

UBS (Irl) Fund Solutions plc

Eine offene Umbrella-Investmentgesellschaft mit variablem Kapital und getrennt haftenden Teilfonds

**HALBJAHRESBERICHT UND UNGEPRÜFTER ZUSAMMENGEFASSTER
HALBJAHRESABSCHLUSS**

FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2022

Registrierungs-Nr. 484724

INHALT

	Seite
INFORMATIONEN ÜBER DIE GESELLSCHAFT	2
ALLGEMEINE INFORMATIONEN	5
ZUSAMMENGEFASSTE BILANZ	10
ZUSAMMENGEFASSTE GESAMTERGEBNISRECHNUNG	18
ZUSAMMENGEFASSTE ENTWICKLUNG DES DEN INHABERN RÜCKKAUFBARER, GEWINNBERECHTIGTER AKTIEN ZUZURECHNENDEN NETTOVERMÖGENS	26
ZUSAMMENGEFASSTE KAPITALFLUSSRECHNUNG	34
ERLÄUTERUNGEN ZUM ZUSAMMENGEFASSTEN HALBJAHRESABSCHLUSS	42
AUFSTELLUNGEN DES WERTPAPIERBESTANDS	75
WESENTLICHE PORTFOLIOTRANSAKTIONEN	171
ANHANG 1 - VERORDNUNG ÜBER DIE TRANSPARENZ VON WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN	188

INFORMATIONEN ÜBER DIE GESELLSCHAFT

VERWALTUNGSRATSMITGLIED	Alan White* (Ire) Frank Muesel* (Schweizer, Deutscher) Naomi Daly**,*** (Irin) Audrey Collins** (Irin) Nina Petrini* (Italienerin) *Nicht-geschäftsführende Verwaltungsratsmitglieder **Unabhängiges, nicht-geschäftsführendes Verwaltungsratsmitglied *** Vorsitzende(r) des Verwaltungsrates
EINGETRAGENER SITZ	(bis zum 1. Dezember 2022) 32 Molesworth Street Dublin 2 Irland (ab dem 1. Dezember 2022) 5 Earlsfort Terrace 2nd Floor, Dublin 2 D02 CK83 Irland
PROMOTER	UBS AG, London Branch 5 Broadgate London EC2M 2QS Großbritannien
VERWALTUNGSGESELLSCHAFT	UBS Fund Management (Ireland) Limited* College Park House South Frederick Street Dublin 2 Irland
ANLAGEVERWALTER	UBS Asset Management (UK) Limited 5 Broadgate London EC2M 2QS Großbritannien
VERWALTER	State Street Fund Services (Ireland) Limited 78 Sir John Rogerson's Quay Dublin 2 Irland
VERWAHRSTELLE	State Street Custodial Services (Ireland) Limited 78 Sir John Rogerson's Quay Dublin 2 Irland
UNABHÄNGIGE ABSCHLUSSPRÜFER	Ernst & Young Chartered Accountants & Statutory Auditors Harcourt Centre Harcourt Street Dublin 2 Irland

* Ehemals bekannt als Lantern Structured Asset Management Limited (vor dem 30. August 2022)

INFORMATIONEN ÜBER DIE GESELLSCHAFT (Fortsetzung)

RECHTSBERATER IN IRLAND	Maples and Calder (Ireland) LLP (bis zum 1. Dezember 2022) 75 St Stephen's Green Dublin 2 Irland
	Dechert (seit dem 1. Dezember 2022) 5 Earlsfort Terrace 2nd Floor, Dublin 2 D02 CK83 Irland
SEKRETÄR	MFD Secretaries Limited (bis zum 1. Dezember 2022) 32 Molesworth Street Dublin 2 Irland
	Dechert Secretarial Limited (seit dem 1. Dezember 2022) 5 Earlsfort Terrace 2nd Floor, Dublin 2 D02 CK83 Irland
INFORMATIONEN- UND ZAHLSTELLE IN ÖSTERREICH	Erste Bank der oesterreichischen Sparkassen AG Am Belvedere 1 1100 Vienna Österreich
UK FACILITIES AGENT	UBS Asset Management (UK) Limited 5 Broadgate London EC2M 2QS Großbritannien
ZENTRAL- UND KORRESPOND- ENZSTELLE IN FRANKREICH	Société Générale 29 Boulevard Haussmann 75009 Paris Frankreich
DEUTSCHE ZAHL- UND INFORMATIONENSTELLE	UBS Europe SE Bockenheimer Landstrasse 2-4 60306 Frankfurt Deutschland
VERTRETER IN DER SCHWEIZ	UBS Fund Management (Switzerland) AG P.O. Box Aeschenvorstadt 1 4002 Basel Schweiz
ZAHLSTELLE IN DER SCHWEIZ	UBS Switzerland AG Bahnhofstrasse 45 8001 Zurich Schweiz und ihre Niederlassungen in der Schweiz

INFORMATIONEN ÜBER DIE GESELLSCHAFT (Fortsetzung)

AUTORISIERTER TEILNEHMER	UBS AG Aeschenvorstadt 1 4002 Basel; and Bahnhofstrasse 45 8001 Zurich Schweiz
VERTRIEBSGESELLSCHAFT	UBS Asset Management Switzerland AG Bahnhofstrasse 45 8001 Zurich Schweiz
ZAHLSTELLE IN LUXEMBURG	State Street Bank Luxembourg S.A. 49, Avenue J.F. Kennedy L-1855 Luxembourg
VERTRETER IN LIECHTENSTEIN	Liechtensteinische Landesbank AG Staedtle 44 9490 Vaduz Liechtenstein
SPANISCHE VERTRETUNG	UBS Europe SE, sucursal en España Cl María de Molina, 4 28006, Madrid Spanien
SCHWEDISCHE ZAHLSTELLE	Skandinaviska Enskilda Banken AB (Publ) Rasta Strandvag 5 169 79 Solna Schweden

Aktionäre können den Verkaufsprospekt, die wesentlichen Informationen für den Anleger (KIID), die Basisinformationsblätter für verpackte Anlageprodukte für Kleinanleger und Versicherungsanlageprodukte (PRIIP), die letzten Jahres- und Halbjahresberichte, die Portfolioveränderungen während des Geschäftsjahres sowie Exemplare der Gründungsurkunde und Satzung kostenlos am Gesellschaftssitz der Verwaltungsgesellschaft, des Administrators oder der örtlichen Vertreter in den Ländern beziehen, in denen die Gesellschaft registriert ist, und in der Schweiz bei der UBS Switzerland AG, Bahnhofstrasse 45, 8098 Zürich, Schweiz.

Für Anleger aus Deutschland werden gemäß § 297 (1) des Kapitalanlagegesetzbuchs der Verkaufsprospekt, die wesentlichen Informationen für den Anleger, die Basisinformationsblätter für verpackte Anlageprodukte für Kleinanleger und Versicherungsanlageprodukte, die Satzung, der Jahres- und Halbjahresbericht sowie der Ausgabe- und Rücknahmepreis kostenlos am Sitz der vorstehend angegebenen Informations- und Zahlstelle in Deutschland zur Verfügung gestellt.

ALLGEMEINE INFORMATIONEN

Die folgenden Informationen stammen aus dem Verkaufsprospekt der Gesellschaft. Der Verkaufsprospekt, die Satzung, die wesentlichen Informationen für den Anleger (KIID), die Basisinformationsblätter für verpackte Anlageprodukte für Kleinanleger und Versicherungsanlageprodukte, der Jahres- und Halbjahresbericht sowie eine Liste aller Käufe und Verkäufe, die während des Berichtszeitraums getätigt wurden, sind kostenlos von State Street Fund Services (Ireland) Limited (der „Administrator“) erhältlich.

Struktur

UBS (Irl) Fund Solutions plc (die „Gesellschaft“) ist eine am 21. Mai 2010 gegründete Umbrella-Investmentgesellschaft mit getrennt haftenden Teilfonds und variablem Kapital, die in Irland in Form einer Public Limited Company zugelassen ist. Die Gesellschaft ist gemäß dem Companies Act 2014 (der „Companies Act“) organisiert und von der Central Bank of Ireland (die „Zentralbank“) als Organismus für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren gemäß den Verordnungen der Europäischen Gemeinschaften (Organismen zur gemeinsamen Anlage in Wertpapieren) von 2011 in der jeweils gültigen Fassung (die „OGAW-Vorschriften“) und den Vorschriften der Zentralbank, Central Bank of Ireland (Supervision and Enforcement) Act 2013 (Section 48(1)) von 2019 (die „OGAW-Vorschriften der Zentralbank“) zugelassen. Verweise auf Rechtsvorschriften, Verordnungen und Gesetze schließen diesbezügliche Änderungen ein.

Die Gesellschaft ist als Umbrella-Investmentgesellschaft strukturiert, in der bisweilen durch den Verwaltungsrat verschiedene Teilfonds aufgelegt werden können. Hierzu benötigt der Verwaltungsrat jeweils die Genehmigung der Central Bank of Ireland (die „Zentralbank“). Für jeden Teilfonds (jeder ein „Teilfonds“, zusammen die „Teilfonds“) ist ein getrenntes Vermögensportfolio zu unterhalten, dessen Vermögen gemäß den Anlagezielen des jeweiligen Teilfonds zu investieren ist. Am Ende des Berichtszeitraums waren folgende Teilfonds in Betrieb:

Teilfonds	Auflegungsdatum	Währung
CMCI Composite SF UCITS ETF	3. November 2010	USD
Bloomberg Commodity Index SF UCITS ETF	3. November 2010	USD
S&P 500 SF UCITS ETF	15. Dezember 2010	USD
MSCI USA SF UCITS ETF	15. Dezember 2010	USD
MSCI Emerging Markets SF UCITS ETF	27. April 2011	USD
MSCI AC Asia Ex Japan SF UCITS ETF	20. August 2012	USD
MSCI ACWI SF UCITS ETF	11. August 2015	USD
CMCI Ex-Agriculture SF UCITS ETF	24. März 2016	USD
Bloomberg Commodity CMCI SF UCITS ETF	25. Mai 2017	USD
CMCI Commodity Carry SF UCITS ETF	16. Januar 2020	USD
MSCI China A SF UCITS ETF	18. Februar 2020	USD
Euro Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF	8. Juli 2020	EUR
Euro Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF	8. Juli 2020	EUR
US Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF	8. Juli 2020	USD
US Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF	8. Juli 2020	USD
MSCI USA SF Index Fund	9. Oktober 2020	USD
CMCI Commodity Carry Ex-Agriculture SF UCITS ETF	22. Januar 2021	USD

Ausschüttungspolitik

Keiner der Teilfonds beabsichtigt, Dividenden auszuschütten, mit Ausnahme des MSCI ACWI SF UCITS ETF und des MSCI USA SF Index Fund. Im Berichtszeitraum gezahlte Dividenden sind in Erläuterung 8 ausgewiesen. Der Verwaltungsrat kann jedoch in seinem alleinigen Ermessen die Festsetzung von Dividenden für jede Aktienklasse beschließen, und die Aktionäre werden entsprechend benachrichtigt.

Anlageziele

CMCI Composite SF UCITS ETF

Anlageziel des CMCI Composite SF UCITS ETF ist es, die Rendite des Referenzindex (d. h. des UBS Bloomberg Constant Maturity Commodity Index Total Return) zu erzielen.

Bloomberg Commodity Index SF UCITS ETF

Anlageziel des Bloomberg Commodity Index SF UCITS ETF ist es, die Rendite des Referenzindex (d. h. des Bloomberg Commodity Index Total Return) zu erzielen.

S&P 500 SF UCITS ETF

Anlageziel des S&P 500 SF UCITS ETF ist es, den Nettogesamtertrag des Referenzindex (d. h. des S&P 500 Net Total Return Index) zu erzielen.

ALLGEMEINE INFORMATIONEN (Fortsetzung)

Anlageziele (Fortsetzung)

MSCI USA SF UCITS ETF

Anlageziel des MSCI USA SF UCITS ETF ist es, den Nettogesamtertrag des Referenzindex (d. h. des MSCI USA Index Net Total Return Index) zu erzielen.

MSCI Emerging Markets SF UCITS ETF

Anlageziel des MSCI Emerging Markets SF UCITS ETF ist es, den Nettogesamtertrag des Referenzindex (d. h. des MSCI Emerging Markets Total Return Net Index) zu erzielen.

MSCI AC Asia Ex Japan SF UCITS ETF

Anlageziel des MSCI AC Asia Ex Japan SF UCITS ETF ist es, den Nettogesamtertrag des Referenzindex (d. h. des MSCI AC Asia Ex Japan Net Total Return Index) zu erzielen.

MSCI ACWI SF UCITS ETF

Anlageziel des MSCI ACWI SF UCITS ETF ist es, den Nettogesamtertrag des Referenzindex (d. h. des MSCI ACWI Net Total Return Index) zu erzielen.

CMCI Ex-Agriculture SF UCITS ETF

Anlageziel des CMCI Ex-Agriculture SF UCITS ETF ist es, die Rendite des Referenzindex (d. h. des UBS Bloomberg CMCI Ex-Agriculture Ex-Livestock Capped Index Total Return) zu erzielen.

Bloomberg Commodity CMCI SF UCITS ETF

Anlageziel des Bloomberg Commodity CMCI SF UCITS ETF ist es, die Rendite des Referenzindex (d. h. des UBS Bloomberg BCOM Constant Maturity Commodity Index Total Return) zu erzielen.

CMCI Commodity Carry SF UCITS ETF

Anlageziel des CMCI Commodity Carry SF UCITS ETF ist es, die Rendite des Referenzindex (d. h. des UBS Bloomberg CM-BCOM Outperformance Strategy Index ex-Precious Metals 2.5 Leveraged Net of Cost Total Return) zu erzielen.

MSCI China A SF UCITS ETF

Anlageziel des MSCI China A SF UCITS ETF ist es, die Rendite des Referenzindex (d. h. des MSCI China A Index Net Total Return Index USD) zu erzielen.

Euro Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF

Anlageziel des Euro Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF ist es, die Rendite des Referenzindex (d. h. des Euro Equity Defensive Covered Call Index) zu erzielen.

Euro Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF

Anlageziel des Euro Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF ist es, die Rendite des Referenzindex (d. h. des Euro Equity Defensive Put Write Index) zu erzielen.

US Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF

Anlageziel des US Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF ist es, die Rendite des Referenzindex (d. h. des US Equity Defensive Covered Call Index) zu erzielen.

US Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF

Anlageziel des US Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF ist es, die Rendite des Referenzindex (d. h. des US Equity Defensive Put Write Index) zu erzielen.

ALLGEMEINE INFORMATIONEN (Fortsetzung)

Anlageziele (Fortsetzung)

MSCI USA SF Index Fund

Anlageziel des MSCI USA SF Index Fund ist es, den Nettogesamtertrag des Referenzindex (d. h. des MSCI USA Index Net Total Return Index) zu erzielen.

CMCI Commodity Carry Ex-Agriculture SF UCITS ETF Fund

Anlageziel des CMCI Commodity Carry Ex-Agriculture SF UCITS ETF ist es, die Rendite des Referenzindex (d. h. des UBS Bloomberg CM-BCOM Outperformance Strategy Index Ex-Precious Metals, Agriculture, Livestock 2.5x Leveraged Net of Cost Total Return) zu erzielen.

Registrierung

Bestimmte Aktienklassen der folgenden Teilfonds der Gesellschaft sind am 31. Dezember 2022 für den öffentlichen Vertrieb in folgenden Ländern registriert:

Teilfonds	Irland	Schweiz	Deutschland	Niederlande	Frankreich
CMCI Composite SF UCITS ETF	Ja	Ja	Ja	Ja	Ja
Bloomberg Commodity Index SF UCITS ETF	Ja	Ja	Ja	-	-
S&P 500 SF UCITS ETF	Ja	Ja	Ja	Ja	Ja
MSCI USA SF UCITS ETF	Ja	Ja	Ja	Ja	Ja
MSCI Emerging Markets SF UCITS ETF	Ja	Ja	Ja	Ja	Ja
MSCI AC Asia Ex Japan SF UCITS ETF	Ja	Ja	Ja	-	-
MSCI ACWI SF UCITS ETF	Ja	Ja	Ja	-	Ja
CMCI Ex-Agriculture SF UCITS ETF	Ja	Ja	Ja	-	Ja
Bloomberg Commodity CMCI SF UCITS ETF	Ja	Ja	Ja	-	-
CMCI Commodity Carry SF UCITS ETF	Ja	Ja	Ja	-	Ja
MSCI China A SF UCITS ETF	Ja	Ja	Ja	-	-
Euro Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF	Ja	Ja	Ja	-	Ja
Euro Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF	Ja	Ja	Ja	-	Ja
US Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF	Ja	Ja	Ja	-	Ja
US Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF	Ja	Ja	Ja	-	Ja
MSCI USA SF Index Fund	-	-	Ja	-	-
CMCI Commodity Carry Ex-Agriculture SF UCITS ETF	Ja	-	Ja	-	-

Teilfonds	Großbritannien	Italien	Luxemburg	Österreich	Liechtenstein
CMCI Composite SF UCITS ETF	Ja	Ja	Ja	Ja	Ja
Bloomberg Commodity Index SF UCITS ETF	Ja	Ja	-	-	Ja
S&P 500 SF UCITS ETF	Ja	Ja	Ja	Ja	Ja
MSCI USA SF UCITS ETF	Ja	Ja	Ja	Ja	Ja
MSCI Emerging Markets SF UCITS ETF	Ja	Ja	Ja	Ja	Ja
MSCI AC Asia Ex Japan SF UCITS ETF	Ja	Ja	-	-	Ja
MSCI ACWI SF UCITS ETF	Ja	Ja	-	Ja	Ja
CMCI Ex-Agriculture SF UCITS ETF	Ja	Ja	Ja	Ja	Ja
Bloomberg Commodity CMCI SF UCITS ETF	Ja	Ja	-	-	Ja
CMCI Commodity Carry SF UCITS ETF	Ja	Ja	-	Ja	Ja
MSCI China A SF UCITS ETF	Ja	Ja	-	Ja	Ja
Euro Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF	Ja	Ja	-	Ja	Ja
Euro Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF	Ja	Ja	-	Ja	Ja
US Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF	Ja	Ja	-	Ja	Ja
US Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF	Ja	Ja	-	Ja	Ja
MSCI USA SF Index Fund	-	-	-	-	-
CMCI Commodity Carry Ex-Agriculture SF UCITS ETF	Ja	Ja	Ja	Ja	Ja

ALLGEMEINE INFORMATIONEN (Fortsetzung)

Registrierung (Fortsetzung)

Teilfonds	Schweden	Singapur	Japan	Spanien	Dänemark
CMCI Composite SF UCITS ETF	Ja	Ja ¹	-	Ja	Ja
Bloomberg Commodity Index SF UCITS ETF	Ja	Ja ¹	-	Ja	Ja
S&P 500 SF UCITS ETF	Ja	-	-	Ja	Ja
MSCI USA SF UCITS ETF	Ja	-	-	-	Ja
MSCI Emerging Markets SF UCITS ETF	Ja	-	-	Ja	Ja
MSCI AC Asia Ex Japan SF UCITS ETF	Ja	Ja ¹	-	Ja	Ja
MSCI ACWI SF UCITS ETF	Ja	Ja ¹	Ja	Ja	Ja
CMCI Ex-Agriculture SF UCITS ETF	Ja	-	-	Ja	Ja
Bloomberg Commodity CMCI SF UCITS ETF	Ja	-	-	Ja	Ja
CMCI Commodity Carry SF UCITS ETF	Ja	-	-	Ja	Ja
MSCI China A SF UCITS ETF	Ja	-	-	Ja	Ja
Euro Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF	Ja	-	-	Ja	Ja
Euro Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF	Ja	-	-	Ja	Ja
US Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF	Ja	-	-	Ja	Ja
US Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF	Ja	-	-	Ja	Ja
MSCI USA SF Index Fund	-	-	-	Ja	-
CMCI Commodity Carry Ex-Agriculture SF UCITS ETF	Ja	-	-	Ja	Ja

Teilfonds	Finnland	Norwegen
CMCI Composite SF UCITS ETF	Ja	Ja
Bloomberg Commodity Index SF UCITS ETF	Ja	Ja
S&P 500 SF UCITS ETF	Ja	Ja
MSCI USA SF UCITS ETF	Ja	Ja
MSCI Emerging Markets SF UCITS ETF	Ja	Ja
MSCI AC Asia Ex Japan SF UCITS ETF	Ja	Ja
MSCI ACWI SF UCITS ETF	Ja	Ja
CMCI Ex-Agriculture SF UCITS ETF	Ja	Ja
Bloomberg Commodity CMCI SF UCITS ETF	Ja	Ja
CMCI Commodity Carry SF UCITS ETF	Ja	Ja
MSCI China A SF UCITS ETF	Ja	Ja
Euro Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF	Ja	Ja
Euro Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF	Ja	Ja
US Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF	Ja	Ja
US Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF	Ja	Ja
MSCI USA SF Index Fund	-	-
CMCI Commodity Carry Ex-Agriculture SF UCITS ETF	Ja	Ja

¹ Der Teilfonds ist ein Restricted Foreign Scheme gemäß Anhang 6 der Securities and Futures (Offers of Investments) (Collective Investment Schemes) Regulations 2005 in Singapur. Der Teilfonds ist nicht von der Monetary Authority of Singapore zugelassen oder anerkannt, und die Aktien des Teilfonds dürfen Privatanlegern nicht angeboten werden.

ALLGEMEINE INFORMATIONEN (Fortsetzung)

Börsennotierungen

Die Teilfonds der Gesellschaft sind per 31. Dezember 2022 an den folgenden Wertpapierbörsen notiert:

Teilfonds	SIX (Schweiz)	XETRA (Deutschland)	LSE (Großbritannien)¹	Borsa Italiana (Italien)	BMV (Mexiko)	Euronext (Irland)
CMCI Composite SF UCITS ETF	Ja ²	Ja	Ja	Ja	Ja	-
Bloomberg Commodity Index SF UCITS ETF	Ja ²	-	-	-	-	-
S&P 500 SF UCITS ETF	Ja ²	-	-	-	-	-
MSCI USA SF UCITS ETF	Ja ²	-	-	-	-	-
MSCI Emerging Markets SF UCITS ETF	Ja ²	-	-	Ja	Ja	-
MSCI AC Asia Ex Japan SF UCITS ETF	Ja	Ja ²	Ja	Ja	-	-
MSCI ACWI SF UCITS ETF	Ja ²	-	-	Ja	Ja	-
CMCI Ex-Agriculture SF UCITS ETF	Ja ²	Ja	Ja	-	-	Ja
Bloomberg Commodity CMCI SF UCITS ETF	Ja	Ja ²	Ja	-	-	Ja
CMCI Commodity Carry SF UCITS ETF	Ja	Ja ²	Ja	-	-	-
MSCI China A SF UCITS ETF	Ja	Ja ²	Ja	Ja	-	-
Euro Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF	Ja ²	-	-	-	-	-
Euro Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF	Ja ²	-	-	-	-	-
US Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF	Ja ²	-	-	-	-	-
US Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF	Ja ²	-	-	-	-	-
MSCI USA SF Index Fund	-	-	-	-	-	-
CMCI Commodity Carry Ex-Agriculture SF UCITS ETF	-	Ja ²	-	-	-	-

¹ Zum Handel im ETF-Segment der Londoner Börse (LSE) zugelassene Teilfonds.

² Hauptbörsenplatz.

Gemeinsame Anlagepools

Zur Senkung der Betriebs- und Verwaltungskosten und zur Erleichterung der Anlagediversifizierung kann die Verwaltungsgesellschaft die Verwaltung der Vermögenswerte eines Teilfonds zusammen mit anderen von der Verwaltungsgesellschaft eingerichteten Fonds oder mit sonstigen von der Verwaltungsgesellschaft oder einem verbundenen Unternehmen der Verwaltungsgesellschaft gegründeten oder verwalteten Fonds genehmigen. Dies geschieht über die Einrichtung eines Vermögenspools („Pool“), der die Barmittel und Anlagen aller Teilfonds umfasst, die sich am Pool beteiligen („beteiligte Fonds“). Diese Technik ist unter der Bezeichnung „Pooling“ bekannt.

Ein Pool stellt keinen selbständigen Rechtsträger dar, und ein Anleger kann nicht direkt in einen Pool investieren. Dem Anlageverwalter ist es nicht gestattet, die Vermögenswerte eines Fonds ohne die vorherige Zustimmung der Verwaltungsgesellschaft auf gepoolter Basis zu verwalten. Die Verwaltungsgesellschaft ist über die Zulassung eines Teilfonds als beteiligter Fonds eines Pools, an dem ein Teilfonds beteiligt ist, zu benachrichtigen.

Zum 31. Dezember 2022 existierten zwei Pools (30. Juni 2022: zwei). Per 31. Dezember 2022 wenden alle Teilfonds Pooling an:

Die Anlage jedes Teilfonds im Pool wird in der Bilanz und in der Vermögensaufstellung des betreffenden Teilfonds als Anteil des Teilfonds an den vom Pool gehaltenen Anlagen ausgewiesen.

**ZUSAMMENGEFASSTE BILANZ
ZUM 31. DEZEMBER 2022**

	Hinweis	CMCI Composite SF UCITS ETF USD	Bloomberg Commodity Index SF UCITS ETF USD	S&P 500 SF UCITS ETF USD	MSCI USA SF UCITS ETF USD	MSCI Emerging Markets SF UCITS ETF USD
UMLAUFVERMÖGEN						
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:						
Wertpapiere	1	1.620.712.769	134.841.842	134.276.712	461.505.597	82.688.570
Swaps zum beizulegenden Zeitwert	1,5(a)	51.275.227	20.046.081	8.063.426	20.232.741	9.758.726
Sicherheiten in Form von Zahlungsmitteln und Zahlungsmitteläquivalenten	5(a)	35.822.755	13.786.630	3.936.876	13.863.199	6.196.763
Forderungen aus Zeichnungen			-	8.084.664	-	-
Swap-Forderungen			-	2.208.345	-	1.025
Sonstige Forderungen		918.843	23.857	25.250	98.342	2.965
Gesamtumlaufvermögen		1.708.729.594	168.698.410	156.595.273	495.699.879	98.648.049
KURZFRISTIGE VERBINDLICHKEITEN						
Zahlbar an Gegenpartei	5(a)	(35.822.755)	(13.786.630)	(3.936.876)	(13.863.199)	(6.196.763)
Swap-Verbindlichkeiten		(32)	-	(4.451.987)	-	(515)
Sonstige Verbindlichkeiten		(918.841)	(23.857)	(25.251)	(98.342)	(2.965)
Kurzfristige Verbindlichkeiten insgesamt		(36.741.628)	(13.810.487)	(8.414.114)	(13.961.541)	(6.200.243)
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnendes Nettovermögen (zu den letztgehandelten Kursen)	-	1.671.987.966	154.887.923	148.181.159	481.738.338	92.447.806

Die beiliegenden Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

**ZUSAMMENGEFASSTE BILANZ (Fortsetzung)
ZUM 31. DEZEMBER 2022**

	Hinweis	MSCI AC Asia Ex Japan SF UCITS ETF USD	MSCI ACWI SF UCITS ETF USD	CMCI Ex-Agriculture SF UCITS ETF USD	Bloomberg Commodity CMCI SF UCITS ETF USD	CMCI Commodity Carry SF UCITS ETF USD
UMLAUFVERMÖGEN						
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:						
Wertpapiere	1	182.054.732	5.219.033.965	110.786.673	625.278.340	165.594.414
Swaps zum beizulegenden Zeitwert	1,5(a)	4.445.895	196.634.426	3.480.714	18.977.779	5.113.300
Sicherheiten in Form von Zahlungsmitteln und Zahlungsmitteläquivalenten	5(a)	7.953.366	151.481.401	2.693.000	13.386.744	11.736.627
Swap-Forderungen		4.351	1.897.929	-	-	-
Sonstige Forderungen		20.781	272.720	62.653	341.567	44.246
Gesamtumlaufvermögen		194.479.125	5.569.320.441	117.023.040	657.984.430	182.488.587
KURZFRISTIGE VERBINDLICHKEITEN						
Zahlbar an Gegenpartei	5(a)	(7.953.366)	(151.481.401)	(2.693.000)	(13.386.744)	(11.736.627)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen			(1.595.836)	-	-	-
Swap-Verbindlichkeiten		(4.351)	(305.449)	-	-	(26)
Sonstige Verbindlichkeiten		(20.781)	(272.533)	(62.653)	(341.567)	(44.246)
Kurzfristige Verbindlichkeiten insgesamt		(7.978.498)	(153.655.219)	(2.755.653)	(13.728.311)	(11.780.899)
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnendes Nettovermögen (zu den letztgehandelten Kursen)		186.500.627	5.415.665.222	114.267.387	644.256.119	170.707.688

Die beiliegenden Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

**ZUSAMMENGEFASSTE BILANZ (Fortsetzung)
ZUM 31. DEZEMBER 2022**

	Hinweis	MSCI China A SF UCITS ETF USD	Euro Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF EUR	Euro Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF EUR	US Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF USD	US Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF USD
UMLAUFVERMÖGEN						
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:						
Wertpapiere	1	154.587.915	4.668.204	19.426.329	3.241.769	19.092.179
Swaps zum beizulegenden Zeitwert	1,5(a)	6.156.236	137.745	640.986	137.762	702.273
Sicherheiten in Form von Zahlungsmitteln und Zahlungsmitteläquivalenten	5(a)	6.359.235	335.677	372.996	252.000	750.000
Sonstige Forderungen		417.243	417	4.263	234	587
Gesamtumlaufvermögen		167.520.629	5.142.043	20.444.574	3.631.765	20.545.039
KURZFRISTIGE VERBINDLICHKEITEN						
Zahlbar an Gegenpartei	5(a)	(6.359.235)	(335.677)	(372.996)	(252.000)	(750.000)
Sonstige Verbindlichkeiten		(417.242)	(417)	(4.263)	(234)	(587)
Kurzfristige Verbindlichkeiten insgesamt		(6.776.477)	(336.094)	(377.259)	(252.234)	(750.587)
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnendes Nettovermögen (zu den letztgehandelten Kursen)		160.744.152	4.805.949	20.067.315	3.379.531	19.794.452

Die beiliegenden Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

**ZUSAMMENGEFASSTE BILANZ (Fortsetzung)
ZUM 31. DEZEMBER 2022**

	Hinweis	MSCI USA SF Index Fund USD	CMCI Commodity Carry Ex-Agriculture SF UCITS ETF USD	Insgesamt USD
UMLAUFVERMÖGEN				
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
Wertpapiere	1	889.085.177	58.938.624	9.887.433.828
Swaps zum beizulegenden Zeitwert	1,5(a)	40.383.171	1.438.742	387.677.589
Sicherheiten in Form von Zahlungsmitteln und Zahlungsmitteläquivalenten	5(a)	35.152.348	1.170.000	305.297.265
Forderungen aus Zeichnungen		56.262	-	8.140.926
Swap-Forderungen		82.972	-	4.194.622
Sonstige Forderungen		225.848	12.567	2.472.697
Gesamtumlaufvermögen		964.985.778	61.559.933	10.595.216.927
KURZFRISTIGE VERBINDLICHKEITEN				
Zahlbar an Gegenpartei	5(a)	(35.152.348)	(1.170.000)	(305.297.265)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(82.975)	-	(1.678.811)
Swap-Verbindlichkeiten		(56.392)	-	(4.818.752)
Sonstige Verbindlichkeiten		(225.848)	(12.609)	(2.472.551)
Kurzfristige Verbindlichkeiten insgesamt		(35.517.563)	(1.182.609)	(314.267.379)
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnendes Nettovermögen (zu den letztgehandelten Kursen)		929.468.215	60.377.324	10.280.949.548

Die beiliegenden Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

**BILANZ
ZUM 30. JUNI 2022**

	Hinweis	CMCI Composite SF UCITS ETF USD	Bloomberg Commodity Index SF UCITS ETF USD	S&P 500 SF UCITS ETF USD	MSCI USA SF UCITS ETF USD	MSCI Emerging Markets SF UCITS ETF USD
UMLAUFVERMÖGEN						
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:						
Wertpapiere	1	2.596.221.710	422.934.303	138.973.839	461.150.769	79.895.770
Swaps zum beizulegenden Zeitwert	1,5(a)	147.531.339	29.043.183	4.719.545	44.870.116	6.178.831
Sicherheiten in Form von Zahlungsmitteln und Zahlungsmitteläquivalenten	5(a)	200.280.857	36.322.264	3.944.446	35.010.600	5.746.130
Forderungen aus verkauften Anlagen		15.447.371	-	826.884	2.743.818	-
Forderungen aus Zeichnungen		34.357.087	-	-	20.159.703	-
Swap-Forderungen		36.498.302	-	-	20.079.064	-
Sonstige Forderungen		1.745.131	123.965	25.423	96.942	15.265
Gesamtumlaufvermögen		3.032.081.797	488.423.715	148.490.137	584.111.012	91.835.996
KURZFRISTIGE VERBINDLICHKEITEN						
Zahlbar an Gegenpartei	5(a)	(200.280.857)	(36.322.264)	(3.944.446)	(35.010.600)	(5.746.130)
Verbindlichkeiten aus gekauften Anlagen		(16.120.524)	-	(863.074)	(2.863.389)	-
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(9.368.737)	-	-	-	-
Swap-Verbindlichkeiten		(43.129.565)	-	-	(40.238.766)	-
Sonstige Verbindlichkeiten		(1.745.132)	(123.965)	(25.422)	(96.943)	(15.265)
Kurzfristige Verbindlichkeiten insgesamt		(270.644.815)	(36.446.229)	(4.832.942)	(78.209.698)	(5.761.395)
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnendes Nettovermögen (zu den letztgehandelten Kursen)		2.761.436.982	451.977.486	143.657.195	505.901.314	86.074.601

Die beiliegenden Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

**BILANZ (Fortsetzung)
ZUM 30. JUNI 2022**

	Hinweis	MSCI AC Asia Ex Japan SF UCITS ETF USD	MSCI ACWI SF UCITS ETF USD	CMCI Ex-Agriculture SF UCITS ETF USD	Bloomberg Commodity CMCI SF UCITS ETF USD	CMCI Commodity Carry SF UCITS ETF USD
UMLAUFVERMÖGEN						
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:						
Wertpapiere	1	170.913.178	2.888.897.740	129.744.570	382.993.294	101.346.450
Swaps zum beizulegenden Zeitwert	1,5(a)	12.644.291	117.156.775	6.731.098	18.164.394	8.614.967
Sicherheiten in Form von Zahlungsmitteln und Zahlungsmitteläquivalenten	5(a)	14.383.050	111.331.245	10.313.000	31.161.794	6.428.128
Forderungen aus verkauften Anlagen		1.016.921	17.188.782	771.971	2.278.786	603.005
Swap-Forderungen		927.160	-	-	-	-
Sonstige Forderungen		31.018	195.140	89.053	257.871	33.388
Gesamtumlaufvermögen		199.915.618	3.134.769.682	147.649.692	434.856.139	117.025.938
KURZFRISTIGE VERBINDLICHKEITEN						
Zahlbar an Gegenpartei	5(a)	(14.383.050)	(111.331.245)	(10.313.000)	(31.161.794)	(6.428.128)
Verbindlichkeiten aus gekauften Anlagen		(1.061.238)	(17.937.815)	(805.613)	(2.378.091)	(629.283)
Swap-Verbindlichkeiten		(927.160)	(1.239)	-	-	-
Sonstige Verbindlichkeiten		(31.018)	(194.951)	(89.053)	(257.871)	(33.388)
Kurzfristige Verbindlichkeiten insgesamt		(16.402.466)	(129.465.250)	(11.207.666)	(33.797.756)	(7.090.799)
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnendes Nettovermögen (zu den letztgehandelten Kursen)		183.513.152	3.005.304.432	136.442.026	401.058.383	109.935.139

Die beiliegenden Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

**BILANZ (Fortsetzung)
ZUM 30. JUNI 2022**

	Hinweis	MSCI China A SF UCITS ETF USD	Euro Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF EUR	Euro Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF EUR	US Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF USD	US Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF USD
UMLAUFVERMÖGEN						
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:						
Wertpapiere	1	130.535.340	2.506.320	15.650.086	3.463.918	14.003.086
Swaps zum beizulegenden Zeitwert	1,5(a)	11.180.281	115.076	845.595	148.230	936.761
Sicherheiten in Form von Zahlungsmitteln und Zahlungsmitteläquivalenten	5(a)	11.368.831	92.783	917.117	352.000	1.140.000
Forderungen aus verkauften Anlagen		776.847	13.196	93.117	18.238	83.317
Forderungen aus Zeichnungen		13.870.940	-	-	-	-
Swap-Forderungen		32.575.300	-	-	-	-
Sonstige Forderungen		22.823	579	3.297	243	429
Gesamtumlaufvermögen		200.330.362	2.727.954	17.509.212	3.982.629	16.163.593
KURZFRISTIGE VERBINDLICHKEITEN						
Zahlbar an Gegenpartei	5(a)	(11.368.831)	(92.783)	(917.117)	(352.000)	(1.140.000)
Verbindlichkeiten aus gekauften Anlagen		(810.702)	(15.552)	(97.175)	(21.494)	(86.948)
Swap-Verbindlichkeiten		(46.446.239)	-	-	-	-
Sonstige Verbindlichkeiten		(22.823)	(579)	(3.297)	(243)	(429)
Kurzfristige Verbindlichkeiten insgesamt		(58.648.595)	(108.914)	(1.017.589)	(373.737)	(1.227.377)
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnendes Nettovermögen (zu den letztgehandelten Kursen)		141.681.767	2.619.040	16.491.623	3.608.892	14.936.216

Die beiliegenden Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

**BILANZ (Fortsetzung)
ZUM 30. JUNI 2022**

	Hinweis	MSCI USA SF Index Fund USD	CMCI Commodity Carry Ex-Agriculture SF UCITS ETF USD	Insgesamt USD
UMLAUFVERMÖGEN				
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
Wertpapiere	1	804.268.587	45.086.332	8.389.410.500
Swaps zum beizulegenden Zeitwert	1,5(a)	41.027.092	4.728.946	454.680.182
Sicherheiten in Form von Zahlungsmitteln und Zahlungsmitteläquivalenten	5(a)	51.900.873	3.660.000	524.399.018
Forderungen aus verkauften Anlagen		4.785.347	268.261	46.920.693
Forderungen aus Zeichnungen		574.456	-	68.962.186
Swap-Forderungen		665.324	-	90.745.150
Sonstige Forderungen		199.748	13.600	2.854.091
Gesamtumlaufvermögen		903.421.427	53.757.139	9.577.971.820
KURZFRISTIGE VERBINDLICHKEITEN				
Zahlbar an Gegenpartei	5(a)	(51.900.873)	(3.660.000)	(524.399.018)
Verbindlichkeiten aus gekauften Anlagen		(4.993.884)	(279.951)	(48.969.856)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(46.676)	-	(9.415.413)
Swap-Verbindlichkeiten		(1.193.237)	-	(131.936.206)
Sonstige Verbindlichkeiten		(199.748)	(13.642)	(2.853.945)
Kurzfristige Verbindlichkeiten insgesamt		(58.334.418)	(3.953.593)	(717.574.438)
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnendes Nettovermögen (zu den letztgehandelten Kursen)		845.087.009	49.803.546	8.860.397.382

Die beiliegenden Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

**ZUSAMMENGEFASSTE GESAMTERGEBNISRECHNUNG
FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2022**

	Hinweis	CMCI Composite SF UCITS ETF USD	Bloomberg Commodity Index SF UCITS ETF USD	S&P 500 SF UCITS ETF USD	MSCI USA SF UCITS ETF USD	MSCI Emerging Markets SF UCITS ETF USD
(Kosten)/Erträge						
Netto(verlust)/-gewinn aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten	1	(19.178.753)	650.205	3.672.858	10.150.655	(3.308.150)
Gesamtanlage(kosten)/-erträge		(19.178.753)	650.205	3.672.858	10.150.655	(3.308.150)
Aufwendungen						
Betriebskosten insgesamt	2	(3.370.760)	(200.010)	(140.110)	(383.592)	(91.324)
Aufwendungen insgesamt		(3.370.760)	(200.010)	(140.110)	(383.592)	(91.324)
Netto(verlust)/-gewinn		(22.549.513)	450.195	3.532.748	9.767.063	(3.399.474)
Finanzierungskosten						
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Aktien	8	-	-	-	-	-
Finanzierungskosten gesamt		-	-	-	-	-
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnende Netto(abnahme)/-zunahme des Vermögens aus der Geschäftstätigkeit		(22.549.513)	450.195	3.532.748	9.767.063	(3.399.474)

Die beiliegenden Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

Außer den in der Gesamtergebnisrechnung ausgewiesenen hatte die Gesellschaft im Berichtszeitraum keine anderen erfassten Gewinne oder Verluste. Alle oben genannten Beträge beziehen sich auf fortzuführende Geschäftsbereiche.

**ZUSAMMENGEFASSTE GESAMTERGEBNISRECHNUNG (Fortsetzung)
FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2022**

	Hinweis	MSCI AC Asia Ex Japan SF UCITS ETF USD	MSCI ACWI SF UCITS ETF USD	CMCI Ex-Agriculture SF UCITS ETF USD	Bloomberg Commodity CMCI SF UCITS ETF USD	CMCI Commodity Carry SF UCITS ETF USD
(Kosten)/Erträge						
Netto(verlust)/-gewinn aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten	1	(7.539.552)	(325.299.378)	2.174.375	14.739.065	18.390.212
Gesamtanlage(kosten)/-erträge		(7.539.552)	(325.299.378)	2.174.375	14.739.065	18.390.212
Aufwendungen						
Betriebskosten insgesamt	2	(216.884)	(4.302.998)	(201.771)	(873.901)	(209.552)
Aufwendungen insgesamt		(216.884)	(4.302.998)	(201.771)	(873.901)	(209.552)
Netto(verlust)/-gewinn		(7.756.436)	(329.602.376)	1.972.604	13.865.164	18.180.660
Finanzierungskosten						
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Aktien	8	-	(3.744.707)	-	-	-
Finanzierungskosten gesamt		-	(3.744.707)	-	-	-
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnende Netto(abnahme)/-zunahme des Vermögens aus der Geschäftstätigkeit		(7.756.436)	(333.347.083)	1.972.604	13.865.164	18.180.660

Die beiliegenden Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

Außer den in der Gesamtergebnisrechnung ausgewiesenen hatte die Gesellschaft im Berichtszeitraum keine anderen erfassten Gewinne oder Verluste. Alle oben genannten Beträge beziehen sich auf fortzuführende Geschäftsbereiche.

**ZUSAMMENGEFASSTE GESAMTERGEBNISRECHNUNG (Fortsetzung)
FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2022**

	Hinweis	MSCI China A SF UCITS ETF USD	Euro Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF EUR	Euro Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF EUR	US Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF USD	US Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF USD
(Kosten)/Erträge						
Netto(verlust)/-gewinn aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten	1	(22.400.027)	68.282	644.387	(271.675)	311.745
Gesamtanlage(kosten)/-erträge		(22.400.027)	68.282	644.387	(271.675)	311.745
Aufwendungen						
Betriebskosten insgesamt	2	(220.475)	(6.155)	(26.434)	(7.608)	(25.345)
Aufwendungen insgesamt		(220.475)	(6.155)	(26.434)	(7.608)	(25.345)
Netto(verlust)/-gewinn		(22.620.502)	62.127	617.953	(279.283)	286.400
Finanzierungskosten						
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Aktien	8	-	-	-	-	-
Finanzierungskosten gesamt		-	-	-	-	-
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnende Netto(abnahme)/-zunahme des Vermögens aus der Geschäftstätigkeit		(22.620.502)	62.127	617.953	(279.283)	286.400

Die beiliegenden Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

Außer den in der Gesamtergebnisrechnung ausgewiesenen hatte die Gesellschaft im Berichtszeitraum keine anderen erfassten Gewinne oder Verluste. Alle oben genannten Beträge beziehen sich auf fortzuführende Geschäftsbereiche.

**ZUSAMMENGEFASSTE GESAMTERGEBNISRECHNUNG (Fortsetzung)
FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2022**

	Hinweis	MSCI USA SF Index Fund USD	CMCI Commodity Carry Ex-Agriculture SF UCITS ETF USD	Insgesamt USD
Erträge/(Kosten)				
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten	1	7.571.888	10.663.773	(308.949.971)
Gesamtanlageerträge/(-kosten)		7.571.888	10.663.773	(308.949.971)
Aufwendungen				
Betriebskosten insgesamt	2	(538.970)	(89.995)	(10.906.347)
Aufwendungen insgesamt		(538.970)	(89.995)	(10.906.347)
Nettogewinn/(-verlust)		7.032.918	10.573.778	(319.856.318)
Finanzierungskosten				
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Aktien	8	(482.575)	-	(4.227.282)
Finanzierungskosten gesamt		(482.575)	-	(4.227.282)
Zunahme/(Abnahme) des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit		6.550.343	10.573.778	(324.083.600)

Die beiliegenden Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

Außer den in der Gesamtergebnisrechnung ausgewiesenen hatte die Gesellschaft im Berichtszeitraum keine anderen erfassten Gewinne oder Verluste. Alle oben genannten Beträge beziehen sich auf fortzuführende Geschäftsbereiche.

**ZUSAMMENGEFASSTE GESAMTERGEBNISRECHNUNG
FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2021**

	Hinweis	CMCI Composite SF UCITS ETF USD	Bloomberg Commodity Index SF UCITS ETF USD	S&P 500 SF UCITS ETF USD	MSCI USA SF UCITS ETF USD	MSCI Emerging Markets SF UCITS ETF USD
Erträge/(Kosten)						
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten	1	128.455.439	4.773.435	19.674.497	69.261.595	(53.230.708)
Gesamtanlageerträge/(-kosten)		128.455.439	4.773.435	19.674.497	69.261.595	(53.230.708)
Aufwendungen						
Betriebskosten insgesamt	2	(3.632.116)	(116.702)	(171.162)	(523.742)	(553.117)
Aufwendungen insgesamt		(3.632.116)	(116.702)	(171.162)	(523.742)	(553.117)
Nettogewinn/(-verlust)		124.823.323	4.656.733	19.503.335	68.737.853	(53.783.825)
Finanzierungskosten						
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Aktien	8	-	-	-	-	-
Finanzierungskosten gesamt		-	-	-	-	-
Zunahme/(Abnahme) des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit		124.823.323	4.656.733	19.503.335	68.737.853	(53.783.825)

Die beiliegenden Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

Außer den in der Gesamtergebnisrechnung ausgewiesenen hatte die Gesellschaft im Berichtszeitraum keine anderen erfassten Gewinne oder Verluste. Alle oben genannten Beträge beziehen sich auf fortzuführende Geschäftsbereiche.

**ZUSAMMENGEFASSTE GESAMTERGEBNISRECHNUNG (Fortsetzung)
FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2021**

	Hinweis	MSCI AC Asia Ex Japan SF UCITS ETF USD	MSCI ACWI SF UCITS ETF USD	CMCI Ex-Agriculture SF UCITS ETF USD	Bloomberg Commodity CMCI SF UCITS ETF USD	CMCI Commodity Carry SF UCITS ETF USD
(Kosten)/Erträge						
Netto(verlust)/-gewinn aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten	1	(25.122.991)	282.672.027	9.153.168	22.285.598	5.102.500
Gesamtanlage(kosten)/-erträge		(25.122.991)	282.672.027	9.153.168	22.285.598	5.102.500
Aufwendungen						
Betriebskosten insgesamt	2	(264.009)	(7.076.484)	(172.706)	(557.210)	(121.978)
Aufwendungen insgesamt		(264.009)	(7.076.484)	(172.706)	(557.210)	(121.978)
Netto(verlust)/-gewinn		(25.387.000)	275.595.543	8.980.462	21.728.388	4.980.522
Finanzierungskosten						
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Aktien	8	-	(2.640.701)	-	-	-
Finanzierungskosten gesamt		-	(2.640.701)	-	-	-
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnende Netto(abnahme)/-zunahme des Vermögens aus der Geschäftstätigkeit		(25.387.000)	272.954.842	8.980.462	21.728.388	4.980.522

Die beiliegenden Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

Außer den in der Gesamtergebnisrechnung ausgewiesenen hatte die Gesellschaft im Berichtszeitraum keine anderen erfassten Gewinne oder Verluste. Alle oben genannten Beträge beziehen sich auf fortzuführende Geschäftsbereiche.

**ZUSAMMENGEFASSTE GESAMTERGEBNISRECHNUNG (Fortsetzung)
FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2021**

	Hinweis	MSCI China A SF UCITS ETF USD	Euro Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF EUR	Euro Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF EUR	US Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF USD	US Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF USD
Erträge						
Nettogewinn aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten	1	357.180	64.245	313.654	473.918	433.403
Gesamtanlageerträge		357.180	64.245	313.654	473.918	433.403
Aufwendungen						
Betriebskosten insgesamt	2	(28.336)	(1.682)	(11.265)	(7.034)	(13.367)
Aufwendungen insgesamt		(28.336)	(1.682)	(11.265)	(7.034)	(13.367)
Nettogewinn		328.844	62.563	302.389	466.884	420.036
Finanzierungskosten						
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Aktien	8	-	-	-	-	-
Finanzierungskosten gesamt		-	-	-	-	-
Zunahme des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit		328.844	62.563	302.389	466.884	420.036

Die beiliegenden Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

Außer den in der Gesamtergebnisrechnung ausgewiesenen hatte die Gesellschaft im Berichtszeitraum keine anderen erfassten Gewinne oder Verluste. Alle oben genannten Beträge beziehen sich auf fortzuführende Geschäftsbereiche.

**ZUSAMMENGEFASSTE GESAMTERGEBNISRECHNUNG (Fortsetzung)
FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2021**

	Hinweis	MSCI USA SF Index Fund USD	CMCI Commodity Carry Ex-Agriculture SF UCITS ETF USD	Insgesamt USD
Erträge				
Nettogewinn aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten	1	80.147.014	323.011	545.197.936
Gesamtanlageerträge		80.147.014	323.011	545.197.936
Aufwendungen				
Betriebskosten insgesamt	2	(529.949)	(10.787)	(13.793.734)
Aufwendungen insgesamt		(529.949)	(10.787)	(13.793.734)
Nettogewinn		79.617.065	312.224	531.404.202
Finanzierungskosten				
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Aktien	8	(143.355)	-	(2.784.056)
Finanzierungskosten gesamt		(143.355)	-	(2.784.056)
Zunahme des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit		79.473.710	312.224	528.620.146

Die beiliegenden Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

Außer den in der Gesamtergebnisrechnung ausgewiesenen hatte die Gesellschaft im Berichtszeitraum keine anderen erfassten Gewinne oder Verluste. Alle oben genannten Beträge beziehen sich auf fortzuführende Geschäftsbereiche.

**ZUSAMMENGEFASSTE ENTWICKLUNG DES DEN INHABERN RÜCKKAUFBARER, GEWINNBERECHTIGTER AKTIEN
ZUZURECHNENDEN NETTOVERMÖGENS
FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2022**

	Hinweis	CMCI Composite SF UCITS ETF USD	Bloomberg Commodity Index SF UCITS ETF USD	S&P 500 SF UCITS ETF USD	MSCI USA SF UCITS ETF USD	MSCI Emerging Markets SF UCITS ETF USD
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnendes Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums		2.761.436.982	451.977.486	143.657.195	505.901.314	86.074.601
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnende Netto(abnahme)/-zunahme des Vermögens aus der Geschäftstätigkeit		(22.549.513)	450.195	3.532.748	9.767.063	(3.399.474)
Aktientransaktionen						
Ausgabe rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien im Berichtszeitraum	4	32.089.751	14.220.720	8.084.664	24.562.651	17.956.528
Rücknahme rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien im Berichtszeitraum	4	(1.098.989.254)	(311.760.478)	(7.093.448)	(58.492.690)	(8.183.849)
Netto(abnahme)/-zunahme aus Aktientransaktionen		(1.066.899.503)	(297.539.758)	991.216	(33.930.039)	9.772.679
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnendes Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums		1.671.987.966	154.887.923	148.181.159	481.738.338	92.447.806

Die beiliegenden Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

**ZUSAMMENGEFASSTE ENTWICKLUNG DES DEN INHABERN RÜCKKAUFBARER, GEWINNBERECHTIGTER AKTIEN
ZUZURECHNENDEN NETTOVERMÖGENS (Fortsetzung)
FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2022**

	Hinweis	MSCI AC Asia Ex Japan SF UCITS ETF USD	MSCI ACWI SF UCITS ETF USD	CMCI Ex-Agriculture SF UCITS ETF USD	Bloomberg Commodity CMCI SF UCITS ETF USD	CMCI Commodity Carry SF UCITS ETF USD
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnendes Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums		183.513.152	3.005.304.432	136.442.026	401.058.383	109.935.139
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnende Netto(abnahme)/-zunahme des Vermögens aus der Geschäftstätigkeit		(7.756.436)	(333.347.083)	1.972.604	13.865.164	18.180.660
Aktientransaktionen						
Ausgabe rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien im Berichtszeitraum	4	18.019.977	5.997.414.128	9.339.717	259.792.828	100.769.685
Rücknahme rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien im Berichtszeitraum	4	(7.276.066)	(3.253.706.255)	(33.486.960)	(30.460.256)	(58.177.796)
Nettozunahme/(-abnahme) aus Aktientransaktionen		10.743.911	2.743.707.873	(24.147.243)	229.332.572	42.591.889
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnendes Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums		186.500.627	5.415.665.222	114.267.387	644.256.119	170.707.688

Die beiliegenden Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

**ZUSAMMENGEFASSTE ENTWICKLUNG DES DEN INHABERN RÜCKKAUFBARER, GEWINNBERECHTIGTER AKTIEN
ZUZURECHNENDEN NETTOVERMÖGENS (Fortsetzung)
FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2022**

	Hinweis	MSCI	Euro Equity Defensive	Euro Equity Defensive	US Equity Defensive	US Equity Defensive
		China A SF UCITS ETF USD	Covered Call SF UCITS ETF EUR	Put Write SF UCITS ETF EUR	Covered Call SF UCITS ETF USD	Put Write SF UCITS ETF USD
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnendes Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums		141.681.767	2.619.040	16.491.623	3.608.892	14.936.216
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnende Netto(abnahme)/-zunahme des Vermögens aus der Geschäftstätigkeit		(22.620.502)	62.127	617.953	(279.283)	286.400
Aktientransaktionen						
Ausgabe rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien im Berichtszeitraum	4	64.706.046	2.124.782	6.754.086	6.588.170	4.571.836
Rücknahme rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien im Berichtszeitraum	4	(23.023.159)	-	(3.796.347)	(6.538.248)	-
Nettozunahme aus Aktientransaktionen		41.682.887	2.124.782	2.957.739	49.922	4.571.836
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnendes Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums		160.744.152	4.805.949	20.067.315	3.379.531	19.794.452

Die beiliegenden Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

**ZUSAMMENGEFASSTE ENTWICKLUNG DES DEN INHABERN RÜCKKAUFBARER, GEWINNBERECHTIGTER AKTIEN
ZUZURECHNENDEN NETTOVERMÖGENS (Fortsetzung)
FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2022**

	Hinweis	MSCI USA SF Index Fund USD	CMCI Commodity Carry Ex-Agriculture SF UCITS ETF USD	Insgesamt USD
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnendes Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums		845.087.009	49.803.546	8.860.397.382
Zunahme/(Abnahme) des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit		6.550.343	10.573.778	(324.083.600)
Aktientransaktionen				
Ausgabe rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien im Berichtszeitraum	4	304.941.188	-	6.872.062.826
Rücknahme rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien im Berichtszeitraum	4	(227.110.325)	-	(5.128.149.035)
Nettozunahme aus Aktientransaktionen		77.830.863	-	1.743.913.791
Berichtigung aus der Währungsumrechnung	1	-	-	721.975
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnendes Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums		929.468.215	60.377.324	10.280.949.548

Die beiliegenden Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

**ZUSAMMENGEFASSTE ENTWICKLUNG DES DEN INHABERN RÜCKKAUFBARER, GEWINNBERECHTIGTER AKTIEN
ZUZURECHNENDEN NETTOVERMÖGENS
FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2021**

		CMCI Composite SF UCITS ETF USD	Bloomberg Commodity Index SF UCITS ETF USD	S&P 500 SF UCITS ETF USD	MSCI USA SF UCITS ETF USD	MSCI Emerging Markets SF UCITS ETF USD
	Hinweis					
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien						
zuzurechnendes Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums		2.322.474.426	137.650.482	165.898.228	665.466.333	574.501.351
Zunahme/(Abnahme) des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit		124.823.323	4.656.733	19.503.335	68.737.853	(53.783.825)
Aktientransaktionen						
Ausgabe rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien im Berichtszeitraum		308.267.901	24.367.300	12.440.480	24.348.365	1.158.683
Rücknahme rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien im Berichtszeitraum		(569.627.440)	(41.865.610)	(9.790.606)	(44.579.663)	(15.103.057)
Netto(abnahme)/-zunahme aus Aktientransaktionen		(261.359.539)	(17.498.310)	2.649.874	(20.231.298)	(13.944.374)
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnendes Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums		2.185.938.210	124.808.905	188.051.437	713.972.888	506.773.152

Die beiliegenden Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

**ZUSAMMENGEFASSTE ENTWICKLUNG DES DEN INHABERN RÜCKKAUFBARER, GEWINNBERECHTIGTER AKTIEN
ZUZURECHNENDEN NETTOVERMÖGENS (Fortsetzung)
FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2021**

	Hinweis	MSCI AC Asia Ex Japan SF UCITS ETF USD	MSCI ACWI SF UCITS ETF USD	CMCI Ex-Agriculture SF UCITS ETF USD	Bloomberg Commodity CMCI SF UCITS ETF USD	CMCI Commodity Carry SF UCITS ETF USD
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnendes Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums		235.719.821	6.881.414.121	95.967.964	302.535.007	81.839.073
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnende Netto(abnahme)/-zunahme des Vermögens aus der Geschäftstätigkeit		(25.387.000)	272.954.842	8.980.462	21.728.388	4.980.522
Aktientransaktionen						
Ausgabe rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien im Berichtszeitraum	4	11.293.895	374.341.264	39.206.179	26.718.121	58.673.138
Rücknahme rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien im Berichtszeitraum	4	(11.999.433)	(3.837.555.848)	(30.564.051)	(8.495.470)	(69.152.435)
Netto(abnahme)/-zunahme aus Aktientransaktionen		(705.538)	(3.463.214.584)	8.642.128	18.222.651	(10.479.297)
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnendes Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums		209.627.283	3.691.154.379	113.590.554	342.486.046	76.340.298

Die beiliegenden Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

**ZUSAMMENGEFASSTE ENTWICKLUNG DES DEN INHABERN RÜCKKAUFBARER, GEWINNBERECHTIGTER AKTIEN
ZUZURECHNENDEN NETTOVERMÖGENS (Fortsetzung)
FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2021**

	Hinweis	MSCI	Euro Equity Defensive	Euro Equity Defensive	US Equity Defensive	US Equity Defensive
		China A	Covered Call	Put Write	Covered Call	Put Write
		SF UCITS ETF	SF UCITS ETF	SF UCITS ETF	SF UCITS ETF	SF UCITS ETF
		USD	EUR	EUR	USD	USD
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnendes Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums		16.793.669	1.264.765	5.374.631	4.501.085	7.235.626
Zunahme des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit		328.844	62.563	302.389	466.884	420.036
Aktientransaktionen						
Ausgabe rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien im Berichtszeitraum	4	6.238.662	-	5.982.827	141.018	3.126.822
Rücknahme rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien im Berichtszeitraum	4	-	(938.899)	(1.049.563)	(279.189)	(2.354.952)
Nettozunahme/(-abnahme) aus Aktientransaktionen		6.238.662	(938.899)	4.933.264	(138.171)	771.870
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnendes Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums		23.361.175	388.429	10.610.284	4.829.798	8.427.532

Die beiliegenden Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

**ZUSAMMENGEFASSTE ENTWICKLUNG DES DEN INHABERN RÜCKKAUFBARER, GEWINNBERECHTIGTER AKTIEN
ZUZURECHNENDEN NETTOVERMÖGENS (Fortsetzung)
FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2021**

	Hinweis	MSCI USA SF Index Fund USD	CMCI Commodity Carry Ex-Agriculture SF UCITS ETF USD	Insgesamt USD
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnendes Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums		853.129.467	6.342.795	12.359.343.494
Zunahme des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit		79.473.710	312.224	528.620.146
Aktientransaktionen				
Ausgabe rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien im Berichtszeitraum	4	85.654.645	-	982.924.262
Rücknahme rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien im Berichtszeitraum	4	(134.263.083)	-	(4.777.940.015)
Nettoabnahme aus Aktientransaktionen		(48.608.438)	-	(3.795.015.753)
Berichtigung aus der Währungsumrechnung	1	-	-	(428.736)
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnendes Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums		883.994.739	6.655.019	9.092.519.151

Die beiliegenden Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

**ZUSAMMENGEFASSTE KAPITALFLUSSRECHNUNG
FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2022**

Hinweis	CMCI Composite SF UCITS ETF USD	Bloomberg Commodity Index SF UCITS ETF USD	S&P 500 SF UCITS ETF USD	MSCI USA SF UCITS ETF USD	MSCI Emerging Markets SF UCITS ETF USD
Cashflow aus laufender Geschäftstätigkeit					
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnende Netto (abnahme)/-zunahme des Vermögens aus der Geschäftstätigkeit	(22.549.513)	450.195	3.532.748	9.767.063	(3.399.474)
<i>Berichtigung für:</i>					
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Aktien	-	-	-	-	-
Insgesamt	(22.549.513)	450.195	3.532.748	9.767.063	(3.399.474)
Nettoverlust/(-gewinn) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten	19.178.753	(650.205)	(3.672.858)	(10.150.655)	3.308.150
Betriebskosten insgesamt	3.370.760	200.010	140.110	383.592	91.324
Veränderung nicht abgerechneter Anlagen	18.357.116	-	(5.841.020)	-	(510)
Kauf von Anlagen	(4.044.624.903)	(902.263.230)	(138.215.045)	(652.606.632)	(190.172.162)
Verkauf von Anlagen	5.093.167.290	1.199.802.988	143.064.849	686.536.671	180.399.993
Abnahme/(Zunahme) der Sicherheiten in Form von Zahlungsmitteln und Zahlungsmitteläquivalenten	164.458.102	22.535.634	7.570	21.147.401	(450.633)
(Abnahme)/Zunahme der an die Gegenpartei zahlbaren Beträge	(164.458.102)	(22.535.634)	(7.570)	(21.147.401)	450.633
Nettomittelzufluss/(-abfluss) aus laufender Geschäftstätigkeit	1.066.899.503	297.539.758	(991.216)	33.930.039	(9.772.679)
Cashflow aus der Finanzierungstätigkeit					
Erlöse aus der Ausgabe rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien im Berichtszeitraum	32.089.751	14.220.720	8.084.664	24.562.651	17.956.528
Zahlungen für im Berichtszeitraum zurückgenommene rückkaufbare, gewinnberechtigter Aktien	(1.098.989.254)	(311.760.478)	(7.093.448)	(58.492.690)	(8.183.849)
Nettomittel(abfluss)/-zufluss aus der Finanzierungstätigkeit	(1.066.899.503)	(297.539.758)	991.216	(33.930.039)	9.772.679
Nettoveränderung von Zahlungsmitteln und Zahlungsmitteläquivalenten	-	-	-	-	-
Nettozahlungsmittel und -zahlungsmitteläquivalente zu Beginn des Berichtszeitraums	-	-	-	-	-
Nettozahlungsmittel und -zahlungsmitteläquivalente am Ende des Berichtszeitraums	-	-	-	-	-
Zusätzliche Informationen					
Gezahlte Steuern	(532.170)	-	(47.066)	(161.688)	-
Zinsertrag	12.948	1.162	1.079	3.688	681
Zinsaufwand	(12.203)	-	(136)	(458)	-
Dividendeneinkünfte	17.488.861	-	1.500.670	5.100.083	-

Das Layout der zusammengefassten Kapitalflussrechnung für den laufenden Berichtszeitraum wurde modifiziert. Der Nettoverlust/(-gewinn) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten wurde nach den einzelnen Komponenten aufgeschlüsselt. Die Vergleichszahlen blieben unverändert. Diese Änderung an der Darstellung hat keine Auswirkungen auf die Zunahme/(Abnahme) des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2022.

Die beiliegenden Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

**ZUSAMMENGEFASSTE KAPITALFLUSSRECHNUNG (Fortsetzung)
FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2022**

Hinweis	MSCI AC Asia Ex Japan SF UCITS ETF USD	MSCI ACWI SF UCITS ETF USD	CMCI Ex-Agriculture SF UCITS ETF USD	Bloomberg Commodity CMCI SF UCITS ETF USD	CMCI Commodity Carry SF UCITS ETF USD
Cashflow aus laufender Geschäftstätigkeit					
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnende Netto(abnahme)/-zunahme des Vermögens aus der Geschäftstätigkeit	(7.756.436)	(333.347.083)	1.972.604	13.865.164	18.180.660
<i>Berichtigung für:</i>					
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Aktien	-	3.744.707	-	-	-
Insgesamt	(7.756.436)	(329.602.376)	1.972.604	13.865.164	18.180.660
Nettoverlust/(-gewinn) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten	7.539.552	325.299.378	(2.174.375)	(14.739.065)	(18.390.212)
Betriebskosten insgesamt	216.884	4.302.998	201.771	873.901	209.552
Veränderung nicht abgerechneter Anlagen	-	2.119	-	-	26
Kauf von Anlagen	(312.899.426)	(22.845.143.024)	(238.894.004)	(1.171.390.421)	(533.445.875)
Verkauf von Anlagen	302.155.515	20.101.433.032	263.041.247	942.057.849	490.853.960
Abnahme/(Zunahme) der Sicherheiten in Form von Zahlungsmitteln und Zahlungsmitteläquivalenten	6.429.684	(40.150.156)	7.620.000	17.775.050	(5.308.499)
(Abnahme)/Zunahme der an die Gegenpartei zahlbaren Beträge	(6.429.684)	40.150.156	(7.620.000)	(17.775.050)	5.308.499
Nettomittel(abfluss)/-zufluss aus laufender Geschäftstätigkeit	(10.743.911)	(2.743.707.873)	24.147.243	(229.332.572)	(42.591.889)
Cashflow aus der Finanzierungstätigkeit					
Erlöse aus der Ausgabe rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien im Berichtszeitraum	18.019.977	5.997.414.128	9.339.717	259.792.828	100.769.685
Zahlungen für im Berichtszeitraum zurückgenommene rückkaufbare, gewinnberechtigte Aktien	(7.276.066)	(3.253.706.255)	(33.486.960)	(30.460.256)	(58.177.796)
Nettomittelzufluss/(-abfluss) aus der Finanzierungstätigkeit	10.743.911	2.743.707.873	(24.147.243)	229.332.572	42.591.889
Nettoveränderung von Zahlungsmitteln und Zahlungsmitteläquivalenten	-	-	-	-	-
Nettozahlungsmittel und -zahlungsmitteläquivalente zu Beginn des Berichtszeitraums	-	-	-	-	-
Nettozahlungsmittel und -zahlungsmitteläquivalente am Ende des Berichtszeitraums	-	-	-	-	-
Zusätzliche Informationen					
Gezahlte Steuern	(62.854)	(1.836.699)	(36.615)	(207.573)	(51.534)
Zinsertrag	1.348	21.930	826	4.373	896
Zinsaufwand	(168)	(2.894)	(884)	(374)	(381)
Dividendeneinkünfte	1.897.928	45.594.939	1.152.717	6.237.186	1.352.039
Dividendenaufwand	-	(3.744.707)	-	-	-

Das Layout der zusammengefassten Kapitalflussrechnung für den laufenden Berichtszeitraum wurde modifiziert. Der Nettoverlust/(-gewinn) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten wurde nach den einzelnen Komponenten aufgeschlüsselt. Die Vergleichszahlen blieben unverändert. Diese Änderung an der Darstellung hat keine Auswirkungen auf die Zunahme/(Abnahme) des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2022.

Die beiliegenden Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

**ZUSAMMENGEFASSTE KAPITALFLUSSRECHNUNG (Fortsetzung)
FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2022**

Hinweis	MSCI	Euro Equity Defensive	Euro Equity Defensive	US Equity Defensive	US Equity Defensive
	China A SF UCITS ETF USD	Covered Call SF UCITS ETF EUR	Put Write SF UCITS ETF EUR	Covered Call SF UCITS ETF USD	Put Write SF UCITS ETF USD
Cashflow aus laufender Geschäftstätigkeit					
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnende Netto (abnahme)/-zunahme des Vermögens aus der Geschäftstätigkeit	(22.620.502)	62.127	617.953	(279.283)	286.400
<i>Berichtigung für:</i>					
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Aktien	-	-	-	-	-
Insgesamt	(22.620.502)	62.127	617.953	(279.283)	286.400
Nettoverlust/(-gewinn) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten	22.400.027	(68.282)	(644.387)	271.675	(311.745)
Betriebskosten insgesamt	220.475	6.155	26.434	7.608	25.345
Veränderung nicht abgerechneter Anlagen	-	-	-	-	-
Kauf von Anlagen	(368.197.388)	(7.692.821)	(35.387.287)	(23.152.662)	(25.141.198)
Verkauf von Anlagen	326.514.501	5.568.039	32.429.548	23.102.740	20.569.362
Abnahme/(Zunahme) der Sicherheiten in Form von Zahlungsmitteln und Zahlungsmitteläquivalenten	5.009.596	(242.894)	544.121	100.000	390.000
(Abnahme)/Zunahme der an die Gegenpartei zahlbaren Beträge	(5.009.596)	242.894	(544.121)	(100.000)	(390.000)
Nettomittel(abfluss) aus laufender Geschäftstätigkeit	(41.682.887)	(2.124.782)	(2.957.739)	(49.922)	(4.571.836)
Cashflow aus der Finanzierungstätigkeit					
Erlöse aus der Ausgabe rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien im Berichtszeitraum	64.706.046	2.124.782	6.754.086	6.588.170	4.571.836
Zahlungen für im Berichtszeitraum zurückgenommene rückkaufbare, gewinnberechtigte Aktien	(23.023.159)	-	(3.796.347)	(6.538.248)	-
Nettomittelzufluss aus der Finanzierungstätigkeit	41.682.887	2.124.782	2.957.739	49.922	4.571.836
Nettoveränderung von Zahlungsmitteln und Zahlungsmitteläquivalenten	-	-	-	-	-
Nettozahlungsmittel und -zahlungsmitteläquivalente zu Beginn des Berichtszeitraums	-	-	-	-	-
Nettozahlungsmittel und -zahlungsmitteläquivalente am Ende des Berichtszeitraums	-	-	-	-	-
Zusätzliche Informationen					
Gezahlte Steuern	(51.835)	(1.586)	(6.488)	(1.135)	(6.424)
Zinsertrag	1.067	35	142	29	136
Zinsaufwand	(128)	(3)	(16)	(4)	(14)
Dividendeneinkünfte	1.532.347	49.405	207.480	43.582	196.273

Das Layout der zusammengefassten Kapitalflussrechnung für den laufenden Berichtszeitraum wurde modifiziert. Der Nettoverlust/(-gewinn) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten wurde nach den einzelnen Komponenten aufgeschlüsselt. Die Vergleichszahlen blieben unverändert. Diese Änderung an der Darstellung hat keine Auswirkungen auf die Zunahme/(Abnahme) des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2022.

Die beiliegenden Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

**ZUSAMMENGEFASSTE KAPITALFLUSSRECHNUNG (Fortsetzung)
FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2022**

Hinweis	MSCI USA SF Index Fund USD	CMCI Commodity Carry Ex-Agriculture SF UCITS ETF USD	Insgesamt USD
Cashflow aus laufender Geschäftstätigkeit			
Zunahme/(Abnahme) des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit	6.550.343	10.573.778	(324.083.600)
<i>Berichtigung für:</i>			
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Aktien	482.575	-	4.227.282
Insgesamt	7.032.918	10.573.778	(319.856.318)
Netto(gewinn)/-verlust aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten	(7.571.888)	(10.663.773)	308.949.971
Betriebskosten insgesamt	538.970	89.995	10.906.347
Veränderung nicht abgerechneter Anlagen	-	-	12.517.732
Kauf von Anlagen	(2.056.309.946)	(120.702.311)	(33.666.850.020)
Verkauf von Anlagen	1.978.479.083	120.702.311	31.910.418.497
Abnahme der Sicherheiten in Form von Zahlungsmitteln und Zahlungsmitteläquivalenten	16.748.525	2.490.000	219.107.778
Abnahme der an die Gegenpartei zahlbaren Beträge	(16.748.525)	(2.490.000)	(219.107.778)
Nettomittel(abfluss) aus laufender Geschäftstätigkeit	(77.830.863)	-	(1.743.913.791)
Cashflow aus der Finanzierungstätigkeit			
Erlöse aus der Ausgabe rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien im Berichtszeitraum	304.941.188	-	6.872.062.826
Zahlungen für im Berichtszeitraum zurückgenommene rückkaufbare, gewinnberechtigte Aktien	(227.110.325)	-	(5.128.149.035)
Nettomittelzufluss aus der Finanzierungstätigkeit	77.830.863	-	1.743.913.791
Nettoveränderung von Zahlungsmitteln und Zahlungsmitteläquivalenten	-	-	-
Nettozahlungsmittel und -zahlungsmitteläquivalente zu Beginn des Berichtszeitraums	-	-	-
Nettozahlungsmittel und -zahlungsmitteläquivalente am Ende des Berichtszeitraums	-	-	-
Zusätzliche Informationen			
Gezahlte Steuern	(312.777)	(18.738)	(3.335.297)
Zinsertrag	107.952	378	158.673
Zinsaufwand	(55.418)	(44)	(73.125)
Dividendeneinkünfte	9.243.287	560.587	92.161.031
Dividendenaufwand	(482.575)	-	(4.227.282)

Das Layout der zusammengefassten Kapitalflussrechnung für den laufenden Berichtszeitraum wurde modifiziert. Der Nettoverlust/(-gewinn) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten wurde nach den einzelnen Komponenten aufgeschlüsselt. Die Vergleichszahlen blieben unverändert. Diese Änderung an der Darstellung hat keine Auswirkungen auf die Zunahme/(Abnahme) des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2022.

Die beiliegenden Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

**ZUSAMMENGEFASSTE KAPITALFLUSSRECHNUNG
FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2021**

Hinweis	CMCI Composite SF UCITS ETF USD	Bloomberg Commodity Index SF UCITS ETF USD	S&P 500 SF UCITS ETF USD	MSCI USA SF UCITS ETF USD	MSCI Emerging Markets SF UCITS ETF USD
Cashflow aus laufender Geschäftstätigkeit					
Zunahme/(Abnahme) des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit	124.823.323	4.656.733	19.503.335	68.737.853	(53.783.825)
<i>Berichtigung für:</i>					
Netto(gewinn)/-verlust aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten	(124.823.323)	(4.656.733)	(19.503.335)	(68.737.853)	53.783.825
Veränderung nicht abgerechneter Anlagen	-	(273.447.724)	-	-	-
Kauf von Anlagen	(3.734.057.545)	(690.885.407)	(139.561.056)	(534.972.879)	(710.004.152)
Verkauf von Anlagen	3.995.417.084	981.831.441	136.911.182	555.204.177	723.948.526
Abnahme/(Zunahme) der Sicherheiten in Form von Zahlungsmitteln und Zahlungsmitteläquivalenten	17.004.415	14.207.782	(1.315.553)	3.222.742	9.614.465
(Abnahme)/Zunahme der an die Gegenpartei zahlbaren Beträge	(17.004.415)	(14.207.782)	1.315.553	(3.222.742)	(9.614.465)
Nettomittelzufluss/(-abfluss) aus laufender Geschäftstätigkeit	261.359.539	17.498.310	(2.649.874)	20.231.298	13.944.374
Cashflow aus der Finanzierungstätigkeit					
Erlöse aus der Ausgabe rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien im Berichtszeitraum	308.267.901	24.367.300	12.440.480	24.348.365	1.158.683
Zahlungen für im Berichtszeitraum zurückgenommene rückkaufbare, gewinnberechtigter Aktien	(569.627.440)	(41.865.610)	(9.790.606)	(44.579.663)	(15.103.057)
Nettomittelzufluss/(-abfluss) aus der Finanzierungstätigkeit	(261.359.539)	(17.498.310)	2.649.874	(20.231.298)	(13.944.374)
Nettoveränderung von Zahlungsmitteln und Zahlungsmitteläquivalenten	-	-	-	-	-
Nettozahlungsmittel und -zahlungsmitteläquivalente zu Beginn des Berichtszeitraums	-	-	-	-	-
Nettozahlungsmittel und -zahlungsmitteläquivalente am Ende des Berichtszeitraums	-	-	-	-	-
Zusätzliche Informationen					
Gezahlte Steuern	(88.016)	-	(7.368)	(28.436)	-
Zinsertrag	175	-	14	55	-
Zinsaufwand	(163)	-	(15)	(68)	-
Dividendeneinkünfte	14.905.671	420.993	1.273.141	4.909.236	1.774.322

Die beiliegenden Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

**ZUSAMMENGEFASSTE KAPITALFLUSSRECHNUNG (Fortsetzung)
FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2021**

Hinweis	MSCI AC Asia Ex Japan SF UCITS ETF USD	MSCI ACWI SF UCITS ETF USD	CMCI Ex-Agriculture SF UCITS ETF USD	Bloomberg Commodity CMCI SF UCITS ETF USD	CMCI Commodity Carry SF UCITS ETF USD
Cashflow aus laufender Geschäftstätigkeit					
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnende Netto (abnahme)/-zunahme des Vermögens aus der Geschäftstätigkeit	(25.387.000)	272.954.842	8.980.462	21.728.388	4.980.522
<i>Berichtigung für:</i>					
Nettoverlust/(-gewinn) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten	25.387.000	(272.954.842)	(8.980.462)	(21.728.388)	(4.980.522)
Veränderung nicht abgerechneter Anlagen	5.081.325	680	(4.955.949)	1.540.740	-
Kauf von Anlagen	(314.602.495)	(13.315.611.438)	(244.573.251)	(257.347.014)	(363.786.182)
Verkauf von Anlagen	310.226.708	16.778.825.342	240.887.072	237.583.623	374.265.479
Abnahme/(Zunahme) der Sicherheiten in Form von Zahlungsmitteln und Zahlungsmitteläquivalenten	9.246.745	65.622.390	(729.000)	3.964.824	2.860.331
(Abnahme)/Zunahme der an die Gegenpartei zahlbaren Beträge	(9.246.745)	(65.622.390)	729.000	(3.964.824)	(2.860.331)
Nettomittelzufluss/(-abfluss) aus laufender Geschäftstätigkeit	705.538	3.463.214.584	(8.642.128)	(18.222.651)	10.479.297
Cashflow aus der Finanzierungstätigkeit					
Erlöse aus der Ausgabe rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien im Berichtszeitraum	11.293.895	374.341.264	39.206.179	26.718.121	58.673.138
Zahlungen für im Berichtszeitraum zurückgenommene rückkaufbare, gewinnberechtigter Aktien	(11.999.433)	(3.837.555.848)	(30.564.051)	(8.495.470)	(69.152.435)
Nettomittel(abfluss)/-zufluss aus der Finanzierungstätigkeit	(705.538)	(3.463.214.584)	8.642.128	18.222.651	(10.479.297)
Nettoveränderung von Zahlungsmitteln und Zahlungsmitteläquivalenten	-	-	-	-	-
Nettozahlungsmittel und -zahlungsmitteläquivalente zu Beginn des Berichtszeitraums	-	-	-	-	-
Nettozahlungsmittel und -zahlungsmitteläquivalente am Ende des Berichtszeitraums	-	-	-	-	-
Zusätzliche Informationen					
Gezahlte Steuern	(9.073)	(288.105)	(4.153)	(13.800)	(237)
Zinsertrag	19	539	9	41	24
Zinsaufwand	(21)	(570)	(8)	(23)	(6)
Dividendeneinkünfte	1.580.800	49.993.657	715.969	2.274.448	474.950
Dividendenaufwand	-	(2.640.701)	-	-	-

Die beiliegenden Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

**ZUSAMMENGEFASSTE KAPITALFLUSSRECHNUNG (Fortsetzung)
FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2021**

Hinweis	MSCI China A SF UCITS ETF USD	Euro Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF EUR	Euro Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF EUR	US Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF USD	US Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF USD
Cashflow aus laufender Geschäftstätigkeit					
Zunahme des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit	328.844	62.563	302.389	466.884	420.036
<i>Berichtigung für:</i>					
Nettogewinn aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten	(328.844)	(62.563)	(302.389)	(466.884)	(420.036)
Veränderung nicht abgerechneter Anlagen	2.051.665	-	-	-	-
Kauf von Anlagen	(35.045.504)	(1.474.074)	(18.021.334)	(2.606.496)	(12.907.292)
Verkauf von Anlagen	26.755.177	2.412.973	13.088.070	2.744.667	12.135.422
Abnahme/(Zunahme) der Sicherheiten in Form von Zahlungsmitteln und Zahlungsmitteläquivalenten	149.000	(85.297)	104.558	-	(10.000)
(Abnahme)/Zunahme der an die Gegenpartei zahlbaren Beträge	(149.000)	85.297	(104.558)	-	10.000
Nettomittel(abfluss)/-zufluss aus laufender Geschäftstätigkeit	(6.238.662)	938.899	(4.933.264)	138.171	(771.870)
Cashflow aus der Finanzierungstätigkeit					
Erlöse aus der Ausgabe rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien im Berichtszeitraum	6.238.662	-	5.982.827	141.018	3.126.822
Zahlungen für im Berichtszeitraum zurückgenommene rückkaufbare, gewinnberechtigter Aktien	-	(938.899)	(1.049.563)	(279.189)	(2.354.952)
Nettomittelzufluss/(-abfluss) aus der Finanzierungstätigkeit	6.238.662	(938.899)	4.933.264	(138.171)	771.870
Nettoveränderung von Zahlungsmitteln und Zahlungsmitteläquivalenten	-	-	-	-	-
Nettozahlungsmittel und -zahlungsmitteläquivalente zu Beginn des Berichtszeitraums	-	-	-	-	-
Nettozahlungsmittel und -zahlungsmitteläquivalente am Ende des Berichtszeitraums	-	-	-	-	-
Zusätzliche Informationen					
Gezahlte Steuern	(783)	(51)	(322)	(197)	(353)
Zinsertrag	2	-	2	-	1
Zinsaufwand	(1)	-	-	-	(1)
Dividendeneinkünfte	134.870	5.410	35.432	34.365	64.582

Die beiliegenden Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

**ZUSAMMENGEFASSTE KAPITALFLUSSRECHNUNG (Fortsetzung)
FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2021**

Hinweis	MSCI USA SF Index Fund USD	CMCI Commodity Carry Ex-Agriculture SF UCITS ETF USD	Insgesamt USD
Cashflow aus laufender Geschäftstätigkeit			
Zunahme des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit	79.473.710	312.224	528.620.146
<i>Berichtigung für:</i>			
Nettogewinn aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten	(79.473.710)	(312.224)	(528.620.146)
Veränderung nicht abgerechneter Anlagen	-	-	(269.729.263)
Kauf von Anlagen	(670.054.449)	(7.228.611)	(21.055.883.565)
Verkauf von Anlagen	718.662.887	7.228.611	25.120.628.582
Abnahme/(Zunahme) der Sicherheiten in Form von Zahlungsmitteln und Zahlungsmitteläquivalenten	789.241	(130.000)	124.519.286
(Abnahme)/Zunahme der an die Gegenpartei zahlbaren Beträge	(789.241)	130.000	(124.519.286)
Nettomittelzufluss aus laufender Geschäftstätigkeit	48.608.438	-	3.795.015.754
Cashflow aus der Finanzierungstätigkeit			
Erlöse aus der Ausgabe rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien im Berichtszeitraum	85.654.645	-	982.924.262
Zahlungen für im Berichtszeitraum zurückgenommene rückkaufbare, gewinnberechtigter Aktien	(134.263.083)	-	(4.777.940.015)
Nettomittelabfluss aus der Finanzierungstätigkeit	(48.608.438)	-	(3.795.015.753)
Nettoveränderung von Zahlungsmitteln und Zahlungsmitteläquivalenten	-	-	-
Nettozahlungsmittel und -zahlungsmitteläquivalente zu Beginn des Berichtszeitraums	-	-	-
Nettozahlungsmittel und -zahlungsmitteläquivalente am Ende des Berichtszeitraums	-	-	-
Zusätzliche Informationen			
Gezahlte Steuern	(35.480)	(237)	(312.087)
Zinsertrag	69	-	700
Zinsaufwand	(74)	(1)	(705)
Dividendeneinkünfte	6.250.969	42.420	6.568.628
Dividendenaufwand	(143.355)	-	(2.784.056)

Die beiliegenden Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

ERLÄUTERUNGEN ZUM ZUSAMMENGEFASSTEN HALBJAHRESABSCHLUSS FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2022

1. WESENTLICHE RECHNUNGSLEGUNGSGRUNDSÄTZE

Die wichtigsten Rechnungslegungsgrundsätze, die bei der Aufstellung dieses Abschlusses angewendet wurden, sind im Folgenden dargelegt.

a) Grundlage der Aufstellung

Dieser zusammengefasste Halbjahresabschluss für den sechsmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2022 wurde gemäß den internationalen Rechnungslegungsgrundsätzen („IAS“) 34 „Zwischenberichterstattung“, herausgegeben vom International Accounting Standards Board, und den OGAW-Verordnungen erstellt. Aufgrund dessen enthält dieser Halbjahresabschluss nicht alle Informationen und Offenlegungen, die für Jahresabschlüsse vorgeschrieben sind, und sollte zusammen mit dem geprüften Jahresabschluss der Gesellschaft für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 gelesen werden, der im Einklang mit den International Financial Reporting Standards („IFRS“), wie in der Europäischen Union („EU“) anzuwenden, den Bestimmungen des Irish Companies Act, 2014 und den OGAW-Verordnungen erstellt wurde.

Der zusammengefasste Halbjahresabschluss für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2022 ist ungeprüft. Wir weisen darauf hin, dass der Bestätigungsvermerk des Abschlussprüfers im geprüften Jahresabschluss zum 30. Juni 2022 ohne Einschränkung erteilt wurde.

Die Bilanzierungsgrundsätze, Schätzungen, Beurteilungen und Berechnungsmethoden in diesem zusammengefassten ungeprüften Halbjahresabschluss entsprechen denen, die für den geprüften Abschluss der Gesellschaft für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 angewandt wurden. In Übereinstimmung mit IAS 34 beziehen sich die Vergleichszahlen für die zusammengefasste Gesamtergebnisrechnung, die zusammengefasste Entwicklung des den Inhabern rückzukaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnenden Nettovermögens und die zusammengefasste Kapitalflussrechnung auf den vorangegangenen Zwischenberichtszeitraum zum 31. Dezember 2021 und für die zusammengefasste Bilanz auf den vorangegangenen Bilanzstichtag 30. Juni 2022.

Der Abschluss wurde nach dem Anschaffungskostenprinzip erstellt, modifiziert durch die erfolgswirksame Neubewertung der finanziellen Vermögenswerte und finanziellen Verbindlichkeiten sowie der derivativen Finanzinstrumente zum beizulegenden Zeitwert.

2. GEBÜHREN UND KOSTEN

Folgende Gebühren fallen für die Inhaber rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien in Bezug auf jede Aktie an (und fallen nicht der Gesellschaft für den jeweiligen Teilfonds an und haben somit keine Auswirkungen auf den Nettoinventarwert der jeweiligen Aktienklasse des Teilfonds), außer im Falle des MSCI USA SF Index Fund:

	Klasse „A“/„A-UKdis“
Zeichnungsgebühr	0 %
Rücknahmegebühr	0 %
Umtauschgebühr	Bis 3 %
Primärmarkt-Transaktionskosten	Bis 1 %

Folgende Gebühren fallen für die Aktionäre in Bezug auf jede Aktie des MSCI USA SF Index Fund an (und fallen nicht der Gesellschaft für den Teilfonds an und haben somit keine Auswirkungen auf den Nettoinventarwert der jeweiligen Aktienklasse des Teilfonds):

	Klasse „A“/„A-UKdis“
Zeichnungsgebühr	Bis 5 %
Rücknahmegebühr	Bis 3 %
Umtauschgebühr	Bis 3 %

Separat von der Zeichnungsgebühr, der Rücknahmegebühr, der Umtauschgebühr und der Primärmarkt-Transaktionsgebühr, die (je nach Sachlage) von dem von einem Anleger erhaltenen Anlagebetrag bzw. von dem an den Anleger zu zahlenden oder zum Kauf der Aktien der neuen Aktienklasse zu verwendenden Rücknahmeerlös abgezogen werden, und im Unterschied zu diesen, entsteht der Gesellschaft für einen Teilfonds eine Pauschalgebühr, die sich auf den NIW der jeweiligen Aktienklasse des Teilfonds auswirkt. Diese Pauschalgebühr deckt die Gebühren der Dienstleister, einschließlich der Verwaltungsgesellschaft, des Anlageverwalters, der Indexlizenz, der Verwahrstelle und des Administrators, ab. Der Promoter kann Gebühren übernehmen, falls die Pauschalgebühr überschritten wird. Die Gebühren fallen täglich auf der Basis des der jeweiligen Aktienklasse zuzurechnenden Nettoinventarwerts an.

**ERLÄUTERUNGEN ZUM ZUSAMMENGEFASSTEN HALBJAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)
FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2022**

2. GEBÜHREN UND KOSTEN (Fortsetzung)

Folgende Pauschalgebühren gelten seit dem 31. Dezember 2022 und 30. Juni 2022, wie nachstehend beschrieben:

Teilfonds	Währung	Klasse „A-dis“
MSCI ACWI SF UCITS ETF	USD	0,21 % p.a.

Teilfonds	Währung	In Kraft per 31. Dezember 2022 Klasse „A“/„A-acc“
CMCI Composite SF UCITS ETF	USD	0,34 % p.a.
Bloomberg Commodity Index SF UCITS ETF	USD	0,19 % p.a.
S&P 500 SF UCITS ETF	USD	0,19 % p.a.
MSCI USA SF UCITS ETF	USD	0,15 % p.a.
MSCI Emerging Markets SF UCITS ETF	USD	0,21 % p.a.
MSCI AC Asia Ex Japan SF UCITS ETF	USD	0,23 % p.a.
MSCI ACWI SF UCITS ETF	USD	0,21 % p.a.
CMCI Ex-Agriculture SF UCITS ETF	USD	0,34 % p.a.
Bloomberg Commodity CMCI SF UCITS ETF	USD	0,34 % p.a.
CMCI Commodity Carry SF UCITS ETF	USD	0,34 % p.a.
MSCI China A SF UCITS ETF	USD	0,30 % p.a.
Euro Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF	EUR	0,26 % p.a.
Euro Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF	EUR	0,26 % p.a.
US Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF	USD	0,29 % p.a.
US Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF	USD	0,29 % p.a.
MSCI USA SF Index Fund	USD	0,12 % p.a.
CMCI Commodity Carry Ex-Agriculture SF UCITS ETF	USD	0,34 % p.a.

Teilfonds	Währung	In Kraft per 30. Juni 2022 Klasse „A“/„A-acc“
CMCI Composite SF UCITS ETF	USD	0,34 % p.a.
Bloomberg Commodity Index SF UCITS ETF	USD	0,19 % p.a.
S&P 500 SF UCITS ETF	USD	0,19 % p.a.
MSCI USA SF UCITS ETF	USD	0,15 % p.a.
MSCI Emerging Markets SF UCITS ETF	USD	0,21 % p.a.
MSCI AC Asia Ex Japan SF UCITS ETF	USD	0,23 % p.a.
MSCI ACWI SF UCITS ETF	USD	0,21 % p.a.
CMCI Ex-Agriculture SF UCITS ETF	USD	0,34 % p.a.
Bloomberg Commodity CMCI SF UCITS ETF	USD	0,34 % p.a.
CMCI Commodity Carry SF UCITS ETF	USD	0,34 % p.a.
MSCI China A SF UCITS ETF	USD	0,30 % p.a.
Euro Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF	EUR	0,26 % p.a.
Euro Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF	EUR	0,26 % p.a.
US Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF	USD	0,29 % p.a.
US Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF	USD	0,29 % p.a.
MSCI USA SF Index Fund	USD	0,12 % p.a.
CMCI Commodity Carry Ex-Agriculture SF UCITS ETF	USD	0,34 % p.a.

**ERLÄUTERUNGEN ZUM ZUSAMMENGEFASSTEN HALBJAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)
FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2022**

2. GEBÜHREN UND KOSTEN (Fortsetzung)

Die tatsächlichen Transaktionskosten der einzelnen Teilfonds für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2022 und 31. Dezember 2021 sind nachstehend aufgeführt:

Teilfonds	Währung	Transaktionskosten für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember		Drag Level gesamt Klasse „A“/„A-acc“/ „A-dis“ ²
		2022 ¹		
CMCI Composite SF UCITS ETF	USD	3.231.982		0,59 % p.a.
Bloomberg Commodity Index SF UCITS ETF	USD	42.383		0,09 % p.a.
S&P 500 SF UCITS ETF	USD	70.080		0,29 % p.a.
MSCI USA SF UCITS ETF	USD	217.478		0,24 % p.a.
MSCI Emerging Markets SF UCITS ETF	USD	(104.682)		(0,03) % p.a.
MSCI AC Asia Ex Japan SF UCITS ETF	USD	(39.774)		0,13 % p.a.
MSCI ACWI SF UCITS ETF	USD	(2.841.809)		0,06 % p.a.
CMCI Ex-Agriculture SF UCITS ETF	USD	202.888		0,59 % p.a.
Bloomberg Commodity CMCI SF UCITS ETF	USD	736.202		0,59 % p.a.
CMCI Commodity Carry SF UCITS ETF	USD	(7.055)		0,24 % p.a.
MSCI China A SF UCITS ETF	USD	(2.546.632)		(3,13) % p.a.
Euro Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF	EUR	(8.523)		(0,10) % p.a.
Euro Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF	EUR	(1.016)		0,25 % p.a.
US Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF	USD	(5.521)		0,08 % p.a.
US Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF	USD	(22.255)		0,04 % p.a.
MSCI USA SF Index Fund	USD	698.174		0,24 % p.a.
CMCI Commodity Carry Ex-Agriculture SF UCITS ETF	USD	(20.650)		0,24 % p.a.

¹ Bei einigen Teilfonds fiel das Drag Level geringer aus als die Pauschalgebühr im laufenden Berichtszeitraum. Daher waren die Transaktionskosten negativ.

² Die Performance von Aktienklassen, die nicht auf die Basiswährung lauten, kann aufgrund von Währungsabsicherungskosten, die zusätzlich zum Drag Level entstehen, von der Performance der auf die Basiswährung lautenden Aktienklassen abweichen. Das gesamte Drag Level ist das Drag Level zum 31. Dezember 2022, repräsentativ für die Basiswährung des jeweiligen Teilfonds.

Teilfonds	Währung	Transaktionskosten für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember		Drag Level gesamt Klasse „A“/„A-acc“/ „A-dis“ ²
		2021 ¹		
CMCI Composite SF UCITS ETF	USD	4.729.329		0,73 % p.a.
Bloomberg Commodity Index SF UCITS ETF	USD	92.647		0,23 % p.a.
S&P 500 SF UCITS ETF	USD	63.796		0,26 % p.a.
MSCI USA SF UCITS ETF	USD	317.186		0,24 % p.a.
MSCI Emerging Markets SF UCITS ETF	USD	(403.234)		- %p.a.
MSCI AC Asia Ex Japan SF UCITS ETF	USD	20.205		0,28 % p.a.
MSCI ACWI SF UCITS ETF ³	USD	(3.777.613)		0,09 % p.a.
CMCI Ex-Agriculture SF UCITS ETF	USD	249.125		0,73 % p.a.
Bloomberg Commodity CMCI SF UCITS ETF	USD	682.743		0,73 % p.a.
CMCI Commodity Carry SF UCITS ETF	USD	32.613		0,38 % p.a.
MSCI China A SF UCITS ETF	USD	(486.750)		(4,01) % p.a.
Euro Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF	EUR	(2.072)		(0,10) % p.a.
Euro Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF	EUR	4.774		0,25 % p.a.
US Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF	USD	(7.525)		0,08 % p.a.
US Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF	USD	(2.499)		0,04 % p.a.
MSCI USA SF Index Fund	USD	499.286		0,24 % p.a.
CMCI Commodity Carry Ex-Agriculture SF UCITS ETF	USD	3.987		- %p.a.

**ERLÄUTERUNGEN ZUM ZUSAMMENGEFASSTEN HALBJAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)
FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2022**

2. GEBÜHREN UND KOSTEN (Fortsetzung)

¹ Bei einigen Teilfonds fiel das Drag Level geringer aus als die Pauschalgebühr im laufenden Berichtszeitraum. Daher waren die Transaktionskosten negativ.

² Die Performance von Aktienklassen, die nicht auf die Basiswährung lauten, kann aufgrund von Währungsabsicherungskosten, die zusätzlich zum Drag Level entstehen, von der Performance der auf die Basiswährung lautenden Aktienklassen abweichen. Das gesamte Drag Level ist das Drag Level zum 31. Dezember 2021, repräsentativ für die Basiswährung des jeweiligen Teilfonds.

³ Der Drag-Level-Satz war der für die Aktienklasse (hedged to USD) A-acc/UKdis.

Die tatsächlichen Drag Levels der einzelnen Teilfonds für das Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2022 und 31. Dezember 2021 sind nachstehend aufgeführt:

Teilfonds	Währung	Kosten für den	Kosten für den
		Berichtszeitraum zum	Berichtszeitraum zum
		31. Dezember 2022	31. Dezember 2021
CMCI Composite SF UCITS ETF	USD	6.596.604	8.328.414
Bloomberg Commodity Index SF UCITS ETF	USD	242.322	208.360
S&P 500 SF UCITS ETF	USD	191.730	256.743
MSCI USA SF UCITS ETF	USD	600.960	916.040
MSCI Emerging Markets SF UCITS ETF	USD	(13.364)	227.412
MSCI AC Asia Ex Japan SF UCITS ETF	USD	177.226	291.123
MSCI ACWI SF UCITS ETF	USD	1.340.266	3.246.013
CMCI Ex-Agriculture SF UCITS ETF	USD	404.615	421.130
Bloomberg Commodity CMCI SF UCITS ETF	USD	1.609.905	1.233.671
CMCI Commodity Carry SF UCITS ETF	USD	202.580	153.543
MSCI China A SF UCITS ETF	USD	(2.381.762)	(438.938)
Euro Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF	EUR	(2.367)	(357)
Euro Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF	EUR	25.417	17.030
US Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF	USD	2.099	(819)
US Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF	USD	3.059	12.108
MSCI USA SF Index Fund	USD	1.237.328	1.034.683
CMCI Commodity Carry Ex-Agriculture SF UCITS ETF	USD	69.372	14.862

Die Kosten für die Gründung der Gesellschaft und der Teilfonds wurden vom Promoter getragen.

Gesamtkostenquote

Gesamtkostenquote (Total Expense Ratio; „TER“): Diese Kennzahl wird im Einklang mit den „Richtlinien zur Berechnung und Offenlegung der TER bei Organismen für gemeinsame Anlagen“ der Asset Management Association Switzerland (AMAS)/der Swiss Funds & Asset Management Association (SFAMA) in ihrer aktuellen Version berechnet und drückt die Summe aller Kosten und Provisionen aus, die fortlaufend auf das Nettovermögen erhoben (Betriebskosten) und als Prozentsatz des Nettovermögens ausgewiesen werden. Die in der TER enthaltenen Gesamtbetriebskosten für die neu aufgelegten Aktienklassen wurden annualisiert.

	Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2022	Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2021
	Gesamtkostenquote %	Gesamtkostenquote %
CMCI Composite SF UCITS ETF		
Klasse (CHF) A-acc	0,34	0,34
Klasse (GBP) A-acc	0,34	0,34
Klasse (EUR) A-acc	0,34	0,34
Klasse (USD) A-acc	0,34	0,34

**ERLÄUTERUNGEN ZUM ZUSAMMENGEFASSTEN HALBJAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)
FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2022**

2. GEBÜHREN UND KOSTEN (Fortsetzung)

Gesamtkostenquote (Fortsetzung)

	Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2022 Gesamtkostenquote %	Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2021 Gesamtkostenquote %
Bloomberg Commodity Index SF UCITS ETF		
Klasse (CHF) A-acc	0,19	0,19
Klasse (EUR) A-acc	0,19	0,19
Klasse (GBP) A-acc	0,19	0,19
Klasse (USD) A-acc	0,19	0,19
S&P 500 SF UCITS ETF		
Klasse (USD) A-acc	0,19	0,19
MSCI USA SF UCITS ETF		
Klasse (USD) A-acc	0,15	0,15
MSCI Emerging Markets SF UCITS ETF		
Klasse (USD) A-acc	0,21	0,21
MSCI AC Asia Ex Japan SF UCITS ETF		
Klasse (USD) A-acc	0,23	0,23
MSCI ACWI SF UCITS ETF		
Klasse (hedged to CHF) A-acc	0,21	0,21
Klasse (hedged to CHF) A-UKdis	0,21	0,21
Klasse (hedged to EUR) A-acc	0,21	0,21
Klasse (hedged to EUR) A-UKdis	0,21	0,21
Klasse (hedged to GBP) A-UKdis	0,21	0,21
Klasse (hedged to JPY) A-acc	0,21	0,21
Klasse (hedged to SGD) A-acc	0,21	0,21
Klasse (hedged to USD) A-acc	0,21	0,21
Klasse (hedged to USD) A-UKdis	0,21	0,21
Klasse (USD) A-UKdis	0,21	0,21
Klasse (USD) A-acc	0,21	0,21
CMCI Ex-Agriculture SF UCITS ETF		
Klasse (hedged to CHF) A-acc	0,34	0,34
Klasse (hedged to EUR) A-acc	0,34	0,34
Klasse (hedged to GBP) A-acc	0,34	0,34
Klasse (USD) A-acc	0,34	0,34
Bloomberg Commodity CMCI SF UCITS ETF		
Klasse (hedged to CHF) A-acc	0,34	0,34
Klasse (hedged to EUR) A-acc	0,34	0,34
Klasse (hedged to GBP) A-acc	0,34	0,34
Klasse (USD) A-acc	0,34	0,34
CMCI Commodity Carry SF UCITS ETF		
Klasse (hedged to CHF) A-acc	0,34	0,34
Klasse (hedged to EUR) A-acc	0,34	0,34
Klasse (USD) A-acc	0,34	0,34

**ERLÄUTERUNGEN ZUM ZUSAMMENGEFASSTEN HALBJAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)
FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2022**

2. GEBÜHREN UND KOSTEN (Fortsetzung)

Gesamtkostenquote (Fortsetzung)

	Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2022 Gesamtkostenquote %	Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2021 Gesamtkostenquote %
MSCI China A SF UCITS ETF		
Klasse (USD) A-acc	0,30	0,30
Euro Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF		
Klasse (EUR) A-acc	0,26	0,26
Euro Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF		
Klasse (EUR) A-acc	0,26	0,26
US Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF		
Klasse (USD) A-acc	0,29	0,29
US Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF		
Klasse (USD) A-acc	0,29	0,29
MSCI USA SF Index Fund		
Klasse (hedged to CHF) A-acc	0,12	0,12
Klasse (hedged to CHF) A-UKdis	0,12	0,12
Klasse (hedged to EUR) A-acc	0,12	0,12
Klasse (hedged to EUR) A-UKdis	0,12	0,12
Klasse (hedged to GBP) A-acc	0,12	0,12
Klasse (hedged to GBP) A-UKdis	0,12	0,12
Klasse (USD) A-acc	0,12	0,12
Klasse (USD) A-UKdis	0,12	0,12
CMCI Commodity Carry Ex-Agriculture SF UCITS ETF		
Klasse (hedged to EUR) A-acc	0,34	0,34
Klasse (USD) A-acc	0,34	0,34

3. GESCHÄFTSVORFÄLLE MIT NAHESTEHENDEN UNTERNEHMEN UND PERSONEN

Nach Meinung des Verwaltungsrats sind der Anlageverwalter, die Verwaltungsgesellschaft, die Vertriebsgesellschaft und die Verwaltungsratsmitglieder nahestehende Unternehmen oder Personen gemäß IAS 24 „Geschäftsvorfälle mit nahestehenden Unternehmen oder Personen“. Die Swap-Gegenpartei, der autorisierte Teilnehmer, der Schweizer Vertreter, die Schweizer Zahlstelle, der spanische Vertreter, der Facilities Agent im Vereinigten Königreich, ausführende Makler in Bezug auf das Anlageportfolio und die deutsche Zahl- und Informationsstelle sind ebenfalls nahestehende Personen bzw. Unternehmen der Gesellschaft. Diese Unternehmen gehören zur Unternehmensgruppe der UBS Group AG.

Verwaltungsratsmitglied Frank Muesel ist ein Mitarbeiter der Vertriebsgesellschaft. Verwaltungsratsmitglied Nina Petrini ist eine Mitarbeiterin der spanischen Vertretung, UBS Europe SE, sucursal en España.

Verwaltungsratsmitglied Alan White ist ein stellvertretendes Verwaltungsratsmitglied der Verwaltungsgesellschaft. Zum Ende des Berichtszeitraums hielten Alan White und Colm Torpey (ein vormaliges Verwaltungsratsmitglied und Mitarbeiter der Verwaltungsgesellschaft) jeweils eine Zeichneraktie der Gesellschaft im Nennwert von 1 EUR.

Für dem Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2022 wurden durch die Verwaltungsgesellschaft Verwaltungsrats honorare in Höhe von EUR 45.000 (31. Dezember 2021: null EUR) gezahlt.

Per 31. Dezember 2022 waren 32.500 EUR an Verwaltungsratsmitglieder zahlbar (30. Juni 2022: null EUR). Nicht unabhängige Verwaltungsratsmitglieder der Gesellschaft erhalten für ihre Funktion als Verwaltungsratsmitglieder keine zusätzlichen Honorare.

Die Honorare der Verwaltungsratsmitglieder für 2022 wurden im 1. Quartal und im 2. Quartal 2023 ausgezahlt.

**ERLÄUTERUNGEN ZUM ZUSAMMENGEFASSTEN HALBJAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)
FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2022**

3. GESCHÄFTSVORFÄLLE MIT NAHESTEHENDEN UNTERNEHMEN UND PERSONEN (Fortsetzung)

Barsicherheiten, die die Teilfonds erhalten, können in den UBS (Irl) Fund plc - Select Money Market Fund - USD und den UBS (Irl) Fund plc - Select Money Market Fund - EUR reinvestiert werden, die von einem nahestehenden Unternehmen, der UBS AG (und ihren Konzerngesellschaften), verwaltet werden. Die UBS Fund Management (Luxembourg) SA erhebt für die Anlagen der Gesellschaft in diesen Fonds Verwaltungsgebühren.

Die UBS Asset Management Switzerland AG handelt als Vertriebsgesellschaft der Gesellschaft. In den Berichtszeiträumen zum 31. Dezember 2022 bzw. zum 31. Dezember 2021 fielen keine Vertriebsstellengebühren an.

Die Gesellschaft hat UBS Fund Management (Ireland) Limited (vormals Lantern Structured Asset Management Limited) zur Verwaltungsgesellschaft der Gesellschaft und aller Teilfonds bestellt, mit der Befugnis, eine oder mehrere ihrer Funktionen zu delegieren, vorbehaltlich der Gesamtüberwachung und Kontrolle durch die Gesellschaft.

Die Verwaltungsgesellschaft ist eine hundertprozentige Tochtergesellschaft der UBS AG. Die von den Teilfonds für den 31. Dezember 2022 in Rechnung gestellten Verwaltungsgebühren und die für den am 31. Dezember 2021 endenden Berichtszeitraum berechneten und zum 30. Juni 2022 fälligen Beträge sind nachstehend aufgeführt:

		Gebühr für den Berichts- zeitraum zum Wäh- rung	Aufgelaufen	Gebühr für den Berichts- zeitraum zum 31. Dezember	Aufge- laufen zum 30. Juni
		2022	31. Dezember	2021	2022
CMCI Composite SF UCITS ETF	USD	991.400	140.590	1.068.270	237.127
Bloomberg Commodity Index SF UCITS ETF	USD	31.580	3.836	18.427	12.181
S&P 500 SF UCITS ETF	USD	22.123	3.665	27.025	3.685
MSCI USA SF UCITS ETF	USD	76.718	12.554	104.748	12.375
MSCI Emerging Markets SF UCITS ETF	USD	13.365	2.402	80.944	2.213
MSCI AC Asia Ex Japan SF UCITS ETF	USD	27.925	4.869	33.993	4.474
MSCI ACWI SF UCITS ETF	USD	614.714	140.854	1.010.926	76.975
CMCI Ex-Agriculture SF UCITS ETF	USD	59.344	9.640	50.796	12.110
Bloomberg Commodity CMCI SF UCITS ETF	USD	257.030	55.057	163.885	36.813
CMCI Commodity Carry SF UCITS ETF	USD	61.633	13.520	35.876	9.232
MSCI China A SF UCITS ETF	USD	44.842	7.998	5.763	4.638
Euro Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF	EUR	1.184	209	323	111
Euro Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF	EUR	5.083	853	2.166	659
US Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF	USD	1.312	146	1.213	152
US Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF	USD	4.370	839	2.305	613
MSCI USA SF Index Fund	USD	31.440	5.644	30.914	5.175
CMCI Commodity Carry Ex-Agriculture SF UCITS ETF	USD	26.469	5.031	3.173	4.000

**ERLÄUTERUNGEN ZUM ZUSAMMENGEFASSTEN HALBJAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)
FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2022**

3. GESCHÄFTSVORFÄLLE MIT NAHESTEHENDEN UNTERNEHMEN UND PERSONEN (Fortsetzung)

Die UBS Asset Management (UK) Limited ist der Anlageverwalter der Gesellschaft. Die in Rechnung gestellten Gebühren des Anlageverwalters und die zum 31. Dezember 2022 sowie die für den am 31. Dezember 2021 endenden Berichtszeitraum berechneten und zum 30. Juni 2022 von den Teilfonds zahlbaren Beträge sind nachstehend aufgeführt:

		Gebühr für den Berichts- zeitraum zum Wäh- rung 31. Dezember 2022	Aufgelaufen den Berichts- zeitraum zum 31. Dezember 2022	Gebühr für den Berichts- zeitraum zum 31. Dezember 2021	Aufge- zulaufen zum 30. Juni 2022
CMCI Composite SF UCITS ETF	USD	1.734.950	242.754	1.602.404	411.694
Bloomberg Commodity Index SF UCITS ETF	USD	100.005	11.966	42.996	38.392
S&P 500 SF UCITS ETF	USD	33.184	5.348	27.025	5.377
MSCI USA SF UCITS ETF	USD	115.077	18.280	104.748	18.012
MSCI Emerging Markets SF UCITS ETF	USD	42.321	6.897	188.869	6.299
MSCI AC Asia Ex Japan SF UCITS ETF	USD	88.429	15.131	79.316	13.880
MSCI ACWI SF UCITS ETF	USD	1.946.594	446.037	2.358.828	243.756
CMCI Ex-Agriculture SF UCITS ETF	USD	103.853	16.702	76.194	21.024
Bloomberg Commodity CMCI SF UCITS ETF	USD	449.802	95.851	245.828	63.924
CMCI Commodity Carry SF UCITS ETF	USD	107.858	23.708	53.814	16.204
MSCI China A SF UCITS ETF	USD	93.422	16.559	9.605	9.558
Euro Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF	EUR	3.432	605	776	322
Euro Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF	EUR	14.742	2.458	5.199	1.898
US Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF	USD	3.804	418	2.911	434
US Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF	USD	12.673	2.418	5.531	1.765
MSCI USA SF Index Fund	USD	166.182	29.519	132.487	27.040
CMCI Commodity Carry Ex-Agriculture SF UCITS ETF	USD	46.321	8.797	4.759	6.994

Die Verwaltungsgebühren und die Gebühren des Anlageverwalters sind in den betrieblichen Nettoaufwendungen in der Gesamtergebnisrechnung erfasst.

Die UBS AG, die Muttergesellschaft der Verwaltungsgesellschaft, ist die einzige Gegenpartei der Funded und Unfunded Swaps, die von den einzelnen Teilfonds gehalten werden. Die von den einzelnen Teilfonds gehaltenen Swaps sind in der jeweiligen Vermögensaufstellung aufgeführt. Die UBS AG hat ferner bei den Teilfonds Sicherheiten für die Funded Swaps hinterlegt. Weitere Angaben zu diesen Sicherheiten finden sich in Erläuterung 5(a).

Die UBS AG ist der autorisierte Teilnehmer und fungiert als Marktmacher (Market Maker) an folgenden Börsen: SIX Swiss Exchange, XETRA, London Stock Exchange und Borsa Italiana. Die UBS Fund Management (Switzerland) AG ist der Vertreter in der Schweiz. Die UBS AG hielt zum 30. Juni 2022 als autorisierter Teilnehmer 100 % (30. Juni 2022: 100 %) der Teilfonds im primären Aktienbuch am 31. Dezember 2022, von denen die Mehrzahl auf dem Sekundärmarkt weiterverkauft wird.

Die UBS Switzerland AG ist die Zahlstelle in der Schweiz.

Verbundene Parteien

Vorschrift 43(1) der OGAW-Vorschriften der Zentralbank, „Einschränkungen von Transaktionen mit verbundenen Parteien“, besagt, dass „ein Verantwortlicher sicherstellen muss, dass jede Transaktion zwischen einem OGAW und einer verbundenen Partei a) nach dem Fremdvergleichsgrundsatz und b) im besten Interesse der Aktionäre des OGAW erfolgt“.

Wie gemäß OGAW-Vorschrift 81.4 der Zentralbank vorgeschrieben, haben sich die Verwaltungsratsmitglieder vergewissert, dass durch schriftliche Verfahren belegte Vorkehrungen getroffen wurden, um sicherzustellen, dass die von Vorschrift 43(1) vorgeschriebenen Pflichten auf alle Transaktionen mit einer verbundenen Partei angewendet werden; und bei allen Transaktionen mit verbundenen Parteien, die im Berichtszeitraum eingegangen wurden, wurden die von Vorschrift 43(1) vorgeschriebenen Pflichten erfüllt.

**ERLÄUTERUNGEN ZUM ZUSAMMENGEFASSTEN HALBJAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)
FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2022**

4. AKTIENKAPITAL

Genehmigt

Das genehmigte Kapital der Gesellschaft beläuft sich auf 2 Zeichneraktien („Zeichneraktien“) im Nennwert von je 1 EUR und 1.000.000.000.000 Aktien ohne Nennwert, die anfangs als unklassifizierte Aktien ausgewiesen wurden und zur Ausgabe als Aktien zur Verfügung stehen. Die Zeichneraktien sind nicht Teil des Nettoinventarwerts der Gesellschaft und werden in diesem Abschluss nur in dieser Erläuterung erwähnt. Diese Offenlegung spiegelt nach Ansicht des Verwaltungsrats das Wesen der Geschäftstätigkeit der Gesellschaft als Investmentfonds wider.

Rückkaufbare, gewinnberechtigte Aktien

Das ausgegebene Kapital rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien eines jeden Teilfonds ist jederzeit gleich dem Nettoinventarwert dieses Teilfonds. Rückkaufbare, gewinnberechtigte Aktien sind auf Wunsch der Inhaber zurückzunehmen und werden als finanzielle Verbindlichkeiten ausgewiesen. Die rückkaufbaren, gewinnberechtigten Aktien können zudem auf einem Sekundärmarkt gekauft und verkauft werden, wenn ein solcher Markt existiert.

Die Veränderungen in der Anzahl der rückkaufbaren, gewinnberechtigten Aktien im Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2022 stellen sich wie folgt dar:

	Anfangsbestand	Gezeichnete rückkaufbare, gewinn- berechtigte Aktien	Zurück- genommene rückkaufbare, gewinn- berechtigte Aktien	Schluss- bestand
CMCI Composite SF UCITS ETF				
Klasse (CHF) A-acc	4.130.960	50.000	(165.000)	4.015.960
Klasse (GBP) A-acc	370.587	-	-	370.587
Klasse (EUR) A-acc	9.197.689	90.000	(5.370.000)	3.917.689
Klasse (USD) A-acc	15.942.626	215.000	(6.830.000)	9.327.626
Bloomberg Commodity Index SF UCITS ETF				
Klasse (CHF) A-acc	6.103.171	50.000	(4.855.000)	1.298.171
Klasse (EUR) A-acc	567.421	-	(120.000)	447.421
Klasse (GBP) A-acc	35.424	70.000	(70.000)	35.424
Klasse (USD) A-acc	799.398	100.000	(170.000)	729.398
S&P 500 SF UCITS ETF				
Klasse (USD) A-acc	2.029.409	111.700	(92.379)	2.048.730
MSCI USA SF UCITS ETF				
Klasse (USD) A-acc	4.812.571	212.870	(531.064)	4.494.377
MSCI Emerging Markets SF UCITS ETF				
Klasse (USD) A-acc	1.855.164	387.628	(189.090)	2.053.702
MSCI AC Asia Ex Japan SF UCITS ETF				
Klasse (USD) A-acc	1.207.236	123.000	(50.300)	1.279.936

**ERLÄUTERUNGEN ZUM ZUSAMMENGEFASSTEN HALBJAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)
FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2022**

4. AKTIENKAPITAL (Fortsetzung)

Rückkaufbare, gewinnberechtigte Aktien (Fortsetzung)

	Anfangsbestand	Gezeichnete rückkaufbare, gewinn- berechtigte Aktien	Zurück- genommene rückkaufbare, gewinn- berechtigte Aktien	Schluss- bestand
MSCI ACWI SF UCITS ETF				
Klasse (hedged to EUR) A-acc	4.070.712	8.629.911	(5.191.907)	7.508.716
Klasse (hedged to EUR) A-UKdis	93.821	6.500	(10.700)	89.621
Klasse (hedged to CHF) A-acc	2.827.067	10.681.546	(5.948.589)	7.560.024
Klasse (hedged to CHF) A-UKdis	180.783	7.000	(2.000)	185.783
Klasse (hedged to GBP) A-UKdis	224.186	1.144.590	(630.382)	738.394
Klasse (hedged to JPY) A-acc	10.414.173	1.008.408	-	11.422.581
Klasse (hedged to SGD) A-acc	18.500	-	(3.500)	15.000
Klasse (hedged to USD) A-acc	4.352.710	14.322.697	(7.998.910)	10.676.497
Klasse (hedged to USD) A-UKdis	209.654	6.300	(3.000)	212.954
Klasse (USD) A-UKdis	1.943.084	9.000	(128.000)	1.824.084
Klasse (USD) A-acc	5.873.689	103.800	(1.075.225)	4.902.264
CMCI Ex-Agriculture SF UCITS ETF				
Klasse (hedged to CHF) A-acc	330.800	-	(25.000)	305.800
Klasse (hedged to EUR) A-acc	45.127	-	-	45.127
Klasse (hedged to GBP) A-acc	27.500	-	(10.000)	17.500
Klasse (USD) A-acc	328.871	45.000	(135.000)	238.871
Bloomberg Commodity CMCI SF UCITS ETF				
Klasse (hedged to CHF) A-acc	2.378.425	-	-	2.378.425
Klasse (hedged to EUR) A-acc	1.225.560	6.550.000	(540.000)	7.235.560
Klasse (hedged to GBP) A-acc	187.000	62.000	-	249.000
Klasse (USD) A-acc	21.422.057	10.318.874	(1.390.000)	30.350.931
CMCI Commodity Carry SF UCITS ETF				
Klasse (USD) A-acc	596.150	-	(255.000)	341.150
Klasse (hedged to EUR) A-acc	278.500	735.000	(230.000)	783.500
Klasse (hedged to CHF) A-acc	100.000	215.000	(35.000)	280.000
MSCI China A SF UCITS ETF				
Klasse (USD) A-acc	1.006.610	507.140	(195.000)	1.318.750
Euro Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF				
Klasse (EUR) A-acc	24.210	19.408	-	43.618
Euro Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF				
Klasse (EUR) A-acc	144.029	58.208	(32.900)	169.337
US Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF				
Klasse (USD) A-acc	29.575	53.041	(54.700)	27.916
US Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF				
Klasse (USD) A-acc	130.707	41.000	-	171.707

**ERLÄUTERUNGEN ZUM ZUSAMMENGEFASSTEN HALBJAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)
FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2022**

4. AKTIENKAPITAL (Fortsetzung)

Rückkaufbare, gewinnberechtigte Aktien (Fortsetzung)

	Anfangs- bestand	Gezeichnete rückkaufbare, gewinn- berechtigte Aktien	Zurück- genommene rückkaufbare, gewinn- berechtigte Aktien	Schluss- bestand
MSCI USA SF Index Fund				
Klasse (USD) A-acc	5.046.478	431.886	(850.755)	4.627.609
Klasse (USD) A-UKdis	478.382	59.557	(29.779)	508.160
Klasse (hedged to GBP) A-UKdis	2.500	-	-	2.500
Klasse (hedged to CHF) A-acc	470.210	195.952	(173.133)	493.029
Klasse (hedged to CHF) A-UKdis	40.250	1.760	(28.700)	13.310
Klasse (hedged to EUR) A-acc	1.620.667	1.401.037	(630.630)	2.391.074
Klasse (hedged to EUR) A-UKdis	29.945	77.163	(39.110)	67.998
Klasse (hedged to GBP) A-acc	46.528	385.947	(236.191)	196.284
CMCI Commodity Carry Ex-Agriculture SF UCITS ETF				
Klasse (hedged to EUR) A-acc	40.000	-	-	40.000
Klasse (USD) A-acc	492.330	-	-	492.330

Die Veränderungen in der Anzahl der rückkaufbaren, gewinnberechtigten Aktien im Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2021 stellen sich wie folgt dar:

	Anfangs- bestand	Gezeichnete rückkaufbare, gewinn- berechtigte Aktien	Zurück- genommene rückkaufbare, gewinn- berechtigte Aktien	Schluss- bestand
CMCI Composite SF UCITS ETF				
Klasse (CHF) A-acc	4.622.460	73.500	(485.000)	4.210.960
Klasse (GBP) A-acc	210.587	52.000	(190.000)	72.587
Klasse (EUR) A-acc	5.119.689	1.767.000	(380.000)	6.506.689
Klasse (USD) A-acc	19.467.776	1.827.250	(5.837.400)	15.457.626
Bloomberg Commodity Index SF UCITS ETF				
Klasse (CHF) A-acc	1.691.171	110.000	(510.000)	1.291.171
Klasse (EUR) A-acc	451.421	95.000	(110.000)	436.421
Klasse (GBP) A-acc	15.424	40.000	-	55.424
Klasse (USD) A-acc	484.398	175.000	(170.000)	489.398
S&P 500 SF UCITS ETF				
Klasse (USD) A-acc	2.088.909	149.500	(115.000)	2.123.409
MSCI USA SF UCITS ETF				
Klasse (USD) A-acc	5.506.056	192.515	(347.000)	5.351.571
MSCI Emerging Markets SF UCITS ETF				
Klasse (USD) A-acc	9.245.691	20.000	(270.000)	8.995.691
MSCI AC Asia Ex Japan SF UCITS ETF				
Klasse (USD) A-acc	1.159.736	58.500	(65.000)	1.153.236

**ERLÄUTERUNGEN ZUM ZUSAMMENGEFASSTEN HALBJAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)
FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2022**

4. AKTIENKAPITAL (Fortsetzung)

Rückkaufbare, gewinnberechtigte Aktien (Fortsetzung)

	Anfangsbestand	Gezeichnete rückkaufbare, gewinn- berechtigte Aktien	Zurück- genommene rückkaufbare, gewinn- berechtigte Aktien	Schluss- bestand
MSCI ACWI SF UCITS ETF				
Klasse (hedged to EUR) A-acc	8.902.277	562.500	(5.637.527)	3.827.250
Klasse (hedged to EUR) A-UKdis	150.821	-	(63.200)	87.621
Klasse (hedged to CHF) A-acc	8.354.569	99.200	(5.714.641)	2.739.128
Klasse (hedged to CHF) A-UKdis	180.582	12.001	(32.300)	160.283
Klasse (hedged to GBP) A-UKdis	870.183	5.000	(663.904)	211.279
Klasse (hedged to JPY) A-acc	8.334.387	995.000	(226.000)	9.103.387
Klasse (hedged to SGD) A-acc	27.900	-	-	27.900
Klasse (hedged to USD) A-acc	11.563.694	108.000	(6.794.274)	4.877.420
Klasse (hedged to USD) A-UKdis	219.704	10.450	(20.500)	209.654
Klasse (USD) A-UKdis	2.117.784	52.000	(271.200)	1.898.584
Klasse (USD) A-acc	4.001.789	1.202.000	(240.100)	4.963.689
CMCI Ex-Agriculture SF UCITS ETF				
Klasse (hedged to CHF) A-acc	383.300	72.500	(125.000)	330.800
Klasse (hedged to EUR) A-acc	65.127	5.000	-	70.127
Klasse (hedged to GBP) A-acc	15.500	-	-	15.500
Klasse (USD) A-acc	157.371	154.000	(59.000)	252.371
Bloomberg Commodity CMCI SF UCITS ETF				
Klasse (hedged to CHF) A-acc	2.573.602	437.851	(378.028)	2.633.425
Klasse (hedged to EUR) A-acc	915.586	200.000	(100.000)	1.015.586
Klasse (hedged to GBP) A-acc	325.000	-	(140.000)	185.000
Klasse (USD) A-acc	19.705.281	1.356.776	-	21.062.057
CMCI Commodity Carry SF UCITS ETF				
Klasse (USD) A-acc	301.150	295.000	(220.000)	376.150
Klasse (hedged to EUR) A-acc	376.500	207.000	(355.000)	228.500
Klasse (hedged to CHF) A-acc	20.000	-	-	20.000
MSCI China A SF UCITS ETF				
Klasse (USD) A-acc	106.410	40.200	-	146.610
Euro Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF				
Klasse (EUR) A-acc	10.435	-	(7.400)	3.035
Euro Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF				
Klasse (EUR) A-acc	47.854	52.000	(9.000)	90.854
US Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF				
Klasse (USD) A-acc	33.475	1.000	(1.900)	32.575
US Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF				
Klasse (USD) A-acc	63.507	27.000	(19.800)	70.707

**ERLÄUTERUNGEN ZUM ZUSAMMENGEFASSTEN HALBJAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)
FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2022**

4. AKTIENKAPITAL (Fortsetzung)

Rückkaufbare, gewinnberechtigte Aktien (Fortsetzung)

	Anfangs- bestand	Gezeichnete rückkaufbare, gewinn- berechtigte Aktien	Zurück- genommene rückkaufbare, gewinn- berechtigte Aktien	Schluss- bestand
MSCI USA SF Index Fund				
Klasse (USD) A-acc	4.916.282	403.709	(706.589)	4.613.402
Klasse (USD) A-UKdis	324.534	88.310	(33.077)	379.767
Klasse (hedged to GBP) A-UKdis	2.500	-	-	2.500
Klasse (hedged to CHF) A-acc	304.763	19.417	(45.412)	278.768
Klasse (hedged to CHF) A-UKdis	28.840	10.500	(6.990)	32.350
Klasse (hedged to EUR) A-acc	982.433	106.254	(190.044)	898.643
Klasse (hedged to EUR) A-UKdis	17.143	1.440	(1.088)	17.495
Klasse (hedged to GBP) A-acc	30.721	5.984	(3.876)	32.829
CMCI Commodity Carry Ex-Agriculture SF UCITS ETF				
Klasse (hedged to EUR) A-acc	40.000	-	-	40.000
Klasse (USD) A-acc	20.000	-	-	20.000

5. FINANZRISIKOMANAGEMENT

Die Teilfonds sind durch ihre Aktivitäten verschiedenen finanziellen Risiken ausgesetzt, wie z. B. dem Marktrisiko (einschließlich Marktpreisrisiko, Zinsrisiko und Währungsrisiko), Kreditrisiko und Liquiditätsrisiko. Der Portfoliomanagementprozess zielt darauf ab, Risiken in Einklang mit den jeweiligen Anlagezielen der Teilfonds zu steuern. Die im Berichtszeitraum angewandten Risikomanagementziele und -methoden entsprechen den im geprüften Jahresabschluss für das Geschäftsjahr der Gesellschaft zum 30. Juni 2022 angewandten.

Allgemeiner Risikomanagementprozess

(a) Kreditrisikomanagement und -überwachung

Bei den am Ende des Berichtszeitraums gehaltenen Sicherheiten handelt es sich gemäß den OGAW-Vorschriften der Zentralbank um zulässige Sicherheiten, einschließlich supranationaler und Staatsanleihen sowie Barmittel. Barsicherheiten werden in den UBS (Irl) Fund plc - Select Money Market Fund - USD und den UBS (Irl) Fund plc - Select Money Market Fund - EUR reinvestiert, die von einem nahestehenden Unternehmen, der UBS AG, (und ihren Konzerngesellschaften) verwaltet werden.

**ERLÄUTERUNGEN ZUM ZUSAMMENGEFASSTEN HALBJAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)
FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2022**

5. FINANZRISIKOMANAGEMENT (Fortsetzung)

Allgemeiner Risikomanagementprozess (Fortsetzung)

(a) *Kreditrisikomanagement und -überwachung (Fortsetzung)*

Nachstehende Tabelle zeigt den Wert des Swap, der Sicherheit und die Besicherungsquote je Teilfonds zum 31. Dezember 2022:

Zum 31. Dezember 2022

	Wert des Swap USD	Wert der Sicherheit einschließlich gehandelter Positionen in USD	Besicherungsquote (Wert der Sicherheit/Wert des Swap)
CMCI Composite SF UCITS ETF	51.275.227	35.822.755	69,86 %
Bloomberg Commodity Index SF UCITS ETF	20.046.081	18.997.340	94,77 %
S&P 500 SF UCITS ETF	8.063.426	3.936.876	48,82 %
MSCI USA SF UCITS ETF	20.232.741	13.863.199	68,52 %
MSCI Emerging Markets SF UCITS ETF	9.758.726	9.826.057	100,69 %
MSCI AC Asia Ex Japan SF UCITS ETF	4.445.895	9.022.382	202,94 %
MSCI ACWI SF UCITS ETF	196.634.426	151.481.401	77,04 %
CMCI Ex-Agriculture SF UCITS ETF	3.480.714	2.693.000	77,37 %
Bloomberg Commodity CMCI SF UCITS ETF	18.977.779	13.386.744	70,54 %
CMCI Commodity Carry SF UCITS ETF	5.113.300	12.864.657	251,59 %
MSCI China A SF UCITS ETF	6.156.236	6.359.235	103,30 %
Euro Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF	163.515	398.477	243,69 %
Euro Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF	760.905	778.938	102,37 %
US Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF	137.762	252.000	182,92 %
US Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF	702.273	750.000	106,80 %
MSCI USA SF Index Fund	40.383.171	35.152.348	87,05 %
CMCI Commodity Carry Ex-Agriculture SF UCITS ETF	1.438.742	1.170.000	81,32 %
	387.770.919	316.755.409	

**ERLÄUTERUNGEN ZUM ZUSAMMENGEFASSTEN HALBJAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)
FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2022**

5. FINANZRISIKOMANAGEMENT (Fortsetzung)

Allgemeiner Risikomanagementprozess (Fortsetzung)

(a) Kreditrisikomanagement und -überwachung (Fortsetzung)

Nachstehende Tabelle zeigt den Wert des Swap, der Sicherheit und die Besicherungsquote je Teilfonds zum 30. Juni 2022:

Zum 30. Juni 2022

	Wert des Swap	Wert der Sicherheit einschließlich gehandelter USD Positionen in USD	Besicherungsquote (Wert der Sicherheit/ Wert des Swap)
CMCI Composite SF UCITS ETF	147.531.339	200.280.857	135,75 %
Bloomberg Commodity Index SF UCITS ETF	29.043.183	47.807.485	164,61 %
S&P 500 SF UCITS ETF	4.719.545	3.944.446	83,58 %
MSCI USA SF UCITS ETF	44.870.116	35.010.600	78,03 %
MSCI Emerging Markets SF UCITS ETF	6.178.831	7.289.403	117,97 %
MSCI AC Asia Ex Japan SF UCITS ETF	12.644.291	14.383.050	113,75 %
MSCI ACWI SF UCITS ETF	117.156.775	111.331.245	95,03 %
CMCI Ex-Agriculture SF UCITS ETF	6.731.098	10.313.000	153,21 %
Bloomberg Commodity CMCI SF UCITS ETF	18.164.394	31.161.794	171,55 %
CMCI Commodity Carry SF UCITS ETF	8.614.967	6.428.128	74,62 %
MSCI China A SF UCITS ETF	11.180.281	11.368.831	101,69 %
Euro Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF	136.605	97.000	71,01 %
Euro Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF	1.003.793	958.800	95,52 %
US Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF	148.230	352.000	237,47 %
US Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF	936.761	1.140.000	121,70 %
MSCI USA SF Index Fund	41.027.092	51.900.873	126,50 %
CMCI Commodity Carry Ex-Agriculture SF UCITS ETF	4.728.946	3.660.000	77,40 %
	454.816.247	537.427.512	

(b) Tracking Error

Der Tracking Error repräsentiert für jeden Teilfonds die Volatilität der täglichen Differenzen zwischen den Renditen des Teilfonds und den Renditen des maßgeblichen Referenzindexes für die zwölfmonatigen Berichtszeiträume zum 31. Dezember 2022 und 31. Dezember 2021.

**ERLÄUTERUNGEN ZUM ZUSAMMENGEFASSTEN HALBJAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)
FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2022**

5. FINANZRISIKOMANAGEMENT (Fortsetzung)

Allgemeiner Risikomanagementprozess (Fortsetzung)

(b) *Tracking Error (Fortsetzung)*

Die nachstehende und umseitige Tabelle fasst den Tracking Error nach Gebühren, Transaktionskosten und Ausgaben für die Berichtszeiträume zum 31. Dezember 2022 und 31. Dezember 2021 zusammen:

	Tracking Error 31. Dezember 2022	Tracking Error 31. Dezember 2021
CMCI Composite SF UCITS ETF	0,02 %	0,03 %
Bloomberg Commodity Index SF UCITS ETF	0,00 %	0,01 %
S&P 500 SF UCITS ETF	0,01 %	0,01 %
MSCI USA SF UCITS ETF	0,01 %	0,01 %
MSCI Emerging Markets SF UCITS ETF	0,00 %	0,00 %
MSCI AC Asia Ex Japan SF UCITS ETF	0,00 %	0,01 %
MSCI ACWI SF UCITS ETF	0,00 %	0,00 %
CMCI Ex-Agriculture SF UCITS ETF	0,02 %	0,03 %
Bloomberg Commodity CMCI SF UCITS ETF	0,02 %	0,03 %
CMCI Commodity Carry SF UCITS ETF	0,01 %	0,01 %
MSCI China A SF UCITS ETF	0,11 %	0,14 %
Euro Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF	0,00 %	0,00 %
Euro Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF	0,01 %	0,01 %
US Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF	0,00 %	0,00 %
US Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF	0,00 %	0,00 %
MSCI USA SF Index Fund	0,01 %	0,00 %
CMCI Commodity Carry Ex-Agriculture SF UCITS ETF	0,01 %	0,01 %

(c) *Schätzung des beizulegenden Zeitwerts*

Die Richtlinien der Gesellschaft zur Ermittlung des beizulegenden Zeitwerts von finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten sind in Erläuterung 1(c) (iii) und (iv) dargelegt. Die Gesellschaft wendet bei der Klassifizierung der Bewertung zum beizulegenden Zeitwert eine Bewertungshierarchie an, die die Bedeutung der für die Bewertung verwendeten Daten widerspiegelt. Die Ebene in der Bewertungshierarchie, innerhalb derer die Zeitwertbewertung in ihrer Gesamtheit eingeordnet wird, wird auf Grundlage der Daten der untersten Ebene ermittelt, die für die Zeitwertbewertung in ihrer Gesamtheit bedeutend sind. Zu diesem Zweck wird die Maßgeblichkeit der Parameter für die Zeitwertbewertung in ihrer Gesamtheit beurteilt. Die Beurteilung der Maßgeblichkeit eines bestimmten Parameters für die Zeitwertbewertung in ihrer Gesamtheit erfordert Urteilsvermögen und die Abwägung von Faktoren, die für den Vermögenswert oder die Verbindlichkeit spezifisch sind.

Die Entscheidung, was als „beobachtbar“ gilt, erfordert ein beträchtliches Urteilsvermögen seitens des Verwaltungsrats in Konsultation mit dem Anlageverwalter. Nach Rücksprache mit dem Anlageverwalter erachtet der Verwaltungsrat als beobachtbare Daten solche Marktdaten, die jederzeit verfügbar sind, regelmäßig veröffentlicht oder aktualisiert werden, verlässlich und überprüfbar und nicht geschützt sind und von unabhängigen Quellen bereitgestellt werden, die aktiv mit dem betreffenden Markt beschäftigt sind.

Finanzinvestitionen, deren Werte auf den notierten Marktpreisen in aktiven Märkten basieren und deshalb in die Ebene 1 eingeordnet wurden, beinhalten aktive börsennotierte Aktien. Die Gesellschaft nimmt keine Anpassungen des notierten Preises für diese Instrumente vor.

Finanzinstrumente, die an nicht als aktiv eingestuften Märkten gehandelt werden, die aber auf der Grundlage von notierten Marktpreisen, Händlernoteierungen oder alternativen Preisinformationsquellen, gestützt durch beobachtbare Daten, bewertet werden, werden der Ebene 2 zugeordnet. Hierzu zählen Funded Swaps und Unfunded Swaps.

Anlagen der Ebene 3 haben wesentliche nicht beobachtbare Daten, da diese selten gehandelt werden. Die Gesellschaft hielt zum 31. Dezember 2022 bzw. 30. Juni 2022 keine Anlagen, die in Ebene 3 eingestuft waren.

Im Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2022 bzw. im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 erfolgten keine Transfers zwischen Ebene 1 und Ebene 2.

**ERLÄUTERUNGEN ZUM ZUSAMMENGEFASSTEN HALBJAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)
FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2022**

5. FINANZRISIKOMANAGEMENT (Fortsetzung)

Allgemeiner Risikomanagementprozess (Fortsetzung)

(c) Schätzung des beizulegenden Zeitwerts (Fortsetzung)

In der folgenden Tabelle wird die Zeitwerthierarchie der zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten der Teilfonds per 31. Dezember 2022 analysiert.

CMCI Composite SF UCITS ETF	Ebene 1 USD	Ebene 2 USD	Ebene 3 USD	Gesamtzeitwert USD
Finanzielle Vermögenswerte				
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
- Aktien	1.620.712.769	-	-	1.620.712.769
- Funded Swaps	-	6.687.952	-	6.687.952
- Unfunded Swaps	-	44.587.275	-	44.587.275
Summe der finanziellen Vermögenswerte	1.620.712.769	51.275.227	-	1.671.987.996

Der CMCI Composite SF UCITS ETF hielt zum 31. Dezember 2022 keine zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten.

Bloomberg Commodity Index SF UCITS ETF	Ebene 1 USD	Ebene 2 USD	Ebene 3 USD	Gesamtzeitwert USD
Finanzielle Vermögenswerte				
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
- Aktien	134.841.842	-	-	134.841.842
- Funded Swaps	-	8.518.837	-	8.518.837
- Unfunded Swaps	-	11.527.244	-	11.527.244
Summe der finanziellen Vermögenswerte	134.841.842	20.046.081	-	154.887.923

Der Bloomberg Commodity Index SF UCITS ETF hielt zum 31. Dezember 2022 keine zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten.

S&P 500 SF UCITS ETF	Ebene 1 USD	Ebene 2 USD	Ebene 3 USD	Gesamtzeitwert USD
Finanzielle Vermögenswerte				
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
- Aktien	134.276.712	-	-	134.276.712
- Funded Swaps	-	607.971	-	607.971
- Unfunded Swaps	-	7.455.455	-	7.455.455
Summe der finanziellen Vermögenswerte	134.276.712	8.063.426	-	142.340.138

Der S&P 500 SF UCITS ETF hielt zum 31. Dezember 2022 keine zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten.

MSCI USA SF UCITS ETF	Ebene 1 USD	Ebene 2 USD	Ebene 3 USD	Gesamtzeitwert USD
Finanzielle Vermögenswerte				
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
- Aktien	461.505.597	-	-	461.505.597
- Funded Swaps	-	1.926.955	-	1.926.955
- Unfunded Swaps	-	18.305.786	-	18.305.786
Summe der finanziellen Vermögenswerte	461.505.597	20.232.741	-	481.738.338

**ERLÄUTERUNGEN ZUM ZUSAMMENGEFASSTEN HALBJAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)
FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2022**

5. FINANZRISIKOMANAGEMENT (Fortsetzung)

Allgemeiner Risikomanagementprozess (Fortsetzung)

(c) Schätzung des beizulegenden Zeitwerts (Fortsetzung)

Der MSCI USA SF UCITS ETF hielt zum 31. Dezember 2022 keine zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten.

MSCI Emerging Markets SF UCITS ETF	Ebene 1 USD	Ebene 2 USD	Ebene 3 USD	Gesamtzeitwert USD
Finanzielle Vermögenswerte				
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
- Aktien	82.688.570	-	-	82.688.570
- Funded Swaps	-	3.697.914	-	3.697.914
- Unfunded Swaps	-	6.060.812	-	6.060.812
Summe der finanziellen Vermögenswerte	82.688.570	9.758.726	-	92.447.296

Der MSCI Emerging Markets SF UCITS ETF hielt zum 31. Dezember 2022 keine zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten.

MSCI AC Asia Ex Japan SF UCITS ETF	Ebene 1 USD	Ebene 2 USD	Ebene 3 USD	Gesamtzeitwert USD
Finanzielle Vermögenswerte				
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
- Aktien	182.054.732	-	-	182.054.732
- Funded Swaps	-	743.827	-	743.827
- Unfunded Swaps	-	3.702.068	-	3.702.068
Summe der finanziellen Vermögenswerte	182.054.732	4.445.895	-	186.500.627

Der MSCI AC Asia Ex Japan SF UCITS ETF hielt zum 31. Dezember 2022 keine zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten.

MSCI ACWI SF UCITS ETF	Ebene 1 USD	Ebene 2 USD	Ebene 3 USD	Gesamtzeitwert USD
Finanzielle Vermögenswerte				
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
- Aktien	5.219.033.965	-	-	5.219.033.965
- Funded Swaps	-	21.644.805	-	21.644.805
- Unfunded Swaps	-	174.989.621	-	174.989.621
Summe der finanziellen Vermögenswerte	5.219.033.965	196.634.426	-	5.415.668.391

Der MSCI ACWI SF UCITS ETF hielt zum 31. Dezember 2022 keine zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten.

CMCI Ex-Agriculture SF UCITS ETF	Ebene 1 USD	Ebene 2 USD	Ebene 3 USD	Gesamtzeitwert USD
Finanzielle Vermögenswerte				
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
- Aktien	110.786.673	-	-	110.786.673
- Funded Swaps	-	457.072	-	457.072
- Unfunded Swaps	-	3.023.642	-	3.023.642
Summe der finanziellen Vermögenswerte	110.786.673	3.480.714	-	114.267.387

**ERLÄUTERUNGEN ZUM ZUSAMMENGEFASSTEN HALBJAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)
FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2022**

5. FINANZRISIKOMANAGEMENT (Fortsetzung)

Allgemeiner Risikomanagementprozess (Fortsetzung)

(c) Schätzung des beizulegenden Zeitwerts (Fortsetzung)

Der CMCI Ex-Agriculture SF UCITS ETF hielt zum 31. Dezember 2022 keine zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten.

Bloomberg Commodity CMCI SF UCITS ETF	Ebene 1 USD	Ebene 2 USD	Ebene 3 USD	Gesamtzeitwert USD
Finanzielle Vermögenswerte				
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
- Aktien	625.278.340	-	-	625.278.340
- Funded Swaps	-	2.577.023	-	2.577.023
- Unfunded Swaps	-	16.400.756	-	16.400.756
Summe der finanziellen Vermögenswerte	625.278.340	18.977.779	-	644.256.119

Der Bloomberg Commodity CMCI SF UCITS ETF hielt zum 31. Dezember 2022 keine zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten.

CMCI Commodity Carry SF UCITS ETF	Ebene 1 USD	Ebene 2 USD	Ebene 3 USD	Gesamtzeitwert USD
Finanzielle Vermögenswerte				
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
- Aktien	165.594.414	-	-	165.594.414
- Funded Swaps	-	682.833	-	682.833
- Unfunded Swaps	-	4.430.467	-	4.430.467
Summe der finanziellen Vermögenswerte	165.594.414	5.113.300	-	170.707.714

Der CMCI Commodity Carry SF UCITS ETF hielt zum 31. Dezember 2022 keine zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten.

MSCI China A SF UCITS ETF	Ebene 1 USD	Ebene 2 USD	Ebene 3 USD	Gesamtzeitwert USD
Finanzielle Vermögenswerte				
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
- Aktien	154.587.915	-	-	154.587.915
- Funded Swaps	-	642.977	-	642.977
- Unfunded Swaps	-	5.513.259	-	5.513.259
Summe der finanziellen Vermögenswerte	154.587.915	6.156.236	-	160.744.151

Der MSCI China A SF UCITS ETF hielt zum 31. Dezember 2022 keine zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten.

Euro Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF	Ebene 1 EUR	Ebene 2 EUR	Ebene 3 EUR	Gesamtzeitwert EUR
Finanzielle Vermögenswerte				
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
- Aktien	4.668.204	-	-	4.668.204
- Funded Swaps	-	19.227	-	19.227
- Unfunded Swaps	-	118.518	-	118.518
Summe der finanziellen Vermögenswerte	4.668.204	137.745	-	4.805.949

**ERLÄUTERUNGEN ZUM ZUSAMMENGEFASSTEN HALBJAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)
FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2022**

5. FINANZRISIKOMANAGEMENT (Fortsetzung)

Allgemeiner Risikomanagementprozess (Fortsetzung)

(c) Schätzung des beizulegenden Zeitwerts (Fortsetzung)

Der Euro Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF hielt zum 31. Dezember 2022 keine zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten.

Euro Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF	Ebene 1 EUR	Ebene 2 EUR	Ebene 3 EUR	Gesamtzeitwert EUR
Finanzielle Vermögenswerte				
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
- Aktien	19.426.329	-	-	19.426.329
- Funded Swaps	-	80.268	-	80.268
- Unfunded Swaps	-	560.718	-	560.718
Summe der finanziellen Vermögenswerte	19.426.329	640.986	-	20.067.315

Der Euro Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF hielt zum 31. Dezember 2022 keine zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten.

US Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF	Ebene 1 USD	Ebene 2 USD	Ebene 3 USD	Gesamtzeitwert USD
Finanzielle Vermögenswerte				
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
- Aktien	3.241.769	-	-	3.241.769
- Funded Swaps	-	13.523	-	13.523
- Unfunded Swaps	-	124.239	-	124.239
Summe der finanziellen Vermögenswerte	3.241.769	137.762	-	3.379.531

Der US Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF hielt zum 31. Dezember 2022 keine zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten.

US Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF	Ebene 1 USD	Ebene 2 USD	Ebene 3 USD	Gesamtzeitwert USD
Finanzielle Vermögenswerte				
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
- Aktien	19.092.179	-	-	19.092.179
- Funded Swaps	-	79.178	-	79.178
- Unfunded Swaps	-	623.095	-	623.095
Summe der finanziellen Vermögenswerte	19.092.179	702.273	-	19.794.452

Der US Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF hielt zum 31. Dezember 2022 keine zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten.

**ERLÄUTERUNGEN ZUM ZUSAMMENGEFASSTEN HALBJAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)
FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2022**

5. FINANZRISIKOMANAGEMENT (Fortsetzung)

Allgemeiner Risikomanagementprozess (Fortsetzung)

(c) *Schätzung des beizulegenden Zeitwerts (Fortsetzung)*

MSCI USA SF Index Fund	Ebene 1 USD	Ebene 2 USD	Ebene 3 USD	Gesamtzeitwert USD
Finanzielle Vermögenswerte				
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
- Aktien	889.085.177	-	-	889.085.177
- Funded Swaps	-	3.725.330	-	3.725.330
- Unfunded Swaps	-	36.657.841	-	36.657.841
Summe der finanziellen Vermögenswerte	889.085.177	40.383.171	-	929.468.348

Der MSCI USA SF Index Fund hielt zum 31. Dezember 2022 keine zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten.

CMCI Commodity Carry Ex-Agriculture SF UCITS ETF	Ebene 1 USD	Ebene 2 USD	Ebene 3 USD	Gesamtzeitwert USD
Finanzielle Vermögenswerte				
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
- Aktien	58.938.624	-	-	58.938.624
- Funded Swaps	-	241.510	-	241.510
- Unfunded Swaps	-	1.197.232	-	1.197.232
Summe der finanziellen Vermögenswerte	58.938.624	1.438.742	-	60.377.366

Der CMCI Commodity Carry Ex-Agriculture SF UCITS ETF hielt zum 31. Dezember 2022 keine zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten.

**ERLÄUTERUNGEN ZUM ZUSAMMENGEFASSTEN HALBJAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)
FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2022**

5. FINANZRISIKOMANAGEMENT (Fortsetzung)

Allgemeiner Risikomanagementprozess (Fortsetzung)

(c) Schätzung des beizulegenden Zeitwerts (Fortsetzung)

In der folgenden Tabelle wird die Zeitwerthierarchie der zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten der Teilfonds per 30. Juni 2022 analysiert.

CMCI Composite SF UCITS ETF	Ebene 1 USD	Ebene 2 USD	Ebene 3 USD	Gesamtzeitwert USD
Finanzielle Vermögenswerte				
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
- Aktien	2.531.925.804	64.295.906	-	2.596.221.710
- Funded Swaps	-	10.984.232	-	10.984.232
- Unfunded Swaps	-	136.547.107	-	136.547.107
Summe der finanziellen Vermögenswerte	2.531.925.804	211.827.245	-	2.743.753.049

Der CMCI Composite SF UCITS ETF hielt zum 30. Juni 2022 keine zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten.

Bloomberg Commodity Index SF UCITS ETF	Ebene 1 USD	Ebene 2 USD	Ebene 3 USD	Gesamtzeitwert USD
Finanzielle Vermögenswerte				
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
- Aktien	422.934.303	-	-	422.934.303
- Funded Swaps	-	9.039.549	-	9.039.549
- Unfunded Swaps	-	20.003.634	-	20.003.634
Summe der finanziellen Vermögenswerte	422.934.303	29.043.183	-	451.977.486

Der Bloomberg Commodity Index SF UCITS ETF hielt zum 30. Juni 2022 keine zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten.

S&P 500 SF UCITS ETF	Ebene 1 USD	Ebene 2 USD	Ebene 3 USD	Gesamtzeitwert USD
Finanzielle Vermögenswerte				
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
- Aktien	135.532.130	3.441.709	-	138.973.839
- Funded Swaps	-	574.629	-	574.629
- Unfunded Swaps	-	4.144.916	-	4.144.916
Summe der finanziellen Vermögenswerte	135.532.130	8.161.254	-	143.693.384

Der S&P 500 SF UCITS ETF hielt zum 30. Juni 2022 keine zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten.

MSCI USA SF UCITS ETF	Ebene 1 USD	Ebene 2 USD	Ebene 3 USD	Gesamtzeitwert USD
Finanzielle Vermögenswerte				
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
- Aktien	449.730.286	11.420.483	-	461.150.769
- Funded Swaps	-	2.023.605	-	2.023.605
- Unfunded Swaps	-	42.846.511	-	42.846.511
Summe der finanziellen Vermögenswerte	449.730.286	56.290.599	-	506.020.885

**ERLÄUTERUNGEN ZUM ZUSAMMENGEFASSTEN HALBJAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)
FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2022**

5. FINANZRISIKOMANAGEMENT (Fortsetzung)

Allgemeiner Risikomanagementprozess (Fortsetzung)

(c) Schätzung des beizulegenden Zeitwerts (Fortsetzung)

Der MSCI USA SF UCITS ETF hielt zum 30. Juni 2022 keine zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten.

MSCI Emerging Markets SF UCITS ETF	Ebene 1 USD	Ebene 2 USD	Ebene 3 USD	Gesamtzeitwert USD
Finanzielle Vermögenswerte				
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
- Aktien	79.895.770	-	-	79.895.770
- Funded Swaps	-	860.746	-	860.746
- Unfunded Swaps	-	5.318.085	-	5.318.085
Summe der finanziellen Vermögenswerte	79.895.770	6.178.831	-	86.074.601

Der MSCI Emerging Markets SF UCITS ETF hielt zum 30. Juni 2022 keine zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten.

MSCI AC Asia Ex Japan SF UCITS ETF	Ebene 1 USD	Ebene 2 USD	Ebene 3 USD	Gesamtzeitwert USD
Finanzielle Vermögenswerte				
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
- Aktien	166.680.482	4.232.696	-	170.913.178
- Funded Swaps	-	734.052	-	734.052
- Unfunded Swaps	-	11.910.239	-	11.910.239
Summe der finanziellen Vermögenswerte	166.680.482	16.876.987	-	183.557.469

Der MSCI AC Asia Ex Japan SF UCITS ETF hielt zum 30. Juni 2022 keine zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten.

MSCI ACWI SF UCITS ETF	Ebene 1 USD	Ebene 2 USD	Ebene 3 USD	Gesamtzeitwert USD
Finanzielle Vermögenswerte				
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
- Aktien	2.817.353.658	71.544.082	-	2.888.897.740
- Funded Swaps	-	12.021.225	-	12.021.225
- Unfunded Swaps	-	105.135.550	-	105.135.550
Summe der finanziellen Vermögenswerte	2.817.353.658	188.700.857	-	3.006.054.515

Der MSCI ACWI SF UCITS ETF hielt zum 30. Juni 2022 keine zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten.

CMCI Ex-Agriculture SF UCITS ETF	Ebene 1 USD	Ebene 2 USD	Ebene 3 USD	Gesamtzeitwert USD
Finanzielle Vermögenswerte				
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
- Aktien	126.531.422	3.213.148	-	129.744.570
- Funded Swaps	-	545.768	-	545.768
- Unfunded Swaps	-	6.185.330	-	6.185.330
Summe der finanziellen Vermögenswerte	126.531.422	9.944.246	-	136.475.668

**ERLÄUTERUNGEN ZUM ZUSAMMENGEFASSTEN HALBJAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)
FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2022**

5. FINANZRISIKOMANAGEMENT (Fortsetzung)

Allgemeiner Risikomanagementprozess (Fortsetzung)

(c) Schätzung des beizulegenden Zeitwerts (Fortsetzung)

Der CMCI Ex-Agriculture SF UCITS ETF hielt zum 30. Juni 2022 keine zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten.

Bloomberg Commodity CMCI SF UCITS ETF	Ebene 1 USD	Ebene 2 USD	Ebene 3 USD	Gesamtzeitwert USD
Finanzielle Vermögenswerte				
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
- Aktien	373.508.395	9.484.899	-	382.993.294
- Funded Swaps	-	2.807.407	-	2.807.407
- Unfunded Swaps	-	15.356.987	-	15.356.987
Summe der finanziellen Vermögenswerte	373.508.395	27.649.293	-	401.157.688

Der Bloomberg Commodity CMCI SF UCITS ETF hielt zum 30. Juni 2022 keine zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten.

CMCI Commodity Carry SF UCITS ETF	Ebene 1 USD	Ebene 2 USD	Ebene 3 USD	Gesamtzeitwert USD
Finanzielle Vermögenswerte				
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
- Aktien	98.836.587	2.509.863	-	101.346.450
- Funded Swaps	-	439.741	-	439.741
- Unfunded Swaps	-	8.175.226	-	8.175.226
Summe der finanziellen Vermögenswerte	98.836.587	11.124.830	-	109.961.417

Der CMCI Commodity Carry SF UCITS ETF hielt zum 30. Juni 2022 keine zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten.

MSCI China A SF UCITS ETF	Ebene 1 USD	Ebene 2 USD	Ebene 3 USD	Gesamtzeitwert USD
Finanzielle Vermögenswerte				
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
- Aktien	127.301.897	3.233.443	-	130.535.340
- Funded Swaps	-	337.466	-	337.466
- Unfunded Swaps	-	10.842.815	-	10.842.815
Summe der finanziellen Vermögenswerte	127.301.897	14.413.724	-	141.715.621

Der MSCI China A SF UCITS ETF hielt zum 30. Juni 2022 keine zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten.

Euro Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF	Ebene 1 EUR	Ebene 2 EUR	Ebene 3 EUR	Gesamtzeitwert EUR
Finanzielle Vermögenswerte				
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
- Aktien	2.444.293	62.027	-	2.506.320
- Funded Swaps	-	10.479	-	10.479
- Unfunded Swaps	-	104.597	-	104.597
Summe der finanziellen Vermögenswerte	2.444.293	177.103	-	2.621.396

**ERLÄUTERUNGEN ZUM ZUSAMMENGEFASSTEN HALBJAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)
FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2022**

5. FINANZRISIKOMANAGEMENT (Fortsetzung)

Allgemeiner Risikomanagementprozess (Fortsetzung)

(c) Schätzung des beizulegenden Zeitwerts (Fortsetzung)

Der Euro Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF hielt zum 30. Juni 2022 keine zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten.

Euro Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF	Ebene 1 EUR	Ebene 2 EUR	Ebene 3 EUR	Gesamtzeitwert EUR
Finanzielle Vermögenswerte				
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
- Aktien	15.262.509	387.577	-	15.650.086
- Funded Swaps	-	65.967	-	65.967
- Unfunded Swaps	-	779.628	-	779.628
Summe der finanziellen Vermögenswerte	15.262.509	1.233.172	-	16.495.681

Der Euro Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF hielt zum 30. Juni 2022 keine zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten.

US Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF	Ebene 1 USD	Ebene 2 USD	Ebene 3 USD	Gesamtzeitwert USD
Finanzielle Vermögenswerte				
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
- Aktien	3.378.192	85.726	-	3.463.918
- Funded Swaps	-	14.436	-	14.436
- Unfunded Swaps	-	133.794	-	133.794
Summe der finanziellen Vermögenswerte	3.378.192	233.956	-	3.612.148

Der US Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF hielt zum 30. Juni 2022 keine zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten.

US Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF	Ebene 1 USD	Ebene 2 USD	Ebene 3 USD	Gesamtzeitwert USD
Finanzielle Vermögenswerte				
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
- Aktien	13.656.297	346.789	-	14.003.086
- Funded Swaps	-	59.745	-	59.745
- Unfunded Swaps	-	877.016	-	877.016
Summe der finanziellen Vermögenswerte	13.656.297	1.283.550	-	14.939.847

Der US Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF hielt zum 30. Juni 2022 keine zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten.

MSCI USA SF Index Fund	Ebene 1 USD	Ebene 2 USD	Ebene 3 USD	Gesamtzeitwert USD
Finanzielle Vermögenswerte				
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
- Aktien	784.350.728	19.917.859	-	804.268.587
- Funded Swaps	-	3.380.294	-	3.380.294
- Unfunded Swaps	-	37.646.798	-	37.646.798
Summe der finanziellen Vermögenswerte	784.350.728	60.944.951	-	845.295.679

**ERLÄUTERUNGEN ZUM ZUSAMMENGEFASSTEN HALBJAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)
FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2022**

5. FINANZRISIKOMANAGEMENT (Fortsetzung)

Allgemeiner Risikomanagementprozess (Fortsetzung)

(c) *Schätzung des beizulegenden Zeitwerts (Fortsetzung)*

Der MSCI USA SF Index Fund hielt zum 30. Juni 2022 keine zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten.

CMCI Commodity Carry Ex-Agriculture SF UCITS ETF Finanzielle Vermögenswerte	Ebene 1 USD	Ebene 2 USD	Ebene 3 USD	Gesamtzeitwert USD
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
- Aktien	43.969.761	1.116.571	-	45.086.332
- Funded Swaps	-	199.213	-	199.213
- Unfunded Swaps	-	4.529.733	-	4.529.733
Summe der finanziellen Vermögenswerte	43.969.761	5.845.517	-	49.815.278

Der CMCI Commodity Carry Ex-Agriculture SF UCITS ETF hielt zum 30. Juni 2022 keine zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten.

IFRS 13 Bemessung des beizulegenden Zeitwerts

Für jede Klasse von Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, die in der Bilanz nicht zum beizulegenden Zeitwert bewertet wird, für die aber ein beizulegender Zeitwert angegeben wird, schreibt IFRS 13 vor, dass die Gesellschaft die Ebene der Zeitwerthierarchie angibt, in der die Bewertung zum beizulegenden Zeitwert einzustufen wäre, sowie eine Beschreibung der Bewertungsmethode und der im Rahmen dieser Methode angewandten Parameter.

Liquide Mittel und Banküberziehungskredite werden bei Banken gehalten und wie sonstige kurzfristige Anlagen an aktiven Märkten der Ebene 1 zugeordnet.

Forderungen aus verkauften Anlagen, Dividendenforderungen und sonstige Forderungen beinhalten die vertraglich festgelegten Beträge für die Abwicklung von Geschäften und anderen Verpflichtungen gegenüber dem Teilfonds. Verbindlichkeiten aus gekauften Anlagen und sonstige Verbindlichkeiten sind die vom Teilfonds zu zahlenden, vertraglich festgelegten Beträge und Verpflichtungen für die Abwicklung von Geschäften und Aufwendungen. Alle Forderungs- und Verbindlichkeitssalden sind der Ebene 2 zugeordnet.

Der Verkaufswert der rückkaufbaren Aktien wird auf Basis der Nettodifferenz zwischen dem Gesamtvermögen und allen anderen Verbindlichkeiten des jeweiligen Teilfonds innerhalb der Gesellschaft gemäß dem Emissionsprospekt der Teilfonds errechnet. Die Aktien der Teilfonds werden auf einem aktiven Markt gehandelt. Diese Aktien haben den Charakter eines Forderungsinstruments, da sie auf Wunsch der Inhaber rückkaufbar sind. Diese Aktien können von den Teilfonds an jedem Handelstag gegen Barmittel/Vermögenswerte zurückgekauft werden, die einem entsprechenden Anteil am der Aktienklasse zurechenbaren Nettoinventarwert des Teilfonds entsprechen.

Ein beträchtlicher Anteil der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte aller Teilfonds basiert auf Kursnotierungen eines aktiven Marktes und wird daher Ebene 1 zugeordnet. Infolgedessen ist die Ebene 1 die angemessenste Kategorie für das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien dieser Teilfonds zuzurechnende Nettovermögen (30. Juni 2022: Ebene 1).

Im Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2022 gab es keine Transfers zwischen den Ebenen (30. Juni 2022: keine).

(d) *Effizientes Portfoliomanagement (EPM)*

Die Gesellschaft kann im Namen eines Teilfonds in Zusammenhang mit Wertpapieren und/oder anderen Finanzinstrumenten, in welche dieser investiert, Techniken und Instrumente für EPM-Zwecke einsetzen. Der Einsatz solcher Techniken und Instrumente erfolgt im Allgemeinen aus einem oder mehreren der folgenden Gründe: zur Reduzierung der Risiken oder der Kosten oder zur Generierung von zusätzlichem Kapital oder Ertrag für den betreffenden Teilfonds bei einem angemessenen Risikoniveau, wobei das Risikoprofil des Teilfonds berücksichtigt werden muss.

**ERLÄUTERUNGEN ZUM ZUSAMMENGEFASSTEN HALBJAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)
FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2022**

5. FINANZRISIKOMANAGEMENT (Fortsetzung)

Allgemeiner Risikomanagementprozess (Fortsetzung)

(d) Effizientes Portfoliomanagement („EPM“) (Fortsetzung)

Die Teilfonds setzen keine derivativen Finanzinstrumenten („DFI“) für die Zwecke eines effizienten Portfoliomanagements ein, mit Ausnahme derjenigen Teilfonds, die Aktienklassen ausgegeben haben, die auf eine andere Währung lauten als die jeweilige Basiswährung. In diesen Fällen gehen die Teilfonds einen oder mehrere Swaps in der Währung der jeweiligen Aktienklasse ein, die nicht auf die Basiswährung lautet, wodurch sich das Währungsrisiko zwischen der Basiswährung und der Währung der Aktienklasse reduziert. Diese nicht auf die Basiswährung lautenden Swaps sind in der Vermögensaufstellung aufgeführt. Die Kosten dieser EPM-Techniken für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2022 und 31. Dezember 2021 sind in der folgenden Tabelle dargestellt und in den Nettogewinnen/(-verlusten) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten in der Gesamtergebnisrechnung enthalten. Im Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2022 und 31. Dezember 2021 wurden aus diesen EPM-Techniken keine Erlöse erzielt.

Teilfonds	Wäh- rung	Kosten für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2022	Kosten für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2021
CMCI Composite SF UCITS ETF	USD	(564.171)	(507.228)
Bloomberg Commodity Index SF UCITS ETF	USD	(112.143)	(65.798)
MSCI ACWI SF UCITS ETF	USD	(1.191.525)	(2.207.656)
CMCI Ex-Agriculture SF UCITS ETF	USD	(44.591)	(49.329)
Bloomberg Commodity CMCI SF UCITS ETF	USD	(65.125)	(35.772)
CMCI Commodity Carry SF UCITS ETF	USD	(46.170)	(16.295)
CMCI Commodity Carry Ex-Agriculture SF UCITS ETF	USD	(2.437)	(2.744)
MSCI USA SF Index Fund	USD	(111.610)	(73.735)

Gesamtrisiko

Die Gesellschaft verwendet den Commitment-Ansatz zur Messung des Gesamtrisikos.

Aufgrund der Richtlinie, der Anwendung eines genau bestimmten Anlageansatzes und der zusätzlichen Beschränkungen, wie in den Verkaufsunterlagen (Gesellschaftsprospekt und Nachträge zu den Teilfonds) beschrieben – zusammen die „Anlageregeln“ – dürfen sämtliche Teilfonds nur ein begrenztes Risiko eingehen. Markt-, Kredit-, und Liquiditätsrisiken innerhalb der Teilfonds werden durch Einhaltung des Exposure der Gesellschaft gemäß den „Anlageregeln“ erzielt. Die Zahlen zum Gesamtrisiko für die Teilfonds zum 31. Dezember 2022 und 30. Juni 2022 spiegeln das Risiko wider, das sich aus der Wiederanlage von Barsicherheiten in Geldmarktfonds ergibt. Das durch DFI erzeugte Gesamtrisiko zum 31. Dezember 2022 und 30. Juni 2022 beträgt für alle Teilfonds null.

Teilfonds	Wäh- rung	Gesamtrisiko zum 31. Dezember 2022	Gesamtrisiko zum 30. Juni 2022
CMCI Composite SF UCITS ETF	USD	3,79 %	6,06 %
Bloomberg Commodity Index SF UCITS ETF	USD	8,82 %	6,30 %
S&P 500 SF UCITS ETF	USD	2,63 %	2,48 %
MSCI USA SF UCITS ETF	USD	2,85 %	5,80 %
MSCI Emerging Markets SF UCITS ETF	USD	8,77 %	5,34 %
MSCI AC Asia Ex Japan SF UCITS ETF	USD	3,26 %	5,87 %
MSCI ACWI SF UCITS ETF	USD	2,34 %	3,63 %
CMCI Ex-Agriculture SF UCITS ETF	USD	3,79 %	4,30 %
Bloomberg Commodity CMCI SF UCITS ETF	USD	3,80 %	4,10 %
CMCI Commodity Carry SF UCITS ETF	USD	5,26 %	3,38 %
MSCI China A SF UCITS ETF	USD	4,14 %	3,18 %
Euro Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF	EUR	6,89 %	3,51 %
Euro Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF	EUR	4,38 %	5,51 %
US Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF	USD	7,38 %	9,21 %
US Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF	USD	5,45 %	3,38 %
MSCI USA SF Index Fund	USD	3,75 %	4,26 %
CMCI Commodity Carry Ex-Agriculture SF UCITS ETF	USD	5,23 %	5,15 %

**ERLÄUTERUNGEN ZUM ZUSAMMENGEFASSTEN HALBJAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)
FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2022**

5. FINANZRISIKOMANAGEMENT (Fortsetzung)

Allgemeiner Risikomanagementprozess (Fortsetzung)

(e) Saisonale/zyklische Änderungen

Die Gesellschaft unterliegt keinen saisonalen oder zyklischen Änderungen.

6. BESTEUERUNG

Gemäß derzeit geltendem Recht und gegenwärtiger Praxis ist die Gesellschaft eine Investmentgesellschaft im Sinne von Section 739B des Taxes Consolidation Act (Steuerkonsolidierungsgesetz) von 1997, in der jeweils gültigen Fassung. Dementsprechend unterliegt sie keiner irischen Steuer auf ihre Erträge oder Veräußerungsgewinne.

Eine irische Steuer kann jedoch beim Eintreten eines „steuerpflichtigen Ereignisses“ anfallen. Ein steuerpflichtiges Ereignis ist unter anderem jede Ausschüttungszahlung an Aktionäre, jede Einlösung, Rücknahme, Annullierung oder Übertragung von Aktien und das Halten von Aktien am Ende jedes mit dem Erwerb solcher Aktien beginnenden Achtjahreszeitraums.

Bei steuerpflichtigen Ereignissen fällt für die Gesellschaft keine irische Steuer an in Bezug auf:

- a) Aktionäre, die zum Zeitpunkt des steuerpflichtigen Ereignisses im steuerlichen Sinn weder in Irland ansässig sind noch dort ihren gewöhnlichen Aufenthalt haben, sofern die Gesellschaft im Besitz der entsprechenden gültigen Erklärungen gemäß den Bestimmungen des Taxes Consolidation Act von 1997, in der aktuellen Fassung, ist oder die Gesellschaft von der irischen Steuerbehörde bevollmächtigt wurde, Bruttozahlungen vorzunehmen, wenn keine entsprechenden Erklärungen vorliegen; und
- b) bestimmte steuerbefreite, in Irland ansässige irische Aktionäre, die der Gesellschaft die entsprechenden gesetzlich vorgeschriebenen und unterzeichneten Erklärungen vorgelegt haben.
- c) Transaktionen (die andernfalls ein steuerpflichtiges Ereignis sein könnten) im Zusammenhang mit Aktien, die in einem anerkannten Clearing-System gemäß den Vorschriften der irischen Steuerbehörde (Revenue Commissioners) (wie zum Beispiel CREST) gehalten werden, stellen kein steuerpflichtiges Ereignis dar. Es ist derzeit die Absicht des Verwaltungsrats, dass alle Aktien der Gesellschaft in CREST oder einem anderen anerkannten Clearing-System gehalten werden.

Dividenden, Zinsen und Kapitalerträge, die ggf. auf die von der Gesellschaft getätigten Anlagen gezahlt werden, unterliegen eventuell einer Steuer in dem Land, aus dem die Anlageerträge/Kapitalerträge vereinnahmt werden, und derartige Steuern können von der Gesellschaft oder ihren Aktionären eventuell nicht wiedererlangt werden.

7. WECHSELKURSE

Die Abschlüsse für den CMCI Composite SF UCITS ETF, den Bloomberg Commodity Index SF UCITS ETF, den S&P 500 SF UCITS ETF, den MSCI USA SF UCITS ETF, den MSCI Emerging Markets SF UCITS ETF, den MSCI AC Asia Ex Japan SF UCITS ETF, den MSCI ACWI SF UCITS ETF, den CMCI Ex-Agriculture SF UCITS ETF, den Bloomberg Commodity CMCI SF UCITS ETF, den CMCI Commodity Carry SF UCITS ETF, den MSCI China A SF UCITS ETF, den US Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF, den US Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF, den MSCI USA SF Index Fund und den CMCI Commodity Carry Ex-Agriculture SF UCITS ETF werden in US-Dollar (USD) erstellt. Die folgenden Wechselkurse wurden am Ende des Berichtszeitraums zur Umrechnung der auf andere Währungen als den USD lautenden Vermögenswerte und Verbindlichkeiten verwendet:

Zum	31. Dezember 2022	30. Juni 2022
CAD	1,3550	1,2900
CHF	0,9252	0,9574
CNY	6,9517	6,6943
DKK	6,9679	7,1134
EUR	0,9370	0,9565
GBP	0,8313	0,8234
HKD	7,8050	7,8470
JPY	131,9450	135,8550
NOK	9,8510	9,8798
SEK	10,4195	10,2474
SGD	1,3412	1,3917

**ERLÄUTERUNGEN ZUM ZUSAMMENGEFASSTEN HALBJAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)
FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2022**

7. WECHSELKURSE (Fortsetzung)

Die Abschlüsse für den Euro Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF und den Euro Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF werden in Euro (EUR) erstellt. Die folgenden Wechselkurse wurden am Ende des Berichtszeitraums/Geschäftsjahres zur Umrechnung der auf andere Währungen als EUR lautenden Vermögenswerte und Verbindlichkeiten verwendet:

Zum	31. Dezember 2022	30. Juni 2022
CHF	0,9874	1,0009
HKD	8,3298	8,2036
JPY	140,8182	142,0296
SEK	11,1202	10,7131
USD	1,0672	1,0454

Bei der Zusammenfassung der Abschlüsse der Teilfonds wurden für die Teilfonds, deren Basiswährung nicht der USD ist, bei der Erstellung der zusammengefassten Entwicklung des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens und der zusammengefassten Kapitalflussrechnung die folgenden durchschnittlichen Wechselkurse zum USD verwendet:

Durchschnittlicher Wechselkurs für den Berichtszeitraum zum	Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2022	Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2021
EUR	0,9860	0,8614

8. DIVIDENDEN

Der Verwaltungsrat beabsichtigt in Bezug auf die thesaurierenden (Acc) Aktienklassen nicht, für die Teilfonds Dividenden festzusetzen. Der Verwaltungsrat kann jedoch in seinem alleinigen Ermessen die Festsetzung von Dividenden für jede Aktienklasse beschließen, und die Aktionäre werden entsprechend benachrichtigt. Etwaige zahlbare Dividenden werden gemäß der im Verkaufsprospekt beschriebenen Ausschüttungspolitik gezahlt.

Für die folgenden Aktienklassen wurden im Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2022 Dividenden festgesetzt:

Teilfonds	Aktienklasse	Ex-Tag	Dividendensatz	Dividende
MSCI ACWI SF UCITS ETF	(hedged to CHF) A-UKdis	01. August 2022	1,4872 CHF je Aktie	268.860 CHF
MSCI ACWI SF UCITS ETF	(hedged to EUR) A-UKdis	01. August 2022	1,7472 EUR je Aktie	152.218 EUR
MSCI ACWI SF UCITS ETF	(hedged to GBP) A-UKdis	01. August 2022	1,5303 GBP je Aktie	364.496 GBP
MSCI ACWI SF UCITS ETF	(hedged to USD) A-UKdis	01. August 2022	1,7169 USD je Aktie	359.955 USD
MSCI ACWI SF UCITS ETF	(USD) A-UKdis	01. August 2022	1,2974 USD je Aktie	2.497.604 USD
MSCI USA SF Index Fund	(hedged to CHF) A-UKdis	01. August 2022	0,7491 CHF je Aktie	30.870 CHF
MSCI USA SF Index Fund	(hedged to EUR) A-UKdis	01. August 2022	0,9011 EUR je Aktie	26.983 EUR
MSCI USA SF Index Fund	(hedged to GBP) A-UKdis	01. August 2022	0,6392 GBP je Aktie	1.598 GBP
MSCI USA SF Index Fund	(USD) A-UKdis	01. August 2022	0,8391 USD je Aktie	420.387 USD

Für die folgenden Aktienklassen wurden zum Ende des Berichtszeitraums Ausschüttungen festgesetzt:

Teilfonds	Aktienklasse	Ex-Tag	Dividendensatz	Dividende
MSCI ACWI SF UCITS ETF	(hedged to CHF) A-UKdis	1. Februar 2023	1,4309 CHF je Aktie	265.837 CHF
MSCI ACWI SF UCITS ETF	(hedged to EUR) A-UKdis	1. Februar 2023	1,1819 EUR je Aktie	146.108 EUR
MSCI ACWI SF UCITS ETF	(hedged to GBP) A-UKdis	1. Februar 2023	2,1282 GBP je Aktie	1.454.399 GBP
MSCI ACWI SF UCITS ETF	(hedged to USD) A-UKdis	1. Februar 2023	1,8625 USD je Aktie	396.627 USD
MSCI ACWI SF UCITS ETF	(USD) A-UKdis	1. Februar 2023	1,3185 USD je Aktie	2.405.055 USD
MSCI USA SF Index Fund	(hedged to CHF) A-UKdis	1. Februar 2023	0,6235 CHF je Aktie	8.486 CHF
MSCI USA SF Index Fund	(hedged to EUR) A-UKdis	1. Februar 2023	0,7916 EUR je Aktie	54.082 EUR
MSCI USA SF Index Fund	(hedged to GBP) A-UKdis	1. Februar 2023	0,7164 GBP je Aktie	1.791 GBP
MSCI USA SF Index Fund	(USD) A-UKdis	1. Februar 2023	0,8083 USD je Aktie	403.314 USD

**ERLÄUTERUNGEN ZUM ZUSAMMENGEFASSTEN HALBJAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)
FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2022**

9. SOFT-COMMISSION-VEREINBARUNGEN UND DIRECT BROKERAGE

Während des Berichtszeitraums zum 31. Dezember 2022 oder im vorangegangenen Berichtszeitraum bestanden keine Vereinbarungen über geldwerte Vorteile („Soft Commissions“) oder Direct Brokerage.

10. GESAMT-NETTOINVENTARWERT JE AKTIENKLASSE

	31. Dezember 2022	30. Juni 2022	31. Dezember 2021
CMCI Composite SF UCITS ETF Klasse (CHF) A-acc	311.006.384 CHF	322.760.912 CHF	287.243.478 CHF
CMCI Composite SF UCITS ETF Klasse (EUR) A-acc	309.725.832 EUR	732.445.405 EUR	452.706.140 EUR
CMCI Composite SF UCITS ETF Klasse (GBP) A-acc	48.855.633 GBP	48.797.311 GBP	8.302.516 GBP
CMCI Composite SF UCITS ETF Klasse (USD) A-acc	946.514.319 USD	1.599.295.687 USD	1.344.621.787 USD
Bloomberg Commodity Index SF UCITS ETF Klasse (CHF) A-acc	70.374.369 CHF	344.198.980 CHF	61.817.652 CHF
Bloomberg Commodity Index SF UCITS ETF Klasse (EUR) A-acc	24.812.403 EUR	32.619.012 EUR	21.333.175 EUR
Bloomberg Commodity Index SF UCITS ETF Klasse (GBP) A-acc	2.088.351 GBP	2.153.477 GBP	2.850.273 GBP
Bloomberg Commodity Index SF UCITS ETF Klasse (USD) A-acc	49.830.867 USD	55.745.380 USD	28.842.524 USD
S&P 500 SF UCITS ETF Klasse (USD) A-acc	148.181.159 USD	143.657.196 USD	188.051.437 USD
MSCI USA SF UCITS ETF Klasse (USD) A-acc	481.738.338 USD	505.901.314 USD	713.972.888 USD
MSCI Emerging Markets SF UCITS ETF Klasse (USD) A-acc	92.447.806 USD	86.074.601 USD	506.773.152 USD
MSCI AC Asia Ex Japan SF UCITS ETF Klasse (USD) A-acc	186.500.627 USD	183.513.152 USD	209.627.283 USD
MSCI ACWI SF UCITS ETF Klasse (hedged to CHF) A-acc	1.088.688.060 CHF	406.039.479 CHF	482.501.506 CHF
MSCI ACWI SF UCITS ETF Klasse (hedged to CHF) A-UKdis	23.645.884 CHF	23.200.570 CHF	25.426.734 CHF
MSCI ACWI SF UCITS ETF Klasse (hedged to EUR) A-acc	1.125.803.565 EUR	605.598.831 EUR	696.275.518 EUR
MSCI ACWI SF UCITS ETF Klasse (hedged to EUR) A-UKdis	12.953.936 EUR	13.608.572 EUR	15.624.901 EUR
MSCI ACWI SF UCITS ETF Klasse (hedged to GBP) A-UKdis	114.529.192 GBP	34.617.193 GBP	39.638.708 GBP
MSCI ACWI SF UCITS ETF Klasse (hedged to JPY) A-acc	18.318.373.731 JPY	16.689.031.804 JPY	17.666.136.594 JPY
MSCI ACWI SF UCITS ETF Klasse (hedged to SGD) A-acc	1.774.538 SGD	2.156.801 SGD	3.961.875 SGD
MSCI ACWI SF UCITS ETF Klasse (hedged to USD) A-acc	1.824.789.500 USD	726.260.110 USD	992.490.100 USD
MSCI ACWI SF UCITS ETF Klasse (hedged to USD) A-UKdis	35.171.674 USD	34.139.554 USD	41.991.243 USD
MSCI ACWI SF UCITS ETF Klasse (USD) A-acc	650.487.293 USD	762.013.057 USD	806.963.301 USD
MSCI ACWI SF UCITS ETF Klasse (USD) A-UKdis	209.691.407 USD	220.748.527 USD	272.639.131 USD
CMCI Ex-Agriculture SF UCITS ETF Klasse (hedged to CHF) A-acc	50.152.056 CHF	54.728.822 CHF	48.881.257 CHF
CMCI Ex-Agriculture SF UCITS ETF Klasse (hedged to EUR) A-acc	7.524.950 EUR	7.575.354 EUR	10.526.420 EUR
CMCI Ex-Agriculture SF UCITS ETF Klasse (hedged to GBP) A-acc	2.444.475 GBP	3.837.222 GBP	1.922.915 GBP
CMCI Ex-Agriculture SF UCITS ETF Klasse (USD) A-acc	49.089.209 USD	66.697.933 USD	45.367.549 USD
Bloomberg Commodity CMCI SF UCITS ETF Klasse (hedged to CHF) A-acc	33.413.779 CHF	33.663.369 CHF	32.094.604 CHF
Bloomberg Commodity CMCI SF UCITS ETF Klasse (hedged to EUR) A-acc	102.938.141 EUR	17.526.625 EUR	12.527.761 EUR
Bloomberg Commodity CMCI SF UCITS ETF Klasse (hedged to GBP) A-acc	3.507.090 GBP	2.626.900 GBP	2.229.805 GBP
Bloomberg Commodity CMCI SF UCITS ETF Klasse (USD) A-acc	494.061.560 USD	344.383.131 USD	289.995.038 USD
CMCI Commodity Carry SF UCITS ETF Klasse (hedged to CHF) A-acc	30.591.288 CHF	9.903.827 CHF	2.094.170 CHF
CMCI Commodity Carry SF UCITS ETF Klasse (hedged to EUR) A-acc	86.413.547 EUR	27.741.216 EUR	24.028.146 EUR

**ERLÄUTERUNGEN ZUM ZUSAMMENGEFASSTEN HALBJAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)
FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2022**

10. GESAMT-NETTOINVENTARWERT JE AKTIENKLASSE (Fortsetzung)

	31. Dezember 2022	30. Juni 2022	31. Dezember 2021
CMCI Commodity Carry SF UCITS ETF Klasse (USD) A-acc	45.418.357 USD	70.587.797 USD	46.717.115 USD
MSCI China A SF UCITS ETF Klasse (USD) A-acc	160.744.152 USD	141.681.767 USD	23.361.175 USD
Euro Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF Klasse (EUR) A-acc	4.805.949 EUR	2.619.040 EUR	388.429 EUR
Euro Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF Klasse (EUR) A-acc	20.067.315 EUR	16.491.623 EUR	10.610.284 EUR
US Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF Klasse (USD) A-acc	3.379.531 USD	3.608.892 USD	4.829.798 USD
US Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF Klasse (USD) A-acc	19.794.452 USD	14.936.216 USD	8.427.532 USD
MSCI USA SF Index Fund Klasse (hedged to CHF) A-acc	51.797.577 CHF	49.443.706 CHF	37.759.349 CHF
MSCI USA SF Index Fund Klasse (hedged to CHF) A-UKdis	1.368.654 CHF	4.168.709 CHF	4.338.287 CHF
MSCI USA SF Index Fund Klasse (hedged to EUR) A-acc	252.533.520 EUR	170.593.578 EUR	121.945.496 EUR
MSCI USA SF Index Fund Klasse (hedged to EUR) A-UKdis	7.051.311 EUR	3.118.621 EUR	2.360.072 EUR
MSCI USA SF Index Fund Klasse (hedged to GBP) A-acc	21.028.670 GBP	4.958.400 GBP	4.484.560 GBP
MSCI USA SF Index Fund Klasse (hedged to GBP) A-UKdis	262.910 GBP	262.985 GBP	338.737 GBP
MSCI USA SF Index Fund Klasse (USD) A-acc	514.133.376 USD	549.786.022 USD	637.887.713 USD
MSCI USA SF Index Fund Klasse (USD) A-UKdis	55.216.818 USD	51.349.476 USD	52.011.103 USD
CMCI Commodity Carry Ex-Agriculture SF UCITS ETF Klasse (hedged to EUR) A-acc	4.387.532 EUR	3.680.364 EUR	4.055.276 EUR
CMCI Commodity Carry Ex-Agriculture SF UCITS ETF Klasse (USD) A-acc	55.694.733 USD	45.955.805 USD	2.043.360 USD

**ERLÄUTERUNGEN ZUM ZUSAMMENGEFASSTEN HALBJAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)
FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2022**

11. NETTOINVENTARWERT JE RÜCKKAUFBARER, GEWINNBERECHTIGTER AKTIE

	31. Dezember 2022	30. Juni 2022	31. Dezember 2021
CMCI Composite SF UCITS ETF Klasse (CHF) A-acc	77,44 CHF	78,13 CHF	68,21 CHF
CMCI Composite SF UCITS ETF Klasse (EUR) A-acc	79,06 EUR	79,63 EUR	69,58 EUR
CMCI Composite SF UCITS ETF Klasse (GBP) A-acc	131,83 GBP	131,68 GBP	114,38 GBP
CMCI Composite SF UCITS ETF Klasse (USD) A-acc	101,47 USD	100,32 USD	86,99 USD
Bloomberg Commodity Index SF UCITS ETF Klasse (CHF) A-acc	54,21 CHF	56,40 CHF	47,88 CHF
Bloomberg Commodity Index SF UCITS ETF Klasse (EUR) A-acc	55,46 EUR	57,49 EUR	48,88 EUR
Bloomberg Commodity Index SF UCITS ETF Klasse (GBP) A-acc	58,95 GBP	60,79 GBP	51,43 GBP
Bloomberg Commodity Index SF UCITS ETF Klasse (USD) A-acc	68,32 USD	69,73 USD	58,93 USD
S&P 500 SF UCITS ETF Klasse (USD) A-acc	72,33 USD	70,79 USD	88,56 USD
MSCI USA SF UCITS ETF Klasse (USD) A-acc	107,19 USD	105,12 USD	133,41 USD
MSCI Emerging Markets SF UCITS ETF Klasse (USD) A-acc	45,02 USD	46,40 USD	56,34 USD
MSCI AC Asia Ex Japan SF UCITS ETF Klasse (USD) A-acc	145,71 USD	152,01 USD	181,77 USD
MSCI ACWI SF UCITS ETF Klasse (hedged to CHF) A-acc	144,01 CHF	143,63 CHF	176,15 CHF
MSCI ACWI SF UCITS ETF Klasse (hedged to CHF) A-UKdis	127,28 CHF	128,33 CHF	158,64 CHF
MSCI ACWI SF UCITS ETF Klasse (hedged to EUR) A-acc	149,93 EUR	148,77 EUR	181,93 EUR
MSCI ACWI SF UCITS ETF Klasse (hedged to EUR) A-UKdis	144,54 EUR	145,05 EUR	178,32 EUR
MSCI ACWI SF UCITS ETF Klasse (hedged to GBP) A-UKdis	155,11 GBP	154,41 GBP	187,61 GBP
MSCI ACWI SF UCITS ETF Klasse (hedged to JPY) A-acc	1.604 JPY	1.603 JPY	1.941 JPY
MSCI ACWI SF UCITS ETF Klasse (hedged to SGD) A-acc	118,30 SGD	116,58 SGD	142,00 SGD
MSCI ACWI SF UCITS ETF Klasse (hedged to USD) A-acc	170,92 USD	166,85 USD	203,49 USD
MSCI ACWI SF UCITS ETF Klasse (hedged to USD) A-UKdis	165,16 USD	162,84 USD	200,29 USD
MSCI ACWI SF UCITS ETF Klasse (USD) A-acc	132,69 USD	129,73 USD	162,57 USD
MSCI ACWI SF UCITS ETF Klasse (USD) A-UKdis	114,96 USD	113,61 USD	143,60 USD
CMCI Ex-Agriculture SF UCITS ETF Klasse (hedged to CHF) A-acc	164,00 CHF	165,44 CHF	147,77 CHF
CMCI Ex-Agriculture SF UCITS ETF Klasse (hedged to EUR) A-acc	166,75 EUR	167,87 EUR	150,11 EUR
CMCI Ex-Agriculture SF UCITS ETF Klasse (hedged to GBP) A-acc	139,68 GBP	139,54 GBP	124,06 GBP
CMCI Ex-Agriculture SF UCITS ETF Klasse (USD) A-acc	205,51 USD	202,81 USD	179,77 USD
Bloomberg Commodity CMCI SF UCITS ETF Klasse (hedged to CHF) A-acc	14,05 CHF	14,15 CHF	12,19 CHF
Bloomberg Commodity CMCI SF UCITS ETF Klasse (hedged to EUR) A-acc	14,23 EUR	14,30 EUR	12,34 EUR
Bloomberg Commodity CMCI SF UCITS ETF Klasse (hedged to GBP) A-acc	14,08 GBP	14,05 GBP	12,05 GBP
Bloomberg Commodity CMCI SF UCITS ETF Klasse (USD) A-acc	16,28 USD	16,08 USD	13,77 USD
CMCI Commodity Carry SF UCITS ETF Klasse (hedged to CHF) A-acc	109,25 CHF	99,04 CHF	104,71 CHF
CMCI Commodity Carry SF UCITS ETF Klasse (hedged to EUR) A-acc	110,29 EUR	99,61 EUR	105,16 EUR
CMCI Commodity Carry SF UCITS ETF Klasse (USD) A-acc	133,13 USD	118,41 USD	124,20 USD
MSCI China A SF UCITS ETF Klasse (USD) A-acc	121,89 USD	140,75 USD	159,34 USD
Euro Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF Klasse (EUR) A-acc	110,18 EUR	108,18 EUR	127,98 EUR
Euro Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF Klasse (EUR) A-acc	118,51 EUR	114,50 EUR	116,78 EUR
US Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF Klasse (USD) A-acc	121,06 USD	122,03 USD	148,27 USD
US Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF Klasse (USD) A-acc	115,28 USD	114,27 USD	119,19 USD
MSCI USA SF Index Fund Klasse (hedged to CHF) A-acc	105,06 CHF	105,15 CHF	135,45 CHF
MSCI USA SF Index Fund Klasse (hedged to CHF) A-UKdis	102,83 CHF	103,57 CHF	134,10 CHF
MSCI USA SF Index Fund Klasse (hedged to EUR) A-acc	105,62 EUR	105,26 EUR	135,70 EUR
MSCI USA SF Index Fund Klasse (hedged to EUR) A-UKdis	103,70 EUR	104,14 EUR	134,90 EUR
MSCI USA SF Index Fund Klasse (hedged to GBP) A-acc	107,13 GBP	106,57 GBP	136,60 GBP
MSCI USA SF Index Fund Klasse (hedged to GBP) A-UKdis	105,16 GBP	105,19 GBP	135,49 GBP
MSCI USA SF Index Fund Klasse (USD) A-acc	111,10 USD	108,94 USD	138,27 USD

**ERLÄUTERUNGEN ZUM ZUSAMMENGEFASSTEN HALBJAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)
FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2022**

11. NETTOINVENTARWERT JE RÜCKKAUFBARER, GEWINNBERECHTIGTER AKTIE (Fortsetzung)

	31. Dezember 2022	30. Juni 2022	31. Dezember 2021
MSCI USA SF Index Fund Klasse (USD) A-UKdis	108,66 USD	107,34 USD	136,96 USD
CMCI Commodity Carry Ex-Agriculture SF UCITS ETF Klasse (hedged to EUR) A-acc	109,69 EUR	92,01 EUR	101,38 EUR
CMCI Commodity Carry Ex-Agriculture SF UCITS ETF Klasse (USD) A-acc	113,12 USD	93,34 USD	102,17 USD

12. BANKGUTHABEN UND EINLAGEN

Keiner der Teilfonds hielt zum 31. Dezember 2022 Barguthaben (30. Juni 2022: null). Barsicherheiten, die die Teilfonds erhalten, werden in den UBS (Irl) Fund plc - Select Money Market Fund—USD und den UBS (Irl) Fund plc - Select Money Market Fund—EUR reinvestiert, die von einem nahestehenden Unternehmen, der UBS AG, (und ihren Konzerngesellschaften) verwaltet werden.

13. WESENTLICHE EREIGNISSE IM BERICHTSZEITRAUM

Die Lage in Russland/der Ukraine

Der Krieg in der Ukraine hatte und hat immer noch erhebliche Auswirkungen auf die Finanzmärkte, in erster Linie auf russische und ukrainische Wertpapiere, aber auch auf die breiteren Märkte weltweit. Die Situation ist nach wie vor sehr volatil und wird vom Anlageverwalter genau beobachtet, um rasch geeignete Maßnahmen zum Schutz der Interessen der Anleger der Teilfonds zu ergreifen. Er hat die erforderlichen Maßnahmen ergriffen, um jederzeit die geltenden Gesetze und Vorschriften einzuhalten, insbesondere, aber nicht ausschließlich, die zuletzt erlassenen Sanktionsregelungen in der EU, der Schweiz, in Großbritannien und den USA.

Mit Wirkung vom 30. August 2022 hat sich der Name der Verwaltungsgesellschaft von Lantern Structured Asset Management Limited in UBS Fund Management (Ireland) Limited geändert.

Mit Wirkung vom 1. Dezember 2022 wurde der eingetragene Sitz der Gesellschaft von 32 Molesworth Street, Dublin 2, Irland, auf 5 Earlsfort Terrace, 2nd Floor, Dublin 2, D02 CK83, Ireland verlegt, und am gleichen Tag wurde als neuer Gesellschaftssekretär Dechert Secretarial Limited bestellt (vorher: MFD Secretaries Limited) und die Rechtsberater von Maples and Calder (Ireland) LLP zu Dechert geändert.

Am 21. Dezember 2022 wurden der S&P 500 SF UCITS ETF, der MSCI Emerging Markets SF UCITS ETF und der MSCI AC ASIA EX JAPAN SF UCITS ETF in Spanien registriert.

Im Berichtszeitraum sind keine anderen wesentlichen Ereignisse mit Auswirkungen auf die Gesellschaft eingetreten.

14. WESENTLICHE EREIGNISSE SEIT DEM ENDE DES BERICHTSZEITRAUMS

Für die Aktienklassen A-UKdis des MSCI ACWI SF UCITS ETF und des MSCI USA SF Index Fund wurden zum Ende des Berichtszeitraums Ausschüttungen festgesetzt. Einzelheiten zu den Ausschüttungen sind Erläuterung 8 zu entnehmen.

Am 24. Januar 2023 wurde der MSCI ACWI SF UCITS ETF in Chile registriert.

Nach Ende des Berichtszeitraums sind keine anderen wesentlichen Ereignisse mit Auswirkungen auf die Gesellschaft aufgetreten.

15. GENEHMIGUNG DES ABSCHLUSSES

Der Abschluss wurde am 20. Februar 2023 vom Verwaltungsrat genehmigt.

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2022**

CMCI COMPOSITE SF UCITS ETF

Aktien – 96,93 % (30. Juni 2022: 94,02 %)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
22.120	3M Co	2.652.652	0,16
46.735	Aalberts NV	1.807.089	0,11
12.139	ABB Ltd	368.170	0,02
49.611	Abbott Laboratories	5.446.762	0,33
64.008	AbbVie Inc	10.344.262	0,62
155.872	Accelleron Industries AG	3.225.422	0,19
24.799	Accenture PLC	6.617.364	0,40
93.020	Achillion Pharmaceuticals Inc	-	0,00
173.834	Activision Blizzard Inc	13.306.991	0,80
36.902	Adobe Inc	12.418.800	0,74
79.714	Advanced Micro Devices Inc	5.163.079	0,31
40.496	AerCap Holdings NV	2.361.713	0,14
53.898	Air Liquide SA	7.616.046	0,46
50.622	Alcon Inc	3.456.887	0,21
142.402	Alibaba Group Holding Ltd	12.544.198	0,75
7.243	Align Technology Inc	1.527.548	0,09
10.921	Allianz SE	2.341.518	0,14
11.073	Allstate Corp	1.501.510	0,09
447	Alnylam Pharmaceuticals Inc	106.309	0,01
134.083	Alphabet Inc - Class A	11.830.148	0,71
261.900	Alphabet Inc - Class C	23.238.348	1,39
906.218	Amazon.com Inc	76.122.276	4,55
6.409	Ameriprise Financial Inc	1.995.467	0,12
4.015	AmerisourceBergen Corp	665.401	0,04
30.169	AMG Advanced Metallurgical Group NV	1.107.595	0,07
6.282	Analog Devices Inc	1.030.430	0,06
38.188	ANDRITZ AG	2.182.482	0,13
608.266	Apple Inc	79.032.013	4,73
58.014	Applied Materials Inc	5.649.392	0,34
5.575	Arista Networks Inc	676.527	0,04
10.894	ASM International NV	2.739.875	0,16
30.169	ASR Nederland NV	1.427.960	0,09
167.604	Assa Abloy AB	3.598.347	0,22
4.743	Automatic Data Processing Inc	1.132.958	0,07
1.150	AutoZone Inc	2.835.108	0,17
800.919	AXA SA	22.271.308	1,33
50.039	Baidu Inc	5.723.456	0,34
251.406	Banca Mediolanum SpA	2.092.302	0,12
340.549	Bank of America Corp	11.278.988	0,67
16.533	Baozun Inc	87.623	0,01
41.939	Baxter International Inc	2.137.639	0,13
59.440	Berkshire Hathaway Inc	18.361.023	1,10
11.924	Best Buy Co Inc	956.465	0,06
2.682	BioMarin Pharmaceutical Inc	277.525	0,02
5.910	Block Inc	371.366	0,02
301.687	BNP Paribas SA	17.145.178	1,03
83.802	Boliden AB	3.146.744	0,19
419	Booking Holdings Inc	844.422	0,05
3.390	Bouygues SA	101.457	0,01
69.202	BP PLC	2.417.218	0,14
3.352	Brighthouse Financial Inc	171.861	0,01

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2022**

CMCI COMPOSITE SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Aktien – 96,93 % (30. Juni 2022: 94,02 %) (Fortsetzung)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
23.726	Cadence Design Systems Inc	3.811.425	0,23
112.531	Carrefour SA	1.878.347	0,11
167.604	Castellum AB	2.030.806	0,12
13.692	Caterpillar Inc	3.280.029	0,20
2.092	Celanese Corp	213.906	0,01
42.404	Charles Schwab Corp	3.530.537	0,21
5.689	Check Point Software Technologies Ltd	717.679	0,04
80.180	Chevron Corp	14.391.536	0,86
335	Chipotle Mexican Grill Inc	465.098	0,03
3.858	Cie Financiere Richemont SA	499.960	0,03
1	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA	19	0,00
21.688	Cigna Corp	7.186.135	0,43
101.434	Citigroup Inc	4.587.852	0,27
237.053	Coca-Cola Co	15.078.950	0,90
19.496	ConocoPhillips	2.300.490	0,14
6.778	Consolidated Edison Inc	645.970	0,04
3.674	Costco Wholesale Corp	1.677.201	0,10
30.266	Coupa Software Inc	2.396.125	0,14
11.732	Credicorp Ltd	1.591.599	0,09
55.647	CSX Corp	1.723.933	0,10
1.953	CVS Health Corp	181.961	0,01
4.525	CyberArk Software Ltd	586.706	0,03
110.999	Danone SA	5.831.972	0,35
63.689	Delivery Hero SE	3.043.810	0,18
7.158	Delta Air Lines Inc	235.207	0,01
23.955	Deutsche Telekom AG	476.491	0,03
18.122	DocuSign Inc	1.004.302	0,06
60.694	Dominion Energy Inc	3.721.738	0,22
45.539	Dropbox Inc	1.019.162	0,06
27.193	DTE Energy Co	3.195.960	0,19
10.580	Duke Energy Corp	1.089.685	0,06
1.104.849	E.ON SE	11.006.178	0,66
5.028	Eastman Chemical Co	409.490	0,02
14.721	Eckert & Ziegler Strahlen- und Medizintechnik AG	728.972	0,04
1.486.924	EDP - Energias de Portugal SA	7.388.697	0,44
51.437	Edwards Lifesciences Corp	3.837.685	0,23
5.028	Electronic Arts Inc	614.335	0,04
23.203	Eli Lilly & Co	8.488.551	0,51
559.007	Engie SA	7.987.287	0,48
28.795	EQT (US listed)	974.152	0,06
73.746	Etablissements Franz Colruyt NV	1.676.417	0,10
32.973	Euroapi SA	487.388	0,03
92.182	Evotec SE	1.501.299	0,09
20.112	EXOR (Netherlands listed)	1.466.060	0,09
3.486	Expedia Group Inc	305.388	0,02
360.131	Exxon Mobil Corp	39.722.411	2,38
9.355	Farfetch Ltd	44.247	0,00
1.009	FleetCor Technologies Inc	185.359	0,01
25.698	Fortinet Inc	1.256.368	0,07
615.253	Fortum OYJ	10.204.001	0,61
7.529	Fox - Class B	214.198	0,01

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2022**

CMCI COMPOSITE SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Aktien – 96,93 % (30. Juni 2022: 94,02 %) (Fortsetzung)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
260.373	Fresenius SE & Co KGaA	7.294.419	0,44
75.948	General Motors Co	2.554.896	0,15
20.199	Georg Fischer AG	1.235.720	0,07
111.137	Gilead Sciences Inc	9.541.104	0,57
1.409	Givaudan SA	4.314.553	0,26
24.032	Global Payments Inc	2.386.846	0,14
53.633	Greenvolt-Energias Renovaveis SA	446.472	0,03
47.767	Groupe Bruxelles Lambert SA	3.802.044	0,23
5.900	Guangzhou Automobile Group Co Ltd	3.976	0,00
36.250	Heineken NV	3.399.917	0,20
953	Holcim AG	49.634	0,00
38.549	Holcim (Switzerland listed)	1.994.942	0,12
16.394	Home Depot Inc	5.178.315	0,31
19.549	Huntington Ingalls Industries Inc	4.509.673	0,27
1.688	IDEXX Laboratories Inc	688.680	0,04
18.436	IMCD NV	2.619.894	0,16
29.906	Incyte Corp	2.402.054	0,14
112.161	Industrivarden - Class A	2.728.807	0,16
383.895	Intel Corp	10.146.350	0,61
12.744	International Business Machines Corp	1.795.539	0,11
5.866.133	Intesa Sanpaolo SpA	13.009.585	0,78
10.024	Intuit Inc	3.901.495	0,23
6.848	IQVIA Holdings Inc	1.403.043	0,08
59.155	JD.com Inc	3.320.366	0,20
159.965	Juniper Networks Inc	5.112.474	0,31
13.870	Kellogg Co	988.067	0,06
14.618	Kimberly-Clark Corp	1.984.357	0,12
18.157	Kinder Morgan Inc	328.276	0,02
3.352	KLA Corp	1.263.833	0,08
333.863	Koninklijke Ahold Delhaize NV	9.563.492	0,57
407.387	Koninklijke Philips NV	6.088.713	0,36
41.901	Koninklijke Vopak NV	1.240.946	0,07
48.605	Kroger Co	2.166.816	0,13
44.602	Liberty Global - Class A	844.311	0,05
9.218	Liberty Media Corp - Liberty SiriusXM - Class C	360.709	0,02
2.973	Linde PLC	969.774	0,06
6.704	Lonza Group AG	3.283.238	0,20
21.588	L’Oreal SA	7.685.907	0,46
11.129	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	8.075.502	0,48
139.310	Marathon Petroleum Corp	16.214.284	0,97
14.414	Marsh & McLennan Cos Inc	2.385.217	0,14
23.232	McDonald’s Corp	6.122.258	0,37
20.491	McKesson Corp	7.686.612	0,46
1.424.632	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA	13.659.618	0,82
32.083	Merck Co Inc	3.559.578	0,21
215.729	Meta Platforms Inc	25.960.837	1,55
182.166	Metso Outotec Oyj	1.868.729	0,11
39.319	Microchip Technology Inc	2.762.196	0,17
297.767	Microsoft Corp	71.410.590	4,27
12	Minebea Mitsumi Inc	175	0,00
3.352	Moderna Inc	602.100	0,04

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2022**

CMCI COMPOSITE SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Aktien – 96,93 % (30. Juni 2022: 94,02 %) (Fortsetzung)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
2.114	Molina Healthcare Inc	698.247	0,04
228	MongoDB Inc	44.802	0,00
63.295	Mosaic Co	2.776.733	0,17
150.946	Nestle SA	17.479.828	1,05
6.101	NetEase Inc	443.100	0,03
1.034	Netflix Inc	304.841	0,02
16.760	New Oriental Education & Technology Group Inc	583.596	0,03
8.958	NextEra Energy Inc	748.910	0,04
65.733	NOS SGPS SA	265.462	0,02
47.707	NVIDIA Corp	6.971.938	0,42
104	NVR Inc	477.766	0,03
65.449	OMV AG	3.359.820	0,20
8.097	ON Semiconductor Corp	505.017	0,03
6.869.718	Orange SA	68.045.538	4,07
8.479	O'Reilly Automotive Inc	7.156.454	0,43
11.464	Packaging Corp of America	1.466.352	0,09
6.977	Parker-Hannifin Corp	2.030.359	0,12
2.095	Paychex Inc	242.104	0,01
76.738	PepsiCo Inc	13.863.471	0,83
1	Pernod Ricard SA	33	0,00
538.463	Pfizer Inc	27.590.833	1,65
76.861	Phillips 66	7.999.721	0,48
16.760	PICC Property & Casualty Co Ltd	15.912	0,00
17.614	Pinduoduo Inc	1.436.434	0,09
8.713	Pioneer Natural Resources Co	1.989.974	0,12
83.802	Porsche Automobil Holding SE	4.582.780	0,27
4.777	Procter & Gamble Co	723.958	0,04
7.389	Public Service Enterprise Group	452.733	0,03
25.157	Publicis Groupe SA	1.595.366	0,10
6.998	Qorvo Inc	634.310	0,04
8.047	QUALCOMM Inc	884.668	0,05
67.041	Raiffeisen Bank International AG	1.098.293	0,07
37.032	Robert Half International Inc	2.734.040	0,16
126.036	Roche Holding (Non-voting rights)	39.573.684	2,37
12.636	Royal Caribbean Cruises Ltd	624.580	0,04
105.310	RWE AG	4.674.393	0,28
3.342	S&P Global Inc	1.119.488	0,07
168.520	Salesforce Inc	22.344.125	1,34
95.721	Sampo Oyj	4.987.374	0,30
528.967	Sanofi	50.718.289	3,03
216.770	Schneider Electric SE	30.241.730	1,81
31.560	SEI Investments Co	1.839.946	0,11
25.832	ServiceNow Inc	10.029.962	0,60
17.125	Siemens (Germany listed)	2.369.420	0,14
8.621	SKF AB	131.685	0,01
90.897	Snap Inc	813.530	0,05
17.340	Southern Co	1.238.270	0,07
184.364	SSAB - Class B	959.023	0,06
103.914	Stora Enso Oyj	1.458.369	0,09
26.817	Swatch Group (Bearer)	7.622.966	0,46
419.010	Swedbank AB	7.129.938	0,43

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2022**

CMCI COMPOSITE SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Aktien – 96,93 % (30. Juni 2022: 94,02 %) (Fortsetzung)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
2.179	Swiss Life Holding AG	1.122.866	0,07
17	Swiss Prime Site AG	1.452	0,00
30.169	Symrise AG	3.272.878	0,20
11.722	Synopsys Inc	3.742.571	0,22
166.835	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	12.427.515	0,74
11.778	Take-Two Interactive Software Inc	1.226.446	0,07
125.703	TeamViewer AG	1.615.913	0,10
251.406	Tele2 AB	2.053.326	0,12
1.298.930	Telefonaktiebolaget LM Ericsson	7.591.997	0,45
38.117	Tesla Inc	4.695.206	0,28
12.813	Texas Instruments Inc	2.116.905	0,13
19.253	Thermo Fisher Scientific Inc	10.602.334	0,63
124.796	T-Mobile US Inc	17.471.411	1,04
2.331.509	TotalEnergies SE	145.938.885	8,73
13.429	Tyson Foods Inc	835.961	0,05
38.432	UCB SA	3.017.141	0,18
5.175	UGI Corp	191.829	0,01
3.753	Ulta Salon Cosmetics & Fragrance Inc	1.760.570	0,11
18.114	Union Pacific Corp	3.750.890	0,22
704	United Rentals Inc	250.193	0,01
14.123	UnitedHealth Group Inc	7.487.982	0,45
257.845	Universal Music Group NV	6.194.415	0,37
80.450	UPM-Kymmene Oyj	2.999.091	0,18
140.137	Valero Energy Corp	17.777.810	1,06
183	Vallourec SA	2.403	0,00
56.985	Valmet Oyj	1.530.169	0,09
92.501	Veolia Environnement SA	2.369.308	0,14
1.238	VeriSign Inc	254.422	0,02
293.714	Verizon Communications Inc	11.572.336	0,69
21.350	Vertex Pharmaceuticals Inc	6.165.514	0,37
116.034	Vinci SA	11.552.738	0,69
7.187	Visa Inc	1.493.245	0,09
1.576.407	Vivendi SE	14.997.088	0,90
60.493	VMware Inc	7.426.110	0,44
184.364	Volkswagen (Non-voting rights)	22.907.102	1,37
4.173	W R Berkley Corp	302.859	0,02
37.021	Walmart Inc	5.249.208	0,31
46.627	Walt Disney Co	4.050.987	0,24
16.817	Waste Management Inc	2.638.203	0,16
159.887	Wells Fargo & Co	6.601.727	0,39
16.563	Western Union Co	228.074	0,01
94.538	Wolters Kluwer NV	9.863.516	0,59
47.050	Yum China Holdings Inc	2.571.296	0,15
47.850	Yum! Brands Inc	6.128.570	0,37
53.169	Zillow Group Inc	1.712.572	0,10
13.790	Zoetis Inc	2.020.965	0,12
8.612	Zoom Video Communications Inc	583.376	0,03
Aktien insgesamt		1.620.712.769	96,93

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2022**

CMCI COMPOSITE SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Funded Swaps* – 0,40 % (30. Juni 2022: 0,40 %)

Wäh- rung	Nominalbetrag	Bezeichnung	Fälligkeitstag	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
CHF	16.064	CMCI Composite Index Swap Klasse A CHF**	31. Jul 23	1.344.602	0,08
EUR	15.671	CMCI Composite Index Swap Klasse A EUR**	31. Jul 23	1.322.218	0,08
GBP	1.482	CMCI Composite Index Swap Klasse A GBP**	31. Jul 23	235.074	0,01
USD	37.311	CMCI Composite Index Swap Klasse A USD	31. Jul 23	3.786.058	0,23
Funded Swaps zum beizulegenden Zeitwert				6.687.952	0,40

Unfunded Swaps* – 2,67 % (30. Juni 2022: 4,94 %)

Wäh- rung	Nominalbetrag	Bezeichnung	Fälligkeitstag	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
CHF	3.999.896	CMCI Composite Net Total Return Index Total Return Swap Klasse A CHF**	31. Jul 23	8.073.190	0,48
EUR	3.902.018	CMCI Composite Net Total Return Index Total Return Swap Klasse A EUR**	31. Jul 23	8.698.466	0,52
GBP	369.105	CMCI Composite Net Total Return Index Total Return Swap Klasse A GBP**	31. Jul 23	1.409.077	0,09
USD	9.290.316	CMCI Composite Net Total Return Index Total Return Swap Klasse A USD	31. Jul 23	26.406.542	1,58
Unfunded Swaps zum beizulegenden Zeitwert				44.587.275	2,67

Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten

(30) (0,00)

Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnendes Nettovermögen

1.671.987.966 100,00

Einstufung

* Im Freiverkehr gehandelte derivative Finanzinstrumente.

** Die abgesicherte Aktienklasse investiert in Swaps mit einem Engagement in einer währungsgesicherten Version des Referenzindex.

Gegenpartei der Swap-Kontrakte ist die UBS AG.

Analyse des Gesamtvermögens

Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind
Im Freiverkehr gehandelte derivative Finanzinstrumente
Sonstige Vermögenswerte

**% des Gesamtver-
mögens**
94,85
3,00
2,15
100,00

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2022**

BLOOMBERG COMMODITY INDEX SF UCITS ETF

Aktien – 87,06 % (30. Juni 2022: 93,57 %)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
72.530	Advanced Micro Devices Inc	4.697.756	3,03
61.851	Alphabet Inc - Class A	5.457.077	3,52
54.709	Amazon.com Inc	4.595.556	2,97
44.306	Apple Inc	5.756.710	3,72
256.417	Bank of America Corp	8.492.538	5,48
19.275	Berkshire Hathaway Inc	5.953.868	3,84
67.542	BioMarin Pharmaceutical Inc	6.989.887	4,51
143.672	BP PLC	5.018.475	3,24
22.771	Chevron Corp	4.087.192	2,64
30.766	CVS Health Corp	2.867.111	1,85
304	Electricite de France SA	3.898	0,00
252	Holcim AG	13.140	0,01
33.905	Incyte Corp	2.723.278	1,76
191.346	Intel Corp	5.057.285	3,27
5.441	MercadoLibre Inc	4.604.620	2,97
47.726	Meta Platforms Inc	5.743.359	3,71
20.841	Microsoft Corp	4.998.051	3,23
59.726	Morgan Stanley	5.077.875	3,28
4.021	O'Reilly Automotive Inc	3.393.958	2,19
59.937	PayPal Holdings Inc	4.268.715	2,76
18.979	PepsiCo Inc	3.428.811	2,21
64.904	Pfizer Inc	3.325.686	2,15
78.210	Pinduoduo Inc	6.378.004	4,12
54.597	Salesforce Inc	7.238.990	4,67
58.070	Texas Instruments Inc	9.594.320	6,19
12.194	Thermo Fisher Scientific Inc	6.715.222	4,34
114.339	Verizon Communications Inc	4.504.940	2,91
44.378	Walt Disney Co	3.855.520	2,49
Aktien insgesamt		134.841.842	87,06

Funded Swaps* – 5,50 % (30. Juni 2022: 2,00 %)

Wäh- rung	Nominalbetrag	Bezeichnung	Fälligkeitstag	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
CHF	71.400	Bloomberg Commodity Index Swap Klasse A CHF**	31. Jul 23	4.183.520	2,70
EUR	24.608	Bloomberg Commodity Index Swap Klasse A EUR**	31. Jul 23	1.456.457	0,94
GBP	1.948	Bloomberg Commodity Index Swap Klasse A GBP**	31. Jul 23	138.163	0,09
USD	40.117	Bloomberg Commodity Index Swap Klasse A USD	31. Jul 23	2.740.697	1,77
Funded Swaps zum beizulegenden Zeitwert				8.518.837	5,50

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2022**

BLOOMBERG COMMODITY INDEX SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Unfunded Swaps* – 7,44 % (30. Juni 2022: 4,43 %)

Wäh- rung	Nominalbetrag	Bezeichnung	Fälligkeitstag	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
CHF	1.226.772	Bloomberg Commodity Net Total Return Index Total Return Swap Klasse A CHF**	31. Jul 23	5.589.769	3,61
EUR	422.813	Bloomberg Commodity Net Total Return Index Total Return Swap Klasse A EUR**	31. Jul 23	2.001.888	1,29
GBP	33.476	Bloomberg Commodity Net Total Return Index Total Return Swap Klasse A GBP**	31. Jul 23	184.364	0,12
USD	689.281	Bloomberg Commodity Net Total Return Index Total Return Swap Klasse A USD	31. Jul 23	3.751.223	2,42
Unfunded Swaps zum beizulegenden Zeitwert				11.527.244	7,44
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten				-	-
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnendes Nettovermögen				154.887.923	100,00

Einstufung

* Im Freiverkehr gehandelte derivative Finanzinstrumente.

** Die abgesicherte Aktienklasse investiert in Swaps mit einem Engagement in einer währungsgesicherten Version des Referenzindex.

Gegenpartei der Swap-Kontrakte ist die UBS AG.

	% des Gesamtver- mögens
Analyse des Gesamtvermögens	
Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind	79,93
Im Freiverkehr gehandelte derivative Finanzinstrumente	11,88
Sonstige Vermögenswerte	8,19
	100,00

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2022**

S&P 500 SF UCITS ETF

Aktien – 90,62 % (30. Juni 2022: 96,74 %)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
1.833	3M Co	219.773	0,15
3.872	Aalberts NV	149.718	0,10
1.006	ABB Ltd	30.503	0,02
4.110	Abbott Laboratories	451.266	0,30
5.303	AbbVie Inc	857.026	0,58
12.914	Accelleron Industries AG	267.228	0,18
2.055	Accenture PLC	548.251	0,37
7.707	Achillion Pharmaceuticals Inc	-	0,00
14.402	Activision Blizzard Inc	1.102.490	0,74
3.057	Adobe Inc	1.028.903	0,69
6.604	Advanced Micro Devices Inc	427.763	0,29
3.355	AerCap Holdings NV	195.669	0,13
4.465	Air Liquide SA	630.993	0,43
4.194	Alcon Inc	286.405	0,19
11.798	Alibaba Group Holding Ltd	1.039.292	0,70
600	Align Technology Inc	126.558	0,09
905	Allianz SE	193.996	0,13
917	Allstate Corp	124.401	0,08
37	Alnylam Pharmaceuticals Inc	8.808	0,01
11.109	Alphabet Inc - Class A	980.133	0,66
21.698	Alphabet Inc - Class C	1.925.307	1,30
75.080	Amazon.com Inc	6.306.762	4,26
531	Ameriprise Financial Inc	165.325	0,11
333	AmerisourceBergen Corp	55.129	0,04
2.499	AMG Advanced Metallurgical Group NV	91.765	0,06
520	Analog Devices Inc	85.372	0,06
3.164	ANDRITZ AG	180.820	0,12
50.395	Apple Inc	6.547.835	4,42
4.806	Applied Materials Inc	468.054	0,32
462	Arista Networks Inc	56.051	0,04
903	ASM International NV	227.000	0,15
2.499	ASR Nederland NV	118.307	0,08
13.886	Assa Abloy AB	298.124	0,20
393	Automatic Data Processing Inc	93.866	0,06
95	AutoZone Inc	234.889	0,16
66.356	AXA SA	1.845.187	1,25
4.146	Baidu Inc	474.191	0,32
20.829	Banca Mediolanum SpA	173.348	0,12
28.215	Bank of America Corp	934.469	0,63
1.370	Baozun Inc	7.260	0,01
3.475	Baxter International Inc	177.104	0,12
4.925	Berkshire Hathaway Inc	1.521.218	1,03
988	Best Buy Co Inc	79.243	0,05
222	BioMarin Pharmaceutical Inc	22.993	0,02
490	Block Inc	30.768	0,02
24.995	BNP Paribas SA	1.420.485	0,96
6.943	Boliden AB	260.709	0,18
35	Booking Holdings Inc	69.960	0,05
281	Bouygues SA	8.406	0,01
5.733	BP PLC	200.267	0,14
278	Brighthouse Financial Inc	14.239	0,01

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2022**

S&P 500 SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Aktien – 90,62 % (30. Juni 2022: 96,74 %) (Fortsetzung)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
1.966	Cadence Design Systems Inc	315.778	0,21
9.323	Carrefour SA	155.622	0,11
13.886	Castellum AB	168.253	0,11
1.134	Caterpillar Inc	271.752	0,18
173	Celanese Corp	17.722	0,01
3.513	Charles Schwab Corp	292.506	0,20
471	Check Point Software Technologies Ltd	59.460	0,04
6.643	Chevron Corp	1.192.345	0,80
28	Chipotle Mexican Grill Inc	38.533	0,03
320	Cie Financiere Richemont SA	41.422	0,03
1.797	Cigna Corp	595.374	0,40
8.404	Citigroup Inc	380.105	0,26
19.640	Coca-Cola Co	1.249.297	0,84
1.615	ConocoPhillips	190.597	0,13
562	Consolidated Edison Inc	53.519	0,04
304	Costco Wholesale Corp	138.957	0,09
2.508	Coupa Software Inc	198.520	0,13
972	Credicorp Ltd	131.865	0,09
4.610	CSX Corp	142.829	0,10
162	CVS Health Corp	15.076	0,01
375	CyberArk Software Ltd	48.609	0,03
9.196	Danone SA	483.181	0,33
5.277	Delivery Hero SE	252.181	0,17
593	Delta Air Lines Inc	19.487	0,01
1.985	Deutsche Telekom AG	39.477	0,03
1.501	DocuSign Inc	83.207	0,06
5.028	Dominion Energy Inc	308.347	0,21
3.773	Dropbox Inc	84.438	0,06
2.253	DTE Energy Co	264.787	0,18
877	Duke Energy Corp	90.281	0,06
91.537	E.ON SE	911.866	0,62
417	Eastman Chemical Co	33.926	0,02
1.220	Eckert & Ziegler Strahlen- und Medizintechnik AG	60.396	0,04
123.192	EDP - Energias de Portugal SA	612.157	0,41
4.262	Edwards Lifesciences Corp	317.954	0,21
417	Electronic Arts Inc	50.898	0,03
1.922	Eli Lilly & Co	703.280	0,47
46.314	Engie SA	661.750	0,45
2.386	EQT (US listed)	80.709	0,05
6.110	Etablissements Franz Colruyt NV	138.892	0,09
2.732	Euroapi SA	40.380	0,03
7.637	Evotec SE	124.383	0,08
1.666	EXOR (Netherlands listed)	121.464	0,08
289	Expedia Group Inc	25.302	0,02
29.837	Exxon Mobil Corp	3.291.018	2,22
775	Farfetch Ltd	3.666	0,00
84	FleetCor Technologies Inc	15.357	0,01
2.129	Fortinet Inc	104.091	0,07
50.974	Fortum OYJ	845.406	0,57
624	Fox - Class B	17.746	0,01
21.572	Fresenius SE & Co KGaA	604.346	0,41

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2022**

S&P 500 SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Aktien – 90,62 % (30. Juni 2022: 96,74 %) (Fortsetzung)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
6.292	General Motors Co	211.674	0,14
1.674	Georg Fischer AG	102.380	0,07
9.208	Gilead Sciences Inc	790.484	0,53
117	Givaudan SA	357.463	0,24
1.991	Global Payments Inc	197.751	0,13
4.444	Greenvolt-Energias Renovaveis SA	36.990	0,03
3.958	Groupe Bruxelles Lambert SA	315.001	0,21
489	Guangzhou Automobile Group Co Ltd	329	0,00
3.003	Heineken NV	281.685	0,19
79	Holcim AG	4.112	0,00
3.194	Holcim (Switzerland listed)	165.282	0,11
1.358	Home Depot Inc	429.025	0,29
1.620	Huntington Ingalls Industries Inc	373.628	0,25
140	IDEXX Laboratories Inc	57.057	0,04
1.527	IMCD NV	217.059	0,15
2.478	Incyte Corp	199.011	0,13
9.293	Industrivarden - Class A	226.083	0,15
31.806	Intel Corp	840.629	0,57
1.056	International Business Machines Corp	148.761	0,10
486.012	Intesa Sanpaolo SpA	1.077.849	0,73
830	Intuit Inc	323.241	0,22
567	IQVIA Holdings Inc	116.243	0,08
4.901	JD.com Inc	275.094	0,19
13.253	Juniper Networks Inc	423.571	0,29
1.149	Kellogg Co	81.862	0,06
1.211	Kimberly-Clark Corp	164.405	0,11
1.504	Kinder Morgan Inc	27.198	0,02
278	KLA Corp	104.709	0,07
27.661	Koninklijke Ahold Delhaize NV	792.339	0,53
33.752	Koninklijke Philips NV	504.452	0,34
3.471	Koninklijke Vopak NV	102.813	0,07
4.027	Kroger Co	179.522	0,12
3.695	Liberty Global - Class A	69.951	0,05
764	Liberty Media Corp - Liberty SiriusXM - Class C	29.885	0,02
246	Linde PLC	80.346	0,05
555	Lonza Group AG	272.018	0,18
1.789	L’Oreal SA	636.780	0,43
922	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	669.058	0,45
11.542	Marathon Petroleum Corp	1.343.360	0,91
1.194	Marsh & McLennan Cos Inc	197.616	0,13
1.925	McDonald’s Corp	507.232	0,34
1.698	McKesson Corp	636.839	0,43
118.031	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA	1.131.705	0,76
2.658	Merck Co Inc	294.913	0,20
17.873	Meta Platforms Inc	2.150.866	1,45
15.092	Metso Outotec Oyj	154.825	0,10
3.258	Microchip Technology Inc	228.849	0,15
24.670	Microsoft Corp	5.916.397	3,99
1	Minebea Mitsumi Inc	15	0,00
278	Moderna Inc	49.884	0,03
175	Molina Healthcare Inc	57.850	0,04

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2022**

S&P 500 SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Aktien – 90,62 % (30. Juni 2022: 96,74 %) (Fortsetzung)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
19	MongoDB Inc	3.712	0,00
5.244	Mosaic Co	230.053	0,16
12.506	Nestle SA	1.448.211	0,98
505	NetEase Inc	36.711	0,02
86	Netflix Inc	25.256	0,02
1.389	New Oriental Education & Technology Group Inc	48.351	0,03
742	NextEra Energy Inc	62.048	0,04
5.446	NOS SGPS SA	21.994	0,02
3.953	NVIDIA Corp	577.628	0,39
9	NVR Inc	39.585	0,03
5.422	OMV AG	278.362	0,19
671	ON Semiconductor Corp	41.841	0,03
569.159	Orange SA	5.637.601	3,80
702	O'Reilly Automotive Inc	592.915	0,40
950	Packaging Corp of America	121.488	0,08
578	Parker-Hannifin Corp	168.216	0,11
174	Paychex Inc	20.058	0,01
6.358	PepsiCo Inc	1.148.594	0,78
44.612	Pfizer Inc	2.285.912	1,54
6.368	Phillips 66	662.780	0,45
1.389	PICC Property & Casualty Co Ltd	1.318	0,00
1.459	Pinduoduo Inc	119.009	0,08
722	Pioneer Natural Resources Co	164.870	0,11
6.943	Porsche Automobil Holding SE	379.685	0,26
396	Procter & Gamble Co	59.980	0,04
612	Public Service Enterprise Group	37.509	0,03
2.084	Publicis Groupe SA	132.177	0,09
580	Qorvo Inc	52.553	0,04
667	QUALCOMM Inc	73.295	0,05
5.554	Raiffeisen Bank International AG	90.994	0,06
3.068	Robert Half International Inc	226.516	0,15
10.442	Roche Holding (Non-voting rights)	3.278.696	2,21
1.047	Royal Caribbean Cruises Ltd	51.747	0,04
8.725	RWE AG	387.275	0,26
277	S&P Global Inc	92.750	0,06
13.962	Salesforce Inc	1.851.220	1,25
7.931	Sampo Oyj	413.206	0,28
43.825	Sanofi	4.202.031	2,84
17.959	Schneider Electric SE	2.505.540	1,69
2.615	SEI Investments Co	152.440	0,10
2.140	ServiceNow Inc	830.986	0,56
1.419	Siemens (Germany listed)	196.307	0,13
714	SKF AB	10.910	0,01
7.531	Snap Inc	67.401	0,05
1.437	Southern Co	102.591	0,07
15.275	SSAB - Class B	79.455	0,05
8.609	Stora Enso Oyj	120.826	0,08
2.222	Swatch Group (Bearer)	631.566	0,43
34.715	Swedbank AB	590.718	0,40
181	Swiss Life Holding AG	93.030	0,06
1	Swiss Prime Site AG	120	0,00

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2022**

S&P 500 SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Aktien – 90,62 % (30. Juni 2022: 96,74 %) (Fortsetzung)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
2.499	Symrise AG	271.159	0,18
971	Synopsys Inc	310.073	0,21
13.822	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	1.029.625	0,70
976	Take-Two Interactive Software Inc	101.612	0,07
10.415	TeamViewer AG	133.879	0,09
20.829	Tele2 AB	170.119	0,12
107.617	Telefonaktiebolaget LM Ericsson	629.000	0,42
3.158	Tesla Inc	389.000	0,26
1.062	Texas Instruments Inc	175.386	0,12
1.595	Thermo Fisher Scientific Inc	878.408	0,59
10.339	T-Mobile US Inc	1.447.513	0,98
193.166	TotalEnergies SE	12.091.096	8,16
1.113	Tyson Foods Inc	69.260	0,05
3.184	UCB SA	249.971	0,17
429	UGI Corp	15.893	0,01
311	Ulta Salon Cosmetics & Fragrance Inc	145.864	0,10
1.501	Union Pacific Corp	310.763	0,21
58	United Rentals Inc	20.728	0,01
1.170	UnitedHealth Group Inc	620.382	0,42
21.363	Universal Music Group NV	513.210	0,35
6.665	UPM-Kymmene Oyj	248.476	0,17
11.610	Valero Energy Corp	1.472.899	0,99
15	Vallourec SA	199	0,00
4.721	Valmet Oyj	126.775	0,09
7.664	Veolia Environnement SA	196.298	0,13
103	VeriSign Inc	21.079	0,01
24.334	Verizon Communications Inc	958.773	0,65
1.769	Vertex Pharmaceuticals Inc	510.815	0,34
9.613	Vinci SA	957.149	0,65
595	Visa Inc	123.716	0,08
130.606	Vivendi SE	1.242.515	0,84
5.012	VMware Inc	615.256	0,42
15.275	Volkswagen (Non-voting rights)	1.897.863	1,28
346	W R Berkley Corp	25.092	0,02
3.067	Walmart Inc	434.899	0,29
3.863	Walt Disney Co	335.626	0,23
1.393	Waste Management Inc	218.576	0,15
13.247	Wells Fargo & Co	546.956	0,37
1.372	Western Union Co	18.896	0,01
7.832	Wolters Kluwer NV	817.196	0,55
3.898	Yum China Holdings Inc	213.033	0,14
3.964	Yum! Brands Inc	507.755	0,34
4.405	Zillow Group Inc	141.887	0,10
1.143	Zoetis Inc	167.438	0,11
713	Zoom Video Communications Inc	48.333	0,03
Aktien insgesamt		134.276.712	90,62

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2022**

S&P 500 SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Funded Swaps* – 0,41 % (30. Juni 2022: 0,40 %)

Wäh- rung	Nominalbetrag	Bezeichnung	Fälligkeitstag	Zeitwert USD	% des Netto- inventarwerts
USD	8.406	S&P 500 Index Swap Klasse A USD	31. Jul 23	607.971	0,41
Funded Swaps zum beizulegenden Zeitwert				607.971	0,41

Unfunded Swaps* – 5,03 % (30. Juni 2022: 2,89 %)

Wäh- rung	Nominalbetrag	Bezeichnung	Fälligkeitstag	Zeitwert USD	% des Netto- inventarwerts
USD	1.959.624	S&P 500 Net Total Return Index Total Return Swap Klasse A USD	31. Jul 23	7.455.455	5,03
Unfunded Swaps zum beizulegenden Zeitwert				7.455.455	5,03
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten				5.841.021	3,94
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnendes Nettovermögen				148.181.159	100,00

Einstufung

* Im Freiverkehr gehandelte derivative Finanzinstrumente.

Gegenpartei der Swap-Kontrakte ist die UBS AG.

Analyse des Gesamtvermögens

Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind	85,75
Im Freiverkehr gehandelte derivative Finanzinstrumente	5,15
Sonstige Vermögenswerte	9,10
	100,00

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2022**

MSCI USA SF UCITS ETF

Aktien – 95,80 % (30. Juni 2022: 91,15 %)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
6.299	3M Co	755.355	0,16
13.308	Aalberts NV	514.577	0,11
3.457	ABB Ltd	104.838	0,02
14.127	Abbott Laboratories	1.550.991	0,32
18.226	AbbVie Inc	2.945.577	0,61
44.385	Accelleron Industries AG	918.454	0,19
7.062	Accenture PLC	1.884.326	0,39
26.488	Achillion Pharmaceuticals Inc	-	0,00
49.500	Activision Blizzard Inc	3.789.229	0,79
10.508	Adobe Inc	3.536.312	0,73
22.699	Advanced Micro Devices Inc	1.470.211	0,31
11.531	AerCap Holdings NV	672.509	0,14
15.348	Air Liquide SA	2.168.705	0,45
14.415	Alcon Inc	984.365	0,20
40.550	Alibaba Group Holding Ltd	3.572.020	0,74
2.062	Align Technology Inc	434.977	0,09
3.110	Allianz SE	666.758	0,14
3.153	Allstate Corp	427.562	0,09
127	Alnylam Pharmaceuticals Inc	30.272	0,01
38.181	Alphabet Inc - Class A	3.368.690	0,70
74.577	Alphabet Inc - Class C	6.617.229	1,37
258.050	Amazon.com Inc	21.676.177	4,50
1.825	Ameriprise Financial Inc	568.218	0,12
1.143	AmerisourceBergen Corp	189.476	0,04
8.591	AMG Advanced Metallurgical Group NV	315.393	0,07
1.789	Analog Devices Inc	293.420	0,06
10.874	ANDRITZ AG	621.472	0,13
173.207	Apple Inc	22.504.738	4,67
16.520	Applied Materials Inc	1.608.691	0,33
1.587	Arista Networks Inc	192.644	0,04
3.102	ASM International NV	780.192	0,16
8.591	ASR Nederland NV	406.618	0,08
47.726	Assa Abloy AB	1.024.646	0,21
1.351	Automatic Data Processing Inc	322.615	0,07
327	AutoZone Inc	807.309	0,17
228.065	AXA SA	6.341.860	1,32
14.249	Baidu Inc	1.629.781	0,34
71.589	Banca Mediolanum SpA	595.793	0,12
96.973	Bank of America Corp	3.211.745	0,67
4.708	Baozun Inc	24.951	0,01
11.942	Baxter International Inc	608.703	0,13
16.926	Berkshire Hathaway Inc	5.228.388	1,09
3.396	Best Buy Co Inc	272.358	0,06
764	BioMarin Pharmaceutical Inc	79.027	0,02
1.683	Block Inc	105.748	0,02
85.907	BNP Paribas SA	4.882.170	1,01
23.863	Boliden AB	896.050	0,19
119	Booking Holdings Inc	240.453	0,05
965	Bouygues SA	28.890	0,01
19.706	BP PLC	688.314	0,14
954	Brighthouse Financial Inc	48.938	0,01

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2022**

MSCI USA SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Aktien – 95,80 % (30. Juni 2022: 91,15 %) (Fortsetzung)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
6.756	Cadence Design Systems Inc	1.085.321	0,23
32.044	Carrefour SA	534.868	0,11
47.726	Castellum AB	578.282	0,12
3.899	Caterpillar Inc	934.004	0,19
596	Celanese Corp	60.911	0,01
12.075	Charles Schwab Corp	1.005.337	0,21
1.620	Check Point Software Technologies Ltd	204.362	0,04
22.832	Chevron Corp	4.098.058	0,85
95	Chipotle Mexican Grill Inc	132.439	0,03
1.099	Cie Financiere Richemont SA	142.366	0,03
6.176	Cigna Corp	2.046.286	0,42
28.884	Citigroup Inc	1.306.413	0,27
67.502	Coca-Cola Co	4.293.802	0,89
5.551	ConocoPhillips	655.075	0,14
1.930	Consolidated Edison Inc	183.943	0,04
1.046	Costco Wholesale Corp	477.591	0,10
8.618	Coupa Software Inc	682.308	0,14
3.341	Credicorp Ltd	453.215	0,09
15.846	CSX Corp	490.898	0,10
556	CVS Health Corp	51.814	0,01
1.289	CyberArk Software Ltd	167.067	0,03
31.608	Danone SA	1.660.682	0,34
18.136	Delivery Hero SE	866.739	0,18
2.038	Delta Air Lines Inc	66.976	0,01
6.821	Deutsche Telekom AG	135.683	0,03
5.160	DocuSign Inc	285.980	0,06
17.283	Dominion Energy Inc	1.059.782	0,22
12.967	Dropbox Inc	290.211	0,06
7.743	DTE Energy Co	910.065	0,19
3.013	Duke Energy Corp	310.293	0,06
314.611	E.ON SE	3.134.061	0,65
1.432	Eastman Chemical Co	116.604	0,02
4.192	Eckert & Ziegler Strahlen- und Medizintechnik AG	207.578	0,04
423.409	EDP - Energias de Portugal SA	2.103.966	0,44
14.647	Edwards Lifesciences Corp	1.092.799	0,23
1.432	Electronic Arts Inc	174.935	0,04
6.607	Eli Lilly & Co	2.417.155	0,50
159.180	Engie SA	2.274.418	0,47
8.200	EQT (US listed)	277.394	0,06
20.999	Etablissements Franz Colruyt NV	477.368	0,10
9.389	Euroapi SA	138.786	0,03
26.249	Evotec SE	427.502	0,09
5.727	EXOR (Netherlands listed)	417.468	0,09
993	Expedia Group Inc	86.961	0,02
102.549	Exxon Mobil Corp	11.311.144	2,35
2.664	Farfetch Ltd	12.600	0,00
287	FleetCor Technologies Inc	52.782	0,01
7.318	Fortinet Inc	357.757	0,07
175.196	Fortum OYJ	2.905.637	0,60
2.144	Fox - Class B	60.994	0,01
74.142	Fresenius SE & Co KGaA	2.077.120	0,43

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2022**

MSCI USA SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Aktien – 95,80 % (30. Juni 2022: 91,15 %) (Fortsetzung)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
21.627	General Motors Co	727.519	0,15
5.752	Georg Fischer AG	351.877	0,07
31.647	Gilead Sciences Inc	2.716.874	0,56
401	Givaudan SA	1.228.589	0,26
6.843	Global Payments Inc	679.666	0,14
15.272	Greenvolt-Energias Renovaveis SA	127.135	0,03
13.602	Groupe Bruxelles Lambert SA	1.082.650	0,22
1.680	Guangzhou Automobile Group Co Ltd	1.132	0,00
10.322	Heineken NV	968.142	0,20
271	Holcim AG	14.133	0,00
10.977	Holcim (Switzerland listed)	568.069	0,12
4.668	Home Depot Inc	1.474.549	0,31
5.567	Huntington Ingalls Industries Inc	1.284.151	0,27
481	IDEXX Laboratories Inc	196.105	0,04
5.250	IMCD NV	746.027	0,16
8.516	Incyte Corp	683.996	0,14
31.938	Industrivarden - Class A	777.041	0,16
109.316	Intel Corp	2.889.221	0,60
3.629	International Business Machines Corp	511.288	0,11
1.670.409	Intesa Sanpaolo SpA	3.704.541	0,77
2.854	Intuit Inc	1.110.969	0,23
1.950	IQVIA Holdings Inc	399.523	0,08
16.845	JD.com Inc	945.490	0,20
45.551	Juniper Networks Inc	1.455.801	0,30
3.949	Kellogg Co	281.357	0,06
4.162	Kimberly-Clark Corp	565.055	0,12
5.170	Kinder Morgan Inc	93.478	0,02
954	KLA Corp	359.883	0,07
95.069	Koninklijke Ahold Delhaize NV	2.723.249	0,57
116.005	Koninklijke Philips NV	1.733.790	0,36
11.931	Koninklijke Vopak NV	353.365	0,07
13.841	Kroger Co	617.011	0,13
12.701	Liberty Global - Class A	240.421	0,05
2.625	Liberty Media Corp - Liberty SiriusXM - Class C	102.713	0,02
847	Linde PLC	276.148	0,06
1.909	Lonza Group AG	934.917	0,19
6.147	L’Oreal SA	2.188.599	0,45
3.169	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	2.299.538	0,48
39.669	Marathon Petroleum Corp	4.617.094	0,96
4.104	Marsh & McLennan Cos Inc	679.202	0,14
6.615	McDonald’s Corp	1.743.342	0,36
5.835	McKesson Corp	2.188.799	0,45
405.671	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA	3.889.640	0,81
9.136	Merck Co Inc	1.013.607	0,21
61.430	Meta Platforms Inc	7.392.471	1,53
51.873	Metso Outotec Oyj	532.130	0,11
11.196	Microchip Technology Inc	786.548	0,16
84.791	Microsoft Corp	20.334.502	4,22
3	Minebea Mitsumi Inc	50	0,00
954	Moderna Inc	171.451	0,04
602	Molina Healthcare Inc	198.829	0,04

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2022**

MSCI USA SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Aktien – 95,80 % (30. Juni 2022: 91,15 %) (Fortsetzung)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
65	MongoDB Inc	12.758	0,00
18.023	Mosaic Co	790.688	0,16
42.983	Nestle SA	4.977.464	1,03
1.737	NetEase Inc	126.175	0,03
294	Netflix Inc	86.805	0,02
4.773	New Oriental Education & Technology Group Inc	166.182	0,03
2.551	NextEra Energy Inc	213.256	0,04
18.718	NOS SGPS SA	75.592	0,02
13.585	NVIDIA Corp	1.985.292	0,41
29	NVR Inc	136.048	0,03
18.637	OMV AG	956.725	0,20
2.306	ON Semiconductor Corp	143.806	0,03
1.956.185	Orange SA	19.376.288	4,02
2.414	O'Reilly Automotive Inc	2.037.834	0,42
3.264	Packaging Corp of America	417.551	0,09
1.987	Parker-Hannifin Corp	578.154	0,12
597	Paychex Inc	68.940	0,01
21.851	PepsiCo Inc	3.947.689	0,82
1	Pernod Ricard SA	9	0,00
153.330	Pfizer Inc	7.856.620	1,63
21.887	Phillips 66	2.277.958	0,47
4.773	PICC Property & Casualty Co Ltd	4.531	0,00
5.016	Pinduoduo Inc	409.031	0,09
2.481	Pioneer Natural Resources Co	566.655	0,12
23.863	Porsche Automobil Holding SE	1.304.968	0,27
1.360	Procter & Gamble Co	206.150	0,04
2.104	Public Service Enterprise Group	128.918	0,03
7.164	Publicis Groupe SA	454.288	0,09
1.993	Qorvo Inc	180.623	0,04
2.291	QUALCOMM Inc	251.913	0,05
19.090	Raiffeisen Bank International AG	312.744	0,07
10.545	Robert Half International Inc	778.531	0,16
35.889	Roche Holding (Non-voting rights)	11.268.793	2,34
3.598	Royal Caribbean Cruises Ltd	177.852	0,04
29.988	RWE AG	1.331.055	0,28
952	S&P Global Inc	318.779	0,07
47.987	Salesforce Inc	6.362.595	1,32
27.257	Sampo Oyj	1.420.178	0,30
150.626	Sanofi	14.442.272	3,00
61.726	Schneider Electric SE	8.611.475	1,79
8.987	SEI Investments Co	523.933	0,11
7.356	ServiceNow Inc	2.856.079	0,59
4.876	Siemens (Germany listed)	674.703	0,14
2.455	SKF AB	37.498	0,01
25.883	Snap Inc	231.657	0,05
4.938	Southern Co	352.603	0,07
52.499	SSAB - Class B	273.086	0,06
29.590	Stora Enso Oyj	415.277	0,09
7.636	Swatch Group (Bearer)	2.170.676	0,45
119.315	Swedbank AB	2.030.284	0,42
620	Swiss Life Holding AG	319.741	0,07

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2022**

MSCI USA SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Aktien – 95,80 % (30. Juni 2022: 91,15 %) (Fortsetzung)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
5	Swiss Prime Site AG	413	0,00
8.591	Symrise AG	931.967	0,19
3.338	Synopsys Inc	1.065.715	0,22
47.507	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	3.538.794	0,73
3.354	Take-Two Interactive Software Inc	349.236	0,07
35.794	TeamViewer AG	460.139	0,10
71.589	Tele2 AB	584.694	0,12
369.876	Telefonaktiebolaget LM Ericsson	2.161.857	0,45
10.854	Tesla Inc	1.336.982	0,28
3.648	Texas Instruments Inc	602.799	0,13
5.482	Thermo Fisher Scientific Inc	3.019.065	0,63
35.536	T-Mobile US Inc	4.975.066	1,03
663.908	TotalEnergies SE	41.556.786	8,63
3.824	Tyson Foods Inc	238.044	0,05
10.944	UCB SA	859.145	0,18
1.474	UGI Corp	54.624	0,01
1.069	Ulta Salon Cosmetics & Fragrance Inc	501.331	0,10
5.158	Union Pacific Corp	1.068.084	0,22
200	United Rentals Inc	71.244	0,02
4.022	UnitedHealth Group Inc	2.132.238	0,44
73.423	Universal Music Group NV	1.763.889	0,37
22.908	UPM-Kymmene Oyj	854.005	0,18
39.905	Valero Energy Corp	5.062.315	1,05
52	Vallourec SA	684	0,00
16.227	Valmet Oyj	435.723	0,09
26.340	Veolia Environnement SA	674.672	0,14
353	VeriSign Inc	72.448	0,02
83.636	Verizon Communications Inc	3.295.277	0,68
6.080	Vertex Pharmaceuticals Inc	1.755.659	0,36
33.041	Vinci SA	3.289.697	0,68
2.047	Visa Inc	425.208	0,09
448.889	Vivendi SE	4.270.491	0,89
17.226	VMware Inc	2.114.620	0,44
52.499	Volkswagen (Non-voting rights)	6.522.905	1,35
1.188	W R Berkley Corp	86.241	0,02
10.542	Walmart Inc	1.494.737	0,31
13.277	Walt Disney Co	1.153.538	0,24
4.789	Waste Management Inc	751.241	0,16
45.528	Wells Fargo & Co	1.879.873	0,39
4.716	Western Union Co	64.945	0,01
26.920	Wolters Kluwer NV	2.808.683	0,58
13.398	Yum China Holdings Inc	732.189	0,15
13.625	Yum! Brands Inc	1.745.139	0,36
15.140	Zillow Group Inc	487.663	0,10
3.927	Zoetis Inc	575.479	0,12
2.452	Zoom Video Communications Inc	166.119	0,03
Aktien insgesamt		461.505.597	95,80

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2022**

MSCI USA SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Funded Swaps* – 0,40 % (30. Juni 2022: 0,40 %)

Wäh- rung	Nominalbetrag	Bezeichnung	Fälligkeitstag	Zeitwert USD	% des Netto- inventarwerts
USD	17.978	MSCI USA Total Return Index Swap Klasse A USD	31. Jul 23	1.926.955	0,40
Funded Swaps zum beizulegenden Zeitwert				1.926.955	0,40

Unfunded Swaps* – 3,80 % (30. Juni 2022: 8,47 %)

Wäh- rung	Nominalbetrag	Bezeichnung	Fälligkeitstag	Zeitwert USD	% des Netto- inventarwerts
USD	4.476.399	MSCI USA Total Return Index Total Return Swap Klasse A USD	31. Jul 23	18.305.786	3,80
Unfunded Swaps zum beizulegenden Zeitwert				18.305.786	3,80

Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten

- -

Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnendes Nettovermögen

481.738.338 100,00

Einstufung

* Im Freiverkehr gehandelte derivative Finanzinstrumente.

Gegenpartei der Swap-Kontrakte ist die UBS AG.

Analyse des Gesamtvermögens

Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind
Im Freiverkehr gehandelte derivative Finanzinstrumente
Sonstige Vermögenswerte

**% des
Gesamtver-
mögens**
93,10
4,08
2,82
100,00

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2022**

MSCI EMERGING MARKETS SF UCITS ETF

Aktien – 89,44 % (30. Juni 2022: 92,82 %)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
44.477	Advanced Micro Devices Inc	2.880.788	3,12
37.928	Alphabet Inc - Class A	3.346.424	3,62
33.549	Amazon.com Inc	2.818.116	3,05
27.170	Apple Inc	3.530.166	3,82
157.242	Bank of America Corp	5.207.848	5,63
11.819	Berkshire Hathaway Inc	3.651.069	3,95
41.418	BioMarin Pharmaceutical Inc	4.286.383	4,64
88.104	BP PLC	3.077.461	3,33
13.964	Chevron Corp	2.506.374	2,71
18.867	CVS Health Corp	1.758.188	1,90
187	Electricite de France SA	2.390	0,00
155	Holcim AG	8.058	0,01
20.792	Incyte Corp	1.669.985	1,81
117.339	Intel Corp	3.101.260	3,35
3.337	MercadoLibre Inc	2.823.674	3,05
29.267	Meta Platforms Inc	3.521.979	3,81
12.780	Microsoft Corp	3.064.937	3,32
36.625	Morgan Stanley	3.113.887	3,37
2.466	O'Reilly Automotive Inc	2.081.265	2,25
36.755	PayPal Holdings Inc	2.617.689	2,83
11.639	PepsiCo Inc	2.102.637	2,27
39.801	Pfizer Inc	2.039.398	2,21
47.960	Pinduoduo Inc	3.911.160	4,23
33.480	Salesforce Inc	4.439.139	4,80
35.610	Texas Instruments Inc	5.883.490	6,36
7.478	Thermo Fisher Scientific Inc	4.117.951	4,45
70.115	Verizon Communications Inc	2.762.548	2,99
27.213	Walt Disney Co	2.364.306	2,56
Aktien insgesamt		82.688.570	89,44

Funded Swaps* – 4,00 % (30. Juni 2022: 1,00 %)

Wäh- rung	Nominalbetrag	Bezeichnung	Fälligkeitstag	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
USD	82.148	MSCI Emerging Markets Total Return Net Index Swap Klasse A USD	31. Jul 23	3.697.914	4,00
Funded Swaps zum beizulegenden Zeitwert				3.697.914	4,00

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2022**

MSCI EMERGING MARKETS SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Unfunded Swaps* – 6,56 % (30. Juni 2022: 6,18 %)

Wäh- rung	Nominalbetrag	Bezeichnung	Fälligkeitstag	Zeitwert USD	% des Netto- inventarwerts
USD	1.971.554	MSCI Emerging Markets Total Return Net Index Total Return Swap Klasse A USD	31. Jul 23	6.060.812	6,56
Unfunded Swaps zum beizulegenden Zeitwert				6.060.812	6,56
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten				510	0,00
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnendes Nettovermögen				92.447.806	100,00

Einstufung

* Im Freiverkehr gehandelte derivative Finanzinstrumente.

Gegenpartei der Swap-Kontrakte ist die UBS AG.

Analyse des Gesamtvermögens

Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind
Im Freiverkehr gehandelte derivative Finanzinstrumente
Sonstige Vermögenswerte

% des Gesamtver- mögens
83,82
9,89
6,29
100,00

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2022**

MSCI AC ASIA EX JAPAN SF UCITS ETF

Aktien – 97,62 % (30. Juni 2022: 93,13 %)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
2.485	3M Co	297.973	0,16
5.250	Aalberts NV	202.990	0,11
1.364	ABB Ltd	41.357	0,02
5.573	Abbott Laboratories	611.835	0,33
7.190	AbbVie Inc	1.161.971	0,62
17.509	Accelleron Industries AG	362.312	0,19
2.786	Accenture PLC	743.329	0,40
10.449	Achillion Pharmaceuticals Inc	-	0,00
19.527	Activision Blizzard Inc	1.494.775	0,80
4.145	Adobe Inc	1.395.004	0,75
8.954	Advanced Micro Devices Inc	579.969	0,31
4.549	AerCap Holdings NV	265.291	0,14
6.054	Air Liquide SA	855.511	0,46
5.686	Alcon Inc	388.312	0,21
15.996	Alibaba Group Holding Ltd	1.409.090	0,76
814	Align Technology Inc	171.590	0,09
1.227	Allianz SE	263.023	0,14
1.244	Allstate Corp	168.665	0,09
50	Alnylam Pharmaceuticals Inc	11.942	0,01
15.062	Alphabet Inc - Class A	1.328.881	0,71
29.419	Alphabet Inc - Class C	2.610.365	1,40
101.795	Amazon.com Inc	8.550.819	4,59
720	Ameriprise Financial Inc	224.151	0,12
451	AmerisourceBergen Corp	74.744	0,04
3.389	AMG Advanced Metallurgical Group NV	124.416	0,07
706	Analog Devices Inc	115.748	0,06
4.290	ANDRITZ AG	245.158	0,13
68.327	Apple Inc	8.877.670	4,76
6.517	Applied Materials Inc	634.596	0,34
626	Arista Networks Inc	75.994	0,04
1.224	ASM International NV	307.770	0,17
3.389	ASR Nederland NV	160.403	0,09
18.827	Assa Abloy AB	404.202	0,22
533	Automatic Data Processing Inc	127.265	0,07
129	AutoZone Inc	318.468	0,17
89.967	AXA SA	2.501.737	1,34
5.621	Baidu Inc	642.916	0,34
28.240	Banca Mediolanum SpA	235.028	0,13
38.254	Bank of America Corp	1.266.969	0,68
1.857	Baozun Inc	9.843	0,01
4.711	Baxter International Inc	240.121	0,13
6.677	Berkshire Hathaway Inc	2.062.494	1,11
1.339	Best Buy Co Inc	107.440	0,06
301	BioMarin Pharmaceutical Inc	31.174	0,02
664	Block Inc	41.716	0,02
33.888	BNP Paribas SA	1.925.919	1,03
9.413	Boliden AB	353.474	0,19
47	Booking Holdings Inc	94.853	0,05
381	Bouygues SA	11.397	0,01
7.773	BP PLC	271.526	0,15
376	Brighthouse Financial Inc	19.305	0,01

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2022**

MSCI AC ASIA EX JAPAN SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Aktien – 97,62 % (30. Juni 2022: 93,13 %) (Fortsetzung)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
2.665	Cadence Design Systems Inc	428.138	0,23
12.641	Carrefour SA	210.995	0,11
18.827	Castellum AB	228.121	0,12
1.538	Caterpillar Inc	368.446	0,20
235	Celanese Corp	24.028	0,01
4.763	Charles Schwab Corp	396.585	0,21
639	Check Point Software Technologies Ltd	80.617	0,04
9.007	Chevron Corp	1.616.602	0,87
38	Chipotle Mexican Grill Inc	52.245	0,03
433	Cie Financiere Richemont SA	56.161	0,03
2.436	Cigna Corp	807.219	0,43
11.394	Citigroup Inc	515.354	0,28
26.628	Coca-Cola Co	1.693.819	0,91
2.190	ConocoPhillips	258.414	0,14
761	Consolidated Edison Inc	72.562	0,04
413	Costco Wholesale Corp	188.400	0,10
3.400	Coupa Software Inc	269.157	0,14
1.318	Credicorp Ltd	178.784	0,10
6.251	CSX Corp	193.649	0,10
219	CVS Health Corp	20.440	0,01
508	CyberArk Software Ltd	65.905	0,04
12.468	Danone SA	655.106	0,35
7.154	Delivery Hero SE	341.911	0,18
804	Delta Air Lines Inc	26.421	0,01
2.691	Deutsche Telekom AG	53.524	0,03
2.036	DocuSign Inc	112.813	0,06
6.818	Dominion Energy Inc	418.063	0,22
5.115	Dropbox Inc	114.483	0,06
3.055	DTE Energy Co	359.002	0,19
1.188	Duke Energy Corp	122.404	0,07
124.108	E.ON SE	1.236.324	0,66
565	Eastman Chemical Co	45.998	0,02
1.654	Eckert & Ziegler Strahlen- und Medizintechnik AG	81.885	0,04
167.026	EDP - Energias de Portugal SA	829.973	0,45
5.778	Edwards Lifesciences Corp	431.087	0,23
565	Electronic Arts Inc	69.008	0,04
2.606	Eli Lilly & Co	953.519	0,51
62.793	Engie SA	897.212	0,48
3.235	EQT (US listed)	109.427	0,06
8.284	Etablissements Franz Colruyt NV	188.312	0,10
3.704	Euroapi SA	54.748	0,03
10.355	Evotec SE	168.641	0,09
2.259	EXOR (Netherlands listed)	164.683	0,09
392	Expedia Group Inc	34.304	0,02
40.453	Exxon Mobil Corp	4.462.020	2,39
1.051	Farfetch Ltd	4.970	0,00
113	FleetCor Technologies Inc	20.821	0,01
2.887	Fortinet Inc	141.128	0,08
69.111	Fortum OYJ	1.146.216	0,61
846	Fox - Class B	24.061	0,01
29.248	Fresenius SE & Co KGaA	819.382	0,44

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2022**

MSCI AC ASIA EX JAPAN SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Aktien – 97,62 % (30. Juni 2022: 93,13 %) (Fortsetzung)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
8.531	General Motors Co	286.992	0,15
2.269	Georg Fischer AG	138.809	0,07
12.484	Gilead Sciences Inc	1.071.753	0,57
158	Givaudan SA	484.654	0,26
2.699	Global Payments Inc	268.114	0,14
6.025	Greenvolt-Energias Renovaveis SA	50.152	0,03
5.366	Groupe Bruxelles Lambert SA	427.084	0,23
663	Guangzhou Automobile Group Co Ltd	447	0,00
4.072	Heineken NV	381.913	0,20
107	Holcim AG	5.575	0,00
4.330	Holcim (Switzerland listed)	224.092	0,12
1.842	Home Depot Inc	581.680	0,31
2.196	Huntington Ingalls Industries Inc	506.572	0,27
190	IDEXX Laboratories Inc	77.359	0,04
2.071	IMCD NV	294.293	0,16
3.359	Incyte Corp	269.823	0,14
12.599	Industrivarden - Class A	306.527	0,16
43.123	Intel Corp	1.139.740	0,61
1.432	International Business Machines Corp	201.693	0,11
658.943	Intesa Sanpaolo SpA	1.461.367	0,78
1.126	Intuit Inc	438.255	0,24
769	IQVIA Holdings Inc	157.604	0,08
6.645	JD.com Inc	372.977	0,20
17.969	Juniper Networks Inc	574.284	0,31
1.558	Kellogg Co	110.990	0,06
1.642	Kimberly-Clark Corp	222.903	0,12
2.040	Kinder Morgan Inc	36.875	0,02
376	KLA Corp	141.967	0,08
37.503	Koninklijke Ahold Delhaize NV	1.074.267	0,58
45.762	Koninklijke Philips NV	683.945	0,37
4.707	Koninklijke Vopak NV	139.396	0,07
5.460	Kroger Co	243.399	0,13
5.010	Liberty Global - Class A	94.841	0,05
1.035	Liberty Media Corp - Liberty SiriusXM - Class C	40.518	0,02
334	Linde PLC	108.935	0,06
753	Lonza Group AG	368.806	0,20
2.425	L’Oreal SA	863.358	0,46
1.250	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	907.122	0,49
15.649	Marathon Petroleum Corp	1.821.351	0,98
1.619	Marsh & McLennan Cos Inc	267.931	0,14
2.610	McDonald’s Corp	687.714	0,37
2.302	McKesson Corp	863.437	0,46
160.029	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA	1.534.385	0,82
3.604	Merck Co Inc	399.848	0,21
24.233	Meta Platforms Inc	2.916.182	1,56
20.463	Metso Outotec Oyj	209.914	0,11
4.417	Microchip Technology Inc	310.278	0,17
33.448	Microsoft Corp	8.021.555	4,30
1	Minebea Mitsumi Inc	20	0,00
376	Moderna Inc	67.634	0,04
237	Molina Healthcare Inc	78.434	0,04

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2022**

MSCI AC ASIA EX JAPAN SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Aktien – 97,62 % (30. Juni 2022: 93,13 %) (Fortsetzung)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
26	MongoDB Inc	5.033	0,00
7.110	Mosaic Co	311.911	0,17
16.956	Nestle SA	1.963.510	1,05
685	NetEase Inc	49.773	0,03
116	Netflix Inc	34.243	0,02
1.883	New Oriental Education & Technology Group Inc	65.555	0,04
1.006	NextEra Energy Inc	84.125	0,05
7.384	NOS SGPS SA	29.819	0,02
5.359	NVIDIA Corp	783.158	0,42
12	NVR Inc	53.667	0,03
7.352	OMV AG	377.409	0,20
909	ON Semiconductor Corp	56.729	0,03
771.676	Orange SA	7.643.558	4,10
952	O'Reilly Automotive Inc	803.885	0,43
1.288	Packaging Corp of America	164.715	0,09
784	Parker-Hannifin Corp	228.070	0,12
235	Paychex Inc	27.196	0,01
8.620	PepsiCo Inc	1.557.284	0,84
60.485	Pfizer Inc	3.099.280	1,66
8.634	Phillips 66	898.609	0,48
1.883	PICC Property & Casualty Co Ltd	1.787	0,00
1.979	Pinduoduo Inc	161.355	0,09
979	Pioneer Natural Resources Co	223.534	0,12
9.413	Porsche Automobil Holding SE	514.784	0,28
537	Procter & Gamble Co	81.322	0,04
830	Public Service Enterprise Group	50.856	0,03
2.826	Publicis Groupe SA	179.208	0,10
786	Qorvo Inc	71.252	0,04
904	QUALCOMM Inc	99.375	0,05
7.531	Raiffeisen Bank International AG	123.371	0,07
4.160	Robert Half International Inc	307.115	0,16
14.158	Roche Holding (Non-voting rights)	4.445.314	2,38
1.419	Royal Caribbean Cruises Ltd	70.159	0,04
11.829	RWE AG	525.075	0,28
375	S&P Global Inc	125.752	0,07
18.930	Salesforce Inc	2.509.917	1,35
10.752	Sampo Oyj	560.232	0,30
59.419	Sanofi	5.697.188	3,05
24.350	Schneider Electric SE	3.397.055	1,82
3.545	SEI Investments Co	206.681	0,11
2.902	ServiceNow Inc	1.126.666	0,60
1.924	Siemens (Germany listed)	266.157	0,14
968	SKF AB	14.792	0,01
10.210	Snap Inc	91.384	0,05
1.948	Southern Co	139.095	0,07
20.710	SSAB - Class B	107.727	0,06
11.673	Stora Enso Oyj	163.819	0,09
3.012	Swatch Group (Bearer)	856.288	0,46
47.067	Swedbank AB	800.906	0,43
245	Swiss Life Holding AG	126.131	0,07
2	Swiss Prime Site AG	163	0,00

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2022**

MSCI AC ASIA EX JAPAN SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Aktien – 97,62 % (30. Juni 2022: 93,13 %) (Fortsetzung)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
3.389	Symrise AG	367.643	0,20
1.317	Synopsys Inc	420.403	0,23
18.740	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	1.395.983	0,75
1.323	Take-Two Interactive Software Inc	137.767	0,07
14.120	TeamViewer AG	181.516	0,10
28.240	Tele2 AB	230.650	0,12
145.909	Telefonaktiebolaget LM Ericsson	852.809	0,46
4.282	Tesla Inc	527.413	0,28
1.439	Texas Instruments Inc	237.792	0,13
2.163	Thermo Fisher Scientific Inc	1.190.961	0,64
14.018	T-Mobile US Inc	1.962.564	1,05
261.898	TotalEnergies SE	16.393.322	8,79
1.508	Tyson Foods Inc	93.904	0,05
4.317	UCB SA	338.916	0,18
581	UGI Corp	21.548	0,01
422	Ulta Salon Cosmetics & Fragrance Inc	197.765	0,11
2.035	Union Pacific Corp	421.338	0,23
79	United Rentals Inc	28.104	0,02
1.586	UnitedHealth Group Inc	841.125	0,45
28.964	Universal Music Group NV	695.819	0,37
9.037	UPM-Kymmene Oyj	336.888	0,18
15.742	Valero Energy Corp	1.996.982	1,07
21	Vallourec SA	270	0,00
6.401	Valmet Oyj	171.884	0,09
10.391	Veolia Environnement SA	266.144	0,14
139	VeriSign Inc	28.579	0,02
32.993	Verizon Communications Inc	1.299.921	0,70
2.398	Vertex Pharmaceuticals Inc	692.572	0,37
13.034	Vinci SA	1.297.720	0,70
807	Visa Inc	167.736	0,09
177.078	Vivendi SE	1.684.624	0,90
6.795	VMware Inc	834.175	0,45
20.710	Volkswagen (Non-voting rights)	2.573.156	1,38
469	W R Berkley Corp	34.020	0,02
4.159	Walmart Inc	589.644	0,32
5.238	Walt Disney Co	455.048	0,24
1.889	Waste Management Inc	296.349	0,16
17.960	Wells Fargo & Co	741.572	0,40
1.860	Western Union Co	25.620	0,01
10.619	Wolters Kluwer NV	1.107.969	0,59
5.285	Yum China Holdings Inc	288.834	0,16
5.375	Yum! Brands Inc	688.423	0,37
5.972	Zillow Group Inc	192.373	0,10
1.549	Zoetis Inc	227.015	0,12
967	Zoom Video Communications Inc	65.531	0,04
Aktien insgesamt		182.054.732	97,62

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2022**

MSCI AC ASIA EX JAPAN SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Funded Swaps* – 0,40 % (30. Juni 2022: 0,40 %)

Wäh- rung	Nominalbetrag	Bezeichnung	Fälligkeitstag	Zeitwert USD	% des Netto- inventarwerts
USD	5.105	MSCI AC Asia Ex Japan Total Return Net Index Total Return Swap Klasse A USD	31. Jul 23	743.827	0,40
Funded Swaps zum beizulegenden Zeitwert				743.827	0,40

Unfunded Swaps* – 1,98 % (30. Juni 2022: 6,49 %)

Wäh- rung	Nominalbetrag	Bezeichnung	Fälligkeitstag	Zeitwert USD	% des Netto- inventarwerts
USD	1.274.831	MSCI AC Asia Ex Japan Total Return Net Index Total Return Swap Klasse A USD	31. Jul 23	3.702.068	1,98
Unfunded Swaps zum beizulegenden Zeitwert				3.702.068	1,98

Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten

- -

Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnendes Nettovermögen

186.500.627 100,00

Einstufung

* Im Freiverkehr gehandelte derivative Finanzinstrumente.

Gegenpartei der Swap-Kontrakte ist die UBS AG.

Analyse des Gesamtvermögens

Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind
Im Freiverkehr gehandelte derivative Finanzinstrumente
Sonstige Vermögenswerte

**% des
Gesamtver-
mögens**
93,61
2,29
4,10
100,00

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2022**

MSCI ACWI SF UCITS ETF

Aktien – 96,37 % (30. Juni 2022: 96,12 %)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
71.232	3M Co	8.542.096	0,16
150.498	Aalberts NV	5.819.204	0,11
39.091	ABB Ltd	1.185.584	0,02
159.757	Abbott Laboratories	17.539.712	0,32
206.118	AbbVie Inc	33.310.687	0,62
501.939	Accelleron Industries AG	10.386.534	0,19
79.858	Accenture PLC	21.309.296	0,39
299.544	Achillion Pharmaceuticals Inc	-	0,00
559.782	Activision Blizzard Inc	42.851.295	0,79
118.834	Adobe Inc	39.991.132	0,74
256.696	Advanced Micro Devices Inc	16.626.194	0,31
130.405	AerCap Holdings NV	7.605.209	0,14
173.564	Air Liquide SA	24.525.262	0,45
163.014	Alcon Inc	11.131.898	0,21
458.564	Alibaba Group Holding Ltd	40.394.940	0,75
23.324	Align Technology Inc	4.919.025	0,09
35.167	Allianz SE	7.540.178	0,14
35.658	Allstate Corp	4.835.176	0,09
1.441	Alnylam Pharmaceuticals Inc	342.337	0,01
431.775	Alphabet Inc - Class A	38.095.549	0,70
843.371	Alphabet Inc - Class C	74.832.340	1,38
2.918.210	Amazon.com Inc	245.129.644	4,53
20.637	Ameriprise Financial Inc	6.425.819	0,12
12.931	AmerisourceBergen Corp	2.142.729	0,04
97.149	AMG Advanced Metallurgical Group NV	3.566.686	0,07
20.229	Analog Devices Inc	3.318.199	0,06
122.973	ANDRITZ AG	7.028.050	0,13
1.958.744	Apple Inc	254.499.606	4,70
186.817	Applied Materials Inc	18.192.223	0,34
17.953	Arista Networks Inc	2.178.558	0,04
35.082	ASM International NV	8.822.969	0,16
97.150	ASR Nederland NV	4.598.329	0,08
539.719	Assa Abloy AB	11.587.429	0,21
15.274	Automatic Data Processing Inc	3.648.361	0,07
3.702	AutoZone Inc	9.129.641	0,17
2.579.127	AXA SA	71.718.267	1,32
161.136	Baidu Inc	18.430.725	0,34
809.579	Banca Mediolanum SpA	6.737.650	0,12
1.096.640	Bank of America Corp	36.320.700	0,67
53.238	Baozun Inc	282.164	0,01
135.053	Baxter International Inc	6.883.646	0,13
191.409	Berkshire Hathaway Inc	59.126.334	1,09
38.399	Best Buy Co Inc	3.080.017	0,06
8.636	BioMarin Pharmaceutical Inc	893.689	0,02
19.031	Block Inc	1.195.877	0,02
971.495	BNP Paribas SA	55.211.057	1,02
269.860	Boliden AB	10.133.173	0,19
1.349	Booking Holdings Inc	2.719.213	0,05
10.917	Bouygues SA	326.712	0,01
222.844	BP PLC	7.783.947	0,14
10.794	Brighthouse Financial Inc	553.428	0,01

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2022**

MSCI ACWI SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Aktien – 96,37 % (30. Juni 2022: 96,12 %) (Fortsetzung)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
76.404	Cadence Design Systems Inc	12.273.585	0,23
362.374	Carrefour SA	6.048.669	0,11
539.719	Castellum AB	6.539.619	0,12
44.091	Caterpillar Inc	10.562.380	0,20
6.737	Celanese Corp	688.823	0,01
136.549	Charles Schwab Corp	11.369.069	0,21
18.319	Check Point Software Technologies Ltd	2.311.076	0,04
258.197	Chevron Corp	46.343.756	0,86
1.079	Chipotle Mexican Grill Inc	1.497.711	0,03
12.423	Cie Financiere Richemont SA	1.609.975	0,03
2	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA	60	0,00
69.840	Cigna Corp	23.140.859	0,43
326.638	Citigroup Inc	14.773.843	0,27
763.361	Coca-Cola Co	48.557.372	0,90
62.780	ConocoPhillips	7.408.058	0,14
21.825	Consolidated Edison Inc	2.080.157	0,04
11.831	Costco Wholesale Corp	5.400.937	0,10
97.461	Coupa Software Inc	7.716.022	0,14
37.780	Credicorp Ltd	5.125.283	0,09
179.194	CSX Corp	5.551.425	0,10
6.288	CVS Health Corp	585.954	0,01
14.572	CyberArk Software Ltd	1.889.314	0,03
357.440	Danone SA	18.780.170	0,35
205.093	Delivery Hero SE	9.801.705	0,18
23.050	Delta Air Lines Inc	757.416	0,01
77.139	Deutsche Telekom AG	1.534.399	0,03
58.356	DocuSign Inc	3.234.064	0,06
195.446	Dominion Energy Inc	11.984.773	0,22
146.645	Dropbox Inc	3.281.915	0,06
87.566	DTE Energy Co	10.291.658	0,19
34.071	Duke Energy Corp	3.509.014	0,06
3.557.843	E.ON SE	35.442.193	0,65
16.192	Eastman Chemical Co	1.318.642	0,02
47.404	Eckert & Ziegler Strahlen- und Medizintechnik AG	2.347.442	0,04
4.788.207	EDP - Energias de Portugal SA	23.793.148	0,44
165.637	Edwards Lifesciences Corp	12.358.148	0,23
16.192	Electronic Arts Inc	1.978.287	0,04
74.718	Eli Lilly & Co	27.334.908	0,50
1.800.121	Engie SA	25.720.735	0,47
92.728	EQT (US listed)	3.136.973	0,06
237.477	Etablissements Franz Colruyt NV	5.398.414	0,10
106.180	Euroapi SA	1.569.491	0,03
296.846	Evotec SE	4.834.496	0,09
64.766	EXOR (Netherlands listed)	4.721.021	0,09
11.226	Expedia Group Inc	983.412	0,02
1.159.696	Exxon Mobil Corp	127.914.468	2,36
30.124	Farfetch Ltd	142.486	0,00
3.250	FleetCor Technologies Inc	596.896	0,01
82.752	Fortinet Inc	4.045.768	0,07
1.981.242	Fortum OYJ	32.859.016	0,61
24.245	Fox - Class B	689.763	0,01

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2022**

MSCI ACWI SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Aktien – 96,37 % (30. Juni 2022: 96,12 %) (Fortsetzung)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
838.455	Fresenius SE & Co KGaA	23.489.555	0,43
244.569	General Motors Co	8.227.300	0,15
65.046	Georg Fischer AG	3.979.278	0,07
357.884	Gilead Sciences Inc	30.724.350	0,57
4.537	Givaudan SA	13.893.767	0,26
77.388	Global Payments Inc	7.686.142	0,14
172.710	Greenvolt-Energias Renovaveis SA	1.437.734	0,03
153.820	Groupe Bruxelles Lambert SA	12.243.376	0,23
18.998	Guangzhou Automobile Group Co Ltd	12.803	0,00
116.734	Heineken NV	10.948.444	0,20
3.069	Holcim AG	159.831	0,00
124.135	Holcim (Switzerland listed)	6.424.130	0,12
52.793	Home Depot Inc	16.675.256	0,31
62.953	Huntington Ingalls Industries Inc	14.522.091	0,27
5.436	IDEXX Laboratories Inc	2.217.693	0,04
59.369	IMCD NV	8.436.607	0,16
96.304	Incyte Corp	7.735.116	0,14
361.182	Industrivarden - Class A	8.787.330	0,16
1.236.223	Intel Corp	32.673.369	0,60
41.039	International Business Machines Corp	5.782.010	0,11
18.890.176	Intesa Sanpaolo SpA	41.893.585	0,77
32.279	Intuit Inc	12.563.630	0,23
22.051	IQVIA Holdings Inc	4.518.094	0,08
190.491	JD.com Inc	10.692.273	0,20
515.120	Juniper Networks Inc	16.463.235	0,30
44.663	Kellogg Co	3.181.782	0,06
47.072	Kimberly-Clark Corp	6.390.046	0,12
58.469	Kinder Morgan Inc	1.057.117	0,02
10.794	KLA Corp	4.069.808	0,08
1.075.108	Koninklijke Ahold Delhaize NV	30.796.443	0,57
1.311.872	Koninklijke Philips NV	19.606.927	0,36
134.930	Koninklijke Vopak NV	3.996.105	0,07
156.519	Kroger Co	6.977.599	0,13
143.627	Liberty Global - Class A	2.718.857	0,05
29.685	Liberty Media Corp - Liberty SiriusXM - Class C	1.161.557	0,02
9.574	Linde PLC	3.122.874	0,06
21.589	Lonza Group AG	10.572.711	0,20
69.516	L’Oreal SA	24.750.228	0,46
35.838	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	26.004.804	0,48
448.607	Marathon Petroleum Corp	52.213.386	0,96
46.416	Marsh & McLennan Cos Inc	7.680.897	0,14
74.811	McDonald’s Corp	19.714.952	0,36
65.986	McKesson Corp	24.752.497	0,46
4.587.614	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA	43.986.824	0,81
103.313	Merck Co Inc	11.462.586	0,21
694.693	Meta Platforms Inc	83.599.321	1,54
586.612	Metso Outotec Oyj	6.017.700	0,11
126.617	Microchip Technology Inc	8.894.850	0,16
958.873	Microsoft Corp	229.957.031	4,25
38	Minebea Mitsumi Inc	564	0,00
10.794	Moderna Inc	1.938.888	0,04

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2022**

MSCI ACWI SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Aktien – 96,37 % (30. Juni 2022: 96,12 %) (Fortsetzung)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
6.809	Molina Healthcare Inc	2.248.501	0,04
733	MongoDB Inc	144.272	0,00
203.822	Mosaic Co	8.941.661	0,17
486.077	Nestle SA	56.288.702	1,04
19.646	NetEase Inc	1.426.873	0,03
3.329	Netflix Inc	981.652	0,02
53.972	New Oriental Education & Technology Group Inc	1.879.303	0,03
28.847	NextEra Energy Inc	2.411.648	0,04
211.675	NOS SGPS SA	854.844	0,02
153.627	NVIDIA Corp	22.451.098	0,41
334	NVR Inc	1.538.512	0,03
210.760	OMV AG	10.819.322	0,20
26.074	ON Semiconductor Corp	1.626.259	0,03
22.121.928	Orange SA	219.120.860	4,05
27.304	O'Reilly Automotive Inc	23.045.277	0,43
36.916	Packaging Corp of America	4.721.959	0,09
22.468	Parker-Hannifin Corp	6.538.181	0,12
6.747	Paychex Inc	779.624	0,01
247.112	PepsiCo Inc	44.643.274	0,82
1	Pernod Ricard SA	106	0,00
1.733.963	Pfizer Inc	88.848.252	1,64
247.509	Phillips 66	25.760.773	0,48
53.972	PICC Property & Casualty Co Ltd	51.241	0,00
56.721	Pinduoduo Inc	4.625.619	0,09
28.058	Pioneer Natural Resources Co	6.408.132	0,12
269.860	Porsche Automobil Holding SE	14.757.510	0,27
15.382	Procter & Gamble Co	2.331.296	0,04
23.795	Public Service Enterprise Group	1.457.895	0,03
81.011	Publicis Groupe SA	5.137.412	0,09
22.535	Qorvo Inc	2.042.612	0,04
25.912	QUALCOMM Inc	2.848.816	0,05
215.888	Raiffeisen Bank International AG	3.536.733	0,07
119.249	Robert Half International Inc	8.804.181	0,16
405.864	Roche Holding (Non-voting rights)	127.435.535	2,35
40.689	Royal Caribbean Cruises Ltd	2.011.279	0,04
339.121	RWE AG	15.052.522	0,28
10.763	S&P Global Inc	3.604.987	0,07
542.671	Salesforce Inc	71.952.755	1,33
308.242	Sampo Oyj	16.060.388	0,30
1.703.386	Sanofi	163.323.493	3,02
698.044	Schneider Electric SE	97.384.694	1,80
101.630	SEI Investments Co	5.925.011	0,11
83.186	ServiceNow Inc	32.298.574	0,60
55.147	Siemens (Germany listed)	7.630.028	0,14
27.763	SKF AB	424.053	0,01
292.708	Snap Inc	2.619.738	0,05
55.839	Southern Co	3.987.489	0,07
593.691	SSAB - Class B	3.088.254	0,06
334.626	Stora Enso Oyj	4.696.252	0,09
86.355	Swatch Group (Bearer)	24.547.546	0,45
1.349.298	Swedbank AB	22.959.892	0,42

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2022**

MSCI ACWI SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Aktien – 96,37 % (30. Juni 2022: 96,12 %) (Fortsetzung)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
7.016	Swiss Life Holding AG	3.615.862	0,07
54	Swiss Prime Site AG	4.675	0,00
97.150	Symrise AG	10.539.350	0,19
37.746	Synopsys Inc	12.051.860	0,22
537.243	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	40.019.198	0,74
37.928	Take-Two Interactive Software Inc	3.949.411	0,07
404.790	TeamViewer AG	5.203.577	0,10
809.579	Tele2 AB	6.612.138	0,12
4.182.825	Telefonaktiebolaget LM Ericsson	24.447.817	0,45
122.744	Tesla Inc	15.119.545	0,28
41.259	Texas Instruments Inc	6.816.875	0,13
61.998	Thermo Fisher Scientific Inc	34.141.734	0,63
401.869	T-Mobile US Inc	56.261.595	1,04
7.507.945	TotalEnergies SE	469.953.723	8,68
43.244	Tyson Foods Inc	2.691.968	0,05
123.758	UCB SA	9.715.826	0,18
16.664	UGI Corp	617.728	0,01
12.086	Ulta Salon Cosmetics & Fragrance Inc	5.669.401	0,10
58.331	Union Pacific Corp	12.078.651	0,22
2.267	United Rentals Inc	805.674	0,01
45.481	UnitedHealth Group Inc	24.112.867	0,45
830.315	Universal Music Group NV	19.947.312	0,37
259.065	UPM-Kymmene Oyj	9.657.701	0,18
451.271	Valero Energy Corp	57.248.265	1,06
591	Vallourec SA	7.739	0,00
183.505	Valmet Oyj	4.927.464	0,09
297.871	Veolia Environnement SA	7.629.667	0,14
3.988	VeriSign Inc	819.292	0,02
945.821	Verizon Communications Inc	37.265.343	0,69
68.752	Vertex Pharmaceuticals Inc	19.854.244	0,37
373.653	Vinci SA	37.202.233	0,69
23.145	Visa Inc	4.808.561	0,09
5.076.360	Vivendi SE	48.293.758	0,89
194.800	VMware Inc	23.913.626	0,44
593.691	Volkswagen (Non-voting rights)	73.765.658	1,36
13.439	W R Berkley Corp	975.269	0,02
119.215	Walmart Inc	16.903.546	0,31
150.150	Walt Disney Co	13.045.025	0,24
54.153	Waste Management Inc	8.495.566	0,16
514.869	Wells Fargo & Co	21.258.942	0,39
53.337	Western Union Co	734.446	0,01
304.431	Wolters Kluwer NV	31.762.583	0,59
151.512	Yum China Holdings Inc	8.280.111	0,15
154.086	Yum! Brands Inc	19.735.277	0,36
171.215	Zillow Group Inc	5.514.840	0,10
44.408	Zoetis Inc	6.507.929	0,12
27.732	Zoom Video Communications Inc	1.878.592	0,03
Aktien insgesamt		5.219.033.965	96,37

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2022**

MSCI ACWI SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Funded Swaps* – 0,40 % (30. Juni 2022: 0,40 %)

Wäh- rung	Nominal- betrag	Bezeichnung	Fälligkeitstag	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
CHF	743	MSCI ACWI Total Return Net Index Swap Klasse A (dist) CHF**	31. Jul 23	102.230	0,00
CHF	30.240	MSCI ACWI Total Return Net Index Swap Klasse A CHF**	31. Jul 23	4.706.823	0,09
EUR	359	MSCI ACWI Total Return Net Index Swap Klasse A (dist) EUR**	31. Jul 23	55.301	0,00
EUR	30.035	MSCI ACWI Total Return Net Index Swap Klasse A EUR**	31. Jul 23	4.806.054	0,09
GBP	2.954	MSCI ACWI Total Return Net Index Swap Klasse A (dist) GBP**	31. Jul 23	551.068	0,01
JPY	45.690	MSCI ACWI Total Return Net Index Swap Klasse A JPY**	31. Jul 23	555.334	0,01
SGD	22	MSCI ACWI Total Return Net Index Swap Klasse A SGD**	31. Jul 23	1.919	0,00
USD	852	MSCI ACWI Total Return Net Index Swap Klasse A (dist) USD	31. Jul 23	140.687	0,00
USD	7.296	MSCI ACWI Total Return Net Index Swap Klasse A (dist) USD	31. Jul 23	838.766	0,02
USD	42.621	MSCI ACWI Total Return Net Index Swap Klasse A USD	31. Jul 23	7.284.673	0,13
USD	19.609	MSCI ACWI Total Return Net Index Swap Klasse A USD	31. Jul 23	2.601.950	0,05
Funded Swaps zum beizulegenden Zeitwert				21.644.805	0,40

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2022**

MSCI ACWI SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Unfunded Swaps* – 3,23 % (30. Juni 2022: 3,50 %)

Wäh- rung	Nominalbetrag	Bezeichnung	Fälligkeitstag	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
CHF	7.529.784	MSCI ACWI Total Return Net Index Total Return Swap Klasse A CHF**	31. Jul 23	34.798.638	0,64
CHF	185.040	MSCI ACWI Total Return Net Index Total Return Swap Klasse A CHF**	31. Jul 23	755.804	0,01
EUR	89.262	MSCI ACWI Total Return Net Index Total Return Swap Klasse A (dist) EUR**	31. Jul 23	438.883	0,01
EUR	7.478.681	MSCI ACWI Total Return Net Index Total Return Swap Klasse A EUR**	31. Jul 23	38.143.399	0,71
GBP	735.440	MSCI ACWI Total Return Net Index Total Return Swap Klasse A GBP**	31. Jul 23	4.051.068	0,08
JPY	11.376.891	MSCI ACWI Total Return Net Index Total Return Swap Klasse A JPY**	31. Jul 23	5.522.956	0,10
SGD	14.978	MSCI ACWI Total Return Net Index Total Return Swap Klasse A SGD**	31. Jul 23	48.608	0,00
USD	1.816.788	MSCI ACWI Total Return Net Index Total Return Swap Klasse A (dist) USD	31. Jul 23	6.669.114	0,12
USD	10.633.876	MSCI ACWI Total Return Net Index Total Return Swap Klasse A USD	31. Jul 23	62.774.860	1,16
USD	212.102	MSCI ACWI Total Return Net Index Total Return Swap Klasse A USD	31. Jul 23	1.097.433	0,02
USD	4.882.655	MSCI ACWI Total Return Net Index Total Return Swap Klasse A USD	31. Jul 23	20.688.858	0,38

Unfunded Swaps zum beizulegenden Zeitwert

174.989.621 3,23

Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten

(3.169) (0,00)

Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnendes Nettovermögen

5.415.665.222 100,00

Einstufung

* Im Freiverkehr gehandelte derivative Finanzinstrumente.

** Die abgesicherte Aktienklasse investiert in Swaps mit einem Engagement in einer währungsgesicherten Version des Referenzindex.

Gegenpartei der Swap-Kontrakte ist die UBS AG.

Analyse des Gesamtvermögens

Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind
Im Freiverkehr gehandelte derivative Finanzinstrumente
Sonstige Vermögenswerte

**% des Gesamtver-
mögens**

93,71

3,53

2,76

100,00

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2022**

CMCI EX-AGRICULTURE SF UCITS ETF

Aktien – 96,95 % (30. Juni 2022: 95,09 %)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
1.512	3M Co	181.327	0,16
3.195	Aalberts NV	123.527	0,11
830	ABB Ltd	25.167	0,02
3.391	Abbott Laboratories	372.323	0,33
4.375	AbbVie Inc	707.100	0,62
10.655	Accelleron Industries AG	220.479	0,19
1.695	Accenture PLC	452.342	0,40
6.359	Achillion Pharmaceuticals Inc	-	0,00
11.883	Activision Blizzard Inc	909.623	0,80
2.523	Adobe Inc	848.909	0,74
5.449	Advanced Micro Devices Inc	352.931	0,31
2.768	AerCap Holdings NV	161.439	0,14
3.684	Air Liquide SA	520.608	0,46
3.460	Alcon Inc	236.302	0,21
9.734	Alibaba Group Holding Ltd	857.481	0,75
495	Align Technology Inc	104.418	0,09
747	Allianz SE	160.059	0,14
757	Allstate Corp	102.638	0,09
31	Alnylam Pharmaceuticals Inc	7.267	0,01
9.165	Alphabet Inc - Class A	808.671	0,71
17.903	Alphabet Inc - Class C	1.588.498	1,39
61.946	Amazon.com Inc	5.203.472	4,55
438	Ameriprise Financial Inc	136.404	0,12
274	AmerisourceBergen Corp	45.485	0,04
2.062	AMG Advanced Metallurgical Group NV	75.712	0,07
429	Analog Devices Inc	70.437	0,06
2.610	ANDRITZ AG	149.187	0,13
41.579	Apple Inc	5.402.372	4,73
3.966	Applied Materials Inc	386.174	0,34
381	Arista Networks Inc	46.245	0,04
745	ASM International NV	187.289	0,16
2.062	ASR Nederland NV	97.611	0,09
11.457	Assa Abloy AB	245.971	0,22
324	Automatic Data Processing Inc	77.445	0,07
79	AutoZone Inc	193.800	0,17
54.748	AXA SA	1.522.394	1,33
3.421	Baidu Inc	391.237	0,34
17.185	Banca Mediolanum SpA	143.023	0,12
23.279	Bank of America Corp	770.995	0,67
1.130	Baozun Inc	5.990	0,01
2.867	Baxter International Inc	146.122	0,13
4.063	Berkshire Hathaway Inc	1.255.100	1,10
815	Best Buy Co Inc	65.381	0,06
183	BioMarin Pharmaceutical Inc	18.971	0,02
404	Block Inc	25.385	0,02
20.622	BNP Paribas SA	1.171.989	1,03
5.728	Boliden AB	215.101	0,19
29	Booking Holdings Inc	57.722	0,05
232	Bouygues SA	6.935	0,01
4.730	BP PLC	165.233	0,14
229	Brighthouse Financial Inc	11.748	0,01

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2022**

CMCI EX-AGRICULTURE SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Aktien – 96,95 % (30. Juni 2022: 95,09 %) (Fortsetzung)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
1.622	Cadence Design Systems Inc	260.537	0,23
7.692	Carrefour SA	128.398	0,11
11.457	Castellum AB	138.819	0,12
936	Caterpillar Inc	224.212	0,20
143	Celanese Corp	14.622	0,01
2.899	Charles Schwab Corp	241.336	0,21
389	Check Point Software Technologies Ltd	49.058	0,04
5.481	Chevron Corp	983.759	0,86
23	Chipotle Mexican Grill Inc	31.793	0,03
264	Cie Financiere Richemont SA	34.176	0,03
1.483	Cigna Corp	491.221	0,43
6.934	Citigroup Inc	313.611	0,27
16.204	Coca-Cola Co	1.030.748	0,90
1.333	ConocoPhillips	157.254	0,14
463	Consolidated Edison Inc	44.156	0,04
251	Costco Wholesale Corp	114.648	0,10
2.069	Coupa Software Inc	163.791	0,14
802	Credicorp Ltd	108.797	0,10
3.804	CSX Corp	117.842	0,10
133	CVS Health Corp	12.438	0,01
309	CyberArk Software Ltd	40.105	0,03
7.588	Danone SA	398.655	0,35
4.354	Delivery Hero SE	208.065	0,18
489	Delta Air Lines Inc	16.078	0,01
1.637	Deutsche Telekom AG	32.571	0,03
1.239	DocuSign Inc	68.651	0,06
4.149	Dominion Energy Inc	254.406	0,22
3.113	Dropbox Inc	69.667	0,06
1.859	DTE Energy Co	218.465	0,19
723	Duke Energy Corp	74.487	0,07
75.524	E.ON SE	752.347	0,66
344	Eastman Chemical Co	27.991	0,02
1.006	Eckert & Ziegler Strahlen- und Medizintechnik AG	49.830	0,04
101.641	EDP - Energias de Portugal SA	505.067	0,44
3.516	Edwards Lifesciences Corp	262.332	0,23
344	Electronic Arts Inc	41.994	0,04
1.586	Eli Lilly & Co	580.250	0,51
38.212	Engie SA	545.985	0,48
1.968	EQT (US listed)	66.590	0,06
5.041	Etablissements Franz Colruyt NV	114.594	0,10
2.254	Euroapi SA	33.316	0,03
6.301	Evotec SE	102.624	0,09
1.375	EXOR (Netherlands listed)	100.215	0,09
238	Expedia Group Inc	20.875	0,02
24.617	Exxon Mobil Corp	2.715.295	2,38
639	Farfetch Ltd	3.025	0,00
69	FleetCor Technologies Inc	12.671	0,01
1.757	Fortinet Inc	85.881	0,07
42.057	Fortum OYJ	697.512	0,61
515	Fox - Class B	14.642	0,01
17.798	Fresenius SE & Co KGaA	498.623	0,44

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2022**

CMCI EX-AGRICULTURE SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Aktien – 96,95 % (30. Juni 2022: 95,09 %) (Fortsetzung)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
5.192	General Motors Co	174.644	0,15
1.381	Georg Fischer AG	84.470	0,07
7.597	Gilead Sciences Inc	652.199	0,57
96	Givaudan SA	294.930	0,26
1.643	Global Payments Inc	163.157	0,14
3.666	Greenvolt-Energias Renovaveis SA	30.519	0,03
3.265	Groupe Bruxelles Lambert SA	259.895	0,23
403	Guangzhou Automobile Group Co Ltd	272	0,00
2.478	Heineken NV	232.407	0,20
65	Holcim AG	3.393	0,00
2.635	Holcim (Switzerland listed)	136.368	0,12
1.121	Home Depot Inc	353.973	0,31
1.336	Huntington Ingalls Industries Inc	308.267	0,27
115	IDEXX Laboratories Inc	47.076	0,04
1.260	IMCD NV	179.088	0,16
2.044	Incyte Corp	164.197	0,14
7.667	Industrivarden - Class A	186.532	0,16
26.242	Intel Corp	693.572	0,61
871	International Business Machines Corp	122.737	0,11
400.990	Intesa Sanpaolo SpA	889.293	0,78
685	Intuit Inc	266.694	0,23
468	IQVIA Holdings Inc	95.908	0,08
4.044	JD.com Inc	226.969	0,20
10.935	Juniper Networks Inc	349.472	0,31
948	Kellogg Co	67.541	0,06
999	Kimberly-Clark Corp	135.644	0,12
1.241	Kinder Morgan Inc	22.440	0,02
229	KLA Corp	86.392	0,08
22.822	Koninklijke Ahold Delhaize NV	653.729	0,57
27.848	Koninklijke Philips NV	416.205	0,36
2.864	Koninklijke Vopak NV	84.827	0,07
3.322	Kroger Co	148.117	0,13
3.049	Liberty Global - Class A	57.714	0,05
630	Liberty Media Corp - Liberty SiriusXM - Class C	24.657	0,02
203	Linde PLC	66.291	0,06
458	Lonza Group AG	224.431	0,20
1.476	L'Oreal SA	525.384	0,46
761	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	552.016	0,48
9.523	Marathon Petroleum Corp	1.108.356	0,97
985	Marsh & McLennan Cos Inc	163.046	0,14
1.588	McDonald's Corp	418.498	0,37
1.401	McKesson Corp	525.432	0,46
97.383	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA	933.727	0,82
2.193	Merck Co Inc	243.321	0,21
14.747	Meta Platforms Inc	1.774.599	1,55
12.452	Metso Outotec Oyj	127.740	0,11
2.688	Microchip Technology Inc	188.815	0,17
20.354	Microsoft Corp	4.881.397	4,27
1	Minebea Mitsumi Inc	12	0,00
229	Moderna Inc	41.158	0,04
145	Molina Healthcare Inc	47.730	0,04

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2022**

CMCI EX-AGRICULTURE SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Aktien – 96,95 % (30. Juni 2022: 95,09 %) (Fortsetzung)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
16	MongoDB Inc	3.062	0,00
4.327	Mosaic Co	189.808	0,17
10.318	Nestle SA	1.194.865	1,05
417	NetEase Inc	30.289	0,03
71	Netflix Inc	20.838	0,02
1.146	New Oriental Education & Technology Group Inc	39.893	0,03
612	NextEra Energy Inc	51.193	0,04
4.493	NOS SGPS SA	18.146	0,02
3.261	NVIDIA Corp	476.579	0,42
7	NVR Inc	32.657	0,03
4.474	OMV AG	229.666	0,20
553	ON Semiconductor Corp	34.521	0,03
469.592	Orange SA	4.651.373	4,07
580	O'Reilly Automotive Inc	489.192	0,43
784	Packaging Corp of America	100.235	0,09
477	Parker-Hannifin Corp	138.789	0,12
143	Paychex Inc	16.549	0,01
5.246	PepsiCo Inc	947.662	0,83
36.808	Pfizer Inc	1.886.020	1,65
5.254	Phillips 66	546.835	0,48
1.146	PICC Property & Casualty Co Ltd	1.088	0,00
1.204	Pinduoduo Inc	98.190	0,09
596	Pioneer Natural Resources Co	136.028	0,12
5.728	Porsche Automobil Holding SE	313.264	0,27
327	Procter & Gamble Co	49.487	0,04
505	Public Service Enterprise Group	30.947	0,03
1.720	Publicis Groupe SA	109.054	0,10
478	Qorvo Inc	43.359	0,04
550	QUALCOMM Inc	60.473	0,05
4.583	Raiffeisen Bank International AG	75.076	0,07
2.531	Robert Half International Inc	186.890	0,16
8.615	Roche Holding (Non-voting rights)	2.705.129	2,37
864	Royal Caribbean Cruises Ltd	42.694	0,04
7.199	RWE AG	319.526	0,28
228	S&P Global Inc	76.525	0,07
11.520	Salesforce Inc	1.527.372	1,34
6.543	Sampo Oyj	340.921	0,30
36.159	Sanofi	3.466.938	3,03
14.818	Schneider Electric SE	2.067.227	1,81
2.157	SEI Investments Co	125.773	0,11
1.766	ServiceNow Inc	685.616	0,60
1.171	Siemens (Germany listed)	161.966	0,14
589	SKF AB	9.002	0,01
6.213	Snap Inc	55.610	0,05
1.185	Southern Co	84.644	0,07
12.603	SSAB - Class B	65.556	0,06
7.103	Stora Enso Oyj	99.689	0,09
1.833	Swatch Group (Bearer)	521.081	0,46
28.642	Swedbank AB	487.380	0,43
149	Swiss Life Holding AG	76.755	0,07
1	Swiss Prime Site AG	99	0,00

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2022**

CMCI EX-AGRICULTURE SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Aktien – 96,95 % (30. Juni 2022: 95,09 %) (Fortsetzung)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
2.062	Symrise AG	223.723	0,20
801	Synopsys Inc	255.830	0,22
11.404	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	849.505	0,74
805	Take-Two Interactive Software Inc	83.836	0,07
8.593	TeamViewer AG	110.459	0,10
17.185	Tele2 AB	140.359	0,12
88.791	Telefonaktiebolaget LM Ericsson	518.964	0,45
2.606	Tesla Inc	320.949	0,28
876	Texas Instruments Inc	144.705	0,13
1.316	Thermo Fisher Scientific Inc	724.741	0,63
8.531	T-Mobile US Inc	1.194.289	1,04
159.374	TotalEnergies SE	9.975.910	8,73
918	Tyson Foods Inc	57.144	0,05
2.627	UCB SA	206.242	0,18
354	UGI Corp	13.113	0,01
257	Ulta Salon Cosmetics & Fragrance Inc	120.347	0,11
1.238	Union Pacific Corp	256.399	0,22
48	United Rentals Inc	17.102	0,01
965	UnitedHealth Group Inc	511.854	0,45
17.625	Universal Music Group NV	423.430	0,37
5.499	UPM-Kymmene Oyj	205.008	0,18
9.579	Valero Energy Corp	1.215.234	1,06
13	Vallourec SA	164	0,00
3.895	Valmet Oyj	104.597	0,09
6.323	Veolia Environnement SA	161.958	0,14
85	VeriSign Inc	17.392	0,02
20.077	Verizon Communications Inc	791.047	0,69
1.459	Vertex Pharmaceuticals Inc	421.455	0,37
7.932	Vinci SA	789.708	0,69
491	Visa Inc	102.073	0,09
107.758	Vivendi SE	1.025.152	0,90
4.135	VMware Inc	507.625	0,44
12.603	Volkswagen (Non-voting rights)	1.565.855	1,37
285	W R Berkley Corp	20.702	0,02
2.531	Walmart Inc	358.819	0,31
3.187	Walt Disney Co	276.912	0,24
1.150	Waste Management Inc	180.339	0,16
10.929	Wells Fargo & Co	451.273	0,39
1.132	Western Union Co	15.590	0,01
6.462	Wolters Kluwer NV	674.238	0,59
3.216	Yum China Holdings Inc	175.765	0,15
3.271	Yum! Brands Inc	418.929	0,37
3.634	Zillow Group Inc	117.066	0,10
943	Zoetis Inc	138.147	0,12
589	Zoom Video Communications Inc	39.878	0,03
Aktien insgesamt		110.786.673	96,95

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2022**

CMCI EX-AGRICULTURE SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Funded Swaps* – 0,40 % (30. Juni 2022: 0,40 %)

Wäh- rung	Nominalbetrag	Bezeichnung	Fälligkeitstag	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
CHF	1.223	CMCI Ex-Agriculture Total Return Index Swap Klasse A CHF**	31. Jul 23	216.828	0,19
EUR	181	CMCI Ex-Agriculture Total Return Index Swap Klasse A EUR**	31. Jul 23	32.124	0,03
GBP	70	CMCI Ex-Agriculture Total Return Index Swap Klasse A GBP**	31. Jul 23	11.762	0,01
USD	955	CMCI Ex-Agriculture Total Return Index Swap Klasse A USD	31. Jul 23	196.358	0,17
Funded Swaps zum beizulegenden Zeitwert				457.072	0,40

Unfunded Swaps* – 2,65 % (30. Juni 2022: 4,53 %)

Wäh- rung	Nominalbetrag	Bezeichnung	Fälligkeitstag	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
CHF	304.577	CMCI Ex-Agriculture Total Return Net Index Total Return Swap Klasse A CHF**	31. Jul 23	1.445.367	1,27
EUR	44.946	CMCI Ex-Agriculture Total Return Net Index Total Return Swap Klasse A EUR**	31. Jul 23	214.470	0,19
GBP	17.430	CMCI Ex-Agriculture Total Return Net Index Total Return Swap Klasse A GBP**	31. Jul 23	71.515	0,06
USD	237.916	CMCI Ex-Agriculture Total Return Net Index Total Return Swap Klasse A USD	31. Jul 23	1.292.290	1,13
Unfunded Swaps zum beizulegenden Zeitwert				3.023.642	2,65

Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten

Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnendes Nettovermögen **114.267.387** **100,00**

Einstufung

* Im Freiverkehr gehandelte derivative Finanzinstrumente.

** Die abgesicherte Aktienklasse investiert in Swaps mit einem Engagement in einer währungsgesicherten Version des Referenzindex.

Gegenpartei der Swap-Kontrakte ist die UBS AG.

Analyse des Gesamtvermögens

Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind	94,67
Im Freiverkehr gehandelte derivative Finanzinstrumente	2,98
Sonstige Vermögenswerte	2,35
	100,00

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2022**

BLOOMBERG COMMODITY CMCI SF UCITS ETF

Aktien – 97,05 % (30. Juni 2022: 95,49 %)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
8.534	3M Co	1.023.405	0,16
18.031	Aalberts NV	697.183	0,11
4.683	ABB Ltd	142.042	0,02
19.140	Abbott Laboratories	2.101.385	0,33
24.694	AbbVie Inc	3.990.863	0,62
60.136	Accelleron Industries AG	1.244.383	0,19
9.568	Accenture PLC	2.553.009	0,40
35.888	Achillion Pharmaceuticals Inc	-	0,00
67.066	Activision Blizzard Inc	5.133.898	0,80
14.237	Adobe Inc	4.791.229	0,74
30.754	Advanced Micro Devices Inc	1.991.939	0,31
15.623	AerCap Holdings NV	911.160	0,14
20.794	Air Liquide SA	2.938.305	0,46
19.530	Alcon Inc	1.333.683	0,21
54.939	Alibaba Group Holding Ltd	4.839.609	0,75
2.794	Align Technology Inc	589.335	0,09
4.213	Allianz SE	903.368	0,14
4.272	Allstate Corp	579.289	0,09
173	Alnylam Pharmaceuticals Inc	41.015	0,01
51.730	Alphabet Inc - Class A	4.564.125	0,71
101.042	Alphabet Inc - Class C	8.965.460	1,39
349.623	Amazon.com Inc	29.368.319	4,56
2.472	Ameriprise Financial Inc	769.860	0,12
1.549	AmerisourceBergen Corp	256.715	0,04
11.639	AMG Advanced Metallurgical Group NV	427.315	0,07
2.424	Analog Devices Inc	397.544	0,06
14.733	ANDRITZ AG	842.012	0,13
234.672	Apple Inc	30.490.909	4,73
22.382	Applied Materials Inc	2.179.561	0,34
2.151	Arista Networks Inc	261.007	0,04
4.203	ASM International NV	1.057.056	0,16
11.639	ASR Nederland NV	550.913	0,09
64.662	Assa Abloy AB	1.388.258	0,22
1.830	Automatic Data Processing Inc	437.100	0,07
444	AutoZone Inc	1.093.798	0,17
308.998	AXA SA	8.592.372	1,33
19.305	Baidu Inc	2.208.135	0,34
96.993	Banca Mediolanum SpA	807.220	0,13
131.385	Bank of America Corp	4.351.485	0,68
6.378	Baozun Inc	33.805	0,01
16.180	Baxter International Inc	824.711	0,13
22.932	Berkshire Hathaway Inc	7.083.766	1,10
4.601	Best Buy Co Inc	369.009	0,06
1.035	BioMarin Pharmaceutical Inc	107.070	0,02
2.280	Block Inc	143.275	0,02
116.392	BNP Paribas SA	6.614.687	1,03
32.331	Boliden AB	1.214.028	0,19
162	Booking Holdings Inc	325.782	0,05
1.308	Bouygues SA	39.142	0,01
26.698	BP PLC	932.574	0,14
1.293	Brighthouse Financial Inc	66.305	0,01

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2022**

BLOOMBERG COMMODITY CMCI SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Aktien – 97,05 % (30. Juni 2022: 95,49 %) (Fortsetzung)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
9.154	Cadence Design Systems Inc	1.470.465	0,23
43.415	Carrefour SA	724.675	0,11
64.662	Castellum AB	783.494	0,12
5.282	Caterpillar Inc	1.265.450	0,20
807	Celanese Corp	82.526	0,01
16.360	Charles Schwab Corp	1.362.097	0,21
2.195	Check Point Software Technologies Ltd	276.884	0,04
30.934	Chevron Corp	5.552.320	0,86
129	Chipotle Mexican Grill Inc	179.437	0,03
1.488	Cie Financiere Richemont SA	192.887	0,03
1	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA	7	0,00
8.367	Cigna Corp	2.772.444	0,43
39.134	Citigroup Inc	1.770.014	0,27
91.456	Coca-Cola Co	5.817.527	0,90
7.522	ConocoPhillips	887.539	0,14
2.615	Consolidated Edison Inc	249.218	0,04
1.417	Costco Wholesale Corp	647.072	0,10
11.677	Coupa Software Inc	924.436	0,14
4.526	Credicorp Ltd	614.046	0,10
21.469	CSX Corp	665.101	0,10
753	CVS Health Corp	70.202	0,01
1.746	CyberArk Software Ltd	226.354	0,04
42.824	Danone SA	2.250.001	0,35
24.572	Delivery Hero SE	1.174.316	0,18
2.762	Delta Air Lines Inc	90.744	0,01
9.242	Deutsche Telekom AG	183.832	0,03
6.991	DocuSign Inc	387.464	0,06
23.416	Dominion Energy Inc	1.435.863	0,22
17.569	Dropbox Inc	393.197	0,06
10.491	DTE Energy Co	1.233.016	0,19
4.082	Duke Energy Corp	420.405	0,07
426.256	E.ON SE	4.246.233	0,66
1.940	Eastman Chemical Co	157.983	0,02
5.679	Eckert & Ziegler Strahlen- und Medizintechnik AG	281.241	0,04
573.662	EDP - Energias de Portugal SA	2.850.593	0,44
19.844	Edwards Lifesciences Corp	1.480.596	0,23
1.940	Electronic Arts Inc	237.013	0,04
8.952	Eli Lilly & Co	3.274.921	0,51
215.668	Engie SA	3.081.532	0,48
11.109	EQT (US listed)	375.832	0,06
28.451	Etablissements Franz Colruyt NV	646.769	0,10
12.721	Euroapi SA	188.036	0,03
35.564	Evotec SE	579.208	0,09
7.759	EXOR (Netherlands listed)	565.613	0,09
1.345	Expedia Group Inc	117.820	0,02
138.940	Exxon Mobil Corp	15.325.086	2,38
3.609	Farfetch Ltd	17.071	0,00
389	FleetCor Technologies Inc	71.513	0,01
9.914	Fortinet Inc	484.713	0,08
237.367	Fortum OYJ	3.936.750	0,61
2.905	Fox - Class B	82.639	0,01

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2022**

BLOOMBERG COMMODITY CMCI SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Aktien – 97,05 % (30. Juni 2022: 95,49 %) (Fortsetzung)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
100.453	Fresenius SE & Co KGaA	2.814.220	0,44
29.301	General Motors Co	985.691	0,15
7.793	Georg Fischer AG	476.747	0,07
42.877	Gilead Sciences Inc	3.681.001	0,57
544	Givaudan SA	1.664.574	0,26
9.272	Global Payments Inc	920.856	0,14
20.692	Greenvolt-Energias Renovaveis SA	172.251	0,03
18.429	Groupe Bruxelles Lambert SA	1.466.846	0,23
2.276	Guangzhou Automobile Group Co Ltd	1.534	0,00
13.986	Heineken NV	1.311.703	0,20
368	Holcim AG	19.149	0,00
14.872	Holcim (Switzerland listed)	769.658	0,12
6.325	Home Depot Inc	1.997.817	0,31
7.542	Huntington Ingalls Industries Inc	1.739.852	0,27
651	IDEXX Laboratories Inc	265.696	0,04
7.113	IMCD NV	1.010.767	0,16
11.538	Incyte Corp	926.723	0,14
43.272	Industrivarden - Class A	1.052.786	0,16
148.109	Intel Corp	3.914.508	0,61
4.917	International Business Machines Corp	692.727	0,11
2.263.181	Intesa Sanpaolo SpA	5.019.157	0,78
3.867	Intuit Inc	1.505.215	0,23
2.642	IQVIA Holdings Inc	541.301	0,08
22.822	JD.com Inc	1.281.012	0,20
61.715	Juniper Networks Inc	1.972.416	0,31
5.351	Kellogg Co	381.201	0,06
5.640	Kimberly-Clark Corp	765.574	0,12
7.005	Kinder Morgan Inc	126.650	0,02
1.293	KLA Corp	487.593	0,08
128.806	Koninklijke Ahold Delhaize NV	3.689.638	0,57
157.172	Koninklijke Philips NV	2.349.053	0,36
16.166	Koninklijke Vopak NV	478.763	0,07
18.752	Kroger Co	835.967	0,13
17.208	Liberty Global - Class A	325.739	0,05
3.556	Liberty Media Corp - Liberty SiriusXM - Class C	139.163	0,02
1.147	Linde PLC	374.143	0,06
2.586	Lonza Group AG	1.266.688	0,20
8.329	L’Oreal SA	2.965.258	0,46
4.294	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	3.115.565	0,48
53.746	Marathon Petroleum Corp	6.255.545	0,97
5.561	Marsh & McLennan Cos Inc	920.228	0,14
8.963	McDonald’s Corp	2.361.995	0,37
7.906	McKesson Corp	2.965.530	0,46
549.630	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA	5.269.942	0,82
12.378	Merck Co Inc	1.373.301	0,21
83.229	Meta Platforms Inc	10.015.809	1,55
70.280	Metso Outotec Oyj	720.964	0,11
15.170	Microchip Technology Inc	1.065.668	0,17
114.880	Microsoft Corp	27.550.530	4,28
5	Minebea Mitsumi Inc	68	0,00
1.293	Moderna Inc	232.293	0,04

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2022**

BLOOMBERG COMMODITY CMCI SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Aktien – 97,05 % (30. Juni 2022: 95,49 %) (Fortsetzung)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
816	Molina Healthcare Inc	269.387	0,04
88	MongoDB Inc	17.285	0,00
24.419	Mosaic Co	1.071.276	0,17
58.236	Nestle SA	6.743.797	1,05
2.354	NetEase Inc	170.950	0,03
399	Netflix Inc	117.609	0,02
6.466	New Oriental Education & Technology Group Inc	225.154	0,03
3.456	NextEra Energy Inc	288.933	0,04
25.360	NOS SGPS SA	102.417	0,02
18.406	NVIDIA Corp	2.689.805	0,42
40	NVR Inc	184.323	0,03
25.251	OMV AG	1.296.234	0,20
3.124	ON Semiconductor Corp	194.838	0,03
2.650.368	Orange SA	26.252.278	4,07
3.271	O'Reilly Automotive Inc	2.760.993	0,43
4.423	Packaging Corp of America	565.725	0,09
2.692	Parker-Hannifin Corp	783.322	0,12
808	Paychex Inc	93.405	0,01
29.606	PepsiCo Inc	5.348.590	0,83
1	Pernod Ricard SA	13	0,00
207.741	Pfizer Inc	10.644.669	1,65
29.653	Phillips 66	3.086.328	0,48
6.466	PICC Property & Casualty Co Ltd	6.139	0,00
6.796	Pinduoduo Inc	554.183	0,09
3.362	Pioneer Natural Resources Co	767.741	0,12
32.331	Porsche Automobil Holding SE	1.768.057	0,27
1.843	Procter & Gamble Co	279.306	0,04
2.851	Public Service Enterprise Group	174.666	0,03
9.706	Publicis Groupe SA	615.499	0,10
2.700	Qorvo Inc	244.720	0,04
3.104	QUALCOMM Inc	341.309	0,05
25.865	Raiffeisen Bank International AG	423.726	0,07
14.287	Robert Half International Inc	1.054.805	0,16
48.625	Roche Holding (Non-voting rights)	15.267.707	2,37
4.875	Royal Caribbean Cruises Ltd	240.966	0,04
40.629	RWE AG	1.803.402	0,28
1.289	S&P Global Inc	431.904	0,07
65.016	Salesforce Inc	8.620.465	1,34
36.930	Sampo Oyj	1.924.152	0,30
204.078	Sanofi	19.567.346	3,04
83.631	Schneider Electric SE	11.667.397	1,81
12.176	SEI Investments Co	709.860	0,11
9.966	ServiceNow Inc	3.869.605	0,60
6.607	Siemens (Germany listed)	914.133	0,14
3.326	SKF AB	50.805	0,01
35.069	Snap Inc	313.864	0,05
6.690	Southern Co	477.730	0,07
71.129	SSAB - Class B	369.995	0,06
40.091	Stora Enso Oyj	562.645	0,09
10.346	Swatch Group (Bearer)	2.940.975	0,46
161.656	Swedbank AB	2.750.763	0,43

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2022**

BLOOMBERG COMMODITY CMCI SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Aktien – 97,05 % (30. Juni 2022: 95,49 %) (Fortsetzung)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
841	Swiss Life Holding AG	433.207	0,07
6	Swiss Prime Site AG	560	0,00
11.639	Symrise AG	1.262.691	0,20
4.522	Synopsys Inc	1.443.901	0,22
64.366	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	4.794.592	0,74
4.544	Take-Two Interactive Software Inc	473.168	0,07
48.497	TeamViewer AG	623.427	0,10
96.993	Tele2 AB	792.182	0,12
501.133	Telefonaktiebolaget LM Ericsson	2.929.027	0,45
14.706	Tesla Inc	1.811.432	0,28
4.943	Texas Instruments Inc	816.711	0,13
7.428	Thermo Fisher Scientific Inc	4.090.428	0,63
48.147	T-Mobile US Inc	6.740.549	1,05
899.507	TotalEnergies SE	56.303.884	8,74
5.181	Tyson Foods Inc	322.517	0,05
14.827	UCB SA	1.164.027	0,18
1.996	UGI Corp	74.008	0,01
1.448	Ulta Salon Cosmetics & Fragrance Inc	679.236	0,11
6.988	Union Pacific Corp	1.447.111	0,22
272	United Rentals Inc	96.526	0,01
5.449	UnitedHealth Group Inc	2.888.897	0,45
99.478	Universal Music Group NV	2.389.833	0,37
31.038	UPM-Kymmene Oyj	1.157.063	0,18
54.066	Valero Energy Corp	6.858.760	1,06
71	Vallourec SA	927	0,00
21.985	Valmet Oyj	590.346	0,09
35.687	Veolia Environnement SA	914.090	0,14
478	VeriSign Inc	98.157	0,02
113.316	Verizon Communications Inc	4.464.660	0,69
8.237	Vertex Pharmaceuticals Inc	2.378.683	0,37
44.766	Vinci SA	4.457.099	0,69
2.773	Visa Inc	576.101	0,09
608.185	Vivendi SE	5.785.944	0,90
23.338	VMware Inc	2.865.027	0,44
71.129	Volkswagen (Non-voting rights)	8.837.664	1,37
1.610	W R Berkley Corp	116.844	0,02
14.283	Walmart Inc	2.025.168	0,31
17.989	Walt Disney Co	1.562.889	0,24
6.488	Waste Management Inc	1.017.831	0,16
61.685	Wells Fargo & Co	2.546.976	0,40
6.390	Western Union Co	87.992	0,01
36.473	Wolters Kluwer NV	3.805.389	0,59
18.152	Yum China Holdings Inc	992.018	0,15
18.461	Yum! Brands Inc	2.364.430	0,37
20.513	Zillow Group Inc	660.718	0,10
5.320	Zoetis Inc	779.697	0,12
3.323	Zoom Video Communications Inc	225.069	0,03
Aktien insgesamt		625.278.340	97,05

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2022**

BLOOMBERG COMMODITY CMCI SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Funded Swaps* – 0,40 % (30. Juni 2022: 0,70 %)

Wäh- rung	Nominalbetrag	Bezeichnung	Fälligkeitstag	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
CHF	9.514	Bloomberg Commodity Total Return Index Swap Klasse A CHF**	31. Jul 23	144.460	0,02
EUR	28.942	Bloomberg Commodity Total Return Index Swap Klasse A EUR**	31. Jul 23	439.443	0,07
GBP	996	Bloomberg Commodity Total Return Index Swap Klasse A GBP**	31. Jul 23	16.874	0,00
USD	121.404	Bloomberg Commodity Total Return Index Swap Klasse A USD	31. Jul 23	1.976.246	0,31
Funded Swaps zum beizulegenden Zeitwert				2.577.023	0,40

Unfunded Swaps* – 2,55 % (30. Juni 2022: 3,83 %)

Wäh- rung	Nominalbetrag	Bezeichnung	Fälligkeitstag	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
CHF	2.368.911	Bloomberg Commodity Total Return Index Total Return Swap Klasse A CHF**	31. Jul 23	810.423	0,13
EUR	7.206.618	Bloomberg Commodity Total Return Index Total Return Swap Klasse A EUR**	31. Jul 23	2.724.523	0,42
GBP	248.004	Bloomberg Commodity Total Return Index Total Return Swap Klasse A GBP**	31. Jul 23	94.445	0,02
USD	30.229.527	Bloomberg Commodity Total Return Index Total Return Swap Klasse A USD	31. Jul 23	12.771.365	1,98
Unfunded Swaps zum beizulegenden Zeitwert				16.400.756	2,55

Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten

- -

Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnendes Nettovermögen

644.256.119 100,00

Einstufung

* Im Freiverkehr gehandelte derivative Finanzinstrumente.

** Die abgesicherte Aktienklasse investiert in Swaps mit einem Engagement in einer währungsgesicherten Version des Referenzindex.

Gegenpartei der Swap-Kontrakte ist die UBS AG.

Analyse des Gesamtvermögens

Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind
Im Freiverkehr gehandelte derivative Finanzinstrumente
Sonstige Vermögenswerte

**% des Gesamtver-
mögens**
95,03
2,88
2,09
100,00

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2022**

CMCI COMMODITY CARRY SF UCITS ETF

Aktien – 97,00 % (30. Juni 2022: 92,19 %)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
2.260	3M Co	271.032	0,16
4.775	Aalberts NV	184.637	0,11
1.240	ABB Ltd	37.617	0,02
5.069	Abbott Laboratories	556.517	0,33
6.540	AbbVie Inc	1.056.913	0,62
15.926	Accelleron Industries AG	329.554	0,19
2.534	Accenture PLC	676.121	0,40
9.504	Achillion Pharmaceuticals Inc	-	0,00
17.761	Activision Blizzard Inc	1.359.626	0,80
3.770	Adobe Inc	1.268.876	0,74
8.145	Advanced Micro Devices Inc	527.532	0,31
4.138	AerCap Holdings NV	241.305	0,14
5.507	Air Liquide SA	778.161	0,46
5.172	Alcon Inc	353.203	0,21
14.550	Alibaba Group Holding Ltd	1.281.689	0,75
740	Align Technology Inc	156.075	0,09
1.116	Allianz SE	239.242	0,14
1.131	Allstate Corp	153.415	0,09
46	Alnylam Pharmaceuticals Inc	10.862	0,01
13.700	Alphabet Inc - Class A	1.208.731	0,71
26.759	Alphabet Inc - Class C	2.374.351	1,39
92.592	Amazon.com Inc	7.777.704	4,56
655	Ameriprise Financial Inc	203.884	0,12
410	AmerisourceBergen Corp	67.987	0,04
3.082	AMG Advanced Metallurgical Group NV	113.167	0,07
642	Analog Devices Inc	105.283	0,06
3.902	ANDRITZ AG	222.993	0,13
62.149	Apple Inc	8.075.003	4,73
5.928	Applied Materials Inc	577.220	0,34
570	Arista Networks Inc	69.123	0,04
1.113	ASM International NV	279.943	0,16
3.082	ASR Nederland NV	145.900	0,09
17.125	Assa Abloy AB	367.657	0,22
485	Automatic Data Processing Inc	115.759	0,07
117	AutoZone Inc	289.673	0,17
81.833	AXA SA	2.275.545	1,33
5.113	Baidu Inc	584.787	0,34
25.687	Banca Mediolanum SpA	213.778	0,13
34.795	Bank of America Corp	1.152.417	0,67
1.689	Baozun Inc	8.953	0,01
4.285	Baxter International Inc	218.411	0,13
6.073	Berkshire Hathaway Inc	1.876.016	1,10
1.218	Best Buy Co Inc	97.726	0,06
274	BioMarin Pharmaceutical Inc	28.356	0,02
604	Block Inc	37.944	0,02
30.825	BNP Paribas SA	1.751.788	1,03
8.562	Boliden AB	321.515	0,19
43	Booking Holdings Inc	86.278	0,05
346	Bouygues SA	10.366	0,01
7.071	BP PLC	246.976	0,14
343	Brighthouse Financial Inc	17.560	0,01

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2022**

CMCI COMMODITY CARRY SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Aktien – 97,00 % (30. Juni 2022: 92,19 %) (Fortsetzung)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
2.424	Cadence Design Systems Inc	389.428	0,23
11.498	Carrefour SA	191.918	0,11
17.125	Castellum AB	207.495	0,12
1.399	Caterpillar Inc	335.133	0,20
214	Celanese Corp	21.856	0,01
4.333	Charles Schwab Corp	360.729	0,21
581	Check Point Software Technologies Ltd	73.328	0,04
8.192	Chevron Corp	1.470.438	0,86
34	Chipotle Mexican Grill Inc	47.520	0,03
394	Cie Financiere Richemont SA	51.083	0,03
2.216	Cigna Corp	734.235	0,43
10.364	Citigroup Inc	468.758	0,27
24.221	Coca-Cola Co	1.540.674	0,90
1.992	ConocoPhillips	235.050	0,14
692	Consolidated Edison Inc	66.001	0,04
375	Costco Wholesale Corp	171.366	0,10
3.092	Coupa Software Inc	244.821	0,14
1.199	Credicorp Ltd	162.620	0,10
5.686	CSX Corp	176.141	0,10
200	CVS Health Corp	18.592	0,01
462	CyberArk Software Ltd	59.946	0,03
11.341	Danone SA	595.875	0,35
6.507	Delivery Hero SE	310.998	0,18
731	Delta Air Lines Inc	24.032	0,01
2.448	Deutsche Telekom AG	48.685	0,03
1.852	DocuSign Inc	102.613	0,06
6.201	Dominion Energy Inc	380.264	0,22
4.653	Dropbox Inc	104.132	0,06
2.778	DTE Energy Co	326.543	0,19
1.081	Duke Energy Corp	111.337	0,07
112.887	E.ON SE	1.124.543	0,66
514	Eastman Chemical Co	41.839	0,02
1.504	Eckert & Ziegler Strahlen- und Medizintechnik AG	74.482	0,04
151.925	EDP - Energias de Portugal SA	754.931	0,44
5.255	Edwards Lifesciences Corp	392.111	0,23
514	Electronic Arts Inc	62.769	0,04
2.371	Eli Lilly & Co	867.308	0,51
57.116	Engie SA	816.092	0,48
2.942	EQT (US listed)	99.533	0,06
7.535	Etablissements Franz Colruyt NV	171.286	0,10
3.369	Euroapi SA	49.798	0,03
9.419	Evotec SE	153.393	0,09
2.055	EXOR (Netherlands listed)	149.793	0,09
356	Expedia Group Inc	31.203	0,02
36.796	Exxon Mobil Corp	4.058.591	2,38
956	Farfetch Ltd	4.521	0,00
103	FleetCor Technologies Inc	18.939	0,01
2.626	Fortinet Inc	128.368	0,08
62.863	Fortum OYJ	1.042.582	0,61
769	Fox - Class B	21.885	0,01
26.603	Fresenius SE & Co KGaA	745.299	0,44

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2022**

CMCI COMMODITY CARRY SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Aktien – 97,00 % (30. Juni 2022: 92,19 %) (Fortsetzung)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
7.760	General Motors Co	261.044	0,15
2.064	Georg Fischer AG	126.258	0,07
11.355	Gilead Sciences Inc	974.851	0,57
144	Givaudan SA	440.836	0,26
2.455	Global Payments Inc	243.873	0,14
5.480	Greenvolt-Energias Renovaveis SA	45.618	0,03
4.881	Groupe Bruxelles Lambert SA	388.469	0,23
603	Guangzhou Automobile Group Co Ltd	406	0,00
3.704	Heineken NV	347.383	0,20
97	Holcim AG	5.071	0,00
3.939	Holcim (Switzerland listed)	203.831	0,12
1.675	Home Depot Inc	529.088	0,31
1.997	Huntington Ingalls Industries Inc	460.771	0,27
172	IDEXX Laboratories Inc	70.365	0,04
1.884	IMCD NV	267.685	0,16
3.056	Incyte Corp	245.427	0,14
11.460	Industrivarden - Class A	278.813	0,16
39.224	Intel Corp	1.036.691	0,61
1.302	International Business Machines Corp	183.457	0,11
599.365	Intesa Sanpaolo SpA	1.329.239	0,78
1.024	Intuit Inc	398.631	0,23
700	IQVIA Holdings Inc	143.354	0,08
6.044	JD.com Inc	339.254	0,20
16.344	Juniper Networks Inc	522.361	0,31
1.417	Kellogg Co	100.955	0,06
1.494	Kimberly-Clark Corp	202.749	0,12
1.855	Kinder Morgan Inc	33.541	0,02
343	KLA Corp	129.131	0,08
34.112	Koninklijke Ahold Delhaize NV	977.138	0,57
41.624	Koninklijke Philips NV	622.107	0,36
4.281	Koninklijke Vopak NV	126.792	0,07
4.966	Kroger Co	221.392	0,13
4.557	Liberty Global - Class A	86.266	0,05
942	Liberty Media Corp - Liberty SiriusXM - Class C	36.855	0,02
304	Linde PLC	99.085	0,06
685	Lonza Group AG	335.461	0,20
2.206	L'Oreal SA	785.298	0,46
1.137	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	825.105	0,48
14.234	Marathon Petroleum Corp	1.656.675	0,97
1.473	Marsh & McLennan Cos Inc	243.707	0,14
2.374	McDonald's Corp	625.535	0,37
2.094	McKesson Corp	785.370	0,46
145.560	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA	1.395.655	0,82
3.278	Merck Co Inc	363.696	0,21
22.042	Meta Platforms Inc	2.652.518	1,55
18.613	Metso Outotec Oyj	190.935	0,11
4.017	Microchip Technology Inc	282.224	0,17
30.424	Microsoft Corp	7.296.293	4,27
1	Minebea Mitsumi Inc	18	0,00
343	Moderna Inc	61.519	0,04
216	Molina Healthcare Inc	71.342	0,04

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2022**

CMCI COMMODITY CARRY SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Aktien – 97,00 % (30. Juni 2022: 92,19 %) (Fortsetzung)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
23	MongoDB Inc	4.578	0,00
6.467	Mosaic Co	283.709	0,17
15.423	Nestle SA	1.785.981	1,05
623	NetEase Inc	45.273	0,03
106	Netflix Inc	31.147	0,02
1.712	New Oriental Education & Technology Group Inc	59.628	0,03
915	NextEra Energy Inc	76.519	0,04
6.716	NOS SGPS SA	27.123	0,02
4.874	NVIDIA Corp	712.349	0,42
11	NVR Inc	48.815	0,03
6.687	OMV AG	343.286	0,20
827	ON Semiconductor Corp	51.599	0,03
701.905	Orange SA	6.952.473	4,07
866	O'Reilly Automotive Inc	731.203	0,43
1.171	Packaging Corp of America	149.823	0,09
713	Parker-Hannifin Corp	207.450	0,12
214	Paychex Inc	24.737	0,01
7.841	PepsiCo Inc	1.416.484	0,83
55.017	Pfizer Inc	2.819.061	1,65
7.853	Phillips 66	817.362	0,48
1.712	PICC Property & Casualty Co Ltd	1.626	0,00
1.800	Pinduoduo Inc	146.766	0,09
890	Pioneer Natural Resources Co	203.323	0,12
8.562	Porsche Automobil Holding SE	468.240	0,27
488	Procter & Gamble Co	73.970	0,04
755	Public Service Enterprise Group	46.258	0,03
2.570	Publicis Groupe SA	163.005	0,10
715	Qorvo Inc	64.810	0,04
822	QUALCOMM Inc	90.390	0,05
6.850	Raiffeisen Bank International AG	112.217	0,07
3.784	Robert Half International Inc	279.347	0,16
12.878	Roche Holding (Non-voting rights)	4.043.395	2,37
1.291	Royal Caribbean Cruises Ltd	63.816	0,04
10.760	RWE AG	477.601	0,28
342	S&P Global Inc	114.382	0,07
17.218	Salesforce Inc	2.282.985	1,34
9.780	Sampo Oyj	509.579	0,30
54.047	Sanofi	5.182.081	3,04
22.148	Schneider Electric SE	3.089.913	1,81
3.225	SEI Investments Co	187.994	0,11
2.639	ServiceNow Inc	1.024.799	0,60
1.750	Siemens (Germany listed)	242.093	0,14
881	SKF AB	13.455	0,01
9.287	Snap Inc	83.122	0,05
1.772	Southern Co	126.519	0,07
18.837	SSAB - Class B	97.987	0,06
10.617	Stora Enso Oyj	149.007	0,09
2.740	Swatch Group (Bearer)	778.868	0,46
42.812	Swedbank AB	728.493	0,43
223	Swiss Life Holding AG	114.727	0,07
2	Swiss Prime Site AG	148	0,00

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2022**

CMCI COMMODITY CARRY SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Aktien – 97,00 % (30. Juni 2022: 92,19 %) (Fortsetzung)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
3.082	Symrise AG	334.402	0,20
1.198	Synopsys Inc	382.393	0,22
17.046	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	1.269.767	0,74
1.203	Take-Two Interactive Software Inc	125.311	0,07
12.844	TeamViewer AG	165.104	0,10
25.687	Tele2 AB	209.796	0,12
132.717	Telefonaktiebolaget LM Ericsson	775.703	0,45
3.895	Tesla Inc	479.727	0,28
1.309	Texas Instruments Inc	216.292	0,13
1.967	Thermo Fisher Scientific Inc	1.083.281	0,63
12.751	T-Mobile US Inc	1.785.121	1,05
238.219	TotalEnergies SE	14.911.134	8,73
1.372	Tyson Foods Inc	85.413	0,05
3.927	UCB SA	308.273	0,18
529	UGI Corp	19.600	0,01
383	Ulta Salon Cosmetics & Fragrance Inc	179.884	0,11
1.851	Union Pacific Corp	383.243	0,22
72	United Rentals Inc	25.563	0,01
1.443	UnitedHealth Group Inc	765.076	0,45
26.345	Universal Music Group NV	632.907	0,37
8.220	UPM-Kymmene Oyj	306.429	0,18
14.318	Valero Energy Corp	1.816.427	1,06
19	Vallourec SA	246	0,00
5.822	Valmet Oyj	156.343	0,09
9.451	Veolia Environnement SA	242.081	0,14
127	VeriSign Inc	25.995	0,02
30.010	Verizon Communications Inc	1.182.390	0,69
2.181	Vertex Pharmaceuticals Inc	629.954	0,37
11.856	Vinci SA	1.180.387	0,69
734	Visa Inc	152.570	0,09
161.068	Vivendi SE	1.532.310	0,90
6.181	VMware Inc	758.754	0,44
18.837	Volkswagen (Non-voting rights)	2.340.506	1,37
426	W R Berkley Corp	30.944	0,02
3.783	Walmart Inc	536.332	0,31
4.764	Walt Disney Co	413.905	0,24
1.718	Waste Management Inc	269.555	0,16
16.336	Wells Fargo & Co	674.524	0,39
1.692	Western Union Co	23.303	0,01
9.659	Wolters Kluwer NV	1.007.793	0,59
4.807	Yum China Holdings Inc	262.719	0,15
4.889	Yum! Brands Inc	626.179	0,37
5.432	Zillow Group Inc	174.980	0,10
1.409	Zoetis Inc	206.490	0,12
880	Zoom Video Communications Inc	59.606	0,03
Aktien insgesamt		165.594.414	97,00

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2022**

CMCI COMMODITY CARRY SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Funded Swaps* – 0,40 % (30. Juni 2022: 0,40 %)

Wäh- rung	Nominalbetrag	Bezeichnung	Fälligkeitstag	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
CHF	1.120	CMCI Commodity Carry Klasse A CHF**	31. Jul 23	132.259	0,08
EUR	3.134	CMCI Commodity Carry Klasse A EUR**	31. Jul 23	368.899	0,21
USD	1.365	CMCI Commodity Carry Klasse A USD	31. Jul 23	181.675	0,11
Funded Swaps zum beizulegenden Zeitwert				682.833	0,40

Unfunded Swaps* – 2,60 % (30. Juni 2022: 7,43 %)

Wäh- rung	Nominalbetrag	Bezeichnung	Fälligkeitstag	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
CHF	278.880	CMCI Commodity Carry Total Return Swap Klasse A CHF**	31. Jul 23	765.879	0,45
EUR	780.366	CMCI Commodity Carry Total Return Swap Klasse A EUR**	31. Jul 23	2.530.040	1,48
USD	339.785	CMCI Commodity Carry Total Return Swap Klasse A USD	31. Jul 23	1.134.548	0,67
Unfunded Swaps zum beizulegenden Zeitwert				4.430.467	2,60

Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten (26) (0,00)

Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnendes Nettovermögen 170.707.688 100,00

Einstufung

* Im Freiverkehr gehandelte derivative Finanzinstrumente.

** Die abgesicherte Aktienklasse investiert in Swaps mit einem Engagement in einer währungsgesicherten Version des Referenzindex.

Gegenpartei der Swap-Kontrakte ist die UBS AG.

	% des Gesamtver- mögens
Analyse des Gesamtvermögens	
Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind	90,74
Im Freiverkehr gehandelte derivative Finanzinstrumente	2,80
Sonstige Vermögenswerte	6,46
	100,00

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2022**

MSCI CHINA A SF UCITS ETF

Aktien – 96,17 % (30. Juni 2022: 92,13 %)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
2.110	3M Co	253.017	0,16
4.458	Aalberts NV	172.365	0,11
1.158	ABB Ltd	35.117	0,02
4.732	Abbott Laboratories	519.527	0,32
6.105	AbbVie Inc	986.663	0,61
14.867	Accelleron Industries AG	307.649	0,19
2.365	Accenture PLC	631.182	0,39
8.872	Achillion Pharmaceuticals Inc	-	0,00
16.581	Activision Blizzard Inc	1.269.256	0,79
3.520	Adobe Inc	1.184.539	0,74
7.603	Advanced Micro Devices Inc	492.468	0,31
3.863	AerCap Holdings NV	225.266	0,14
5.141	Air Liquide SA	726.439	0,45
4.828	Alcon Inc	329.727	0,21
13.583	Alibaba Group Holding Ltd	1.196.499	0,74
691	Align Technology Inc	145.702	0,09
1.042	Allianz SE	223.340	0,14
1.056	Allstate Corp	143.218	0,09
43	Alnylam Pharmaceuticals Inc	10.140	0,01
12.789	Alphabet Inc - Class A	1.128.391	0,70
24.981	Alphabet Inc - Class C	2.216.536	1,38
86.437	Amazon.com Inc	7.260.746	4,52
611	Ameriprise Financial Inc	190.333	0,12
383	AmerisourceBergen Corp	63.468	0,04
2.878	AMG Advanced Metallurgical Group NV	105.645	0,07
599	Analog Devices Inc	98.285	0,06
3.642	ANDRITZ AG	208.171	0,13
58.018	Apple Inc	7.538.285	4,69
5.533	Applied Materials Inc	538.854	0,34
532	Arista Networks Inc	64.529	0,04
1.039	ASM International NV	261.337	0,16
2.878	ASR Nederland NV	136.203	0,08
15.986	Assa Abloy AB	343.220	0,21
452	Automatic Data Processing Inc	108.065	0,07
110	AutoZone Inc	270.419	0,17
76.394	AXA SA	2.124.297	1,32
4.773	Baidu Inc	545.919	0,34
23.980	Banca Mediolanum SpA	199.569	0,12
32.482	Bank of America Corp	1.075.820	0,67
1.577	Baozun Inc	8.358	0,01
4.000	Baxter International Inc	203.894	0,13
5.670	Berkshire Hathaway Inc	1.751.323	1,09
1.137	Best Buy Co Inc	91.230	0,06
256	BioMarin Pharmaceutical Inc	26.471	0,02
564	Block Inc	35.422	0,02
28.776	BNP Paribas SA	1.635.353	1,02
7.993	Boliden AB	300.145	0,19
40	Booking Holdings Inc	80.543	0,05
323	Bouygues SA	9.677	0,01
6.601	BP PLC	230.561	0,14
320	Brighthouse Financial Inc	16.393	0,01

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2022**

MSCI CHINA A SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Aktien – 96,17 % (30. Juni 2022: 92,13 %) (Fortsetzung)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
2.263	Cadence Design Systems Inc	363.544	0,23
10.734	Carrefour SA	179.162	0,11
15.986	Castellum AB	193.704	0,12
1.306	Caterpillar Inc	312.858	0,19
200	Celanese Corp	20.403	0,01
4.045	Charles Schwab Corp	336.752	0,21
543	Check Point Software Technologies Ltd	68.454	0,04
7.648	Chevron Corp	1.372.703	0,85
32	Chipotle Mexican Grill Inc	44.362	0,03
368	Cie Financiere Richemont SA	47.687	0,03
2.069	Cigna Corp	685.433	0,43
9.675	Citigroup Inc	437.602	0,27
22.611	Coca-Cola Co	1.438.271	0,89
1.860	ConocoPhillips	219.427	0,14
646	Consolidated Edison Inc	61.614	0,04
350	Costco Wholesale Corp	159.976	0,10
2.887	Coupa Software Inc	228.549	0,14
1.119	Credicorp Ltd	151.811	0,09
5.308	CSX Corp	164.433	0,10
186	CVS Health Corp	17.356	0,01
432	CyberArk Software Ltd	55.962	0,03
10.587	Danone SA	556.269	0,35
6.075	Delivery Hero SE	290.327	0,18
683	Delta Air Lines Inc	22.435	0,01
2.285	Deutsche Telekom AG	45.449	0,03
1.728	DocuSign Inc	95.793	0,06
5.789	Dominion Energy Inc	354.989	0,22
4.344	Dropbox Inc	97.210	0,06
2.594	DTE Energy Co	304.839	0,19
1.009	Duke Energy Corp	103.937	0,06
105.383	E.ON SE	1.049.799	0,65
480	Eastman Chemical Co	39.058	0,02
1.404	Eckert & Ziegler Strahlen- und Medizintechnik AG	69.531	0,04
141.827	EDP - Energias de Portugal SA	704.754	0,44
4.906	Edwards Lifesciences Corp	366.049	0,23
480	Electronic Arts Inc	58.597	0,04
2.213	Eli Lilly & Co	809.661	0,50
53.320	Engie SA	761.849	0,47
2.747	EQT (US listed)	92.917	0,06
7.034	Etablissements Franz Colruyt NV	159.901	0,10
3.145	Euroapi SA	46.488	0,03
8.793	Evotec SE	143.198	0,09
1.918	EXOR (Netherlands listed)	139.837	0,09
333	Expedia Group Inc	29.129	0,02
34.350	Exxon Mobil Corp	3.788.830	2,36
892	Farfetch Ltd	4.220	0,00
96	FleetCor Technologies Inc	17.680	0,01
2.451	Fortinet Inc	119.836	0,07
58.684	Fortum OYJ	973.285	0,61
718	Fox - Class B	20.431	0,01
24.835	Fresenius SE & Co KGaA	695.761	0,43

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2022**

MSCI CHINA A SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Aktien – 96,17 % (30. Juni 2022: 92,13 %) (Fortsetzung)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
7.244	General Motors Co	243.693	0,15
1.927	Georg Fischer AG	117.866	0,07
10.601	Gilead Sciences Inc	910.056	0,57
134	Givaudan SA	411.535	0,26
2.292	Global Payments Inc	227.664	0,14
5.116	Greenvolt-Energias Renovaveis SA	42.586	0,03
4.556	Groupe Bruxelles Lambert SA	362.649	0,23
563	Guangzhou Automobile Group Co Ltd	379	0,00
3.458	Heineken NV	324.293	0,20
91	Holcim AG	4.734	0,00
3.677	Holcim (Switzerland listed)	190.283	0,12
1.564	Home Depot Inc	493.921	0,31
1.865	Huntington Ingalls Industries Inc	430.145	0,27
161	IDEXX Laboratories Inc	65.688	0,04
1.758	IMCD NV	249.893	0,16
2.852	Incyte Corp	229.114	0,14
10.698	Industrivarden - Class A	260.281	0,16
36.617	Intel Corp	967.786	0,60
1.216	International Business Machines Corp	171.263	0,11
559.527	Intesa Sanpaolo SpA	1.240.889	0,77
956	Intuit Inc	372.135	0,23
653	IQVIA Holdings Inc	133.826	0,08
5.642	JD.com Inc	316.705	0,20
15.258	Juniper Networks Inc	487.641	0,30
1.323	Kellogg Co	94.244	0,06
1.394	Kimberly-Clark Corp	189.273	0,12
1.732	Kinder Morgan Inc	31.312	0,02
320	KLA Corp	120.548	0,07
31.845	Koninklijke Ahold Delhaize NV	912.191	0,57
38.858	Koninklijke Philips NV	580.758	0,36
3.997	Koninklijke Vopak NV	118.365	0,07
4.636	Kroger Co	206.677	0,13
4.254	Liberty Global - Class A	80.533	0,05
879	Liberty Media Corp - Liberty SiriusXM - Class C	34.405	0,02
284	Linde PLC	92.499	0,06
639	Lonza Group AG	313.164	0,19
2.059	L’Oreal SA	733.102	0,46
1.062	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	770.263	0,48
13.288	Marathon Petroleum Corp	1.546.562	0,96
1.375	Marsh & McLennan Cos Inc	227.508	0,14
2.216	McDonald’s Corp	583.957	0,36
1.954	McKesson Corp	733.170	0,46
135.885	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA	1.302.891	0,81
3.060	Merck Co Inc	339.522	0,21
20.577	Meta Platforms Inc	2.476.214	1,54
17.375	Metso Outotec Oyj	178.244	0,11
3.750	Microchip Technology Inc	263.466	0,16
28.402	Microsoft Corp	6.811.333	4,24
1	Minebea Mitsumi Inc	17	0,00
320	Moderna Inc	57.430	0,04
202	Molina Healthcare Inc	66.601	0,04

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2022**

MSCI CHINA A SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Aktien – 96,17 % (30. Juni 2022: 92,13 %) (Fortsetzung)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
22	MongoDB Inc	4.273	0,00
6.037	Mosaic Co	264.852	0,16
14.398	Nestle SA	1.667.273	1,04
582	NetEase Inc	42.264	0,03
99	Netflix Inc	29.077	0,02
1.599	New Oriental Education & Technology Group Inc	55.665	0,03
854	NextEra Energy Inc	71.433	0,04
6.270	NOS SGPS SA	25.321	0,02
4.550	NVIDIA Corp	665.002	0,41
10	NVR Inc	45.572	0,03
6.243	OMV AG	320.469	0,20
772	ON Semiconductor Corp	48.170	0,03
655.252	Orange SA	6.490.365	4,04
809	O'Reilly Automotive Inc	682.602	0,42
1.093	Packaging Corp of America	139.865	0,09
665	Parker-Hannifin Corp	193.661	0,12
200	Paychex Inc	23.092	0,01
7.319	PepsiCo Inc	1.322.335	0,82
51.360	Pfizer Inc	2.631.688	1,64
7.331	Phillips 66	763.035	0,47
1.599	PICC Property & Casualty Co Ltd	1.518	0,00
1.680	Pinduoduo Inc	137.011	0,09
831	Pioneer Natural Resources Co	189.809	0,12
7.993	Porsche Automobil Holding SE	437.118	0,27
456	Procter & Gamble Co	69.053	0,04
705	Public Service Enterprise Group	43.183	0,03
2.400	Publicis Groupe SA	152.170	0,09
667	Qorvo Inc	60.502	0,04
768	QUALCOMM Inc	84.382	0,05
6.395	Raiffeisen Bank International AG	104.758	0,07
3.532	Robert Half International Inc	260.780	0,16
12.022	Roche Holding (Non-voting rights)	3.774.644	2,35
1.205	Royal Caribbean Cruises Ltd	59.574	0,04
10.045	RWE AG	445.856	0,28
319	S&P Global Inc	106.780	0,07
16.074	Salesforce Inc	2.131.242	1,33
9.130	Sampo Oyj	475.709	0,30
50.454	Sanofi	4.837.646	3,01
20.676	Schneider Electric SE	2.884.537	1,79
3.010	SEI Investments Co	175.499	0,11
2.464	ServiceNow Inc	956.684	0,60
1.633	Siemens (Germany listed)	226.002	0,14
822	SKF AB	12.560	0,01
8.670	Snap Inc	77.597	0,05
1.654	Southern Co	118.110	0,07
17.585	SSAB - Class B	91.474	0,06
9.912	Stora Enso Oyj	139.103	0,09
2.558	Swatch Group (Bearer)	727.099	0,45
39.966	Swedbank AB	680.073	0,42
208	Swiss Life Holding AG	107.102	0,07
2	Swiss Prime Site AG	139	0,00

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2022**

MSCI CHINA A SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Aktien – 96,17 % (30. Juni 2022: 92,13 %) (Fortsetzung)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
2.878	Symrise AG	312.176	0,19
1.118	Synopsys Inc	356.976	0,22
15.913	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	1.185.370	0,74
1.123	Take-Two Interactive Software Inc	116.982	0,07
11.990	TeamViewer AG	154.130	0,10
23.980	Tele2 AB	195.852	0,12
123.895	Telefonaktiebolaget LM Ericsson	724.145	0,45
3.636	Tesla Inc	447.841	0,28
1.222	Texas Instruments Inc	201.916	0,13
1.836	Thermo Fisher Scientific Inc	1.011.279	0,63
11.903	T-Mobile US Inc	1.666.470	1,04
222.386	TotalEnergies SE	13.920.041	8,66
1.281	Tyson Foods Inc	79.736	0,05
3.666	UCB SA	287.783	0,18
494	UGI Corp	18.297	0,01
358	Ulta Salon Cosmetics & Fragrance Inc	167.928	0,10
1.728	Union Pacific Corp	357.770	0,22
67	United Rentals Inc	23.864	0,01
1.347	UnitedHealth Group Inc	714.224	0,44
24.594	Universal Music Group NV	590.840	0,37
7.674	UPM-Kymmene Oyj	286.061	0,18
13.367	Valero Energy Corp	1.695.695	1,05
17	Vallourec SA	229	0,00
5.435	Valmet Oyj	145.952	0,09
8.823	Veolia Environnement SA	225.991	0,14
118	VeriSign Inc	24.267	0,02
28.015	Verizon Communications Inc	1.103.800	0,69
2.036	Vertex Pharmaceuticals Inc	588.083	0,37
11.068	Vinci SA	1.101.931	0,69
686	Visa Inc	142.430	0,09
150.362	Vivendi SE	1.430.462	0,89
5.770	VMware Inc	708.322	0,44
17.585	Volkswagen (Non-voting rights)	2.184.941	1,36
398	W R Berkley Corp	28.888	0,02
3.531	Walmart Inc	500.683	0,31
4.447	Walt Disney Co	386.394	0,24
1.604	Waste Management Inc	251.639	0,16
15.250	Wells Fargo & Co	629.690	0,39
1.580	Western Union Co	21.754	0,01
9.017	Wolters Kluwer NV	940.808	0,59
4.488	Yum China Holdings Inc	245.257	0,15
4.564	Yum! Brands Inc	584.559	0,36
5.071	Zillow Group Inc	163.350	0,10
1.315	Zoetis Inc	192.765	0,12
821	Zoom Video Communications Inc	55.644	0,03
Aktien insgesamt		154.587.915	96,17

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2022**

MSCI CHINA A SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Funded Swaps* – 0,40 % (30. Juni 2022: 0,24 %)

Wäh- rung	Nominalbetrag	Bezeichnung	Fälligkeitstag	Zeitwert USD	% des Netto- inventarwerts
USD	5.275	MSCI China A Klasse A USD	31. Jul 23	642.977	0,40
Funded Swaps zum beizulegenden Zeitwert				642.977	0,40

Unfunded Swaps* – 3,43 % (30. Juni 2022: 7,65 %)

Wäh- rung	Nominalbetrag	Bezeichnung	Fälligkeitstag	Zeitwert USD	% des Netto- inventarwerts
USD	1.313.475	MSCI China A Total Return Net Index Swap Klasse A USD	31. Jul 23	5.513.259	3,43
Unfunded Swaps zum beizulegenden Zeitwert				5.513.259	3,43

Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten 1 0,00

Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnendes Nettovermögen **160.744.152** **100,00**

Einstufung

* Im Freiverkehr gehandelte derivative Finanzinstrumente.

Gegenpartei der Swap-Kontrakte ist die UBS AG.

	% des Gesamtver- mögens
Analyse des Gesamtvermögens	
Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind	92,28
Im Freiverkehr gehandelte derivative Finanzinstrumente	3,67
Sonstige Vermögenswerte	4,05
	100,00

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2022**

EURO EQUITY DEFENSIVE COVERED CALL SF UCITS ETF

Aktien – 97,13 % (30. Juni 2022: 95,70 %)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert EUR	% des Netto- inventar- werts
68	3M Co	7.641	0,16
144	Aalberts NV	5.205	0,11
37	ABB Ltd	1.060	0,02
153	Abbott Laboratories	15.689	0,33
197	AbbVie Inc	29.795	0,62
479	Accelleron Industries AG	9.290	0,19
76	Accenture PLC	19.060	0,40
286	Achillion Pharmaceuticals Inc	-	0,00
534	Activision Blizzard Inc	38.329	0,80
113	Adobe Inc	35.770	0,74
245	Advanced Micro Devices Inc	14.871	0,31
125	AerCap Holdings NV	6.803	0,14
166	Air Liquide SA	21.937	0,46
156	Alcon Inc	9.957	0,21
438	Alibaba Group Holding Ltd	36.132	0,75
22	Align Technology Inc	4.400	0,09
34	Allianz SE	6.744	0,14
34	Allstate Corp	4.325	0,09
1	Alnylam Pharmaceuticals Inc	306	0,01
412	Alphabet Inc - Class A	34.075	0,71
805	Alphabet Inc - Class C	66.935	1,39
2.786	Amazon.com Inc	219.258	4,56
20	Ameriprise Financial Inc	5.748	0,12
12	AmerisourceBergen Corp	1.917	0,04
93	AMG Advanced Metallurgical Group NV	3.190	0,07
19	Analog Devices Inc	2.968	0,06
117	ANDRITZ AG	6.286	0,13
1.870	Apple Inc	227.639	4,74
178	Applied Materials Inc	16.272	0,34
17	Arista Networks Inc	1.949	0,04
34	ASM International NV	7.892	0,16
93	ASR Nederland NV	4.113	0,09
515	Assa Abloy AB	10.364	0,22
15	Automatic Data Processing Inc	3.263	0,07
4	AutoZone Inc	8.166	0,17
2.462	AXA SA	64.149	1,33
154	Baidu Inc	16.486	0,34
773	Banca Mediolanum SpA	6.027	0,13
1.047	Bank of America Corp	32.487	0,68
51	Baozun Inc	252	0,01
129	Baxter International Inc	6.157	0,13
183	Berkshire Hathaway Inc	52.886	1,10
37	Best Buy Co Inc	2.755	0,06
8	BioMarin Pharmaceutical Inc	799	0,02
18	Block Inc	1.070	0,02
927	BNP Paribas SA	49.384	1,03
258	Boliden AB	9.064	0,19
1	Booking Holdings Inc	2.432	0,05
10	Bouygues SA	292	0,01
213	BP PLC	6.962	0,14
10	Brighthouse Financial Inc	495	0,01

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2022**

EURO EQUITY DEFENSIVE COVERED CALL SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Aktien – 97,13 % (30. Juni 2022: 95,70 %) (Fortsetzung)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert EUR	% des Netto- inventar- werts
73	Cadence Design Systems Inc	10.978	0,23
346	Carrefour SA	5.410	0,11
515	Castellum AB	5.849	0,12
42	Caterpillar Inc	9.448	0,20
6	Celanese Corp	616	0,01
130	Charles Schwab Corp	10.169	0,21
18	Check Point Software Technologies Ltd	2.067	0,04
246	Chevron Corp	41.453	0,86
1	Chipotle Mexican Grill Inc	1.339	0,03
12	Cie Financiere Richemont SA	1.440	0,03
67	Cigna Corp	20.698	0,43
312	Citigroup Inc	13.215	0,27
729	Coca-Cola Co	43.433	0,90
60	ConocoPhillips	6.626	0,14
21	Consolidated Edison Inc	1.861	0,04
11	Costco Wholesale Corp	4.831	0,10
93	Coupa Software Inc	6.902	0,14
36	Credicorp Ltd	4.584	0,10
171	CSX Corp	4.966	0,10
6	CVS Health Corp	524	0,01
14	CyberArk Software Ltd	1.690	0,04
341	Danone SA	16.798	0,35
196	Delivery Hero SE	8.767	0,18
22	Delta Air Lines Inc	678	0,01
74	Deutsche Telekom AG	1.372	0,03
56	DocuSign Inc	2.893	0,06
187	Dominion Energy Inc	10.720	0,22
140	Dropbox Inc	2.936	0,06
84	DTE Energy Co	9.206	0,19
33	Duke Energy Corp	3.139	0,07
3.396	E.ON SE	31.702	0,66
15	Eastman Chemical Co	1.180	0,02
45	Eckert & Ziegler Strahlen- und Medizintechnik AG	2.100	0,04
4.571	EDP - Energias de Portugal SA	21.282	0,44
158	Edwards Lifesciences Corp	11.054	0,23
15	Electronic Arts Inc	1.770	0,04
71	Eli Lilly & Co	24.450	0,51
1.718	Engie SA	23.006	0,48
89	EQT (US listed)	2.806	0,06
227	Etablissements Franz Colruyt NV	4.829	0,10
101	Euroapi SA	1.404	0,03
283	Evotec SE	4.324	0,09
62	EXOR (Netherlands listed)	4.223	0,09
11	Expedia Group Inc	880	0,02
1.107	Exxon Mobil Corp	114.414	2,38
29	Farfetch Ltd	127	0,00
3	FleetCor Technologies Inc	534	0,01
79	Fortinet Inc	3.619	0,08
1.891	Fortum OYJ	29.391	0,61
23	Fox - Class B	617	0,01
800	Fresenius SE & Co KGaA	21.010	0,44

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2022**

EURO EQUITY DEFENSIVE COVERED CALL SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Aktien – 97,13 % (30. Juni 2022: 95,70 %) (Fortsetzung)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert EUR	% des Netto- inventar- werts
233	General Motors Co	7.359	0,15
62	Georg Fischer AG	3.559	0,07
342	Gilead Sciences Inc	27.482	0,57
4	Givaudan SA	12.426	0,26
74	Global Payments Inc	6.875	0,14
165	Greenvolt-Energias Renovaveis SA	1.286	0,03
147	Groupe Bruxelles Lambert SA	10.951	0,23
18	Guangzhou Automobile Group Co Ltd	11	0,00
111	Heineken NV	9.793	0,20
3	Holcim AG	143	0,00
119	Holcim (Switzerland listed)	5.746	0,12
50	Home Depot Inc	14.915	0,31
60	Huntington Ingalls Industries Inc	12.989	0,27
5	IDEXX Laboratories Inc	1.984	0,04
57	IMCD NV	7.546	0,16
92	Incyte Corp	6.919	0,14
345	Industrivarden - Class A	7.860	0,16
1.180	Intel Corp	29.225	0,61
39	International Business Machines Corp	5.172	0,11
18.033	Intesa Sanpaolo SpA	37.472	0,78
31	Intuit Inc	11.238	0,23
21	IQVIA Holdings Inc	4.041	0,08
182	JD.com Inc	9.564	0,20
492	Juniper Networks Inc	14.726	0,31
43	Kellogg Co	2.846	0,06
45	Kimberly-Clark Corp	5.716	0,12
56	Kinder Morgan Inc	946	0,02
10	KLA Corp	3.640	0,08
1.026	Koninklijke Ahold Delhaize NV	27.546	0,57
1.252	Koninklijke Philips NV	17.538	0,36
129	Koninklijke Vopak NV	3.574	0,07
149	Kroger Co	6.241	0,13
137	Liberty Global - Class A	2.432	0,05
28	Liberty Media Corp - Liberty SiriusXM - Class C	1.039	0,02
9	Linde PLC	2.793	0,06
21	Lonza Group AG	9.457	0,20
66	L'Oreal SA	22.138	0,46
34	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	23.260	0,48
428	Marathon Petroleum Corp	46.703	0,97
44	Marsh & McLennan Cos Inc	6.870	0,14
71	McDonald's Corp	17.634	0,37
63	McKesson Corp	22.140	0,46
4.379	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA	39.344	0,82
99	Merck Co Inc	10.253	0,21
663	Meta Platforms Inc	74.776	1,56
560	Metso Outotec Oyj	5.383	0,11
121	Microchip Technology Inc	7.956	0,17
915	Microsoft Corp	205.687	4,28
10	Moderna Inc	1.734	0,04
7	Molina Healthcare Inc	2.011	0,04
1	MongoDB Inc	129	0,00

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2022**

EURO EQUITY DEFENSIVE COVERED CALL SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Aktien – 97,13 % (30. Juni 2022: 95,70 %) (Fortsetzung)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert EUR	% des Netto- inventar- werts
195	Mosaic Co	7.998	0,17
464	Nestle SA	50.348	1,05
19	NetEase Inc	1.276	0,03
3	Netflix Inc	878	0,02
52	New Oriental Education & Technology Group Inc	1.681	0,03
28	NextEra Energy Inc	2.157	0,04
202	NOS SGPS SA	765	0,02
147	NVIDIA Corp	20.082	0,42
1	NVR Inc	1.374	0,03
201	OMV AG	9.677	0,20
25	ON Semiconductor Corp	1.455	0,03
21.118	Orange SA	195.995	4,08
26	O'Reilly Automotive Inc	20.613	0,43
35	Packaging Corp of America	4.224	0,09
21	Parker-Hannifin Corp	5.848	0,12
6	Paychex Inc	697	0,01
236	PepsiCo Inc	39.932	0,83
1.655	Pfizer Inc	79.471	1,65
236	Phillips 66	23.042	0,48
52	PICC Property & Casualty Co Ltd	46	0,00
54	Pinduoduo Inc	4.137	0,09
27	Pioneer Natural Resources Co	5.732	0,12
258	Porsche Automobil Holding SE	13.200	0,27
15	Procter & Gamble Co	2.085	0,04
23	Public Service Enterprise Group	1.304	0,03
77	Publicis Groupe SA	4.595	0,10
22	Qorvo Inc	1.827	0,04
25	QUALCOMM Inc	2.548	0,05
206	Raiffeisen Bank International AG	3.163	0,07
114	Robert Half International Inc	7.875	0,16
387	Roche Holding (Non-voting rights)	113.986	2,37
39	Royal Caribbean Cruises Ltd	1.799	0,04
324	RWE AG	13.464	0,28
10	S&P Global Inc	3.225	0,07
518	Salesforce Inc	64.359	1,34
294	Sampo Oyj	14.365	0,30
1.626	Sanofi	146.086	3,04
666	Schneider Electric SE	87.107	1,81
97	SEI Investments Co	5.300	0,11
79	ServiceNow Inc	28.890	0,60
53	Siemens (Germany listed)	6.825	0,14
27	SKF AB	379	0,01
279	Snap Inc	2.343	0,05
53	Southern Co	3.567	0,07
567	SSAB - Class B	2.762	0,06
319	Stora Enso Oyj	4.201	0,09
82	Swatch Group (Bearer)	21.957	0,46
1.288	Swedbank AB	20.537	0,43
7	Swiss Life Holding AG	3.234	0,07
93	Symrise AG	9.427	0,20
36	Synopsys Inc	10.780	0,22

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2022**

EURO EQUITY DEFENSIVE COVERED CALL SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Aktien – 97,13 % (30. Juni 2022: 95,70 %) (Fortsetzung)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert EUR	% des Netto- inventar- werts
513	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	35.796	0,74
36	Take-Two Interactive Software Inc	3.533	0,07
386	TeamViewer AG	4.654	0,10
773	Tele2 AB	5.914	0,12
3.993	Telefonaktiebolaget LM Ericsson	21.868	0,46
117	Tesla Inc	13.524	0,28
39	Texas Instruments Inc	6.097	0,13
59	Thermo Fisher Scientific Inc	30.538	0,64
384	T-Mobile US Inc	50.324	1,05
7.167	TotalEnergies SE	420.354	8,75
41	Tyson Foods Inc	2.408	0,05
118	UCB SA	8.690	0,18
16	UGI Corp	553	0,01
12	Ulta Salon Cosmetics & Fragrance Inc	5.071	0,11
56	Union Pacific Corp	10.804	0,22
2	United Rentals Inc	721	0,01
43	UnitedHealth Group Inc	21.568	0,45
793	Universal Music Group NV	17.842	0,37
247	UPM-Kymmene Oyj	8.638	0,18
431	Valero Energy Corp	51.206	1,07
1	Vallourec SA	7	0,00
175	Valmet Oyj	4.407	0,09
284	Veolia Environnement SA	6.824	0,14
4	VeriSign Inc	733	0,02
903	Verizon Communications Inc	33.332	0,69
66	Vertex Pharmaceuticals Inc	17.759	0,37
357	Vinci SA	33.276	0,69
22	Visa Inc	4.301	0,09
4.846	Vivendi SE	43.197	0,90
186	VMware Inc	21.390	0,45
567	Volkswagen (Non-voting rights)	65.980	1,37
13	W R Berkley Corp	872	0,02
114	Walmart Inc	15.120	0,31
143	Walt Disney Co	11.668	0,24
52	Waste Management Inc	7.599	0,16
492	Wells Fargo & Co	19.015	0,40
51	Western Union Co	657	0,01
291	Wolters Kluwer NV	28.410	0,59
145	Yum China Holdings Inc	7.406	0,15
147	Yum! Brands Inc	17.652	0,37
163	Zillow Group Inc	4.933	0,10
42	Zoetis Inc	5.821	0,12
26	Zoom Video Communications Inc	1.680	0,03
Aktien insgesamt		4.668.204	97,13

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2022**

EURO EQUITY DEFENSIVE COVERED CALL SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Funded Swaps* – 0,40 % (30. Juni 2022: 0,40 %)

Wäh- rung	Nominalbetrag	Bezeichnung	Fälligkeitstag	Zeitwert EUR	% des Netto- inventarwerts
EUR	174	Euro Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF Klasse A EUR	31. Jul 23	19.227	0,40
Funded Swaps zum beizulegenden Zeitwert				19.227	0,40

Unfunded Swaps* – 2,47 % (30. Juni 2022: 3,99 %)

Wäh- rung	Nominalbetrag	Bezeichnung	Fälligkeitstag	Zeitwert EUR	% des Netto- inventarwerts
EUR	43.444	Euro Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF Total Return Swap Klasse A EUR	31. Jul 23	118.518	2,47
Unfunded Swaps zum beizulegenden Zeitwert				118.518	2,47

Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten

- -

Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnendes Nettovermögen

4.805.949 100,00

Einstufung

* Im Freiverkehr gehandelte derivative Finanzinstrumente.

Gegenpartei der Swap-Kontrakte ist die UBS AG.

Analyse des Gesamtvermögens

Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind
Im Freiverkehr gehandelte derivative Finanzinstrumente
Sonstige Vermögenswerte

**% des
Gesamtver-
mögens**
90,78
2,68
6,54
100,00

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2022**

EURO EQUITY DEFENSIVE PUT WRITE SF UCITS ETF

Aktien – 96,81 % (30. Juni 2022: 94,89 %)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert EUR	% des Netto- inventar- werts
283	3M Co	31.795	0,16
598	Aalberts NV	21.660	0,11
155	ABB Ltd	4.413	0,02
635	Abbott Laboratories	65.286	0,33
819	AbbVie Inc	123.989	0,62
1.994	Accelleron Industries AG	38.661	0,19
317	Accenture PLC	79.318	0,40
1.190	Achillion Pharmaceuticals Inc	-	0,00
2.224	Activision Blizzard Inc	159.501	0,79
472	Adobe Inc	148.855	0,74
1.020	Advanced Micro Devices Inc	61.886	0,31
518	AerCap Holdings NV	28.308	0,14
690	Air Liquide SA	91.288	0,45
648	Alcon Inc	41.435	0,21
1.822	Alibaba Group Holding Ltd	150.358	0,75
93	Align Technology Inc	18.310	0,09
140	Allianz SE	28.066	0,14
142	Allstate Corp	17.998	0,09
6	Alnylam Pharmaceuticals Inc	1.274	0,01
1.715	Alphabet Inc - Class A	141.800	0,71
3.350	Alphabet Inc - Class C	278.542	1,39
11.593	Amazon.com Inc	912.424	4,55
82	Ameriprise Financial Inc	23.918	0,12
51	AmerisourceBergen Corp	7.976	0,04
386	AMG Advanced Metallurgical Group NV	13.276	0,07
80	Analog Devices Inc	12.351	0,06
489	ANDRITZ AG	26.160	0,13
7.781	Apple Inc	947.301	4,72
742	Applied Materials Inc	67.715	0,34
71	Arista Networks Inc	8.109	0,04
139	ASM International NV	32.841	0,16
386	ASR Nederland NV	17.116	0,09
2.144	Assa Abloy AB	43.131	0,21
61	Automatic Data Processing Inc	13.580	0,07
15	AutoZone Inc	33.982	0,17
10.246	AXA SA	266.950	1,33
640	Baidu Inc	68.603	0,34
3.216	Banca Mediolanum SpA	25.079	0,12
4.356	Bank of America Corp	135.193	0,67
212	Baozun Inc	1.050	0,01
537	Baxter International Inc	25.622	0,13
760	Berkshire Hathaway Inc	220.080	1,10
153	Best Buy Co Inc	11.465	0,06
34	BioMarin Pharmaceutical Inc	3.327	0,02
76	Block Inc	4.451	0,02
3.859	BNP Paribas SA	205.507	1,02
1.072	Boliden AB	37.718	0,19
5	Booking Holdings Inc	10.121	0,05
43	Bouygues SA	1.216	0,01
885	BP PLC	28.973	0,14
43	Brighthouse Financial Inc	2.060	0,01

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2022**

EURO EQUITY DEFENSIVE PUT WRITE SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Aktien – 96,81 % (30. Juni 2022: 94,89 %) (Fortsetzung)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert EUR	% des Netto- inventar- werts
304	Cadence Design Systems Inc	45.685	0,23
1.440	Carrefour SA	22.514	0,11
2.144	Castellum AB	24.342	0,12
175	Caterpillar Inc	39.315	0,20
27	Celanese Corp	2.564	0,01
542	Charles Schwab Corp	42.318	0,21
73	Check Point Software Technologies Ltd	8.602	0,04
1.026	Chevron Corp	172.501	0,86
4	Chipotle Mexican Grill Inc	5.575	0,03
49	Cie Financiere Richemont SA	5.993	0,03
277	Cigna Corp	86.135	0,43
1.298	Citigroup Inc	54.991	0,27
3.032	Coca-Cola Co	180.741	0,90
249	ConocoPhillips	27.574	0,14
87	Consolidated Edison Inc	7.743	0,04
47	Costco Wholesale Corp	20.104	0,10
387	Coupa Software Inc	28.721	0,14
150	Credicorp Ltd	19.077	0,09
712	CSX Corp	20.664	0,10
25	CVS Health Corp	2.181	0,01
58	CyberArk Software Ltd	7.032	0,03
1.420	Danone SA	69.904	0,35
815	Delivery Hero SE	36.484	0,18
92	Delta Air Lines Inc	2.819	0,01
306	Deutsche Telekom AG	5.711	0,03
232	DocuSign Inc	12.038	0,06
776	Dominion Energy Inc	44.610	0,22
583	Dropbox Inc	12.216	0,06
348	DTE Energy Co	38.308	0,19
135	Duke Energy Corp	13.061	0,06
14.134	E.ON SE	131.923	0,66
64	Eastman Chemical Co	4.908	0,02
188	Eckert & Ziegler Strahlen- und Medizintechnik AG	8.738	0,04
19.021	EDP - Energias de Portugal SA	88.563	0,44
658	Edwards Lifesciences Corp	46.000	0,23
64	Electronic Arts Inc	7.364	0,04
297	Eli Lilly & Co	101.746	0,51
7.151	Engie SA	95.738	0,48
368	EQT (US listed)	11.676	0,06
943	Etablissements Franz Colruyt NV	20.094	0,10
422	Euroapi SA	5.842	0,03
1.179	Evotec SE	17.995	0,09
257	EXOR (Netherlands listed)	17.573	0,09
45	Expedia Group Inc	3.660	0,02
4.607	Exxon Mobil Corp	476.124	2,37
120	Farfetch Ltd	530	0,00
13	FleetCor Technologies Inc	2.222	0,01
329	Fortinet Inc	15.059	0,07
7.871	Fortum OYJ	122.308	0,61
96	Fox - Class B	2.567	0,01
3.331	Fresenius SE & Co KGaA	87.433	0,44

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2022**

EURO EQUITY DEFENSIVE PUT WRITE SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Aktien – 96,81 % (30. Juni 2022: 94,89 %) (Fortsetzung)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert EUR	% des Netto- inventar- werts
972	General Motors Co	30.624	0,15
258	Georg Fischer AG	14.812	0,07
1.422	Gilead Sciences Inc	114.362	0,57
18	Givaudan SA	51.715	0,26
307	Global Payments Inc	28.609	0,14
686	Greenvolt-Energias Renovaveis SA	5.352	0,03
611	Groupe Bruxelles Lambert SA	45.572	0,23
75	Guangzhou Automobile Group Co Ltd	48	0,00
464	Heineken NV	40.752	0,20
12	Holcim AG	595	0,00
493	Holcim (Switzerland listed)	23.912	0,12
210	Home Depot Inc	62.069	0,31
250	Huntington Ingalls Industries Inc	54.054	0,27
22	IDEXX Laboratories Inc	8.255	0,04
236	IMCD NV	31.403	0,16
383	Incyte Corp	28.792	0,14
1.435	Industrivarden - Class A	32.708	0,16
4.911	Intel Corp	121.617	0,61
163	International Business Machines Corp	21.522	0,11
75.042	Intesa Sanpaolo SpA	155.937	0,78
128	Intuit Inc	46.764	0,23
88	IQVIA Holdings Inc	16.817	0,08
757	JD.com Inc	39.799	0,20
2.046	Juniper Networks Inc	61.280	0,31
177	Kellogg Co	11.843	0,06
187	Kimberly-Clark Corp	23.785	0,12
232	Kinder Morgan Inc	3.935	0,02
43	KLA Corp	15.149	0,08
4.271	Koninklijke Ahold Delhaize NV	114.631	0,57
5.211	Koninklijke Philips NV	72.981	0,36
536	Koninklijke Vopak NV	14.874	0,07
622	Kroger Co	25.972	0,13
571	Liberty Global - Class A	10.120	0,05
118	Liberty Media Corp - Liberty SiriusXM - Class C	4.324	0,02
38	Linde PLC	11.624	0,06
86	Lonza Group AG	39.354	0,20
276	L'Oreal SA	92.126	0,46
142	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	96.795	0,48
1.782	Marathon Petroleum Corp	194.349	0,97
184	Marsh & McLennan Cos Inc	28.590	0,14
297	McDonald's Corp	73.383	0,37
262	McKesson Corp	92.134	0,46
18.224	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA	163.728	0,82
410	Merck Co Inc	42.666	0,21
2.760	Meta Platforms Inc	311.174	1,55
2.330	Metso Outotec Oyj	22.399	0,11
503	Microchip Technology Inc	33.109	0,16
3.809	Microsoft Corp	855.948	4,27
43	Moderna Inc	7.217	0,04
27	Molina Healthcare Inc	8.369	0,04
3	MongoDB Inc	537	0,00

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2022**

EURO EQUITY DEFENSIVE PUT WRITE SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Aktien – 96,81 % (30. Juni 2022: 94,89 %) (Fortsetzung)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert EUR	% des Netto- inventar- werts
810	Mosaic Co	33.283	0,17
1.931	Nestle SA	209.518	1,04
78	NetEase Inc	5.311	0,03
13	Netflix Inc	3.654	0,02
214	New Oriental Education & Technology Group Inc	6.995	0,03
115	NextEra Energy Inc	8.977	0,04
841	NOS SGPS SA	3.182	0,02
610	NVIDIA Corp	83.568	0,42
1	NVR Inc	5.727	0,03
837	OMV AG	40.272	0,20
104	ON Semiconductor Corp	6.053	0,03
87.880	Orange SA	815.614	4,06
108	O'Reilly Automotive Inc	85.779	0,43
147	Packaging Corp of America	17.576	0,09
89	Parker-Hannifin Corp	24.337	0,12
27	Paychex Inc	2.902	0,01
982	PepsiCo Inc	166.172	0,83
6.888	Pfizer Inc	330.712	1,65
983	Phillips 66	95.887	0,48
214	PICC Property & Casualty Co Ltd	191	0,00
225	Pinduoduo Inc	17.218	0,09
111	Pioneer Natural Resources Co	23.853	0,12
1.072	Porsche Automobil Holding SE	54.931	0,27
61	Procter & Gamble Co	8.678	0,04
95	Public Service Enterprise Group	5.427	0,03
322	Publicis Groupe SA	19.123	0,10
90	Qorvo Inc	7.603	0,04
103	QUALCOMM Inc	10.604	0,05
858	Raiffeisen Bank International AG	13.164	0,07
474	Robert Half International Inc	32.771	0,16
1.612	Roche Holding (Non-voting rights)	474.342	2,36
162	Royal Caribbean Cruises Ltd	7.486	0,04
1.347	RWE AG	56.029	0,28
43	S&P Global Inc	13.419	0,07
2.156	Salesforce Inc	267.823	1,33
1.225	Sampo Oyj	59.780	0,30
6.767	Sanofi	607.924	3,03
2.773	Schneider Electric SE	362.486	1,81
404	SEI Investments Co	22.054	0,11
330	ServiceNow Inc	120.222	0,60
219	Siemens (Germany listed)	28.401	0,14
110	SKF AB	1.578	0,01
1.163	Snap Inc	9.751	0,05
222	Southern Co	14.842	0,07
2.358	SSAB - Class B	11.495	0,06
1.329	Stora Enso Oyj	17.480	0,09
343	Swatch Group (Bearer)	91.371	0,46
5.360	Swedbank AB	85.462	0,43
28	Swiss Life Holding AG	13.459	0,07
1	Swiss Prime Site AG	17	0,00
386	Symrise AG	39.230	0,20

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2022**

EURO EQUITY DEFENSIVE PUT WRITE SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Aktien – 96,81 % (30. Juni 2022: 94,89 %) (Fortsetzung)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert EUR	% des Netto- inventar- werts
150	Synopsys Inc	44.859	0,22
2.134	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	148.960	0,74
151	Take-Two Interactive Software Inc	14.701	0,07
1.608	TeamViewer AG	19.369	0,10
3.216	Tele2 AB	24.612	0,12
16.616	Telefonaktiebolaget LM Ericsson	91.000	0,45
488	Tesla Inc	56.278	0,28
164	Texas Instruments Inc	25.374	0,13
246	Thermo Fisher Scientific Inc	127.083	0,63
1.596	T-Mobile US Inc	209.417	1,04
29.826	TotalEnergies SE	1.749.266	8,72
172	Tyson Foods Inc	10.020	0,05
492	UCB SA	36.164	0,18
66	UGI Corp	2.299	0,01
48	Ulta Salon Cosmetics & Fragrance Inc	21.103	0,11
232	Union Pacific Corp	44.959	0,22
9	United Rentals Inc	2.999	0,01
181	UnitedHealth Group Inc	89.753	0,45
3.298	Universal Music Group NV	74.248	0,37
1.029	UPM-Kymmene Oyj	35.948	0,18
1.793	Valero Energy Corp	213.090	1,06
2	Vallourec SA	29	0,00
729	Valmet Oyj	18.341	0,09
1.183	Veolia Environnement SA	28.399	0,14
16	VeriSign Inc	3.050	0,02
3.757	Verizon Communications Inc	138.709	0,69
273	Vertex Pharmaceuticals Inc	73.902	0,37
1.484	Vinci SA	138.474	0,69
92	Visa Inc	17.898	0,09
20.166	Vivendi SE	179.759	0,90
774	VMware Inc	89.011	0,44
2.358	Volkswagen (Non-voting rights)	274.571	1,37
53	W R Berkley Corp	3.630	0,02
474	Walmart Inc	62.919	0,31
597	Walt Disney Co	48.556	0,24
215	Waste Management Inc	31.622	0,16
2.045	Wells Fargo & Co	79.130	0,39
212	Western Union Co	2.734	0,01
1.209	Wolters Kluwer NV	118.227	0,59
602	Yum China Holdings Inc	30.820	0,15
612	Yum! Brands Inc	73.459	0,37
680	Zillow Group Inc	20.527	0,10
176	Zoetis Inc	24.224	0,12
110	Zoom Video Communications Inc	6.993	0,03
Aktien insgesamt		19.426.329	96,81

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2022**

EURO EQUITY DEFENSIVE PUT WRITE SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Funded Swaps* – 0,40 % (30. Juni 2022: 0,40 %)

Wäh- rung	Nominalbetrag	Bezeichnung	Fälligkeitstag	Zeitwert EUR	% des Netto- inventarwerts
EUR	677	Euro Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF Klasse A EUR	31. Jul 23	80.268	0,40
Funded Swaps zum beizulegenden Zeitwert				80.268	0,40

Unfunded Swaps* – 2,79 % (30. Juni 2022: 4,73 %)

Wäh- rung	Nominalbetrag	Bezeichnung	Fälligkeitstag	Zeitwert EUR	% des Netto- inventarwerts
EUR	168.660	Euro Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF Total Return Swap Klasse A EUR	31. Jul 23	560.718	2,79
Unfunded Swaps zum beizulegenden Zeitwert				560.718	2,79

Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten

- -

Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnendes Nettovermögen

20.067.315 100,00

Einstufung

* Im Freiverkehr gehandelte derivative Finanzinstrumente.

Gegenpartei der Swap-Kontrakte ist die UBS AG.

	% des Gesamtver- mögens
Analyse des Gesamtvermögens	
Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind	95,02
Im Freiverkehr gehandelte derivative Finanzinstrumente	3,13
Sonstige Vermögenswerte	1,85
	100,00

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2022**

US EQUITY DEFENSIVE COVERED CALL SF UCITS ETF

Aktien – 95,92 % (30. Juni 2022: 95,98 %)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
44	3M Co	5.306	0,16
94	Aalberts NV	3.615	0,11
24	ABB Ltd	736	0,02
99	Abbott Laboratories	10.895	0,32
128	AbbVie Inc	20.691	0,61
312	Accelleron Industries AG	6.452	0,19
50	Accenture PLC	13.236	0,39
186	Achillion Pharmaceuticals Inc	-	0,00
348	Activision Blizzard Inc	26.617	0,79
74	Adobe Inc	24.840	0,74
159	Advanced Micro Devices Inc	10.327	0,31
81	AerCap Holdings NV	4.724	0,14
108	Air Liquide SA	15.234	0,45
101	Alcon Inc	6.915	0,20
285	Alibaba Group Holding Ltd	25.091	0,74
15	Align Technology Inc	3.056	0,09
22	Allianz SE	4.684	0,14
22	Allstate Corp	3.003	0,09
1	Alnylam Pharmaceuticals Inc	213	0,01
268	Alphabet Inc - Class A	23.663	0,70
524	Alphabet Inc - Class C	46.482	1,38
1.813	Amazon.com Inc	152.261	4,51
13	Ameriprise Financial Inc	3.991	0,12
8	AmerisourceBergen Corp	1.331	0,04
60	AMG Advanced Metallurgical Group NV	2.215	0,07
13	Analog Devices Inc	2.061	0,06
76	ANDRITZ AG	4.365	0,13
1.217	Apple Inc	158.081	4,68
116	Applied Materials Inc	11.300	0,33
11	Arista Networks Inc	1.353	0,04
22	ASM International NV	5.480	0,16
60	ASR Nederland NV	2.856	0,08
335	Assa Abloy AB	7.197	0,21
10	Automatic Data Processing Inc	2.266	0,07
2	AutoZone Inc	5.670	0,17
1.602	AXA SA	44.547	1,32
100	Baidu Inc	11.448	0,34
503	Banca Mediolanum SpA	4.185	0,12
681	Bank of America Corp	22.560	0,67
33	Baozun Inc	175	0,01
84	Baxter International Inc	4.276	0,13
119	Berkshire Hathaway Inc	36.726	1,09
24	Best Buy Co Inc	1.913	0,06
5	BioMarin Pharmaceutical Inc	555	0,02
12	Block Inc	743	0,02
603	BNP Paribas SA	34.294	1,01
168	Boliden AB	6.294	0,19
1	Booking Holdings Inc	1.689	0,05
7	Bouygues SA	203	0,01
138	BP PLC	4.835	0,14
7	Brighthouse Financial Inc	344	0,01

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2022**

US EQUITY DEFENSIVE COVERED CALL SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Aktien – 95,92 % (30. Juni 2022: 95,98 %) (Fortsetzung)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
47	Cadence Design Systems Inc	7.624	0,23
225	Carrefour SA	3.757	0,11
335	Castellum AB	4.062	0,12
27	Caterpillar Inc	6.561	0,19
4	Celanese Corp	428	0,01
85	Charles Schwab Corp	7.062	0,21
11	Check Point Software Technologies Ltd	1.436	0,04
160	Chevron Corp	28.786	0,85
1	Chipotle Mexican Grill Inc	930	0,03
8	Cie Financiere Richemont SA	1.000	0,03
43	Cigna Corp	14.374	0,43
203	Citigroup Inc	9.177	0,27
474	Coca-Cola Co	30.161	0,89
39	ConocoPhillips	4.602	0,14
14	Consolidated Edison Inc	1.292	0,04
7	Costco Wholesale Corp	3.355	0,10
61	Coupa Software Inc	4.793	0,14
23	Credicorp Ltd	3.184	0,09
111	CSX Corp	3.448	0,10
4	CVS Health Corp	364	0,01
9	CyberArk Software Ltd	1.174	0,03
222	Danone SA	11.665	0,35
127	Delivery Hero SE	6.088	0,18
14	Delta Air Lines Inc	470	0,01
48	Deutsche Telekom AG	953	0,03
36	DocuSign Inc	2.009	0,06
121	Dominion Energy Inc	7.444	0,22
91	Dropbox Inc	2.039	0,06
54	DTE Energy Co	6.393	0,19
21	Duke Energy Corp	2.180	0,06
2.210	E.ON SE	22.015	0,65
10	Eastman Chemical Co	819	0,02
29	Eckert & Ziegler Strahlen- und Medizintechnik AG	1.458	0,04
2.974	EDP - Energias de Portugal SA	14.779	0,44
103	Edwards Lifesciences Corp	7.676	0,23
10	Electronic Arts Inc	1.229	0,04
46	Eli Lilly & Co	16.979	0,50
1.118	Engie SA	15.976	0,47
58	EQT (US listed)	1.949	0,06
148	Etablissements Franz Colruyt NV	3.353	0,10
66	Euroapi SA	975	0,03
184	Evotec SE	3.003	0,09
40	EXOR (Netherlands listed)	2.932	0,09
7	Expedia Group Inc	611	0,02
720	Exxon Mobil Corp	79.454	2,35
19	Farfetch Ltd	89	0,00
2	FleetCor Technologies Inc	371	0,01
51	Fortinet Inc	2.513	0,07
1.231	Fortum OYJ	20.410	0,60
15	Fox - Class B	428	0,01
521	Fresenius SE & Co KGaA	14.590	0,43

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2022**

US EQUITY DEFENSIVE COVERED CALL SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Aktien – 95,92 % (30. Juni 2022: 95,98 %) (Fortsetzung)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
152	General Motors Co	5.110	0,15
40	Georg Fischer AG	2.472	0,07
222	Gilead Sciences Inc	19.084	0,56
3	Givaudan SA	8.629	0,26
48	Global Payments Inc	4.774	0,14
107	Greenvolt-Energias Renovaveis SA	893	0,03
96	Groupe Bruxelles Lambert SA	7.605	0,23
12	Guangzhou Automobile Group Co Ltd	8	0,00
73	Heineken NV	6.801	0,20
2	Holcim AG	99	0,00
77	Holcim (Switzerland listed)	3.990	0,12
33	Home Depot Inc	10.358	0,31
39	Huntington Ingalls Industries Inc	9.020	0,27
3	IDEXX Laboratories Inc	1.378	0,04
37	IMCD NV	5.240	0,16
60	Incyte Corp	4.805	0,14
224	Industrivarden - Class A	5.458	0,16
768	Intel Corp	20.295	0,60
26	International Business Machines Corp	3.591	0,11
11.734	Intesa Sanpaolo SpA	26.022	0,77
20	Intuit Inc	7.804	0,23
14	IQVIA Holdings Inc	2.806	0,08
118	JD.com Inc	6.641	0,20
320	Juniper Networks Inc	10.226	0,30
28	Kellogg Co	1.976	0,06
29	Kimberly-Clark Corp	3.969	0,12
36	Kinder Morgan Inc	657	0,02
7	KLA Corp	2.528	0,07
668	Koninklijke Ahold Delhaize NV	19.129	0,57
815	Koninklijke Philips NV	12.179	0,36
84	Koninklijke Vopak NV	2.482	0,07
97	Kroger Co	4.334	0,13
89	Liberty Global - Class A	1.689	0,05
18	Liberty Media Corp - Liberty SiriusXM - Class C	721	0,02
6	Linde PLC	1.940	0,06
13	Lonza Group AG	6.567	0,19
43	L’Oreal SA	15.374	0,45
22	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	16.153	0,48
279	Marathon Petroleum Corp	32.432	0,96
29	Marsh & McLennan Cos Inc	4.771	0,14
46	McDonald’s Corp	12.246	0,36
41	McKesson Corp	15.375	0,45
2.850	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA	27.322	0,81
64	Merck Co Inc	7.120	0,21
432	Meta Platforms Inc	51.927	1,54
364	Metso Outotec Oyj	3.738	0,11
79	Microchip Technology Inc	5.525	0,16
596	Microsoft Corp	142.837	4,23
7	Moderna Inc	1.204	0,04
4	Molina Healthcare Inc	1.397	0,04
1	MongoDB Inc	90	0,00

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2022**

US EQUITY DEFENSIVE COVERED CALL SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Aktien – 95,92 % (30. Juni 2022: 95,98 %) (Fortsetzung)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
127	Mosaic Co	5.554	0,16
302	Nestle SA	34.964	1,03
12	NetEase Inc	886	0,03
2	Netflix Inc	610	0,02
34	New Oriental Education & Technology Group Inc	1.167	0,03
18	NextEra Energy Inc	1.498	0,04
132	NOS SGPS SA	531	0,02
95	NVIDIA Corp	13.945	0,41
1	NVR Inc	955	0,03
131	OMV AG	6.720	0,20
16	ON Semiconductor Corp	1.010	0,03
13.741	Orange SA	136.106	4,03
17	O'Reilly Automotive Inc	14.315	0,42
23	Packaging Corp of America	2.933	0,09
14	Parker-Hannifin Corp	4.061	0,12
4	Paychex Inc	484	0,01
154	PepsiCo Inc	27.730	0,82
1.077	Pfizer Inc	55.188	1,63
154	Phillips 66	16.001	0,47
34	PICC Property & Casualty Co Ltd	32	0,00
35	Pinduoduo Inc	2.873	0,09
17	Pioneer Natural Resources Co	3.980	0,12
168	Porsche Automobil Holding SE	9.167	0,27
10	Procter & Gamble Co	1.448	0,04
15	Public Service Enterprise Group	906	0,03
50	Publicis Groupe SA	3.191	0,09
14	Qorvo Inc	1.269	0,04
16	QUALCOMM Inc	1.769	0,05
134	Raiffeisen Bank International AG	2.197	0,07
74	Robert Half International Inc	5.469	0,16
252	Roche Holding (Non-voting rights)	79.156	2,34
25	Royal Caribbean Cruises Ltd	1.249	0,04
211	RWE AG	9.350	0,28
7	S&P Global Inc	2.239	0,07
337	Salesforce Inc	44.693	1,32
191	Sampo Oyj	9.976	0,30
1.058	Sanofi	101.448	3,00
434	Schneider Electric SE	60.490	1,79
63	SEI Investments Co	3.680	0,11
52	ServiceNow Inc	20.062	0,59
34	Siemens (Germany listed)	4.739	0,14
17	SKF AB	263	0,01
182	Snap Inc	1.627	0,05
35	Southern Co	2.477	0,07
369	SSAB - Class B	1.918	0,06
208	Stora Enso Oyj	2.917	0,09
54	Swatch Group (Bearer)	15.248	0,45
838	Swedbank AB	14.261	0,42
4	Swiss Life Holding AG	2.246	0,07
60	Symrise AG	6.546	0,19
23	Synopsys Inc	7.486	0,22

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2022**

US EQUITY DEFENSIVE COVERED CALL SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Aktien – 95,92 % (30. Juni 2022: 95,98 %) (Fortsetzung)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
334	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	24.858	0,74
24	Take-Two Interactive Software Inc	2.453	0,07
251	TeamViewer AG	3.232	0,10
503	Tele2 AB	4.107	0,12
2.598	Telefonaktiebolaget LM Ericsson	15.186	0,45
76	Tesla Inc	9.392	0,28
26	Texas Instruments Inc	4.234	0,13
39	Thermo Fisher Scientific Inc	21.207	0,63
250	T-Mobile US Inc	34.947	1,03
4.664	TotalEnergies SE	291.910	8,64
27	Tyson Foods Inc	1.672	0,05
77	UCB SA	6.035	0,18
10	UGI Corp	384	0,01
8	Ulta Salon Cosmetics & Fragrance Inc	3.521	0,10
36	Union Pacific Corp	7.503	0,22
1	United Rentals Inc	500	0,01
28	UnitedHealth Group Inc	14.978	0,44
516	Universal Music Group NV	12.390	0,37
161	UPM-Kymmene Oyj	5.999	0,18
280	Valero Energy Corp	35.560	1,05
114	Valmet Oyj	3.061	0,09
185	Veolia Environnement SA	4.739	0,14
2	VeriSign Inc	509	0,02
588	Verizon Communications Inc	23.147	0,68
43	Vertex Pharmaceuticals Inc	12.332	0,36
232	Vinci SA	23.108	0,68
14	Visa Inc	2.987	0,09
3.153	Vivendi SE	29.997	0,89
121	VMware Inc	14.854	0,44
369	Volkswagen (Non-voting rights)	45.819	1,36
8	W R Berkley Corp	606	0,02
74	Walmart Inc	10.500	0,31
93	Walt Disney Co	8.103	0,24
34	Waste Management Inc	5.277	0,16
320	Wells Fargo & Co	13.205	0,39
33	Western Union Co	456	0,01
189	Wolters Kluwer NV	19.729	0,58
94	Yum China Holdings Inc	5.143	0,15
96	Yum! Brands Inc	12.259	0,36
106	Zillow Group Inc	3.426	0,10
28	Zoetis Inc	4.042	0,12
17	Zoom Video Communications Inc	1.167	0,03
Aktien insgesamt		3.241.769	95,92

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2022**

US EQUITY DEFENSIVE COVERED CALL SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Funded Swaps* – 0,40 % (30. Juni 2022: 0,40 %)

Wäh- rung	Nominalbetrag	Bezeichnung	Fälligkeitstag	Zeitwert USD	% des Netto- inventarwerts
USD	112	US Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF Klasse A USD	31. Jul 23	13.523	0,40
Funded Swaps zum beizulegenden Zeitwert				13.523	0,40

Unfunded Swaps* – 3,68 % (30. Juni 2022: 3,71 %)

Wäh- rung	Nominalbetrag	Bezeichnung	Fälligkeitstag	Zeitwert USD	% des Netto- inventarwerts
USD	27.804	US Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF Total Return Swap Klasse A USD	31. Jul 23	124.239	3,68
Unfunded Swaps zum beizulegenden Zeitwert				124.239	3,68

Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten

- -

Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnendes Nettovermögen

3.379.531 100,00

Einstufung

* Im Freiverkehr gehandelte derivative Finanzinstrumente.

Gegenpartei der Swap-Kontrakte ist die UBS AG.

Analyse des Gesamtvermögens

Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind
Im Freiverkehr gehandelte derivative Finanzinstrumente
Sonstige Vermögenswerte

**% des
Gesamtver-
mögens**
89,26
3,79
6,95
100,00

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2022**

US EQUITY DEFENSIVE PUT WRITE SF UCITS ETF

Aktien – 96,45 % (30. Juni 2022: 93,75 %)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
261	3M Co	31.249	0,16
551	Aalberts NV	21.288	0,11
143	ABB Ltd	4.337	0,02
584	Abbott Laboratories	64.163	0,32
754	AbbVie Inc	121.857	0,62
1.836	Accelleron Industries AG	37.996	0,19
292	Accenture PLC	77.953	0,39
1.096	Achillion Pharmaceuticals Inc	-	0,00
2.048	Activision Blizzard Inc	156.758	0,79
435	Adobe Inc	146.295	0,74
939	Advanced Micro Devices Inc	60.822	0,31
477	AerCap Holdings NV	27.821	0,14
635	Air Liquide SA	89.718	0,45
596	Alcon Inc	40.723	0,21
1.678	Alibaba Group Holding Ltd	147.772	0,75
85	Align Technology Inc	17.995	0,09
129	Allianz SE	27.583	0,14
130	Allstate Corp	17.688	0,09
5	Alnylam Pharmaceuticals Inc	1.252	0,01
1.580	Alphabet Inc - Class A	139.361	0,70
3.085	Alphabet Inc - Class C	273.750	1,38
10.675	Amazon.com Inc	896.729	4,53
76	Ameriprise Financial Inc	23.507	0,12
47	AmerisourceBergen Corp	7.838	0,04
355	AMG Advanced Metallurgical Group NV	13.048	0,07
74	Analog Devices Inc	12.139	0,06
450	ANDRITZ AG	25.710	0,13
7.165	Apple Inc	931.006	4,70
683	Applied Materials Inc	66.550	0,34
66	Arista Networks Inc	7.970	0,04
128	ASM International NV	32.276	0,16
355	ASR Nederland NV	16.822	0,08
1.974	Assa Abloy AB	42.389	0,21
56	Automatic Data Processing Inc	13.346	0,07
14	AutoZone Inc	33.397	0,17
9.435	AXA SA	262.359	1,33
589	Baidu Inc	67.423	0,34
2.962	Banca Mediolanum SpA	24.648	0,12
4.012	Bank of America Corp	132.868	0,67
195	Baozun Inc	1.032	0,01
494	Baxter International Inc	25.182	0,13
700	Berkshire Hathaway Inc	216.295	1,09
140	Best Buy Co Inc	11.267	0,06
32	BioMarin Pharmaceutical Inc	3.269	0,02
70	Block Inc	4.375	0,02
3.554	BNP Paribas SA	201.972	1,02
987	Boliden AB	37.069	0,19
5	Booking Holdings Inc	9.947	0,05
40	Bouygues SA	1.195	0,01
815	BP PLC	28.475	0,14
40	Brighthouse Financial Inc	2.025	0,01

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2022**

US EQUITY DEFENSIVE PUT WRITE SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Aktien – 96,45 % (30. Juni 2022: 93,75 %) (Fortsetzung)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
280	Cadence Design Systems Inc	44.899	0,23
1.326	Carrefour SA	22.127	0,11
1.974	Castellum AB	23.923	0,12
161	Caterpillar Inc	38.639	0,20
25	Celanese Corp	2.520	0,01
500	Charles Schwab Corp	41.590	0,21
67	Check Point Software Technologies Ltd	8.454	0,04
945	Chevron Corp	169.534	0,86
4	Chipotle Mexican Grill Inc	5.479	0,03
45	Cie Financiere Richemont SA	5.890	0,03
256	Cigna Corp	84.653	0,43
1.195	Citigroup Inc	54.045	0,27
2.793	Coca-Cola Co	177.632	0,90
230	ConocoPhillips	27.100	0,14
80	Consolidated Edison Inc	7.610	0,04
43	Costco Wholesale Corp	19.758	0,10
357	Coupa Software Inc	28.227	0,14
138	Credicorp Ltd	18.749	0,09
656	CSX Corp	20.308	0,10
23	CVS Health Corp	2.144	0,01
53	CyberArk Software Ltd	6.912	0,03
1.308	Danone SA	68.701	0,35
750	Delivery Hero SE	35.856	0,18
84	Delta Air Lines Inc	2.771	0,01
282	Deutsche Telekom AG	5.613	0,03
213	DocuSign Inc	11.831	0,06
715	Dominion Energy Inc	43.843	0,22
536	Dropbox Inc	12.006	0,06
320	DTE Energy Co	37.649	0,19
125	Duke Energy Corp	12.837	0,06
13.015	E.ON SE	129.654	0,66
59	Eastman Chemical Co	4.824	0,02
173	Eckert & Ziegler Strahlen- und Medizintechnik AG	8.587	0,04
17.516	EDP - Energias de Portugal SA	87.040	0,44
606	Edwards Lifesciences Corp	45.208	0,23
59	Electronic Arts Inc	7.237	0,04
273	Eli Lilly & Co	99.996	0,51
6.585	Engie SA	94.091	0,48
339	EQT (US listed)	11.476	0,06
869	Etablissements Franz Colruyt NV	19.748	0,10
388	Euroapi SA	5.741	0,03
1.086	Evotec SE	17.685	0,09
237	EXOR (Netherlands listed)	17.270	0,09
41	Expedia Group Inc	3.597	0,02
4.242	Exxon Mobil Corp	467.935	2,36
110	Farfetch Ltd	521	0,00
12	FleetCor Technologies Inc	2.184	0,01
303	Fortinet Inc	14.800	0,07
7.248	Fortum OYJ	120.204	0,61
89	Fox - Class B	2.523	0,01
3.067	Fresenius SE & Co KGaA	85.929	0,43

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2022**

US EQUITY DEFENSIVE PUT WRITE SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Aktien – 96,45 % (30. Juni 2022: 93,75 %) (Fortsetzung)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
895	General Motors Co	30.097	0,15
238	Georg Fischer AG	14.557	0,07
1.309	Gilead Sciences Inc	112.395	0,57
17	Givaudan SA	50.827	0,26
283	Global Payments Inc	28.117	0,14
632	Greenvolt-Energias Renovaveis SA	5.260	0,03
563	Groupe Bruxelles Lambert SA	44.789	0,23
70	Guangzhou Automobile Group Co Ltd	47	0,00
427	Heineken NV	40.051	0,20
11	Holcim AG	585	0,00
454	Holcim (Switzerland listed)	23.501	0,12
193	Home Depot Inc	61.001	0,31
230	Huntington Ingalls Industries Inc	53.124	0,27
20	IDEXX Laboratories Inc	8.113	0,04
217	IMCD NV	30.863	0,16
352	Incyte Corp	28.297	0,14
1.321	Industrivarden - Class A	32.146	0,16
4.522	Intel Corp	119.525	0,60
150	International Business Machines Corp	21.152	0,11
69.104	Intesa Sanpaolo SpA	153.254	0,77
118	Intuit Inc	45.960	0,23
81	IQVIA Holdings Inc	16.528	0,08
697	JD.com Inc	39.114	0,20
1.884	Juniper Networks Inc	60.226	0,30
163	Kellogg Co	11.640	0,06
172	Kimberly-Clark Corp	23.376	0,12
214	Kinder Morgan Inc	3.867	0,02
40	KLA Corp	14.888	0,08
3.933	Koninklijke Ahold Delhaize NV	112.659	0,57
4.799	Koninklijke Philips NV	71.726	0,36
494	Koninklijke Vopak NV	14.618	0,07
573	Kroger Co	25.525	0,13
525	Liberty Global - Class A	9.946	0,05
109	Liberty Media Corp - Liberty SiriusXM - Class C	4.249	0,02
35	Linde PLC	11.424	0,06
79	Lonza Group AG	38.677	0,20
254	L’Oreal SA	90.541	0,46
131	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	95.131	0,48
1.641	Marathon Petroleum Corp	191.006	0,96
170	Marsh & McLennan Cos Inc	28.098	0,14
274	McDonald’s Corp	72.121	0,36
241	McKesson Corp	90.549	0,46
16.782	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA	160.912	0,81
378	Merck Co Inc	41.932	0,21
2.541	Meta Platforms Inc	305.822	1,55
2.146	Metso Outotec Oyj	22.014	0,11
463	Microchip Technology Inc	32.539	0,16
3.508	Microsoft Corp	841.225	4,25
40	Moderna Inc	7.093	0,04
25	Molina Healthcare Inc	8.225	0,04
3	MongoDB Inc	528	0,00

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2022**

US EQUITY DEFENSIVE PUT WRITE SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Aktien – 96,45 % (30. Juni 2022: 93,75 %) (Fortsetzung)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
746	Mosaic Co	32.710	0,17
1.778	Nestle SA	205.914	1,04
72	NetEase Inc	5.220	0,03
12	Netflix Inc	3.591	0,02
197	New Oriental Education & Technology Group Inc	6.875	0,03
106	NextEra Energy Inc	8.822	0,04
774	NOS SGPS SA	3.127	0,02
562	NVIDIA Corp	82.130	0,41
1	NVR Inc	5.627	0,03
771	OMV AG	39.579	0,20
95	ON Semiconductor Corp	5.949	0,03
80.926	Orange SA	801.584	4,05
100	O'Reilly Automotive Inc	84.304	0,43
135	Packaging Corp of America	17.274	0,09
82	Parker-Hannifin Corp	23.918	0,12
25	Paychex Inc	2.852	0,01
904	PepsiCo Inc	163.313	0,83
6.343	Pfizer Inc	325.023	1,64
905	Phillips 66	94.238	0,48
197	PICC Property & Casualty Co Ltd	187	0,00
208	Pinduoduo Inc	16.921	0,09
103	Pioneer Natural Resources Co	23.442	0,12
987	Porsche Automobil Holding SE	53.986	0,27
56	Procter & Gamble Co	8.528	0,04
87	Public Service Enterprise Group	5.333	0,03
296	Publicis Groupe SA	18.794	0,09
82	Qorvo Inc	7.472	0,04
95	QUALCOMM Inc	10.422	0,05
790	Raiffeisen Bank International AG	12.938	0,07
436	Robert Half International Inc	32.207	0,16
1.485	Roche Holding (Non-voting rights)	466.183	2,36
149	Royal Caribbean Cruises Ltd	7.358	0,04
1.241	RWE AG	55.065	0,28
39	S&P Global Inc	13.188	0,07
1.985	Salesforce Inc	263.216	1,33
1.128	Sampo Oyj	58.752	0,30
6.231	Sanofi	597.467	3,02
2.554	Schneider Electric SE	356.251	1,80
372	SEI Investments Co	21.675	0,11
304	ServiceNow Inc	118.154	0,60
202	Siemens (Germany listed)	27.912	0,14
102	SKF AB	1.551	0,01
1.071	Snap Inc	9.583	0,05
204	Southern Co	14.587	0,07
2.172	SSAB - Class B	11.297	0,06
1.224	Stora Enso Oyj	17.180	0,09
316	Swatch Group (Bearer)	89.800	0,45
4.936	Swedbank AB	83.991	0,42
26	Swiss Life Holding AG	13.227	0,07
1	Swiss Prime Site AG	17	0,00
355	Symrise AG	38.555	0,19

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2022**

US EQUITY DEFENSIVE PUT WRITE SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Aktien – 96,45 % (30. Juni 2022: 93,75 %) (Fortsetzung)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
138	Synopsys Inc	44.088	0,22
1.965	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	146.398	0,74
139	Take-Two Interactive Software Inc	14.448	0,07
1.481	TeamViewer AG	19.036	0,10
2.962	Tele2 AB	24.188	0,12
15.302	Telefonaktiebolaget LM Ericsson	89.435	0,45
449	Tesla Inc	55.310	0,28
151	Texas Instruments Inc	24.937	0,13
227	Thermo Fisher Scientific Inc	124.897	0,63
1.470	T-Mobile US Inc	205.815	1,04
27.465	TotalEnergies SE	1.719.177	8,69
158	Tyson Foods Inc	9.848	0,05
453	UCB SA	35.542	0,18
61	UGI Corp	2.260	0,01
44	Ulta Salon Cosmetics & Fragrance Inc	20.740	0,10
213	Union Pacific Corp	44.186	0,22
8	United Rentals Inc	2.947	0,01
166	UnitedHealth Group Inc	88.209	0,45
3.037	Universal Music Group NV	72.971	0,37
948	UPM-Kymmene Oyj	35.330	0,18
1.651	Valero Energy Corp	209.425	1,06
2	Vallourec SA	28	0,00
671	Valmet Oyj	18.026	0,09
1.090	Veolia Environnement SA	27.911	0,14
15	VeriSign Inc	2.997	0,02
3.460	Verizon Communications Inc	136.323	0,69
252	Vertex Pharmaceuticals Inc	72.630	0,37
1.367	Vinci SA	136.093	0,69
85	Visa Inc	17.591	0,09
18.570	Vivendi SE	176.667	0,89
713	VMware Inc	87.480	0,44
2.172	Volkswagen (Non-voting rights)	269.848	1,36
49	W R Berkley Corp	3.568	0,02
436	Walmart Inc	61.836	0,31
549	Walt Disney Co	47.721	0,24
198	Waste Management Inc	31.078	0,16
1.884	Wells Fargo & Co	77.769	0,39
195	Western Union Co	2.687	0,01
1.114	Wolters Kluwer NV	116.193	0,59
554	Yum China Holdings Inc	30.290	0,15
564	Yum! Brands Inc	72.195	0,36
626	Zillow Group Inc	20.174	0,10
162	Zoetis Inc	23.807	0,12
101	Zoom Video Communications Inc	6.872	0,03
Aktien insgesamt		19.092.179	96,45

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2022**

US EQUITY DEFENSIVE PUT WRITE SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Funded Swaps* – 0,40 % (30. Juni 2022: 0,40 %)

Wäh- rung	Nominalbetrag	Bezeichnung	Fälligkeitstag	Zeitwert USD	% des Netto- inventarwerts
USD	687	US Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF Klasse A USD	31. Jul 23	79.178	0,40
Funded Swaps zum beizulegenden Zeitwert				79.178	0,40

Unfunded Swaps* – 3,15 % (30. Juni 2022: 5,87 %)

Wäh- rung	Nominalbetrag	Bezeichnung	Fälligkeitstag	Zeitwert USD	% des Netto- inventarwerts
USD	171.020	US Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF Total Return Swap Klasse A USD	31. Jul 23	623.095	3,15
Unfunded Swaps zum beizulegenden Zeitwert				623.095	3,15

Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten

- -

Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnendes Nettovermögen

19.794.452 100,00

Einstufung

* Im Freiverkehr gehandelte derivative Finanzinstrumente.

Gegenpartei der Swap-Kontrakte ist die UBS AG.

Analyse des Gesamtvermögens

Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind
Im Freiverkehr gehandelte derivative Finanzinstrumente
Sonstige Vermögenswerte

**% des
Gesamtver-
mögens**
92,93
3,42
3,65
100,00

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2022**

MSCI USA SF INDEX FUND

Aktien – 95,66 % (30. Juni 2022: 95,17 %)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
12.135	3M Co	1.455.183	0,16
25.638	Aalberts NV	991.327	0,11
6.659	ABB Ltd	201.970	0,02
27.215	Abbott Laboratories	2.987.967	0,32
35.113	AbbVie Inc	5.674.621	0,61
85.508	Accelleron Industries AG	1.769.391	0,19
13.604	Accenture PLC	3.630.131	0,39
51.029	Achillion Pharmaceuticals Inc	-	0,00
95.361	Activision Blizzard Inc	7.299.905	0,79
20.244	Adobe Inc	6.812.664	0,73
43.729	Advanced Micro Devices Inc	2.832.345	0,30
22.215	AerCap Holdings NV	1.295.581	0,14
29.567	Air Liquide SA	4.177.985	0,45
27.770	Alcon Inc	1.896.367	0,20
78.118	Alibaba Group Holding Ltd	6.881.454	0,74
3.973	Align Technology Inc	837.977	0,09
5.991	Allianz SE	1.284.502	0,14
6.074	Allstate Corp	823.693	0,09
245	Alnylam Pharmaceuticals Inc	58.319	0,01
73.555	Alphabet Inc - Class A	6.489.743	0,70
143.672	Alphabet Inc - Class C	12.748.015	1,37
497.130	Amazon.com Inc	41.758.903	4,49
3.516	Ameriprise Financial Inc	1.094.666	0,12
2.203	AmerisourceBergen Corp	365.023	0,04
16.550	AMG Advanced Metallurgical Group NV	607.601	0,07
3.446	Analog Devices Inc	565.270	0,06
20.949	ANDRITZ AG	1.197.259	0,13
333.681	Apple Inc	43.355.117	4,66
31.825	Applied Materials Inc	3.099.124	0,33
3.058	Arista Networks Inc	371.127	0,04
5.976	ASM International NV	1.503.031	0,16
16.550	ASR Nederland NV	783.345	0,08
91.944	Assa Abloy AB	1.973.969	0,21
2.602	Automatic Data Processing Inc	621.514	0,07
631	AutoZone Inc	1.555.274	0,17
439.366	AXA SA	12.217.519	1,31
27.450	Baidu Inc	3.139.754	0,34
137.915	Banca Mediolanum SpA	1.147.788	0,12
186.817	Bank of America Corp	6.187.390	0,67
9.069	Baozun Inc	48.068	0,01
23.007	Baxter International Inc	1.172.659	0,13
32.607	Berkshire Hathaway Inc	10.072.428	1,08
6.542	Best Buy Co Inc	524.694	0,06
1.471	BioMarin Pharmaceutical Inc	152.244	0,02
3.242	Block Inc	203.723	0,02
165.498	BNP Paribas SA	9.405.444	1,01
45.972	Boliden AB	1.726.230	0,19
230	Booking Holdings Inc	463.230	0,05
1.860	Bouygues SA	55.657	0,01
37.962	BP PLC	1.326.029	0,14
1.839	Brighthouse Financial Inc	94.279	0,01

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2022**

MSCI USA SF INDEX FUND (Fortsetzung)

Aktien – 95,66 % (30. Juni 2022: 95,17 %) (Fortsetzung)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
13.016	Cadence Design Systems Inc	2.090.859	0,23
61.732	Carrefour SA	1.030.417	0,11
91.944	Castellum AB	1.114.053	0,12
7.511	Caterpillar Inc	1.799.348	0,19
1.148	Celanese Corp	117.344	0,01
23.262	Charles Schwab Corp	1.936.770	0,21
3.121	Check Point Software Technologies Ltd	393.702	0,04
43.985	Chevron Corp	7.894.861	0,85
184	Chipotle Mexican Grill Inc	255.141	0,03
2.116	Cie Financiere Richemont SA	274.266	0,03
1	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA	10	0,00
11.898	Cigna Corp	3.942.146	0,42
55.644	Citigroup Inc	2.516.789	0,27
130.042	Coca-Cola Co	8.271.960	0,89
10.695	ConocoPhillips	1.261.995	0,14
3.718	Consolidated Edison Inc	354.364	0,04
2.016	Costco Wholesale Corp	920.073	0,10
16.603	Coupa Software Inc	1.314.458	0,14
6.436	Credicorp Ltd	873.114	0,09
30.526	CSX Corp	945.709	0,10
1.071	CVS Health Corp	99.820	0,01
2.482	CyberArk Software Ltd	321.853	0,03
60.892	Danone SA	3.199.284	0,34
34.939	Delivery Hero SE	1.669.763	0,18
3.927	Delta Air Lines Inc	129.029	0,01
13.141	Deutsche Telekom AG	261.392	0,03
9.941	DocuSign Inc	550.937	0,06
33.295	Dominion Energy Inc	2.041.658	0,22
24.982	Dropbox Inc	559.088	0,06
14.917	DTE Energy Co	1.753.229	0,19
5.804	Duke Energy Corp	597.776	0,06
606.094	E.ON SE	6.037.732	0,65
2.758	Eastman Chemical Co	224.636	0,02
8.075	Eckert & Ziegler Strahlen- und Medizintechnik AG	399.897	0,04
815.692	EDP - Energias de Portugal SA	4.053.266	0,44
28.217	Edwards Lifesciences Corp	2.105.264	0,23
2.758	Electronic Arts Inc	337.010	0,04
12.729	Eli Lilly & Co	4.656.621	0,50
306.658	Engie SA	4.381.639	0,47
15.797	EQT (US listed)	534.397	0,06
40.455	Etablissements Franz Colruyt NV	919.643	0,10
18.088	Euroapi SA	267.370	0,03
50.569	Evotec SE	823.577	0,09
11.033	EXOR (Netherlands listed)	804.246	0,09
1.912	Expedia Group Inc	167.529	0,02
197.559	Exxon Mobil Corp	21.790.787	2,34
5.132	Farfetch Ltd	24.273	0,00
554	FleetCor Technologies Inc	101.684	0,01
14.097	Fortinet Inc	689.214	0,07
337.513	Fortum OYJ	5.597.677	0,60
4.130	Fox - Class B	117.504	0,01

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2022**

MSCI USA SF INDEX FUND (Fortsetzung)

Aktien – 95,66 % (30. Juni 2022: 95,17 %) (Fortsetzung)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
142.834	Fresenius SE & Co KGaA	4.001.548	0,43
41.663	General Motors Co	1.401.556	0,15
11.081	Georg Fischer AG	677.887	0,07
60.967	Gilead Sciences Inc	5.234.027	0,56
773	Givaudan SA	2.366.863	0,25
13.183	Global Payments Inc	1.309.368	0,14
29.422	Greenvolt-Energias Renovaveis SA	244.924	0,03
26.204	Groupe Bruxelles Lambert SA	2.085.712	0,22
3.236	Guangzhou Automobile Group Co Ltd	2.181	0,00
19.886	Heineken NV	1.865.115	0,20
523	Holcim AG	27.228	0,00
21.147	Holcim (Switzerland listed)	1.094.379	0,12
8.994	Home Depot Inc	2.840.702	0,31
10.724	Huntington Ingalls Industries Inc	2.473.901	0,27
926	IDEXX Laboratories Inc	377.793	0,04
10.114	IMCD NV	1.437.213	0,15
16.406	Incyte Corp	1.317.711	0,14
61.529	Industrivarden - Class A	1.496.960	0,16
210.596	Intel Corp	5.566.051	0,60
6.991	International Business Machines Corp	984.991	0,11
3.218.024	Intesa Sanpaolo SpA	7.136.755	0,77
5.499	Intuit Inc	2.140.269	0,23
3.757	IQVIA Holdings Inc	769.677	0,08
32.451	JD.com Inc	1.821.475	0,20
87.753	Juniper Networks Inc	2.804.584	0,30
7.609	Kellogg Co	542.030	0,06
8.019	Kimberly-Clark Corp	1.088.572	0,12
9.960	Kinder Morgan Inc	180.085	0,02
1.839	KLA Corp	693.310	0,07
183.149	Koninklijke Ahold Delhaize NV	5.246.308	0,56
223.483	Koninklijke Philips NV	3.340.126	0,36
22.986	Koninklijke Vopak NV	680.754	0,07
26.664	Kroger Co	1.188.664	0,13
24.467	Liberty Global - Class A	463.169	0,05
5.057	Liberty Media Corp - Liberty SiriusXM - Class C	197.876	0,02
1.631	Linde PLC	531.995	0,06
3.678	Lonza Group AG	1.801.108	0,19
11.842	L’Oreal SA	4.216.309	0,45
6.105	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	4.430.032	0,48
76.422	Marathon Petroleum Corp	8.894.778	0,96
7.907	Marsh & McLennan Cos Inc	1.308.474	0,14
12.744	McDonald’s Corp	3.358.528	0,36
11.241	McKesson Corp	4.216.696	0,45
781.520	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA	7.493.347	0,81
17.600	Merck Co Inc	1.952.701	0,21
118.344	Meta Platforms Inc	14.241.509	1,53
99.932	Metso Outotec Oyj	1.025.141	0,11
21.570	Microchip Technology Inc	1.515.276	0,16
163.348	Microsoft Corp	39.174.182	4,21
6	Minebea Mitsumi Inc	96	0,00
1.839	Moderna Inc	330.298	0,04

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2022**

MSCI USA SF INDEX FUND (Fortsetzung)

Aktien – 95,66 % (30. Juni 2022: 95,17 %) (Fortsetzung)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
1.160	Molina Healthcare Inc	383.042	0,04
125	MongoDB Inc	24.577	0,00
34.722	Mosaic Co	1.523.251	0,16
82.805	Nestle SA	9.589.026	1,03
3.347	NetEase Inc	243.074	0,03
567	Netflix Inc	167.229	0,02
9.194	New Oriental Education & Technology Group Inc	320.147	0,03
4.914	NextEra Energy Inc	410.835	0,04
36.060	NOS SGPS SA	145.627	0,02
26.171	NVIDIA Corp	3.824.642	0,41
57	NVR Inc	262.091	0,03
35.904	OMV AG	1.843.119	0,20
4.442	ON Semiconductor Corp	277.040	0,03
3.768.567	Orange SA	37.328.193	4,02
4.651	O'Reilly Automotive Inc	3.925.864	0,42
6.289	Packaging Corp of America	804.406	0,09
3.828	Parker-Hannifin Corp	1.113.808	0,12
1.149	Paychex Inc	132.812	0,01
42.097	PepsiCo Inc	7.605.176	0,82
1	Pernod Ricard SA	18	0,00
295.388	Pfizer Inc	15.135.687	1,63
42.164	Phillips 66	4.388.460	0,47
9.194	PICC Property & Casualty Co Ltd	8.729	0,00
9.663	Pinduoduo Inc	787.994	0,09
4.780	Pioneer Natural Resources Co	1.091.653	0,12
45.972	Porsche Automobil Holding SE	2.514.006	0,27
2.620	Procter & Gamble Co	397.147	0,04
4.054	Public Service Enterprise Group	248.359	0,03
13.801	Publicis Groupe SA	875.181	0,09
3.839	Qorvo Inc	347.968	0,04
4.414	QUALCOMM Inc	485.308	0,05
36.777	Raiffeisen Bank International AG	602.498	0,07
20.315	Robert Half International Inc	1.499.831	0,16
69.141	Roche Holding (Non-voting rights)	21.709.199	2,34
6.932	Royal Caribbean Cruises Ltd	342.630	0,04
57.771	RWE AG	2.564.263	0,28
1.834	S&P Global Inc	614.125	0,07
92.446	Salesforce Inc	12.257.465	1,32
52.510	Sampo Oyj	2.735.957	0,29
290.179	Sanofi	27.822.869	2,99
118.915	Schneider Electric SE	16.589.907	1,79
17.313	SEI Investments Co	1.009.351	0,11
14.171	ServiceNow Inc	5.502.203	0,59
9.395	Siemens (Germany listed)	1.299.808	0,14
4.730	SKF AB	72.239	0,01
49.864	Snap Inc	446.284	0,05
9.512	Southern Co	679.286	0,07
101.138	SSAB - Class B	526.098	0,06
57.005	Stora Enso Oyj	800.027	0,09
14.711	Swatch Group (Bearer)	4.181.781	0,45
229.859	Swedbank AB	3.911.318	0,42

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2022**

MSCI USA SF INDEX FUND (Fortsetzung)

Aktien – 95,66 % (30. Juni 2022: 95,17 %) (Fortsetzung)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
1.195	Swiss Life Holding AG	615.978	0,07
9	Swiss Prime Site AG	797	0,00
16.550	Symrise AG	1.795.424	0,19
6.430	Synopsys Inc	2.053.087	0,22
91.522	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	6.817.445	0,73
6.461	Take-Two Interactive Software Inc	672.799	0,07
68.958	TeamViewer AG	886.452	0,10
137.915	Tele2 AB	1.126.407	0,12
712.562	Telefonaktiebolaget LM Ericsson	4.164.792	0,45
20.910	Tesla Inc	2.575.681	0,28
7.029	Texas Instruments Inc	1.161.285	0,13
10.562	Thermo Fisher Scientific Inc	5.816.193	0,63
68.460	T-Mobile US Inc	9.584.408	1,03
1.279.011	TotalEnergies SE	80.058.664	8,61
7.367	Tyson Foods Inc	458.589	0,05
21.083	UCB SA	1.655.133	0,18
2.839	UGI Corp	105.233	0,01
2.059	Ulta Salon Cosmetics & Fragrance Inc	965.808	0,10
9.937	Union Pacific Corp	2.057.651	0,22
386	United Rentals Inc	137.250	0,02
7.748	UnitedHealth Group Inc	4.107.732	0,44
141.448	Universal Music Group NV	3.398.111	0,37
44.133	UPM-Kymmene Oyj	1.645.232	0,18
76.876	Valero Energy Corp	9.752.491	1,05
101	Vallourec SA	1.318	0,00
31.261	Valmet Oyj	839.415	0,09
50.744	Veolia Environnement SA	1.299.747	0,14
679	VeriSign Inc	139.570	0,02
161.125	Verizon Communications Inc	6.348.314	0,68
11.712	Vertex Pharmaceuticals Inc	3.382.257	0,36
63.653	Vinci SA	6.337.563	0,68
3.943	Visa Inc	819.159	0,09
864.780	Vivendi SE	8.227.052	0,89
33.185	VMware Inc	4.073.790	0,44
101.138	Volkswagen (Non-voting rights)	12.566.301	1,35
2.289	W R Berkley Corp	166.141	0,02
20.309	Walmart Inc	2.879.593	0,31
25.579	Walt Disney Co	2.222.277	0,24
9.225	Waste Management Inc	1.447.257	0,16
87.710	Wells Fargo & Co	3.621.554	0,39
9.086	Western Union Co	125.116	0,01
51.861	Wolters Kluwer NV	5.410.895	0,58
25.811	Yum China Holdings Inc	1.410.553	0,15
26.249	Yum! Brands Inc	3.361.991	0,36
29.167	Zillow Group Inc	939.477	0,10
7.565	Zoetis Inc	1.108.654	0,12
4.724	Zoom Video Communications Inc	320.026	0,03
Aktien insgesamt		889.085.177	95,66

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2022**

MSCI USA SF INDEX FUND (Fortsetzung)

Funded Swaps* – 0,40 % (30. Juni 2022: 0,40 %)

Wäh- rung	Nominalbetrag	Bezeichnung	Fälligkeitstag	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
CHF	53	MSCI USA SF Index Fund Klasse A CHF**	31. Jul 23	5.917	0,00
CHF	1.980	MSCI USA SF Index Fund Klasse A CHF**	31. Jul 23	224.773	0,03
EUR	272	MSCI USA SF Index Fund Klasse A EUR**	31. Jul 23	30.103	0,00
EUR	9.636	MSCI USA SF Index Fund Klasse A EUR**	31. Jul 23	1.086.149	0,12
GBP	10	MSCI USA SF Index Fund Klasse A GBP**	31. Jul 23	1.265	0,00
GBP	785	MSCI USA SF Index Fund Klasse A GBP**	31. Jul 23	101.182	0,01
USD	18.497	MSCI USA SF Index Fund Klasse A USD	31. Jul 23	2.055.073	0,22
USD	2.033	MSCI USA SF Index Fund Klasse A USD	31. Jul 23	220.868	0,02
Funded Swaps zum beizulegenden Zeitwert				3.725.330	0,40

Unfunded Swaps* – 3,94 % (30. Juni 2022: 4,45 %)

Wäh- rung	Nominalbetrag	Bezeichnung	Fälligkeitstag	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
CHF	13.257	MSCI USA SF Index Fund Total Return Swap Klasse A CHF**	31. Jul 23	54.028	0,00
CHF	491.049	MSCI USA SF Index Fund Total Return Swap Klasse A CHF**	31. Jul 23	2.043.914	0,22
EUR	67.726	MSCI USA SF Index Fund Total Return Swap Klasse A EUR**	31. Jul 23	293.102	0,03
EUR	2.381.438	MSCI USA SF Index Fund Total Return Swap Klasse A EUR**	31. Jul 23	10.488.940	1,13
GBP	2.490	MSCI USA SF Index Fund Total Return Swap Klasse A GBP**	31. Jul 23	11.498	0,00
GBP	195.499	MSCI USA SF Index Fund Total Return Swap Klasse A GBP**	31. Jul 23	919.650	0,10
USD	4.609.112	MSCI USA SF Index Fund Total Return Swap Klasse A USD	31. Jul 23	20.727.297	2,23
USD	506.127	MSCI USA SF Index Fund Total Return Swap Klasse A USD	31. Jul 23	2.119.412	0,23
Unfunded Swaps zum beizulegenden Zeitwert				36.657.841	3,94

Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten (133) (0,00)

Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnendes Nettovermögen 929.468.215 100,00

Einstufung

* Im Freiverkehr gehandelte derivative Finanzinstrumente.

** Die abgesicherte Aktienklasse investiert in Swaps mit einem Engagement in einer währungsgesicherten Version des Referenzindex.

Gegenpartei der Swap-Kontrakte ist die UBS AG.

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2022**

MSCI USA SF INDEX FUND (Fortsetzung)

	% des Gesamtver-
Analyse des Gesamtvermögens	mögens
Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind	92,13
Im Freiverkehr gehandelte derivative Finanzinstrumente	4,19
Sonstige Vermögenswerte	3,68
	<hr/>
	100,00
	<hr/>

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2022**

CMCI COMMODITY CARRY EX-AGRICULTURE SF UCITS ETF

Aktien – 97,62 % (30. Juni 2022: 90,53 %)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
804	3M Co	96.466	0,16
1.700	Aalberts NV	65.716	0,11
441	ABB Ltd	13.389	0,02
1.804	Abbott Laboratories	198.076	0,33
2.328	AbbVie Inc	376.178	0,62
5.668	Accelleron Industries AG	117.295	0,19
902	Accenture PLC	240.646	0,40
3.383	Achillion Pharmaceuticals Inc	-	0,00
6.322	Activision Blizzard Inc	483.920	0,80
1.342	Adobe Inc	451.621	0,75
2.899	Advanced Micro Devices Inc	187.760	0,31
1.473	AerCap Holdings NV	85.886	0,14
1.960	Air Liquide SA	276.964	0,46
1.841	Alcon Inc	125.713	0,21
5.179	Alibaba Group Holding Ltd	456.181	0,76
263	Align Technology Inc	55.551	0,09
397	Allianz SE	85.151	0,14
403	Allstate Corp	54.604	0,09
16	Alnylam Pharmaceuticals Inc	3.866	0,01
4.876	Alphabet Inc - Class A	430.214	0,71
9.524	Alphabet Inc - Class C	845.083	1,40
32.955	Amazon.com Inc	2.768.253	4,59
233	Ameriprise Financial Inc	72.567	0,12
146	AmerisourceBergen Corp	24.198	0,04
1.097	AMG Advanced Metallurgical Group NV	40.279	0,07
228	Analog Devices Inc	37.472	0,06
1.389	ANDRITZ AG	79.368	0,13
22.120	Apple Inc	2.874.068	4,76
2.110	Applied Materials Inc	205.445	0,34
203	Arista Networks Inc	24.602	0,04
396	ASM International NV	99.638	0,17
1.097	ASR Nederland NV	51.929	0,09
6.095	Assa Abloy AB	130.857	0,22
172	Automatic Data Processing Inc	41.201	0,07
42	AutoZone Inc	103.101	0,17
29.126	AXA SA	809.915	1,34
1.820	Baidu Inc	208.138	0,34
9.143	Banca Mediolanum SpA	76.088	0,13
12.384	Bank of America Corp	410.170	0,68
601	Baozun Inc	3.186	0,01
1.525	Baxter International Inc	77.737	0,13
2.162	Berkshire Hathaway Inc	667.715	1,11
434	Best Buy Co Inc	34.783	0,06
97	BioMarin Pharmaceutical Inc	10.092	0,02
215	Block Inc	13.505	0,02
10.971	BNP Paribas SA	623.499	1,03
3.047	Boliden AB	114.434	0,19
15	Booking Holdings Inc	30.709	0,05
123	Bouygues SA	3.690	0,01
2.517	BP PLC	87.904	0,15
122	Brighthouse Financial Inc	6.250	0,01

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2022**

CMCI COMMODITY CARRY EX-AGRICULTURE SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Aktien – 97,62 % (30. Juni 2022: 90,53 %) (Fortsetzung)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
863	Cadence Design Systems Inc	138.606	0,23
4.092	Carrefour SA	68.308	0,11
6.095	Castellum AB	73.852	0,12
498	Caterpillar Inc	119.281	0,20
76	Celanese Corp	7.779	0,01
1.542	Charles Schwab Corp	128.391	0,21
207	Check Point Software Technologies Ltd	26.099	0,04
2.916	Chevron Corp	523.361	0,87
12	Chipotle Mexican Grill Inc	16.914	0,03
140	Cie Financiere RICHEMONT SA	18.181	0,03
789	Cigna Corp	261.330	0,43
3.689	Citigroup Inc	166.841	0,28
8.621	Coca-Cola Co	548.359	0,91
709	ConocoPhillips	83.659	0,14
246	Consolidated Edison Inc	23.491	0,04
134	Costco Wholesale Corp	60.993	0,10
1.101	Coupa Software Inc	87.137	0,14
427	Credicorp Ltd	57.880	0,10
2.024	CSX Corp	62.692	0,10
71	CVS Health Corp	6.617	0,01
165	CyberArk Software Ltd	21.336	0,04
4.037	Danone SA	212.085	0,35
2.316	Delivery Hero SE	110.691	0,18
260	Delta Air Lines Inc	8.554	0,01
871	Deutsche Telekom AG	17.328	0,03
659	DocuSign Inc	36.522	0,06
2.207	Dominion Energy Inc	135.344	0,22
1.656	Dropbox Inc	37.063	0,06
989	DTE Energy Co	116.224	0,19
385	Duke Energy Corp	39.627	0,07
40.179	E.ON SE	400.249	0,66
183	Eastman Chemical Co	14.891	0,02
535	Eckert & Ziegler Strahlen- und Medizintechnik AG	26.510	0,04
54.073	EDP - Energias de Portugal SA	268.696	0,45
1.871	Edwards Lifesciences Corp	139.561	0,23
183	Electronic Arts Inc	22.341	0,04
844	Eli Lilly & Co	308.694	0,51
20.329	Engie SA	290.465	0,48
1.047	EQT (US listed)	35.426	0,06
2.682	Etablissements Franz Colruyt NV	60.964	0,10
1.199	Euroapi SA	17.724	0,03
3.352	Evotec SE	54.596	0,09
731	EXOR (Netherlands listed)	53.315	0,09
127	Expedia Group Inc	11.106	0,02
13.096	Exxon Mobil Corp	1.444.540	2,39
340	Farfetch Ltd	1.609	0,00
37	FleetCor Technologies Inc	6.741	0,01
934	Fortinet Inc	45.689	0,08
22.374	Fortum OYJ	371.077	0,61
274	Fox - Class B	7.790	0,01
9.469	Fresenius SE & Co KGaA	265.268	0,44

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2022**

CMCI COMMODITY CARRY EX-AGRICULTURE SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Aktien – 97,62 % (30. Juni 2022: 90,53 %) (Fortsetzung)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
2.762	General Motors Co	92.911	0,15
735	Georg Fischer AG	44.938	0,07
4.042	Gilead Sciences Inc	346.970	0,57
51	Givaudan SA	156.902	0,26
874	Global Payments Inc	86.800	0,14
1.950	Greenvolt-Energias Renovaveis SA	16.236	0,03
1.737	Groupe Bruxelles Lambert SA	138.265	0,23
215	Guangzhou Automobile Group Co Ltd	145	0,00
1.318	Heineken NV	123.641	0,20
35	Holcim AG	1.805	0,00
1.402	Holcim (Switzerland listed)	72.548	0,12
596	Home Depot Inc	188.314	0,31
711	Huntington Ingalls Industries Inc	163.998	0,27
61	IDEXX Laboratories Inc	25.044	0,04
670	IMCD NV	95.275	0,16
1.088	Incyte Corp	87.353	0,14
4.079	Industrivarden - Class A	99.235	0,16
13.961	Intel Corp	368.981	0,61
463	International Business Machines Corp	65.296	0,11
213.327	Intesa Sanpaolo SpA	473.105	0,78
364	Intuit Inc	141.881	0,24
249	IQVIA Holdings Inc	51.023	0,08
2.151	JD.com Inc	120.748	0,20
5.817	Juniper Networks Inc	185.920	0,31
504	Kellogg Co	35.932	0,06
532	Kimberly-Clark Corp	72.163	0,12
660	Kinder Morgan Inc	11.938	0,02
122	KLA Corp	45.960	0,08
12.141	Koninklijke Ahold Delhaize NV	347.785	0,58
14.815	Koninklijke Philips NV	221.421	0,37
1.524	Koninklijke Vopak NV	45.128	0,07
1.768	Kroger Co	78.798	0,13
1.622	Liberty Global - Class A	30.704	0,05
335	Liberty Media Corp - Liberty SiriusXM - Class C	13.117	0,02
108	Linde PLC	35.267	0,06
244	Lonza Group AG	119.398	0,20
785	L'Oreal SA	279.505	0,46
405	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	293.673	0,49
5.066	Marathon Petroleum Corp	589.647	0,98
524	Marsh & McLennan Cos Inc	86.740	0,14
845	McDonald's Corp	222.641	0,37
745	McKesson Corp	279.530	0,46
51.808	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA	496.744	0,82
1.167	Merck Co Inc	129.447	0,21
7.845	Meta Platforms Inc	944.088	1,56
6.625	Metso Outotec Oyj	67.958	0,11
1.430	Microchip Technology Inc	100.450	0,17
10.829	Microsoft Corp	2.596.908	4,30
1	Minebea Mitsumi Inc	6	0,00
122	Moderna Inc	21.896	0,04
77	Molina Healthcare Inc	25.392	0,04

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2022**

CMCI COMMODITY CARRY EX-AGRICULTURE SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Aktien – 97,62 % (30. Juni 2022: 90,53 %) (Fortsetzung)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
8	MongoDB Inc	1.629	0,00
2.302	Mosaic Co	100.978	0,17
5.489	Nestle SA	635.669	1,05
222	NetEase Inc	16.114	0,03
38	Netflix Inc	11.086	0,02
609	New Oriental Education & Technology Group Inc	21.223	0,04
326	NextEra Energy Inc	27.235	0,05
2.390	NOS SGPS SA	9.654	0,02
1.735	NVIDIA Corp	253.541	0,42
4	NVR Inc	17.376	0,03
2.380	OMV AG	122.183	0,20
294	ON Semiconductor Corp	18.365	0,03
249.823	Orange SA	2.474.535	4,10
308	O'Reilly Automotive Inc	260.251	0,43
417	Packaging Corp of America	53.325	0,09
254	Parker-Hannifin Corp	73.836	0,12
76	Paychex Inc	8.804	0,01
2.791	PepsiCo Inc	504.157	0,84
19.582	Pfizer Inc	1.003.365	1,66
2.795	Phillips 66	290.917	0,48
609	PICC Property & Casualty Co Ltd	579	0,00
641	Pinduoduo Inc	52.237	0,09
317	Pioneer Natural Resources Co	72.367	0,12
3.047	Porsche Automobil Holding SE	166.657	0,28
174	Procter & Gamble Co	26.327	0,04
269	Public Service Enterprise Group	16.464	0,03
915	Publicis Groupe SA	58.017	0,10
254	Qorvo Inc	23.067	0,04
293	QUALCOMM Inc	32.172	0,05
2.438	Raiffeisen Bank International AG	39.940	0,07
1.347	Robert Half International Inc	99.426	0,16
4.583	Roche Holding (Non-voting rights)	1.439.131	2,38
459	Royal Caribbean Cruises Ltd	22.713	0,04
3.830	RWE AG	169.988	0,28
122	S&P Global Inc	40.711	0,07
6.128	Salesforce Inc	812.563	1,35
3.481	Sampo Oyj	181.370	0,30
19.236	Sanofi	1.844.414	3,05
7.883	Schneider Electric SE	1.099.767	1,82
1.148	SEI Investments Co	66.911	0,11
939	ServiceNow Inc	364.748	0,60
623	Siemens (Germany listed)	86.166	0,14
313	SKF AB	4.789	0,01
3.306	Snap Inc	29.585	0,05
631	Southern Co	45.031	0,07
6.705	SSAB - Class B	34.876	0,06
3.779	Stora Enso Oyj	53.035	0,09
975	Swatch Group (Bearer)	277.216	0,46
15.238	Swedbank AB	259.286	0,43
79	Swiss Life Holding AG	40.834	0,07
1	Swiss Prime Site AG	53	0,00

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2022**

CMCI COMMODITY CARRY EX-AGRICULTURE SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Aktien – 97,62 % (30. Juni 2022: 90,53 %) (Fortsetzung)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
1.097	Symrise AG	119.021	0,20
426	Synopsys Inc	136.102	0,23
6.067	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	451.937	0,75
428	Take-Two Interactive Software Inc	44.601	0,07
4.571	TeamViewer AG	58.764	0,10
9.143	Tele2 AB	74.671	0,12
47.237	Telefonaktiebolaget LM Ericsson	276.090	0,46
1.386	Tesla Inc	170.745	0,28
466	Texas Instruments Inc	76.983	0,13
700	Thermo Fisher Scientific Inc	385.563	0,64
4.538	T-Mobile US Inc	635.363	1,05
84.787	TotalEnergies SE	5.307.194	8,79
488	Tyson Foods Inc	30.400	0,05
1.398	UCB SA	109.721	0,18
188	UGI Corp	6.976	0,01
136	Ulta Salon Cosmetics & Fragrance Inc	64.025	0,11
659	Union Pacific Corp	136.404	0,23
26	United Rentals Inc	9.098	0,02
514	UnitedHealth Group Inc	272.307	0,45
9.377	Universal Music Group NV	225.265	0,37
2.926	UPM-Kymmene Oyj	109.065	0,18
5.096	Valero Energy Corp	646.505	1,07
7	Vallourec SA	87	0,00
2.072	Valmet Oyj	55.646	0,09
3.364	Veolia Environnement SA	86.162	0,14
45	VeriSign Inc	9.252	0,02
10.681	Verizon Communications Inc	420.838	0,70
776	Vertex Pharmaceuticals Inc	224.214	0,37
4.220	Vinci SA	420.125	0,70
261	Visa Inc	54.303	0,09
57.327	Vivendi SE	545.382	0,90
2.200	VMware Inc	270.057	0,45
6.705	Volkswagen (Non-voting rights)	833.037	1,38
152	W R Berkley Corp	11.014	0,02
1.346	Walmart Inc	190.892	0,32
1.696	Walt Disney Co	147.318	0,24
612	Waste Management Inc	95.941	0,16
5.814	Wells Fargo & Co	240.078	0,40
602	Western Union Co	8.294	0,01
3.438	Wolters Kluwer NV	358.695	0,59
1.711	Yum China Holdings Inc	93.507	0,16
1.740	Yum! Brands Inc	222.871	0,37
1.934	Zillow Group Inc	62.279	0,10
501	Zoetis Inc	73.494	0,12
313	Zoom Video Communications Inc	21.215	0,04
Aktien insgesamt		58.938.624	97,62

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2022**

CMCI COMMODITY CARRY EX-AGRICULTURE SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Funded Swaps* – 0,40 % (30. Juni 2022: 0,40 %)

Wäh- rung	Nominalbetrag	Bezeichnung	Fälligkeitstag	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
EUR	160	CMCI Commodity Carry Ex-Agriculture Klasse A EUR**	31. Jul 23	18.730	0,03
USD	1.969	CMCI Commodity Carry Ex-Agriculture Klasse A USD	31. Jul 23	222.780	0,37
Funded Swaps zum beizulegenden Zeitwert				241.510	0,40

Unfunded Swaps* – 1,98 % (30. Juni 2022: 9,09 %)

Wäh- rung	Nominalbetrag	Bezeichnung	Fälligkeitstag	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
EUR	39.840	CMCI Commodity Carry Ex-Agriculture Total Return Net Index Swap Klasse A EUR**	31. Jul 23	89.899	0,15
USD	490.361	CMCI Commodity Carry Ex-Agriculture Total Return Net Index Swap Klasse A USD	31. Jul 23	1.107.333	1,83
Unfunded Swaps zum beizulegenden Zeitwert				1.197.232	1,98

Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten (42) (0,00)

Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnendes Nettovermögen 60.377.324 100,00

Einstufung

* Im Freiverkehr gehandelte derivative Finanzinstrumente.

** Die abgesicherte Aktienklasse investiert in Swaps mit einem Engagement in einer währungsgesicherten Version des Referenzindex.

Gegenpartei der Swap-Kontrakte ist die UBS AG.

	% des Gesamtver- mögens
Analyse des Gesamtvermögens	
Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind	95,74
Im Freiverkehr gehandelte derivative Finanzinstrumente	2,34
Sonstige Vermögenswerte	1,92
	100,00

**WESENTLICHE PORTFOLIOTRANSAKTIONEN
FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2022**

Die folgende Aufstellung der wesentlichen Portfoliotransaktionen weist die Gesamtkäufe eines Wertpapiers, die 1 % des Gesamtwerts der Käufe im Geschäftsjahr übersteigen, und die Gesamtveräußerungen, die 1 % der Gesamtverkäufe im Berichtszeitraum übersteigen, aus. Gegebenenfalls sind mindestens die 20 größten Käufe und Verkäufe anzugeben.

CMCI COMPOSITE SF UCITS ETF

Portfoliokäufe	Kosten USD	Portfolioverkäufe	Erlöse USD
Apple Inc	287.957.604	Apple Inc	(261.075.200)
Microsoft Corp	192.102.563	Microsoft Corp	(187.622.507)
Amazon.com Inc	127.510.919	Exxon Mobil Corp	(121.152.289)
Exxon Mobil Corp	121.418.524	Pfizer Inc	(107.404.776)
Pfizer Inc	91.658.307	Bank of America Corp	(90.007.095)
Telefonaktiebolaget LM Ericsson	90.875.553	ConocoPhillips	(78.151.671)
Bank of America Corp	78.031.254	Chevron Corp	(77.236.205)
Chevron Corp	73.674.449	Alphabet Inc - Class C	(72.129.007)
ConocoPhillips	72.462.618	Telefonaktiebolaget LM Ericsson	(65.525.849)
Activision Blizzard Inc	57.365.431	PepsiCo Inc	(57.349.495)
Marathon Petroleum Corp	56.855.884	Alphabet Inc - Class A	(54.784.371)
PepsiCo Inc	51.993.099	Meta Platforms Inc	(47.247.698)
Swedish Match AB	51.225.113	Marathon Petroleum Corp	(45.479.710)
Walmart Inc	50.074.177	Cisco Systems Inc	(45.173.123)
Roche Holding AG	49.680.239	Aker BP ASA	(43.248.670)
Merck Co Inc	49.110.984	NVIDIA Corp	(42.354.587)
Telia Co AB	45.634.862	QUALCOMM Inc	(41.462.323)
Assa Abloy AB	44.030.926	Zurich Insurance Group Ltd	(39.660.672)
Nestle SA	42.430.751	Swedish Match AB	(37.552.691)
Alphabet Inc - Class C	41.848.536	Novartis AG	(37.194.667)

**WESENTLICHE PORTFOLIOTRANSAKTIONEN (Fortsetzung)
FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2022**

Die folgende Aufstellung der wesentlichen Portfoliotransaktionen weist die Gesamtkäufe eines Wertpapiers, die 1 % des Gesamtwerts der Käufe im Geschäftsjahr übersteigen, und die Gesamtveräußerungen, die 1 % der Gesamtverkäufe im Berichtszeitraum übersteigen, aus. Gegebenenfalls sind mindestens die 20 größten Käufe und Verkäufe anzugeben.

BLOOMBERG COMMODITY INDEX SF UCITS ETF

Portfoliokäufe	Kosten USD	Portfolioverkäufe	Erlöse USD
Lam Research Corp	29.646.926	Apple Inc	(50.065.628)
NXP Semiconductors NV	26.466.028	UnitedHealth Group Inc	(34.902.081)
JPMorgan Chase & Co	24.635.087	Advanced Micro Devices Inc	(28.859.449)
Accenture PLC	21.314.089	Lam Research Corp	(27.414.183)
Bank of America Corp	20.109.697	NXP Semiconductors NV	(25.377.882)
Texas Instruments Inc	19.827.323	PepsiCo Inc	(23.665.620)
Apple Inc	19.782.854	JPMorgan Chase & Co	(23.105.519)
Mastercard Inc	19.673.354	Morgan Stanley	(23.036.762)
Charles Schwab Corp	18.018.762	Bank of America Corp	(22.960.477)
Microsoft Corp	16.066.206	Berkshire Hathaway Inc	(22.040.240)
Walt Disney Co	14.664.834	Accenture PLC	(21.978.401)
PayPal Holdings Inc	13.017.392	Microsoft Corp	(20.464.427)
Cisco Systems Inc	12.731.744	Mastercard Inc	(19.944.591)
Berkshire Hathaway Inc	12.497.925	Walt Disney Co	(18.789.125)
Trip.com Group Ltd	10.282.305	Meta Platforms Inc	(18.697.843)
UnitedHealth Group Inc	10.090.673	QUALCOMM Inc	(16.299.970)
Salesforce Inc	10.004.876	Thermo Fisher Scientific Inc	(15.959.259)
BP PLC	9.624.606	Skyworks Solutions Inc	(15.750.697)
Morgan Stanley	8.769.475	Charles Schwab Corp	(15.419.983)
Advanced Micro Devices Inc	8.710.260	Adobe Inc	(13.636.244)
Alphabet Inc - Class A	8.624.069	Intel Corp	(13.017.208)
PepsiCo Inc	8.622.798	Cisco Systems Inc	(12.469.626)
Exxon Mobil Corp	8.290.066	Chevron Corp	(11.707.403)
Merck Co Inc	8.264.557	Netflix Inc	(10.669.852)
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	8.182.915	Baidu Inc	(10.595.304)
Meta Platforms Inc	7.667.423	NVIDIA Corp	(10.513.431)
Citigroup Inc	7.123.343	Scientific Games Corp	(10.494.079)
Colgate-Palmolive Co	6.985.941	Colgate-Palmolive Co	(10.330.961)
Amazon.com Inc	6.800.727	Micron Technology Inc	(10.282.168)
NVIDIA Corp	6.681.380	Procter & Gamble Co	(9.630.628)
Thermo Fisher Scientific Inc	6.583.566	Exxon Mobil Corp	(9.505.546)
Netflix Inc	6.232.690	Texas Instruments Inc	(9.492.811)
Marathon Petroleum Corp	6.145.163	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	(8.274.333)
DocuSign Inc	5.930.169	Lowe's Cos Inc	(8.264.433)
Intel Corp	5.776.018	Marathon Petroleum Corp	(7.834.582)
Fisker Inc	5.229.991	DocuSign Inc	(7.775.683)
Pinduoduo Inc	5.019.980	Trip.com Group Ltd	(7.664.002)

**WESENTLICHE PORTFOLIOTRANSAKTIONEN (Fortsetzung)
FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2022**

Die folgende Aufstellung der wesentlichen Portfoliotransaktionen weist die Gesamtkäufe eines Wertpapiers, die 1 % des Gesamtwerts der Käufe im Geschäftsjahr übersteigen, und die Gesamtveräußerungen, die 1 % der Gesamtverkäufe im Berichtszeitraum übersteigen, aus. Gegebenenfalls sind mindestens die 20 größten Käufe und Verkäufe anzugeben.

S&P 500 SF UCITS ETF

Portfoliokäufe	Kosten USD	Portfolioverkäufe	Erlöse USD
Apple Inc	21.924.579	Apple Inc	(18.885.680)
Microsoft Corp	15.156.720	Microsoft Corp	(13.834.998)
Amazon.com Inc	10.482.788	Exxon Mobil Corp	(9.335.849)
Exxon Mobil Corp	9.927.565	Pfizer Inc	(7.588.577)
Pfizer Inc	6.879.641	Bank of America Corp	(7.498.549)
Telefonaktiebolaget LM Ericsson	6.433.920	Chevron Corp	(6.156.066)
Bank of America Corp	6.192.604	ConocoPhillips	(5.714.676)
Chevron Corp	5.527.315	Telefonaktiebolaget LM Ericsson	(5.166.276)
ConocoPhillips	5.256.203	Alphabet Inc - Class C	(4.320.170)
Roche Holding AG	4.321.671	PepsiCo Inc	(4.230.244)
Marathon Petroleum Corp	4.308.543	Meta Platforms Inc	(3.714.389)
PepsiCo Inc	4.132.431	Alphabet Inc - Class A	(3.356.586)
Walmart Inc	3.941.102	Marathon Petroleum Corp	(3.279.668)
Activision Blizzard Inc	3.568.482	Assa Abloy AB	(3.271.919)
TotalEnergies SE	3.561.680	NVIDIA Corp	(3.214.945)
Assa Abloy AB	3.477.115	Novartis AG	(3.138.259)
Merck Co Inc	3.461.152	Zurich Insurance Group Ltd	(3.067.548)
Nestle SA	3.438.364	Aker BP ASA	(3.048.879)
Telia Co AB	3.209.127	Cisco Systems Inc	(3.019.882)
Alphabet Inc - Class C	3.121.538	Telia Co AB	(2.846.347)

**WESENTLICHE PORTFOLIOTRANSAKTIONEN (Fortsetzung)
FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2022**

Die folgende Aufstellung der wesentlichen Portfoliotransaktionen weist die Gesamtkäufe eines Wertpapiers, die 1 % des Gesamtwerts der Käufe im Geschäftsjahr übersteigen, und die Gesamtveräußerungen, die 1 % der Gesamtverkäufe im Berichtszeitraum übersteigen, aus. Gegebenenfalls sind mindestens die 20 größten Käufe und Verkäufe anzugeben.

MSCI USA SF UCITS ETF

Portfoliokäufe	Kosten USD	Portfolioverkäufe	Erlöse USD
Apple Inc	76.124.028	Apple Inc	(65.534.111)
Microsoft Corp	51.965.368	Microsoft Corp	(47.609.170)
Amazon.com Inc	35.887.849	Exxon Mobil Corp	(32.145.416)
Exxon Mobil Corp	33.393.852	Pfizer Inc	(26.584.640)
Pfizer Inc	24.030.018	Bank of America Corp	(25.542.582)
Telefonaktiebolaget LM Ericsson	22.609.296	Chevron Corp	(21.111.853)
Bank of America Corp	21.217.142	ConocoPhillips	(19.694.915)
Chevron Corp	19.171.849	Telefonaktiebolaget LM Ericsson	(17.831.935)
ConocoPhillips	18.548.626	Alphabet Inc - Class C	(15.169.381)
Marathon Petroleum Corp	14.906.163	PepsiCo Inc	(14.742.564)
Roche Holding AG	14.743.100	Meta Platforms Inc	(12.731.858)
PepsiCo Inc	14.362.457	Alphabet Inc - Class A	(11.611.593)
Walmart Inc	13.765.358	Marathon Petroleum Corp	(11.444.632)
Activision Blizzard Inc	12.507.601	NVIDIA Corp	(11.331.955)
Assa Abloy AB	12.082.944	Assa Abloy AB	(11.026.631)
TotalEnergies SE	12.011.851	Aker BP ASA	(10.672.958)
Merck Co Inc	11.885.235	Novartis AG	(10.634.653)
Nestle SA	11.800.722	Zurich Insurance Group Ltd	(10.476.723)
Telia Co AB	11.465.709	Cisco Systems Inc	(10.309.278)
Alphabet Inc - Class C	10.875.347	QUALCOMM Inc	(9.912.205)

**WESENTLICHE PORTFOLIOTRANSAKTIONEN (Fortsetzung)
FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2022**

Die folgende Aufstellung der wesentlichen Portfoliotransaktionen weist die Gesamtkäufe eines Wertpapiers, die 1 % des Gesamtwerts der Käufe im Geschäftsjahr übersteigen, und die Gesamtveräußerungen, die 1 % der Gesamtverkäufe im Berichtszeitraum übersteigen, aus. Gegebenenfalls sind mindestens die 20 größten Käufe und Verkäufe anzugeben.

MSCI EMERGING MARKETS SF UCITS ETF

Portfoliokäufe	Kosten USD	Portfolioverkäufe	Erlöse USD
Texas Instruments Inc	11.745.686	Lam Research Corp	(14.694.264)
Apple Inc	11.621.229	Apple Inc	(14.652.829)
JPMorgan Chase & Co	9.583.869	UnitedHealth Group Inc	(14.076.098)
Bank of America Corp	9.456.936	JPMorgan Chase & Co	(12.817.064)
Microsoft Corp	9.430.755	Advanced Micro Devices Inc	(12.019.200)
Lam Research Corp	8.115.902	NXP Semiconductors NV	(11.451.282)
Walt Disney Co	7.272.393	Walt Disney Co	(9.654.112)
Mastercard Inc	6.923.890	Accenture PLC	(9.615.699)
Cisco Systems Inc	6.888.209	Bank of America Corp	(9.453.625)
NXP Semiconductors NV	6.764.945	PepsiCo Inc	(9.138.341)
BP PLC	5.663.311	Berkshire Hathaway Inc	(8.713.219)
Salesforce Inc	5.657.731	Thermo Fisher Scientific Inc	(8.116.702)
UnitedHealth Group Inc	5.531.260	Microsoft Corp	(7.648.606)
PepsiCo Inc	5.067.223	Cisco Systems Inc	(7.284.282)
Morgan Stanley	5.055.122	Charles Schwab Corp	(7.219.725)
Accenture PLC	5.046.980	Mastercard Inc	(7.004.628)
Exxon Mobil Corp	4.674.437	Meta Platforms Inc	(6.059.668)
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	4.592.464	Skyworks Solutions Inc	(5.968.094)
Alphabet Inc - Class A	4.159.240	Baidu Inc	(5.757.190)
Citigroup Inc	4.041.027	Morgan Stanley	(5.646.286)
Thermo Fisher Scientific Inc	4.037.216	Chevron Corp	(5.556.146)
NVIDIA Corp	3.830.878	NVIDIA Corp	(5.416.030)
Amazon.com Inc	3.816.777	Texas Instruments Inc	(5.375.400)
Marathon Petroleum Corp	3.448.825	Exxon Mobil Corp	(5.334.804)
Charles Schwab Corp	3.420.076	Netflix Inc	(5.211.089)
Intel Corp	3.382.723	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	(5.002.179)
Advanced Micro Devices Inc	3.301.669	Marathon Petroleum Corp	(4.353.135)
Pinduoduo Inc	2.788.730	Adobe Inc	(4.174.788)
MercadoLibre Inc	2.571.776	Colgate-Palmolive Co	(3.841.397)
Medtronic PLC	2.513.708	Trip.com Group Ltd	(3.637.302)
Chevron Corp	2.497.713	Citigroup Inc	(3.608.148)
PayPal Holdings Inc	2.480.692	Scientific Games Corp	(3.595.599)
Berkshire Hathaway Inc	2.461.844	DocuSign Inc	(3.501.720)
Verizon Communications Inc	2.440.748	Vertex Pharmaceuticals Inc	(3.373.903)
Meta Platforms Inc	2.281.816	Salesforce Inc	(3.347.310)
Trip.com Group Ltd	2.057.282	Merck Co Inc	(3.315.669)
		QUALCOMM Inc	(3.286.052)

**WESENTLICHE PORTFOLIOTRANSAKTIONEN (Fortsetzung)
FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2022**

Die folgende Aufstellung der wesentlichen Portfoliotransaktionen weist die Gesamtkäufe eines Wertpapiers, die 1 % des Gesamtwerts der Käufe im Geschäftsjahr übersteigen, und die Gesamtveräußerungen, die 1 % der Gesamtverkäufe im Berichtszeitraum übersteigen, aus. Gegebenenfalls sind mindestens die 20 größten Käufe und Verkäufe anzugeben.

MSCI AC ASIA EX JAPAN SF UCITS ETF

Portfoliokäufe	Kosten USD	Portfolioverkäufe	Erlöse USD
Apple Inc	26.796.662	Apple Inc	(23.153.712)
Microsoft Corp	18.728.162	Microsoft Corp	(16.856.420)
Amazon.com Inc	12.844.151	Exxon Mobil Corp	(11.326.925)
Exxon Mobil Corp	11.966.201	Pfizer Inc	(9.561.781)
Pfizer Inc	8.455.664	Bank of America Corp	(9.228.717)
Telefonaktiebolaget LM Ericsson	8.030.181	Chevron Corp	(7.363.859)
Bank of America Corp	7.530.592	ConocoPhillips	(7.274.000)
Chevron Corp	6.877.213	Telefonaktiebolaget LM Ericsson	(6.435.916)
ConocoPhillips	6.404.761	Alphabet Inc - Class C	(5.545.906)
Marathon Petroleum Corp	5.418.384	PepsiCo Inc	(5.291.270)
Roche Holding AG	5.338.831	Meta Platforms Inc	(4.595.158)
PepsiCo Inc	5.099.930	Alphabet Inc - Class A	(4.252.655)
Walmart Inc	4.820.332	Assa Abloy AB	(4.157.639)
Assa Abloy AB	4.454.997	Marathon Petroleum Corp	(4.075.153)
Activision Blizzard Inc	4.453.635	NVIDIA Corp	(4.069.472)
TotalEnergies SE	4.412.751	Cisco Systems Inc	(3.840.476)
Merck Co Inc	4.283.740	Zurich Insurance Group Ltd	(3.834.581)
Nestle SA	4.275.374	Novartis AG	(3.789.167)
Telia Co AB	4.166.075	Aker BP ASA	(3.737.320)
Alphabet Inc - Class C	3.926.130	Merck Co Inc	(3.553.943)

**WESENTLICHE PORTFOLIOTRANSAKTIONEN (Fortsetzung)
FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2022**

Die folgende Aufstellung der wesentlichen Portfoliotransaktionen weist die Gesamtkäufe eines Wertpapiers, die 1 % des Gesamtwerts der Käufe im Geschäftsjahr übersteigen, und die Gesamtveräußerungen, die 1 % der Gesamtverkäufe im Berichtszeitraum übersteigen, aus. Gegebenenfalls sind mindestens die 20 größten Käufe und Verkäufe anzugeben.

MSCI ACWI SF UCITS ETF

Portfoliokäufe	Kosten USD	Portfolioverkäufe	Erlöse USD
Apple Inc	566.841.107	Apple Inc	(387.047.756)
Microsoft Corp	462.725.533	Microsoft Corp	(279.142.073)
Amazon.com Inc	273.903.735	Bank of America Corp	(188.749.743)
Exxon Mobil Corp	222.973.083	Exxon Mobil Corp	(187.668.058)
Pfizer Inc	163.511.933	Pfizer Inc	(168.244.074)
Bank of America Corp	160.875.829	ConocoPhillips	(128.081.361)
Chevron Corp	159.196.984	Chevron Corp	(126.563.163)
Telefonaktiebolaget LM Ericsson	151.027.467	PepsiCo Inc	(120.764.128)
PepsiCo Inc	143.254.667	NVIDIA Corp	(116.180.936)
Roche Holding AG	141.374.266	Telefonaktiebolaget LM Ericsson	(112.928.267)
TotalEnergies SE	131.361.985	Walmart Inc	(107.056.635)
ConocoPhillips	118.516.444	Assa Abloy AB	(106.743.836)
Telia Co AB	111.786.948	Merck Co Inc	(101.774.420)
Salesforce Inc	109.577.738	Atlas Copco AB	(96.982.100)
Marathon Petroleum Corp	108.284.427	Telia Co AB	(94.456.495)
Verizon Communications Inc	103.365.208	Alphabet Inc - Class C	(87.558.346)
NVIDIA Corp	97.924.451	Meta Platforms Inc	(83.411.452)
Walmart Inc	97.775.878	Activision Blizzard Inc	(78.262.479)
Merck Co Inc	91.802.350	QUALCOMM Inc	(77.340.850)
Coca-Cola Co	90.015.188	Cisco Systems Inc	(77.218.261)

**WESENTLICHE PORTFOLIOTRANSAKTIONEN (Fortsetzung)
FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2022**

Die folgende Aufstellung der wesentlichen Portfoliotransaktionen weist die Gesamtkäufe eines Wertpapiers, die 1 % des Gesamtwerts der Käufe im Geschäftsjahr übersteigen, und die Gesamtveräußerungen, die 1 % der Gesamtverkäufe im Berichtszeitraum übersteigen, aus. Gegebenenfalls sind mindestens die 20 größten Käufe und Verkäufe anzugeben.

CMCI EX-AGRICULTURE SF UCITS ETF

Portfoliokäufe	Kosten USD	Portfolioverkäufe	Erlöse USD
Apple Inc	17.094.357	Apple Inc	(15.235.713)
Microsoft Corp	11.732.957	Microsoft Corp	(10.749.687)
Amazon.com Inc	8.039.800	Exxon Mobil Corp	(7.327.082)
Exxon Mobil Corp	7.533.647	Pfizer Inc	(6.391.793)
Pfizer Inc	5.436.267	Bank of America Corp	(5.789.894)
Telefonaktiebolaget LM Ericsson	5.142.583	Chevron Corp	(4.761.810)
Bank of America Corp	4.866.557	ConocoPhillips	(4.555.934)
Chevron Corp	4.307.178	Telefonaktiebolaget LM Ericsson	(4.042.798)
ConocoPhillips	4.068.104	Alphabet Inc - Class C	(3.774.566)
Marathon Petroleum Corp	3.435.360	PepsiCo Inc	(3.339.097)
Roche Holding AG	3.250.323	Meta Platforms Inc	(2.954.186)
PepsiCo Inc	3.162.493	Alphabet Inc - Class A	(2.930.693)
Activision Blizzard Inc	3.059.045	Marathon Petroleum Corp	(2.619.055)
Walmart Inc	2.971.831	NVIDIA Corp	(2.570.790)
Assa Abloy AB	2.904.433	Cisco Systems Inc	(2.560.052)
Merck Co Inc	2.811.335	Assa Abloy AB	(2.442.607)
Nestle SA	2.782.570	Zurich Insurance Group Ltd	(2.433.222)
Swedish Match AB	2.739.720	Novartis AG	(2.401.745)
TotalEnergies SE	2.662.135	Aker BP ASA	(2.395.990)
Telia Co AB	2.604.572	QUALCOMM Inc	(2.318.757)

**WESENTLICHE PORTFOLIOTRANSAKTIONEN (Fortsetzung)
FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2022**

Die folgende Aufstellung der wesentlichen Portfoliotransaktionen weist die Gesamtkäufe eines Wertpapiers, die 1 % des Gesamtwerts der Käufe im Geschäftsjahr übersteigen, und die Gesamtveräußerungen, die 1 % der Gesamtverkäufe im Berichtszeitraum übersteigen, aus. Gegebenenfalls sind mindestens die 20 größten Käufe und Verkäufe anzugeben.

BLOOMBERG COMMODITY CMCI SF UCITS ETF

Portfoliokäufe	Kosten USD	Portfolioverkäufe	Erlöse USD
Apple Inc	73.896.318	Apple Inc	(61.740.119)
Microsoft Corp	54.970.103	Microsoft Corp	(43.205.447)
Amazon.com Inc	42.475.559	Exxon Mobil Corp	(33.655.385)
Exxon Mobil Corp	38.005.217	Bank of America Corp	(30.177.743)
Pfizer Inc	24.447.832	Pfizer Inc	(25.006.409)
Bank of America Corp	23.534.580	Chevron Corp	(23.414.667)
Telefonaktiebolaget LM Ericsson	18.265.932	Telefonaktiebolaget LM Ericsson	(19.904.804)
Roche Holding AG	18.177.355	ConocoPhillips	(17.487.965)
Chevron Corp	18.139.117	Meta Platforms Inc	(14.784.725)
TotalEnergies SE	15.624.326	Assa Abloy AB	(14.316.979)
ConocoPhillips	15.562.567	PepsiCo Inc	(13.465.007)
Assa Abloy AB	15.513.135	Novartis AG	(13.380.281)
Marathon Petroleum Corp	15.327.729	Telia Co AB	(12.268.839)
PepsiCo Inc	14.656.494	Alphabet Inc - Class C	(11.887.678)
Nestle SA	14.503.819	Zurich Insurance Group Ltd	(11.494.611)
Walmart Inc	13.482.795	Atlas Copco AB	(11.304.394)
Novartis AG	12.250.631	NVIDIA Corp	(11.006.476)
Volkswagen AG	12.080.195	Alphabet Inc - Class A	(10.354.588)
Meta Platforms Inc	11.956.896	Cisco Systems Inc	(10.342.152)
Merck Co Inc	11.703.466	Swedish Match AB	(10.120.259)

**WESENTLICHE PORTFOLIOTRANSAKTIONEN (Fortsetzung)
FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2022**

Die folgende Aufstellung der wesentlichen Portfoliotransaktionen weist die Gesamtkäufe eines Wertpapiers, die 1 % des Gesamtwerts der Käufe im Geschäftsjahr übersteigen, und die Gesamtveräußerungen, die 1 % der Gesamtverkäufe im Berichtszeitraum übersteigen, aus. Gegebenenfalls sind mindestens die 20 größten Käufe und Verkäufe anzugeben.

CMCI COMMODITY CARRY SF UCITS ETF

Portfoliokäufe	Kosten USD	Portfolioverkäufe	Erlöse USD
Apple Inc	17.699.180	Apple Inc	(15.298.161)
Microsoft Corp	12.168.436	Microsoft Corp	(10.705.717)
Amazon.com Inc	8.810.434	Exxon Mobil Corp	(8.100.663)
Exxon Mobil Corp	8.449.553	Bank of America Corp	(6.518.924)
Bank of America Corp	5.957.735	Pfizer Inc	(5.840.542)
Pfizer Inc	5.669.114	Chevron Corp	(5.350.376)
Telefonaktiebolaget LM Ericsson	4.493.493	ConocoPhillips	(4.533.354)
Chevron Corp	4.109.806	Telefonaktiebolaget LM Ericsson	(4.167.768)
Roche Holding AG	3.864.993	Alphabet Inc - Class C	(3.346.159)
ConocoPhillips	3.748.579	Meta Platforms Inc	(3.191.598)
PepsiCo Inc	3.494.135	Novartis AG	(3.133.724)
Marathon Petroleum Corp	3.401.313	PepsiCo Inc	(3.132.173)
TotalEnergies SE	3.118.983	Assa Abloy AB	(3.063.244)
Assa Abloy AB	3.098.540	Zurich Insurance Group Ltd	(2.682.331)
Walmart Inc	3.035.227	Cisco Systems Inc	(2.635.059)
Nestle SA	2.916.886	Alphabet Inc - Class A	(2.619.244)
Merck Co Inc	2.791.784	NVIDIA Corp	(2.566.719)
Volkswagen AG	2.748.111	Telia Co AB	(2.466.884)
Activision Blizzard Inc	2.709.452	Marathon Petroleum Corp	(2.405.787)
Meta Platforms Inc	2.647.084	Atlas Copco AB	(2.290.934)

**WESENTLICHE PORTFOLIOTRANSAKTIONEN (Fortsetzung)
FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2022**

Die folgende Aufstellung der wesentlichen Portfoliotransaktionen weist die Gesamtkäufe eines Wertpapiers, die 1 % des Gesamtwerts der Käufe im Geschäftsjahr übersteigen, und die Gesamtveräußerungen, die 1 % der Gesamtverkäufe im Berichtszeitraum übersteigen, aus. Gegebenenfalls sind mindestens die 20 größten Käufe und Verkäufe anzugeben.

MSCI CHINA A SF UCITS ETF

Portfoliokäufe	Kosten USD	Portfolioverkäufe	Erlöse USD
Apple Inc	20.907.520	Apple Inc	(18.762.037)
Microsoft Corp	15.437.103	Microsoft Corp	(13.238.432)
Amazon.com Inc	10.595.677	Exxon Mobil Corp	(8.971.291)
Exxon Mobil Corp	9.736.486	Bank of America Corp	(7.714.038)
Pfizer Inc	6.546.975	Pfizer Inc	(7.396.402)
Bank of America Corp	6.296.828	Chevron Corp	(5.959.555)
Telefonaktiebolaget LM Ericsson	6.055.499	ConocoPhillips	(5.927.914)
Chevron Corp	5.546.660	Telefonaktiebolaget LM Ericsson	(5.212.606)
ConocoPhillips	4.932.715	PepsiCo Inc	(4.379.346)
Marathon Petroleum Corp	4.304.791	Alphabet Inc - Class C	(4.185.788)
Roche Holding AG	4.168.186	Meta Platforms Inc	(3.839.449)
PepsiCo Inc	4.013.913	NVIDIA Corp	(3.327.646)
Assa Abloy AB	3.762.269	Assa Abloy AB	(3.322.770)
Walmart Inc	3.727.877	Alphabet Inc - Class A	(3.289.404)
Nestle SA	3.586.374	Zurich Insurance Group Ltd	(3.179.883)
TotalEnergies SE	3.582.348	Marathon Petroleum Corp	(3.140.125)
Telia Co AB	3.483.427	Cisco Systems Inc	(3.133.671)
Activision Blizzard Inc	3.368.015	Novartis AG	(3.114.190)
Merck Co Inc	3.367.606	Merck Co Inc	(2.927.671)
Meta Platforms Inc	3.104.133	Swedish Match AB	(2.837.374)

**WESENTLICHE PORTFOLIOTRANSAKTIONEN (Fortsetzung)
FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2022**

Die folgende Aufstellung der wesentlichen Portfoliotransaktionen weist die Gesamtkäufe eines Wertpapiers, die 1 % des Gesamtwerts der Käufe im Geschäftsjahr übersteigen, und die Gesamtveräußerungen, die 1 % der Gesamtverkäufe im Berichtszeitraum übersteigen, aus. Gegebenenfalls sind mindestens die 20 größten Käufe und Verkäufe anzugeben.

EURO EQUITY DEFENSIVE COVERED CALL SF UCITS ETF

Portfoliokäufe	Kosten EUR	Portfolioverkäufe	Erlöse EUR
Apple Inc	712.425	Apple Inc	(618.252)
Microsoft Corp	478.528	Microsoft Corp	(448.336)
Amazon.com Inc	345.308	Exxon Mobil Corp	(308.861)
Exxon Mobil Corp	323.742	Pfizer Inc	(246.896)
Pfizer Inc	225.906	Bank of America Corp	(246.222)
Telefonaktiebolaget LM Ericsson	206.938	Chevron Corp	(202.525)
Bank of America Corp	206.174	ConocoPhillips	(186.238)
Chevron Corp	176.070	Telefonaktiebolaget LM Ericsson	(169.298)
ConocoPhillips	163.099	Alphabet Inc - Class C	(138.870)
Roche Holding AG	142.436	PepsiCo Inc	(136.726)
Marathon Petroleum Corp	139.938	Meta Platforms Inc	(123.175)
PepsiCo Inc	134.054	Assa Abloy AB	(107.146)
Walmart Inc	127.024	Novartis AG	(105.430)
Assa Abloy AB	117.817	Marathon Petroleum Corp	(105.202)
TotalEnergies SE	117.201	NVIDIA Corp	(104.422)
Nestle SA	111.945	Zurich Insurance Group Ltd	(100.754)
Meta Platforms Inc	103.012	Alphabet Inc - Class A	(97.014)
Activision Blizzard Inc	102.854	Aker BP ASA	(96.866)
Telia Co AB	102.369	Swedish Match AB	(93.044)
Alphabet Inc - Class C	101.564	Telia Co AB	(92.830)

**WESENTLICHE PORTFOLIOTRANSAKTIONEN (Fortsetzung)
FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2022**

Die folgende Aufstellung der wesentlichen Portfoliotransaktionen weist die Gesamtkäufe eines Wertpapiers, die 1 % des Gesamtwerts der Käufe im Geschäftsjahr übersteigen, und die Gesamtveräußerungen, die 1 % der Gesamtverkäufe im Berichtszeitraum übersteigen, aus. Gegebenenfalls sind mindestens die 20 größten Käufe und Verkäufe anzugeben.

EURO EQUITY DEFENSIVE PUT WRITE SF UCITS ETF

Portfoliokäufe	Kosten EUR	Portfolioverkäufe	Erlöse EUR
Apple Inc	2.858.362	Apple Inc	(2.681.826)
Microsoft Corp	2.060.691	Microsoft Corp	(1.903.851)
Amazon.com Inc	1.435.565	Exxon Mobil Corp	(1.274.286)
Exxon Mobil Corp	1.333.005	Bank of America Corp	(1.025.195)
Bank of America Corp	903.912	Pfizer Inc	(994.605)
Pfizer Inc	901.363	ConocoPhillips	(858.004)
Telefonaktiebolaget LM Ericsson	841.663	Chevron Corp	(824.385)
Chevron Corp	745.836	Telefonaktiebolaget LM Ericsson	(696.175)
ConocoPhillips	681.029	PepsiCo Inc	(595.467)
Roche Holding AG	574.451	Alphabet Inc - Class C	(564.288)
Marathon Petroleum Corp	573.067	Meta Platforms Inc	(521.825)
PepsiCo Inc	553.696	Zurich Insurance Group Ltd	(452.998)
Walmart Inc	503.235	NVIDIA Corp	(450.130)
Assa Abloy AB	501.015	Novartis AG	(441.229)
Telia Co AB	479.829	Alphabet Inc - Class A	(439.854)
TotalEnergies SE	476.834	Marathon Petroleum Corp	(436.131)
Nestle SA	471.594	Assa Abloy AB	(433.708)
Merck Co Inc	463.784	Cisco Systems Inc	(427.626)
Activision Blizzard Inc	458.308	Swedish Match AB	(390.731)
Meta Platforms Inc	439.404	Walmart Inc	(389.101)

**WESENTLICHE PORTFOLIOTRANSAKTIONEN (Fortsetzung)
FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2022**

Die folgende Aufstellung der wesentlichen Portfoliotransaktionen weist die Gesamtkäufe eines Wertpapiers, die 1 % des Gesamtwerts der Käufe im Geschäftsjahr übersteigen, und die Gesamtveräußerungen, die 1 % der Gesamtverkäufe im Berichtszeitraum übersteigen, aus. Gegebenenfalls sind mindestens die 20 größten Käufe und Verkäufe anzugeben.

US EQUITY DEFENSIVE COVERED CALL SF UCITS ETF

Portfoliokäufe	Kosten USD	Portfolioverkäufe	Erlöse USD
Apple Inc	729.711	Apple Inc	(828.857)
Microsoft Corp	481.894	Microsoft Corp	(600.545)
Exxon Mobil Corp	302.015	Exxon Mobil Corp	(314.306)
Telefonaktiebolaget LM Ericsson	280.019	ConocoPhillips	(307.985)
Amazon.com Inc	276.029	Pfizer Inc	(259.332)
Pfizer Inc	220.095	Bank of America Corp	(203.460)
Bank of America Corp	213.260	Chevron Corp	(177.561)
ConocoPhillips	209.580	PepsiCo Inc	(177.276)
Chevron Corp	192.446	Alphabet Inc - Class C	(174.562)
Telia Co AB	158.596	Telefonaktiebolaget LM Ericsson	(151.718)
Activision Blizzard Inc	136.782	Verizon Communications Inc	(143.800)
Marathon Petroleum Corp	136.482	Marathon Petroleum Corp	(141.572)
PepsiCo Inc	130.985	QUALCOMM Inc	(131.256)
Walmart Inc	127.026	Zurich Insurance Group Ltd	(127.949)
Merck Co Inc	125.081	Cisco Systems Inc	(125.168)
Swedish Match AB	122.192	ASML Holding NV	(124.267)
Roche Holding AG	108.814	Aker BP ASA	(123.062)
Alphabet Inc - Class C	104.025	Alphabet Inc - Class A	(121.197)
Meta Platforms Inc	103.958	AbbVie Inc	(119.222)
Verizon Communications Inc	103.078	Meta Platforms Inc	(113.212)

**WESENTLICHE PORTFOLIOTRANSAKTIONEN (Fortsetzung)
FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2022**

Die folgende Aufstellung der wesentlichen Portfoliotransaktionen weist die Gesamtkäufe eines Wertpapiers, die 1 % des Gesamtwerts der Käufe im Geschäftsjahr übersteigen, und die Gesamtveräußerungen, die 1 % der Gesamtverkäufe im Berichtszeitraum übersteigen, aus. Gegebenenfalls sind mindestens die 20 größten Käufe und Verkäufe anzugeben.

US EQUITY DEFENSIVE PUT WRITE SF UCITS ETF

Portfoliokäufe	Kosten USD	Portfolioverkäufe	Erlöse USD
Apple Inc	2.523.247	Apple Inc	(2.152.432)
Microsoft Corp	1.799.188	Microsoft Corp	(1.537.953)
Amazon.com Inc	1.364.400	Exxon Mobil Corp	(1.139.364)
Exxon Mobil Corp	1.235.891	Bank of America Corp	(955.557)
Pfizer Inc	817.521	Pfizer Inc	(858.461)
Bank of America Corp	796.315	Chevron Corp	(769.876)
Telefonaktiebolaget LM Ericsson	672.930	ConocoPhillips	(649.830)
Chevron Corp	618.693	Telefonaktiebolaget LM Ericsson	(641.523)
ConocoPhillips	563.820	Meta Platforms Inc	(474.834)
Roche Holding AG	559.556	PepsiCo Inc	(461.589)
Marathon Petroleum Corp	507.661	Alphabet Inc - Class C	(450.758)
PepsiCo Inc	488.478	Assa Abloy AB	(431.417)
Assa Abloy AB	488.403	Novartis AG	(423.347)
TotalEnergies SE	471.101	Zurich Insurance Group Ltd	(378.275)
Walmart Inc	449.054	Telia Co AB	(376.753)
Nestle SA	439.325	NVIDIA Corp	(370.914)
Merck Co Inc	401.518	Alphabet Inc - Class A	(369.868)
Meta Platforms Inc	400.397	Cisco Systems Inc	(349.072)
Activision Blizzard Inc	376.276	Swedish Match AB	(345.897)
Volkswagen AG	368.359	Marathon Petroleum Corp	(344.697)

**WESENTLICHE PORTFOLIOTRANSAKTIONEN (Fortsetzung)
FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2022**

Die folgende Aufstellung der wesentlichen Portfoliotransaktionen weist die Gesamtkäufe eines Wertpapiers, die 1 % des Gesamtwerts der Käufe im Geschäftsjahr übersteigen, und die Gesamtveräußerungen, die 1 % der Gesamtverkäufe im Berichtszeitraum übersteigen, aus. Gegebenenfalls sind mindestens die 20 größten Käufe und Verkäufe anzugeben.

MSCI USA SF INDEX FUND

Portfoliokäufe	Kosten USD	Portfolioverkäufe	Erlöse USD
Apple Inc	135.079.829	Apple Inc	(108.727.915)
Microsoft Corp	94.409.954	Microsoft Corp	(81.262.574)
Amazon.com Inc	63.106.669	Exxon Mobil Corp	(54.466.980)
Exxon Mobil Corp	58.628.316	Pfizer Inc	(45.127.764)
Pfizer Inc	41.261.726	Bank of America Corp	(44.907.230)
Telefonaktiebolaget LM Ericsson	39.157.827	Chevron Corp	(36.308.270)
Bank of America Corp	36.753.276	ConocoPhillips	(33.396.577)
Chevron Corp	34.761.185	Telefonaktiebolaget LM Ericsson	(31.298.010)
ConocoPhillips	34.425.262	PepsiCo Inc	(26.629.727)
Roche Holding AG	27.364.101	Alphabet Inc - Class C	(25.378.232)
Marathon Petroleum Corp	27.223.776	Meta Platforms Inc	(22.112.898)
PepsiCo Inc	26.365.271	Assa Abloy AB	(20.679.705)
Walmart Inc	26.300.777	NVIDIA Corp	(20.229.504)
TotalEnergies SE	23.105.607	Alphabet Inc - Class A	(19.970.560)
Activision Blizzard Inc	21.742.283	Marathon Petroleum Corp	(19.605.730)
Merck Co Inc	21.674.319	Aker BP ASA	(18.684.870)
Verizon Communications Inc	20.254.810	Cisco Systems Inc	(18.407.489)
Telia Co AB	19.887.371	Novartis AG	(18.284.758)
Nestle SA	19.717.741	Telia Co AB	(17.964.984)
Assa Abloy AB	19.666.361	Merck Co Inc	(17.694.534)

**WESENTLICHE PORTFOLIOTRANSAKTIONEN (Fortsetzung)
FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2022**

Die folgende Aufstellung der wesentlichen Portfoliotransaktionen weist die Gesamtkäufe eines Wertpapiers, die 1 % des Gesamtwerts der Käufe im Geschäftsjahr übersteigen, und die Gesamtveräußerungen, die 1 % der Gesamtverkäufe im Berichtszeitraum übersteigen, aus. Gegebenenfalls sind mindestens die 20 größten Käufe und Verkäufe anzugeben.

CMCI COMMODITY CARRY EX-AGRICULTURE SF UCITS ETF

Portfoliokäufe	Kosten USD	Portfolioverkäufe	Erlöse USD
Apple Inc	7.417.483	Apple Inc	(6.557.013)
Microsoft Corp	5.218.946	Microsoft Corp	(4.683.780)
Amazon.com Inc	3.800.785	Exxon Mobil Corp	(3.279.875)
Exxon Mobil Corp	3.482.023	Bank of America Corp	(2.642.704)
Pfizer Inc	2.321.689	Pfizer Inc	(2.597.365)
Bank of America Corp	2.315.962	Chevron Corp	(2.162.929)
Telefonaktiebolaget LM Ericsson	2.116.878	ConocoPhillips	(2.068.378)
Chevron Corp	1.846.208	Telefonaktiebolaget LM Ericsson	(1.812.096)
ConocoPhillips	1.708.433	Alphabet Inc - Class C	(1.451.937)
Roche Holding AG	1.560.691	PepsiCo Inc	(1.422.357)
Marathon Petroleum Corp	1.481.677	Meta Platforms Inc	(1.380.253)
PepsiCo Inc	1.462.740	Assa Abloy AB	(1.220.143)
Assa Abloy AB	1.326.422	Novartis AG	(1.174.732)
Walmart Inc	1.319.641	Alphabet Inc - Class A	(1.149.875)
TotalEnergies SE	1.254.157	Zurich Insurance Group Ltd	(1.123.387)
Nestle SA	1.239.200	NVIDIA Corp	(1.113.420)
Merck Co Inc	1.201.122	Cisco Systems Inc	(1.101.420)
Activision Blizzard Inc	1.174.407	Marathon Petroleum Corp	(1.099.701)
Meta Platforms Inc	1.124.674	Telia Co AB	(1.027.783)
Telia Co AB	1.121.571	Swedish Match AB	(995.203)

**ANHANG 1
VERORDNUNG ÜBER DIE TRANSPARENZ VON
WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN**

Artikel 13 der Verordnung (EU) 2015/2365 über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften („SFTR“) und der Weiterverwendung sowie zur Änderung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 verlangt von den OGAW-Anlagegesellschaften die folgenden Informationen über die Verwendung von SFTs.

Die Verordnung über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften (EU-Verordnung 2015/2365) („SFTR“) trat am 12. Januar 2016 in Kraft und führte unter anderem neue Offenlegungsanforderungen für Unternehmensabschlüsse nach dem 13. Januar 2017 ein, aus denen der Einsatz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps durch den Teilfonds hervorgeht. Daher wurde dieser Anhang um zusätzliche Offenlegungen ergänzt.

Nachstehend wird der Zeitwert der Vermögenswerte dargelegt, die zum 31. Dezember 2022 an Wertpapierfinanzierungsgeschäften beteiligt waren. Bei den Vermögenswerten, die zum Berichtsdatum an Wertpapierfinanzierungsgeschäften beteiligt sind, handelt es sich um Total Return Swaps, die bilateral abgewickelt werden.

Teilfonds	Währung	Zeitwert	% des Nettoinventarwerts
CMCI Composite SF UCITS ETF	USD	51.275.227	3,07 %
Bloomberg Commodity Index SF UCITS ETF	USD	20.046.081	12,94 %
S&P 500 SF UCITS ETF	USD	8.063.426	5,44 %
MSCI USA SF UCITS ETF	USD	20.232.741	4,20 %
MSCI Emerging Markets SF UCITS ETF	USD	9.758.726	10,56 %
MSCIACAsia Ex Japan SF UCITS ETF	USD	4.445.895	2,38 %
MSCIACWI SF UCITS ETF	USD	196.634.426	3,63 %
CMCI Ex-Agriculture SF UCITS ETF	USD	3.480.714	3,05 %
Bloomberg Commodity CMCI SF UCITS ETF	USD	18.977.779	2,95 %
CMCI Commodity Carry SF UCITS ETF	USD	5.113.300	3,00 %
MSCI ChinaA SF UCITS ETF	USD	6.156.236	3,83 %
Euro Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF	EUR	137.745	2,87 %
Euro Equity Defensive PutWrite SF UCITS ETF	EUR	640.986	3,19 %
US Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF	USD	137.762	4,08 %
US Equity Defensive PutWrite SF UCITS ETF	USD	702.273	3,55 %
MSCI USA SF Index Fund	USD	40.383.171	4,34 %
CMCI Commodity Carry Ex-Agriculture SF UCITS ETF	USD	1.438.742	2,38 %
		387.677.589	

Die UBS AG, Schweiz, ist die einzige Gegenpartei der Total Return Swaps, die von den einzelnen Teilfonds gehalten werden. Die von den einzelnen Teilfonds gehaltenen Total Return Swaps sind in der jeweiligen Vermögensaufstellung aufgeführt.

**ANHANG 1
VERORDNUNG ÜBER DIE TRANSPARENZ VON
WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (Fortsetzung)**

Die folgende Tabelle zeigt eine Analyse der Fälligkeiten der Total Return Swaps zum 31. Dezember 2022.

Teilfonds	Währung	1 bis 3 Monate	3 Monate bis 1 Jahr	Über 1 Jahr
CMCI Composite SF UCITS ETF	USD	-	51.275.227	-
Bloomberg Commodity Index SF UCITS ETF	USD	-	20.046.081	-
S&P 500 SF UCITS ETF	USD	-	8.063.426	-
MSCI USA SF UCITS ETF	USD	-	20.232.741	-
MSCI Emerging Markets SF UCITS ETF	USD	-	9.758.726	-
MSCIACAsia Ex Japan SF UCITS ETF	USD	-	4.445.895	-
MSCIACWI SF UCITS ETF	USD	-	196.634.426	-
CMCI Ex-Agriculture SF UCITS ETF	USD	-	3.480.714	-
Bloomberg Commodity CMCI SF UCITS ETF	USD	-	18.977.779	-
CMCI Commodity Carry SF UCITS ETF	USD	-	5.113.300	-
MSCI ChinaA SF UCITS ETF	USD	-	6.156.236	-
Euro Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF	EUR	-	137.745	-
Euro Equity Defensive PutWrite SF UCITS ETF	EUR	-	640.986	-
US Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF	USD	-	137.762	-
US Equity Defensive PutWrite SF UCITS ETF	USD	-	702.273	-
MSCI USA SF Index Fund	USD	-	40.383.171	-
CMCI Commodity Carry Ex-Agriculture SF UCITS ETF	USD	-	1.438.742	-

**ANHANG 1
VERORDNUNG ÜBER DIE TRANSPARENZ VON
WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (Fortsetzung)**

Die folgende Tabelle zeigt eine Analyse der Art und Qualität von Sicherheiten zum 31. Dezember 2022.

Teilfonds	Währung	Art der Sicherheit	Qualität der Sicherheiten/Rating		
			Investment Grade	Investment Grade	Kein Rating
CMCI Composite SF UCITS ETF	USD	Zahlungsmittel Anleihen und	-	-	35.822.755
Bloomberg Commodity Index SF UCITS ETF	USD	Zahlungsmittel	5.210.710	-	13.786.630
S&P 500 SF UCITS ETF	USD	Zahlungsmittel	-	-	3.936.876
MSCI USA SF UCITS ETF	USD	Zahlungsmittel Anleihen und	-	-	13.863.199
MSCI Emerging Markets SF UCITS ETF	USD	Zahlungsmittel Anleihen und	3.629.294	-	6.196.763
MSCIACAsia Ex Japan SF UCITS ETF	USD	Zahlungsmittel	1.069.016	-	7.953.366
MSCIACWI SF UCITS ETF	USD	Zahlungsmittel	-	-	151.481.401
CMCI Ex-Agriculture SF UCITS ETF	USD	Zahlungsmittel	-	-	2.693.000
Bloomberg Commodity CMCI SF UCITS ETF	USD	Zahlungsmittel Anleihen und	-	-	13.386.744
CMCI Commodity Carry SF UCITS ETF	USD	Zahlungsmittel	1.128.030	-	11.736.627
MSCI ChinaA SF UCITS ETF	USD	Zahlungsmittel	-	-	6.359.235
Euro Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF	EUR	Zahlungsmittel Anleihen und	-	-	335.677
Euro Equity Defensive PutWrite SF UCITS ETF	EUR	Zahlungsmittel	283.181	-	372.996
US Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF	USD	Zahlungsmittel	-	-	252.000
US Equity Defensive PutWrite SF UCITS ETF	USD	Zahlungsmittel	-	-	750.000
MSCI USA SF Index Fund	USD	Zahlungsmittel	-	-	35.152.348
CMCI Commodity Carry Ex-Agriculture SF UCITS ETF	USD	Zahlungsmittel	-	-	1.170.000

**ANHANG 1
VERORDNUNG ÜBER DIE TRANSPARENZ VON
WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (Fortsetzung)**

Die folgenden Tabellen zeigen eine Analyse der Währung von Sicherheiten zum 31. Dezember 2022.

	CMCI Composite SF UCITS ETF	Bloomberg Commodity Index SF UCITS ETF	S&P 500 SF UCITS ETF	MSCI USA SF UCITS ETF	MSCI Emerging Markets SF UCITS ETF
Währung	USD	USD	USD	USD	USD
EUR	-	3.962.883	-	-	9.366.057
GBP	26.518.755	7.720.462	3.093.876	7.245.199	-
USD	9.304.000	7.313.995	843.000	6.618.000	460.000
	35.822.755	18.997.340	3.936.876	13.863.199	9.826.057

	MSCI AC Asia Ex Japan SF UCITS ETF	MSCI ACWI SF UCITS ETF	CMCI Ex-Agriculture SF UCITS ETF	Bloomberg Commodity CMCI SF UCITS ETF	CMCI Commodity Carry SF UCITS ETF
Währung	USD	USD	USD	USD	USD
EUR	4.913.366	79.344.401	-	1.214.744	4.949.627
GBP	1.069.016	-	-	-	1.128.030
USD	3.040.000	72.137.000	2.693.000	12.172.000	6.787.000
	9.022.382	151.481.401	2.693.000	13.386.744	12.864.657

	MSCI China A SF UCITS ETF	Euro Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF	Euro Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF	US Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF	US Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF
Währung	USD	EUR	EUR	USD	USD
EUR	2.612.295	-	283.181	-	-
GBP	-	-	-	-	-
USD	3.746.940	335.677	372.996	252.000	750.000
	6.359.235	335.677	656.177	252.000	750.000

	CMCI Commodity Carry
Währung	USD
EUR	-
GBP	34.322.348
USD	830.000
	35.152.348

Sicherheiten, die die einzelnen Teilfonds entgegengenommen haben, werden bei der Verwahrstelle, der State Street Custodial Services (Ireland) Limited, gehalten.

Barsicherheiten können in Geldmarktfonds angelegt werden. Die Teilfonds investieren solche Barmittel in die UBS (Irl) Select Money Market Fund EUR/USD Sustainable Fund. Einzelheiten zu allen Fonds finden Sie unter www.ubs.com/funds. Die minimale/maximale Rendite für Geldmarktanlagen als Prozentsatz des durchschnittlichen verwalteten Vermögens für den Zeitraum betrug -0,008 %/0,0001 %.

Sachsicherheiten dürfen gemäß dem Verkaufsprospekt der Gesellschaft nicht verkauft, verpfändet oder reinvestiert werden.

**ANHANG 1
VERORDNUNG ÜBER DIE TRANSPARENZ VON
WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (Fortsetzung)**

Die nachstehende Tabelle enthält eine Analyse der Laufzeit der Sicherheiten zum 31. Dezember 2022.

Teilfonds	Währung	Weniger als 1 Jahr	Über 1 Jahr	Offene Laufzeit
CMCI Composite SF UCITS ETF	USD	-	-	35.822.755
Bloomberg Commodity Index SF UCITS ETF	USD	-	5.210.710	13.786.630
S&P 500 SF UCITS ETF	USD	-	-	3.936.876
MSCI USA SF UCITS ETF	USD	-	-	13.863.199
MSCI Emerging Markets SF UCITS ETF	USD	-	3.629.294	6.196.763
MSCIACAsia Ex Japan SF UCITS ETF	USD	-	1.069.016	7.953.366
MSCIACWI SF UCITS ETF	USD	-	-	151.481.401
CMCI Ex-Agriculture SF UCITS ETF	USD	-	-	2.693.000
Bloomberg Commodity CMCI SF UCITS ETF	USD	-	-	13.386.744
CMCI Commodity Carry SF UCITS ETF	USD	-	1.128.030	11.736.627
MSCI ChinaA SF UCITS ETF	USD	-	-	6.359.235
Euro Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF	EUR	-	-	335.677
Euro Equity Defensive PutWrite SF UCITS ETF	EUR	-	283.181	372.996
US Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF	USD	-	-	252.000
US Equity Defensive PutWrite SF UCITS ETF	USD	-	-	750.000
MSCI USA SF Index Fund	USD	-	-	35.152.348
CMCI Commodity Carry Ex-Agriculture SF UCITS ETF	USD	-	-	1.170.000

**ANHANG 1
VERORDNUNG ÜBER DIE TRANSPARENZ VON
WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (Fortsetzung)**

In den folgenden Tabellen sind die zehn größten Emittenten des jeweiligen Teilfonds zum 31. Dezember 2022 aufgeführt. Bei weniger als zehn Emittenten sind alle Emittenten aufgeführt.

	Bloomberg Commodity Index SF UCITS ETF USD	MSCI Emerging Markets SF UCITS ETF USD	MSCI AC Asia Ex Japan SF UCITS ETF USD	CMCI Commodity Carry SF UCITS ETF USD
Sicherheitenemittenten				
Französische Staatsanleihen	3.962.883	2.992.665	-	-
Deutsche Staatsanleihen	-	636.629	-	-
Britische Staatsanleihen	1.247.826	-	1.069.016	1.128.030
	5.210.709	3.629.294	1.069.016	1.128.030
	Euro Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF EUR			
Sicherheitenemittenten				
Französische Staatsanleihen	283.181			
	283.181			

**ANHANG 1
VERORDNUNG ÜBER DIE TRANSPARENZ VON
WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (Fortsetzung)**

Die Renditen und Kosten der von den Teilfonds gehaltenen Total Return Swaps sind im Folgenden aufgeführt:

CMCI COMPOSITE SF UCITS ETF

Art von Wertpapierfinanzierungsgeschäften	Erl.	Insgesamt	Organismus für gemeinsame Anlagen	Verwaltungsgesellschaft	Dritte
Total Return Swaps	1				
Absolute Werte		USD	USD	USD	USD
Rendite	2	605.878.615	605.878.615	null	null
Kosten	3,8	(6.596.604)	(6.596.604)	null	null
Wirtschaftlicher Nutzen	4	612.475.219	612.475.219	null	null
Prozentualer mit der jeweiligen Art erzielter Anteil an der Gesamrendite		% der Gesamrendite	% der Gesamrendite	% der Gesamrendite	% der Gesamrendite
Rendite		100,00 %	100,00 %	null	null
Kosten	5	(1,09 %)	(1,09 %)	null	null
Wirtschaftlicher Nutzen	4	98,91 %	98,91 %	null	null
Prozentualer Anteil am NIW		% des NIW	% des NIW	% des NIW	% des NIW
Rendite	6	30,89 %	30,89 %	null	null
Kosten	7,8	(0,33 %)	(0,33 %)	null	null
Wirtschaftlicher Nutzen	4	30,56 %	30,56 %	null	null

**ANHANG 1
VERORDNUNG ÜBER DIE TRANSPARENZ VON
WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (Fortsetzung)**

CMCI COMPOSITE SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Hinweis

- 1 Mit Ausnahme von Total Return Swaps hat die Gesellschaft im Berichtszeitraum keine Wertpapierfinanzierungsgeschäfte getätigt.
- 2 Dies betrifft die realisierten und nicht realisierten Gewinne und Verluste aus den Fully Funded Swaps und Total Return Swaps (gemeinsam die „TRS“ gemäß der SFTR-Definition) während der sechs Monate zum 31. Dezember 2022, die in der Gesamtergebnisrechnung enthalten sind und vor Abzug der mit ihnen im Zusammenhang stehenden Kosten aufgeführt sind.
- 3 Dies betrifft Abzüge auf die Werte der TRS in den sechs Monaten zum 31. Dezember 2022.
- 4 Berechnet als Differenz zwischen der Rendite und den Kosten.
- 5 Berechnet als absoluter Betrag der Kosten in Prozent des absoluten Betrags der Renditen.
- 6 Berechnet als absoluter Betrag der Rendite in Prozent des durchschnittlichen NIW für den Berichtszeitraum.
- 7 Berechnet als absoluter Betrag der Kosten in Prozent des durchschnittlichen NIW für den Berichtszeitraum.
- 8 Die von der Gegenpartei an den Werten der TRS vorgenommenen Abzüge berücksichtigen alle externen Gebühren, zu deren Zahlung sie verpflichtet ist, sowie alle Transaktionskosten und Gebühren, die normalerweise anfallen. Diese werden für die sechs Monate bis zum 31. Dezember 2022 wie folgt analysiert (alle in Prozent des durchschnittlichen NIW für den Berichtszeitraum):

Bezeichnung	Erl.	USD	% des NIW
Verwaltungsgebühren	9	247.850	0,01 %
Verwahrstellengebühren	9	128.882	0,01 %
Treuhändergebühren	9	29.742	0,00 %
Gebühren für die Sicherheitenverwaltung	9	-	- %
Sonstige Aufwendungen	9,10	237.936	0,01 %
Anlageverwaltungsgebühren	9	1.734.950	0,09 %
Gebühren der Verwaltungsgesellschaft	9	991.400	0,05 %
Nicht bedingte Abzüge für Swap-Gegenpartei	9	3.225.844	0,16 %
Insgesamt		6.596.604	0,33 %

- 9 Diese Beträge werden von der TRS-Gegenpartei an den Fonds während der sechs Monate bis zum 31. Dezember 2022 gezahlt oder sind von der TRS-Gegenpartei zu zahlen.
- 10 Die sonstigen Aufwendungen sind im Verkaufsprospekt beschrieben. Zum Beispiel (aber nicht beschränkt auf) laufende Organisations- und Eintragungsgebühren, Ausgaben für Rechtsberatung und prüfungsrelevante Leistungen sowie Marketingkosten.
- 11 Diese Beträge werden von der TRS-Gegenpartei während der sechs Monate bis zum 31. Dezember 2022 einbehalten und beziehen sich auf Swap-Transaktionskosten und Index-Lizenzierungsgebühren.

**ANHANG 1
VERORDNUNG ÜBER DIE TRANSPARENZ VON
WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (Fortsetzung)**

Die Renditen und Kosten der von den Teilfonds gehaltenen Total Return Swaps sind im Folgenden aufgeführt:

BLOOMBERG COMMODITY INDEX SF UCITS ETF

Art von Wertpapierfinanzierungsgeschäften	Erl.	Insgesamt	Organismus für gemeinsame Anlagen	Verwaltungsgesellschaft	Dritte
Total Return Swaps	1				
Absolute Werte		USD	USD	USD	USD
Rendite	2	87.721.923	87.721.923	null	null
Kosten	3,8	(242.322)	(242.322)	null	null
Wirtschaftlicher Nutzen	4	87.964.245	87.964.245	null	null
Prozentualer mit der jeweiligen Art erzielter Anteil an der Gesamrendite		% der Gesamtrendite	% der Gesamtrendite	% der Gesamtrendite	% der Gesamtrendite
Rendite		100,00 %	100,00 %	null	null
Kosten	5	(0,28 %)	(0,28 %)	null	null
Wirtschaftlicher Nutzen	4	99,72 %	99,72 %	null	null
Prozentualer Anteil am NIW		% des NIW	% des NIW	% des NIW	% des NIW
Rendite	6	42,25 %	42,25 %	null	null
Kosten	7,8	(0,12 %)	(0,12 %)	null	null
Wirtschaftlicher Nutzen	4	42,13 %	42,13 %	null	null

**ANHANG 1
VERORDNUNG ÜBER DIE TRANSPARENZ VON
WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (Fortsetzung)**

BLOOMBERG COMMODITY INDEX SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Hinweis

- 1 Mit Ausnahme von Total Return Swaps hat die Gesellschaft im Berichtszeitraum keine Wertpapierfinanzierungsgeschäfte getätigt.
- 2 Dies betrifft die realisierten und nicht realisierten Gewinne und Verluste aus den Fully Funded Swaps und Total Return Swaps (gemeinsam die „TRS“ gemäß der SFTR-Definition) während der sechs Monate zum 31. Dezember 2022, die in der Gesamtergebnisrechnung enthalten sind und vor Abzug der mit ihnen im Zusammenhang stehenden Kosten aufgeführt sind.
- 3 Dies betrifft Abzüge auf die Werte der TRS in den sechs Monaten zum 31. Dezember 2022.
- 4 Berechnet als Differenz zwischen der Rendite und den Kosten.
- 5 Berechnet als absoluter Betrag der Kosten in Prozent des absoluten Betrags der Renditen.
- 6 Berechnet als absoluter Betrag der Rendite in Prozent des durchschnittlichen NIW für den Berichtszeitraum.
- 7 Berechnet als absoluter Betrag der Kosten in Prozent des durchschnittlichen NIW für den Berichtszeitraum.
- 8 Die von der Gegenpartei an den Werten der TRS vorgenommenen Abzüge berücksichtigen alle externen Gebühren, zu deren Zahlung sie verpflichtet ist, sowie alle Transaktionskosten und Gebühren, die normalerweise anfallen. Diese werden für die sechs Monate bis zum 31. Dezember 2022 wie folgt analysiert (alle in Prozent des durchschnittlichen NIW für den Berichtszeitraum):

Bezeichnung	Erl.	USD	% des NIW
Verwaltungsgebühren	9	26.317	0,01 %
Verwahrstellengebühren	9	13.685	0,01 %
Treuhändergebühren	9	3.158	0,00 %
Gebühren für die Sicherheitenverwaltung	9	-	- %
Sonstige Aufwendungen	9,10	25.265	0,01 %
Anlageverwaltungsgebühren	9	100.005	0,05 %
Gebühren der Verwaltungsgesellschaft	9	31.580	0,02 %
Nicht bedingte Abzüge für Swap-Gegenpartei	9	42.312	0,02 %
Insgesamt		242.322	0,12 %

- 9 Diese Beträge werden von der TRS-Gegenpartei an den Fonds während der sechs Monate bis zum 31. Dezember 2022 gezahlt oder sind von der TRS-Gegenpartei zu zahlen.
- 10 Die sonstigen Aufwendungen sind im Verkaufsprospekt beschrieben. Zum Beispiel (aber nicht beschränkt auf) laufende Organisations- und Eintragungsgebühren, Ausgaben für Rechtsberatung und prüfungsrelevante Leistungen sowie Marketingkosten.
- 11 Diese Beträge werden von der TRS-Gegenpartei während der sechs Monate bis zum 31. Dezember 2022 einbehalten und beziehen sich auf Swap-Transaktionskosten und Index-Lizenzierungsgebühren.

**ANHANG 1
VERORDNUNG ÜBER DIE TRANSPARENZ VON
WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (Fortsetzung)**

Die Renditen und Kosten der von den Teilfonds gehaltenen Total Return Swaps sind im Folgenden aufgeführt:

S&P 500 SF UCITS ETF

Art von Wertpapierfinanzierungsgeschäften	Erl.	Insgesamt	Organismus für gemeinsame Anlagen	Verwaltungsgesellschaft	Dritte
Total Return Swaps	1				
Absolute Werte		USD	USD	USD	USD
Rendite	2	40.020.357	40.020.357	null	null
Kosten	3,8	(191.730)	(191.730)	null	null
Wirtschaftlicher Nutzen	4	40.212.087	40.212.087	null	null
Prozentualer mit der jeweiligen Art erzielter Anteil an der Gesamrendite		% der Gesamtrendite	% der Gesamtrendite	% der Gesamtrendite	% der Gesamtrendite
Rendite		100,00 %	100,00 %	null	null
Kosten	5	(0,48 %)	(0,48 %)	null	null
Wirtschaftlicher Nutzen	4	99,52 %	99,52 %	null	null
Prozentualer Anteil am NIW		% des NIW	% des NIW	% des NIW	% des NIW
Rendite	6	27,34 %	27,34 %	null	null
Kosten	7,8	(0,13 %)	(0,13 %)	null	null
Wirtschaftlicher Nutzen	4	27,21 %	27,21 %	null	null

**ANHANG 1
VERORDNUNG ÜBER DIE TRANSPARENZ VON
WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (Fortsetzung)**

S&P 500 SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Hinweis

- 1 Mit Ausnahme von Total Return Swaps hat die Gesellschaft im Berichtszeitraum keine Wertpapierfinanzierungsgeschäfte getätigt.
- 2 Dies betrifft die realisierten und nicht realisierten Gewinne und Verluste aus den Fully Funded Swaps und Total Return Swaps (gemeinsam die „TRS“ gemäß der SFTR-Definition) während der sechs Monate zum 31. Dezember 2022, die in der Gesamtergebnisrechnung enthalten sind und vor Abzug der mit ihnen im Zusammenhang stehenden Kosten aufgeführt sind.
- 3 Dies betrifft Abzüge auf die Werte der TRS in den sechs Monaten zum 31. Dezember 2022.
- 4 Berechnet als Differenz zwischen der Rendite und den Kosten.
- 5 Berechnet als absoluter Betrag der Kosten in Prozent des absoluten Betrags der Renditen.
- 6 Berechnet als absoluter Betrag der Rendite in Prozent des durchschnittlichen NIW für den Berichtszeitraum.
- 7 Berechnet als absoluter Betrag der Kosten in Prozent des durchschnittlichen NIW für den Berichtszeitraum.
- 8 Die von der Gegenpartei an den Werten der TRS vorgenommenen Abzüge berücksichtigen alle externen Gebühren, zu deren Zahlung sie verpflichtet ist, sowie alle Transaktionskosten und Gebühren, die normalerweise anfallen. Diese werden für die sechs Monate bis zum 31. Dezember 2022 wie folgt analysiert (alle in Prozent des durchschnittlichen NIW für den Berichtszeitraum):

Bezeichnung	Erl.	USD	% des NIW
Verwaltungsgebühren	9	18.436	0,01 %
Verwahrstellengebühren	9	9.586	0,01 %
Treuhändergebühren	9	2.212	0,00 %
Gebühren für die Sicherheitenverwaltung	9	-	- %
Sonstige Aufwendungen	9,10	17.698	0,01 %
Anlageverwaltungsgebühren	9	33.184	0,02 %
Gebühren der Verwaltungsgesellschaft	9	22.123	0,02 %
Nicht bedingte Abzüge für Swap-Gegenpartei	9	88.491	0,06 %
Insgesamt		191.730	0,13 %

- 9 Diese Beträge werden von der TRS-Gegenpartei an den Fonds während der sechs Monate bis zum 31. Dezember 2022 gezahlt oder sind von der TRS-Gegenpartei zu zahlen.
- 10 Die sonstigen Aufwendungen sind im Verkaufsprospekt beschrieben. Zum Beispiel (aber nicht beschränkt auf) laufende Organisations- und Eintragungsgebühren, Ausgaben für Rechtsberatung und prüfungsrelevante Leistungen sowie Marketingkosten.
- 11 Diese Beträge werden von der TRS-Gegenpartei während der sechs Monate bis zum 31. Dezember 2022 einbehalten und beziehen sich auf Swap-Transaktionskosten und Index-Lizenzierungsgebühren.

**ANHANG 1
VERORDNUNG ÜBER DIE TRANSPARENZ VON
WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (Fortsetzung)**

Die Renditen und Kosten der von den Teilfonds gehaltenen Total Return Swaps sind im Folgenden aufgeführt:

MSCI USA SF UCITS ETF

Art von Wertpapierfinanzierungsgeschäften	Erl.	Insgesamt	Organismus für gemeinsame Anlagen	Verwaltungsgesellschaft	Dritte
Total Return Swaps	1				
Absolute Werte		USD	USD	USD	USD
Rendite	2	149.305.141	149.305.141	null	null
Kosten	3,8	(600.960)	(600.960)	null	null
Wirtschaftlicher Nutzen	4	149.906.101	149.906.101	null	null
Prozentualer mit der jeweiligen Art erzielter Anteil an der Gesamrendite		% der Gesamrendite	% der Gesamrendite	% der Gesamrendite	% der Gesamrendite
Rendite		100,00 %	100,00 %	null	null
Kosten	5	(0,40 %)	(0,40 %)	null	null
Wirtschaftlicher Nutzen	4	99,60 %	99,60 %	null	null
Prozentualer Anteil am NIW		% des NIW	% des NIW	% des NIW	% des NIW
Rendite	6	29,43 %	29,43 %	null	null
Kosten	7,8	(0,12 %)	(0,12 %)	null	null
Wirtschaftlicher Nutzen	4	29,31 %	29,31 %	null	null

**ANHANG 1
VERORDNUNG ÜBER DIE TRANSPARENZ VON
WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (Fortsetzung)**

MSCI USA SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Hinweis

- 1 Mit Ausnahme von Total Return Swaps hat die Gesellschaft im Berichtszeitraum keine Wertpapierfinanzierungsgeschäfte getätigt.
- 2 Dies betrifft die realisierten und nicht realisierten Gewinne und Verluste aus den Fully Funded Swaps und Total Return Swaps (gemeinsam die „TRS“ gemäß der SFTR-Definition) während der sechs Monate zum 31. Dezember 2022, die in der Gesamtergebnisrechnung enthalten sind und vor Abzug der mit ihnen im Zusammenhang stehenden Kosten aufgeführt sind.
- 3 Dies betrifft Abzüge auf die Werte der TRS in den sechs Monaten zum 31. Dezember 2022.
- 4 Berechnet als Differenz zwischen der Rendite und den Kosten.
- 5 Berechnet als absoluter Betrag der Kosten in Prozent des absoluten Betrags der Renditen.
- 6 Berechnet als absoluter Betrag der Rendite in Prozent des durchschnittlichen NIW für den Berichtszeitraum.
- 7 Berechnet als absoluter Betrag der Kosten in Prozent des durchschnittlichen NIW für den Berichtszeitraum.
- 8 Die von der Gegenpartei an den Werten der TRS vorgenommenen Abzüge berücksichtigen alle externen Gebühren, zu deren Zahlung sie verpflichtet ist, sowie alle Transaktionskosten und Gebühren, die normalerweise anfallen. Diese werden für die sechs Monate bis zum 31. Dezember 2022 wie folgt analysiert (alle in Prozent des durchschnittlichen NIW für den Berichtszeitraum):

Bezeichnung	Erl.	USD	% des NIW
Verwaltungsgebühren	9	63.932	0,01 %
Verwahrstellengebühren	9	33.245	0,01 %
Treuhändergebühren	9	7.672	0,00 %
Gebühren für die Sicherheitenverwaltung	9	-	- %
Sonstige Aufwendungen	9,10	17.901	0,00 %
Anlageverwaltungsgebühren	9	115.077	0,02 %
Gebühren der Verwaltungsgesellschaft	9	76.718	0,02 %
Nicht bedingte Abzüge für Swap-Gegenpartei	9	286.415	0,06 %
Insgesamt		600.960	0,12 %

- 9 Diese Beträge werden von der TRS-Gegenpartei an den Fonds während der sechs Monate bis zum 31. Dezember 2022 gezahlt oder sind von der TRS-Gegenpartei zu zahlen.
- 10 Die sonstigen Aufwendungen sind im Verkaufsprospekt beschrieben. Zum Beispiel (aber nicht beschränkt auf) laufende Organisations- und Eintragungsgebühren, Ausgaben für Rechtsberatung und prüfungsrelevante Leistungen sowie Marketingkosten.
- 11 Diese Beträge werden von der TRS-Gegenpartei während der sechs Monate bis zum 31. Dezember 2022 einbehalten und beziehen sich auf Swap-Transaktionskosten und Index-Lizenzierungsgebühren.

**ANHANG 1
VERORDNUNG ÜBER DIE TRANSPARENZ VON
WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (Fortsetzung)**

Die Renditen und Kosten der von den Teilfonds gehaltenen Total Return Swaps sind im Folgenden aufgeführt:

MSCI EMERGING MARKETS SF UCITS ETF

Art von Wertpapierfinanzierungsgeschäften	Erl.	Insgesamt	Organismus für gemeinsame Anlagen	Verwaltungsgesellschaft	Dritte
Total Return Swaps	1				
Absolute Werte		USD	USD	USD	USD
Rendite	2	84.397.298	84.397.298	null	null
Kosten	3,8	13.364	13.364	null	null
Wirtschaftlicher Nutzen	4	84.383.934	84.383.934	null	null
Prozentualer mit der jeweiligen Art erzielter Anteil an der Gesamrendite		% der Gesamtrendite	% der Gesamtrendite	% der Gesamtrendite	% der Gesamtrendite
Rendite		100,00 %	100,00 %	null	null
Kosten	5	0,02 %	0,02 %	null	null
Wirtschaftlicher Nutzen	4	100,02 %	100,02 %	null	null
Prozentualer Anteil am NIW		% des NIW	% des NIW	% des NIW	% des NIW
Rendite	6	95,80 %	95,80 %	null	null
Kosten	7,8	0,01 %	0,01 %	null	null
Wirtschaftlicher Nutzen	4	95,81 %	95,81 %	null	null

**ANHANG 1
VERORDNUNG ÜBER DIE TRANSPARENZ VON
WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (Fortsetzung)**

MSCI EMERGING MARKETS SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Hinweis

- 1 Mit Ausnahme von Total Return Swaps hat die Gesellschaft im Berichtszeitraum keine Wertpapierfinanzierungsgeschäfte getätigt.
- 2 Dies betrifft die realisierten und nicht realisierten Gewinne und Verluste aus den Fully Funded Swaps und Total Return Swaps (gemeinsam die „TRS“ gemäß der SFTR-Definition) während der sechs Monate zum 31. Dezember 2022, die in der Gesamtergebnisrechnung enthalten sind und vor Abzug der mit ihnen im Zusammenhang stehenden Kosten aufgeführt sind.
- 3 Dies betrifft Abzüge auf die Werte der TRS in den sechs Monaten zum 31. Dezember 2022.
- 4 Berechnet als Differenz zwischen der Rendite und den Kosten.
- 5 Berechnet als absoluter Betrag der Kosten in Prozent des absoluten Betrags der Renditen.
- 6 Berechnet als absoluter Betrag der Rendite in Prozent des durchschnittlichen NIW für den Berichtszeitraum.
- 7 Berechnet als absoluter Betrag der Kosten in Prozent des durchschnittlichen NIW für den Berichtszeitraum.
- 8 Die von der Gegenpartei an den Werten der TRS vorgenommenen Abzüge berücksichtigen alle externen Gebühren, zu deren Zahlung sie verpflichtet ist, sowie alle Transaktionskosten und Gebühren, die normalerweise anfallen. Diese werden für die sechs Monate bis zum 31. Dezember 2022 wie folgt analysiert (alle in Prozent des durchschnittlichen NIW für den Berichtszeitraum):

Bezeichnung	Erl.	USD	% des NIW
Verwaltungsgebühren	9	11.137	0,01 %
Verwahrstellengebühren	9	5.791	0,01 %
Treuhändergebühren	9	1.336	0,00 %
Gebühren für die Sicherheitenverwaltung	9	-	- %
Sonstige Aufwendungen	9,10	2.673	0,00 %
Anlageverwaltungsgebühren	9	42.321	0,05 %
Gebühren der Verwaltungsgesellschaft	9	13.365	0,02 %
Nicht bedingte Abzüge für Swap-Gegenpartei	9	(89.987)	(0,10 %)
Insgesamt		(13.364)	(0,01 %)

- 9 Diese Beträge werden von der TRS-Gegenpartei an den Fonds während der sechs Monate bis zum 31. Dezember 2022 gezahlt oder sind von der TRS-Gegenpartei zu zahlen.
- 10 Die sonstigen Aufwendungen sind im Verkaufsprospekt beschrieben. Zum Beispiel (aber nicht beschränkt auf) laufende Organisations- und Eintragungsgebühren, Ausgaben für Rechtsberatung und prüfungsrelevante Leistungen sowie Marketingkosten.
- 11 Diese Beträge werden von der TRS-Gegenpartei während der sechs Monate bis zum 31. Dezember 2022 einbehalten und beziehen sich auf Swap-Transaktionskosten und Index-Lizenzierungsgebühren.

**ANHANG 1
VERORDNUNG ÜBER DIE TRANSPARENZ VON
WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (Fortsetzung)**

Die Renditen und Kosten der von den Teilfonds gehaltenen Total Return Swaps sind im Folgenden aufgeführt:

MSCI AC ASIA EX JAPAN SF UCITS ETF

Art von Wertpapierfinanzierungsgeschäften	Erl.	Insgesamt	Organismus für gemeinsame Anlagen	Verwaltungsgesellschaft	Dritte
Total Return Swaps	1				
Absolute Werte		USD	USD	USD	USD
Rendite	2	(6.148.662)	(6.148.662)	null	null
Kosten	3,8	(177.226)	(177.226)	null	null
Wirtschaftlicher Nutzen	4	(5.971.436)	(5.971.436)	null	null
Prozentualer mit der jeweiligen Art erzielter Anteil an der Gesamrendite		% der Gesamrendite	% der Gesamrendite	% der Gesamrendite	% der Gesamrendite
Rendite		(100,00 %)	(100,00 %)	null	null
Kosten	5	(2,88 %)	(2,88 %)	null	null
Wirtschaftlicher Nutzen	4	(102,88 %)	(102,88 %)	null	null
Prozentualer Anteil am NIW		% des NIW	% des NIW	% des NIW	% des NIW
Rendite	6	(3,33 %)	(3,33 %)	null	null
Kosten	7,8	(0,10 %)	(0,10 %)	null	null
Wirtschaftlicher Nutzen	4	(3,43 %)	(3,43 %)	null	null

**ANHANG 1
VERORDNUNG ÜBER DIE TRANSPARENZ VON
WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (Fortsetzung)**

MSCI AC ASIA EX JAPAN SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Hinweis

- 1 Mit Ausnahme von Total Return Swaps hat die Gesellschaft im Berichtszeitraum keine Wertpapierfinanzierungsgeschäfte getätigt.
- 2 Dies betrifft die realisierten und nicht realisierten Gewinne und Verluste aus den Fully Funded Swaps und Total Return Swaps (gemeinsam die „TRS“ gemäß der SFTR-Definition) während der sechs Monate zum 31. Dezember 2022, die in der Gesamtergebnisrechnung enthalten sind und vor Abzug der mit ihnen im Zusammenhang stehenden Kosten aufgeführt sind.
- 3 Dies betrifft Abzüge auf die Werte der TRS in den sechs Monaten zum 31. Dezember 2022.
- 4 Berechnet als Differenz zwischen der Rendite und den Kosten.
- 5 Berechnet als absoluter Betrag der Kosten in Prozent des absoluten Betrags der Renditen.
- 6 Berechnet als absoluter Betrag der Rendite in Prozent des durchschnittlichen NIW für den Berichtszeitraum.
- 7 Berechnet als absoluter Betrag der Kosten in Prozent des durchschnittlichen NIW für den Berichtszeitraum.
- 8 Die von der Gegenpartei an den Werten der TRS vorgenommenen Abzüge berücksichtigen alle externen Gebühren, zu deren Zahlung sie verpflichtet ist, sowie alle Transaktionskosten und Gebühren, die normalerweise anfallen. Diese werden für die sechs Monate bis zum 31. Dezember 2022 wie folgt analysiert (alle in Prozent des durchschnittlichen NIW für den Berichtszeitraum):

Bezeichnung	Erl.	USD	% des NIW
Verwaltungsgebühren	9	23.271	0,01 %
Verwahrstellengebühren	9	12.101	0,01 %
Treuhändergebühren	9	2.792	0,00 %
Gebühren für die Sicherheitenverwaltung	9	-	- %
Sonstige Aufwendungen	9,10	26.994	0,01 %
Anlageverwaltungsgebühren	9	88.429	0,05 %
Gebühren der Verwaltungsgesellschaft	9	27.925	0,02 %
Nicht bedingte Abzüge für Swap-Gegenpartei	9	(4.286)	(0,00 %)
Insgesamt		177.226	0,10 %

- 9 Diese Beträge werden von der TRS-Gegenpartei an den Fonds während der sechs Monate bis zum 31. Dezember 2022 gezahlt oder sind von der TRS-Gegenpartei zu zahlen.
- 10 Die sonstigen Aufwendungen sind im Verkaufsprospekt beschrieben. Zum Beispiel (aber nicht beschränkt auf) laufende Organisations- und Eintragungsgebühren, Ausgaben für Rechtsberatung und prüfungsrelevante Leistungen sowie Marketingkosten.
- 11 Diese Beträge werden von der TRS-Gegenpartei während der sechs Monate bis zum 31. Dezember 2022 einbehalten und beziehen sich auf Swap-Transaktionskosten und Index-Lizenzierungsgebühren.

**ANHANG 1
VERORDNUNG ÜBER DIE TRANSPARENZ VON
WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (Fortsetzung)**

Die Renditen und Kosten der von den Teilfonds gehaltenen Total Return Swaps sind im Folgenden aufgeführt:

MSCI ACWI SF UCITS ETF

Art von Wertpapierfinanzierungsgeschäften	Erl.	Insgesamt	Organismus für gemeinsame Anlagen	Verwaltungsgesellschaft	Dritte
Total Return Swaps	1				
Absolute Werte		USD	USD	USD	USD
Rendite	2	1.315.323.448	1.315.323.448	null	null
Kosten	3,8	(1.340.266)	(1.340.266)	null	null
Wirtschaftlicher Nutzen	4	1.316.663.714	1.316.663.714	null	null
Prozentualer mit der jeweiligen Art erzielter Anteil an der Gesamrendite		% der Gesamrendite	% der Gesamrendite	% der Gesamrendite	% der Gesamrendite
Rendite		100,00 %	100,00 %	null	null
Kosten	5	(0,10 %)	(0,10 %)	null	null
Wirtschaftlicher Nutzen	4	99,90 %	99,90 %	null	null
Prozentualer Anteil am NIW		% des NIW	% des NIW	% des NIW	% des NIW
Rendite	6	32,85 %	32,85 %	null	null
Kosten	7,8	(0,04 %)	(0,04 %)	null	null
Wirtschaftlicher Nutzen	4	32,81 %	32,81 %	null	null

**ANHANG 1
VERORDNUNG ÜBER DIE TRANSPARENZ VON
WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (Fortsetzung)**

MSCI ACWI SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Hinweis

- 1 Mit Ausnahme von Total Return Swaps hat die Gesellschaft im Berichtszeitraum keine Wertpapierfinanzierungsgeschäfte getätigt.
- 2 Dies betrifft die realisierten und nicht realisierten Gewinne und Verluste aus den Fully Funded Swaps und Total Return Swaps (gemeinsam die „TRS“ gemäß der SFTR-Definition) während der sechs Monate zum 31. Dezember 2022, die in der Gesamtergebnisrechnung enthalten sind und vor Abzug der mit ihnen im Zusammenhang stehenden Kosten aufgeführt sind.
- 3 Dies betrifft Abzüge auf die Werte der TRS in den sechs Monaten zum 31. Dezember 2022.
- 4 Berechnet als Differenz zwischen der Rendite und den Kosten.
- 5 Berechnet als absoluter Betrag der Kosten in Prozent des absoluten Betrags der Renditen.
- 6 Berechnet als absoluter Betrag der Rendite in Prozent des durchschnittlichen NIW für den Berichtszeitraum.
- 7 Berechnet als absoluter Betrag der Kosten in Prozent des durchschnittlichen NIW für den Berichtszeitraum.
- 8 Die von der Gegenpartei an den Werten der TRS vorgenommenen Abzüge berücksichtigen alle externen Gebühren, zu deren Zahlung sie verpflichtet ist, sowie alle Transaktionskosten und Gebühren, die normalerweise anfallen. Diese werden für die sechs Monate bis zum 31. Dezember 2022 wie folgt analysiert (alle in Prozent des durchschnittlichen NIW für den Berichtszeitraum):

Bezeichnung	Erl.	USD	% des NIW
Verwaltungsgebühren	9	512.262	0,01 %
Verwahrstellengebühren	9	266.376	0,01 %
Treuhändergebühren	9	61.471	0,00 %
Gebühren für die Sicherheitenverwaltung	9	-	- %
Sonstige Aufwendungen	9,10	225.396	0,01 %
Anlageverwaltungsgebühren	9	1.946.594	0,05 %
Gebühren der Verwaltungsgesellschaft	9	614.714	0,02 %
Nicht bedingte Abzüge für Swap-Gegenpartei	9	(2.286.547)	(0,06 %)
Insgesamt		1.340.266	0,04 %

- 9 Diese Beträge werden von der TRS-Gegenpartei an den Fonds während der sechs Monate bis zum 31. Dezember 2022 gezahlt oder sind von der TRS-Gegenpartei zu zahlen.
- 10 Die sonstigen Aufwendungen sind im Verkaufsprospekt beschrieben. Zum Beispiel (aber nicht beschränkt auf) laufende Organisations- und Eintragungsgebühren, Ausgaben für Rechtsberatung und prüfungsrelevante Leistungen sowie Marketingkosten.
- 11 Diese Beträge werden von der TRS-Gegenpartei während der sechs Monate bis zum 31. Dezember 2022 einbehalten und beziehen sich auf Swap-Transaktionskosten und Index-Lizenzierungsgebühren.

**ANHANG 1
VERORDNUNG ÜBER DIE TRANSPARENZ VON
WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (Fortsetzung)**

Die Renditen und Kosten der von den Teilfonds gehaltenen Total Return Swaps sind im Folgenden aufgeführt:

CMCI EX-AGRICULTURE SF UCITS ETF

Art von Wertpapierfinanzierungsgeschäften	Erl.	Insgesamt	Organismus für gemeinsame Anlagen	Verwaltungsgesellschaft	Dritte
Total Return Swaps	1				
Absolute Werte		USD	USD	USD	USD
Rendite	2	29.345.596	29.345.596	null	null
Kosten	3,8	(404.615)	(404.615)	null	null
Wirtschaftlicher Nutzen	4	29.750.211	29.750.211	null	null
Prozentualer mit der jeweiligen Art erzielter Anteil an der Gesamrendite		% der Gesamrendite	% der Gesamrendite	% der Gesamrendite	% der Gesamrendite
Rendite		100,00 %	100,00 %	null	null
Kosten	5	(1,38 %)	(1,38 %)	null	null
Wirtschaftlicher Nutzen	4	98,62 %	98,62 %	null	null
Prozentualer Anteil am NIW		% des NIW	% des NIW	% des NIW	% des NIW
Rendite	6	24,96 %	24,96 %	null	null
Kosten	7,8	(0,34 %)	(0,34 %)	null	null
Wirtschaftlicher Nutzen	4	24,62 %	24,62 %	null	null

**ANHANG 1
VERORDNUNG ÜBER DIE TRANSPARENZ VON
WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (Fortsetzung)**

CMCI EX-AGRICULTURE SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Hinweis

- 1 Mit Ausnahme von Total Return Swaps hat die Gesellschaft im Berichtszeitraum keine Wertpapierfinanzierungsgeschäfte getätigt.
- 2 Dies betrifft die realisierten und nicht realisierten Gewinne und Verluste aus den Fully Funded Swaps und Total Return Swaps (gemeinsam die „TRS“ gemäß der SFTR-Definition) während der sechs Monate zum 31. Dezember 2022, die in der Gesamtergebnisrechnung enthalten sind und vor Abzug der mit ihnen im Zusammenhang stehenden Kosten aufgeführt sind.
- 3 Dies betrifft Abzüge auf die Werte der TRS in den sechs Monaten zum 31. Dezember 2022.
- 4 Berechnet als Differenz zwischen der Rendite und den Kosten.
- 5 Berechnet als absoluter Betrag der Kosten in Prozent des absoluten Betrags der Renditen.
- 6 Berechnet als absoluter Betrag der Rendite in Prozent des durchschnittlichen NIW für den Berichtszeitraum.
- 7 Berechnet als absoluter Betrag der Kosten in Prozent des durchschnittlichen NIW für den Berichtszeitraum.
- 8 Die von der Gegenpartei an den Werten der TRS vorgenommenen Abzüge berücksichtigen alle externen Gebühren, zu deren Zahlung sie verpflichtet ist, sowie alle Transaktionskosten und Gebühren, die normalerweise anfallen. Diese werden für die sechs Monate bis zum 31. Dezember 2022 wie folgt analysiert (alle in Prozent des durchschnittlichen NIW für den Berichtszeitraum):

Bezeichnung	Erl.	USD	% des NIW
Verwaltungsgebühren	9	14.836	0,01 %
Verwahrstellengebühren	9	7.715	0,01 %
Treuhändergebühren	9	1.780	0,00 %
Gebühren für die Sicherheitenverwaltung	9	-	- %
Sonstige Aufwendungen	9,10	14.243	0,01 %
Anlageverwaltungsgebühren	9	103.853	0,09 %
Gebühren der Verwaltungsgesellschaft	9	59.344	0,05 %
Nicht bedingte Abzüge für Swap-Gegenpartei	9	202.844	0,17 %
Insgesamt		404.615	0,34 %

- 9 Diese Beträge werden von der TRS-Gegenpartei an den Fonds während der sechs Monate bis zum 31. Dezember 2022 gezahlt oder sind von der TRS-Gegenpartei zu zahlen.
- 10 Die sonstigen Aufwendungen sind im Verkaufsprospekt beschrieben. Zum Beispiel (aber nicht beschränkt auf) laufende Organisations- und Eintragungsgebühren, Ausgaben für Rechtsberatung und prüfungsrelevante Leistungen sowie Marketingkosten.
- 11 Diese Beträge werden von der TRS-Gegenpartei während der sechs Monate bis zum 31. Dezember 2022 einbehalten und beziehen sich auf Swap-Transaktionskosten und Index-Lizenzierungsgebühren.

**ANHANG 1
VERORDNUNG ÜBER DIE TRANSPARENZ VON
WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (Fortsetzung)**

Die Renditen und Kosten der von den Teilfonds gehaltenen Total Return Swaps sind im Folgenden aufgeführt:

BLOOMBERG COMMODITY CMCI SF UCITS ETF

Art von Wertpapierfinanzierungsgeschäften	Erl.	Insgesamt	Organismus für gemeinsame Anlagen	Verwaltungsgesellschaft	Dritte
Total Return Swaps	1				
Absolute Werte		USD	USD	USD	USD
Rendite	2	85.160.193	85.160.193	null	null
Kosten	3,8	(1.609.905)	(1.609.905)	null	null
Wirtschaftlicher Nutzen	4	86.770.098	86.770.098	null	null
Prozentualer mit der jeweiligen Art erzielter Anteil an der Gesamrendite		% der Gesamtrendite	% der Gesamtrendite	% der Gesamtrendite	% der Gesamtrendite
Rendite		100,00 %	100,00 %	null	null
Kosten	5	(1,89 %)	(1,89 %)	null	null
Wirtschaftlicher Nutzen	4	98,11 %	98,11 %	null	null
Prozentualer Anteil am NIW		% des NIW	% des NIW	% des NIW	% des NIW
Rendite	6	16,67 %	16,67 %	null	null
Kosten	7,8	(0,31 %)	(0,31 %)	null	null
Wirtschaftlicher Nutzen	4	16,36 %	16,36 %	null	null

**ANHANG 1
VERORDNUNG ÜBER DIE TRANSPARENZ VON
WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (Fortsetzung)**

BLOOMBERG COMMODITY CMCI SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Hinweis

- 1 Mit Ausnahme von Total Return Swaps hat die Gesellschaft im Berichtszeitraum keine Wertpapierfinanzierungsgeschäfte getätigt.
- 2 Dies betrifft die realisierten und nicht realisierten Gewinne und Verluste aus den Fully Funded Swaps und Total Return Swaps (gemeinsam die „TRS“ gemäß der SFTR-Definition) während der sechs Monate zum 31. Dezember 2022, die in der Gesamtergebnisrechnung enthalten sind und vor Abzug der mit ihnen im Zusammenhang stehenden Kosten aufgeführt sind.
- 3 Dies betrifft Abzüge auf die Werte der TRS in den sechs Monaten zum 31. Dezember 2022.
- 4 Berechnet als Differenz zwischen der Rendite und den Kosten.
- 5 Berechnet als absoluter Betrag der Kosten in Prozent des absoluten Betrags der Renditen.
- 6 Berechnet als absoluter Betrag der Rendite in Prozent des durchschnittlichen NIW für den Berichtszeitraum.
- 7 Berechnet als absoluter Betrag der Kosten in Prozent des durchschnittlichen NIW für den Berichtszeitraum.
- 8 Die von der Gegenpartei an den Werten der TRS vorgenommenen Abzüge berücksichtigen alle externen Gebühren, zu deren Zahlung sie verpflichtet ist, sowie alle Transaktionskosten und Gebühren, die normalerweise anfallen. Diese werden für die sechs Monate bis zum 31. Dezember 2022 wie folgt analysiert (alle in Prozent des durchschnittlichen NIW für den Berichtszeitraum):

Bezeichnung	Erl.	USD	% des NIW
Verwaltungsgebühren	9	64.257	0,01 %
Verwahrstellengebühren	9	33.414	0,01 %
Treuhändergebühren	9	7.711	0,00 %
Gebühren für die Sicherheitenverwaltung	9	-	- %
Sonstige Aufwendungen	9,10	61.687	0,01 %
Anlageverwaltungsgebühren	9	449.802	0,09 %
Gebühren der Verwaltungsgesellschaft	9	257.030	0,05 %
Nicht bedingte Abzüge für Swap-Gegenpartei	9	736.004	0,14 %
Insgesamt		1.609.905	0,31 %

- 9 Diese Beträge werden von der TRS-Gegenpartei an den Fonds während der sechs Monate bis zum 31. Dezember 2022 gezahlt oder sind von der TRS-Gegenpartei zu zahlen.
- 10 Die sonstigen Aufwendungen sind im Verkaufsprospekt beschrieben. Zum Beispiel (aber nicht beschränkt auf) laufende Organisations- und Eintragungsgebühren, Ausgaben für Rechtsberatung und prüfungsrelevante Leistungen sowie Marketingkosten.
- 11 Diese Beträge werden von der TRS-Gegenpartei während der sechs Monate bis zum 31. Dezember 2022 einbehalten und beziehen sich auf Swap-Transaktionskosten und Index-Lizenzierungsgebühren.

**ANHANG 1
VERORDNUNG ÜBER DIE TRANSPARENZ VON
WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (Fortsetzung)**

Die Renditen und Kosten der von den Teilfonds gehaltenen Total Return Swaps sind im Folgenden aufgeführt:

CMCI COMMODITY CARRY SF UCITS ETF

Art von Wertpapierfinanzierungsgeschäften	Erl.	Insgesamt	Organismus für gemeinsame Anlagen	Verwaltungsgesellschaft	Dritte
Total Return Swaps	1				
Absolute Werte		USD	USD	USD	USD
Rendite	2	21.967.933	21.967.933	null	null
Kosten	3,8	(202.580)	(202.580)	null	null
Wirtschaftlicher Nutzen	4	22.170.513	22.170.513	null	null
Prozentualer mit der jeweiligen Art erzielter Anteil an der Gesamrendite		% der Gesamrendite	% der Gesamrendite	% der Gesamrendite	% der Gesamrendite
Rendite		100,00 %	100,00 %	null	null
Kosten	5	(0,92 %)	(0,92 %)	null	null
Wirtschaftlicher Nutzen	4	99,08 %	99,08 %	null	null
Prozentualer Anteil am NIW		% des NIW	% des NIW	% des NIW	% des NIW
Rendite	6	17,99 %	17,99 %	null	null
Kosten	7,8	(0,16 %)	(0,16 %)	null	null
Wirtschaftlicher Nutzen	4	17,83 %	17,83 %	null	null

**ANHANG 1
VERORDNUNG ÜBER DIE TRANSPARENZ VON
WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (Fortsetzung)**

CMCI COMMODITY CARRY SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Hinweis

- 1 Mit Ausnahme von Total Return Swaps hat die Gesellschaft im Berichtszeitraum keine Wertpapierfinanzierungsgeschäfte getätigt.
- 2 Dies betrifft die realisierten und nicht realisierten Gewinne und Verluste aus den Fully Funded Swaps und Total Return Swaps (gemeinsam die „TRS“ gemäß der SFTR-Definition) während der sechs Monate zum 31. Dezember 2022, die in der Gesamtergebnisrechnung enthalten sind und vor Abzug der mit ihnen im Zusammenhang stehenden Kosten aufgeführt sind.
- 3 Dies betrifft Abzüge auf die Werte der TRS in den sechs Monaten zum 31. Dezember 2022.
- 4 Berechnet als Differenz zwischen der Rendite und den Kosten.
- 5 Berechnet als absoluter Betrag der Kosten in Prozent des absoluten Betrags der Renditen.
- 6 Berechnet als absoluter Betrag der Rendite in Prozent des durchschnittlichen NIW für den Berichtszeitraum.
- 7 Berechnet als absoluter Betrag der Kosten in Prozent des durchschnittlichen NIW für den Berichtszeitraum.
- 8 Die von der Gegenpartei an den Werten der TRS vorgenommenen Abzüge berücksichtigen alle externen Gebühren, zu deren Zahlung sie verpflichtet ist, sowie alle Transaktionskosten und Gebühren, die normalerweise anfallen. Diese werden für die sechs Monate bis zum 31. Dezember 2022 wie folgt analysiert (alle in Prozent des durchschnittlichen NIW für den Berichtszeitraum):

Bezeichnung	Erl.	USD	% des NIW
Verwaltungsgebühren	9	15.408	0,01 %
Verwahrstellengebühren	9	8.012	0,01 %
Treuhändergebühren	9	1.849	0,00 %
Gebühren für die Sicherheitenverwaltung	9	-	- %
Sonstige Aufwendungen	9,10	14.792	0,01 %
Anlageverwaltungsgebühren	9	107.858	0,09 %
Gebühren der Verwaltungsgesellschaft	9	61.633	0,05 %
Nicht bedingte Abzüge für Swap-Gegenpartei	9	(6.972)	(0,01 %)
Insgesamt		202.580	0,16 %

- 9 Diese Beträge werden von der TRS-Gegenpartei an den Fonds während der sechs Monate bis zum 31. Dezember 2022 gezahlt oder sind von der TRS-Gegenpartei zu zahlen.
- 10 Die sonstigen Aufwendungen sind im Verkaufsprospekt beschrieben. Zum Beispiel (aber nicht beschränkt auf) laufende Organisations- und Eintragungsgebühren, Ausgaben für Rechtsberatung und prüfungsrelevante Leistungen sowie Marketingkosten.
- 11 Diese Beträge werden von der TRS-Gegenpartei während der sechs Monate bis zum 31. Dezember 2022 einbehalten und beziehen sich auf Swap-Transaktionskosten und Index-Lizenzierungsgebühren.

**ANHANG 1
VERORDNUNG ÜBER DIE TRANSPARENZ VON
WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (Fortsetzung)**

Die Renditen und Kosten der von den Teilfonds gehaltenen Total Return Swaps sind im Folgenden aufgeführt:

MSCI CHINA A SF UCITS ETF

Art von Wertpapierfinanzierungsgeschäften	Erl.	Insgesamt	Organismus für gemeinsame Anlagen	Verwaltungsgesellschaft	Dritte
Total Return Swaps	1				
Absolute Werte		USD	USD	USD	USD
Rendite	2	18.282.758	18.282.758	null	null
Kosten	3,8	2.381.762	2.381.762	null	null
Wirtschaftlicher Nutzen	4	15.900.996	15.900.996	null	null
Prozentualer mit der jeweiligen Art erzielter Anteil an der Gesamrendite		% der Gesamrendite	% der Gesamrendite	% der Gesamrendite	% der Gesamrendite
Rendite		100,00 %	100,00 %	null	null
Kosten	5	13,03 %	13,03 %	null	null
Wirtschaftlicher Nutzen	4	113,03 %	113,03 %	null	null
Prozentualer Anteil am NIW		% des NIW	% des NIW	% des NIW	% des NIW
Rendite	6	12,37 %	12,37 %	null	null
Kosten	7,8	1,62 %	1,62 %	null	null
Wirtschaftlicher Nutzen	4	13,99 %	13,99 %	null	null

**ANHANG 1
VERORDNUNG ÜBER DIE TRANSPARENZ VON
WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (Fortsetzung)**

MSCI CHINA A SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Hinweis

- 1 Mit Ausnahme von Total Return Swaps hat die Gesellschaft im Berichtszeitraum keine Wertpapierfinanzierungsgeschäfte getätigt.
- 2 Dies betrifft die realisierten und nicht realisierten Gewinne und Verluste aus den Fully Funded Swaps und Total Return Swaps (gemeinsam die „TRS“ gemäß der SFTR-Definition) während der sechs Monate zum 31. Dezember 2022, die in der Gesamtergebnisrechnung enthalten sind und vor Abzug der mit ihnen im Zusammenhang stehenden Kosten aufgeführt sind.
- 3 Dies betrifft Abzüge auf die Werte der TRS in den sechs Monaten zum 31. Dezember 2022.
- 4 Berechnet als Differenz zwischen der Rendite und den Kosten.
- 5 Berechnet als absoluter Betrag der Kosten in Prozent des absoluten Betrags der Renditen.
- 6 Berechnet als absoluter Betrag der Rendite in Prozent des durchschnittlichen NIW für den Berichtszeitraum.
- 7 Berechnet als absoluter Betrag der Kosten in Prozent des durchschnittlichen NIW für den Berichtszeitraum.
- 8 Die von der Gegenpartei an den Werten der TRS vorgenommenen Abzüge berücksichtigen alle externen Gebühren, zu deren Zahlung sie verpflichtet ist, sowie alle Transaktionskosten und Gebühren, die normalerweise anfallen. Diese werden für die sechs Monate bis zum 31. Dezember 2022 wie folgt analysiert (alle in Prozent des durchschnittlichen NIW für den Berichtszeitraum):

Bezeichnung	Erl.	USD	% des NIW
Verwaltungsgebühren	9	18.684	0,01 %
Verwahrstellengebühren	9	9.716	0,01 %
Treuhändergebühren	9	2.242	0,00 %
Gebühren für die Sicherheitenverwaltung	9	-	- %
Sonstige Aufwendungen	9,10	19.432	0,01 %
Anlageverwaltungsgebühren	9	93.422	0,06 %
Gebühren der Verwaltungsgesellschaft	9	44.842	0,03 %
Nicht bedingte Abzüge für Swap-Gegenpartei	9	(2.570.100)	(1,74 %)
Insgesamt		(2.381.762)	(1,62 %)

- 9 Diese Beträge werden von der TRS-Gegenpartei an den Fonds während der sechs Monate bis zum 31. Dezember 2022 gezahlt oder sind von der TRS-Gegenpartei zu zahlen.
- 10 Die sonstigen Aufwendungen sind im Verkaufsprospekt beschrieben. Zum Beispiel (aber nicht beschränkt auf) laufende Organisations- und Eintragungsgebühren, Ausgaben für Rechtsberatung und prüfungsrelevante Leistungen sowie Marketingkosten.
- 11 Diese Beträge werden von der TRS-Gegenpartei während der sechs Monate bis zum 31. Dezember 2022 einbehalten und beziehen sich auf Swap-Transaktionskosten und Index-Lizenzierungsgebühren.

**ANHANG 1
VERORDNUNG ÜBER DIE TRANSPARENZ VON
WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (Fortsetzung)**

Die Renditen und Kosten der von den Teilfonds gehaltenen Total Return Swaps sind im Folgenden aufgeführt:

EURO EQUITY DEFENSIVE COVERED CALL SF UCITS ETF

Art von Wertpapierfinanzierungsgeschäften	Erl.	Insgesamt	Organismus für gemeinsame Anlagen	Verwal- tungsge- sellschaft	Dritte
Total Return Swaps	1				
Absolute Werte		EUR	EUR	EUR	EUR
Rendite	2	397.959	397.959	null	null
Kosten	3,8	2.367	2.367	null	null
Wirtschaftlicher Nutzen	4	395.592	395.592	null	null
Prozentualer mit der jeweiligen Art erzielter Anteil an der Gesamrendite		% der Gesamt- rendite	% der Gesamt- rendite	% der Gesamt- rendite	% der Gesamt- rendite
Rendite		100,00 %	100,00 %	null	null
Kosten	5	0,59 %	0,59 %	null	null
Wirtschaftlicher Nutzen	4	100,59 %	100,59 %	null	null
Prozentualer Anteil am NIW		% des NIW	% des NIW	% des NIW	% des NIW
Rendite	6	8,43 %	8,43 %	null	null
Kosten	7,8	0,05 %	0,05 %	null	null
Wirtschaftlicher Nutzen	4	8,48 %	8,48 %	null	null

**ANHANG 1
VERORDNUNG ÜBER DIE TRANSPARENZ VON
WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (Fortsetzung)**

EURO EQUITY DEFENSIVE COVERED CALL SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Hinweis

- 1 Mit Ausnahme von Total Return Swaps hat die Gesellschaft im Berichtszeitraum keine Wertpapierfinanzierungsgeschäfte getätigt.
- 2 Dies betrifft die realisierten und nicht realisierten Gewinne und Verluste aus den Fully Funded Swaps und Total Return Swaps (gemeinsam die „TRS“ gemäß der SFTR-Definition) während der sechs Monate zum 31. Dezember 2022, die in der Gesamtergebnisrechnung enthalten sind und vor Abzug der mit ihnen im Zusammenhang stehenden Kosten aufgeführt sind.
- 3 Dies betrifft Abzüge auf die Werte der TRS in den sechs Monaten zum 31. Dezember 2022.
- 4 Berechnet als Differenz zwischen der Rendite und den Kosten.
- 5 Berechnet als absoluter Betrag der Kosten in Prozent des absoluten Betrags der Renditen.
- 6 Berechnet als absoluter Betrag der Rendite in Prozent des durchschnittlichen NIW für den Berichtszeitraum.
- 7 Berechnet als absoluter Betrag der Kosten in Prozent des durchschnittlichen NIW für den Berichtszeitraum.
- 8 Die von der Gegenpartei an den Werten der TRS vorgenommenen Abzüge berücksichtigen alle externen Gebühren, zu deren Zahlung sie verpflichtet ist, sowie alle Transaktionskosten und Gebühren, die normalerweise anfallen. Diese werden für die sechs Monate bis zum 31. Dezember 2022 wie folgt analysiert (alle in Prozent des durchschnittlichen NIW für den Berichtszeitraum):

Bezeichnung	Erl.	EUR	% des NIW
Verwaltungsgebühren	9	592	0,01 %
Verwahrstellengebühren	9	308	0,01 %
Treuhändergebühren	9	71	0,00 %
Gebühren für die Sicherheitenverwaltung	9	-	- %
Sonstige Aufwendungen	9,10	568	0,01 %
Anlageverwaltungsgebühren	9	3.432	0,07 %
Gebühren der Verwaltungsgesellschaft	9	1.184	0,03 %
Nicht bedingte Abzüge für Swap-Gegenpartei	9	(8.522)	(0,18 %)
Insgesamt		(2.367)	(0,05 %)

- 9 Diese Beträge werden von der TRS-Gegenpartei an den Fonds während der sechs Monate bis zum 31. Dezember 2022 gezahlt oder sind von der TRS-Gegenpartei zu zahlen.
- 10 Die sonstigen Aufwendungen sind im Verkaufsprospekt beschrieben. Zum Beispiel (aber nicht beschränkt auf) laufende Organisations- und Eintragungsgebühren, Ausgaben für Rechtsberatung und prüfungsrelevante Leistungen sowie Marketingkosten.
- 11 Diese Beträge werden von der TRS-Gegenpartei während der sechs Monate bis zum 31. Dezember 2022 einbehalten und beziehen sich auf Swap-Transaktionskosten und Index-Lizenzierungsgebühren.

**ANHANG 1
VERORDNUNG ÜBER DIE TRANSPARENZ VON
WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (Fortsetzung)**

Die Renditen und Kosten der von den Teilfonds gehaltenen Total Return Swaps sind im Folgenden aufgeführt:

EURO EQUITY DEFENSIVE PUT WRITE SF UCITS ETF

Art von Wertpapierfinanzierungsgeschäften	Erl.	Insgesamt	Organismus für gemeinsame Anlagen	Verwaltungsgesellschaft	Dritte
Total Return Swaps	1				
Absolute Werte		EUR	EUR	EUR	EUR
Rendite	2	2.211.451	2.211.451	null	null
Kosten	3,8	(25.417)	(25.417)	null	null
Wirtschaftlicher Nutzen	4	2.236.868	2.236.868	null	null
Prozentualer mit der jeweiligen Art erzielter Anteil an der Gesamrendite		% der Gesamrendite	% der Gesamrendite	% der Gesamrendite	% der Gesamrendite
Rendite		100,00 %	100,00 %	null	null
Kosten	5	(1,15 %)	(1,15 %)	null	null
Wirtschaftlicher Nutzen	4	98,85 %	98,85 %	null	null
Prozentualer Anteil am NIW		% des NIW	% des NIW	% des NIW	% des NIW
Rendite	6	10,97 %	10,97 %	null	null
Kosten	7,8	(0,12 %)	(0,12 %)	null	null
Wirtschaftlicher Nutzen	4	10,85 %	10,85 %	null	null

**ANHANG 1
VERORDNUNG ÜBER DIE TRANSPARENZ VON
WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (Fortsetzung)**

EURO EQUITY DEFENSIVE PUT WRITE SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Hinweis

- 1 Mit Ausnahme von Total Return Swaps hat die Gesellschaft im Berichtszeitraum keine Wertpapierfinanzierungsgeschäfte getätigt.
- 2 Dies betrifft die realisierten und nicht realisierten Gewinne und Verluste aus den Fully Funded Swaps und Total Return Swaps (gemeinsam die „TRS“ gemäß der SFTR-Definition) während der sechs Monate zum 31. Dezember 2022, die in der Gesamtergebnisrechnung enthalten sind und vor Abzug der mit ihnen im Zusammenhang stehenden Kosten aufgeführt sind.
- 3 Dies betrifft Abzüge auf die Werte der TRS in den sechs Monaten zum 31. Dezember 2022.
- 4 Berechnet als Differenz zwischen der Rendite und den Kosten.
- 5 Berechnet als absoluter Betrag der Kosten in Prozent des absoluten Betrags der Renditen.
- 6 Berechnet als absoluter Betrag der Rendite in Prozent des durchschnittlichen NIW für den Berichtszeitraum.
- 7 Berechnet als absoluter Betrag der Kosten in Prozent des durchschnittlichen NIW für den Berichtszeitraum.
- 8 Die von der Gegenpartei an den Werten der TRS vorgenommenen Abzüge berücksichtigen alle externen Gebühren, zu deren Zahlung sie verpflichtet ist, sowie alle Transaktionskosten und Gebühren, die normalerweise anfallen. Diese werden für die sechs Monate bis zum 31. Dezember 2022 wie folgt analysiert (alle in Prozent des durchschnittlichen NIW für den Berichtszeitraum):

Bezeichnung	Erl.	EUR	% des NIW
Verwaltungsgebühren	9	2.542	0,01 %
Verwahrstellengebühren	9	1.322	0,01 %
Treuhändergebühren	9	305	0,00 %
Gebühren für die Sicherheitenverwaltung	9	-	- %
Sonstige Aufwendungen	9,10	2.440	0,01 %
Anlageverwaltungsgebühren	9	14.742	0,07 %
Gebühren der Verwaltungsgesellschaft	9	5.083	0,03 %
Nicht bedingte Abzüge für Swap-Gegenpartei	9	(1.017)	(0,01 %)
Insgesamt		25.417	0,12 %

- 9 Diese Beträge werden von der TRS-Gegenpartei an den Fonds während der sechs Monate bis zum 31. Dezember 2022 gezahlt oder sind von der TRS-Gegenpartei zu zahlen.
- 10 Die sonstigen Aufwendungen sind im Verkaufsprospekt beschrieben. Zum Beispiel (aber nicht beschränkt auf) laufende Organisations- und Eintragungsgebühren, Ausgaben für Rechtsberatung und prüfungsrelevante Leistungen sowie Marketingkosten.
- 11 Diese Beträge werden von der TRS-Gegenpartei während der sechs Monate bis zum 31. Dezember 2022 einbehalten und beziehen sich auf Swap-Transaktionskosten und Index-Lizenzierungsgebühren.

**ANHANG 1
VERORDNUNG ÜBER DIE TRANSPARENZ VON
WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (Fortsetzung)**

Die Renditen und Kosten der von den Teilfonds gehaltenen Total Return Swaps sind im Folgenden aufgeführt:

US EQUITY DEFENSIVE COVERED CALL SF UCITS ETF

Art von Wertpapierfinanzierungsgeschäften	Erl.	Insgesamt	Organismus für gemeinsame Anlagen	Verwaltungsgesellschaft	Dritte
Total Return Swaps	1				
Absolute Werte		USD	USD	USD	USD
Rendite	2	1.058.994	1.058.994	null	null
Kosten	3,8	(2.099)	(2.099)	null	null
Wirtschaftlicher Nutzen	4	1.061.093	1.061.093	null	null
Prozentualer mit der jeweiligen Art erzielter Anteil an der Gesamrendite		% der Gesamtrendite	% der Gesamtrendite	% der Gesamtrendite	% der Gesamtrendite
Rendite		100,00 %	100,00 %	null	null
Kosten	5	(0,20 %)	(0,20 %)	null	null
Wirtschaftlicher Nutzen	4	99,80 %	99,80 %	null	null
Prozentualer Anteil am NIW		% des NIW	% des NIW	% des NIW	% des NIW
Rendite	6	20,28 %	20,28 %	null	null
Kosten	7,8	(0,04 %)	(0,04 %)	null	null
Wirtschaftlicher Nutzen	4	20,24 %	20,24 %	null	null

**ANHANG 1
VERORDNUNG ÜBER DIE TRANSPARENZ VON
WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (Fortsetzung)**

US EQUITY DEFENSIVE COVERED CALL SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Hinweis

- 1 Mit Ausnahme von Total Return Swaps hat die Gesellschaft im Berichtszeitraum keine Wertpapierfinanzierungsgeschäfte getätigt.
- 2 Dies betrifft die realisierten und nicht realisierten Gewinne und Verluste aus den Fully Funded Swaps und Total Return Swaps (gemeinsam die „TRS“ gemäß der SFTR-Definition) während der sechs Monate zum 31. Dezember 2022, die in der Gesamtergebnisrechnung enthalten sind und vor Abzug der mit ihnen im Zusammenhang stehenden Kosten aufgeführt sind.
- 3 Dies betrifft Abzüge auf die Werte der TRS in den sechs Monaten zum 31. Dezember 2022.
- 4 Berechnet als Differenz zwischen der Rendite und den Kosten.
- 5 Berechnet als absoluter Betrag der Kosten in Prozent des absoluten Betrags der Renditen.
- 6 Berechnet als absoluter Betrag der Rendite in Prozent des durchschnittlichen NIW für den Berichtszeitraum.
- 7 Berechnet als absoluter Betrag der Kosten in Prozent des durchschnittlichen NIW für den Berichtszeitraum.
- 8 Die von der Gegenpartei an den Werten der TRS vorgenommenen Abzüge berücksichtigen alle externen Gebühren, zu deren Zahlung sie verpflichtet ist, sowie alle Transaktionskosten und Gebühren, die normalerweise anfallen. Diese werden für die sechs Monate bis zum 31. Dezember 2022 wie folgt analysiert (alle in Prozent des durchschnittlichen NIW für den Berichtszeitraum):

Bezeichnung	Erl.	USD	% des NIW
Verwaltungsgebühren	9	656	0,01 %
Verwahrstellengebühren	9	341	0,01 %
Treuhändergebühren	9	79	0,00 %
Gebühren für die Sicherheitenverwaltung	9	-	- %
Sonstige Aufwendungen	9,10	498	0,01 %
Anlageverwaltungsgebühren	9	3.804	0,07 %
Gebühren der Verwaltungsgesellschaft	9	1.312	0,03 %
Nicht bedingte Abzüge für Swap-Gegenpartei	9	(4.591)	(0,09 %)
Insgesamt		2.099	0,04 %

- 9 Diese Beträge werden von der TRS-Gegenpartei an den Fonds während der sechs Monate bis zum 31. Dezember 2022 gezahlt oder sind von der TRS-Gegenpartei zu zahlen.
- 10 Die sonstigen Aufwendungen sind im Verkaufsprospekt beschrieben. Zum Beispiel (aber nicht beschränkt auf) laufende Organisations- und Eintragungsgebühren, Ausgaben für Rechtsberatung und prüfungsrelevante Leistungen sowie Marketingkosten.
- 11 Diese Beträge werden von der TRS-Gegenpartei während der sechs Monate bis zum 31. Dezember 2022 einbehalten und beziehen sich auf Swap-Transaktionskosten und Index-Lizenzierungsgebühren.

**ANHANG 1
VERORDNUNG ÜBER DIE TRANSPARENZ VON
WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (Fortsetzung)**

Die Renditen und Kosten der von den Teilfonds gehaltenen Total Return Swaps sind im Folgenden aufgeführt:

US EQUITY DEFENSIVE PUT WRITE SF UCITS ETF

Art von Wertpapierfinanzierungsgeschäften	Erl.	Insgesamt	Organismus für gemeinsame Anlagen	Verwaltungsgesellschaft	Dritte
Total Return Swaps	1				
Absolute Werte		USD	USD	USD	USD
Rendite	2	2.624.728	2.624.728	null	null
Kosten	3,8	(3.059)	(3.059)	null	null
Wirtschaftlicher Nutzen	4	2.627.787	2.627.787	null	null
Prozentualer mit der jeweiligen Art erzielter Anteil an der Gesamrendite		% der Gesamrendite	% der Gesamrendite	% der Gesamrendite	% der Gesamrendite
Rendite		100,00 %	100,00 %	null	null
Kosten	5	(0,12 %)	(0,12 %)	null	null
Wirtschaftlicher Nutzen	4	99,88 %	99,88 %	null	null
Prozentualer Anteil am NIW		% des NIW	% des NIW	% des NIW	% des NIW
Rendite	6	15,11 %	15,11 %	null	null
Kosten	7,8	(0,02 %)	(0,02 %)	null	null
Wirtschaftlicher Nutzen	4	15,09 %	15,09 %	null	null

**ANHANG 1
VERORDNUNG ÜBER DIE TRANSPARENZ VON
WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (Fortsetzung)**

US EQUITY DEFENSIVE PUT WRITE SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Hinweis

- 1 Mit Ausnahme von Total Return Swaps hat die Gesellschaft im Berichtszeitraum keine Wertpapierfinanzierungsgeschäfte getätigt.
- 2 Dies betrifft die realisierten und nicht realisierten Gewinne und Verluste aus den Fully Funded Swaps und Total Return Swaps (gemeinsam die „TRS“ gemäß der SFTR-Definition) während der sechs Monate zum 31. Dezember 2022, die in der Gesamtergebnisrechnung enthalten sind und vor Abzug der mit ihnen im Zusammenhang stehenden Kosten aufgeführt sind.
- 3 Dies betrifft Abzüge auf die Werte der TRS in den sechs Monaten zum 31. Dezember 2022.
- 4 Berechnet als Differenz zwischen der Rendite und den Kosten.
- 5 Berechnet als absoluter Betrag der Kosten in Prozent des absoluten Betrags der Renditen.
- 6 Berechnet als absoluter Betrag der Rendite in Prozent des durchschnittlichen NIW für den Berichtszeitraum.
- 7 Berechnet als absoluter Betrag der Kosten in Prozent des durchschnittlichen NIW für den Berichtszeitraum.
- 8 Die von der Gegenpartei an den Werten der TRS vorgenommenen Abzüge berücksichtigen alle externen Gebühren, zu deren Zahlung sie verpflichtet ist, sowie alle Transaktionskosten und Gebühren, die normalerweise anfallen. Diese werden für die sechs Monate bis zum 31. Dezember 2022 wie folgt analysiert (alle in Prozent des durchschnittlichen NIW für den Berichtszeitraum):

Bezeichnung	Erl.	USD	% des NIW
Verwaltungsgebühren	9	2.185	0,01 %
Verwahrstellengebühren	9	1.136	0,01 %
Treuhändergebühren	9	262	0,00 %
Gebühren für die Sicherheitenverwaltung	9	-	- %
Sonstige Aufwendungen	9,10	2.097	0,01 %
Anlageverwaltungsgebühren	9	12.673	0,07 %
Gebühren der Verwaltungsgesellschaft	9	4.370	0,03 %
Nicht bedingte Abzüge für Swap-Gegenpartei	9	(19.664)	(0,11 %)
Insgesamt		3.059	0,02 %

- 9 Diese Beträge werden von der TRS-Gegenpartei an den Fonds während der sechs Monate bis zum 31. Dezember 2022 gezahlt oder sind von der TRS-Gegenpartei zu zahlen.
- 10 Die sonstigen Aufwendungen sind im Verkaufsprospekt beschrieben. Zum Beispiel (aber nicht beschränkt auf) laufende Organisations- und Eintragungsgebühren, Ausgaben für Rechtsberatung und prüfungsrelevante Leistungen sowie Marketingkosten.
- 11 Diese Beträge werden von der TRS-Gegenpartei während der sechs Monate bis zum 31. Dezember 2022 einbehalten und beziehen sich auf Swap-Transaktionskosten und Index-Lizenzierungsgebühren.

**ANHANG 1
VERORDNUNG ÜBER DIE TRANSPARENZ VON
WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (Fortsetzung)**

Die Renditen und Kosten der von den Teilfonds gehaltenen Total Return Swaps sind im Folgenden aufgeführt:

MSCI USA SF INDEX FUND

Art von Wertpapierfinanzierungsgeschäften	Erl.	Insgesamt	Organismus für gemeinsame Anlagen	Verwaltungsgesellschaft	Dritte
Total Return Swaps	1				
Absolute Werte		USD	USD	USD	USD
Rendite	2	213.760.879	213.760.879	null	null
Kosten	3,8	(1.237.328)	(1.237.328)	null	null
Wirtschaftlicher Nutzen	4	214.998.207	214.998.207	null	null
Prozentualer mit der jeweiligen Art erzielter Anteil an der Gesamrendite		% der Gesamrendite	% der Gesamrendite	% der Gesamrendite	% der Gesamrendite
Rendite		100,00 %	100,00 %	null	null
Kosten	5	(0,58 %)	(0,58 %)	null	null
Wirtschaftlicher Nutzen	4	99,42 %	99,42 %	null	null
Prozentualer Anteil am NIW		% des NIW	% des NIW	% des NIW	% des NIW
Rendite	6	24,04 %	24,04 %	null	null
Kosten	7,8	(0,14 %)	(0,14 %)	null	null
Wirtschaftlicher Nutzen	4	23,90 %	23,90 %	null	null

**ANHANG 1
VERORDNUNG ÜBER DIE TRANSPARENZ VON
WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (Fortsetzung)**

MSCI USA SF INDEX FUND (Fortsetzung)

Hinweis

- 1 Mit Ausnahme von Total Return Swaps hat die Gesellschaft im Berichtszeitraum keine Wertpapierfinanzierungsgeschäfte getätigt.
- 2 Dies betrifft die realisierten und nicht realisierten Gewinne und Verluste aus den Fully Funded Swaps und Total Return Swaps (gemeinsam die „TRS“ gemäß der SFTR-Definition) während der sechs Monate zum 31. Dezember 2022, die in der Gesamtergebnisrechnung enthalten sind und vor Abzug der mit ihnen im Zusammenhang stehenden Kosten aufgeführt sind.
- 3 Dies betrifft Abzüge auf die Werte der TRS in den sechs Monaten zum 31. Dezember 2022.
- 4 Berechnet als Differenz zwischen der Rendite und den Kosten.
- 5 Berechnet als absoluter Betrag der Kosten in Prozent des absoluten Betrags der Renditen.
- 6 Berechnet als absoluter Betrag der Rendite in Prozent des durchschnittlichen NIW für den Berichtszeitraum.
- 7 Berechnet als absoluter Betrag der Kosten in Prozent des durchschnittlichen NIW für den Berichtszeitraum.
- 8 Die von der Gegenpartei an den Werten der TRS vorgenommenen Abzüge berücksichtigen alle externen Gebühren, zu deren Zahlung sie verpflichtet ist, sowie alle Transaktionskosten und Gebühren, die normalerweise anfallen. Diese werden für die sechs Monate bis zum 31. Dezember 2022 wie folgt analysiert (alle in Prozent des durchschnittlichen NIW für den Berichtszeitraum):

Bezeichnung	Erl.	USD	% des NIW
Verwaltungsgebühren	9	112.286	0,01 %
Verwahrstellengebühren	9	58.388	0,01 %
Treuhändergebühren	9	13.474	0,00 %
Gebühren für die Sicherheitenverwaltung	9	-	- %
Sonstige Aufwendungen	9,10	44.914	0,01 %
Anlageverwaltungsgebühren	9	166.182	0,02 %
Gebühren der Verwaltungsgesellschaft	9	31.440	0,00 %
Nicht bedingte Abzüge für Swap-Gegenpartei	9	810.644	0,09 %
Insgesamt		1.237.328	0,14 %

- 9 Diese Beträge werden von der TRS-Gegenpartei an den Fonds während der sechs Monate bis zum 31. Dezember 2022 gezahlt oder sind von der TRS-Gegenpartei zu zahlen.
- 10 Die sonstigen Aufwendungen sind im Verkaufsprospekt beschrieben. Zum Beispiel (aber nicht beschränkt auf) laufende Organisations- und Eintragungsgebühren, Ausgaben für Rechtsberatung und prüfungsrelevante Leistungen sowie Marketingkosten.
- 11 Diese Beträge werden von der TRS-Gegenpartei während der sechs Monate bis zum 31. Dezember 2022 einbehalten und beziehen sich auf Swap-Transaktionskosten und Index-Lizenzierungsgebühren.

**ANHANG 1
VERORDNUNG ÜBER DIE TRANSPARENZ VON
WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (Fortsetzung)**

Die Renditen und Kosten der von den Teilfonds gehaltenen Total Return Swaps sind im Folgenden aufgeführt:

CMCI COMMODITY CARRY EX-AGRICULTURE SF UCITS ETF

Art von Wertpapierfinanzierungsgeschäften	Erl.	Insgesamt	Organismus für gemeinsame Anlagen	Verwaltungsgesellschaft	Dritte
Total Return Swaps	1				
Absolute Werte		USD	USD	USD	USD
Rendite	2	5.815.384	5.815.384	null	null
Kosten	3,8	(69.372)	(69.372)	null	null
Wirtschaftlicher Nutzen	4	5.884.756	5.884.756	null	null
Prozentualer mit der jeweiligen Art erzielter Anteil an der Gesamrendite		% der Gesamtrendite	% der Gesamtrendite	% der Gesamtrendite	% der Gesamtrendite
Rendite		100,00 %	100,00 %	null	null
Kosten	5	(1,19 %)	(1,19 %)	null	null
Wirtschaftlicher Nutzen	4	98,81 %	98,81 %	null	null
Prozentualer Anteil am NIW		% des NIW	% des NIW	% des NIW	% des NIW
Rendite	6	11,07 %	11,07 %	null	null
Kosten	7,8	(0,13 %)	(0,13 %)	null	null
Wirtschaftlicher Nutzen	4	10,94 %	10,94 %	null	null

**ANHANG 1
VERORDNUNG ÜBER DIE TRANSPARENZ VON
WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (Fortsetzung)**

CMCI COMMODITY CARRY EX-AGRICULTURE SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Hinweis

- 1 Mit Ausnahme von Total Return Swaps hat die Gesellschaft im Berichtszeitraum keine Wertpapierfinanzierungsgeschäfte getätigt.
- 2 Dies betrifft die realisierten und nicht realisierten Gewinne und Verluste aus den Fully Funded Swaps und Total Return Swaps (gemeinsam die „TRS“ gemäß der SFTR-Definition) während der sechs Monate zum 31. Dezember 2022, die in der Gesamtergebnisrechnung enthalten sind und vor Abzug der mit ihnen im Zusammenhang stehenden Kosten aufgeführt sind.
- 3 Dies betrifft Abzüge auf die Werte der TRS in den sechs Monaten zum 31. Dezember 2022.
- 4 Berechnet als Differenz zwischen der Rendite und den Kosten.
- 5 Berechnet als absoluter Betrag der Kosten in Prozent des absoluten Betrags der Renditen.
- 6 Berechnet als absoluter Betrag der Rendite in Prozent des durchschnittlichen NIW für den Berichtszeitraum.
- 7 Berechnet als absoluter Betrag der Kosten in Prozent des durchschnittlichen NIW für den Berichtszeitraum.
- 8 Die von der Gegenpartei an den Werten der TRS vorgenommenen Abzüge berücksichtigen alle externen Gebühren, zu deren Zahlung sie verpflichtet ist, sowie alle Transaktionskosten und Gebühren, die normalerweise anfallen. Diese werden für die sechs Monate bis zum 31. Dezember 2022 wie folgt analysiert (alle in Prozent des durchschnittlichen NIW für den Berichtszeitraum):

Bezeichnung	Erl.	USD	% des NIW
Verwaltungsgebühren	9	6.617	0,01 %
Verwahrstellengebühren	9	3.441	0,01 %
Treuhändergebühren	9	794	0,00 %
Gebühren für die Sicherheitenverwaltung	9	-	- %
Sonstige Aufwendungen	9,10	6.353	0,01 %
Anlageverwaltungsgebühren	9	46.321	0,09 %
Gebühren der Verwaltungsgesellschaft	9	26.469	0,05 %
Nicht bedingte Abzüge für Swap-Gegenpartei	9	(20.623)	(0,04 %)
Insgesamt		69.372	0,13 %

- 9 Diese Beträge werden von der TRS-Gegenpartei an den Fonds während der sechs Monate bis zum 31. Dezember 2022 gezahlt oder sind von der TRS-Gegenpartei zu zahlen.
- 10 Die sonstigen Aufwendungen sind im Verkaufsprospekt beschrieben. Zum Beispiel (aber nicht beschränkt auf) laufende Organisations- und Eintragungsgebühren, Ausgaben für Rechtsberatung und prüfungsrelevante Leistungen sowie Marketingkosten.
- 11 Diese Beträge werden von der TRS-Gegenpartei während der sechs Monate bis zum 31. Dezember 2022 einbehalten und beziehen sich auf Swap-Transaktionskosten und Index-Lizenzierungsgebühren.