



PROSPERIS

GEPRÜFTER JAHRESBERICHT

Per 31. Dezember 2023

PROSPERIS INVESTMENT FUNDS

Umbrella-Fonds schweizerischen Rechts für qualifizierte Anleger
(Art «Übriger Fonds für traditionelle Anlagen»)

INHALTSVERZEICHNIS

ALLGEMEINE ANGABEN	3
Fondsleitung	3
Depotbank	3
Vermögensverwalter	3
Prüfgesellschaft	3
Valoren- / ISIN-Nummern	3
VERMÖGENSRECHNUNG	4
Prosperis Aktiensignal	4
ERFOLGSRECHNUNG	6
Prosperis Aktiensignal	6
BERICHT ÜBER DIE TÄTIGKEITEN	8
Prosperis Aktiensignal	8
ERGÄNZENDE INFORMATIONEN	11
Angaben zu Derivaten	11
Dreijahresvergleich	11
Fondsrendite	11
Branchenverteilung	12
Kosteninformationen	12
TER	12
Transaktionskosten	12
Hinweis auf Soft Commissions Agreements	12
Grundsätze für die Bewertung sowie die Berechnung des Nettoinventarwertes	13
Rechtlich und wirtschaftlich bedeutende Angaben	15
BERICHT DES WIRTSCHAFTSPRÜFERS	16

ALLGEMEINE ANGABEN

FONDSLEITUNG

1741 Fund Solutions AG
Burggraben 16
CH-9000 St. Gallen
T +41 58 458 48 00
www.1741group.com
info@1741fs.com

DEPOTBANK

Zürcher Kantonalbank AG
Bahnhofstrasse 9
CH-8001 Zürich

VERMÖGENSVERWALTER

Bis am 19.07.2023

1741 Fund Solutions AG
Burggraben 16
CH-9000 St. Gallen
T +41 58 458 48 00
www.1741group.com
info@1741fs.com

Ab dem 19.07.2023

Prosperis Sustainable Wealth Management AG
Oberdorfstrasse 8
8001 Zürich
T +41 44 215 47 00
www.prosperis.ch
info@prosperis.ch

PRÜFGESELLSCHAFT

Grant Thornton AG
Claridenstrasse 35
CH-8002 Zürich
www.grant-thornton.ch

VALOREN- / ISIN-NUMMERN

Fonds	Valor	ISIN
Prosperis Aktiensignal CHF	113599996	CH1135999964
Prosperis Aktiensignal EUR ¹	113599997	CH1135999972

¹ Die Anteilsklasse EUR wurde per 19.07.2023 aus dem Fondsvertrag gestrichen

VERMÖGENSRECHNUNG

| PROSPERIS AKTIENSIGNAL

Vermögensrechnung

in CHF	31.12.2023	31.12.2022
Anlagen, aufgeteilt in		
Bankguthaben	3'082'355.11	6'703'569.64
<i>auf Sicht</i>	3'082'355.11	6'703'569.64
<i>auf Zeit</i>		
Geldmarktinstrumente		
Forderungen aus Pensionsgeschäften		
Effekten	42'686'160.34	37'356'133.84
<i>Obligationen, Wandelobligationen</i>		
<i>Strukturierte Produkte</i>		
<i>Aktien</i>		
<i>Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen</i>	42'686'160.34	37'356'133.84
Andere Anlagen		
<i>Edelmetalle</i>		
Derivative Finanzinstrumente	461'132.00	142'117.84
<i>Futures</i>		
<i>Devisentermingeschäft</i>	461'132.00	142'117.84
<i>Swaps</i>		
<i>Andere Derivative Finanzinstrumente</i>		
Darlehen		
Sonstige Vermögenswerte	13'676.46	22'950.27
Gesamtfondsvermögen	46'243'323.91	44'224'771.59
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten		
Bankverbindlichkeiten auf Zeit		
Andere Verbindlichkeiten	-28'766.48	-33'913.59
Nettofondsvermögen	46'214'557.43	44'190'858.00
Nettofondsvermögen Klasse CHF	46'214'557.43	41'052'042.59
Nettofondsvermögen Klasse EUR		3'138'815.41
Anzahl Anteile im Umlauf		
Klasse CHF		
Anteile zu Beginn der Berichtsperiode	443'808.000	0.000
Ausgegebene Anteile	117'796.824	504'618.000
Zurückgenommene Anteile	-82'080.000	-60'810.000
Anteile am Ende der Berichtsperiode	479'524.824	443'808.000
Inventarwert pro Anteil	96.38	92.50
Swung-NAV	96.38	92.50

Klasse EUR

Anteile zu Beginn der Berichtsperiode	34'441.000	0.000
Ausgegebene Anteile	1'640.000	55'285.000
Zurückgenommene Anteile	-36'081.000	-20'844.000
Anteile am Ende der Berichtsperiode	0.000	34'441.000

Inventarwert pro Anteil **92.30**

Swung-NAV **92.30**

Veränderung des Nettofondsvermögens

in CHF **31.12.2023** **31.12.2022**

Klasse CHF

Nettofondsvermögen zu Beginn der Berichtsperiode	41'052'042.59	0.00
Abgeführte Verrechnungssteuer an ESTV	-175'557.53	0.00
Saldo aus Anteilsverkehr	3'039'405.08	44'290'824.17
Gesamterfolg der Berichtsperiode	2'298'667.29	-3'238'781.58
Nettofondsvermögen am Ende der Berichtsperiode	46'214'557.43	41'052'042.59

Klasse EUR

Nettofondsvermögen zu Beginn der Berichtsperiode	3'138'815.41	0.00
Abgeführte Verrechnungssteuer an ESTV	-14'931.46	0.00
Saldo aus Anteilsverkehr	-2'845'597.76	3'749'394.90
Gesamterfolg der Berichtsperiode	-278'286.19	-610'579.49
Nettofondsvermögen am Ende der Berichtsperiode	0.00	3'138'815.41

ERFOLGSRECHNUNG

| PROSPERIS AKTIENSIGNAL

Erfolgsrechnung

in CHF	01.01.2023 - 31.12.2023	01.01.2022 - 31.12.2022
Erträge	652'024.14	574'662.46
Bankguthaben	22'466.83	
<i>auf Sicht</i>	22'466.83	
<i>auf Zeit</i>		
Effekten	599'614.78	579'423.67
<i>Obligationen</i>		
<i>Geldmarktinstrumente</i>		
<i>Strukturierte Produkte</i>		
<i>Aktien (einschliesslich Erträge aus Gratisaktien)</i>		
<i>Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen</i>	599'614.78	579'423.67
Erträge der anderen Anlagen		
Erträge aus Securities Lending		
Erträge aus Darlehen		
Sonstige Erträge	26'236.66	5'266.87
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen	3'705.87	-10'028.08
Aufwendungen	-115'786.57	-140'841.64
Passivzinsen	-645.91	-2'036.50
Prüfaufwand		
Reglementarische Vergütungen	-108'317.45	-135'279.09
<i>Verwaltungskommission</i>		
<i>an Fondsleitung</i>		
	<i>Klasse CHF</i>	<i>Klasse CHF</i>
	-79'432.82	-93'601.53
	<i>Klasse EUR</i>	<i>Klasse EUR</i>
	-2'459.59	-7'760.74
<i>an Depotbank</i>		
	<i>Klasse CHF</i>	<i>Klasse CHF</i>
	-25'579.37	-31'329.63
	<i>Klasse EUR</i>	<i>Klasse EUR</i>
	-845.67	-2'587.19
Übertrag der Performance Fee auf realisierter Kapitalerfolg ¹⁾		
Sonstige Aufwendungen	-5'589.88	-8'670.40
Teilübertrag von Aufwendungen auf realisierten Kapitalerfolg ²⁾		
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen	-1'233.33	5'144.35
Nettoerfolg der Berichtsperiode	536'237.57	433'820.82
Steuerliche Anpassung wegen Erträgen aus Anteilen anderer kollektiver Kapitalanlagen	63'377.21	145'602.85
Nettoerfolg nach Anpassung Erträgen aus Zielfonds	599'614.78	579'423.67
Ausgleich wegen Erträgen aus Anteilen anderer kollektiver Kapitalanlagen	-546'484.89	-586'402.95
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste	-4'394'516.07	4'717'684.27
Vergütung Nebenkosten Swinging-Single-Pricing	12'162.04	31'269.23
Übertrag Performance Fee von regl. Vergütungen an Fondsleitung ¹⁾		
Teilübertrag von Aufwendungen auf realisierten Kapitalerfolg ²⁾		

Realisierter Erfolg der Berichtsperiode	-4'329'224.14	4'741'974.22
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste	6'349'605.24	-8'591'335.29
Gesamterfolg der Berichtsperiode	2'020'381.10	-3'849'361.07

¹⁾ Gemäss Kreisschreiben Nr. 24 Art. 2.9.1 Performance-Kommission

²⁾ Gemäss Kreisschreiben Nr. 24 Art. 2.9.2 Abzugsfähige Gebühren

Verwendung des Erfolgs²

in CHF	31.12.2023	31.12.2022
Nettoerfolg der Berichtsperiode		
Nettoerfolg der Berichtsperiode - Klasse CHF	599'614.78	538'268.01
Total Gewinnvortrag des Vorjahres		
Total Gewinnvortrag des Vorjahres - Klasse CHF	0.00	0.00
Zur Verteilung stehender Ertrag		
Zur Verteilung stehender Ertrag - Klasse CHF	599'614.78	538'268.01
Abzüglich Eidg. Verrechnungssteuer		
Abzüglich Eidg. Verrechnungssteuer - Klasse CHF	-209'865.17	188'393.80
Zur Wiederanlage zurückbehaltener Erfolg		
Zur Wiederanlage zurückbehaltener Erfolg - Klasse CHF	389'749.61	349'874.21
Vortrag auf neue Rechnung		
Vortrag auf neue Rechnung - Klasse CHF	0.00	726'661.81

Kapitalgewinne werden keine ausgeschüttet.

² Es handelt es sich um einen thesaurierenden Fonds

BERICHT ÜBER DIE TÄTIGKEITEN

| PROSPERIS AKTIENSIGNAL

Inventar des Fondsvermögens am Ende der Berichtsperiode

ISIN	Anzahl/ Nominal	Titelbezeichnung	Whg	Titel- kurs	Devisen- kurs	Verkehrswert in CHF	in %*
Effekten, die an einer Börse gehandelt werden**						42'686'160.34	92.30
Beteiligungspapiere						0.00	0.00
Forderungspapiere						0.00	0.00
Strukturierte Produkte						0.00	0.00
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen						42'686'160.34	92.30
Anteile an anderen kollektiven Kapitalanlagen						42'686'160.34	92.30
Irland						36'830'263.72	79.64
CHF						24'118'734.15	52.15
IE00BDR55F85	610'692	UBS ETF ACWI SRI HDG CHF ACC	CHF	13.1980	1.0000	8'059'913.02	17.43
IE00BK72HT65	685'932	UBS ETF MSCIW SRI H.CHF ACC	CHF	12.1400	1.0000	8'327'214.48	18.00
IE00BMZ17V16	1'254'113	ISHARES MSCI WORLD SRI-CHFHD	CHF	6.1650	1.0000	7'731'606.65	16.72
USD						12'711'529.57	27.49
IE00BYVJRP78	893'604	ISHARES SUST MSCI EM SRI	USD	6.9300	0.8417	5'212'065.52	11.27
IE00BNKVQQ11	3'714'846	FD HR SUS GL EQ FD-X USDACC	USD	2.3986	0.8417	7'499'464.05	16.22
Luxemburg						5'855'896.62	12.66
CHF						5'855'896.62	12.66
LU1550202615	57'377	VONTOBEL FUND-MTX SUST EM MK L-HI H	CHF	102.0600	1.0000	5'855'896.62	12.66
Effekten, die nicht an einer Börse gehandelt werden***						0.00	0.00
Beteiligungspapiere						0.00	0.00
Forderungspapiere						0.00	0.00
Strukturierte Produkte						0.00	0.00
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen						0.00	0.00
Derivative Finanzinstrumente (ohne Strukturierte Produkte)***						461'132.00	1.00
Derivative Finanzinstrumente						461'132.00	1.00
Derivative Finanzinstrumente						461'132.00	1.00
USD						461'132.00	1.00
DAT009732	12'222'000		CHF	1.0000	1.0000	12'222'000.00	26.43
DAT009732	-		USD	0.8401	0.8417	-	-25.43
	14'000'000					11'760'868.00	
Derivative Finanzinstrumente (ohne Strukturierte Produkte)						461'132.00	1.00
aufgelaufene Gewinne/Verluste aus Optionen						0.00	0.00
aufgelaufene Gewinne/Verluste aus Futures-Geschäften						0.00	0.00
aufgelaufene Gewinne/Verluste aus Devisentermingeschäften						461'132.00	1.00
aufgelaufene Gewinne/Verluste aus Swap-Geschäften						0.00	0.00
aufgelaufene Gewinne/Verluste aus and. Derivative Finanzinstrumenten						0.00	0.00

Total Effekten und derivative Finanzinstrumente	43'147'292.34	93.30
Bankguthaben	3'082'355.11	6.67
Auf Sicht	3'082'355.11	6.67
Auf Zeit	0.00	0.00
Edelmetalle***	0.00	0.00
Darlehen	0.00	0.00
Sonstige Vermögenswerte	13'676.46	0.03
Gesamtfondsvermögen	46'243'323.91	100.00
Verbindlichkeiten	-28'766.48	0
Nettofondsvermögen	46'214'557.43	

* Allfällige Abweichungen in den Totalisierungen sind auf Rundungsdifferenzen zurückzuführen.

** Diese Anlagen sind zu Kursen bewertet, die am Hauptmarkt bezahlt werden.

*** Diese Anlagen sind aufgrund von am Markt beobachteten Parametern bewertet.

Aufstellung der Käufe, Verkäufe und anderer Geschäfte

Veränderungen im Wertschriftenbestand in der Berichtsperiode

| 9

ISIN	Titelbezeichnung	Anfangsbestand per 31.12.2022	Kauf	Verkauf	Schlussbestand per 31.12.2023
Wertpapiere mit Bestand am Ende der Berichtsperiode					
IE00BDR55F85	UBS ETF ACWI SRI HDG CHF ACC	592'654	54'038	36'000	610'692
IE00BK72HT65	UBS ETF MSCIW SRI H.CHF ACC	662'530	63'402	40'000	685'932
IE00BNKVQQ11	FD HR SUS GL EQ FD-X USDACC		3'714'846		3'714'846
Wertpapiere ohne Bestand am Ende der Berichtsperiode					
IE00BK72HJ67	UBS ETF MSCIW SRI USD ACC	469'235		469'235	

"Käufe" umfassen die Transaktionen: Gratistitel / Käufe / Konversionen / Namensänderungen / "Splits" / Stock-/Wahldividenden / Titelaufteilungen / Überträge / Umbuchungen infolge Redenominierung in Euro / Umtausch zwischen Gesellschaften / Zuteilung aus Bezugs-/Optionsrechten / Zuteilung von Bezugsrechten ab Basistiteln
 "Verkäufe" umfassen die Transaktionen: Auslosungen / Ausbuchung infolge Verfall / Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten / "Reverse splits" / Rückzahlungen / Überträge / Umbuchungen infolge Redenominierung in Euro / Umtausch zwischen Gesellschaften / Verkäufe

Veränderungen im Wertschriftenbestand in der Berichtsperiode – Derivative Finanzinstrumente

ID	Titelbezeichnung	Verfall	Long Whg	Long Nominal	Short Whg	Short Nominal
Devisentermingeschäfte						
DAT007943	DTG CHF/USD 09.03.2023	09/03/2023	CHF	12'083'890	USD	13'000'000
DAT007945	DTG EUR/CHF 09.03.2023	09/03/2023	EUR	3'220'000	CHF	3'173'693
DAT008437	DTG EUR/CHF 06.04.2023	06/04/2023	EUR	3'333'000	CHF	3'317'085
DAT008438	DTG CHF/USD 09.06.2023	09/06/2023	CHF	12'679'076	USD	13'700'000
DAT008550	DTG EUR/CHF 05.05.2023	05/05/2023	EUR	3'363'000	CHF	3'344'816
DAT008702	DTG EUR/CHF 09.06.2023	09/06/2023	EUR	3'338'000	CHF	3'262'391
DAT008730	DTG CHF/EUR 09.06.2023	09/06/2023	CHF	951'628	EUR	978'000
DAT008833	DTG CHF/USD 08.09.2023	08/09/2023	CHF	12'548'382	USD	14'000'000
DAT008834	DTG EUR/CHF 12.06.2023	12/06/2023	EUR	2'408'000	CHF	2'338'999
DAT008837	DTG EUR/CHF 11.06.2023	11/06/2023	EUR	2'413'000	CHF	2'355'964
DAT009228	DTG CHF/USD 07.12.2023	07/12/2023	CHF	12'322'016	USD	14'000'000
DAT009694	DTG CHF/USD 15.12.2023	15/12/2023	CHF	12'250'000	USD	14'000'000
DAT009732	DTG CHF/USD 16.01.2024	16/01/2024	CHF	12'222'000	USD	14'000'000

ID	Titelbezeichnung	Anfangsbestand per 31.12.2022	Kauf	Verkauf	Schlussbestand per 31.12.2023
----	------------------	-------------------------------	------	---------	-------------------------------

Optionen

keine

| 10

ID	Titelbezeichnung	Anfangsbestand per 31.12.2022	Kauf	Verkauf	Schlussbestand per 31.12.2023
----	------------------	-------------------------------	------	---------	-------------------------------

Futures

Futures		0	0	0	0
Indexe		0	0	0	0
MSCIEM0323	MSCI Emerging Market	-246	246	0	0
MSCIEM0623	MSCI Emerging Market	0	246	246	0
MSCIEM0923	MSCI Emerging Market	0	511	511	0
ZWP0323	MSCI WORLD INDEX	-343	712	369	0
ZWP0623	MSCI WORLD INDEX	0	354	354	0
ZWP0923	MSCI WORLD INDEX	0	366	366	0
ZWP1223	MSCI WORLD INDEX	0	178	178	0

ID	Titelbezeichnung	Anfangsbestand per 31.12.2022	Kauf	Verkauf	Schlussbestand per 31.12.2023
----	------------------	-------------------------------	------	---------	-------------------------------

Swap-Geschäfte (inkl. Roll-overs)

keine

ERGÄNZENDE INFORMATIONEN

| ANGABEN ZU DERIVATEN

Angaben zu Geschäften mit Derivaten in der Berichtsperiode finden sich im Bericht über die Tätigkeiten des jeweiligen Teilfonds.

Weitere Informationen zum Exposure

Position	CHF	In %
Total engagementerhöhende Positionen	0.00	0.00
Total engagementreduzierende Positionen	0.00	0.00

Position	CHF	In %
Brutto Gesamtengagement aus Derivaten	11'760'868	25.45
Netto Gesamtengagement aus Derivaten	0.00	0.00
Engagement aus Effektenleihe und Pensionsgeschäften	0.00	0.00

| DREIJAHRESVERGLEICH

Prosperis Aktiensignal – CHF	29.09.2021	31.12.2022	31.12.2023
Nettofondsvermögen in CHF	29'234'900	41'052'043	46'214'557
Total ausstehende Anteile	292'349.000	443'808.000	479'524.824
Inventarwert je Anteil in CHF	100.00	92.50	96.38

| 11

| FONDSRENDITE^{3 4}

Prosperis Aktiensignal - Klasse CHF	Fonds
31.12.2022 - 31.12.2023	4.67%
31.12.2021 - 31.12.2022	-10.24%
Seit Lancierung (23.09.2021 - 31.12.2023, kumulativ)	-3.18%

³ 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. Die Performance wird unter Berücksichtigung etwaiger Ausschüttungen ausgewiesen.

⁴ Per Kalenderjahrende

BRANCHENVERTEILUNG

Branche	CHF	in %
Anlagefonds	42'686'160.34	92.30
Andere	461'132.00	1.00
Total	43'147'292.34	93.30

KOSTENINFORMATIONEN

Prosperis Aktiensignal

Vergütungen	
All in Fee ⁵	Klasse CHF: 0.075% p.a. (max. 1.00% p.a.)
Performance Fee	keine
Verwaltungskommission der Zielfonds	1.22% (maximal)

Aus der obengenannten Verwaltungskommission werden nach Massgabe der sachbezüglichen Richtlinien der Asset Management Association Switzerland (AMAS) Rückvergütungen an institutionelle Anleger, die Fondsanteile wirtschaftlich für Dritte halten, und Vertriebsentschädigungen an Vertriebssträger und Vertriebspartner bezahlt.

TER

Die synthetische Total Expense Ratio (TER) betrug in der Berichtsperiode:

Fonds	In %
Prosperis Aktiensignal – CHF	0.67

Die synthetische Total Expense Ratio unter Berücksichtigung der Performance Fee (TER inkl. PF) betrug in der Berichtsperiode:

Fonds	In %
Prosperis Aktiensignal – CHF	0.67

TRANSAKTIONSKOSTEN

Die Transaktionskosten betragen in der Berichtsperiode:

Fonds	Betrag
Prosperis Aktiensignal – CHF	CHF 31'969

HINWEIS AUF SOFT COMMISSIONS AGREEMENTS

Die Fondsleitung hat keine Vereinbarung bezüglich so genannter "soft commissions" geschlossen.

⁵ In der Berichtsperiode wurden zusätzlich CHF 20'000.- p.a. als Depotbankfix Gebühr gezahlt

| GRUNDSÄTZE FÜR DIE BEWERTUNG SOWIE DIE BERECHNUNG DES NETTOINVENTARWERTES

Die Bewertung erfolgt gemäss den Vorgaben aus § 16 des Fondsvertrages.

§ 16 Berechnung des Bewertungs-Nettoinventarwertes und des modifizierten Nettoinventarwertes

1. Der Bewertungs-Nettoinventarwert und der modifizierte Nettoinventarwert jedes Teilvermögens und der Anteil der einzelnen Klassen (Quoten) wird zum Verkehrswert auf Ende des Rechnungsjahres sowie für jeden Tag, an dem Anteile ausgegeben oder zurückgenommen werden, in der jeweiligen Rechnungseinheit des Teilvermögens bzw. der Anteilklasse berechnet. Für Tage, an welchen die Börsen bzw. Märkte der Hauptanlageländer der Teilvermögen geschlossen sind (z.B. Banken- und Börsenfeiertage), findet keine Berechnung des Vermögens des jeweiligen Teilvermögens statt.
2. An einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offenstehenden Markt gehandelte Anlagen 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 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 offenstehenden 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, sukzessiv 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 Bewertungs-Nettoinventarwert eines Anteils einer Klasse ergibt sich aus der der betreffenden Anteilklasse am Verkehrswert des Vermögens dieses Teilvermögens zukommenden Quote, vermindert um allfällige Verbindlichkeiten dieses Teilvermögens, die der betreffenden Anteilklasse zugeteilt sind, dividiert durch die Anzahl der im Umlauf befindlichen Anteile der entsprechenden Anteilklasse. Er wird auf 1/100 (zwei Stellen nach dem Komma) der Rechnungseinheit der jeweiligen Anteilklasse gerundet.
7. Falls an einem Auftragstag die Summe der Zeichnungen und Rücknahmen aller Anteilklassen eines einzelnen Teilvermögens zu einem Nettovermögenszufluss bzw. -abfluss des Teilvermögens führt, wird der Bewertungs-Nettoinventarwert aller Anteilklassen erhöht bzw. reduziert (Swinging Single Pricing). Die maximale Anpassung beläuft sich auf 1% des Bewertungs-Nettoinventarwertes der jeweiligen Anteilklasse. Berücksichtigt werden die Nebenkosten (Geld/Brief-Spanne, marktconforme Courtagen, Kommissionen, Abgaben usw.), die im Durchschnitt aus der Anlage des Nettovermögenszuflusses bzw. aus dem Verkauf des dem Nettovermögensabfluss entsprechenden Teils der Anlage erwachsen. Die Anpassung führt zu einer Erhöhung des Bewertungs-Nettoinventarwertes aller Anteilklassen, wenn die Nettobewegungen zu einem Anstieg des Nettofondsvermögens führen. Die Anpassung resultiert in einer Verminderung des Bewertungs-Nettoinventarwertes aller Anteilklassen, wenn die Nettobewegungen einen Rückgang des Nettofondsvermögens bewirken. Der unter Anwendung des Swinging Single Pricing ermittelte modifizierte

Nettoinventarwert ist somit gegenüber dem Bewertungs-Nettoinventarwert der jeweiligen Anteilklasse um die durchschnittlichen Nebenkosten modifiziert.

Die Fondsleitung kann, anstelle der oben erwähnten durchschnittlichen Nebenkosten bei der Anpassung auch die tatsächliche Höhe der Nebenkosten berücksichtigen, sofern dies unter Berücksichtigung der relevanten Umstände (z.B. Höhe des Betrags, allgemeine Marktsituation, spezifische Marktsituation für die betreffende Anlageklasse) im Ermessen der Fondsleitung angemessen erscheint. Die Anpassung kann in einem solchen Fall höher oder tiefer als die durchschnittlichen Nebenkosten ausfallen.

In den in § 17 Ziff. 4 genannten sowie in sonstigen ausserordentlichen Fällen kann, sofern dies nach Ansicht der Fondsleitung im Interesse der Gesamtheit der Anleger geboten ist, zudem der Höchstwert von 1% des Nettoinventarwerts überschritten werden. Die Fondsleitung teilt den Entscheid über die Überschreitung unverzüglich der Prüfgesellschaft, der Aufsichtsbehörde sowie in angemessener Weise den bestehenden und neuen Anlegern mit.

8. Die Quoten am Verkehrswert des Nettoteilvermögens (Vermögen des Teilvermögens abzüglich der Verbindlichkeiten), welche den jeweiligen Anteilsklassen zuzurechnen sind, werden erstmals bei der Erstaussgabe mehrerer Anteilsklassen (wenn diese gleichzeitig erfolgt) oder der Erstaussgabe einer weiteren Anteilsklasse auf der Basis der dem Umbrella-Fonds bzw. dem Teilvermögen 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 einzelnen 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;
 - 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 Nettoteilvermögen, getätigt wurden.

| RECHTLICH UND WIRTSCHAFTLICH BEDEUTENDE ANGABEN

Verwaltungsrat der 1741 Fund Solutions AG

Person	Funktion
Markus Wagner, CEO 1741 Fund Management AG	Präsident
Dr. Benedikt Czok, CEO 1741 Fund Solutions AG	Vizepräsident
Dr. André E. Lebrecht, Partner bei CMS von Erlach Poncet AG	Mitglied
Adrian Gautschi, Geschäftsführer Gautschi Advisory GmbH	Mitglied

Geschäftsleitung der 1741 Fund Solutions AG

Person	Funktion
Dr. Benedikt Czok	CEO
Alfred Gmünder	Head Operations & CFO

Informationen über Dritte

Delegation der Anlageentscheide

Die Anlageentscheide des Anlagefonds wurden ab dem 19. Juli 2023 an die Prosperis Sustainable Wealth Management AG, Oberdorfstrasse 8, CH 8001 Zürich, übertragen. Die Prosperis Sustainable Wealth Management AG ist ein Vermögensverwalter gemäss Art. 17 des Bundesgesetzes über die Finanzinstitute (FINIG); sie wird als solche in der Schweiz durch die Eidgenössische Finanzmarktaufsicht (FINMA) bewilligt und untersteht der laufenden Aufsicht durch eine von der FINMA bewilligte Aufsichtsorganisation.

Delegation weiterer Teilaufgaben

Keine.

FATCA

Das Teilvermögen ist bei den US-Steuerbehörden als "Registered Deemed-Compliant Financial Institution" (GIIN: CFDHMH.99999.SL.756) im Sinne der Sections 1471 – 1474 des U.S. Internal Revenue Code (Foreign Account Tax Compliance Act, einschliesslich diesbezüglicher Erlasse, "FATCA") angemeldet.

Wesentliche Änderungen in der Berichtsperiode

Eine Änderung des Fondsvertrags wurde den Anlegern am 6. Juli 2023 im Publikationsorgan des Anlagefonds mitgeteilt und am 17. Juli 2023 von der Aufsichtsbehörde genehmigt. Die Fondsvertragsänderungen sind per 19. Juli 2023 in Kraft getreten. Der Fondsvertrag wurde in folgenden Punkten geändert:

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

Die Vermögensverwaltung der Teilvermögen (aktuell «Prosperis Aktiensignal») wurde neu von der Prosperis Sustainable Wealth Management AG übernommen.

Streichung der Anteilsklasse «EUR»

Die Anteilsklasse „EUR“ wurde gestrichen.

**Kurzbericht der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft
an den Verwaltungsrat der Fondsleitung zur Prüfung der Jahresrechnung des
Umbrella-Fonds Prosperis Investment Funds****Prüfungsurteil**

Wir haben die Jahresrechnung des Anlagefonds Prosperis Investment Funds mit dem Teilvermögen
- Prosperis Aktiensignal

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) (Seiten 4 bis 15 des Jahresberichts) geprüft.

Nach unserer Beurteilung entspricht die beigefügte Jahresrechnung dem schweizerischen Kollektivanlagengesetz, den dazugehörigen Verordnungen sowie dem Fondsvertrag.

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.

Sonstige Informationen

Der Verwaltungsrat der Fondsleitung ist für die sonstigen Informationen verantwortlich. Die sonstigen Informationen umfassen die im Jahresbericht enthaltenen Informationen, aber nicht die Jahresrechnung und unseren dazugehörigen Bericht.

Unser Prüfungsurteil zur Jahresrechnung erstreckt sich nicht auf die sonstigen Informationen, und wir bringen keinerlei Form von Prüfungsschlussfolgerung hierzu zum Ausdruck.

Im Zusammenhang mit unserer Abschlussprüfung haben wir die Verantwortlichkeit, die sonstigen Informationen zu lesen und dabei zu würdigen, ob die sonstigen Informationen wesentliche Unstimmigkeiten zur Jahresrechnung oder unseren bei der Abschlussprüfung erlangten Kenntnissen aufweisen oder anderweitig wesentlich falsch dargestellt erscheinen.

Falls wir auf Grundlage der von uns durchgeführten Arbeiten den Schluss ziehen, dass eine wesentliche falsche Darstellung dieser sonstigen Informationen vorliegt, sind wir verpflichtet, über diese Tatsache zu berichten. Wir haben in diesem Zusammenhang nichts zu berichten.

Verantwortlichkeiten des Verwaltungsrates 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 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 einzeln 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 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.

Zürich, 5. April 2024
Grant Thornton AG

Markus Eugster
Revisionsexperte
(Leitender Revisor)

Nicole Schwarzenbach
Revisionsexpertin