

LGT (CH) Premium Strategy GIM

Anlagefonds schweizerischen Rechts der Art «Übrige Fonds für alternative Anlagen» mit besonderem Risiko

Jahresbericht per 31. Dezember 2023

LGT (CH) Premium Strategy GIM ist ein vertraglicher Anlagefonds der Art «Übrige Fonds für alternative Anlagen» mit besonderem Risiko. Der Anlagefonds investiert in eine Vielzahl von Anlageklassen, einschliesslich und in erheblichem Umfang in alternative Anlagen mit erhöhtem Anlagerisiko wie Hedge Funds und Private Equity. Die Anlagen werden in erheblichem Umfang indirekt, über andere kollektive Kapitalanlagen, Genussscheine, Zertifikate und strukturierte Produkte getätigt. Die Risiken des Anlagefonds sind nicht mit denen von Effektenfonds vergleichbar. Die Anleger werden daher ausdrücklich auf die im Prospekt bzw. Fondsvertrag erläuterten Risiken und auf die geringere Liquidität und erschwerte Bewertbarkeit der meistens nicht kotierten und nicht gehandelten Anlagen des Anlagefonds aufmerksam gemacht. Die Anleger müssen insbesondere bereit und in der Lage sein, Kapitalverluste einschliesslich eines Totalverlusts hinzunehmen. Deshalb sollten die Anteile am LGT (CH) Premium Strategy GIM beim Anleger nur einen geringen Teil seines Portefeuilles ausmachen, und die Anteile sollten innerhalb eines diversifizierten Portefeuilles gehalten werden.

Inhaltsverzeichnis

Verwaltung und Organe	3
LGT (CH) Premium Strategy GIM	4
Erläuterungen zum Jahresbericht	14
Bericht der Prüfgesellschaft	17

Verwaltung und Organe

Fondsleitung

Credit Suisse Funds AG, Zürich

Verwaltungsrat

- Andreas Binder, Präsident (ab 1. März 2023, Mitglied ab 2. November 2022 bis 28. Februar 2023)
- Luca Diener, Vizepräsident
- Patrick Tschumper, Mitglied (ab 1. März 2023, Präsident bis 28. Februar 2023)
- Jürg Roth, Mitglied
Managing Director, Credit Suisse (Schweiz) AG
- Thomas Vonaesch, Mitglied
- Hans Peter Bär, Mitglied (ab 1. April 2023)

Geschäftsleitung

- Thomas Schärer, CEO
- Markus Hafner, Mitglied, COO (ab 2. Oktober 2023)
- Hans Christoph Nickl, Mitglied, COO (bis 1. Oktober 2023)
- David Dubach, Mitglied, Oversight & ManCo Services
- Emil Stark, Mitglied, stellvertretender CEO und Leiter Fund Solutions AM
- Gilbert Eyb, Mitglied, Legal
- Ralph Warth, Mitglied, Fund Solutions PLF
- Christian Bieri, Mitglied, Real Estate Fund Management
- Naftali Halonbrenner, Mitglied, Fund Services
- Gabriele Wyss, Mitglied, Compliance
- Marcus Eberlein, Mitglied, Performance & Risk Management

Depotbank

Credit Suisse (Schweiz) AG, Zürich

Prüfgesellschaft

PricewaterhouseCoopers AG, Zürich

Informationen über Dritte

Übertragung der Anlageentscheide

Die Anlageentscheide des Anlagefonds sind an LGT Capital Partners AG, Pfäffikon SZ, übertragen, mit Weiterübertragung der Anlageentscheide an LGT Capital Partners (Asia-Pacific) Ltd. Hong Kong und die LGT Capital Partners (USA) Inc. New York, die als Vermögensverwalter bzw. als Untervermögensverwalter für den Anlagefonds agieren.

Übertragung weiterer Teilaufgaben

Die Fondsleitung hat verschiedene Teilaufgaben der Fondsadministration an nachfolgende Gruppengesellschaften der UBS Group AG übertragen:

- Credit Suisse AG, Schweiz: Teilaufgaben in den Bereichen Rechts- und Complianceberatung, Facility Management und Management Information System MIS.
- Credit Suisse (Schweiz) AG, Schweiz: Teilaufgaben in den Bereichen Complianceberatung, Personalwesen Collateral Management, IT Dienstleistungen und First Line of Defense Support (FLDS).
- Credit Suisse Asset Management (Schweiz) AG, Schweiz: Real Estate Administration (u.a. Fonds- und Liegenschaftsbuchhaltung, Liegenschaftenverwaltung).
- Credit Suisse Services AG, Schweiz: Teilaufgaben in den Bereichen Complianceberatung, Finanzwesen der Fondsleitung und Steuerberatung.
- Credit Suisse Fund Services (Luxembourg) S.A., Luxembourg: Teilaufgaben im Bereich der Fondsbuchhaltung sowie Unterstützung bei der Überwachung der Anlagevorschriften.
- Credit Suisse (Poland) Sp.z.o.o., Polen: Teilaufgaben in den Bereichen Fondsbuchhaltung, Information Management (u.a. Produkt-Masterdaten, Preis-Publikationen, Factsheet-Produktion, Basisinformationsblatt-Produktion und Erstellen von Reportings), Legal Reporting (Erstellung des Jahresberichts) sowie weitere Supportaufgaben.

Die genaue Ausführung des Auftrages regelt ein zwischen der Fondsleitung und den genannten Gruppengesellschaften abgeschlossener Vertrag. Es besteht die Möglichkeit, den genannten Gruppengesellschaften weitere Teilaufgaben zu übertragen.

Kurze Übersicht

Kennzahlen	Währung	31.12.2023	31.12.2022	31.12.2021
Konsolidierung				
Nettobondsvermögen in Mio.	USD	846.27	639.14	719.86
Anteilklasse (CHF) B				
Nettobondsvermögen in Mio.	USD	496.76	339.03	294.66
Inventarwert pro Anteil	CHF	1'184.96	1'150.12	1'271.78
Anteilklasse (EUR) B				
Nettobondsvermögen in Mio.	USD	290.64	251.71	218.24
Inventarwert pro Anteil	EUR	1'254.93	1'184.94	1'290.06
Anteilklasse (USD) B				
Nettobondsvermögen in Mio.	USD	52.63	42.80	48.73
Inventarwert pro Anteil	USD	1'391.43	1'281.82	1'392.62
Anteilklasse (CHF) IM				
Nettobondsvermögen in Mio.	USD	6.24	5.59	158.24
Inventarwert pro Anteil	CHF	1'351.83	1'287.54	1'396.42

Verwendung des Erfolges

Thesaurierung pro Anteil

1. Für in der Schweiz domizillierte Anteilinhaber Für im Ausland domizillierte Anteilinhaber, ohne Bankenerklärung

Thesaurierung 2023		Anteilklasse (CHF) B	Anteilklasse (EUR) B	Anteilklasse (USD) B
Zur Thesaurierung verfügbarer Erfolg	CHF	20.423	EUR 21.984	USD 24.568
./.. 35% Eidgenössische Verrechnungssteuer	CHF	7.148	EUR 7.695	USD 8.599
Zur Thesaurierung zurückbehaltener Erfolg	CHF	13.275	EUR 14.290	USD 15.969

2. Für im Ausland domizillierte Anteilinhaber, mit Bankenerklärung

Thesaurierung 2023		Anteilklasse (CHF) B	Anteilklasse (EUR) B	Anteilklasse (USD) B
Zur Thesaurierung verfügbarer Erfolg	CHF	20.423	EUR 21.984	USD 24.568
./.. 35% Eidgenössische Verrechnungssteuer 1)	CHF	7.148	EUR 7.695	USD 8.599
Zur Thesaurierung zurückbehaltener Erfolg	CHF	13.275	EUR 14.290	USD 15.969

Coupon Nr. Ertrag **7** **7** **7**

1) Anleger mit ausländischem Domizil erhalten die Eidgenössische Verrechnungssteuer durch ihre Depotbank gutgeschrieben.

1. Für in der Schweiz domizillierte Anteilinhaber Für im Ausland domizillierte Anteilinhaber, ohne Bankenerklärung

Thesaurierung 2023		Anteilklasse (CHF) IM
Zur Thesaurierung verfügbarer Erfolg	CHF	23.327
./.. 35% Eidgenössische Verrechnungssteuer	CHF	8.165
Zur Thesaurierung zurückbehaltener Erfolg	CHF	15.163

2. Für im Ausland domizillierte Anteilinhaber, mit Bankenerklärung

Thesaurierung 2023		Anteilklasse (CHF) IM
Zur Thesaurierung verfügbarer Erfolg	CHF	23.327
./.. 35% Eidgenössische Verrechnungssteuer 1)	CHF	8.165
Zur Thesaurierung zurückbehaltener Erfolg	CHF	15.163

Coupon Nr. Ertrag **7**

1) Anleger mit ausländischem Domizil erhalten die Eidgenössische Verrechnungssteuer durch ihre Depotbank gutgeschrieben.

Wechselkurse

Wechselkurse per	31.12.2023
CHINESISCHER RENMINBI YUAN	0.140437
ENGLISCHES PFUND	1.274768
EURO	1.104650
JAPANISCHER YEN	0.007093
NEUER TAIWAN DOLLAR	0.032583
SCHWEIZER FRANKEN	1.188179
SUEDKOREANISCHER WON	0.000776
US DOLLAR	1.000000

Vermögensrechnung per 31. Dezember 2023

	Konsolidierung	
	31.12.2023	31.12.2022
	USD	USD
Vermögenswerte		
Bankguthaben, einschliesslich Treuhandanlagen bei Drittbanken, aufgeteilt in:		
- Sichtguthaben	24'112'512.60	26'043'464.84
Effekten, einschliesslich ausgeliehene und pensionierte Effekten, aufgeteilt in:		
- Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	821'765'685.15	617'949'069.78
Derivative Finanzinstrumente	12'368'205.48	9'294'749.77
Sonstige Vermögenswerte	620'077.43	754'114.23
Gesamtfondsvermögen abzüglich:	858'866'480.66	654'041'398.62
Andere Verbindlichkeiten	12'596'491.66	14'902'769.00
Nettofondsvermögen	846'269'989.00	639'138'629.62
Veränderung des Nettofondsvermögens		
Nettofondsvermögen zu Beginn der Berichtsperiode	639'138'629.62	719'863'439.09
Ablieferung Verrechnungssteuer	-2'508'205.02	-2'029'251.67
Ausgaben von Anteilen	168'624'959.82	156'526'792.03
Rücknahmen von Anteilen	-45'209'532.87	-161'078'932.56
Sonstiges aus Anteilverkehr	-4'584'067.19	9'121'932.44
Gesamterfolg	90'808'204.64	-83'265'349.71
Nettofondsvermögen am Ende der Berichtsperiode	846'269'989.00	639'138'629.62
Entwicklung der Anteile im Umlauf		
Bestand zu Beginn der Berichtsperiode	509'188.152	498'100.304
Ausgegebene Anteile	129'716.838	121'842.154
Zurückgenommene Anteile	-34'712.275	-110'754.306
Bestand am Ende der Berichtsperiode	604'192.715	509'188.152
Währung Anteilklasse		
Inventarwert pro Anteil		

Anteilklasse (CHF) B		Anteilklasse (EUR) B		Anteilklasse (USD) B		Anteilklasse (CHF) IM	
01.01.2023 - 31.12.2023	01.01.2022 - 31.12.2022	01.01.2023 - 31.12.2023	01.01.2022 - 31.12.2022	01.01.2023 - 31.12.2023	01.01.2022 - 31.12.2022	01.01.2023 - 31.12.2023	01.01.2022 - 31.12.2022
USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
339'033'590.45	294'661'302.04	251'708'514.79	218'235'096.91	42'802'490.24	48'727'113.81	5'594'034.17	158'239'926.34
-1'934'678.02	-842'707.05	-974'541.21	-619'492.78	-177'166.62	-136'548.83	-21'819.17	-430'503.01
120'095'459.58	82'873'042.02	39'068'979.90	67'505'734.77	8'198'993.82	5'094'000.00	1'261'526.52	1'054'015.24
-16'176'301.11	-4'719'090.11	-25'259'796.24	-1'744'439.67	-2'325'735.52	-6'892'402.78	-1'447'700.00	-147'723'000.00
-4'519'059.22	7'167'277.68	54'686.38	7'448'964.24	-120'510.57	-497'665.63	816.23	-4'996'643.83
59'662'048.12	-40'106'234.13	26'041'373.63	-39'117'348.68	4'255'862.56	-3'492'006.33	848'920.33	-549'760.57
496'761'059.80	339'033'590.45	290'639'217.25	251'708'514.79	52'633'933.91	42'802'490.24	6'235'778.08	5'594'034.17
272'738.215	211'103.961	199'038.064	148'757.260	33'391.981	34'989.557	4'019.892	103'249.526
92'856.164	65'560.893	29'810.986	51'713.071	6'187.319	3'797.824	862.369	770.366
-12'769.009	-3'926.639	-19'191.220	-1'432.267	-1'752.046	-5'395.400	-1'000.000	-100'000.000
352'825.370	272'738.215	209'657.830	199'038.064	37'827.254	33'391.981	3'882.261	4'019.892
(CHF)	(CHF)	(EUR)	(EUR)	(USD)	(USD)	(CHF)	(CHF)
1'184.96	1'150.12	1'254.93	1'184.94	1'391.43	1'281.82	1'351.83	1'287.54

Erfolgsrechnung für die Zeit vom 1. Januar 2023 bis zum 31. Dezember 2023

	Konsolidierung	
	01.01.2023 - 31.12.2023	01.01.2022 - 31.12.2022
	USD	USD
Ertrag		
Erträge der Bankguthaben	658'189.22	292'847.17
Negativzinsen	0.00	-25'600.41
Erträge der Effekten, aufgeteilt in:		
- Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	14'690'267.17	7'059'541.52
Erträge der Rückvergütungen	-21'836.98	38'588.12
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen	-930'448.35	-928'970.11
Total Erträge	14'396'171.06	6'436'406.29
Aufwendungen		
Passivzinsen	9'236.11	78'640.38
Prüfaufwand	25'853.88	24'238.90
Reglementarische Vergütung an:		
- die Fondsleitung	14'474'570.09	11'477'658.64
Teilübertrag von Aufwendungen auf realisierte Kapitalverluste	-3'705'484.76	-2'921'500.66
Sonstige Aufwendungen	174'859.36	37'343.72
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei Rücknahme von Anteilen	-183'165.34	-150'044.51
Total Aufwendungen	10'795'869.34	8'546'336.47
Nettoertrag vor steuerlichen Anpassungen	3'600'301.72	-2'109'930.18
Steuerliche Anpassungen wegen Erträgen aus Zielfonds	11'089'965.45	9'115'717.95
Nettoertrag nach steuerlichen Anpassungen	14'690'267.17	7'005'787.77
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste	20'178'064.29	-9'123'970.97
Teilübertrag von Aufwendungen auf realisierte Kapitalverluste	-3'705'484.76	-2'921'500.66
Teilübertrag von steuerlichem Ausgleich wegen Erträgen aus Zielfonds	-11'089'965.45	-9'115'717.95
Realisierter Erfolg	20'072'881.25	-14'155'401.81
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste	70'735'323.39	-69'109'947.90
Gesamterfolg	90'808'204.64	-83'265'349.71
Verwendung des Erfolgs		
Nettoertrag des Rechnungsjahres	14'690'267.17	7'005'787.77
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	14'690'267.17	7'005'787.77
Ablieferung/Ausschüttung der Verrechnungssteuer (35%)	5'141'593.21	2'452'025.46
Zur Wiederanlage zurückbehaltener Ertrag (65%)	9'548'673.96	4'553'762.31

Anteilklasse (CHF) B		Anteilklasse (EUR) B		Anteilklasse (USD) B		Anteilklasse (CHF) IM	
01.01.2023 - 31.12.2023	01.01.2022 - 31.12.2022	01.01.2023 - 31.12.2023	01.01.2022 - 31.12.2022	01.01.2023 - 31.12.2023	01.01.2022 - 31.12.2022	01.01.2023 - 31.12.2023	01.01.2022 - 31.12.2022
USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
370'041.19	154'231.53	239'947.93	114'695.19	42'738.90	21'766.64	5'461.20	2'153.81
0.00	-11'739.94	0.00	-8'635.73	0.00	-1'825.37	0.00	-3'399.37
8'561'759.47	3'749'003.48	5'091'554.97	2'764'982.45	929'347.40	483'792.57	107'605.33	61'763.02
-11'555.63	20'134.03	-8'515.30	14'823.39	-1'581.65	2'727.78	-184.40	902.92
-697'545.54	-510'747.31	-196'828.67	-406'986.04	-36'575.75	-12'557.60	501.61	1'320.84
8'222'699.49	3'400'881.79	5'126'158.93	2'478'879.26	933'928.90	493'904.02	113'383.74	62'741.22
4'905.65	41'329.26	3'649.26	30'152.11	601.60	6'467.68	79.60	691.33
14'437.62	11'887.74	9'511.45	8'773.87	1'689.70	1'776.99	215.11	1'800.30
8'136'806.08	6'064'226.58	5'379'357.33	4'461'425.10	953'019.06	915'692.15	5'387.62	36'314.81
-2'074'145.65	-1'546'927.64	-1'386'538.32	-1'142'560.38	-244'800.79	-232'012.64	0.00	0.00
95'463.78	19'579.42	66'095.49	14'381.95	11'829.88	2'769.99	1'470.21	612.36
-12'265.50	-42'903.18	-156'379.40	-16'314.77	-14'495.77	-55'695.76	-24.67	-35'130.80
6'165'201.98	4'547'192.18	3'915'695.81	3'355'857.88	707'843.68	638'998.41	7'127.87	4'288.00
2'057'497.51	-1'146'310.39	1'210'463.12	-876'978.62	226'085.22	-145'094.39	106'255.87	58'453.22
6'504'261.96	4'866'992.37	3'881'091.85	3'620'997.76	703'262.18	624'861.03	1'349.46	2'866.79
8'561'759.47	3'720'681.98	5'091'554.97	2'744'019.14	929'347.40	479'766.64	107'605.33	61'320.01
14'401'920.47	511'678.64	5'863'477.72	-10'955'036.57	-210'958.32	1'898'908.00	123'624.42	-579'521.04
-2'074'145.65	-1'546'927.64	-1'386'538.32	-1'142'560.38	-244'800.79	-232'012.64	0.00	0.00
-6'504'261.96	-4'866'992.37	-3'881'091.85	-3'620'997.76	-703'262.18	-624'861.03	-1'349.46	-2'866.79
14'385'272.33	-2'181'559.39	5'687'402.52	-12'974'575.57	-229'673.89	1'521'800.97	229'880.29	-521'067.82
45'276'775.79	-37'924'674.74	20'353'971.11	-26'142'773.11	4'485'536.45	-5'013'807.30	619'040.04	-28'692.75
59'662'048.12	-40'106'234.13	26'041'373.63	-39'117'348.68	4'255'862.56	-3'492'006.33	848'920.33	-549'760.57
8'561'759.47	3'720'681.98	5'091'554.97	2'744'019.14	929'347.40	479'766.64	107'605.33	61'320.01
8'561'759.47	3'720'681.98	5'091'554.97	2'744'019.14	929'347.40	479'766.64	107'605.33	61'320.01
2'996'615.67	1'302'238.57	1'782'044.09	960'406.57	325'271.59	167'918.32	37'661.86	21'462.00
5'565'143.80	2'418'443.41	3'309'510.88	1'783'612.57	604'075.81	311'848.32	69'943.47	39'858.01

Zusammensetzung des Portefolles und Bestandesveränderungen

Titelbezeichnung	Währung	31.12.2022 Anzahl/ Nominal	Käufe (1)	Verkäufe (1)	31.12.2023 Anzahl/ Nominal	Kurswert USD	in % des Gesamtfonds- vermögens
Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere; bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden							
Kollektive Kapitalanlagen							
Irland							
ISHARES JP MORGAN ESG USD EM B -USD ACC- USD	USD	1'173'131	109'103		1'282'234	6'770'195.52	0.79
ISHARES LISTED PRIVATE EQUITY -USD DIST- CHF	CHF	267'939		267'939			
ISHARES LISTED PRIVATE EQUITY -USD DIST- USD	USD		314'010	314'010			
						6'770'195.52	0.79
Total Kollektive Kapitalanlagen						6'770'195.52	0.79
Total Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere; bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden							
Wertpapiere bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern						6'770'195.52	0.79
Kollektive Kapitalanlagen							
Irland							
CROWN A GENERIX PLC - LGT AI NEWS-BASED TRADING SUB-FUND -A USD- USD	USD	2'661	384	3'045			
CROWN A GENERIX PLC - LGT ALPHA GENERIX LONG VOLATILITY SUB-FUND	USD	16'591	5'840	1'047	21'384	24'593'709.46	2.86
CROWN A GENERIX PLC - LGT RISK PREMIA SUB-FUND -A USD- USD	USD	10'231	3'039	1'226	12'044	17'628'063.53	2.05
CROWN ALTERNATIVE UCITS PLC - LGT SELECT BOND EMMA LOCAL BLEND A USD	USD	11'001	1'635	738	11'898	15'421'968.27	1.80
CROWN SIGMA UCITS PLC - LGT CROWN LIQUID PRIVATE EQUITY OPPORTUNITIES SUB-FUND -O- USD	USD	45'884	7'419		53'303	8'340'905.55	0.97
CROWN SIGMA UCITS PLC - LGT EM FRONTIER LC BOND SUB-FUND -A USD ACC- USD	USD		7'421		7'421	7'967'590.06	0.93
CROWN SIGMA UCITS PLC - LGT SUSTAINABLE QUALITY EQUITY HEDGED SUB-FUND -B- USD	USD	13'936	2'425	261	16'100	31'191'723.07	3.63
GMO EMERGING COUNTRY DEBT INVESTMENT FUND PLC	USD	68'875	16'345		85'220	8'166'634.90	0.95
LGT MULTI-ALTERNATIVES PLATFORM ICAV - LMA PRIVATE CREDIT POOLING SUB-FUND -A- USD	USD		37'917	3'066	34'851	36'688'568.95	4.27
LGT MULTI-ALTERNATIVES PLATFORM ICAV - LMA PRIVATE DEBT POOLING SUB-FUND -A- USD	USD		11'185	491	10'694	11'919'447.69	1.39
LGT MULTI-ALTERNATIVES PLATFORM ICAV - LMA PRIVATE INFRASTRUCTURE POOLING SUB-FUND -A- USD	USD	6'354	4'363		10'717	12'475'581.40	1.45
LGT MULTI-ALTERNATIVES PLATFORM ICAV-LMA PRIVATE REAL ESTATE POOLING SUB-FUND -A- USD	USD		31'801		31'801	32'428'220.75	3.78
LGT MULTI-ALTERNATIVES PLATFORM ICAV - LMA PRIVATE EQUITY POOLING SUB-FUND -A- USD	USD		175'467	2'975	172'492	184'269'636.25	21.45
						391'092'049.88	45.54
Kaimaninseln							
LGT CAPITAL INVEST (SC2) LTD - EX PRIVATE REAL ESTATE B (USD)	USD	8'752	872	9'624			
LGT CAPITAL INVEST (SC2) LTD - LGT CF EX PRIVATE EQUITY ZERO B (USD)	USD	38'133	2'091	40'224			
LGT CAPITAL INVEST (SC2) LTD - LGT CLASS FUND EXPRIVATE DEBT B (USD)	USD	18'214	7'286	25'500			
LGT CAPITAL INVEST (SC2) LTD - EX PRIVATE DEBT II SEGREGATED PORTFOLIO USD PARTICIPATING SHARES	USD	6'667		6'667			
						0.00	0.00
Liechtenstein							
LGT MULTI-ASSETS II - MA SUSTAINABLE GLOBAL EQUITY FUND -IM USD INC- USD	USD	15'351	2'618		17'969	25'472'672.22	2.97
LGT MULTI-ASSETS II - MAS MONEY MARKET FUND -IM- USD	USD	2'000	51'370	52'300	1'070	1'196'645.20	0.14
LGT PORTFOLIO INVEST SICAV - EQUITY DEFENSIVE	USD	4'453	746		5'199	17'778'536.16	2.07
LGT PORTFOLIO INVEST SICAV - ILS LIFE	USD	2'946	307	229	3'024	3'431'929.11	0.40
LGT PORTFOLIO INVEST SICAV - ILS NATCAT	USD	8'461	2'692		11'153	22'935'507.85	2.67
LGT PORTFOLIO INVEST SICAV - ILS NATCAT DIRECT	USD	14'036	4'767	1'049	17'754	19'778'876.10	2.30
LGT PORTFOLIO INVEST SICAV - LIQUID ALTERNATIVE RISK PREMIA	USD	20'461	9'796	547	29'710	47'578'014.32	5.54
LGT PORTFOLIO INVEST SICAV - OVERLAY OPPORTUNITIES	USD	26'755	11'180	3'503	34'432	8'713'328.77	1.01
LGT SELECT FUNDS - LGT SELECT BOND EMERGING MARKETS USD IM	USD	9'990	1'915	822	11'083	20'426'639.60	2.38
LGT SELECT FUNDS - LGT SELECT BOND HIGH YIELD USD IM	USD	6'995	6'707	997	12'705	33'989'340.33	3.96
LGT SELECT FUNDS - LGT SELECT EQUITY EMERGING MARKETS USD IM	USD	10'923	2'234	2'258	10'899	20'952'315.83	2.44
LGT SELECT FUNDS - LGT SELECT EQUITY ENHANCED MINIMUM VARIANCE USD IM	USD	6'923	2'354	836	8'441	27'085'327.30	3.15
LGT SELECT FUNDS - LGT SELECT EQUITY GLOBAL -IM USD ACC- USD	USD	39'058	6'346		45'404	72'381'458.74	8.43
LGT SELECT FUNDS - LGT SELECT REITS USD IM	USD	8'574	1'913	10'487			
LGT SELECT FUNDS II - LGT SELECT FIXED INCOME GLOBAL GOVERNMENT USD IM	USD	15'034	3'784		18'818	24'844'913.47	2.89
LGT PORTFOLIO INVEST SICAV - LIQUID ALTERNATIVE SELECT	USD	33'798	7'490	490	40'798	74'790'934.75	8.71
						421'356'439.75	49.06
Schweiz							
FUND PREPAYMENT USD	USD	2'174'000	373'000		2'547'000	2'547'000.00	0.30
						2'547'000.00	0.30
Total Kollektive Kapitalanlagen						814'995'489.63	94.89
Total Wertpapiere bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern						814'995'489.63	94.89

Titelbezeichnung	Währung	31.12.2022 Anzahl/ Nominal	Käufe (1)	Verkäufe (1)	31.12.2023 Anzahl/ Nominal	Kurswert USD	in % des Gesamtfonds- vermögens
Derivative Finanzinstrumente							
Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere; bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden							
Financial Futures							
Deutschland							
EURO BUND Commodities -100000- 03/24	EUR		15		15	0.00	0.00
EURO STOXX 50 Index -10- 03/23	EUR	-125	160	35			
EURO STOXX 50 Index -10- 09/23	EUR		153	153			
EURO STOXX 50 Index -10- 12/23	EUR		195	195			
EURO STOXX 50 Index -10- 03/24	EUR			168	-168	0.00	0.00
EURO STOXX 50 Index -10- 06/23	EUR		168	168			
						0.00	0.00
Japan							
TOPIX SEC 1 Index -10000- 03/23	JPY	16		16			
TOPIX SEC 1 Index -10000- 06/23	JPY		16	16			
TOPIX SEC 1 Index -10000- 09/23	JPY		27	27			
TOPIX SEC 1 Index -10000- 12/23	JPY		27	27			
TOPIX SEC 1 Index -10000- 03/24	JPY		17		17	0.00	0.00
MINI 10-YEAR JAPANESE GOVERNMENT BOND Commodities -10000000- 03/24	JPY		21		21	0.00	0.00
						0.00	0.00
USA							
MSCI INC. Index -100- 03/23	USD	48	59	107			
MSCI INC. Index -100- 06/23	USD		122	122			
MSCI INC. Index -100- 09/23	USD		143	143			
MSCI INC. Index -100- 12/23	USD		131	131			
S&P E-MINI 500 Index -50- 03/23	USD	144		144			
S&P E-MINI 500 Index -50- 06/23	USD		121	121			
S&P E-MINI 500 Index -50- 09/23	USD		193	193			
S&P E-MINI 500 Index -50- 12/23	USD		254	254			
US TREASURY NOTES 10 YEARS -100000- 03/24	USD		37		37	0.00	0.00
S&P E-MINI 500 Index -50- 03/24	USD		154	16	138	0.00	0.00
						0.00	0.00
Total Financial Futures						0.00	0.00
Total Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere; bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden						0.00	0.00
Wertpapiere bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern							
Devisentermingeschäfte							
Devisentermingeschäfte (siehe Liste)						12'368'205.48	1.44
Total Devisentermingeschäfte						12'368'205.48	1.44
Total Wertpapiere bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern						12'368'205.48	1.44
Total Derivative Finanzinstrumente						12'368'205.48	1.44
Total Anlagen						834'133'890.63	97.12
Bankguthaben auf Sicht						24'112'512.60	2.81
Bankguthaben auf Zeit						0.00	0.00
Sonstige Vermögenswerte						620'077.43	0.07
Gesamtfondsvermögen (GFV)						858'866'480.66	100.00
./. Bankverbindlichkeiten						0.00	0.00
./. Andere Verbindlichkeiten						12'596'491.66	1.47
./. Andere Kredite						0.00	0.00
Nettofondsvermögen						846'269'989.00	98.53

(1) Umfassen auch Corporate Actions

Summarische Gliederung des Portefeuilles gemäss KKV FINMA Art. 84 Absatz 2

Anlagekategorien	Kurswert USD	in % des Gesamtfonds- vermögens
Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere; bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden	6'770'195.52	0.79
Wertpapiere bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern	827'363'695.11	96.33
Wertpapiere bewertet aufgrund geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten	0.00	0.00

Aufstellung der Devisentermingeschäfte für die Zeit vom 1. Januar 2023 bis zum 31. Dezember 2023

Fälligkeit	Transaktion	Währung	Betrag	Gegen	Gegenwert	Devisengewinn/-verlust Mandatswährung	in % des GFV
02.02.2023	Bought	USD	6'389'894	CNH	45'066'000	0.00	0.00
02.02.2023	Bought	USD	9'718'099	CNH	65'896'000	0.00	0.00
08.05.2023	Bought	JPY	1'920'476'000	USD	14'100'411	0.00	0.00
05.07.2023	Bought	CHF	295'570'000	USD	324'727'618	0.00	0.00
05.07.2023	Bought	CHF	4'723'400	USD	5'189'358	0.00	0.00
05.07.2023	Bought	EUR	208'764'000	USD	222'954'733	0.00	0.00
05.07.2023	Bought	USD	7'136'493	CHF	6'496'000	0.00	0.00
05.07.2023	Bought	USD	2'000'379	CHF	1'786'000	0.00	0.00
05.07.2023	Bought	USD	31'921	CHF	28'500	0.00	0.00
05.07.2023	Bought	USD	23'256'063	CNH	165'230'000	0.00	0.00
05.07.2023	Bought	USD	67'260'052	EUR	62'982'000	0.00	0.00
05.07.2023	Bought	USD	1'378'405	EUR	1'261'000	0.00	0.00
05.07.2023	Bought	USD	25'050'604	GBP	20'205'000	0.00	0.00
05.07.2023	Bought	USD	15'085'413	JPY	2'097'479'000	0.00	0.00
05.07.2023	Bought	USD	5'363'274	KRW	7'164'100'000	0.00	0.00
05.07.2023	Bought	USD	7'156'354	TWD	219'100'000	0.00	0.00
03.08.2023	Bought	CHF	310'057'000	USD	347'679'776	0.00	0.00
03.08.2023	Bought	CHF	4'861'300	USD	5'451'177	0.00	0.00
03.08.2023	Bought	CHF	1'138'000	USD	1'316'307	0.00	0.00
03.08.2023	Bought	CHF	17'800	USD	20'589	0.00	0.00
03.08.2023	Bought	EUR	199'742'000	USD	218'325'996	0.00	0.00
03.08.2023	Bought	EUR	1'466'000	USD	1'630'450	0.00	0.00
03.08.2023	Bought	USD	7'474'510	CHF	6'666'000	0.00	0.00
03.08.2023	Bought	USD	24'108'965	CNH	175'099'000	0.00	0.00
03.08.2023	Bought	USD	68'230'994	EUR	62'426'000	0.00	0.00
03.08.2023	Bought	USD	27'949'772	GBP	21'985'000	0.00	0.00
03.08.2023	Bought	USD	15'769'758	JPY	2'270'251'000	0.00	0.00
05.09.2023	Bought	CHF	319'728'000	USD	370'111'244	0.00	0.00
05.09.2023	Bought	CHF	4'991'500	USD	5'778'068	0.00	0.00
05.09.2023	Bought	EUR	207'254'000	USD	228'833'908	0.00	0.00
05.09.2023	Bought	EUR	943'000	USD	1'023'028	0.00	0.00
05.09.2023	Bought	GBP	943'000	USD	1'196'364	0.00	0.00
05.09.2023	Bought	USD	7'894'341	CHF	6'820'000	0.00	0.00
05.09.2023	Bought	USD	3'116'499	CHF	2'738'000	0.00	0.00
05.09.2023	Bought	USD	48'603	CHF	42'700	0.00	0.00
05.09.2023	Bought	USD	25'567'592	CNH	182'149'000	0.00	0.00
05.09.2023	Bought	USD	71'731'623	EUR	64'970'000	0.00	0.00
05.09.2023	Bought	USD	1'375'545	EUR	1'268'000	0.00	0.00
05.09.2023	Bought	USD	29'414'822	GBP	22'866'000	0.00	0.00
05.09.2023	Bought	USD	16'642'425	JPY	2'352'328'000	0.00	0.00
03.10.2023	Bought	CHF	324'244'000	USD	368'438'157	0.00	0.00
03.10.2023	Bought	CHF	5'008'900	USD	5'691'608	0.00	0.00
03.10.2023	Bought	CHF	3'966'000	USD	4'447'589	0.00	0.00
03.10.2023	Bought	CHF	61'300	USD	68'744	0.00	0.00
03.10.2023	Bought	EUR	208'753'000	USD	226'881'111	0.00	0.00
03.10.2023	Bought	EUR	2'554'000	USD	2'743'520	0.00	0.00
03.10.2023	Bought	USD	7'842'380	CHF	6'902'000	0.00	0.00
03.10.2023	Bought	USD	69'633'896	EUR	64'073'000	0.00	0.00
03.10.2023	Bought	USD	27'393'643	GBP	21'609'000	0.00	0.00
03.10.2023	Bought	USD	16'676'699	JPY	2'417'902'000	0.00	0.00
12.10.2023	Bought	CNH	175'670'000	USD	24'123'867	0.00	0.00
12.10.2023	Bought	CNH	10'396'000	USD	1'427'986	0.00	0.00
12.10.2023	Bought	USD	25'587'731	CNH	186'066'000	0.00	0.00
02.11.2023	Bought	CHF	326'847'000	USD	358'572'018	0.00	0.00
02.11.2023	Bought	CHF	3'975'100	USD	4'360'938	0.00	0.00
02.11.2023	Bought	EUR	206'991'000	USD	219'468'210	0.00	0.00
02.11.2023	Bought	USD	7'572'683	CHF	6'903'000	0.00	0.00
02.11.2023	Bought	USD	4'003'040	CHF	3'576'000	0.00	0.00
02.11.2023	Bought	USD	48'695	CHF	43'500	0.00	0.00
02.11.2023	Bought	USD	22'752'253	CNH	165'622'000	0.00	0.00
02.11.2023	Bought	USD	63'571'451	EUR	59'960'000	0.00	0.00
02.11.2023	Bought	USD	1'604'852	EUR	1'510'000	0.00	0.00
02.11.2023	Bought	USD	26'458'030	GBP	21'670'000	0.00	0.00
02.11.2023	Bought	USD	14'247'420	JPY	2'115'406'000	0.00	0.00
03.11.2023	Bought	KRW	1'630'340'000	USD	1'232'594	0.00	0.00
03.11.2023	Bought	TWD	38'780'000	USD	1'222'187	0.00	0.00
03.11.2023	Bought	TWD	48'200'000	USD	1'514'871	0.00	0.00
03.11.2023	Bought	USD	5'599'380	KRW	7'333'900'000	0.00	0.00
03.11.2023	Bought	USD	331'135	KRW	436'800'000	0.00	0.00

Aufstellung der Devisentermingeschäfte für die Zeit vom 1. Januar 2023 bis zum 31. Dezember 2023

Fälligkeit	Transaktion	Währung	Betrag	Gegen	Gegenwert	Devisengewinn/-verlust Mandatswährung	in % des GFV
03.11.2023	Bought	USD	9'297'905	TWD	288'130'000	0.00	0.00
04.12.2023	Bought	CHF	328'291'000	USD	362'164'619	0.00	0.00
04.12.2023	Bought	CHF	4'107'900	USD	4'531'760	0.00	0.00
04.12.2023	Bought	CHF	20'000	USD	22'555	0.00	0.00
04.12.2023	Bought	CHF	2'794'000	USD	3'112'020	0.00	0.00
04.12.2023	Bought	CHF	35'000	USD	38'984	0.00	0.00
04.12.2023	Bought	CHF	1'597'000	USD	1'800'979	0.00	0.00
04.12.2023	Bought	EUR	206'634'000	USD	218'624'764	0.00	0.00
04.12.2023	Bought	EUR	1'005'000	USD	1'091'596	0.00	0.00
04.12.2023	Bought	EUR	1'633'000	USD	1'745'620	0.00	0.00
04.12.2023	Bought	USD	5'704'288	CHF	5'171'000	0.00	0.00
04.12.2023	Bought	USD	22'944'388	CNH	168'161'000	0.00	0.00
04.12.2023	Bought	USD	67'728'770	EUR	64'017'000	0.00	0.00
04.12.2023	Bought	USD	26'710'053	GBP	22'008'000	0.00	0.00
04.12.2023	Bought	USD	13'831'837	JPY	2'083'607'000	0.00	0.00
02.02.2024	Bought	CHF	337'246'000	USD	390'448'063	11'637'190.65	1.35
02.02.2024	Bought	CHF	4'227'400	USD	4'894'291	145'872.92	0.02
02.02.2024	Bought	CHF	28'400	USD	32'620	1'240.57	0.00
02.02.2024	Bought	CHF	148'500	USD	176'971	79.86	0.00
02.02.2024	Bought	CHF	2'269'000	USD	2'606'126	99'114.38	0.01
02.02.2024	Bought	CHF	2'679'000	USD	3'192'627	1'440.65	0.00
02.02.2024	Bought	EUR	210'682'000	USD	230'506'544	2'535'979.24	0.30
02.02.2024	Bought	EUR	1'073'000	USD	1'187'119	-237.14	0.00
02.02.2024	Bought	EUR	2'062'000	USD	2'228'422	52'426.35	0.01
02.02.2024	Bought	JPY	236'326'000	USD	1'684'532	471.93	0.00
02.02.2024	Bought	USD	6'157'540	CHF	5'319'000	-183'466.00	-0.02
02.02.2024	Bought	USD	14'300	CHF	12'000	-7.08	0.00
02.02.2024	Bought	USD	24'447'809	CNH	173'866'000	-22'176.19	0.00
02.02.2024	Bought	USD	917'290	CNH	6'523'000	-760.31	0.00
02.02.2024	Bought	USD	72'057'338	EUR	65'866'000	-798'211.58	-0.09
02.02.2024	Bought	USD	2'477'017	EUR	2'239'000	382.36	0.00
02.02.2024	Bought	USD	28'374'286	GBP	22'406'000	-193'239.56	-0.02
02.02.2024	Bought	USD	5'284'568	GBP	4'147'000	-2'840.18	0.00
02.02.2024	Bought	USD	6'754'188	JPY	989'243'000	-297'570.80	-0.03
05.02.2024	Bought	USD	3'826'747	KRW	5'140'600'000	-171'478.00	-0.02
05.02.2024	Bought	USD	7'663'765	TWD	246'610'000	-436'006.59	-0.05
Total Devisentermingeschäfte						12'368'205.48	1.44

Ausserbilanzgeschäfte	31.12.2023		31.12.2022	
	Basiswertäquivalent in Fondswährung	in % des NFV	Basiswertäquivalent in Fondswährung	in % des NFV
- Marktrisiko (Aktienkursänderungsrisiko)	44'156'660.54	5.22%	37'740'545.18	5.90%
- Marktrisiko (Zinsänderungsrisiko)	6'908'803.12	0.82%	0.00	0.00%
- Währungsrisiko	809'482'422.67	95.65%	625'779'308.72	97.91%
Brutto-Gesamtengagement aus Derivaten	922'728'886.33	101.69%	663'519'853.90	103.81%
- Marktrisiko (Aktienkursänderungsrisiko)	44'156'660.54	5.22%	37'740'545.18	5.90%
- Marktrisiko (Zinsänderungsrisiko)	6'908'803.12	0.82%	0.00	0.00%
- Währungsrisiko	809'482'422.67	95.65%	625'779'308.72	97.91%
Netto-Gesamtengagement aus Derivaten	922'728'886.33	101.69%	663'519'853.90	103.81%

Erläuterungen zum Jahresbericht per 31. Dezember 2023

Erläuterung 1: Angaben über Angelegenheiten von besonderer wirtschaftlicher oder rechtlicher Bedeutung

Am 19. März 2023 haben die Credit Suisse Group AG und die UBS Group AG eine Vereinbarung zum Zusammenschluss unterzeichnet, welche per 12. Juni 2023 vollzogen wurde. Der Fonds bezieht verschiedene Dienstleistungen und unterhält Bankbeziehungen mit konsolidierten Tochtergesellschaften der Credit Suisse Group AG bzw. der UBS Group AG. Es ist geplant, dass die Credit Suisse Funds AG im 2. Quartal 2024 in die UBS Fund Management AG fusioniert wird. Zu diesem geplanten Zeitpunkt wird die UBS Fund Management AG die Fondsleitungsfunktion übernehmen. Folglich können Beziehungen und Dienstleister in Zukunft ändern.

Erläuterung 2: Verkaufsrestriktionen USA

Anteile dieser kollektiven Kapitalanlage dürfen innerhalb der USA und ihren Territorien weder angeboten, verkauft noch ausgeliefert werden. Anteile dieser kollektiven Kapitalanlage dürfen Bürgern der USA oder Personen mit Wohnsitz oder Sitz in den USA und/oder anderen natürlichen wie juristischen Personen, deren Einkommen und/oder Erträge, ungeachtet der Herkunft, der US-Einkommenssteuer unterliegen, sowie Personen, die gemäss Bestimmung S des US Securities Act von 1933 und/oder dem US Commodity Exchange Act in der jeweils gültigen Fassung als US-Personen gelten, weder angeboten, verkauft noch ausgeliefert werden.

Erläuterung 3: Kennzahlen und technische Daten

Fondsname	Anteilklasse	Valor	Währung	pauschale ¹ Verwaltungs- kommission	Total Expense ² Ratio (TER)	Performance ³ Fee	Total Expense ^{2,4,5} Ratio (TER) inkl. Performance fee
LGT (CH) Premium Strategy GIM	(CHF) B	34 766 162	CHF	1.98%	3.01%	0.00%	3.01%
	(EUR) B	34 766 244	EUR	1.98%	3.02%	0.00%	3.02%
	(USD) B	34 766 253	USD	1.98%	3.01%	0.00%	3.01%
	(CHF) IM	34 766 255	CHF	0.09%	1.12%	0.00%	1.12%

¹ Die Fondsleitung hat keine Gebührenteilungsvereinbarungen oder Vereinbarungen betreffend Retrozessionen in Form von sogenannten «soft commissions» geschlossen.

² Die TER (Total Expense Ratio) bezeichnet die Summe aller periodisch erhobenen Kosten und Kommissionen, die dem Fondsvermögen belastet werden, und zwar rückwirkend als Prozentsatz des durchschnittlichen Fondsvermögens. Allfällige Rückvergütungen/Bestandespflegekommissionen von Zielfonds wurden dem Fonds gutgeschrieben und reduzieren somit die TER. Die maximale Verwaltungskommission der Zielfonds beträgt 3%.

³ Als prozentualer Anteil des durchschnittlichen Nettovermögens

⁴ Zusammengesetzte TER, da mehr als 10% des Nettovermögens in andere kollektive Kapitalanlagen (Zielfonds) per Stichtag investiert war. Die TER der Zielfonds können auch von KIID's, etc. stammen.

⁵ Der ausgewiesene Wert wurde inklusive der geschätzten Portfolio Positionen berechnet (100%). Die TER-Berechnung exklusive der geschätzten Portfolio Positionen umfasst ca. 44.1% und entspricht für die Anteilklasse (CHF) B 2.15%, (EUR) B 2.15%, (USD) B 2.15% und (CHF) IM 0.26%.

Erläuterung 4: Fondsp performance

Fondsname	Anteilklasse	Valor	Lancierungs- datum	Währung	2023 ¹	2022 ¹	2021 ¹
LGT (CH) Premium Strategy GIM	(CHF) B	34 766 162	31.03.2017	CHF	3.4%	-9.3%	12.5%
	(EUR) B	34 766 244	30.04.2017	EUR	6.3%	-7.9%	13.8%
	(USD) B	34 766 253	30.04.2017	USD	9.0%	-7.7%	12.7%
	(CHF) IM	34 766 255	31.03.2017	CHF	5.4%	-7.5%	15.4%

¹ Die Fondsp performance basiert auf offiziellen publizierten Nettoinventarwerten, die auf den Börsenschlusskursen des jeweiligen Monatsendes basieren.

Die historische Performance stellt keinen Indikator für die laufende oder zukünftige Performance dar. Die Performancedaten lassen die bei der Ausgabe und Rücknahme der Anteile erhobenen Kommissionen und Kosten unberücksichtigt.

Erläuterung 5: Identität der Vertragspartner bei OTC-Geschäften

Fondsname	Vertragspartner
LGT (CH) Premium Strategy GIM	LGT BANK AG VADUZ CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG

Erläuterung 6: Entgegengenommene Sicherheiten

Keine

Erläuterung 7: Direkte und indirekte operationelle Kosten und Gebühren aus Effektenleihen

Keine

Erläuterung 8: Zusammensetzung des Portefeuilles

Die Zusammensetzung des Portefeuilles weist Bestandesveränderungen ohne Fraktionen aus. Dies kann zu Rundungsdifferenzen in der Totalisierung führen.

Erläuterung 9: Ausweis der Ausserbilanzgeschäfte für Brutto/Netto Darstellung (Commitment-Ansatz II)

Es wird auf eine Verrechnung gegenläufiger Derivat-Positionen verzichtet. Somit entspricht das Netto-Gesamtengagement aus Derivaten dem Wert des Brutto-Gesamtengagements.

Erläuterung 10: Bewertung des Fondsvermögens und der Anteile

1. Der Nettoinventarwert des Anlagefonds und der Anteil der einzelnen Klassen (Quoten) wird zum Verkehrswert auf Ende des Rechnungsjahres sowie am letzten Kalendertag eines jeden Monats, an dem Anteile ausgegeben oder zurückgenommen werden, in der Rechnungseinheit des Anlagefonds berechnet. Für Tage, an welchen die Börsen bzw. Märkte der Hauptanlageländer des Anlagefonds geschlossen sind (z.B. Banken- und Börsenfeiertage), findet keine Berechnung des Vermögens des Anlagefonds statt. Des Weiteren finden keine Berechnung des Nettoinventarwertes statt, wenn die Ausgabe und Rücknahme von Anteilen aufgeschoben wird gemäss §17 Ziff. 5.
2. An einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offenstehenden Markt gehandelte Anlagen (inkl. geschlossene kollektive Kapitalanlagen, welche an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offenstehenden Markt gehandelt werden) sind mit den am Hauptmarkt bezahlten aktuellen Kursen zu bewerten. Andere Anlagen oder Anlagen, für die keine aktuellen Kurse verfügbar sind, sind mit dem Preis zu bewerten, der bei sorgfältigem Verkauf im Zeitpunkt der Schätzung wahrscheinlich erzielt würde. Die Fondsleitung wendet in diesem Fall zur Ermittlung des Verkehrswertes angemessene und in der Praxis anerkannte Bewertungsmodelle und -grundsätze sowie die nachfolgend statuierten Grundsätze an.
3. Offene kollektive Kapitalanlagen werden mit ihrem Rücknahmepreis bzw. Nettoinventarwert bewertet. Werden sie regelmässig an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt, so kann die Fondsleitung diese gemäss Ziff. 2 bewerten.
4. Der Wert von Geldmarktinstrumenten, welche nicht an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offenstehenden Markt gehandelt werden, wird wie folgt bestimmt: Der Bewertungspreis solcher Anlagen wird, ausgehend vom Nettoerwerbspreis, unter Konstanthaltung der daraus berechneten Anlagerendite sukzessive dem Rückzahlungspreis angeglichen. Bei wesentlichen Änderungen der Marktbedingungen wird die Bewertungsgrundlage der einzelnen Anlagen der neuen Marktrendite angepasst. Dabei wird bei fehlendem aktuellem Marktpreis in der Regel auf die Bewertung von Geldmarktinstrumenten mit gleichen Merkmalen (Qualität und Sitz des Emittenten, Ausgabewährung, Laufzeit) abgestellt.
5. Bankguthaben werden mit ihrem Forderungsbetrag plus aufgelaufene Zinsen bewertet. Bei wesentlichen Änderungen der Marktbedingungen oder der Bonität wird die Bewertungsgrundlage für Bankguthaben auf Zeit den neuen Verhältnissen angepasst.
6. Der Nettoinventarwert eines Anteils einer Klasse des Anlagefonds ergibt sich aus der der betreffenden Anteilsklasse am Verkehrswert des Vermögens des Anlagefonds zukommenden Quote, vermindert um allfällige Verbindlichkeiten des Anlagefonds, die der betreffenden Anteilsklasse zugeteilt sind, dividiert durch die Anzahl der im Umlauf befindlichen Anteile der entsprechenden Klasse. Er wird auf die jeweils kleinste gängige Einheit der Rechnungseinheit gerundet.
7. Falls an einem Bewertungstag die Summe der Zeichnungen und Rücknahmen von Anteilen zu einem Nettovermögenszufluss bzw. -abfluss führt, wird der Nettoinventarwert erhöht bzw. reduziert (Swinging Single Pricing). Die maximale Anpassung beläuft sich auf 1% des Nettoinventarwertes. Berücksichtigt werden die Nebenkosten (namentlich marktübliche Courtagen, Kommissionen, Steuern und Abgaben), die im Durchschnitt aus der Anlage des einbezahlten Betrages bzw. aus dem Verkauf eines dem gekündigten Anteil entsprechenden Teils der Anlagen durchschnittlich erwachsen. Die Anpassung führt zu einer Erhöhung des Nettoinventarwertes, wenn die Nettobewegung zu einem Anstieg der Anzahl Anteile führen. Die Anpassung resultiert in einer Verminderung des Nettoinventarwertes, wenn die Nettobewegung einen Rückgang der Anzahl der Anteile bewirkt. Der unter Anwendung des Swinging Single Pricing ermittelte Nettoinventarwert ist somit ein gemäss Satz 1 dieser Ziffer modifizierter Nettoinventarwert. Der bei den Zeichnungen bzw. Rücknahmen anfallende Zu- bzw. Abschlag zum Nettoinventarwert erfolgt jeweils pauschal bezogen auf einen Durchschnittswert aus einer im Prospekt definierten Periode.
8. Die Quoten am Verkehrswert des Nettovermögens des Anlagefonds (Vermögen des Anlagefonds abzüglich der Verbindlichkeiten), welche den jeweiligen Anteilsklassen zuzurechnen sind, werden erstmals bei der Erstausgabe mehrerer Anteilsklassen (wenn diese gleichzeitig erfolgt) oder der Erstausgabe einer weiteren Anteilsklasse auf der Basis der dem Anlagefonds für jede Anteilsklasse zufließenden Beträge bestimmt. Die Quote wird bei folgenden Ereignissen jeweils neu berechnet:
 - a) bei der Ausgabe und Rücknahme von Anteilen;
 - b) auf den Stichtag von Ausschüttungen, sofern (i) solche Ausschüttungen nur auf einzelne Anteilsklassen (Ausschüttungsklassen) anfallen oder sofern (ii) die Ausschüttungen der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten ihres jeweiligen Nettoinventarwertes unterschiedlich ausfallen oder sofern (iii) auf den Ausschüttungen der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten der Ausschüttung unterschiedliche Kommissions- oder Kostenbelastungen anfallen;
 - c) bei der Inventarwertberechnung im Rahmen der Zuweisung von Verbindlichkeiten (einschliesslich der fälligen oder aufgelaufenen Kosten und Kommissionen) an die verschiedenen Anteilsklassen, sofern die Verbindlichkeiten der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten ihres jeweiligen Nettoinventarwertes unterschiedlich ausfallen, namentlich, wenn (i) für die verschiedenen Anteilsklassen unterschiedliche Kommissionssätze zur Anwendung gelangen oder wenn (ii) klassenspezifische Kostenbelastungen erfolgen; bei der Inventarwertberechnung im Rahmen der Zuweisung von Erträgen oder Kapitalerträgen an die verschiedenen Anteilsklassen, sofern die Erträge oder Kapitalerträge aus Transaktionen anfallen, die nur im Interesse einer Anteilsklasse oder im Interesse mehrerer Anteilsklassen, nicht jedoch proportional zu deren Quote am Nettovermögen des Anlagefonds getätigt wurden.
 - d) bei der Inventarwertberechnung im Rahmen der Zuweisung von Erträgen oder Kapitalerträgen an die verschiedenen Anteilsklassen, sofern die Erträge oder Kapitalerträge aus Transaktionen anfallen, die nur im Interesse einer Anteilsklasse oder im Interesse mehrerer Anteilsklassen, nicht jedoch proportional zu deren Quote am Nettovermögen des Anlagefonds getätigt wurden.

Erläuterung 11: Änderungen des Fondsvertrags per 26. Juli 2023

Die Eidgenössische Finanzmarktaufsicht FINMA hat die von der Fondsleitung und der Depotbank beantragten Änderungen des Fondsvertrags mit Verfügung vom 26. Juli 2023 bewilligt. Die Änderungen sind per 1. August 2023 in Kraft getreten. Die Publikation auf der elektronischen Plattform „www.swissfunddata.ch“ am 6. Juli 2023 lautet wie folgt:

Die Credit Suisse Funds AG, Zürich, als Fondsleitung, mit Zustimmung der Credit Suisse (Schweiz) AG, Zürich, als Depotbank, beabsichtigt, vorbehältlich der Genehmigung durch die Eidgenössische Finanzmarktaufsicht FINMA den Fondsvertrag des Fonds wie folgt zu ändern:

1. § 1 Bezeichnung; Firma und Sitz von Fondsleitung, Depotbank und Vermögensverwalter

Neu werden die Anlageentscheide bezüglich der Vermögensverwaltung des Fonds von LGT Capital Partners AG, Pfäffikon SZ neben LGT Capital Partners (Asia-Pacific) Ltd., Hong Kong, zusätzlich ab 01. August 2023 an LGT Capital Partners (USA) Inc., New York weiterdelegiert.

Für weitere Angaben wird auf den Prospekt verwiesen (*Ziff. 2.2*).

2. Änderung des Prospekts

Der Prospekt des Fonds wird entsprechend angepasst.

Kurzbericht der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

an den Verwaltungsrat der Fondsleitung Credit Suisse Funds AG, Zürich

Kurzbericht zur Prüfung der Jahresrechnung

Prüfungsurteil

Wir haben die Jahresrechnung des Umbrella-Fonds LGT (CH) Premium Strategy GIM mit dem Teilvermögen

- LGT (CH) Premium Strategy GIM

bestehend aus der Vermögensrechnung zum 31. Dezember 2023, der Erfolgsrechnung für das dann endende Jahr, den Angaben über die Verwendung des Erfolges und die Offenlegung der Kosten sowie den weiteren Angaben gemäss Art. 89 Abs. 1 Bst. b–h des schweizerischen Kollektivanlagengesetzes (KAG) geprüft.

Nach unserer Beurteilung entspricht die beigefügte Jahresrechnung (Seiten 3 bis 16) dem schweizerischen Kollektivanlagengesetz, den dazugehörigen Verordnungen sowie dem Fondsvertrag und dem Prospekt.

Grundlage für das Prüfungsurteil

Wir haben unsere Abschlussprüfung in Übereinstimmung mit dem schweizerischen Gesetz und den Schweizer Standards zur Abschlussprüfung (SA-CH) durchgeführt. Unsere Verantwortlichkeiten nach diesen Vorschriften und Standards sind im Abschnitt „Verantwortlichkeiten der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft für die Prüfung der Jahresrechnung“ unseres Berichts weitergehend beschrieben. Wir sind vom Anlagefonds sowie der Fondsleitung unabhängig in Übereinstimmung mit den schweizerischen gesetzlichen Vorschriften und den Anforderungen des Berufsstands, und wir haben unsere sonstigen beruflichen Verhaltenspflichten in Übereinstimmung mit diesen Anforderungen erfüllt.

Wir sind der Auffassung, dass die von uns erlangten Prüfungsnachweise ausreichend und geeignet sind, um als eine Grundlage für unser Prüfungsurteil zu dienen.

Verantwortlichkeiten des Verwaltungsrats der Fondsleitung für die Jahresrechnung

Der Verwaltungsrat der Fondsleitung ist verantwortlich für die Aufstellung einer Jahresrechnung in Übereinstimmung mit dem schweizerischen Kollektivanlagengesetz, den dazugehörigen Verordnungen sowie dem Fondsvertrag und dem Prospekt und für die internen Kontrollen, die der Verwaltungsrat als notwendig feststellt, um die Aufstellung einer Jahresrechnung zu ermöglichen, die frei von wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern ist.

Verantwortlichkeiten der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft für die Prüfung der Jahresrechnung

Unsere Ziele sind, hinreichende Sicherheit darüber zu erlangen, ob die Jahresrechnung als Ganzes frei von wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern ist, und einen Bericht abzugeben, der unser Prüfungsurteil beinhaltet. Hinreichende Sicherheit ist ein hohes Mass an Sicherheit, aber keine Garantie dafür, dass eine in Übereinstimmung mit dem schweizerischen Gesetz und den SA-CH durchgeführte Abschlussprüfung eine wesentliche falsche Darstellung, falls eine solche vorliegt, stets aufdeckt. Falsche Darstellungen können aus dolosen Handlungen oder Irrtümern resultieren und werden als wesentlich gewürdigt, wenn von ihnen

einzelnen oder insgesamt vernünftigerweise erwartet werden könnte, dass sie die auf der Grundlage dieser Jahresrechnung getroffenen wirtschaftlichen Entscheidungen von Nutzern beeinflussen.

Als Teil einer Abschlussprüfung in Übereinstimmung mit dem schweizerischen Gesetz und den SA-CH üben wir während der gesamten Abschlussprüfung pflichtgemässes Ermessen aus und bewahren eine kritische Grundhaltung. Darüber hinaus:

- identifizieren und beurteilen wir die Risiken wesentlicher falscher Darstellungen in der Jahresrechnung aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern, planen und führen Prüfungshandlungen als Reaktion auf diese Risiken durch sowie erlangen Prüfungsnachweise, die ausreichend und geeignet sind, um als Grundlage für unser Prüfungsurteil zu dienen. Das Risiko, dass aus dolosen Handlungen resultierende wesentliche falsche Darstellungen nicht aufgedeckt werden, ist höher als ein aus Irrtümern resultierendes, da dolose Handlungen kollusives Zusammenwirken, Fälschungen, beabsichtigte Unvollständigkeiten, irreführende Darstellungen oder das Ausserkraftsetzen interner Kontrollen beinhalten können.
- gewinnen wir ein Verständnis von dem für die Abschlussprüfung relevanten internen Kontrollsystem, um Prüfungshandlungen zu planen, die unter den gegebenen Umständen angemessen sind, jedoch nicht mit dem Ziel, ein Prüfungsurteil zur Wirksamkeit des internen Kontrollsystems des Anlagefonds abzugeben.
- beurteilen wir die Angemessenheit der angewandten Rechnungslegungsmethoden sowie die Vertretbarkeit der dargestellten geschätzten Werte in der Rechnungslegung und damit zusammenhängenden Angaben.

Wir kommunizieren mit dem Verwaltungsrat der Fondsleitung bzw. dessen zuständigem Ausschuss unter anderem über den geplanten Umfang und die geplante zeitliche Einteilung der Abschlussprüfung sowie über bedeutsame Prüfungsfeststellungen, einschliesslich etwaiger bedeutsamer Mängel im internen Kontrollsystem, die wir während unserer Abschlussprüfung identifizieren.

PricewaterhouseCoopers AG

Raffael Simone

Zugelassener Revisionsexperte
Leitender Prüfer

Yael Fries

Zugelassene Revisionsexpertin

Zürich, 22. April 2024

Credit Suisse Funds AG
Teil des UBS-Konzerns
Uetlibergstrasse 231
CH-8045 Zürich

www.credit-suisse.com