

Swisscanto (LU) Bond Fund

Jahresbericht mit geprüftem Jahresabschluss per 31.01.2024

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

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

Depotbank: CACEIS Investor Services Bank S.A.

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

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

Bericht des Réviseur d'entreprises agréé

An die Anteilscheininhaber des
Swisscanto (LU) Bond Fund

Prüfungsurteil

Wir haben den Jahresabschluss des Swisscanto (LU) Bond Fund (der „Fonds“) und für jeden seiner jeweiligen Teilfonds - bestehend aus der Vermögensaufstellung zum 31. Januar 2024 sowie der Ertrags- und Aufwandsrechnung und andere Veränderungen des Nettovermögens für das an diesem Datum endende Geschäftsjahr sowie dem Anhang mit einer Zusammenfassung bedeutsamer Rechnungslegungsmethoden - geprüft.

Nach unserer Beurteilung vermittelt der beigefügte Jahresabschluss in Übereinstimmung mit den in Luxemburg geltenden gesetzlichen Bestimmungen und Verordnungen betreffend die Aufstellung und Darstellung des Jahresabschlusses ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild der Vermögens- und Finanzlage des Fonds und jeder seiner Teilfonds zum 31. Januar 2024 sowie ihrer Ertragslage und ihrer Entwicklung des Nettofondsvermögens für das an diesem Datum endende Geschäftsjahr.

Grundlage für das Prüfungsurteil

Wir führten unsere Abschlussprüfung in Übereinstimmung mit dem Gesetz über die Prüfungstätigkeit (Gesetz vom 23. Juli 2016) und nach den für Luxemburg von der Commission de Surveillance du Secteur Financier („CSSF“) angenommenen internationalen Prüfungsstandards („ISA“) durch. Unsere Verantwortung gemäß dem Gesetz vom 23. Juli 2016 und den ISA-Standards, wie sie in Luxemburg von der CSSF angenommen wurden, wird im Abschnitt „Verantwortung des Réviseur d'entreprises agréé für die Jahresabschlussprüfung“ weitergehend beschrieben. Wir sind auch unabhängig von der Gesellschaft in Übereinstimmung mit dem für Luxemburg von der CSSF angenommenen „International Code of Ethics for Professional Accountants, including International Independence Standards“, herausgegeben vom „International Ethics Standards Board for Accountants“ (IESBA Code), zusammen mit den beruflichen Verhaltensanforderungen, welche wir im Rahmen der Jahresabschlussprüfung einzuhalten haben und haben alle sonstigen Berufspflichten in Übereinstimmung mit diesen Verhaltensanforderungen erfüllt. Wir sind der Auffassung, dass die von uns erlangten Prüfungsnachweise ausreichend und geeignet sind, um als Grundlage für unser Prüfungsurteil zu dienen.

Sonstige Informationen

Der Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft ist verantwortlich für die sonstigen Informationen. Die sonstigen Informationen beinhalten die Informationen, welche im Jahresbericht enthalten sind, jedoch beinhalten sie nicht den Jahresabschluss oder unseren Bericht des Réviseur d'entreprises agréé zu diesem Jahresabschluss.

Unser Prüfungsurteil zum Jahresabschluss deckt nicht die sonstigen Informationen ab und wir geben keinerlei Sicherheit jedweder Art auf diese Informationen.

Im Zusammenhang mit der Prüfung des Jahresabschlusses besteht unsere Verantwortung darin, die sonstigen Informationen zu lesen und dabei zu beurteilen, ob eine wesentliche Unstimmigkeit zwischen diesen und dem Jahresabschluss oder mit den bei der Abschlussprüfung gewonnenen Erkenntnissen besteht oder auch ansonsten die sonstigen Informationen wesentlich falsch dargestellt erscheinen. Sollten wir auf Basis der von uns durchgeführten Arbeiten schlussfolgern, dass sonstige Informationen wesentliche falsche Darstellungen enthalten, sind wir verpflichtet, diesen Sachverhalt zu berichten. Wir haben diesbezüglich nichts zu berichten.

Verantwortung des Verwaltungsrats der Verwaltungsgesellschaft für den Jahresabschluss

Der Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft ist verantwortlich für die Aufstellung und sachgerechte Gesamtdarstellung des Jahresabschlusses in Übereinstimmung mit den in Luxemburg geltenden gesetzlichen Bestimmungen und Verordnungen zur Aufstellung und Darstellung des Jahresabschlusses und für die internen Kontrollen, die der Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft als notwendig erachtet, um die Aufstellung des Jahresabschlusses zu ermöglichen, der frei von wesentlichen - beabsichtigten oder unbeabsichtigten - falschen Darstellungen ist.

Bei der Aufstellung des Jahresabschlusses ist der Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft verantwortlich für die Beurteilung der Fähigkeit des Fonds und jeder seiner Teilfonds zur Fortführung der Unternehmenstätigkeit und - sofern einschlägig - Angaben zu Sachverhalten zu machen, die im Zusammenhang mit der Fortführung der Unternehmenstätigkeit stehen, und die Annahme der Unternehmensfortführung als Rechnungslegungsgrundsatz zu nutzen, sofern nicht der Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft beabsichtigt den Fonds oder einen seiner Teilfonds zu liquidieren, die Geschäftstätigkeit einzustellen oder keine andere realistische Alternative mehr hat, als so zu handeln.

Verantwortung des Réviseur d'entreprises agréé für die Jahresabschlussprüfung

Die Zielsetzung unserer Prüfung ist es, eine hinreichende Sicherheit zu erlangen, ob der Jahresabschluss als Ganzes frei von wesentlichen - beabsichtigten oder unbeabsichtigten - falschen Darstellungen ist und darüber einen Bericht des Réviseur d'entreprises agréé, welcher unser Prüfungsurteil enthält, zu erteilen. Hinreichende Sicherheit entspricht einem hohen Grad an Sicherheit, ist aber keine Garantie dafür, dass eine Prüfung in Übereinstimmung mit dem Gesetz vom 23. Juli 2016 und nach den für Luxemburg von der CSSF angenommenen ISAs stets eine wesentliche falsche Darstellung, falls vorhanden, aufdeckt. Falsche Darstellungen können entweder aus Unrichtigkeiten oder aus Verstößen resultieren und werden als wesentlich angesehen, wenn vernünftigerweise davon ausgegangen werden kann, dass diese individuell oder insgesamt, die auf der Grundlage dieses Jahresabschlusses getroffenen wirtschaftlichen Entscheidungen von Adressaten beeinflussen.

Im Rahmen einer Abschlussprüfung in Übereinstimmung mit dem Gesetz vom 23. Juli 2016 und nach den für Luxemburg von der CSSF angenommenen ISAs üben wir unser pflichtgemäßes Ermessen aus und bewahren eine kritische Grundhaltung. Darüber hinaus:

- Identifizieren und beurteilen wir das Risiko von wesentlichen falschen Darstellungen im Jahresabschluss aus Unrichtigkeiten oder Verstößen, planen und führen Prüfungshandlungen durch als Antwort auf diese Risiken und erlangen Prüfungsnachweise, die ausreichend und angemessen sind, um als Grundlage für das Prüfungsurteil zu dienen. Das Risiko, dass wesentliche falsche Darstellungen nicht aufgedeckt werden, ist bei Verstößen höher als bei Unrichtigkeiten, da Verstöße betrügerisches Zusammenwirken, Fälschungen, beabsichtigte Unvollständigkeiten, irreführende Angaben bzw. 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 Fonds abzugeben.
- Beurteilen wir die Angemessenheit der von dem Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft angewandten Bilanzierungsmethoden, der rechnungslegungsrelevanten Schätzungen und den entsprechenden Anhangangaben.
- Schlussfolgern wir über die Angemessenheit der Anwendung des Rechnungslegungsgrundsatzes der Fortführung der Unternehmenstätigkeit durch den Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft sowie auf der Grundlage der erlangten Prüfungsnachweise, ob eine wesentliche Unsicherheit im Zusammenhang mit Ereignissen oder Gegebenheiten besteht, die bedeutsame Zweifel an der Fähigkeit des Fonds oder einem seiner Teilfonds zur Fortführung der Unternehmenstätigkeit aufwerfen könnten. Sollten wir schlussfolgern, dass eine wesentliche Unsicherheit besteht, sind wir verpflichtet im Bericht des Réviseur d'entreprises agréé auf die dazugehörigen Anhangangaben zum Jahresabschluss hinzuweisen oder, falls die Angaben unangemessen sind, das Prüfungsurteil zu modifizieren. Diese Schlussfolgerungen basieren auf der Grundlage der bis zum Datum des Berichts des Réviseur d'entreprises agréé erlangten Prüfungsnachweise. Zukünftige Ereignisse oder Gegebenheiten können jedoch dazu führen, dass der Fonds oder einer seiner Teilfonds seine Unternehmenstätigkeit nicht mehr fortführen kann.
- Beurteilen wir die Gesamtdarstellung, den Aufbau und den Inhalt des Jahresabschlusses einschließlich der Anhangangaben und beurteilen, ob dieser die zugrundeliegenden Geschäftsvorfälle und Ereignisse sachgerecht darstellt.

Wir kommunizieren mit den für die Überwachung Verantwortlichen, unter anderem den geplanten Prüfungsumfang und Zeitraum sowie wesentliche Prüfungsfeststellungen einschließlich wesentlicher Schwächen im internen Kontrollsystem, welche wir im Rahmen der Prüfung identifizieren.

Ernst & Young
Société anonyme
Cabinet de révision agréé



Nadia Faber

Luxemburg, den 30. Mai 2024

Inhaltsverzeichnis

| | | |
|----|---|-----|
| 1 | Verwaltung und Organe | 6 |
| 2 | Allgemeine Informationen | 8 |
| 3 | Aktivitätsbericht | 9 |
| 4 | Vermögensaufstellung | 41 |
| 5 | Ertrags- und Aufwandsrechnung und andere Veränderungen des Nettovermögens | 53 |
| 6 | Statistik | 58 |
| 7 | Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible COCO | 69 |
| 8 | Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Corporate Hybrid | 73 |
| 9 | Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Emerging Markets Opportunities | 76 |
| 10 | Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Absolute Return | 81 |
| 11 | Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Convertible | 88 |
| 12 | Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Corporate | 93 |
| 13 | Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Rates | 100 |
| 14 | Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Secured High Yield | 104 |
| 15 | Swisscanto (LU) Bond Fund Sustainable Global Credit | 110 |
| 16 | Swisscanto (LU) Bond Fund Sustainable Global High Yield | 117 |
| 17 | Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible AUD | 122 |
| 18 | Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible CAD | 126 |
| 19 | Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible CHF | 129 |
| 20 | Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible EUR | 134 |
| 21 | Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible GBP | 140 |
| 22 | Swisscanto (LU) Bond Fund Sustainable Global Aggregate | 143 |
| 23 | Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible USD | 150 |
| 24 | Erläuterungen | 154 |
| 25 | Ungeprüfte Informationen | 179 |

1 Verwaltung und Organe

Verwaltungsgesellschaft

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

Verwaltungsrat

Präsident

Hans Frey, Schweiz, Geschäftsführer Swisscanto Fondsleitung AG, Zürich

Mitglieder

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

Geschäftsführung

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

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

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

Portfolio Manager

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

Zahl- und Vertriebsstellen

Deutschland

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

Liechtenstein

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

Luxemburg

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

Österreich

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

Zahlstelle in der Schweiz

Basler Kantonalbank
Spiegelgasse 2, CH-4002 Basel

Vertreterstelle in der Schweiz

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

Unabhängiger Wirtschaftsprüfer

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

2 Allgemeine Informationen

Anlagefonds nach luxemburgischem Recht „Umbrella Construction“

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

Die Vertragsbedingungen des Anlagefonds wurden am 30. Oktober 1991 von der Verwaltungsgesellschaft festgesetzt. Es erfolgten mehrere Änderungen, die entsprechend den Vertragsbedingungen im „Mémorial“ publiziert wurden.

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

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

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

Verkaufsbeschränkungen

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

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

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

Risikomanagementverfahren

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

3 Aktivitätsbericht

Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible AUD

1. Marktübersicht

Eine verfrühte Jahresend-Rally hat seit November 2023 die Mehrzahl der Investoren mit einem wechselhaften Anlageperiode vom Februar 2023 bis Januar 2024 versöhnt. Mit viel Euphorie sind die Finanzmärkte gestartet und das obwohl zu Beginn des Jahres das baldige Eintreten einer globalen Rezession dem Marktkonsens entsprach. Doch die teils prognostizierte Energiekrise wurde dank eines milden Winters vermieden und insbesondere in den USA sorgte der überraschend robuste Konjunkturverlauf für die nötige Stütze der Aktienmärkte. Weder weitere Leitzinserhöhungen in praktisch allen entwickelten Regionen (Ausnahme Japan) noch die Turbulenzen im Bankensektor konnten für eine nachhaltige Umkehr dieses positiven Trends sorgen.

Ebenfalls unterstützend wirkten die meist tiefer als erwartet publizierten Inflationszahlen und es zeigte sich zunehmend, dass der Kampf gegen die mancherorts aus dem Ruder gelaufene Preissteigerung bald gewonnen werden dürfte. Entsprechend wurde bereits früh im Jahr über mögliche Zinsgipfel oder sogar etwaige Zinssenkungen zum Jahresende spekuliert. Die erste Hälfte der Berichtsperiode zeigte somit zumindest auf den ersten Blick eine herausragende Performance, gerade für amerikanische Aktien. Bei näherer Betrachtung blieb jedoch die Konklusion, dass primär der Hype um künstliche Intelligenz und die damit eng verbundene Wertsteigerung von sieben US Mega-Caps für die stark positive Differenz sorgte.

Nach dem Sommer belastete insbesondere die auf sich warten lassende (leichte) Rezession, die auch die Türen zu weniger hohen Zinsen aufgestossen hätte. Bei sichtbar rückläufigen Inflationsraten hat jüngst aber die amerikanische Notenbank Fed erneute Zinssenkungsfantasien aufkommen lassen und damit die Finanzmärkte zum Jahresschluss nochmals beflügelt. In diesem Umfeld verzeichneten Anleihen als auch Aktien deutliche Gewinne während der US-Dollar als auch der Euro gegenüber dem Schweizer Franken nachgaben.

2. Rückblick auf für den Fonds relevante Kategorien

Im letzten Jahr sind die Zinsen in vielen Währungen über den Berichtszeitraum angestiegen. In Australien verzeichnete die Rendite der 10-jährigen Staatsanleihe Anfang November 2023 mit knapp 5% einen neuen Höchststand seit 2011. Danach sanken diese wieder um ungefähr ein Prozent. Die Kreditprämien bewegten sich in Australien unter hoher Volatilität nach unten.

3. Performancerückblick

Der Fonds antizipierte den Zinsanstieg, war aber von dessen weiten Aufschlägen noch oben dann doch überrascht. Da die Zinsen und Kreditprämien aber schon zuvor ansprechende Levels erreicht hatten, resultierte eine ansprechende absolute Performance. Dank der aktiven Zinssteuerung und der ausgewogenen Kreditallokation konnte der Fonds die Benchmark Brutto übertreffen.

| Klasse | ISIN | Valor | Distribution | Performance in % |
|--------|--------------|-----------|--------------|------------------|
| AA | LU0141247303 | 001363630 | Pay out | 1.99 |
| AT | LU0161529945 | 001544305 | Accumulate | 1.98 |
| BT | LU0999468225 | 23101408 | Accumulate | 2.36 |
| CT | LU1663701321 | 37844019 | Accumulate | 2.47 |
| DT | LU1495640127 | 34048568 | Accumulate | 2.64 |
| GT | LU0899937097 | 20854819 | Accumulate | 2.70 |

Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible CAD

1. Marktübersicht

Eine verfrühte Jahresend-Rally hat seit November 2023 die Mehrzahl der Investoren mit einem wechselhaften Anlageperiode vom Februar 2023 bis Januar 2024 versöhnt. Mit viel Euphorie sind die Finanzmärkte gestartet und das obwohl zu Beginn des Jahres das baldige Eintreten einer globalen Rezession dem Marktkonsens entsprach. Doch die teils prognostizierte Energiekrise wurde dank eines milden Winters vermieden und insbesondere in den USA sorgte der überraschend robuste Konjunkturverlauf für die nötige Stütze der Aktienmärkte. Weder weitere Leitzinserhöhungen in praktisch allen entwickelten Regionen (Ausnahme Japan) noch die Turbulenzen im Bankensektor konnten für eine nachhaltige Umkehr dieses positiven Trends sorgen.

Ebenfalls unterstützend wirkten die meist tiefer als erwartet publizierten Inflationszahlen und es zeigte sich zunehmend, dass der Kampf gegen die mancherorts aus dem Ruder gelaufene Preissteigerung bald gewonnen werden dürfte. Entsprechend wurde bereits früh im Jahr über mögliche Zinsgipfel oder sogar etwaige Zinssenkungen zum Jahresende spekuliert. Die erste Hälfte der Berichtsperiode zeigte somit zumindest auf den ersten Blick eine herausragende Performance, gerade für amerikanische Aktien. Bei näherer Betrachtung blieb jedoch die Konklusion, dass primär der Hype um künstliche Intelligenz und die damit eng verbundene Wertsteigerung von sieben US Mega-Caps für die stark positive Differenz sorgte.

Nach dem Sommer belastete insbesondere die auf sich warten lassende (leichte) Rezession, die auch die Türen zu weniger hohen Zinsen aufgestossen hätte. Bei sichtbar rückläufigen Inflationsraten hat jüngst aber die amerikanische Notenbank Fed erneute Zinssenkungsfantasien aufkommen lassen und damit die Finanzmärkte zum Jahresschluss nochmals beflügelt. In diesem Umfeld verzeichneten Anleihen als auch Aktien deutliche Gewinne während der US-Dollar als auch der Euro gegenüber dem Schweizer Franken nachgaben.

2. Rückblick auf für den Fonds relevante Kategorien

Am Anfang der Berichtsperiode schienen die Notenbanken ihr Narrativ von «höheren Zinsen für länger» erfolgreich an den Märkten etabliert zu haben. Das Schreckgespenst eines dritten Jahres in Folge mit negativer Gesamtrendite wurde für globale Staatsanleihen immer realistischer. Unterstützt durch ausgabefreudige Konsumentinnen und Konsumenten und einen resilienten Arbeitsmarkt in den USA sowie auf hohem Niveau verharrenden Inflationszahlen, kletterten die Zinsen beidseits des Atlantiks weiter in die Höhe. Die Marktreaktion auf die gestiegenen geopolitischen Risiken durch den verheerenden Terrorangriff auf Israel war verhalten. Die Zinsen fielen nur vorübergehend, und der Ölpreis bewegte sich kaum. Die Zinsvolatilität blieb sehr hoch und erreichte Ende Oktober einen Höhepunkt, als die Rendite der zehnjährigen US-Staatsanleihen zum ersten Mal seit 2007 die Fünfprozent-Marke überschritt. Der erste Novembertag brachte dann einen kompletten Stimmungsumschwung: Nachdem die Europäische Zentralbank (EZB) und die Bank of Japan keine Zinsänderung vorgenommen hatten, liess auch die amerikanische Fed an ihrer regulären Sitzung wie erwartet die Zinsen unverändert. Die anschliessende Pressekonferenz von Jerome Powell markierte aber einen Wendepunkt (Pivot) für die Märkte. Die Investoren interpretierten seine Aussagen dahingehend, dass die Fed keine weiteren Zinserhöhungen plane und vielmehr bald erste Zinssenkungen bevorstünden. Die schwachen Konjunkturdaten und die hinter den Erwartungen zurückbleibenden Neuemissionspläne für US-Staatsanleihen liessen die Aktienmärkte kräftig steigen und die Rendite der zehnjährigen US-Staatsanleihen fallen. Dies war nur der Anfang einer sich selbst verstärkenden Bewegung, die bis zum Ende der Berichtsperiode andauerte. Damit wurde der November der beste Monat für den US-Anleihenmarkt in den vergangenen 40 Jahren. Mindestens zum siebten Mal in diesem Zinszyklus spekulierten die Märkte auf eine Trendwende der Zentralbanken in Richtung expansive Politik. Doch die Hoffnungen auf baldige Zinssenkungen wurden bisher regelmässig enttäuscht. Diesmal wurde die Rallye in allen Anlageklassen in den letzten zwei Monaten des Jahres jedoch von einer Reihe technischer Faktoren und Verhaltensmuster der Investoren befeuert. So waren die meisten Marktplayer bis Ende Oktober nämlich defensiv positioniert und hielten hohe Bargeldbestände. Sie wurden von den steigenden Kursen risikobehafteter Aktiva und den fallenden Zinsen überrascht. Entsprechend mussten sie ihre Short-Positionen schliessen und das Risiko in den Portfolios erhöhen. Die unterdessen attraktiven Ausgangsbewertungen und die Angst der Investoren, etwas zu verpassen (Fear of missing out, FOMO) trugen zum Kursfeuerwerk bei. An ihrer letzten Sitzung des Jahres 2023 Mitte Dezember hat die Fed auch nichts unternommen, um die Euphorie an den Märkten zu bremsen. Die vorsichtigeren Töne der EZB wurden ignoriert, wodurch viele Märkte innerhalb von nur zwei Monaten von Jahrestiefst- zu Jahreshöchstständen emporschnellten. Die CAD-Zinsen konnten sich dem internationalen Umfeld nicht entziehen, obwohl die Bank of Canada früher als die Fed eine Pause im Zinserhöhungszyklus einlegte und seit Juli 2023 ihren Leitzins unverändert bei 5% belies.

3. Performancerückblick

Die absolute Fondspersformance sowie die relative gegenüber Benchmark fiel in der Berichtsperiode positiv aus. Absolut und relativ war durch die Positionierung auf der CAD-Zinskurve - mit den höheren Sätzen bei kurzen Laufzeiten als langen Laufzeiten geprägt. Die Titelselektion - keine Ausfälle - und das generelle Einengen der Spreads von Unternehmensanleihen gegenüber Staatsanleihen trugen ebenfalls positiv zur Performance bei. Das Engagement um verschiedene Risikoprämien wie High Yield, Coco und Emerging Marktes abzuschöpfen, hat sich einmal mehr bewährt.

| Klasse | ISIN | Valor | Distribution | Performance in % |
|--------|--------------|-----------|--------------|------------------|
| AA | LU0141247725 | 001363633 | Pay out | 1.73 |
| AT | LU0161530109 | 001544299 | Accumulate | 1.72 |
| CT | LU1663701677 | 37844026 | Accumulate | 2.20 |
| DT | LU1495640044 | 34048567 | Accumulate | 2.24 |
| GT | LU0899937170 | 20855043 | Accumulate | 2.39 |

Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible COCO

1. Marktübersicht

Eine verfrühte Jahresend-Rally hat seit November 2023 die Mehrzahl der Investoren mit einem wechselhaften Anlageperiode vom Februar 2023 bis Januar 2024 versöhnt. Mit viel Euphorie sind die Finanzmärkte gestartet und das obwohl zu Beginn des Jahres das baldige Eintreten einer globalen Rezession dem Marktkonsens entsprach. Doch die teils prognostizierte Energiekrise wurde dank eines milden Winters vermieden und insbesondere in den USA sorgte der überraschend robuste Konjunkturverlauf für die nötige Stütze der Aktienmärkte. Weder weitere Leitzinserhöhungen in praktisch allen entwickelten Regionen (Ausnahme Japan) noch die Turbulenzen im Bankensektor konnten für eine nachhaltige Umkehr dieses positiven Trends sorgen.

Ebenfalls unterstützend wirkten die meist tiefer als erwartet publizierten Inflationszahlen und es zeigte sich zunehmend, dass der Kampf gegen die mancherorts aus dem Ruder gelaufene Preissteigerung bald gewonnen werden dürfte. Entsprechend wurde bereits früh im Jahr über mögliche Zinsgipfel oder sogar etwaige Zinssenkungen zum Jahresende spekuliert. Die erste Hälfte der Berichtsperiode zeigte somit zumindest auf den ersten Blick eine herausragende Performance, gerade für amerikanische Aktien. Bei näherer Betrachtung blieb jedoch die Konklusion, dass primär der Hype um künstliche Intelligenz und die damit eng verbundene Wertsteigerung von sieben US Mega-Caps für die stark positive Differenz sorgte.

Nach dem Sommer belastete insbesondere die auf sich warten lassende (leichte) Rezession, die auch die Türen zu weniger hohen Zinsen aufgestossen hätte. Bei sichtbar rückläufigen Inflationsraten hat jüngst aber die amerikanische Notenbank Fed erneute Zinssenkungsfantasien aufkommen lassen und damit die Finanzmärkte zum Jahreschluss nochmals beflügelt. In diesem Umfeld verzeichneten Anleihen als auch Aktien deutliche Gewinne während der US-Dollar als auch der Euro gegenüber dem Schweizer Franken nachgaben.

2. Rückblick auf für den Fonds relevante Kategorien

Am Anfang der Berichtsperiode schienen die Notenbanken ihr Narrativ von «höheren Zinsen für länger» erfolgreich an den Märkten etabliert zu haben. Das Schreckgespenst eines dritten Jahres in Folge mit negativer Gesamtrendite wurde für globale Unternehmensanleihen immer realistischer. Unterstützt durch ausgabefreudige Konsumentinnen und Konsumenten und einen resilienten Arbeitsmarkt in den USA sowie auf hohem Niveau verharrenden Inflationszahlen, kletterten die Zinsen beidseits des Atlantiks weiter in die Höhe. Die Marktreaktion auf die gestiegenen geopolitischen Risiken durch den verheerenden Terrorangriff auf Israel war verhalten. Die Zinsen fielen nur vorübergehend, und der Ölpreis bewegte sich kaum. Die Zinsvolatilität blieb sehr hoch und erreichte Ende Oktober einen Höhepunkt, als die Rendite der zehnjährigen US-Staatsanleihen zum ersten Mal seit 2007 die Fünfprozent-Marke überschritt. Der kontinuierliche Anstieg der nominalen und realen Zinsen belastete die Aktienmärkte und führte zu einer Ausweitung der Credit Spreads. Der erste Novembertag brachte dann einen kompletten Stimmungsumschwung: Nachdem die Europäische Zentralbank (EZB) und die Bank of Japan keine Zinsänderung vorgenommen hatten, liess auch die amerikanische Fed an ihrer regulären Sitzung wie erwartet die Zinsen unverändert. Die anschließende Pressekonferenz von Jerome Powell markierte aber einen Wendepunkt (Pivot) für die Märkte. Die Investoren interpretierten seine Aussagen dahingehend, dass die Fed keine weiteren Zinserhöhungen plane und vielmehr bald erste Zinssenkungen bevorstünden. Die schwachen Konjunkturdaten und die hinter den Erwartungen zurückbleibenden Neuemissionspläne für US-Staatsanleihen liessen die Aktienmärkte kräftig steigen und die Rendite der zehnjährigen US-Staatsanleihen fallen. Dies war nur der Anfang einer sich selbst verstärkenden Bewegung, die bis zum Ende der Berichtsperiode andauerte. Damit wurde der November der beste Monat für den US-Anleihenmarkt in den vergangenen 40 Jahren. Mindestens zum siebten Mal in diesem Zinszyklus spekulierten die Märkte auf eine Trendwende der Zentralbanken in Richtung expansive Politik. Doch die Hoffnungen auf baldige Zinssenkungen wurden bisher regelmässig enttäuscht. Diesmal wurde die Rallye in allen Anlageklassen in den letzten zwei Monaten des Jahres jedoch von einer Reihe technischer Faktoren und Verhaltensmuster der Investoren befeuert. So waren die meisten Marktplayer bis Ende Oktober nämlich defensiv positioniert und hielten hohe Bargeldbestände. Sie wurden von den steigenden Kursen risikobehafteter Aktiva und den fallenden Zinsen überrascht. Entsprechend mussten sie ihre Short-Positionen schliessen und das Risiko in den Portfolios erhöhen. Die relativ attraktiven Ausgangsbewertungen und die Angst der Investoren, etwas zu verpassen (Fear of missing out, FOMO) trugen zum Kursfeuerwerk bei. An ihrer letzten Sitzung des Jahres 2023 Mitte Dezember hat die Fed auch nichts unternommen, um die Euphorie an den Märkten zu bremsen. Der breite US-Aktienindex S&P500 erreichte dadurch ein Allzeithöchst. Die vorsichtigeren Töne der EZB wurden ignoriert, wodurch viele Märkte innerhalb von nur zwei Monaten von Jahrestiefst- zu Jahreshöchstständen emporschnellten. Im Vergleich zum März 2022, als die Fed mit den Zinserhöhungen begonnen hatte, notieren die Aktienmärkte inzwischen wieder höher, die Spreads haben sich verengt und die impliziten Volatilitäten sind überall gesunken. Die so entstandenen finanziellen Rahmenbedingungen konterkarieren jedoch die Absichten der Zentralbanken, die Inflation unter Kontrolle zu halten und könnten sie dazu zwingen, die Zinsen später wieder zu erhöhen oder zumindest restriktivere Töne anzuschlagen. Die jüngsten Marktbewegungen fördern zudem einen weiteren Widerspruch zutage, nämlich jenen zwischen tiefen Zinsen (die einer schwächeren Wirtschaftsentwicklung entsprechen würden) und hohen Aktienbewertungen (die eine brummende Wirtschaft und steigende Unternehmensgewinne implizieren). Der einzige Ausweg aus diesem Dilemma wäre eine kontrollierte Abschwächung der Konjunktur (Soft Landing), die Zinssenkungen erlauben würde, bevor die hohen Zinsen weitere Unfälle verursachen. Dieses Soft-Landing-Szenario scheint nicht unmöglich. Doch das Risiko, dass es nicht gelingt, ist an den Märkten derzeit nicht eingepreist.

3. Performancerückblick

Der Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible COCO erzielte über die Berichtsperiode eine positive Performance, auch gegenüber der Benchmark waren wir besser. Die wichtigsten positiven Beiträge zur Relativperformance lieferten die Übergewichtung in AT1-Anleihen mit ersten Kündigungsterminen in einem bis fünf Jahren, die Untergewichtung in Credit Suisse und die

Übergewichtung in spanischen Banken. Die wichtigsten negativen Beiträge zur relativen Performance trugen die Untergewichtungen in britische Banken, französische Banken und AT1-Anleihen mit ersten Kündigungsterminen von null bis einem Jahr bei.

| Klasse | ISIN | Valor | Distribution | Performance in % |
|---------|--------------|-----------|--------------|------------------|
| AAH CHF | LU1100907903 | 25213529 | Pay out | 1.34 |
| AAH EUR | LU1057798107 | 24231395 | Pay out | 3.65 |
| AT | LU0599119962 | 012722636 | Accumulate | 5.75 |
| ATH CHF | LU0599119533 | 012722631 | Accumulate | 1.35 |
| ATH EUR | LU0599119707 | 012722634 | Accumulate | 3.66 |
| BTH CHF | LU0999470395 | 23102576 | Accumulate | 1.94 |
| BTH EUR | LU2071846757 | 50763564 | Accumulate | 0.33 |
| DAH EUR | LU2133081658 | 53096171 | Pay out | 4.42 |
| DT | LU0599120036 | 12722637 | Accumulate | 6.64 |
| DTH CHF | LU0599119616 | 12722632 | Accumulate | 2.20 |
| DTH EUR | LU1495639384 | 34048561 | Accumulate | 4.52 |
| DTH SEK | LU1495639467 | 34048562 | Accumulate | 4.50 |
| GT | LU0899937410 | 20855063 | Accumulate | 6.81 |
| GTH CHF | LU0866336398 | 20261056 | Accumulate | 2.35 |
| GTH EUR | LU0899937337 | 20855058 | Accumulate | 4.62 |
| MTH CHF | LU2099034667 | 51747426 | Accumulate | 2.94 |
| NT | LU1734303610 | 39462988 | Accumulate | 7.45 |
| NTH CHF | LU0866336125 | 20261055 | Accumulate | 2.98 |
| NTH EUR | LU1583993347 | 36094881 | Accumulate | 5.26 |

Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Emerging Markets Opportunities

1. Marktübersicht

Eine verfrühte Jahresend-Rally hat seit November 2023 die Mehrzahl der Investoren mit einem wechselhaften Anlageperiode vom Februar 2023 bis Januar 2024 versöhnt. Mit viel Euphorie sind die Finanzmärkte gestartet und das obwohl zu Beginn des Jahres das baldige Eintreten einer globalen Rezession dem Marktkonsens entsprach. Doch die teils prognostizierte Energiekrise wurde dank eines milden Winters vermieden und insbesondere in den USA sorgte der überraschend robuste Konjunkturverlauf für die nötige Stütze der Aktienmärkte. Weder weitere Leitzinserhöhungen in praktisch allen entwickelten Regionen (Ausnahme Japan) noch die Turbulenzen im Bankensektor konnten für eine nachhaltige Umkehr dieses positiven Trends sorgen.

Ebenfalls unterstützend wirkten die meist tiefer als erwartet publizierten Inflationszahlen und es zeigte sich zunehmend, dass der Kampf gegen die mancherorts aus dem Ruder gelaufene Preissteigerung bald gewonnen werden dürfte. Entsprechend wurde bereits früh im Jahr über mögliche Zinsgipfel oder sogar etwaige Zinssenkungen zum Jahresende spekuliert. Die erste Hälfte der Berichtsperiode zeigte somit zumindest auf den ersten Blick eine herausragende Performance, gerade für amerikanische Aktien. Bei näherer Betrachtung blieb jedoch die Konklusion, dass primär der Hype um künstliche Intelligenz und die damit eng verbundene Wertsteigerung von sieben US Mega-Caps für die stark positive Differenz sorgte.

Nach dem Sommer belastete insbesondere die auf sich warten lassende (leichte) Rezession, die auch die Türen zu weniger hohen Zinsen aufgestossen hätte. Bei sichtbar rückläufigen Inflationsraten hat jüngst aber die amerikanische Notenbank Fed erneute Zinssenkungsfantasien aufkommen lassen und damit die Finanzmärkte zum Jahreschluss nochmals beflügelt. In diesem Umfeld verzeichneten Anleihen als auch Aktien deutliche Gewinne während der US-Dollar als auch der Euro gegenüber dem Schweizer Franken nachgaben.

2. Rückblick auf für den Fonds relevante Kategorien

Am Anfang der Berichtsperiode schienen die Notenbanken ihr Narrativ von «höheren Zinsen für länger» erfolgreich an den Märkten etabliert zu haben. Das Schreckgespenst eines dritten Jahres in Folge mit negativer Gesamtrendite wurde für globale Unternehmensanleihen immer realistischer. Unterstützt durch ausgabefreudige Konsumentinnen und Konsumenten und einen resilienten Arbeitsmarkt in den USA sowie auf hohem Niveau verharrenden Inflationszahlen, kletterten die Zinsen beidseits des Atlantiks weiter in die Höhe. Die Marktreaktion auf die gestiegenen geopolitischen Risiken durch den verheerenden Terrorangriff auf Israel war verhalten. Die Zinsen fielen nur vorübergehend, und der Ölpreis bewegte sich kaum. Die Zinsvolatilität blieb sehr hoch und erreichte Ende Oktober einen Höhepunkt, als die Rendite der zehnjährigen US Staatsanleihen zum ersten Mal seit 2007 die Fünfprozent-Marke überschritt. Der kontinuierliche Anstieg der nominalen und realen Zinsen belastete die Aktienmärkte und führte zu einer Ausweitung der Credit Spreads. Der erste Novembertag brachte dann einen kompletten Stimmungsumschwung: Nachdem die Europäische Zentralbank (EZB) und die Bank of Japan keine Zinsänderung vorgenommen hatten, liess auch die amerikanische Fed an ihrer regulären Sitzung wie erwartet die Zinsen unverändert. Die anschliessende Pressekonferenz von Jerome Powell markierte aber einen Wendepunkt (Pivot) für die Märkte. Die Investoren interpretierten seine Aussagen dahingehend, dass die Fed keine weiteren Zinserhöhungen plane und vielmehr bald erste Zinssenkungen bevorstünden. Die schwachen Konjunkturdaten und die hinter den Erwartungen zurückbleibenden Neuemissionspläne für US-Staatsanleihen liessen die Aktienmärkte kräftig steigen und die Rendite der zehnjährigen US-Staatsanleihen fallen. Dies war nur der Anfang einer sich selbst verstärkenden Bewegung, die bis zum Ende der Berichtsperiode andauerte. Damit wurde der November der beste Monat für den US-Anleihenmarkt in den vergangenen 40 Jahren. Mindestens zum siebten Mal in diesem Zinszyklus spekulierten die Märkte auf eine Trendwende der Zentralbanken in Richtung expansive Politik. Doch die Hoffnungen auf baldige Zinssenkungen wurden bisher regelmässig enttäuscht. Diesmal wurde die Rallye in allen Anlageklassen in den letzten zwei Monaten des Jahres jedoch von einer Reihe technischer Faktoren und Verhaltensmuster der Investoren befeuert. So waren die meisten Marktplayer bis Ende Oktober nämlich defensiv positioniert und hielten hohe Bargeldbestände. Sie wurden von den steigenden Kursen risikobehafteter Aktiva und den fallenden Zinsen überrascht. Entsprechend mussten sie ihre Short-Positionen schliessen und das Risiko in den Portfolios erhöhen. Die relativ attraktiven Ausgangsbewertungen und die Angst der Investoren, etwas zu verpassen (Fear of missing out, FOMO) trugen zum Kursfeuerwerk bei. An ihrer letzten Sitzung des Jahres 2023 Mitte Dezember hat die Fed auch nichts unternommen, um die Euphorie an den Märkten zu bremsen. Der breite US-Aktienindex S&P500 erreichte dadurch ein Allzeithöchst. Die vorsichtigeren Töne der EZB wurden ignoriert, wodurch viele Märkte innerhalb von nur zwei Monaten von Jahrestiefst- zu Jahreshöchstständen emporschnellten. Im Vergleich zum März 2022, als die Fed mit den Zinserhöhungen begonnen hatte, notieren die Aktienmärkte inzwischen wieder höher, die Spreads haben sich verengt und die impliziten Volatilitäten sind überall gesunken. Die so entstandenen finanziellen Rahmenbedingungen konterkarieren jedoch die Absichten der Zentralbanken, die Inflation unter Kontrolle zu halten und könnten sie dazu zwingen, die Zinsen später wieder zu erhöhen oder zumindest restriktivere Töne anzuschlagen. Die jüngsten Marktbewegungen fördern zudem einen weiteren Widerspruch zutage, nämlich jenen zwischen tiefen Zinsen (die einer schwächeren Wirtschaftsentwicklung entsprechen würden) und hohen Aktienbewertungen (die eine brummende Wirtschaft und steigende Unternehmensgewinne implizieren). Der einzige Ausweg aus diesem Dilemma wäre eine kontrollierte Abschwächung der Konjunktur (Soft Landing), die Zinssenkungen erlauben würde, bevor die hohen Zinsen weitere Unfälle verursachen. Dieses Soft-Landing-Szenario scheint nicht unmöglich. Doch das Risiko, dass es nicht gelingt, ist an den Märkten derzeit nicht eingepreist. Unternehmensanleihen haben im vierten Quartal von den tieferen Zinsen profitiert, aber auch die Spreads gingen deutlich zurück. Vor allem High-Yield-Anleihen im BB-Segment sowie nachrangige Unternehmens- und Finanzanleihen erzielten Renditen im doppelstelligen Bereich und machten die Verluste des Vorjahres weitgehend wett. Die Spreads liegen Ende 2023 zwar auf einem nicht mehr günstigen Niveau, aber im historischen Vergleich im mittleren Bereich.

3. Performancerückblick

Die Anlageklasse Emerging-Market-Bonds verzeichnete eine positive Performance im Jahr 2023. Der Fonds generierte eine Outperformance. Auch in diesem Zeitraum leisteten unsere Übergewichtungen in lokaler Währung in Lateinamerika und die Untergewichtungen von türkischen Anleihen die grössten positiven Performancebeiträge. Negativ auf die relative Performance wirkte sich dagegen das «Nicht-Halten» verschiedener sich in Notlage befindlicher Länder wie Pakistan, Sri Lanka und Sambia aus.

| Klasse | ISIN | Valor | Distribution | Performance in % |
|----------------------------------|--------------|-----------|--------------|------------------|
| AT | LU2108481859 | 052188835 | Accumulate | 5.71 |
| CT | LU2108481933 | 052193772 | Accumulate | 6.35 |
| DT | LU2108482071 | 052193775 | Accumulate | 6.46 |
| DTH CHF | LU2108482154 | 052193788 | Accumulate | 1.36 |
| DTH EUR | LU2108482238 | 052195816 | Accumulate | 3.76 |
| GT | LU2108482311 | 052195831 | Accumulate | 6.56 |
| NT | LU2108482667 | 052195893 | Accumulate | 7.25 |
| NTH CHF | LU2108482741 | 052196586 | Accumulate | 1.97 |
| NTH EUR (Schliessung 18.12.2023) | LU2108482824 | 052196594 | Accumulate | 4.35 |

Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Absolute Return

1. Marktübersicht

Eine verfrühte Jahresend-Rally hat seit November 2023 die Mehrzahl der Investoren mit einem wechselhaften Anlageperiode vom Februar 2023 bis Januar 2024 versöhnt. Mit viel Euphorie sind die Finanzmärkte gestartet und das obwohl zu Beginn des Jahres das baldige Eintreten einer globalen Rezession dem Marktkonsens entsprach. Doch die teils prognostizierte Energiekrise wurde dank eines milden Winters vermieden und insbesondere in den USA sorgte der überraschend robuste Konjunkturverlauf für die nötige Stütze der Aktienmärkte. Weder weitere Leitzinserhöhungen in praktisch allen entwickelten Regionen (Ausnahme Japan) noch die Turbulenzen im Bankensektor konnten für eine nachhaltige Umkehr dieses positiven Trends sorgen.

Ebenfalls unterstützend wirkten die meist tiefer als erwartet publizierten Inflationszahlen und es zeigte sich zunehmend, dass der Kampf gegen die mancherorts aus dem Ruder gelaufene Preissteigerung bald gewonnen werden dürfte. Entsprechend wurde bereits früh im Jahr über mögliche Zinsgipfel oder sogar etwaige Zinssenkungen zum Jahresende spekuliert. Die erste Hälfte der Berichtsperiode zeigte somit zumindest auf den ersten Blick eine herausragende Performance, gerade für amerikanische Aktien. Bei näherer Betrachtung blieb jedoch die Konklusion, dass primär der Hype um künstliche Intelligenz und die damit eng verbundene Wertsteigerung von sieben US Mega-Caps für die stark positive Differenz sorgte.

Nach dem Sommer belastete insbesondere die auf sich warten lassende (leichte) Rezession, die auch die Türen zu weniger hohen Zinsen aufgestossen hätte. Bei sichtbar rückläufigen Inflationsraten hat jüngst aber die amerikanische Notenbank Fed erneute Zinssenkungsfantasien aufkommen lassen und damit die Finanzmärkte zum Jahreschluss nochmals beflügelt. In diesem Umfeld verzeichneten Anleihen als auch Aktien deutliche Gewinne während der US-Dollar als auch der Euro gegenüber dem Schweizer Franken nachgaben.

2. Rückblick auf für den Fonds relevante Kategorien

Am Anfang der Berichtsperiode schienen die Notenbanken ihr Narrativ von «höheren Zinsen für länger» erfolgreich an den Märkten etabliert zu haben. Das Schreckgespenst eines dritten Jahres in Folge mit negativer Gesamtrendite wurde für globale Unternehmensanleihen immer realistischer. Unterstützt durch ausgabefreudige Konsumentinnen und Konsumenten und einen resilienten Arbeitsmarkt in den USA sowie auf hohem Niveau verharrenden Inflationszahlen, kletterten die Zinsen beidseits des Atlantiks weiter in die Höhe. Die Marktreaktion auf die gestiegenen geopolitischen Risiken durch den verheerenden Terrorangriff auf Israel war verhalten. Die Zinsen fielen nur vorübergehend, und der Ölpreis bewegte sich kaum. Die Zinsvolatilität blieb sehr hoch und erreichte Ende Oktober einen Höhepunkt, als die Rendite der zehnjährigen US-Staatsanleihen zum ersten Mal seit 2007 die Fünfprozent-Marke überschritt. Der kontinuierliche Anstieg der nominalen und realen Zinsen belastete die Aktienmärkte und führte zu einer Ausweitung der Credit Spreads. Der erste Novembertag brachte dann einen kompletten Stimmungsumschwung: Nachdem die Europäische Zentralbank (EZB) und die Bank of Japan keine Zinsänderung vorgenommen hatten, liess auch die amerikanische Fed an ihrer regulären Sitzung wie erwartet die Zinsen unverändert. Die anschließende Pressekonferenz von Jerome Powell markierte aber einen Wendepunkt (Pivot) für die Märkte. Die Investoren interpretierten seine Aussagen dahingehend, dass die Fed keine weiteren Zinserhöhungen plane und vielmehr bald erste Zinssenkungen bevorstünden. Die schwachen Konjunkturdaten und die hinter den Erwartungen zurückbleibenden Neuemissionspläne für US-Staatsanleihen liessen die Aktienmärkte kräftig steigen und die Rendite der zehnjährigen US-Staatsanleihen um 20 Basispunkte (Bp) fallen. Dies war nur der Anfang einer sich selbst verstärkenden Bewegung, die bis zum Ende der Berichtsperiode andauerte. Damit wurde der November der beste Monat für den US-Anleihenmarkt in den vergangenen 40 Jahren. Mindestens zum siebten Mal in diesem Zinszyklus spekulierten die Märkte auf eine Trendwende der Zentralbanken in Richtung expansive Politik. Doch die Hoffnungen auf baldige Zinssenkungen wurden bisher regelmässig enttäuscht. Diesmal wurde die Rallye in allen Anlageklassen in den letzten zwei Monaten des Jahres jedoch von einer Reihe technischer Faktoren und Verhaltensmuster der Investoren befeuert. So waren die meisten Marktplayer bis Ende Oktober nämlich defensiv positioniert und hielten hohe Bargeldbestände. Sie wurden von den steigenden Kursen risikobehafteter Aktiva und den fallenden Zinsen überrascht. Entsprechend mussten sie ihre Short-Positionen schliessen und das Risiko in den Portfolios erhöhen. Die relativ attraktiven Ausgangsbewertungen und die Angst der Investoren, etwas zu verpassen (Fear of missing out, FOMO) trugen zum Kursfeuerwerk bei. An ihrer letzten Sitzung des Jahres 2023 Mitte Dezember hat die Fed auch nichts unternommen, um die Euphorie an den Märkten zu bremsen. Der breite US-Aktienindex S&P500 erreichte dadurch ein Allzeithöchst. Die vorsichtigeren Töne der EZB wurden ignoriert, wodurch viele Märkte innerhalb von nur zwei Monaten von Jahrestiefst- zu Jahreshöchstständen emporschnellten. Im Vergleich zum März 2022, als die Fed mit den Zinserhöhungen begonnen hatte, notieren die Aktienmärkte inzwischen wieder höher, die Spreads haben sich verengt und die impliziten Volatilitäten sind überall gesunken. Die so entstandenen finanziellen Rahmenbedingungen konterkarieren jedoch die Absichten der Zentralbanken, die Inflation unter Kontrolle zu halten und könnten sie dazu zwingen, die Zinsen später wieder zu erhöhen oder zumindest restriktivere Töne anzuschlagen. Die jüngsten Marktbewegungen fördern zudem einen weiteren Widerspruch zutage, nämlich jenen zwischen tiefen Zinsen (die einer schwächeren Wirtschaftsentwicklung entsprechen würden) und hohen Aktienbewertungen (die eine brummende Wirtschaft und steigende Unternehmensgewinne implizieren). Der einzige Ausweg aus diesem Dilemma wäre eine kontrollierte Abschwächung der Konjunktur (Soft Landing), die Zinssenkungen erlauben würde, bevor die hohen Zinsen weitere Unfälle verursachen. Dieses Soft-Landing-Szenario scheint nicht unmöglich. Doch das Risiko, dass es nicht gelingt, ist an den Märkten derzeit nicht eingepreist. Unternehmensanleihen haben im vierten Quartal von den tieferen Zinsen profitiert, aber auch die Spreads gingen deutlich zurück. Vor allem High-Yield-Anleihen im BB-Segment sowie nachrangige Unternehmens- und Finanzanleihen erzielten Renditen im doppelstelligen Bereich und machten die Verluste des Vorjahres weitgehend wett. Die Spreads liegen Ende 2023 zwar auf einem nicht mehr günstigen Niveau, aber im historischen Vergleich im mittleren Bereich.

3. Performancerückblick

Der Fonds konnte in seiner Referenzwährung USD einen positiven Return erwirtschaften der nur knapp unter dem Gesamtmarkt lag. Die Haupttreiber waren die Allokationen in den lokalen Emerging Markets von Mexiko, Brasilien und Südafrika sowie der guten Positionierung auf der USD Zinskurve. Weitere positive Beiträge zur Performance lieferten die Investitionen in NOK, AUD und CNY. Performance mindernd präsentierten sich die Anlagen in EUR Staatsanleihen sowie Corporate Bonds in GBP. In der Sektorallokation waren vor allem die Unternehmensanleihen mit einem positiven Beitrag behaftet. In den ersten drei Quartalen hatte der Fonds aufgrund des allgemein schwierigen Umfeldes eine unterdurchschnittliche Performance. Die Rally im Q4 konnte der Fonds schlussendlich ausnützen, um einen deutlich positiven Return für das abgelaufene Jahr zu sichern.

| Klasse | ISIN | Valor | Distribution | Performance in % |
|----------------------------------|--------------|----------|--------------|------------------|
| AA | LU0957587206 | 22257080 | Pay out | 3.67 |
| AAH CHF | LU0957585929 | 22255232 | Pay out | -0.70 |
| AAH EUR | LU0957586737 | 22256233 | Pay out | 1.52 |
| AT | LU0957587388 | 22257224 | Accumulate | 3.67 |
| ATH CHF | LU0957586067 | 22255233 | Accumulate | -0.67 |
| ATH EUR | LU0957586810 | 22256235 | Accumulate | 1.55 |
| BTH CHF | LU0999470635 | 23104232 | Accumulate | -0.18 |
| BTH EUR | LU0999470718 | 23104235 | Accumulate | 2.04 |
| CTH CHF | LU1663697115 | 37839843 | Accumulate | -0.05 |
| DTH CHF | LU1495637925 | 34048549 | Accumulate | -0.01 |
| DTH EUR | LU1495637842 | 34048548 | Accumulate | 2.17 |
| GT | LU0957587628 | 22257229 | Accumulate | 4.43 |
| GTH CHF | LU0957586570 | 22256232 | Accumulate | 0.04 |
| GTH EUR | LU0957587115 | 22257079 | Accumulate | 2.19 |
| NTH CHF (Schliessung 18.01.2024) | LU0957586497 | 22256231 | Accumulate | -0.31 |

Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Corporate

1. Marktübersicht

Eine verfrühte Jahresend-Rally hat seit November 2023 die Mehrzahl der Investoren mit einem wechselhaften Anlageperiode vom Februar 2023 bis Januar 2024 versöhnt. Mit viel Euphorie sind die Finanzmärkte gestartet und das obwohl zu Beginn des Jahres das baldige Eintreten einer globalen Rezession dem Marktkonsens entsprach. Doch die teils prognostizierte Energiekrise wurde dank eines milden Winters vermieden und insbesondere in den USA sorgte der überraschend robuste Konjunkturverlauf für die nötige Stütze der Aktienmärkte. Weder weitere Leitzinserhöhungen in praktisch allen entwickelten Regionen (Ausnahme Japan) noch die Turbulenzen im Bankensektor konnten für eine nachhaltige Umkehr dieses positiven Trends sorgen.

Ebenfalls unterstützend wirkten die meist tiefer als erwartet publizierten Inflationszahlen und es zeigte sich zunehmend, dass der Kampf gegen die mancherorts aus dem Ruder gelaufene Preissteigerung bald gewonnen werden dürfte. Entsprechend wurde bereits früh im Jahr über mögliche Zinsgipfel oder sogar etwaige Zinssenkungen zum Jahresende spekuliert. Die erste Hälfte der Berichtsperiode zeigte somit zumindest auf den ersten Blick eine herausragende Performance, gerade für amerikanische Aktien. Bei näherer Betrachtung blieb jedoch die Konklusion, dass primär der Hype um künstliche Intelligenz und die damit eng verbundene Wertsteigerung von sieben US Mega-Caps für die stark positive Differenz sorgte.

Nach dem Sommer belastete insbesondere die auf sich warten lassende (leichte) Rezession, die auch die Türen zu weniger hohen Zinsen aufgestossen hätte. Bei sichtbar rückläufigen Inflationsraten hat jüngst aber die amerikanische Notenbank Fed erneute Zinssenkungsfantasien aufkommen lassen und damit die Finanzmärkte zum Jahreschluss nochmals beflügelt. In diesem Umfeld verzeichneten Anleihen als auch Aktien deutliche Gewinne während der US-Dollar als auch der Euro gegenüber dem Schweizer Franken nachgaben.

2. Rückblick auf für den Fonds relevante Kategorien

Am Anfang der Berichtsperiode schienen die Notenbanken ihr Narrativ von «höheren Zinsen für länger» erfolgreich an den Märkten etabliert zu haben. Das Schreckgespenst eines dritten Jahres in Folge mit negativer Gesamtrendite wurde für globale Unternehmensanleihen immer realistischer. Unterstützt durch ausgabefreudige Konsumentinnen und Konsumenten und einen resilienten Arbeitsmarkt in den USA sowie auf hohem Niveau verharrenden Inflationszahlen, kletterten die Zinsen beidseits des Atlantiks weiter in die Höhe. Die Marktreaktion auf die gestiegenen geopolitischen Risiken durch den verheerenden Terrorangriff auf Israel war verhalten. Die Zinsen fielen nur vorübergehend, und der Ölpreis bewegte sich kaum. Die Zinsvolatilität blieb sehr hoch und erreichte Ende Oktober einen Höhepunkt, als die Rendite der zehnjährigen US-Staatsanleihen zum ersten Mal seit 2007 die Fünfprozent-Marke überschritt. Der kontinuierliche Anstieg der nominalen und realen Zinsen belastete die Aktienmärkte und führte zu einer Ausweitung der Credit Spreads. Der erste Novembertag brachte dann einen kompletten Stimmungsumschwung: Nachdem die Europäische Zentralbank (EZB) und die Bank of Japan keine Zinsänderung vorgenommen hatten, liess auch die amerikanische Fed an ihrer regulären Sitzung wie erwartet die Zinsen unverändert. Die anschliessende Pressekonferenz von Jerome Powell markierte aber einen Wendepunkt (Pivot) für die Märkte. Die Investoren interpretierten seine Aussagen dahingehend, dass die Fed keine weiteren Zinserhöhungen plane und vielmehr bald erste Zinssenkungen bevorstünden. Die schwachen Konjunkturdaten und die hinter den Erwartungen zurückbleibenden Neuemissionspläne für US-Staatsanleihen liessen die Aktienmärkte kräftig steigen und die Rendite der zehnjährigen US-Staatsanleihen fallen. Dies war nur der Anfang einer sich selbst verstärkenden Bewegung, die bis zum Ende der Berichtsperiode andauerte. Damit wurde der November der beste Monat für den US-Anleihenmarkt in den vergangenen 40 Jahren. Mindestens zum siebten Mal in diesem Zinszyklus spekulierten die Märkte auf eine Trendwende der Zentralbanken in Richtung expansive Politik. Doch die Hoffnungen auf baldige Zinssenkungen wurden bisher regelmässig enttäuscht. Diesmal wurde die Rallye in allen Anlageklassen in den letzten zwei Monaten des Jahres jedoch von einer Reihe technischer Faktoren und Verhaltensmuster der Investoren befeuert. So waren die meisten Marktplayer bis Ende Oktober nämlich defensiv positioniert und hielten hohe Bargeldbestände. Sie wurden von den steigenden Kursen risikobehafteter Aktiva und den fallenden Zinsen überrascht. Entsprechend mussten sie ihre Short-Positionen schliessen und das Risiko in den Portfolios erhöhen. Die relativ attraktiven Ausgangsbewertungen und die Angst der Investoren, etwas zu verpassen (Fear of missing out, FOMO) trugen zum Kursfeuerwerk bei. An ihrer letzten Sitzung des Jahres 2023 Mitte Dezember hat die Fed auch nichts unternommen, um die Euphorie an den Märkten zu bremsen. Der breite US-Aktienindex S&P500 erreichte dadurch ein Allzeithöchst. Die vorsichtigeren Töne der EZB wurden ignoriert, wodurch viele Märkte innerhalb von nur zwei Monaten von Jahrestiefst- zu Jahreshöchstständen emporschnellten. Im Vergleich zum März 2022, als die Fed mit den Zinserhöhungen begonnen hatte, notieren die Aktienmärkte inzwischen wieder höher, die Spreads haben sich verengt und die impliziten Volatilitäten sind überall gesunken. Die so entstandenen finanziellen Rahmenbedingungen konterkarieren jedoch die Absichten der Zentralbanken, die Inflation unter Kontrolle zu halten und könnten sie dazu zwingen, die Zinsen später wieder zu erhöhen oder zumindest restriktivere Töne anzuschlagen. Die jüngsten Marktbewegungen fördern zudem einen weiteren Widerspruch zutage, nämlich jenen zwischen tiefen Zinsen (die einer schwächeren Wirtschaftsentwicklung entsprechen würden) und hohen Aktienbewertungen (die eine brummende Wirtschaft und steigende Unternehmensgewinne implizieren). Der einzige Ausweg aus diesem Dilemma wäre eine kontrollierte Abschwächung der Konjunktur (Soft Landing), die Zinssenkungen erlauben würde, bevor die hohen Zinsen weitere Unfälle verursachen. Dieses Soft-Landing-Szenario scheint nicht unmöglich. Doch das Risiko, dass es nicht gelingt, ist an den Märkten derzeit nicht eingepreist. Die Spreads liegen Ende 2023 zwar auf einem nicht mehr günstigen Niveau, aber im historischen Vergleich im mittleren Bereich.

3. Performancerückblick

Nach einem sehr volatilen Jahr mutet es fast unglaublich an, dass die Renditekurve der US-Staatsanleihen im Laufzeitenbereich von zehn Jahren und länger das Jahr auf demselben Renditeniveau wie Anfang Jahr beendete. Dank tieferen US-Zinsen im Bereich von

zwei bis zehn Jahren sowie tieferen Credit Spreads und tieferen europäischen Zinsen konnten globale Unternehmensanleihen den Betrachtungszeitraum mit einer deutlich positiven Performance abschliessen. Trotz der Ereignisse um die US Regionalbanken und die Credit Suisse im ersten Quartal hat die Übergewichtung des Finanzsektors auch über das ganze Jahr hinweg den grössten positiven Performancebeitrag geliefert.

| Klasse | ISIN | Valor | Distribution | Performance in % |
|----------------------------|--------------|-----------|--------------|------------------|
| AT | LU0519886476 | 11437451 | Accumulate | 5.37 |
| ATH CHF | LU0489326578 | 011046520 | Accumulate | 1.00 |
| ATH EUR | LU0494188096 | 011114484 | Accumulate | 3.12 |
| BTH CHF | LU0999469207 | 23107080 | Accumulate | 1.33 |
| BTH EUR | LU0999469389 | 23107085 | Accumulate | 3.31 |
| CTH CHF | LU1663701164 | 037844009 | Accumulate | 1.39 |
| DT | LU1495640713 | 34048573 | Accumulate | 5.86 |
| DTH CHF | LU1495640804 | 34048574 | Accumulate | 1.43 |
| DTH EUR | LU0494188682 | 11114487 | Accumulate | 3.61 |
| GT | LU0899938491 | 20856865 | Accumulate | 5.98 |
| GTH CHF | LU0899938061 | 20856853 | Accumulate | 1.51 |
| GTH EUR | LU0899938228 | 20856856 | Accumulate | 3.69 |
| NT (Lancierung 27.03.2023) | LU2597529739 | 125590636 | Accumulate | 8.36 |

Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Convertible

1. Marktübersicht

Eine verfrühte Jahresend-Rally hat seit November 2023 die Mehrzahl der Investoren mit einem wechselhaften Anlageperiode vom Februar 2023 bis Januar 2024 versöhnt. Mit viel Euphorie sind die Finanzmärkte gestartet und das obwohl zu Beginn des Jahres das baldige Eintreten einer globalen Rezession dem Marktkonsens entsprach. Doch die teils prognostizierte Energiekrise wurde dank eines milden Winters vermieden und insbesondere in den USA sorgte der überraschend robuste Konjunkturverlauf für die nötige Stütze der Aktienmärkte. Weder weitere Leitzinserhöhungen in praktisch allen entwickelten Regionen (Ausnahme Japan) noch die Turbulenzen im Bankensektor konnten für eine nachhaltige Umkehr dieses positiven Trends sorgen.

Ebenfalls unterstützend wirkten die meist tiefer als erwartet publizierten Inflationszahlen und es zeigte sich zunehmend, dass der Kampf gegen die mancherorts aus dem Ruder gelaufene Preissteigerung bald gewonnen werden dürfte. Entsprechend wurde bereits früh im Jahr über mögliche Zinsgipfel oder sogar etwaige Zinssenkungen zum Jahresende spekuliert. Die erste Hälfte der Berichtsperiode zeigte somit zumindest auf den ersten Blick eine herausragende Performance, gerade für amerikanische Aktien.

Nach dem Sommer belastete insbesondere die auf sich warten lassende (leichte) Rezession, die auch die Türen zu weniger hohen Zinsen aufgestossen hätte. Bei sichtbar rückläufigen Inflationsraten hat jüngst aber die amerikanische Notenbank Fed erneute Zinssenkungsfantasien aufkommen lassen und damit die Finanzmärkte zum Jahresschluss nochmals beflügelt. In diesem Umfeld verzeichneten Anleihen als auch Aktien deutliche Gewinne während der US-Dollar als auch der Euro gegenüber dem Schweizer Franken nachgaben.

2. Rückblick auf für den Fonds relevante Kategorien

Der Neuemissionsmarkt hat sich in der Berichtsperiode - wie erwartet - von den tiefen Volumina im 2022 erholt. Das Neuemission Volumen ist angestiegen, liegt aber immer noch unter dem historischen Durchschnitt. Wir erwarten eine Fortsetzung dieser Erholung in den kommenden Jahren.

Neben den üblichen Sektoren war in der Berichtsperiode das vermehrte Auftreten von Utilities auf dem Markt zu beobachten. Neuemittenten mit offiziellem Investment Grade Rating sind neu an dem Markt gekommen und haben Wandelanleihen mit eher kurzen Laufzeiten platziert. Solche Emittenten aus dem Utilities Sektor sind für Ihre Refinanzierung nicht auf Wandelanleihen angewiesen und haben typischerweise schon Corporate Bonds ausstehend. Sie emittieren eher aus taktischen Gründen, um von den günstigeren Refinanzierungskosten zu profitieren.

3. Performancerückblick

Das Jahr war im Zeichen der Volatilität; der Markt schwankte in der Berichtsperiode zwischen positiven und negativen einstelligen Performance.

Der Swisscanto Bond Fund Responsible Global Convertible erzielte eine positive Bruttoperformance, obwohl leicht hinter seiner Benchmark war.

Das ist hauptsächlich aufgrund des Untergewichtes in Industrial und Pharmaceutical Sektoren sowie von dem Übergewicht in Retail / Wholesale Sektor entstanden. Unsere defensive Positionierung - Quality Bias - hat sich in diesem Kontext nicht auszahlt. Innerhalb vom Industrial Sektor waren wir gegenüber Electric Vehicles untergewichtet, das hat uns Performance gekostet, da dieser Sektor ausgesprochen positive Resultate erzielt hat.

Unsere Positionierung zu Leisure / Transportation sowie in Food & Drink hat dagegen positiv zur Performance beigetragen, konnte aber den negativen Beitrag von den oben genannten Sektoren nicht vollständig kompensieren.

Wir haben ein einige Wandlungen mitgemacht, das hat aber nicht signifikant zur gesamten Exponierung zum Aktienmarkt beigetragen.

Das Gesamtdelta (Aktiensensitivität) war am Ende der Berichtsperiode leicht über jener der Benchmark. Die effektive Duration ist tief und ist damit deutlich geringer als bei den meisten Obligationenfonds.

| Klasse | ISIN | Valor | Distribution | Performance in % |
|---------|--------------|----------|--------------|------------------|
| AT | LU0582724695 | 22947743 | Accumulate | 1.89 |
| ATH CHF | LU0556183134 | 11963008 | Accumulate | -2.33 |
| ATH EUR | LU0556184025 | 11963017 | Accumulate | -0.26 |
| DTH CHF | LU0556183647 | 11963013 | Accumulate | -1.55 |

| Klasse | ISIN | Valor | Distribution | Performance in % |
|---------|--------------|----------|--------------|------------------|
| DTH EUR | LU0556184538 | 11963019 | Accumulate | 0.55 |
| GT | LU0899937923 | 20855103 | Accumulate | 2.81 |
| GTH CHF | LU0899937766 | 20855091 | Accumulate | -1.49 |
| GTH EUR | LU0899937840 | 20855098 | Accumulate | 0.95 |
| MTH CHF | LU2099034584 | 51747351 | Accumulate | -0.95 |
| NT | LU1637934586 | 37269081 | Accumulate | 3.37 |
| NTH CHF | LU1637934313 | 37269071 | Accumulate | -0.93 |
| NTH EUR | LU1637934404 | 37269072 | Accumulate | 1.14 |

Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Rates

1. Marktübersicht

Eine verfrühte Jahresend-Rally hat seit November 2023 die Mehrzahl der Investoren mit einem wechselhaften Anlageperiode vom Februar 2023 bis Januar 2024 versöhnt. Mit viel Euphorie sind die Finanzmärkte gestartet und das obwohl zu Beginn des Jahres das baldige Eintreten einer globalen Rezession dem Marktkonsens entsprach. Doch die teils prognostizierte Energiekrise wurde dank eines milden Winters vermieden und insbesondere in den USA sorgte der überraschend robuste Konjunkturverlauf für die nötige Stütze der Aktienmärkte. Weder weitere Leitzinserhöhungen in praktisch allen entwickelten Regionen (Ausnahme Japan) noch die Turbulenzen im Bankensektor konnten für eine nachhaltige Umkehr dieses positiven Trends sorgen.

Ebenfalls unterstützend wirkten die meist tiefer als erwartet publizierten Inflationszahlen und es zeigte sich zunehmend, dass der Kampf gegen die mancherorts aus dem Ruder gelaufene Preissteigerung bald gewonnen werden dürfte. Entsprechend wurde bereits früh im Jahr über mögliche Zinsgipfel oder sogar etwaige Zinssenkungen zum Jahresende spekuliert. Die erste Hälfte der Berichtsperiode zeigte somit zumindest auf den ersten Blick eine herausragende Performance, gerade für amerikanische Aktien. Bei näherer Betrachtung blieb jedoch die Konklusion, dass primär der Hype um künstliche Intelligenz und die damit eng verbundene Wertsteigerung von sieben US Mega-Caps für die stark positive Differenz sorgte.

Nach dem Sommer belastete insbesondere die auf sich warten lassende (leichte) Rezession, die auch die Türen zu weniger hohen Zinsen aufgestossen hätte. Bei sichtbar rückläufigen Inflationsraten hat jüngst aber die amerikanische Notenbank Fed erneute Zinssenkungsfantasien aufkommen lassen und damit die Finanzmärkte zum Jahresschluss nochmals beflügelt. In diesem Umfeld verzeichneten Anleihen als auch Aktien deutliche Gewinne während der US-Dollar als auch der Euro gegenüber dem Schweizer Franken nachgaben.

2. Rückblick auf für den Fonds relevante Kategorien

Am Anfang der Berichtsperiode schienen die Notenbanken ihr Narrativ von «höheren Zinsen für länger» erfolgreich an den Märkten etabliert zu haben. Das Schreckgespenst eines dritten Jahres in Folge mit negativer Gesamtrendite wurde für globale Staatsanleihen immer realistischer. Unterstützt durch ausgabefreudige Konsumentinnen und Konsumenten und einen resilienten Arbeitsmarkt in den USA sowie auf hohem Niveau verharrenden Inflationszahlen, kletterten die Zinsen beidseits des Atlantiks weiter in die Höhe. Die Marktreaktion auf die gestiegenen geopolitischen Risiken durch den verheerenden Terrorangriff auf Israel war verhalten. Die Zinsen fielen nur vorübergehend, und der Ölpreis bewegte sich kaum. Die Zinsvolatilität blieb sehr hoch und erreichte Ende Oktober einen Höhepunkt, als die Rendite der zehnjährigen US-Staatsanleihen zum ersten Mal seit 2007 die Fünfprozent-Marke überschritt. Der erste Novembertag brachte dann einen kompletten Stimmungsumschwung: Nachdem die Europäische Zentralbank (EZB) und die Bank of Japan keine Zinsänderung vorgenommen hatten, liess auch die amerikanische Fed an ihrer regulären Sitzung wie erwartet die Zinsen unverändert. Die anschliessende Pressekonferenz von Jerome Powell markierte aber einen Wendepunkt (Pivot) für die Märkte. Die Investoren interpretierten seine Aussagen dahingehend, dass die Fed keine weiteren Zinserhöhungen plane und vielmehr bald erste Zinssenkungen bevorstünden. Die schwachen Konjunkturdaten und die hinter den Erwartungen zurückbleibenden Neuemissionspläne für US-Staatsanleihen liessen die Aktienmärkte kräftig steigen und die Rendite der zehnjährigen US-Staatsanleihen fallen. Dies war nur der Anfang einer sich selbst verstärkenden Bewegung, die bis zum Ende der Berichtsperiode andauerte. Damit wurde der November der beste Monat für den US-Anleihenmarkt in den vergangenen 40 Jahren. Mindestens zum siebten Mal in diesem Zinszyklus spekulierten die Märkte auf eine Trendwende der Zentralbanken in Richtung expansive Politik. Doch die Hoffnungen auf baldige Zinssenkungen wurden bisher regelmässig enttäuscht. Diesmal wurde die Rallye in allen Anlageklassen in den letzten zwei Monaten des Jahres jedoch von einer Reihe technischer Faktoren und Verhaltensmuster der Investoren befeuert. So waren die meisten Marktplayer bis Ende Oktober nämlich defensiv positioniert und hielten hohe Bargeldbestände. Sie wurden von den steigenden Kursen risikobehafteter Aktiva und den fallenden Zinsen überrascht. Entsprechend mussten sie ihre Short-Positionen schliessen und das Risiko in den Portfolios erhöhen. Die relativ attraktiven Ausgangsbewertungen und die Angst der Investoren, etwas zu verpassen (Fear of missing out, FOMO) trugen zum Kursfeuerwerk bei. An ihrer letzten Sitzung des Jahres 2023 Mitte Dezember hat die Fed auch nichts unternommen, um die Euphorie an den Märkten zu bremsen. Der breite US-Aktienindex S&P500 erreichte dadurch ein Allzeithöchst. Die vorsichtigeren Töne der EZB wurden ignoriert, wodurch viele Märkte innerhalb von nur zwei Monaten von Jahrestiefst- zu Jahreshöchstständen emporschnellten. Die so entstandenen finanziellen Rahmenbedingungen konterkarieren jedoch die Absichten der Zentralbanken, die Inflation unter Kontrolle zu halten und könnten sie dazu zwingen, die Zinsen später wieder zu erhöhen oder zumindest restriktivere Töne anzuschlagen. Die jüngsten Marktbewegungen fördern zudem einen weiteren Widerspruch zutage, nämlich jenen zwischen tiefen Zinsen (die einer schwächeren Wirtschaftsentwicklung entsprechen würden) und hohen Aktienbewertungen (die eine brummende Wirtschaft und steigende Unternehmensgewinne implizieren).

3. Performancerückblick

Der Fonds wurde Ende September neu auf globale Staatsanleihen ausgerichtet. Die Performance im letzten Quartal war absolut wie positiv (jeweils vor Kosten). Haupttreiber waren die Long Duration Wetten auf den Hauptzinskurven und Allokationen in MXN.

| Klasse | ISIN | Valor | Distribution | Performance in % |
|----------------------------------|--------------|-----------|--------------|------------------|
| AAH EUR (Schliessung 29.09.2023) | LU0957594590 | 22254932 | Pay out | -1.36 |
| AT (Lancierung 02.10.2023) | LU2658244392 | 128577059 | Accumulate | 6.88 |
| ATH CHF (Schliessung 29.09.2023) | LU0957594087 | 22254680 | Accumulate | -2.31 |
| GTH CHF (Schliessung 29.09.2023) | LU0957594327 | 22254909 | Accumulate | -1.74 |
| GTH EUR (Schliessung 18.04.2023) | LU0957594913 | 22255203 | Accumulate | -0.76 |
| MTH CHF (Schliessung 18.04.2023) | LU2099034402 | 51745346 | Accumulate | -1.00 |
| NT | LU1637934230 | 37269052 | Accumulate | 9.26 |
| NT EUR (Lancierung 05.09.2023) | LU2658244046 | 128577072 | Accumulate | 4.87 |
| NTH CHF (Schliessung 29.09.2023) | LU1637934073 | 37267997 | Accumulate | -1.39 |
| NTH EUR (Schliessung 29.09.2023) | LU1637934156 | 37268013 | Accumulate | -0.26 |
| ST (Lancierung 05.09.2023) | LU2658242347 | 128577076 | Accumulate | 6.38 |

Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Secured High Yield

1. Marktübersicht

Eine verfrühte Jahresend-Rally hat seit November 2023 die Mehrzahl der Investoren mit einem wechselhaften Anlageperiode vom Februar 2023 bis Januar 2024 versöhnt. Mit viel Euphorie sind die Finanzmärkte gestartet und das obwohl zu Beginn des Jahres das baldige Eintreten einer globalen Rezession dem Marktkonsens entsprach. Doch die teils prognostizierte Energiekrise wurde dank eines milden Winters vermieden und insbesondere in den USA sorgte der überraschend robuste Konjunkturverlauf für die nötige Stütze der Aktienmärkte. Weder weitere Leitzinserhöhungen in praktisch allen entwickelten Regionen (Ausnahme Japan) noch die Turbulenzen im Bankensektor konnten für eine nachhaltige Umkehr dieses positiven Trends sorgen.

Ebenfalls unterstützend wirkten die meist tiefer als erwartet publizierten Inflationszahlen und es zeigte sich zunehmend, dass der Kampf gegen die mancherorts aus dem Ruder gelaufene Preissteigerung bald gewonnen werden dürfte. Entsprechend wurde bereits früh im Jahr über mögliche Zinsgipfel oder sogar etwaige Zinssenkungen zum Jahresende spekuliert. Die erste Hälfte der Berichtsperiode zeigte somit zumindest auf den ersten Blick eine herausragende Performance, gerade für amerikanische Aktien. Bei näherer Betrachtung blieb jedoch die Konklusion, dass primär der Hype um künstliche Intelligenz und die damit eng verbundene Wertsteigerung von sieben US Mega-Caps für die stark positive Differenz sorgte.

Nach dem Sommer belastete insbesondere die auf sich warten lassende (leichte) Rezession, die auch die Türen zu weniger hohen Zinsen aufgestossen hätte. Bei sichtbar rückläufigen Inflationsraten hat jüngst aber die amerikanische Notenbank Fed erneute Zinssenkungsfantasien aufkommen lassen und damit die Finanzmärkte zum Jahresschluss nochmals beflügelt. In diesem Umfeld verzeichneten Anleihen als auch Aktien deutliche Gewinne während der US-Dollar als auch der Euro gegenüber dem Schweizer Franken nachgaben.

2. Rückblick auf für den Fonds relevante Kategorien

Das Finanzjahr 2023 war insgesamt ein extrem erfolgreiches Jahr für High Yield Anleihen. Entscheidend für die ausserordentlich hohe Jahresrendite waren fallende Risikoprämien und Zinsen sowie das Wirtschaftswachstum, das sich als viel resistenter erwies als befürchtet. Verschiedene Risk Off Phasen wie zum Beispiel im 1. Quartal aufgrund der Kollapse verschiedener Banken konnten unbeschadet gemeistert werden.

Nach einem optimistischen Sommer begannen die Finanzmärkte das vierte Quartal in der Defensive, wobei die Trends, die das zweite und dritte Quartal dominiert hatten, weiter anhielten: steigende Renditen bei den Staatsanleihen und schwache Aktienmärkte. Ende Oktober, als die Renditen der zehnjährigen US Staatsanleihen fast 5% erreichten, signalisierte die Fed, dass das Ende der Zinserhöhungsphase erreicht sei. Dies löste signifikante Kursanstiege an den Finanzmärkten aus, wobei die Anleiherenditen fielen, die Bonitätsaufschläge sanken und die Aktienmärkte auf das höchste Niveau des Jahres kletterten. Vor diesem Hintergrund verbuchten hochverzinsliche Anleihen das fünfte Quartal in Folge positive Renditen. Und diese Renditen fielen mit überdurchschnittlich hoch aus. Die Bonitätsaufschläge für hochverzinsliche Anleihen reduzierten sich in Europa und in den USA. Die Anleihen mit einem B-Rating legten dabei am deutlichsten zu, dicht gefolgt von Anleihen mit BB-Rating. CCC-Ratings entwickelten sich während des Quartals schlechter, insbesondere in Europa, wo das Wirtschaftswachstum schwächer ist als in Nordamerika. Die Emissionstätigkeit für neue hochverzinsliche Anleihen liess im Verlauf des Quartals etwas nach. Bis Mitte November hielten sich viele Emittenten angesichts des hohen Zinsniveaus zurück. Dank sinkender Renditen und einer besseren Anlegerstimmung nahmen die Aktivitäten am Primärmarkt einige Wochen lang zu, bevor sie Mitte Dezember erneut abflauten. Wir sahen eine gute Mischung aus Emittenten aus verschiedenen Sektoren und über das gesamte Ratingspektrum hinweg, einschliesslich bekannter Namen und Emittenten von Erstanleihen.

3. Performancerückblick

Der Swisscanto Bond Fund Secured High Yield erzielte eine sehr positive Performance, auch im Vergleich zur Benchmark konnten wir eine attraktive Outperformance generieren. Die Aufrechterhaltung einer angemessenen Beta-Position während des gesamten Jahres war in einem Umfeld volatiler, aber insgesamt sich verengender Spreads von entscheidender Bedeutung. Am stärksten zur Performance beigetragen haben Einzelhandel, Automobil und Konsumgüter, die stark nachgefragt waren. Aus Alpha-Perspektive trug unsere Long Positionierung im Automobil-, Telekommunikations- und Transportsektor insgesamt am meisten zur relativen Outperformance bei. Im Gegensatz dazu hat unsere Positionierung in Technologie, Versorger und Konsumgüter im Jahresverlauf unterdurchschnittlich abgeschnitten, vor allem aufgrund unserer Untergewichtung in diesen Segmenten. Was den Beitrag aus Rating-Perspektive anbelangt, so ist der Unterschied zwischen BB und B zurückgegangen. Daher war unsere Übergewichtung in BB nicht optimal, wurde aber durch eine hervorragende Auswahl bei Anleihen mit B-Rating gestützt, was zu einer insgesamt soliden relativen Performance in allen Ratingsegmenten führte.

| Klasse | ISIN | Valor | Distribution | Performance in % |
|---------|--------------|----------|--------------|------------------|
| AA | LU1057799337 | 24238122 | Pay out | 10.90 |
| AAH CHF | LU1057798362 | 24237163 | Pay out | 6.43 |

| Klasse | ISIN | Valor | Distribution | Performance in % |
|---------|--------------|-----------|--------------|------------------|
| AAH EUR | LU1057798958 | 24237576 | Pay out | 8.70 |
| AT | LU1057799410 | 24238128 | Accumulate | 10.89 |
| ATH CHF | LU1057798446 | 24237200 | Accumulate | 6.38 |
| ATH EUR | LU1057799097 | 24237603 | Accumulate | 8.70 |
| BTH CHF | LU1057798875 | 24237470 | Accumulate | 6.91 |
| DAH EUR | LU1520698124 | 34588619 | Pay out | 9.56 |
| DT | LU1495638733 | 34048555 | Accumulate | 11.77 |
| DTH CHF | LU1495638816 | 34048556 | Accumulate | 7.16 |
| DTH EUR | LU1495638907 | 34048557 | Accumulate | 9.50 |
| GT | LU1057799501 | 24238130 | Accumulate | 11.88 |
| GTH CHF | LU1057798792 | 24237208 | Accumulate | 7.35 |
| GTH EUR | LU1057799170 | 24237608 | Accumulate | 9.59 |
| NT | LU2490185381 | 119535320 | Accumulate | 12.50 |
| NTH CHF | LU1706092639 | 38787959 | Accumulate | 7.84 |

Swisscanto (LU) Bond Fund Sustainable Global High Yield

1. Marktübersicht

Eine verfrühte Jahresend-Rally hat seit November 2023 die Mehrzahl der Investoren mit einem wechselhaften Anlageperiode vom Februar 2023 bis Januar 2024 versöhnt. Mit viel Euphorie sind die Finanzmärkte gestartet und das obwohl zu Beginn des Jahres das baldige Eintreten einer globalen Rezession dem Marktkonsens entsprach. Doch die teils prognostizierte Energiekrise wurde dank eines milden Winters vermieden und insbesondere in den USA sorgte der überraschend robuste Konjunkturverlauf für die nötige Stütze der Aktienmärkte. Weder weitere Leitzinserhöhungen in praktisch allen entwickelten Regionen (Ausnahme Japan) noch die Turbulenzen im Bankensektor konnten für eine nachhaltige Umkehr dieses positiven Trends sorgen.

Ebenfalls unterstützend wirkten die meist tiefer als erwartet publizierten Inflationszahlen und es zeigte sich zunehmend, dass der Kampf gegen die mancherorts aus dem Ruder gelaufene Preissteigerung bald gewonnen werden dürfte. Entsprechend wurde bereits früh im Jahr über mögliche Zinsgipfel oder sogar etwaige Zinssenkungen zum Jahresende spekuliert. Die erste Hälfte der Berichtsperiode zeigte somit zumindest auf den ersten Blick eine herausragende Performance, gerade für amerikanische Aktien. Bei näherer Betrachtung blieb jedoch die Konklusion, dass primär der Hype um künstliche Intelligenz und die damit eng verbundene Wertsteigerung von sieben US Mega-Caps für die stark positive Differenz sorgte.

Nach dem Sommer belastete insbesondere die auf sich warten lassende (leichte) Rezession, die auch die Türen zu weniger hohen Zinsen aufgestossen hätte. Bei sichtbar rückläufigen Inflationsraten hat jüngst aber die amerikanische Notenbank Fed erneute Zinssenkungsfantasien aufkommen lassen und damit die Finanzmärkte zum Jahresschluss nochmals beflügelt. In diesem Umfeld verzeichneten Anleihen als auch Aktien deutliche Gewinne während der US-Dollar als auch der Euro gegenüber dem Schweizer Franken nachgaben.

2. Rückblick auf für den Fonds relevante Kategorien

Die Finanzmärkte begannen das vierte Quartal in der Defensive, wobei die Trends, die das zweite und dritte Quartal dominiert hatten, weiter anhielten: steigende Renditen bei den Staatsanleihen und schwache Aktienmärkte. Ende Oktober, signalisierte die Fed, dass das Ende der Zinserhöhungsphase erreicht sei. Dies löste signifikante Kursanstiege an den Finanzmärkten aus, wobei die Anleiherenditen fielen, die Bonitätsaufschläge sanken und die Aktienmärkte auf das höchste Niveau des Jahres kletterten. Vor diesem Hintergrund verbuchten hochverzinsliche Anleihen das fünfte Quartal in Folge positive Renditen. Die Bonitätsaufschläge für hochverzinsliche Anleihen reduzierten sich in Europa und in den USA ebenfalls und sogar noch stärker. Die Anleihen mit einem B-Rating legten dabei am deutlichsten zu, dicht gefolgt von Anleihen mit BB-Rating. CCC-Ratings entwickelten sich während des Quartals schlechter, insbesondere in Europa, wo das Wirtschaftswachstum schwächer ist als in Nordamerika. Die Emissionstätigkeit für neue hochverzinsliche Anleihen liess im Verlauf des Quartals etwas nach. Bis Mitte November hielten sich viele Emittenten angesichts des hohen Zinsniveaus zurück. Dank sinkender Renditen und einer besseren Anlegerstimmung nahmen die Aktivitäten am Primärmarkt einige Wochen lang zu, bevor sie Mitte Dezember erneut abflauten. Wir sahen eine gute Mischung aus Emittenten aus verschiedenen Sektoren und über das gesamte Ratingspektrum hinweg, einschliesslich bekannter Namen und Emittenten von Erstanleihen. 2023 erwies sich als ein ausgezeichnetes Jahr für Anleger in High-Yield-Anleihen.

3. Performancerückblick

Der Fonds erzielte eine positive Performance, gegenüber der Benchmark haben wir etwas an Performance verloren. Der Grossteil der Unterperformance war auf gewisse Emittenten in Schwellenländern zurückzuführen, die im Berichtszeitraum eine schlechte Performance erzielten. Unsere chinesischen Titel entwickelten sich nicht wie erhofft, da die Erholung im Immobiliensektor nicht eingetreten ist. Wir hielten auch eine US- und eine europäische Anleihe mit unerfreulicher Performance. Was die verpassten Opportunitäten anbelangt, so hatten wir kein Engagement in Kreuzfahrt-, Fluggesellschafts- und Energieunternehmen, die alle sehr positiv zur Benchmark-Performance beitrugen. Andererseits haben wir bei der Wertpapierselektion in den Bereichen Banken, Medien und Telekommunikation sehr gut abgeschnitten. Zu den einzelnen Emittenten in anderen Sektoren, die einen bemerkenswerten positiven Einfluss auf die Performance hatten, gehören einige unserer bevorzugten SDG Leader. Was die Asset-Allokation anbelangt, so wirkte sich unsere Untergewichtung in Titel mit CCC-Ratings in diesem starken Marktumfeld im Vergleich zum Referenzindex negativ aus. 2023 war ein schwieriges Jahr für nachhaltige hochverzinsliche Anleihen im Vergleich zu traditionellen hochverzinslichen Anleihen, da einige der leistungsstärksten Sektoren und Ratingklassen in diesem Segment unterrepräsentiert sind. Vor diesem Hintergrund entwickelte sich der Fonds dennoch gut.

| Klasse | ISIN | Valor | Distribution | Performance in % |
|---------|--------------|-----------|--------------|------------------|
| AAH EUR | LU0830970272 | 19520551 | Pay out | 4.71 |
| AT | LU0582725312 | 012353464 | Accumulate | 6.90 |
| ATH CHF | LU0556184884 | 011963041 | Accumulate | 2.44 |
| ATH EUR | LU0556185345 | 011963062 | Accumulate | 4.72 |
| BTH CHF | LU0999469975 | 23107102 | Accumulate | 3.05 |

| Klasse | ISIN | Valor | Distribution | Performance in % |
|----------------------------------|--------------|----------|--------------|------------------|
| DAH EUR | LU0830970603 | 19520589 | Pay out | 5.81 |
| DT | LU1495639111 | 34048559 | Accumulate | 8.06 |
| DTH CHF | LU0582724935 | 12353466 | Accumulate | 3.59 |
| DTH EUR | LU1495639202 | 34048560 | Accumulate | 5.86 |
| GT (Schliessung 22.05.2024) | LU0899938657 | 20856876 | Accumulate | 8.17 |
| GTH CHF (Schliessung 26.09.2023) | LU0866336711 | 20261061 | Accumulate | -1.86 |
| GTH EUR | LU0899938574 | 20856872 | Accumulate | 5.95 |
| NT | LU1637934743 | 37269600 | Accumulate | 8.77 |
| NTH CHF | LU1506499356 | 34347171 | Accumulate | 4.31 |
| NTH EUR | LU1637934669 | 37269594 | Accumulate | 6.52 |

Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible USD

1. Marktübersicht

Eine verfrühte Jahresend-Rally hat seit November 2023 die Mehrzahl der Investoren mit einem wechselhaften Anlageperiode vom Februar 2023 bis Januar 2024 versöhnt. Mit viel Euphorie sind die Finanzmärkte gestartet und das obwohl zu Beginn des Jahres das baldige Eintreten einer globalen Rezession dem Marktkonsens entsprach. Doch die teils prognostizierte Energiekrise wurde dank eines milden Winters vermieden und insbesondere in den USA sorgte der überraschend robuste Konjunkturverlauf für die nötige Stütze der Aktienmärkte. Weder weitere Leitzinserhöhungen in praktisch allen entwickelten Regionen (Ausnahme Japan) noch die Turbulenzen im Bankensektor konnten für eine nachhaltige Umkehr dieses positiven Trends sorgen.

Ebenfalls unterstützend wirkten die meist tiefer als erwartet publizierten Inflationszahlen und es zeigte sich zunehmend, dass der Kampf gegen die mancherorts aus dem Ruder gelaufene Preissteigerung bald gewonnen werden dürfte. Entsprechend wurde bereits früh im Jahr über mögliche Zinsgipfel oder sogar etwaige Zinssenkungen zum Jahresende spekuliert. Die erste Hälfte der Berichtsperiode zeigte somit zumindest auf den ersten Blick eine herausragende Performance, gerade für amerikanische Aktien. Bei näherer Betrachtung blieb jedoch die Konklusion, dass primär der Hype um künstliche Intelligenz und die damit eng verbundene Wertsteigerung von sieben US Mega-Caps für die stark positive Differenz sorgte.

Nach dem Sommer belastete insbesondere die auf sich warten lassende (leichte) Rezession, die auch die Türen zu weniger hohen Zinsen aufgestossen hätte. Bei sichtbar rückläufigen Inflationsraten hat jüngst aber die amerikanische Notenbank Fed erneute Zinssenkungsfantasien aufkommen lassen und damit die Finanzmärkte zum Jahreschluss nochmals beflügelt. In diesem Umfeld verzeichneten Anleihen als auch Aktien deutliche Gewinne während der US-Dollar als auch der Euro gegenüber dem Schweizer Franken nachgaben.

2. Rückblick auf für den Fonds relevante Kategorien

Am Anfang der Berichtsperiode schienen die Notenbanken ihr Narrativ von «höheren Zinsen für länger» erfolgreich an den Märkten etabliert zu haben. Das Schreckgespenst eines dritten Jahres in Folge mit negativer Gesamtrendite wurde für globale Unternehmensanleihen immer realistischer. Unterstützt durch ausgabefreudige Konsumentinnen und Konsumenten und einen resilienten Arbeitsmarkt in den USA sowie auf hohem Niveau verharrenden Inflationszahlen, kletterten die Zinsen beidseits des Atlantiks weiter in die Höhe. Die Marktreaktion auf die gestiegenen geopolitischen Risiken durch den verheerenden Terrorangriff auf Israel war verhalten. Die Zinsen fielen nur vorübergehend, und der Ölpreis bewegte sich kaum. Die Zinsvolatilität blieb sehr hoch und erreichte Ende Oktober einen Höhepunkt, als die Rendite der zehnjährigen US-Staatsanleihen zum ersten Mal seit 2007 die Fünfprozent-Marke überschritt. Der kontinuierliche Anstieg der nominalen und realen Zinsen belastete die Aktienmärkte und führte zu einer Ausweitung der Credit Spreads. Der erste Novembertag brachte dann einen kompletten Stimmungsumschwung: Nachdem die Europäische Zentralbank (EZB) und die Bank of Japan keine Zinsänderung vorgenommen hatten, liess auch die amerikanische Fed an ihrer regulären Sitzung wie erwartet die Zinsen unverändert. Die anschliessende Pressekonferenz von Jerome Powell markierte aber einen Wendepunkt (Pivot) für die Märkte. Die Investoren interpretierten seine Aussagen dahingehend, dass die Fed keine weiteren Zinserhöhungen plane und vielmehr bald erste Zinssenkungen bevorstünden. Die schwachen Konjunkturdaten und die hinter den Erwartungen zurückbleibenden Neuemissionspläne für US-Staatsanleihen liessen die Aktienmärkte kräftig steigen und die Rendite der zehnjährigen US-Staatsanleihen fallen. Dies war nur der Anfang einer sich selbst verstärkenden Bewegung, die bis zum Ende der Berichtsperiode andauerte. Damit wurde der November der beste Monat für den US-Anleihenmarkt in den vergangenen 40 Jahren. Mindestens zum siebten Mal in diesem Zinszyklus spekulierten die Märkte auf eine Trendwende der Zentralbanken in Richtung expansive Politik. Doch die Hoffnungen auf baldige Zinssenkungen wurden bisher regelmässig enttäuscht. Diesmal wurde die Rallye in allen Anlageklassen in den letzten zwei Monaten des Jahres jedoch von einer Reihe technischer Faktoren und Verhaltensmuster der Investoren befeuert. So waren die meisten Marktplayer bis Ende Oktober nämlich defensiv positioniert und hielten hohe Bargeldbestände. Sie wurden von den steigenden Kursen risikobehafteter Aktiva und den fallenden Zinsen überrascht. Entsprechend mussten sie ihre Short-Positionen schliessen und das Risiko in den Portfolios erhöhen. Die relativ attraktiven Ausgangsbewertungen und die Angst der Investoren, etwas zu verpassen (Fear of missing out, FOMO) trugen zum Kursfeuerwerk bei. An ihrer letzten Sitzung des Jahres 2023 Mitte Dezember hat die Fed auch nichts unternommen, um die Euphorie an den Märkten zu bremsen. Der breite US-Aktienindex S&P500 erreichte dadurch ein Allzeithöchst. Die vorsichtigeren Töne der EZB wurden ignoriert, wodurch viele Märkte innerhalb von nur zwei Monaten von Jahrestiefst- zu Jahreshöchstständen emporschnellten. Im Vergleich zum März 2022, als die Fed mit den Zinserhöhungen begonnen hatte, notieren die Aktienmärkte inzwischen wieder höher, die Spreads haben sich verengt und die impliziten Volatilitäten sind überall gesunken. Die so entstandenen finanziellen Rahmenbedingungen konterkarieren jedoch die Absichten der Zentralbanken, die Inflation unter Kontrolle zu halten und könnten sie dazu zwingen, die Zinsen später wieder zu erhöhen oder zumindest restriktivere Töne anzuschlagen. Die jüngsten Marktbewegungen fördern zudem einen weiteren Widerspruch zutage, nämlich jenen zwischen tiefen Zinsen (die einer schwächeren Wirtschaftsentwicklung entsprechen würden) und hohen Aktienbewertungen (die eine brummende Wirtschaft und steigende Unternehmensgewinne implizieren). Der einzige Ausweg aus diesem Dilemma wäre eine kontrollierte Abschwächung der Konjunktur (Soft Landing), die Zinssenkungen erlauben würde, bevor die hohen Zinsen weitere Unfälle verursachen. Dieses Soft-Landing-Szenario scheint nicht unmöglich. Doch das Risiko, dass es nicht gelingt, ist an den Märkten derzeit nicht eingepreist. Unternehmensanleihen haben im vierten Quartal von den tieferen Zinsen profitiert, aber auch die Spreads gingen deutlich zurück. Vor allem High-Yield-Anleihen im BB-Segment sowie nachrangige Unternehmens- und Finanzanleihen erzielten Renditen im doppelstelligen Bereich und machten die Verluste des Vorjahres weitgehend wett. Die Spreads liegen Ende 2023 zwar auf einem nicht mehr günstigen Niveau, aber im historischen Vergleich im mittleren Bereich.

3. Performancerückblick

Der Fonds hat das Jahr mit einer Outperformance (vor Kosten) gegenüber seiner Benchmark abgeschlossen. Zunächst konnte man von den sinken Kreditrisikoprämien am Anfang des Jahres profitieren, wobei dann temporär die erhöhte Volatilität durch die Notübernahme der CS die Performance getrübt wurde. Hier war das Übergewicht in Financials nicht hilfreich. Im Nachgang konnte der durch seine guten Investitionen in Unternehmensanleihen wieder aufholen und das Jahr positiv abschliessen.

| Klasse | ISIN | Valor | Distribution | Performance in % |
|--------|--------------|-----------|--------------|------------------|
| AA | LU0141248962 | 001363590 | Pay out | 1.49 |
| AT | LU0161531685 | 001544297 | Accumulate | 1.49 |
| CT | LU1663713508 | 37844069 | Accumulate | 1.96 |
| DA | LU0276847182 | 2794985 | Pay out | 2.03 |
| DT | LU1495639970 | 34048566 | Accumulate | 2.04 |
| GT | LU0899939119 | 20858108 | Accumulate | 2.10 |
| NT | LU1932595454 | 045701359 | Accumulate | 2.49 |

Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Corporate Hybrid

1. Marktübersicht

Eine verfrühte Jahresend-Rally hat seit November 2023 die Mehrzahl der Investoren mit einem wechselhaften Anlageperiode vom Februar 2023 bis Januar 2024 versöhnt. Mit viel Euphorie sind die Finanzmärkte gestartet und das obwohl zu Beginn des Jahres das baldige Eintreten einer globalen Rezession dem Marktkonsens entsprach. Doch die teils prognostizierte Energiekrise wurde dank eines milden Winters vermieden und insbesondere in den USA sorgte der überraschend robuste Konjunkturverlauf für die nötige Stütze der Aktienmärkte. Weder weitere Leitzinserhöhungen in praktisch allen entwickelten Regionen (Ausnahme Japan) noch die Turbulenzen im Bankensektor konnten für eine nachhaltige Umkehr dieses positiven Trends sorgen.

Ebenfalls unterstützend wirkten die meist tiefer als erwartet publizierten Inflationszahlen und es zeigte sich zunehmend, dass der Kampf gegen die mancherorts aus dem Ruder gelaufene Preissteigerung bald gewonnen werden dürfte. Entsprechend wurde bereits früh im Jahr über mögliche Zinsgipfel oder sogar etwaige Zinssenkungen zum Jahresende spekuliert. Die erste Hälfte der Berichtsperiode zeigte somit zumindest auf den ersten Blick eine herausragende Performance, gerade für amerikanische Aktien. Bei näherer Betrachtung blieb jedoch die Konklusion, dass primär der Hype um künstliche Intelligenz und die damit eng verbundene Wertsteigerung von sieben US Mega-Caps für die stark positive Differenz sorgte.

Nach dem Sommer belastete insbesondere die auf sich warten lassende (leichte) Rezession, die auch die Türen zu weniger hohen Zinsen aufgestossen hätte. Bei sichtbar rückläufigen Inflationsraten hat jüngst aber die amerikanische Notenbank Fed erneute Zinssenkungsfantasien aufkommen lassen und damit die Finanzmärkte zum Jahreschluss nochmals beflügelt. In diesem Umfeld verzeichneten Anleihen als auch Aktien deutliche Gewinne während der US-Dollar als auch der Euro gegenüber dem Schweizer Franken nachgaben.

2. Rückblick auf für den Fonds relevante Kategorien

Am Anfang der Berichtsperiode schienen die Notenbanken ihr Narrativ von «höheren Zinsen für länger» erfolgreich an den Märkten etabliert zu haben. Das Schreckgespenst eines dritten Jahres in Folge mit negativer Gesamtrendite wurde für globale Unternehmensanleihen immer realistischer. Unterstützt durch ausgabefreudige Konsumentinnen und Konsumenten und einen resilienten Arbeitsmarkt in den USA sowie auf hohem Niveau verharrenden Inflationszahlen, kletterten die Zinsen beidseits des Atlantiks weiter in die Höhe. Die Marktreaktion auf die gestiegenen geopolitischen Risiken durch den verheerenden Terrorangriff auf Israel war verhalten. Die Zinsen fielen nur vorübergehend, und der Ölpreis bewegte sich kaum. Die Zinsvolatilität blieb sehr hoch und erreichte Ende Oktober einen Höhepunkt, als die Rendite der zehnjährigen US Staatsanleihen zum ersten Mal seit 2007 die Fünfprozent-Marke überschritt. Der kontinuierliche Anstieg der nominalen und realen Zinsen belastete die Aktienmärkte und führte zu einer Ausweitung der Credit Spreads. Der erste Novembertag brachte dann einen kompletten Stimmungsumschwung: Nachdem die Europäische Zentralbank (EZB) und die Bank of Japan keine Zinsänderung vorgenommen hatten, liess auch die amerikanische Fed an ihrer regulären Sitzung wie erwartet die Zinsen unverändert. Die anschliessende Pressekonferenz von Jerome Powell markierte aber einen Wendepunkt (Pivot) für die Märkte. Die Investoren interpretierten seine Aussagen dahingehend, dass die Fed keine weiteren Zinserhöhungen plane und vielmehr bald erste Zinssenkungen bevorstünden. Die schwachen Konjunkturdaten und die hinter den Erwartungen zurückbleibenden Neuemissionspläne für US-Staatsanleihen liessen die Aktienmärkte kräftig steigen und die Rendite der zehnjährigen US-Staatsanleihen fallen. Dies war nur der Anfang einer sich selbst verstärkenden Bewegung, die bis zum Ende der Berichtsperiode andauerte. Damit wurde der November der beste Monat für den US-Anleihenmarkt in den vergangenen 40 Jahren. Mindestens zum siebten Mal in diesem Zinszyklus spekulierten die Märkte auf eine Trendwende der Zentralbanken in Richtung expansive Politik. Doch die Hoffnungen auf baldige Zinssenkungen wurden bisher regelmässig enttäuscht. Diesmal wurde die Rallye in allen Anlageklassen in den letzten zwei Monaten des Jahres jedoch von einer Reihe technischer Faktoren und Verhaltensmuster der Investoren befeuert. So waren die meisten Marktplayer bis Ende Oktober nämlich defensiv positioniert und hielten hohe Bargeldbestände. Sie wurden von den steigenden Kursen risikobehafteter Aktiva und den fallenden Zinsen überrascht. Entsprechend mussten sie ihre Short-Positionen schliessen und das Risiko in den Portfolios erhöhen. Die relativ attraktiven Ausgangsbewertungen und die Angst der Investoren, etwas zu verpassen (Fear of missing out, FOMO) trugen zum Kursfeuerwerk bei. An ihrer letzten Sitzung des Jahres 2023 Mitte Dezember hat die Fed auch nichts unternommen, um die Euphorie an den Märkten zu bremsen. Der breite US-Aktienindex S&P500 erreichte dadurch ein Allzeithöchst. Die vorsichtigeren Töne der EZB wurden ignoriert, wodurch viele Märkte innerhalb von nur zwei Monaten von Jahrestiefst- zu Jahreshöchstständen emporschnellten. Im Vergleich zum März 2022, als die Fed mit den Zinserhöhungen begonnen hatte, notieren die Aktienmärkte inzwischen wieder höher, die Spreads haben sich verengt und die impliziten Volatilitäten sind überall gesunken. Die so entstandenen finanziellen Rahmenbedingungen konterkarieren jedoch die Absichten der Zentralbanken, die Inflation unter Kontrolle zu halten und könnten sie dazu zwingen, die Zinsen später wieder zu erhöhen oder zumindest restriktivere Töne anzuschlagen. Die jüngsten Marktbewegungen fördern zudem einen weiteren Widerspruch zutage, nämlich jenen zwischen tiefen Zinsen (die einer schwächeren Wirtschaftsentwicklung entsprechen würden) und hohen Aktienbewertungen (die eine brummende Wirtschaft und steigende Unternehmensgewinne implizieren). Der einzige Ausweg aus diesem Dilemma wäre eine kontrollierte Abschwächung der Konjunktur (Soft Landing), die Zinssenkungen erlauben würde, bevor die hohen Zinsen weitere Unfälle verursachen. Dieses Soft-Landing-Szenario scheint nicht unmöglich. Doch das Risiko, dass es nicht gelingt, ist an den Märkten derzeit nicht eingepreist. Unternehmensanleihen haben seit November 2023 von den tieferen Zinsen profitiert, aber auch die Spreads gingen deutlich zurück. Nachrangige Unternehmensanleihen erzielten Renditen im doppelstelligen Bereich und machten die Verluste des Vorjahres weitgehend wett. Die Spreads liegen Ende Januar 2024 zwar auf einem nicht mehr günstigen Niveau, aber im historischen Vergleich im mittleren Bereich.

3. Performancerückblick

Der Markt für nachrangige Unternehmensanleihen hat sich von den Turbulenzen im Vorjahr gut erholt. Dank einer soliden Nachfrage der Investoren und weniger Neuemissionen als Rückzahlungen konnten Corporate Hybrids eine deutlich bessere Performance als den Gesamtmarkt erzielen. Der Fonds hat eine positive absolute Performance und eine positive relative Performance gegenüber der Benchmark erzielt. In der Berichtsperiode haben die Übergewichtung von Telekom und Energie sowie der BB Bereich den grössten positiven Beitrag geliefert.

| Klasse | ISIN | Valor | Distribution | Performance in % |
|---------------------------------|--------------|-----------|--------------|------------------|
| AA | LU2511502226 | 120721633 | Pay out | 7.67 |
| ATH CHF | LU2508240509 | 120608598 | Accumulate | 5.18 |
| DT | LU2365392617 | 112681129 | Accumulate | 8.34 |
| DTH CHF (Lancierung 10.01.2024) | LU2740254417 | 131800092 | Accumulate | 1.08 |
| GTH CHF | LU2364758834 | 112686288 | Accumulate | 5.93 |
| NTH CHF | LU2364758917 | 112686800 | Accumulate | 5.18 |
| STH CHF | LU2368700907 | 112797487 | Accumulate | 6.52 |
| STH USD | LU2364759055 | 112698545 | Accumulate | 10.88 |

Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible EUR

1. Marktübersicht

Eine verfrühte Jahresend-Rally hat seit November 2023 die Mehrzahl der Investoren mit einem wechselhaften Anlageperiode vom Februar 2023 bis Januar 2024 versöhnt. Mit viel Euphorie sind die Finanzmärkte gestartet und das obwohl zu Beginn des Jahres das baldige Eintreten einer globalen Rezession dem Marktkonsens entsprach. Doch die teils prognostizierte Energiekrise wurde dank eines milden Winters vermieden und insbesondere in den USA sorgte der überraschend robuste Konjunkturverlauf für die nötige Stütze der Aktienmärkte. Weder weitere Leitzinserhöhungen in praktisch allen entwickelten Regionen (Ausnahme Japan) noch die Turbulenzen im Bankensektor konnten für eine nachhaltige Umkehr dieses positiven Trends sorgen.

Ebenfalls unterstützend wirkten die meist tiefer als erwartet publizierten Inflationszahlen und es zeigte sich zunehmend, dass der Kampf gegen die mancherorts aus dem Ruder gelaufene Preissteigerung bald gewonnen werden dürfte. Entsprechend wurde bereits früh im Jahr über mögliche Zinsgipfel oder sogar etwaige Zinssenkungen zum Jahresende spekuliert. Die erste Hälfte der Berichtsperiode zeigte somit zumindest auf den ersten Blick eine herausragende Performance, gerade für amerikanische Aktien. Bei näherer Betrachtung blieb jedoch die Konklusion, dass primär der Hype um künstliche Intelligenz und die damit eng verbundene Wertsteigerung von sieben US Mega-Caps für die stark positive Differenz sorgte.

Nach dem Sommer belastete insbesondere die auf sich warten lassende (leichte) Rezession, die auch die Türen zu weniger hohen Zinsen aufgestossen hätte. Bei sichtbar rückläufigen Inflationsraten hat jüngst aber die amerikanische Notenbank Fed erneute Zinssenkungsfantasien aufkommen lassen und damit die Finanzmärkte zum Jahreschluss nochmals beflügelt. In diesem Umfeld verzeichneten Anleihen als auch Aktien deutliche Gewinne während der US-Dollar als auch der Euro gegenüber dem Schweizer Franken nachgaben.

2. Rückblick auf für den Fonds relevante Kategorien

Am Anfang der Berichtsperiode schienen die Notenbanken ihr Narrativ von «höheren Zinsen für länger» erfolgreich an den Märkten etabliert zu haben. Das Schreckgespenst eines dritten Jahres in Folge mit negativer Gesamtrendite wurde für globale Unternehmensanleihen immer realistischer. Unterstützt durch ausgabefreudige Konsumentinnen und Konsumenten und einen resilienten Arbeitsmarkt in den USA sowie auf hohem Niveau verharrenden Inflationszahlen, kletterten die Zinsen beidseits des Atlantiks weiter in die Höhe. Die Marktreaktion auf die gestiegenen geopolitischen Risiken durch den verheerenden Terrorangriff auf Israel war verhalten. Die Zinsen fielen nur vorübergehend, und der Ölpreis bewegte sich kaum. Die Zinsvolatilität blieb sehr hoch und erreichte Ende Oktober einen Höhepunkt, als die Rendite der zehnjährigen US-Staatsanleihen zum ersten Mal seit 2007 die Fünfprozent-Marke überschritt. Der kontinuierliche Anstieg der nominalen und realen Zinsen belastete die Aktienmärkte und führte zu einer Ausweitung der Credit Spreads. Der erste Novembertag brachte dann einen kompletten Stimmungsumschwung: Nachdem die Europäische Zentralbank (EZB) und die Bank of Japan keine Zinsänderung vorgenommen hatten, liess auch die amerikanische Fed an ihrer regulären Sitzung wie erwartet die Zinsen unverändert. Die anschliessende Pressekonferenz von Jerome Powell markierte aber einen Wendepunkt (Pivot) für die Märkte. Die Investoren interpretierten seine Aussagen dahingehend, dass die Fed keine weiteren Zinserhöhungen plane und vielmehr bald erste Zinssenkungen bevorstünden. Die schwachen Konjunkturdaten und die hinter den Erwartungen zurückbleibenden Neuemissionspläne für US-Staatsanleihen liessen die Aktienmärkte kräftig steigen und die Rendite der zehnjährigen US-Staatsanleihen fallen. Dies war nur der Anfang einer sich selbst verstärkenden Bewegung, die bis zum Ende der Berichtsperiode andauerte. Damit wurde der November der beste Monat für den US-Anleihenmarkt in den vergangenen 40 Jahren. Mindestens zum siebten Mal in diesem Zinszyklus spekulierten die Märkte auf eine Trendwende der Zentralbanken in Richtung expansive Politik. Doch die Hoffnungen auf baldige Zinssenkungen wurden bisher regelmässig enttäuscht. Diesmal wurde die Rallye in allen Anlageklassen in den letzten zwei Monaten des Jahres jedoch von einer Reihe technischer Faktoren und Verhaltensmuster der Investoren befeuert. So waren die meisten Marktplayer bis Ende Oktober nämlich defensiv positioniert und hielten hohe Bargeldbestände. Sie wurden von den steigenden Kursen risikobehafteter Aktiva und den fallenden Zinsen überrascht. Entsprechend mussten sie ihre Short-Positionen schliessen und das Risiko in den Portfolios erhöhen. Die relativ attraktiven Ausgangsbewertungen und die Angst der Investoren, etwas zu verpassen (Fear of missing out, FOMO) trugen zum Kursfeuerwerk bei. An ihrer letzten Sitzung des Jahres 2023 Mitte Dezember hat die Fed auch nichts unternommen, um die Euphorie an den Märkten zu bremsen. Der breite US-Aktienindex S&P500 erreichte dadurch ein Allzeithöchst. Die vorsichtigeren Töne der EZB wurden ignoriert, wodurch viele Märkte innerhalb von nur zwei Monaten von Jahrestiefst- zu Jahreshöchstständen emporschnellten. Im Vergleich zum März 2022, als die Fed mit den Zinserhöhungen begonnen hatte, notieren die Aktienmärkte inzwischen wieder höher, die Spreads haben sich verengt und die impliziten Volatilitäten sind überall gesunken. Die so entstandenen finanziellen Rahmenbedingungen konterkarieren jedoch die Absichten der Zentralbanken, die Inflation unter Kontrolle zu halten und könnten sie dazu zwingen, die Zinsen später wieder zu erhöhen oder zumindest restriktivere Töne anzuschlagen. Die jüngsten Marktbewegungen fördern zudem einen weiteren Widerspruch zutage, nämlich jenen zwischen tiefen Zinsen (die einer schwächeren Wirtschaftsentwicklung entsprechen würden) und hohen Aktienbewertungen (die eine brummende Wirtschaft und steigende Unternehmensgewinne implizieren). Der einzige Ausweg aus diesem Dilemma wäre eine kontrollierte Abschwächung der Konjunktur (Soft Landing), die Zinssenkungen erlauben würde, bevor die hohen Zinsen weitere Unfälle verursachen. Dieses Soft-Landing-Szenario scheint nicht unmöglich. Doch das Risiko, dass es nicht gelingt, ist an den Märkten derzeit nicht eingepreist. Unternehmensanleihen haben im vierten Quartal von den tieferen Zinsen profitiert, aber auch die Spreads gingen deutlich zurück. Vor allem High-Yield-Anleihen im BB-Segment sowie nachrangige Unternehmens- und Finanzanleihen erzielten Renditen im doppelstelligen Bereich und machten die Verluste des Vorjahres weitgehend wett. Die Spreads liegen Ende 2023 zwar auf einem nicht mehr günstigen Niveau, aber im historischen Vergleich im mittleren Bereich.

3. Performancerückblick

Der Fonds konnte über das Jahr gesehen einen kleinen Outperformance erzielen. Zunächst konnte das Portfolio von einem guten Start in das Berichtsjahr profitieren. Das Übergewicht von Finanztiteln hatte mit der CS Notübernahme allerdings stark an Performance gekostet. Im Nachgang konnte sich der Fonds stetig erholen und schlussendlich seine Benchmark noch übertreffen. Haupttreiber war das Übergewicht bei Unternehmensanleihen und eine gute Durationpositionierung gegen Ende des Jahres.

| Klasse | ISIN | Valor | Distribution | Performance in % |
|--------|--------------|-----------|--------------|------------------|
| AA | LU0141248459 | 001363644 | Pay out | 3.37 |
| AT | LU0161530794 | 001544301 | Accumulate | 3.37 |
| CT | LU1663712799 | 37844040 | Accumulate | 3.84 |
| DA | LU0276846457 | 2794968 | Pay out | 4.03 |
| DT | LU1495639897 | 34048565 | Accumulate | 4.02 |
| GT | LU0899937501 | 20855074 | Accumulate | 4.09 |
| NT | LU1932537092 | 045701357 | Accumulate | 4.49 |

Swisscanto (LU) Bond Fund Sustainable Global Credit

1. Marktübersicht

Eine verfrühte Jahresend-Rally hat seit November 2023 die Mehrzahl der Investoren mit einem wechselhaften Anlageperiode vom Februar 2023 bis Januar 2024 versöhnt. Mit viel Euphorie sind die Finanzmärkte gestartet und das obwohl zu Beginn des Jahres das baldige Eintreten einer globalen Rezession dem Marktkonsens entsprach. Doch die teils prognostizierte Energiekrise wurde dank eines milden Winters vermieden und insbesondere in den USA sorgte der überraschend robuste Konjunkturverlauf für die nötige Stütze der Aktienmärkte. Weder weitere Leitzinserhöhungen in praktisch allen entwickelten Regionen (Ausnahme Japan) noch die Turbulenzen im Bankensektor konnten für eine nachhaltige Umkehr dieses positiven Trends sorgen.

Ebenfalls unterstützend wirkten die meist tiefer als erwartet publizierten Inflationszahlen und es zeigte sich zunehmend, dass der Kampf gegen die mancherorts aus dem Ruder gelaufene Preissteigerung bald gewonnen werden dürfte. Entsprechend wurde bereits früh im Jahr über mögliche Zinsgipfel oder sogar etwaige Zinssenkungen zum Jahresende spekuliert. Die erste Hälfte der Berichtsperiode zeigte somit zumindest auf den ersten Blick eine herausragende Performance, gerade für amerikanische Aktien. Bei näherer Betrachtung blieb jedoch die Konklusion, dass primär der Hype um künstliche Intelligenz und die damit eng verbundene Wertsteigerung von sieben US Mega-Caps für die stark positive Differenz sorgte.

Nach dem Sommer belastete insbesondere die auf sich warten lassende (leichte) Rezession, die auch die Türen zu weniger hohen Zinsen aufgestossen hätte. Bei sichtbar rückläufigen Inflationsraten hat jüngst aber die amerikanische Notenbank Fed erneute Zinssenkungsfantasien aufkommen lassen und damit die Finanzmärkte zum Jahreschluss nochmals beflügelt. In diesem Umfeld verzeichneten Anleihen als auch Aktien deutliche Gewinne während der US-Dollar als auch der Euro gegenüber dem Schweizer Franken nachgaben.

2. Rückblick auf für den Fonds relevante Kategorien

Am Anfang der Berichtsperiode schienen die Notenbanken ihr Narrativ von «höheren Zinsen für länger» erfolgreich an den Märkten etabliert zu haben. Das Schreckgespenst eines dritten Jahres in Folge mit negativer Gesamtrendite wurde für globale Unternehmensanleihen immer realistischer. Unterstützt durch ausgabefreudige Konsumentinnen und Konsumenten und einen resilienten Arbeitsmarkt in den USA sowie auf hohem Niveau verharrenden Inflationszahlen, kletterten die Zinsen beidseits des Atlantiks weiter in die Höhe. Die Marktreaktion auf die gestiegenen geopolitischen Risiken durch den verheerenden Terrorangriff auf Israel war verhalten. Die Zinsen fielen nur vorübergehend, und der Ölpreis bewegte sich kaum. Die Zinsvolatilität blieb sehr hoch und erreichte Ende Oktober einen Höhepunkt, als die Rendite der zehnjährigen US Staatsanleihen zum ersten Mal seit 2007 die Fünfprozent-Marke überschritt. Der kontinuierliche Anstieg der nominalen und realen Zinsen belastete die Aktienmärkte und führte zu einer Ausweitung der Credit Spreads. Der erste Novembertag brachte dann einen kompletten Stimmungsumschwung: Nachdem die Europäische Zentralbank (EZB) und die Bank of Japan keine Zinsänderung vorgenommen hatten, liess auch die amerikanische Fed an ihrer regulären Sitzung wie erwartet die Zinsen unverändert. Die anschliessende Pressekonferenz von Jerome Powell markierte aber einen Wendepunkt (Pivot) für die Märkte. Die Investoren interpretierten seine Aussagen dahingehend, dass die Fed keine weiteren Zinserhöhungen plane und vielmehr bald erste Zinssenkungen bevorstünden. Die schwachen Konjunkturdaten und die hinter den Erwartungen zurückbleibenden Neuemissionspläne für US-Staatsanleihen liessen die Aktienmärkte kräftig steigen und die Rendite der zehnjährigen US-Staatsanleihen fallen. Dies war nur der Anfang einer sich selbst verstärkenden Bewegung, die bis zum Ende der Berichtsperiode andauerte. Damit wurde der November der beste Monat für den US-Anleihenmarkt in den vergangenen 40 Jahren. Mindestens zum siebten Mal in diesem Zinszyklus spekulierten die Märkte auf eine Trendwende der Zentralbanken in Richtung expansive Politik. Doch die Hoffnungen auf baldige Zinssenkungen wurden bisher regelmässig enttäuscht. Diesmal wurde die Rallye in allen Anlageklassen in den letzten zwei Monaten des Jahres jedoch von einer Reihe technischer Faktoren und Verhaltensmuster der Investoren befeuert. So waren die meisten Marktplayer bis Ende Oktober nämlich defensiv positioniert und hielten hohe Bargeldbestände. Sie wurden von den steigenden Kursen risikobehafteter Aktiva und den fallenden Zinsen überrascht. Entsprechend mussten sie ihre Short-Positionen schliessen und das Risiko in den Portfolios erhöhen. Die relativ attraktiven Ausgangsbewertungen und die Angst der Investoren, etwas zu verpassen (Fear of missing out, FOMO) trugen zum Kursfeuerwerk bei. An ihrer letzten Sitzung des Jahres 2023 Mitte Dezember hat die Fed auch nichts unternommen, um die Euphorie an den Märkten zu bremsen. Der breite US-Aktienindex S&P500 erreichte dadurch ein Allzeithöchst. Die vorsichtigeren Töne der EZB wurden ignoriert, wodurch viele Märkte innerhalb von nur zwei Monaten von Jahrestiefst- zu Jahreshöchstständen emporschnellten. Im Vergleich zum März 2022, als die Fed mit den Zinserhöhungen begonnen hatte, notieren die Aktienmärkte inzwischen wieder höher, die Spreads haben sich verengt und die impliziten Volatilitäten sind überall gesunken. Die so entstandenen finanziellen Rahmenbedingungen konterkarieren jedoch die Absichten der Zentralbanken, die Inflation unter Kontrolle zu halten und könnten sie dazu zwingen, die Zinsen später wieder zu erhöhen oder zumindest restriktivere Töne anzuschlagen. Die jüngsten Marktbewegungen fördern zudem einen weiteren Widerspruch zutage, nämlich jenen zwischen tiefen Zinsen (die einer schwächeren Wirtschaftsentwicklung entsprechen würden) und hohen Aktienbewertungen (die eine brummende Wirtschaft und steigende Unternehmensgewinne implizieren). Der einzige Ausweg aus diesem Dilemma wäre eine kontrollierte Abschwächung der Konjunktur (Soft Landing), die Zinssenkungen erlauben würde, bevor die hohen Zinsen weitere Unfälle verursachen. Dieses Soft-Landing-Szenario scheint nicht unmöglich. Doch das Risiko, dass es nicht gelingt, ist an den Märkten derzeit nicht eingepreist. Unternehmensanleihen haben im vierten Quartal von den tieferen Zinsen profitiert, aber auch die Spreads gingen deutlich zurück. Vor allem High-Yield-Anleihen im BB-Segment sowie nachrangige Unternehmens- und Finanzanleihen erzielten Renditen im doppelstelligen Bereich und machten die Verluste des Vorjahres weitgehend wett. Die Spreads liegen Ende 2023 zwar auf einem nicht mehr günstigen Niveau, aber im historischen Vergleich im mittleren Bereich.

3. Performancerückblick

Anfangs 2023 lagen die Gesamtrenditen der globalen Unternehmensanleihen auf dem höchsten Stand seit über 13 Jahren. Dementsprechend hoch waren die Erwartungen an die Performance in diesem Jahr. Im letzten Quartal des Jahres startete dann endlich das Kursfeuerwerk und die Wertentwicklung drehte deutlich ins Plus. Der Fonds hat eine positive Brutto-Performance und ebenfalls eine Outperformance gegenüber der Benchmark vor Kosten erzielt. Den grössten positiven Beitrag lieferten die Übergewichtung und Selektion innerhalb des Finanzsektors. Die Übergewichtung defensiver Sektoren und der weitgehende Ausschluss des Energiesektors wirkten negativ. Die Durationspositionierung lieferte keinen nennenswerten Beitrag auf Jahressicht.

| Klasse | ISIN | Valor | Distribution | Performance in % |
|---------------------------------|--------------|-----------|--------------|------------------|
| AA | LU1813279012 | 041499713 | Pay out | 0.52 |
| AAH EUR | LU1813279442 | 041499724 | Pay out | 2.58 |
| AT | LU1813279103 | 041499717 | Accumulate | 0.51 |
| ATH EUR | LU1813279525 | 041499726 | Accumulate | 2.57 |
| BT | LU1813279368 | 041499722 | Accumulate | 0.95 |
| DAH EUR | LU1813279798 | 041499728 | Pay out | 3.05 |
| DT | LU1813279285 | 041499720 | Accumulate | 1.03 |
| DTH EUR | LU2399149009 | 114247346 | Accumulate | 2.85 |
| DTH USD (Lancierung 15.12.2023) | LU2729687645 | 131214287 | Accumulate | 0.36 |
| GT | LU2480904056 | 119034217 | Accumulate | 1.11 |
| GTH EUR | LU2480904130 | 119034257 | Accumulate | 3.15 |
| NT | LU1877924016 | 043582999 | Accumulate | 1.54 |

Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible CHF

1. Marktübersicht

Eine verfrühte Jahresend-Rally hat seit November 2023 die Mehrzahl der Investoren mit einem wechselhaften Anlageperiode vom Februar 2023 bis Januar 2024 versöhnt. Mit viel Euphorie sind die Finanzmärkte gestartet und das obwohl zu Beginn des Jahres das baldige Eintreten einer globalen Rezession dem Marktkonsens entsprach. Doch die teils prognostizierte Energiekrise wurde dank eines milden Winters vermieden und insbesondere in den USA sorgte der überraschend robuste Konjunkturverlauf für die nötige Stütze der Aktienmärkte. Weder weitere Leitzinserhöhungen in praktisch allen entwickelten Regionen (Ausnahme Japan) noch die Turbulenzen im Bankensektor konnten für eine nachhaltige Umkehr dieses positiven Trends sorgen.

Ebenfalls unterstützend wirkten die meist tiefer als erwartet publizierten Inflationszahlen und es zeigte sich zunehmend, dass der Kampf gegen die mancherorts aus dem Ruder gelaufene Preissteigerung bald gewonnen werden dürfte. Entsprechend wurde bereits früh im Jahr über mögliche Zinsgipfel oder sogar etwaige Zinssenkungen zum Jahresende spekuliert. Die erste Hälfte der Berichtsperiode zeigte somit zumindest auf den ersten Blick eine herausragende Performance, gerade für amerikanische Aktien. Bei näherer Betrachtung blieb jedoch die Konklusion, dass primär der Hype um künstliche Intelligenz und die damit eng verbundene Wertsteigerung von sieben US Mega-Caps für die stark positive Differenz sorgte.

Nach dem Sommer belastete insbesondere die auf sich warten lassende (leichte) Rezession, die auch die Türen zu weniger hohen Zinsen aufgestossen hätte. Bei sichtbar rückläufigen Inflationsraten hat jüngst aber die amerikanische Notenbank Fed erneute Zinssenkungsfantasien aufkommen lassen und damit die Finanzmärkte zum Jahresschluss nochmals beflügelt. In diesem Umfeld verzeichneten Anleihen als auch Aktien deutliche Gewinne.

2. Rückblick auf für den Fonds relevante Kategorien

Im Jahr 2023 erlebte auch die Schweiz eine rückläufige Inflation. Die Inflationsrate war ab dem zweiten Halbjahr bereits innerhalb dem von der Schweizerischen Nationalbank (SNB) anvisierten Zielbereich. Ein positiver Basiseffekt, insbesondere bei den Energiekosten, hat zu einer deutlichen Reduktion der Inflation geführt. Die Schweiz verzeichnete eine Abkühlung der Wirtschaft nicht zuletzt aufgrund des schwächelnden Handelspartners Deutschland. Jedoch blieb der private Konsum robust, unterstützt durch einen stabilen Arbeitsmarkt. Der Schweizer Franken behielt seinen Status als starke Währung, insbesondere im Vergleich zum Euro. Infolge geopolitischer Unsicherheiten war der Schweizer Franken gefragt, während der Euro aufgrund der schwierigen Rahmenbedingungen in der Eurozone schwächelte.

3. Performancerückblick

Im Berichtszeitraum von Februar 2023 bis Ende Januar 2024 erzielte der Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible CHF eine absolut positive Brutto-Performance. Es war ein volatiles Jahr für die Zinsen. Speziell im November und Dezember sind die Zinsen aber über alle Laufzeiten gefallen und trugen positiv zur absoluten Performance bei. Die Zinskurve wurde dabei flacher und ist am langen Ende weiterhin invers. Die Zinspositionierung hatte im Berichtszeitraum einen negativen Einfluss auf die relative Performance. Einen positiven Einfluss hingegen hatte die Kreditpositionierung, wobei der Fonds vom Übergewicht im Finanzsektor stark profitieren konnte.

| Klasse | ISIN | Valor | Distribution | Performance in % |
|--------|--------------|-----------|--------------|------------------|
| AA | LU0141248293 | 001363575 | Pay out | 3.01 |
| AT | LU0161530448 | 001544302 | Accumulate | 3.00 |
| BT | LU0999473811 | 23102574 | Accumulate | 3.39 |
| CT | LU1663701750 | 37844035 | Accumulate | 3.47 |
| DA | LU0276846374 | 2794954 | Pay out | 3.56 |
| DT | LU1495639541 | 34048563 | Accumulate | 3.00 |
| GT | LU0899937253 | 20855051 | Accumulate | 3.07 |
| NT | LU1932506709 | 045701359 | Accumulate | 3.46 |

Swisscanto (LU) Bond Fund Sustainable Global Aggregate

1. Marktübersicht

Eine verfrühte Jahresend-Rally hat seit November 2023 die Mehrzahl der Investoren mit einem wechselhaften Anlageperiode vom Februar 2023 bis Januar 2024 versöhnt. Mit viel Euphorie sind die Finanzmärkte gestartet und das obwohl zu Beginn des Jahres das baldige Eintreten einer globalen Rezession dem Marktkonsens entsprach. Doch die teils prognostizierte Energiekrise wurde dank eines milden Winters vermieden und insbesondere in den USA sorgte der überraschend robuste Konjunkturverlauf für die nötige Stütze der Aktienmärkte. Weder weitere Leitzinserhöhungen in praktisch allen entwickelten Regionen (Ausnahme Japan) noch die Turbulenzen im Bankensektor konnten für eine nachhaltige Umkehr dieses positiven Trends sorgen.

Ebenfalls unterstützend wirkten die meist tiefer als erwartet publizierten Inflationszahlen und es zeigte sich zunehmend, dass der Kampf gegen die mancherorts aus dem Ruder gelaufene Preissteigerung bald gewonnen werden dürfte. Entsprechend wurde bereits früh im Jahr über mögliche Zinsgipfel oder sogar etwaige Zinssenkungen zum Jahresende spekuliert. Die erste Hälfte der Berichtsperiode zeigte somit zumindest auf den ersten Blick eine herausragende Performance, gerade für amerikanische Aktien. Bei näherer Betrachtung blieb jedoch die Konklusion, dass primär der Hype um künstliche Intelligenz und die damit eng verbundene Wertsteigerung von sieben US Mega-Caps für die stark positive Differenz sorgte.

Nach dem Sommer belastete insbesondere die auf sich warten lassende (leichte) Rezession, die auch die Türen zu weniger hohen Zinsen aufgestossen hätte. Bei sichtbar rückläufigen Inflationsraten hat jüngst aber die amerikanische Notenbank Fed erneute Zinssenkungsfantasien aufkommen lassen und damit die Finanzmärkte zum Jahresschluss nochmals beflügelt. In diesem Umfeld verzeichneten Anleihen als auch Aktien deutliche Gewinne während der US-Dollar als auch der Euro gegenüber dem Schweizer Franken nachgaben.

2. Rückblick auf für den Fonds relevante Kategorien

Am Anfang der Berichtsperiode schienen die Notenbanken ihr Narrativ von «höheren Zinsen für länger» erfolgreich an den Märkten etabliert zu haben. Das Schreckgespenst eines dritten Jahres in Folge mit negativer Gesamtrendite wurde für globale Staatsanleihen immer realistischer. Unterstützt durch ausgabefreudige Konsumentinnen und Konsumenten und einen resilienten Arbeitsmarkt in den USA sowie auf hohem Niveau verharrenden Inflationszahlen, kletterten die Zinsen beidseits des Atlantiks weiter in die Höhe. Die Marktreaktion auf die gestiegenen geopolitischen Risiken durch den verheerenden Terrorangriff auf Israel war verhalten. Die Zinsen fielen nur vorübergehend, und der Ölpreis bewegte sich kaum. Die Zinsvolatilität blieb sehr hoch und erreichte Ende Oktober einen Höhepunkt, als die Rendite der zehnjährigen US-Staatsanleihen zum ersten Mal seit 2007 die Fünfprozent-Marke überschritt. Der erste Novembertag brachte dann einen kompletten Stimmungsumschwung: Nachdem die Europäische Zentralbank (EZB) und die Bank of Japan keine Zinsänderung vorgenommen hatten, liess auch die amerikanische Fed an ihrer regulären Sitzung wie erwartet die Zinsen unverändert. Die anschliessende Pressekonferenz von Jerome Powell markierte aber einen Wendepunkt (Pivot) für die Märkte. Die Investoren interpretierten seine Aussagen dahingehend, dass die Fed keine weiteren Zinserhöhungen plane und vielmehr bald erste Zinssenkungen bevorstünden. Die schwachen Konjunkturdaten und die hinter den Erwartungen zurückbleibenden Neuemissionspläne für US-Staatsanleihen liessen die Aktienmärkte kräftig steigen und die Rendite der zehnjährigen US-Staatsanleihen fallen. Dies war nur der Anfang einer sich selbst verstärkenden Bewegung, die bis zum Ende der Berichtsperiode andauerte. Damit wurde der November der beste Monat für den US-Anleihenmarkt in den vergangenen 40 Jahren. Mindestens zum siebten Mal in diesem Zinszyklus spekulierten die Märkte auf eine Trendwende der Zentralbanken in Richtung expansive Politik. Doch die Hoffnungen auf baldige Zinssenkungen wurden bisher regelmässig enttäuscht. Diesmal wurde die Rallye in allen Anlageklassen in den letzten zwei Monaten des Jahres jedoch von einer Reihe technischer Faktoren und Verhaltensmuster der Investoren befeuert. So waren die meisten Marktplayer bis Ende Oktober nämlich defensiv positioniert und hielten hohe Bargeldbestände. Sie wurden von den steigenden Kursen risikobehafteter Aktiva und den fallenden Zinsen überrascht. Entsprechend mussten sie ihre Short-Positionen schliessen und das Risiko in den Portfolios erhöhen. Die unterdessen attraktiven Ausgangsbewertungen und die Angst der Investoren, etwas zu verpassen (Fear of missing out, FOMO) trugen zum Kursfeuerwerk bei. An ihrer letzten Sitzung des Jahres 2023 Mitte Dezember hat die Fed auch nichts unternommen, um die Euphorie an den Märkten zu bremsen. Der breite US-Aktienindex S&P500 erreichte dadurch ein Allzeithochst. Die vorsichtigeren Töne der EZB wurden ignoriert, wodurch viele Märkte innerhalb von nur zwei Monaten von Jahrestiefst- zu Jahreshöchstständen emporschnellten.

3. Performancerückblick

Der Fonds wurde im Jahresverlauf auf das Sustainable Anlageuniversum ausgerichtet. Die absolute Fondsperformance war durch die starke Aufwertung des Schweizer Francs gegenüber den meisten Währungen dominiert und fiel entsprechend negativ aus. In der relativen Performance (vor Kosten) schloss der Fonds gegenüber Benchmark hingegen sehr positiv ab. Die Gründe dafür liegen in der Titelselektion, dem Einengen der Spreads von Unternehmensanleihen gegenüber Staatsanleihen und der Positionierung auf den Zinskurven in den verschiedenen Währungen.

| Klasse | ISIN | Valor | Distribution | Performance in % |
|--------|--------------|-----------|--------------|------------------|
| AA | LU0081697723 | 000644521 | Pay out | -5.78 |
| AT | LU0161532063 | 001544323 | Accumulate | -5.78 |
| BT | LU0999469116 | 23107124 | Accumulate | -5.43 |
| CT | LU1663713417 | 37844074 | Accumulate | -5.35 |
| DT | LU1495640630 | 34048572 | Accumulate | -5.15 |
| GT | LU0899938731 | 20857891 | Accumulate | -5.24 |
| NT | LU2445633097 | 116748825 | Accumulate | -4.87 |

Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible GBP

1. Marktübersicht

Eine verfrühte Jahresend-Rally hat seit November 2023 die Mehrzahl der Investoren mit einem wechselhaften Anlageperiode vom Februar 2023 bis Januar 2024 versöhnt. Mit viel Euphorie sind die Finanzmärkte gestartet und das obwohl zu Beginn des Jahres das baldige Eintreten einer globalen Rezession dem Marktkonsens entsprach. Doch die teils prognostizierte Energiekrise wurde dank eines milden Winters vermieden und insbesondere in den USA sorgte der überraschend robuste Konjunkturverlauf für die nötige Stütze der Aktienmärkte. Weder weitere Leitzinserhöhungen in praktisch allen entwickelten Regionen (Ausnahme Japan) noch die Turbulenzen im Bankensektor konnten für eine nachhaltige Umkehr dieses positiven Trends sorgen.

Ebenfalls unterstützend wirkten die meist tiefer als erwartet publizierten Inflationszahlen und es zeigte sich zunehmend, dass der Kampf gegen die mancherorts aus dem Ruder gelaufene Preissteigerung bald gewonnen werden dürfte. Entsprechend wurde bereits früh im Jahr über mögliche Zinsgipfel oder sogar etwaige Zinssenkungen zum Jahresende spekuliert. Die erste Hälfte der Berichtsperiode zeigte somit zumindest auf den ersten Blick eine herausragende Performance, gerade für amerikanische Aktien. Bei näherer Betrachtung blieb jedoch die Konklusion, dass primär der Hype um künstliche Intelligenz und die damit eng verbundene Wertsteigerung von sieben US Mega-Caps für die stark positive Differenz sorgte.

Nach dem Sommer belastete insbesondere die auf sich warten lassende (leichte) Rezession, die auch die Türen zu weniger hohen Zinsen aufgestossen hätte. Bei sichtbar rückläufigen Inflationsraten hat jüngst aber die amerikanische Notenbank Fed erneute Zinssenkungsfantasien aufkommen lassen und damit die Finanzmärkte zum Jahresschluss nochmals beflügelt. In diesem Umfeld verzeichneten Anleihen als auch Aktien deutliche Gewinne während der US-Dollar als auch der Euro gegenüber dem Schweizer Franken nachgaben.

2. Rückblick auf für den Fonds relevante Kategorien

Das Jahr 2023 war, gleich wie die Jahre zuvor, aussergewöhnlich. Nachdem global die Geldpolitik in restriktive Sphären überführt wurde, erwartete man deutliche Spuren in Form einer nachlassenden Wirtschaftsdynamik. Die prognostizierte Abschwächung blieb jedoch aus, und der Markt adjustierte seine Erwartungen in Form von weiter steigenden Zinsen.

In den meisten entwickelten Ländern waren dagegen die Inflationsraten klar auf dem Rückzug. Immer noch über den Inflationszielen der jeweiligen Notenbanken, doch auch in absoluten Grössen nicht mehr ganz so besorgniserregend. In Grossbritannien liess dieser Trend länger auf sich warten und etablierte sich erst gegen Ende des dritten Quartals. Gleichzeitig zeigte sich auch die Lohnentwicklung in den UK als problematisch. Obwohl der Arbeitsmarkt erste Anzeichen einer Abschwächung aufwies, stiegen die Löhne weiter zu stark, als dass sich die Bank of England damit zufriedengeben konnte.

Diese lokalen Divergenzen führten denn auch dazu, dass die Mitglieder der Bank of England im Vergleich zu ihren Peers weniger euphorisch den Sieg über die Inflation im Nachgang zur Covid-Pandemie feierten. Die globalen Finanzmärkte sind jedoch stark korreliert. Dies zeigte sich sehr schön in der Tatsache, dass im Sog der US-Zinsen auch in den UK die Zinsen in den letzten zwei Monaten des Jahres deutlich fielen.

Ob, und wie stark, die Bank of England im kommenden Jahr die Zinsen senken wird hängt stark von der weiteren Entwicklung der Inflation und des Lohndrucks in Grossbritannien ab. Die Abschwächung des Arbeitsmarktes mahnt jedoch deutlich, dass die lokalen Gewerbe unter der Zinslast leiden und die Konsumfreudigkeit der Haushalte nachgelassen hat. Dies sollte die Bank of England zuversichtlich stimmen, dass sich die UK, wengleich mit leichter Verzögerung, ebenfalls auf dem richtigen Weg befindet.

3. Performancerückblick

Auch in einem anspruchsvollen Jahr wie 2023 vermochte der Fonds eine relative Outperformance (vor Kosten) gegenüber der Benchmark zu erzielen. Das leichte Übergewicht von Kreditrisiken kostete zu Jahresbeginn leicht Performance, hatte jedoch aufgrund der Rally in den letzten zwei Monaten des Jahres einen insgesamt stark positiven Beitrag. In Bezug auf Zinsrisiken war der Fonds das ganze Jahr hindurch tendenziell übergewichtet. Diese Positionierung kostete zu Beginn deutlich. Während eine Abschwächung erwartet worden war, zeigte sich die Britische wie auch globale Wirtschaft überraschend widerstandsfähig, was die Zinsen vorerst weiter steigen liess. In den letzten beiden Monaten fielen die Zinsen dann deutlich und reduzierten den insgesamt negativen Beitrag der Zinsseite. So resultierte in der Summe eine klar positive, relative Performance für 2023.

| Klasse | ISIN | Valor | Distribution | Performance in % |
|--------|--------------|-----------|--------------|------------------|
| AA | LU0141248616 | 001363622 | Pay out | -0.43 |
| AT | LU0161531099 | 001544300 | Accumulate | -0.45 |
| CT | LU1663713250 | 37844050 | Accumulate | 0.01 |
| DA | LU0276846705 | 2794978 | Pay out | 0.10 |

| Klasse | ISIN | Valor | Distribution | Performance in % |
|-----------------------------|--------------|----------|--------------|------------------|
| DT (Schliessung 23.01.2024) | LU1495639624 | 34048564 | Accumulate | -1.49 |
| GT | LU0899937683 | 20855077 | Accumulate | 0.16 |

4 Vermögensaufstellung

| | Erläuterung | Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Corporate Hybrid EUR | Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Rates USD | Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible COCO USD | Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Emerging Markets Opportunities USD |
|---|-------------|--|--|--|---|
| VERMÖGENSWERTE | | | | | |
| Wertpapierbestand inklusive Optionen (gekauft Optionen) zum Marktwert | (2,8) | 120'634'923 | 47'634'821 | 447'140'983 | 453'962'227 |
| Bankguthaben | | 4'743'489 | 1'305'828 | 5'018'601 | 12'171'578 |
| Forderungen aus Wertpapierverkäufen | | 0 | 36'723 | 10'086'478 | 0 |
| Forderung aus Devisenverkäufen | | 0 | 277'932 | 106'323 | 128'338'077 |
| Ausstehende Zeichnungsbeträge | | 0 | 11'399 | 133'563 | 20'084'154 |
| Forderungen aus Swaps und Swaptions | | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Forderungen aus Wertpapiererträgen | | 1'853'522 | 391'022 | 6'795'878 | 5'999'168 |
| Zinsforderungen aus Bankguthaben | | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisentermingeschäften | (6) | 0 | 5'131 | 2'799'635 | 0 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Termingeschäften | | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Swapgeschäften | (9) | 0 | 18'201 | 0 | 0 |
| Sonstige Vermögenswerte | | 162'037 | 90'359 | 0 | 100'000 |
| SUMME DER VERMÖGENSWERTE | | 127'393'971 | 49'771'416 | 472'081'461 | 620'655'204 |
| VERBINDLICHKEITEN | | | | | |
| Optionen (geschriebene Optionen) zum Marktwert | | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Bankverbindlichkeiten | | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen | | -938'841 | -12'370 | -3'495'270 | -32'657'548 |
| Verbindlichkeiten aus Devisenkäufen | | 0 | -279'769 | -106'493 | -130'264'412 |
| Ausstehende Zahlungen aus dem Rückkauf von Anteilen | | -1'894 | -599'851 | -62'512 | -82'277 |
| Verbindlichkeiten aus Swaps und Swaptions | | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisentermingeschäften | (6) | -110'989 | 0 | 0 | -418'545 |
| Nicht realisierter Verlust aus Termingeschäften | | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Nicht realisierter Verlust aus Swapgeschäften | (9) | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Bankzinsen und sonstige Verbindlichkeiten | | -3'405 | 0 | -306'558 | -162'960 |
| SUMME DER VERBINDLICHKEITEN | | -1'055'129 | -892'409 | -3'970'833 | -163'585'742 |
| NETTOVERMÖGEN AM ENDE DES GESCHÄFTSJAHRES | | 126'338'844 | 48'879'006 | 468'110'628 | 457'069'462 |

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Berichtes.

| | Erläuterung | Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Absolute Return USD | Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Convertible USD | Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Corporate USD | Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Secured High Yield USD |
|--|-------------|---|--|--|---|
| VERMÖGENSWERTE | | | | | |
| Wertpapierbestand inklusive Optionen (gekaufte Optionen) zum Marktwert | (2,8) | 217'707'334 | 70'863'699 | 342'039'416 | 146'911'821 |
| Bankguthaben | | 3'868'560 | 982'035 | 6'610'870 | 7'646'888 |
| Forderungen aus Wertpapierverkäufen | | 2'075'566 | 334'259 | 7'866'337 | 713'142 |
| Forderung aus Devisenverkäufen | | 20'148 | 589'500 | 3'426'124 | 210'119 |
| Ausstehende Zeichnungsbeträge | | 164'043 | 120 | 114'704 | 226'332 |
| Forderungen aus Swaps und Swaptions | | -114'126 | 0 | 0 | 0 |
| Forderungen aus Wertpapiererträgen | | 1'870'707 | 269'735 | 4'822'481 | 2'200'096 |
| Zinsforderungen aus Bankguthaben | | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisentermingeschäften | (6) | 1'677'868 | 466'882 | 1'664'277 | 1'574'689 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Termingeschäften | | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Swapgeschäften | (9) | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Sonstige Vermögenswerte | | 3'808'546 | 0 | 957'028 | 0 |
| SUMME DER VERMÖGENSWERTE | | 231'078'646 | 73'506'230 | 367'501'237 | 159'483'087 |
| VERBINDLICHKEITEN | | | | | |
| Optionen (geschriebene Optionen) zum Marktwert | | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Bankverbindlichkeiten | | -1'427'960 | 0 | 0 | 0 |
| Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen | | -4'036'463 | 0 | -3'961'587 | -1'362'955 |
| Verbindlichkeiten aus Devisenkäufen | | -20'076 | -585'867 | -3'432'050 | -211'066 |
| Ausstehende Zahlungen aus dem Rückkauf von Anteilen | | -44'866 | -583'589 | -2'250'479 | -3'790'122 |
| Verbindlichkeiten aus Swaps und Swaptions | | 114'126 | 0 | 0 | 0 |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisentermingeschäften | (6) | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Nicht realisierter Verlust aus Termingeschäften | | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Nicht realisierter Verlust aus Swapgeschäften | (9) | -636'987 | 0 | 0 | 0 |
| Bankzinsen und sonstige Verbindlichkeiten | | -215'974 | -51'978 | -187'335 | -91'959 |
| SUMME DER VERBINDLICHKEITEN | | -5'963'799 | -1'221'434 | -9'831'451 | -5'456'102 |
| NETTOVERMÖGEN AM ENDE DES GESCHÄFTSJAHRES | | 225'114'846 | 72'284'796 | 357'669'786 | 154'026'984 |

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Berichtes.

| | Erläuterung | Swisscanto (LU) Bond Fund Sustainable Global High Yield USD | Swisscanto (LU) Bond Fund Sustainable Global Aggregate CHF | Swisscanto (LU) Bond Fund Sustainable Global Credit CHF | Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible AUD |
|---|-------------|---|--|---|---|
| VERMÖGENSWERTE | | | | | |
| Wertpapierbestand inklusive Optionen (gekauft Optionen) zum Marktwert | (2,8) | 59'277'409 | 66'275'282 | 167'486'947 | 107'456'729 |
| Bankguthaben | | 911'721 | 2'206'402 | 2'783'811 | 3'553'622 |
| Forderungen aus Wertpapierverkäufen | | 384'167 | 135'878 | 0 | 513'279 |
| Forderung aus Devisenverkäufen | | 0 | 0 | 2'578'330 | 0 |
| Ausstehende Zeichnungsbeträge | | 0 | 13'585 | 3'122'293 | 2'400 |
| Forderungen aus Swaps und Swaptions | | 0 | 0 | 0 | -10'196 |
| Forderungen aus Wertpapiererträgen | | 924'258 | 590'411 | 2'047'953 | 699'192 |
| Zinsforderungen aus Bankguthaben | | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisentermingeschäften | (6) | 233'611 | 0 | 0 | 63'561 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Termingeschäften | | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Swapgeschäften | (9) | 111'094 | 185'566 | 0 | 0 |
| Sonstige Vermögenswerte | | 0 | 93'962 | 518'229 | 627'478 |
| SUMME DER VERMÖGENSWERTE | | 61'842'260 | 69'501'086 | 178'537'563 | 112'906'065 |
| VERBINDLICHKEITEN | | | | | |
| Optionen (geschriebene Optionen) zum Marktwert | | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Bankverbindlichkeiten | | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen | | -108'625 | -221'510 | -2'712'052 | -979'820 |
| Verbindlichkeiten aus Devisenkäufen | | 0 | 0 | -2'578'411 | 0 |
| Ausstehende Zahlungen aus dem Rückkauf von Anteilen | | 0 | -60'606 | -743'633 | -152'255 |
| Verbindlichkeiten aus Swaps und Swaptions | | 0 | 0 | 0 | 10'196 |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisentermingeschäften | (6) | 0 | -3'844 | -1'798'656 | 0 |
| Nicht realisierter Verlust aus Termingeschäften | | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Nicht realisierter Verlust aus Swapgeschäften | (9) | 0 | 0 | 0 | -304'400 |
| Bankzinsen und sonstige Verbindlichkeiten | | -48'534 | -43'261 | -68'425 | -89'360 |
| SUMME DER VERBINDLICHKEITEN | | -157'159 | -329'221 | -7'901'177 | -1'515'639 |
| NETTOVERMÖGEN AM ENDE DES GESCHÄFTSJAHRES | | 61'685'100 | 69'171'866 | 170'636'387 | 111'390'427 |

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Berichtes.

| | Erläuterung | Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible CAD | | | Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible CHF | | | Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible EUR | | | Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible GBP | | |
|---|-------------|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|
| | | | | | | | | | | | | | |
| VERMÖGENSWERTE | | | | | | | | | | | | | |
| Wertpapierbestand inklusive Optionen (gekauft Optionen) zum Marktwert | (2,8) | 58'394'347 | | | 221'780'734 | | | 142'339'862 | | | 21'272'886 | | |
| Bankguthaben | | 818'015 | | | 3'858'931 | | | 1'244'638 | | | 662'866 | | |
| Forderungen aus Wertpapierverkäufen | | 229'765 | | | 540'859 | | | 121'920 | | | 32'062 | | |
| Forderung aus Devisenverkäufen | | 0 | | | 0 | | | 0 | | | 0 | | |
| Ausstehende Zeichnungsbeträge | | 13'118 | | | 11'045 | | | 62'725 | | | 0 | | |
| Forderungen aus Swaps und Swaptions | | 0 | | | 0 | | | 0 | | | 0 | | |
| Forderungen aus Wertpapiererträgen | | 343'564 | | | 1'365'068 | | | 1'188'347 | | | 155'503 | | |
| Zinsforderungen aus Bankguthaben | | 0 | | | 0 | | | 0 | | | 0 | | |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisentermingeschäften | (6) | 9'971 | | | 0 | | | 0 | | | 8'433 | | |
| Nicht realisierter Gewinn aus Termingeschäften | | 0 | | | 0 | | | 0 | | | 0 | | |
| Nicht realisierter Gewinn aus Swapgeschäften | (9) | 0 | | | 273'994 | | | 0 | | | 86'474 | | |
| Sonstige Vermögenswerte | | 910'394 | | | 60'589 | | | 2'060'078 | | | 107'588 | | |
| SUMME DER VERMÖGENSWERTE | | 60'719'174 | | | 227'891'220 | | | 147'017'570 | | | 22'325'812 | | |
| VERBINDLICHKEITEN | | | | | | | | | | | | | |
| Optionen (geschriebene Optionen) zum Marktwert | | 0 | | | 0 | | | 0 | | | 0 | | |
| Bankverbindlichkeiten | | 0 | | | 0 | | | 0 | | | 0 | | |
| Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen | | -277'070 | | | -5'877'000 | | | -466'000 | | | -4'587 | | |
| Verbindlichkeiten aus Devisenkäufen | | 0 | | | 0 | | | 0 | | | 0 | | |
| Ausstehende Zahlungen aus dem Rückkauf von Anteilen | | -9'012 | | | -303'548 0 | | | -690'506 | | | -6'366 | | |
| Verbindlichkeiten aus Swaps und Swaptions | | 0 | | | 0 | | | 0 | | | 0 | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisentermingeschäften | (6) | 0 | | | 0 | | | -4'339 | | | 0 | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Termingeschäften | | 0 | | | 0 | | | 0 | | | 0 | | |
| Nicht realisierter Verlust aus Swapgeschäften | (9) | -273'865 | | | 0 | | | -210'510 | | | 0 | | |
| Bankzinsen und sonstige Verbindlichkeiten | | -45'667 | | | -117'821 | | | -86'315 | | | -18'618 | | |
| SUMME DER VERBINDLICHKEITEN | | -605'614 | | | -6'298'369 | | | -1'457'670 | | | -29'571 | | |
| NETTOVERMÖGEN AM ENDE DES GESCHÄFTSJAHRES | | 60'113'560 | | | 221'592'851 | | | 145'559'900 | | | 22'296'242 | | |

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Berichtes.

| | Erläuterung | Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible USD USD | Konsolidiert CHF |
|--|-------------|---|----------------------|
| VERMÖGENSWERTE | | | |
| Wertpapierbestand inklusive Optionen (gekauft Optionen) zum Marktwert | (2,8) | 48'345'083 | 2'395'458'865 |
| Bankguthaben | | 1'986'093 | 52'438'456 |
| Forderungen aus Wertpapierverkäufen | | 806'919 | 20'397'104 |
| Forderung aus Devisenverkäufen | | 0 | 116'645'120 |
| Ausstehende Zeichnungsbeträge | | 1'347 | 21'003'244 |
| Forderungen aus Swaps und Swaptions | | 0 | -103'685 |
| Forderungen aus Wertpapiererträgen | | 348'997 | 27'889'358 |
| Zinsforderungen aus Bankguthaben | | 0 | 0 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisentermingeschäften | (6) | 0 | 7'276'551 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Termingeschäften | | 0 | 0 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Swapgeschäften | (9) | 344 | 569'936 |
| Sonstige Vermögenswerte | | 609'951 | 8'576'034 |
| SUMME DER VERMÖGENSWERTE | | 52'098'734 | 2'650'246'285 |
| VERBINDLICHKEITEN | | | |
| Optionen (geschriebene Optionen) zum Marktwert | | 0 | 0 |
| Bankverbindlichkeiten | | 0 | -1'224'975 |
| Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen | | -1'308'810 | -51'128'785 |
| Verbindlichkeiten aus Devisenkäufen | | 0 | -118'302'146 |
| Ausstehende Zahlungen aus dem Rückkauf von Anteilen | | -842'947 | -8'935'034 |
| Verbindlichkeiten aus Swaps und Swaptions | | 0 | 103'685 |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisentermingeschäften | (6) | 0 | -2'269'016 |
| Nicht realisierter Verlust aus Termingeschäften | | 0 | 0 |
| Nicht realisierter Verlust aus Swapgeschäften | (9) | 0 | -829'933 |
| Bankzinsen und sonstige Verbindlichkeiten | | -33'594 | -1'356'489 |
| SUMME DER VERBINDLICHKEITEN | | -2'185'351 | -183'942'699 |
| NETTOVERMÖGEN AM ENDE DES GESCHÄFTSJAHRES | | 49'913'384 | 2'466'303'590 |

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Berichtes.

Entwicklung der Anzahl Anteile

Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible COCO - USD

| Klasse | Bestand zu Beginn des Geschäftsjahres | Ausgegebene Anteile | Zurückgenommene Anteile | Bestand am Ende des Geschäftsjahres |
|---------|---|------------------------|----------------------------|---|
| AAH CHF | 115'082.638 | 14'081.376 | -18'962.000 | 110'202.014 |
| AAH EUR | 57'477.624 | 2'948.000 | -14'831.147 | 45'594.477 |
| AT | 35'406.218 | 2'113.000 | -4'743.422 | 32'775.797 |
| ATH CHF | 126'685.030 | 12'163.675 | -26'308.391 | 112'540.314 |
| ATH EUR | 36'101.587 | 4'185.677 | -9'510.109 | 30'777.156 |
| BTH CHF | 77'654.900 | 1'695.000 | -34'140.000 | 45'209.900 |
| BTH EUR | 0.000 | 10.000 | -10.000 | 0.000 |
| DAH EUR | 103'836.990 | 47'170.883 | -92'846.960 | 58'160.912 |
| DT | 124'520.616 | 44'156.594 | -34'124.310 | 134'552.899 |
| DTH CHF | 197'569.084 | 34'248.224 | -23'682.813 | 208'134.495 |
| DTH EUR | 688'753.069 | 207'441.918 | -276'217.999 | 619'976.988 |
| DTH SEK | 8'550.000 | 0.000 | 0.000 | 8'550.000 |
| GT | 5'363.209 | 3'350.000 | -1'902.962 | 6'810.247 |
| GTH CHF | 766'244.107 | 87'319.780 | -156'857.264 | 696'706.623 |
| GTH EUR | 144'949.735 | 59'879.961 | -23'600.500 | 181'229.197 |
| MTH CHF | 1'600.000 | 0.000 | 0.000 | 1'600.000 |
| NT | 63'300.000 | 4'000.000 | -37'000.000 | 30'300.000 |
| NTH CHF | 270'045.266 | 21'136.000 | -156'729.896 | 134'451.371 |
| NTH EUR | 142'224.211 | 0.000 | -12'288.000 | 129'936.211 |

Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Corporate Hybrid - EUR

| Klasse | Bestand zu Beginn des Geschäftsjahres | Ausgegebene Anteile | Zurückgenommene Anteile | Bestand am Ende des Geschäftsjahres |
|---------|---|------------------------|----------------------------|---|
| AA | 297.000 | 2'538.000 | -112.000 | 2'723.000 |
| ATH CHF | 1'159.067 | 1'400.000 | -659.067 | 1'900.000 |
| DT | 11'550.946 | 4'589.309 | -910.793 | 15'229.461 |
| DTH CHF | 0.000 | 22'358.480 | 0.000 | 22'358.480 |
| GTH CHF | 5'625.000 | 6'129.000 | -182.000 | 11'572.000 |
| NTH CHF | 79'513.000 | 49'265.000 | -128'778.000 | 0.000 |
| STH CHF | 1'002.400 | 66.543 | 0.000 | 1'068.943 |
| STH USD | 150.000 | 1.500 | 0.000 | 151.500 |

Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Emerging Markets Opportunities - USD

| Klasse | Bestand zu Beginn des Geschäftsjahres | Ausgegebene Anteile | Zurückgenommene Anteile | Bestand am Ende des Geschäftsjahres |
|---------|---|------------------------|----------------------------|---|
| AT | 271.191 | 724'933.000 | -71'095.000 | 654'109.191 |
| CT | 4'227.513 | 3'165.884 | -721.513 | 6'671.884 |
| DT | 462'259.329 | 84'754.959 | -1'687.774 | 545'326.513 |
| DTH CHF | 81'878.850 | 21'476.836 | -10'433.682 | 92'922.004 |
| DTH EUR | 12'108.716 | 256'657.181 | -48'737.303 | 220'028.595 |
| GT | 144'902.356 | 105'187.768 | -13'948.853 | 236'141.271 |
| NT | 1'498'435.465 | 695'575.577 | -214'179.078 | 1'979'831.965 |
| NTH CHF | 745'372.131 | 244'318.317 | -349'037.000 | 640'653.448 |
| NTH EUR | 13'173.000 | 0.000 | -13'173.000 | 0.000 |

Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Absolute Return - USD

| Klasse | Bestand zu Beginn des Geschäftsjahres | Ausgegebene Anteile | Zurückgenommene Anteile | Bestand am Ende des Geschäftsjahres |
|---------|---|------------------------|----------------------------|---|
| AA | 30'413.000 | 550.000 | -1'122.000 | 29'841.000 |
| AAH CHF | 1'476'407.790 | 2'133.929 | -216'713.483 | 1'261'828.236 |
| AAH EUR | 310'786.265 | 409.449 | -67'447.000 | 243'748.714 |
| AT | 27'065.812 | 770.000 | -5'182.687 | 22'653.125 |
| ATH CHF | 374'020.169 | 1'556.634 | -71'253.211 | 304'323.591 |
| ATH EUR | 104'696.126 | 170.600 | -21'737.632 | 83'129.095 |
| BTH CHF | 22'836.968 | 2'809.058 | -1'822.439 | 23'823.587 |
| BTH EUR | 2'203.361 | 0.000 | -178.000 | 2'025.361 |
| CTH CHF | 26'898.603 | 500.000 | -4'257.904 | 23'140.699 |
| DTH CHF | 47'560.999 | 400.000 | -14'787.106 | 33'173.893 |
| DTH EUR | 247'517.324 | 9'225.986 | -105'561.521 | 151'181.789 |
| GT | 4'794.001 | 0.000 | -3'294.000 | 1'500.001 |
| GTH CHF | 729'785.109 | 32'160.000 | -571'570.072 | 190'375.037 |
| GTH EUR | 155'382.250 | 1'600.929 | -153'547.993 | 3'435.186 |
| NTH CHF | 745'467.000 | 0.000 | -745'467.000 | 0.000 |

Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Convertible - USD

| Klasse | Bestand zu Beginn des Geschäftsjahres | Ausgegebene Anteile | Zurückgenommene Anteile | Bestand am Ende des Geschäftsjahres |
|---------|---|------------------------|----------------------------|---|
| AT | 3'450.000 | 0.000 | -180.000 | 3'270.000 |
| ATH CHF | 210'108.896 | 13'928.757 | -38'924.324 | 185'113.329 |
| ATH EUR | 26'249.186 | 18.000 | -7'258.181 | 19'009.005 |
| DTH CHF | 95'655.748 | 613.700 | -30'688.548 | 65'580.900 |
| DTH EUR | 17'135.187 | 0.000 | -4'135.187 | 13'000.000 |
| GT | 1'418.000 | 579.000 | -1'222.000 | 775.000 |
| GTH CHF | 185'153.510 | 48'243.868 | -138'507.000 | 94'890.378 |
| GTH EUR | 13'470.000 | 114.000 | -13'512.000 | 72.000 |
| MTH CHF | 16'953.138 | 0.000 | -100.000 | 16'853.138 |
| NT | 28'640.000 | 0.000 | -24'340.000 | 4'300.000 |
| NTH CHF | 116'754.707 | 17'786.001 | -14'537.000 | 120'003.707 |
| NTH EUR | 31'000.000 | 0.000 | -27'663.000 | 3'337.000 |

Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Corporate - USD

| Klasse | Bestand zu Beginn des Geschäftsjahres | Ausgegebene Anteile | Zurückgenommene Anteile | Bestand am Ende des Geschäftsjahres |
|---------|---|------------------------|----------------------------|---|
| AT | 66'797.729 | 1'340.000 | -8'634.400 | 59'503.329 |
| ATH CHF | 502'416.183 | 15'691.864 | -63'412.495 | 454'695.553 |
| ATH EUR | 94'831.498 | 2'943.301 | -13'202.078 | 84'572.721 |
| BTH CHF | 4'031.531 | 0.000 | -1'860.000 | 2'171.531 |
| BTH EUR | 979.000 | 0.000 | -729.000 | 250.000 |
| CTH CHF | 27'597.642 | 0.000 | -1'380.434 | 26'217.209 |
| DT | 151'161.059 | 18'710.273 | -26'330.249 | 143'541.083 |
| DTH CHF | 276'031.178 | 65'642.700 | -136'165.828 | 205'508.050 |
| DTH EUR | 215'133.132 | 16'010.838 | -56'470.881 | 174'673.090 |
| GT | 51'461.313 | 2'626.811 | -33'979.442 | 20'108.682 |
| GTH CHF | 1'297'602.920 | 194'069.624 | -292'018.912 | 1'199'653.633 |
| GTH EUR | 296'235.094 | 28'310.463 | -77'299.102 | 247'246.455 |
| NT | 0.000 | 119'093.670 | -24'350.670 | 94'743.000 |

Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Rates - USD

| Klasse | Bestand zu Beginn des Geschäftsjahres | Ausgegebene Anteile | Zurückgenommene Anteile | Bestand am Ende des Geschäftsjahres |
|---------|---|------------------------|----------------------------|---|
| AAH EUR | 4'461.341 | 59.000 | -4'520.341 | 0.000 |
| AT | 0.000 | 120.000 | 0.000 | 120.000 |
| ATH CHF | 4'792.000 | 370.000 | -5'162.000 | 0.000 |
| GTH CHF | 14'701.029 | 0.000 | -14'701.029 | 0.000 |
| NT | 118'955.288 | 287'028.000 | -148'804.288 | 257'179.000 |
| NT EUR | 0.000 | 100.000 | 0.000 | 100.000 |
| NTH CHF | 487'937.640 | 351.000 | -488'288.640 | 0.000 |
| NTH EUR | 158'660.453 | 0.000 | -158'660.453 | 0.000 |
| ST | 0.000 | 156.100 | 0.000 | 156.100 |

Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Secured High Yield - USD

| Klasse | Bestand zu Beginn des Geschäftsjahres | Ausgegebene Anteile | Zurückgenommene Anteile | Bestand am Ende des Geschäftsjahres |
|---------|---|------------------------|----------------------------|---|
| AA | 21'684.190 | 2'847.000 | -1'510.000 | 23'021.190 |
| AAH CHF | 136'174.498 | 4'008.587 | -13'711.000 | 126'472.086 |
| AAH EUR | 142'175.873 | 6'896.729 | -7'672.285 | 141'400.317 |
| AT | 3'530.279 | 80.829 | -341.400 | 3'269.708 |
| ATH CHF | 94'919.395 | 12'498.000 | -7'045.400 | 100'371.995 |
| ATH EUR | 9'259.600 | 3'037.864 | -3'879.500 | 8'417.965 |
| BTH CHF | 4'837.000 | 0.000 | -1'550.000 | 3'287.000 |
| DAH EUR | 29'120.000 | 800.000 | -12'470.000 | 17'450.000 |
| DT | 2'967.000 | 62.900 | -44.500 | 2'985.400 |
| DTH CHF | 79'688.866 | 13'234.200 | -15'728.412 | 77'194.654 |
| DTH EUR | 155'445.504 | 24'646.671 | -55'190.857 | 124'901.320 |
| GT | 1'880.001 | 2'674.000 | -854.000 | 3'700.001 |
| GTH CHF | 115'170.268 | 260'509.000 | -37'584.211 | 338'095.057 |
| GTH EUR | 33'203.821 | 22'327.000 | -9'961.289 | 45'569.532 |
| NT | 168'558.125 | 8'194.000 | -45'536.125 | 131'216.000 |
| NTH CHF | 168'993.000 | 13'590.000 | -41'775.000 | 140'808.000 |

Swisscanto (LU) Bond Fund Sustainable Global Credit - CHF

| Klasse | Bestand zu Beginn des Geschäftsjahres | Ausgegebene Anteile | Zurückgenommene Anteile | Bestand am Ende des Geschäftsjahres |
|---------|---|------------------------|----------------------------|---|
| AA | 204'145.926 | 11'023.654 | -18'705.224 | 196'464.356 |
| AAH EUR | 184'737.221 | 25'435.922 | -22'357.128 | 187'816.016 |
| AT | 131'083.538 | 4'471.390 | -13'852.942 | 121'701.987 |
| ATH EUR | 19'964.644 | 3'631.960 | -1'468.936 | 22'127.668 |
| BT | 33'175.655 | 1'396.763 | -2'206.349 | 32'366.069 |
| DAH EUR | 12'077.161 | 6'858.095 | -1'457.051 | 17'478.205 |
| DT | 214'034.212 | 172'492.576 | -202'871.269 | 183'655.519 |
| DTH EUR | 2'010.000 | 117'991.481 | -961.279 | 119'040.202 |
| DTH USD | 0.000 | 4'512.578 | -100.000 | 4'412.578 |
| GT | 189'523.243 | 31'252.200 | -78'762.880 | 142'012.563 |
| GTH EUR | 21'082.000 | 2'821.990 | -7'973.990 | 15'930.000 |
| NT | 541'415.978 | 274'957.875 | -82'165.369 | 734'208.484 |

Swisscanto (LU) Bond Fund Sustainable Global High Yield - USD

| Klasse | Bestand zu Beginn des Geschäftsjahres | Ausgegebene Anteile | Zurückgenommene Anteile | Bestand am Ende des Geschäftsjahres |
|---------|---|------------------------|----------------------------|---|
| AAH EUR | 19'847.000 | 984.000 | -5'142.000 | 15'689.000 |
| AT | 35'350.389 | 465.000 | -5'438.000 | 30'377.389 |
| ATH CHF | 182'313.269 | 790.549 | -33'601.726 | 149'502.092 |
| ATH EUR | 36'941.720 | 209.000 | -5'097.377 | 32'053.343 |
| BTH CHF | 6'849.271 | 498.744 | 0.000 | 7'348.015 |
| DAH EUR | 11'365.000 | 0.000 | -9'920.000 | 1'445.000 |
| DT | 13'600.000 | 0.000 | 0.000 | 13'600.000 |
| DTH CHF | 51'800.829 | 360.000 | -8'977.007 | 43'183.822 |
| DTH EUR | 18'019.363 | 0.000 | -4'804.347 | 13'215.016 |
| GT | 500.000 | 0.000 | 0.000 | 500.000 |
| GTH CHF | 8'029.000 | 1'325.000 | -9'354.000 | 0.000 |
| GTH EUR | 435.000 | 706.016 | 0.000 | 1'141.016 |
| NT | 55'628.716 | 0.000 | -25'760.716 | 29'868.000 |
| NTH CHF | 134'224.399 | 0.000 | -34'965.000 | 99'259.399 |
| NTH EUR | 39'097.000 | 0.000 | -15'508.000 | 23'589.000 |

Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible AUD - AUD

| Klasse | Bestand zu Beginn des Geschäftsjahres | Ausgegebene Anteile | Zurückgenommene Anteile | Bestand am Ende des Geschäftsjahres |
|--------|---|------------------------|----------------------------|---|
| AA | 595'889.121 | 12'415.507 | -90'387.043 | 517'917.585 |
| AT | 136'932.455 | 665.332 | -20'090.578 | 117'507.209 |
| BT | 25'034.829 | 1'876.588 | -4'758.726 | 22'152.691 |
| CT | 108'331.014 | 729.000 | -28'093.898 | 80'966.115 |
| DT | 49'973.912 | 434.000 | -47'788.384 | 2'619.528 |
| GT | 94'508.309 | 3'740.758 | -15'054.725 | 83'194.342 |

Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible CAD - CAD

| Klasse | Bestand zu Beginn des Geschäftsjahres | Ausgegebene Anteile | Zurückgenommene Anteile | Bestand am Ende des Geschäftsjahres |
|--------|---|------------------------|----------------------------|---|
| AA | 193'544.337 | 3'637.213 | -30'806.557 | 166'374.993 |
| AT | 126'278.251 | 312.841 | -17'593.484 | 108'997.608 |
| CT | 33'923.201 | 6'785.347 | -4'622.782 | 36'085.766 |
| DT | 173'928.728 | 0.000 | -155'880.000 | 18'048.728 |
| GT | 349'420.851 | 336'040.102 | -593'727.723 | 91'733.231 |

Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible CHF - CHF

| Klasse | Bestand zu Beginn des Geschäftsjahres | Ausgegebene Anteile | Zurückgenommene Anteile | Bestand am Ende des Geschäftsjahres |
|--------|---|------------------------|----------------------------|---|
| AA | 853'677.435 | 6'655.421 | -117'872.814 | 742'460.042 |
| AT | 332'585.769 | 2'974.621 | -28'795.652 | 306'764.738 |
| BT | 32'849.038 | 3'000.000 | -350.000 | 35'499.038 |
| CT | 53'453.729 | 1'211.377 | -7'980.467 | 46'684.640 |
| DA | 57'192.537 | 96'345.000 | -4'900.000 | 148'637.537 |
| DT | 85'389.035 | 57'231.038 | -21'879.005 | 120'741.068 |
| GT | 25'416.223 | 195.000 | -1'835.000 | 23'776.223 |
| NT | 617'306.182 | 137'704.000 | -50'627.000 | 704'383.182 |

Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible EUR - EUR

| Klasse | Bestand zu Beginn des Geschäftsjahres | Ausgegebene Anteile | Zurückgenommene Anteile | Bestand am Ende des Geschäftsjahres |
|--------|---|------------------------|----------------------------|---|
| AA | 973'776.000 | 4'061.742 | -133'648.209 | 844'189.533 |
| AT | 339'064.225 | 3'053.270 | -49'110.941 | 293'006.552 |
| CT | 30'695.388 | 700.000 | -2'166.679 | 29'228.710 |
| DA | 3'120.857 | 8'177.000 | -1'465.000 | 9'832.857 |
| DT | 145'566.841 | 22'278.502 | -77'248.378 | 90'596.967 |
| GT | 283'939.661 | 121'204.000 | -200'790.973 | 204'352.688 |
| NT | 198'727.210 | 162'029.000 | -62'636.180 | 298'120.029 |

Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible GBP - GBP

| Klasse | Bestand zu Beginn des Geschäftsjahres | Ausgegebene Anteile | Zurückgenommene Anteile | Bestand am Ende des Geschäftsjahres |
|--------|---|------------------------|----------------------------|---|
| AA | 96'555.547 | 2'966.000 | -12'457.000 | 87'064.547 |
| AT | 171'584.080 | 134.109 | -36'689.777 | 135'028.413 |
| CT | 7'516.164 | 600.000 | -1'653.641 | 6'462.523 |
| DA | 427.000 | 0.000 | 0.000 | 427.000 |
| DT | 672.652 | 0.000 | -672.652 | 0.000 |
| GT | 148'189.821 | 6'451.000 | -136'340.031 | 18'300.790 |

Swisscanto (LU) Bond Fund Sustainable Global Aggregate - CHF

| Klasse | Bestand zu Beginn des Geschäftsjahres | Ausgegebene Anteile | Zurückgenommene Anteile | Bestand am Ende des Geschäftsjahres |
|--------|---|------------------------|----------------------------|---|
| AA | 478'272.708 | 497.000 | -44'936.353 | 433'833.355 |
| AT | 93'146.791 | 275.000 | -14'756.674 | 78'665.117 |
| BT | 10'070.423 | 520.000 | -1'830.000 | 8'760.423 |
| CT | 7'592.201 | 0.000 | -490.027 | 7'102.174 |
| DT | 20'000.000 | 18'200.000 | -20'000.000 | 18'200.000 |
| GT | 267'305.000 | 97'749.733 | -36'367.000 | 328'687.733 |
| NT | 345'996.613 | 71'625.000 | -409'608.613 | 8'013.000 |

Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible USD - USD

| Klasse | Bestand zu Beginn des Geschäftsjahres | Ausgegebene Anteile | Zurückgenommene Anteile | Bestand am Ende der Geschäftsjahres |
|---------------|--|--------------------------------|------------------------------------|--|
| AA | 211'263.496 | 5'274.627 | -28'909.521 | 187'628.603 |
| AT | 70'588.322 | 1'203.916 | -7'139.710 | 64'652.528 |
| CT | 25'634.685 | 155.000 | -5'120.087 | 20'669.598 |
| DA | 611.409 | 0.000 | -36.000 | 575.409 |
| DT | 269.708 | 0.000 | 0.000 | 269.708 |
| GT | 361'584.078 | 115'013.000 | -385'090.625 | 91'506.453 |
| NT | 89'216.324 | 30'212.000 | -73'514.271 | 45'914.053 |

5 Ertrags- und Aufwandsrechnung und andere Veränderungen des Nettovermögens

| Erläuterung | Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Corporate Hybrid EUR | Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Rates USD | Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible COCO USD | Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Emerging Markets Opportunities USD |
|---|--|--|--|---|
| NETTOVERMÖGEN ZU BEGINN DES GESCHÄFTSJAHRES | 108'942'588 | 86'622'556 | 495'792'812 | 291'517'593 |
| ERTRÄGE | | | | |
| Dividenden aus Wertpapierbestand, netto | 18'441 | 0 | 0 | 0 |
| Nettozinserträge aus Anleihen und anderen Schuldverschreibungen | 4'103'979 | 3'075'245 | 29'578'935 | 21'324'980 |
| Zinserträge aus Bankguthaben | 94'641 | 110'689 | 1'033'039 | 501'875 |
| Zinsen aus Swaps, netto | 0 | 78'568 | 0 | 0 |
| Erhaltene Kommissionen (13) | 1'393 | 8'232 | 187'394 | 0 |
| Sonstige Erträge | 123 | 554 | 0 | 267 |
| GESAMTERTRÄGE | 4'218'577 | 3'273'287 | 30'799'368 | 21'827'122 |
| AUFWENDUNGEN | | | | |
| Transaktionskosten | -2'919 | -4'218 | -7'798 | -1'224 |
| Pauschale Verwaltungskommission (3) | -11'999 | -11'254 | -3'249'505 | -1'554'434 |
| Abonnementsteuer ("taxe d'abonnement") (4) | -11'821 | -7'023 | -67'636 | -70'011 |
| Zinsaufwendungen aus Bankverbindlichkeiten | -11 | -31'823 | -242'210 | -9'423 |
| Zinsaufwendungen aus Swaps, netto | 0 | -7'982 | 0 | 0 |
| Sonstige Aufwendungen | -1'349 | -13'530 | -15'095 | -7'800 |
| GESAMTAUFWENDUNGEN | -28'098 | -75'830 | -3'582'244 | -1'642'892 |
| ERTRAGSAUSGLEICH | -113'652 | -1'693'075 | -2'087'655 | 2'079'949 |
| SUMME DER NETTOERTRÄGE | 4'076'828 | 1'504'382 | 25'129'469 | 22'264'180 |
| Nettorealisierte Werterhöhungen/ (Wertverminderungen) aus Wertpapieren | -4'153'572 | -11'190'412 | -42'255'233 | -751'745 |
| Nettorealisierte Werterhöhungen/(Wertverminderungen) aus Swaps | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Nettorealisierte Werterhöhungen/(Wertverminderungen) aus Optionen | 0 | 40'669 | 0 | 0 |
| Nettorealisierte Werterhöhungen/(Wertverminderungen) aus Devisentermingeschäften | 4'709'029 | -610'790 | 4'973'724 | 245'604 |
| Nettorealisierte Werterhöhungen/(Wertverminderungen) aus Termingeschäften | 671'200 | 24'756 | -126'610 | 0 |
| Nettorealisierte Werterhöhungen/(Wertverminderungen) aus Devisengeschäften | 84'090 | 517'137 | -3'973'856 | -67'992 |
| NETTOGEWINN (-VERLUST) AUS ANLAGEN | 5'387'575 | -9'714'258 | -16'252'506 | 21'690'046 |
| NETTOVERÄNDERUNG DES NICHT REAL. ERFOLGES | | | | |
| - aus Wertpapieren | 9'535'115 | 10'643'471 | 38'770'417 | 7'417'598 |
| - aus Swaps | 0 | 0 | 0 | 0 |
| - aus Termingeschäften | 0 | 0 | 0 | 0 |
| - aus Devisentermingeschäften | -110'988 | 5'131 | 2'799'635 | -418'545 |
| - aus Optionen | 0 | 0 | 0 | 0 |
| NETTOERHÖHUNG/NETTOVERMINDERUNG DES NETTOVERMÖGENS | 14'811'702 | 934'344 | 25'317'546 | 28'689'099 |
| Zeichnung von Anteilen (2) | 14'433'506 | 49'216'710 | 92'344'982 | 209'799'492 |
| Rücknahme von Anteilen (2) | -11'962'215 | -89'583'387 | -145'807'769 | -70'856'773 |
| Ausschüttungen | -388 | -4'291 | -1'624'598 | 0 |
| Ertragsausgleich | 113'652 | 1'693'075 | 2'087'655 | -2'079'949 |
| Bewertungsdifferenz (2) | | | | |
| NETTOVERMÖGEN AM ENDE DES GESCHÄFTSJAHRES | 126'338'844 | 48'879'006 | 468'110'628 | 457'069'462 |

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Berichtes.

| | Erläuterung | Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Absolute Return USD | Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Convertible USD | Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Corporate USD | Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Secured High Yield USD |
|---|-------------|---|--|--|---|
| NETTOVERMÖGEN ZU BEGINN DES GESCHÄFTSJAHRES | | 415'623'709 | 98'561'350 | 369'130'034 | 121'202'738 |
| ERTRÄGE | | | | | |
| Dividenden aus Wertpapierbestand, netto | | 0 | 6'166 | 0 | 156'260 |
| Nettozinserträge aus Anleihen und anderen Schuldverschreibungen | | 11'325'169 | 841'293 | 16'019'317 | 7'219'147 |
| Zinserträge aus Bankguthaben | | 890'872 | 80'418 | 526'599 | 229'643 |
| Zinsen aus Swaps, netto | | 4'772'654 | 0 | 0 | 446'227 |
| Erhaltene Kommissionen | (13) | 76'899 | 29'521 | 44'219 | 61'946 |
| Sonstige Erträge | | 385 | 184 | 765 | 133 |
| GESAMTERTRÄGE | | 17'065'979 | 957'582 | 16'590'900 | 8'113'355 |
| AUFWENDUNGEN | | | | | |
| Transaktionskosten | | -75'912 | -2'441 | -11'042 | -5'572 |
| Pauschale Verwaltungskommission | (3) | -2'628'071 | -642'327 | -2'036'574 | -819'251 |
| Abonnementsteuer ("taxe d'abonnement") | (4) | -109'095 | -20'910 | -68'879 | -27'935 |
| Zinsaufwendungen aus Bankverbindlichkeiten | | -111'264 | -27'097 | -22'138 | -27'821 |
| Zinsaufwendungen aus Swaps, netto | | -6'491'043 | 0 | 0 | -109'522 |
| Sonstige Aufwendungen | | -33'611 | -6'418 | -12'322 | -13'068 |
| GESAMTAUFWENDUNGEN | | -9'448'996 | -699'193 | -2'150'955 | -1'003'168 |
| ERTRAGSAUSGLEICH | | -3'962'946 | -88'139 | -962'540 | 1'237'848 |
| SUMME DER NETTOERTRÄGE | | 3'654'037 | 170'250 | 13'477'405 | 8'348'035 |
| Nettorealisierte Werterhöhungen/ (Wertverminderungen) aus Wertpapieren | | -20'390'250 | -1'532'481 | -26'553'034 | -3'318'153 |
| Nettorealisierte Werterhöhungen/(Wertverminderungen) aus Swaps | | -2'643'391 | 0 | 0 | 782'945 |
| Nettorealisierte Werterhöhungen/(Wertverminderungen) aus Optionen | | -479'552 | 0 | 0 | 0 |
| Nettorealisierte Werterhöhungen/(Wertverminderungen) aus Devisentermingeschäften | | 2'498'532 | 3'477'674 | 6'755'019 | 628'479 |
| Nettorealisierte Werterhöhungen/(Wertverminderungen) aus Termingeschäften | | 2'238'512 | 0 | 832'988 | 0 |
| Nettorealisierte Werterhöhungen/(Wertverminderungen) aus Devisengeschäften | | -105'631 | -27'836 | -850'116 | -217'167 |
| NETTOGEWINN (-VERLUST) AUS ANLAGEN | | -15'227'743 | 2'087'607 | -6'337'738 | 6'224'139 |
| NETTOVERÄNDERUNG DES NICHT REAL. ERFOLGES | | | | | |
| - aus Wertpapieren | | 25'808'248 | 1'613'526 | 28'283'625 | 8'595'855 |
| - aus Swaps | | 0 | 0 | 0 | 0 |
| - aus Termingeschäften | | 0 | 0 | 0 | 0 |
| - aus Devisentermingeschäften | | 1'677'868 | 466'881 | 1'664'277 | 1'574'688 |
| - aus Optionen | | 0 | 0 | 0 | 0 |
| NETTOERHÖHUNG/NETTOVERMINDERUNG DES NETTOVERMÖGENS | | 12'258'372 | 4'168'014 | 23'610'164 | 16'394'683 |
| Zeichnung von Anteilen | (2) | 5'548'323 | 10'739'743 | 53'819'683 | 47'632'776 |
| Rücknahme von Anteilen | (2) | -210'263'898 | -41'272'450 | -89'852'634 | -28'744'947 |
| Ausschüttungen | | -2'014'606 | 0 | 0 | -1'220'418 |
| Ertragsausgleich | | 3'962'946 | 88'139 | 962'540 | -1'237'848 |
| Bewertungsdifferenz | (2) | | | | |
| NETTOVERMÖGEN AM ENDE DES GESCHÄFTSJAHRES | | 225'114'846 | 72'284'796 | 357'669'786 | 154'026'984 |

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Berichtes.

| | Erläuterung | Swisscanto (LU) Bond Fund Sustainable Global High Yield USD | Swisscanto (LU) Bond Fund Sustainable Global Aggregate CHF | Swisscanto (LU) Bond Fund Sustainable Global Credit CHF | Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible AUD |
|---|-------------|---|--|---|--|
| NETTOVERMÖGEN ZU BEGINN DES GESCHÄFTSJAHRES | | 74'337'047 | 102'827'151 | 150'062'193 | 133'725'990 |
| ERTRÄGE | | | | | |
| Dividenden aus Wertpapierbestand, netto | | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Nettozinserträge aus Anleihen und anderen Schuldverschreibungen | | 3'874'747 | 1'869'404 | 6'089'591 | 3'504'412 |
| Zinserträge aus Bankguthaben | | 73'853 | 134'977 | 104'762 | 131'661 |
| Zinsen aus Swaps, netto | | 231'007 | 392'936 | 0 | 359'700 |
| Erhaltene Kommissionen | (13) | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Sonstige Erträge | | 158 | 0 | 0 | 24 |
| GESAMTERTRÄGE | | 4'179'765 | 2'397'317 | 6'194'353 | 3'995'797 |
| AUFWENDUNGEN | | | | | |
| Transaktionskosten | | -2'949 | -7'069 | -3'912 | -17'901 |
| Pauschale Verwaltungskommission | (3) | -523'510 | -473'349 | -706'945 | -1'013'511 |
| Abonnementsteuer ("taxe d'abonnement") | (4) | -19'287 | -23'190 | -35'236 | -50'958 |
| Zinsaufwendungen aus Bankverbindlichkeiten | | -7'433 | -6'340 | -17'646 | -8'235 |
| Zinsaufwendungen aus Swaps, netto | | -97'311 | -212'780 | 0 | -386'844 |
| Sonstige Aufwendungen | | -12'487 | -12'301 | -6'607 | -20'341 |
| GESAMTAUFWENDUNGEN | | -662'977 | -735'029 | -770'346 | -1'497'790 |
| ERTRAGSAUSGLEICH | | -481'063 | -461'485 | 517'235 | -283'626 |
| SUMME DER NETTOERTRÄGE | | 3'035'724 | 1'200'804 | 5'941'242 | 2'214'381 |
| Nettorealisierte Werterhöhungen/ (Wertverminderungen) aus Wertpapieren | | -3'779'201 | -9'309'388 | -9'025'563 | -2'153'587 |
| Nettorealisierte Werterhöhungen/(Wertverminderungen) aus Swaps | | 167'915 | 35'810 | 0 | 189'667 |
| Nettorealisierte Werterhöhungen/(Wertverminderungen) aus Optionen | | 0 | 14'338 | 0 | 0 |
| Nettorealisierte Werterhöhungen/(Wertverminderungen) aus Devisentermingeschäften | | 1'029'857 | 80'212 | 7'144'795 | -455'107 |
| Nettorealisierte Werterhöhungen/(Wertverminderungen) aus Termingeschäften | | 0 | -499'310 | -215'309 | -2'260'010 |
| Nettorealisierte Werterhöhungen/(Wertverminderungen) aus Devisengeschäften | | 180'683 | -257'298 | -1'620'839 | 352'278 |
| NETTOGEWINN (-VERLUST) AUS ANLAGEN | | 634'977 | -8'734'832 | 2'224'325 | -2'112'379 |
| NETTOVERÄNDERUNG DES NICHT REAL. ERFOLGES | | | | | |
| - aus Wertpapieren | | 4'005'129 | 2'402'525 | 1'612'292 | 3'859'684 |
| - aus Swaps | | 0 | 0 | 0 | 0 |
| - aus Termingeschäften | | 0 | 0 | 0 | 0 |
| - aus Devisentermingeschäften | | 233'611 | -3'844 | -1'798'656 | 63'562 |
| - aus Optionen | | 0 | 0 | 0 | 0 |
| NETTOERHÖHUNG/NETTOVERMINDERUNG DES NETTOVERMÖGENS | | 4'873'717 | -6'336'150 | 2'037'961 | 1'810'867 |
| Zeichnung von Anteilen | (2) | 618'077 | 17'394'396 | 61'512'171 | 2'376'201 |
| Rücknahme von Anteilen | (2) | -18'531'637 | -44'783'098 | -41'660'629 | -25'480'050 |
| Ausschüttungen | | -93'168 | -391'917 | -798'074 | -1'326'206 |
| Ertragsausgleich | | 481'063 | 461'485 | -517'235 | 283'626 |
| Bewertungsdifferenz | (2) | | | | |
| NETTOVERMÖGEN AM ENDE DES GESCHÄFTSJAHRES | | 61'685'100 | 69'171'866 | 170'636'387 | 111'390'427 |

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Berichtes.

| | Erläuterung | Swisscanto (LU) Bond Fund Vision | | | Swisscanto (LU) Bond Fund Vision | | | Swisscanto (LU) Bond Fund Vision | | | Swisscanto (LU) Bond Fund Vision | | |
|---|-------------|-------------------------------------|--------------------|--------------------|-------------------------------------|--------------------|--------------------|-------------------------------------|--------------------|--------------------|-------------------------------------|--------------------|--------------------|
| | | Responsible CAD | Responsible CAD | Responsible CAD | Responsible CHF | Responsible CHF | Responsible CHF | Responsible EUR | Responsible EUR | Responsible EUR | Responsible GBP | Responsible GBP | Responsible GBP |
| NETTOVERMÖGEN ZU BEGINN DES GESCHÄFTSJAHRES | | 111'979'066 | 208'684'869 | 157'360'435 | 41'316'231 | | | | | | | | |
| ERTRÄGE | | | | | | | | | | | | | |
| Dividenden aus Wertpapierbestand, netto | | 0 | 0 | 0 | 0 | | | | | | | | |
| Nettozinserträge aus Anleihen und anderen Schuldverschreibungen | | 2'695'514 | 2'482'514 | 2'866'969 | 736'335 | | | | | | | | |
| Zinserträge aus Bankguthaben | | 128'607 | 102'352 | 137'992 | 22'572 | | | | | | | | |
| Zinsen aus Swaps, netto | | 253'252 | 396'129 | 1'112'212 | 82'435 | | | | | | | | |
| Erhaltene Kommissionen | (13) | 0 | 0 | 13'421 | 0 | | | | | | | | |
| Sonstige Erträge | | 0 | 0 | 77 | 0 | | | | | | | | |
| GESAMTERTRÄGE | | 3'077'373 | 2'980'995 | 4'130'671 | 841'342 | | | | | | | | |
| AUFWENDUNGEN | | | | | | | | | | | | | |
| Transaktionskosten | | -9'343 | -5'864 | -15'408 | -5'755 | | | | | | | | |
| Pauschale Verwaltungskommission | (3) | -647'837 | -1'247'337 | -963'295 | -231'542 | | | | | | | | |
| Abonnementsteuer ("taxe d'abonnement") | (4) | -27'163 | -66'174 | -46'377 | -10'418 | | | | | | | | |
| Zinsaufwendungen aus Bankverbindlichkeiten | | -3'510 | -12'280 | -12'121 | -1'658 | | | | | | | | |
| Zinsaufwendungen aus Swaps, netto | | -392'861 | -294'793 | -1'906'577 | -68'919 | | | | | | | | |
| Sonstige Aufwendungen | | -16'646 | -12'165 | -18'710 | -11'226 | | | | | | | | |
| GESAMTAUFWENDUNGEN | | -1'097'358 | -1'638'612 | -2'962'487 | -329'518 | | | | | | | | |
| ERTRAGSAUSGLEICH | | -890'053 | 66'429 | -36'943 | -184'506 | | | | | | | | |
| SUMME DER NETTOERTRÄGE | | 1'089'961 | 1'408'811 | 1'131'241 | 327'318 | | | | | | | | |
| Nettorealisierte Werterhöhungen/ (Wertverminderungen) aus Wertpapieren | | -8'283'929 | -3'295'787 | -11'103'263 | -5'518'180 | | | | | | | | |
| Nettorealisierte Werterhöhungen/(Wertverminderungen) aus Swaps | | 32'852 | 371'973 | -116'713 | 16'971 | | | | | | | | |
| Nettorealisierte Werterhöhungen/(Wertverminderungen) aus Optionen | | 0 | -211'659 | 161'298 | 0 | | | | | | | | |
| Nettorealisierte Werterhöhungen/(Wertverminderungen) aus Devisentermingeschäften | | -81'886 | 0 | 233'217 | 144'945 | | | | | | | | |
| Nettorealisierte Werterhöhungen/(Wertverminderungen) aus Termingeschäften | | -322'794 | -316'997 | -127'868 | -237'338 | | | | | | | | |
| Nettorealisierte Werterhöhungen/(Wertverminderungen) aus Devisengeschäften | | -6'122 | -69'965 | -10'801 | -23'267 | | | | | | | | |
| NETTOGEWINN (-VERLUST) AUS ANLAGEN | | -7'571'917 | -2'113'624 | -9'832'890 | -5'289'550 | | | | | | | | |
| NETTOVERÄNDERUNG DES NICHT REAL. ERFOLGES | | | | | | | | | | | | | |
| - aus Wertpapieren | | 6'240'011 | 9'397'955 | 15'123'240 | 4'060'729 | | | | | | | | |
| - aus Swaps | | 0 | 0 | 0 | 0 | | | | | | | | |
| - aus Termingeschäften | | 0 | 0 | 0 | 0 | | | | | | | | |
| - aus Devisentermingeschäften | | 9'971 | 0 | -4'340 | 8'433 | | | | | | | | |
| - aus Optionen | | 0 | 0 | 0 | 0 | | | | | | | | |
| NETTOERHÖHUNG/NETTOVERMINDERUNG DES NETTOVERMÖGENS | | -1'321'936 | 7'284'331 | 5'286'011 | -1'220'387 | | | | | | | | |
| Zeichnung von Anteilen | (2) | 39'595'680 | 29'508'009 | 31'523'040 | 921'301 | | | | | | | | |
| Rücknahme von Anteilen | (2) | -90'572'962 | -23'613'342 | -48'224'381 | -18'797'541 | | | | | | | | |
| Ausschüttungen | | -456'342 | -204'587 | -422'149 | -107'868 | | | | | | | | |
| Ertragsausgleich | | 890'053 | -66'429 | 36'943 | 184'506 | | | | | | | | |
| Bewertungsdifferenz | (2) | | | | | | | | | | | | |
| NETTOVERMÖGEN AM ENDE DES GESCHÄFTSJAHRES | | 60'113'560 | 221'592'851 | 145'559'900 | 22'296'242 | | | | | | | | |

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Berichtes.

| | Erläuterung | Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible USD USD | Konsolidiert CHF |
|---|-------------|---|----------------------|
| NETTOVERMÖGEN ZU BEGINN DES GESCHÄFTSJAHRES | | 88'072'293 | 2'812'740'553 |
| ERTRÄGE | | | |
| Dividenden aus Wertpapierbestand, netto | | 0 | 156'521 |
| Nettozinserträge aus Anleihen und anderen Schuldverschreibungen | | 1'957'484 | 103'141'037 |
| Zinserträge aus Bankguthaben | | 180'413 | 3'852'530 |
| Zinsen aus Swaps, netto | | 296'817 | 7'279'317 |
| Erhaltene Kommissionen | (13) | 1'207 | 365'023 |
| Sonstige Erträge | | 5 | 2'301 |
| GESAMTERTRÄGE | | 2'435'926 | 114'796'730 |
| AUFWENDUNGEN | | | |
| Transaktionskosten | | -10'334 | -160'578 |
| Pauschale Verwaltungskommission | (3) | -442'603 | -14'794'970 |
| Abonnementsteuer ("taxe d'abonnement") | (4) | -20'125 | -589'041 |
| Zinsaufwendungen aus Bankverbindlichkeiten | | -4'687 | -471'415 |
| Zinsaufwendungen aus Swaps, netto | | -320'862 | -8'858'974 |
| Sonstige Aufwendungen | | -13'740 | -194'117 |
| GESAMTAUFWENDUNGEN | | -812'350 | -25'069'094 |
| ERTRAGSAUSGLEICH | | -628'443 | -6'601'890 |
| SUMME DER NETTOERTRÄGE | | 995'133 | 83'125'745 |
| Nettorealisierte Werterhöhungen/ (Wertverminderungen) aus Wertpapieren | | -4'916'837 | -146'800'595 |
| Nettorealisierte Werterhöhungen/(Wertverminderungen) aus Swaps | | 36'274 | -974'604 |
| Nettorealisierte Werterhöhungen/(Wertverminderungen) aus Optionen | | 0 | -423'513 |
| Nettorealisierte Werterhöhungen/(Wertverminderungen) aus Devisentermingeschäften | | 0 | 27'975'579 |
| Nettorealisierte Werterhöhungen/(Wertverminderungen) aus Termingeschäften | | -495'575 | -151'081 |
| Nettorealisierte Werterhöhungen/(Wertverminderungen) aus Devisengeschäften | | 46'174 | -5'568'514 |
| NETTOGEWINN (-VERLUST) AUS ANLAGEN | | -4'334'831 | -42'553'128 |
| NETTOVERÄNDERUNG DES NICHT REAL. ERFOLGES | | | |
| - aus Wertpapieren | | 3'674'736 | 157'523'653 |
| - aus Swaps | | 0 | 0 |
| - aus Termingeschäften | | 0 | 0 |
| - aus Devisentermingeschäften | | 0 | 5'007'536 |
| - aus Optionen | | 0 | 0 |
| NETTOERHÖHUNG/NETTOVERMINDERUNG DES NETTOVERMÖGENS | | -660'095 | 119'978'061 |
| Zeichnung von Anteilen | (2) | 16'691'717 | 596'284'257 |
| Rücknahme von Anteilen | (2) | -54'458'615 | -902'129'359 |
| Ausschüttungen | | -360'359 | -7'512'793 |
| Ertragsausgleich | | 628'443 | 6'601'890 |
| Bewertungsdifferenz | (2) | | -159'395'164 |
| NETTOVERMÖGEN AM ENDE DES GESCHÄFTSJAHRES | | 49'913'384 | 2'466'303'590 |

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Berichtes.

6 Statistik

Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible COCO - USD

| | Klasse | Y | Y-1 | Y-2 |
|-------------------------------|---------------|-----------------|----------------|----------------|
| Nettovermögen | | 468'110'628.11 | 495'792'812.00 | 741'603'555.00 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | AAH CHF | 90.58 | 94.00 | 102.56 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | AAH EUR | 95.29 | 96.86 | 105.41 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | AT | 211.33 | 199.83 | 202.51 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | ATH CHF | 164.13 | 161.94 | 168.89 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | ATH EUR | 177.09 | 170.84 | 177.33 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | BTH CHF | 128.79 | 126.34 | 130.91 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | DAH EUR | 113.04 | 114.87 | 125.22 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | DT | 180.03 | 168.82 | 169.66 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | DTH CHF | 180.82 | 176.92 | 183.04 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | DTH EUR | 195.12 | 186.69 | 192.12 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | DTH SEK | 1'383.53 | 1'323.90 | 1'358.21 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | GT | 193.64 | 181.30 | 181.88 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | GTH CHF | 153.33 | 149.81 | 154.63 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | GTH EUR | 158.58 | 151.57 | 155.79 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | MTH CHF | 102.29 | 99.37 | 102.03 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | NT | 138.92 | 129.29 | 128.96 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | NTH CHF | 141.45 | 137.36 | 141.02 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | NTH EUR | 135.82 | 129.03 | 131.78 |
| TER pro Anteil | AAH CHF | 1.36 | | |
| TER pro Anteil | AAH EUR | 1.31 | | |
| TER pro Anteil | AT | 1.60 | | |
| TER pro Anteil | ATH CHF | 1.36 | | |
| TER pro Anteil | ATH EUR | 1.32 | | |
| TER pro Anteil | BTH CHF | 0.81 | | |
| TER pro Anteil | BTH EUR | 0.00 | | |
| TER pro Anteil | DAH EUR | 0.64 | | |
| TER pro Anteil | DT | 0.76 | | |
| TER pro Anteil | DTH CHF | 0.76 | | |
| TER pro Anteil | DTH EUR | 0.63 | | |
| TER pro Anteil | DTH SEK | 0.07 | | |
| TER pro Anteil | GT | 0.61 | | |
| TER pro Anteil | GTH CHF | 0.61 | | |
| TER pro Anteil | GTH EUR | 0.61 | | |
| TER pro Anteil | MTH CHF | 0.05 | | |
| TER pro Anteil | NT | 0.01 | | |
| TER pro Anteil | NTH CHF | 0.01 | | |
| TER pro Anteil | NTH EUR | 0.01 | | |
| | Klasse | Ex-Datum | Betrag | Anteile |
| Ausschüttung | AAH CHF | 23.05.2023 | 1.60 | 112'718.639 |
| Ausschüttung | AAH EUR | 23.05.2023 | 1.70 | 58'957.624 |
| Ausschüttung | DAH EUR | 23.05.2023 | 2.80 | 122'258.724 |

Klassen ohne Währung in der Bezeichnung sind immer in Portfoliowährung.

| | | | | |
|--------------|---------|------------|------|-------------|
| Ausschüttung | AAH CHF | 25.05.2023 | 3.10 | 112'718.639 |
| Ausschüttung | AAH EUR | 25.05.2023 | 3.20 | 58'657.624 |
| Ausschüttung | DAH EUR | 25.05.2023 | 3.80 | 122'253.500 |

Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Corporate Hybrid - USD

| | Klasse | Y | Y-1 | Y-2 |
|-------------------------------|---------|----------------|----------------|----------------|
| Nettovermögen | | 126'338'844.04 | 108'942'588.00 | 105'962'691.00 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | AA | 109.16 | 102.24 | 0.00 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | ATH CHF | 103.27 | 98.18 | 0.00 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | DT | 94.72 | 87.43 | 96.79 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | DTH CHF | 100.82 | 86.74 | 96.67 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | GTH CHF | 91.88 | 87.41 | 96.85 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | STH CHF | 93'153.40 | 87'455.06 | 96'897.39 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | STH USD | 100'157.59 | 90'332.94 | 97'362.25 |
| TER pro Anteil | AA | 1.17 | | |
| TER pro Anteil | ATH CHF | 0.84 | | |
| TER pro Anteil | DT | 0.56 | | |
| TER pro Anteil | DTH CHF | 0.59 | | |
| TER pro Anteil | GTH CHF | 0.52 | | |
| TER pro Anteil | NTH CHF | 0.00 | | |
| TER pro Anteil | STH CHF | 0.01 | | |
| TER pro Anteil | STH USD | 0.01 | | |

| | Klasse | Ex-Datum | Betrag | Anteile |
|--------------|--------|------------|--------|---------|
| Ausschüttung | AA | 23.05.2023 | 0.85 | 456.000 |

Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Emerging Markets Opportunities - USD

| | Klasse | Y | Y-1 | Y-2 |
|-------------------------------|---------|----------------|----------------|----------------|
| Nettovermögen | | 457'069'461.61 | 293'062'636.00 | 138'925'182.00 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | AT | 100.16 | 94.75 | 103.10 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | CT | 102.38 | 96.27 | 104.12 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | DT | 102.75 | 96.52 | 104.29 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | DTH CHF | 92.67 | 91.42 | 101.92 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | DTH EUR | 95.38 | 91.92 | 102.18 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | GT | 103.11 | 96.77 | 104.46 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | NT | 105.58 | 98.44 | 105.57 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | NTH CHF | 95.15 | 93.32 | 103.21 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | NTH EUR | 0.00 | 99.48 | 0.00 |
| TER pro Anteil | AT | 1.46 | | |
| TER pro Anteil | CT | 0.85 | | |
| TER pro Anteil | DT | 0.76 | | |
| TER pro Anteil | DTH CHF | 0.76 | | |
| TER pro Anteil | DTH EUR | 0.77 | | |
| TER pro Anteil | GT | 0.66 | | |
| TER pro Anteil | NT | 0.01 | | |
| TER pro Anteil | NTH CHF | 0.01 | | |
| TER pro Anteil | NTH EUR | 0.00 | | |

Klassen ohne Währung in der Bezeichnung sind immer in Portfoliowährung.

Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Absolute Return - USD

| | Klasse | Y | Y-1 | Y-2 |
|-------------------------------|---------|----------------|----------------|----------------|
| Nettovermögen | | 225'114'846.16 | 414'626'212.00 | 509'498'784.00 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | AA | 95.90 | 93.92 | 98.85 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | AAH CHF | 68.94 | 70.48 | 76.36 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | AAH EUR | 74.72 | 74.73 | 80.67 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | AT | 116.15 | 112.04 | 116.18 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | ATH CHF | 109.04 | 109.77 | 117.11 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | ATH EUR | 121.14 | 119.29 | 126.52 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | BTH CHF | 94.72 | 94.89 | 100.70 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | BTH EUR | 102.23 | 100.19 | 105.75 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | CTH CHF | 93.02 | 93.07 | 98.71 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | DTH CHF | 96.16 | 96.15 | 102.08 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | DTH EUR | 100.66 | 98.51 | 103.91 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | GT | 124.91 | 119.60 | 123.12 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | GTH CHF | 99.56 | 99.51 | 105.29 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | GTH EUR | 105.93 | 103.65 | 109.21 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | NTH CHF | 0.00 | 0.00 | 101.45 |
| TER pro Anteil | AA | 1.20 | | |
| TER pro Anteil | AAH CHF | 1.02 | | |
| TER pro Anteil | AAH EUR | 0.98 | | |
| TER pro Anteil | AT | 1.21 | | |
| TER pro Anteil | ATH CHF | 1.01 | | |
| TER pro Anteil | ATH EUR | 0.98 | | |
| TER pro Anteil | BTH CHF | 0.73 | | |
| TER pro Anteil | BTH EUR | 0.60 | | |
| TER pro Anteil | CTH CHF | 0.53 | | |
| TER pro Anteil | DTH CHF | 0.56 | | |
| TER pro Anteil | DTH EUR | 0.45 | | |
| TER pro Anteil | GT | 0.46 | | |
| TER pro Anteil | GTH CHF | 0.46 | | |
| TER pro Anteil | GTH EUR | 0.35 | | |
| TER pro Anteil | NTH CHF | 0.00 | | |

| | Klasse | Ex-Datum | Betrag | Anteile |
|--------------|---------|------------|--------|---------------|
| Ausschüttung | AA | 23.05.2023 | 1.40 | 29'859.000 |
| Ausschüttung | AAH CHF | 23.05.2023 | 1.04 | 1'415'134.307 |
| Ausschüttung | AAH EUR | 23.05.2023 | 1.10 | 287'832.265 |

Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Convertible - USD

| | Klasse | Y | Y-1 | Y-2 |
|-------------------------------|---------|---------------|---------------|----------------|
| Nettovermögen | | 72'284'796.17 | 98'561'350.00 | 109'243'883.00 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | AT | 136.18 | 133.65 | 145.50 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | ATH CHF | 118.85 | 121.69 | 136.76 |

Klassen ohne Währung in der Bezeichnung sind immer in Portfoliowährung.

| | | | | |
|-------------------------------|---------|--------|--------|--------|
| Nettovermögenswert pro Anteil | ATH EUR | 128.18 | 128.51 | 143.79 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | DTH CHF | 132.40 | 134.49 | 149.89 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | DTH EUR | 114.12 | 113.50 | 126.00 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | GT | 145.76 | 141.78 | 152.97 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | GTH CHF | 124.93 | 126.82 | 141.31 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | GTH EUR | 131.12 | 129.88 | 144.02 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | MTH CHF | 101.49 | 102.46 | 113.50 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | NT | 128.50 | 124.31 | 133.40 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | NTH CHF | 106.67 | 107.67 | 119.27 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | NTH EUR | 111.16 | 109.91 | 121.21 |
| TER pro Anteil | AT | 1.45 | | |
| TER pro Anteil | ATH CHF | 1.23 | | |
| TER pro Anteil | ATH EUR | 1.17 | | |
| TER pro Anteil | DTH CHF | 0.55 | | |
| TER pro Anteil | DTH EUR | 0.55 | | |
| TER pro Anteil | GT | 0.56 | | |
| TER pro Anteil | GTH CHF | 0.45 | | |
| TER pro Anteil | GTH EUR | 0.56 | | |
| TER pro Anteil | MTH CHF | 0.05 | | |
| TER pro Anteil | NT | 0.01 | | |
| TER pro Anteil | NTH CHF | 0.01 | | |
| TER pro Anteil | NTH EUR | 0.01 | | |

Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Corporate - USD

| | Klasse | Y | Y-1 | Y-2 |
|-------------------------------|---------|----------------|----------------|----------------|
| Nettovermögen | | 357'669'786.21 | 369'130'034.00 | 370'070'125.00 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | AT | 158.65 | 150.57 | 165.38 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | ATH CHF | 123.42 | 122.20 | 138.29 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | ATH EUR | 134.05 | 130.00 | 146.20 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | BTH CHF | 99.05 | 97.75 | 110.08 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | BTH EUR | 106.21 | 102.81 | 115.12 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | CTH CHF | 94.92 | 93.62 | 105.43 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | DT | 122.78 | 115.84 | 126.49 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | DTH CHF | 100.21 | 98.68 | 111.07 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | DTH EUR | 134.43 | 129.59 | 144.89 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | GT | 136.01 | 128.17 | 139.82 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | GTH CHF | 111.53 | 109.73 | 123.25 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | GTH EUR | 117.77 | 113.44 | 126.77 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | NT | 108.49 | 0.00 | 0.00 |
| TER pro Anteil | AT | 1.11 | | |
| TER pro Anteil | ATH CHF | 0.93 | | |
| TER pro Anteil | ATH EUR | 0.90 | | |
| TER pro Anteil | BTH CHF | 0.55 | | |
| TER pro Anteil | BTH EUR | 0.50 | | |
| TER pro Anteil | CTH CHF | 0.62 | | |
| TER pro Anteil | DT | 0.51 | | |

Klassen ohne Währung in der Bezeichnung sind immer in Portfoliowährung.

| | | |
|----------------|---------|------|
| TER pro Anteil | DTH CHF | 0.51 |
| TER pro Anteil | DTH EUR | 0.51 |
| TER pro Anteil | GT | 0.41 |
| TER pro Anteil | GTH CHF | 0.41 |
| TER pro Anteil | GTH EUR | 0.42 |
| TER pro Anteil | NT | 0.01 |

Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Rates - USD

| | Klasse | Y | Y-1 | Y-2 |
|-------------------------------|---------|---------------|---------------|----------------|
| Nettovermögen | | 48'879'006.28 | 86'622'556.00 | 196'194'309.00 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | AAH EUR | 0.00 | 82.02 | 94.40 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | AT | 106.88 | 0.00 | 0.00 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | ATH CHF | 0.00 | 101.03 | 111.97 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | GTH CHF | 0.00 | 101.60 | 111.62 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | NT | 125.40 | 114.77 | 121.68 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | NT EUR | 104.87 | 0.00 | 0.00 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | NTH CHF | 0.00 | 99.57 | 108.78 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | NTH EUR | 0.00 | 101.70 | 110.59 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | ST | 106'378.67 | 0.00 | 0.00 |
| TER pro Anteil | AAH EUR | 0.00 | | |
| TER pro Anteil | AT | 1.01 | | |
| TER pro Anteil | ATH CHF | 0.00 | | |
| TER pro Anteil | GTH CHF | 0.00 | | |
| TER pro Anteil | NT | 0.01 | | |
| TER pro Anteil | NT EUR | 0.01 | | |
| TER pro Anteil | NTH CHF | 0.00 | | |
| TER pro Anteil | NTH EUR | 0.00 | | |
| TER pro Anteil | ST | 0.01 | | |

| | Klasse | Ex-Datum | Betrag | Anteile |
|--------------|---------|------------|--------|-----------|
| Ausschüttung | AAH EUR | 23.05.2023 | 2.84 | 1'384.341 |

Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Secured High Yield - USD

| | Klasse | Y | Y-1 | Y-2 |
|-------------------------------|---------|----------------|----------------|----------------|
| Nettovermögen | | 154'026'983.79 | 121'202'738.00 | 148'112'347.00 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | AA | 95.40 | 90.05 | 96.85 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | AAH CHF | 75.03 | 73.67 | 81.91 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | AAH EUR | 79.63 | 76.65 | 84.99 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | AT | 136.84 | 123.40 | 127.40 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | ATH CHF | 108.44 | 101.94 | 108.38 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | ATH EUR | 115.24 | 106.02 | 112.19 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | BTH CHF | 113.02 | 105.72 | 111.92 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | DAH EUR | 83.84 | 80.70 | 89.57 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | DT | 132.72 | 118.74 | 121.63 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | DTH CHF | 108.71 | 101.45 | 107.16 |

Klassen ohne Währung in der Bezeichnung sind immer in Portfoliowährung.

| | | | | |
|-------------------------------|---------|--------|--------|--------|
| Nettovermögenswert pro Anteil | DTH EUR | 113.74 | 103.87 | 108.98 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | GT | 148.26 | 132.52 | 135.60 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | GTH CHF | 117.70 | 109.64 | 115.67 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | GTH EUR | 124.90 | 113.97 | 119.53 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | NT | 121.94 | 108.39 | 0.00 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | NTH CHF | 107.23 | 99.43 | 104.27 |
| TER pro Anteil | AA | 1.46 | | |
| TER pro Anteil | AAH CHF | 1.24 | | |
| TER pro Anteil | AAH EUR | 1.21 | | |
| TER pro Anteil | AT | 1.45 | | |
| TER pro Anteil | ATH CHF | 1.26 | | |
| TER pro Anteil | ATH EUR | 1.21 | | |
| TER pro Anteil | BTH CHF | 0.76 | | |
| TER pro Anteil | DAH EUR | 0.55 | | |
| TER pro Anteil | DT | 0.66 | | |
| TER pro Anteil | DTH CHF | 0.66 | | |
| TER pro Anteil | DTH EUR | 0.54 | | |
| TER pro Anteil | GT | 0.57 | | |
| TER pro Anteil | GTH CHF | 0.56 | | |
| TER pro Anteil | GTH EUR | 0.56 | | |
| TER pro Anteil | NT | 0.01 | | |
| TER pro Anteil | NTH CHF | 0.01 | | |

| | Klasse | Ex-Datum | Betrag | Anteile |
|--------------|---------------|-----------------|---------------|----------------|
| Ausschüttung | AA | 23.05.2023 | 4.05 | 21'554.190 |
| Ausschüttung | AAH CHF | 23.05.2023 | 3.22 | 136'672.498 |
| Ausschüttung | AAH EUR | 23.05.2023 | 3.36 | 143'857.415 |
| Ausschüttung | DAH EUR | 23.05.2023 | 4.13 | 28'820.000 |

Swisscanto (LU) Bond Fund Sustainable Global Credit - CHF

| | Klasse | Y | Y-1 | Y-2 |
|-------------------------------|---------------|----------------|----------------|----------------|
| Nettovermögen | | 170'636'386.68 | 149'732'056.00 | 183'241'293.00 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | AA | 87.34 | 88.95 | 102.61 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | AAH EUR | 90.11 | 89.91 | 103.36 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | AT | 95.92 | 95.43 | 107.95 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | ATH EUR | 99.14 | 96.66 | 108.79 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | BT | 98.16 | 97.24 | 109.54 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | DAH EUR | 90.41 | 90.31 | 103.94 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | DT | 99.06 | 97.97 | 110.18 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | DTH EUR | 88.62 | 86.10 | 96.38 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | DTH USD | 100.08 | 0.00 | 0.00 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | GT | 98.80 | 97.63 | 0.00 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | GTH EUR | 101.15 | 97.97 | 0.00 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | NT | 102.38 | 100.74 | 112.72 |
| TER pro Anteil | AA | 1.11 | | |
| TER pro Anteil | AAH EUR | 0.84 | | |

Klassen ohne Währung in der Bezeichnung sind immer in Portfoliowährung.

| | | |
|----------------|---------|------|
| TER pro Anteil | AT | 1.12 |
| TER pro Anteil | ATH EUR | 0.85 |
| TER pro Anteil | BT | 0.68 |
| TER pro Anteil | DAH EUR | 0.40 |
| TER pro Anteil | DT | 0.51 |
| TER pro Anteil | DTH EUR | 0.52 |
| TER pro Anteil | DTH USD | 0.52 |
| TER pro Anteil | GT | 0.44 |
| TER pro Anteil | GTH EUR | 0.32 |
| TER pro Anteil | NT | 0.01 |

| | Klasse | Ex-Datum | Betrag | Anteile |
|--------------|---------------|-----------------|---------------|----------------|
| Ausschüttung | AA | 23.05.2023 | 1.96 | 201'379.089 |
| Ausschüttung | AAH EUR | 23.05.2023 | 1.95 | 187'254.045 |
| Ausschüttung | DAH EUR | 23.05.2023 | 2.50 | 12'068.150 |

Swisscanto (LU) Bond Fund Sustainable Global High Yield - USD

| | Klasse | Y | Y-1 | Y-2 |
|-------------------------------|---------------|---------------|---------------|----------------|
| Nettovermögen | | 61'685'100.29 | 74'337'047.00 | 129'491'958.00 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | AAH EUR | 68.83 | 68.57 | 76.21 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | AT | 150.16 | 140.47 | 145.49 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | ATH CHF | 116.46 | 113.69 | 121.30 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | ATH EUR | 126.12 | 120.44 | 127.88 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | BTH CHF | 105.28 | 102.16 | 108.45 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | DAH EUR | 69.41 | 69.18 | 77.05 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | DT | 161.64 | 150.02 | 154.16 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | DTH CHF | 127.34 | 123.29 | 130.58 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | DTH EUR | 136.85 | 129.65 | 136.52 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | GT | 140.69 | 130.44 | 133.91 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | GTH CHF | 0.00 | 108.61 | 114.87 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | GTH EUR | 117.43 | 111.16 | 116.93 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | NT | 126.60 | 116.73 | 119.18 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | NTH CHF | 109.62 | 105.40 | 110.94 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | NTH EUR | 110.05 | 103.61 | 108.44 |
| TER pro Anteil | AAH EUR | 1.18 | | |
| TER pro Anteil | AT | 1.46 | | |
| TER pro Anteil | ATH CHF | 1.24 | | |
| TER pro Anteil | ATH EUR | 1.21 | | |
| TER pro Anteil | BTH CHF | 0.82 | | |
| TER pro Anteil | DAH EUR | 0.53 | | |
| TER pro Anteil | DT | 0.67 | | |
| TER pro Anteil | DTH CHF | 0.67 | | |
| TER pro Anteil | DTH EUR | 0.54 | | |
| TER pro Anteil | GT | 0.56 | | |
| TER pro Anteil | GTH CHF | 0.00 | | |
| TER pro Anteil | GTH EUR | 0.56 | | |

Klassen ohne Währung in der Bezeichnung sind immer in Portfoliowährung.

| | | |
|----------------|---------|------|
| TER pro Anteil | NT | 0.01 |
| TER pro Anteil | NTH CHF | 0.01 |
| TER pro Anteil | NTH EUR | 0.01 |

| | Klasse | Ex-Datum | Betrag | Anteile |
|--------------|---------------|-----------------|---------------|----------------|
| Ausschüttung | AAH EUR | 23.05.2023 | 2.75 | 19'722.000 |
| Ausschüttung | DAH EUR | 23.05.2023 | 3.30 | 9'445.000 |

Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible AUD - AUD

| | Klasse | Y | Y-1 | Y-2 |
|-------------------------------|---------------|----------------|----------------|----------------|
| Nettovermögen | | 111'390'426.60 | 133'725'990.00 | 177'171'273.00 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | AA | 115.19 | 115.25 | 126.64 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | AT | 247.02 | 242.22 | 261.57 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | BT | 114.27 | 111.64 | 120.11 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | CT | 109.05 | 106.42 | 114.40 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | DT | 111.76 | 108.99 | 117.06 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | GT | 131.51 | 128.18 | 137.58 |
| TER pro Anteil | AA | 1.00 | | |
| TER pro Anteil | AT | 1.00 | | |
| TER pro Anteil | BT | 0.63 | | |
| TER pro Anteil | CT | 0.54 | | |
| TER pro Anteil | DT | 0.46 | | |
| TER pro Anteil | GT | 0.39 | | |

| | Klasse | Ex-Datum | Betrag | Anteile |
|--------------|---------------|-----------------|---------------|----------------|
| Ausschüttung | AA | 23.05.2023 | 2.30 | 576'611.343 |

Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible CAD - CAD

| | Klasse | Y | Y-1 | Y-2 |
|-------------------------------|---------------|---------------|----------------|----------------|
| Nettovermögen | | 60'113'560.11 | 111'979'066.00 | 138'423'553.00 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | AA | 124.77 | 125.09 | 134.89 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | AT | 208.70 | 205.18 | 217.77 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | CT | 107.79 | 105.47 | 111.43 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | DT | 106.58 | 104.24 | 110.04 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | GT | 117.66 | 114.91 | 121.22 |
| TER pro Anteil | AA | 1.00 | | |
| TER pro Anteil | AT | 1.00 | | |
| TER pro Anteil | CT | 0.54 | | |
| TER pro Anteil | DT | 0.46 | | |
| TER pro Anteil | GT | 0.39 | | |

| | Klasse | Ex-Datum | Betrag | Anteile |
|--------------|---------------|-----------------|---------------|----------------|
| Ausschüttung | AA | 23.05.2023 | 2.40 | 190'142.482 |

Klassen ohne Währung in der Bezeichnung sind immer in Portfoliowährung.

Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible CHF - CHF

| | Klasse | Y | Y-1 | Y-2 |
|-------------------------------|---------------|-----------------|----------------|----------------|
| Nettovermögen | | 221'592'850.89 | 209'248'318.00 | 213'715'507.00 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | AA | 101.20 | 98.45 | 104.90 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | AT | 126.48 | 122.80 | 130.72 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | BT | 96.16 | 93.01 | 98.64 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | CT | 97.97 | 94.68 | 100.32 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | DA | 97.96 | 95.35 | 101.63 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | DT | 97.68 | 94.32 | 99.86 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | GT | 103.49 | 99.87 | 105.66 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | NT | 101.44 | 97.51 | 102.78 |
| TER pro Anteil | AA | 1.01 | | |
| TER pro Anteil | AT | 1.01 | | |
| TER pro Anteil | BT | 0.63 | | |
| TER pro Anteil | CT | 0.54 | | |
| TER pro Anteil | DA | 0.46 | | |
| TER pro Anteil | DT | 0.46 | | |
| TER pro Anteil | GT | 0.40 | | |
| TER pro Anteil | NT | 0.01 | | |
| | Klasse | Ex-Datum | Betrag | Anteile |
| Ausschüttung | AA | 23.05.2023 | 0.20 | 808'461.544 |
| Ausschüttung | DA | 23.05.2023 | 0.75 | 57'192.537 |

Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible EUR - EUR

| | Klasse | Y | Y-1 | Y-2 |
|-------------------------------|---------------|-----------------|----------------|----------------|
| Nettovermögen | | 145'559'899.73 | 157'360'435.00 | 198'177'814.00 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | AA | 61.94 | 60.38 | 70.79 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | AT | 92.97 | 89.94 | 105.12 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | CT | 95.13 | 91.61 | 106.58 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | DA | 99.41 | 96.92 | 113.70 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | DT | 117.08 | 112.66 | 130.96 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | GT | 109.78 | 105.55 | 122.61 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | NT | 97.61 | 93.50 | 108.20 |
| TER pro Anteil | AA | 1.01 | | |
| TER pro Anteil | AT | 1.00 | | |
| TER pro Anteil | CT | 0.54 | | |
| TER pro Anteil | DA | 0.46 | | |
| TER pro Anteil | DT | 0.46 | | |
| TER pro Anteil | GT | 0.39 | | |
| TER pro Anteil | NT | 0.01 | | |
| | Klasse | Ex-Datum | Betrag | Anteile |
| Ausschüttung | AA | 23.05.2023 | 0.45 | 929'440.309 |
| Ausschüttung | DA | 23.05.2023 | 1.25 | 3'120.857 |

Klassen ohne Währung in der Bezeichnung sind immer in Portfoliowährung.

Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible GBP - GBP

| | Klasse | Y | Y-1 | Y-2 |
|-------------------------------|---------------|---------------|---------------|---------------|
| Nettovermögen | | 22'296'241.90 | 41'316'231.00 | 53'265'844.00 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | AA | 60.89 | 62.38 | 75.97 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | AT | 106.47 | 106.95 | 129.44 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | CT | 89.20 | 89.19 | 107.45 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | DA | 100.40 | 102.85 | 125.46 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | DT | 0.00 | 90.90 | 109.42 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | GT | 109.27 | 109.10 | 131.23 |
| TER pro Anteil | AA | 1.00 | | |
| TER pro Anteil | AT | 1.00 | | |
| TER pro Anteil | CT | 0.54 | | |
| TER pro Anteil | DA | 0.46 | | |
| TER pro Anteil | DT | 0.00 | | |
| TER pro Anteil | GT | 0.39 | | |

| | Klasse | Ex-Datum | Betrag | Anteile |
|--------------|---------------|-----------------|---------------|----------------|
| Ausschüttung | AA | 23.05.2023 | 1.15 | 92'907.547 |
| Ausschüttung | DA | 23.05.2023 | 2.40 | 427.000 |

Swisscanto (LU) Bond Fund Sustainable Global Aggregate - CHF

| | Klasse | Y | Y-1 | Y-2 |
|-------------------------------|---------------|---------------|----------------|---------------|
| Nettovermögen | | 69'171'865.81 | 102'662'628.00 | 93'821'666.00 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | AA | 61.87 | 66.55 | 77.22 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | AT | 91.78 | 97.41 | 112.02 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | BT | 89.33 | 94.46 | 108.23 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | CT | 86.37 | 91.25 | 104.45 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | DT | 80.90 | 85.41 | 97.70 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | GT | 95.72 | 100.98 | 115.42 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | NT | 86.39 | 90.79 | 0.00 |
| TER pro Anteil | AA | 1.00 | | |
| TER pro Anteil | AT | 1.01 | | |
| TER pro Anteil | BT | 0.63 | | |
| TER pro Anteil | CT | 0.55 | | |
| TER pro Anteil | DT | 0.46 | | |
| TER pro Anteil | GT | 0.39 | | |
| TER pro Anteil | NT | 0.10 | | |

| | Klasse | Ex-Datum | Betrag | Anteile |
|--------------|---------------|-----------------|---------------|----------------|
| Ausschüttung | AA | 23.05.2023 | 0.85 | 461'079.355 |

Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible USD - USD

| | Klasse | Y | Y-1 | Y-2 |
|-------------------------------|---------------|---------------|---------------|----------------|
| Nettovermögen | | 49'913'383.84 | 88'072'293.00 | 102'516'020.00 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | AA | 110.91 | 111.06 | 123.04 |

Klassen ohne Währung in der Bezeichnung sind immer in Portfoliowährung.

| | | | | |
|-------------------------------|----|--------|--------|--------|
| Nettovermögenswert pro Anteil | AT | 177.58 | 174.98 | 191.37 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | CT | 105.70 | 103.67 | 112.86 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | DA | 106.39 | 106.55 | 118.13 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | DT | 108.62 | 106.45 | 115.80 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | GT | 112.97 | 110.65 | 120.28 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | NT | 109.12 | 106.47 | 115.30 |
| TER pro Anteil | AA | 1.00 | | |
| TER pro Anteil | AT | 1.00 | | |
| TER pro Anteil | CT | 0.54 | | |
| TER pro Anteil | DA | 0.46 | | |
| TER pro Anteil | DT | 0.46 | | |
| TER pro Anteil | GT | 0.39 | | |
| TER pro Anteil | NT | 0.01 | | |

| | Klasse | Ex-Datum | Betrag | Anteile |
|--------------|---------------|-----------------|---------------|----------------|
| Ausschüttung | AA | 23.05.2023 | 1.74 | 205'133.251 |
| Ausschüttung | DA | 23.05.2023 | 2.24 | 611.409 |

Klassen ohne Währung in der Bezeichnung sind immer in Portfoliowährung.

7 Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible COCO

Wertpapierbestand zum 31.01.2024 (Angaben in USD)

| ISIN Nummer | Bezeichnung | Stückzahl / Nennwert | Währung | Einstandswert | Marktwert | % des Netto- vermögens |
|---|------------------------|-------------------------|---------|-------------------|-------------------|---------------------------|
| Amtlich notierte sowie an anderen geregelten Märkten gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | | | | | | |
| Anleihen | | | | | | |
| AT | | | | | | |
| XS1961057780 | ERSTBK 5 1/8 PERP EMTN | 1'000'000 | EUR | 1'253'113 | 1'041'147 | 0.22 |
| XS1806328750 | BGAV 5 PERP | 5'000'000 | EUR | 4'943'587 | 4'781'664 | 1.02 |
| AT0000A36XD5 | ERSTBK 8 1/2 PERP | 2'000'000 | EUR | 2'141'695 | 2'319'379 | 0.50 |
| AT0000A2L583 | ERSTBK 4 1/4 PERP PERP | 2'000'000 | EUR | 1'687'446 | 1'914'795 | 0.41 |
| | | | | 10'025'840 | 10'056'985 | 2.15 |
| AU | | | | | | |
| USQ08328AA64 | ANZ 6 3/4 PERP REGS | 7'000'000 | USD | 8'092'415 | 7'064'330 | 1.51 |
| US96122UAA25 | WSTP 5 PERP | 200'000 | USD | 200'000 | 187'704 | 0.04 |
| | | | | 8'292'415 | 7'252'034 | 1.55 |
| BE | | | | | | |
| BE0002961424 | KBCBB 8 PERP | 5'000'000 | EUR | 5'429'989 | 5'782'153 | 1.24 |
| BE0002582600 | CCBGBB 3 5/8 PERP | 3'000'000 | EUR | 2'426'264 | 2'974'875 | 0.64 |
| | | | | 7'856'253 | 8'757'028 | 1.88 |
| BR | | | | | | |
| USP5R6DPAB67 | ITAU 7.859 PERP REGS | 3'200'000 | USD | 3'240'232 | 3'195'872 | 0.68 |
| USP5R6DPAA84 | ITAU 7.721 PERP REGS | 6'000'000 | USD | 5'971'689 | 5'982'840 | 1.28 |
| | | | | 9'211'922 | 9'178'712 | 1.96 |
| CA | | | | | | |
| US064159KJ44 | BNS Float PERP | 200'000 | USD | 200'888 | 190'500 | 0.04 |
| | | | | 200'888 | 190'500 | 0.04 |
| CH | | | | | | |
| USH42097ES26 | UBS 9 1/4 PERP REGS | 3'000'000 | USD | 3'102'750 | 3'210'840 | 0.69 |
| USH42097ER43 | UBS 9 1/4 PERP REGS | 3'000'000 | USD | 3'031'000 | 3'285'360 | 0.70 |
| USH42097CS44 | UBS 4 7/8 PERP REGS | 9'000'000 | USD | 7'548'300 | 8'133'750 | 1.74 |
| USH42097CL90 | UBS 3 7/8 PERP REGS | 1'000'000 | USD | 875'500 | 894'340 | 0.19 |
| USH42097CB19 | UBS 4 3/8 PERP REGS | 1'000'000 | USD | 744'453 | 792'370 | 0.17 |
| CH0286864027 | UBS 6 7/8 PERP | 1'000'000 | USD | 977'916 | 989'640 | 0.21 |
| | | | | 16'279'919 | 17'306'300 | 3.70 |
| DE | | | | | | |
| USX10001AB51 | ALVGR 3.2 PERP REGS | 3'000'000 | USD | 2'292'950 | 2'406'690 | 0.51 |
| USX10001AA78 | ALVGR 3 1/2 PERP REGS | 16'800'000 | USD | 16'793'354 | 15'267'336 | 3.27 |
| DE000DL19WG7 | DB 6 3/4 PERP | 6'000'000 | EUR | 5'425'522 | 6'163'459 | 1.32 |
| DE000DL19VZ9 | DB 4 5/8 PERP | 4'000'000 | EUR | 3'089'146 | 3'592'222 | 0.77 |
| DE000DL19V55 | DB 4 1/2 PERP | 4'000'000 | EUR | 3'289'859 | 3'666'348 | 0.78 |
| DE000A30VT97 | DB 10 PERP | 5'000'000 | EUR | 5'159'185 | 5'857'267 | 1.25 |
| DE000A289FK7 | ALVGR 2 5/8 PERP | 3'000'000 | EUR | 2'457'841 | 2'576'982 | 0.55 |
| | | | | 38'507'857 | 39'530'305 | 8.45 |
| ES | | | | | | |
| XS2638924709 | BBVASM 8 3/8 PERP | 7'000'000 | EUR | 7'582'292 | 8'164'740 | 1.74 |

| ISIN Nummer | Bezeichnung | Stückzahl / Nennwert | Währung | Einstandswert | Marktwert | % des Netto- vermögens |
|--------------|----------------------------|-------------------------|---------|-------------------|-------------------|---------------------------|
| XS2471862040 | SABSM 9 3/8 PERP | 5'000'000 | EUR | 5'498'512 | 5'808'114 | 1.24 |
| XS2389116307 | SABSM 5 PERP | 3'000'000 | EUR | 3'484'938 | 2'890'799 | 0.62 |
| XS2388378981 | SANTAN 3 5/8 PERP | 2'000'000 | EUR | 2'197'180 | 1'662'416 | 0.36 |
| XS2342620924 | SANTAN 4 1/8 PERP EUR | 3'000'000 | EUR | 2'564'109 | 2'821'062 | 0.60 |
| XS2310945048 | SABSM 5 3/4 PERP | 1'000'000 | EUR | 938'052 | 1'032'707 | 0.22 |
| XS2102912966 | SANTAN 4 3/8 PERP | 7'000'000 | EUR | 7'023'126 | 7'000'760 | 1.50 |
| US05971KAQ22 | SANTAN 9 5/8 PERP _ | 6'000'000 | USD | 6'064'114 | 6'450'960 | 1.38 |
| US05971KAP49 | SANTAN 9 5/8 PERP | 5'000'000 | USD | 5'001'067 | 5'311'200 | 1.13 |
| US05946KAM36 | BBVASM 9 3/8 PERP | 8'000'000 | USD | 7'909'740 | 8'483'200 | 1.82 |
| ES0844251019 | CAZAR 9 1/8 PERP | 1'000'000 | EUR | 1'062'583 | 1'142'288 | 0.24 |
| ES0840609053 | CABKSM 7 1/2 PERP | 3'000'000 | EUR | 3'341'391 | 3'339'463 | 0.71 |
| ES0840609046 | CABKSM 8 1/4 PERP | 3'000'000 | EUR | 3'186'380 | 3'453'161 | 0.74 |
| ES0840609038 | CABKSM 3 5/8 PERP | 2'000'000 | EUR | 1'689'853 | 1'740'517 | 0.37 |
| ES0840609012 | CABKSM 5 1/4 PERP | 5'000'000 | EUR | 4'625'581 | 5'149'848 | 1.10 |
| ES0813211028 | BBVASM 6 PERP | 4'000'000 | EUR | 4'263'664 | 4'311'710 | 0.92 |
| | | | | 66'432'582 | 68'762'946 | 14.69 |
| | FR | | | | | |
| XS2737652474 | AXASA 6 3/8 PERP EMTN | 7'000'000 | EUR | 7'683'213 | 7'755'355 | 1.66 |
| XS2353099638 | ACAFP 7 1/2 PERP REGS | 2'000'000 | GBP | 2'450'048 | 2'523'494 | 0.54 |
| USF8600KAA46 | SOCGEN 10 PERP REGS | 5'000'000 | USD | 5'009'360 | 5'348'700 | 1.14 |
| USF8586CBQ45 | SOCGEN 6 3/4 PERP REGS | 4'000'000 | USD | 3'282'000 | 3'571'680 | 0.76 |
| USF8500RAC63 | SOCGEN 9 3/8 PERP REGS | 3'000'000 | USD | 3'104'809 | 3'118'650 | 0.67 |
| USF8500RAB80 | SOCGEN 4 3/4 PERP REGS | 4'000'000 | USD | 3'349'629 | 3'553'280 | 0.76 |
| USF8500RAA08 | SOCGEN 5 3/8 PERP REGS | 1'000'000 | USD | 757'267 | 814'310 | 0.17 |
| USF43628B413 | SOCGEN 8 PERP REGS | 1'000'000 | USD | 984'573 | 1'003'990 | 0.21 |
| USF2R125CJ25 | ACAFP 4 3/4 PERP REGS | 3'000'000 | USD | 2'518'200 | 2'566'530 | 0.55 |
| USF1R15XL357 | BNP 4 5/8 PERP REGS | 1'000'000 | USD | 722'000 | 808'870 | 0.17 |
| USF1R15XL274 | BNP 4 1/2 PERP REGS | 5'000'000 | USD | 3'517'000 | 4'012'900 | 0.86 |
| USF1R15XK854 | BNP 7 PERP REGS | 1'000'000 | USD | 904'225 | 974'520 | 0.21 |
| USF1067PAE63 | BNP 8 1/2 PERP REGS | 2'000'000 | USD | 1'977'333 | 2'076'560 | 0.44 |
| USF1067PAD80 | BNP 9 1/4 PERP REGS | 3'000'000 | USD | 3'162'593 | 3'201'000 | 0.68 |
| USF1067PAC08 | BNP 7 3/4 PERP REGS | 3'000'000 | USD | 2'945'250 | 3'041'070 | 0.65 |
| USF1067PAB25 | BNP 4 5/8 PERP REGS | 5'000'000 | USD | 4'170'001 | 4'443'000 | 0.95 |
| FR001400N2U2 | ACAFP 6 1/2 PERP | 4'000'000 | EUR | 4'368'672 | 4'372'800 | 0.93 |
| FR001400FB22 | BPCEGP 5 1/8 01/25/35 EMTN | 1'000'000 | EUR | 1'123'394 | 1'113'882 | 0.24 |
| FR001400F877 | SOCGEN 7 7/8 PERP EMTN | 2'000'000 | EUR | 2'152'496 | 2'235'846 | 0.48 |
| FR001400F2H9 | BNP 7 3/8 PERP | 3'000'000 | EUR | 3'193'027 | 3'429'991 | 0.73 |
| FR001400F067 | ACAFP 7 1/4 PERP EMTN | 1'000'000 | EUR | 1'134'636 | 1'137'291 | 0.24 |
| FR0014002RQ0 | CNPFP 4 7/8 PERP | 5'000'000 | USD | 4'594'525 | 4'073'250 | 0.87 |
| FR0013461795 | FRLBP 3 7/8 PERP | 1'000'000 | EUR | 1'204'657 | 987'247 | 0.21 |
| | | | | 64'308'908 | 66'164'218 | 14.12 |
| | GB | | | | | |
| XS2591803841 | BACR 9 1/4 PERP | 5'000'000 | GBP | 6'011'595 | 6'379'029 | 1.36 |
| XS2575900977 | LLOYDS 8 1/2 PERP | 4'000'000 | GBP | 4'892'601 | 5'118'301 | 1.09 |
| XS2529511722 | LLOYDS 8 1/2 PERP | 6'500'000 | GBP | 7'620'158 | 8'360'613 | 1.79 |
| XS2492482828 | BACR 8 7/8 PERP | 5'000'000 | GBP | 6'152'047 | 6'378'775 | 1.36 |
| XS2485268150 | AVLN 6 7/8 PERP | 7'000'000 | GBP | 7'797'532 | 8'307'810 | 1.77 |
| XS2315966742 | NWG 4 1/2 PERP | 1'000'000 | GBP | 888'562 | 1'071'328 | 0.23 |
| XS2258827034 | NWG 5 1/8 PERP | 2'000'000 | GBP | 2'037'533 | 2'300'029 | 0.49 |

| ISIN Nummer | Bezeichnung | Stückzahl / Nennwert | Währung | Einstandswert | Marktwert | % des Netto- vermögens |
|--------------|---------------------------|-------------------------|---------|--------------------|--------------------|---------------------------|
| XS2190956941 | LGEM 5 5/8 PERP | 6'500'000 | GBP | 10'118'301 | 7'261'537 | 1.55 |
| XS2113658202 | NWIDE 5 3/4 PERP | 7'000'000 | GBP | 8'796'673 | 8'250'848 | 1.76 |
| XS2048709427 | NWIDE 5 7/8 PERP | 3'000'000 | GBP | 4'110'246 | 3'752'844 | 0.80 |
| XS1884698256 | HSBC 5 7/8 PERP | 3'000'000 | GBP | 4'042'994 | 3'654'050 | 0.78 |
| USG84228FJ22 | STANLN 7 3/4 PERP REGs | 500'000 | USD | 468'900 | 508'970 | 0.11 |
| US780099CK11 | NWG 8 PERP | 5'000'000 | USD | 5'120'500 | 5'028'150 | 1.07 |
| US780097BQ34 | NWG 6 PERP | 9'000'000 | USD | 8'785'090 | 8'767'890 | 1.88 |
| US639057AD02 | NWG 4.6 PERP | 3'000'000 | USD | 2'097'400 | 2'281'440 | 0.49 |
| US53944YAJ29 | LLOYDS 6 3/4 PERP | 1'000'000 | USD | 928'450 | 978'040 | 0.21 |
| US539439AU36 | LLOYDS 7 1/2 PERP | 2'000'000 | USD | 2'187'795 | 1'960'860 | 0.42 |
| US404280DT33 | HSBC 8 PERP | 2'000'000 | USD | 1'964'075 | 2'082'780 | 0.44 |
| US404280CQ03 | HSBC 4.7 PERP | 2'000'000 | USD | 1'522'500 | 1'641'860 | 0.35 |
| US404280CP20 | HSBC 4 PERP | 4'000'000 | USD | 3'484'600 | 3'679'600 | 0.79 |
| US404280BP39 | HSBC 6 1/2 PERP | 4'000'000 | USD | 4'274'800 | 3'857'000 | 0.82 |
| US404280BL25 | HSBC 6 PERP | 4'000'000 | USD | 3'611'267 | 3'803'600 | 0.81 |
| US06738ECN31 | BACR 9 5/8 PERP | 5'000'000 | USD | 4'995'240 | 5'162'500 | 1.10 |
| | | | | 101'908'858 | 100'587'854 | 21.47 |
| | GR | | | | | |
| XS2747093321 | TPEIR 7 1/4 04/17/34 EMTN | 1'500'000 | EUR | 1'629'820 | 1'662'611 | 0.36 |
| | | | | 1'629'820 | 1'662'611 | 0.36 |
| | IT | | | | | |
| XS2678939427 | ISPIM 9 1/8 PERP | 7'000'000 | EUR | 7'625'521 | 8'396'882 | 1.79 |
| XS2463450408 | ISPIM 6 3/8 PERP | 7'000'000 | EUR | 6'515'374 | 7'344'145 | 1.57 |
| XS2356217039 | UCGIM 4.45 PERP EMTN | 7'000'000 | EUR | 5'900'502 | 6'785'270 | 1.45 |
| XS2223761813 | ISPIM 5 7/8 PERP EMTN | 1'000'000 | EUR | 900'675 | 997'751 | 0.21 |
| XS2124979753 | ISPIM 3 3/4 PERP | 2'000'000 | EUR | 1'976'376 | 2'060'439 | 0.44 |
| XS2105110329 | ISPIM 5 7/8 PERP EMTN | 2'000'000 | EUR | 2'065'169 | 2'159'287 | 0.46 |
| XS1963834251 | UCGIM 7 1/2 PERP | 3'000'000 | EUR | 3'939'354 | 3'344'319 | 0.71 |
| XS1739839998 | UCGIM 5 3/8 PERP | 2'000'000 | EUR | 2'004'002 | 2'124'962 | 0.45 |
| | | | | 30'926'971 | 33'213'057 | 7.08 |
| | JP | | | | | |
| US606822DD36 | MUFG 8.2 PERP | 2'200'000 | USD | 2'200'000 | 2'372'348 | 0.51 |
| | | | | 2'200'000 | 2'372'348 | 0.51 |
| | KY | | | | | |
| XS1802140894 | PHNXLN 5 3/4 PERP | 1'800'000 | GBP | 2'451'875 | 1'999'197 | 0.43 |
| | | | | 2'451'875 | 1'999'197 | 0.43 |
| | MX | | | | | |
| USP1401KAB72 | BANORT 6 5/8 PERP REGS | 5'000'000 | USD | 4'110'500 | 4'246'900 | 0.91 |
| USP1400MAC21 | BANORT 8 3/8 PERP REGS | 6'000'000 | USD | 6'379'280 | 5'923'800 | 1.27 |
| USP14008AE91 | BANORT 7 5/8 PERP REGS | 1'000'000 | USD | 953'500 | 965'070 | 0.21 |
| | | | | 11'443'280 | 11'135'770 | 2.39 |
| | NL | | | | | |
| XS2616652637 | NNGRNV 6 11/03/43 EMTN | 3'000'000 | EUR | 3'533'415 | 3'471'573 | 0.74 |
| XS2554581830 | ASRNED 7 12/07/43 | 3'000'000 | EUR | 3'361'424 | 3'694'406 | 0.79 |
| XS2456432413 | RABOBK 4 7/8 PERP | 10'000'000 | EUR | 9'816'391 | 9'968'390 | 2.14 |
| XS2202900424 | RABOBK 4 3/8 PERP | 4'000'000 | EUR | 4'096'806 | 4'080'860 | 0.87 |
| XS2131567138 | ABNANV 4 3/8 PERP | 5'000'000 | EUR | 4'975'897 | 5'225'994 | 1.12 |
| XS2122174415 | INTNED 4 7/8 PERP | 5'000'000 | USD | 4'133'060 | 4'225'850 | 0.90 |

| ISIN Nummer | Bezeichnung | Stückzahl / Nennwert | Währung | Einstandswert | Marktwert | % des Netto- vermögens |
|--------------|---|-------------------------|---------|-------------------|--------------------|---------------------------|
| XS2056490423 | ACHMEA 4 5/8 PERP | 1'000'000 | EUR | 1'270'291 | 959'429 | 0.20 |
| XS1886478806 | AEGON 5 5/8 PERP | 200'000 | EUR | 188'920 | 208'686 | 0.04 |
| XS1877860533 | RABOBK 4 5/8 PERP | 7'000'000 | EUR | 7'669'422 | 7'363'383 | 1.57 |
| XS1700709683 | ASRNED 4 5/8 PERP | 3'000'000 | EUR | 3'343'746 | 2'948'968 | 0.63 |
| XS1693822634 | ABNANV 4 3/4 PERP | 8'000'000 | EUR | 7'542'855 | 8'005'649 | 1.71 |
| US456837AZ69 | INTNED 4 1/4 PERP NC10 | 5'000'000 | USD | 3'306'757 | 3'713'500 | 0.79 |
| US456837AY94 | INTNED 3 7/8 PERP | 3'000'000 | USD | 2'175'125 | 2'467'830 | 0.53 |
| US456837AR44 | INTNED 5 3/4 PERP | 8'000'000 | USD | 7'039'742 | 7'547'120 | 1.61 |
| US456837AF06 | INTNED 6 1/2 PERP | 3'000'000 | USD | 2'866'530 | 2'940'930 | 0.63 |
| | | | | 65'320'382 | 66'822'567 | 14.27 |
| | TH | | | | | |
| XS2242131071 | KBANK 5.275 PERP EMTN | 1'000'000 | USD | 1'048'000 | 976'060 | 0.21 |
| USY06072AD75 | BBLTB 5 PERP REGS | 1'000'000 | USD | 1'038'188 | 973'370 | 0.21 |
| | | | | 2'086'188 | 1'949'430 | 0.42 |
| | US | | | | | |
| US172967HQ76 | C 6.3 PERP M | 200'000 | USD | 214'000 | 199'122 | 0.04 |
| | | | | 214'000 | 199'122 | 0.04 |
| | Summe - Anleihen | | | | 447'140'983 | |
| | Summe - Amtlich notierte sowie an anderen geregelten Märkten gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | | | | 447'140'983 | |
| | SUMME DES WERTPAPIERBESTANDES | | | | 447'140'983 | 95.51 |

8 Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Corporate Hybrid

Wertpapierbestand zum 31.01.2024 (Angaben in USD)

| ISIN Nummer | Bezeichnung | Stückzahl / Nennwert | Währung | Einstandswert | Marktwert | % des Netto- vermögens |
|---|-----------------------------|-------------------------|---------|-------------------|-------------------|---------------------------|
| Amtlich notierte sowie an anderen geregelten Märkten gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | | | | | | |
| Anleihen | | | | | | |
| AT | | | | | | |
| XS2224439385 | OMVAV 2 1/2 PERP | 3'500'000 | EUR | 3'351'125 | 3'324'790 | 2.63 |
| | | | | 3'351'125 | 3'324'790 | 2.63 |
| AU | | | | | | |
| XS2711801287 | APAAU 7 1/8 11/09/2083 eMTN | 1'200'000 | EUR | 1'194'192 | 1'287'636 | 1.02 |
| XS2308313860 | ANVAU 1 5/8 03/11/2081 EMTN | 4'000'000 | EUR | 3'468'650 | 3'678'720 | 2.91 |
| | | | | 4'662'842 | 4'966'356 | 3.93 |
| BE | | | | | | |
| BE6342251038 | ELIASO 5.85 PERP | 1'000'000 | EUR | 999'210 | 1'031'070 | 0.82 |
| | | | | 999'210 | 1'031'070 | 0.82 |
| CA | | | | | | |
| US29250NAS45 | ENBCN 5 1/2 07/15/2077 | 1'500'000 | USD | 1'411'921 | 1'288'642 | 1.02 |
| | | | | 1'411'921 | 1'288'642 | 1.02 |
| DE | | | | | | |
| XS2751678272 | ENBW 5 1/4 01/23/2084 | 1'000'000 | EUR | 1'000'000 | 1'016'960 | 0.80 |
| XS2381277008 | ENBW 2 1/8 08/31/2081 | 2'500'000 | EUR | 1'692'500 | 1'995'625 | 1.58 |
| XS2381272207 | ENBW 1 3/8 08/31/2081 | 1'900'000 | EUR | 1'900'000 | 1'643'994 | 1.30 |
| XS2056730323 | IFXGR 2 7/8 PERP EMTN | 1'000'000 | EUR | 1'058'700 | 979'130 | 0.78 |
| XS2011260705 | MRKGR 2 7/8 06/25/2079 | 2'000'000 | EUR | 2'234'000 | 1'858'680 | 1.47 |
| XS2010039548 | DBHNGR 1.6 PERP CB | 2'500'000 | EUR | 2'406'845 | 2'141'750 | 1.70 |
| XS1222594472 | BERTEL 3 1/2 04/23/2075 | 1'000'000 | EUR | 1'108'750 | 961'060 | 0.76 |
| DE000A3E5WW4 | EVKGR 1 3/8 09/02/2081 | 1'000'000 | EUR | 918'750 | 902'060 | 0.71 |
| | | | | 12'319'545 | 11'499'259 | 9.10 |
| DK | | | | | | |
| XS2563353361 | ORSTED 5 1/4 12/08/3022 | 1'000'000 | EUR | 1'000'000 | 1'013'750 | 0.80 |
| XS2010036874 | ORSTED 1 3/4 12/09/3019 | 2'000'000 | EUR | 1'967'740 | 1'797'580 | 1.42 |
| | | | | 2'967'740 | 2'811'330 | 2.22 |
| ES | | | | | | |
| XS2552369469 | REESM 4 5/8 PERP | 1'600'000 | EUR | 1'594'720 | 1'639'344 | 1.30 |
| XS2405855375 | IBESM 1.575 PERP | 1'500'000 | EUR | 1'500'000 | 1'352'940 | 1.07 |
| | | | | 3'094'720 | 2'992'284 | 2.37 |
| FR | | | | | | |
| XS2432130610 | TTEFP 2 PERP | 4'000'000 | EUR | 3'861'250 | 3'727'880 | 2.95 |
| XS2290960520 | TTEFP 1 5/8 PERP NC7 | 3'000'000 | EUR | 3'069'240 | 2'712'510 | 2.15 |
| USF2941JAA81 | EDF 9 1/8 PERP REGS | 900'000 | USD | 835'614 | 928'164 | 0.73 |
| FR001400KKC3 | VIEFP 5.993 PERP | 500'000 | EUR | 500'000 | 527'010 | 0.42 |
| FR001400IU83 | URWFP 7 1/4 PERP | 2'200'000 | EUR | 2'227'500 | 2'275'152 | 1.80 |
| FR001400GDJ1 | ORAFP 5 3/8 PERP EMTN | 1'100'000 | EUR | 1'092'190 | 1'156'111 | 0.92 |
| FR001400EFQ6 | EDF 7 1/2 PERP EMTN | 1'600'000 | EUR | 1'600'000 | 1'748'112 | 1.38 |
| FR00140046Y4 | ENGIFP 1 7/8 PERP | 3'000'000 | EUR | 2'495'400 | 2'503'740 | 1.98 |
| FR00140007L3 | VIEFP 2 1/2 PERP | 2'000'000 | EUR | 2'006'050 | 1'798'380 | 1.42 |

| ISIN Nummer | Bezeichnung | Stückzahl / Nennwert | Währung | Einstandswert | Marktwert | % des Netto- vermögens |
|--------------|------------------------------|-------------------------|---------|-------------------|-------------------|---------------------------|
| FR00140005L7 | ORAFP 1 3/4 PERP emtn | 3'000'000 | EUR | 2'909'880 | 2'680'320 | 2.12 |
| FR0013478252 | AKEFF 1 1/2 PERP | 1'500'000 | EUR | 1'339'688 | 1'411'965 | 1.12 |
| FR0013331949 | FRPTT 3 1/8 PERP | 2'000'000 | EUR | 2'134'000 | 1'932'380 | 1.53 |
| FR0013330537 | URWFP 2 7/8 PERP | 1'500'000 | EUR | 1'246'000 | 1'396'290 | 1.11 |
| | | | | 25'316'812 | 24'798'014 | 19.63 |
| GB | | | | | | |
| XS2636324274 | BRITEL 8 3/8 12/20/2083 EMTN | 1'400'000 | GBP | 1'626'249 | 1'759'822 | 1.39 |
| XS2630493570 | VOD 8 08/30/2086 EMTN | 1'750'000 | GBP | 1'997'094 | 2'216'088 | 1.75 |
| XS2195190876 | SSELN 3.74 PERP | 2'000'000 | GBP | 2'429'185 | 2'231'030 | 1.77 |
| XS2193662728 | BPLN 3 5/8 PERP | 4'000'000 | EUR | 3'575'500 | 3'772'600 | 2.99 |
| XS0903532090 | NGGLN 5 5/8 06/18/2073 GBP | 1'000'000 | GBP | 1'322'762 | 1'159'290 | 0.92 |
| US92857WBQ24 | VOD 7 04/04/2079 | 1'000'000 | USD | 929'512 | 951'670 | 0.75 |
| US05565QDV77 | BPLN 4 7/8 PERP | 2'000'000 | USD | 1'731'288 | 1'747'796 | 1.38 |
| | | | | 13'611'590 | 13'838'297 | 10.95 |
| IT | | | | | | |
| XS2576550086 | ENELIM 6 3/8 PERP EMTN | 1'000'000 | EUR | 1'000'000 | 1'062'880 | 0.84 |
| XS2437854487 | TRNIM 2 3/8 PERP | 2'000'000 | EUR | 1'991'720 | 1'838'020 | 1.45 |
| XS2353073161 | POSIM 2 5/8 PERP | 2'000'000 | EUR | 1'999'000 | 1'687'360 | 1.34 |
| XS2334852253 | ENIIM 2 PERP NC6 | 2'000'000 | EUR | 2'048'150 | 1'842'700 | 1.46 |
| XS2312746345 | ENELIM 1 7/8 PERP 95Y | 2'000'000 | EUR | 1'515'000 | 1'638'340 | 1.30 |
| XS2312744217 | ENELIM 1 3/8 PERP 65Y | 1'000'000 | EUR | 915'763 | 892'890 | 0.71 |
| XS2242931603 | ENIIM 3 3/8 PERP NC9 | 1'500'000 | EUR | 1'548'450 | 1'387'485 | 1.10 |
| | | | | 11'018'083 | 10'349'675 | 8.20 |
| LU | | | | | | |
| XS2287744721 | ARNDTN 1 5/8 PERP EMTN | 4'000'000 | EUR | 1'446'000 | 1'609'120 | 1.27 |
| XS2271225281 | GYCGR 1 1/2 PERP EMTN | 4'000'000 | EUR | 2'409'975 | 2'163'160 | 1.71 |
| XS2027946610 | ARNDTN 2 7/8 PERP EMTN | 1'000'000 | EUR | 395'000 | 445'870 | 0.35 |
| XS2010028343 | SESGFP 2 7/8 PERP | 500'000 | EUR | 427'500 | 467'850 | 0.37 |
| | | | | 4'678'475 | 4'686'000 | 3.70 |
| MX | | | | | | |
| USP2253TJT71 | CEMEX 9 1/8 PERP REGS | 500'000 | USD | 473'082 | 489'718 | 0.39 |
| | | | | 473'082 | 489'718 | 0.39 |
| NL | | | | | | |
| XS2462605671 | TELEFO 7 1/8 PERP | 1'500'000 | EUR | 1'500'000 | 1'631'190 | 1.29 |
| XS2410367747 | TELEFO 2.88 PERP | 1'800'000 | EUR | 1'800'000 | 1'671'372 | 1.32 |
| XS2388141892 | ADENVX 1 03/21/2082 | 2'500'000 | EUR | 2'275'085 | 2'168'475 | 1.72 |
| XS2342732646 | VW 4 3/8 PERP | 1'000'000 | EUR | 880'500 | 912'730 | 0.72 |
| XS2320533131 | REPSM 2 1/2 PERP | 1'500'000 | EUR | 1'299'375 | 1'407'855 | 1.11 |
| XS2314246526 | STEDIN 1 1/2 PERP | 1'000'000 | EUR | 851'700 | 908'400 | 0.72 |
| XS2295335413 | IBESM 1.45 PERP NC6 | 1'500'000 | EUR | 1'464'090 | 1'381'995 | 1.09 |
| XS2295333988 | IBESM 1.825 PERP NC9 | 1'000'000 | EUR | 710'000 | 862'830 | 0.68 |
| XS2282606578 | ABESM 2 5/8 PERP | 1'500'000 | EUR | 1'366'875 | 1'394'700 | 1.10 |
| XS2238783778 | JAPTOB 2 7/8 10/07/2083 | 2'000'000 | EUR | 1'785'000 | 1'877'000 | 1.49 |
| XS2207430120 | TENN 2.374 PERP | 1'000'000 | EUR | 935'950 | 969'670 | 0.77 |
| XS2187689380 | VW 3 7/8 PERP | 1'000'000 | EUR | 893'500 | 917'910 | 0.73 |
| XS2186001314 | REPSM 4.247 PERP | 1'000'000 | EUR | 908'500 | 972'410 | 0.77 |
| XS2182055009 | FIRMEN 3 3/4 PERP | 3'000'000 | EUR | 3'270'000 | 2'950'830 | 2.34 |
| | | | | 19'940'575 | 20'027'367 | 15.85 |

| ISIN Nummer | Bezeichnung | Stückzahl / Nennwert | Währung | Einstandswert | Marktwert | % des Netto- vermögens |
|---|-----------------------------|-------------------------|---------|------------------|--------------------|---------------------------|
| NO | | | | | | |
| XS2708134023 | VARNO 7.862 11/15/2083 | 2'000'000 | EUR | 2'056'400 | 2'139'760 | 1.69 |
| | | | | 2'056'400 | 2'139'760 | 1.69 |
| PT | | | | | | |
| PTEDPYOM0020 | EDPPL 1 7/8 03/14/2082 NC8 | 2'300'000 | EUR | 2'131'837 | 1'953'022 | 1.55 |
| PTEDP4OM0025 | EDPPL 5.943 04/23/2083 EMTN | 1'000'000 | EUR | 1'000'000 | 1'042'730 | 0.83 |
| | | | | 3'131'837 | 2'995'752 | 2.38 |
| SE | | | | | | |
| XS2526881532 | TELIAS 4 5/8 12/21/2082 | 3'000'000 | EUR | 2'950'180 | 3'018'210 | 2.39 |
| XS2355631693 | VATFAL 2 1/2 06/29/2083 | 700'000 | GBP | 652'176 | 700'126 | 0.55 |
| XS1205618470 | VATFAL 3 03/19/2077 | 2'000'000 | EUR | 2'182'500 | 1'915'160 | 1.52 |
| | | | | 5'784'856 | 5'633'496 | 4.46 |
| US | | | | | | |
| XS2114413565 | T 2 7/8 PERP B | 2'000'000 | EUR | 2'037'500 | 1'951'380 | 1.54 |
| US65339KCB44 | NEE 3.8 03/15/2082 | 2'000'000 | USD | 1'772'186 | 1'616'205 | 1.28 |
| US37045XDB91 | GM 5.7 PERP C | 2'500'000 | USD | 2'010'201 | 2'122'328 | 1.68 |
| US29379VBN29 | EPD 5 1/4 08/16/2077 E | 1'000'000 | USD | 815'226 | 890'653 | 0.70 |
| | | | | 6'635'113 | 6'580'566 | 5.20 |
| VG | | | | | | |
| XS2123115029 | HYSAN 4.1 PERP | 1'500'000 | USD | 1'179'510 | 1'182'548 | 0.94 |
| | | | | 1'179'510 | 1'182'548 | 0.94 |
| Summe - Anleihen | | | | | 120'634'923 | |
| Summe - Amtlich notierte sowie an anderen geregelten Märkten gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | | | | | 120'634'923 | |
| SUMME DES WERTPAPIERBESTANDES | | | | | 120'634'923 | 95.48 |

9 Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Emerging Markets Opportunities

Wertpapierbestand zum 31.01.2024 (Angaben in USD)

| ISIN Nummer | Bezeichnung | Stückzahl / Nennwert | Währung | Einstandswert | Marktwert | % des Netto- vermögens |
|---|----------------------------|-------------------------|---------|-------------------|-------------------|---------------------------|
| Amtlich notierte sowie an anderen geregelten Märkten gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | | | | | | |
| Anleihen | | | | | | |
| AO | | | | | | |
| XS2083302419 | ANGOL 8 11/26/29 REGS | 5'300'000 | USD | 4'528'350 | 4'627'377 | 1.01 |
| | | | | 4'528'350 | 4'627'377 | 1.01 |
| AR | | | | | | |
| US040114HW38 | ARGENT 3 5/8 07/09/46 | 10'100'000 | USD | 3'078'030 | 3'454'604 | 0.76 |
| | | | | 3'078'030 | 3'454'604 | 0.76 |
| BR | | | | | | |
| US105756CE88 | BRAZIL 3 3/4 09/12/31 | 5'920'000 | USD | 5'054'570 | 5'214'277 | 1.14 |
| US105756CB40 | BRAZIL 4 3/4 01/14/50 | 1'920'000 | USD | 1'778'022 | 1'421'472 | 0.31 |
| BRSTNCNTF1Q6 | BNTNF 10 01/01/29 NTNFB | 97'200 | BRL | 18'081'479 | 19'511'309 | 4.27 |
| BRSTNCNTF170 | BNTNF 10 01/01/25 NTNFB | 45'230 | BRL | 8'744'643 | 9'153'667 | 2.00 |
| BRSTNCNTB3D4 | BNTNB 6 08/15/50 NTNFB | 1'250 | BRL | 961'624 | 1'114'185 | 0.24 |
| | | | | 34'620'338 | 36'414'911 | 7.96 |
| CI | | | | | | |
| XS2264871828 | IVYCST 4 7/8 01/30/32 REGS | 7'965'000 | EUR | 7'459'443 | 7'277'082 | 1.59 |
| | | | | 7'459'443 | 7'277'082 | 1.59 |
| CL | | | | | | |
| US168863DL94 | CHILE 3 1/2 01/25/50 | 10'580'000 | USD | 8'211'970 | 7'844'647 | 1.72 |
| CL0002599166 | BTPCL 2 1/2 03/01/25 | 7'300'000'000 | CLP | 1'901'515 | 1'796'844 | 0.39 |
| | | | | 10'113'485 | 9'641'491 | 2.11 |
| CN | | | | | | |
| CND100045210 | CGB 3.03 03/11/26 INBK | 7'500'000 | CNY | 1'153'781 | 1'066'197 | 0.23 |
| CND10003N750 | CGB 3.81 09/14/50 INBK | 7'000'000 | CNY | 1'126'047 | 1'179'843 | 0.26 |
| CND100031JZ0 | CGB 1.99 04/09/25 INBK | 48'670'000 | CNY | 7'092'376 | 6'778'602 | 1.48 |
| CND10002M200 | CGB 3.39 03/16/50 INBK | 3'500'000 | CNY | 476'281 | 550'026 | 0.12 |
| CND10002HV84 | CGB 3.13 11/21/29 1915 | 36'800'000 | CNY | 5'455'732 | 5'348'791 | 1.17 |
| | | | | 15'304'216 | 14'923'460 | 3.26 |
| CO | | | | | | |
| US195325EG61 | COLOM 7 1/2 02/02/34 | 3'850'000 | USD | 3'746'960 | 3'949'292 | 0.86 |
| US195325EA91 | COLOM 4 1/8 02/22/42 | 1'300'000 | USD | 845'000 | 883'974 | 0.19 |
| US195325DP79 | COLOM 4 1/2 03/15/29 | 5'990'000 | USD | 5'881'442 | 5'537'755 | 1.21 |
| US195325CU73 | COLOM 5 06/15/45 | 2'000'000 | USD | 1'324'500 | 1'462'080 | 0.32 |
| COL17CT03490 | COLTES 7 06/30/32 B | 550'000'000 | COP | 5'633'004 | 6'978'909 | 1.53 |
| COL17CT02914 | COLTES 6 04/28/28 B | 800'000'000 | COP | 3'820'140 | 3'940'357 | 0.86 |
| | | | | 21'251'047 | 22'752'367 | 4.97 |
| CR | | | | | | |
| USP3699PGK77 | COSTAR 6 1/8 02/19/31 REGS | 3'425'000 | USD | 3'313'340 | 3'478'396 | 0.76 |
| USP3699PGJ05 | COSTAR 7.158 03/12/45 REGS | 2'430'000 | USD | 2'365'212 | 2'508'392 | 0.55 |
| | | | | 5'678'552 | 5'986'788 | 1.31 |
| CZ | | | | | | |
| CZ0001006233 | CZGB 1 3/4 06/23/32 138 | 172'900'000 | CZK | 5'966'052 | 6'503'728 | 1.42 |

| ISIN Nummer | Bezeichnung | Stückzahl / Nennwert | Währung | Einstandswert | Marktwert | % des Netto- vermögens |
|--------------|----------------------------|-------------------------|---------|-------------------|-------------------|---------------------------|
| CZ0001005870 | CZGB 1 1/4 02/14/25 120 | 180'000'000 | CZK | 7'545'992 | 7'610'669 | 1.67 |
| | | | | 13'512'045 | 14'114'397 | 3.09 |
| | DE | | | | | |
| DE000BU0E048 | BUBILL 0 04/17/24 | 8'000'000 | EUR | 8'650'384 | 8'623'767 | 1.89 |
| | | | | 8'650'384 | 8'623'767 | 1.89 |
| | DO | | | | | |
| USP3579ECH82 | DOMREP 4 7/8 09/23/32 REGS | 9'570'000 | USD | 8'276'195 | 8'558'547 | 1.87 |
| USP3579EBK21 | DOMREP 6 7/8 01/29/26 REGS | 2'375'000 | USD | 2'692'590 | 2'417'251 | 0.53 |
| USP3579EAY34 | DOMREP 7.45 04/30/44 REGS | 510'000 | USD | 594'285 | 532'445 | 0.12 |
| | | | | 11'563'070 | 11'508'243 | 2.52 |
| | EC | | | | | |
| XS2214239506 | ECUA 0 07/31/30 REGS | 20'290 | USD | 10'551 | 6'787 | 0.00 |
| XS2214239175 | ECUA 2 1/2 07/31/40 REGS | 113'500 | USD | 59'023 | 42'120 | 0.01 |
| XS2214238441 | ECUA 3 1/2 07/31/35 REGS | 4'677'650 | USD | 2'230'339 | 1'918'445 | 0.42 |
| XS2214237807 | ECUA 6 07/31/30 REGS | 5'594'500 | USD | 4'507'770 | 2'937'001 | 0.64 |
| | | | | 6'807'684 | 4'904'352 | 1.07 |
| | EG | | | | | |
| XS1775617464 | EGYPT 7.903 02/21/48 REGS | 9'800'000 | USD | 6'743'418 | 5'847'954 | 1.28 |
| EGBGR03071F0 | EGYGB 14.06 01/12/26 5YR | 8'000'000 | EGP | 505'816 | 214'097 | 0.05 |
| | | | | 7'249'234 | 6'062'051 | 1.33 |
| | GA | | | | | |
| XS2113615228 | GABON 6 5/8 02/06/31 REGS | 2'900'000 | USD | 2'308'820 | 2'377'275 | 0.52 |
| | | | | 2'308'820 | 2'377'275 | 0.52 |
| | GH | | | | | |
| XS2115122538 | GHANA 6 3/8 02/11/27 REGS | 2'970'000 | USD | 2'472'431 | 1'349'330 | 0.30 |
| XS1821416408 | GHANA 8.627 06/16/49 REGS | 4'690'000 | USD | 2'625'824 | 2'051'781 | 0.45 |
| | | | | 5'098'255 | 3'401'112 | 0.75 |
| | GT | | | | | |
| USP5015VAM83 | GUATEM 3.7 10/07/33 REGS | 3'400'000 | USD | 2'911'990 | 2'805'782 | 0.61 |
| USP5015VAE67 | GUATEM 4 7/8 02/13/28 REGS | 1'330'000 | USD | 1'369'550 | 1'288'398 | 0.28 |
| | | | | 4'281'540 | 4'094'180 | 0.89 |
| | HN | | | | | |
| USP5178RAC27 | HONDUR 6 1/4 01/19/27 REGS | 820'000 | USD | 893'762 | 782'034 | 0.17 |
| | | | | 893'762 | 782'034 | 0.17 |
| | HU | | | | | |
| XS2010026487 | REPHUN 5 1/2 06/16/34 REGS | 3'950'000 | USD | 3'902'848 | 3'921'086 | 0.86 |
| | | | | 3'902'848 | 3'921'086 | 0.86 |
| | ID | | | | | |
| XS1432493440 | INDON 3 3/4 06/14/28 REGS | 420'000 | EUR | 539'096 | 459'012 | 0.10 |
| USY20721BN86 | INDON 4 3/4 01/08/26 REGS | 1'220'000 | USD | 1'250'490 | 1'220'537 | 0.27 |
| US455780DR40 | INDON 4.85 01/11/33 | 1'600'000 | USD | 1'610'000 | 1'604'336 | 0.35 |
| US455780CE46 | INDON 4.35 01/11/48 | 7'750'000 | USD | 7'685'806 | 6'788'148 | 1.49 |
| US455780CD62 | INDON 3 1/2 01/11/28 | 5'920'000 | USD | 5'947'845 | 5'652'179 | 1.24 |
| IDG000020801 | INDOGB 7 02/15/33 FR96 | '200'000'000 | IDR | 4'222'788 | 4'207'573 | 0.92 |
| IDG000013806 | INDOGB 7 09/15/30 FR82 | '200'000'000 | IDR | 12'768'508 | 12'153'741 | 2.66 |
| IDG000010307 | INDOGB 6 1/8 05/15/28 FR64 | '630'000'000 | IDR | 8'094'153 | 7'343'394 | 1.61 |
| | | | | 42'118'686 | 39'428'920 | 8.64 |

| ISIN Nummer | Bezeichnung | Stückzahl / Nennwert | Währung | Einstandswert | Marktwert | % des Netto- vermögens |
|--------------|----------------------------|-------------------------|---------|-------------------|-------------------|---------------------------|
| JM | | | | | | |
| US470160CA80 | JAMAN 6 3/4 04/28/28 | 620'000 | USD | 682'190 | 649'010 | 0.14 |
| | | | | 682'190 | 649'010 | 0.14 |
| KE | | | | | | |
| XS1781710543 | KENINT 7 1/4 02/28/28 REGS | 670'000 | USD | 669'688 | 602'236 | 0.13 |
| | | | | 669'688 | 602'236 | 0.13 |
| KZ | | | | | | |
| XS1682544157 | KZTGKZ 4 3/8 09/26/27 REGS | 670'000 | USD | 741'910 | 640'024 | 0.14 |
| XS1263139856 | KAZAKS 6 1/2 07/21/45 REGS | 320'000 | USD | 479'040 | 354'051 | 0.08 |
| | | | | 1'220'950 | 994'075 | 0.22 |
| MA | | | | | | |
| XS2080771806 | MOROC 1 1/2 11/27/31 REGS | 930'000 | EUR | 892'569 | 811'725 | 0.18 |
| | | | | 892'569 | 811'725 | 0.18 |
| MX | | | | | | |
| US91087BAM28 | MEX 2.659 05/24/31 | 10'410'000 | USD | 9'028'645 | 8'772'299 | 1.92 |
| US91086QAZ19 | MEX 5 3/4 10/12/2110 GMTN | 7'620'000 | USD | 7'024'956 | 6'741'338 | 1.47 |
| MX0SGO0000F0 | MUDI 4 11/30/28 S | 8'000 | MXN | 317'693 | 365'279 | 0.08 |
| MX0MGO0000P2 | MBONO 7 3/4 05/29/31 M | 3'451'900 | MXN | 17'330'270 | 18'610'576 | 4.07 |
| MX0MGO0000J5 | MBONO 8 1/2 11/18/38 M | 342'000 | MXN | 1'839'754 | 1'869'964 | 0.41 |
| MX0MGO0000H9 | MBONO 8 1/2 05/31/29 M | 1'435'600 | MXN | 7'528'992 | 8'145'195 | 1.78 |
| | | | | 43'070'311 | 44'504'650 | 9.73 |
| MY | | | | | | |
| USY6886MAC48 | PETMK 3.404 04/28/61 REGS | 1'200'000 | USD | 955'500 | 824'976 | 0.18 |
| MYBMO2200016 | MGS 3.582 07/15/32 0122 | 35'400'000 | MYR | 7'532'417 | 7'360'057 | 1.61 |
| MYBMO2000028 | MGS 2.632 04/15/31 0220 | 74'350'000 | MYR | 15'166'935 | 14'645'535 | 3.20 |
| | | | | 23'654'852 | 22'830'568 | 4.99 |
| NL | | | | | | |
| US71647NBJ72 | PETBRA 5 1/2 06/10/51 | 300'000 | USD | 304'200 | 248'430 | 0.05 |
| US71647NBH17 | PETBRA 5.6 01/03/31 | 1'000'000 | USD | 1'094'563 | 973'750 | 0.21 |
| | | | | 1'398'763 | 1'222'180 | 0.26 |
| OM | | | | | | |
| XS2288905370 | OMAN 6 1/4 01/25/31 REGS | 9'600'000 | USD | 10'036'368 | 9'954'048 | 2.18 |
| XS1750113661 | OMAN 5 5/8 01/17/28 REGS | 1'510'000 | USD | 1'456'301 | 1'526'142 | 0.33 |
| XS1575968026 | OMAN 6 1/2 03/08/47 REGS | 2'100'000 | USD | 2'017'285 | 2'076'018 | 0.45 |
| | | | | 13'509'953 | 13'556'208 | 2.96 |
| PA | | | | | | |
| US698299BL70 | PANAMA 3.87 07/23/60 | 6'050'000 | USD | 3'779'355 | 3'410'325 | 0.75 |
| | | | | 3'779'355 | 3'410'325 | 0.75 |
| PE | | | | | | |
| US715638BU55 | PERU 4 1/8 08/25/27 | 1'320'000 | USD | 1'416'570 | 1'292'782 | 0.28 |
| US715638BM30 | PERU 5 5/8 11/18/50 | 610'000 | USD | 942'080 | 616'381 | 0.13 |
| US715638BE14 | PERU 6.95 08/12/31 REGS | 13'498'000 | PEN | 3'920'958 | 3'706'006 | 0.81 |
| | | | | 6'279'608 | 5'615'168 | 1.22 |
| PH | | | | | | |
| US718286CW51 | PHILIP 5 07/17/33 | 1'800'000 | USD | 1'821'582 | 1'825'902 | 0.40 |
| US718286CL96 | PHILIP 2.65 12/10/45 | 2'700'000 | USD | 2'191'594 | 1'807'677 | 0.40 |
| US718286CB15 | PHILIP 3.7 02/02/42 | 510'000 | USD | 591'972 | 419'164 | 0.09 |

| ISIN Nummer | Bezeichnung | Stückzahl / Nennwert | Währung | Einstandswert | Marktwert | % des Netto- vermögens |
|--------------|----------------------------|-------------------------|---------|-------------------|-------------------|---------------------------|
| US718286BN61 | PHILIP 5 1/2 03/30/26 | 4'220'000 | USD | 4'494'960 | 4'290'221 | 0.94 |
| | | | | 9'100'108 | 8'342'964 | 1.83 |
| | PL | | | | | |
| PL0000114393 | POLGB 3 3/4 05/25/27 0527 | 22'850'000 | PLN | 4'516'744 | 5'547'057 | 1.21 |
| PL0000112736 | POLGB 1 1/4 10/25/30 1030 | 67'100'000 | PLN | 11'650'045 | 13'328'865 | 2.92 |
| | | | | 16'166'789 | 18'875'921 | 4.13 |
| | PY | | | | | |
| USP75744AL92 | PARGUY 3.849 06/28/33 REGS | 3'500'000 | USD | 3'102'340 | 3'044'615 | 0.67 |
| USP75744AJ47 | PARGUY 4.95 04/28/31 REGS | 1'470'000 | USD | 1'632'180 | 1'419'888 | 0.31 |
| USP75744AD76 | PARGUY 5 04/15/26 REGS | 210'000 | USD | 231'819 | 209'462 | 0.05 |
| | | | | 4'966'339 | 4'673'965 | 1.03 |
| | RO | | | | | |
| XS2330503694 | ROMANI 2 04/14/33 REGS | 5'040'000 | EUR | 3'798'403 | 4'164'871 | 0.91 |
| | | | | 3'798'403 | 4'164'871 | 0.91 |
| | RS | | | | | |
| XS2015296465 | SERBIA 1 1/2 06/26/29 REGS | 5'100'000 | EUR | 4'361'178 | 4'665'121 | 1.02 |
| | | | | 4'361'178 | 4'665'121 | 1.02 |
| | RU | | | | | |
| RU000A1006S9 | RUSSIA 5.1 03/28/35 REGS | 200'000 | USD | 249'500 | 0 | 0.00 |
| RU000A0ZYYN4 | RUSSIA 4 3/8 03/21/29 REGS | 600'000 | USD | 689'040 | 0 | 0.00 |
| RU000A0ZYUA9 | RFLB 6.9 05/23/29 6224 | 42'320'000 | RUB | 671'745 | 47 | 0.00 |
| RU000A0JWM07 | RFLB 7 3/4 09/16/26 6219 | 168'260'000 | RUB | 2'520'401 | 187 | 0.00 |
| | | | | 4'130'685 | 235 | 0.00 |
| | SA | | | | | |
| XS2159975700 | KSA 3 1/4 10/22/30 REGS | 5'380'000 | USD | 4'994'608 | 4'911'294 | 1.07 |
| XS1936302949 | KSA 5 1/4 01/16/50 REGS | 7'740'000 | USD | 8'501'690 | 7'286'823 | 1.59 |
| | | | | 13'496'298 | 12'198'117 | 2.66 |
| | SN | | | | | |
| XS2333676133 | SENEGL 5 3/8 06/08/37 REGS | 2'200'000 | EUR | 1'666'841 | 1'731'729 | 0.38 |
| | | | | 1'666'841 | 1'731'729 | 0.38 |
| | SV | | | | | |
| USP01012CC84 | ELSALV 9 1/2 07/15/52 REGS | 300'000 | USD | 300'000 | 256'779 | 0.06 |
| USP01012AT38 | ELSALV 6 3/8 01/18/27 REGS | 1'020'000 | USD | 530'290 | 912'115 | 0.20 |
| | | | | 830'290 | 1'168'894 | 0.26 |
| | TH | | | | | |
| TH0623A3H605 | THAIGB 3.39 06/17/37 | 273'200'000 | THB | 8'755'848 | 8'164'697 | 1.79 |
| TH0623A38308 | THAIGB 1 1/4 03/12/28 ILB | 89'230'000 | THB | 2'800'211 | 2'681'532 | 0.59 |
| TH0623038609 | THAIGB 2.65 06/17/28 | 120'300'000 | THB | 3'523'810 | 3'434'929 | 0.75 |
| TH0623034905 | THAIGB 0 3/4 09/17/24 | 90'200'000 | THB | 2'474'338 | 2'518'176 | 0.55 |
| TH0623034608 | THAIGB 0 3/4 06/17/24 | 174'500'000 | THB | 5'170'018 | 4'889'788 | 1.07 |
| | | | | 22'724'225 | 21'689'122 | 4.75 |
| | TT | | | | | |
| USP93960AG08 | TRITOB 4 1/2 08/04/26 REGS | 1'410'000 | USD | 1'444'499 | 1'379'882 | 0.30 |
| | | | | 1'444'499 | 1'379'882 | 0.30 |
| | UA | | | | | |
| XS2010030836 | UKRAIN 7.253 03/15/35 REGS | 300'000 | USD | 300'000 | 69'474 | 0.02 |
| XS1577952952 | UKRAIN 7 3/8 09/25/34 REGS | 5'140'000 | USD | 2'655'050 | 1'188'214 | 0.26 |

| ISIN Nummer | Bezeichnung | Stückzahl / Nennwert | Währung | Einstandswert | Marktwert | % des Netto- vermögens |
|--------------|---|-------------------------|---------|-------------------|--------------------|---------------------------|
| XS1303926528 | UKRAIN 7 3/4 09/01/28 REGS | 3'770'000 | USD | 3'008'276 | 975'563 | 0.21 |
| | | | | 5'963'326 | 2'233'251 | 0.49 |
| | US | | | | | |
| US91282CHX20 | T 4 3/8 08/31/28 | 2'000'000 | USD | 1'996'335 | 2'043'438 | 0.45 |
| US91282CGW55 | TII 1 1/4 04/15/28 | 11'000'000 | USD | 10'781'657 | 11'040'316 | 2.42 |
| | | | | 12'777'992 | 13'083'754 | 2.87 |
| | UY | | | | | |
| US917288BM35 | URUGUA 8 1/4 05/21/31 | 215'000'000 | UYU | 5'230'437 | 5'201'994 | 1.14 |
| US917288BK78 | URUGUA 4 3/8 01/23/31 | 3'450'000 | USD | 3'433'464 | 3'402'804 | 0.74 |
| US760942BA98 | URUGUA 5.1 06/18/50 | 2'260'000 | USD | 2'784'084 | 2'201'579 | 0.48 |
| | | | | 11'447'984 | 10'806'377 | 2.36 |
| | VN | | | | | |
| USY9384RAA87 | VIETNM 4.8 11/19/24 REGS | 450'000 | USD | 495'000 | 446'544 | 0.10 |
| | | | | 495'000 | 446'544 | 0.10 |
| | XS | | | | | |
| XS1649504096 | IFC 7 07/20/27 GMTN | 76'500'000 | MXN | 4'135'798 | 4'137'917 | 0.91 |
| XS1492818866 | EIB 2 3/4 08/25/26 EMTN | 26'000'000 | PLN | 6'059'158 | 6'112'990 | 1.34 |
| | | | | 10'194'956 | 10'250'907 | 2.25 |
| | ZA | | | | | |
| ZAG000107012 | SAGB 8 1/2 01/31/37 #2037 2037 | 286'272'000 | ZAR | 13'119'922 | 12'015'150 | 2.63 |
| ZAG000107004 | SAGB 8 1/4 03/31/32 #2032 2032 | 319'880'000 | ZAR | 16'282'639 | 15'008'711 | 3.28 |
| US836205BC70 | SOAF 5 7/8 04/20/32 | 5'920'000 | USD | 5'304'468 | 5'443'558 | 1.19 |
| US836205AW44 | SOAF 4.85 09/27/27 | 620'000 | USD | 619'722 | 597'847 | 0.13 |
| US836205AP92 | SOAF 6 1/4 03/08/41 | 7'900'000 | USD | 7'230'535 | 6'693'670 | 1.46 |
| | | | | 42'557'287 | 39'758'936 | 8.69 |
| | Summe - Anleihen | | | | 453'962'227 | |
| | Summe - Amtlich notierte sowie an anderen geregelten Märkten gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | | | | 453'962'227 | |
| | SUMME DES WERTPAPIERBESTANDES | | | | 453'962'227 | 99.31 |

10 Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Absolute Return

Wertpapierbestand zum 31.01.2024 (Angaben in USD)

| ISIN Nummer | Bezeichnung | Stückzahl / Nennwert | Währung | Einstandswert | Marktwert | % des Netto- vermögens |
|---|------------------------------|-------------------------|---------|-------------------|-------------------|---------------------------|
| Amtlich notierte sowie an anderen geregelten Märkten gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | | | | | | |
| Anleihen | | | | | | |
| AE | | | | | | |
| XS2707149600 | MUBAUH 5 7/8 05/01/34 REGS | 1'900'000 | USD | 1'877'181 | 2'044'875 | 0.91 |
| XS2651619285 | MASDAR 4 7/8 07/25/33 EMTN | 750'000 | USD | 746'250 | 739'943 | 0.33 |
| XS2623206187 | MUBAUH 5.084 05/22/53 REGS | 700'000 | USD | 612'500 | 670'628 | 0.30 |
| | | | | 3'235'931 | 3'455'446 | 1.53 |
| AR | | | | | | |
| XS2177365363 | ARGENT 3 07/09/41 | 2'150'000 | EUR | 891'594 | 677'673 | 0.30 |
| | | | | 891'594 | 677'673 | 0.30 |
| AT | | | | | | |
| XS2320746394 | VERAV 0.9 04/01/41 | 400'000 | EUR | 465'866 | 302'077 | 0.13 |
| US676167CG22 | OKB 4 5/8 11/03/25 | 1'600'000 | USD | 1'613'236 | 1'603'856 | 0.71 |
| AT0000A33SH3 | RAGB 2.9 05/23/29 | 900'000 | EUR | 983'774 | 1'002'993 | 0.45 |
| AT0000A32HA3 | HYNOE 4 02/01/27 EMTN | 800'000 | EUR | 867'218 | 878'166 | 0.39 |
| AT0000A32562 | ERSTBK 4 01/16/31 | 400'000 | EUR | 426'708 | 451'167 | 0.20 |
| AT0000A2HLC4 | RAGB 0.85 06/30/2120 | 3'200'000 | EUR | 1'431'687 | 1'583'176 | 0.70 |
| | | | | 5'788'489 | 5'821'435 | 2.59 |
| AU | | | | | | |
| XS2711801287 | APAAU 7 1/8 11/09/2083 eMTN | 600'000 | EUR | 634'028 | 699'346 | 0.31 |
| CAQ57085HQ08 | MQGAU 2.723 08/21/29 MPLE | 1'800'000 | CAD | 1'437'642 | 1'199'919 | 0.53 |
| AU35G0002579 | TCV 2 09/17/35 | 3'000'000 | AUD | 1'543'172 | 1'475'007 | 0.66 |
| AU35G0002553 | NSWTC 1 3/4 03/20/34 | 2'000'000 | AUD | 1'436'052 | 1'012'120 | 0.45 |
| AU35G0002348 | NSWTC 1 1/4 11/20/30 | 900'000 | AUD | 643'349 | 492'293 | 0.22 |
| | | | | 5'694'244 | 4'878'686 | 2.17 |
| BE | | | | | | |
| BE0974365976 | KBCBB 0 3/8 06/16/27 EMTN | 800'000 | EUR | 900'312 | 810'106 | 0.36 |
| | | | | 900'312 | 810'106 | 0.36 |
| CA | | | | | | |
| XS2411135150 | ONTTFT 0.95 11/24/51 EMTN | 1'300'000 | EUR | 1'471'469 | 783'093 | 0.35 |
| XS2403528776 | CPPIBC 1 5/8 10/22/2071 EMTN | 1'000'000 | GBP | 656'657 | 529'106 | 0.24 |
| XS2356317177 | CPPIBC 1 1/2 06/23/28 | 4'000'000 | AUD | 3'077'095 | 2'341'148 | 1.04 |
| USC68012AG55 | OMERFT 4 04/19/52 REGS | 1'000'000 | USD | 971'800 | 809'770 | 0.36 |
| USC23264AL58 | CADEPO 1 05/26/26 REGS | 3'000'000 | USD | 2'917'261 | 2'776'710 | 1.23 |
| US78013XZU52 | RY 2.55 07/16/24 GMTN | 1'200'000 | USD | 1'197'936 | 1'184'784 | 0.53 |
| US68329AAH14 | ONTTFT 1 1/4 09/27/30 144A | 1'000'000 | USD | 994'680 | 818'840 | 0.36 |
| US683234AR91 | ONT 1 1/8 10/07/30 | 1'000'000 | USD | 833'440 | 822'670 | 0.37 |
| US13645RBD52 | CP 1.35 12/02/24 | 1'200'000 | USD | 1'152'928 | 1'161'444 | 0.52 |
| CH1242301302 | CCDJ 1.735 01/31/28 | 800'000 | CHF | 859'338 | 946'319 | 0.42 |
| CA12593ZAA80 | CPPIBC 3.95 06/02/32 | 1'000'000 | CAD | 744'009 | 748'333 | 0.33 |
| | | | | 14'876'613 | 12'922'217 | 5.74 |
| CH | | | | | | |
| XS2589907653 | UBS 5 1/2 08/20/26 EMTN | 800'000 | EUR | 851'586 | 914'360 | 0.41 |

| ISIN Nummer | Bezeichnung | Stückzahl / Nennwert | Währung | Einstandswert | Marktwert | % des Netto- vermögens |
|--------------|----------------------------|-------------------------|---------|-------------------|-------------------|---------------------------|
| USH42097ER43 | UBS 9 1/4 PERP REGS | 400'000 | USD | 400'000 | 438'048 | 0.19 |
| USH42097DT18 | UBS 5.959 01/12/34 REGS | 500'000 | USD | 500'000 | 517'155 | 0.23 |
| USH42097CZ86 | UBS 4.488 05/12/26 REGS | 450'000 | USD | 450'000 | 443'966 | 0.20 |
| CH1266847149 | ZKB 4.156 06/08/29 | 800'000 | EUR | 858'516 | 892'348 | 0.40 |
| CH1249416046 | PSHYPO 2 1/8 11/15/30 736 | 1'700'000 | CHF | 2'052'803 | 2'080'090 | 0.92 |
| CH1218301963 | PSHYPO 2 1/4 09/25/37 731 | 1'100'000 | CHF | 1'254'464 | 1'407'041 | 0.63 |
| CH1199659975 | PSHYPO 1 7/8 01/25/38 725 | 800'000 | CHF | 819'944 | 983'109 | 0.44 |
| CH1170565753 | ZKB 2.02 04/13/28 | 800'000 | EUR | 873'560 | 823'993 | 0.37 |
| CH0576402181 | UBS 0 1/4 11/05/28 EMTN | 800'000 | EUR | 939'001 | 767'656 | 0.34 |
| CH0536893321 | ZKB 1 3/4 PERP | 2'100'000 | CHF | 2'265'760 | 2'235'618 | 0.99 |
| CH0506668869 | UBS 3 PERP | 1'200'000 | CHF | 1'297'581 | 1'322'259 | 0.59 |
| CH0485252875 | PSHYPO 0 08/26/49 678 | 1'300'000 | CHF | 988'159 | 1'055'488 | 0.47 |
| CH0364277415 | BERCTY 0 5/8 06/13/39 | 800'000 | CHF | 678'724 | 839'308 | 0.37 |
| | | | | 14'230'098 | 14'720'438 | 6.54 |
| CL | | | | | | |
| USP8718AAP14 | SQM 6 1/2 11/07/33 REGS | 800'000 | USD | 795'368 | 827'640 | 0.37 |
| CH1142512339 | BCICI 0.5994 04/26/27 EMTN | 800'000 | CHF | 874'269 | 894'329 | 0.40 |
| | | | | 1'669'637 | 1'721'969 | 0.76 |
| CN | | | | | | |
| XS2332559637 | BCHINA 3.08 04/28/26 EMTn | 7'500'000 | CNY | 1'154'700 | 1'047'953 | 0.47 |
| | | | | 1'154'700 | 1'047'953 | 0.47 |
| CR | | | | | | |
| USP3699PGN17 | COSTAR 7.3 11/13/54 REGS | 1'700'000 | USD | 1'623'313 | 1'785'578 | 0.79 |
| USP3699PGJ05 | COSTAR 7.158 03/12/45 REGS | 800'000 | USD | 715'000 | 825'808 | 0.37 |
| | | | | 2'338'313 | 2'611'386 | 1.16 |
| DE | | | | | | |
| XS2745726047 | VW 4 04/11/31 EMTN | 575'000 | EUR | 625'578 | 633'106 | 0.28 |
| XS2649707846 | PRFINE 9 3/8 07/15/28 REGS | 800'000 | EUR | 869'405 | 895'025 | 0.40 |
| XS2480050090 | DB 4 06/24/26 | 400'000 | GBP | 496'929 | 496'875 | 0.22 |
| XS2233088132 | HHOCGR 0 1/8 02/24/31 | 800'000 | EUR | 952'522 | 718'106 | 0.32 |
| XS2194283672 | IFXGR 1 1/8 06/24/26 EMTN | 400'000 | EUR | 446'346 | 414'530 | 0.18 |
| DE000NRW0MP9 | NRW 0.95 01/10/2121 EMTN | 3'000'000 | EUR | 1'261'246 | 1'456'170 | 0.65 |
| DE000A3823H4 | ALVGR 4.851 07/26/54 | 800'000 | EUR | 872'683 | 891'758 | 0.64 |
| DE000A30VT97 | DB 10 PERP | 600'000 | EUR | 600'648 | 702'872 | 0.40 |
| DE000A30V5C3 | DB 5 3/8 01/11/29 | 800'000 | EUR | 845'888 | 915'221 | 0.31 |
| DE000A13R7Z7 | ALVGR 3 3/8 PERP | 800'000 | EUR | 995'616 | 863'063 | 0.41 |
| DE0001030732 | DBR 0 08/15/31 G | 2'200'000 | EUR | 2'144'484 | 2'055'134 | 0.91 |
| DE0001030724 | DBR 0 08/15/50 G | 5'500'000 | EUR | 5'036'685 | 3'221'915 | 1.43 |
| CH1244319450 | DB 3.645 01/27/29 EMTN | 400'000 | CHF | 431'849 | 482'602 | 0.21 |
| CH1134691620 | DB 0.315 09/14/27 EMTN | 800'000 | CHF | 870'554 | 882'439 | 0.39 |
| | | | | 16'450'432 | 14'628'813 | 6.50 |
| DK | | | | | | |
| XS2591029876 | ORSTED 3 3/4 03/01/30 EMTN | 600'000 | EUR | 632'987 | 666'342 | 0.30 |
| XS2531569965 | ORSTED 3 1/4 09/13/31 emtn | 700'000 | EUR | 693'156 | 752'375 | 0.33 |
| XS2291068992 | KOMMUN 0 1/2 01/28/26 EMTN | 2'000'000 | USD | 1'975'530 | 1'852'820 | 0.82 |
| NO0012826033 | SKIBID Float 03/02/28 | 800'000 | EUR | 836'763 | 887'369 | 0.39 |
| | | | | 4'138'435 | 4'158'905 | 1.85 |
| DO | | | | | | |

| ISIN Nummer | Bezeichnung | Stückzahl / Nennwert | Währung | Einstandswert | Marktwert | % des Netto- vermögens |
|--------------|----------------------------|-------------------------|---------|-------------------|-------------------|---------------------------|
| USP3579ECP09 | DOMREP 5 1/2 02/22/29 REGS | 500'000 | USD | 500'000 | 485'675 | 0.22 |
| | | | | 500'000 | 485'675 | 0.22 |
| | ES | | | | | |
| XS2638924709 | BBVASM 8 3/8 PERP | 1'000'000 | EUR | 1'080'252 | 1'166'391 | 0.52 |
| XS2634826031 | SANTAN 4 1/4 06/12/30 EMTN | 1'000'000 | EUR | 1'069'999 | 1'136'932 | 0.51 |
| XS2013745703 | BBVASM 1 06/21/26 | 800'000 | EUR | 871'026 | 823'854 | 0.37 |
| US05971KAQ22 | SANTAN 9 5/8 PERP _ | 1'000'000 | USD | 1'000'000 | 1'075'160 | 0.48 |
| US05971KAP49 | SANTAN 9 5/8 PERP | 1'400'000 | USD | 1'400'000 | 1'487'136 | 0.66 |
| ES0344251022 | CAZAR 4 3/8 07/30/28 | 200'000 | EUR | 216'348 | 219'587 | 0.10 |
| ES0200002089 | ADIFAL 3.9 04/30/33 emtn | 1'000'000 | EUR | 1'094'551 | 1'126'537 | 0.50 |
| | | | | 6'732'176 | 7'035'598 | 3.13 |
| | FI | | | | | |
| XS2718201515 | NESVFH 3 7/8 05/21/31 EMTN | 600'000 | EUR | 643'716 | 672'409 | 0.30 |
| | | | | 643'716 | 672'409 | 0.30 |
| | FR | | | | | |
| XS2737652474 | AXASA 6 3/8 PERP EMTN | 600'000 | EUR | 655'079 | 664'745 | 0.30 |
| USF8600KAA46 | SOCGEN 10 PERP REGS | 900'000 | USD | 900'000 | 962'766 | 0.43 |
| US83368TBY38 | SOCGEN 7.132 01/19/55 REGS | 650'000 | USD | 650'000 | 649'799 | 0.29 |
| US83368TBR86 | SOCGEN 6.446 01/10/29 REGS | 800'000 | USD | 800'000 | 826'768 | 0.37 |
| FR001400M2F4 | RCFFP 5 1/4 11/22/28 EMTN | 300'000 | EUR | 323'734 | 344'847 | 0.15 |
| FR001400LWN3 | BFCM 4 3/4 11/10/31 EMTN | 800'000 | EUR | 841'917 | 922'207 | 0.41 |
| FR001400KWR6 | ELOFR 6 03/22/29 EMTN | 600'000 | EUR | 638'292 | 658'514 | 0.29 |
| FR001400KHI6 | ENGIFP 4 1/2 09/06/42 EMTN | 600'000 | EUR | 647'519 | 692'542 | 0.31 |
| FR001400ITG9 | BPCECB 3 3/8 06/27/33 | 800'000 | EUR | 872'947 | 895'199 | 0.40 |
| FR001400I7U8 | BNP 6 08/18/29 EMTN | 500'000 | GBP | 635'543 | 666'950 | 0.30 |
| FR001400H9B5 | BNP 4 1/4 04/13/31 EMTN | 800'000 | EUR | 871'944 | 899'127 | 0.40 |
| FR0014006G24 | ATOPF 1 11/12/29 | 700'000 | EUR | 675'353 | 194'412 | 0.09 |
| FR0014003C70 | BPIFRA 0 05/25/28 EMTN | 1'000'000 | EUR | 1'190'276 | 969'726 | 0.43 |
| FR0014000MX1 | SFILFR 0 11/23/28 EMTN | 800'000 | EUR | 963'642 | 763'320 | 0.34 |
| FR00140005J1 | BNP 0 3/8 10/14/27 EMTN | 800'000 | EUR | 852'986 | 801'599 | 0.36 |
| FR00140005B8 | SOGRPR 0 11/25/30 EMTN | 800'000 | EUR | 942'162 | 719'426 | 0.32 |
| | | | | 12'461'394 | 11'631'947 | 5.17 |
| | GB | | | | | |
| XS2745115837 | NWG 3 5/8 01/09/29 EMTN | 1'000'000 | EUR | 1'091'665 | 1'090'528 | 0.48 |
| XS2692259398 | AVLN 6 7/8 11/27/53 | 400'000 | GBP | 495'522 | 530'209 | 0.24 |
| XS2675685700 | SSELN 4 09/05/31 EMTN | 800'000 | EUR | 866'022 | 904'176 | 0.40 |
| XS2673969650 | IDSLN 5 1/4 09/14/28 | 800'000 | EUR | 852'763 | 907'539 | 0.40 |
| XS2662538425 | BACR 4.918 08/08/30 EMTN | 800'000 | EUR | 877'147 | 905'696 | 0.40 |
| XS2623518821 | NWG 4.771 02/16/29 EMTN | 800'000 | EUR | 876'435 | 901'916 | 0.40 |
| XS2597114284 | HSBC 4.787 03/10/32 EMTN | 800'000 | EUR | 854'320 | 920'243 | 0.41 |
| XS2593105476 | AZN 3 3/4 03/03/32 EMTN | 1'200'000 | EUR | 1'264'879 | 1'364'827 | 0.61 |
| XS2560422581 | BACR 5.262 01/29/34 EMTN | 800'000 | EUR | 822'760 | 932'635 | 0.41 |
| XS2540612129 | NWG 6 3/8 11/08/27 emtn | 400'000 | GBP | 457'583 | 534'121 | 0.24 |
| XS1732478000 | OSPRAQ 4 03/08/26 EMTN | 400'000 | GBP | 547'647 | 480'962 | 0.21 |
| USG84228GC69 | STANLN 6.097 01/11/35 REGS | 800'000 | USD | 800'000 | 818'240 | 0.36 |
| US53944YAR45 | LLOYDS 3.511 03/18/26 | 700'000 | USD | 700'000 | 684'250 | 0.30 |
| US404280DQ93 | HSBC 7.336 11/03/26 | 500'000 | USD | 500'000 | 519'015 | 0.23 |
| US06738ECN31 | BACR 9 5/8 PERP | 600'000 | USD | 600'000 | 619'500 | 0.28 |
| GB00BM8Z2521 | UKT 0 7/8 07/31/33 | 800'000 | GBP | 1'091'800 | 780'676 | 0.35 |

| ISIN Nummer | Bezeichnung | Stückzahl / Nennwert | Währung | Einstandswert | Marktwert | % des Netto- vermögens |
|--------------|-----------------------------|-------------------------|---------|-------------------|-------------------|---------------------------|
| CH1160382904 | ITAU 0.56 02/17/25 | 800'000 | CHF | 868'480 | 917'550 | 0.41 |
| | | | | 13'567'022 | 13'812'082 | 6.14 |
| | GH | | | | | |
| XS2115122538 | GHANA 6 3/8 02/11/27 REGS | 1'000'000 | USD | 931'942 | 454'320 | 0.20 |
| | | | | 931'942 | 454'320 | 0.20 |
| | GR | | | | | |
| XS2747093321 | TPEIR 7 1/4 04/17/34 EMTN | 1'300'000 | EUR | 1'412'511 | 1'440'930 | 0.64 |
| | | | | 1'412'511 | 1'440'930 | 0.64 |
| | IE | | | | | |
| XS2626007939 | JCI 4 1/4 05/23/35 | 600'000 | EUR | 644'740 | 689'120 | 0.31 |
| US78448TAK88 | SMBCAC 5.7 07/25/33 144A | 700'000 | USD | 697'627 | 704'564 | 0.31 |
| | | | | 1'342'367 | 1'393'684 | 0.62 |
| | IS | | | | | |
| XS2679765037 | LANBNN 6 3/8 03/12/27 EMTN | 500'000 | EUR | 533'646 | 566'239 | 0.25 |
| | | | | 533'646 | 566'239 | 0.25 |
| | IT | | | | | |
| XS2739132897 | ENIIM 3 7/8 01/15/34 EMTN | 500'000 | EUR | 544'610 | 550'413 | 0.24 |
| XS2725962398 | ISPIM 7.2 11/28/33 REGS | 500'000 | USD | 503'160 | 535'410 | 0.24 |
| XS2673808726 | ISPIM 5 1/8 08/29/31 EMTN | 800'000 | EUR | 861'813 | 937'623 | 0.42 |
| XS2630420268 | ISPIM 6 5/8 05/31/33 EMTN | 400'000 | GBP | 489'958 | 539'469 | 0.24 |
| XS2625196352 | ISPIM 4 7/8 05/19/30 EMTN | 900'000 | EUR | 977'899 | 1'038'343 | 0.46 |
| XS2609970848 | ASSGEN 5.399 04/20/33 EMTN | 450'000 | EUR | 497'138 | 518'267 | 0.23 |
| XS2598063480 | ISPIM 6 1/2 03/14/29 EMTN | 500'000 | GBP | 592'031 | 650'504 | 0.29 |
| XS2592658947 | ISPIM 5 5/8 03/08/33 eMTN | 800'000 | EUR | 841'793 | 948'234 | 0.42 |
| IT0005570988 | UCGIM 4.6 02/14/30 EMTN | 700'000 | EUR | 747'106 | 793'351 | 0.35 |
| IT0005542359 | BTPS 4 10/30/31 8Y | 800'000 | EUR | 876'577 | 903'871 | 0.40 |
| IT0005532723 | BTPS 2 03/14/28 ICPI | 800'000 | EUR | 845'520 | 871'610 | 0.39 |
| IT0005508590 | BTPS 4 04/30/35 13Y | 800'000 | EUR | 790'252 | 886'196 | 0.39 |
| IT0005494239 | BTPS 2 1/2 12/01/32 10Y | 800'000 | EUR | 716'535 | 801'964 | 0.36 |
| | | | | 9'284'392 | 9'975'256 | 4.43 |
| | JP | | | | | |
| XS2323295563 | NIDEC 0.046 03/30/26 | 500'000 | EUR | 591'525 | 504'953 | 0.22 |
| USJ5S39RAC82 | NTT 1.162 04/03/26 REGS | 1'700'000 | USD | 1'687'284 | 1'572'177 | 0.70 |
| | | | | 2'278'809 | 2'077'130 | 0.92 |
| | KR | | | | | |
| XS2465969132 | KORWAT 3 1/2 04/27/25 | 750'000 | USD | 747'525 | 735'840 | 0.33 |
| | | | | 747'525 | 735'840 | 0.33 |
| | KY | | | | | |
| XS1509084775 | MTRC 2 1/2 11/02/26 DIP | 800'000 | USD | 790'625 | 759'800 | 0.34 |
| USG53901AA58 | LBTCOR 10 7/8 01/15/31 REGS | 500'000 | USD | 500'000 | 514'845 | 0.23 |
| | | | | 1'290'625 | 1'274'645 | 0.57 |
| | LU | | | | | |
| XS2760863329 | LHMCFI 6 1/2 03/15/29 REGS | 850'000 | EUR | 921'100 | 922'157 | 0.41 |
| XS2235996217 | NOVNVX 0 09/23/28 | 1'200'000 | EUR | 1'410'251 | 1'149'177 | 0.51 |
| USL6401PAM51 | BEEFBZ 8 7/8 09/13/33 REGS | 800'000 | USD | 800'000 | 843'192 | 0.37 |
| USL62788AE12 | STENA 7 1/4 01/15/31 REGS | 800'000 | USD | 800'000 | 804'528 | 0.36 |
| LU2591861021 | LGB 3 1/4 03/02/43 | 2'300'000 | EUR | 2'418'676 | 2'601'328 | 1.16 |

| ISIN Nummer | Bezeichnung | Stückzahl / Nennwert | Währung | Einstandswert | Marktwert | % des Netto- vermögens |
|--------------|-----------------------------|-------------------------|---------|-------------------|-------------------|---------------------------|
| | | | | 6'350'026 | 6'320'382 | 2.81 |
| MX | | | | | | |
| XS2363910436 | MEX 2 1/4 08/12/36 | 800'000 | EUR | 945'340 | 673'491 | 0.30 |
| US191241AJ70 | KOF 1.85 09/01/32 | 500'000 | USD | 498'020 | 398'170 | 0.18 |
| MX0MGO0001D6 | MBONO 7 1/2 05/26/33 M | 600'000 | MXN | 3'081'921 | 3'134'616 | 1.39 |
| MX0MGO0000H9 | MBONO 8 1/2 05/31/29 M | 600'000 | MXN | 3'243'114 | 3'404'233 | 1.51 |
| | | | | 7'768'395 | 7'610'510 | 3.38 |
| NL | | | | | | |
| XS2744491874 | NEDWBK 2 5/8 01/10/34 | 1'800'000 | EUR | 1'942'631 | 1'919'837 | 0.85 |
| XS2715941949 | SDZSW 4 1/2 11/17/33 | 800'000 | EUR | 856'051 | 929'733 | 0.41 |
| XS2694995163 | ASRNED 3 5/8 12/12/28 | 400'000 | EUR | 430'498 | 438'071 | 0.19 |
| XS2681541327 | ZFFNGR 6 1/8 03/13/29 EMTN | 500'000 | EUR | 532'606 | 572'333 | 0.25 |
| XS2646608401 | TELEFO 6 3/4 PERP | 600'000 | EUR | 655'709 | 704'749 | 0.31 |
| XS2637069357 | ACHMEA 6 3/4 12/26/43 EMTN | 600'000 | EUR | 653'611 | 708'796 | 0.31 |
| XS2634690114 | STLA 4 1/4 06/16/31 EMTN | 400'000 | EUR | 426'877 | 451'862 | 0.20 |
| XS2624554320 | OI 6 1/4 05/15/28 REGS | 300'000 | EUR | 325'874 | 339'828 | 0.15 |
| XS2590262296 | ABNANV 5 1/8 02/22/28 EMTN | 400'000 | GBP | 479'677 | 514'163 | 0.23 |
| XS2575971994 | ABNANV 4 01/16/28 EMTN | 1'000'000 | EUR | 1'070'852 | 1'110'059 | 0.49 |
| XS2554581830 | ASRNED 7 12/07/43 | 600'000 | EUR | 617'182 | 738'881 | 0.33 |
| XS2542914986 | EDPPL 3 7/8 03/11/30 emtn | 300'000 | EUR | 297'727 | 336'162 | 0.15 |
| XS2530756191 | WKLNA 3 09/23/26 | 550'000 | EUR | 549'324 | 598'357 | 0.27 |
| XS2475958059 | PHIANA 2 1/8 11/05/29 EMTN | 800'000 | EUR | 834'295 | 803'954 | 0.36 |
| XS2462605671 | TELEFO 7 1/8 PERP | 600'000 | EUR | 619'890 | 708'751 | 0.31 |
| XS2390530330 | CTPNV 0 5/8 09/27/26 EMTN | 400'000 | EUR | 468'653 | 397'402 | 0.18 |
| XS2350756446 | INTNED 0 7/8 06/09/32 EMTN | 800'000 | EUR | 971'872 | 778'935 | 0.35 |
| XS2176018609 | MUBAUH 2 1/2 05/21/26 GMTN | 1'300'000 | USD | 1'359'196 | 1'230'125 | 0.55 |
| XS1797138960 | IBESM 2 5/8 PERP EMTN | 1'000'000 | EUR | 1'032'040 | 1'083'489 | 0.48 |
| US74977SDJ87 | RABOBK 1.004 09/24/26 REGS | 700'000 | USD | 656'138 | 652'645 | 0.29 |
| | | | | 14'780'702 | 15'018'132 | 6.67 |
| NO | | | | | | |
| XS2631835332 | STATNE 3 1/2 06/08/33 EMTN | 700'000 | EUR | 750'203 | 785'937 | 0.35 |
| NO0012712506 | NGB 3 1/2 10/06/42 485 | 62'000'000 | NOK | 5'660'058 | 6'035'700 | 2.68 |
| CH1132966271 | NONGNO 0 1/8 09/15/28 EMTN | 400'000 | CHF | 435'969 | 432'243 | 0.19 |
| | | | | 6'846'230 | 7'253'881 | 3.22 |
| NZ | | | | | | |
| US06407F2C54 | BZLNZ 1 03/03/26 REGS | 1'000'000 | USD | 993'990 | 921'750 | 0.41 |
| US00182FBU93 | ANZNZ 5.355 08/14/28 REGS | 1'300'000 | USD | 1'300'000 | 1'322'672 | 0.59 |
| NZIIBDT004C8 | NZGBI 2 1/2 09/20/35 0935 | 5'500'000 | NZD | 4'103'992 | 4'220'466 | 1.87 |
| | | | | 6'397'982 | 6'464'888 | 2.87 |
| PE | | | | | | |
| USP42009AE34 | MIVIVI 4 5/8 04/12/27 REGS | 1'300'000 | USD | 1'296'796 | 1'265'628 | 0.56 |
| | | | | 1'296'796 | 1'265'628 | 0.56 |
| PT | | | | | | |
| PTEDP4OM0025 | EDPPL 5.943 04/23/2083 EMTN | 400'000 | EUR | 433'020 | 453'065 | 0.20 |
| | | | | 433'020 | 453'065 | 0.20 |
| SG | | | | | | |
| US449276AG99 | IBM 5.3 02/05/54 | 500'000 | USD | 497'175 | 503'155 | 0.22 |
| US449276AE42 | IBM 4.9 02/05/34 | 2'000'000 | USD | 1'995'000 | 1'999'640 | 0.89 |

| ISIN Nummer | Bezeichnung | Stückzahl / Nennwert | Währung | Einstandswert | Marktwert | % des Netto- vermögens |
|-------------------------|----------------------------|-------------------------|---------|-------------------|--------------------|---------------------------|
| | | | | 2'492'175 | 2'502'795 | 1.11 |
| | UA | | | | | |
| XS2010033343 | UKRAIN 4 3/8 01/27/32 REGS | 1'400'000 | EUR | 1'235'442 | 323'828 | 0.14 |
| | | | | 1'235'442 | 323'828 | 0.14 |
| | US | | | | | |
| XS2597740476 | NWMLIC 4.109 03/15/30 GMTN | 800'000 | EUR | 844'200 | 909'233 | 0.40 |
| XS2595028536 | MS 4.656 03/02/29 | 800'000 | EUR | 848'400 | 903'758 | 0.40 |
| XS2575965327 | MASSMU 3 3/4 01/19/30 GMTN | 800'000 | EUR | 854'671 | 885'197 | 0.39 |
| XS2386220698 | LLY 1 3/8 09/14/61 | 1'800'000 | EUR | 954'000 | 1'177'117 | 0.52 |
| USU9841MAA00 | WPROIN 1 1/2 06/23/26 REGS | 800'000 | USD | 797'088 | 738'280 | 0.33 |
| USU75000BS44 | ROSW 0.991 03/05/26 REGS | 1'500'000 | USD | 1'500'000 | 1'396'410 | 0.62 |
| US91324PDR01 | UNH 2 3/8 08/15/24 | 1'200'000 | USD | 1'205'579 | 1'181'604 | 0.52 |
| US91282CEJ62 | TII 0 1/8 04/15/27 | 1'700'000 | USD | 1'735'050 | 1'750'287 | 0.78 |
| US912828ZJ22 | TII 0 1/8 04/15/25 | 1'200'000 | USD | 1'322'386 | 1'384'722 | 0.62 |
| US912810TJ79 | T 3 08/15/52 | 650'000 | USD | 475'617 | 519'137 | 0.23 |
| US912810TE82 | TII 0 1/8 02/15/52 | 2'700'000 | USD | 1'923'031 | 1'823'171 | 0.81 |
| US87264ADF93 | TMUS 5.15 04/15/34 | 500'000 | USD | 498'270 | 504'795 | 0.22 |
| US79466LAH78 | CRM 1 1/2 07/15/28 | 400'000 | USD | 397'936 | 356'352 | 0.16 |
| US717081FB45 | PFE 1 3/4 08/18/31 | 900'000 | USD | 896'967 | 742'698 | 0.33 |
| US64952XEZ06 | NYLIFE 4.9 06/13/28 REGS | 1'300'000 | USD | 1'298'804 | 1'315'080 | 0.58 |
| US58933YAZ88 | MRK 1.45 06/24/30 | 800'000 | USD | 763'412 | 669'168 | 0.30 |
| US478160CQ51 | JNJ 1.3 09/01/30 | 2'600'000 | USD | 2'521'083 | 2'180'022 | 0.97 |
| US46647PDM59 | JPM 5.546 12/15/25 | 1'300'000 | USD | 1'301'359 | 1'301'144 | 0.58 |
| US345397D260 | F 6.95 06/10/26 | 900'000 | USD | 900'000 | 923'877 | 0.41 |
| US161175CP73 | CHTR 6.65 02/01/34 | 650'000 | USD | 649'207 | 679'393 | 0.30 |
| US03040WBA27 | AWK 4.45 06/01/32 | 550'000 | USD | 548'257 | 542'267 | 0.24 |
| AU3CB0288553 | ATH 4.76 04/21/27 MTN | 1'100'000 | AUD | 729'770 | 687'329 | 0.31 |
| | | | | 22'965'086 | 22'571'041 | 10.03 |
| | XS | | | | | |
| XS2447948824 | AFDB 0 02/24/42 | 10'000'000 | BRL | 380'780 | 432'819 | 0.19 |
| XS2437747210 | IBRD 2 1/4 01/19/29 GMTN | 15'000'000 | CNY | 2'144'444 | 2'072'759 | 0.92 |
| XS2306086872 | CAF 6.82 02/22/31 EMTN | 50'000'000 | MXN | 2'144'019 | 2'424'879 | 1.08 |
| XS2288098457 | IBRD 4 1/4 01/22/26 EMTN | 75'000'000 | MXN | 3'587'116 | 3'939'056 | 1.75 |
| XS2288097640 | IBRD 5 01/22/26 EMTN | 22'000'000 | BRL | 3'955'505 | 4'188'731 | 1.86 |
| XS2228199209 | IFC 0 09/09/30 GMTN | 150'000'000 | RUB | 1'061'225 | 621'109 | 0.28 |
| XS1551056234 | IFC 0 01/20/37 EMTN | 75'000'000 | MXN | 1'266'297 | 1'375'855 | 0.61 |
| US4581X0EJ31 | IADB 3 1/2 04/12/33 GMTN | 3'000'000 | USD | 2'975'730 | 2'863'110 | 1.27 |
| EU000A3K4D09 | EU 2 3/4 12/04/37 SURE | 1'500'000 | EUR | 1'572'295 | 1'585'184 | 0.70 |
| CA459058KM45 | IBRD 3.7 01/18/28 | 2'500'000 | CAD | 1'837'950 | 1'868'231 | 0.83 |
| AU3CB0295764 | EIB 4 3/4 01/20/33 | 2'600'000 | AUD | 1'790'954 | 1'729'249 | 0.77 |
| | | | | 22'716'315 | 23'100'980 | 10.26 |
| | ZA | | | | | |
| ZAG000106998 | SAGB 8 01/31/30 #2030 2030 | 100'000'000 | ZAR | 5'656'640 | 4'958'720 | 2.20 |
| US836205AY00 | SOAF 5 7/8 06/22/30 | 800'000 | USD | 863'133 | 754'456 | 0.34 |
| | | | | 6'519'773 | 5'713'176 | 2.54 |
| Summe - Anleihen | | | | | 217'609'088 | |
| Optionen | | | | | | |
| | GB | | | | | |

| ISIN Nummer | Bezeichnung | Stückzahl / Nennwert | Währung | Einstandswert | Marktwert | % des Netto- vermögens |
|---|----------------------------|-------------------------|---------|----------------|--------------------|---------------------------|
| GB00K6Z2BN30 | EURIBOR 3M OPT Jun24C 97.5 | 50'000'000 | EUR | 59 | 0 | 0.00 |
| SPSS0DZ2 | Markit CDX.NA.IG.41 | 75'000'000 | USD | 111'750 | 35'195 | 0.02 |
| SPOK0SUK | Markit ITRX EUR | 100'000'000 | EUR | 131'274 | 63'050 | 0.03 |
| | | | | 243'082 | 98'245 | 0.04 |
| Summe - Optionen | | | | | 98'245 | |
| Summe - Amtlich notierte sowie an anderen geregelten Märkten gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | | | | | 217'707'334 | |
| SUMME DES WERTPAPIERBESTANDES | | | | | 217'707'334 | 96.71 |

11 Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Convertible

Wertpapierbestand zum 31.01.2024 (Angaben in USD)

| ISIN Nummer | Bezeichnung | Stückzahl / Nennwert | Währung | Einstandswert | Marktwert | % des Netto- vermögens |
|---|----------------------------|-------------------------|---------|------------------|------------------|---------------------------|
| Amtlich notierte sowie an anderen geregelten Märkten gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | | | | | | |
| Anleihen | | | | | | |
| AU | | | | | | |
| XS2487637527 | DXSAU 3 1/2 11/24/27 | 600'000 | AUD | 431'001 | 434'116 | 0.60 |
| XS2400443748 | FLTAU 1 5/8 11/01/28 | 200'000 | AUD | 148'194 | 128'476 | 0.18 |
| | | | | 579'196 | 562'592 | 0.78 |
| BM | | | | | | |
| US62886HBK68 | NCLH 2 1/2 02/15/27 | 450'000 | USD | 390'282 | 413'343 | 0.57 |
| US62886HAX98 | NCLH 5 3/8 08/01/25 | 625'000 | USD | 761'532 | 755'319 | 1.04 |
| US472145AF83 | JAZZ 2 06/15/26 | 650'000 | USD | 717'637 | 660'010 | 0.91 |
| | | | | 1'869'451 | 1'828'672 | 2.52 |
| CA | | | | | | |
| US008911BF52 | ACACN 4 07/01/25 | 550'000 | USD | 595'760 | 606'062 | 0.84 |
| | | | | 595'760 | 606'062 | 0.84 |
| DE | | | | | | |
| DE000A3H2WP2 | DEHEHO 0 7/8 07/15/25 | 200'000 | EUR | 197'518 | 197'297 | 0.27 |
| DE000A3H2UK7 | LHAGR 2 11/17/25 LHA | 300'000 | EUR | 371'779 | 345'759 | 0.48 |
| DE000A352B25 | RAGSTF 2 1/4 11/28/30 | 600'000 | EUR | 656'068 | 655'555 | 0.91 |
| DE000A30VPN9 | RAGSTF 1 7/8 11/16/29 | 500'000 | EUR | 509'008 | 544'656 | 0.75 |
| DE000A30V5R1 | DEHEHO 3 1/4 02/21/30 | 800'000 | EUR | 860'590 | 718'757 | 0.99 |
| DE000A289T23 | LEGGR 0.4 06/30/28 | 300'000 | EUR | 257'975 | 282'149 | 0.39 |
| | | | | 2'852'937 | 2'744'173 | 3.79 |
| ES | | | | | | |
| XS2257580857 | CLNXSM 0 3/4 11/20/31 CLNX | 500'000 | EUR | 518'036 | 457'810 | 0.63 |
| XS2154448059 | AMSSM 1 1/2 04/09/25 | 600'000 | EUR | 754'144 | 808'951 | 1.12 |
| XS2021212332 | CLNXSM 0 1/2 07/05/28 CLNX | 300'000 | EUR | 353'768 | 346'532 | 0.48 |
| | | | | 1'625'947 | 1'613'292 | 2.23 |
| FR | | | | | | |
| FR001400MA32 | UBIFP 2 7/8 12/05/31 | 200'000 | EUR | 220'148 | 193'478 | 0.27 |
| FR001400M9F9 | SUFP 1.97 11/27/30 SUFP | 700'000 | EUR | 765'764 | 820'884 | 1.14 |
| FR001400F2K3 | SPIEFP 2 01/17/28 | 300'000 | EUR | 327'813 | 353'564 | 0.49 |
| FR001400DV38 | UBIFP 2 3/8 11/15/28 | 200'000 | EUR | 224'671 | 208'738 | 0.29 |
| FR001400DU47 | AFFP 6 1/2 PERP | 300'000 | EUR | 343'471 | 357'191 | 0.49 |
| FR001400AFJ9 | ELISGP 2 1/4 09/22/29 | 300'000 | EUR | 333'060 | 444'134 | 0.61 |
| FR0014003YP6 | EDENFP 0 06/14/28 EDEN | 1'700 | EUR | 115'475 | 121'718 | 0.17 |
| FR0013444395 | EDENFP 0 09/06/24 EDEN | 4'900 | EUR | 343'804 | 327'367 | 0.45 |
| | | | | 2'674'207 | 2'827'075 | 3.91 |
| HK | | | | | | |
| XS2523390867 | LENOVO 2 1/2 08/26/29 | 400'000 | USD | 383'306 | 464'908 | 0.64 |
| | | | | 383'306 | 464'908 | 0.64 |
| IL | | | | | | |
| US653656AB42 | NICEIT 0 09/15/25 | 350'000 | USD | 365'464 | 336'109 | 0.46 |
| | | | | 365'464 | 336'109 | 0.46 |

| ISIN Nummer | Bezeichnung | Stückzahl / Nennwert | Währung | Einstandswert | Marktwert | % des Netto- vermögens |
|--------------|----------------------------|-------------------------|---------|------------------|------------------|---------------------------|
| IT | | | | | | |
| XS2677538493 | SPMIM 2 7/8 09/11/29 | 400'000 | EUR | 435'221 | 452'127 | 0.63 |
| XS2637952610 | ENIIM 2.95 09/14/30 ENI | 300'000 | EUR | 321'151 | 339'235 | 0.47 |
| XS2294704007 | PRYIM 0 02/02/26 PRY | 200'000 | EUR | 235'845 | 240'595 | 0.33 |
| XS2161819722 | NEXIIM 1 3/4 04/24/27 | 200'000 | EUR | 220'870 | 203'348 | 0.28 |
| | | | | 1'213'087 | 1'235'305 | 1.71 |
| JP | | | | | | |
| XS2743016607 | DAIWAH 0 03/29/30 | 80'000'000 | JPY | 561'798 | 554'891 | 0.77 |
| XS2743016193 | DAIWAH 0 03/30/29 | 50'000'000 | JPY | 351'123 | 349'140 | 0.48 |
| XS2730213290 | OSGMFG 0 12/20/30 | 30'000'000 | JPY | 211'074 | 224'129 | 0.31 |
| XS2727915899 | KOBSTL 0 12/14/28 | 40'000'000 | JPY | 279'168 | 304'471 | 0.42 |
| XS2700269660 | TAIYUD 0 10/18/30 | 50'000'000 | JPY | 352'456 | 367'830 | 0.51 |
| XS2635167963 | TOKYU 0 09/30/30 | 50'000'000 | JPY | 367'055 | 353'676 | 0.49 |
| XS2635167450 | TOKYU 0 09/29/28 | 30'000'000 | JPY | 220'233 | 210'328 | 0.29 |
| XS2633836304 | FERTEC 0 06/23/28 | 30'000'000 | JPY | 235'920 | 218'637 | 0.30 |
| XS2631868937 | TOHPHA 0 06/16/28 | 30'000'000 | JPY | 227'954 | 245'714 | 0.34 |
| XS2584105055 | PARKTF 0 02/24/28 | 50'000'000 | JPY | 378'584 | 344'792 | 0.48 |
| XS2550564251 | CYBAG 0 11/16/29 | 40'000'000 | JPY | 271'304 | 264'185 | 0.37 |
| XS2413708442 | ANAIIR 0 12/10/31 | 170'000'000 | JPY | 1'398'307 | 1'364'478 | 1.89 |
| XS2387597573 | NIPSTL 0 10/05/26 | 110'000'000 | JPY | 991'472 | 1'088'525 | 1.51 |
| XS2357278204 | MORSEI 0 07/16/24 | 40'000'000 | JPY | 350'411 | 330'443 | 0.46 |
| XS2357174684 | MERCAR 0 07/14/28 | 20'000'000 | JPY | 185'311 | 105'946 | 0.15 |
| XS2286049338 | KYOMAI 0 01/29/26 | 30'000'000 | JPY | 291'279 | 273'753 | 0.38 |
| XS2267079643 | RELGRI 0 12/17/27 | 20'000'000 | JPY | 153'171 | 130'485 | 0.18 |
| XS2080209435 | ROHMCO 0 12/05/24 | 30'000'000 | JPY | 301'027 | 209'002 | 0.29 |
| XS2008155488 | YAOKO 0 06/20/24 | 20'000'000 | JPY | 155'272 | 194'467 | 0.27 |
| XS1915588559 | TAKASH 0 12/06/28 | 30'000'000 | JPY | 240'347 | 227'514 | 0.31 |
| | | | | 7'523'264 | 7'362'405 | 10.20 |
| KR | | | | | | |
| XS2647856777 | LGCHM 1.6 07/18/30 | 700'000 | USD | 717'306 | 646'730 | 0.89 |
| XS2647856348 | LGCHM 1 1/4 07/18/28 | 700'000 | USD | 723'956 | 664'447 | 0.92 |
| XS2607736407 | HYUELE 1 3/4 04/11/30 | 1'000'000 | USD | 1'048'583 | 1'323'980 | 1.83 |
| | | | | 2'489'844 | 2'635'157 | 3.64 |
| KY | | | | | | |
| XS2287867563 | CATHAY 2 3/4 02/05/26 | 6'000'000 | HKD | 780'153 | 792'202 | 1.10 |
| XS2264840864 | HONGQI 5 1/4 01/25/26 | 400'000 | USD | 504'167 | 430'608 | 0.60 |
| XS2171663227 | ZHOSHK 0 05/21/25 | 4'000'000 | HKD | 549'758 | 548'362 | 0.76 |
| XS2158580493 | KINSF 0 5/8 04/29/25 | 2'000'000 | HKD | 313'400 | 254'941 | 0.35 |
| XS2090962775 | BOSINT 1 12/17/24 | 500'000 | USD | 561'875 | 508'860 | 0.70 |
| US98980AAB17 | ZTO 1 1/2 09/01/27 | 400'000 | USD | 381'192 | 363'736 | 0.50 |
| US98313RAJ59 | WYNMAC 4 1/2 03/07/29 144A | 650'000 | USD | 688'180 | 648'538 | 0.90 |
| US81180WBK62 | STX 3 1/2 06/01/28 | 500'000 | USD | 550'500 | 604'815 | 0.84 |
| US62914VAH96 | NIO 4 5/8 10/15/30 | 250'000 | USD | 250'000 | 197'933 | 0.27 |
| | | | | 4'579'225 | 4'349'994 | 6.02 |
| LU | | | | | | |
| XS2630795404 | LAGFNC 3 1/2 06/08/28 | 200'000 | EUR | 214'629 | 209'476 | 0.29 |
| XS2566032095 | C 0 03/15/28 GMTN | 200'000 | EUR | 216'631 | 239'828 | 0.33 |
| | | | | 431'261 | 449'305 | 0.62 |

| ISIN Nummer | Bezeichnung | Stückzahl / Nennwert | Währung | Einstandswert | Marktwert | % des Netto- vermögens |
|--------------|----------------------------|-------------------------|---------|------------------|------------------|---------------------------|
| NL | | | | | | |
| XS2740429589 | CPRIM 2 3/8 01/17/29 | 300'000 | EUR | 331'618 | 333'001 | 0.46 |
| XS2576250448 | BAC 0 01/30/26 TTE | 200'000 | EUR | 218'380 | 220'915 | 0.31 |
| XS2308171383 | AMXLMM 0 03/02/24 | 400'000 | EUR | 416'584 | 439'626 | 0.61 |
| XS2211997239 | STM 0 08/04/27 B | 1'000'000 | USD | 1'078'739 | 1'125'200 | 1.56 |
| XS1908221507 | QGEN 1 11/13/24 | 400'000 | USD | 476'306 | 410'952 | 0.57 |
| XS1592282740 | SRENVX 3 1/4 06/13/24 SREN | 200'000 | USD | 213'883 | 243'992 | 0.34 |
| DE000A3MQE86 | CAPGR 1 7/8 PERP | 300'000 | EUR | 310'439 | 280'995 | 0.39 |
| DE000A286LPO | QGEN 0 12/17/27 QGEN | 400'000 | USD | 362'400 | 369'868 | 0.51 |
| | | | | 3'408'348 | 3'424'549 | 4.75 |
| NZ | | | | | | |
| XS2263667250 | XROAU 0 12/02/25 | 600'000 | USD | 538'500 | 544'422 | 0.75 |
| | | | | 538'500 | 544'422 | 0.75 |
| SE | | | | | | |
| XS2591236315 | BALDER 3 1/2 02/23/28 | 300'000 | EUR | 321'327 | 397'994 | 0.55 |
| | | | | 321'327 | 397'994 | 0.55 |
| SG | | | | | | |
| XS2260025296 | SIASP 1 5/8 12/03/25 | 500'000 | SGD | 419'577 | 481'461 | 0.67 |
| | | | | 419'577 | 481'461 | 0.67 |
| TW | | | | | | |
| XS2156579497 | YAGEO 0 05/26/25 | 300'000 | USD | 321'000 | 327'405 | 0.45 |
| | | | | 321'000 | 327'405 | 0.45 |
| US | | | | | | |
| XS2565604704 | C 0 02/26/26 1299 | 4'000'000 | HKD | 500'901 | 472'059 | 0.65 |
| XS2470870366 | JPM 0 04/29/25 DTE | 300'000 | EUR | 336'244 | 375'505 | 0.52 |
| XS2431434971 | JPM 0 01/14/25 | 200'000 | EUR | 209'166 | 222'740 | 0.31 |
| XS2352315571 | JPM 0 06/10/24 MCFP | 300'000 | EUR | 387'125 | 340'141 | 0.47 |
| XS2303829308 | JPM 0 02/18/24 | 200'000 | EUR | 269'330 | 239'657 | 0.33 |
| US98980GAB86 | ZS 0 1/8 07/01/25 | 250'000 | USD | 333'867 | 400'090 | 0.55 |
| US98954MAH43 | Z 2 3/4 05/15/25 | 100'000 | USD | 99'160 | 109'955 | 0.15 |
| US98954MAG69 | Z 1 3/8 09/01/26 | 550'000 | USD | 604'373 | 749'221 | 1.04 |
| US98139AAC99 | WK 1 1/4 08/15/28 | 650'000 | USD | 642'620 | 627'874 | 0.87 |
| US974637AE01 | WGO 3 1/4 01/15/30 | 200'000 | USD | 203'900 | 205'678 | 0.28 |
| US958102AS46 | WDC 3 11/15/28 | 300'000 | USD | 365'350 | 390'021 | 0.54 |
| US94419LAF85 | W 1 08/15/26 | 500'000 | USD | 414'053 | 431'515 | 0.60 |
| US928298AQ11 | VSH 2 1/4 09/15/30 | 650'000 | USD | 636'287 | 611'052 | 0.85 |
| US92277GAY35 | VTR 3 3/4 06/01/26 | 600'000 | USD | 599'571 | 618'036 | 0.86 |
| US91879QAN97 | MTN 0 01/01/26 | 400'000 | USD | 402'288 | 361'272 | 0.50 |
| US90353TAL44 | UBER 0 7/8 12/01/28 2028 | 800'000 | USD | 819'080 | 893'696 | 1.24 |
| US90353TAJ97 | UBER 0 12/15/25 | 500'000 | USD | 464'500 | 517'210 | 0.72 |
| US902252AB17 | TYL 0 1/4 03/15/26 | 200'000 | USD | 207'477 | 202'690 | 0.28 |
| US88162GAA13 | TTEK 2 1/4 08/15/28 | 400'000 | USD | 397'800 | 407'120 | 0.56 |
| US852234AF05 | SQ 0 1/8 03/01/25 | 230'000 | USD | 296'744 | 221'865 | 0.31 |
| US848637AD65 | SPLK 1 1/8 09/15/25 | 600'000 | USD | 681'215 | 667'176 | 0.92 |
| US844741BG22 | LUV 1 1/4 05/01/25 | 500'000 | USD | 640'402 | 512'915 | 0.71 |
| US83304AAH95 | SNAP 0 1/8 03/01/28 | 600'000 | USD | 454'800 | 475'254 | 0.66 |
| US82489TAA25 | SWAV 1 08/15/28 | 600'000 | USD | 600'129 | 631'092 | 0.87 |
| US82452JAB52 | FOUR 0 12/15/25 | 250'000 | USD | 286'521 | 275'235 | 0.38 |

| ISIN Nummer | Bezeichnung | Stückzahl / Nennwert | Währung | Einstandswert | Marktwert | % des Netto- vermögens |
|--------------|---------------------|-------------------------|---------|---------------|-----------|---------------------------|
| US803607AD25 | SRPT 1 1/4 09/15/27 | 750'000 | USD | 881'824 | 846'758 | 1.17 |
| US76954AAC71 | RIVN 3 5/8 10/15/30 | 200'000 | USD | 186'740 | 183'658 | 0.25 |
| US76954AAA16 | RIVN 4 5/8 03/15/29 | 200'000 | USD | 240'040 | 209'054 | 0.29 |
| US753422AG97 | RPD 1 1/4 03/15/29 | 300'000 | USD | 329'813 | 327'774 | 0.45 |
| US737446AT14 | POST 2 1/2 08/15/27 | 250'000 | USD | 256'382 | 260'045 | 0.36 |
| US69331CAK45 | PCG 4 1/4 12/01/27 | 1'050'000 | USD | 1'069'080 | 1'070'486 | 1.48 |
| US686688AB85 | ORA 2 1/2 07/15/27 | 400'000 | USD | 392'000 | 388'640 | 0.54 |
| US682189AT21 | ON 0 1/2 03/01/29 | 1'075'000 | USD | 1'083'325 | 1'043'965 | 1.44 |
| US68213NAD12 | OMCL 0 1/4 09/15/25 | 500'000 | USD | 613'696 | 459'550 | 0.64 |
| US670704AJ40 | GMED 0 3/8 03/15/25 | 400'000 | USD | 384'914 | 374'468 | 0.52 |
| US65341BAD82 | NEP 0 11/15/25 | 300'000 | USD | 313'470 | 265'131 | 0.37 |
| US629377CG50 | NRG 2 3/4 06/01/48 | 400'000 | USD | 410'760 | 529'336 | 0.73 |
| US596278AB74 | MIDD 1 09/01/25 | 450'000 | USD | 492'233 | 533'966 | 0.74 |
| US589889AA22 | MMSI 3 02/01/29 | 400'000 | USD | 400'000 | 450'044 | 0.62 |
| US57164YAD94 | VAC 0 01/15/26 | 450'000 | USD | 501'168 | 399'029 | 0.55 |
| US55024UAG40 | LITE 1 1/2 12/15/29 | 400'000 | USD | 403'800 | 409'204 | 0.57 |
| US55024UAD19 | LITE 0 1/2 12/15/26 | 500'000 | USD | 516'557 | 452'940 | 0.63 |
| US538034BA63 | LYV 3 1/8 01/15/29 | 493'000 | USD | 486'985 | 543'537 | 0.75 |
| US531229AN28 | LMCA 3 3/4 03/15/28 | 500'000 | USD | 520'669 | 622'015 | 0.86 |
| US516544AB96 | LNTH 2 5/8 12/15/27 | 500'000 | USD | 521'125 | 520'540 | 0.72 |
| US501812AB77 | LCII 1 1/8 05/15/26 | 350'000 | USD | 336'828 | 332'332 | 0.46 |
| US48123VAE20 | ZD 1 3/4 11/01/26 | 300'000 | USD | 312'000 | 283'911 | 0.39 |
| US477839AB04 | JBT 0 1/4 05/15/26 | 300'000 | USD | 301'568 | 272'298 | 0.38 |
| US45826HAA77 | ITGR 2 1/8 02/15/28 | 350'000 | USD | 373'164 | 456'411 | 0.63 |
| US457985AM13 | IART 0 1/2 08/15/25 | 400'000 | USD | 407'150 | 376'228 | 0.52 |
| US40637HAF64 | HALO 1 08/15/28 | 500'000 | USD | 494'123 | 454'075 | 0.63 |
| US393657AM33 | GBX 2 7/8 04/15/28 | 400'000 | USD | 415'350 | 408'760 | 0.57 |
| US345370CZ16 | F 0 03/15/26 | 700'000 | USD | 752'389 | 683'767 | 0.95 |
| US313747BD82 | FRT 3 1/4 01/15/29 | 400'000 | USD | 400'000 | 394'576 | 0.55 |
| US30212PBE43 | EXPE 0 02/15/26 | 200'000 | USD | 177'500 | 189'382 | 0.26 |
| US30063PAD78 | EXAS 2 03/01/30 | 300'000 | USD | 363'900 | 333'666 | 0.46 |
| US30063PAC95 | EXAS 0 3/8 03/01/28 | 550'000 | USD | 525'725 | 485'606 | 0.67 |
| US30034WAC01 | EVRG 4 1/2 12/15/27 | 100'000 | USD | 100'000 | 101'455 | 0.14 |
| US298736AL30 | EEFT 0 3/4 03/15/49 | 200'000 | USD | 203'794 | 190'266 | 0.26 |
| US29786AAJ51 | ETSY 0 1/8 10/01/26 | 625'000 | USD | 860'424 | 652'356 | 0.90 |
| US29415FAC86 | NVST 1 3/4 08/15/28 | 300'000 | USD | 303'750 | 273'252 | 0.38 |
| US29404KAG13 | ENV 2 5/8 12/01/27 | 450'000 | USD | 463'500 | 451'175 | 0.62 |
| US26441CBX20 | DUK 4 1/8 04/15/26 | 500'000 | USD | 501'468 | 498'860 | 0.69 |
| US26210CAD65 | DBX 0 03/01/28 | 480'000 | USD | 479'241 | 502'330 | 0.69 |
| US26210CAC82 | DBX 0 03/01/26 | 450'000 | USD | 476'161 | 455'769 | 0.63 |
| US252131AK39 | DXCM 0 1/4 11/15/25 | 700'000 | USD | 737'174 | 725'102 | 1.00 |
| US23804LAB99 | DDOG 0 1/8 06/15/25 | 550'000 | USD | 633'325 | 779'636 | 1.08 |
| US225447AD33 | WOLF 1 3/4 05/01/26 | 200'000 | USD | 390'056 | 197'108 | 0.27 |
| US22003BAQ95 | CDP 5 1/4 09/15/28 | 500'000 | USD | 509'250 | 514'045 | 0.71 |
| US207410AH48 | CNMD 2 1/4 06/15/27 | 600'000 | USD | 587'012 | 570'960 | 0.79 |
| US194014AA45 | ENOV 3 7/8 10/15/28 | 500'000 | USD | 524'780 | 619'325 | 0.86 |
| US17243VAB80 | CNK 4 1/2 08/15/25 | 200'000 | USD | 239'616 | 241'132 | 0.33 |
| US122017AC09 | BURL 1 1/4 12/15/27 | 325'000 | USD | 323'781 | 370'776 | 0.51 |
| US09257WAE03 | BXMT 5 1/2 03/15/27 | 350'000 | USD | 346'510 | 314'335 | 0.43 |
| US090043AB64 | BILL 0 12/01/25 | 300'000 | USD | 339'191 | 281'538 | 0.39 |

| ISIN Nummer | Bezeichnung | Stückzahl / Nennwert | Währung | Einstandswert | Marktwert | % des Netto- vermögens |
|---|-----------------------|-------------------------|---------|-------------------|-------------------|---------------------------|
| US08265TAB52 | BSY 0 1/8 01/15/26 | 550'000 | USD | 512'991 | 539'424 | 0.75 |
| US05464CAB72 | AXON 0 1/2 12/15/27 | 400'000 | USD | 425'400 | 495'524 | 0.69 |
| US03209RAA14 | AMPH 2 03/15/29 | 250'000 | USD | 250'000 | 278'890 | 0.39 |
| US02376RAF91 | AAL 6 1/2 07/01/25 | 700'000 | USD | 766'993 | 798'413 | 1.10 |
| US00971TAM36 | AKAM 1 1/8 02/15/29 | 200'000 | USD | 202'300 | 222'194 | 0.31 |
| US00971TAL52 | AKAM 0 3/8 09/01/27 | 680'000 | USD | 742'510 | 779'253 | 1.08 |
| US00971TAJ07 | AKAM 0 1/8 05/01/25 | 800'000 | USD | 893'871 | 1'054'256 | 1.46 |
| US007973AD29 | AEIS 2 1/2 09/15/28 | 500'000 | USD | 504'500 | 518'690 | 0.72 |
| | | | | 38'034'780 | 37'946'281 | 52.50 |
| | VG | | | | | |
| XS2193653818 | FRESHK 2 1/2 07/08/25 | 200'000 | USD | 202'250 | 198'400 | 0.27 |
| XS2089160506 | ANTSPL 0 02/05/25 | 500'000 | EUR | 652'421 | 528'139 | 0.73 |
| | | | | 854'671 | 726'539 | 1.00 |
| Summe - Anleihen | | | | | 70'863'699 | |
| Summe - Amtlich notierte sowie an anderen geregelten Märkten gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | | | | | 70'863'699 | |
| SUMME DES WERTPAPIERBESTANDES | | | | | 70'863'699 | 98.03 |

12 Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Corporate

Wertpapierbestand zum 31.01.2024 (Angaben in USD)

| ISIN Nummer | Bezeichnung | Stückzahl / Nennwert | Währung | Einstandswert | Marktwert | % des Netto- vermögens |
|---|-----------------------------|-------------------------|---------|-------------------|-------------------|---------------------------|
| Amtlich notierte sowie an anderen geregelten Märkten gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | | | | | | |
| Anleihen | | | | | | |
| AT | | | | | | |
| USA8372TAC20 | SUZANO 7 03/16/47 REGS | 1'000'000 | USD | 1'044'500 | 1'045'770 | 0.29 |
| US86964WAJ18 | SUZANO 3 3/4 01/15/31 | 1'000'000 | USD | 856'800 | 872'510 | 0.24 |
| | | | | 1'901'300 | 1'918'280 | 0.53 |
| AU | | | | | | |
| XS2711801287 | APAAU 7 1/8 11/09/2083 eMTN | 1'500'000 | EUR | 1'592'864 | 1'748'365 | 0.49 |
| USQ98236AC80 | WPLAU 3.7 09/15/26 REGS | 1'530'000 | USD | 1'531'466 | 1'469'351 | 0.41 |
| USQ08328AA64 | ANZ 6 3/4 PERP REGS | 1'700'000 | USD | 1'648'830 | 1'715'623 | 0.48 |
| USQ04578AG72 | APAAU 4 1/4 07/15/27 REGS | 1'500'000 | USD | 1'557'660 | 1'456'755 | 0.41 |
| AU3CB0243764 | TLSAU 4 04/19/27 MTN | 2'100'000 | AUD | 1'577'197 | 1'371'213 | 0.38 |
| | | | | 7'908'017 | 7'761'307 | 2.17 |
| CA | | | | | | |
| US94106BAF85 | WCNCN 4.2 01/15/33 | 1'500'000 | USD | 1'416'825 | 1'442'190 | 0.40 |
| CA87971MCC51 | TCN 5 3/4 09/08/33 | 1'000'000 | CAD | 741'483 | 794'446 | 0.22 |
| CA87971MCB78 | TCN 5.6 09/09/30 | 1'000'000 | CAD | 715'793 | 786'251 | 0.22 |
| CA780086ZH08 | RY 5.228 06/24/30 | 3'500'000 | CAD | 2'547'982 | 2'717'402 | 0.76 |
| CA29251ZCB19 | ENBCN 5.76 05/26/53 | 1'000'000 | CAD | 733'710 | 784'237 | 0.22 |
| CA29251ZBY21 | ENBCN 5.7 11/09/27 | 1'500'000 | CAD | 1'127'655 | 1'164'444 | 0.33 |
| CA29251ZBW64 | ENBCN 6.1 11/09/32 | 1'000'000 | CAD | 769'453 | 805'434 | 0.23 |
| CA07813ZCM47 | BCECN 5.15 02/09/53 | 1'000'000 | CAD | 717'199 | 743'393 | 0.21 |
| CA07813ZCL63 | BCECN 4.55 02/09/30 | 2'000'000 | CAD | 1'455'390 | 1'495'827 | 0.42 |
| CA07813ZCK80 | BCECN 5.85 11/10/32 | 1'500'000 | CAD | 1'181'565 | 1'206'152 | 0.34 |
| | | | | 11'407'054 | 11'939'776 | 3.35 |
| CH | | | | | | |
| USH42097EQ69 | UBS 6.301 09/22/34 REGS | 1'700'000 | USD | 1'704'420 | 1'802'901 | 0.50 |
| | | | | 1'704'420 | 1'802'901 | 0.50 |
| DE | | | | | | |
| XS2751678272 | ENBW 5 1/4 01/23/2084 | 1'500'000 | EUR | 1'643'408 | 1'657'006 | 0.46 |
| XS2549815913 | HANRUE 5 7/8 08/26/43 | 1'500'000 | EUR | 1'526'638 | 1'816'310 | 0.51 |
| USD5558XAA66 | MUNRE 5 7/8 05/23/42 REGS | 2'000'000 | USD | 2'034'800 | 2'030'140 | 0.57 |
| US251526CU14 | DB 6.819 11/20/29 | 2'000'000 | USD | 2'051'670 | 2'099'920 | 0.59 |
| DE000A351U49 | ALVGR 5.824 07/25/53 | 1'500'000 | EUR | 1'606'129 | 1'788'725 | 0.50 |
| DE000A30VTT8 | ALVGR 4.597 09/07/38 EMTN | 1'500'000 | EUR | 1'577'068 | 1'666'506 | 0.47 |
| | | | | 10'439'713 | 11'058'607 | 3.10 |
| DK | | | | | | |
| DK0030507694 | NYKRE 5 1/2 12/29/32 | 1'500'000 | EUR | 1'517'051 | 1'680'828 | 0.47 |
| | | | | 1'517'051 | 1'680'828 | 0.47 |
| ES | | | | | | |
| XS2726256113 | CABKSM 4 3/8 11/29/33 EMTN | 800'000 | EUR | 866'998 | 915'829 | 0.26 |
| XS2705604234 | SANTAN 4 7/8 10/18/31 EMTN | 1'000'000 | EUR | 1'039'535 | 1'155'247 | 0.32 |
| XS2638924709 | BBVASM 8 3/8 PERP | 1'000'000 | EUR | 1'087'330 | 1'166'391 | 0.33 |

| ISIN Nummer | Bezeichnung | Stückzahl / Nennwert | Währung | Einstandswert | Marktwert | % des Netto- vermögens |
|--------------|----------------------------|-------------------------|---------|-------------------|-------------------|---------------------------|
| XS2626699982 | SANTAN 5 3/4 08/23/33 EMTN | 1'000'000 | EUR | 1'072'710 | 1'136'313 | 0.32 |
| XS2580221658 | IBESM 4 7/8 PERP EMTN | 1'500'000 | EUR | 1'619'180 | 1'658'017 | 0.46 |
| XS2555187801 | CABKSM 5 3/8 11/14/30 EMTN | 1'000'000 | EUR | 1'028'807 | 1'171'486 | 0.33 |
| XS2553801502 | SABSM 5 1/8 11/10/28 EMTN | 1'500'000 | EUR | 1'631'806 | 1'720'177 | 0.48 |
| XS2545206166 | BBVASM 4 3/8 10/14/29 GMTN | 1'000'000 | EUR | 1'114'054 | 1'149'718 | 0.32 |
| US05971KAQ22 | SANTAN 9 5/8 PERP _ | 1'800'000 | USD | 1'808'750 | 1'935'288 | 0.54 |
| US05964HAY18 | SANTAN 6.607 11/07/28 | 1'000'000 | USD | 1'001'400 | 1'062'350 | 0.30 |
| US05946KAM36 | BBVASM 9 3/8 PERP | 1'000'000 | USD | 982'000 | 1'060'400 | 0.30 |
| ES0840609053 | CABKSM 7 1/2 PERP | 1'000'000 | EUR | 1'106'753 | 1'113'154 | 0.31 |
| ES0344251022 | CAZAR 4 3/8 07/30/28 | 1'000'000 | EUR | 1'089'762 | 1'097'936 | 0.31 |
| | | | | 15'449'085 | 16'342'306 | 4.58 |
| | FR | | | | | |
| XS2737652474 | AXASA 6 3/8 PERP EMTN | 1'700'000 | EUR | 1'866'213 | 1'883'443 | 0.53 |
| XS1550938978 | AXASA 5 1/8 01/17/47 EMTN | 1'250'000 | USD | 1'280'500 | 1'238'538 | 0.35 |
| XS1346228577 | AXASA 3 3/8 07/06/47 EMTN | 1'000'000 | EUR | 1'114'839 | 1'064'556 | 0.30 |
| XS1115498260 | ORAFP 5 PERP EMTn | 1'000'000 | EUR | 974'811 | 1'112'253 | 0.31 |
| USF11494CB90 | BPCEGP 6.508 01/18/35 REGS | 1'000'000 | USD | 1'006'700 | 1'013'110 | 0.28 |
| USF1067PAD80 | BNP 9 1/4 PERP REGS | 1'000'000 | USD | 1'037'667 | 1'067'000 | 0.30 |
| USF1067PAB25 | BNP 4 5/8 PERP REGs | 1'000'000 | USD | 828'450 | 888'600 | 0.25 |
| US83368TBY38 | SOCGEN 7.132 01/19/55 REGS | 1'000'000 | USD | 1'000'193 | 999'690 | 0.28 |
| US83368TBR86 | SOCGEN 6.446 01/10/29 REGS | 1'000'000 | USD | 995'700 | 1'033'460 | 0.29 |
| US22535EAG26 | ACAFP 5.514 07/05/33 REGS | 1'500'000 | USD | 1'506'150 | 1'555'620 | 0.43 |
| US05581LAF67 | BNP 5.335 06/12/29 REGS | 1'000'000 | USD | 999'020 | 1'013'270 | 0.28 |
| FR001400N2U2 | ACAFP 6 1/2 PERP | 1'700'000 | EUR | 1'863'548 | 1'858'440 | 0.52 |
| FR001400M2F4 | RCFFP 5 1/4 11/22/28 EMTN | 1'500'000 | EUR | 1'628'795 | 1'724'234 | 0.48 |
| FR001400L1E0 | CARDFP 5 1/2 10/09/28 EMTN | 1'300'000 | EUR | 1'379'129 | 1'484'324 | 0.41 |
| FR001400KKC3 | VIEFP 5.993 PERP | 1'500'000 | EUR | 1'608'813 | 1'717'391 | 0.48 |
| FR001400I7P8 | BPCEGP 5 3/4 06/01/33 EMTN | 1'000'000 | EUR | 1'077'853 | 1'145'601 | 0.32 |
| FR001400I4X9 | BNP 4 1/8 05/24/33 EMTn | 1'000'000 | EUR | 1'085'248 | 1'148'914 | 0.32 |
| FR001400H9B5 | BNP 4 1/4 04/13/31 EMTN | 1'000'000 | EUR | 1'089'930 | 1'123'908 | 0.31 |
| FR001400GDJ1 | ORAFP 5 3/8 PERP EMTN | 1'000'000 | EUR | 1'141'842 | 1'141'658 | 0.32 |
| FR001400E797 | BPCEGP 4 11/29/32 EMTN | 1'500'000 | EUR | 1'589'843 | 1'694'107 | 0.47 |
| FR001400DZO1 | SOCGEN 4 1/4 11/16/32 emtn | 1'000'000 | EUR | 1'082'615 | 1'158'614 | 0.32 |
| FR0014002RQ0 | CNPFPP 4 7/8 PERP | 1'000'000 | USD | 866'681 | 814'650 | 0.23 |
| | | | | 27'024'540 | 27'881'381 | 7.78 |
| | GB | | | | | |
| XS2711945878 | BACR 7.09 11/06/29 | 1'000'000 | GBP | 1'220'534 | 1'354'836 | 0.38 |
| XS2690137299 | LLOYDS 4 3/4 09/21/31 EMTN | 1'700'000 | EUR | 1'804'774 | 1'939'027 | 0.54 |
| XS2675225531 | BRITEL 4 1/4 01/06/33 EMTN | 1'500'000 | EUR | 1'623'683 | 1'712'731 | 0.48 |
| XS2641168997 | UU 5 3/4 06/26/36 EMTN | 1'500'000 | GBP | 1'913'765 | 2'022'627 | 0.57 |
| XS2630493570 | VOD 8 08/30/2086 EMTN | 1'000'000 | GBP | 1'228'216 | 1'375'555 | 0.38 |
| XS2528858033 | NWG 4.067 09/06/28 EMTN | 1'000'000 | EUR | 998'850 | 1'105'062 | 0.31 |
| XS2485268150 | AVLN 6 7/8 PERP | 1'000'000 | GBP | 1'130'941 | 1'186'830 | 0.33 |
| XS2193663619 | BPLN 4 1/4 PERP | 500'000 | GBP | 732'081 | 601'635 | 0.17 |
| XS2193661324 | BPLN 3 1/4 PERP | 1'000'000 | EUR | 1'060'028 | 1'053'270 | 0.29 |
| XS2113658202 | NWIDE 5 3/4 PERP | 1'000'000 | GBP | 1'068'074 | 1'178'693 | 0.33 |
| XS2078692014 | STANLN 3.516 02/12/30 EMTN | 1'600'000 | USD | 1'603'672 | 1'544'144 | 0.43 |
| XS2057092236 | SSELN 2 1/4 09/27/35 EMTN | 1'000'000 | GBP | 1'331'312 | 966'714 | 0.27 |
| XS2051734981 | NGGLN 2 09/16/38 EMTN | 750'000 | GBP | 1'083'610 | 631'552 | 0.18 |

| ISIN Nummer | Bezeichnung | Stückzahl / Nennwert | Währung | Einstandswert | Marktwert | % des Netto- vermögens |
|--------------|----------------------------|-------------------------|---------|-------------------|-------------------|---------------------------|
| XS1907317660 | LGEM 5 1/8 11/14/48 | 1'000'000 | GBP | 1'396'809 | 1'241'856 | 0.35 |
| USG84228FQ64 | STANLN 6.301 01/09/29 REGS | 1'000'000 | USD | 1'020'600 | 1'029'120 | 0.29 |
| USG7420TAE67 | RKTLN 3 06/26/27 REGS | 2'000'000 | USD | 2'174'060 | 1'905'840 | 0.53 |
| US92857WBY57 | VOD 5 5/8 02/10/53 | 1'000'000 | USD | 849'220 | 1'007'370 | 0.28 |
| US92857WBX74 | VOD 5 1/8 06/04/2081 | 1'700'000 | USD | 1'738'700 | 1'287'563 | 0.36 |
| US636274AE20 | NGGLN 5.809 06/12/33 | 1'000'000 | USD | 1'008'350 | 1'039'860 | 0.29 |
| US636274AD47 | NGGLN 5.602 06/12/28 | 1'000'000 | USD | 1'006'610 | 1'028'770 | 0.29 |
| US404280DV88 | HSBC 6.254 03/09/34 | 1'800'000 | USD | 1'864'800 | 1'910'250 | 0.53 |
| | | | | 27'858'690 | 27'123'304 | 7.58 |
| IE | | | | | | |
| XS2626007939 | JCI 4 1/4 05/23/35 | 1'500'000 | EUR | 1'606'051 | 1'722'800 | 0.48 |
| XS1385999492 | ZURNVX 5 5/8 06/24/46 EMTN | 1'000'000 | USD | 1'071'562 | 1'001'060 | 0.28 |
| US00774MBC82 | AER 5 3/4 06/06/28 | 1'700'000 | USD | 1'686'536 | 1'734'612 | 0.48 |
| | | | | 4'364'149 | 4'458'472 | 1.24 |
| IT | | | | | | |
| XS2678939427 | ISPIM 9 1/8 PERP | 1'000'000 | EUR | 1'082'680 | 1'199'555 | 0.34 |
| XS2630420268 | ISPIM 6 5/8 05/31/33 EMTN | 1'000'000 | GBP | 1'224'896 | 1'348'673 | 0.38 |
| XS2576550086 | ENELIM 6 3/8 PERP EMTN | 1'500'000 | EUR | 1'632'639 | 1'731'827 | 0.48 |
| XS2545759099 | ISPIM 5 1/4 01/13/30 EMTN | 1'000'000 | EUR | 1'132'546 | 1'173'735 | 0.33 |
| | | | | 5'072'761 | 5'453'789 | 1.53 |
| JE | | | | | | |
| US03835VAJ52 | APTV 3.1 12/01/51 | 2'000'000 | USD | 1'956'280 | 1'310'080 | 0.37 |
| | | | | 1'956'280 | 1'310'080 | 0.37 |
| JP | | | | | | |
| US874060AX48 | TACHEM 2.05 03/31/30 | 1'000'000 | USD | 860'000 | 855'110 | 0.24 |
| US86562MDG24 | SUMIBK 5.716 09/14/28 | 1'800'000 | USD | 1'791'916 | 1'855'152 | 0.52 |
| US606822DD36 | MUFG 8.2 PERP | 600'000 | USD | 600'000 | 647'004 | 0.18 |
| US606822CY81 | MUFG 5.242 04/19/29 | 1'000'000 | USD | 959'510 | 1'010'400 | 0.28 |
| | | | | 4'211'426 | 4'367'666 | 1.22 |
| LI | | | | | | |
| CH1210198136 | SLHNVX 3 1/4 08/31/29 | 1'000'000 | EUR | 991'040 | 1'082'685 | 0.30 |
| | | | | 991'040 | 1'082'685 | 0.30 |
| LU | | | | | | |
| XS2589820294 | PRIFII 4 5/8 02/21/35 EMTN | 1'000'000 | EUR | 1'061'451 | 1'121'768 | 0.31 |
| USL6401PAM51 | BEEFBZ 8 7/8 09/13/33 REGS | 1'700'000 | USD | 1'727'680 | 1'791'783 | 0.50 |
| | | | | 2'789'131 | 2'913'551 | 0.81 |
| MX | | | | | | |
| USP1400MAC21 | BANORT 8 3/8 PERP REGS | 1'000'000 | USD | 982'300 | 987'300 | 0.28 |
| USPOR80BAG79 | SILAMX 5 3/8 04/04/32 REGS | 1'200'000 | USD | 1'165'350 | 1'115'616 | 0.31 |
| USP01703AC49 | ALPEKA 4 1/4 09/18/29 REGS | 2'000'000 | USD | 1'823'712 | 1'834'660 | 0.51 |
| | | | | 3'971'362 | 3'937'576 | 1.10 |
| NL | | | | | | |
| XS2728561098 | JDEPNA 4 1/8 01/23/30 EMTN | 1'150'000 | EUR | 1'256'380 | 1'282'626 | 0.36 |
| XS2681541327 | ZFFNGR 6 1/8 03/13/29 EMTN | 1'500'000 | EUR | 1'602'461 | 1'717'000 | 0.48 |
| XS2616652637 | NNGRNV 6 11/03/43 EMTN | 1'500'000 | EUR | 1'620'981 | 1'735'786 | 0.49 |
| XS2554581830 | ASRNED 7 12/07/43 | 1'500'000 | EUR | 1'573'541 | 1'847'203 | 0.52 |
| XS2536941656 | ABNANV 4 1/4 02/21/30 EMTN | 1'500'000 | EUR | 1'600'255 | 1'692'738 | 0.47 |
| XS2524746687 | INTNED 4 1/8 08/24/33 | 1'000'000 | EUR | 1'010'422 | 1'077'547 | 0.30 |

| ISIN Nummer | Bezeichnung | Stückzahl / Nennwert | Währung | Einstandswert | Marktwert | % des Netto- vermögens |
|--------------|-----------------------------|-------------------------|---------|-------------------|-------------------|---------------------------|
| XS2486270858 | KPN 6 PERP | 1'000'000 | EUR | 104'620 | 114'671 | 0.03 |
| XS2462605671 | TELEFO 7 1/8 PERP | 1'500'000 | EUR | 1'590'388 | 1'771'877 | 0.50 |
| XS2456432413 | RABOBK 4 7/8 PERP | 1'000'000 | EUR | 886'647 | 996'839 | 0.28 |
| XS1877860533 | RABOBK 4 5/8 PERP | 1'000'000 | EUR | 992'741 | 1'051'912 | 0.29 |
| XS1700709683 | ASRNED 4 5/8 PERP | 1'000'000 | EUR | 903'739 | 982'989 | 0.27 |
| XS1693822634 | ABNANV 4 3/4 PERP | 1'000'000 | EUR | 894'697 | 1'000'706 | 0.28 |
| US74977SDS86 | RABOBK 5.564 02/28/29 REGS | 2'000'000 | USD | 2'002'000 | 2'033'880 | 0.57 |
| US456837BH52 | INTNED 6.114 09/11/34 | 1'500'000 | USD | 1'504'521 | 1'572'735 | 0.44 |
| US456837AR44 | INTNED 5 3/4 PERP | 1'000'000 | USD | 884'800 | 943'390 | 0.26 |
| US007924AJ23 | AEGON 5 1/2 04/11/48 | 1'000'000 | USD | 1'180'833 | 964'020 | 0.27 |
| | | | | 19'609'025 | 20'785'920 | 5.81 |
| | NO | | | | | |
| XS2708134023 | VARNO 7.862 11/15/2083 | 1'000'000 | EUR | 1'155'985 | 1'162'155 | 0.32 |
| XS2635428274 | DNBNO 5 09/13/33 EMTN | 1'000'000 | EUR | 1'068'445 | 1'125'310 | 0.31 |
| US25601C2B81 | DNBNO 1.605 03/30/28 REGS | 1'200'000 | USD | 1'188'048 | 1'075'560 | 0.30 |
| | | | | 3'412'478 | 3'363'025 | 0.93 |
| | NZ | | | | | |
| USQ0553JAA99 | ASBBNK 5.284 06/17/32 REGS | 800'000 | USD | 787'120 | 787'624 | 0.22 |
| US06407F2G68 | BZLNZ 4.846 02/07/28 REGS | 2'000'000 | USD | 1'983'800 | 1'993'040 | 0.56 |
| US00216NAF69 | ASBBNK 5.398 11/29/27 REGS | 1'000'000 | USD | 1'009'450 | 1'015'270 | 0.28 |
| | | | | 3'780'370 | 3'795'934 | 1.06 |
| | PT | | | | | |
| PTEDP4OM0025 | EDPPL 5.943 04/23/2083 EMTN | 1'500'000 | EUR | 1'625'746 | 1'698'995 | 0.48 |
| | | | | 1'625'746 | 1'698'995 | 0.48 |
| | SE | | | | | |
| XS2526881532 | TELIAS 4 5/8 12/21/2082 | 1'500'000 | EUR | 1'509'558 | 1'639'262 | 0.46 |
| | | | | 1'509'558 | 1'639'262 | 0.46 |
| | SG | | | | | |
| US716973AG71 | PFE 5.3 05/19/53 | 2'000'000 | USD | 2'034'724 | 2'021'000 | 0.57 |
| | | | | 2'034'724 | 2'021'000 | 0.57 |
| | TH | | | | | |
| XS2056558088 | KBANK 3.343 10/02/31 EMTN | 1'000'000 | USD | 1'001'900 | 926'290 | 0.26 |
| USY06072AD75 | BBLTB 5 PERP REGS | 200'000 | USD | 207'750 | 194'674 | 0.05 |
| | | | | 1'209'650 | 1'120'964 | 0.31 |
| | US | | | | | |
| XS2644969698 | O 5 1/8 07/06/34 | 1'000'000 | EUR | 1'087'306 | 1'176'320 | 0.33 |
| XS2644969425 | O 4 7/8 07/06/30 | 1'000'000 | EUR | 1'085'036 | 1'148'849 | 0.32 |
| XS2625194811 | PLD 4 5/8 05/23/33 | 1'000'000 | EUR | 1'078'450 | 1'155'127 | 0.32 |
| USU9841MAA00 | WPROIN 1 1/2 06/23/26 REGS | 2'000'000 | USD | 1'992'462 | 1'845'700 | 0.52 |
| USU75000CH79 | ROSW 5.593 11/13/33 REGS | 1'600'000 | USD | 1'673'110 | 1'720'432 | 0.48 |
| USU01386AF57 | ALCSW 5 3/4 12/06/52 REGS | 1'000'000 | USD | 1'004'137 | 1'067'940 | 0.30 |
| USU01386AE82 | ALCSW 5 3/8 12/06/32 REGS | 1'000'000 | USD | 999'028 | 1'032'960 | 0.29 |
| US98978VAV53 | ZTS 5.6 11/16/32 | 1'000'000 | USD | 997'762 | 1'059'980 | 0.30 |
| US98956PAX06 | ZBH 5.35 12/01/28 | 1'000'000 | USD | 1'009'290 | 1'030'880 | 0.29 |
| US95000U3G61 | WFC 6.303 10/23/29 | 1'700'000 | USD | 1'694'373 | 1'793'245 | 0.50 |
| US94106LBT52 | WM 4 5/8 02/15/30 | 1'500'000 | USD | 1'499'655 | 1'510'035 | 0.42 |
| US928563AL97 | VMW 2.2 08/15/31 | 700'000 | USD | 659'435 | 578'837 | 0.16 |
| US928563AK15 | VMW 1.8 08/15/28 | 700'000 | USD | 674'485 | 615'328 | 0.17 |

| ISIN Nummer | Bezeichnung | Stückzahl / Nennwert | Währung | Einstandswert | Marktwert | % des Netto- vermögens |
|--------------|---------------------------|-------------------------|---------|---------------|-----------|---------------------------|
| US928563AE54 | VMW 4.65 05/15/27 | 1'000'000 | USD | 1'147'329 | 991'410 | 0.28 |
| US92826CAF95 | V 4.3 12/14/45 | 1'000'000 | USD | 1'426'580 | 928'210 | 0.26 |
| US92556VAF31 | VTRS 4 06/22/50 | 1'000'000 | USD | 661'160 | 711'180 | 0.20 |
| US92556VAE65 | VTRS 3.85 06/22/40 | 1'000'000 | USD | 889'005 | 759'650 | 0.21 |
| US92343VGT52 | VZ 5.05 05/09/33 | 1'000'000 | USD | 990'750 | 1'014'210 | 0.28 |
| US92343VES97 | VZ 3 7/8 02/08/29 | 1'000'000 | USD | 1'001'150 | 967'870 | 0.27 |
| US91324PES74 | UNH 5 7/8 02/15/53 | 4'000'000 | USD | 4'277'007 | 4'472'880 | 1.25 |
| US907818GC65 | UNP 4.95 09/09/52 | 1'000'000 | USD | 998'782 | 1'003'640 | 0.28 |
| US87264ADD46 | TMUS 6 06/15/54 | 1'500'000 | USD | 1'503'510 | 1'642'845 | 0.46 |
| US87264ADC62 | TMUS 5 3/4 01/15/34 | 1'500'000 | USD | 1'497'465 | 1'584'285 | 0.44 |
| US87264ACZ66 | TMUS 4.95 03/15/28 | 1'500'000 | USD | 1'492'800 | 1'513'485 | 0.42 |
| US863667BC42 | SYK 4.85 12/08/28 | 1'000'000 | USD | 999'030 | 1'011'170 | 0.28 |
| US75884RBA05 | REG 3.7 06/15/30 | 1'500'000 | USD | 1'379'130 | 1'395'690 | 0.39 |
| US747525BT99 | QCOM 6 05/20/53 | 2'500'000 | USD | 2'685'830 | 2'856'700 | 0.80 |
| US74432QCE35 | PRU 4.35 02/25/50 MTN | 1'500'000 | USD | 1'708'860 | 1'323'780 | 0.37 |
| US744320AY89 | PRU 3.905 12/07/47 | 986'000 | USD | 817'870 | 812'789 | 0.23 |
| US713448EP96 | PEP 2 7/8 10/15/49 | 1'000'000 | USD | 911'697 | 717'690 | 0.20 |
| US68389XCK90 | ORCL 6.9 11/09/52 | 1'500'000 | USD | 1'749'205 | 1'765'035 | 0.49 |
| US68389XCH61 | ORCL 6.15 11/09/29 | 2'000'000 | USD | 2'125'095 | 2'137'840 | 0.60 |
| US674599ED34 | OXY 6 5/8 09/01/30 | 1'700'000 | USD | 1'715'810 | 1'814'682 | 0.51 |
| US63111XAK72 | NDAQ 5.95 08/15/53 | 1'600'000 | USD | 1'621'211 | 1'719'568 | 0.48 |
| US63111XAH44 | NDAQ 5.35 06/28/28 | 1'600'000 | USD | 1'606'716 | 1'642'064 | 0.46 |
| US61747YFY77 | MS 6.342 10/18/33 | 1'750'000 | USD | 1'884'413 | 1'891'243 | 0.53 |
| US61747YEV39 | MS 6.296 10/18/28 | 2'000'000 | USD | 2'087'970 | 2'091'540 | 0.58 |
| US594918CE21 | MSFT 2.921 03/17/52 | 2'500'000 | USD | 2'582'453 | 1'808'425 | 0.51 |
| US59156RBN70 | MET 4.05 03/01/45 | 1'500'000 | USD | 1'681'665 | 1'304'745 | 0.36 |
| US58933YBM66 | MRK 5 05/17/53 | 2'000'000 | USD | 2'000'946 | 2'016'080 | 0.56 |
| US57636QAQ73 | MA 3.85 03/26/50 | 1'000'000 | USD | 1'344'520 | 860'590 | 0.24 |
| US574599BQ83 | MAS 2 02/15/31 | 1'000'000 | USD | 972'110 | 827'060 | 0.23 |
| US55903VAY92 | WBD 3.788 03/15/25 | 1'200'000 | USD | 1'198'464 | 1'178'172 | 0.33 |
| US548661EQ61 | LOW 5.15 07/01/33 | 1'500'000 | USD | 1'482'885 | 1'536'405 | 0.43 |
| US548661EM57 | LOW 5 5/8 04/15/53 | 1'500'000 | USD | 1'456'410 | 1'565'610 | 0.44 |
| US532457CG18 | LLY 4 7/8 02/27/53 | 2'500'000 | USD | 2'569'780 | 2'531'150 | 0.71 |
| US50077LAZ94 | KHC 4 7/8 10/01/49 | 1'700'000 | USD | 1'562'538 | 1'586'168 | 0.44 |
| US49446RAW97 | KIM 2.7 10/01/30 | 1'750'000 | USD | 1'545'365 | 1'524'635 | 0.43 |
| US487836BZ07 | K 5 1/4 03/01/33 | 1'800'000 | USD | 1'799'091 | 1'838'610 | 0.51 |
| US46647PDY97 | JPM 6.254 10/23/34 | 1'700'000 | USD | 1'686'196 | 1'846'540 | 0.52 |
| US46647PDX15 | JPM 6.087 10/23/29 | 1'700'000 | USD | 1'691'993 | 1'786'989 | 0.50 |
| US46647PDW32 | JPM 6.07 10/22/27 | 1'700'000 | USD | 1'696'175 | 1'749'300 | 0.49 |
| US459200KZ37 | IBM 5.1 02/06/53 | 1'000'000 | USD | 994'520 | 988'210 | 0.28 |
| US458140CJ73 | INTC 5.7 02/10/53 | 1'000'000 | USD | 1'026'990 | 1'061'870 | 0.30 |
| US458140CF51 | INTC 5 1/8 02/10/30 | 1'000'000 | USD | 1'008'830 | 1'031'650 | 0.29 |
| US44891CCP68 | HYNMTR 6.2 09/21/30 REGS | 1'000'000 | USD | 996'660 | 1'063'750 | 0.30 |
| US44891CCH43 | HYNMTR 5.68 06/26/28 REGS | 1'000'000 | USD | 996'201 | 1'028'400 | 0.29 |
| US42824CBP32 | HPE 5 1/4 07/01/28 | 2'000'000 | USD | 1'995'980 | 2'034'660 | 0.57 |
| US40434LAN55 | HPQ 5 1/2 01/15/33 | 1'700'000 | USD | 1'667'411 | 1'742'466 | 0.49 |
| US38141GA468 | GS 6.484 10/24/29 | 1'700'000 | USD | 1'696'056 | 1'806'250 | 0.51 |
| US37045VAY65 | GM 5.4 10/15/29 | 2'000'000 | USD | 1'973'070 | 2'034'460 | 0.57 |
| US370334CT90 | GIS 4.95 03/29/33 | 1'500'000 | USD | 1'509'201 | 1'506'615 | 0.42 |
| US36267VAH69 | GEHC 5.857 03/15/30 | 2'000'000 | USD | 2'036'134 | 2'106'120 | 0.59 |

| ISIN Nummer | Bezeichnung | Stückzahl / Nennwert | Währung | Einstandswert | Marktwert | % des Netto- vermögens |
|--------------|--------------------------|-------------------------|---------|--------------------|--------------------|---------------------------|
| US345397C684 | F 7.35 03/06/30 | 1'000'000 | USD | 1'002'100 | 1'071'260 | 0.30 |
| US345397C353 | F 7.35 11/04/27 | 1'000'000 | USD | 1'048'330 | 1'055'240 | 0.30 |
| US29444UBU97 | EQIX 3.9 04/15/32 | 1'500'000 | USD | 1'447'695 | 1'391'835 | 0.39 |
| US28622HAC51 | ELV 5 1/8 02/15/53 | 1'500'000 | USD | 1'432'515 | 1'476'450 | 0.41 |
| US24703TAG13 | DELL 5.3 10/01/29 | 1'000'000 | USD | 1'187'840 | 1'025'300 | 0.29 |
| US24703DBH35 | DELL 3.45 12/15/51 | 543'000 | USD | 516'246 | 390'585 | 0.11 |
| US24703DBF78 | DELL 3 3/8 12/15/41 | 1'000'000 | USD | 751'410 | 762'800 | 0.21 |
| US22822VBC46 | CCI 5.1 05/01/33 | 1'000'000 | USD | 1'001'731 | 990'170 | 0.28 |
| US22822VBA89 | CCI 5 01/11/28 | 1'000'000 | USD | 1'005'736 | 996'740 | 0.28 |
| US20030NEF42 | CMCSA 5.35 05/15/53 | 1'200'000 | USD | 1'180'836 | 1'228'776 | 0.34 |
| US20030NED93 | CMCSA 4.55 01/15/29 | 1'200'000 | USD | 1'187'964 | 1'204'080 | 0.34 |
| US20030NEC11 | CMCSA 4.65 02/15/33 | 1'200'000 | USD | 1'198'067 | 1'199'904 | 0.34 |
| US172967PA33 | C 6.27 11/17/33 | 1'500'000 | USD | 1'590'285 | 1'612'020 | 0.45 |
| US172967NX53 | C 5.61 09/29/26 | 2'000'000 | USD | 2'013'560 | 2'015'880 | 0.56 |
| US16411QAP63 | CQP 5.95 06/30/33 144A | 1'700'000 | USD | 1'701'926 | 1'740'919 | 0.49 |
| US161175BR49 | CHTR 5.05 03/30/29 | 1'500'000 | USD | 1'412'865 | 1'477'650 | 0.41 |
| US15135BAV36 | CNC 3 3/8 02/15/30 | 1'000'000 | USD | 833'370 | 897'870 | 0.25 |
| US15135BAT89 | CNC 4 5/8 12/15/29 | 1'000'000 | USD | 906'650 | 960'980 | 0.27 |
| US134429BJ73 | CPB 2 3/8 04/24/30 | 1'000'000 | USD | 1'019'040 | 865'510 | 0.24 |
| US126650DV97 | CVS 5 5/8 02/21/53 | 1'500'000 | USD | 1'435'080 | 1'499'040 | 0.42 |
| US126650DU15 | CVS 5 1/4 02/21/33 | 1'500'000 | USD | 1'492'602 | 1'519'815 | 0.42 |
| US126650DT42 | CVS 5 1/8 02/21/30 | 1'500'000 | USD | 1'488'180 | 1'518'000 | 0.42 |
| US126408HV80 | CSX 4 1/2 11/15/52 | 1'500'000 | USD | 1'372'440 | 1'370'865 | 0.38 |
| US11135FBV22 | AVGO 4.926 05/15/37 144A | 2'000'000 | USD | 1'796'227 | 1'937'200 | 0.54 |
| US110122EB03 | BMY 6 1/4 11/15/53 | 1'000'000 | USD | 1'000'610 | 1'138'090 | 0.32 |
| US110122DZ89 | BMY 5.9 11/15/33 | 1'500'000 | USD | 1'500'420 | 1'622'865 | 0.45 |
| US099724AL02 | BWA 2.65 07/01/27 | 1'500'000 | USD | 1'580'790 | 1'399'395 | 0.39 |
| US075887CJ64 | BDX 2.823 05/20/30 | 1'000'000 | USD | 1'048'370 | 894'390 | 0.25 |
| US06051GLC14 | BAC 6.204 11/10/28 | 2'500'000 | USD | 2'618'305 | 2'613'175 | 0.73 |
| US06051GKY43 | BAC 5.015 07/22/33 MTN | 1'000'000 | USD | 994'753 | 992'610 | 0.28 |
| US058498AZ97 | BALL 6 06/15/29 | 1'000'000 | USD | 1'000'000 | 1'011'170 | 0.28 |
| US058498AY23 | BALL 6 7/8 03/15/28 | 1'000'000 | USD | 1'029'500 | 1'033'040 | 0.29 |
| US052769AG12 | ADSK 2.85 01/15/30 | 1'000'000 | USD | 956'130 | 906'950 | 0.25 |
| US04636NAG88 | AZN 4.9 03/03/30 | 2'500'000 | USD | 2'395'476 | 2'569'600 | 0.72 |
| US03740LAF94 | AON 5 09/12/32 | 1'700'000 | USD | 1'705'436 | 1'707'021 | 0.48 |
| US036752AL74 | ELV 2 7/8 09/15/29 | 2'000'000 | USD | 1'787'590 | 1'831'680 | 0.51 |
| US03522AAH32 | ABIBB 4.7 02/01/36 | 2'000'000 | USD | 1'814'480 | 1'984'460 | 0.55 |
| US031162DT45 | AMGN 5.65 03/02/53 | 1'000'000 | USD | 997'085 | 1'035'260 | 0.29 |
| US031162DR88 | AMGN 5 1/4 03/02/33 | 1'000'000 | USD | 982'250 | 1'022'190 | 0.29 |
| US031162DQ06 | AMGN 5 1/4 03/02/30 | 1'000'000 | USD | 1'009'400 | 1'026'200 | 0.29 |
| US03040WBA27 | AWK 4.45 06/01/32 | 1'500'000 | USD | 1'475'021 | 1'478'910 | 0.41 |
| US03027XBZ24 | AMT 5.65 03/15/33 | 1'000'000 | USD | 1'025'640 | 1'034'460 | 0.29 |
| US03027XBY58 | AMT 5 1/2 03/15/28 | 1'500'000 | USD | 1'529'008 | 1'535'115 | 0.43 |
| US025816DF35 | AXP 5.043 05/01/34 | 2'000'000 | USD | 1'981'880 | 2'005'500 | 0.56 |
| US023135CJ31 | AMZN 3.95 04/13/52 | 1'500'000 | USD | 1'295'370 | 1'290'990 | 0.36 |
| US012653AE17 | ALB 5.05 06/01/32 | 1'000'000 | USD | 969'220 | 971'790 | 0.27 |
| US00287YAR09 | ABBV 4 1/2 05/14/35 | 4'000'000 | USD | 3'703'645 | 3'911'600 | 1.09 |
| US00206RMT67 | T 5.4 02/15/34 | 2'500'000 | USD | 2'458'050 | 2'570'300 | 0.72 |
| US00206RKG64 | T 1.65 02/01/28 | 1'000'000 | USD | 882'560 | 892'500 | 0.25 |
| | | | | 161'568'232 | 161'558'169 | 45.17 |

| ISIN Nummer | Bezeichnung | Stückzahl / Nennwert | Währung | Einstandswert | Marktwert | % des Netto- vermögens |
|---|---|-------------------------|---------|-------------------|--------------------|---------------------------|
| Summe - Anleihen | | | | | 327'015'778 | |
| Summe - Amtlich notierte sowie an anderen geregelten Märkten gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | | | | | 327'015'778 | |
| Anlagefonds | | | | | | |
| LU | | | | | | |
| LU2364759055 | SWC (LU) BF Resp. Corporate Hybrid STH USD | 150 | USD | 15'000'000 | 15'023'639 | 4.21 |
| | | | | 15'000'000 | 15'023'639 | 4.21 |
| Summe - Anlagefonds | | | | | 15'023'639 | |
| Summe - Anlagefonds | | | | | 15'023'639 | |
| SUMME DES WERTPAPIERBESTANDES | | | | | 342'039'416 | 95.63 |

13 Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Rates

Wertpapierbestand zum 31.01.2024 (Angaben in USD)

| ISIN Nummer | Bezeichnung | Stückzahl / Nennwert | Währung | Einstandswert | Marktwert | % des Netto- vermögens |
|---|----------------------------|-------------------------|---------|------------------|------------------|---------------------------|
| Amtlich notierte sowie an anderen geregelten Märkten gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | | | | | | |
| Anleihen | | | | | | |
| AE | | | | | | |
| XS2707149600 | MUBAUH 5 7/8 05/01/34 REGS | 350'000 | USD | 345'797 | 376'688 | 0.77 |
| | | | | 345'797 | 376'688 | 0.77 |
| AT | | | | | | |
| AT0000A33SH3 | RAGB 2.9 05/23/29 | 1'000'000 | EUR | 1'049'190 | 1'114'436 | 2.28 |
| AT0000A2Y8G4 | RAGB 1.85 05/23/49 | 100'000 | EUR | 77'958 | 86'639 | 0.18 |
| | | | | 1'127'147 | 1'201'075 | 2.46 |
| AU | | | | | | |
| AU3TB0000168 | ACGB 3 1/4 04/21/25 139 | 150'000 | AUD | 95'031 | 98'467 | 0.20 |
| AU000XCLWAP3 | ACGB 3 1/4 06/21/39 147 | 300'000 | AUD | 164'543 | 176'352 | 0.36 |
| AU0000087454 | ACGB 1 12/21/30 160 | 500'000 | AUD | 263'152 | 274'673 | 0.56 |
| | | | | 522'726 | 549'492 | 1.12 |
| BE | | | | | | |
| BE0000360694 | BGB 2.85 10/22/34 100 | 200'000 | EUR | 217'897 | 218'549 | 0.45 |
| BE0000350596 | BGB 0.4 06/22/40 90 | 800'000 | EUR | 500'812 | 570'376 | 1.17 |
| BE0000346552 | BGB 1 1/4 04/22/33 86 | 500'000 | EUR | 448'080 | 483'207 | 0.99 |
| | | | | 1'166'789 | 1'272'131 | 2.61 |
| BG | | | | | | |
| XS2536817211 | BGARIA 4 1/8 09/23/29 | 300'000 | EUR | 295'937 | 336'045 | 0.69 |
| | | | | 295'937 | 336'045 | 0.69 |
| BR | | | | | | |
| BRSTNCNTF1Q6 | BNTNF 10 01/01/29 NTNf | 2'000 | BRL | 408'404 | 401'467 | 0.82 |
| | | | | 408'404 | 401'467 | 0.82 |
| CA | | | | | | |
| CA135087M680 | CAN 1 3/4 12/01/53 | 200'000 | CAD | 93'721 | 106'969 | 0.22 |
| CA135087K940 | CAN 0 1/2 09/01/25 | 300'000 | CAD | 204'827 | 212'067 | 0.43 |
| CA135087F825 | CAN 1 06/01/27 | 300'000 | CAD | 197'592 | 207'224 | 0.42 |
| | | | | 496'140 | 526'259 | 1.07 |
| CH | | | | | | |
| CH0015803239 | SWISS 3 1/2 04/08/33 | 225'000 | CHF | 305'014 | 324'668 | 0.66 |
| | | | | 305'014 | 324'668 | 0.66 |
| CN | | | | | | |
| CND10004R114 | CGB 2.37 01/20/27 INBK | 3'500'000 | CNY | 475'851 | 490'211 | 1.00 |
| CND10002M200 | CGB 3.39 03/16/50 INBK | 3'500'000 | CNY | 490'654 | 550'026 | 1.13 |
| CND10002HV84 | CGB 3.13 11/21/29 1915 | 5'000'000 | CNY | 743'882 | 726'738 | 1.49 |
| | | | | 1'710'387 | 1'766'975 | 3.62 |
| CZ | | | | | | |
| CZ0001006894 | CZGB 4.9 04/14/34 151 | 3'000'000 | CZK | 134'779 | 142'519 | 0.29 |
| CZ0001005243 | CZGB 2 10/13/33 103 | 10'000'000 | CZK | 351'209 | 374'083 | 0.77 |
| CZ0001004253 | CZGB 2.4 09/17/25 89 | 1'500'000 | CZK | 70'894 | 63'821 | 0.13 |
| | | | | 556'882 | 580'423 | 1.19 |

| ISIN Nummer | Bezeichnung | Stückzahl / Nennwert | Währung | Einstandswert | Marktwert | % des Netto- vermögens |
|--------------|----------------------------|-------------------------|---------|------------------|------------------|---------------------------|
| DE | | | | | | |
| XS2322827382 | KFW 2.7 03/25/24 EMTN | 3'000'000 | CNY | 459'576 | 418'178 | 0.86 |
| DE000BU3Z005 | DBR 2.3 02/15/33 G | 600'000 | EUR | 614'781 | 662'705 | 1.36 |
| DE0001030757 | DBR 1.8 08/15/53 G | 300'000 | EUR | 253'547 | 285'075 | 0.58 |
| | | | | 1'327'904 | 1'365'957 | 2.80 |
| ES | | | | | | |
| ES0200002097 | ADIFAL 3 1/2 07/30/28 EMTN | 800'000 | EUR | 860'440 | 885'049 | 1.81 |
| ES0000012107 | SPGB 1 07/30/42 | 250'000 | EUR | 158'222 | 177'583 | 0.36 |
| ES0000012H41 | SPGB 0.1 04/30/31 | 300'000 | EUR | 247'093 | 268'182 | 0.55 |
| | | | | 1'265'755 | 1'330'813 | 2.72 |
| FI | | | | | | |
| FI4000348727 | RFGB 0 1/2 09/15/28 | 500'000 | EUR | 469'374 | 498'767 | 1.02 |
| | | | | 469'374 | 498'767 | 1.02 |
| GB | | | | | | |
| GB00BPCJD997 | UKT 3 3/4 10/22/53 | 200'000 | GBP | 205'423 | 225'276 | 0.46 |
| GB00BN65R313 | UKT 3 1/2 01/22/45 | 400'000 | GBP | 395'864 | 445'478 | 0.91 |
| GB00BMF9LF76 | UKT 4 10/22/63 | 200'000 | GBP | 230'245 | 236'477 | 0.48 |
| GB00BM8Z2V59 | UKT 1 1/2 07/31/53 | 350'000 | GBP | 211'770 | 232'566 | 0.48 |
| GB00BM8Z2S21 | UKT 0 7/8 07/31/33 | 300'000 | GBP | 266'775 | 292'753 | 0.60 |
| GB00B00NY175 | UKT 4 3/4 12/07/38 | 700'000 | GBP | 868'118 | 945'970 | 1.94 |
| GB0030880693 | UKT 5 03/07/25 | 400'000 | GBP | 492'578 | 511'840 | 1.05 |
| | | | | 2'670'772 | 2'890'360 | 5.92 |
| HK | | | | | | |
| HK0000929999 | HKINTL 3.3 06/07/33 GMTN | 1'000'000 | CNY | 140'335 | 144'238 | 0.30 |
| | | | | 140'335 | 144'238 | 0.30 |
| HU | | | | | | |
| HU0000404892 | HGB 2 1/4 06/22/34 34/A | 100'000'000 | HUF | 198'539 | 206'462 | 0.42 |
| | | | | 198'539 | 206'462 | 0.42 |
| ID | | | | | | |
| IDG000014101 | INDOGB 7 1/2 04/15/40 FR83 | '000'000'000 | IDR | 222'466 | 202'279 | 0.41 |
| IDG000012501 | INDOGB 7 3/8 05/15/48 FR76 | 300'000'000 | IDR | 20'667 | 20'055 | 0.04 |
| IDG000009507 | INDOGB 8 3/8 09/15/26 FR56 | '328'000'000 | IDR | 179'439 | 154'841 | 0.32 |
| | | | | 422'572 | 377'175 | 0.77 |
| IT | | | | | | |
| IT0005508590 | BTPS 4 04/30/35 13Y | 400'000 | EUR | 402'438 | 443'098 | 0.91 |
| IT0005484552 | BTPS 1.1 04/01/27 5Y | 300'000 | EUR | 291'381 | 308'672 | 0.63 |
| IT0005425233 | BTPS 1.7 09/01/51 31Y | 250'000 | EUR | 135'208 | 164'615 | 0.34 |
| IT0005162828 | BTPS 2.7 03/01/47 31Y | 200'000 | EUR | 168'631 | 170'126 | 0.35 |
| IT0004513641 | BTPS 5 03/01/25 16Y | 550'000 | EUR | 595'311 | 608'483 | 1.24 |
| | | | | 1'592'970 | 1'694'994 | 3.47 |
| JP | | | | | | |
| JP1400131L54 | JGB 0 1/2 03/20/60 13 | 100'000'000 | JPY | 471'025 | 443'845 | 0.91 |
| JP1201841P46 | JGB 1.1 03/20/43 184 | 165'000'000 | JPY | 1'063'241 | 1'061'509 | 2.17 |
| JP1201651J76 | JGB 0 1/2 06/20/38 165 | 300'000'000 | JPY | 1'877'111 | 1'882'587 | 3.85 |
| JP1103711P74 | JGB 0.4 06/20/33 371 | 175'000'000 | JPY | 1'146'460 | 1'168'140 | 2.39 |
| JP1103601LA4 | JGB 0.1 09/20/30 360 | 250'000'000 | JPY | 1'647'486 | 1'678'315 | 3.43 |
| JP1103411FC6 | JGB 0.3 12/20/25 341 | 350'000'000 | JPY | 2'387'699 | 2'406'125 | 4.92 |

| ISIN Nummer | Bezeichnung | Stückzahl / Nennwert | Währung | Einstandswert | Marktwert | % des Netto- vermögens |
|--------------|-------------------------------|-------------------------|---------|-------------------|-------------------|---------------------------|
| | | | | 8'593'023 | 8'640'521 | 17.67 |
| | KR | | | | | |
| KR103502GBC0 | KTB 2 3/8 12/10/31 3112 | '000'000'000 | KRW | 748'160 | 698'697 | 1.43 |
| KR103502GA34 | KTB 1 1/2 03/10/50 5003 | 550'000'000 | KRW | 305'409 | 290'413 | 0.59 |
| | | | | 1'053'570 | 989'110 | 2.02 |
| | MX | | | | | |
| XS2363910436 | MEX 2 1/4 08/12/36 | 300'000 | EUR | 354'640 | 252'559 | 0.52 |
| MX0MGO0000U2 | MBONO 7 3/4 11/23/34 M | 196'569 | MXN | 1'059'279 | 1'033'471 | 2.11 |
| | | | | 1'413'919 | 1'286'030 | 2.63 |
| | NL | | | | | |
| NL0012171458 | NETHER 0 3/4 07/15/27 | 500'000 | EUR | 490'470 | 516'554 | 1.06 |
| | | | | 490'470 | 516'554 | 1.06 |
| | NO | | | | | |
| NO0012712506 | NGB 3 1/2 10/06/42 485 | 1'000'000 | NOK | 91'289 | 97'350 | 0.20 |
| | | | | 91'289 | 97'350 | 0.20 |
| | PL | | | | | |
| PL0000115291 | POLGB 6 10/25/33 1033 | 1'250'000 | PLN | 341'765 | 332'613 | 0.68 |
| PL0000111498 | POLGB 2 3/4 10/25/29 1029 | 1'000'000 | PLN | 201'219 | 224'644 | 0.46 |
| | | | | 542'984 | 557'256 | 1.14 |
| | RO | | | | | |
| XS2538441598 | ROMANI 6 5/8 09/27/29 REGS | 150'000 | EUR | 149'321 | 175'281 | 0.36 |
| | | | | 149'321 | 175'281 | 0.36 |
| | RU | | | | | |
| RU000A100EG3 | RFLB 7.15 11/12/25 6229 | 50'000'000 | RUB | 736'179 | 56 | 0.00 |
| RU000A0JXQF2 | RFLB 7.1 10/16/24 6222 | 75'000'000 | RUB | 1'292'964 | 84 | 0.00 |
| | | | | 2'029'143 | 139 | 0.00 |
| | SE | | | | | |
| SE0017830730 | SGB 1 3/4 11/11/33 #1065 1065 | 4'000'000 | SEK | 321'334 | 372'206 | 0.76 |
| | | | | 321'334 | 372'206 | 0.76 |
| | US | | | | | |
| US91282CHW47 | T 4 1/8 08/31/30 | 2'000'000 | USD | 1'945'946 | 2'027'500 | 4.15 |
| US91282CHT18 | T 3 7/8 08/15/33 | 2'000'000 | USD | 1'901'038 | 1'990'625 | 4.07 |
| US91282CCX74 | T 0 3/8 09/15/24 | 2'000'000 | USD | 1'905'396 | 1'943'945 | 3.98 |
| US91282CAM38 | T 0 1/4 09/30/25 | 2'250'000 | USD | 2'045'782 | 2'104'585 | 4.31 |
| US91282CAL54 | T 0 3/8 09/30/27 | 1'400'000 | USD | 1'182'070 | 1'232'875 | 2.52 |
| US912828ZB95 | T 1 1/8 02/28/27 | 3'200'000 | USD | 2'834'820 | 2'940'000 | 6.00 |
| US912810TU25 | T 4 3/8 08/15/43 | 750'000 | USD | 714'993 | 759'316 | 1.55 |
| US912810TT51 | T 4 1/8 08/15/53 | 1'150'000 | USD | 1'061'534 | 1'138'051 | 2.33 |
| US912810TP30 | TII 1 1/2 02/15/53 | 200'000 | USD | 185'778 | 186'543 | 0.38 |
| | | | | 13'777'356 | 14'323'440 | 29.29 |
| | XS | | | | | |
| XS2749537481 | IDAWBG 3.2 01/18/44 GMTN | 800'000 | EUR | 875'229 | 868'720 | 1.78 |
| XS2472637136 | EBRD 2 3/4 04/27/32 GMTN | 4'000'000 | CNY | 608'638 | 574'131 | 1.17 |
| XS2437747210 | IBRD 2 1/4 01/19/29 GMTN | 3'000'000 | CNY | 431'569 | 414'552 | 0.85 |
| XS2306086872 | CAF 6.82 02/22/31 EMTN | 5'500'000 | MXN | 243'989 | 266'737 | 0.55 |
| XS2288098457 | IBRD 4 1/4 01/22/26 EMTN | 6'000'000 | MXN | 288'485 | 315'124 | 0.64 |
| XS2288097640 | IBRD 5 01/22/26 EMTN | 1'000'000 | BRL | 172'436 | 190'397 | 0.39 |

| ISIN Nummer | Bezeichnung | Stückzahl / Nennwert | Währung | Einstandswert | Marktwert | % des Netto- vermögens |
|---|-----------------------------|-------------------------|---------|------------------|-------------------|---------------------------|
| US4581X0EN43 | IADB 4 1/8 02/15/29 | 800'000 | USD | 796'888 | 805'552 | 1.65 |
| EU000A3LNF05 | EU 3 1/8 12/04/30 NGEU | 500'000 | EUR | 519'423 | 560'803 | 1.15 |
| EU000A3K4EN5 | EU 3 1/8 12/05/28 NGEU | 750'000 | EUR | 825'814 | 835'632 | 1.71 |
| | | | | 4'762'472 | 4'831'647 | 9.89 |
| Summe - Anleihen | | | | | 47'633'525 | |
| Optionen | | | | | | |
| | DE | | | | | |
| DE000F0JJS60 | EURO-BOBL OPTION Apr24P 119 | -1'500'000 | EUR | 37 | 0 | 0.00 |
| BOP000ZLX54 | FX Option:440000506_USD/CNY | 3'000'000 | USD | 0 | 1'296 | 0.00 |
| | | | | 37 | 1'296 | |
| Summe - Optionen | | | | | 1'296 | |
| Summe - Amtlich notierte sowie an anderen geregelten Märkten gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | | | | | 47'634'821 | |
| SUMME DES WERTPAPIERBESTANDES | | | | | 47'634'821 | 97.45 |

14 Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Secured High Yield

Wertpapierbestand zum 31.01.2024 (Angaben in USD)

| ISIN Nummer | Bezeichnung | Stückzahl / Nennwert | Währung | Einstandswert | Marktwert | % des Netto- vermögens |
|---|-----------------------------|-------------------------|---------|-------------------|-------------------|---------------------------|
| Amtlich notierte sowie an anderen geregelten Märkten gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | | | | | | |
| Anleihen | | | | | | |
| AT | | | | | | |
| XS2619047728 | BENTLR 9 3/8 05/15/28 REGS | 1'750'000 | EUR | 1'959'210 | 2'039'455 | 1.32 |
| | | | | 1'959'210 | 2'039'455 | 1.32 |
| AU | | | | | | |
| US603051AC70 | MINAU 8 11/01/27 144A | 300'000 | USD | 303'714 | 306'345 | 0.20 |
| | | | | 303'714 | 306'345 | 0.20 |
| CA | | | | | | |
| US91911KAN28 | BHCCN 5 1/2 11/01/25 144A | 600'000 | USD | 601'230 | 551'160 | 0.36 |
| US68245XAH26 | BCULC 3 7/8 01/15/28 144A | 500'000 | USD | 503'542 | 471'445 | 0.31 |
| US071734AP21 | BHCCN 6 1/8 02/01/27 144A | 1'400'000 | USD | 1'140'509 | 891'772 | 0.58 |
| US008911BK48 | ACACN 3 7/8 08/15/26 144A | 350'000 | USD | 327'250 | 332'875 | 0.22 |
| | | | | 2'572'531 | 2'247'252 | 1.46 |
| CO | | | | | | |
| US279158AT64 | ECOPET 8 5/8 01/19/29 | 600'000 | USD | 599'958 | 634'836 | 0.41 |
| US279158AS81 | ECOPET 8 7/8 01/13/33 | 300'000 | USD | 297'561 | 317'145 | 0.21 |
| | | | | 897'519 | 951'981 | 0.62 |
| CZ | | | | | | |
| XS2706258352 | ENGPRO 11 11/02/28 REGS | 700'000 | USD | 700'000 | 733'656 | 0.48 |
| | | | | 700'000 | 733'656 | 0.48 |
| DE | | | | | | |
| XS2649707846 | PRFINE 9 3/8 07/15/28 REGS | 2'500'000 | EUR | 2'725'720 | 2'796'953 | 1.82 |
| XS2623604233 | PELHOL 9 1/2 04/01/27 REGS | 1'650'000 | EUR | 1'707'945 | 1'825'162 | 1.18 |
| XS2615562274 | GRUPHA 6 3/4 05/15/30 REGS | 550'000 | EUR | 603'962 | 638'182 | 0.41 |
| XS2550063478 | SAZGR 7 1/2 08/21/26 REGS | 550'000 | EUR | 526'788 | 620'193 | 0.40 |
| XS2336345140 | CBRSER 5 1/2 04/15/26 REGS | 1'150'000 | EUR | 1'269'140 | 1'240'004 | 0.81 |
| XS2326497802 | DOUGR 6 04/08/26 REGS | 500'000 | EUR | 588'567 | 540'175 | 0.35 |
| XS2326493728 | HNDLIN 3 3/8 04/15/29 REGS | 500'000 | EUR | 591'525 | 508'136 | 0.33 |
| XS2199597456 | THYELE 4 3/8 07/15/27 REGS | 800'000 | EUR | 906'178 | 847'665 | 0.55 |
| XS1490159495 | IHOVER 3 3/4 09/15/26 REGS | 550'000 | EUR | 662'232 | 587'477 | 0.38 |
| USD6710TAC48 | IHOVER 4 3/4 09/15/26 REGS | 300'000 | USD | 281'250 | 289'398 | 0.19 |
| US80627DAC02 | IHOVER 4 3/4 09/15/26 144A | 400'000 | USD | 375'375 | 388'924 | 0.25 |
| | | | | 10'238'683 | 10'282'268 | 6.68 |
| DK | | | | | | |
| NO0012826033 | SKIBID Float 03/02/28 | 700'000 | EUR | 738'726 | 776'448 | 0.50 |
| | | | | 738'726 | 776'448 | 0.50 |
| ES | | | | | | |
| XS2647351142 | AMARAZ 10 1/4 07/15/28 REGS | 1'350'000 | EUR | 1'456'372 | 1'217'786 | 0.79 |
| XS2357281174 | NHHSM 4 07/02/26 REGS | 450'000 | EUR | 506'000 | 484'803 | 0.31 |
| XS2355632584 | ATLNSA 3 1/2 04/30/28 REGS | 900'000 | EUR | 872'480 | 790'751 | 0.51 |
| XS2240463674 | LORCAT 4 09/18/27 REGS | 2'050'000 | EUR | 2'210'595 | 2'170'404 | 1.41 |
| XS2077646391 | GRFSM 2 1/4 11/15/27 REGS | 1'250'000 | EUR | 1'311'384 | 1'240'183 | 0.81 |

| ISIN Nummer | Bezeichnung | Stückzahl / Nennwert | Währung | Einstandswert | Marktwert | % des Netto- vermögens |
|--------------|-----------------------------|-------------------------|---------|-------------------|-------------------|---------------------------|
| XS1812087598 | ATLNSA 3 3/8 04/30/26 REGS | 500'000 | EUR | 468'159 | 501'347 | 0.33 |
| | | | | 6'824'991 | 6'405'274 | 4.16 |
| | FI | | | | | |
| XS2319950130 | AHLMUN 3 5/8 02/04/28 REGS | 350'000 | EUR | 417'830 | 352'270 | 0.23 |
| | | | | 417'830 | 352'270 | 0.23 |
| | FR | | | | | |
| XS2732357525 | LOXAM 6 3/8 05/31/29 REGS | 750'000 | EUR | 816'084 | 839'534 | 0.55 |
| XS2712525109 | PAPREC 7 1/4 11/17/29 REGS | 1'000'000 | EUR | 1'108'817 | 1'163'654 | 0.76 |
| XS2553825949 | EOFP 7 1/4 06/15/26 | 350'000 | EUR | 349'983 | 396'866 | 0.26 |
| XS2401886788 | LOXAM 4 1/2 02/15/27 REGS | 900'000 | EUR | 997'802 | 975'746 | 0.63 |
| XS2397781944 | ILDFF 5 5/8 10/15/28 REGs | 700'000 | EUR | 782'262 | 764'518 | 0.50 |
| XS2349786835 | PAPREC 3 1/2 07/01/28 REGS | 750'000 | EUR | 857'162 | 777'781 | 0.50 |
| XS2294854745 | THOEUR 5 3/8 03/01/26 REGS | 1'000'000 | EUR | 1'070'796 | 1'098'077 | 0.71 |
| XS2247623643 | GETFP 3 1/2 10/30/25 | 450'000 | EUR | 514'375 | 484'994 | 0.31 |
| XS2232102876 | SFRFP 4 1/8 01/15/29 REGS | 850'000 | EUR | 803'838 | 705'723 | 0.46 |
| XS2053846262 | SFRFP 3 3/8 01/15/28 REGS | 350'000 | EUR | 288'274 | 294'641 | 0.19 |
| XS2031871069 | LOXAM 3 3/4 07/15/26 | 400'000 | EUR | 426'428 | 430'441 | 0.28 |
| XS2010034077 | KILOTO 3 3/8 12/15/26 REGS | 700'000 | EUR | 776'475 | 731'746 | 0.48 |
| XS1975699569 | LOXAM 2 7/8 04/15/26 REGS | 500'000 | EUR | 557'204 | 527'618 | 0.34 |
| US449691AA27 | ILDFF 6 1/2 10/15/26 144A | 300'000 | USD | 310'395 | 296'223 | 0.19 |
| US02156LAC54 | SFRFP 5 1/2 01/15/28 144a | 300'000 | USD | 297'750 | 236'793 | 0.15 |
| US02156LAA98 | SFRFP 8 1/8 02/01/27 144A | 1'400'000 | USD | 1'359'210 | 1'253'672 | 0.81 |
| FR001400MLX3 | ILDFF 5 3/8 02/15/29 | 700'000 | EUR | 760'865 | 779'854 | 0.51 |
| FR001400FV85 | ILDFF 5 5/8 02/15/30 | 700'000 | EUR | 753'314 | 790'249 | 0.51 |
| FR001400EJ15 | ILDFF 5 3/8 06/14/27 | 900'000 | EUR | 955'576 | 1'003'990 | 0.65 |
| | | | | 13'786'607 | 13'552'120 | 8.80 |
| | GB | | | | | |
| XS2719998952 | EGBLFN 11 11/30/28 REGs | 200'000 | EUR | 213'411 | 230'645 | 0.15 |
| XS2719090636 | STYRO 8 1/2 03/15/29 REGS | 1'250'000 | EUR | 1'378'566 | 1'440'555 | 0.94 |
| XS2696093033 | PURGYM 10 10/11/28 REGS | 1'050'000 | GBP | 1'265'678 | 1'407'549 | 0.91 |
| XS2660424008 | ICELTD 10 7/8 12/15/27 REGS | 450'000 | GBP | 581'396 | 614'839 | 0.40 |
| XS2643284388 | PEPGRP 7 1/4 07/01/28 REGS | 1'050'000 | EUR | 1'162'236 | 1'180'423 | 0.77 |
| XS2615937187 | SAZKAG 7 1/4 04/30/30 REGS | 500'000 | EUR | 548'675 | 575'663 | 0.37 |
| XS2587558474 | INEGRP 6 5/8 05/15/28 REGS | 300'000 | EUR | 322'860 | 334'816 | 0.22 |
| XS2558411224 | NEMEAN 13 1/4 12/15/26 REGS | 710'000 | GBP | 895'167 | 962'729 | 0.63 |
| XS2404741238 | ASSDLN 4 1/2 02/16/26 REGS | 300'000 | GBP | 293'856 | 365'661 | 0.24 |
| XS2397447025 | MODULA 4 3/4 11/30/28 REGS | 1'750'000 | EUR | 1'935'610 | 1'768'135 | 1.15 |
| XS2370618618 | SHODFP 6 1/2 08/01/26 REGS | 800'000 | GBP | 1'120'341 | 901'592 | 0.59 |
| XS2358483258 | VMED 4 1/2 07/15/31 REGS | 750'000 | GBP | 1'043'775 | 824'556 | 0.54 |
| XS2329602135 | GTWICK 4 3/8 04/07/26 | 850'000 | GBP | 1'143'458 | 1'045'392 | 0.68 |
| XS2303071992 | ASSDLN 3 1/4 02/16/26 REGS | 650'000 | GBP | 900'519 | 783'210 | 0.51 |
| XS2210014788 | STONPB 8 1/4 07/31/25 REGS | 250'000 | GBP | 299'396 | 308'321 | 0.20 |
| XS1843437549 | INEGRP 2 7/8 05/01/26 REGS | 400'000 | EUR | 460'063 | 426'583 | 0.28 |
| XS1120937617 | HTHROW 5 3/4 03/03/25 | 500'000 | GBP | 625'311 | 636'617 | 0.41 |
| USG64252AA01 | NEPENE 6 5/8 05/15/25 REGS | 600'000 | USD | 574'355 | 598'374 | 0.39 |
| USG49774AB18 | IAECN 9 07/15/26 REGS | 1'100'000 | USD | 1'095'559 | 1'099'956 | 0.71 |
| USG4289TAA19 | HBRLN 5 1/2 10/15/26 REGS | 950'000 | USD | 950'000 | 931'722 | 0.60 |
| US460599AF06 | IGT 4 1/8 04/15/26 144A | 500'000 | USD | 489'060 | 483'665 | 0.31 |
| US28228PAC59 | EGBLFN 12 11/30/28 144A | 500'000 | USD | 521'875 | 528'945 | 0.34 |

| ISIN Nummer | Bezeichnung | Stückzahl / Nennwert | Währung | Einstandswert | Marktwert | % des Netto- vermögens |
|--------------|-----------------------------|-------------------------|---------|-------------------|-------------------|---------------------------|
| US26151AAA79 | DRXLN 6 5/8 11/01/25 144A | 300'000 | USD | 301'500 | 298'605 | 0.19 |
| US20752TAA25 | ISATLN 6 3/4 10/01/26 144A | 550'000 | USD | 556'353 | 539'017 | 0.35 |
| | | | | 18'679'019 | 18'287'570 | 11.87 |
| | GI | | | | | |
| XS2498543102 | GAMHOL 7.558 07/15/27 REGS | 1'300'000 | EUR | 1'185'909 | 1'362'232 | 0.88 |
| | | | | 1'185'909 | 1'362'232 | 0.88 |
| | IE | | | | | |
| XS2187646901 | VMED 4 7/8 07/15/28 REGS | 750'000 | GBP | 944'738 | 874'564 | 0.57 |
| | | | | 944'738 | 874'564 | 0.57 |
| | IL | | | | | |
| XS2406607171 | TEVA 4 3/8 05/09/30 | 1'200'000 | EUR | 1'353'979 | 1'227'751 | 0.80 |
| | | | | 1'353'979 | 1'227'751 | 0.80 |
| | IT | | | | | |
| XS2750308483 | ATLIM 4 3/4 01/24/29 EMTN | 1'000'000 | EUR | 1'079'060 | 1'094'145 | 0.71 |
| XS2719293826 | INTDGP 10 11/15/28 REGS | 1'350'000 | EUR | 1'476'636 | 1'526'265 | 0.99 |
| XS2681940297 | IPGIM 7 09/27/28 | 500'000 | EUR | 530'518 | 574'012 | 0.37 |
| XS2582788100 | FIREBC 10 02/06/28 REGS | 1'400'000 | EUR | 1'517'142 | 1'609'985 | 1.05 |
| XS2581393134 | TITIM 6 7/8 02/15/28 | 450'000 | EUR | 487'395 | 520'672 | 0.34 |
| XS2548508881 | FEDRIG 11 10/25/27 REGS | 1'200'000 | EUR | 1'185'058 | 1'422'142 | 0.92 |
| XS2536848448 | GAMENT 9 3/4 09/30/27 REGS | 700'000 | EUR | 719'398 | 820'010 | 0.53 |
| XS2437324333 | IPGIM 3 7/8 07/28/26 | 550'000 | EUR | 623'975 | 589'676 | 0.38 |
| XS2394823418 | EOLOSP 4 7/8 10/21/28 REGS | 250'000 | EUR | 277'336 | 217'996 | 0.14 |
| XS2389112736 | ITLYUM 4 5/8 10/01/26 REGS | 550'000 | EUR | 569'391 | 577'578 | 0.37 |
| XS2291911282 | MANTEN 7 1/4 02/01/26 REGS | 1'300'000 | EUR | 1'390'491 | 1'315'901 | 0.85 |
| XS2275090749 | IMAIM 3 3/4 01/15/28 REGS | 500'000 | EUR | 606'475 | 523'974 | 0.34 |
| | | | | 10'462'876 | 10'792'355 | 7.01 |
| | JE | | | | | |
| XS2615792194 | TRAVEL 10 1/4 04/28/28 REGS | 700'000 | GBP | 855'528 | 938'776 | 0.61 |
| XS2230739059 | CPKLN 6 1/2 08/28/26 | 400'000 | GBP | 521'000 | 498'866 | 0.32 |
| | | | | 1'376'528 | 1'437'642 | 0.93 |
| | KY | | | | | |
| USG53901AA58 | LBTCOR 10 7/8 01/15/31 REGS | 800'000 | USD | 800'000 | 823'752 | 0.53 |
| US41984LAA52 | HA 5 3/4 01/20/26 144A | 1'100'000 | USD | 1'025'879 | 1'034'583 | 0.67 |
| | | | | 1'825'879 | 1'858'335 | 1.21 |
| | LU | | | | | |
| XS2760863329 | LHMCFI 6 1/2 03/15/29 REGS | 1'050'000 | EUR | 1'137'829 | 1'139'135 | 0.74 |
| XS2649695736 | LHMCFI 7 7/8 07/31/28 REGS | 1'100'000 | EUR | 1'202'747 | 1'253'386 | 0.81 |
| XS2623489627 | DAN 8 1/2 07/15/31 REGS | 1'100'000 | EUR | 1'242'670 | 1'308'039 | 0.85 |
| XS2615006470 | CABBCO 8 3/4 05/01/28 REGS | 1'050'000 | EUR | 1'168'042 | 1'186'936 | 0.77 |
| XS2550380104 | LHMCFI 10 3/8 11/30/27 REGS | 950'000 | EUR | 1'016'123 | 1'112'654 | 0.72 |
| XS2423013742 | EDRSM 5 1/2 07/15/27 REGS | 700'000 | EUR | 695'806 | 753'568 | 0.49 |
| XS2406727151 | KEMONE 5 5/8 11/15/28 REGS | 450'000 | EUR | 406'028 | 400'156 | 0.26 |
| XS2399700959 | AGKLN 5 1/4 10/15/26 REGS | 1'100'000 | EUR | 1'179'092 | 1'185'326 | 0.77 |
| XS2298381307 | KPERST 4 1/4 03/01/26 REGS | 1'150'000 | EUR | 1'075'241 | 1'103'968 | 0.72 |
| XS2102493389 | ALTICE 3 01/15/28 REGS | 1'200'000 | EUR | 1'052'445 | 1'147'730 | 0.75 |
| XS2067263850 | KANGRP 5 3/4 10/31/26 REGS | 600'000 | EUR | 688'112 | 638'277 | 0.41 |
| XS2010025836 | STENA 7 1/4 02/15/28 REGS | 400'000 | EUR | 436'860 | 461'177 | 0.30 |
| XS1881594946 | ROSINI 6 3/4 10/30/25 REGS | 250'000 | EUR | 287'741 | 272'404 | 0.18 |

| ISIN Nummer | Bezeichnung | Stückzahl / Nennwert | Währung | Einstandswert | Marktwert | % des Netto- vermögens |
|--------------|----------------------------|-------------------------|---------|-------------------|-------------------|---------------------------|
| XS1720690889 | MATTER 4 11/15/27 REGS | 400'000 | EUR | 435'418 | 429'342 | 0.28 |
| USL65266AA36 | MOVIBZ 5 1/4 02/08/31 REGS | 600'000 | USD | 600'900 | 524'268 | 0.34 |
| USL6401PAM51 | BEEFBZ 8 7/8 09/13/33 REGS | 400'000 | USD | 400'000 | 421'596 | 0.27 |
| USL62788AE12 | STENA 7 1/4 01/15/31 REGS | 800'000 | USD | 800'000 | 804'528 | 0.52 |
| US85858EAB92 | STENA 6 1/8 02/01/25 144A | 500'000 | USD | 499'929 | 500'185 | 0.32 |
| US02154CAH60 | ALTICE 5 3/4 08/15/29 144a | 500'000 | USD | 436'250 | 436'105 | 0.28 |
| US013304AA87 | AGKLN 6 1/8 10/15/26 144A | 300'000 | USD | 274'500 | 296'400 | 0.19 |
| CH1282945554 | MATTER 5 1/4 07/31/28 | 500'000 | CHF | 576'469 | 604'418 | 0.39 |
| BE6300372289 | TNETBB 5 1/2 03/01/28 144A | 800'000 | USD | 745'385 | 760'256 | 0.49 |
| | | | | 16'357'585 | 16'739'853 | 10.87 |
| MU | | | | | | |
| USV3856JAA17 | GRNKEN 5 1/2 04/06/25 REGS | 800'000 | USD | 794'857 | 788'168 | 0.51 |
| | | | | 794'857 | 788'168 | 0.51 |
| MX | | | | | | |
| USP71340AD81 | TNEMAK 3 5/8 06/28/31 REGS | 250'000 | USD | 186'563 | 201'625 | 0.13 |
| | | | | 186'563 | 201'625 | 0.13 |
| NL | | | | | | |
| XS2696111389 | WRLDPY 8 1/2 01/15/31 REGS | 350'000 | GBP | 429'815 | 479'840 | 0.31 |
| XS2681541327 | ZFFNGR 6 1/8 03/13/29 EMTN | 600'000 | EUR | 659'424 | 686'800 | 0.45 |
| XS2541618299 | HOUSEH 9 11/03/29 REGS | 1'100'000 | EUR | 1'144'416 | 1'227'565 | 0.80 |
| XS2434783911 | ADRBID 5 1/4 02/01/30 REGS | 1'350'000 | EUR | 1'518'217 | 1'364'635 | 0.89 |
| XS2431015655 | ZIGGO 3 1/2 01/15/32 REGS | 1'550'000 | EUR | 1'531'906 | 1'525'940 | 0.99 |
| XS2333565815 | DUFNSW 3 5/8 04/15/26 | 250'000 | CHF | 264'799 | 291'286 | 0.19 |
| XS2272845798 | ZIGGO 2 7/8 01/15/29 REGS | 200'000 | EUR | 242'670 | 189'561 | 0.12 |
| XS2232108568 | MAXDIY 5 7/8 10/01/26 REGS | 750'000 | EUR | 586'659 | 662'381 | 0.43 |
| XS2111947748 | ADRBID 3 5/8 02/15/28 REGS | 350'000 | EUR | 386'593 | 349'703 | 0.23 |
| XS2111946930 | ADRBID 3 1/8 02/15/26 REGS | 500'000 | EUR | 548'043 | 524'457 | 0.34 |
| XS2078976805 | PPFTEL 2 1/8 01/31/25 EMTN | 350'000 | EUR | 370'821 | 373'442 | 0.24 |
| XS2034068432 | TRIVIU 3 3/4 08/15/26 REGS | 1'650'000 | EUR | 1'823'473 | 1'748'093 | 1.13 |
| XS1713568811 | CSTM 4 1/4 02/15/26 REGS | 300'000 | EUR | 372'999 | 325'118 | 0.21 |
| XS1629969327 | UPCB 3 7/8 06/15/29 REGS | 1'100'000 | EUR | 1'212'283 | 1'138'164 | 0.74 |
| US91845AAA34 | ZIGGO 5 01/15/32 144a | 600'000 | USD | 453'000 | 521'994 | 0.34 |
| | | | | 11'545'117 | 11'408'980 | 7.41 |
| SE | | | | | | |
| XS2493887264 | PREEM 12 06/30/27 REGS | 850'000 | EUR | 828'559 | 901'439 | 0.59 |
| XS2289588837 | VERISR 3 1/4 02/15/27 REGS | 650'000 | EUR | 786'013 | 680'714 | 0.44 |
| | | | | 1'614'571 | 1'582'152 | 1.03 |
| US | | | | | | |
| XS2623496085 | F 6 1/8 05/15/28 | 700'000 | EUR | 776'520 | 820'147 | 0.53 |
| XS2332250708 | OGN 2 7/8 04/30/28 REGS | 650'000 | EUR | 622'881 | 659'101 | 0.43 |
| XS2310487074 | AMPBEV 2 09/01/28 REGS | 750'000 | EUR | 798'335 | 708'524 | 0.46 |
| XS2205083749 | AVTR 3 7/8 07/15/28 REGS | 450'000 | EUR | 507'848 | 478'004 | 0.31 |
| US98877DAE58 | ZFFNGR 7 1/8 04/14/30 144A | 300'000 | USD | 309'858 | 316'317 | 0.21 |
| US98310WAS70 | TNL 6 5/8 07/31/26 144A | 500'000 | USD | 498'125 | 505'260 | 0.33 |
| US92339LAA08 | VRTV 10 1/2 11/30/30 144A | 1'100'000 | USD | 1'100'000 | 1'134'749 | 0.74 |
| US92332YAD31 | VENLNG 9 7/8 02/01/32 144A | 1'350'000 | USD | 1'391'500 | 1'421'226 | 0.92 |
| US92332YAC57 | VENLNG 9 1/2 02/01/29 144A | 600'000 | USD | 621'716 | 636'792 | 0.41 |
| US92328MAA18 | VENTGL 3 7/8 08/15/29 144A | 700'000 | USD | 649'959 | 628'012 | 0.41 |

| ISIN Nummer | Bezeichnung | Stückzahl / Nennwert | Währung | Einstandswert | Marktwert | % des Netto- vermögens |
|---|-----------------------------|-------------------------|---------|-------------------|--------------------|---------------------------|
| US91327TAA97 | UNIT 10 1/2 02/15/28 144A | 600'000 | USD | 608'063 | 609'996 | 0.40 |
| US896818AU56 | TGI 9 03/15/28 144A | 500'000 | USD | 500'000 | 528'600 | 0.34 |
| US896522AJ82 | TRN 7 3/4 07/15/28 144A | 400'000 | USD | 404'250 | 417'952 | 0.27 |
| US893647BS53 | TDG 6 7/8 12/15/30 144A | 1'250'000 | USD | 1'254'688 | 1'283'925 | 0.83 |
| US88033GDQ01 | THC 6 1/8 06/15/30 | 2'300'000 | USD | 2'258'086 | 2'304'462 | 1.50 |
| US88033GDB32 | THC 5 1/8 11/01/27 | 200'000 | USD | 199'312 | 195'148 | 0.13 |
| US855170AA41 | SYNH 9 10/01/30 144A | 600'000 | USD | 600'000 | 631'482 | 0.41 |
| US81105DAA37 | SSP 3 7/8 01/15/29 144A | 500'000 | USD | 441'250 | 432'365 | 0.28 |
| US747262AM52 | QVCN 5.95 03/15/43 | 900'000 | USD | 815'684 | 538'983 | 0.35 |
| US74166NAA28 | ADT 4 7/8 07/15/32 144A | 450'000 | USD | 374'603 | 413'280 | 0.27 |
| US74166MAC01 | PRSESE 5 3/4 04/15/26 144A | 600'000 | USD | 593'756 | 600'270 | 0.39 |
| US70052LAA17 | PK 7 1/2 06/01/25 144A | 250'000 | USD | 255'530 | 251'585 | 0.16 |
| US68622TAA97 | OGN 4 1/8 04/30/28 144a | 1'000'000 | USD | 926'485 | 915'660 | 0.59 |
| US599191AA16 | UAL 6 1/2 06/20/27 144A | 200'000 | USD | 114'236 | 140'423 | 0.09 |
| US57767XAA81 | MHED 5 3/4 08/01/28 144A | 500'000 | USD | 445'000 | 472'550 | 0.31 |
| US45174HBC07 | IHRT 6 3/8 05/01/26 | 450'000 | USD | 466'437 | 386'735 | 0.25 |
| US35908MAE03 | FYBR 8 5/8 03/15/31 144A | 350'000 | USD | 351'737 | 354'904 | 0.23 |
| US35908MAD20 | FYBR 8 3/4 05/15/30 144A | 700'000 | USD | 729'837 | 716'912 | 0.47 |
| US35906ABE73 | FYBR 5 7/8 10/15/27 144A | 1'100'000 | USD | 1'036'571 | 1'057'694 | 0.69 |
| US345397C353 | F 7.35 11/04/27 | 200'000 | USD | 200'000 | 211'048 | 0.14 |
| US30015DAA90 | EVGRN 9 3/4 04/26/28 144A | 520'000 | USD | 521'438 | 557'367 | 0.36 |
| US25470XBF15 | DISH 5 3/4 12/01/28 144A | 200'000 | USD | 161'544 | 135'556 | 0.09 |
| US25470XBE40 | DISH 5 1/4 12/01/26 144A | 1'400'000 | USD | 1'371'557 | 1'108'660 | 0.72 |
| US25470MAG42 | DISH 11 3/4 11/15/27 144A | 800'000 | USD | 819'170 | 834'272 | 0.54 |
| US25461LAB80 | DTV 8 7/8 02/01/30 144A | 1'000'000 | USD | 1'010'181 | 1'021'950 | 0.66 |
| US20903XAF06 | CNSL 6 1/2 10/01/28 144A | 950'000 | USD | 749'125 | 826'918 | 0.54 |
| US20338QAD51 | COMM 6 03/01/26 144A | 900'000 | USD | 873'859 | 780'453 | 0.51 |
| US17302XAN66 | CITPET 8 3/8 01/15/29 144A | 750'000 | USD | 746'875 | 778'845 | 0.51 |
| US16411RAK59 | LNG 4 5/8 10/15/28 | 350'000 | USD | 332'046 | 339'780 | 0.22 |
| US14366RAA77 | CCL 10 3/8 05/01/28 144A | 500'000 | USD | 492'325 | 547'690 | 0.36 |
| US12543DBN93 | CYH 10 7/8 01/15/32 144A | 700'000 | USD | 708'500 | 733'334 | 0.48 |
| US12543DBK54 | CYH 4 3/4 02/15/31 144A | 800'000 | USD | 603'742 | 638'384 | 0.41 |
| US12543DBD12 | CYH 8 12/15/27 144A | 1'250'000 | USD | 1'245'688 | 1'231'275 | 0.80 |
| US1248EPCE15 | CHTR 4 1/2 08/15/30 144A | 500'000 | USD | 435'000 | 434'120 | 0.28 |
| US03674XAS53 | AR 5 3/8 03/01/30 144A | 200'000 | USD | 208'750 | 190'828 | 0.12 |
| US023771T402 | AAL 8 1/2 05/15/29 144A | 800'000 | USD | 800'975 | 848'392 | 0.55 |
| | | | | 30'933'041 | 30'779'929 | 19.98 |
| | XS | | | | | |
| XS2342057143 | UNSEAM 3 5/8 06/01/28 REGs | 600'000 | EUR | 738'006 | 596'761 | 0.39 |
| XS2036387525 | ARGID 2 1/8 08/15/26 REGs | 600'000 | EUR | 615'366 | 586'848 | 0.38 |
| US100018AB62 | BORRNO 10 3/8 11/15/30 144a | 450'000 | USD | 455'875 | 467'276 | 0.30 |
| US100018AA89 | BORRNO 10 11/15/28 144A | 750'000 | USD | 750'150 | 778'860 | 0.51 |
| US00253XAB73 | AAL 5 3/4 04/20/29 144A | 700'000 | USD | 755'125 | 688'492 | 0.45 |
| US00253XAA90 | AAL 5 1/2 04/20/26 144A | 500'000 | USD | 389'531 | 372'060 | 0.24 |
| EU000A3K4EK1 | EUB 0 04/05/24 6M | 2'200'000 | EUR | 2'297'571 | 2'373'950 | 1.54 |
| | | | | 6'001'624 | 5'864'246 | 3.81 |
| Summe - Anleihen | | | | | 140'852'471 | |
| Summe - Amtlich notierte sowie an anderen geregelten Märkten gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | | | | | 140'852'471 | |
| Anlagefonds | | | | | | |

| ISIN Nummer | Bezeichnung | Stückzahl / Nennwert | Währung | Einstandswert | Marktwert | % des Netto- vermögens |
|--------------------------------------|------------------------------|-------------------------|---------|------------------|--------------------|---------------------------|
| Anlagefonds | | | | | | |
| GB | | | | | | |
| IE00BYM31M36 | ISHARES FALLEN ANGEL HY CORP | 1'150'000 | USD | 6'097'515 | 6'059'350 | 3.93 |
| | | | | 6'097'515 | 6'059'350 | 3.93 |
| Summe - Anlagefonds | | | | | 6'059'350 | |
| Summe - Anlagefonds | | | | | 6'059'350 | |
| SUMME DES WERTPAPIERBESTANDES | | | | | 146'911'821 | 95.38 |

15 Swisscanto (LU) Bond Fund Sustainable Global Credit

Wertpapierbestand zum 31.01.2024 (Angaben in CHF)

| ISIN Nummer | Bezeichnung | Stückzahl / Nennwert | Währung | Einstandswert | Marktwert | % des Netto- vermögens |
|---|----------------------------|-------------------------|---------|------------------|------------------|---------------------------|
| Amtlich notierte sowie an anderen geregelten Märkten gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | | | | | | |
| Anleihen | | | | | | |
| AT | | | | | | |
| USA35155AB50 | KLAB 7 04/03/49 REGS | 500'000 | USD | 535'996 | 431'477 | 0.25 |
| AT0000A32562 | ERSTBK 4 01/16/31 | 500'000 | EUR | 489'888 | 483'792 | 0.28 |
| AT0000A2J645 | ERSTBK 1 5/8 09/08/31 EMTN | 700'000 | EUR | 757'996 | 611'232 | 0.36 |
| | | | | 1'783'879 | 1'526'500 | 0.89 |
| AU | | | | | | |
| XS2577127967 | ANZ 5.101 02/03/33 EMTN | 500'000 | EUR | 501'673 | 479'435 | 0.28 |
| XS1808838434 | TQLAU 4 1/2 04/19/28 EMTN | 1'117'000 | USD | 1'079'982 | 928'715 | 0.54 |
| USQ08328AA64 | ANZ 6 3/4 PERP REGS | 1'000'000 | USD | 1'087'058 | 865'734 | 0.51 |
| US961214EW94 | WSTP 1.953 11/20/28 | 500'000 | USD | 456'525 | 379'547 | 0.22 |
| US55608XAB38 | MQGAU 4 7/8 06/10/25 144A | 1'000'000 | USD | 1'003'464 | 848'920 | 0.50 |
| US2027A0JN00 | CBAAU 3.9 07/12/47 144A | 500'000 | USD | 474'695 | 363'278 | 0.21 |
| | | | | 4'603'398 | 3'865'629 | 2.26 |
| BE | | | | | | |
| BE6343825251 | LONNVX 3 7/8 05/25/33 | 300'000 | EUR | 289'485 | 290'965 | 0.17 |
| BE0002961424 | KBCBB 8 PERP | 400'000 | EUR | 381'851 | 396'818 | 0.23 |
| | | | | 671'335 | 687'783 | 0.40 |
| CA | | | | | | |
| US94106BAD38 | WCNCN 2.95 01/15/52 | 500'000 | USD | 263'687 | 296'687 | 0.17 |
| US94106BAC54 | WCNCN 2.2 01/15/32 | 960'000 | USD | 883'441 | 684'037 | 0.40 |
| US89115A2C54 | TD 4.108 06/08/27 | 1'700'000 | USD | 1'544'900 | 1'431'351 | 0.84 |
| US78016FZX58 | RY 5 02/01/33 GMTN | 1'450'000 | USD | 1'264'933 | 1'248'149 | 0.73 |
| US13648TAA51 | CP 2.05 03/05/30 | 900'000 | USD | 827'235 | 664'524 | 0.39 |
| US136375DB52 | CNRCN 4.4 08/05/52 | 1'000'000 | USD | 835'908 | 789'008 | 0.46 |
| CA87971MCC51 | TCN 5 3/4 09/08/33 | 1'000'000 | CAD | 633'278 | 681'516 | 0.40 |
| CA13645RAZ79 | CP 3.15 03/13/29 | 1'000'000 | CAD | 775'866 | 607'741 | 0.36 |
| CA136375CX83 | CNRCN 3.05 02/08/50 | 1'000'000 | CAD | 547'242 | 482'786 | 0.28 |
| CA07813ZCK80 | BCECN 5.85 11/10/32 | 1'500'000 | CAD | 1'027'928 | 1'034'698 | 0.61 |
| | | | | 8'604'418 | 7'920'497 | 4.64 |
| CH | | | | | | |
| USH42097ES26 | UBS 9 1/4 PERP REGs | 400'000 | USD | 364'162 | 367'256 | 0.22 |
| USH42097EQ69 | UBS 6.301 09/22/34 REGS | 500'000 | USD | 451'119 | 454'888 | 0.27 |
| USH42097DT18 | UBS 5.959 01/12/34 REGS | 1'050'000 | USD | 983'829 | 931'647 | 0.55 |
| CH0521617305 | HELNSW 1 1/2 PERP | 1'000'000 | CHF | 1'000'000 | 967'750 | 0.57 |
| CH0506668869 | UBS 3 PERP | 600'000 | CHF | 539'067 | 567'150 | 0.33 |
| | | | | 3'338'177 | 3'288'691 | 1.94 |
| DE | | | | | | |
| XS2751678272 | ENBW 5 1/4 01/23/2084 | 1'300'000 | EUR | 1'234'040 | 1'231'934 | 0.72 |
| XS2722190795 | DBHNGR 4 11/23/43 EMTN | 300'000 | EUR | 298'272 | 301'770 | 0.18 |
| XS2549815913 | HANRUE 5 7/8 08/26/43 | 600'000 | EUR | 622'728 | 623'249 | 0.37 |
| XS2221845683 | MUNRE 1 1/4 05/26/41 | 600'000 | EUR | 638'136 | 464'111 | 0.27 |
| XS2218405772 | MRKGR 1 5/8 09/09/2080 | 900'000 | EUR | 970'430 | 786'632 | 0.46 |

| ISIN Nummer | Bezeichnung | Stückzahl / Nennwert | Währung | Einstandswert | Marktwert | % des Netto- vermögens |
|--------------|----------------------------|-------------------------|---------|------------------|------------------|---------------------------|
| XS2056730679 | IFXGR 3 5/8 PERP | 500'000 | EUR | 564'968 | 448'349 | 0.26 |
| XS2010039548 | DBHNGR 1.6 PERP CB | 1'000'000 | EUR | 778'622 | 798'306 | 0.47 |
| USX10001AB51 | ALVGR 3.2 PERP REGS | 200'000 | USD | 182'890 | 137'639 | 0.08 |
| US018820AA81 | ALVGR 3 1/2 PERP 144A | 1'400'000 | USD | 1'264'123 | 1'091'460 | 0.64 |
| DE000DL19WL7 | DB 1 7/8 02/23/28 EMTN | 1'100'000 | EUR | 1'148'311 | 967'405 | 0.57 |
| DE000CZ45W57 | CMZB 3 09/14/27 | 500'000 | EUR | 492'913 | 456'479 | 0.27 |
| DE000A3MQQV5 | DBOERS 2 06/23/48 | 700'000 | EUR | 691'153 | 597'618 | 0.35 |
| DE000A3823H4 | ALVGR 4.851 07/26/54 | 300'000 | EUR | 279'002 | 286'873 | 0.17 |
| | | | | 9'165'588 | 8'191'826 | 4.81 |
| ES | | | | | | |
| XS2726256113 | CABKSM 4 3/8 11/29/33 EMTN | 900'000 | EUR | 867'467 | 883'849 | 0.52 |
| XS2674597468 | BBVASM 8 1/4 11/30/33 EMTN | 900'000 | GBP | 1'049'603 | 1'053'317 | 0.62 |
| XS2580221658 | IBESM 4 7/8 PERP EMTN | 400'000 | EUR | 375'020 | 379'288 | 0.22 |
| XS2552369469 | REESM 4 5/8 PERP | 1'200'000 | EUR | 1'206'081 | 1'145'702 | 0.67 |
| XS2455392584 | SABSM 2 5/8 03/24/26 EMTN | 1'000'000 | EUR | 1'038'216 | 917'357 | 0.54 |
| XS2385393587 | CLNXSM 2 09/15/32 EMTN | 500'000 | EUR | 396'856 | 404'986 | 0.24 |
| US05971KAQ22 | SANTAN 9 5/8 PERP _ | 1'200'000 | USD | 1'102'619 | 1'106'791 | 0.65 |
| US05971KAG40 | SANTAN 2.749 12/03/30 | 1'600'000 | USD | 1'345'783 | 1'134'929 | 0.67 |
| ES0840609053 | CABKSM 7 1/2 PERP | 400'000 | EUR | 381'471 | 381'968 | 0.22 |
| ES0813211028 | BBVASM 6 PERP | 1'000'000 | EUR | 975'315 | 924'700 | 0.54 |
| | | | | 8'738'431 | 8'332'887 | 4.89 |
| FR | | | | | | |
| XS2737652474 | AXASA 6 3/8 PERP EMTN | 800'000 | EUR | 749'201 | 760'335 | 0.45 |
| XS2610457967 | AXASA 5 1/2 07/11/43 EMTN | 400'000 | EUR | 396'284 | 398'424 | 0.23 |
| XS1346228577 | AXASA 3 3/8 07/06/47 EMTN | 500'000 | EUR | 521'456 | 456'615 | 0.27 |
| XS1134541306 | AXASA 3.941 PERP EMTN | 250'000 | EUR | 311'075 | 231'564 | 0.14 |
| USF8500RAC63 | SOCGEN 9 3/8 PERP REGS | 500'000 | USD | 483'087 | 445'889 | 0.26 |
| USF2R125Q730 | ACAFP 6.251 01/10/35 REGS | 800'000 | USD | 698'402 | 700'712 | 0.41 |
| USF11494CB90 | BPCEGP 6.508 01/18/35 REGS | 1'000'000 | USD | 848'318 | 869'096 | 0.51 |
| USF1067PAB25 | BNP 4 5/8 PERP REGs | 1'000'000 | USD | 721'848 | 762'286 | 0.45 |
| US83368TBY38 | SOCGEN 7.132 01/19/55 REGS | 250'000 | USD | 213'763 | 214'396 | 0.13 |
| US83368TBD90 | SOCGEN 2.889 06/09/32 REGS | 200'000 | USD | 179'710 | 141'665 | 0.08 |
| US22536PAK75 | ACAFP 5.335 01/10/30 REGS | 500'000 | USD | 430'641 | 430'272 | 0.25 |
| US09660V2C60 | BNP 2.824 01/26/41 REGS | 1'400'000 | USD | 1'243'830 | 830'905 | 0.49 |
| US05578QAB95 | BPCEGP 5.15 07/21/24 144A | 1'000'000 | USD | 1'083'866 | 853'887 | 0.50 |
| FR001400NCB6 | SOCGEN 5 3/4 01/22/32 EMTN | 400'000 | GBP | 433'714 | 441'525 | 0.26 |
| FR001400N6I8 | BFCM 3 3/4 02/03/34 EMTN | 300'000 | EUR | 276'528 | 280'826 | 0.16 |
| FR001400N2U2 | ACAFP 6 1/2 PERP | 400'000 | EUR | 377'642 | 375'121 | 0.22 |
| FR001400M2F4 | RCFFP 5 1/4 11/22/28 EMTN | 400'000 | EUR | 385'453 | 394'436 | 0.23 |
| FR001400L461 | SUEZFP 6 5/8 10/05/43 EMTN | 600'000 | GBP | 702'663 | 731'989 | 0.43 |
| FR001400KZP3 | SOCGEN 4 1/4 09/28/26 | 500'000 | EUR | 484'749 | 477'204 | 0.28 |
| FR001400KKC3 | VIEFP 5.993 PERP | 500'000 | EUR | 491'444 | 491'088 | 0.29 |
| FR001400KHI6 | ENGIFP 4 1/2 09/06/42 EMTN | 1'000'000 | EUR | 990'157 | 990'162 | 0.58 |
| FR001400I4X9 | BNP 4 1/8 05/24/33 EMTn | 500'000 | EUR | 486'272 | 492'798 | 0.29 |
| FR001400I3C5 | BNFP 3.47 05/22/31 EMTN | 300'000 | EUR | 291'919 | 285'084 | 0.17 |
| FR001400FB22 | BPCEGP 5 1/8 01/25/35 EMTN | 500'000 | EUR | 498'971 | 477'772 | 0.28 |
| FR001400F877 | SOCGEN 7 7/8 PERP EMTN | 300'000 | EUR | 302'009 | 287'703 | 0.17 |
| FR001400F1G3 | ENGIFP 3 5/8 01/11/30 eMTN | 500'000 | EUR | 490'258 | 474'781 | 0.28 |
| FR001400DQ84 | SUEZFP 4 5/8 11/03/28 EMTN | 700'000 | EUR | 693'144 | 687'347 | 0.40 |

| ISIN Nummer | Bezeichnung | Stückzahl / Nennwert | Währung | Einstandswert | Marktwert | % des Netto- vermögens |
|--------------|------------------------------|-------------------------|---------|-------------------|-------------------|---------------------------|
| FR0014005EJ6 | BNFP 1 PERP | 1'000'000 | EUR | 1'091'518 | 857'431 | 0.50 |
| | | | | 15'877'920 | 14'841'310 | 8.71 |
| | GB | | | | | |
| XS2742660660 | MOTOPG 3 7/8 01/24/34 EMTN | 200'000 | EUR | 186'835 | 190'015 | 0.11 |
| XS2741906809 | NGGLN 5.35 07/10/39 EMTN | 500'000 | GBP | 537'648 | 541'304 | 0.32 |
| XS2692259398 | AVLN 6 7/8 11/27/53 | 950'000 | GBP | 1'062'509 | 1'080'244 | 0.63 |
| XS2690137299 | LLOYDS 4 3/4 09/21/31 EMTN | 500'000 | EUR | 476'408 | 489'234 | 0.29 |
| XS2678308359 | MOTOPG 5 5/8 09/11/35 emtn | 450'000 | GBP | 497'655 | 522'578 | 0.31 |
| XS2641168997 | UU 5 3/4 06/26/36 EMTN | 500'000 | GBP | 570'680 | 578'370 | 0.34 |
| XS2636324274 | BRITEL 8 3/8 12/20/2083 EMTN | 500'000 | GBP | 568'092 | 585'668 | 0.34 |
| XS2596458591 | BXBAU 4 1/4 03/22/31 emtn | 300'000 | EUR | 290'811 | 294'001 | 0.17 |
| XS2574871997 | MOTOPG 4 7/8 01/17/43 EMTN | 600'000 | GBP | 693'212 | 626'316 | 0.37 |
| XS2403426427 | PRUFIN 2.95 11/03/33 EMTN | 1'000'000 | USD | 917'550 | 760'029 | 0.45 |
| XS2258827034 | NWG 5 1/8 PERP | 500'000 | GBP | 643'219 | 493'270 | 0.29 |
| XS2113658202 | NWIDE 5 3/4 PERP | 400'000 | GBP | 405'814 | 404'457 | 0.24 |
| XS2083961370 | LGEN 3 3/4 11/26/49 EMTN | 500'000 | GBP | 483'962 | 490'588 | 0.29 |
| XS2078692014 | STANLN 3.516 02/12/30 EMTN | 400'000 | USD | 396'637 | 331'161 | 0.19 |
| XS2057092236 | SSELN 2 1/4 09/27/35 EMTN | 500'000 | GBP | 396'557 | 414'648 | 0.24 |
| XS1713495759 | IRM 3 7/8 11/15/25 REGS | 650'000 | GBP | 802'006 | 691'432 | 0.41 |
| XS1395052639 | STANLN 4.05 04/12/26 REGS | 500'000 | USD | 521'745 | 419'304 | 0.25 |
| USG84228EP90 | STANLN 4 3/4 PERP REGS | 300'000 | USD | 263'805 | 208'450 | 0.12 |
| US92857WBX74 | VOD 5 1/8 06/04/2081 | 1'000'000 | USD | 584'707 | 649'727 | 0.38 |
| US92857WBU36 | VOD 4 1/4 09/17/50 | 1'300'000 | USD | 871'331 | 919'475 | 0.54 |
| US639057AC29 | NWG 1.642 06/14/27 | 200'000 | USD | 179'170 | 157'613 | 0.09 |
| US53944YAU73 | LLOYDS 4.976 08/11/33 | 600'000 | USD | 548'887 | 500'154 | 0.29 |
| US404280DL07 | HSBC 6 1/2 05/02/36 | 2'000'000 | USD | 2'176'749 | 1'792'117 | 1.05 |
| | | | | 14'075'989 | 13'140'155 | 7.71 |
| | IE | | | | | |
| XS2626007939 | JCI 4 1/4 05/23/35 | 600'000 | EUR | 577'783 | 591'162 | 0.35 |
| XS2555925218 | AIB 5 3/4 02/16/29 | 800'000 | EUR | 799'119 | 800'904 | 0.47 |
| XS2528657567 | BKIR 7.594 12/06/32 EMTN | 650'000 | GBP | 741'671 | 736'416 | 0.43 |
| XS2283177561 | ZURNVX 3 04/19/51 EMTN | 800'000 | USD | 710'513 | 561'453 | 0.33 |
| XS1108784510 | SRENVX 4 1/2 09/11/44 | 750'000 | USD | 757'219 | 636'336 | 0.37 |
| US47837RAA86 | JCI 1 3/4 09/15/30 | 1'150'000 | USD | 1'056'824 | 820'949 | 0.48 |
| | | | | 4'643'129 | 4'147'218 | 2.43 |
| | IT | | | | | |
| XS2678939427 | ISPIM 9 1/8 PERP | 650'000 | EUR | 624'837 | 668'875 | 0.39 |
| XS2630420268 | ISPIM 6 5/8 05/31/33 EMTN | 625'000 | GBP | 716'700 | 723'099 | 0.42 |
| XS2625196352 | ISPIM 4 7/8 05/19/30 EMTN | 300'000 | EUR | 291'919 | 296'914 | 0.17 |
| XS2609970848 | ASSGEN 5.399 04/20/33 EMTN | 200'000 | EUR | 196'369 | 197'598 | 0.12 |
| XS2437854487 | TRNIM 2 3/8 PERP | 900'000 | EUR | 930'719 | 770'732 | 0.45 |
| XS2360310044 | UCGIM 0.8 07/05/29 EMTN | 500'000 | EUR | 549'032 | 415'441 | 0.24 |
| XS2317069685 | ISPIM 0 3/4 03/16/28 EMTN | 1'000'000 | EUR | 824'569 | 842'941 | 0.49 |
| XS2056491587 | ASSGEN 2.124 10/01/30 EMTN | 1'000'000 | EUR | 1'019'556 | 824'183 | 0.48 |
| | | | | 5'153'701 | 4'739'782 | 2.76 |
| | JE | | | | | |
| US03835VAJ52 | APTV 3.1 12/01/51 | 1'000'000 | USD | 893'091 | 561'926 | 0.33 |
| US03835VAG14 | APTV 4.35 03/15/29 | 500'000 | USD | 515'213 | 421'363 | 0.25 |
| | | | | 1'408'304 | 983'289 | 0.58 |

| ISIN Nummer | Bezeichnung | Stückzahl / Nennwert | Währung | Einstandswert | Marktwert | % des Netto- vermögens |
|--------------|----------------------------|-------------------------|---------|-------------------|-------------------|---------------------------|
| JP | | | | | | |
| USJ5S39RAJ36 | NTT 4.239 07/25/25 REGS | 300'000 | USD | 291'120 | 254'511 | 0.15 |
| US86562MDG24 | SUMIBK 5.716 09/14/28 | 500'000 | USD | 453'784 | 442'067 | 0.26 |
| US65535HAS85 | NOMURA 2.679 07/16/30 | 1'000'000 | USD | 930'784 | 731'643 | 0.43 |
| US606822DD36 | MUFG 8.2 PERP | 500'000 | USD | 466'919 | 462'527 | 0.27 |
| US438127AB80 | HNDA 2.534 03/10/27 | 1'400'000 | USD | 1'294'618 | 1'129'855 | 0.66 |
| | | | | 3'437'225 | 3'020'604 | 1.77 |
| KR | | | | | | |
| USY8085FBU31 | HYUELE 5 1/2 01/16/29 REGS | 800'000 | USD | 699'396 | 690'631 | 0.40 |
| | | | | 699'396 | 690'631 | 0.40 |
| KY | | | | | | |
| US81180WAR25 | STX 4 7/8 06/01/27 | 503'000 | USD | 498'808 | 424'193 | 0.25 |
| | | | | 498'808 | 424'193 | 0.25 |
| LU | | | | | | |
| XS2447550893 | PRIFII 3 02/22/42 EMTN | 350'000 | GBP | 436'154 | 279'632 | 0.16 |
| XS2431319107 | LOGICR 2 01/17/34 EMTN | 600'000 | EUR | 620'521 | 435'776 | 0.26 |
| XS2197076651 | HELNSW 2 3/4 09/30/41 | 500'000 | EUR | 529'368 | 406'221 | 0.24 |
| | | | | 1'586'042 | 1'121'628 | 0.66 |
| NL | | | | | | |
| XS2728561098 | JDEPNA 4 1/8 01/23/30 EMTN | 300'000 | EUR | 288'784 | 287'035 | 0.17 |
| XS2728560959 | JDEPNA 4 1/2 01/23/34 emTN | 300'000 | EUR | 290'834 | 292'346 | 0.17 |
| XS2715941949 | SDZSW 4 1/2 11/17/33 | 600'000 | EUR | 576'871 | 598'178 | 0.35 |
| XS2694995163 | ASRNED 3 5/8 12/12/28 | 100'000 | EUR | 94'085 | 93'950 | 0.06 |
| XS2681541327 | ZFFNGR 6 1/8 03/13/29 EMTN | 600'000 | EUR | 572'456 | 589'171 | 0.35 |
| XS2646608401 | TELEFO 6 3/4 PERP | 300'000 | EUR | 287'866 | 302'285 | 0.18 |
| XS2624554320 | OI 6 1/4 05/15/28 REGS | 200'000 | EUR | 194'862 | 194'348 | 0.11 |
| XS2590262296 | ABNANV 5 1/8 02/22/28 EMTN | 600'000 | GBP | 665'947 | 661'612 | 0.39 |
| XS2585240984 | INTNED 7 1/2 PERP | 900'000 | USD | 793'456 | 766'854 | 0.45 |
| XS2554581830 | ASRNED 7 12/07/43 | 1'200'000 | EUR | 1'206'390 | 1'267'698 | 0.74 |
| XS2526486159 | NNGRNV 5 1/4 03/01/43 EMTN | 800'000 | EUR | 761'621 | 763'317 | 0.45 |
| XS2486270858 | KPN 6 PERP | 800'000 | EUR | 778'918 | 786'963 | 0.46 |
| XS2462605671 | TELEFO 7 1/8 PERP | 500'000 | EUR | 493'740 | 506'668 | 0.30 |
| XS2456432413 | RABOBK 4 7/8 PERP | 1'000'000 | EUR | 901'884 | 855'138 | 0.50 |
| XS2350756446 | INTNED 0 7/8 06/09/32 EMTN | 100'000 | EUR | 109'159 | 83'526 | 0.05 |
| XS2303052695 | CTPNV 0 3/4 02/18/27 EMTN | 450'000 | EUR | 484'267 | 381'286 | 0.22 |
| XS2295333988 | IBESM 1.825 PERP NC9 | 1'200'000 | EUR | 896'432 | 964'821 | 0.57 |
| XS2207430120 | TENN 2.374 PERP | 800'000 | EUR | 816'527 | 722'860 | 0.42 |
| XS1813579593 | DAR 3 5/8 05/15/26 REGS | 100'000 | EUR | 114'787 | 92'936 | 0.05 |
| XS1076781589 | NNGRNV 4 3/8 PERP EMTN | 121'000 | EUR | 144'800 | 112'695 | 0.07 |
| USN4580HAC18 | INTNED 1.4 07/01/26 REGS | 500'000 | USD | 473'307 | 406'278 | 0.24 |
| USN4580HAA51 | INTNED 4 5/8 01/06/26 REGS | 1'300'000 | USD | 1'334'519 | 1'109'484 | 0.65 |
| US82620KAU79 | SIEGR 3.4 03/16/27 144A | 500'000 | USD | 531'734 | 414'475 | 0.24 |
| US74977SDJ87 | RABOBK 1.004 09/24/26 REGS | 750'000 | USD | 682'688 | 599'862 | 0.35 |
| | | | | 13'495'936 | 12'853'787 | 7.54 |
| NO | | | | | | |
| XS2325328313 | STBNO 1 7/8 09/30/51 | 1'000'000 | EUR | 1'080'482 | 749'720 | 0.44 |
| XS2075280995 | DNBNO 4 7/8 PERP | 750'000 | USD | 735'118 | 633'370 | 0.37 |
| US25601C2B81 | DNBNO 1.605 03/30/28 REGS | 400'000 | USD | 368'940 | 307'556 | 0.18 |

| ISIN Nummer | Bezeichnung | Stückzahl / Nennwert | Währung | Einstandswert | Marktwert | % des Netto- vermögens |
|--------------|-----------------------------|-------------------------|---------|------------------|------------------|---------------------------|
| | | | | 2'184'540 | 1'690'646 | 0.99 |
| | NZ | | | | | |
| US00216NAD12 | ASBBNK 1 5/8 10/22/26 REGS | 1'000'000 | USD | 920'191 | 784'435 | 0.46 |
| | | | | 920'191 | 784'435 | 0.46 |
| | PL | | | | | |
| XS2388876232 | MBKPW 0.966 09/21/27 EMTN | 500'000 | EUR | 543'172 | 409'133 | 0.24 |
| | | | | 543'172 | 409'133 | 0.24 |
| | PT | | | | | |
| PTEDPUOM0008 | EDPPL 3 7/8 06/26/28 EMTN | 200'000 | EUR | 195'265 | 190'952 | 0.11 |
| PTEDPROM0029 | EDPPL 1 7/8 08/02/2081 | 500'000 | EUR | 426'753 | 436'925 | 0.26 |
| PTEDP4OM0025 | EDPPL 5.943 04/23/2083 EMTN | 800'000 | EUR | 798'569 | 777'324 | 0.46 |
| | | | | 1'420'586 | 1'405'201 | 0.83 |
| | SE | | | | | |
| XS2526881532 | TELIAS 4 5/8 12/21/2082 | 300'000 | EUR | 285'803 | 281'248 | 0.16 |
| | | | | 285'803 | 281'248 | 0.16 |
| | SG | | | | | |
| US716973AE24 | PFE 4 3/4 05/19/33 | 300'000 | USD | 268'442 | 255'901 | 0.15 |
| US24023LAF31 | DBSSP 1.194 03/15/27 REGS | 750'000 | USD | 688'913 | 579'988 | 0.34 |
| | | | | 957'354 | 835'889 | 0.49 |
| | US | | | | | |
| XS2595036554 | APD 4 03/03/35 | 400'000 | EUR | 393'772 | 393'299 | 0.23 |
| XS2386220698 | LLY 1 3/8 09/14/61 | 700'000 | EUR | 746'678 | 392'696 | 0.23 |
| XS2346207892 | AMT 0 7/8 05/21/29 | 1'100'000 | EUR | 1'052'771 | 895'069 | 0.52 |
| XS2251742537 | AVTR 2 5/8 11/01/25 REGS | 700'000 | EUR | 701'801 | 639'006 | 0.37 |
| XS1891174341 | DLR 2 1/2 01/16/26 | 250'000 | EUR | 287'761 | 227'052 | 0.13 |
| USU9841MAA00 | WPROIN 1 1/2 06/23/26 REGS | 400'000 | USD | 358'271 | 316'667 | 0.19 |
| USU75000CH79 | ROSW 5.593 11/13/33 REGS | 1'500'000 | USD | 1'374'170 | 1'383'631 | 0.81 |
| USU01386AF57 | ALCSW 5 3/4 12/06/52 REGS | 500'000 | USD | 485'761 | 458'066 | 0.27 |
| US98956PAX06 | ZBH 5.35 12/01/28 | 500'000 | USD | 438'836 | 442'170 | 0.26 |
| US98877DAE58 | ZFFNGR 7 1/8 04/14/30 144A | 150'000 | USD | 135'549 | 135'676 | 0.08 |
| US95040QAF19 | WELL 4.95 09/01/48 | 1'000'000 | USD | 1'092'136 | 808'781 | 0.47 |
| US94106LBS79 | WM 4.15 04/15/32 | 1'850'000 | USD | 1'642'271 | 1'534'587 | 0.90 |
| US928563AL97 | VMW 2.2 08/15/31 | 400'000 | USD | 368'373 | 283'746 | 0.17 |
| US928563AC98 | VMW 3.9 08/21/27 | 1'000'000 | USD | 1'020'662 | 829'850 | 0.49 |
| US92556VAF31 | VTRS 4 06/22/50 | 800'000 | USD | 438'095 | 488'069 | 0.29 |
| US92343VGL27 | VZ 2.85 09/03/41 | 1'400'000 | USD | 1'045'377 | 882'860 | 0.52 |
| US92343VGK44 | VZ 3.4 03/22/41 | 400'000 | USD | 370'005 | 272'834 | 0.16 |
| US92343VES97 | VZ 3 7/8 02/08/29 | 750'000 | USD | 819'102 | 622'715 | 0.36 |
| US91324PEU21 | UNH 4 1/4 01/15/29 | 1'000'000 | USD | 917'078 | 851'631 | 0.50 |
| US91324PED06 | UNH 2.3 05/15/31 | 350'000 | USD | 315'444 | 258'546 | 0.15 |
| US91324PDV13 | UNH 3 7/8 08/15/59 | 250'000 | USD | 258'076 | 173'069 | 0.10 |
| US907818GC65 | UNP 4.95 09/09/52 | 500'000 | USD | 481'495 | 430'486 | 0.25 |
| US907818FX12 | UNP 2.8 02/14/32 | 1'500'000 | USD | 1'304'826 | 1'134'048 | 0.66 |
| US87264ADD46 | TMUS 6 06/15/54 | 700'000 | USD | 618'103 | 657'680 | 0.39 |
| US87264ADC62 | TMUS 5 3/4 01/15/34 | 1'000'000 | USD | 892'208 | 906'053 | 0.53 |
| US871829BK24 | SYU 2.4 02/15/30 | 1'000'000 | USD | 755'516 | 755'852 | 0.44 |
| US871503AU26 | GEN 5 04/15/25 144A | 600'000 | USD | 592'480 | 512'131 | 0.30 |
| US863667BC42 | SYK 4.85 12/08/28 | 1'000'000 | USD | 873'146 | 867'432 | 0.51 |

| ISIN Nummer | Bezeichnung | Stückzahl / Nennwert | Währung | Einstandswert | Marktwert | % des Netto- vermögens |
|--------------|------------------------|-------------------------|---------|---------------|-----------|---------------------------|
| US857477BF90 | STT 3.031 11/01/34 | 1'500'000 | USD | 1'448'558 | 1'160'916 | 0.68 |
| US832696AZ12 | SJM 6 1/2 11/15/53 | 700'000 | USD | 683'396 | 682'324 | 0.40 |
| US828807DX23 | SPG 6.65 01/15/54 | 200'000 | USD | 195'675 | 203'226 | 0.12 |
| US828807DW40 | SPG 6 1/4 01/15/34 | 1'200'000 | USD | 1'085'880 | 1'118'702 | 0.66 |
| US79466LAM63 | CRM 3.05 07/15/61 | 1'050'000 | USD | 874'639 | 616'937 | 0.36 |
| US773903AJ82 | ROK 4.2 03/01/49 | 500'000 | USD | 626'715 | 380'349 | 0.22 |
| US75886FAE79 | REGN 1 3/4 09/15/30 | 200'000 | USD | 182'354 | 141'907 | 0.08 |
| US747525BT99 | QCOM 6 05/20/53 | 700'000 | USD | 683'933 | 686'174 | 0.40 |
| US747525BS17 | QCOM 5.4 05/20/33 | 500'000 | USD | 460'368 | 457'663 | 0.27 |
| US744320BH48 | PRU 3.7 10/01/50 | 900'000 | USD | 826'497 | 681'903 | 0.40 |
| US66989HAK41 | NOVNVX 4 11/20/45 | 1'000'000 | USD | 1'036'510 | 762'105 | 0.45 |
| US66989HAH12 | NOVNVX 4.4 05/06/44 | 600'000 | USD | 747'977 | 485'927 | 0.28 |
| US64952WFE84 | NYLIFE 5 01/09/34 144A | 950'000 | USD | 805'176 | 821'330 | 0.48 |
| US63111XAK72 | NDAQ 5.95 08/15/53 | 500'000 | USD | 455'387 | 460'979 | 0.27 |
| US61747YFG52 | MS 5.424 07/21/34 MTN | 1'175'000 | USD | 1'011'690 | 1'024'071 | 0.60 |
| US595112CD31 | MU 5.3 01/15/31 | 800'000 | USD | 698'685 | 694'282 | 0.41 |
| US595112BS19 | MU 2.703 04/15/32 | 800'000 | USD | 644'044 | 576'413 | 0.34 |
| US594918BT09 | MSFT 3.7 08/08/46 | 1'150'000 | USD | 1'215'873 | 859'098 | 0.50 |
| US59217HEP82 | MET 1.55 01/07/31 REGS | 1'000'000 | USD | 888'226 | 686'434 | 0.40 |
| US59156RCC07 | MET 5 07/15/52 | 700'000 | USD | 695'533 | 595'217 | 0.35 |
| US58933YAZ88 | MRK 1.45 06/24/30 | 400'000 | USD | 377'232 | 287'023 | 0.17 |
| US58933YAV74 | MRK 3.9 03/07/39 | 1'000'000 | USD | 1'063'129 | 779'477 | 0.46 |
| US57636QAU85 | MA 2 11/18/31 | 950'000 | USD | 871'549 | 686'846 | 0.40 |
| US548661EQ61 | LOW 5.15 07/01/33 | 600'000 | USD | 552'570 | 527'202 | 0.31 |
| US548661EJ29 | LOW 4 1/4 04/01/52 | 500'000 | USD | 470'248 | 362'969 | 0.21 |
| US548661DN40 | LOW 3.7 04/15/46 | 450'000 | USD | 454'270 | 307'649 | 0.18 |
| US532457CF35 | LLY 4.7 02/27/33 | 1'000'000 | USD | 926'709 | 876'208 | 0.51 |
| US50077LAZ94 | KHC 4 7/8 10/01/49 | 1'500'000 | USD | 1'134'929 | 1'200'613 | 0.70 |
| US46647PEA03 | JPM 5.04 01/23/28 | 100'000 | USD | 86'000 | 86'203 | 0.05 |
| US46647PDW32 | JPM 6.07 10/22/27 | 1'500'000 | USD | 1'345'141 | 1'324'091 | 0.78 |
| US46647PDR47 | JPM 5.35 06/01/34 | 2'000'000 | USD | 1'760'078 | 1'745'913 | 1.02 |
| US459200KZ37 | IBM 5.1 02/06/53 | 300'000 | USD | 275'382 | 254'321 | 0.15 |
| US459200KK67 | IBM 2.85 05/15/40 | 750'000 | USD | 696'918 | 483'589 | 0.28 |
| US437076AS19 | HD 5 7/8 12/16/36 | 400'000 | USD | 490'098 | 381'575 | 0.22 |
| US42824CBL28 | HPE 5.9 10/01/24 | 650'000 | USD | 591'790 | 558'874 | 0.33 |
| US38141GZK39 | GS 2.64 02/24/28 | 1'200'000 | USD | 1'079'942 | 959'687 | 0.56 |
| US37045VAY65 | GM 5.4 10/15/29 | 900'000 | USD | 812'410 | 785'368 | 0.46 |
| US36267VAM54 | GEHC 6.377 11/22/52 | 1'000'000 | USD | 1'009'961 | 984'752 | 0.58 |
| US36267VAF04 | GEHC 5.65 11/15/27 | 180'000 | USD | 176'419 | 159'462 | 0.09 |
| US345370DA55 | F 3 1/4 02/12/32 | 1'200'000 | USD | 830'626 | 853'266 | 0.50 |
| US29444UBU97 | EQIX 3.9 04/15/32 | 1'000'000 | USD | 781'318 | 795'990 | 0.47 |
| US28622HAA95 | ELV 4.9 02/08/26 | 100'000 | USD | 92'203 | 85'605 | 0.05 |
| US24703DBJ90 | DELL 5 1/4 02/01/28 | 1'000'000 | USD | 882'775 | 877'143 | 0.51 |
| US237266AJ06 | DAR 6 06/15/30 144A | 500'000 | USD | 488'864 | 426'206 | 0.25 |
| US22822VBE02 | CCI 5.8 03/01/34 | 1'000'000 | USD | 880'054 | 886'382 | 0.52 |
| US20030NEC11 | CMCSA 4.65 02/15/33 | 1'000'000 | USD | 857'204 | 857'781 | 0.50 |
| US20030NDQ16 | CMCSA 2.65 08/15/62 | 1'100'000 | USD | 867'483 | 559'085 | 0.33 |
| US17327CAN39 | C 2.014 01/25/26 | 700'000 | USD | 641'655 | 579'652 | 0.34 |
| US172967MF56 | C 3.352 04/24/25 | 1'150'000 | USD | 1'157'532 | 981'092 | 0.57 |
| US161175CM43 | CHTR 6.15 11/10/26 | 150'000 | USD | 134'932 | 131'488 | 0.08 |

| ISIN Nummer | Bezeichnung | Stückzahl / Nennwert | Währung | Einstandswert | Marktwert | % des Netto- vermögens |
|--------------|---|-------------------------|---------|-------------------|--------------------|---------------------------|
| US161175BZ64 | CHTR 3 1/2 06/01/41 | 1'000'000 | USD | 551'627 | 600'349 | 0.35 |
| US15135BAT89 | CNC 4 5/8 12/15/29 | 800'000 | USD | 654'655 | 659'501 | 0.39 |
| US126650DV97 | CVS 5 5/8 02/21/53 | 500'000 | USD | 459'962 | 428'650 | 0.25 |
| US126650DU15 | CVS 5 1/4 02/21/33 | 1'000'000 | USD | 865'318 | 869'182 | 0.51 |
| US126408HV80 | CSX 4 1/2 11/15/52 | 1'200'000 | USD | 1'157'218 | 940'797 | 0.55 |
| US11135FBV22 | AVGO 4.926 05/15/37 144A | 1'500'000 | USD | 1'185'724 | 1'246'370 | 0.73 |
| US110122CQ99 | BMY 4 1/8 06/15/39 | 1'250'000 | USD | 1'334'763 | 969'874 | 0.57 |
| US110122CP17 | BMY 3.4 07/26/29 | 310'000 | USD | 303'048 | 252'371 | 0.15 |
| US08652BAA70 | BBY 4.45 10/01/28 | 1'000'000 | USD | 1'090'243 | 855'345 | 0.50 |
| US071813CP23 | BAX 2.272 12/01/28 | 400'000 | USD | 371'400 | 306'067 | 0.18 |
| US071813BY49 | BAX 3.95 04/01/30 | 1'000'000 | USD | 1'105'389 | 812'221 | 0.48 |
| US06051GLC14 | BAC 6.204 11/10/28 | 2'000'000 | USD | 1'964'292 | 1'793'370 | 1.05 |
| US06051GKB40 | BAC 2.972 07/21/52 | 900'000 | USD | 826'110 | 535'026 | 0.31 |
| US052769AG12 | ADSK 2.85 01/15/30 | 800'000 | USD | 602'850 | 622'422 | 0.36 |
| US04636NAG88 | AZN 4.9 03/03/30 | 1'500'000 | USD | 1'319'173 | 1'322'599 | 0.78 |
| US038222AN54 | AMAT 1 3/4 06/01/30 | 700'000 | USD | 674'796 | 512'967 | 0.30 |
| US03740LAF94 | AON 5 09/12/32 | 800'000 | USD | 691'021 | 689'114 | 0.40 |
| US036752AX13 | ELV 6.1 10/15/52 | 535'000 | USD | 543'413 | 511'394 | 0.30 |
| US036752AU73 | ELV 4.55 05/15/52 | 550'000 | USD | 536'110 | 427'363 | 0.25 |
| US036752AT01 | ELV 4.1 05/15/32 | 1'000'000 | USD | 955'558 | 814'022 | 0.48 |
| US031162DT45 | AMGN 5.65 03/02/53 | 200'000 | USD | 184'843 | 177'620 | 0.10 |
| US031162DD92 | AMGN 3 02/22/29 | 1'150'000 | USD | 1'055'652 | 920'608 | 0.54 |
| US03040WBA27 | AWK 4.45 06/01/32 | 200'000 | USD | 194'850 | 169'158 | 0.10 |
| US03040WAZ86 | AWK 3 1/4 06/01/51 | 1'000'000 | USD | 801'343 | 631'764 | 0.37 |
| US03040WAW55 | AWK 2.8 05/01/30 | 500'000 | USD | 468'488 | 385'406 | 0.23 |
| US025816DB21 | AXP 5.85 11/05/27 | 200'000 | USD | 200'006 | 179'002 | 0.10 |
| US025816CW76 | AXP 4.05 05/03/29 | 1'300'000 | USD | 1'259'486 | 1'102'257 | 0.65 |
| US012653AD34 | ALB 4.65 06/01/27 | 400'000 | USD | 397'054 | 339'067 | 0.20 |
| US00287YBV02 | ABBV 2.95 11/21/26 | 1'000'000 | USD | 935'379 | 822'764 | 0.48 |
| US00206RKH48 | T 2 1/4 02/01/32 | 1'500'000 | USD | 1'351'336 | 1'060'328 | 0.62 |
| US00037BAC63 | ABBNVX 4 3/8 05/08/42 | 400'000 | USD | 478'895 | 314'062 | 0.18 |
| | | | | 81'356'304 | 71'706'213 | 41.99 |
| | VG | | | | | |
| USG91139AL26 | TAISEM 4 5/8 07/22/32 REGS | 200'000 | USD | 191'993 | 172'459 | 0.10 |
| USG91139AK43 | TAISEM 4 3/8 07/22/27 REGS | 200'000 | USD | 193'595 | 170'822 | 0.10 |
| | | | | 385'588 | 343'281 | 0.20 |
| | XS | | | | | |
| US62954HBB33 | NXPI 5 01/15/33 | 300'000 | USD | 298'640 | 254'491 | 0.15 |
| | | | | 298'640 | 254'491 | 0.15 |
| | Summe - Anleihen | | | | 167'486'947 | |
| | Summe - Amtlich notierte sowie an anderen geregelten Märkten gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | | | | 167'486'947 | |
| | SUMME DES WERTPAPIERBESTANDES | | | | 167'486'947 | 98.15 |

16 Swisscanto (LU) Bond Fund Sustainable Global High Yield

Wertpapierbestand zum 31.01.2024 (Angaben in USD)

| ISIN Nummer | Bezeichnung | Stückzahl / Nennwert | Währung | Einstandswert | Marktwert | % des Netto- vermögens |
|---|-----------------------------|-------------------------|---------|------------------|------------------|---------------------------|
| Amtlich notierte sowie an anderen geregelten Märkten gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | | | | | | |
| Anleihen | | | | | | |
| AT | | | | | | |
| USA35155AB50 | KLAB 7 04/03/49 REGS | 350'000 | USD | 343'438 | 352'083 | 0.57 |
| | | | | 343'438 | 352'083 | 0.57 |
| BE | | | | | | |
| BE6342251038 | ELIASO 5.85 PERP | 400'000 | EUR | 426'198 | 447'999 | 0.73 |
| | | | | 426'198 | 447'999 | 0.73 |
| BM | | | | | | |
| XS2312752400 | LRELN 5 5/8 09/18/41 | 250'000 | USD | 219'373 | 216'905 | 0.35 |
| USG4923NAB40 | CMIENE 6 1/4 04/26/29 REGS | 200'000 | USD | 192'040 | 190'610 | 0.31 |
| | | | | 411'413 | 407'515 | 0.66 |
| BR | | | | | | |
| USP59699AB77 | ITAU 4 5/8 PERP REGS | 300'000 | USD | 250'500 | 273'780 | 0.44 |
| USP3772WAK82 | BANBRA 4 7/8 01/1 1/29 REGS | 200'000 | USD | 196'000 | 193'700 | 0.31 |
| USP19118AA91 | BTHREE 4 1/8 09/20/31 REGS | 450'000 | USD | 388'935 | 392'679 | 0.64 |
| | | | | 835'435 | 860'159 | 1.39 |
| CA | | | | | | |
| US92660FAK03 | QBRCN 5 1/8 04/15/27 144A | 500'000 | USD | 487'500 | 492'800 | 0.80 |
| US89346DAH08 | TACN 7 3/4 11/15/29 | 350'000 | USD | 359'625 | 368'144 | 0.60 |
| US071734AP21 | BHCCN 6 1/8 02/01/27 144A | 500'000 | USD | 412'500 | 318'490 | 0.52 |
| | | | | 1'259'625 | 1'179'434 | 1.91 |
| CH | | | | | | |
| USH4209UAT37 | UBS 7 PERP REGS | 200'000 | USD | 211'074 | 200'124 | 0.32 |
| | | | | 211'074 | 200'124 | 0.32 |
| CO | | | | | | |
| US05968LAL62 | BCOLO 4 5/8 12/18/29 | 450'000 | USD | 403'500 | 423'392 | 0.69 |
| | | | | 403'500 | 423'392 | 0.69 |
| CZ | | | | | | |
| XS2706258352 | ENGPRO 11 11/02/28 REGS | 300'000 | USD | 300'000 | 314'424 | 0.51 |
| | | | | 300'000 | 314'424 | 0.51 |
| DE | | | | | | |
| XS2649707846 | PRFINE 9 3/8 07/15/28 REGS | 1'000'000 | EUR | 1'086'756 | 1'118'781 | 1.81 |
| XS2618867159 | CHEPDE 7 1/2 05/15/30 REGS | 350'000 | EUR | 386'455 | 401'462 | 0.65 |
| XS2615562274 | GRUPHA 6 3/4 05/15/30 REGS | 350'000 | EUR | 384'712 | 406'116 | 0.66 |
| XS2550063478 | SAZGR 7 1/2 08/21/26 REGS | 350'000 | EUR | 397'250 | 394'668 | 0.64 |
| XS2499278724 | SCHUBR Float 07/15/27 REGS | 300'000 | EUR | 293'506 | 333'047 | 0.54 |
| XS2326493728 | HNDLIN 3 3/8 04/15/29 REGS | 600'000 | EUR | 575'306 | 609'763 | 0.99 |
| XS2056730323 | IFXGR 2 7/8 PERP EMTN | 300'000 | EUR | 326'718 | 319'073 | 0.52 |
| DE000CZ45W81 | CMZB 6 1/2 12/06/32 EMTN | 200'000 | EUR | 200'664 | 229'118 | 0.37 |
| DE000A3E5WW4 | EVKGR 1 3/8 09/02/2081 | 500'000 | EUR | 463'987 | 489'930 | 0.79 |
| | | | | 4'115'354 | 4'301'959 | 6.97 |
| ES | | | | | | |

| ISIN Nummer | Bezeichnung | Stückzahl / Nennwert | Währung | Einstandswert | Marktwert | % des Netto- vermögens |
|--------------|------------------------------|-------------------------|---------|------------------|------------------|---------------------------|
| XS2647351142 | AMARAZ 10 1/4 07/15/28 REGS | 350'000 | EUR | 380'365 | 315'722 | 0.51 |
| XS2638924709 | BBVASM 8 3/8 PERP | 600'000 | EUR | 648'151 | 699'835 | 1.13 |
| XS2397198487 | LORCAT 5 1/8 09/30/29 REGS | 500'000 | EUR | 455'656 | 526'255 | 0.85 |
| | | | | 1'484'172 | 1'541'812 | 2.50 |
| | FI | | | | | |
| XS2387052744 | CASTSS 0 7/8 09/17/29 EMTN | 150'000 | EUR | 106'425 | 129'341 | 0.21 |
| XS2346224806 | SBBBSS 1 1/8 11/26/29 EMTN | 200'000 | EUR | 125'728 | 138'023 | 0.22 |
| | | | | 232'153 | 267'364 | 0.43 |
| | FR | | | | | |
| XS2737652474 | AXASA 6 3/8 PERP EMTN | 350'000 | EUR | 382'129 | 387'768 | 0.63 |
| XS2553825949 | EOFP 7 1/4 06/15/26 | 200'000 | EUR | 199'990 | 226'780 | 0.37 |
| XS2312733871 | EOFP 2 3/8 06/15/29 | 100'000 | EUR | 84'589 | 98'119 | 0.16 |
| USF8600KAA46 | SOCGEN 10 PERP REGS | 400'000 | USD | 400'120 | 427'896 | 0.69 |
| US449691AC82 | ILDFF 7 10/15/28 144A | 600'000 | USD | 579'000 | 595'182 | 0.96 |
| US02156LAA98 | SFRFP 8 1/8 02/01/27 144A | 500'000 | USD | 551'250 | 447'740 | 0.73 |
| FR0013331949 | FRPTT 3 1/8 PERP | 300'000 | EUR | 305'274 | 314'857 | 0.51 |
| | | | | 2'502'353 | 2'498'341 | 4.05 |
| | GB | | | | | |
| XS2696093033 | PURGYM 10 10/11/28 REGS | 350'000 | GBP | 422'736 | 469'183 | 0.76 |
| XS2636324274 | BRITEL 8 3/8 12/20/2083 EMTN | 300'000 | GBP | 376'448 | 409'629 | 0.66 |
| XS2591803841 | BACR 9 1/4 PERP | 250'000 | GBP | 280'166 | 318'951 | 0.52 |
| XS2358483258 | VMED 4 1/2 07/15/31 REGS | 300'000 | GBP | 304'477 | 329'822 | 0.53 |
| XS2329602135 | GTWICK 4 3/8 04/07/26 | 200'000 | GBP | 233'833 | 245'975 | 0.40 |
| XS2259808702 | MCGLN 4 1/4 PERP | 300'000 | GBP | 415'871 | 350'422 | 0.57 |
| XS2256977013 | IPFLN 9 3/4 11/12/25 | 350'000 | EUR | 337'809 | 374'446 | 0.61 |
| XS1888180640 | VOD 6 1/4 10/03/2078 | 500'000 | USD | 545'950 | 499'520 | 0.81 |
| USG84228EP90 | STANLN 4 3/4 PERP REGS | 350'000 | USD | 288'155 | 283'490 | 0.46 |
| US92858RAB69 | VMED 4 3/4 07/15/31 144A | 350'000 | USD | 322'872 | 313'233 | 0.51 |
| US780099CK11 | NWG 8 PERP | 300'000 | USD | 316'800 | 301'689 | 0.49 |
| | | | | 3'845'117 | 3'896'359 | 6.32 |
| | GR | | | | | |
| XS2747093321 | TPEIR 7 1/4 04/17/34 EMTN | 300'000 | EUR | 325'964 | 332'522 | 0.54 |
| XS2388172855 | ALPHA 2 1/2 03/23/28 | 250'000 | EUR | 229'649 | 253'185 | 0.41 |
| | | | | 555'613 | 585'708 | 0.95 |
| | IE | | | | | |
| XS2528657567 | BKIR 7.594 12/06/32 EMTN | 350'000 | GBP | 407'085 | 462'239 | 0.75 |
| US71429MAC91 | PRGO 3.15 06/15/30 | 350'000 | USD | 327'233 | 323'838 | 0.52 |
| | | | | 734'318 | 786'076 | 1.27 |
| | IL | | | | | |
| XS2406607098 | TEVA 3 3/4 05/09/27 | 700'000 | EUR | 810'600 | 736'589 | 1.19 |
| | | | | 810'600 | 736'589 | 1.19 |
| | IN | | | | | |
| USY7280PAA13 | RPVIN 4 1/2 07/14/28 REGS | 200'000 | USD | 168'500 | 181'342 | 0.29 |
| USY7279WAA90 | RPVIN 5 7/8 03/05/27 REGS | 441'000 | USD | 410'130 | 427'942 | 0.69 |
| | | | | 578'630 | 609'284 | 0.99 |
| | IT | | | | | |
| XS2681940297 | IPGIM 7 09/27/28 | 300'000 | EUR | 306'513 | 344'407 | 0.56 |
| XS2581393134 | TITIM 6 7/8 02/15/28 | 400'000 | EUR | 434'119 | 462'820 | 0.75 |

| ISIN Nummer | Bezeichnung | Stückzahl / Nennwert | Währung | Einstandswert | Marktwert | % des Netto- vermögens |
|--------------|-----------------------------|-------------------------|---------|------------------|------------------|---------------------------|
| XS2389112736 | ITLYUM 4 5/8 10/01/26 REGS | 400'000 | EUR | 411'662 | 420'056 | 0.68 |
| XS2291911282 | MANTEN 7 1/4 02/01/26 REGS | 200'000 | EUR | 216'317 | 202'446 | 0.33 |
| | | | | 1'368'611 | 1'429'730 | 2.32 |
| | JP | | | | | |
| USJ5S39RAC82 | NTT 1.162 04/03/26 REGS | 300'000 | USD | 271'587 | 277'443 | 0.45 |
| | | | | 271'587 | 277'443 | 0.45 |
| | KY | | | | | |
| XS2530437339 | KWGPRO 7 7/8 08/30/24 | 300'000 | USD | 91'200 | 26'673 | 0.04 |
| XS2205316941 | CIFIHG 5.95 10/20/25 | 200'000 | USD | 133'000 | 18'208 | 0.03 |
| XS1953029284 | SHIMAO 6 1/8 02/21/24 | 600'000 | USD | 616'500 | 29'028 | 0.05 |
| USG53901AA58 | LBTCOR 10 7/8 01/15/31 REGS | 300'000 | USD | 300'950 | 308'907 | 0.50 |
| | | | | 1'141'650 | 382'816 | 0.62 |
| | LU | | | | | |
| XS2623489627 | DAN 8 1/2 07/15/31 REGS | 200'000 | EUR | 221'213 | 237'825 | 0.39 |
| XS2423013742 | EDRSM 5 1/2 07/15/27 REGS | 200'000 | EUR | 226'900 | 215'305 | 0.35 |
| XS2138128314 | SFRFP 8 05/15/27 REGs | 300'000 | EUR | 182'950 | 173'496 | 0.28 |
| XS1881594946 | ROSINI 6 3/4 10/30/25 REGS | 200'000 | EUR | 254'084 | 217'923 | 0.35 |
| USL79090AC78 | RAILBZ 5 1/4 01/10/28 REGS | 250'000 | USD | 244'688 | 240'073 | 0.39 |
| USL6388GHV51 | TIGO 6 1/4 03/25/29 REGS | 400'000 | USD | 355'500 | 345'859 | 0.56 |
| | | | | 1'485'335 | 1'430'481 | 2.32 |
| | MU | | | | | |
| XS2189784957 | HLSTWR 7 12/18/25 REGS | 200'000 | USD | 191'400 | 198'222 | 0.32 |
| USV3856JAA17 | GRNKEN 5 1/2 04/06/25 REGS | 500'000 | USD | 500'000 | 492'605 | 0.80 |
| | | | | 691'400 | 690'827 | 1.12 |
| | MX | | | | | |
| USP2253TJT71 | CEMEX 9 1/8 PERP REGS | 700'000 | USD | 700'420 | 744'737 | 1.21 |
| USP14008AE91 | BANORT 7 5/8 PERP REGS | 500'000 | USD | 468'125 | 482'535 | 0.78 |
| | | | | 1'168'545 | 1'227'272 | 1.99 |
| | NL | | | | | |
| XS2758100296 | ADRBID 10 02/15/29 REGS | 100'000 | EUR | 109'016 | 109'809 | 0.18 |
| XS2681541327 | ZFFNGR 6 1/8 03/13/29 EMTN | 300'000 | EUR | 319'564 | 343'400 | 0.56 |
| XS2646608401 | TELEFO 6 3/4 PERP | 200'000 | EUR | 218'570 | 234'916 | 0.38 |
| XS2592804434 | TEVA 7 3/8 09/15/29 | 400'000 | EUR | 427'654 | 473'761 | 0.77 |
| XS2585240984 | INTNED 7 1/2 PERP | 500'000 | USD | 500'000 | 496'625 | 0.81 |
| XS2554581830 | ASRNED 7 12/07/43 | 300'000 | EUR | 316'365 | 369'441 | 0.60 |
| XS2486270858 | KPN 6 PERP | 400'000 | EUR | 397'255 | 458'683 | 0.74 |
| XS2434783911 | ADRBID 5 1/4 02/01/30 REGS | 300'000 | EUR | 297'807 | 303'252 | 0.49 |
| XS2410367747 | TELEFO 2.88 PERP | 500'000 | EUR | 439'273 | 504'312 | 0.82 |
| XS2310411090 | CITCON 1 5/8 03/12/28 EMTN | 150'000 | EUR | 117'553 | 134'669 | 0.22 |
| XS2111947748 | ADRBID 3 5/8 02/15/28 REGS | 200'000 | EUR | 149'668 | 199'831 | 0.32 |
| XS2051106073 | IHS 8 09/18/27 REGS | 200'000 | USD | 184'800 | 184'630 | 0.30 |
| | | | | 3'477'523 | 3'813'329 | 6.18 |
| | PT | | | | | |
| PTEDP4OM0025 | EDPPL 5.943 04/23/2083 EMTN | 500'000 | EUR | 537'234 | 566'332 | 0.92 |
| PTBIT3OM0098 | BCPPL 3.871 03/27/30 EMTN | 300'000 | EUR | 288'731 | 318'282 | 0.52 |
| | | | | 825'965 | 884'613 | 1.43 |
| | SE | | | | | |
| XS2493887264 | PREEM 12 06/30/27 REGS | 300'000 | EUR | 304'126 | 318'155 | 0.52 |

| ISIN Nummer | Bezeichnung | Stückzahl / Nennwert | Währung | Einstandswert | Marktwert | % des Netto- vermögens |
|--------------|----------------------------|-------------------------|---------|----------------|----------------|---------------------------|
| XS2380124227 | CASTSS 3 1/8 PERP | 150'000 | EUR | 115'242 | 135'981 | 0.22 |
| SE0020540219 | FOXWAY Float 07/12/28 | 400'000 | EUR | 438'380 | 428'238 | 0.69 |
| | | | | 857'748 | 882'374 | 1.43 |
| US | | | | | | |
| US98981BAA08 | ZMINFO 3 7/8 02/01/29 144A | 500'000 | USD | 417'500 | 445'360 | 0.72 |
| US98311AAB17 | WH 4 3/8 08/15/28 144A | 350'000 | USD | 333'340 | 327'142 | 0.53 |
| US98310WAS70 | TNL 6 5/8 07/31/26 144A | 500'000 | USD | 509'221 | 505'260 | 0.82 |
| US97360AAA51 | UNVR 8 1/2 06/15/30 144A | 300'000 | USD | 292'269 | 310'404 | 0.50 |
| US95081QAP90 | WCC 7 1/4 06/15/28 144A | 450'000 | USD | 472'185 | 462'294 | 0.75 |
| US92826CAD48 | V 3.15 12/14/25 | 300'000 | USD | 288'450 | 293'145 | 0.48 |
| US92343VGG32 | VZ 1.45 03/20/26 | 500'000 | USD | 466'000 | 466'775 | 0.76 |
| US92339LAA08 | VRTV 10 1/2 11/30/30 144A | 700'000 | USD | 700'000 | 722'113 | 1.17 |
| US91327TAA97 | UNIT 10 1/2 02/15/28 144A | 200'000 | USD | 202'500 | 203'332 | 0.33 |
| US911365BG81 | URI 4 7/8 01/15/28 | 500'000 | USD | 498'900 | 488'370 | 0.79 |
| US896522AJ82 | TRN 7 3/4 07/15/28 144A | 350'000 | USD | 355'625 | 365'708 | 0.59 |
| US88104LAE39 | TERP 5 01/31/28 144A | 400'000 | USD | 380'159 | 384'988 | 0.62 |
| US88033GDQ01 | THC 6 1/8 06/15/30 | 500'000 | USD | 501'125 | 500'970 | 0.81 |
| US88033GDK31 | THC 6 1/8 10/01/28 | 300'000 | USD | 285'000 | 298'734 | 0.48 |
| US86614RAM97 | SUMMAT 6 1/2 03/15/27 144A | 350'000 | USD | 351'313 | 349'524 | 0.57 |
| US817565CE22 | SCI 5 1/8 06/01/29 | 300'000 | USD | 301'974 | 293'787 | 0.48 |
| US74168LAA44 | PRMWCN 4 3/8 04/30/29 144A | 450'000 | USD | 395'897 | 411'876 | 0.67 |
| US68622TAB70 | OGN 5 1/8 04/30/31 144A | 500'000 | USD | 426'875 | 428'385 | 0.69 |
| US682357AA69 | CTECLN 3 7/8 10/15/29 144A | 400'000 | USD | 349'000 | 359'488 | 0.58 |
| US682189AQ81 | ON 3 7/8 09/01/28 144A | 250'000 | USD | 238'075 | 229'748 | 0.37 |
| US668771AL22 | GEN 7 1/8 09/30/30 144A | 400'000 | USD | 401'000 | 415'688 | 0.67 |
| US65342QAB86 | NEP 4 1/2 09/15/27 144A | 400'000 | USD | 393'000 | 377'972 | 0.61 |
| US65336YAN31 | NXST 4 3/4 11/01/28 144A | 400'000 | USD | 349'000 | 367'000 | 0.59 |
| US58733RAF91 | MELI 3 1/8 01/14/31 | 300'000 | USD | 240'000 | 253'419 | 0.41 |
| US57767XAB64 | MHED 8 08/01/29 144A | 200'000 | USD | 175'000 | 186'928 | 0.30 |
| US57767XAA81 | MHED 5 3/4 08/01/28 144A | 350'000 | USD | 314'635 | 330'785 | 0.54 |
| US576323AP42 | MTZ 4 1/2 08/15/28 144A | 400'000 | USD | 361'000 | 375'208 | 0.61 |
| US57164PAH91 | VAC 4 1/2 06/15/29 144A | 400'000 | USD | 356'000 | 358'776 | 0.58 |
| US55617LAP76 | M 5 7/8 04/01/29 144A | 500'000 | USD | 462'811 | 485'165 | 0.79 |
| US53219LAV18 | RGCARE 9 7/8 08/15/30 144A | 400'000 | USD | 405'000 | 413'820 | 0.67 |
| US52736RBJ05 | LEVI 3 1/2 03/01/31 144A | 400'000 | USD | 339'000 | 346'556 | 0.56 |
| US48666KBA60 | KBH 7 1/4 07/15/30 | 300'000 | USD | 297'450 | 310'329 | 0.50 |
| US46285MAA80 | IRM 5 07/15/32 144A | 600'000 | USD | 513'750 | 540'552 | 0.88 |
| US46266TAA60 | IQV 5 05/15/27 144A | 500'000 | USD | 504'375 | 489'270 | 0.79 |
| US459200JZ55 | IBM 3.3 05/15/26 | 300'000 | USD | 286'800 | 291'327 | 0.47 |
| US45688CAB37 | NGVT 3 7/8 11/01/28 144A | 300'000 | USD | 274'470 | 265'413 | 0.43 |
| US45174HBE62 | IHRT 5 1/4 08/15/27 144A | 200'000 | USD | 180'500 | 155'506 | 0.25 |
| US45174HBC07 | IHRT 6 3/8 05/01/26 | 200'000 | USD | 163'500 | 171'882 | 0.28 |
| US43284MAA62 | HGVLLC 5 06/01/29 144A | 450'000 | USD | 420'750 | 415'926 | 0.67 |
| US432833AF84 | HLT 4 7/8 01/15/30 | 550'000 | USD | 537'515 | 530'591 | 0.86 |
| US431571AE83 | HI 3 3/4 03/01/31 | 400'000 | USD | 339'800 | 349'264 | 0.57 |
| US389286AA34 | GTN 5 3/8 11/15/31 144A | 200'000 | USD | 143'500 | 157'410 | 0.26 |
| US38869AAB35 | GPK 3 1/2 03/15/28 144A | 550'000 | USD | 504'013 | 511'929 | 0.83 |
| US375558BF95 | GILD 3.65 03/01/26 | 300'000 | USD | 289'090 | 293'427 | 0.48 |
| US35908MAD20 | FYBR 8 3/4 05/15/30 144A | 500'000 | USD | 519'500 | 512'080 | 0.83 |
| US35906ABG22 | FYBR 6 3/4 05/01/29 144A | 100'000 | USD | 85'000 | 88'739 | 0.14 |

6

| ISIN Nummer | Bezeichnung | Stückzahl / Nennwert | Währung | Einstandswert | Marktwert | % des Netto- vermögens |
|---|----------------------------|-------------------------|---------|-------------------|-------------------|---------------------------|
| US345370DA55 | F 3 1/4 02/12/32 | 300'000 | USD | 239'065 | 248'664 | 0.40 |
| US30015DAA90 | EVGRN 9 3/4 04/26/28 144A | 850'000 | USD | 862'664 | 911'081 | 1.48 |
| US29272WAD11 | ENR 4 3/8 03/31/29 144A | 400'000 | USD | 354'500 | 360'892 | 0.59 |
| US25461LAB80 | DTV 8 7/8 02/01/30 144A | 300'000 | USD | 302'981 | 306'585 | 0.50 |
| US23918KAS78 | DVA 4 5/8 06/01/30 144A | 500'000 | USD | 395'000 | 442'705 | 0.72 |
| US237266AJ06 | DAR 6 06/15/30 144A | 600'000 | USD | 597'000 | 596'196 | 0.97 |
| US235825AH97 | DAN 4 1/4 09/01/30 | 450'000 | USD | 390'654 | 393'876 | 0.64 |
| US22282EAJ10 | CVA 5 09/01/30 | 400'000 | USD | 330'000 | 342'704 | 0.56 |
| US21925DAA72 | CNR 6 1/8 01/15/29 144A | 300'000 | USD | 237'354 | 266'880 | 0.43 |
| US20903XAF06 | CNSL 6 1/2 10/01/28 144A | 400'000 | USD | 322'500 | 348'176 | 0.56 |
| US20338QAD51 | COMM 6 03/01/26 144A | 250'000 | USD | 235'635 | 216'793 | 0.35 |
| US203372AX50 | COMM 4 3/4 09/01/29 144A | 150'000 | USD | 130'875 | 100'152 | 0.16 |
| US184496AN71 | CLH 4 7/8 07/15/27 144A | 400'000 | USD | 401'588 | 388'216 | 0.63 |
| US171779AL52 | CIEN 4 01/31/30 144A | 400'000 | USD | 352'000 | 367'604 | 0.60 |
| US16115QAF72 | GTLS 7 1/2 01/01/30 144A | 350'000 | USD | 357'000 | 360'521 | 0.58 |
| US126650CL25 | CVS 3 7/8 07/20/25 | 300'000 | USD | 295'005 | 295'290 | 0.48 |
| US12543DBN93 | CYH 10 7/8 01/15/32 144A | 200'000 | USD | 205'500 | 209'524 | 0.34 |
| US12543DBG43 | CYH 5 5/8 03/15/27 144A | 200'000 | USD | 175'250 | 185'322 | 0.30 |
| US12543DBC39 | CYH 8 03/15/26 144A | 198'000 | USD | 199'980 | 195'996 | 0.32 |
| US1248EPCS01 | CHTR 6 3/8 09/01/29 144A | 500'000 | USD | 500'625 | 486'455 | 0.79 |
| US1248EPCP61 | CHTR 4 1/4 01/15/34 144A | 200'000 | USD | 149'500 | 159'180 | 0.26 |
| US1248EPCD32 | CHTR 4 3/4 03/01/30 144A | 500'000 | USD | 460'150 | 444'200 | 0.72 |
| US053773BH95 | CAR 8 02/15/31 144A | 500'000 | USD | 505'000 | 498'560 | 0.81 |
| US05368VAA44 | AVNT 7 1/8 08/01/30 144A | 400'000 | USD | 401'549 | 410'644 | 0.67 |
| US05352TAA79 | AVTR 4 5/8 07/15/28 144A | 500'000 | USD | 453'400 | 475'985 | 0.77 |
| US047649AA63 | ATKR 4 1/4 06/01/31 144A | 400'000 | USD | 350'000 | 352'452 | 0.57 |
| US03969YAA64 | AMPBEV 3 1/4 09/01/28 144A | 500'000 | USD | 440'085 | 437'180 | 0.71 |
| US02406PBB58 | AXL 5 10/01/29 | 400'000 | USD | 349'000 | 351'040 | 0.57 |
| US00790RAA23 | WMS 5 09/30/27 144A | 350'000 | USD | 338'730 | 339'409 | 0.55 |
| US00774CAB37 | ACM 5 1/8 03/15/27 | 350'000 | USD | 345'062 | 344'295 | 0.55 |
| US004498AB73 | ACIW 5 3/4 08/15/26 144A | 500'000 | USD | 511'250 | 495'870 | 0.80 |
| US00175PAB94 | AMN 4 5/8 10/01/27 144A | 400'000 | USD | 369'712 | 381'824 | 0.62 |
| | | | | 28'180'478 | 28'556'634 | 46.29 |
| | XS | | | | | |
| US03969AAQ31 | ARGID 5 1/4 04/30/25 144A | 300'000 | USD | 290'850 | 293'268 | 0.48 |
| | | | | 290'850 | 293'268 | 0.48 |
| Summe - Anleihen | | | | | 59'277'409 | |
| Summe - Amtlich notierte sowie an anderen geregelten Märkten gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | | | | | 59'277'409 | |
| SUMME DES WERTPAPIERBESTANDES | | | | | 59'277'409 | 96.10 |

17 Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible AUD

Wertpapierbestand zum 31.01.2024 (Angaben in AUD)

| ISIN Nummer | Bezeichnung | Stückzahl / Nennwert | Währung | Einstandswert | Marktwert | % des Netto- vermögens |
|---|----------------------------|-------------------------|---------|------------------|------------------|---------------------------|
| Amtlich notierte sowie an anderen geregelten Märkten gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | | | | | | |
| Anleihen | | | | | | |
| AE | | | | | | |
| XS2677030194 | ADCBUH 5 1/2 01/12/29 GMTN | 300'000 | USD | 468'178 | 463'612 | 0.42 |
| XS2651619285 | MASDAR 4 7/8 07/25/33 EMTN | 450'000 | USD | 655'900 | 671'607 | 0.60 |
| | | | | 1'124'078 | 1'135'219 | 1.02 |
| AU | | | | | | |
| XS2054471722 | WSTP 1.1 09/27/24 EMTN | 1'293'000 | AUD | 1'302'310 | 1'262'421 | 1.13 |
| XS1859337849 | ZURNVX 4 1/2 07/26/38 EMTN | 600'000 | AUD | 582'540 | 486'924 | 0.44 |
| AU3TB0000192 | ACGB 3 3/4 04/21/37 144 | 1'000'000 | AUD | 1'164'302 | 960'090 | 0.86 |
| AU3TB0000150 | ACGB 3 1/4 04/21/29 138 | 2'000'000 | AUD | 1'980'963 | 1'962'140 | 1.76 |
| AU3TB0000143 | ACGB 2 3/4 04/21/24 137 | 500'000 | AUD | 494'745 | 498'390 | 0.45 |
| AU3SG0002934 | TCV 5 1/4 09/15/38 MTN | 1'000'000 | AUD | 991'370 | 1'012'360 | 0.91 |
| AU3SG0002579 | TCV 2 09/17/35 | 1'200'000 | AUD | 1'187'688 | 892'524 | 0.80 |
| AU3SG0002553 | NSWTC 1 3/4 03/20/34 | 2'000'000 | AUD | 1'984'320 | 1'531'080 | 1.37 |
| AU3SG0002447 | SAFA 1 3/4 05/24/34 | 1'400'000 | AUD | 1'379'518 | 1'063'496 | 0.95 |
| AU3SG0002371 | QTC 1 1/4 03/10/31 | 1'800'000 | AUD | 1'824'480 | 1'474'164 | 1.32 |
| AU3SG0001928 | QTC 2 1/2 03/06/29 | 500'000 | AUD | 552'180 | 467'075 | 0.42 |
| AU3SG0001878 | NSWTC 3 11/15/28 | 500'000 | AUD | 574'160 | 480'130 | 0.43 |
| AU3SG0001647 | QTC 4.2 02/20/47 47 | 800'000 | AUD | 1'165'400 | 706'696 | 0.63 |
| AU3FN0062659 | NAB Float 08/24/26 FRN | 1'400'000 | AUD | 1'400'000 | 1'389'486 | 1.25 |
| AU3CB0297547 | QTC 4 1/2 03/09/33 | 1'000'000 | AUD | 1'002'800 | 1'006'560 | 0.90 |
| AU3CB0285740 | CBAAU 2.4 01/14/27 MTN | 1'000'000 | AUD | 998'600 | 941'030 | 0.84 |
| AU3CB0282945 | TOYOTA 0.85 09/09/24 | 1'000'000 | AUD | 965'470 | 977'030 | 0.88 |
| AU3CB0282341 | AUSTC 1.465 08/18/31 MTN | 2'300'000 | AUD | 2'300'000 | 1'879'169 | 1.69 |
| AU3CB0280634 | NBNAUS 2.15 06/02/28 MTN | 600'000 | AUD | 597'906 | 538'800 | 0.48 |
| AU000XCLWAX7 | ACGB 2 3/4 11/21/29 154 | 2'000'000 | AUD | 1'946'194 | 1'901'640 | 1.71 |
| AU000XCLWAU3 | ACGB 2 3/4 11/21/28 152 | 1'400'000 | AUD | 1'473'707 | 1'347'444 | 1.21 |
| AU000XCLWAR9 | ACGB 2 1/4 05/21/28 149 | 1'700'000 | AUD | 1'723'099 | 1'610'172 | 1.45 |
| AU000XCLWAQ1 | ACGB 2 3/4 11/21/27 148 | 1'000'000 | AUD | 988'158 | 971'060 | 0.87 |
| AU000XCLWAP3 | ACGB 3 1/4 06/21/39 147 | 1'600'000 | AUD | 1'884'147 | 1'422'800 | 1.28 |
| AU000XCLWAO6 | ACGB 1 1/4 08/21/40 40CI | 920'000 | AUD | 977'813 | 1'082'196 | 0.97 |
| AU000XCLWAM0 | ACGB 2 3/4 06/21/35 145 | 1'500'000 | AUD | 1'427'030 | 1'320'795 | 1.19 |
| AU0000XCLWV6 | ACGB 2 1/2 09/20/30 30CI | 220'000 | AUD | 307'186 | 333'894 | 0.30 |
| AU0000274706 | ACGB 3 1/2 12/21/34 168 | 2'100'000 | AUD | 2'073'183 | 1'999'200 | 1.79 |
| AU0000217101 | ACGB 3 11/21/33 166 | 2'200'000 | AUD | 2'159'087 | 2'021'096 | 1.81 |
| AU0000143901 | ACGB 1 3/4 11/21/32 165 | 3'100'000 | AUD | 2'710'324 | 2'591'290 | 2.33 |
| AU0000106411 | ACGB 0 1/2 09/21/26 164 | 600'000 | AUD | 539'592 | 554'100 | 0.50 |
| AU0000101792 | ACGB 1 11/21/31 163 | 3'000'000 | AUD | 2'602'139 | 2'419'440 | 2.17 |
| AU0000097495 | ACGB 1 3/4 06/21/51 162 | 2'500'000 | AUD | 1'907'514 | 1'452'075 | 1.30 |
| AU0000095457 | ACGB 0 1/4 11/21/25 161 | 1'000'000 | AUD | 911'268 | 940'830 | 0.84 |
| AU0000087454 | ACGB 1 12/21/30 160 | 3'400'000 | AUD | 2'750'332 | 2'825'468 | 2.54 |
| AU0000079402 | QTC 1 3/4 07/20/34 | 1'375'000 | AUD | 1'373'240 | 1'048'630 | 0.94 |
| AU0000075681 | ACGB 1 1/4 05/21/32 158 | 3'300'000 | AUD | 2'929'442 | 2'676'630 | 2.40 |
| AU0000047003 | ACGB 1 1/2 06/21/31 157 | 2'300'000 | AUD | 2'227'825 | 1'953'965 | 1.75 |

| ISIN Nummer | Bezeichnung | Stückzahl / Nennwert | Währung | Einstandswert | Marktwert | % des Netto- vermögens |
|--------------|----------------------------|-------------------------|---------|-------------------|-------------------|---------------------------|
| AU0000018442 | ACGB 2 3/4 05/21/41 156 | 2'000'000 | AUD | 2'063'302 | 1'621'380 | 1.46 |
| AU0000013740 | ACGB 2 1/2 05/21/30 155 | 4'200'000 | AUD | 4'075'935 | 3'906'630 | 3.51 |
| | | | | 61'499'269 | 55'530'300 | 49.85 |
| CA | | | | | | |
| XS2356317177 | CPPIBC 1 1/2 06/23/28 | 1'850'000 | AUD | 1'846'337 | 1'637'972 | 1.47 |
| AU3CB0289072 | RY 3 3/4 05/06/25 | 1'000'000 | AUD | 998'950 | 990'510 | 0.89 |
| AU3CB0264778 | TD 2.05 07/10/24 | 1'000'000 | AUD | 997'760 | 987'830 | 0.89 |
| AU3CB0242683 | MP 3.6 08/17/27 MTN | 1'000'000 | AUD | 1'008'300 | 973'710 | 0.87 |
| AU3CB0237949 | ALTA 3.1 12/14/26 MTN | 500'000 | AUD | 496'150 | 482'865 | 0.43 |
| AU3CB0221232 | BRCOL 4 1/4 11/27/24 MTN | 900'000 | AUD | 882'810 | 898'164 | 0.81 |
| | | | | 6'230'307 | 5'971'051 | 5.36 |
| CH | | | | | | |
| AU3CB0278174 | UBS 1.1 02/26/26 | 1'000'000 | AUD | 965'000 | 925'190 | 0.83 |
| | | | | 965'000 | 925'190 | 0.83 |
| CL | | | | | | |
| US168863EB04 | CHILE 4.85 01/22/29 | 200'000 | USD | 305'911 | 305'263 | 0.27 |
| | | | | 305'911 | 305'263 | 0.27 |
| CZ | | | | | | |
| XS2676413235 | CESSPO 5.737 03/08/28 EMTN | 200'000 | EUR | 336'494 | 341'142 | 0.31 |
| | | | | 336'494 | 341'142 | 0.31 |
| DE | | | | | | |
| XS1869582335 | CMZB 5 1/2 08/29/28 EMTN | 1'000'000 | AUD | 1'025'550 | 923'540 | 0.83 |
| DE000A3826R6 | DB 3 3/4 01/15/30 | 500'000 | EUR | 815'537 | 825'864 | 0.74 |
| AU3CB0247419 | DBHNGR 3.8 09/27/27 MTN | 500'000 | AUD | 579'145 | 485'760 | 0.44 |
| AU000KFWHAGO | KFW 3.2 03/15/28 MTN | 529'000 | AUD | 568'781 | 509'432 | 0.46 |
| AU0000KFWHX0 | KFW 5 03/19/24 MTN | 1'000'000 | AUD | 1'009'320 | 1'000'580 | 0.90 |
| | | | | 3'998'333 | 3'745'176 | 3.36 |
| DK | | | | | | |
| AU3CB0237527 | KOMMUN 2.9 11/27/26 MTN | 1'230'000 | AUD | 1'243'244 | 1'180'345 | 1.06 |
| | | | | 1'243'244 | 1'180'345 | 1.06 |
| ES | | | | | | |
| XS1649193072 | SANTAN 4.8 07/19/27 EMTN | 600'000 | AUD | 600'741 | 578'586 | 0.52 |
| AU3CB0297596 | SANTAN 5.678 03/09/28 FXD | 450'000 | AUD | 450'000 | 453'906 | 0.41 |
| | | | | 1'050'741 | 1'032'492 | 0.93 |
| FR | | | | | | |
| XS1615104244 | SOCGEN 5 05/19/27 EMTN | 500'000 | AUD | 558'400 | 483'935 | 0.43 |
| US83368TBY38 | SOCGEN 7.132 01/19/55 REGS | 250'000 | USD | 375'347 | 378'069 | 0.34 |
| FR001400M2F4 | RCFFP 5 1/4 11/22/28 EMTN | 300'000 | EUR | 496'029 | 521'665 | 0.47 |
| FR0014008M32 | BNP 3.695 02/24/28 EMTN | 400'000 | AUD | 361'400 | 377'120 | 0.34 |
| FR0013515764 | BNP 2.518 06/05/25 EMTN | 400'000 | AUD | 415'780 | 386'364 | 0.35 |
| FR0013365871 | SOCGEN 4.7 09/20/28 EMTN | 200'000 | AUD | 193'186 | 189'512 | 0.17 |
| AU3CB0306017 | ACAFP 5.411 01/18/29 MTN | 600'000 | AUD | 600'000 | 606'522 | 0.54 |
| | | | | 3'000'143 | 2'943'187 | 2.64 |
| GB | | | | | | |
| XS2742660660 | MOTOPG 3 7/8 01/24/34 EMTN | 300'000 | EUR | 494'246 | 502'612 | 0.45 |
| AU3CB0251239 | LLOYDS 4 03/07/25 MTN | 700'000 | AUD | 699'413 | 691'075 | 0.62 |
| | | | | 1'193'658 | 1'193'687 | 1.07 |

| ISIN Nummer | Bezeichnung | Stückzahl / Nennwert | Währung | Einstandswert | Marktwert | % des Netto- vermögens |
|--------------|----------------------------|-------------------------|---------|------------------|------------------|---------------------------|
| IS | | | | | | |
| XS2679765037 | LANBNN 6 3/8 03/12/27 EMTN | 300'000 | EUR | 502'294 | 513'945 | 0.46 |
| | | | | 502'294 | 513'945 | 0.46 |
| JP | | | | | | |
| AU3FN0065587 | SUMIBK Float 01/20/25 TCD | 500'000 | AUD | 500'000 | 499'985 | 0.45 |
| | | | | 500'000 | 499'985 | 0.45 |
| KR | | | | | | |
| USY3815NBG52 | HYUCAP 5 1/8 02/05/27 REGS | 200'000 | USD | 302'550 | 301'817 | 0.27 |
| AU3CB0256113 | SHNHAN 5 08/30/28 MTN | 1'150'000 | AUD | 1'173'460 | 1'077'746 | 0.97 |
| | | | | 1'476'010 | 1'379'562 | 1.24 |
| KY | | | | | | |
| AU3CB0248169 | ADCBUH 4 1/2 10/25/27 MTN | 880'000 | AUD | 968'465 | 862'541 | 0.77 |
| | | | | 968'465 | 862'541 | 0.77 |
| LU | | | | | | |
| XS1752984440 | ARNDTN 4.542 PERP | 600'000 | EUR | 336'222 | 440'405 | 0.40 |
| | | | | 336'222 | 440'405 | 0.40 |
| NL | | | | | | |
| AU3CB0258135 | NEDWBK 3.3 05/02/29 MTN | 500'000 | AUD | 577'525 | 473'660 | 0.43 |
| | | | | 577'525 | 473'660 | 0.43 |
| NZ | | | | | | |
| US00182FBU93 | ANZLNZ 5.355 08/14/28 REGS | 500'000 | USD | 761'209 | 769'564 | 0.69 |
| AU3CB0304681 | NZLGFA 5.1 11/28/30 MTN | 900'000 | AUD | 898'065 | 925'254 | 0.83 |
| AU3CB0301240 | NZLGFA 4.7 08/01/28 MTN | 1'000'000 | AUD | 998'280 | 1'013'630 | 0.91 |
| AU3CB0248300 | KIWI 4 1/4 10/27/27 MTN | 600'000 | AUD | 595'279 | 585'234 | 0.53 |
| AU3CB0239754 | AUCKCN 2.9 09/16/27 | 1'500'000 | AUD | 1'421'100 | 1'410'915 | 1.27 |
| | | | | 4'673'933 | 4'704'597 | 4.22 |
| SE | | | | | | |
| XS2715276163 | SHBASS 3 7/8 05/10/27 EMTN | 400'000 | EUR | 660'728 | 669'992 | 0.60 |
| XS1306326536 | NDAFH 4.2 10/14/25 EMTN | 800'000 | AUD | 857'120 | 791'648 | 0.71 |
| | | | | 1'517'848 | 1'461'640 | 1.31 |
| SG | | | | | | |
| US449276AG99 | IBM 5.3 02/05/54 | 200'000 | USD | 301'661 | 304'458 | 0.27 |
| AU3CB0302107 | CLFCAP 4.753 08/31/28 MTN | 650'000 | AUD | 650'000 | 662'077 | 0.59 |
| | | | | 951'661 | 966'535 | 0.87 |
| US | | | | | | |
| XS2753287585 | SKINNV 4 7/8 01/23/27 | 200'000 | USD | 302'063 | 302'488 | 0.27 |
| XS2083139837 | F 3.683 12/03/24 EMTN | 700'000 | AUD | 714'202 | 687'715 | 0.62 |
| USU3822UAA89 | HWQCUS 5 07/27/28 REGS | 300'000 | USD | 438'883 | 457'536 | 0.41 |
| US06428CAA27 | BAC 5.526 08/18/26 | 700'000 | USD | 1'079'830 | 1'079'168 | 0.97 |
| AU3CB0268167 | VZ 3 1/2 11/04/39 MTN | 750'000 | AUD | 714'750 | 529'403 | 0.48 |
| AU3CB0245504 | MET 4 07/13/27 MTN | 1'000'000 | AUD | 996'380 | 963'790 | 0.87 |
| | | | | 4'246'108 | 4'020'100 | 3.61 |
| XS | | | | | | |
| XS2749537481 | IDAWBG 3.2 01/18/44 GMTN | 600'000 | EUR | 980'246 | 985'614 | 0.88 |
| AU3CB0295764 | EIB 4 3/4 01/20/33 | 1'400'000 | AUD | 1'397'522 | 1'408'568 | 1.26 |
| AU3CB0293975 | IFC 4.45 05/14/27 | 2'000'000 | AUD | 2'038'000 | 2'020'900 | 1.81 |
| AU3CB0285690 | ASIA 2.35 01/13/32 MTN | 1'000'000 | AUD | 997'790 | 845'360 | 0.76 |

| ISIN Nummer | Bezeichnung | Stückzahl / Nennwert | Währung | Einstandswert | Marktwert | % des Netto- vermögens |
|---|--------------------------------------|-------------------------|---------|-------------------|--------------------|---------------------------|
| AU3CB0277077 | EIB 0 3/4 07/15/27 MTN | 1'500'000 | AUD | 1'497'630 | 1'338'555 | 1.20 |
| AU3CB0242600 | NIB 3.3 08/16/27 MTN | 1'000'000 | AUD | 1'079'762 | 970'850 | 0.87 |
| AU3CB0242121 | AFDB 3.3 07/27/27 MTN | 800'000 | AUD | 863'200 | 775'240 | 0.70 |
| AU3CB0230134 | CAF 4 1/2 06/05/25 MTN | 1'509'000 | AUD | 1'602'391 | 1'488'689 | 1.34 |
| AU3CB0213205 | AFDB 4 3/4 03/06/24 GDIF | 500'000 | AUD | 546'250 | 500'040 | 0.45 |
| | | | | 11'002'791 | 10'333'816 | 9.28 |
| Summe - Anleihen | | | | | 99'959'837 | |
| Summe - Amtlich notierte sowie an anderen geregelten Märkten gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | | | | | 99'959'837 | |
| Anlagefonds | | | | | | |
| LU | | | | | | |
| LU2108482667 | SWC (LU) BF Responsible EmMa Opps NT | 24'000 | USD | 3'399'068 | 3'833'175 | 3.44 |
| LU1734303610 | SWC (LU) BF Responsible COCO NT | 17'400 | USD | 2'623'944 | 3'656'619 | 3.28 |
| | | | | 6'023'011 | 7'489'794 | 6.72 |
| Summe - Anlagefonds | | | | | 7'489'794 | |
| Summe - Anlagefonds | | | | | 7'489'794 | |
| SUMME DES WERTPAPIERBESTANDES | | | | | 107'449'631 | 96.46 |

18 Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible CAD

Wertpapierbestand zum 31.01.2024 (Angaben in CAD)

| ISIN Nummer | Bezeichnung | Stückzahl / Nennwert | Währung | Einstandswert | Marktwert | % des Netto- vermögens |
|---|---------------------------|-------------------------|---------|----------------|----------------|---------------------------|
| Amtlich notierte sowie an anderen geregelten Märkten gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | | | | | | |
| Anleihen | | | | | | |
| AU | | | | | | |
| CAQ57085HQ08 | MQGAU 2.723 08/21/29 MPLE | 350'000 | CAD | 350'000 | 311'724 | 0.52 |
| CA89400PAJ27 | TCLAU 4.555 11/14/28 MPLE | 500'000 | CAD | 503'385 | 489'575 | 0.81 |
| | | | | 853'385 | 801'299 | 1.33 |
| CA | | | | | | |
| CA98704CRA67 | YORKMU 2.65 04/18/29 | 500'000 | CAD | 499'345 | 473'440 | 0.79 |
| CA98704CQZ28 | YORKMU 2.35 06/09/27 | 700'000 | CAD | 700'000 | 666'855 | 1.11 |
| CA90664ZAX83 | ENBGAS 2.88 11/22/27 MTN | 500'000 | CAD | 510'910 | 475'915 | 0.79 |
| CA89353ZCC01 | TRPCN 4.18 07/03/48 MTN | 500'000 | CAD | 491'436 | 412'750 | 0.69 |
| CA891288DV15 | TRNT 1.6 12/02/30 | 500'000 | CAD | 488'910 | 433'195 | 0.72 |
| CA891288DT68 | TRNT 2.6 09/24/39 | 500'000 | CAD | 496'445 | 398'585 | 0.66 |
| CA891288DQ20 | TRNT 2.4 06/07/27 | 500'000 | CAD | 500'000 | 477'080 | 0.79 |
| CA89117F3M90 | TD 2.667 09/09/25 | 700'000 | CAD | 662'378 | 676'536 | 1.13 |
| CA891160QY28 | TD 3.224 07/25/29 MTN | 500'000 | CAD | 492'700 | 494'455 | 0.82 |
| CA880789AC67 | TERANE 5.754 12/17/40 | 200'000 | CAD | 208'781 | 192'786 | 0.32 |
| CA87971MBS13 | TCN 2.05 10/07/30 | 200'000 | CAD | 160'440 | 169'978 | 0.28 |
| CA803854KJ60 | SCDA 2.2 06/02/30 | 500'000 | CAD | 499'945 | 455'380 | 0.76 |
| CA803854JW90 | SCDA 3.2 06/03/24 | 500'000 | CAD | 506'740 | 496'980 | 0.83 |
| CA780086TY05 | RY 1.833 07/31/28 | 400'000 | CAD | 397'232 | 360'464 | 0.60 |
| CA780086SY14 | RY 1.67 01/28/33 | 500'000 | CAD | 466'333 | 444'735 | 0.74 |
| CA780086RQ98 | RY 2.328 01/28/27 | 300'000 | CAD | 280'476 | 281'754 | 0.47 |
| CA780086QY32 | RY 2.352 07/02/24 | 1'000'000 | CAD | 1'040'830 | 988'590 | 1.64 |
| CA74814ZFY15 | Q 4.4 12/01/55 | 500'000 | CAD | 550'330 | 523'170 | 0.87 |
| CA74814ZFP32 | Q 3.65 05/20/32 | 400'000 | CAD | 364'824 | 393'596 | 0.65 |
| CA74814ZFN83 | Q 3 1/4 09/01/32 | 1'000'000 | CAD | 976'240 | 951'150 | 1.58 |
| CA74814ZFM01 | Q 2.1 05/27/31 | 400'000 | CAD | 404'124 | 356'888 | 0.59 |
| CA74814ZFL28 | Q 2.85 12/01/53 | 1'000'000 | CAD | 1'007'950 | 779'200 | 1.30 |
| CA74814ZFG33 | Q 1.9 09/01/30 | 500'000 | CAD | 527'235 | 445'570 | 0.74 |
| CA74814ZER07 | Q 3 1/2 12/01/45 | 500'000 | CAD | 556'488 | 446'060 | 0.74 |
| CA74814ZDK62 | Q 5 12/01/38 | 700'000 | CAD | 969'242 | 761'712 | 1.27 |
| CA69363TAN24 | PSPCAP 2.05 01/15/30 12 | 500'000 | CAD | 502'540 | 453'585 | 0.75 |
| CA689551FE46 | OTTAWA 3 1/4 11/10/47 | 700'000 | CAD | 747'848 | 572'831 | 0.95 |
| CA68333ZAV90 | ONT 3 3/4 12/02/53 | 500'000 | CAD | 467'315 | 465'825 | 0.77 |
| CA68333ZAS61 | ONT 2.55 12/02/52 | 1'000'000 | CAD | 912'200 | 732'150 | 1.22 |
| CA68333ZAR88 | ONT 1.55 11/01/29 | 900'000 | CAD | 897'768 | 798'840 | 1.33 |
| CA68333ZAG24 | ONT 2.65 12/02/50 | 1'200'000 | CAD | 1'331'448 | 902'688 | 1.50 |
| CA68323AAY07 | ONT 3 1/2 06/02/43 | 500'000 | CAD | 536'965 | 450'140 | 0.75 |
| CA683234YD42 | ONT 4.7 06/02/37 | 500'000 | CAD | 665'500 | 527'005 | 0.88 |
| CA68321ZAJ09 | ONTPOW 2.947 02/21/51 | 500'000 | CAD | 460'260 | 359'390 | 0.60 |
| CA68321ZAB72 | ONTPOW 3.838 06/22/48 MTN | 200'000 | CAD | 169'806 | 172'326 | 0.29 |
| CA65479EAC80 | NISCAN 1.626 03/18/24 | 300'000 | CAD | 283'559 | 298'581 | 0.50 |
| CA651333GD25 | NF 2.65 10/17/50 | 300'000 | CAD | 295'626 | 211'899 | 0.35 |
| CA642866GQ40 | NBRNS 3.05 08/14/50 | 500'000 | CAD | 545'000 | 400'395 | 0.67 |

| ISIN Nummer | Bezeichnung | Stückzahl / Nennwert | Währung | Einstandswert | Marktwert | % des Netto- vermögens |
|--------------|----------------------------|-------------------------|---------|-------------------|-------------------|---------------------------|
| CA63306AFX96 | NACN 2.983 03/04/24 | 500'000 | CAD | 514'400 | 499'060 | 0.83 |
| CA62620DAP65 | BCMFA 3.3 04/08/32 | 500'000 | CAD | 473'462 | 476'965 | 0.79 |
| CA626209JR29 | BCMFA 2 1/2 04/19/26 | 500'000 | CAD | 498'945 | 482'710 | 0.80 |
| CA614852NZ03 | MNTRL 3 1/2 12/01/38 | 500'000 | CAD | 573'900 | 448'955 | 0.75 |
| CA563469US23 | MP 3.2 03/05/50 | 500'000 | CAD | 509'930 | 410'230 | 0.68 |
| CA563469UP83 | MP 2.6 06/02/27 | 500'000 | CAD | 494'298 | 480'900 | 0.80 |
| CA563469TM71 | MP 4.1 03/05/41 | 500'000 | CAD | 503'920 | 483'325 | 0.80 |
| CA44932WAB69 | HYNMTR 3.196 02/16/27 | 200'000 | CAD | 184'292 | 191'806 | 0.32 |
| CA44810ZCR97 | HYDONE 4.39 03/01/34 | 250'000 | CAD | 248'400 | 249'218 | 0.41 |
| CA44810ZCG33 | HYDONE 2.23 09/17/31 | 500'000 | CAD | 424'205 | 435'545 | 0.72 |
| CA44810ZCC29 | HYDONE 2.16 02/28/30 MTN | 500'000 | CAD | 509'200 | 447'235 | 0.74 |
| CA44810ZBD11 | HYDONE 4.39 09/26/41 MTN | 500'000 | CAD | 562'450 | 481'820 | 0.80 |
| CA34527ACJ75 | F 2.961 09/16/26 | 200'000 | CAD | 172'750 | 188'442 | 0.31 |
| CA29251ZBS52 | ENBCN 2.99 10/03/29 MTN | 300'000 | CAD | 309'750 | 275'859 | 0.46 |
| CA233852AD45 | DTRGR 2.14 12/13/24 | 500'000 | CAD | 481'173 | 486'925 | 0.81 |
| CA136375CX83 | CNRCN 3.05 02/08/50 | 500'000 | CAD | 446'800 | 375'955 | 0.63 |
| CA13607LKJ12 | CM 5.35 04/20/33 | 500'000 | CAD | 494'010 | 505'330 | 0.84 |
| CA13607GRU09 | CM 1.1 01/19/26 | 500'000 | CAD | 491'890 | 467'950 | 0.78 |
| CA13607GFB55 | CM 2.35 08/28/24 | 400'000 | CAD | 385'076 | 393'784 | 0.66 |
| CA13509PJL81 | CANHOU 3.1 06/15/28 | 1'000'000 | CAD | 994'730 | 977'690 | 1.63 |
| CA135087ZS68 | CAN 3 1/2 12/01/45 | 900'000 | CAD | 1'090'612 | 926'244 | 1.54 |
| CA135087YQ12 | CAN 4 06/01/41 | 1'000'000 | CAD | 1'112'791 | 1'087'650 | 1.81 |
| CA135087XG49 | CAN 5 3/4 06/01/33 | 1'500'000 | CAD | 1'870'266 | 1'785'330 | 2.97 |
| CA135087P576 | CAN 3 1/2 03/01/28 | 800'000 | CAD | 797'664 | 801'440 | 1.33 |
| CA135087N423 | CAN 1 1/2 05/01/24 | 1'000'000 | CAD | 981'050 | 991'590 | 1.65 |
| CA135087N266 | CAN 1 1/2 12/01/31 | 500'000 | CAD | 433'045 | 437'465 | 0.73 |
| CA135087L518 | CAN 0 1/4 03/01/26 | 500'000 | CAD | 483'925 | 464'035 | 0.77 |
| CA135087J546 | CAN 2 1/4 03/01/24 | 1'400'000 | CAD | 1'385'734 | 1'397'102 | 2.32 |
| CA135087H722 | CAN 2 12/01/51 | 600'000 | CAD | 546'448 | 460'878 | 0.77 |
| CA135087D358 | CAN 2 3/4 12/01/48 | 600'000 | CAD | 675'535 | 545'934 | 0.91 |
| CA135087C939 | CAN 2 3/4 12/01/64 | 600'000 | CAD | 627'251 | 537'174 | 0.89 |
| CA11070TAG37 | BRCOL 2.8 06/18/48 | 500'000 | CAD | 445'095 | 391'295 | 0.65 |
| CA110709GJ55 | BRCOL 2.95 06/18/50 | 500'000 | CAD | 406'463 | 400'570 | 0.67 |
| CA110709GC03 | BRCOL 3.2 06/18/44 | 500'000 | CAD | 520'995 | 428'510 | 0.71 |
| CA07813ZCG78 | BCECN 3 03/17/31 MTN | 300'000 | CAD | 256'125 | 270'399 | 0.45 |
| CA07813ZBZ68 | BCECN 3.35 03/12/25 MTN | 750'000 | CAD | 729'990 | 736'455 | 1.23 |
| CA06415E4E25 | BNS 1.4 11/01/27 | 1'000'000 | CAD | 962'133 | 901'390 | 1.50 |
| CA064151WY58 | BNS 2.29 06/28/24 DPNT | 500'000 | CAD | 501'655 | 494'425 | 0.82 |
| CA06368DCV43 | BMO 2.37 02/03/25 MTN | 1'000'000 | CAD | 974'515 | 973'090 | 1.62 |
| CA06368B5B08 | BMO 2.28 07/29/24 | 1'000'000 | CAD | 964'697 | 986'360 | 1.64 |
| CA06368B2H05 | BMO 2.85 03/06/24 | 500'000 | CAD | 507'889 | 498'950 | 0.83 |
| CA01585PAG06 | AQNCN 4.09 02/17/27 | 500'000 | CAD | 522'120 | 487'545 | 0.81 |
| CA013051EQ66 | ALTA 2.95 06/01/52 | 1'000'000 | CAD | 980'300 | 791'830 | 1.32 |
| CA013051DS32 | ALTA 3.3 12/01/46 | 500'000 | CAD | 571'875 | 426'795 | 0.71 |
| | | | | 49'196'925 | 44'884'639 | 74.67 |
| GB | | | | | | |
| CAG5533WBW69 | LLOYDS 3 1/2 02/03/25 MPLE | 500'000 | CAD | 503'350 | 488'515 | 0.81 |
| CAG0810GAA53 | BACR 2.166 06/23/27 MPLE | 1'000'000 | CAD | 981'410 | 925'550 | 1.54 |
| | | | | 1'484'760 | 1'414'065 | 2.35 |

| ISIN Nummer | Bezeichnung | Stückzahl / Nennwert | Währung | Einstandswert | Marktwert | % des Netto- vermögens |
|---|---|-------------------------|---------|------------------|-------------------|---------------------------|
| LU | | | | | | |
| CA04269KAA12 | ARNDTN 4 5/8 09/18/25 MPLE | 300'000 | CAD | 298'026 | 291'147 | 0.48 |
| | | | | 298'026 | 291'147 | 0.48 |
| NL | | | | | | |
| CA639832AA25 | NEDWBK 5.2 03/31/25 EMTN | 500'000 | CAD | 547'934 | 501'700 | 0.83 |
| | | | | 547'934 | 501'700 | 0.83 |
| US | | | | | | |
| CA92343VFG47 | VZ 2 1/2 05/16/30 MPLE | 500'000 | CAD | 526'650 | 444'500 | 0.74 |
| CA64953BAU22 | NYLIFE 2 04/17/28 MPLE | 300'000 | CAD | 299'298 | 273'342 | 0.45 |
| CA61747YEE10 | MS 1.779 08/04/27 MPLE | 1'000'000 | CAD | 975'144 | 928'620 | 1.54 |
| CA6174468D43 | MS 3 02/07/24 MPLE | 500'000 | CAD | 529'110 | 499'790 | 0.83 |
| CA592179KA25 | MET 1.95 03/20/28 MPLE | 500'000 | CAD | 479'973 | 454'780 | 0.76 |
| CA38141GXT61 | GS 2.013 02/28/29 MPLE | 1'000'000 | CAD | 979'000 | 898'540 | 1.49 |
| CA38141GWR15 | GS 3.307 10/31/25 MPLE | 500'000 | CAD | 538'950 | 492'190 | 0.82 |
| CA172967JS17 | C 4.09 06/09/25 MPLE | 500'000 | CAD | 557'050 | 491'530 | 0.82 |
| CA060505FS82 | BAC 3.515 03/24/26 MPLE | 1'000'000 | CAD | 1'097'800 | 980'620 | 1.63 |
| CA00206RDY59 | T 4.85 05/25/47 MPLE | 700'000 | CAD | 706'072 | 635'019 | 1.06 |
| | | | | 6'689'047 | 6'098'931 | 10.15 |
| XS | | | | | | |
| XS0284501094 | EIB 4.6 01/30/37 REGS | 500'000 | CAD | 629'585 | 518'725 | 0.86 |
| | | | | 629'585 | 518'725 | 0.86 |
| Summe - Anleihen | | | | | 54'510'506 | |
| Summe - Amtlich notierte sowie an anderen geregelten Märkten gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | | | | | 54'510'506 | |
| Anlagefonds | | | | | | |
| LU | | | | | | |
| LU2108482667 | SWC (LU) BF Responsible EmMa Opps NT | 8'000 | USD | 981'223 | 1'128'481 | 1.88 |
| LU1734303610 | SWC (LU) BF Responsible COCO NT | 5'400 | USD | 753'860 | 1'002'262 | 1.67 |
| LU1637934743 | SWC (LU) BF Sust Glbl High Yield NT | 6'000 | USD | 765'643 | 1'014'864 | 1.69 |
| LU1637934586 | SWC (LU) BF Responsible Global Convertible NT | 4'300 | USD | 565'098 | 738'234 | 1.23 |
| | | | | 3'065'823 | 3'883'841 | 6.46 |
| Summe - Anlagefonds | | | | | 3'883'841 | |
| Summe - Anlagefonds | | | | | 3'883'841 | |
| SUMME DES WERTPAPIERBESTANDES | | | | | 58'394'347 | 97.14 |

19 Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible CHF

Wertpapierbestand zum 31.01.2024 (Angaben in CHF)

| ISIN Nummer | Bezeichnung | Stückzahl / Nennwert | Währung | Einstandswert | Marktwert | % des Netto- vermögens |
|---|----------------------------|-------------------------|---------|-------------------|-------------------|---------------------------|
| Amtlich notierte sowie an anderen geregelten Märkten gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | | | | | | |
| Anleihen | | | | | | |
| AE | | | | | | |
| CH1145096181 | FABUH 0.1475 11/17/26 EMTN | 1'500'000 | CHF | 1'500'000 | 1'435'875 | 0.65 |
| CH0465044680 | FABUH 0.401 10/02/24 EMTN | 1'500'000 | CHF | 1'484'000 | 1'483'425 | 0.67 |
| | | | | 2'984'000 | 2'919'300 | 1.32 |
| AT | | | | | | |
| CH1231094363 | BAWAG 1.96 05/26/31 EMTN | 1'000'000 | CHF | 1'003'000 | 1'031'500 | 0.47 |
| CH1216400049 | BAWAG 2.87 10/03/25 | 1'000'000 | CHF | 1'021'100 | 1'019'000 | 0.46 |
| CH0525158462 | VORHYP 0 1/8 03/27/30 EMTN | 500'000 | CHF | 503'240 | 441'000 | 0.20 |
| CH0020632144 | OKB 2 7/8 02/25/30 | 4'000'000 | CHF | 5'380'000 | 4'398'000 | 1.98 |
| | | | | 7'907'340 | 6'889'500 | 3.11 |
| AU | | | | | | |
| CH1289657137 | NAB 2.201 04/12/29 GMTN | 2'000'000 | CHF | 2'000'120 | 2'059'500 | 0.93 |
| CH1271360385 | WSTP 2.0125 06/13/30 | 2'000'000 | CHF | 2'049'600 | 2'073'000 | 0.94 |
| CH1243651911 | NAB 1.715 02/03/33 EMTN | 1'000'000 | CHF | 1'021'000 | 1'021'000 | 0.46 |
| CH1118483747 | MQGAU 0.395 07/20/28 EMTN | 1'000'000 | CHF | 895'500 | 940'250 | 0.42 |
| CH0409606362 | TQLAU 1 12/08/25 EMTN | 2'000'000 | CHF | 2'017'340 | 1'978'000 | 0.89 |
| CH0340912168 | TQLAU 0.65 11/02/26 EMTN | 1'000'000 | CHF | 997'500 | 973'000 | 0.44 |
| | | | | 8'981'060 | 9'044'750 | 4.08 |
| BM | | | | | | |
| CH0575017105 | COMQAT 0.735 11/27/24 EMTN | 2'000'000 | CHF | 1'956'200 | 1'974'400 | 0.89 |
| | | | | 1'956'200 | 1'974'400 | 0.89 |
| CA | | | | | | |
| CH1321481454 | TD 1.4825 01/30/29 EMTN | 1'000'000 | CHF | 1'000'000 | 1'003'500 | 0.45 |
| CH1294486324 | BNS 2.3825 09/22/27 EMTN | 2'000'000 | CHF | 2'000'000 | 2'048'000 | 0.92 |
| CH1264823431 | Q 2.04 05/09/33 MTN | 1'000'000 | CHF | 1'000'000 | 1'059'000 | 0.48 |
| CH1261608918 | BNS 2.0425 05/04/26 EMTN | 1'000'000 | CHF | 1'004'700 | 1'015'250 | 0.46 |
| CH1253456102 | RY 2.085 03/31/28 EMTN | 1'000'000 | CHF | 1'000'000 | 1'029'750 | 0.46 |
| CH1243933558 | TD 2.2025 01/31/28 EMTN | 2'000'000 | CHF | 1'993'200 | 2'037'000 | 0.92 |
| CH1243018814 | BMO 2.26 02/01/29 EMTN | 2'000'000 | CHF | 1'995'000 | 2'050'500 | 0.93 |
| CH1242301302 | CCDJ 1.735 01/31/28 | 1'000'000 | CHF | 1'000'000 | 1'014'750 | 0.46 |
| CH1230759552 | RY 2.445 01/25/28 EMTN | 2'000'000 | CHF | 2'000'000 | 2'057'000 | 0.93 |
| CH1167887251 | BNS 0.278 04/01/27 EMTN | 3'000'000 | CHF | 2'993'460 | 2'901'750 | 1.31 |
| CH1151526212 | CM 0.2825 02/03/27 EMTN | 2'000'000 | CHF | 1'852'000 | 1'917'500 | 0.87 |
| CH1137407412 | CM 0.18 04/20/29 | 1'000'000 | CHF | 897'000 | 920'750 | 0.42 |
| CH0537261866 | MP 0.7 04/20/40 EMTN | 900'000 | CHF | 906'723 | 806'400 | 0.36 |
| CH0528881227 | ALTA 0 1/4 04/20/28 EMTN | 2'500'000 | CHF | 2'497'575 | 2'401'875 | 1.08 |
| CH0498400578 | CM 0.05 10/15/26 EMTN | 3'500'000 | CHF | 3'242'550 | 3'362'625 | 1.52 |
| CH0461239003 | NBRNS 0 1/8 12/06/32 | 3'000'000 | CHF | 3'046'770 | 2'668'500 | 1.20 |
| CH0367206759 | ONT 0 1/4 06/28/29 EMTN | 1'000'000 | CHF | 998'000 | 949'500 | 0.43 |
| CH0343366800 | NBRNS 0.2 11/07/31 | 1'500'000 | CHF | 1'494'000 | 1'368'000 | 0.62 |
| | | | | 30'920'978 | 30'611'650 | 13.81 |
| CH | | | | | | |

| ISIN Nummer | Bezeichnung | Stückzahl / Nennwert | Währung | Einstandswert | Marktwert | % des Netto- vermögens |
|--------------|-----------------------------|-------------------------|---------|-------------------|-------------------|---------------------------|
| CH1228837865 | UBS 2.33 11/14/25 | 1'000'000 | CHF | 1'000'000 | 1'013'000 | 0.46 |
| CH1120085670 | UBS 0.15 06/29/28 EMTN | 1'250'000 | CHF | 1'252'175 | 1'171'250 | 0.53 |
| CH0564642053 | ACANXB 0.07 09/18/29 | 1'600'000 | CHF | 1'601'072 | 1'474'400 | 0.67 |
| CH0506668869 | UBS 3 PERP | 2'400'000 | CHF | 2'372'000 | 2'268'600 | 1.02 |
| CH0485261355 | KBLUZE 1 1/2 PERP | 1'000'000 | CHF | 1'000'000 | 792'750 | 0.36 |
| CH0485252875 | PSHYPO 0 08/26/49 678 | 1'000'000 | CHF | 615'400 | 696'500 | 0.31 |
| CH0483181001 | UBS 0 07/16/29 EMTN | 1'000'000 | CHF | 896'500 | 921'500 | 0.42 |
| CH0373476115 | SGKNSW 1.7 PERP | 3'000'000 | CHF | 3'000'000 | 2'949'750 | 1.33 |
| CH0361532945 | ZKB 3.6 PERP | 2'250'000 | CHF | 2'316'933 | 2'242'125 | 1.01 |
| | | | | 14'054'080 | 13'529'875 | 6.11 |
| CL | | | | | | |
| CH1300950032 | BSANCI 2.445 01/25/27 EMTN | 1'000'000 | CHF | 1'000'000 | 1'009'000 | 0.46 |
| CH0496632628 | BSANCI 0.135 08/29/29 EMTN | 1'000'000 | CHF | 909'000 | 889'250 | 0.40 |
| CH0494734376 | BCICI 0 1/4 09/24/29 EMTN | 1'000'000 | CHF | 821'900 | 893'250 | 0.40 |
| | | | | 2'730'900 | 2'791'500 | 1.26 |
| DE | | | | | | |
| CH1298665980 | FREGR 2.96 10/18/28 EMTN | 930'000 | CHF | 930'000 | 971'153 | 0.44 |
| CH1279261130 | HESLAN 4.2425 07/25/33 | 1'000'000 | CHF | 1'000'000 | 1'060'250 | 0.48 |
| CH1270825529 | MUNHYP 4.2525 06/07/33 EMTN | 2'000'000 | CHF | 2'000'000 | 2'114'500 | 0.95 |
| CH1244319450 | DB 3.645 01/27/29 EMTN | 2'000'000 | CHF | 2'005'000 | 2'070'000 | 0.93 |
| CH1204259811 | DBHNGR 1.95 09/21/32 EMTN | 1'000'000 | CHF | 1'050'250 | 1'050'500 | 0.47 |
| CH1134691620 | DB 0.315 09/14/27 EMTN | 800'000 | CHF | 799'600 | 757'000 | 0.34 |
| CH1122290237 | MUNHYP 0.05 08/13/36 EMTN | 1'000'000 | CHF | 780'000 | 841'250 | 0.38 |
| CH0581947808 | DBHNGR 0.1 01/28/36 EMTN | 3'000'000 | CHF | 2'988'750 | 2'565'000 | 1.16 |
| CH0561923852 | BHH 0 1/4 09/11/28 EMTN | 1'500'000 | CHF | 1'316'700 | 1'398'000 | 0.63 |
| CH0522158887 | DBHNGR 0.2 05/20/33 EMTN | 1'000'000 | CHF | 838'800 | 898'000 | 0.41 |
| CH0479514272 | DBHNGR 0.1 06/19/29 EMNT | 840'000 | CHF | 809'170 | 790'440 | 0.36 |
| CH0463112059 | MUNHYP 0.55 03/15/34 EMTN | 1'000'000 | CHF | 1'002'160 | 917'000 | 0.41 |
| CH0417086086 | MUNHYP 0 1/2 06/14/28 EMTN | 4'500'000 | CHF | 4'827'109 | 4'348'125 | 1.96 |
| CH0385997108 | DBHNGR 0.45 11/08/30 EMTN | 1'000'000 | CHF | 1'049'200 | 948'250 | 0.43 |
| CH0026096567 | CMZB 3 1/8 07/14/25 EMTN | 2'000'000 | CHF | 2'122'200 | 2'048'700 | 0.92 |
| | | | | 23'518'939 | 22'778'168 | 10.28 |
| DK | | | | | | |
| CH0026985520 | KOMMUN 2 7/8 10/13/31 EMTN | 800'000 | CHF | 1'209'200 | 896'400 | 0.40 |
| | | | | 1'209'200 | 896'400 | 0.40 |
| ES | | | | | | |
| CH1228837907 | BBVASM 2.77 11/28/28 GMTN | 2'000'000 | CHF | 2'000'000 | 2'094'000 | 0.94 |
| CH1227937724 | SANTAN 2.2475 01/30/26 EMTN | 1'000'000 | CHF | 1'000'000 | 1'012'000 | 0.46 |
| CH0428194200 | SANTAN 1 12/10/24 EMTN | 1'000'000 | CHF | 992'600 | 992'850 | 0.45 |
| | | | | 3'992'600 | 4'098'850 | 1.85 |
| FI | | | | | | |
| CH1264823514 | NDAFH 2.49 05/26/28 EMTN | 2'000'000 | CHF | 2'000'000 | 2'056'000 | 0.93 |
| | | | | 2'000'000 | 2'056'000 | 0.93 |
| FR | | | | | | |
| CH1321113453 | BFCM 2.2225 01/30/32 EMTN | 1'000'000 | CHF | 1'000'000 | 1'023'250 | 0.46 |
| CH1298957064 | SOCGEN 2.6825 10/19/29 EMTN | 1'000'000 | CHF | 1'000'000 | 1'040'250 | 0.47 |
| CH1279261148 | CFE 1.8375 07/18/30 EMTN | 1'000'000 | CHF | 1'000'900 | 1'027'250 | 0.46 |
| CH1277582008 | ENGIFP 2.34 01/04/27 EMTN | 1'000'000 | CHF | 1'000'070 | 1'023'250 | 0.46 |

| ISIN Nummer | Bezeichnung | Stückzahl / Nennwert | Währung | Einstandswert | Marktwert | % des Netto- vermögens |
|--------------|-----------------------------|-------------------------|---------|-------------------|-------------------|---------------------------|
| CH1277240938 | FRLBP 2.7725 07/12/27 EMTN | 1'000'000 | CHF | 1'000'000 | 1'036'000 | 0.47 |
| CH1277028440 | SNCF 1.985 06/28/33 EMTN | 1'000'000 | CHF | 1'017'200 | 1'052'250 | 0.47 |
| CH1270825511 | BPCEGP 2.655 06/12/30 EMTN | 1'000'000 | CHF | 1'000'000 | 1'040'250 | 0.47 |
| CH1256367207 | ACAFP 2.5075 04/27/27 EMTN | 3'000'000 | CHF | 3'009'700 | 3'084'000 | 1.39 |
| CH1251030107 | CFF 1.903 06/16/28 EMTN | 2'000'000 | CHF | 2'000'000 | 2'048'000 | 0.92 |
| CH1244321761 | BNP 2.63 06/07/29 EMTN | 2'000'000 | CHF | 2'014'000 | 2'087'000 | 0.94 |
| CH1242969199 | BFCM 2.3 01/30/27 EMTN | 2'000'000 | CHF | 2'001'030 | 2'041'500 | 0.92 |
| CH1231312690 | ACAFP 2.19 12/07/27 EMTN | 1'000'000 | CHF | 1'000'000 | 1'018'000 | 0.46 |
| CH1213243913 | ACAFP 3.0425 09/29/27 EMTN | 1'600'000 | CHF | 1'616'320 | 1'665'600 | 0.75 |
| CH1159841332 | SOCGEN 0.28 01/26/27 EMTN | 2'000'000 | CHF | 1'929'800 | 1'913'000 | 0.86 |
| CH1142754303 | BFCM 0.15 03/06/28 EMTN | 1'000'000 | CHF | 1'001'170 | 938'750 | 0.42 |
| CH1125186663 | BNP 0.1475 07/13/27 EMTN | 2'000'000 | CHF | 1'948'000 | 1'896'500 | 0.86 |
| CH0521617339 | SOCGEN 0 1/4 02/25/27 EMTN | 1'000'000 | CHF | 1'005'560 | 949'250 | 0.43 |
| CH0506071346 | CDCEPS 0 06/16/26 EMTN | 1'000'000 | CHF | 1'017'780 | 970'000 | 0.44 |
| CH0506071205 | BNP 0.15 03/10/28 EMTN | 1'800'000 | CHF | 1'616'400 | 1'681'200 | 0.76 |
| CH0479514264 | BFCM 0.2 06/12/26 EMTN | 2'000'000 | CHF | 1'963'880 | 1'940'000 | 0.88 |
| CH0435590382 | ACACB 0 1/2 10/03/28 EMTN | 1'500'000 | CHF | 1'378'200 | 1'448'250 | 0.65 |
| CH0310175598 | ACACB 0.1 01/26/26 eMTN | 300'000 | CHF | 287'475 | 292'725 | 0.13 |
| CH0305398247 | ACACB 0 1/4 06/18/26 EMTN | 25'000 | CHF | 25'525 | 24'381 | 0.01 |
| CH0125067774 | RESFER 2 5/8 03/11/37 EMTN | 4'000'000 | CHF | 5'989'423 | 4'589'000 | 2.07 |
| CH0118532735 | AGFRNC 1 7/8 11/12/29 EMTN | 5'305'000 | CHF | 6'712'228 | 5'454'866 | 2.46 |
| | | | | 43'534'662 | 41'284'523 | 18.63 |
| | GB | | | | | |
| CH1292012775 | SANUK 2.01 09/12/26 EMTN | 1'000'000 | CHF | 1'000'000 | 1'017'750 | 0.46 |
| CH1280994299 | NWIDE 2.97 09/08/27 EMTN | 1'000'000 | CHF | 1'000'000 | 1'023'500 | 0.46 |
| CH1280994281 | LLOYDS 1.87 08/31/27 EMTN | 1'000'000 | CHF | 1'000'000 | 1'018'000 | 0.46 |
| CH1270825545 | NWG 2.8575 06/06/28 EMTN | 1'000'000 | CHF | 1'000'000 | 1'038'500 | 0.47 |
| CH1236363417 | NWIDE 2.0125 01/23/30 | 1'000'000 | CHF | 1'000'000 | 1'035'250 | 0.47 |
| CH1231312708 | NWG 2.7825 12/06/27 EMTN | 1'000'000 | CHF | 1'000'000 | 1'033'750 | 0.47 |
| CH1187520494 | HSBC 1.805 06/01/26 EMTN | 1'000'000 | CHF | 983'750 | 997'500 | 0.45 |
| CH1154887157 | LLOYDS 0.6025 02/09/29 EMTN | 3'000'000 | CHF | 2'782'200 | 2'799'750 | 1.26 |
| CH0485445982 | NWIDE 0 07/11/25 EMTN | 2'650'000 | CHF | 2'697'806 | 2'593'688 | 1.17 |
| | | | | 12'463'756 | 12'557'688 | 5.67 |
| | KR | | | | | |
| CH1271360633 | KORWAT 2.1725 09/18/25 EMTN | 910'000 | CHF | 910'000 | 917'963 | 0.41 |
| CH1243933574 | KHFC 1.815 02/10/26 | 2'000'000 | CHF | 1'992'000 | 2'011'000 | 0.91 |
| CH1239495042 | HYUCAP 3.0325 02/01/28 | 1'000'000 | CHF | 1'000'000 | 1'039'500 | 0.47 |
| CH1231312716 | KOROIL 2.15 12/19/24 | 1'000'000 | CHF | 1'000'000 | 1'002'400 | 0.45 |
| CH1216400056 | KHFC 2.155 10/14/25 | 1'000'000 | CHF | 1'000'000 | 1'009'250 | 0.46 |
| CH0540633044 | KDB 0.445 05/08/25 EMTN | 1'000'000 | CHF | 969'900 | 985'450 | 0.44 |
| CH0506668851 | EIBKOR 0 05/27/25 EMTN | 500'000 | CHF | 495'875 | 490'300 | 0.22 |
| CH0370634633 | EIBKOR 0.17 07/18/25 GMTN | 2'000'000 | CHF | 2'000'000 | 1'960'700 | 0.88 |
| | | | | 9'367'775 | 9'416'563 | 4.25 |
| | LI | | | | | |
| CH1306117040 | LLBSW 2 1/2 11/22/30 | 1'600'000 | CHF | 1'602'288 | 1'646'000 | 0.74 |
| | | | | 1'602'288 | 1'646'000 | 0.74 |
| | MX | | | | | |
| CH0520663664 | BANORT 0 1/2 12/06/24 | 1'200'000 | CHF | 1'174'980 | 1'174'320 | 0.53 |
| | | | | 1'174'980 | 1'174'320 | 0.53 |

| ISIN Nummer | Bezeichnung | Stückzahl / Nennwert | Währung | Einstandswert | Marktwert | % des Netto- vermögens |
|---|-----------------------------|-------------------------|---------|-------------------|--------------------|---------------------------|
| NL | | | | | | |
| CH1322499620 | VW 2.4925 02/12/30 EMTN | 870'000 | CHF | 870'000 | 881'910 | 0.40 |
| CH1276269722 | ABNANV 2.505 06/26/28 | 1'000'000 | CHF | 1'000'000 | 1'031'000 | 0.47 |
| CH1181713640 | RABOBK 1.3625 04/28/28 GMTN | 400'000 | CHF | 386'800 | 391'800 | 0.18 |
| CH1175016125 | DLR 1.7 03/30/27 | 1'000'000 | CHF | 986'500 | 986'250 | 0.45 |
| CH1121837244 | DLR 0.55 04/16/29 | 500'000 | CHF | 433'750 | 460'000 | 0.21 |
| CH0026620846 | RABOBK 3 1/8 09/15/26 | 2'000'000 | CHF | 2'334'000 | 2'083'500 | 0.94 |
| | | | | 6'011'050 | 5'834'460 | 2.63 |
| NO | | | | | | |
| CH1273429691 | DNBNO 2.685 06/15/28 EMTN | 1'000'000 | CHF | 1'000'000 | 1'019'250 | 0.46 |
| CH1249416012 | NONGNO 2.7 03/20/29 EMTN | 1'800'000 | CHF | 1'803'960 | 1'847'700 | 0.83 |
| CH1230759537 | KBN 1.275 12/22/27 EMTN | 1'000'000 | CHF | 1'000'000 | 1'003'750 | 0.45 |
| CH1184694730 | DNBNO 1.1675 06/03/27 EMTN | 500'000 | CHF | 480'830 | 491'875 | 0.22 |
| CH0474977755 | NONGNO 0 1/8 12/11/25 EMTN | 550'000 | CHF | 524'975 | 536'525 | 0.24 |
| | | | | 4'809'765 | 4'899'100 | 2.21 |
| NZ | | | | | | |
| CH1251030115 | ASBBNK 2.5025 12/20/28 EMTN | 1'500'000 | CHF | 1'497'750 | 1'554'000 | 0.70 |
| CH0357520433 | ANZNZ 0 1/4 09/22/25 EMTN | 1'000'000 | CHF | 1'004'210 | 979'000 | 0.44 |
| CH0350030414 | ASBBNK 0.2 08/02/24 Emtn | 1'000'000 | CHF | 1'000'300 | 992'850 | 0.45 |
| | | | | 3'502'260 | 3'525'850 | 1.59 |
| SE | | | | | | |
| CH1184694748 | STAAKA 0.78 05/24/28 EMTN | 1'000'000 | CHF | 952'200 | 978'250 | 0.44 |
| CH1166151964 | STAAKA 0.35 03/24/27 | 800'000 | CHF | 800'000 | 776'200 | 0.35 |
| | | | | 1'752'200 | 1'754'450 | 0.79 |
| US | | | | | | |
| CH1271360625 | EQIX 2 7/8 09/12/28 | 1'950'000 | CHF | 1'950'000 | 2'034'338 | 0.92 |
| CH1255924461 | MASSMU 2.65 05/03/28 EMTN | 1'000'000 | CHF | 1'000'930 | 1'038'750 | 0.47 |
| CH1137122839 | PACLIF 0 1/4 10/26/28 EMTN | 300'000 | CHF | 287'100 | 278'025 | 0.13 |
| CH0569237677 | MET 0 1/8 09/25/28 EMTN | 4'000'000 | CHF | 4'036'800 | 3'740'000 | 1.69 |
| CH0564642095 | NYLIFE 0 1/8 09/11/29 EMTN | 500'000 | CHF | 440'750 | 461'375 | 0.21 |
| CH0517825268 | JXN 0 1/8 07/14/28 EMTN | 3'000'000 | CHF | 3'002'550 | 2'725'500 | 1.23 |
| CH0503924414 | C 0 1/2 11/01/28 EMTN | 2'500'000 | CHF | 2'493'660 | 2'360'000 | 1.07 |
| CH0474977722 | BAC 0.2525 06/12/26 EMTN | 3'000'000 | CHF | 3'000'000 | 2'910'000 | 1.31 |
| | | | | 16'211'790 | 15'547'988 | 7.02 |
| XS | | | | | | |
| CH1231312682 | CABEI 2.1375 12/13/27 EMTN | 1'000'000 | CHF | 993'000 | 1'013'750 | 0.46 |
| CH1151526238 | CAF 0.45 02/24/27 EMTN | 4'000'000 | CHF | 3'965'250 | 3'832'000 | 1.73 |
| CH1148308716 | CABEI 0.11 12/15/28 EMTN | 1'000'000 | CHF | 959'500 | 923'250 | 0.42 |
| CH0550103078 | CABEI 0.405 06/25/25 EMTN | 1'000'000 | CHF | 1'027'500 | 981'600 | 0.44 |
| CH0463112042 | FNPLAT 0.578 03/11/24 | 750'000 | CHF | 750'000 | 748'425 | 0.34 |
| CH0260067779 | CAF 1 1/2 12/01/28 EMTN | 2'000'000 | CHF | 1'889'300 | 1'963'500 | 0.89 |
| CH0215376325 | EIB 1 3/4 06/28/33 | 425'000 | CHF | 580'763 | 447'049 | 0.20 |
| | | | | 10'165'313 | 9'909'574 | 4.47 |
| Summe - Anleihen | | | | | 205'140'907 | |
| Summe - Amtlich notierte sowie an anderen geregelten Märkten gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | | | | | 205'140'907 | |
| Anlagefonds | | | | | | |

| ISIN Nummer | Bezeichnung | Stückzahl / Nennwert | Währung | Einstandswert | Marktwert | % des Netto- vermögens |
|--------------------------------------|---|-------------------------|---------|-------------------|--------------------|---------------------------|
| LU | | | | | | |
| LU2368700907 | SWC (LU) BF Resp. Corporate Hybrid STH CHF | 46 | CHF | 4'037'239 | 4'246'044 | 1.92 |
| LU2108482741 | SWC (LU) BF Responsible EmMa Opps NTH CHF | 45'591 | CHF | 4'275'524 | 4'337'984 | 1.96 |
| LU1506499356 | SWC (LU) BF Sust Glbl High Yield NTH CHF | 38'959 | CHF | 4'065'747 | 4'270'729 | 1.93 |
| LU0866336125 | SWC (LU) BF Responsible COCO NTH CHF | 26'759 | CHF | 3'252'915 | 3'785'070 | 1.71 |
| | | | | 15'631'424 | 16'639'827 | 7.51 |
| Summe - Anlagefonds | | | | | 16'639'827 | |
| Summe - Anlagefonds | | | | | 16'639'827 | |
| SUMME DES WERTPAPIERBESTANDES | | | | | 221'780'734 | 100.08 |

20 Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible EUR

Wertpapierbestand zum 31.01.2024 (Angaben in EUR)

| ISIN Nummer | Bezeichnung | Stückzahl / Nennwert | Währung | Einstandswert | Marktwert | % des Netto- vermögens |
|---|----------------------------|-------------------------|---------|------------------|------------------|---------------------------|
| Amtlich notierte sowie an anderen geregelten Märkten gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | | | | | | |
| Anleihen | | | | | | |
| AE | | | | | | |
| XS2466186074 | FABUH 1 5/8 04/07/27 EMTN | 500'000 | EUR | 498'455 | 470'190 | 0.32 |
| | | | | 498'455 | 470'190 | 0.32 |
| AT | | | | | | |
| XS2024602240 | ASFING 0.1 07/09/29 | 700'000 | EUR | 698'537 | 613'018 | 0.42 |
| AT0000A33SH3 | RAGB 2.9 05/23/29 | 550'000 | EUR | 548'411 | 564'273 | 0.39 |
| AT0000A32HA3 | HYN0E 4 02/01/27 EMTN | 500'000 | EUR | 498'860 | 505'275 | 0.35 |
| AT0000A2WSC8 | RAGB 0.9 02/20/32 | 1'000'000 | EUR | 933'690 | 878'620 | 0.60 |
| AT0000A2QQB6 | RAGB 0.7 04/20/2071 | 1'000'000 | EUR | 442'615 | 459'490 | 0.32 |
| AT0000A2KQ43 | RAGB 0 10/20/40 | 1'000'000 | EUR | 859'695 | 616'650 | 0.42 |
| AT0000A269M8 | RAGB 0 1/2 02/20/29 | 1'500'000 | EUR | 1'562'220 | 1'365'525 | 0.94 |
| AT0000A1VGK0 | RAGB 0 1/2 04/20/27 | 500'000 | EUR | 483'130 | 471'365 | 0.32 |
| | | | | 6'027'158 | 5'474'216 | 3.76 |
| AU | | | | | | |
| XS1748436190 | WSTP 0 1/2 01/16/25 EMTN | 300'000 | EUR | 298'194 | 291'453 | 0.20 |
| | | | | 298'194 | 291'453 | 0.20 |
| BE | | | | | | |
| BE6342263157 | AZELIS 5 3/4 03/15/28 REGS | 200'000 | EUR | 200'000 | 206'918 | 0.14 |
| BE0000360694 | BGB 2.85 10/22/34 100 | 600'000 | EUR | 598'728 | 603'588 | 0.41 |
| BE0000355645 | BGB 1.4 06/22/53 95 | 500'000 | EUR | 432'394 | 325'420 | 0.22 |
| BE0000352618 | BGB 0 10/22/31 92 | 700'000 | EUR | 543'354 | 576'191 | 0.40 |
| BE0000304130 | BGB 5 03/28/35 44 | 600'000 | EUR | 771'747 | 723'792 | 0.50 |
| | | | | 2'546'223 | 2'435'909 | 1.67 |
| BG | | | | | | |
| XS2579483319 | BGARIA 4 1/2 01/27/33 REGS | 500'000 | EUR | 489'075 | 523'840 | 0.36 |
| | | | | 489'075 | 523'840 | 0.36 |
| CA | | | | | | |
| XS2539371653 | ONTTFT 3.3 10/05/29 REGS | 500'000 | EUR | 498'860 | 507'495 | 0.35 |
| XS2475513953 | ONTTFT 1.85 05/03/32 REGS | 400'000 | EUR | 399'456 | 363'396 | 0.25 |
| XS2411135150 | ONTTFT 0.95 11/24/51 EMTN | 300'000 | EUR | 299'220 | 166'365 | 0.11 |
| XS2381362966 | BNS 0 1/4 11/01/28 EMTN | 500'000 | EUR | 499'820 | 434'740 | 0.30 |
| XS2027438899 | CPPIBC 0 3/4 07/15/49 EMTN | 350'000 | EUR | 339'675 | 205'097 | 0.14 |
| | | | | 2'037'031 | 1'677'093 | 1.15 |
| CH | | | | | | |
| XS2589907653 | UBS 5 1/2 08/20/26 EMTN | 700'000 | EUR | 697'956 | 736'540 | 0.51 |
| CH1266847149 | ZKB 4.156 06/08/29 | 800'000 | EUR | 800'000 | 821'496 | 0.56 |
| CH1194000340 | UBS 2 3/4 06/15/27 EMTN | 500'000 | EUR | 499'740 | 490'350 | 0.34 |
| CH1111393000 | ZKB 0 05/15/26 175 | 500'000 | EUR | 502'710 | 466'205 | 0.32 |
| CH0576402181 | UBS 0 1/4 11/05/28 EMTN | 500'000 | EUR | 495'965 | 441'690 | 0.30 |
| | | | | 2'996'371 | 2'956'281 | 2.03 |
| CZ | | | | | | |

| ISIN Nummer | Bezeichnung | Stückzahl / Nennwert | Währung | Einstandswert | Marktwert | % des Netto- vermögens |
|--------------|----------------------------|-------------------------|---------|-------------------|-------------------|---------------------------|
| AT0000A2STV4 | CESSPO 0 1/2 09/13/28 EMTN | 500'000 | EUR | 499'380 | 436'605 | 0.30 |
| | | | | 499'380 | 436'605 | 0.30 |
| | DE | | | | | |
| XS2751678272 | ENBW 5 1/4 01/23/2084 | 300'000 | EUR | 300'000 | 305'088 | 0.21 |
| XS2745726047 | VW 4 04/11/31 EMTN | 325'000 | EUR | 322'748 | 329'430 | 0.23 |
| XS2722190795 | DBHNGR 4 11/23/43 EMTN | 400'000 | EUR | 393'864 | 431'792 | 0.30 |
| XS2388457264 | KFW 0 09/15/31 EMTN | 1'000'000 | EUR | 996'900 | 823'910 | 0.57 |
| XS2381261424 | MUNRE 1 05/26/42 | 200'000 | EUR | 198'710 | 158'152 | 0.11 |
| XS2233088132 | HHOCGR 0 1/8 02/24/31 | 500'000 | EUR | 494'765 | 413'180 | 0.28 |
| DE000NRWOMP9 | NRW 0.95 01/10/2121 EMTN | 800'000 | EUR | 334'904 | 357'480 | 0.25 |
| DE000DL19WU8 | DB 3 1/4 05/24/28 | 200'000 | EUR | 199'184 | 196'322 | 0.13 |
| DE000A3823H4 | ALVGR 4.851 07/26/54 | 500'000 | EUR | 500'140 | 513'095 | 0.35 |
| DE000A30VTT8 | ALVGR 4.597 09/07/38 EMTN | 200'000 | EUR | 200'000 | 204'558 | 0.14 |
| DE000A30VT06 | DB 5 09/05/30 | 300'000 | EUR | 294'993 | 311'913 | 0.21 |
| DE000A30VHW7 | NIESA 1 1/2 10/17/29 | 750'000 | EUR | 747'308 | 708'083 | 0.49 |
| DE000A289FK7 | ALVGR 2 5/8 PERP | 200'000 | EUR | 200'016 | 158'158 | 0.11 |
| DE000A168Y55 | KFW 0 3/8 03/09/26 | 1'000'000 | EUR | 989'000 | 953'840 | 0.66 |
| DE0001135481 | DBR 2 1/2 07/04/44 | 700'000 | EUR | 967'885 | 707'854 | 0.49 |
| DE0001135275 | DBR 4 01/04/37 | 1'000'000 | EUR | 1'518'378 | 1'186'830 | 0.82 |
| DE0001135226 | DBR 4 3/4 07/04/34 | 1'000'000 | EUR | 1'461'176 | 1'236'480 | 0.85 |
| DE0001102465 | DBR 0 1/4 02/15/29 | 1'200'000 | EUR | 1'056'972 | 1'099'752 | 0.76 |
| DE0001102424 | DBR 0 1/2 08/15/27 | 750'000 | EUR | 770'269 | 709'883 | 0.49 |
| DE0001102382 | DBR 1 08/15/25 | 1'000'000 | EUR | 1'021'470 | 975'190 | 0.67 |
| DE0001030757 | DBR 1.8 08/15/53 G | 1'500'000 | EUR | 1'268'145 | 1'312'200 | 0.90 |
| DE0001030716 | OBL 0 10/10/25 G | 1'000'000 | EUR | 941'740 | 959'910 | 0.66 |
| DE0001030708 | DBR 0 08/15/30 G | 3'000'000 | EUR | 2'573'377 | 2'637'000 | 1.81 |
| | | | | 17'751'944 | 16'690'099 | 11.47 |
| | DK | | | | | |
| XS2591029876 | ORSTED 3 3/4 03/01/30 EMTN | 400'000 | EUR | 397'056 | 408'956 | 0.28 |
| | | | | 397'056 | 408'956 | 0.28 |
| | EE | | | | | |
| XS2532370231 | ESTONI 4 10/12/32 | 800'000 | EUR | 798'512 | 850'320 | 0.58 |
| | | | | 798'512 | 850'320 | 0.58 |
| | ES | | | | | |
| XS2638924709 | BBVASM 8 3/8 PERP | 400'000 | EUR | 400'000 | 429'512 | 0.30 |
| XS2634826031 | SANTAN 4 1/4 06/12/30 EMTN | 700'000 | EUR | 699'251 | 732'662 | 0.50 |
| XS2356033147 | ICO 0 04/30/27 EMTN | 700'000 | EUR | 613'515 | 639'996 | 0.44 |
| ES0344251022 | CAZAR 4 3/8 07/30/28 | 200'000 | EUR | 199'722 | 202'152 | 0.14 |
| ES0200002097 | ADIFAL 3 1/2 07/30/28 EMTN | 400'000 | EUR | 398'960 | 407'388 | 0.28 |
| ES0200002089 | ADIFAL 3.9 04/30/33 emtn | 500'000 | EUR | 499'225 | 518'545 | 0.36 |
| ES0000090888 | ANDAL 0.7 07/30/33 | 400'000 | EUR | 398'620 | 314'628 | 0.22 |
| ES0000012L60 | SPGB 3.9 07/30/39 | 1'000'000 | EUR | 1'029'502 | 1'043'180 | 0.72 |
| ES0000012J07 | SPGB 1 07/30/42 | 1'300'000 | EUR | 1'056'110 | 850'109 | 0.58 |
| ES0000012H41 | SPGB 0.1 04/30/31 | 2'000'000 | EUR | 1'806'998 | 1'645'920 | 1.13 |
| ES0000012E69 | SPGB 1.85 07/30/35 | 500'000 | EUR | 567'920 | 434'755 | 0.30 |
| ES0000012932 | SPGB 4.2 01/31/37 | 700'000 | EUR | 894'521 | 764'624 | 0.53 |
| ES00000128Q6 | SPGB 2.35 07/30/33 | 2'000'000 | EUR | 1'815'320 | 1'887'440 | 1.30 |
| ES00000128P8 | SPGB 1 1/2 04/30/27 | 1'600'000 | EUR | 1'556'936 | 1'545'440 | 1.06 |
| ES00000128E2 | SPGB 3.45 07/30/66 | 300'000 | EUR | 320'115 | 273'777 | 0.19 |

| ISIN Nummer | Bezeichnung | Stückzahl / Nennwert | Währung | Einstandswert | Marktwert | % des Netto- vermögens |
|--------------|----------------------------|-------------------------|---------|-------------------|-------------------|---------------------------|
| ES0000012729 | SPGB 1.95 04/30/26 | 3'500'000 | EUR | 3'478'962 | 3'444'245 | 2.37 |
| | | | | 15'735'676 | 15'134'373 | 10.40 |
| | FI | | | | | |
| XS2718201515 | NESVFH 3 7/8 05/21/31 EMTN | 450'000 | EUR | 445'478 | 464'265 | 0.32 |
| XS2465142755 | OPBANK 1 10/05/27 EMTN | 1'000'000 | EUR | 912'500 | 935'860 | 0.64 |
| XS2436153139 | AKTIA 0 1/8 10/25/28 EMTN | 1'000'000 | EUR | 847'920 | 883'420 | 0.61 |
| XS2324321368 | OPBANK 0.05 03/25/31 | 1'000'000 | EUR | 785'700 | 816'030 | 0.56 |
| XS2023679843 | KUNTA 0.05 09/06/29 EMTN | 1'550'000 | EUR | 1'463'880 | 1'348'996 | 0.93 |
| XS1692485912 | KUNTA 0 3/4 09/07/27 EMTN | 1'000'000 | EUR | 905'920 | 938'480 | 0.64 |
| | | | | 5'361'398 | 5'387'051 | 3.70 |
| | FR | | | | | |
| XS2737652474 | AXASA 6 3/8 PERP EMTN | 600'000 | EUR | 600'000 | 611'964 | 0.42 |
| XS2022425024 | RESFER 0 3/4 05/25/36 EMTN | 500'000 | EUR | 491'155 | 376'005 | 0.26 |
| FR001400NCB6 | SOCGEN 5 3/4 01/22/32 EMTN | 600'000 | GBP | 694'814 | 710'732 | 0.49 |
| FR001400M2F4 | RCFFP 5 1/4 11/22/28 EMTN | 500'000 | EUR | 496'575 | 529'110 | 0.36 |
| FR001400LWN3 | BFCM 4 3/4 11/10/31 EMTN | 800'000 | EUR | 796'512 | 848'984 | 0.58 |
| FR001400KKC3 | VIEFP 5.993 PERP | 500'000 | EUR | 500'000 | 527'010 | 0.36 |
| FR001400KHI6 | ENGIFP 4 1/2 09/06/42 EMTN | 500'000 | EUR | 493'755 | 531'295 | 0.37 |
| FR001400ITG9 | BPCECB 3 3/8 06/27/33 | 700'000 | EUR | 699'125 | 721'105 | 0.50 |
| FR001400H9B5 | BNP 4 1/4 04/13/31 EMTN | 500'000 | EUR | 496'800 | 517'335 | 0.36 |
| FR001400DQ84 | SUEZFP 4 5/8 11/03/28 EMTN | 500'000 | EUR | 498'950 | 526'875 | 0.36 |
| FR0014009HA0 | BNP 2 1/2 03/31/32 EMTN | 500'000 | EUR | 499'650 | 472'845 | 0.32 |
| FR0014007LL3 | BPCEGP 0 1/2 01/14/28 EMTN | 400'000 | EUR | 397'448 | 365'384 | 0.25 |
| FR0014006XA3 | SOCGEN 0 5/8 12/02/27 | 400'000 | EUR | 398'080 | 367'676 | 0.25 |
| FR0014006G24 | ATOPF 1 11/12/29 | 200'000 | EUR | 198'340 | 51'136 | 0.04 |
| FR0014005SE7 | ALSFR 0 3/8 10/05/31 EMTN | 600'000 | EUR | 596'484 | 498'954 | 0.34 |
| FR0014003OC5 | IDFMOB 0.4 05/28/31 EMTN | 500'000 | EUR | 499'755 | 421'000 | 0.29 |
| FR0014003C70 | BPIFRA 0 05/25/28 EMTN | 500'000 | EUR | 500'495 | 446'365 | 0.31 |
| FR0014003513 | FRTR 0 02/25/27 | 1'000'000 | EUR | 1'021'500 | 930'420 | 0.64 |
| FR0014003067 | IDF 0 04/20/28 EMTN | 600'000 | EUR | 604'896 | 535'032 | 0.37 |
| FR0014001MO8 | BPCECB 0.01 01/29/29 EMTN | 1'000'000 | EUR | 832'500 | 867'690 | 0.60 |
| FR00140007J7 | BFCM 0 5/8 02/21/31 EMTN | 1'000'000 | EUR | 776'400 | 816'630 | 0.56 |
| FR00140005J1 | BNP 0 3/8 10/14/27 EMTN | 700'000 | EUR | 665'141 | 645'708 | 0.44 |
| FR0013459757 | CAFFIL 0.1 11/13/29 EMTN | 1'000'000 | EUR | 819'900 | 854'360 | 0.59 |
| FR0013404969 | FRTR 1 1/2 05/25/50 | 1'000'000 | EUR | 673'470 | 705'650 | 0.48 |
| FR0013313582 | FRTR 1 1/4 05/25/34 | 2'000'000 | EUR | 1'651'320 | 1'742'360 | 1.20 |
| FR0013286192 | FRTR 0 3/4 05/25/28 | 3'000'000 | EUR | 2'874'320 | 2'805'360 | 1.93 |
| FR0013264488 | RATPPF 0 7/8 05/25/27 EMTN | 400'000 | EUR | 398'944 | 376'368 | 0.26 |
| FR0013150257 | CAFFIL 0 5/8 04/13/26 EMTN | 500'000 | EUR | 462'495 | 475'515 | 0.33 |
| FR0012558310 | FRTR 0.1 03/01/25 OATi | 2'000'000 | EUR | 2'312'539 | 2'330'280 | 1.60 |
| FR0012517027 | FRTR 0 1/2 05/25/25 | 1'500'000 | EUR | 1'529'280 | 1'455'150 | 1.00 |
| FR0010070060 | FRTR 4 3/4 04/25/35 | 500'000 | EUR | 624'255 | 594'740 | 0.41 |
| FR0000571218 | FRTR 5 1/2 04/25/29 | 1'000'000 | EUR | 1'324'698 | 1'150'660 | 0.79 |
| | | | | 25'429'597 | 24'809'698 | 17.04 |
| | GB | | | | | |
| XS2745115837 | NWG 3 5/8 01/09/29 EMTN | 600'000 | EUR | 597'870 | 602'364 | 0.41 |
| XS2742661122 | MOTOPG 5 5/8 01/24/54 EMTN | 350'000 | GBP | 406'948 | 430'412 | 0.30 |
| XS2675685700 | SSELN 4 09/05/31 EMTN | 700'000 | EUR | 699'762 | 728'336 | 0.50 |
| XS2673969650 | IDSLN 5 1/4 09/14/28 | 500'000 | EUR | 497'875 | 522'175 | 0.36 |

| ISIN Nummer | Bezeichnung | Stückzahl / Nennwert | Währung | Einstandswert | Marktwert | % des Netto- vermögens |
|--------------|----------------------------|-------------------------|---------|-------------------|-------------------|---------------------------|
| XS2662538425 | BACR 4.918 08/08/30 EMTN | 800'000 | EUR | 801'100 | 833'784 | 0.57 |
| XS2623518821 | NWG 4.771 02/16/29 EMTN | 700'000 | EUR | 699'993 | 726'516 | 0.50 |
| XS2593105476 | AZN 3 3/4 03/03/32 EMTN | 700'000 | EUR | 699'944 | 732'935 | 0.50 |
| XS2342060360 | BACR 1.106 05/12/32 | 1'000'000 | EUR | 768'820 | 813'220 | 0.56 |
| | | | | 5'172'312 | 5'389'742 | 3.70 |
| | GR | | | | | |
| XS2747093321 | TPEIR 7 1/4 04/17/34 EMTN | 800'000 | EUR | 796'152 | 816'320 | 0.56 |
| | | | | 796'152 | 816'320 | 0.56 |
| | IE | | | | | |
| IE00BV8C9418 | IRISH 1 05/15/26 | 500'000 | EUR | 476'630 | 484'860 | 0.33 |
| | | | | 476'630 | 484'860 | 0.33 |
| | IS | | | | | |
| XS2679765037 | LANBNN 6 3/8 03/12/27 EMTN | 700'000 | EUR | 698'207 | 729'792 | 0.50 |
| | | | | 698'207 | 729'792 | 0.50 |
| | IT | | | | | |
| XS2739132897 | ENIIM 3 7/8 01/15/34 EMTN | 400'000 | EUR | 397'108 | 405'368 | 0.28 |
| XS2673808726 | ISPIM 5 1/8 08/29/31 EMTN | 900'000 | EUR | 893'547 | 971'073 | 0.67 |
| XS2592658947 | ISPIM 5 5/8 03/08/33 eMTN | 200'000 | EUR | 198'508 | 218'236 | 0.15 |
| XS2576550086 | ENELIM 6 3/8 PERP EMTN | 200'000 | EUR | 200'000 | 212'576 | 0.15 |
| XS2360310044 | UCGIM 0.8 07/05/29 EMTN | 1'100'000 | EUR | 928'082 | 980'826 | 0.67 |
| XS2317069685 | ISPIM 0 3/4 03/16/28 EMTN | 1'000'000 | EUR | 857'130 | 904'600 | 0.62 |
| IT0005570988 | UCGIM 4.6 02/14/30 EMTN | 1'000'000 | EUR | 998'870 | 1'043'370 | 0.72 |
| IT0005568123 | CDEP 4 3/4 10/18/30 EMTN | 500'000 | EUR | 496'860 | 527'785 | 0.36 |
| IT0005549362 | UCGIM 3 3/8 01/31/27 emTN | 1'000'000 | EUR | 986'740 | 1'008'390 | 0.69 |
| IT0005542359 | BTPS 4 10/30/31 8Y | 1'000'000 | EUR | 999'374 | 1'040'130 | 0.71 |
| IT0005532723 | BTPS 2 03/14/28 ICPI | 1'000'000 | EUR | 1'000'000 | 1'003'005 | 0.69 |
| IT0005521981 | BTPS 3.4 04/01/28 5Y | 1'000'000 | EUR | 991'150 | 1'016'510 | 0.70 |
| IT0005508590 | BTPS 4 04/30/35 13Y | 1'000'000 | EUR | 988'592 | 1'019'790 | 0.70 |
| IT0005489932 | BAMIIM 0 3/4 03/15/27 EMTN | 1'000'000 | EUR | 892'910 | 927'060 | 0.64 |
| IT0005467482 | BTPS 0.45 02/15/29 7Y | 1'000'000 | EUR | 827'780 | 878'730 | 0.60 |
| IT0005454241 | BTPS 0 08/01/26 5Y | 1'700'000 | EUR | 1'650'150 | 1'584'094 | 1.09 |
| IT0005438004 | BTPS 1 1/2 04/30/45 34Y | 500'000 | EUR | 304'635 | 314'295 | 0.22 |
| IT0005436693 | BTPS 0.6 08/01/31 10Y | 600'000 | EUR | 542'340 | 490'422 | 0.34 |
| IT0005416570 | BTPS 0.95 09/15/27 7Y | 1'000'000 | EUR | 1'037'640 | 933'930 | 0.64 |
| IT0005387052 | BTPS 0.4 05/15/30 CPI | 500'000 | EUR | 503'710 | 559'003 | 0.38 |
| IT0005283491 | ISPIM 1 1/8 10/04/27 | 1'000'000 | EUR | 900'540 | 934'960 | 0.64 |
| IT0005240350 | BTPS 2.45 09/01/33 15Y | 1'000'000 | EUR | 951'517 | 907'580 | 0.62 |
| IT0005170839 | BTPS 1.6 06/01/26 10Y | 3'000'000 | EUR | 2'858'613 | 2'916'330 | 2.00 |
| | | | | 20'405'796 | 20'798'063 | 14.29 |
| | JP | | | | | |
| XS2241387252 | MIZUHO 0.214 10/07/25 emtn | 700'000 | EUR | 700'000 | 664'839 | 0.46 |
| XS1675764945 | MUFUG 0.872 09/07/24 EMTN | 500'000 | EUR | 497'250 | 491'070 | 0.34 |
| | | | | 1'197'250 | 1'155'909 | 0.79 |
| | LT | | | | | |
| XS2604821228 | LITHUN 3 7/8 06/14/33 EMTN | 850'000 | EUR | 844'611 | 884'162 | 0.61 |
| | | | | 844'611 | 884'162 | 0.61 |
| | LU | | | | | |
| XS2760863329 | LHMCFI 6 1/2 03/15/29 REGS | 400'000 | EUR | 400'000 | 399'500 | 0.27 |

| ISIN Nummer | Bezeichnung | Stückzahl / Nennwert | Währung | Einstandswert | Marktwert | % des Netto- vermögens |
|--------------|-----------------------------|-------------------------|---------|-------------------|-------------------|---------------------------|
| XS2623489627 | DAN 8 1/2 07/15/31 REGS | 200'000 | EUR | 200'000 | 218'942 | 0.15 |
| XS2431319107 | LOGICR 2 01/17/34 EMTN | 250'000 | EUR | 246'408 | 194'855 | 0.13 |
| XS1752984440 | ARNDTN 4.542 PERP | 1'000'000 | EUR | 343'500 | 446'690 | 0.31 |
| LU2591861021 | LGB 3 1/4 03/02/43 | 1'000'000 | EUR | 989'460 | 1'041'210 | 0.72 |
| | | | | 2'179'368 | 2'301'197 | 1.58 |
| MX | | | | | | |
| XS2754067242 | MEX 4.4899 05/25/32 | 800'000 | EUR | 800'000 | 812'208 | 0.56 |
| | | | | 800'000 | 812'208 | 0.56 |
| NL | | | | | | |
| XS2715941949 | SDZSW 4 1/2 11/17/33 | 500'000 | EUR | 499'725 | 534'945 | 0.37 |
| XS2681541327 | ZFFNGR 6 1/8 03/13/29 EMTN | 500'000 | EUR | 497'390 | 526'890 | 0.36 |
| XS2673570995 | BNG 3 1/4 08/29/33 EMTN | 1'000'000 | EUR | 991'450 | 1'036'890 | 0.71 |
| XS2646608401 | TELEFO 6 3/4 PERP | 600'000 | EUR | 600'000 | 648'792 | 0.45 |
| XS2637069357 | ACHMEA 6 3/4 12/26/43 EMTN | 200'000 | EUR | 199'432 | 217'506 | 0.15 |
| XS2624554320 | OI 6 1/4 05/15/28 REGS | 200'000 | EUR | 200'000 | 208'564 | 0.14 |
| XS2613821300 | NEDWBK 3 04/20/33 | 600'000 | EUR | 595'314 | 611'754 | 0.42 |
| XS2575971994 | ABNANV 4 01/16/28 EMTN | 600'000 | EUR | 598'158 | 613'152 | 0.42 |
| XS2542914986 | EDPPL 3 7/8 03/11/30 emtn | 200'000 | EUR | 199'352 | 206'314 | 0.14 |
| XS2530756191 | WKLNA 3 09/23/26 | 250'000 | EUR | 249'805 | 250'385 | 0.17 |
| XS2483607474 | INTNED 2 1/8 05/23/26 EMTN | 700'000 | EUR | 687'572 | 685'195 | 0.47 |
| XS2462605671 | TELEFO 7 1/8 PERP | 200'000 | EUR | 200'000 | 217'492 | 0.15 |
| XS1797138960 | IBESM 2 5/8 PERP EMTN | 1'300'000 | EUR | 1'271'256 | 1'296'698 | 0.89 |
| XS1626191792 | NEDWBK 1 1/4 06/07/32 EMTN | 500'000 | EUR | 535'547 | 444'625 | 0.31 |
| NL0012818504 | NETHER 0 3/4 07/15/28 | 2'000'000 | EUR | 2'142'040 | 1'875'180 | 1.29 |
| NL0000102234 | NETHER 4 01/15/37 | 1'000'000 | EUR | 1'292'654 | 1'151'420 | 0.79 |
| | | | | 10'759'694 | 10'525'802 | 7.23 |
| NO | | | | | | |
| XS2631835332 | STATNE 3 1/2 06/08/33 EMTN | 450'000 | EUR | 449'402 | 465'129 | 0.32 |
| XS2289593670 | DNBNO 0.01 01/21/31 | 800'000 | EUR | 816'168 | 655'592 | 0.45 |
| XS2069102163 | KBN 0.05 10/24/29 | 500'000 | EUR | 497'810 | 432'615 | 0.30 |
| XS2063288190 | SRBANK 0.01 10/08/26 EMTN | 1'000'000 | EUR | 894'150 | 926'920 | 0.64 |
| XS2051032444 | MINGNO 0 1/8 09/11/26 EMTN | 1'000'000 | EUR | 884'566 | 920'870 | 0.63 |
| XS1617533275 | KBN 0 7/8 05/24/27 EMTN | 1'000'000 | EUR | 1'050'500 | 944'270 | 0.65 |
| | | | | 4'592'596 | 4'345'396 | 2.99 |
| NZ | | | | | | |
| XS2407197545 | AUCKCN 0 1/4 11/17/31 EMTN | 500'000 | EUR | 497'000 | 406'645 | 0.28 |
| XS2353483733 | BZLNZ 0.01 06/15/28 | 400'000 | EUR | 400'112 | 348'984 | 0.24 |
| | | | | 897'112 | 755'629 | 0.52 |
| PL | | | | | | |
| XS2348767836 | SNSPW 2 1/2 06/07/28 REGS | 300'000 | EUR | 300'000 | 261'492 | 0.18 |
| | | | | 300'000 | 261'492 | 0.18 |
| PT | | | | | | |
| PTEDPYOM0020 | EDPPL 1 7/8 03/14/2082 NC8 | 300'000 | EUR | 298'347 | 254'742 | 0.18 |
| PTEDP4OM0025 | EDPPL 5.943 04/23/2083 EMTN | 300'000 | EUR | 300'000 | 312'819 | 0.21 |
| | | | | 598'347 | 567'561 | 0.39 |
| RO | | | | | | |
| XS2538441598 | ROMANI 6 5/8 09/27/29 REGS | 500'000 | EUR | 498'010 | 537'880 | 0.37 |
| | | | | 498'010 | 537'880 | 0.37 |

| ISIN Nummer | Bezeichnung | Stückzahl / Nennwert | Währung | Einstandswert | Marktwert | % des Netto- vermögens |
|---|---|-------------------------|---------|------------------|--------------------|---------------------------|
| SE | | | | | | |
| XS2397251807 | HEIBOS 3 5/8 PERP EMTN | 200'000 | EUR | 198'852 | 115'842 | 0.08 |
| | | | | 198'852 | 115'842 | 0.08 |
| US | | | | | | |
| XS2597093009 | TOYOTA 4.05 09/13/29 EMTN | 500'000 | EUR | 499'090 | 522'765 | 0.36 |
| XS2575965327 | MASSMU 3 3/4 01/19/30 GMTN | 300'000 | EUR | 298'044 | 305'592 | 0.21 |
| XS2484340075 | PPG 2 3/4 06/01/29 | 400'000 | EUR | 398'940 | 390'160 | 0.27 |
| XS2446386356 | MS 2.103 05/08/26 | 400'000 | EUR | 400'000 | 391'728 | 0.27 |
| XS2386220698 | LLY 1 3/8 09/14/61 | 800'000 | EUR | 426'152 | 481'624 | 0.33 |
| XS2123320033 | JPM 0.389 02/24/28 EMTN | 500'000 | EUR | 500'000 | 457'195 | 0.31 |
| | | | | 2'522'226 | 2'549'064 | 1.75 |
| XS | | | | | | |
| XS2749537481 | IDAWBG 3.2 01/18/44 GMTN | 2'000'000 | EUR | 1'995'040 | 1'999'360 | 1.37 |
| XS2528875714 | IDAWBG 2 1/2 01/15/38 GMTN | 1'000'000 | EUR | 993'910 | 942'820 | 0.65 |
| XS2454249652 | NIB 0 1/4 03/09/29 | 800'000 | EUR | 796'848 | 715'720 | 0.49 |
| XS2289410420 | IBRD 0.2 01/21/61 | 500'000 | EUR | 499'425 | 188'030 | 0.13 |
| XS2016138765 | IBRD 0 1/2 06/21/35 GDIF | 1'000'000 | EUR | 995'560 | 775'060 | 0.53 |
| EU000A3K4EK1 | EUB 0 04/05/24 6M | 600'000 | EUR | 590'336 | 596'034 | 0.41 |
| EU000A3K4DT4 | EU 2 1/2 10/04/52 NGEU | 750'000 | EUR | 650'304 | 646'298 | 0.44 |
| EU000A3K4D09 | EU 2 3/4 12/04/37 SURE | 1'000'000 | EUR | 971'727 | 972'880 | 0.67 |
| | | | | 7'493'150 | 6'836'202 | 4.70 |
| Summe - Anleihen | | | | | 137'413'203 | |
| Optionen | | | | | | |
| DE | | | | | | |
| DE000F0JJS60 | EURO-BOBL OPTION Apr24P 119 | -5'000'000 | EUR | 114 | 0 | 0.00 |
| | | | | 114 | 0 | 0.00 |
| Summe - Optionen | | | | | 0 | |
| Summe - Amtlich notierte sowie an anderen geregelten Märkten gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | | | | | 137'413'203 | |
| Anlagefonds | | | | | | |
| LU | | | | | | |
| LU1637934669 | SWC (LU) BF Sust Glbl High Yield NTH EUR | 20'000 | EUR | 2'008'257 | 2'201'000 | 1.51 |
| LU1583993347 | SWC (LU) BF Responsible COCO NTH EUR | 19'775 | EUR | 2'211'040 | 2'685'837 | 1.85 |
| | | | | 4'219'297 | 4'886'837 | 3.36 |
| Summe - Anlagefonds | | | | | 4'886'837 | |
| Summe - Anlagefonds | | | | | 4'886'837 | |
| SUMME DES WERTPAPIERBESTANDES | | | | | 142'300'040 | 97.76 |

21 Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible GBP

Wertpapierbestand zum 31.01.2024 (Angaben in GBP)

| ISIN Nummer | Bezeichnung | Stückzahl / Nennwert | Währung | Einstandswert | Marktwert | % des Netto- vermögens |
|---|------------------------------|-------------------------|---------|------------------|------------------|---------------------------|
| Amtlich notierte sowie an anderen geregelten Märkten gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | | | | | | |
| Anleihen | | | | | | |
| AE | | | | | | |
| XS2297626645 | FABUH 0 7/8 12/09/25 EMTN | 200'000 | GBP | 199'116 | 184'420 | 0.83 |
| | | | | 199'116 | 184'420 | 0.83 |
| AU | | | | | | |
| XS2487052727 | MQGAU 4.08 05/31/29 EMTN | 100'000 | GBP | 97'219 | 95'695 | 0.43 |
| | | | | 97'219 | 95'695 | 0.43 |
| BE | | | | | | |
| BE6316405560 | EUROCL 1 1/4 09/30/24 EMTN | 400'000 | GBP | 399'021 | 389'688 | 1.75 |
| | | | | 399'021 | 389'688 | 1.75 |
| CA | | | | | | |
| XS2645243853 | CPPIBC 6 06/07/25 EMTN | 250'000 | GBP | 249'675 | 253'440 | 1.14 |
| | | | | 249'675 | 253'440 | 1.14 |
| CN | | | | | | |
| XS2384533563 | ICBCAS 1 5/8 12/28/25 GMTN | 200'000 | GBP | 199'324 | 184'894 | 0.83 |
| | | | | 199'324 | 184'894 | 0.83 |
| DE | | | | | | |
| XS2480050090 | DB 4 06/24/26 | 100'000 | GBP | 99'621 | 97'545 | 0.44 |
| XS2476782631 | NRW 2 1/8 06/13/25 EMTN | 400'000 | GBP | 399'276 | 385'380 | 1.73 |
| | | | | 498'897 | 482'925 | 2.17 |
| ES | | | | | | |
| XS2393518597 | SANTAN 2 1/4 10/04/32 EMTN | 200'000 | GBP | 182'194 | 174'528 | 0.78 |
| | | | | 182'194 | 174'528 | 0.78 |
| FI | | | | | | |
| XS2385122630 | NDAFH 1 5/8 12/09/32 EMTN | 200'000 | GBP | 199'446 | 171'930 | 0.77 |
| | | | | 199'446 | 171'930 | 0.77 |
| FR | | | | | | |
| FR001400NCB6 | SOCGEN 5 3/4 01/22/32 EMTN | 200'000 | GBP | 199'198 | 202'084 | 0.91 |
| FR001400N624 | ACAAP 5 3/8 01/15/29 | 200'000 | GBP | 199'666 | 202'054 | 0.91 |
| FR001400I7U8 | BNP 6 08/18/29 EMTN | 100'000 | GBP | 99'834 | 104'747 | 0.47 |
| FR001400F794 | BFCM 5 01/19/26 EMTN | 400'000 | GBP | 397'917 | 400'528 | 1.80 |
| FR0014007Z61 | AFLBNK 1 3/8 06/20/25 EMTN | 500'000 | GBP | 491'899 | 476'380 | 2.14 |
| FR0000486763 | CFF 5 1/2 01/26/27 EMTN | 400'000 | GBP | 405'000 | 409'188 | 1.84 |
| | | | | 1'793'514 | 1'794'981 | 8.05 |
| GB | | | | | | |
| XS2742661122 | MOTOPG 5 5/8 01/24/54 EMTN | 100'000 | GBP | 99'655 | 104'897 | 0.47 |
| XS2741906809 | NGGLN 5.35 07/10/39 EMTN | 150'000 | GBP | 149'801 | 148'652 | 0.67 |
| XS2692259398 | AVLN 6 7/8 11/27/53 | 100'000 | GBP | 99'140 | 104'089 | 0.47 |
| XS2636324274 | BRITEL 8 3/8 12/20/2083 EMTN | 100'000 | GBP | 99'550 | 107'223 | 0.48 |
| XS2574871997 | MOTOPG 4 7/8 01/17/43 EMTN | 100'000 | GBP | 99'810 | 95'554 | 0.43 |
| XS2540612129 | NWG 6 3/8 11/08/27 emtn | 200'000 | GBP | 208'098 | 209'714 | 0.94 |
| XS2507889835 | IFFIM 2 3/4 06/07/25 EMTN | 400'000 | GBP | 399'900 | 388'136 | 1.74 |

| ISIN Nummer | Bezeichnung | Stückzahl / Nennwert | Währung | Einstandswert | Marktwert | % des Netto- vermögens |
|-------------------------|----------------------------|-------------------------|---------|-------------------|-------------------|---------------------------|
| XS2445344570 | SVTLN 2 5/8 02/22/33 EMTN | 200'000 | GBP | 166'726 | 165'076 | 0.74 |
| XS2305547064 | SGELN 1 5/8 02/25/31 | 200'000 | GBP | 187'841 | 161'904 | 0.73 |
| XS2291328735 | UU 0 7/8 10/28/29 EMTN | 250'000 | GBP | 194'623 | 201'608 | 0.90 |
| XS2263535853 | BBOXLN 1 1/2 11/27/33 | 200'000 | GBP | 137'243 | 143'154 | 0.64 |
| XS2112228676 | NGTRAN 1 3/8 02/07/31 EMTN | 300'000 | GBP | 259'307 | 234'033 | 1.05 |
| XS2025842688 | LLOYDS 1 3/4 07/11/24 EMTN | 400'000 | GBP | 392'889 | 393'900 | 1.77 |
| XS1692835249 | SGROLN 2 3/8 10/11/29 | 200'000 | GBP | 169'874 | 176'120 | 0.79 |
| XS0979476602 | NGGLN 3 7/8 10/17/24 EMTN | 300'000 | GBP | 316'704 | 296'343 | 1.33 |
| GB00BZB26Y51 | UKT 1 3/4 09/07/37 | 1'050'000 | GBP | 881'008 | 792'131 | 3.55 |
| GB00BZ1NTB69 | UKTI 0 1/8 08/10/28 3MO | 100'000 | GBP | 127'019 | 135'758 | 0.61 |
| GB00BMGR2916 | UKT 0 5/8 07/31/35 | 2'450'000 | GBP | 2'234'016 | 1'696'870 | 7.61 |
| GB00BMGR2809 | UKT 0 1/4 07/31/31 | 2'000'000 | GBP | 1'498'665 | 1'552'420 | 6.96 |
| GB00BMBL1G81 | UKT 0 1/8 01/31/28 | 950'000 | GBP | 801'442 | 825'550 | 3.70 |
| GB00BMBL1F74 | UKT 0 5/8 10/22/50 | 3'000'000 | GBP | 2'876'240 | 1'233'900 | 5.53 |
| GB00BMBL1D50 | UKT 0 1/2 10/22/61 | 1'250'000 | GBP | 1'156'204 | 381'838 | 1.71 |
| GB00BL68HH02 | UKT 0 3/8 10/22/30 | 800'000 | GBP | 621'856 | 645'880 | 2.90 |
| GB00BJQWYH73 | UKT 1 1/4 10/22/41 | 650'000 | GBP | 650'707 | 404'892 | 1.82 |
| GB00BFMCN652 | UKT 1 5/8 10/22/2071 | 700'000 | GBP | 482'972 | 332'416 | 1.49 |
| GB00BDRHNP05 | UKT 1 1/4 07/22/27 | 800'000 | GBP | 719'064 | 736'328 | 3.30 |
| GB00BDCHBW80 | UKT 1 1/2 07/22/47 | 2'000'000 | GBP | 1'860'614 | 1'149'400 | 5.16 |
| GB00B84Z9V04 | UKT 3 1/4 01/22/44 | 600'000 | GBP | 569'100 | 507'864 | 2.28 |
| | | | | 17'460'066 | 13'325'647 | 59.77 |
| | IT | | | | | |
| XS2598063480 | ISPIM 6 1/2 03/14/29 EMTN | 300'000 | GBP | 299'169 | 306'492 | 1.37 |
| | | | | 299'169 | 306'492 | 1.37 |
| | JE | | | | | |
| XS2317082787 | HTHROW 2 5/8 03/16/28 | 250'000 | GBP | 235'409 | 223'600 | 1.00 |
| | | | | 235'409 | 223'600 | 1.00 |
| | LU | | | | | |
| XS1700429308 | ARNDTN 3 10/16/29 EMTN | 100'000 | GBP | 99'645 | 79'058 | 0.35 |
| DE000A3LSV01 | TRAGR 5 5/8 01/16/29 EMTN | 100'000 | GBP | 99'638 | 100'524 | 0.45 |
| | | | | 199'283 | 179'582 | 0.81 |
| | NL | | | | | |
| XS2590262296 | ABNANV 5 1/8 02/22/28 EMTN | 200'000 | GBP | 199'832 | 201'878 | 0.91 |
| | | | | 199'832 | 201'878 | 0.91 |
| | NO | | | | | |
| XS2465774474 | DNBNO 2 5/8 06/10/26 | 400'000 | GBP | 395'090 | 386'976 | 1.74 |
| XS0416848793 | EQNR 6 7/8 03/11/31 EMTN | 150'000 | GBP | 232'724 | 172'608 | 0.77 |
| | | | | 627'814 | 559'584 | 2.51 |
| | US | | | | | |
| XS2492487389 | NYLIFE 4.35 09/16/25 EMTN | 400'000 | GBP | 399'882 | 396'772 | 1.78 |
| XS2472657084 | BAC 3.584 04/27/31 | 200'000 | GBP | 200'000 | 186'382 | 0.84 |
| XS2348234936 | BAC 1.667 06/02/29 EMTN | 250'000 | GBP | 233'623 | 218'978 | 0.98 |
| XS2335966631 | JPM 0.991 04/28/26 | 500'000 | GBP | 453'485 | 474'370 | 2.13 |
| XS2251337353 | VZ 1 1/8 11/03/28 | 200'000 | GBP | 188'509 | 172'066 | 0.77 |
| XS0834641358 | MET 3 1/2 09/30/26 GMTN | 300'000 | GBP | 304'684 | 291'627 | 1.31 |
| | | | | 1'780'183 | 1'740'195 | 7.80 |
| Summe - Anleihen | | | | | 20'269'479 | |

| ISIN Nummer | Bezeichnung | Stückzahl / Nennwert | Währung | Einstandswert | Marktwert | % des Netto- vermögens |
|---|---|-------------------------|---------|----------------|-------------------|---------------------------|
| Summe - Amtlich notierte sowie an anderen geregelten Märkten gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente Anlagefonds | | | | | 20'269'479 | |
| Anlagefonds | | | | | | |
| LU | | | | | | |
| LU1637934669 | SWC (LU) BF Sust Glbl High Yield NTH EUR | 3'589 | EUR | 321'714 | 336'907 | 1.51 |
| LU1637934404 | SWC (LU) BF Responsible Global Convertible NTH EUR | 3'337 | EUR | 294'730 | 316'411 | 1.42 |
| LU1583993347 | SWC (LU) BF Responsible COCO NTH EUR | 3'022 | EUR | 296'204 | 350'088 | 1.57 |
| | | | | 912'648 | 1'003'407 | 4.50 |
| Summe - Anlagefonds | | | | | 1'003'407 | |
| Summe - Anlagefonds | | | | | 1'003'407 | |
| SUMME DES WERTPAPIERBESTANDES | | | | | 21'272'886 | 95.41 |

22 Swisscanto (LU) Bond Fund Sustainable Global Aggregate

Wertpapierbestand zum 31.01.2024 (Angaben in USD)

| ISIN Nummer | Bezeichnung | Stückzahl / Nennwert | Währung | Einstandswert | Marktwert | % des Netto- vermögens |
|---|----------------------------|-------------------------|---------|------------------|------------------|---------------------------|
| Amtlich notierte sowie an anderen geregelten Märkten gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | | | | | | |
| Anleihen | | | | | | |
| AE | | | | | | |
| XS2651619285 | MASDAR 4 7/8 07/25/33 EMTN | 400'000 | USD | 341'345 | 338'538 | 0.49 |
| | | | | 341'345 | 338'538 | 0.49 |
| AT | | | | | | |
| XS2320746394 | VERAV 0.9 04/01/41 | 100'000 | EUR | 108'937 | 64'784 | 0.09 |
| | | | | 108'937 | 64'784 | 0.09 |
| AU | | | | | | |
| XS2071382662 | VCXAU 1 1/8 11/07/29 EMTN | 200'000 | EUR | 219'783 | 158'530 | 0.23 |
| XS2013539635 | SGTOPT 1 06/20/29 EMTN | 150'000 | EUR | 167'167 | 121'967 | 0.18 |
| XS1748436190 | WSTP 0 1/2 01/16/25 EMTN | 300'000 | EUR | 350'992 | 271'587 | 0.39 |
| AU3TB0000192 | ACGB 3 3/4 04/21/37 144 | 100'000 | AUD | 82'288 | 54'445 | 0.08 |
| AU3SG0002579 | TCV 2 09/17/35 | 500'000 | AUD | 300'603 | 210'889 | 0.30 |
| AU3SG0002314 | TCV 1 1/2 09/10/31 MTN | 500'000 | AUD | 304'218 | 229'827 | 0.33 |
| AU000XCLWAM0 | ACGB 2 3/4 06/21/35 145 | 100'000 | AUD | 73'065 | 49'933 | 0.07 |
| AU0000XVGH14 | TCV 3 10/20/28 MTN | 400'000 | AUD | 304'610 | 217'043 | 0.31 |
| | | | | 1'802'726 | 1'314'221 | 1.90 |
| BE | | | | | | |
| BE0002956374 | WALLOO 3 3/4 04/22/39 EMTN | 500'000 | EUR | 489'185 | 482'291 | 0.70 |
| | | | | 489'185 | 482'291 | 0.70 |
| BR | | | | | | |
| USP2000TAA36 | BANBRA 3 1/4 09/30/26 REGS | 500'000 | USD | 460'369 | 406'141 | 0.59 |
| | | | | 460'369 | 406'141 | 0.59 |
| CA | | | | | | |
| XS2491195710 | BMO 3.85 06/17/25 GMTN | 5'000'000 | CNY | 605'460 | 601'931 | 0.87 |
| XS2454011839 | CM 0 3/8 03/10/26 EMTN | 300'000 | EUR | 270'787 | 264'103 | 0.38 |
| XS2356317177 | CPPIBC 1 1/2 06/23/28 | 500'000 | AUD | 314'458 | 251'044 | 0.36 |
| XS2066727061 | CM 0.295 10/18/24 EMTN | 100'000'000 | JPY | 603'938 | 585'979 | 0.85 |
| XS2027438899 | CPPIBC 0 3/4 07/15/49 EMTN | 250'000 | EUR | 270'347 | 136'512 | 0.20 |
| USC23264AL58 | CADEPO 1 05/26/26 REGS | 250'000 | USD | 224'236 | 198'500 | 0.29 |
| US94106BAC54 | WCNCN 2.2 01/15/32 | 300'000 | USD | 275'606 | 213'762 | 0.31 |
| US89114TZD70 | TD 1.2 06/03/26 MTN | 500'000 | USD | 439'251 | 395'692 | 0.57 |
| US78013XZU52 | RY 2.55 07/16/24 GMTN | 500'000 | USD | 464'695 | 423'486 | 0.61 |
| US69376Q2B87 | PSPCAP 1 5/8 10/26/28 REGS | 400'000 | USD | 368'494 | 305'075 | 0.44 |
| US136375CP57 | CNRCN 3.65 02/03/48 | 315'000 | USD | 289'368 | 220'794 | 0.32 |
| US13607GRR73 | CM 0.95 10/23/25 | 100'000 | USD | 87'091 | 80'483 | 0.12 |
| US06418BAC28 | BNS 2.44 03/11/24 | 500'000 | USD | 433'348 | 427'565 | 0.62 |
| US06367TQW35 | BMO 0 5/8 07/09/24 MTN | 400'000 | USD | 341'808 | 336'164 | 0.49 |
| CA803854JW90 | SCDA 3.2 06/03/24 | 300'000 | CAD | 245'424 | 191'460 | 0.28 |
| CA748148RL96 | Q 5 3/4 12/01/36 | 300'000 | CAD | 288'580 | 223'178 | 0.32 |
| CA68333ZAL19 | ONT 1.9 12/02/51 | 200'000 | CAD | 120'658 | 81'037 | 0.12 |
| CA68323AEE07 | ONT 2.6 06/02/27 | 300'000 | CAD | 228'338 | 185'364 | 0.27 |
| CA44810ZCR97 | HYDONE 4.39 03/01/34 | 300'000 | CAD | 191'643 | 192'021 | 0.28 |

| ISIN Nummer | Bezeichnung | Stückzahl / Nennwert | Währung | Einstandswert | Marktwert | % des Netto- vermögens |
|--------------|----------------------------|-------------------------|---------|------------------|------------------|---------------------------|
| CA135087J546 | CAN 2 1/4 03/01/24 | 250'000 | CAD | 162'291 | 160'188 | 0.23 |
| CA135087C939 | CAN 2 3/4 12/01/64 | 350'000 | CAD | 300'246 | 201'197 | 0.29 |
| CA11070TAF53 | BRCOL 2.85 06/18/25 | 300'000 | CAD | 236'929 | 188'507 | 0.27 |
| CA013051DM61 | ALTA 3.1 06/01/24 | 300'000 | CAD | 241'436 | 191'356 | 0.28 |
| | | | | 7'004'431 | 6'055'398 | 8.75 |
| CH | | | | | | |
| USH42097EQ69 | UBS 6.301 09/22/34 REGS | 400'000 | USD | 359'160 | 363'910 | 0.53 |
| USH42097CC91 | UBS 2.095 02/11/32 REGS | 200'000 | USD | 179'760 | 138'083 | 0.20 |
| CH0379268722 | UBS 2 1/8 09/12/25 | 150'000 | GBP | 186'432 | 160'581 | 0.23 |
| CH0224397346 | SWISS 0 06/22/29 | 400'000 | CHF | 409'480 | 383'860 | 0.55 |
| | | | | 1'134'832 | 1'046'434 | 1.51 |
| CL | | | | | | |
| XS1151586945 | CHILE 1 5/8 01/30/25 | 200'000 | EUR | 237'505 | 182'609 | 0.26 |
| | | | | 237'505 | 182'609 | 0.26 |
| DE | | | | | | |
| XS2590582529 | KFW 2.9 02/24/26 EMTN | 10'000'000 | CNY | 1'226'925 | 1'206'601 | 1.74 |
| XS2322827382 | KFW 2.7 03/25/24 EMTN | 8'000'000 | CNY | 1'143'932 | 956'623 | 1.38 |
| XS2233088132 | HHOCGR 0 1/8 02/24/31 | 200'000 | EUR | 213'972 | 154'007 | 0.22 |
| XS2218405772 | MRKGR 1 5/8 09/09/2080 | 200'000 | EUR | 215'651 | 174'807 | 0.25 |
| XS2102932055 | MRKGR 0 1/2 07/16/28 EMTN | 200'000 | EUR | 215'257 | 167'811 | 0.24 |
| XS1721762240 | RENTEN 7.46 11/22/27 EMTN | 5'000'000 | MXN | 226'450 | 230'114 | 0.33 |
| USX10001AB51 | ALVGR 3.2 PERP REGS | 200'000 | USD | 182'890 | 137'639 | 0.20 |
| US515110BT00 | RENTEN 2 1/2 11/15/27 37 | 200'000 | USD | 199'420 | 162'243 | 0.23 |
| US500769CG75 | KFW 2.6 06/20/37 | 200'000'000 | JPY | 2'049'554 | 1'438'864 | 2.08 |
| US500769BN36 | KFW 2.05 02/16/26 | 20'000'000 | JPY | 173'576 | 122'239 | 0.18 |
| DE000DL19VS4 | DB 1 3/4 11/19/30 EMTN | 500'000 | EUR | 564'845 | 408'755 | 0.59 |
| DE0001030724 | DBR 0 08/15/50 G | 400'000 | EUR | 254'287 | 201'012 | 0.29 |
| AU3CB0247401 | DBHNGR 3 1/2 09/27/24 MTN | 350'000 | AUD | 269'596 | 196'849 | 0.28 |
| | | | | 6'936'355 | 5'557'565 | 8.03 |
| DK | | | | | | |
| XS2531569965 | ORSTED 3 1/4 09/13/31 emtn | 100'000 | EUR | 97'433 | 92'204 | 0.13 |
| XS2293075680 | ORSTED 1 1/2 02/18/3021 | 100'000 | EUR | 108'010 | 73'566 | 0.11 |
| | | | | 205'443 | 165'769 | 0.24 |
| ES | | | | | | |
| XS2393518597 | SANTAN 2 1/4 10/04/32 EMTN | 300'000 | GBP | 375'356 | 285'989 | 0.41 |
| XS2194370727 | SANTAN 1 1/8 06/23/27 EMTN | 400'000 | EUR | 413'573 | 348'135 | 0.50 |
| US05971KAP49 | SANTAN 9 5/8 PERP | 200'000 | USD | 177'490 | 182'249 | 0.26 |
| ES0000012J07 | SPGB 1 07/30/42 | 700'000 | EUR | 502'885 | 426'550 | 0.62 |
| ES0000012932 | SPGB 4.2 01/31/37 | 500'000 | EUR | 599'149 | 508'933 | 0.74 |
| | | | | 2'068'453 | 1'751'855 | 2.53 |
| FR | | | | | | |
| XS2314312179 | AXASA 1 3/8 10/07/41 EMTn | 200'000 | EUR | 218'669 | 153'884 | 0.22 |
| XS2022425024 | RESFER 0 3/4 05/25/36 EMTN | 200'000 | EUR | 218'311 | 140'150 | 0.20 |
| XS0096412548 | RESFER 5 1/4 12/07/28 EMTN | 600'000 | GBP | 909'660 | 685'661 | 0.99 |
| US05579T5G71 | BNP 4 1/4 10/15/24 MTN | 400'000 | USD | 343'962 | 339'973 | 0.49 |
| FR001400M2F4 | RCFFP 5 1/4 11/22/28 EMTN | 100'000 | EUR | 95'631 | 98'609 | 0.14 |
| FR001400LY92 | BNFP 3.706 11/13/29 EMTN | 200'000 | EUR | 192'788 | 192'616 | 0.28 |
| FR001400LWN3 | BFCM 4 3/4 11/10/31 EMTN | 200'000 | EUR | 191'547 | 197'779 | 0.29 |

| ISIN Nummer | Bezeichnung | Stückzahl / Nennwert | Währung | Einstandswert | Marktwert | % des Netto- vermögens |
|--------------|----------------------------|-------------------------|---------|------------------|------------------|---------------------------|
| FR0014008CP1 | IDFMOB 1.275 02/14/42 EMTN | 200'000 | EUR | 210'984 | 132'580 | 0.19 |
| FR0014007LL3 | BPCEGP 0 1/2 01/14/28 EMTN | 200'000 | EUR | 199'450 | 170'239 | 0.25 |
| FR0014006OB0 | SOGRRP 1 11/26/51 EMTN | 500'000 | EUR | 483'135 | 253'749 | 0.37 |
| FR0014003L79 | BNP 0.557 05/20/27 EMTN | 100'000'000 | JPY | 825'010 | 574'013 | 0.83 |
| FR0013534674 | BPCEGP 0 1/2 09/15/27 DMTN | 300'000 | EUR | 301'520 | 258'071 | 0.37 |
| FR0013457058 | ALSFR 0 1/2 10/30/34 EMTN | 100'000 | EUR | 108'645 | 71'046 | 0.10 |
| FR0013426905 | BPCEGP 0.444 06/22/29 EMTN | 200'000'000 | JPY | 1'833'287 | 1'116'616 | 1.61 |
| | | | | 6'132'598 | 4'384'986 | 6.34 |
| GB | | | | | | |
| XS2678308359 | MOTOPG 5 5/8 09/11/35 emtn | 150'000 | GBP | 165'885 | 174'193 | 0.25 |
| XS2675225531 | BRITEL 4 1/4 01/06/33 EMTN | 400'000 | EUR | 379'617 | 391'804 | 0.57 |
| XS2456435945 | STANLN 4.35 03/18/26 EMTN | 2'000'000 | CNY | 247'352 | 242'339 | 0.35 |
| XS2431784441 | MOTOPG 2 1/8 01/18/42 EMTN | 100'000 | GBP | 123'581 | 71'134 | 0.10 |
| XS2357991038 | BACR 4 03/24/24 EMTN | 5'000'000 | CNY | 611'909 | 598'655 | 0.87 |
| XS2355184149 | HSBC 3.4 06/29/27 EMTN | 5'000'000 | CNY | 617'339 | 598'021 | 0.86 |
| XS2351311290 | BACR 0.654 06/09/27 EMTN | 100'000'000 | JPY | 820'922 | 575'057 | 0.83 |
| XS2287624154 | MOTOPG 1 1/2 01/20/41 EMTN | 200'000 | GBP | 200'779 | 130'353 | 0.19 |
| XS2114778140 | UU 1 3/4 02/10/38 EMTN | 100'000 | GBP | 125'104 | 73'339 | 0.11 |
| XS1992115524 | BACR 3 05/08/26 EMTN | 200'000 | GBP | 244'216 | 208'789 | 0.30 |
| XS0121464779 | LGEN 5 7/8 12/11/31 EMTN | 50'000 | GBP | 87'471 | 58'689 | 0.08 |
| US639057AC29 | NWG 1.642 06/14/27 | 100'000 | USD | 89'585 | 78'806 | 0.11 |
| US63859VBF76 | NWIDE 1 08/28/25 REGS | 200'000 | USD | 181'853 | 161'315 | 0.23 |
| US06738EBM66 | BACR 2.645 06/24/31 | 400'000 | USD | 367'783 | 289'874 | 0.42 |
| US06738EAU91 | BACR 4.337 01/10/28 | 500'000 | USD | 480'520 | 417'331 | 0.60 |
| US046353AW81 | AZN 1 3/8 08/06/30 | 500'000 | USD | 432'130 | 355'652 | 0.51 |
| US046353AM00 | AZN 4 3/8 11/16/45 | 400'000 | USD | 283'509 | 317'123 | 0.46 |
| GB00BM8Z2V59 | UKT 1 1/2 07/31/53 | 400'000 | GBP | 499'850 | 228'007 | 0.33 |
| GB00BLPK7334 | UKT 1 1/8 01/31/39 | 400'000 | GBP | 295'690 | 287'007 | 0.41 |
| GB00BLPK7110 | UKT 0 1/4 01/31/25 | 400'000 | GBP | 413'437 | 418'829 | 0.61 |
| GB00BHFH458 | UKT 2 3/4 09/07/24 | 200'000 | GBP | 218'051 | 215'914 | 0.31 |
| GB00BBJNQY21 | UKT 3 1/2 07/22/68 | 100'000 | GBP | 193'210 | 91'815 | 0.13 |
| GB00B06YGN05 | UKT 4 1/4 12/07/55 | 200'000 | GBP | 448'577 | 211'815 | 0.31 |
| AU3CB0251239 | LLOYDS 4 03/07/25 MTN | 300'000 | AUD | 220'629 | 167'955 | 0.24 |
| | | | | 7'748'999 | 6'363'819 | 9.20 |
| GR | | | | | | |
| XS2747093321 | TPEIR 7 1/4 04/17/34 EMTN | 400'000 | EUR | 370'404 | 380'339 | 0.55 |
| | | | | 370'404 | 380'339 | 0.55 |
| HK | | | | | | |
| XS2356311139 | AIA 0.88 09/09/33 GMTN | 100'000 | EUR | 108'483 | 79'206 | 0.11 |
| | | | | 108'483 | 79'206 | 0.11 |
| IE | | | | | | |
| XS2555925218 | AIB 5 3/4 02/16/29 | 200'000 | EUR | 197'185 | 200'226 | 0.29 |
| XS2523960719 | ZURNVX 5 1/8 11/23/52 EMTN | 200'000 | GBP | 227'934 | 210'162 | 0.30 |
| XS2416978190 | ZURNVX 3 1/2 05/02/52 EMTN | 450'000 | USD | 400'308 | 319'075 | 0.46 |
| XS2343340852 | AIB 0 1/2 11/17/27 EMTN | 200'000 | EUR | 218'569 | 171'380 | 0.25 |
| XS2325562697 | FREGR 0 7/8 10/01/31 EMTN | 300'000 | EUR | 303'436 | 226'560 | 0.33 |
| XS2283177561 | ZURNVX 3 04/19/51 EMTN | 300'000 | USD | 266'835 | 210'545 | 0.30 |
| XS2076155105 | ABT 0 3/8 11/19/27 | 300'000 | EUR | 296'932 | 256'111 | 0.37 |
| | | | | 1'911'200 | 1'594'058 | 2.30 |

| ISIN Nummer | Bezeichnung | Stückzahl / Nennwert | Währung | Einstandswert | Marktwert | % des Netto- vermögens |
|--------------|----------------------------|-------------------------|---------|------------------|------------------|---------------------------|
| IL | | | | | | |
| XS2406607098 | TEVA 3 3/4 05/09/27 | 100'000 | EUR | 105'917 | 90'269 | 0.13 |
| | | | | 105'917 | 90'269 | 0.13 |
| IT | | | | | | |
| XS2592650373 | ISPIM 5 03/08/28 EMTN | 500'000 | EUR | 479'785 | 483'549 | 0.70 |
| IT0005570988 | UCGIM 4.6 02/14/30 EMTN | 175'000 | EUR | 168'164 | 170'144 | 0.25 |
| IT0005438004 | BTPS 1 1/2 04/30/45 34Y | 300'000 | EUR | 305'867 | 175'723 | 0.25 |
| IT0005403396 | BTPS 0.95 08/01/30 10Y | 500'000 | EUR | 397'566 | 402'852 | 0.58 |
| IT0005321325 | BTPS 2.95 09/01/38 20Y | 200'000 | EUR | 238'871 | 164'449 | 0.24 |
| IT0005210650 | BTPS 1 1/4 12/01/26 10Y | 550'000 | EUR | 594'812 | 490'719 | 0.71 |
| IT0005162828 | BTPS 2.7 03/01/47 31Y | 300'000 | EUR | 389'688 | 218'914 | 0.32 |
| | | | | 2'574'753 | 2'106'350 | 3.05 |
| JP | | | | | | |
| US874060AX48 | TACHEM 2.05 03/31/30 | 250'000 | USD | 237'022 | 183'389 | 0.27 |
| | | | | 237'022 | 183'389 | 0.27 |
| LU | | | | | | |
| XS2238789460 | MDT 0 3/8 10/15/28 | 300'000 | EUR | 312'414 | 247'895 | 0.36 |
| XS2051149552 | DHR 1.8 09/18/49 | 100'000 | EUR | 107'783 | 66'482 | 0.10 |
| XS1960678412 | MDT 1 5/8 03/07/31 | 100'000 | EUR | 112'228 | 84'479 | 0.12 |
| | | | | 532'425 | 398'856 | 0.58 |
| NL | | | | | | |
| XS2715941949 | SDZSW 4 1/2 11/17/33 | 200'000 | EUR | 192'290 | 199'393 | 0.29 |
| XS2384726282 | MDLZ 0 5/8 09/09/32 REGS | 100'000 | EUR | 108'000 | 74'636 | 0.11 |
| XS2384269101 | LPTY 0 1/4 09/07/26 EMTN | 300'000 | EUR | 323'345 | 257'078 | 0.37 |
| XS2350756446 | INTNED 0 7/8 06/09/32 EMTN | 100'000 | EUR | 109'159 | 83'526 | 0.12 |
| XS2305244241 | LPTY 0 1/4 02/23/26 EMTN | 200'000 | EUR | 215'092 | 173'857 | 0.25 |
| XS2286044370 | ABBNVX 0 01/19/30 EMTN | 100'000 | EUR | 107'464 | 77'735 | 0.11 |
| XS2232115423 | DLR 1 01/15/32 | 200'000 | EUR | 213'135 | 147'998 | 0.21 |
| XS1890845875 | IBESM 3 1/4 PERP | 100'000 | EUR | 106'080 | 92'522 | 0.13 |
| XS0451790280 | KPN 5 3/4 09/17/29 GMTN | 50'000 | GBP | 80'488 | 56'797 | 0.08 |
| XS0105290349 | AEGON 6 1/8 12/15/31 EMTN | 100'000 | GBP | 177'413 | 116'133 | 0.17 |
| USN4580HAC18 | INTNED 1.4 07/01/26 REGS | 500'000 | USD | 473'307 | 406'278 | 0.59 |
| US74977SDJ87 | RABOBK 1.004 09/24/26 REGS | 500'000 | USD | 455'075 | 399'908 | 0.58 |
| US456837BH52 | INTNED 6.114 09/11/34 | 200'000 | USD | 177'840 | 179'889 | 0.26 |
| DE000A2RWAY2 | ALVGR 1 1/2 01/15/30 EMTN | 400'000 | EUR | 446'556 | 346'558 | 0.50 |
| | | | | 3'185'246 | 2'612'309 | 3.78 |
| NO | | | | | | |
| NO0012712506 | NGB 3 1/2 10/06/42 485 | 1'100'000 | NOK | 99'346 | 91'863 | 0.13 |
| NO0010786288 | NGB 1 3/4 02/17/27 479 | 1'000'000 | NOK | 117'041 | 77'996 | 0.11 |
| | | | | 216'387 | 169'859 | 0.25 |
| NZ | | | | | | |
| XS2055663764 | AUCKCN 0 1/8 09/26/29 EMTN | 200'000 | EUR | 219'070 | 160'280 | 0.23 |
| US00216NAE94 | ASBBNK 2 3/8 10/22/31 REGS | 400'000 | USD | 365'930 | 280'592 | 0.41 |
| NZGOVDT433C9 | NZGB 3 1/2 04/14/33 0433 | 200'000 | NZD | 93'303 | 97'272 | 0.14 |
| NZGOVDT427C1 | NZGB 4 1/2 04/15/27 0427 | 800'000 | NZD | 629'295 | 422'989 | 0.61 |
| AU3CB0304681 | NZLGFA 5.1 11/28/30 MTN | 900'000 | AUD | 520'056 | 524'695 | 0.76 |
| | | | | 1'827'654 | 1'485'828 | 2.15 |
| SE | | | | | | |

| ISIN Nummer | Bezeichnung | Stückzahl / Nennwert | Währung | Einstandswert | Marktwert | % des Netto- vermögens |
|--------------|-------------------------------|-------------------------|---------|------------------|----------------|---------------------------|
| XS2198237039 | SWEDA 0.423 07/04/25 EMTN | 100'000'000 | JPY | 855'279 | 584'218 | 0.84 |
| SE0009496367 | SGB 0 3/4 05/12/28 #1060 1060 | 1'000'000 | SEK | 118'171 | 78'177 | 0.11 |
| SE0007125927 | SGB 1 11/12/26 #1059 1059 | 1'000'000 | SEK | 123'411 | 79'971 | 0.12 |
| SE0005676608 | SGB 2 1/2 05/12/25 #1058 1058 | 300'000 | SEK | 42'080 | 24'765 | 0.04 |
| SE0004517290 | SGB 2 1/4 06/01/32 #1056 1056 | 415'000 | SEK | 53'421 | 34'698 | 0.05 |
| SE0002829192 | SGB 3 1/2 03/30/39 #1053 1053 | 460'000 | SEK | 68'549 | 43'746 | 0.06 |
| | | | | 1'260'910 | 845'576 | 1.22 |
| SG | | | | | | |
| US716973AF98 | PFE 5.11 05/19/43 | 500'000 | USD | 427'311 | 425'828 | 0.62 |
| | | | | 427'311 | 425'828 | 0.62 |
| SI | | | | | | |
| XS2635185437 | SLOVEN 5 09/19/33 REGS | 600'000 | USD | 532'072 | 522'662 | 0.76 |
| | | | | 532'072 | 522'662 | 0.76 |
| US | | | | | | |
| XS2565541351 | C 3.3 05/17/28 GMTN | 3'000'000 | CNY | 385'149 | 356'578 | 0.52 |
| XS2343846940 | BWA 1 05/19/31 | 200'000 | EUR | 217'170 | 154'365 | 0.22 |
| XS2337252931 | FDX 0.45 05/04/29 | 100'000 | EUR | 109'709 | 80'772 | 0.12 |
| XS2251742537 | AVTR 2 5/8 11/01/25 REGS | 100'000 | EUR | 106'764 | 91'287 | 0.13 |
| XS2180007549 | T 1.6 05/19/28 | 400'000 | EUR | 425'061 | 348'910 | 0.50 |
| XS2079716937 | AAPL 0 1/2 11/15/31 | 400'000 | EUR | 384'443 | 317'127 | 0.46 |
| XS2033262622 | JPM 1.001 07/25/31 EMTN | 250'000 | EUR | 276'859 | 199'625 | 0.29 |
| XS1843436228 | FIS 1 1/2 05/21/27 | 200'000 | EUR | 226'010 | 176'615 | 0.26 |
| XS1512978112 | IBM 0.3 11/02/26 | 100'000'000 | JPY | 613'157 | 582'687 | 0.84 |
| XS1374392717 | T 4 3/8 09/14/29 | 100'000 | GBP | 141'157 | 106'966 | 0.15 |
| USU9841MAA00 | WPROIN 1 1/2 06/23/26 REGS | 400'000 | USD | 352'345 | 316'667 | 0.46 |
| USU75000BY12 | ROSW 2.607 12/13/51 REGS | 400'000 | USD | 343'684 | 226'870 | 0.33 |
| USU74078CD32 | NESNVX 4 09/24/48 REGS | 400'000 | USD | 379'751 | 301'912 | 0.44 |
| US931142ET65 | WMT 1.8 09/22/31 | 100'000 | USD | 91'908 | 72'198 | 0.10 |
| US92277GAN79 | VTR 4.4 01/15/29 | 150'000 | USD | 149'421 | 125'002 | 0.18 |
| US91324PDS83 | UNH 2 7/8 08/15/29 | 150'000 | USD | 147'710 | 118'602 | 0.17 |
| US87264ADF93 | TMUS 5.15 04/15/34 | 100'000 | USD | 84'930 | 86'608 | 0.13 |
| US87264ADC62 | TMUS 5 3/4 01/15/34 | 550'000 | USD | 489'587 | 498'329 | 0.72 |
| US87264ACQ67 | TMUS 2.7 03/15/32 | 100'000 | USD | 91'700 | 73'029 | 0.11 |
| US863667BC42 | SYK 4.85 12/08/28 | 250'000 | USD | 218'338 | 216'858 | 0.31 |
| US79466LAH78 | CRM 1 1/2 07/15/28 | 200'000 | USD | 177'876 | 152'848 | 0.22 |
| US771196BU52 | ROSW 1.882 03/08/24 144A | 500'000 | USD | 420'290 | 427'424 | 0.62 |
| US717081EY56 | PFE 1.7 05/28/30 | 500'000 | USD | 406'961 | 365'466 | 0.53 |
| US717081EA70 | PFE 3 12/15/26 | 500'000 | USD | 488'284 | 412'995 | 0.60 |
| US713448EP96 | PEP 2 7/8 10/15/49 | 450'000 | USD | 439'287 | 277'052 | 0.40 |
| US66989HAS76 | NOVNVX 2 3/4 08/14/50 | 200'000 | USD | 190'959 | 120'049 | 0.17 |
| US6174468V45 | MS 0.985 12/10/26 | 300'000 | USD | 266'670 | 237'925 | 0.34 |
| US595112BS19 | MU 2.703 04/15/32 | 200'000 | USD | 177'433 | 144'103 | 0.21 |
| US58933YBM66 | MRK 5 05/17/53 | 200'000 | USD | 177'276 | 172'949 | 0.25 |
| US58933YBF16 | MRK 2 3/4 12/10/51 | 50'000 | USD | 46'195 | 28'971 | 0.04 |
| US58933YAZ88 | MRK 1.45 06/24/30 | 200'000 | USD | 188'616 | 143'511 | 0.21 |
| US57636QAU85 | MA 2 11/18/31 | 100'000 | USD | 91'742 | 72'300 | 0.10 |
| US57636QAL86 | MA 3.65 06/01/49 | 300'000 | USD | 308'823 | 214'266 | 0.31 |
| US532457CF35 | LLY 4.7 02/27/33 | 500'000 | USD | 439'414 | 438'104 | 0.63 |
| US494368CC54 | KMB 1.05 09/15/27 | 200'000 | USD | 183'410 | 153'229 | 0.22 |

| ISIN Nummer | Bezeichnung | Stückzahl / Nennwert | Währung | Einstandswert | Marktwert | % des Netto- vermögens |
|--------------|---|-------------------------|---------|-------------------|-------------------|---------------------------|
| US494368CA98 | KMB 2 7/8 02/07/50 | 250'000 | USD | 241'313 | 151'854 | 0.22 |
| US46647PAJ57 | JPM 3.882 07/24/38 | 500'000 | USD | 353'891 | 378'196 | 0.55 |
| US459200KZ37 | IBM 5.1 02/06/53 | 300'000 | USD | 275'382 | 254'321 | 0.37 |
| US459200KK67 | IBM 2.85 05/15/40 | 500'000 | USD | 313'286 | 322'393 | 0.47 |
| US437076CK64 | HD 2 3/4 09/15/51 | 500'000 | USD | 458'015 | 288'508 | 0.42 |
| US437076CJ91 | HD 1 7/8 09/15/31 | 560'000 | USD | 488'187 | 398'830 | 0.58 |
| US40434LAK17 | HPQ 4 04/15/29 | 300'000 | USD | 276'631 | 248'909 | 0.36 |
| US29444UBL98 | EQIX 1.55 03/15/28 | 400'000 | USD | 370'979 | 302'670 | 0.44 |
| US110122DY15 | BMY 5 3/4 02/01/31 | 500'000 | USD | 450'023 | 456'754 | 0.66 |
| US110122DQ80 | BMY 1.45 11/13/30 | 700'000 | USD | 613'744 | 492'736 | 0.71 |
| US075887CL11 | BDX 1.957 02/11/31 | 300'000 | USD | 271'146 | 214'040 | 0.31 |
| US075887CJ64 | BDX 2.823 05/20/30 | 500'000 | USD | 481'612 | 383'626 | 0.55 |
| US06051GLC14 | BAC 6.204 11/10/28 | 300'000 | USD | 297'439 | 269'005 | 0.39 |
| US037833BX70 | AAPL 4.65 02/23/46 | 500'000 | USD | 518'178 | 423'237 | 0.61 |
| US036752AX13 | ELV 6.1 10/15/52 | 50'000 | USD | 49'371 | 47'794 | 0.07 |
| US03073EAT29 | COR 2.7 03/15/31 | 300'000 | USD | 281'222 | 224'740 | 0.32 |
| US03027XBJ81 | AMT 1 1/2 01/31/28 | 200'000 | USD | 166'908 | 150'807 | 0.22 |
| US023135CA22 | AMZN 2 7/8 05/12/41 | 500'000 | USD | 328'909 | 334'549 | 0.48 |
| US023135BC96 | AMZN 3.15 08/22/27 | 200'000 | USD | 191'337 | 165'031 | 0.24 |
| US002824BQ25 | ABT 1.4 06/30/30 | 700'000 | USD | 619'996 | 507'851 | 0.73 |
| US00206RKJ04 | T 3 1/2 09/15/53 | 1'000'000 | USD | 810'241 | 616'245 | 0.89 |
| | | | | 17'095'896 | 14'444'293 | 20.88 |
| | VG | | | | | |
| USG91139AF57 | TAISEM 1 1/4 04/23/26 REGS | 400'000 | USD | 364'719 | 318'396 | 0.46 |
| | | | | 364'719 | 318'396 | 0.46 |
| | XS | | | | | |
| XS2707161308 | IBRD 2 1/2 01/13/31 EMTN | 10'000'000 | CNY | 1'225'227 | 1'198'601 | 1.73 |
| XS2539449608 | EIB 2.6 09/29/26 EMTN | 5'000'000 | CNY | 611'199 | 601'746 | 0.87 |
| XS2437747210 | IBRD 2 1/4 01/19/29 GMTN | 10'000'000 | CNY | 1'198'469 | 1'185'411 | 1.71 |
| XS2388085370 | ASIA 2 1/2 02/15/27 GMTN | 7'000'000 | CNY | 1'008'762 | 839'054 | 1.21 |
| XS2332164966 | EIB 2.7 04/22/24 EMTN | 3'000'000 | CNY | 423'216 | 358'418 | 0.52 |
| XS2296027217 | CAF 0 1/4 02/04/26 | 450'000 | EUR | 469'113 | 392'331 | 0.57 |
| XS2016138765 | IBRD 0 1/2 06/21/35 GDIF | 200'000 | EUR | 223'112 | 144'446 | 0.21 |
| XS1958237403 | ASIA 2.9 03/05/24 GMTN | 4'000'000 | CNY | 576'995 | 478'302 | 0.69 |
| XS0282506657 | EIB 2.15 01/18/27 | 350'000'000 | JPY | 3'504'153 | 2'181'603 | 3.15 |
| US45905CAA27 | IBRD 4 3/4 02/15/35 GMTN | 584'000 | USD | 694'117 | 519'220 | 0.75 |
| US459058KU68 | IBRD 4 07/25/30 | 950'000 | USD | 813'138 | 813'548 | 1.18 |
| US459058GE72 | IBRD 2 1/2 11/22/27 GDIF | 950'000 | USD | 936'462 | 771'667 | 1.12 |
| US219868CH71 | CAF 6 04/26/27 | 250'000 | USD | 223'925 | 222'153 | 0.32 |
| EU000A3K4DM9 | EU 2 5/8 02/04/48 NGEU | 300'000 | EUR | 239'940 | 254'137 | 0.37 |
| EU000A3K4D41 | EU 3 1/4 07/04/34 NGEU | 500'000 | EUR | 473'071 | 483'829 | 0.70 |
| CA458182EA63 | IADB 1.7 10/10/24 | 500'000 | CAD | 322'273 | 314'221 | 0.45 |
| | | | | 12'943'171 | 10'758'686 | 15.55 |
| | Summe - Anleihen | | | | 64'530'313 | |
| | Summe - Amtlich notierte sowie an anderen geregelten Märkten gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | | | | 64'530'313 | |
| | Anlagefonds | | | | | |
| | Anlagefonds | | | | | |

| ISIN Nummer | Bezeichnung | Stückzahl / Nennwert | Währung | Einstandswert | Marktwert | % des Netto- vermögens |
|--------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------|---------|------------------|-------------------|---------------------------|
| LU | | | | | | |
| LU1637934743 | SWC (LU) BF Sust Glbl High Yield NT | 16'000 | USD | 1'544'114 | 1'737'661 | 2.51 |
| | | | | 1'544'114 | 1'737'661 | 2.51 |
| Summe - Anlagefonds | | | | | 1'737'661 | |
| Summe - Anlagefonds | | | | | 1'737'661 | |
| SUMME DES WERTPAPIERBESTANDES | | | | | 66'267'974 | 95.80 |

23 Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible USD

Wertpapierbestand zum 31.01.2024 (Angaben in USD)

| ISIN Nummer | Bezeichnung | Stückzahl / Nennwert | Währung | Einstandswert | Marktwert | % des Netto- vermögens |
|---|----------------------------|-------------------------|---------|------------------|------------------|---------------------------|
| Amtlich notierte sowie an anderen geregelten Märkten gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | | | | | | |
| Anleihen | | | | | | |
| AE | | | | | | |
| XS2707149600 | MUBAUH 5 7/8 05/01/34 REGS | 350'000 | USD | 345'797 | 376'688 | 0.75 |
| XS2677030194 | ADCBUH 5 1/2 01/12/29 GMTN | 200'000 | USD | 198'960 | 204'314 | 0.41 |
| XS2651619285 | MASDAR 4 7/8 07/25/33 EMTN | 250'000 | USD | 248'750 | 246'648 | 0.49 |
| | | | | 793'507 | 827'649 | 1.66 |
| AT | | | | | | |
| US676167CG22 | OKB 4 5/8 11/03/25 | 150'000 | USD | 149'984 | 150'362 | 0.30 |
| US676167CC18 | OKB 0 1/2 02/02/26 GMTN | 200'000 | USD | 199'380 | 185'350 | 0.37 |
| | | | | 349'364 | 335'712 | 0.67 |
| BR | | | | | | |
| US105756CH10 | BRAZIL 6 1/8 03/15/34 | 500'000 | USD | 492'350 | 495'960 | 0.99 |
| | | | | 492'350 | 495'960 | 0.99 |
| CA | | | | | | |
| USC23264AL58 | CADEPO 1 05/26/26 REGS | 300'000 | USD | 299'898 | 277'671 | 0.56 |
| US94106BAC54 | WCNCN 2.2 01/15/32 | 100'000 | USD | 99'836 | 83'061 | 0.17 |
| US78015K7H17 | RY 1.15 06/10/25 MTN | 300'000 | USD | 298'956 | 285'666 | 0.57 |
| US748149AH49 | Q 2 7/8 10/16/24 QO | 500'000 | USD | 481'650 | 492'470 | 0.99 |
| US748148SD69 | Q 3 5/8 04/13/28 | 200'000 | USD | 199'800 | 196'036 | 0.39 |
| US683234AU21 | ONT 2 1/8 01/21/32 MTN | 300'000 | USD | 299'571 | 257'862 | 0.52 |
| US63307A2X29 | NACN 5.6 12/18/28 | 250'000 | USD | 249'795 | 256'178 | 0.51 |
| US30216BJW37 | EDC 3 7/8 02/14/28 | 200'000 | USD | 201'779 | 198'912 | 0.40 |
| US29250NAY13 | ENBCN 2 1/2 01/15/25 | 200'000 | USD | 199'628 | 195'078 | 0.39 |
| US135087Q560 | CANADA 3 3/4 04/26/28 | 400'000 | USD | 398'232 | 396'620 | 0.79 |
| US135087N757 | CANADA 2 7/8 04/28/25 | 400'000 | USD | 399'976 | 391'784 | 0.78 |
| US110709AH51 | BRCOL 0.9 07/20/26 | 250'000 | USD | 249'623 | 230'460 | 0.46 |
| | | | | 3'378'744 | 3'261'798 | 6.53 |
| CH | | | | | | |
| USH42097DT18 | UBS 5.959 01/12/34 REGS | 250'000 | USD | 250'660 | 258'578 | 0.52 |
| | | | | 250'660 | 258'578 | 0.52 |
| DE | | | | | | |
| XS2760775549 | RENTEN 4 1/8 02/06/31 EMTN | 100'000 | USD | 99'400 | 100'286 | 0.20 |
| XS2481608029 | RENTEN 3 05/21/29 EMTN | 300'000 | USD | 298'953 | 284'958 | 0.57 |
| XS2396652682 | LBANK 1 3/8 10/12/28 EMTN | 300'000 | USD | 299'526 | 264'942 | 0.53 |
| XS2270152098 | LBANK 0 1/2 12/08/25 EMTN | 400'000 | USD | 398'944 | 372'076 | 0.75 |
| US500769JW52 | KFW 3 3/4 02/15/28 | 300'000 | USD | 298'593 | 296'898 | 0.59 |
| US500769JU96 | KFW 3 1/8 06/10/25 | 250'000 | USD | 249'975 | 245'298 | 0.49 |
| US500769JF20 | KFW 0 3/8 07/18/25 | 300'000 | USD | 298'767 | 282'531 | 0.57 |
| | | | | 1'944'158 | 1'846'989 | 3.70 |
| FI | | | | | | |
| XS2381694533 | KUNTA 0 7/8 09/02/26 REGS | 300'000 | USD | 299'370 | 275'463 | 0.55 |
| XS2289129483 | KUNTA 0 5/8 03/20/26 REGS | 500'000 | USD | 498'100 | 462'385 | 0.93 |

| ISIN Nummer | Bezeichnung | Stückzahl / Nennwert | Währung | Einstandswert | Marktwert | % des Netto- vermögens |
|--------------|----------------------------|-------------------------|---------|------------------|------------------|---------------------------|
| | | | | 797'470 | 737'848 | 1.48 |
| | FR | | | | | |
| XS2402074277 | CADES 1 1/4 10/28/26 REGS | 400'000 | USD | 398'764 | 369'736 | 0.74 |
| XS2233264550 | CADES 0 3/8 09/23/25 REGS | 300'000 | USD | 298'329 | 280'590 | 0.56 |
| US89153VAQ23 | TTEFP 3.455 02/19/29 | 250'000 | USD | 250'000 | 239'298 | 0.48 |
| US83368TBY38 | SOCGEN 7.132 01/19/55 REGS | 250'000 | USD | 250'000 | 249'923 | 0.50 |
| US83368TBR86 | SOCGEN 6.446 01/10/29 REGS | 400'000 | USD | 404'612 | 413'384 | 0.83 |
| US83368TBG22 | SOCGEN 2.226 01/21/26 REGS | 200'000 | USD | 200'000 | 193'212 | 0.39 |
| US09659X2N16 | BNP 1.323 01/13/27 REGS | 200'000 | USD | 200'000 | 185'370 | 0.37 |
| US05581LAG41 | BNP 5.894 12/05/34 REGS | 200'000 | USD | 200'000 | 209'048 | 0.42 |
| | | | | 2'201'705 | 2'140'560 | 4.29 |
| | GB | | | | | |
| XS2333299324 | IFFIM 1 04/21/26 GMTN | 500'000 | USD | 498'520 | 464'355 | 0.93 |
| USG84228GC69 | STANLN 6.097 01/11/35 REGS | 400'000 | USD | 400'000 | 409'120 | 0.82 |
| US404280DQ93 | HSBC 7.336 11/03/26 | 300'000 | USD | 300'000 | 311'409 | 0.62 |
| | | | | 1'198'520 | 1'184'884 | 2.37 |
| | IE | | | | | |
| XS2283177561 | ZURNVX 3 04/19/51 EMTN | 300'000 | USD | 300'000 | 245'433 | 0.49 |
| US78448TAK88 | SMBCAC 5.7 07/25/33 144A | 200'000 | USD | 199'322 | 201'304 | 0.40 |
| | | | | 499'322 | 446'737 | 0.90 |
| | JP | | | | | |
| XS2613192926 | JFM 4 1/8 04/27/28 REGS | 400'000 | USD | 400'777 | 393'188 | 0.79 |
| US874060AX48 | TACHEM 2.05 03/31/30 | 200'000 | USD | 199'608 | 171'022 | 0.34 |
| US60687YCP25 | MIZUHO 5.667 05/27/29 | 300'000 | USD | 300'000 | 305'910 | 0.61 |
| US606822AJ33 | MUFG 2.757 09/13/26 | 300'000 | USD | 292'230 | 283'521 | 0.57 |
| | | | | 1'192'615 | 1'153'641 | 2.31 |
| | KR | | | | | |
| XS2241376727 | SHINCA 1 3/8 10/19/25 | 200'000 | USD | 199'856 | 187'064 | 0.37 |
| USY3815NBH36 | HYUCAP 5 1/8 02/05/29 REGS | 200'000 | USD | 199'174 | 199'976 | 0.40 |
| USY3815NBG52 | HYUCAP 5 1/8 02/05/27 REGS | 200'000 | USD | 199'456 | 199'516 | 0.40 |
| USY3815NBC49 | HYUCAP 1 1/4 02/08/26 REGS | 200'000 | USD | 199'104 | 184'186 | 0.37 |
| US50066RAR75 | KOROIL 1 3/4 04/18/25 REGS | 250'000 | USD | 249'673 | 240'235 | 0.48 |
| US50064FAR55 | KOREA 2 06/19/24 | 400'000 | USD | 396'664 | 395'440 | 0.79 |
| US500630DZ86 | KDB 5 3/8 10/23/26 | 250'000 | USD | 249'713 | 254'463 | 0.51 |
| | | | | 1'693'639 | 1'660'880 | 3.33 |
| | LU | | | | | |
| USL62788AE12 | STENA 7 1/4 01/15/31 REGS | 200'000 | USD | 200'000 | 201'132 | 0.40 |
| | | | | 200'000 | 201'132 | 0.40 |
| | NL | | | | | |
| XS2532478190 | EDPPL 6.3 10/11/27 REGS | 200'000 | USD | 199'746 | 210'280 | 0.42 |
| XS2259866577 | BNG 0 1/2 11/24/25 REGS | 300'000 | USD | 299'277 | 279'321 | 0.56 |
| US456837BH52 | INTNED 6.114 09/11/34 | 200'000 | USD | 200'000 | 209'698 | 0.42 |
| | | | | 699'023 | 699'299 | 1.40 |
| | NZ | | | | | |
| US00182FBU93 | ANZNZ 5.355 08/14/28 REGS | 200'000 | USD | 200'000 | 203'488 | 0.41 |
| | | | | 200'000 | 203'488 | 0.41 |
| | SE | | | | | |

| ISIN Nummer | Bezeichnung | Stückzahl / Nennwert | Währung | Einstandswert | Marktwert | % des Netto- vermögens |
|--------------|----------------------------|-------------------------|---------|----------------|----------------|---------------------------|
| XS2441084071 | KOMINS 1 3/8 05/08/24 REGS | 500'000 | USD | 499'850 | 494'655 | 0.99 |
| | | | | 499'850 | 494'655 | 0.99 |
| | SG | | | | | |
| US716973AG71 | PFE 5.3 05/19/53 | 200'000 | USD | 199'702 | 202'100 | 0.40 |
| US449276AG99 | IBM 5.3 02/05/54 | 100'000 | USD | 99'435 | 100'631 | 0.20 |
| US449276AE42 | IBM 4.9 02/05/34 | 500'000 | USD | 498'750 | 499'910 | 1.00 |
| | | | | 797'887 | 802'641 | 1.61 |
| | US | | | | | |
| USU75000CH79 | ROSW 5.593 11/13/33 REGS | 200'000 | USD | 200'000 | 215'054 | 0.43 |
| USU75000BS44 | ROSW 0.991 03/05/26 REGS | 500'000 | USD | 500'000 | 465'470 | 0.93 |
| USU74078CN14 | NESNVX 2 1/2 09/14/41 REGS | 300'000 | USD | 299'295 | 221'064 | 0.44 |
| US94988J6D46 | WFC 5.45 08/07/26 BKNT | 250'000 | USD | 249'980 | 254'043 | 0.51 |
| US94106LBS79 | WM 4.15 04/15/32 | 300'000 | USD | 299'550 | 290'088 | 0.58 |
| US91324PDT66 | UNH 3 1/2 08/15/39 | 150'000 | USD | 148'524 | 127'484 | 0.26 |
| US91282CGM73 | T 3 1/2 02/15/33 | 1'800'000 | USD | 1'685'058 | 1'744'172 | 3.49 |
| US91282CDB46 | T 0 5/8 10/15/24 | 800'000 | USD | 748'815 | 776'219 | 1.56 |
| US9128284Z04 | T 2 3/4 08/31/25 | 500'000 | USD | 478'486 | 487'842 | 0.98 |
| US9128284V99 | T 2 7/8 08/15/28 | 3'000'000 | USD | 2'974'974 | 2'877'422 | 5.76 |
| US9128282U35 | T 1 7/8 08/31/24 | 700'000 | USD | 673'370 | 687'135 | 1.38 |
| US912810TT51 | T 4 1/8 08/15/53 | 400'000 | USD | 343'844 | 395'844 | 0.79 |
| US912810TP30 | TII 1 1/2 02/15/53 | 250'000 | USD | 229'698 | 233'178 | 0.47 |
| US912810SX72 | T 2 3/8 05/15/51 | 5'900'000 | USD | 4'800'261 | 4'113'406 | 8.24 |
| US912810RP57 | T 3 11/15/45 | 700'000 | USD | 564'515 | 570'391 | 1.14 |
| US912810QT88 | T 3 1/8 11/15/41 | 1'650'000 | USD | 1'455'807 | 1'420'289 | 2.85 |
| US912810QB70 | T 4 1/4 05/15/39 | 1'300'000 | USD | 1'436'133 | 1'326'609 | 2.66 |
| US87264ADF93 | TMUS 5.15 04/15/34 | 300'000 | USD | 298'962 | 302'877 | 0.61 |
| US863667BC42 | SYK 4.85 12/08/28 | 200'000 | USD | 199'806 | 202'234 | 0.41 |
| US832696AW80 | SJM 5.9 11/15/28 | 250'000 | USD | 254'408 | 261'963 | 0.52 |
| US79466LAH78 | CRM 1 1/2 07/15/28 | 300'000 | USD | 272'768 | 267'264 | 0.54 |
| US747525BK80 | QCOM 2.15 05/20/30 | 150'000 | USD | 138'671 | 131'349 | 0.26 |
| US744320BH48 | PRU 3.7 10/01/50 | 200'000 | USD | 200'000 | 176'644 | 0.35 |
| US66989HAQ11 | NOVNVX 2 02/14/27 | 400'000 | USD | 399'636 | 375'848 | 0.75 |
| US65339KBP49 | NEE 6.051 03/01/25 | 100'000 | USD | 100'250 | 100'917 | 0.20 |
| US61747YFG52 | MS 5.424 07/21/34 MTN | 100'000 | USD | 100'000 | 101'597 | 0.20 |
| US58933YAZ88 | MRK 1.45 06/24/30 | 200'000 | USD | 198'282 | 167'292 | 0.34 |
| US532457BV93 | LLY 3 3/8 03/15/29 | 82'000 | USD | 81'874 | 78'808 | 0.16 |
| US494368CC54 | KMB 1.05 09/15/27 | 200'000 | USD | 200'000 | 178'620 | 0.36 |
| US487836BZ07 | K 5 1/4 03/01/33 | 50'000 | USD | 49'912 | 51'073 | 0.10 |
| US478160CJ19 | JNJ 2 5/8 01/15/25 | 100'000 | USD | 99'983 | 97'957 | 0.20 |
| US42824CBL28 | HPE 5.9 10/01/24 | 200'000 | USD | 199'868 | 200'456 | 0.40 |
| US40434LAB18 | HPQ 3 06/17/27 | 200'000 | USD | 199'436 | 189'156 | 0.38 |
| US38145GAM24 | GS 5.798 08/10/26 | 75'000 | USD | 75'000 | 75'747 | 0.15 |
| US37045XEHS2 | GM 5.8 06/23/28 | 250'000 | USD | 248'025 | 256'950 | 0.51 |
| US37045XDU72 | GM 3.8 04/07/25 | 200'000 | USD | 199'960 | 196'738 | 0.39 |
| US36267VAM54 | GEHC 6.377 11/22/52 | 200'000 | USD | 217'202 | 229'586 | 0.46 |
| US36267VAF04 | GEHC 5.65 11/15/27 | 250'000 | USD | 248'998 | 258'175 | 0.52 |
| US126650DV97 | CVS 5 5/8 02/21/53 | 200'000 | USD | 199'712 | 199'872 | 0.40 |
| US126650CU24 | CVS 2 7/8 06/01/26 | 300'000 | USD | 292'410 | 286'989 | 0.57 |
| US075887CP25 | BDX 4.298 08/22/32 | 100'000 | USD | 100'000 | 96'497 | 0.19 |

| ISIN Nummer | Bezeichnung | Stückzahl / Nennwert | Währung | Einstandswert | Marktwert | % des Netto- vermögens |
|--------------|---|-------------------------|---------|-------------------|-------------------|---------------------------|
| US075887CL11 | BDX 1.957 02/11/31 | 200'000 | USD | 200'000 | 166'338 | 0.33 |
| US06051GLH01 | BAC 5.288 04/25/34 | 300'000 | USD | 296'285 | 302'271 | 0.61 |
| US06051GLA57 | BAC 4.827 07/22/26 MTN | 400'000 | USD | 398'926 | 397'968 | 0.80 |
| US06051GKB40 | BAC 2.972 07/21/52 | 300'000 | USD | 300'000 | 207'894 | 0.42 |
| US06051GFM69 | BAC 4 01/22/25 MTN | 300'000 | USD | 293'736 | 296'106 | 0.59 |
| US036752AT01 | ELV 4.1 05/15/32 | 300'000 | USD | 292'949 | 284'673 | 0.57 |
| US03027XCE85 | AMT 5.8 11/15/28 | 100'000 | USD | 99'828 | 103'826 | 0.21 |
| US02079KAG22 | GOOGL 2 1/4 08/15/60 | 150'000 | USD | 121'625 | 90'114 | 0.18 |
| US00206RKJ04 | T 3 1/2 09/15/53 | 300'000 | USD | 262'825 | 215'508 | 0.43 |
| US00206RKG64 | T 1.65 02/01/28 | 300'000 | USD | 299'622 | 267'750 | 0.54 |
| | | | | 24'229'265 | 23'022'764 | 46.13 |
| | XS | | | | | |
| XS2758114164 | OFIDEV 4 5/8 02/08/27 REGS | 200'000 | USD | 199'690 | 200'774 | 0.40 |
| US62954HBB33 | NXPI 5 01/15/33 | 100'000 | USD | 99'701 | 98'887 | 0.20 |
| US45950KDA51 | IFC 3 5/8 09/15/25 GMTN | 200'000 | USD | 199'922 | 197'476 | 0.40 |
| US45950KCX63 | IFC 0 3/4 10/08/26 GMTN | 500'000 | USD | 449'859 | 457'840 | 0.92 |
| US45905URL07 | IBRD 2 1/8 03/03/25 GDIF | 600'000 | USD | 569'892 | 583'902 | 1.17 |
| US459058KU68 | IBRD 4 07/25/30 | 400'000 | USD | 399'200 | 399'308 | 0.80 |
| US459058KL69 | IBRD 3 5/8 09/21/29 | 300'000 | USD | 299'601 | 294'651 | 0.59 |
| US459058KJ14 | IBRD 3 1/8 06/15/27 | 400'000 | USD | 399'792 | 388'596 | 0.78 |
| US459058JZ74 | IBRD 1 1/8 09/13/28 | 300'000 | USD | 299'397 | 264'060 | 0.53 |
| US459058JL88 | IBRD 0 1/2 10/28/25 | 200'000 | USD | 183'268 | 187'088 | 0.37 |
| US4581X0EH74 | IADB 4 01/12/28 | 400'000 | USD | 402'083 | 399'708 | 0.80 |
| US4581X0EF19 | IADB 3 1/2 09/14/29 | 500'000 | USD | 498'766 | 488'025 | 0.98 |
| US4581X0DN51 | IADB 0 5/8 07/15/25 | 300'000 | USD | 277'698 | 283'698 | 0.57 |
| US298785JV96 | EIB 3 3/4 02/14/33 | 300'000 | USD | 298'464 | 293'685 | 0.59 |
| US298785JU14 | EIB 3 7/8 03/15/28 | 400'000 | USD | 401'903 | 398'440 | 0.80 |
| US298785JT41 | EIB 3 1/4 11/15/27 | 200'000 | USD | 199'940 | 194'780 | 0.39 |
| US298785JR84 | EIB 1 3/4 03/15/29 | 350'000 | USD | 326'755 | 314'710 | 0.63 |
| US298785JL15 | EIB 1 1/4 02/14/31 | 500'000 | USD | 419'835 | 418'365 | 0.84 |
| US298785JK32 | EIB 0 3/8 03/26/26 | 400'000 | USD | 385'629 | 368'816 | 0.74 |
| US219868CG98 | CAF 4 3/4 04/01/26 | 300'000 | USD | 299'346 | 299'073 | 0.60 |
| | | | | 6'610'742 | 6'531'882 | 13.09 |
| | Summe - Anleihen | | | | 46'307'094 | |
| | Summe - Amtlich notierte sowie an anderen geregelten Märkten gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | | | | 46'307'094 | |
| | Anlagefonds | | | | | |
| | LU | | | | | |
| LU1734303610 | SWC (LU) BF Responsible COCO NT | 7'500 | USD | 750'000 | 1'041'900 | 2.09 |
| LU1637934743 | SWC (LU) BF Sust Glbl High Yield NT | 7'868 | USD | 791'577 | 996'089 | 2.00 |
| | | | | 1'541'577 | 2'037'989 | 4.08 |
| | Summe - Anlagefonds | | | | 2'037'989 | |
| | Summe - Anlagefonds | | | | 2'037'989 | |
| | SUMME DES WERTPAPIERBESTANDES | | | | 48'345'083 | 96.86 |

24 Erläuterungen

Erläuterung 1: Finanzberichte

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

Erläuterung 2: Wichtigste Grundsätze der Rechnungslegung

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

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

Devisenkurse

| | | |
|-----|--------------|------------|
| CAD | 1.00 = CHF | 0.64207926 |
| INR | 1.00 = CHF | 0.01033010 |
| NOK | 100.00 = CHF | 8.20390900 |
| RUB | 1.00 = CHF | 0.00955822 |
| CHF | 1.00 = CHF | 1.00000000 |
| PLN | 1.00 = CHF | 0.21536704 |
| JPY | 100.00 = CHF | 0.58686500 |
| MYR | 1.00 = CHF | 0.18136364 |
| BRL | 1.00 = CHF | 0.17361518 |
| CZK | 1.00 = CHF | 0.03742924 |
| MXN | 1.00 = CHF | 0.04994614 |
| THB | 1.00 = CHF | 0.02418012 |
| USD | 1.00 = CHF | 0.85785000 |
| AUD | 1.00 = CHF | 0.56708174 |
| CNY | 1.00 = CHF | 0.11958264 |
| COP | 1.00 = CHF | 0.00021934 |
| GBP | 1.00 = CHF | 1.09242908 |
| UYU | 1.00 = CHF | 0.02193148 |
| CLP | 1.00 = CHF | 0.00092041 |
| HKD | 1.00 = CHF | 0.10973808 |
| IDR | 1.00 = CHF | 0.00005436 |
| NZD | 1.00 = CHF | 0.52804957 |
| PEN | 1.00 = CHF | 0.22554820 |
| SEK | 100.00 = CHF | 8.30256400 |
| KRW | 1.00 = CHF | 0.00064275 |
| ZAR | 1.00 = CHF | 0.04612406 |
| EGP | 1.00 = CHF | 0.02776214 |
| EUR | 1.00 = CHF | 0.93183793 |

| | | |
|-----|--------------|-------------|
| HUF | 1.00 = CHF | 0.00242831 |
| ILS | 1.00 = CHF | 0.23581560 |
| SGD | 1.00 = CHF | 0.64193513 |
| DKK | 100.00 = CHF | 12.50182170 |
| RON | 1.00 = CHF | 0.18728509 |
| TRY | 1.00 = CHF | 0.02827083 |

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

Bewertungsgrundsätze:

a) Wertpapiere, Derivate und andere Anlagen, welche an einer Börse notiert sind, werden zu den letztbekanntesten Marktpreisen bewertet. Falls diese Wertpapiere, Derivate und anderen Anlagen an mehreren Börsen notiert sind, ist der letztverfügbare Kurs an jener Börse maßgebend, die der Hauptmarkt für dieses Wertpapier ist. Bei Wertpapieren, Derivaten und anderen Anlagen, bei welchen der Handel an einer Börse geringfügig ist und für welche ein Zweitmarkt zwischen Wertpapierhändlern mit marktkonformer Preisbildung besteht, kann die Verwaltungsgesellschaft die Bewertung dieser Wertpapiere, Derivate und anderen Anlagen aufgrund dieser Preise vornehmen, Wertpapiere, Derivate und andere Anlagen, die nicht an einer Börse notiert sind, die aber an einem anderen geregelten Markt, der anerkannt, für das Publikum offen und dessen Funktionsweise ordnungsgemäß ist, gehandelt werden, werden zum letztverfügbaren Kurs auf diesem Markt bewertet.

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

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

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

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

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

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

h) Berechnung des Nettoinventarwertes

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

i) Swinging Single Prices (SSP)

Für alle Teilfonds wird die SSP-Methode angewandt. Bei der SSP-Methode werden bei der Berechnung des Nettoinventarwertes die durch die Zeichnungen und Rücknahmen verursachten Nebenkosten für den An- und Verkauf der Anlagen (Geld/Brief-Spannen, marktkonforme Courtagen, Kommissionen, Abgaben usw.) mitberücksichtigt. Falls an einem Bankgeschäftstag die Summe der Zeichnungen bzw. Rücknahmen aller Anteilsklassen eines Teilfonds zu einem Nettovermögenszufluss bzw. -abfluss führt, wird der Nettovermögenswert des betreffenden Teilfonds erhöht bzw. reduziert. Diese Summe wird als «modifizierter Nettoinventarwert» bezeichnet. Die Anpassung führt zu einer Erhöhung des Nettovermögenswertes, wenn die Nettobewegungen zu einem Anstieg der Anzahl der Anteile des betroffenen Teilfonds führen. Sie resultiert in einer Verminderung des Nettovermögenswertes, wenn die Nettobewegungen einen Rückgang der Anzahl der Anteile bewirken.

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

Der bei den Zeichnungen bzw. Rücknahmen anfallende Zu- bzw. Abschlag bei den Transaktionskosten erfolgt jeweils pauschal und bezieht sich auf einen Durchschnittswert aus einer Vorperiode von maximal einem Jahr.

Die maximale Anpassung beläuft sich auf 2% des Nettovermögenswertes des Teilfonds. Wenn der Fonds weniger als ein Jahr auf dem Markt ist, wird dieser Faktor je nach den Besonderheiten des Fonds so festgelegt, dass ein repräsentativer Wert resultiert.

Die Beträge werden am darauffolgenden Tag bei definitiver Kapitalbuchung ausgebucht.

j) Bewertung der Devisentermingeschäfte

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

k) Kapitalgewinne oder -verluste aus Wertpapiergeschäften

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

Erläuterung 3: Verwaltungskommission

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

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

Im Geschäftsjahr belief sich die effektive pauschale Verwaltungskommission auf:

| Teilfonds | Klasse | PVK p.a. in % | PMF p.a. in % | PAF p.a. in % |
|--|---------|---------------|---------------|---------------|
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible COCO | AT | 1.550 | 1.200 | 0.350 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible COCO | BTH EUR | 0.950 | 0.600 | 0.350 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible COCO | DAH EUR | 0.750 | 0.570 | 0.180 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible COCO | DT | 0.750 | 0.570 | 0.180 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible COCO | GT | 0.600 | 0.420 | 0.180 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible COCO | GTH EUR | 0.600 | 0.420 | 0.180 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible COCO | MTH CHF | - | - | - |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible COCO | NT | - | - | - |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Emerging Markets Opportunities | AT | 1.400 | 1.050 | 0.350 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Emerging Markets Opportunities | CT | 0.800 | 0.450 | 0.350 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Emerging Markets Opportunities | DT | 0.750 | 0.570 | 0.180 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Emerging Markets Opportunities | DTH CHF | 0.750 | 0.570 | 0.180 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Emerging Markets Opportunities | DTH EUR | 0.750 | 0.570 | 0.180 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Emerging Markets Opportunities | GT | 0.650 | 0.470 | 0.180 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Emerging Markets Opportunities | NT | - | - | - |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Emerging Markets Opportunities | NTH CHF | - | - | - |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Emerging Markets Opportunities | NTH EUR | - | - | - |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Absolute Return | AA | 1.150 | 0.950 | 0.200 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Absolute Return | AAH CHF | 1.150 | 0.950 | 0.200 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Absolute Return | AAH EUR | 1.150 | 0.950 | 0.200 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Absolute Return | AT | 1.150 | 0.950 | 0.200 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Absolute Return | ATH CHF | 1.150 | 0.950 | 0.200 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Absolute Return | ATH EUR | 1.150 | 0.950 | 0.200 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Absolute Return | BTH CHF | 0.675 | 0.475 | 0.200 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Absolute Return | BTH EUR | 0.675 | 0.475 | 0.200 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Absolute Return | CTH CHF | 0.570 | 0.370 | 0.200 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Absolute Return | DTH CHF | 0.550 | 0.450 | 0.100 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Absolute Return | DTH EUR | 0.550 | 0.450 | 0.100 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Absolute Return | GT | 0.450 | 0.350 | 0.100 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Absolute Return | GTH CHF | 0.450 | 0.350 | 0.100 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Absolute Return | GTH EUR | 0.450 | 0.350 | 0.100 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Absolute Return | NTH CHF | - | - | - |

| | | | | |
|--|---------|-------|-------|-------|
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Convertible | ATH CHF | 1.400 | 1.050 | 0.350 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Convertible | ATH EUR | 1.400 | 1.050 | 0.350 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Convertible | DTH CHF | 0.650 | 0.470 | 0.180 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Convertible | DTH EUR | 0.650 | 0.470 | 0.180 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Convertible | GTH CHF | 0.550 | 0.370 | 0.180 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Convertible | GTH EUR | 0.550 | 0.370 | 0.180 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Convertible | MTH CHF | - | - | - |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Convertible | NTH CHF | - | - | - |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Convertible | NTH EUR | - | - | - |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Corporate | AT | 1.050 | 0.850 | 0.200 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Corporate | ATH CHF | 1.050 | 0.850 | 0.200 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Corporate | ATH EUR | 1.050 | 0.850 | 0.200 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Corporate | BTH CHF | 0.630 | 0.430 | 0.200 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Corporate | BTH EUR | 0.630 | 0.430 | 0.200 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Corporate | CTH CHF | 0.570 | 0.370 | 0.200 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Corporate | DT | 0.500 | 0.400 | 0.100 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Corporate | DTH CHF | 0.500 | 0.400 | 0.100 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Corporate | DTH EUR | 0.500 | 0.400 | 0.100 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Corporate | GT | 0.400 | 0.300 | 0.100 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Corporate | GTH CHF | 0.400 | 0.300 | 0.100 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Corporate | GTH EUR | 0.400 | 0.300 | 0.100 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Corporate | NT | - | - | - |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Rates | AT | 0.317 | 0.750 | 0.200 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Rates | MTH CHF | - | - | - |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Rates | NT | - | - | - |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Rates | NTH EUR | - | - | - |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Rates | ST | - | - | - |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Secured High Yield | AA | 1.400 | 1.050 | 0.350 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Secured High Yield | AAH CHF | 1.400 | 1.050 | 0.350 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Secured High Yield | AAH EUR | 1.400 | 1.050 | 0.350 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Secured High Yield | AT | 1.400 | 1.050 | 0.350 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Secured High Yield | ATH CHF | 1.400 | 1.050 | 0.350 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Secured High Yield | ATH EUR | 1.400 | 1.050 | 0.350 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Secured High Yield | BTH CHF | 0.880 | 0.530 | 0.350 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Secured High Yield | DAH EUR | 0.650 | 0.470 | 0.180 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Secured High Yield | DT | 0.650 | 0.470 | 0.180 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Secured High Yield | DTH CHF | 0.650 | 0.470 | 0.180 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Secured High Yield | DTH EUR | 0.650 | 0.470 | 0.180 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Secured High Yield | GT | 0.550 | 0.370 | 0.180 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Secured High Yield | GTH CHF | 0.550 | 0.370 | 0.180 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Secured High Yield | GTH EUR | 0.550 | 0.370 | 0.180 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Secured High Yield | NT | - | - | - |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Secured High Yield | NTH CHF | - | - | - |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Sustainable Global Credit | AA | 1.050 | 0.850 | 0.200 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Sustainable Global Credit | AAH EUR | 1.050 | 0.850 | 0.200 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Sustainable Global Credit | AT | 1.050 | 0.850 | 0.200 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Sustainable Global Credit | ATH EUR | 1.050 | 0.850 | 0.200 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Sustainable Global Credit | BT | 0.630 | 0.430 | 0.200 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Sustainable Global Credit | DAH EUR | 0.500 | 0.400 | 0.100 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Sustainable Global Credit | DT | 0.500 | 0.400 | 0.100 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Sustainable Global Credit | DTH EUR | 0.500 | 0.400 | 0.100 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Sustainable Global Credit | GT | 0.430 | 0.330 | 0.100 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Sustainable Global Credit | GTH EUR | 0.430 | 0.330 | 0.100 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Sustainable Global Credit | NT | - | - | - |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Sustainable Global High Yield | AAH EUR | 1.400 | 1.050 | |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Sustainable Global High Yield | ATH CHF | 1.400 | 1.050 | |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Sustainable Global High Yield | ATH EUR | 1.400 | 1.050 | |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Sustainable Global High Yield | BTH CHF | 0.880 | 0.530 | |

| | | | | |
|---|---------|-------|-------|-------|
| Swisscanto (LU) Bond Fund Sustainable Global High Yield | DAH EUR | 0.650 | 0.470 | 0.180 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Sustainable Global High Yield | DT | 0.650 | 0.470 | 0.180 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Sustainable Global High Yield | DTH CHF | 0.650 | 0.470 | 0.180 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Sustainable Global High Yield | DTH EUR | 0.650 | 0.470 | 0.180 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Sustainable Global High Yield | GT | 0.550 | 0.370 | 0.180 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Sustainable Global High Yield | GTH CHF | 0.550 | 0.370 | 0.180 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Sustainable Global High Yield | GTH EUR | 0.550 | 0.370 | 0.180 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Sustainable Global High Yield | NT | - | - | - |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Sustainable Global High Yield | NTH EUR | - | - | - |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible AUD | AA | 0.950 | 0.750 | 0.200 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible AUD | AT | 0.950 | 0.750 | 0.200 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible AUD | BT | 0.580 | 0.380 | 0.200 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible AUD | CT | 0.490 | 0.290 | 0.200 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible AUD | DT | 0.450 | 0.350 | 0.100 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible AUD | GT | 0.380 | 0.280 | 0.100 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible CHF | AA | 0.950 | 0.750 | 0.200 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible CHF | AT | 0.950 | 0.750 | 0.200 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible CHF | BT | 0.580 | 0.380 | 0.200 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible CHF | CT | 0.490 | 0.290 | 0.200 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible CHF | DA | 0.450 | 0.350 | 0.100 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible CHF | DT | 0.450 | 0.350 | 0.100 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible CHF | GT | 0.380 | 0.280 | 0.100 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible CHF | NT | - | - | - |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible EUR | AA | 0.950 | 0.750 | 0.200 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible EUR | AT | 0.950 | 0.750 | 0.200 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible EUR | CT | 0.490 | 0.290 | 0.200 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible EUR | DA | 0.450 | 0.350 | 0.100 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible EUR | DT | 0.450 | 0.350 | 0.100 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible EUR | GT | 0.380 | 0.280 | 0.100 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible EUR | NT | - | - | - |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible GBP | AA | 0.950 | 0.750 | 0.200 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible GBP | AT | 0.950 | 0.750 | 0.200 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible GBP | CT | 0.490 | 0.290 | 0.200 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible GBP | DA | 0.450 | 0.350 | 0.100 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible GBP | DT | 0.450 | 0.350 | 0.100 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible GBP | GT | 0.380 | 0.280 | 0.100 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Sustainable Global Aggregate | AA | 0.950 | 0.750 | 0.200 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Sustainable Global Aggregate | AT | 0.950 | 0.750 | 0.200 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Sustainable Global Aggregate | BT | 0.580 | 0.380 | 0.200 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Sustainable Global Aggregate | CT | 0.490 | 0.290 | 0.200 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Sustainable Global Aggregate | DT | 0.450 | 0.350 | 0.100 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Sustainable Global Aggregate | GT | 0.380 | 0.280 | 0.100 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Sustainable Global Aggregate | NT | - | - | - |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible CAD | AA | 0.950 | 0.750 | 0.200 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible CAD | AT | 0.950 | 0.750 | 0.200 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible CAD | CT | 0.490 | 0.290 | 0.200 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible CAD | DT | 0.450 | 0.350 | 0.100 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible CAD | GT | 0.380 | 0.280 | 0.100 |

| | | | | |
|--|---------|-------|-------|-------|
| Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible USD | AA | 0.950 | 0.750 | 0.200 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible USD | AT | 0.950 | 0.750 | 0.200 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible USD | CT | 0.490 | 0.290 | 0.200 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible USD | DA | 0.450 | 0.350 | 0.100 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible USD | DT | 0.450 | 0.350 | 0.100 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible USD | GT | 0.380 | 0.280 | 0.100 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible USD | NT | - | - | - |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Corporate Hybrid | AA | 1.100 | 0.900 | 0.200 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Corporate Hybrid | ATH CHF | 1.100 | 0.900 | 0.200 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Corporate Hybrid | DT | 0.550 | 0.450 | 0.100 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Corporate Hybrid | DTH CHF | 0.550 | 0.450 | 0.100 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Corporate Hybrid | GTH CHF | 0.500 | 0.400 | 0.100 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Corporate Hybrid | NTH CHF | - | - | - |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Corporate Hybrid | STH CHF | - | - | - |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Corporate Hybrid | STH USD | - | - | - |

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

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

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

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

Erläuterung 5: Total Expense Ratio (TER)

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

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

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

Erläuterung 6: Angaben über Devisentermingeschäfte

Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible COCO - USD

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Fälligkeit | Nicht realisiertes Ergebnis (in USD) |
|---------|----------------|---------|----------------|------------|--------------------------------------|
| GBP | 63'602'700.00 | USD | 50'000'000 | 28.2.2024 | -78'877.15 |
| EUR | 195'916'626.00 | USD | 180'000'000.00 | 28.2.2024 | 171'845.59 |
| CHF | 2'382.70 | USD | 2'767.60 | 29.2.2024 | 18.11 |
| EUR | 74'465.44 | USD | 80'519.41 | 29.2.2024 | 460.18 |
| EUR | 4'368'781.71 | USD | 4'723'959.29 | 29.2.2024 | 26'998.50 |
| EUR | 916'694.87 | USD | 991'221.25 | 29.2.2024 | 5'665.06 |
| CHF | 277'132.44 | USD | 321'900.79 | 29.2.2024 | 2'106.24 |
| EUR | 441'096.52 | USD | 476'957.23 | 29.2.2024 | 2'725.91 |
| CHF | 144'190.73 | USD | 167'483.50 | 29.2.2024 | 1'095.87 |
| SEK | 11'776'587.60 | USD | 1'124'757.16 | 29.2.2024 | 16'274.98 |
| EUR | 115'858'546.26 | USD | 125'267'650.52 | 29.2.2024 | 726'027.47 |
| CHF | 18'480'299.57 | USD | 21'461'893.06 | 29.2.2024 | 144'175.56 |
| CHF | 37'342'722.57 | USD | 43'367'560.98 | 29.2.2024 | 291'332.27 |
| CHF | 106'448'054.71 | USD | 123'622'279.95 | 29.2.2024 | 830'463.10 |
| EUR | 5'449'940.47 | USD | 5'892'541.04 | 29.2.2024 | 34'152.04 |
| CHF | 18'766'894.26 | USD | 21'794'726.66 | 29.2.2024 | 146'411.44 |
| EUR | 28'341'374.37 | USD | 30'643'034.07 | 29.2.2024 | 177'601.19 |
| EUR | 4'299'513.04 | USD | 4'648'685.09 | 29.2.2024 | 26'942.90 |
| CHF | 9'842'704.97 | USD | 11'430'717.38 | 29.2.2024 | 76'788.66 |
| CHF | 5'787'198.41 | USD | 6'720'899.35 | 29.2.2024 | 45'149.30 |
| EUR | 17'571'201.98 | USD | 18'998'194.44 | 29.2.2024 | 110'109.91 |
| CHF | 161'501.00 | USD | 187'557.41 | 29.2.2024 | 1'259.97 |
| EUR | 6'507'032.20 | USD | 7'035'481.30 | 29.2.2024 | 40'776.31 |
| EUR | 23'927.50 | USD | 25'962.13 | 29.2.2024 | 58.90 |
| EUR | 29'365.22 | USD | 31'862.23 | 29.2.2024 | 72.30 |

Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Corporate Hybrid - EUR

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Fälligkeit | Nicht realisiertes Ergebnis (in EUR) |
|---------|---------------|---------|----------------|------------|--------------------------------------|
| GBP | 8'122'930.10 | EUR | 7'000'000.00 | 22.2.2024 | -76'901.15 |
| USD | 11'273'564.50 | EUR | 12'300'000.00 | 22.2.2024 | -39'661.04 |
| CHF | 12'186.36 | EUR | 13'095.15 | 29.2.2024 | 6.36 |
| CHF | 1'047'254.35 | EUR | 1'124'994.87 | 29.2.2024 | 902.61 |
| USD | 15'041'407.14 | EUR | 13'913'920.43 | 29.2.2024 | -82'551.62 |
| CHF | 98'762'801.62 | EUR | 106'094'231.28 | 29.2.2024 | 85'121.66 |
| CHF | 194'807.95 | EUR | 209'269.07 | 29.2.2024 | 167.90 |
| CHF | 2'235'848 | EUR | 2'401'821.04 | 29.2.2024 | 1'927.04 |

Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Emerging Markets Opportunities - USD

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Fälligkeit | Nicht realisiertes Ergebnis (in USD) |
|---------|------------------|---------|--------------|------------|--------------------------------------|
| CLP | 3'191'697'697.00 | USD | 3'430'000.00 | 26.2.2024 | -15'441.69 |
| HUF | 1'839'718'272.00 | EUR | 4'800'000.00 | 26.2.2024 | -26'827.64 |
| IDR | 18'099'850'000 | USD | 1'150'000.00 | 26.2.2024 | -3'156.99 |
| USD | 8'687'442.80 | EUR | 7'950'000.00 | 17.4.2024 | 24'367.70 |
| BRL | 9'419'858.00 | USD | 1'900'000.00 | 26.2.2024 | 31.27 |

| | | | | | |
|-----|-------------------|-----|---------------|-----------|-------------|
| INR | 104'464'500.00 | USD | 1'250'000.00 | 26.2.2024 | 6'526.15 |
| USD | 7'260'000.00 | EUR | 6'760'266.25 | 26.2.2024 | -90'651.24 |
| EUR | 3'500'000.00 | PLN | 15'599'874.50 | 26.2.2024 | -108'673.36 |
| USD | 3'350'000.00 | PLN | 13'903'863.45 | 26.2.2024 | -138'769.15 |
| HUF | 910'513'531.50 | USD | 2'550'000.00 | 26.2.2024 | 19'800.61 |
| USD | 4'800'000.00 | ZAR | 90'533'232.00 | 26.2.2024 | -57'082.58 |
| USD | 2'386'276.86 | EUR | 2'200'000.00 | 26.2.2024 | -5'943.36 |
| IDR | 37'865'760'000.00 | USD | 2'400'000.00 | 26.2.2024 | -771.50 |
| USD | 10'169'972.44 | CHF | 8'724'310.86 | 2.2.2024 | -2'093.72 |
| CHF | 8'724'310.86 | USD | 10'204'707.82 | 4.3.2024 | -221.87 |
| USD | 23'021'372.85 | EUR | 21'193'438.76 | 2.2.2024 | -1'873.12 |
| EUR | 21'193'438.76 | USD | 23'053'226.59 | 4.3.2024 | -1'471.07 |
| USD | 70'673'123.27 | CHF | 60'626'938.80 | 2.2.2024 | -14'549.61 |
| CHF | 60'626'938.80 | USD | 70'914'506.22 | 4.3.2024 | -1'541.84 |
| USD | 0.03 | EUR | 0.03 | 2.2.2024 | 0.00 |
| EUR | 0.03 | USD | 0.03 | 4.3.2024 | 0.00 |
| USD | 196'798.09 | CHF | 168'295.96 | 4.3.2024 | -50.85 |
| USD | 11'483.47 | EUR | 10'559.74 | 4.3.2024 | -2.17 |
| USD | 443'733.57 | EUR | 408'039.81 | 4.3.2024 | -84.09 |
| USD | 23'685.80 | CHF | 20'255.40 | 4.3.2024 | -6.12 |
| USD | 226'937.59 | CHF | 194'070.38 | 4.3.2024 | -58.65 |

Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Absolute Return - USD

| Wahrung | Kufe | Wahrung | Verkufe | Falligkeit | Nicht realisiertes Ergebnis (in USD) |
|----------|----------------|----------|----------------|-------------|--------------------------------------|
| CHF | 8'750'000.00 | USD | 10'171'650.97 | 21.3.2024 | 80'587.17 |
| JPY | 375'000'000.00 | USD | 2'588'849.31 | 22.2.2024 | -14'824.14 |
| EUR | 6'100'000.00 | CHF | 6'463'339.88 | 29.2.2024 | 102'605.65 |
| USD | 4'000'000.00 | CAD | 2'966'142.45 | 14.3.2024 | 29'188.82 |
| EUR | 5'586'828.00 | CHF | 6'000'000.00 | 15.2.2024 | 1'166.47 |
| USD | 5'157'157.38 | SEK | 53'500'000.00 | 22.2.2024 | -25'318.72 |
| CHF | 16'799'420.71 | USD | 14'500'000.00 | 22.2.2024 | -141'112.37 |
| USD | 7'610'370.00 | GBP | 6'000'000.00 | 22.2.2024 | -31'102.71 |
| USD | 3'347'745.71 | NZD | 5'400'000.00 | 22.2.2024 | 23'405.48 |
| CNY | 10'000'000.00 | USD | 1'408'131.77 | 22.2.2024 | -12'016.46 |
| EUR | 14'000'000.00 | USD | 15'259'808.20 | 14.3.2024 | -25'783.87 |
| USD | 6'017'294.85 | ZAR | 113'132'767.00 | 22.2.2024 | -54'375.03 |
| USD | 14'999'267.34 | CHF | 13'000'000.00 | 22.3.2024 | -233'365.67 |
| MXN | 140'000'000.00 | USD | 8'145'154.09 | 29.2.2024 | -30'642.71 |
| USD | 43'204'792.76 | EUR | 39'380'537.00 | 22.2.2024 | 388'453.76 |
| USD | 6'116'698.18 | CAD | 8'259'873.00 | 22.2.2024 | -67'314.19 |
| USD | 6'624'890.00 | AUD | 10'000'000.00 | 22.2.2024 | 9'798.49 |
| USD | 16'146'877.62 | CNY | 115'000'000.00 | 22.3.2024 | 62'257.62 |
| EUR | 9'000'000.00 | USD | 9'786'065.40 | 21.2.2024 | -1'517.39 |
| SEK | 20'500'000.00 | EUR | 1'811'687.22 | 22.2.2024 | 16'095.92 |
| AUD | 1'600'000.00 | USD | 1'057'763.20 | 14.3.2024 | 1'306.25 |
| EUR | 10'623'176.80 | CHF | 10'000'000.00 | 22.2.2024 | -133'341.63 |
| USD | 13'684'049.69 | MXN | -238'500'000 | 22.2.2024 | -153'859.64 |
| USD | 26'319'696.00 | EUR | 24'000'000.00 | 21.3.2024 | 195'405.97 |
| MXN | 32'000'000.00 | USD | 1'837'360.20 | 1.4.2024 | 8'142.15 |

| | | | | | |
|-----|---------------|-----|----------------|-----------|------------|
| USD | 6'543'349.32 | EUR | 6'000'000.00 | 22.2.2024 | 19'999.74 |
| USD | 3'094'686.35 | CAD | 4'200'000.00 | 22.2.2024 | -49'724.61 |
| USD | 11'570'097.07 | EUR | 10'702'518.00 | 22.2.2024 | -65'617.47 |
| USD | 3'537'401.79 | AUD | 5'300'000.00 | 22.2.2024 | 31'318.22 |
| USD | 6'000'000.00 | MXN | 101'769'270.00 | 22.2.2024 | 94'765.15 |
| USD | 2'547'993.42 | GBP | 2'000'000.00 | 22.2.2024 | 799.48 |
| USD | 4'023'943.92 | NOK | 41'500'000.00 | 22.2.2024 | 52'706.07 |
| CHF | 1'500'000.00 | USD | 1'753'920.30 | 21.3.2024 | 3'681.43 |
| USD | 21'912'540.00 | EUR | 20'000'000.00 | 15.2.2024 | 173'888.66 |
| CHF | 86'890'320.56 | USD | 100'909'120.07 | 29.2.2024 | 677'881.85 |
| EUR | 18'177'451.37 | USD | 19'653'678.55 | 29.2.2024 | 113'908.99 |
| CHF | 33'379'828.75 | USD | 38'765'297.74 | 29.2.2024 | 260'415.44 |
| EUR | 10'059'257.99 | USD | 10'876'190.45 | 29.2.2024 | 63'036.34 |
| CHF | 2'260'487.66 | USD | 2'625'192.53 | 29.2.2024 | 17'635.38 |
| EUR | 206'691.15 | USD | 223'476.95 | 29.2.2024 | 1'295.24 |
| CHF | 2'141'551.13 | USD | 2'487'066.90 | 29.2.2024 | 16'707.48 |
| CHF | 3'199'767.93 | USD | 3'716'015.36 | 29.2.2024 | 24'963.26 |
| EUR | 15'221'064.10 | USD | 16'457'197.16 | 29.2.2024 | 95'382.78 |
| CHF | 19'061'740.65 | USD | 22'137'143.28 | 29.2.2024 | 148'711.71 |
| EUR | 362'778.83 | USD | 392'240.82 | 29.2.2024 | 2'273.36 |

Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Convertible - USD

| Wahrung | Kaufe | Wahrung | Verkaufe | Falligkeit | Nicht realisiertes Ergebnis (in USD) |
|----------|---------------|----------|------------------|-------------|--------------------------------------|
| USD | 320'000.00 | SGD | 239'765.28 | 17.4.2024 | 411.89 |
| USD | 600'000.00 | EUR | 654'479.82 | 17.4.2024 | -676.14 |
| EUR | 13'874'725.71 | USD | 12'690'000.00 | 17.4.2024 | 46'410.42 |
| USD | 7'194'632.98 | JPY | 1'046'604'000.00 | 17.4.2024 | -48'865.93 |
| SGD | 696'786.63 | USD | 930'000.00 | 17.4.2024 | -1'227.93 |
| AUD | 553'213.48 | USD | 837'000.00 | 17.4.2024 | -1'319.44 |
| USD | 2'100'782.96 | HKD | 16'400'000.00 | 17.4.2024 | -1'135.22 |
| CHF | 22'030'304.30 | USD | 25'584'652.09 | 29.2.2024 | 171'871.21 |
| CHF | 8'710'040.28 | USD | 10'115'309.68 | 29.2.2024 | 67'952.08 |
| CHF | 11'879'204.52 | USD | 13'795'783.78 | 29.2.2024 | 92'676.58 |
| EUR | 2'422'807.03 | USD | 2'619'568.03 | 29.2.2024 | 15'182.52 |
| EUR | 1'481'513.78 | USD | 1'601'830.48 | 29.2.2024 | 9'283.90 |
| EUR | 9'448.92 | USD | 10'216.29 | 29.2.2024 | 59.21 |
| CHF | 13'318'773.42 | USD | 15'467'611.32 | 29.2.2024 | 103'907.49 |
| EUR | 370'654.76 | USD | 400'756.37 | 29.2.2024 | 2'322.72 |
| CHF | 1'712'759.12 | USD | 1'989'094 | 29.2.2024 | 13'362.24 |
| USD | 584'352.90 | CHF | 503'116.16 | 29.2.2024 | -3'860.91 |
| EUR | 28'627.01 | USD | 31'061.25 | 29.2.2024 | 70.48 |
| CHF | 62'955.03 | USD | 73'147.34 | 29.2.2024 | 456.10 |

Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Corporate - USD

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Fälligkeit | Nicht realisiertes Ergebnis (in USD) |
|---------|----------------|---------|----------------|------------|--------------------------------------|
| AUD | 1'314'354.00 | USD | 2'000'000.00 | 28.2.2024 | -8'855.08 |
| GBP | 12'032'510.00 | USD | 9'500'000.00 | 28.2.2024 | -66'775.02 |
| CAD | 9'643'223.00 | USD | 13'000'000.00 | 28.2.2024 | -90'335.31 |
| USD | 2'182'280.00 | EUR | 2'000'000.00 | 28.2.2024 | 7'315.59 |
| USD | 81'325'800.00 | EUR | 75'000'000.00 | 28.2.2024 | -233'261.69 |
| CHF | 20'520'110.99 | USD | 23'830'805.67 | 29.2.2024 | 160'089.31 |
| CHF | 55'883'318.30 | USD | 64'899'478.33 | 29.2.2024 | 435'978.22 |
| CHF | 132'705'731.47 | USD | 154'116'344.65 | 29.2.2024 | 1'035'314.48 |
| CHF | 212'350.58 | USD | 246'611.02 | 29.2.2024 | 1'656.66 |
| EUR | 11'144'848.24 | USD | 12'049'943.66 | 29.2.2024 | 69'839.19 |
| EUR | 23'229'036.16 | USD | 25'115'512.64 | 29.2.2024 | 145'564.73 |
| EUR | 26'383.77 | USD | 28'526.45 | 29.2.2024 | 165.33 |
| EUR | 28'885'525.85 | USD | 31'231'377.18 | 29.2.2024 | 181'011.12 |
| CHF | 2'456'765.13 | USD | 2'853'137.22 | 29.2.2024 | 19'166.65 |
| EUR | 3'000'000 | USD | 3'255'271.20 | 29.2.2024 | 7'100.51 |
| EUR | 122'844.18 | USD | 133'289.99 | 29.2.2024 | 302.42 |

Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Rates - USD

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Fälligkeit | Nicht realisiertes Ergebnis (in USD) |
|---------|----------------|---------|---------------|------------|--------------------------------------|
| USD | 162'125'000.00 | JPY | 1'102'902.86 | 29.2.2024 | 11'046.65 |
| USD | 1'060'000.00 | NOK | 100'861.49 | 29.2.2024 | 581.44 |
| USD | 100'000.00 | CNY | 13'906.54 | 29.2.2024 | 59.15 |
| BRL | 382'259.92 | USD | 1'900'000.00 | 29.2.2024 | -1'020.82 |
| JPY | 453'881.17 | USD | 66'270'000.00 | 15.2.2024 | -506.15 |
| MXN | 1'020'989.83 | USD | 17'550'000.00 | 29.2.2024 | 3'778.14 |
| PLN | 137'382.47 | USD | 550'000.00 | 29.2.2024 | -624.56 |
| SEK | 374'261.25 | USD | 3'900'000.00 | 29.2.2024 | -3'616.86 |
| GBP | 56'109'408.00 | JPY | 300'000.00 | 29.2.2024 | 3'432.07 |
| ILS | 196'590.22 | USD | 740'000.00 | 29.2.2024 | -6'951.38 |
| USD | 150'000.00 | NZD | 91'664.63 | 29.2.2024 | 672.77 |
| USD | 750'000.00 | AUD | 494'263.35 | 29.2.2024 | 1'958.60 |
| USD | 240'000.00 | CHF | 278'745.64 | 29.2.2024 | 1'848.21 |
| HUF | 145'520.47 | USD | 51'340'000.00 | 29.2.2024 | 661.93 |
| USD | 150'000.00 | SGD | 111'990.40 | 29.2.2024 | 377.47 |
| CZK | 483'417.25 | USD | 11'000'000.00 | 29.2.2024 | 3'880.18 |
| CHF | 693'677.95 | USD | 600'000.00 | 29.2.2024 | -7'793.10 |
| USD | 660'000.00 | EUR | 719'839.56 | 29.2.2024 | -2'077.16 |
| GBP | 502'511.89 | USD | 395'000.00 | 29.2.2024 | -575.31 |

Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Secured High Yield - USD

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Fälligkeit | Nicht realisiertes Ergebnis (in USD) |
|---------|---------------|---------|---------------|------------|--------------------------------------|
| GBP | 10'110'557.75 | USD | 8'010'000.00 | 29.2.2024 | -90'947.21 |
| EUR | 78'979'652.16 | USD | 71'870'240.00 | 29.2.2024 | 816'886.69 |
| CHF | 721'443.60 | USD | 629'549.00 | 29.2.2024 | -14'546.46 |
| EUR | 14'156'695.12 | USD | 15'306'388.64 | 29.2.2024 | 88'712.91 |
| CHF | 8'210'981.19 | USD | 9'535'732.88 | 29.2.2024 | 64'058.63 |
| CHF | 9'479'917.69 | USD | 11'009'398.36 | 29.2.2024 | 73'958.34 |
| CHF | 10'819'845.47 | USD | 12'565'508.78 | 29.2.2024 | 84'411.89 |
| CHF | 39'737'267.88 | USD | 46'148'439.89 | 29.2.2024 | 310'013.50 |
| EUR | 11'222'053.86 | USD | 12'133'419.30 | 29.2.2024 | 70'322.99 |
| EUR | 967'827.92 | USD | 1'046'427.16 | 29.2.2024 | 6'064.90 |
| CHF | 368'676.94 | USD | 428'158.92 | 29.2.2024 | 2'876.26 |
| EUR | 5'673'756.44 | USD | 6'134'533.55 | 29.2.2024 | 35'554.59 |
| EUR | 1'452'640.47 | USD | 1'570'612.31 | 29.2.2024 | 9'102.96 |
| CHF | 14'975'925.27 | USD | 17'392'126.43 | 29.2.2024 | 116'835.89 |
| CHF | 146'934.00 | USD | 170'722.36 | 29.2.2024 | 1'064.49 |
| CHF | 43'859.94 | USD | 50'960.79 | 29.2.2024 | 317.76 |

Swisscanto (LU) Bond Fund Sustainable Global Credit - CHF

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Fälligkeit | Nicht realisiertes Ergebnis (in CHF) |
|---------|----------------|---------|----------------|------------|--------------------------------------|
| EUR | 44'285'107.02 | CHF | 47'800'000.00 | 7.3.2024 | -156'058.80 |
| GBP | 10'751'290.00 | CHF | 10'000'000.00 | 7.3.2024 | -134'470.78 |
| USD | 108'738'271.32 | CHF | 128'900'000.00 | 7.3.2024 | -1'427'797.91 |
| CHF | 1'500'000.00 | USD | 1'292'685.00 | 7.3.2024 | -10'646.53 |
| CAD | 2'778'974.00 | CHF | 4'400'000.00 | 7.3.2024 | -37'008.88 |
| EUR | 16'782'455.89 | CHF | 15'625'674.77 | 29.2.2024 | -15'480.22 |
| EUR | 2'188'611.99 | CHF | 2'037'755.34 | 29.2.2024 | -2'018.79 |
| EUR | 1'562'257.60 | CHF | 1'454'574.31 | 29.2.2024 | -1'441.03 |
| EUR | 10'446'294.67 | CHF | 9'726'252.47 | 29.2.2024 | -9'635.70 |
| EUR | 1'607'325.43 | CHF | 1'496'535.70 | 29.2.2024 | -1'482.59 |
| USD | 439'984.05 | CHF | 378'938.46 | 29.2.2024 | -2'614.63 |

Swisscanto (LU) Bond Fund Sustainable Global High Yield - USD

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Fälligkeit | Nicht realisiertes Ergebnis (in USD) |
|---------|---------------|---------|---------------|------------|--------------------------------------|
| GBP | 2'599'108.90 | USD | 2'050'000.00 | 29.2.2024 | -11'812.23 |
| EUR | 16'880'370.00 | USD | 15'600'000.00 | 29.2.2024 | -84'351.97 |
| EUR | 1'087.72 | USD | 1'176.15 | 29.2.2024 | 6.72 |
| EUR | 1'476.29 | USD | 1'596.31 | 29.2.2024 | 9.12 |
| EUR | 19'704.29 | USD | 21'306.23 | 29.2.2024 | 121.77 |
| EUR | 1'792'139.92 | USD | 1'937'683.19 | 29.2.2024 | 11'230.44 |
| CHF | 17'394'152.55 | USD | 20'200'508.14 | 29.2.2024 | 135'701.89 |
| CHF | 5'469'204.64 | USD | 6'351'600.78 | 29.2.2024 | 42'668.44 |
| EUR | 1'073'839.49 | USD | 1'161'048.14 | 29.2.2024 | 6'729.21 |
| EUR | 4'034'369.82 | USD | 4'362'009.06 | 29.2.2024 | 25'281.38 |
| EUR | 99'387.35 | USD | 107'458.80 | 29.2.2024 | 622.81 |
| CHF | 769'695.37 | USD | 893'877.27 | 29.2.2024 | 6'004.84 |
| EUR | 132'756.80 | USD | 143'538.25 | 29.2.2024 | 831.91 |
| CHF | 10'812'501.92 | USD | 12'556'980.43 | 29.2.2024 | 84'354.60 |

| | | | | | |
|-----|--------------|-----|--------------|-----------|-----------|
| EUR | 2'597'941.72 | USD | 2'808'925.76 | 29.2.2024 | 16'280.00 |
| USD | 223'981.52 | CHF | 191'625.00 | 29.2.2024 | -61.19 |
| CHF | 47'524.28 | USD | 55'570.82 | 29.2.2024 | -6.63 |

Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible AUD - AUD

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Fälligkeit | Nicht realisiertes Ergebnis (in AUD) |
|---------|---------------|---------|--------------|------------|--------------------------------------|
| USD | 11'356'650.30 | AUD | 7'500'000.00 | 18.4.2024 | 36'543.28 |
| EUR | 5'125'815.90 | AUD | 3'100'000.00 | 18.4.2024 | 27'018.50 |

Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible CAD - CAD

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Fälligkeit | Nicht realisiertes Ergebnis (in CAD) |
|---------|--------------|---------|--------------|------------|--------------------------------------|
| USD | 4'218'095.70 | CAD | 3'150'000.00 | 7.2.2024 | 9'971.01 |

Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible EUR - EUR

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Fälligkeit | Nicht realisiertes Ergebnis (in EUR) |
|---------|--------------|---------|---------------|------------|--------------------------------------|
| GBP | 640'630.66 | EUR | 550'000.00 | 22.2.2024 | -3'647.46 |
| GBP | 233'218.75 | EUR | 200'000.00 | 29.2.2024 | -1'010.47 |
| HKD | 1'668'390.48 | USD | 13'000'000.00 | 31.5.2024 | 318.29 |

Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible GBP - GBP

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Fälligkeit | Nicht realisiertes Ergebnis (in GBP) |
|---------|--------------|---------|--------------|------------|--------------------------------------|
| EUR | 1'013'683.08 | GBP | 1'175'000.00 | 18.4.2024 | 8'433.21 |

Swisscanto (LU) Bond Fund Sustainable Global Aggregate - CHF

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Fälligkeit | Nicht realisiertes Ergebnis (in CHF) |
|---------|------------------|---------|---------------|------------|--------------------------------------|
| AUD | 850'000.00 | USD | 1'271'611.41 | 7.2.2024 | 7'893.40 |
| USD | 1'049'178.17 | EUR | 1'150'000.00 | 7.2.2024 | -8'572.08 |
| JPY | 300'000.00 | USD | 43'162'860.00 | 7.2.2024 | 3'776.54 |
| GBP | 1'200'000.00 | USD | 943'871.58 | 7.2.2024 | -1'727.14 |
| USD | 1'300'000'000.00 | KRW | 999'323.53 | 11.4.2024 | -18'035.57 |
| CHF | 400'000.00 | USD | 339'098.00 | 7.2.2024 | 3'793.69 |
| NZD | 450'000.00 | USD | 723'847.04 | 7.2.2024 | 3'784.37 |
| CNY | 4'300'000.00 | USD | 30'786'679.90 | 7.2.2024 | 5'243.25 |

Die Devisentermingeschäfte wurden mit folgender Gegenparteien abgeschlossen: BNP Paribas SA/Paris, CACEIS Investor Services Bank SA/LU, Goldman Sachs International, J.P. Morgan, London, Merrill Lynch International, London, Royal Bank of Canada, London, UBS AG, Zürcher Kantonalbank

Erläuterung 7: Angaben über Termingeschäfte

Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Corporate Hybrid - EUR

| | Anzahl der Kontrakte | Bezeichnung | Währung | Commitment | Nicht realisiertes Ergebnis (in EUR) |
|---------|----------------------|------------------------|---------|----------------|--------------------------------------|
| Verkauf | (100) | EURO-BOBL FUTURE Mar24 | EUR | -10'350'681.74 | -125'000.00 |

Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Absolute Return - USD

| | Anzahl der Kontrakte | Bezeichnung | Währung | Commitment | Nicht realisiertes Ergebnis (in USD) |
|---------|----------------------|--------------------------|---------|----------------|--------------------------------------|
| Kauf | 100 | US 10YR NOTE (CBT) Mar24 | USD | 10'747'566.19 | 345'313.00 |
| Kauf | 200 | AUST 3YR BOND FUT Mar24 | AUD | 14'139'007.96 | 146'489.86 |
| Verkauf | (175) | Euro-BTP Future Mar24 | EUR | -20'524'423.81 | -610'674.78 |
| Verkauf | (25) | EURO-BUXL 30Y BND Mar24 | EUR | -2'171'743.79 | -111'916.30 |
| Kauf | 50 | US 5YR NOTE (CBT) Mar24 | USD | 5'009'996.83 | 34'608.50 |
| Verkauf | (50) | US ULTRA BOND CBT Mar24 | USD | -3'913'005.32 | 214'062.5 |
| Verkauf | (200) | EURO-BUND FUTURE Mar24 | EUR | -22'161'802.58 | -366'593.84 |
| Kauf | 50 | AUST 10Y BOND FUT Mar24 | AUD | 3'838'306.71 | 89'568.85 |
| Kauf | 50 | CAN 10YR BOND FUT Mar24 | CAD | 3'405'513.16 | 120'954.07 |
| Kauf | 200 | CAN 2YR BOND FUT Mar24 | CAD | 15'338'891.47 | 53'637.16 |
| Kauf | 34 | EURO-BOBL FUTURE Mar24 | EUR | 38'227.58 | 28'807.30 |

Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Corporate - USD

| | Anzahl der Kontrakte | Bezeichnung | Währung | Commitment | Nicht realisiertes Ergebnis (in USD) |
|---------|-----------------------------|-------------------------|----------------|-------------------|---|
| Verkauf | (150) | US 10YR NOTE (CBT)Mar24 | USD | -16'121'349.29 | -105'469.50 |
| Verkauf | (40) | EURO-BUND FUTURE Mar24 | EUR | -4'432'360.52 | -22'519.05 |

Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Rates - USD

| | Anzahl der Kontrakte | Bezeichnung | Währung | Commitment | Nicht realisiertes Ergebnis (in USD) |
|---------|-----------------------------|-------------------------|----------------|-------------------|---|
| Kauf | 5 | EURO-BOBL FUTURE Mar24 | EUR | 562'170.42 | 4'228.12 |
| Kauf | 2 | EURO-BUXL 30Y BND Mar24 | EUR | 173'739.50 | -1'235.33 |
| Kauf | 30 | US 5YR NOTE (CBT) Mar24 | USD | 3'005'998.10 | 33'593.89 |
| Kauf | 7 | US 10yr Ultra Fut Mar24 | USD | 698'438.07 | 27'507.81 |
| Verkauf | (4) | LONG GILT FUTURE Mar24 | GBP | -522'400.77 | -15'415.31 |
| Verkauf | (4) | US ULTRA BOND CBT Mar24 | USD | -313'040.43 | 4'687.50 |
| Verkauf | (1) | EURO-BUND FUTURE Mar24 | EUR | -110'809.01 | -749.50 |

Swisscanto (LU) Bond Fund Sustainable Global Credit - CHF

| | Anzahl der Kontrakte | Bezeichnung | Währung | Commitment | Nicht realisiertes Ergebnis (in CHF) |
|---------|-----------------------------|-------------------------|----------------|-------------------|---|
| Verkauf | (10) | US 10YR NOTE (CBT)Mar24 | USD | -921'979.97 | -12'946.23 |

Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible AUD - AUD

| | Anzahl der Kontrakte | Bezeichnung | Währung | Commitment | Nicht realisiertes Ergebnis (in AUD) |
|---------|-----------------------------|-------------------------|----------------|-------------------|---|
| Kauf | 7 | LONG GILT FUTURE Mar24 | GBP | 1'382'953.39 | -71.85 |
| Kauf | 80 | AUST 10Y BOND FUT Mar24 | AUD | 9'290'206.10 | 211'647.47 |
| Verkauf | (30) | US 10yr Ultra Fut Mar24 | USD | -4'528'108.36 | -208'333.21 |
| Verkauf | (5) | EURO-BUND FUTURE Mar24 | EUR | -838'128.83 | -5'539.66 |
| Kauf | 175 | AUST 3YR BOND FUT Mar24 | AUD | 18'715'122.85 | 190'219.94 |

Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible CAD - CAD

| | Anzahl der Kontrakte | Bezeichnung | Währung | Commitment | Nicht realisiertes Ergebnis (in CAD) |
|---------|----------------------|-------------------------|---------|---------------|--------------------------------------|
| Kauf | 100 | CAN 2YR BOND FUT Mar24 | CAD | 10'246'763.00 | 22'336.83 |
| Verkauf | (28) | EURO-BOBL FUTURE Mar24 | EUR | -4'206'091.60 | -31'857.48 |
| Kauf | 20 | CAN 10YR BOND FUT Mar24 | CAD | 1'819'974.35 | 55'800.00 |
| Kauf | 11 | US 10yr Ultra Fut Mar24 | USD | 1'466'375.72 | 27'500.00 |

Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible CHF - CHF

| | Anzahl der Kontrakte | Bezeichnung | Währung | Commitment | Nicht realisiertes Ergebnis (in CHF) |
|------|----------------------|------------------------|---------|--------------|--------------------------------------|
| Kauf | 10 | EURO-BUND FUTURE Mar24 | EUR | 950'575.11 | 14'249.13 |
| Kauf | 25 | EURO-BOBL FUTURE Mar24 | EUR | 2'411'289.46 | 19'793.22 |

Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible EUR - EUR

| | Anzahl der Kontrakte | Bezeichnung | Währung | Commitment | Nicht realisiertes Ergebnis (in EUR) |
|---------|----------------------|-------------------------|---------|---------------|--------------------------------------|
| Kauf | 30 | Euro-BTP Future Mar24 | EUR | 3'239'105.92 | 20'680.00 |
| Kauf | 38 | EURO-BOBL FUTURE Mar24 | EUR | 3'933'259.06 | 31'390.00 |
| Kauf | 20 | EURO-BUXL 30Y BND Mar24 | EUR | 1'599'445.87 | 57'500.00 |
| Verkauf | (50) | EURO-BUND FUTURE Mar24 | EUR | -5'100'538.86 | -21'300.00 |

Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible GBP - GBP

| | Anzahl der Kontrakte | Bezeichnung | Währung | Commitment | Nicht realisiertes Ergebnis (in GBP) |
|---------|----------------------|-------------------------|---------|--------------|--------------------------------------|
| Kauf | 23 | US 5YR NOTE (CBT) Mar24 | USD | 1'809'728.34 | 32'387.65 |
| Verkauf | (6) | EURO-BOBL FUTURE Mar24 | EUR | -529'745.57 | -4'747.91 |
| Kauf | 21 | LONG GILT FUTURE Mar24 | GBP | 2'153'680.18 | 89'040.00 |
| Verkauf | (1) | US ULTRA BOND CBT Mar24 | USD | -61'455.19 | -823.39 |

Swisscanto (LU) Bond Fund Sustainable Global Aggregate - CHF

| | Anzahl der Kontrakte | Bezeichnung | Währung | Commitment | Nicht realisiertes Ergebnis (in CHF) |
|---------|----------------------|-------------------------|---------|--------------|--------------------------------------|
| Kauf | 7 | EURO-BUND FUTURE Mar24 | EUR | 665'402.58 | 13'299.07 |
| Verkauf | (9) | Euro-OAT Future Mar24 | EUR | -808'133.87 | -21'195.49 |
| Verkauf | (7) | EURO-BUXL 30Y BND Mar24 | EUR | -521'648.51 | -32'745.70 |
| Kauf | 15 | EURO-BOBL FUTURE Mar24 | EUR | 1'446'773.68 | 11'095.09 |
| Kauf | 25 | CAN 10YR BOND FUT Mar24 | CAD | 1'460'709.73 | 45'382.18 |
| Kauf | 50 | EURO-SCHATZ FUT Mar24 | EUR | 4'770'338.80 | 4'193.47 |

Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible USD - USD

| | Anzahl der Kontrakte | Bezeichnung | Währung | Commitment | Nicht realisiertes Ergebnis (in USD) |
|---------|-----------------------------|-------------------------|----------------|-------------------|---|
| Kauf | 10 | US 10YR NOTE (CBT)Mar24 | USD | 1'074'756.62 | 2'031.30 |
| Kauf | 9 | US ULTRA BOND CBT Mar24 | USD | 704'340.96 | 66'375.00 |
| Verkauf | (9) | EURO-BUND FUTURE Mar24 | EUR | -997'281.12 | -40'725.21 |

Erläuterung 8: Eventualverpflichtungen aus Optionen

Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Absolute Return - USD

| Währung | Put/Call | Strike | Anzahl Kontrakte | Fälligkeit | Bezeichnung | Marktwert |
|---------|----------|--------|------------------|------------|--------------------------|-----------|
| EUR | Call | 97.50 | 50 | 17.06.2024 | 3MO EURO EURIBOR Jun24 | 0.00 |
| EUR | Put | 65.00 | 100'000'000 | 21.02.2024 | MARKIT ITRX EUROPE 12/28 | 63'050.18 |
| USD | Put | 60.00 | 75'000'000 | 21.02.2024 | CDX IG CDSI S41 5Y | 35'195.25 |

Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Rates - USD

| Währung | Put/Call | Strike | Anzahl Kontrakte | Fälligkeit | Bezeichnung | Marktwert |
|---------|----------|--------|------------------|------------|------------------------|-----------|
| EUR | Put | 119.00 | (15) | 22.03.2024 | EURO-BOBL FUTURE Jun24 | 0.00 |

Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible AUD - AUD

| Währung | Put/Call | Strike | Anzahl Kontrakte | Fälligkeit | Bezeichnung | Marktwert |
|---------|----------|--------|------------------|------------|--------------------|-----------|
| USD | Put | 60.00 | 10'000'000 | 21.02.2024 | CDX IG CDSI S41 5Y | 7'098.86 |

Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible EUR - EUR

| Währung | Put/Call | Strike | Anzahl Kontrakte | Fälligkeit | Bezeichnung | Marktwert |
|---------|----------|--------|------------------|------------|--------------------------|-----------|
| EUR | Put | 119.00 | (50) | 22.03.2024 | EURO-BOBL FUTURE Jun24 | 0.00 |
| EUR | Put | 65.00 | 50'000'000 | 21.02.2024 | MARKIT ITRX EUROPE 12/28 | 29'022.00 |
| USD | Put | 60.00 | 25'000'000 | 21.02.2024 | CDX IG CDSI S41 5Y | 10'800.25 |

Swisscanto (LU) Bond Fund Sustainable Global Aggregate - CHF

| Währung | Put/Call | Strike | Anzahl Kontrakte | Fälligkeit | Bezeichnung | Marktwert |
|---------|----------|--------|------------------|------------|--------------------|-----------|
| USD | Put | 60.00 | 15'000'000 | 21.02.2024 | CDX IG CDSI S41 5Y | 6'038.45 |

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

Erläuterung 9: Swapgeschäfte

Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Absolute Return - USD

Credit default swap

| | Nominal | Bezeichnung | Währung | Nicht realisiertes Ergebnis (in USD) |
|---------|-------------|-----------------------------|---------|--------------------------------------|
| Verkauf | (5'000'000) | MARKIT ITRX EUR XOVER 12/27 | EUR | -491'792.67 |
| Verkauf | (5'000'000) | MARKIT ITRX EUR XOVER 12/27 | EUR | -491'792.67 |
| Kauf | 10'000'000 | MARKIT ITRX EUR XOVER 06/24 | EUR | 161'367.30 |
| Kauf | 10'000'000 | MARKIT ITRX EUR XOVER 12/24 | EUR | 366'582.21 |

Interest rate swap

| Währung | Nominal | Bezeichnung | Währung | Nicht realisiertes Ergebnis (in USD) |
|---------|---------------|--------------------------------------|---------|--------------------------------------|
| Verkauf | (70'000'000) | IRS Floating Leg - CNY - CNRR007 | CNY | -9'757'865.60 |
| Kauf | 70'000'000 | IRS Fix Leg 2.3455% p.a. CNY | CNY | 9'859'792.85 |
| Verkauf | (8'250'000) | IRS Fix Leg 2.9274% p.a. USD | USD | -7'401'224.26 |
| Kauf | 8'250'000 | IRS Floating Leg - USD-SOFR-COMPOUND | USD | 8'250'000.00 |
| Kauf | 115'000'000 | IRS Fix Leg 2.935% p.a. SEK | SEK | 11'103'416.61 |
| Verkauf | (115'000'000) | IRS Floating Leg - SEK STIBOR 3M | SEK | -11'130'091.00 |
| Verkauf | (42'678'945) | IRS Floating Leg - BRL 1D / BZDIOVRA | BRL | -8'637'539.02 |
| Kauf | 42'678'945 | IRS Fix Leg 11.417261% p.a. BRL | BRL | 8'948'063.74 |
| Kauf | 15'000'000 | IRS Fix Leg 1.743% p.a. EUR | EUR | 15'313'321.09 |
| Verkauf | (15'000'000) | IRS Floating Leg - EURIBOR 6M EUR | EUR | -16'293'721.50 |
| Verkauf | (10'000'000) | IRS Float Leg - SRFXON3 IRS 2y2y | CHF | -11'657'049.60 |
| Kauf | 10'000'000 | IRS Fix Leg - -0.085% SRFXON3 2y2y | CHF | 11'405'993.47 |
| Verkauf | (5'000'000) | IRS Floating Leg - SONIA GBP | GBP | -6'367'250.00 |
| Kauf | 5'000'000 | IRS Fix Leg 0.5378% p.a. GBP | GBP | 5'126'271.51 |
| Kauf | 2'000'000 | IRS Floating Leg - SONIA GBP | GBP | 2'546'900.00 |
| Verkauf | (2'000'000) | IRS Fix Leg 0.5688% p.a. GBP | GBP | -1'185'969.02 |

Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Rates - USD**Interest rate swap**

| Währung | Nominal | Bezeichnung | Währung | Nicht realisiertes Ergebnis (in USD) |
|---------|--------------|----------------------------------|---------|--------------------------------------|
| Kauf | 12'500'000 | IRS Fix Leg 2.3455% p.a. CNY | CNY | 1'760'677.30 |
| Verkauf | (12'500'000) | IRS Floating Leg - CNY - CNRR007 | CNY | -1'742'476.00 |

Swisscanto (LU) Bond Fund Sustainable Global High Yield - USD**Credit default swap**

| | Nominal | Bezeichnung | Währung | Nicht realisiertes Ergebnis (in USD) |
|------|-----------|---------------------------|---------|--------------------------------------|
| Kauf | 1'000'000 | MARKIT CDX.NA.HY.41 12/28 | USD | 55'547.07 |
| Kauf | 1'000'000 | MARKIT CDX.NA.HY.41 12/28 | USD | 55'547.07 |

Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible AUD - AUD**Credit default swap**

| | Nominal | Bezeichnung | Währung | Nicht realisiertes Ergebnis (in AUD) |
|---------|-------------|-----------------------------|---------|--------------------------------------|
| Verkauf | (2'000'000) | MARKIT ITRX EUR XOVER 12/28 | EUR | -230'235.71 |
| Verkauf | (2'000'000) | MARKIT ITRX EUR XOVER 12/28 | EUR | -230'235.71 |
| Verkauf | (700'000) | MARKIT CDX.NA.HY.41 12/28 | USD | -58'819.98 |
| Kauf | 5'800'000 | MARKIT CDX.NA.IG.41 12/28 | USD | 168'995.45 |
| Verkauf | (1'000'000) | MARKIT ITRX EUR XOVER 12/28 | EUR | -115'117.86 |
| Kauf | 5'500'000 | MARKIT ITRX EUROPE 12/28 | EUR | 161'013.22 |

Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible CAD - CAD**Credit default swap**

| | Nominal | Bezeichnung | Währung | Nicht realisiertes Ergebnis (in CAD) |
|---------|----------------|-----------------------------|----------------|---|
| Kauf | 1'000'000 | MARKIT ITRX EUR XOVER 06/27 | EUR | 131'856.74 |
| Verkauf | (400'000) | MARKIT CDX.NA.HY.41 12/28 | USD | -29'685.47 |
| Kauf | 3'100'000 | MARKIT CDX.NA.IG.41 12/28 | USD | 79'774.80 |
| Verkauf | (300'000) | MARKIT ITRX EUR XOVER 12/28 | EUR | -30'501.49 |
| Kauf | 1'400'000 | MARKIT ITRX EUROPE 12/28 | EUR | 36'197.96 |

Interest rate swap

| Währung | Nominal | Bezeichnung | Währung | Nicht realisiertes Ergebnis (in CAD) |
|----------------|----------------|-----------------------------------|----------------|---|
| Verkauf | (5'000'000) | IRS Floating Leg - EURIBOR 6M EUR | EUR | -7'256'408.85 |
| Kauf | 5'000'000 | IRS Fix Leg 0.451% p.a. EUR | EUR | 6'794'901.70 |

Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible CHF - CHF**Credit default swap**

| | Nominal | Bezeichnung | Währung | Nicht realisiertes Ergebnis (in CHF) |
|---------|----------------|-----------------------------|----------------|---|
| Verkauf | (2'100'000) | MARKIT CDX.NA.HY.41 12/28 | USD | -100'067.21 |
| Kauf | 18'000'000 | MARKIT CDX.NA.IG.41 12/28 | USD | 297'416.60 |
| Verkauf | (3'200'000) | MARKIT ITRX EUR XOVER 12/28 | EUR | -208'899.95 |
| Kauf | 17'200'000 | MARKIT ITRX EUROPE 12/28 | EUR | 285'543.96 |

Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible EUR - EUR**Credit default swap**

| | Nominal | Bezeichnung | Währung | Nicht realisiertes Ergebnis (in EUR) |
|---------|----------------|-----------------------------|----------------|---|
| Verkauf | (7'500'000) | MARKIT ITRX EUR XOVER 12/27 | EUR | -679'116.49 |
| Verkauf | (1'300'000) | MARKIT CDX.NA.HY.41 12/28 | USD | -66'477.62 |
| Kauf | 11'400'000 | MARKIT CDX.NA.IG.41 12/28 | USD | 202'142.28 |
| Verkauf | (2'000'000) | MARKIT ITRX EUR XOVER 12/28 | EUR | -140'112.85 |
| Kauf | 10'800'000 | MARKIT ITRX EUROPE 12/28 | EUR | 192'410.12 |
| Kauf | 10'000'000 | MARKIT ITRX EUR XOVER 12/27 | EUR | 905'488.66 |
| Verkauf | (5'000'000) | MARKIT ITRX EUR XOVER 12/27 | EUR | -452'744.33 |

Interest rate swap

| Währung | Nominal | Bezeichnung | Währung | Nicht realisiertes Ergebnis (in EUR) |
|----------------|----------------|---|----------------|---|
| Verkauf | (4'500'000) | IRS Floating Leg - EURIBOR 6M EUR | EUR | -4'500'000.00 |
| Verkauf | (2'500'000) | IRS Floating Leg - EUR - EURIBOR 6M EUR | EUR | -2'500'000.00 |
| Kauf | 2'500'000 | IRS Fix Leg 3.111% p.a. EUR | EUR | 2'614'099.74 |
| Kauf | 4'500'000 | IRS Fix Leg 0.451% p.a. EUR | EUR | 4'213'800.28 |

Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible GBP - GBP
Credit default swap

| | Nominal | Bezeichnung | Währung | Nicht realisiertes Ergebnis (in GBP) |
|---------|-----------|-----------------------------|---------|--------------------------------------|
| Verkauf | (300'000) | MARKIT CDX.NA.HY.41 12/28 | USD | -13'085.81 |
| Kauf | 2'200'000 | MARKIT CDX.NA.IG.41 12/28 | USD | 33'275.31 |
| Verkauf | (400'000) | MARKIT ITRX EUR XOVER 12/28 | EUR | -23'903.15 |
| Kauf | 2'100'000 | MARKIT ITRX EUROPE 12/28 | EUR | 31'913.22 |

Interest rate swap

| Währung | Nominal | Bezeichnung | Währung | Nicht realisiertes Ergebnis (in GBP) |
|---------|-----------|---|---------|--------------------------------------|
| Verkauf | (700'000) | IRS Floating Leg - EUR - EURIBOR 6M EUR | EUR | -597'097.39 |
| Kauf | 700'000 | IRS Fix Leg 3.23% p.a. EUR | EUR | 614'977.00 |
| Verkauf | (500'000) | IRS Fix Leg 2.9274% p.a. USD | USD | -352'239.23 |
| Kauf | 500'000 | IRS Floating Leg - USD-SOFR-COMPOUND | USD | 392'634.19 |

Swisscanto (LU) Bond Fund Sustainable Global Aggregate - CHF
Interest rate swap

| Währung | Nominal | Bezeichnung | Währung | Nicht realisiertes Ergebnis (in CHF) |
|---------|---------------|--|---------|--------------------------------------|
| Verkauf | (20'000'000) | IRS Floating Leg - CNY - CNRR007 | CNY | -2'391'652.80 |
| Kauf | 20'000'000 | IRS Fix Leg 2.3455% p.a. CNY | CNY | 2'416'635.17 |
| Verkauf | (2'000'000) | IRS Floating Leg - USD - SOFR-COMPOUND | USD | -1'715'700.00 |
| Kauf | 2'000'000 | IRS Fix Leg 4.3373% p.a. USD | USD | 1'850'378.43 |
| Verkauf | (1'000'000) | IRS Floating Leg - USD - SOFR-COMPOUND | USD | -857'850.00 |
| Kauf | 1'000'000 | IRS Fix Leg 4.1875% p.a. USD | USD | 922'670.70 |
| Verkauf | (100'000'000) | IRS Floating Leg - JPY - TONA-OIS-COMPOUND | JPY | -586'865.00 |
| Verkauf | (100'000'000) | IRS Floating Leg - JPY - TONA-OIS-COMPOUND | JPY | -586'865.00 |
| Verkauf | (100'000'000) | IRS Floating Leg - JPY - TONA-OIS-COMPOUND | JPY | -586'865.00 |
| Kauf | 100'000'000 | IRS Fix Leg 1.4276% p.a. JPY | JPY | 567'083.07 |
| Kauf | 100'000'000 | IRS Fix Leg 1.40135% p.a. JPY | JPY | 572'084.24 |
| Kauf | 100'000'000 | IRS Fix Leg 1.13175% p.a. JPY | JPY | 582'511.89 |

Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible USD - USD
Credit default swap

| | Nominal | Bezeichnung | Währung | Nicht realisiertes Ergebnis (in USD) |
|---------|-----------|-----------------------------|---------|--------------------------------------|
| Kauf | 2'000'000 | MARKIT ITRX EUR XOVER 06/27 | EUR | 197'382.96 |
| Verkauf | (500'000) | MARKIT CDX.NA.HY.41 12/28 | USD | -27'773.53 |
| Kauf | 4'500'000 | MARKIT CDX.NA.IG.41 12/28 | USD | 86'675.00 |
| Verkauf | (800'000) | MARKIT ITRX EUR XOVER 12/28 | EUR | -60'878.93 |
| Kauf | 4'200'000 | MARKIT ITRX EUROPE 12/28 | EUR | 81'279.77 |

Interest rate swap

| Währung | Nominal | Bezeichnung | Währung | Nicht realisiertes Ergebnis (in USD) |
|---------|-------------|-----------------------------------|---------|--------------------------------------|
| Verkauf | (4'000'000) | IRS Floating Leg - EURIBOR 6M EUR | EUR | -4'344'992.40 |
| Kauf | 4'000'000 | IRS Fix Leg 0.451% p.a. EUR | EUR | 4'068'651.17 |

Erläuterung 10: Wertpapierbestandsveränderungen

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

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

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

Erläuterung 12: Transaktionskosten

Im Berichtsjahr entstanden dem Fonds folgende Transaktionskosten aus dem Kauf bzw. Verkauf von übertragbaren Wertpapieren, beziehungsweise Geldmarktinstrumenten:

| | | |
|---|-----|----------|
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Absolute Return | USD | 3'836.22 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible CAD | CAD | 874.19 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible USD | USD | 816.01 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Convertible | USD | 2'011.26 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Rates | USD | 648.69 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible EUR | EUR | 741.03 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible CHF | CHF | 842.59 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Sustainable Global Aggregate | CHF | 536.20 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible AUD | AUD | 2'070.49 |

Die Transaktionskosten, welche in der Aufstellung "Ertrags- und Aufwandsrechnung" ausgewiesen werden, und die vor allem im Zusammenhang mit Unterdepotbankgebühren und ähnlichen Gebühren stehen, sind somit nicht in den oben aufgeführten Werten beinhaltet, stehen aber ebenfalls im direkten Zusammenhang mit Käufen und Verkäufen von Wertpapieren. Aufgrund buchungstechnischer Restriktionen können diese Transaktionskosten nicht den Anschaffungswerten der verschiedenen Wertpapiere zugeführt werden.

Erläuterung 13: Wertpapierleihe (Securities Lending)

Im Hinblick auf eine effiziente Verwaltung der Vermögenswerte kann ein Teilfonds, in Übereinstimmung mit den Anforderungen der maßgeblichen rechtlichen Vorschriften, zur Generierung zusätzlichen Ertrages, Techniken und Instrumente der Wertpapierleihe (Securities Lending), gemäß Artikel 51 Absatz 2 der OGAW-Richtlinie und Artikel 11 der Richtlinie 2007/16/EG vom 19. März 2007 (Eligible Assets Richtlinie), anwenden. Bei der Wertpapierleihe tritt der Teilfonds als Verleiher oder Lender auf, welcher der Entleiherin ein Wertpapier für eine begrenzte Zeit zur Nutzung überlässt, wofür der Teilfonds eine Gebühr erhält. Die Zürcher Kantonalbank ist die einzige direkte Entleiherin (Principal) und die einzige direkte Gegenpartei bei der Wertpapierleihe. Als selbstständige öffentlich-rechtliche Anstalt des Kantons Zürich genießt sie eine unbeschränkte Staatsgarantie. Sie unterliegt als solche der behördlichen Aufsicht der Schweizer Aufsichtsbehörde (Eidgenössische Finanzmarktaufsicht, FINMA), welche von der CSSF als denen durch Recht der Europäischen Union festgesetzten Regelungen äquivalent angesehen wird (Art. 41 (1) f) des OGAW-Gesetzes).

Zum Berichtszeitpunkt bestanden Wertpapierleihe-Transaktionen in folgender Höhe:

| Teilfonds | Währung | Marktwert | Garantiebetrag |
|--|---------|------------|----------------|
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible COCO | USD | 66'167'111 | 74'232'487 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Corporate Hybrid | EUR | 913'581 | 1'024'966 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Emerging Markets Opportunities | USD | - | - |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Absolute Return | USD | 16'147'427 | 18'115'862 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Convertible | USD | - | - |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Corporate | USD | 29'716'090 | 33'338'577 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Rates | USD | 547'349 | 614'095 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Secured High Yield | USD | 14'345'172 | 16'093'940 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Sustainable Global Credit | CHF | - | - |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Sustainable Global High Yield | USD | - | - |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible AUD | AUD | - | - |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible CAD | CAD | - | - |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible CHF | CHF | - | - |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible EUR | EUR | 4'823'731 | 5'411'829 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible GBP | GBP | - | - |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Sustainable Global Aggregate | CHF | - | - |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible USD | USD | - | - |

Umsatzdetails für das Jahr sind nachstehend aufgeführt:

| Teilfonds | Währung | Bruttoerträge | Von den Bruttoerträgen aus dem Wertpapierleihgeschäft in Abzug gebrachte direkte und indirekte Kosten und Gebühren | Ertrag nach Abzug der Aufwendungen |
|--|---------|---------------|--|------------------------------------|
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Secured High Yield | USD | 67'999.79 | 6'119.98 | 61'879.81 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Corporate Hybrid | EUR | 1'596.56 | 143.69 | 1'452.87 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Emerging Markets Opportunities | USD | - | - | - |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Absolute Return | USD | 78'939.45 | 7'104.55 | 71'834.90 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Convertible | USD | 26'719.66 | 2'404.77 | 24'314.89 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Corporate | USD | 50'361.39 | 4'532.53 | 45'828.87 |

| | | | | |
|---|-----|------------|-----------|------------|
| Swisscanto (LU) Bond Fund Sustainable Global Credit | USD | - | - | - |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible COCO | USD | 209'511.35 | 18'856.02 | 190'655.33 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Rates | CHF | 7'194.42 | 647.50 | 6'546.92 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Sustainable Global High Yield | USD | - | - | - |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible AUD | AUD | - | - | - |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible CAD | CAD | - | - | - |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible CHF | CHF | - | - | - |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible EUR | EUR | 14'605.14 | 1'314.46 | 13'290.68 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible GBP | GBP | - | - | - |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Sustainable Global Aggregate | CHF | - | - | - |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible USD | USD | 587.02 | 52.83 | 534.19 |

Erläuterung 14: Gebühren bei Zeichnung und Rückkauf von Zielfonds

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

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

| Zielfonds | Marktwert (in CHF) |
|--|--------------------|
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible COCO | 16'211'483.88 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Corporate Hybrid | 21'759'173.68 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Emerging Markets Opportunities | 12'855'000.07 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Convertible | 1'439'395.98 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Sustainable Global High Yield | 11'420'525.98 |

Erläuterung 15: Zusätzliche Informationen

Auflegung neuer Anteilklasse.

Die folgenden Anteilklassen waren während der Geschäftsperiode aufgelegt:

Swisscanto (LU) BF Responsible Global Corporate NT: 27.03.2023 aktiviert

Swisscanto (LU) BF Responsible Global Rates AT: 02.10.2023 aktiviert.

Swisscanto (LU) BF Responsible Global Rates NT EUR: 04.09.2023 aktiviert.

Swisscanto (LU) BF Responsible Global Rates ST: 04.09.2023 aktiviert.

Swisscanto (LU) BF Sustainable Global Credit DTH USD: 15.12.2023 aktiviert.

Schließung Anteilklasse.

Die folgenden Anteilklassen wurde während der Geschäftsperiode geschlossen oder gingen dormant:

Swisscanto (LU) BF Responsible COCO BTH EUR: 22.11.2023 dormant.

Swisscanto (LU) BF Resp. Corporate Hybrid NTH CHF: 10.01.2024 dormant.

Swisscanto (LU) BF Responsible EmMa Opps NTH EUR. 18.12.2023 dormant.

Swisscanto (LU) BF Responsible Glbl Abs Rtn NTH CHF: 22.01.2024 dormant.

Swisscanto (LU) BF Resp. Global Rates AAH EUR: 29.09.2023 geschlossen.

Swisscanto (LU) BF Resp. Global Rates ATH CHF: 29.09.2023 geschlossen.

Swisscanto (LU) BF Resp. Global Rates GTH CHF. 29.09.2023 geschlossen.

Swisscanto (LU) BF Resp. Global Rates GTH EUR: 18.04.2023 geschlossen.

Swisscanto (LU) BF Resp. Global Rates MTH CHF: 18.04.2023 geschlossen.

Swisscanto (LU) BF Resp. Global Rates NTH CHF: 29.09.2023 geschlossen.

Swisscanto (LU) BF Resp. Global Rates NTH EUR: 29.09.2023 geschlossen.

Swisscanto (LU) BF Sust Glbl High Yield GTH CHF: 27.09.2023 dormant.

Erläuterung 16: Wichtige Ereignisse

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

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

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

Mit Wirkung zum 31. Mai 2022 wird der Teilfonds Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Short Term High Yield in Swisscanto (LU) Bond Fund Sustainable Global High Yield umbenannt. Der Teilfonds wurde in Zukunft nachhaltige Investitionen verfolgen und mindestens zwei Drittel der Vermögenswerte unter Einhaltung der Vorgaben des Sustainable-Ansatzes anlegen. Die Zusammensetzung des Portfolios soll sich zukünftig am Referenzindex "ICE BofA Global High Yield Index TR" orientieren, wobei das Anlageuniversum durch den Sustainable-Ansatz eingeschränkt wird.

Erläuterung 17: Nachfolgende Ereignisse

Es gibt keine nachfolgende Ereignisse.

Erläuterung 18: Klassifizierung nach SFDR-Verordnung (EU 2019/2088) (ungeprüft)

Die Teilfonds, die den ESG-Ansatz verfolgen und die Bezeichnung „ESG“ im Namen enthalten, sind im Einklang mit Artikel 8 der 2019/2088 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 27. November 2019 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (im Folgenden „SFDR“) aktiv vom Vermögensverwalter dieser Teilfonds verwaltet worden.

Die Einhaltung der Anforderungen des Artikel 8 SFDR ist insofern erreicht worden, als dass der Vermögensverwalter bei seinen Anlageentscheidungen die vom ESG-Ansatz umfassten Kriterien, nämlich Ausschlusskriterien und ESG-Faktoren, auf mindestens zwei Drittel der Vermögenswerte des jeweiligen Teilfonds angewendet hat.

Soweit in Unternehmen investiert worden ist, sind solche ausgewählt worden, die die Prinzipien der guten Unternehmensführung erfüllt haben. Um dies zu erreichen, sind die Unternehmen anhand von Indikatoren, die von Drittanbietern zur Verfügung gestellt werden, ausgewählt worden.

Es sind keine gezielten Investitionen nach den Vorgaben der Verordnung (EU) 2020/852 vom 18. Juni 2020 über die Einrichtung eines Rahmens zur Erleichterung nachhaltiger Investitionen getätigt worden.

25 Ungeprüfte Informationen

Angaben zur Vergütungspolitik

Im Folgenden werden Informationen, die die von der Verwaltungsgesellschaft gezahlten Vergütungen an ihre Mitarbeiter betreffen, offengelegt. Diese Informationen gelten sowohl für die Verwaltungsgesellschaft als auch für die von ihr verwalteten Investmentfonds und umfassen die gesamte Anzahl der Mitarbeiter.

| | Anzahl MA | CHF |
|---|-----------|--------------|
| Gesamtvergütung Swisscanto Asset Management International S.A. (01.01.2023 – 31.12.2023) | 17 | 2'549'839.67 |
| davon fester Bestandteil | | 1'748'982.55 |
| variabler Bestandteil* | | 800'857.12 |
| | Anzahl MA | CHF |
| Gesamtvergütung delegiertes Asset Management Zürcher Kantonalbank (01.01.2023 – 31.12.2023) | 19 | 5'789'000.00 |
| davon fester Bestandteil | | 3'319'500.00 |
| variabler Bestandteil* | | 2'469'500.00 |

Aufgrund der geringen Mitarbeiteranzahl und in Anwendung des Verhältnismäßigkeitsgrundsatzes ist auf eine weitere Aufgliederung der Vergütungen für die identifizierten Mitarbeiter verzichtet worden.

Die Berechnung der Vergütung sowie der sonstigen Zuwendungen richtet sich nach dem geltenden Marktstandard sowie der individuellen Leistung des Mitarbeiters. Der feste Bestandteil der Vergütung berücksichtigt Faktoren von langfristiger Bedeutung wie z. B. nachhaltige Rentabilität, solides Risiko- und Kapitalmanagement, erstklassiger Kundenservice sowie Teamarbeit. Die gleiche Vorgehensweise gilt für den variablen Bestandteil der Vergütung, bei dem jedoch noch Faktoren wie z.B. die Belohnung von Erfolg und Leistung und die stetige Einhaltung von Richtlinien im Bereich Corporate Governance hinzukommen. Zudem hängt die variable Vergütung massgeblich von dem Ergebnis des Konzerns sowie der Verwaltungsgesellschaft und der von der letzteren verwalteten Fonds ab.

Weitere Informationen können der Vergütungspolitik auf folgender Internetseite entnommen werden:

<https://www.swisscanto.com/lu/de/gs/rechtliche-hinweise/verguetungspolitik.html>

Die Verwaltungsgesellschaft:

SWISSCANTO ASSET MANAGEMENT INTERNATIONAL S.A., Luxemburg

Verordnung über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften und der Weiterverwendung sowie zur Änderung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012

| Allgemeine Daten (in CHF) | | | Nettovermögen insgesamt | (in %) der Vermögenswerte | Anlageportfolio zum Marktwert | (%) der beleihbaren Vermögenswerte |
|--|-----------------|------------|-------------------------|---------------------------|-------------------------------|------------------------------------|
| Teilfonds | Gesamtbewertung | Sicherheit | | | | |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible COCO | 56'761'456 | 63'680'338 | 436'203'238 | 13.01 | 383'659'645 | 14.79 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Corporate Hybrid | 851'309 | 955'102 | 116'307'540 | 0.73 | 112'303'580 | 0.76 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Emerging Markets Opportunities | - | - | 392'097'038 | - | 389'091'280 | - |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Absolute Return | 13'852'070 | 15'540'692 | 207'240'727 | 6.68 | 186'609'961 | 7.42 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Convertible | - | - | 62'009'512 | - | 60'784'932 | - |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Corporate | 25'491'948 | 28'599'498 | 329'270'805 | 7.74 | 293'088'403 | 8.70 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Rates | 469'544 | 526'802 | 44'998'013 | 1.04 | 40'882'435 | 1.15 |

| | | | | | | |
|--|--------------------|--------------------|-------------|------|----------------------|------|
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Secured High Yield | 12'306'006 | 13'806'186 | 141'797'241 | 8.68 | 126'638'574 | 9.72 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Sustainable Global Credit | - | - | 146'380'424 | - | 165'720'964 | - |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Sustainable Global High Yield | - | - | 52'916'563 | - | 50'863'933 | - |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible AUD | - | - | 63'167'477 | - | 60'796'148 | - |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible CAD | - | - | 38'597'670 | - | 37'324'358 | - |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible CHF | - | - | 221'592'851 | - | 222'054'727 | - |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible EUR | 4'494'936 | 5'042'948 | 135'638'235 | 3.31 | 132'400'370 | 3.39 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible GBP | - | - | 24'357'063 | - | 23'342'799 | - |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible International | - | - | 69'171'866 | - | 66'449'696 | - |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible USD | - | - | 42'818'196 | - | 41'473'125 | - |
| Total | 114'227'268 | 128'151'566 | | | 2'393'484'932 | |

Die wichtigsten zehn Gegenparteien

Gesamtbewertung

| | |
|----------------------|-------------|
| Zürcher Kantonalbank | 114'227'268 |
|----------------------|-------------|

Laufzeiten von Wertpapierfinanzierungsgeschäften (SFT)

Gesamtbewertung

| | |
|---------------|--------------------|
| Unbegrenzt | 114'227'268 |
| Gesamt | 114'227'268 |

Land, in dem die Gegenparteien niedergelassen sind

Gesamtbewertung

| | |
|---------------|--------------------|
| Schweiz | 114'227'268 |
| Gesamt | 114'227'268 |

Abwicklung und Clearing

Gesamtbewertung

| | |
|---------------|--------------------|
| Bilateral | 114'227'268 |
| Gesamt | 114'227'268 |

Art von Konten

| | |
|------------------|---|
| Getrennte Konten | - |
|------------------|---|

Angaben zu Rendite und Kosten für jedes einzelne Wertpapierfinanzierungsgeschäft (SFT) (in EUR)

| Bezeichnung des Teilfonds | Bruttoerträge | Gebühren des Agenten (RBC) | Nettoerträge des Fonds |
|--|---------------|----------------------------|------------------------|
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible COCO | 192'876.15 | 17'358.85 | 175'517.30 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible AUD | - | - | - |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible CAD | - | - | - |

| | | | |
|--|-------------------|------------------|-------------------|
| Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible CHF | - | - | - |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible EUR | 14'605.14 | 1314.46 | 13'290.68 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible GBP | - | - | - |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible USD | 540.41 | 48.64 | 491.77 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Rates | - | - | - |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Credit Opportunities | 6'623.18 | 596.09 | 6'027.09 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Corporate Hybrid | 1'596.56 | 143.69 | 1'452.87 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Corporate | 46'362.70 | 4'172.64 | 42'190.06 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Sustainable Global High Yield | - | - | - |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Convertible | 24'598.12 | 2'213.83 | 22'384.29 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Secured High Yield | 62'600.61 | 5'634.05 | 56'966.56 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Sustainable Global Aggregate | - | - | - |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Absolute Return | 72'671.66 | 6'540.45 | 66'131.21 |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Emerging Markets Opportunities | - | - | - |
| Gesamt | 422'474.53 | 38'022.71 | 384'451.82 |



Regelmässige Information zum 31.01.2024

Regelmässige Informationen zu den in Artikel 8, Absätze 1, 2, 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts:

Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible USD

Unternehmenskennung (LEI-Code):

54930070FQYVCKE6MZ76

Benchmark

Bloomberg Barclays US Aggregate Bond Index (TR) in USD

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. In dieser Verordnung ist kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten festgelegt. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

| <input checked="" type="radio"/> <input checked="" type="radio"/> <input type="checkbox"/> Ja | | <input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> <input checked="" type="checkbox"/> Nein | |
|--|--|--|---|
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: _ % | <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind | <input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 33.0% an nachhaltigen Investitionen | <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind |
| <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind | <input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: _ % | <input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind | <input checked="" type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel |
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: _ % | | <input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt . | |



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die von dem Teilfonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale wurden durch folgende Aktivitäten erreicht:

1. Ausschlusskriterien
2. ESG-Integration
3. Reduktion der CO₂e-Intensität
4. Nachhaltige Investitionen










Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Aus Übersichtsgründen werden die Angaben zur Performance (siehe Details am Ende des Reports) der Nachhaltigkeitsindikatoren direkt mit dem historischen Vergleich in der nächsten Frage beantwortet.

...und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Ausschlusskriterien

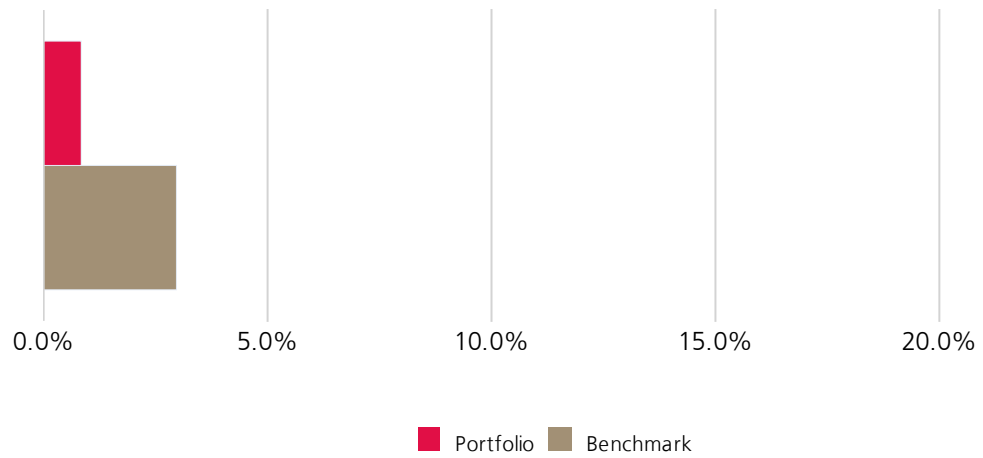
| Responsible | | | | | | | |
|---|-------------------|-------------------|--|--|-------------------|-------------------|------------------------------|
| Kriterien | Gewicht Portfolio | Gewicht Benchmark | Anzahl Unternehmen Benchmark | Kriterien | Gewicht Portfolio | Gewicht Benchmark | Anzahl Unternehmen Benchmark |
|  Kohlereserven (ex. Metallproduktion) | 0.00% | 0.53% | 8 |  Herstellung von Kriegstechnik (> 5% Umsatz) | 0.00% | 0.49% | 12 |
| Förderung von Kohle (> 5% Umsatz) | 0.00% | 0.03% | 1 |  Herstellung von Waffen & Munition | 0.00% | 0.33% | 7 |
|  Klimawandel | | | |  Kontroverse Waffen | 0.00% | 0.28% | 3 |
| | | |  Gefährdung von Gesellschaft und Gesundheit |  Ausbeuterische Kinderarbeit | 0.00% | 0.26% | 3 |
| | | | |  UN Global Compact Verstöße | 0.00% | 0.04% | 2 |
| | | | |  Herstellung von Pornografie | 0.00% | 0.00% | 0 |

Zwecks Minderung der Nachhaltigkeitsrisiken und mit dem Ziel, nicht in Wertpapiere der oben aufgeführten kontroversen Geschäftsmodellen zu investieren, sind die oben genannten Ausschlusskriterien angewendet worden. Die Tabelle zeigt die Anzahl der Unternehmen, die gegen die Ausschlusskriterien verstossen haben, sowie die jeweilige Portfolio- und Benchmark-Exposition. Liegen bei einem Unternehmen mehrere Verstöße vor, werden diese für jedes Kriterium separat aufgeführt. Daher ist die Summe aller Positionen in diesem Bericht in der Regel höher als die effektive Allokation zu den oben abgebildeten Kriterien. Die historischen Vergleiche werden in nachfolgender Tabelle gemacht. Aus Übersichtsgründen werden die Ausschlusskriterien aggregiert.

| | Indikator | Datum 2023 | Datum 2024 |
|-----------|----------------------------|------------|------------|
| Portfolio | Ausschlusskriterien Total* | 0% | 0% |
| Benchmark | Ausschlusskriterien Total* | 1.23% | 1.4% |

*alle Ausschlusskriterien kumuliert.

ESG-Integration

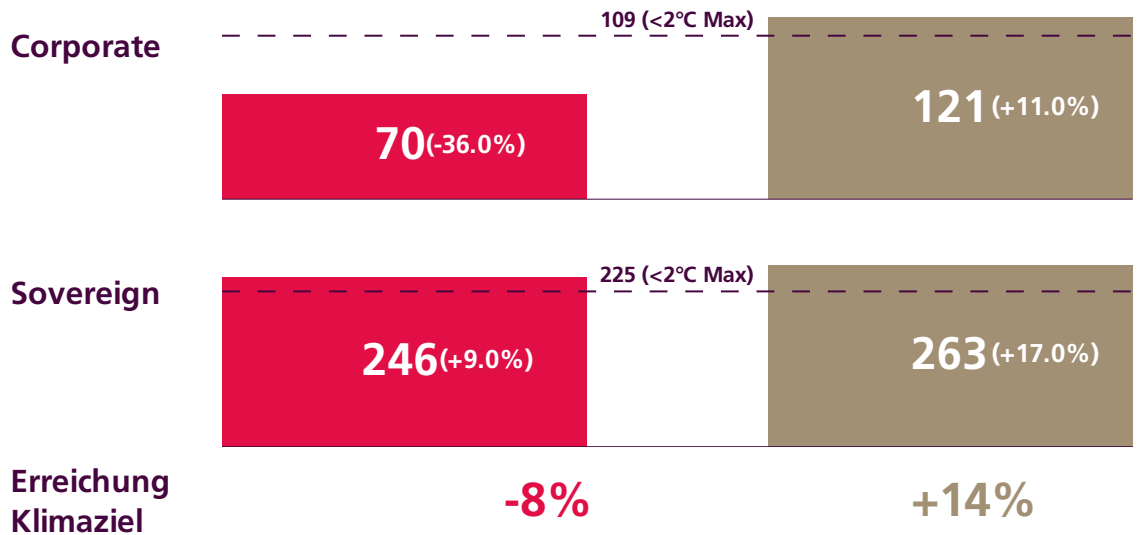


Das Portfolio strebte in der Berichtsperiode im Vergleich zur Benchmark eine geringere Exposition zu ESG-Laggards an. ESG-Laggards sind Unternehmungen mit der schwächsten Umwelt-, Sozial und Governance- Performance des relevanten Anlageuniversums.

Die historischen Vergleiche werden in nachfolgender Tabelle gemacht.

| | Indikator | Datum 2023 | Datum 2024 |
|-----------|----------------------------|------------|------------|
| Portfolio | Exposition zu ESG Laggards | 3.25% | 0.84% |
| Benchmark | Exposition zu ESG Laggards | 3.98% | 2.97% |

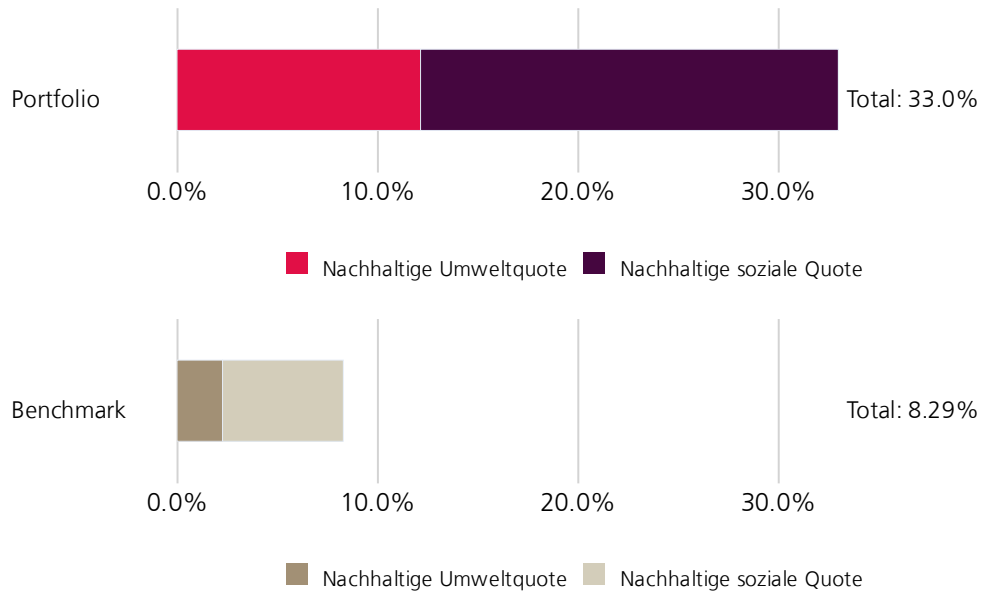
Reduktion der CO₂e-Intensität



Im Einklang mit dem < 2° Pariser Klimaziel ("<2°C Max") zielte die Investitionstätigkeit des Fonds während der Berichtsperiode darauf ab, die CO₂e-Emissionen des Portfolios, um mindestens 4 % pro Jahr zu reduzieren. Der Absenkpfad berechnet sich aus den gewichteten CO₂e-Intensitäten der Benchmark, diskontiert mit 4 % pro Jahr zuzüglich des realen Wirtschaftswachstums. Die gestrichelten 2° Max-Linie zeigt den Maximalwert an. Die Balken stellen die CO₂e-Intensitäten des Portfolios und der Benchmark dar. CO₂e-Intensitäten unterhalb der 2° Max-Linie zeigen an, dass das Portfolio oder die Benchmark das <2°-Klimaziel erfüllen. Werte bei "Erreichung Klimaziel" setzen das Portfolio und die Benchmark in Relation zum Klimaziel. Negative Werte bedeuten, dass das Ziel erreicht wurde. Die historischen Vergleiche werden in nachfolgender Tabelle gemacht.

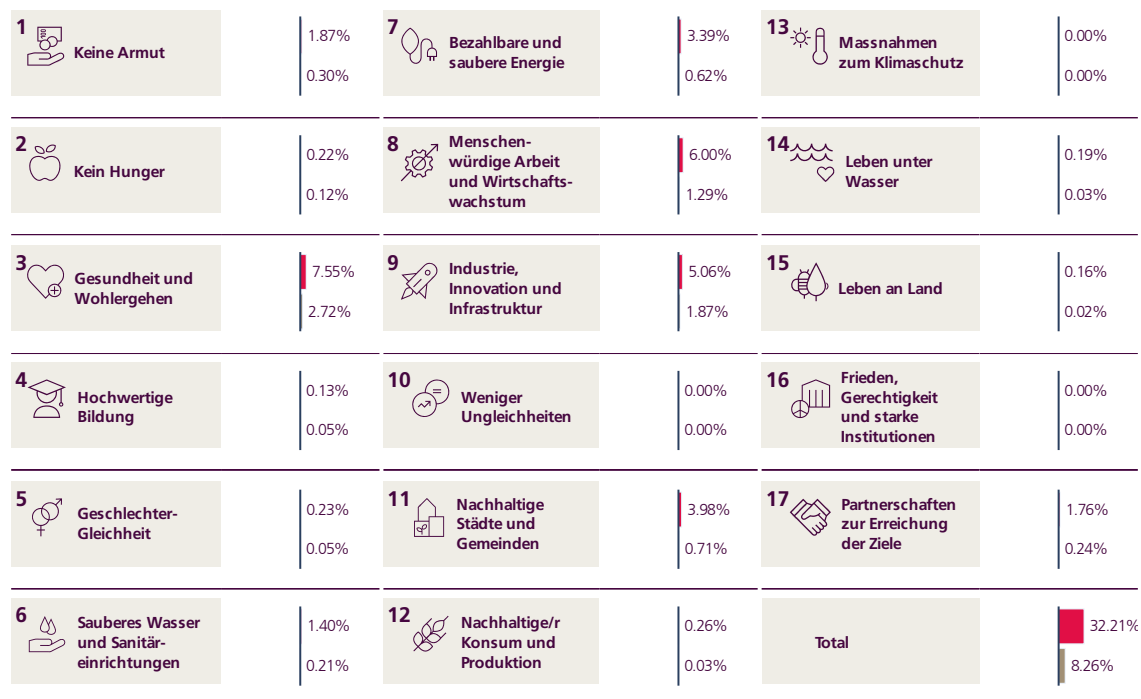
| | Indikator | Datum 2023 | Datum 2024 |
|-----------|--|------------|------------|
| Portfolio | CO ₂ e-Intensität Corporate | 54 | 70 |
| | CO ₂ e-Intensität Sovereign | 255 | 246 |
| | Erreichung Klimaziel | -27% | -8% |
| | Reduktion Corporate | -55% | -36% |
| | Reduktion Sovereign | 4% | 9% |
| Benchmark | CO ₂ e-Intensität Corporate | 125 | 121 |
| | CO ₂ e-Intensität Sovereign | 279 | 263 |
| | Erreichung Klimaziel | 9% | 14% |
| | Reduktion Corporate | 5% | 11% |
| | Reduktion Sovereign | 14% | 17% |

Nachhaltige Investitionen



Das Diagramm zeigt die prozentualen Umsätze der im Portfolio des Fonds enthaltenen Unternehmungen und der der Benchmark, welche nicht EU-Taxonomie konform, jedoch im Einklang mit den sich aus den UN Sustainable Development Goals (SDGs) ergebenden Umwelt- und sozialen Zielen gemäss Art. 2 (17) SFDR investiert worden sind. Der Fonds hat keine Investitionen in ökologisch nachhaltige Aktivitäten im Sinne der EU Taxonomie-Verordnung angestrebt. Der Investmentmanager des (Teil-)Fonds hat eine Methodologie zur Definition nachhaltiger Investitionen entwickelt, die den Anforderungen des Art. 2 (17) SFDR entspricht. Die Methodologie ist detailliert in den Vorvertraglichen Informationen beschrieben. Die Aufteilung der nachhaltigen Investitionen in UN SDGs werden in folgender Grafik gemacht. Die historischen Vergleiche werden in nachfolgender Tabelle gemacht.

| | Indikator | Datum 2023 | Datum 2024 |
|-----------|---|------------|------------|
| Portfolio | Anteil nachhaltige Investitionen mit Umweltziel | 10.19% | 12.19% |
| | Anteil sozial nachhaltige Investitionen | 21.52% | 20.81% |
| | Total nachhaltige Quote | 31.71% | 33% |
| Benchmark | Anteil nachhaltige Investitionen mit Umweltziel | 1.98% | 2.26% |
| | Anteil sozial nachhaltige Investitionen | 5.77% | 6.04% |
| | Total nachhaltige Quote | 7.75% | 8.29% |



■ Portfolio
 ■ Benchmark

Aufgrund der unterschiedlichen Behandlung von Green, Social und Sustainable Bonds kann das SDG-Exposure von den prozentualen Umsätzen der im Portfolio des Fonds enthaltenen Unternehmungen und den der Benchmark, welche im Einklang mit den sich aus den SDGs ergebenden Umweltzielen gemäss Art. 2 (17) SFDR investiert worden sind, abweichen.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Im Berichtszeitraum konzentrierte sich der Vermögensverwalter auf Wertpapiere von Unternehmen, welche Umsätze aus dem Verkauf von Produkten und Dienstleistungen mit einem positiven Beitrag zu den 17 SDGs erzielten und dabei keine DNSH- und/oder Minimum Safeguards-Verletzungen aufgewiesen haben.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Emittenten mit einem negativen Nettobeitrag zu den SDGs wurden in der Berichtsperiode aus dem Anlageuniversum des Finanzproduktes entfernt. Darüber hinaus berücksichtigte der Teilfonds nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (engl: Principal Adverse Impacts - PAI). Zu diesem Zweck wurden die obligatorischen Indikatoren Anhang 1 der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1288 zur Ergänzung der Verordnung (EU) 2019/2088 zugrunde gelegt. Unternehmen, die der Vermögensverwalter gemäss PAI als besonders schädlich einstufte, wurden entsprechend nicht zu den nachhaltigen Anlagen gezählt. Emittenten, welche die PAIs 7 (Biodiversität), 10 (Global Compact der Vereinten Nationen (UNGC)/OECD Leitsätze für multinationale Unternehmen) oder 14 (Engagement in umstrittenen Waffen) verletzen, haben einen PAI-Score von null erhalten. Aus den restlichen PAI-Indikatoren wurde ein PAI-Score berechnet. Instrumente von Emittenten mit einem Score < 10 wurden nicht den nachhaltigen Investitionen angerechnet.

● **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Die nachteiligen Auswirkungen (PAI) sind systematisch im Anlageprozess berücksichtigt worden.

● **Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:**

Bei der Anlageanalyse für nachhaltige Investitionen wurden in der Berichtsperiode die folgenden Normverletzungen berücksichtigt: Global Compact der Vereinten Nationen (UNGC), die UN Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte (UNGP) und das Übereinkommen der Internationalen Arbeitsorganisation (ILO). Jeder schwerwiegende Verstoß gegen diese Normen führte zum Ausschluss des Emittenten aus dem investierbaren Universum des Finanzprodukts.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

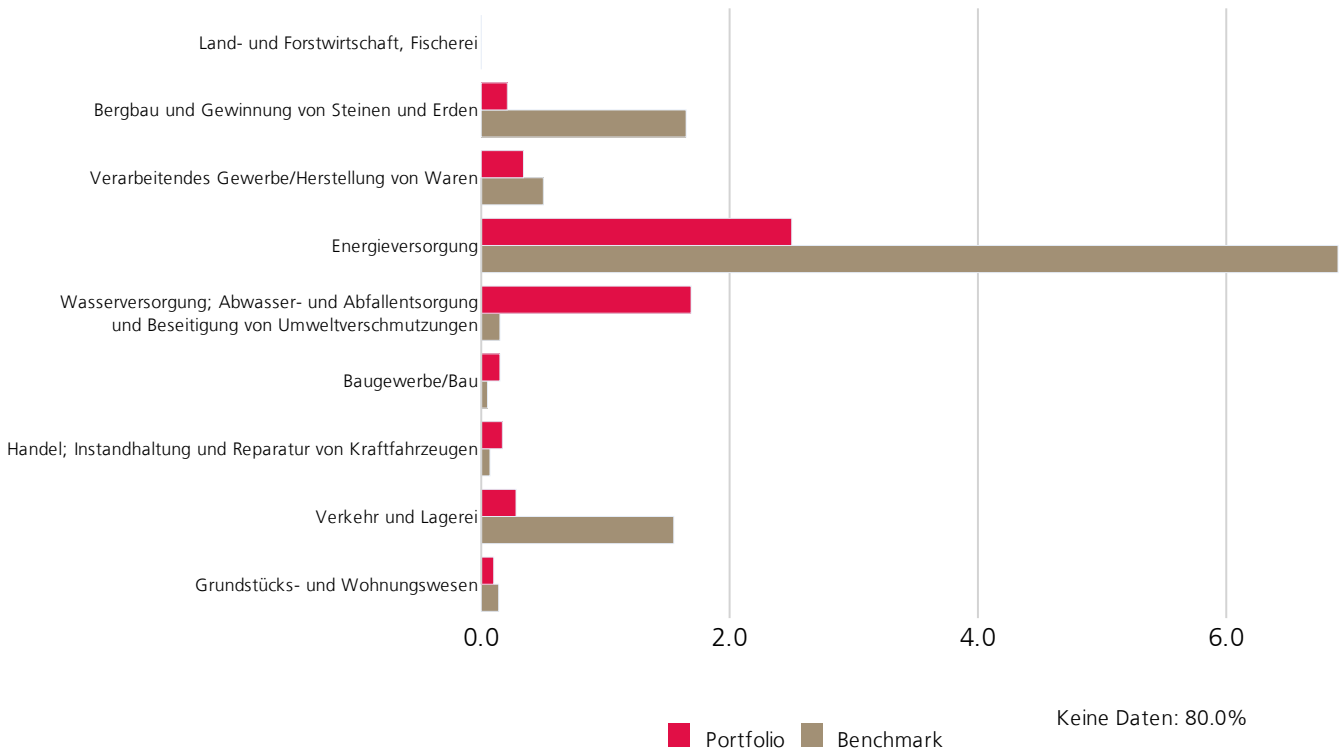
Nachteilige Nachhaltigkeitsauswirkungen (PAI) – Corporate Anlagen

Primäre Indikatoren - Energie und Emissionen

| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Benchmark Aktuell | Benchmark Vorjahr | Erklärung |
|--|--|-------------------|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|-----------|
| 1. THG-Emissionen | 1a. GHG Emissions - Scope 1 per Mio EUR Enterprise Value | 345.24 | 34.81% | 681.86 | 892.86 | 1535.47 | |
| | 1b. GHG Emissions - Scope 2 per Mio EUR Enterprise Value | 83.14 | 34.81% | 170.53 | 138.21 | 188.1 | |
| | 1c. GHG Emissions - Scope 3 per Mio EUR Enterprise Value | 3535.2 | 34.81% | 7912.37 | 5708.43 | 7267.6 | |
| 2. CO ₂ -Fussabdruck | 2. GHG Emissions - Scope 1+2+3 per Mio EUR Enterprise Value | 64.92 | 34.81% | 107.9 | 113.16 | 109.9 | |
| 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird | 3. GHG Emissions - Emissions Intensity - Total Emissions (EUR) | 81.61 | 35.35% | 71.96 | 291.51 | 245.96 | |
| 4. Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind | 4. Fossil Fuel - Involvement (PAI) | 1.83% | 38.71% | 2.44% | 3.09% | 2.53% | |

| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Benchmark Aktuell | Benchmark Vorjahr | Erklärung |
|--|--|-------------------|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|---|
| 5. Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen | 5a. CR Raw - Energy use - Coal/nuclear/undear energy sources | 52.48% | 9.74% | 44.87% | 61.89% | 62.3% | |
| | 5b. Non-renewable energy consumption | 56.94% | 13.37% | 69.92% | 61.8% | 80.97% | Der Verbrauch nicht-erneuerbarer Energie umfasst den Verbrauch von Energie, die aus nicht-erneuerbaren Quellen erzeugt wird, sowie den Verbrauch von Energie aus Biomasse. Alle Zahlen zum Energieverbrauch, bei denen die Energiequelle unklar ist, sind ebenfalls in diesem Faktor enthalten. |
| | 5c. Non-renewable energy production | 0.94% | 37.92% | 1.92% | 3.82% | 3.11% | |
| 6. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren | 6. Energy consumption intensity (GWh/mEUR) | 0.2 | 19.32% | 0.16 | 0.44 | 0.47 | |

Intensität des Energieverbrauchs pro High Impact Sector (pro Mio. EUR)



| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Benchmark Aktuell | Benchmark Vorjahr | Erklärung |
|---|--|-------------------|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|-----------|
| 7. Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken | 7. Companies negatively affecting biodiversity-sensitive areas | 0% | 38.83% | 0% | 0% | 0% | |
| 8. Emissionen in Wasser | 8. CR Raw - COD emissions | 14.26 | 0.32% | 124.75 | 8.52 | 7.71 | |
| 9. Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle | 9. CR Raw - Hazardous waste | 0 | 3.4% | 0 | 0.01 | 0 | |

| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Benchmark Aktuell | Benchmark Vorjahr | Erklärung |
|--|--|-------------------|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|-----------|
| 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | 10. UNGC / OECD Guidelines Violation | 0% | 38.83% | 0% | 3.69% | 4.25% | |
| 11. Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen | 11. Lack of processes monitoring UNGC and OECD Guidelines compliance | 6.17% | 31.2% | 5.63% | 5.96% | 4.82% | |
| 12. Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle | 12. Unadjusted gender pay gap | 0.17% | 3.52% | 0.17% | 0.12% | 0.12% | |
| 13. Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen | 13. Ratio of female to male board members | 54.84% | 22.88% | 59.35% | 52.94% | 53.41% | |
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) | 14. Controversial weapons involvement (APM, CM, Bio, Chem) | 0% | 38.83% | 0% | 0.06% | 0.08% | |

Nachteilige Nachhaltigkeitsauswirkungen (PAI) – Staatliche und Supranationale Vermögenswerte

Primäre Indikatoren

| Umwelt | | | | | | | |
|--------------------|-------------------|-------------------|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|-----------|
| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Benchmark Aktuell | Benchmark Vorjahr | Erklärung |
| 15. GHG Intensität | 15. GHG Intensity | 282.69 | 56.66% | 300.73 | 289.75 | 307.27 | |

| Sozial | | | | | | | |
|--|---|-------------------|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|-----------|
| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Benchmark Aktuell | Benchmark Vorjahr | Erklärung |
| 16. Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen | 16a. Countries subject to social violations (#) | 5.25 | 29.93% | 10.5 | 4.5 | 6 | |
| | 16b. Countries subject to social violations (%) | 12.64% | 29.93% | 20.14% | 9.12% | 12.03% | |

| Indikator | Metrik |
|-----------|---|
| 1a | Scope-1-Treibhausgas-Emissionen |
| 1b | Scope-2-Treibhausgas-Emissionen |
| 1c | Scope-3-Treibhausgas-Emissionen |
| 2. | CO2-Fussabdruck pro Mio EUR |
| 3. | THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird |
| 4. | Anteil der Investitionen in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind |
| 5a | Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung der Unternehmen, in die investiert wird, aus nicht erneuerbaren Energiequellen im Vergleich zu erneuerbaren Energiequellen, ausgedrückt in Prozent der gesamten Energiequellen |
| 5b | Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung der Unternehmen, in die investiert wird, aus nicht erneuerbaren Energiequellen im Vergleich zu erneuerbaren Energiequellen, ausgedrückt in Prozent der gesamten Energiequellen |
| 5c | Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung der Unternehmen, in die investiert wird, aus nicht erneuerbaren Energiequellen im Vergleich zu erneuerbaren Energiequellen, ausgedrückt in Prozent der gesamten Energiequellen |
| 6. | Energieverbrauch in GWh pro einer Million EUR Umsatz der Unternehmen, in die investiert wird, aufgeschlüsselt nach klimaintensiven Sektoren |
| 7. | Anteil der Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird, mit Standorten/Betrieben in oder in der Nähe von Gebieten mit schutzbedürftiger Biodiversität, sofern sich die Tätigkeiten dieser Unternehmen nachteilig auf diese Gebiete auswirken |
| 8. | Tonnen Emissionen in Wasser, die von den Unternehmen, in die investiert wird, pro investierter Million EUR verursacht werden, ausgedrückt als gewichteter Durchschnitt |
| 9. | Tonnen gefährlicher und radioaktiver Abfälle, die von den Unternehmen, in die investiert wird, pro investierter Million EUR erzeugt werden, ausgedrückt als gewichteter Durchschnitt |
| 10. | Anteil der Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird, die an Verstößen gegen die UNGC-Grundsätze oder gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen beteiligt waren |
| 11. | Anteil der Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird, die keine Richtlinien zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen oder keine Verfahren zur Bearbeitung von Beschwerden wegen Verstößen gegen die UNGC-Grundsätze und OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen eingerichtet haben |
| 12. | Durchschnittliches unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle bei den Unternehmen, in die investiert wird |
| 13. | Durchschnittliches Verhältnis von Frauen zu Männern in den Leitungs- und Kontrollorganen der Unternehmen, in die investiert wird, ausgedrückt als Prozentsatz aller Mitglieder der Leitungs- und Kontrollorgane |
| 14. | Anteil der Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird, die an der Herstellung oder am Verkauf von umstrittenen Waffen beteiligt sind |
| 15. | THG-Emissionsintensität der Länder, in die investiert wird |
| 16a | Anzahl der Länder, in die investiert wird, die nach Maßgabe internationaler Verträge und Übereinkommen, der Grundsätze der Vereinten Nationen oder, falls anwendbar, nationaler Rechtsvorschriften gegen soziale Bestimmungen verstoßen (absolute Zahl und relative Zahl, geteilt durch alle Länder, in die investiert wird) |
| 16b | Anzahl der Länder, in die investiert wird, die nach Maßgabe internationaler Verträge und Übereinkommen, der Grundsätze der Vereinten Nationen oder, falls anwendbar, nationaler Rechtsvorschriften gegen soziale Bestimmungen verstoßen (absolute Zahl und relative Zahl, geteilt durch alle Länder, in die investiert wird) |

Das Dokument wurde von Swisscanto mit geschäftsüblicher Sorgfalt erstellt und kann Informationen aus sorgfältig ausgewählten Drittquellen enthalten. Anleger sollten beachten, dass die zuvor für 2023 berechneten und veröffentlichten Daten für dieses in 2024 veröffentlichte Dokument neu berechnet wurden. Dementsprechend kann es zu Abweichungen bei diesen in den Jahren 2023 und 2024 veröffentlichten historischen Daten kommen.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 01.02.2023 - 31.01.2024

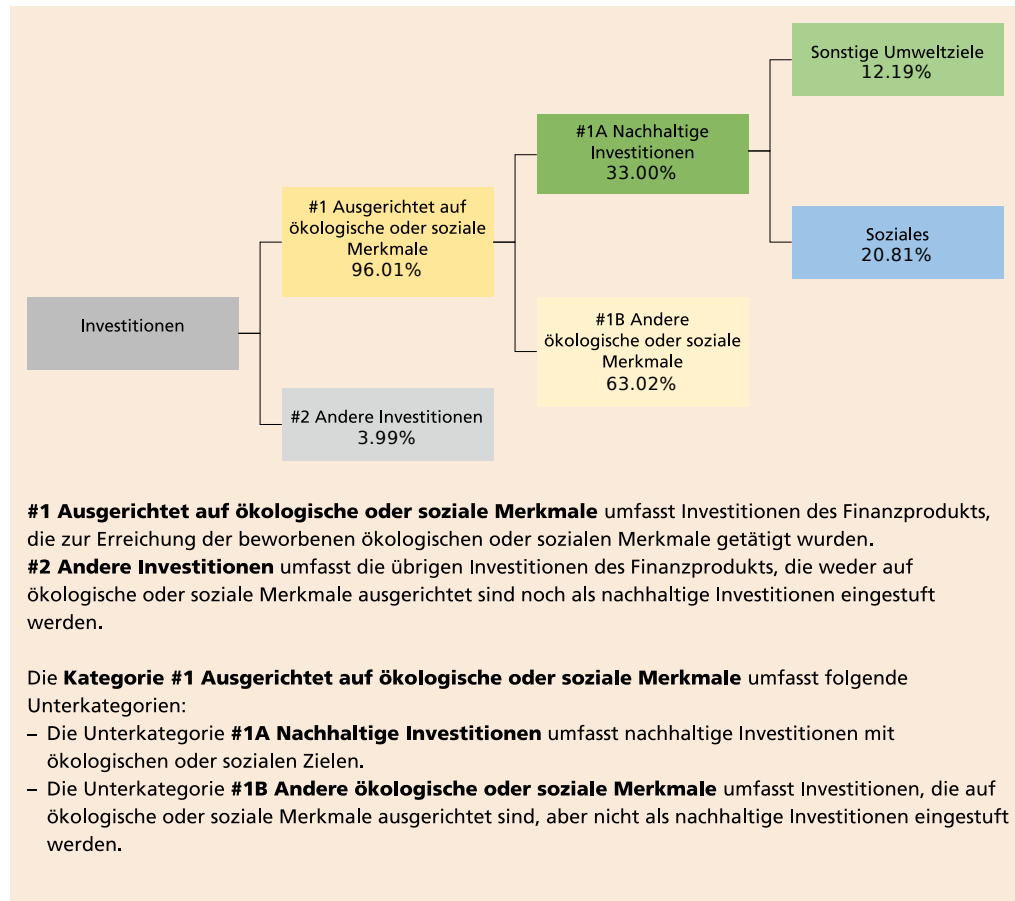
| Grösste Investitionen | Sektor | In % der Vermögenswerte | Land |
|---|--|-------------------------|------|
| Government of the United States of America 2.875% 15-AUG-2028 | Public Administration and Defence, Compulsory Social Security | 6.78% | USA |
| Government of the United States of America 2.375% 15-MAY-2051 | Public Administration and Defence, Compulsory Social Security | 6.18% | USA |
| Government of the United States of America 4.25% 15-MAY-2039 | Public Administration and Defence, Compulsory Social Security | 4.12% | USA |
| Government of the United States of America 3.125% 15-NOV-2041 | Public Administration and Defence, Compulsory Social Security | 2.67% | USA |
| USD Cash | | 2.48% | |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible COCO NT USD Klasse | | 1.83% | |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Sustainable Global High Yield NT USD Klasse | | 1.80% | |
| Government of the United States of America 3.5% 15-FEB-2033 | Public Administration and Defence, Compulsory Social Security | 1.72% | USA |
| Government of the United States of America 1.375% 15-NOV-2031 | Public Administration and Defence, Compulsory Social Security | 1.43% | USA |
| Government of the United States of America 2.75% 31-AUG-2025 | Public Administration and Defence, Compulsory Social Security | 1.30% | USA |
| Government of the United States of America 0.625% 15-OCT-2024 | Public Administration and Defence, Compulsory Social Security | 1.27% | USA |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Rates NT USD Klasse | | 1.19% | |
| Government of the United States of America 1.875% 31-AUG-2024 | Public Administration and Defence, Compulsory Social Security | 1.07% | USA |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Convertible NT Klasse | | 0.98% | |
| International Bank for Reconstruction & Development 2.125% 03-MAR-2025 | Financial and Insurance Activities | 0.96% | |



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Der Anteil an nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen und Angaben zur Vermögensallokation werden in untenstehender Frage beantwortet.

Wie sah die Vermögensallokation aus?



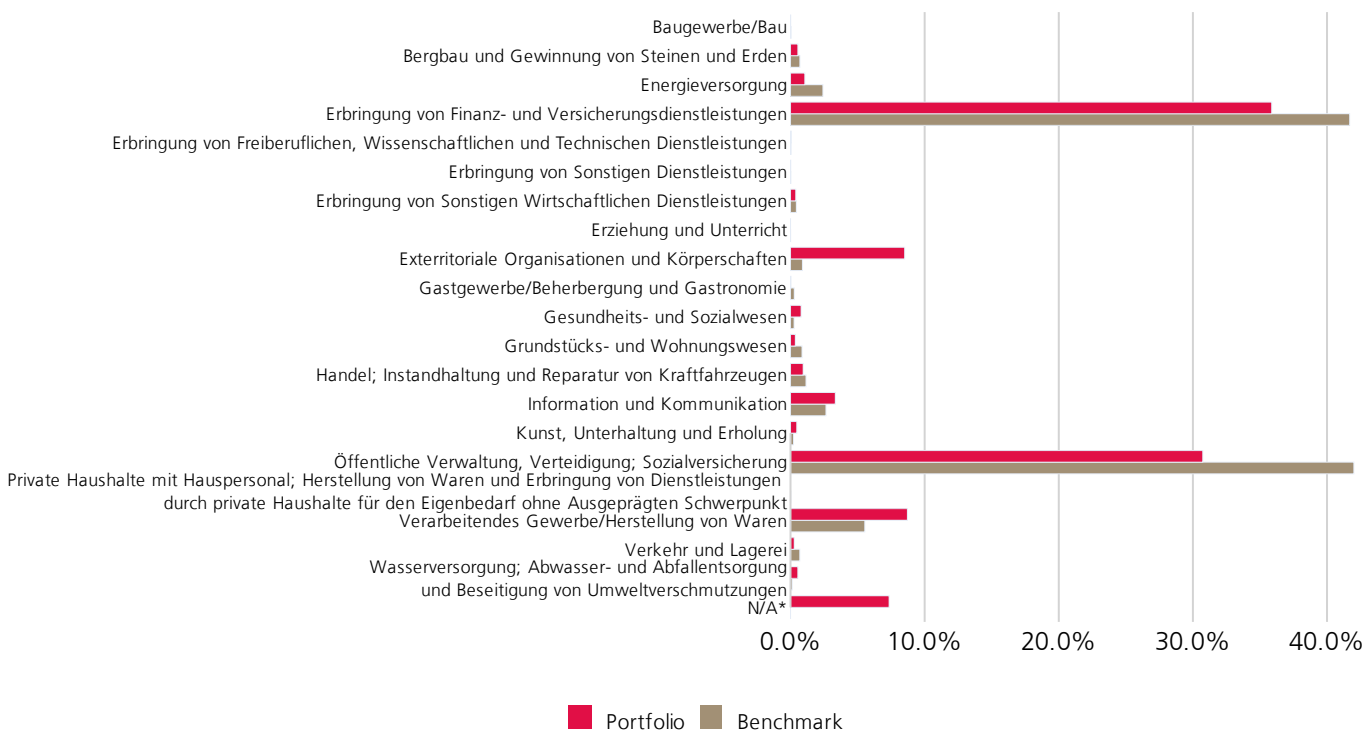
#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.
#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die **Kategorie #1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst nachhaltige Investitionen mit ökologischen oder sozialen Zielen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Wegen mangelnder Datenverfügbarkeit können Subsektoren nicht angezeigt werden.



*Diese Klassifizierung umfasst alle Bestände, für die keine NACE-Klassifizierung gefunden oder geschätzt werden kann; Liquidität ist darin enthalten.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Obwohl keine Investitionen getätigt wurden, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind, wird in untenstehender Grafik die Alignment der nachhaltigen Investitionen mit der EU-Taxonomie offengelegt.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomeikonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert¹?

Ja

In fossiles Gas

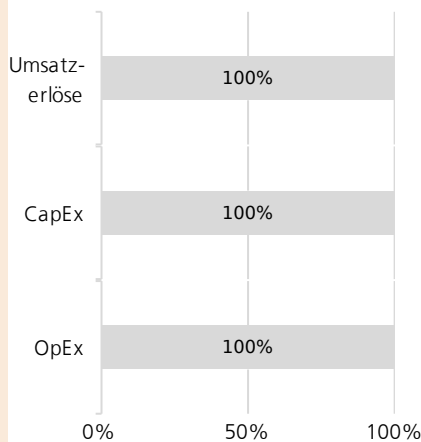
In Kernenergie

Nein

¹Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomeikonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels ("Klimaschutz") beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomeikonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

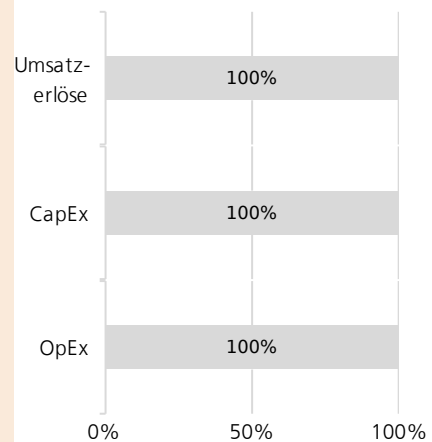
Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomeikonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzproduktes einschliesslich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzproduktes zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.

1. Taxonomiekonformität der Investitionen einschliesslich Staatsanleihen*



- Taxonomiekonform: Fossiles Gas
- Taxonomiekonform: Kernenergie
- Taxonomiekonform: (ohne fossiles Gas und Kernenergie)
- Nicht taxonomiekonform

2. Taxonomiekonformität der Investitionen ohne Staatsanleihen*



- Taxonomiekonform: Fossiles Gas
- Taxonomiekonform: Kernenergie
- Taxonomiekonform: (ohne fossiles Gas und Kernenergie)
- Nicht taxonomiekonform

Diese Grafik gibt **39.0%** der Gesamtinvestitionen wieder.

*Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff "Staatsanleihen" alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Mit Blick auf die EU-Taxonomeikonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf erneuerbare Energie oder CO2-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO2-armen Alternativen gibt und die Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomeikonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:
- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

Investitionsausgaben (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, z.B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft
- **Betriebsausgaben** (Opex), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Angaben zu Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten werden in der Tabelle zusammengefasst. Wenn keine Angaben verfügbar sind, wird die Tabelle ebenfalls keine Angaben enthalten.

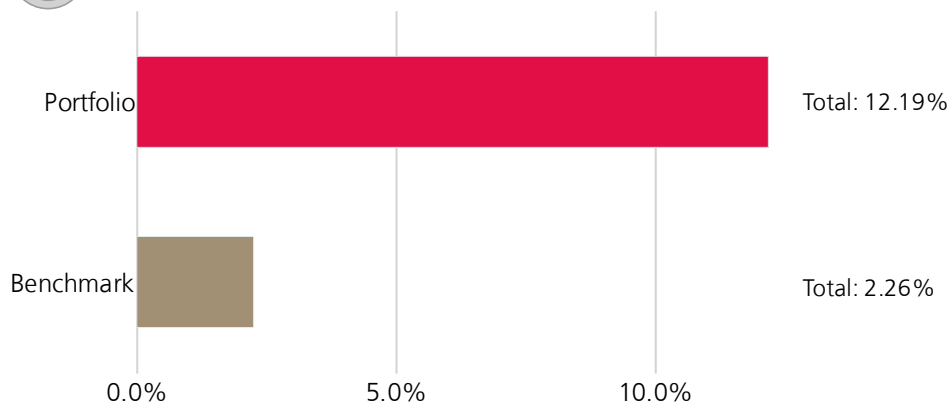
| Issuer Name | Nace Sektor | Total Eligible Activity Revenue | Total Aligned Revenue | Total Likely Aligned Revenue | Total Potentially Aligned Revenue | Portfolio Gewicht (Consol.) |
|-----------------------------|---|---------------------------------|-----------------------|------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------|
| Orsted | Electricity, Gas, Steam and Air Conditioning Supply | 56.27% | 18.25% | 31.86% | 0.00% | 0.01% |
| EDP Finance BV | Electricity, Gas, Steam and Air Conditioning Supply | 77.52% | 12.25% | 0.00% | 32.43% | 0.89% |
| EDP-Energias de Portugal SA | Electricity, Gas, Steam and Air Conditioning Supply | 77.52% | 12.25% | 0.00% | 32.43% | 0.01% |
| SPIE SA | Professional, Scientific and Technical Activities | 83.99% | 11.50% | 13.95% | 0.00% | 0.01% |
| Electricite de France SA | Electricity, Gas, Steam and Air Conditioning Supply | 71.56% | 9.50% | 0.00% | 7.23% | 0.00% |
| Iberdrola International BV | Electricity, Gas, Steam and Air Conditioning Supply | 61.60% | 9.13% | 0.00% | 15.60% | 0.01% |
| Iberdrola Finanzas SA | Electricity, Gas, Steam and Air Conditioning Supply | 61.60% | 9.13% | 0.00% | 15.60% | 0.01% |
| Veolia Environnement SA | Water Supply, Sewerage, Waste Management and Remediation Activities | 68.52% | 8.28% | 30.01% | 0.00% | 0.01% |
| Pirelli & C. S.p.A. | Manufacturing | 15.75% | 6.25% | 0.00% | 0.00% | 0.00% |
| Enel SpA | Electricity, Gas, Steam and Air Conditioning Supply | 33.21% | 5.35% | 0.00% | 8.48% | 0.01% |

Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?


Da im vorangegangenen Berichtsjahr keine Daten verfügbar waren, erübrigt sich ein Vorjahresvergleich.

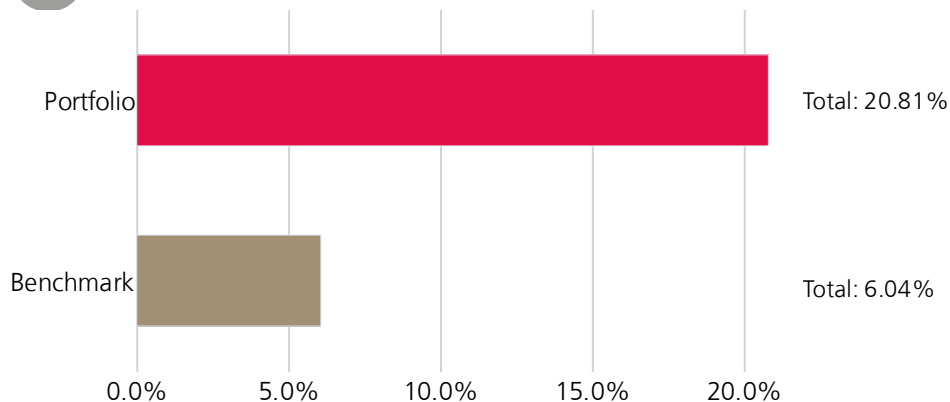
 sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.

 **Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**




Das Diagramm zeigt die prozentualen Umsätze der im Portfolio des Fonds enthaltenen Unternehmungen und der der Benchmark, welche nicht EU-Taxonomie konform, jedoch im Einklang mit den sich aus den SDGs ergebenden Umweltzielen gemäss Art. 2 (17) SFDR investiert worden sind.

 **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**



Das Diagramm zeigt die prozentualen Umsätze der im Portfolio des Fonds enthaltenen Unternehmungen und der der Benchmark, welche nicht EU-Taxonomie konform, jedoch im Einklang mit den sich aus den SDGs ergebenden sozialen Zielen gemäss Art. 2 (17) SFDR investiert worden sind.

 **Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

Diese Vermögenswerte haben die in der spezifischen Anlagepolitik vorgesehenen Anlagen umfasst, einschliesslich Derivate zu Absicherungszwecken und flüssige Mittel. Die Anlagen, ausgenommen Derivate und flüssige Mittel, haben die Grundsätze des ökologischen oder sozialen Mindestschutzes umgesetzt.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Im Berichtszeitraum förderte der Vermögensverwalter durch Investment Stewardship und Kapitalallokation nachhaltige Geschäftspraktiken und die Einhaltung anerkannter internationaler Prinzipien und ESG-Best-Practice-Standards. Dementsprechend stand er im Dialog mit den Managementteams der investierten Unternehmen. Darüber hinaus hat er sich im Rahmen der United Nations Collaboration Platform for Responsible Investment (UN PRI) und bei Investoreninitiativen engagiert. Das Abstimmungsverhalten basierte auf den schweizerischen und internationalen Corporate-Governance-Regeln sowie auf den Prinzipien des UN Global Compact und den 17 Zielen für nachhaltige Entwicklung (UN SDGs). Weitere Informationen finden Sie unter: Swisssanto | Proxy Voting Dashboard (issgovernance.com) <https://www.swisssanto.com/int/de/nachhaltigkeit/investment-stewardship.html>

Swisssanto | Proxy Voting Dashboard (issgovernance.com)

<https://www.swisssanto.com/int/de/nachhaltigkeit/investment-stewardship.html>



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Es wurde kein Index als Referenzwert bestimmt, um festzustellen, ob dieses Finanzprodukt auf die beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet ist.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?

Nicht anwendbar.

Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?

Nicht anwendbar.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?

Nicht anwendbar.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?

Nicht anwendbar.

Das Dokument wurde von Swisssanto mit geschäftsüblicher Sorgfalt erstellt und kann Informationen aus sorgfältig ausgewählten Drittquellen enthalten. Anleger sollten beachten, dass die zuvor für 2023 berechneten und veröffentlichten Daten für dieses in 2024 veröffentlichte Dokument neu berechnet wurden. Dementsprechend kann es zu Abweichungen bei diesen in den Jahren 2023 und 2024 veröffentlichten historischen Daten kommen.



Regelmässige Information zum 31.01.2024

Regelmässige Informationen zu den in Artikel 8, Absätze 1, 2, 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts:

Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible COCO

Unternehmenskennung (LEI-Code):

5493000GXMB1PV730R63

Benchmark

ICE BofA Contingent Capital Index Hedged in USD

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. In dieser Verordnung ist kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten festgelegt. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

| Ja | | Nein | |
|--------------------------|---|-------------------------------------|---|
| <input type="checkbox"/> | Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: _ % | <input checked="" type="checkbox"/> | Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 19.92% an nachhaltigen Investitionen |
| <input type="checkbox"/> | in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind | <input type="checkbox"/> | mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind |
| <input type="checkbox"/> | in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind | <input checked="" type="checkbox"/> | mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind |
| <input type="checkbox"/> | Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: _ % | <input checked="" type="checkbox"/> | mit einem sozialen Ziel |
| <input type="checkbox"/> | | <input type="checkbox"/> | Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt . |



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die von dem Teilfonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale wurden durch folgende Aktivitäten erreicht:

1. Ausschlusskriterien
2. ESG-Integration
3. Reduktion der CO₂e-Intensität
4. Nachhaltige Investitionen





Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Aus Übersichtsgründen werden die Angaben zur Performance (siehe Details am Ende des Reports) der Nachhaltigkeitsindikatoren direkt mit dem historischen Vergleich in der nächsten Frage beantwortet.

...und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Ausschlusskriterien

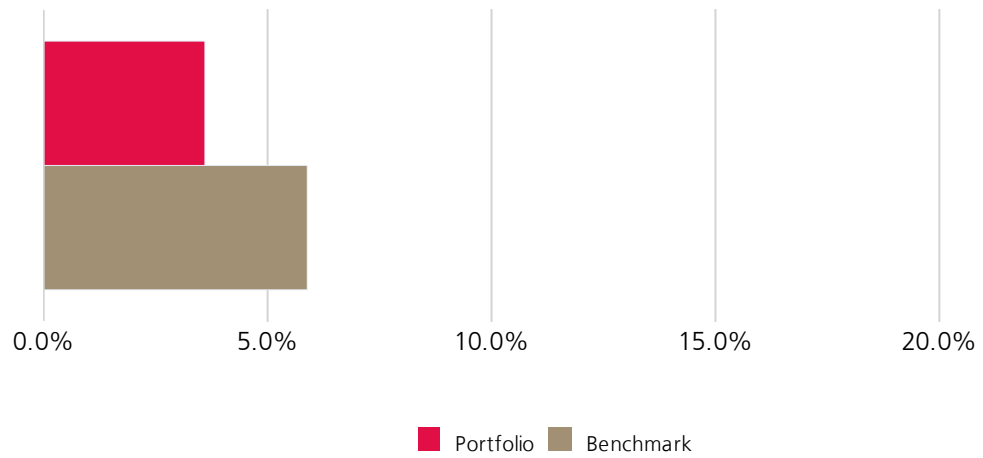
| Responsible | | | | | | | |
|--|-------------------|--|------------------------------|--|-------------------|-------------------|------------------------------|
| Kriterien | Gewicht Portfolio | Gewicht Benchmark | Anzahl Unternehmen Benchmark | Kriterien | Gewicht Portfolio | Gewicht Benchmark | Anzahl Unternehmen Benchmark |
|  Förderung von Kohle (> 5% Umsatz) | 0.00% | 0.00% | 0 |  Ausbeuterische Kinderarbeit | 0.00% | 0.00% | 0 |
| Kohlereserven (ex. Metalproduktion) | 0.00% | 0.00% | 0 | Herstellung von Kriegstechnik (> 5% Umsatz) | 0.00% | 0.00% | 0 |
|  Klimawandel | |  Gefährdung von Gesellschaft und Gesundheit | | Herstellung von Pornografie | 0.00% | 0.00% | 0 |
| | | | | Herstellung von Waffen & Munition | 0.00% | 0.00% | 0 |
| | | | | Kontroverse Waffen | 0.00% | 0.00% | 0 |
| | | | | UN Global Compact Verstöße | 0.00% | 0.00% | 0 |

Zwecks Minderung der Nachhaltigkeitsrisiken und mit dem Ziel, nicht in Wertpapiere der oben aufgeführten kontroversen Geschäftsmodellen zu investieren, sind die oben genannten Ausschlusskriterien angewendet worden. Die Tabelle zeigt die Anzahl der Unternehmen, die gegen die Ausschlusskriterien verstossen haben, sowie die jeweilige Portfolio- und Benchmark-Exposition. Liegen bei einem Unternehmen mehrere Verstöße vor, werden diese für jedes Kriterium separat aufgeführt. Daher ist die Summe aller Positionen in diesem Bericht in der Regel höher als die effektive Allokation zu den oben abgebildeten Kriterien. Die historischen Vergleiche werden in nachfolgender Tabelle gemacht. Aus Übersichtsgründen werden die Ausschlusskriterien aggregiert.

| | Indikator | Datum 2023 | Datum 2024 |
|-----------|----------------------------|------------|------------|
| Portfolio | Ausschlusskriterien Total* | 0% | 0% |
| Benchmark | Ausschlusskriterien Total* | 0% | 0% |

*alle Ausschlusskriterien kumuliert.

ESG-Integration

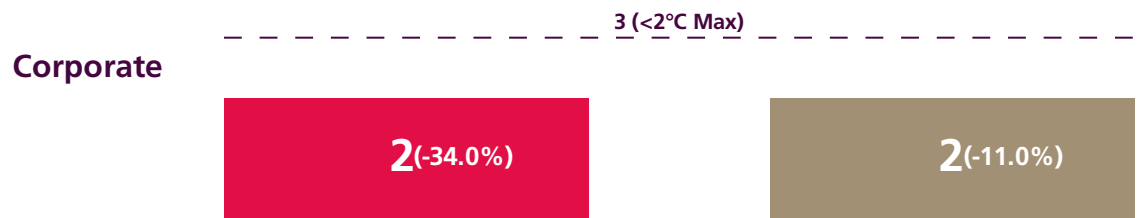


Das Portfolio strebte in der Berichtsperiode im Vergleich zur Benchmark eine geringere Exposition zu ESG-Laggards an. ESG-Laggards sind Unternehmungen mit der schwächsten Umwelt-, Sozial und Governance- Performance des relevanten Anlageuniversums.

Die historischen Vergleiche werden in nachfolgender Tabelle gemacht.

| | Indikator | Datum 2023 | Datum 2024 |
|-----------|----------------------------|------------|------------|
| Portfolio | Exposition zu ESG Laggards | 2.83% | 3.6% |
| Benchmark | Exposition zu ESG Laggards | 9.9% | 5.89% |

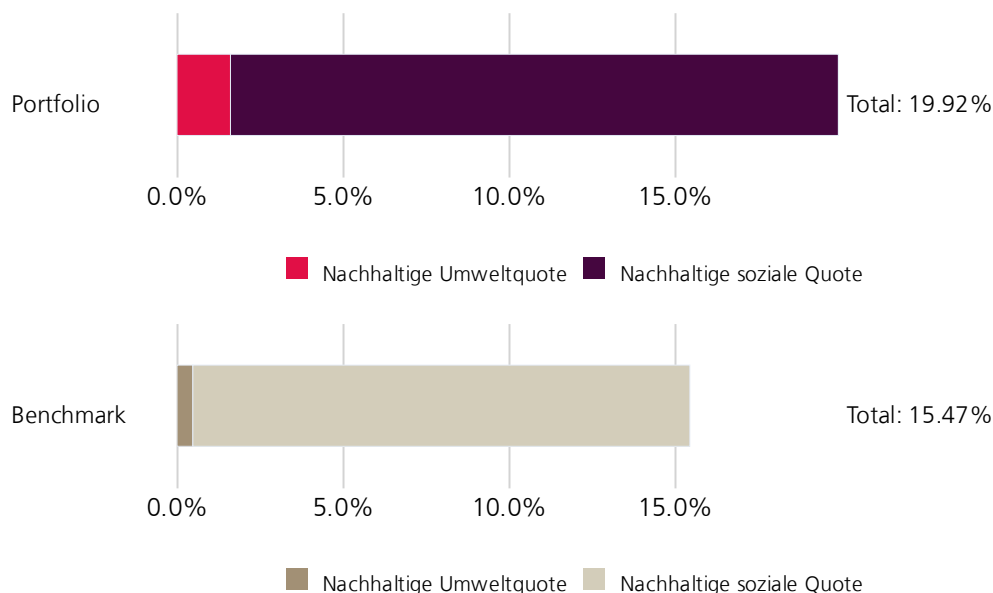
Reduktion der CO₂e-Intensität



Im Einklang mit dem < 2° Pariser Klimaziel ("<2°C Max") zielt die Investitionstätigkeit des Fonds während der Berichtsperiode darauf ab, die CO₂e-Emissionen des Portfolios, um mindestens 4 % pro Jahr zu reduzieren. Der Absenkpfad berechnet sich aus den gewichteten CO₂e-Intensitäten der Benchmark, diskontiert mit 4 % pro Jahr zuzüglich des realen Wirtschaftswachstums. Die gestrichelten 2° Max-Linie zeigt den Maximalwert an. Die Balken stellen die CO₂e-Intensitäten des Portfolios und der Benchmark dar. CO₂e-Intensitäten unterhalb der 2° Max-Linie zeigen an, dass das Portfolio oder die Benchmark das <2°-Klimaziel erfüllen. Werte bei "Erreichung Klimaziel" setzen das Portfolio und die Benchmark in Relation zum Klimaziel. Negative Werte bedeuten, dass das Ziel erreicht wurde. Die historischen Vergleiche werden in nachfolgender Tabelle gemacht.


















| | Indikator | Datum 2023 | Datum 2024 |
|-----------|--|------------|------------|
| Portfolio | CO ₂ e-Intensität Corporate | 2 | 2 |
| | Reduktion Corporate | -14% | -34% |
| Benchmark | CO ₂ e-Intensität Corporate | 3 | 2 |
| | Reduktion Corporate | 2% | -11% |

Nachhaltige Investitionen



Das Diagramm zeigt die prozentualen Umsätze der im Portfolio des Fonds enthaltenen Unternehmungen und der der Benchmark, welche nicht EU-Taxonomie konform, jedoch im Einklang mit den sich aus den den UN Sustainable Development Goals (SDGs) ergebenden Umwelt- und sozialen Zielen gemäss Art. 2 (17) SFDR investiert worden sind. Der Fonds hat keine Investitionen in ökologisch nachhaltige Aktivitäten im Sinne der EU Taxonomie-Verordnung angestrebt. Der Investmentmanager des (Teil-)Fonds hat eine Methodologie zur Definition nachhaltiger Investitionen entwickelt, die den Anforderungen des Art. 2 (17) SFDR entspricht. Die Methodologie ist detailliert in den Vorvertraglichen Informationen beschrieben. Die Aufteilung der nachhaltigen Investitionen in UN SDGs werden in folgender Grafik gemacht. Die historischen Vergleiche werden in nachfolgender Tabelle gemacht.

| | Indikator | Datum 2023 | Datum 2024 |
|-----------|---|------------|------------|
| Portfolio | Anteil nachhaltige Investitionen mit Umweltziel | 0.71% | 1.62% |
| | Anteil sozial nachhaltige Investitionen | 16.84% | 18.3% |
| | Total nachhaltige Quote | 17.55% | 19.92% |
| Benchmark | Anteil nachhaltige Investitionen mit Umweltziel | 0.9% | 0.48% |
| | Anteil sozial nachhaltige Investitionen | 13.94% | 14.98% |
| | Total nachhaltige Quote | 14.84% | 15.47% |

| | | | | | |
|---|----------------|---|-----------------|---|------------------|
| 1  Keine Armut | 2.91% 3.22% | 7  Bezahlbare und saubere Energie | 1.04% 0.30% | 13  Massnahmen zum Klimaschutz | 0.00% 0.00% |
| 2  Kein Hunger | 0.00% 0.00% | 8  Menschenwürdige Arbeit und Wirtschaftswachstum | 12.31% 8.39% | 14  Leben unter Wasser | 0.00% 0.00% |
| 3  Gesundheit und Wohlergehen | 0.15% 0.14% | 9  Industrie, Innovation und Infrastruktur | 1.07% 1.14% | 15  Leben an Land | 0.00% 0.00% |
| 4  Hochwertige Bildung | 0.00% 0.00% | 10  Weniger Ungleichheiten | 0.00% 0.00% | 16  Frieden, Gerechtigkeit und starke Institutionen | 0.00% 0.00% |
| 5  Geschlechtergleichheit | 0.00% 0.00% | 11  Nachhaltige Städte und Gemeinden | 0.57% 0.18% | 17  Partnerschaften zur Erreichung der Ziele | 1.83% 2.08% |
| 6  Sauberes Wasser und Sanitäreinrichtungen | 0.00% 0.00% | 12  Nachhaltige/r Konsum und Produktion | 0.00% 0.00% | Total | 19.87% 15.45% |

■ Portfolio ■ Benchmark

Aufgrund der unterschiedlichen Behandlung von Green, Social und Sustainable Bonds kann das SDG-Exposure von den prozentualen Umsätzen der im Portfolio des Fonds enthaltenen Unternehmungen und den der Benchmark, welche im Einklang mit den sich aus den SDGs ergebenden Umweltzielen gemäss Art. 2 (17) SFDR investiert worden sind, abweichen.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Im Berichtszeitraum konzentrierte sich der Vermögensverwalter auf Wertpapiere von Unternehmen, welche Umsätze aus dem Verkauf von Produkten und Dienstleistungen mit einem positiven Beitrag zu den 17 SDGs erzielten und dabei keine DNSH- und/oder Minimum Safeguards-Verletzungen aufgewiesen haben.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Emittenten mit einem negativen Nettobeitrag zu den SDGs wurden in der Berichtsperiode aus dem Anlageuniversum des Finanzproduktes entfernt. Darüber hinaus berücksichtigte der Teilfonds nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (engl: Principal Adverse Impacts - PAI). Zu diesem Zweck wurden die obligatorischen Indikatoren Anhang 1 der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1288 zur Ergänzung der Verordnung (EU) 2019/2088 zugrunde gelegt. Unternehmen, die der Vermögensverwalter gemäss PAI als besonders schädlich einstufte, wurden entsprechend nicht zu den nachhaltigen Anlagen gezählt. Emittenten, welche die PAIs 7 (Biodiversität), 10 (Global Compact der Vereinten Nationen (UNGC)/OECD Leitsätze für multinationale Unternehmen) oder 14 (Engagement in umstrittenen Waffen) verletzen, haben einen PAI-Score von null erhalten. Aus den restlichen PAI-Indikatoren wurde ein PAI-Score berechnet. Instrumente von Emittenten mit einem Score < 10 wurden nicht den nachhaltigen Investitionen angerechnet.

● **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Die nachteiligen Auswirkungen (PAI) sind systematisch im Anlageprozess berücksichtigt worden.

● **Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:**

Bei der Anlageanalyse für nachhaltige Investitionen wurden in der Berichtsperiode die folgenden Normverletzungen berücksichtigt: Global Compact der Vereinten Nationen (UNGC), die UN Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte (UNGP) und das Übereinkommen der Internationalen Arbeitsorganisation (ILO). Jeder schwerwiegende Verstoß gegen diese Normen führte zum Ausschluss des Emittenten aus dem investierbaren Universum des Finanzprodukts.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

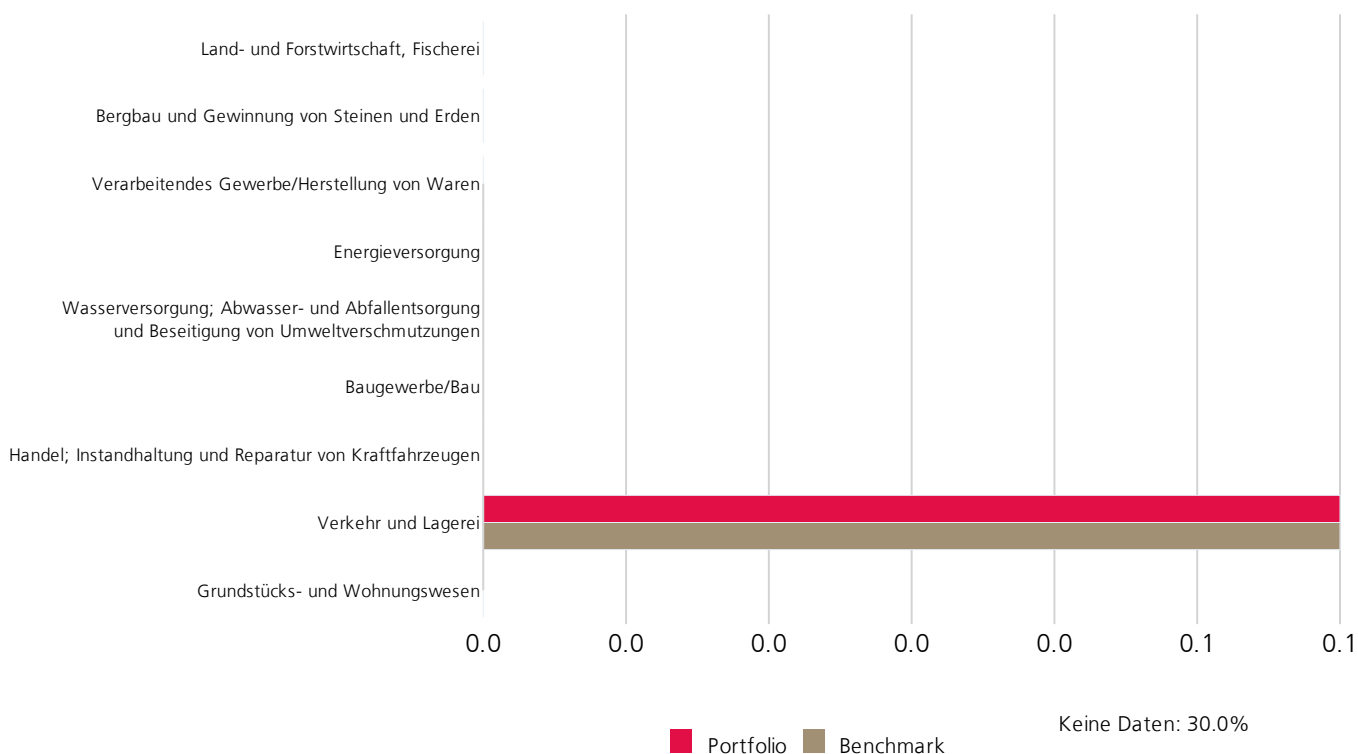
Nachteilige Nachhaltigkeitsauswirkungen (PAI) – Corporate Anlagen

Primäre Indikatoren - Energie und Emissionen

| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Benchmark Aktuell | Benchmark Vorjahr | Erklärung |
|--|--|-------------------|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|-----------|
| 1. THG-Emissionen | 1a. GHG Emissions - Scope 1 per Mio EUR Enterprise Value | 285.63 | 83.33% | 67.42 | 356.79 | 170.13 | |
| | 1b. GHG Emissions - Scope 2 per Mio EUR Enterprise Value | 114.27 | 83.33% | 115.06 | 202.14 | 161.04 | |
| | 1c. GHG Emissions - Scope 3 per Mio EUR Enterprise Value | 33746.8 | 83.33% | 22816.8 | 30712.3 | 20729.5 | |
| 2. CO ₂ -Fussabdruck | 2. GHG Emissions - Scope 1+2+3 per Mio EUR Enterprise Value | 81.55 | 83.33% | 53.87 | 74.69 | 49.33 | |
| 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird | 3. GHG Emissions - Emissions Intensity - Total Emissions (EUR) | 3.21 | 87.32% | 1.91 | 4.12 | 2.75 | |
| 4. Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind | 4. Fossil Fuel - Involvement (PAI) | 0% | 84.2% | 0% | 0% | 0% | |

| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Benchmark Aktuell | Benchmark Vorjahr | Erklärung |
|--|--|-------------------|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|---|
| 5. Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen | 5a. CR Raw - Energy use - Coal/nuclear/undear energy sources | 0% | 0% | 0% | 52.8% | 67.6% | |
| | 5b. Non-renewable energy consumption | 0.09% | 15.51% | 0% | 56.19% | 18.7% | Der Verbrauch nicht-erneuerbarer Energie umfasst den Verbrauch von Energie, die aus nicht-erneuerbaren Quellen erzeugt wird, sowie den Verbrauch von Energie aus Biomasse. Alle Zahlen zum Energieverbrauch, bei denen die Energiequelle unklar ist, sind ebenfalls in diesem Faktor enthalten. |
| | 5c. Non-renewable energy production | 0% | 84.2% | 0% | 0% | 0% | |
| 6. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren | 6. Energy consumption intensity (GWh/mEUR) | 0.02 | 63.38% | 0.01 | 0.02 | 0.01 | |

Intensität des Energieverbrauchs pro High Impact Sector (pro Mio. EUR)



| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Benchmark Aktuell | Benchmark Vorjahr | Erklärung |
|---|--|-------------------|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|-----------|
| 7. Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken | 7. Companies negatively affecting biodiversity-sensitive areas | 0% | 84.58% | 0% | 0% | 0% | |
| 8. Emissionen in Wasser | 8. CR Raw - COD emissions | 0 | 0% | 0 | 0 | 0 | |
| 9. Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle | 9. CR Raw - Hazardous waste | 0 | 5.89% | 0 | 0 | 0 | |

| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Benchmark Aktuell | Benchmark Vorjahr | Erklärung |
|--|--|-------------------|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|-----------|
| 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | 10. UNGC / OECD Guidelines Violation | 0% | 84.58% | 0% | 0% | 0% | |
| 11. Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen | 11. Lack of processes monitoring UNGC and OECD Guidelines compliance | 0.61% | 74.87% | 0.07% | 3.61% | 2.37% | |
| 12. Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle | 12. Unadjusted gender pay gap | 1.88% | 11.35% | 0.81% | 1.71% | 1.01% | |
| 13. Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen | 13. Ratio of female to male board members | 71.11% | 75.7% | 52.7% | 70.8% | 53.04% | |
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) | 14. Controversial weapons involvement (APM, CM, Bio, Chem) | 0% | 84.58% | 0% | 0% | 0% | |

Nachteilige Nachhaltigkeitsauswirkungen (PAI) – Staatliche und Supranationale Vermögenswerte

Primäre Indikatoren

| Umwelt | | | | | | | Erklärung |
|--------------------|-------------------|-------------------|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|-----------|
| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Benchmark Aktuell | Benchmark Vorjahr | |
| 15. GHG Intensität | 15. GHG Intensity | 129.5 | 0.25% | 47.6 | 137.71 | 44.95 | |

| Sozial | | | | | | | Erklärung |
|--|---|-------------------|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|-----------|
| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Benchmark Aktuell | Benchmark Vorjahr | |
| 16. Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen | 16a. Countries subject to social violations (#) | 0 | 0% | 0 | 0 | 0 | |
| | 16b. Countries subject to social violations (%) | 0% | 0% | 0% | 0% | 0% | |

| Indikator | Metrik |
|-----------|---|
| 1a | Scope-1-Treibhausgas-Emissionen |
| 1b | Scope-2-Treibhausgas-Emissionen |
| 1c | Scope-3-Treibhausgas-Emissionen |
| 2. | CO2-Fussabdruck pro Mio EUR |
| 3. | THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird |
| 4. | Anteil der Investitionen in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind |
| 5a | Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung der Unternehmen, in die investiert wird, aus nicht erneuerbaren Energiequellen im Vergleich zu erneuerbaren Energiequellen, ausgedrückt in Prozent der gesamten Energiequellen |
| 5b | Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung der Unternehmen, in die investiert wird, aus nicht erneuerbaren Energiequellen im Vergleich zu erneuerbaren Energiequellen, ausgedrückt in Prozent der gesamten Energiequellen |
| 5c | Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung der Unternehmen, in die investiert wird, aus nicht erneuerbaren Energiequellen im Vergleich zu erneuerbaren Energiequellen, ausgedrückt in Prozent der gesamten Energiequellen |
| 6. | Energieverbrauch in GWh pro einer Million EUR Umsatz der Unternehmen, in die investiert wird, aufgeschlüsselt nach klimaintensiven Sektoren |
| 7. | Anteil der Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird, mit Standorten/Betrieben in oder in der Nähe von Gebieten mit schutzbedürftiger Biodiversität, sofern sich die Tätigkeiten dieser Unternehmen nachteilig auf diese Gebiete auswirken |
| 8. | Tonnen Emissionen in Wasser, die von den Unternehmen, in die investiert wird, pro investierter Million EUR verursacht werden, ausgedrückt als gewichteter Durchschnitt |
| 9. | Tonnen gefährlicher und radioaktiver Abfälle, die von den Unternehmen, in die investiert wird, pro investierter Million EUR erzeugt werden, ausgedrückt als gewichteter Durchschnitt |
| 10. | Anteil der Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird, die an Verstößen gegen die UNGC-Grundsätze oder gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen beteiligt waren |
| 11. | Anteil der Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird, die keine Richtlinien zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen oder keine Verfahren zur Bearbeitung von Beschwerden wegen Verstößen gegen die UNGC-Grundsätze und OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen eingerichtet haben |
| 12. | Durchschnittliches unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle bei den Unternehmen, in die investiert wird |
| 13. | Durchschnittliches Verhältnis von Frauen zu Männern in den Leitungs- und Kontrollorganen der Unternehmen, in die investiert wird, ausgedrückt als Prozentsatz aller Mitglieder der Leitungs- und Kontrollorgane |
| 14. | Anteil der Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird, die an der Herstellung oder am Verkauf von umstrittenen Waffen beteiligt sind |
| 15. | THG-Emissionsintensität der Länder, in die investiert wird |
| 16a | Anzahl der Länder, in die investiert wird, die nach Maßgabe internationaler Verträge und Übereinkommen, der Grundsätze der Vereinten Nationen oder, falls anwendbar, nationaler Rechtsvorschriften gegen soziale Bestimmungen verstoßen (absolute Zahl und relative Zahl, geteilt durch alle Länder, in die investiert wird) |
| 16b | Anzahl der Länder, in die investiert wird, die nach Maßgabe internationaler Verträge und Übereinkommen, der Grundsätze der Vereinten Nationen oder, falls anwendbar, nationaler Rechtsvorschriften gegen soziale Bestimmungen verstoßen (absolute Zahl und relative Zahl, geteilt durch alle Länder, in die investiert wird) |

Das Dokument wurde von Swisscanto mit geschäftsüblicher Sorgfalt erstellt und kann Informationen aus sorgfältig ausgewählten Drittquellen enthalten. Anleger sollten beachten, dass die zuvor für 2023 berechneten und veröffentlichten Daten für dieses in 2024 veröffentlichte Dokument neu berechnet wurden. Dementsprechend kann es zu Abweichungen bei diesen in den Jahren 2023 und 2024 veröffentlichten historischen Daten kommen.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts entfiel:
01.02.2023 - 31.01.2024

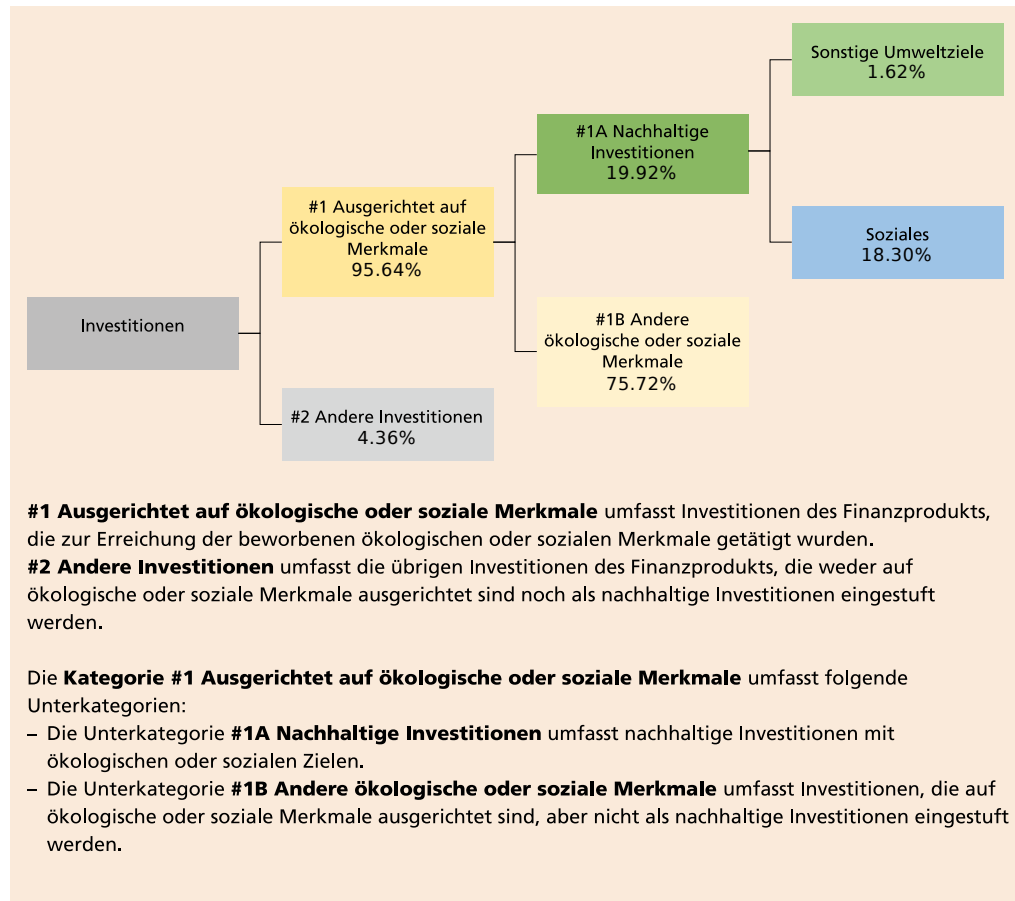
| Grösste Investitionen | Sektor | In % der Vermögenswerte | Land |
|--|------------------------------------|-------------------------|----------------|
| USD Cash | | 0.90% | |
| Allianz SE 3.5% PERP REGS | Financial and Insurance Activities | 0.81% | Germany |
| Commerzbank AG 6.125% PERP REGS | Financial and Insurance Activities | 0.56% | Germany |
| Intesa Sanpaolo SpA 7.75% PERP REGS | Financial and Insurance Activities | 0.56% | Italy |
| NatWest Group PLC 6% PERP | Financial and Insurance Activities | 0.45% | United Kingdom |
| Australia & New Zealand Banking Group Ltd/United Kingdom 6.75% PERP REGS | Financial and Insurance Activities | 0.43% | |
| Lloyds Banking Group PLC 8.5% PERP | Financial and Insurance Activities | 0.43% | United Kingdom |
| Barclays PLC 8.875% PERP REGS | Financial and Insurance Activities | 0.42% | United Kingdom |
| Banco Santander SA 7.5% PERP REGS | Financial and Insurance Activities | 0.42% | Spain |
| Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 8.375% PERP REGS | Financial and Insurance Activities | 0.41% | Spain |
| Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 6% PERP REGS | Financial and Insurance Activities | 0.40% | Spain |
| UBS Group AG 6.875% PERP REGS | Financial and Insurance Activities | 0.38% | Switzerland |
| Legal & General Group PLC 5.625% PERP REGS | Financial and Insurance Activities | 0.36% | United Kingdom |
| Nationwide Building Society 5.875% PERP REGS | Financial and Insurance Activities | 0.36% | |
| UniCredit SpA 7.5% PERP REGS | Financial and Insurance Activities | 0.36% | Italy |



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

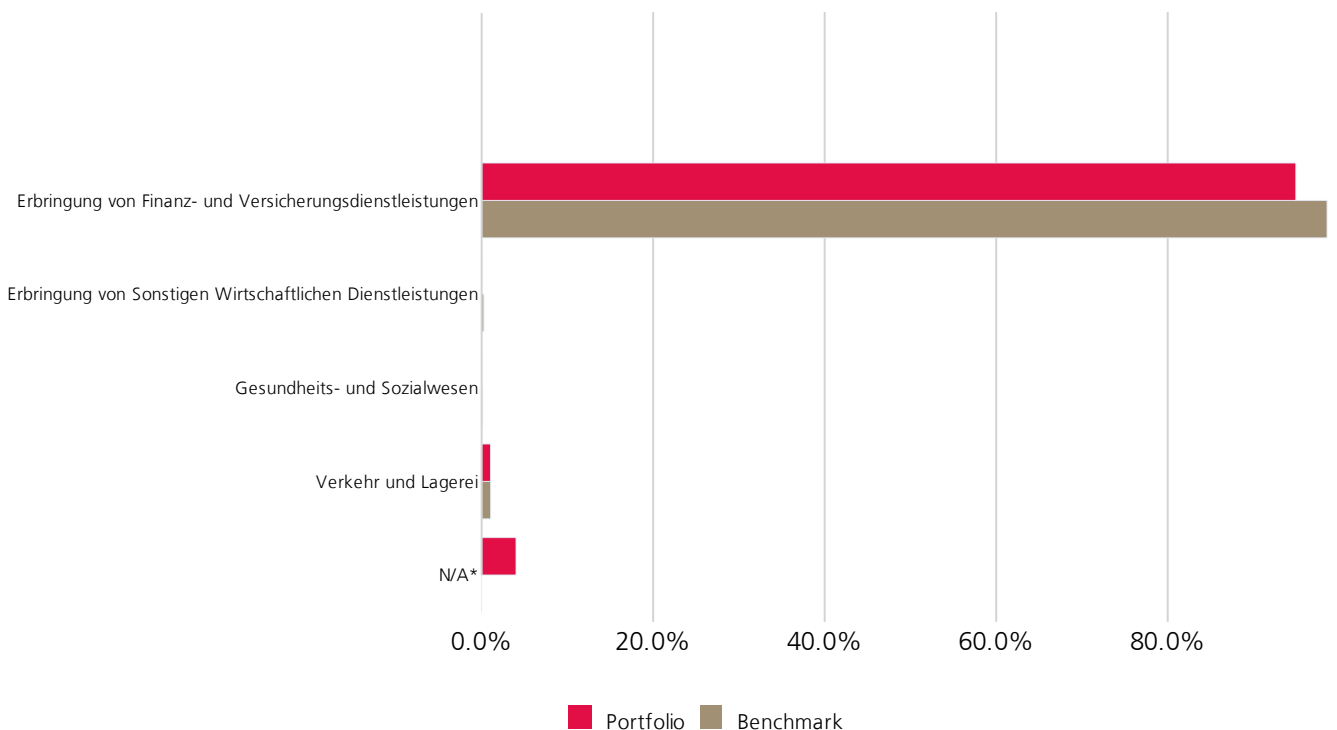
Der Anteil an nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen und Angaben zur Vermögensallokation werden in untenstehender Frage beantwortet.

Wie sah die Vermögensallokation aus?



In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Wegen mangelnder Datenverfügbarkeit können Subsektoren nicht angezeigt werden.



*Diese Klassifizierung umfasst alle Bestände, für die keine NACE-Klassifizierung gefunden oder geschätzt werden kann; Liquidität ist darin enthalten.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Obwohl keine Investitionen getätigt wurden, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind, wird in untenstehender Grafik die Alignment der nachhaltigen Investitionen mit der EU-Taxonomie offengelegt.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomeikonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert¹?

Ja

In fossiles Gas

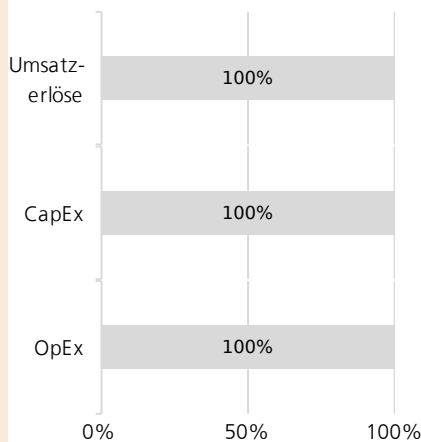
In Kernenergie

Nein

¹Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomeikonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels ("Klimaschutz") beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomeikonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

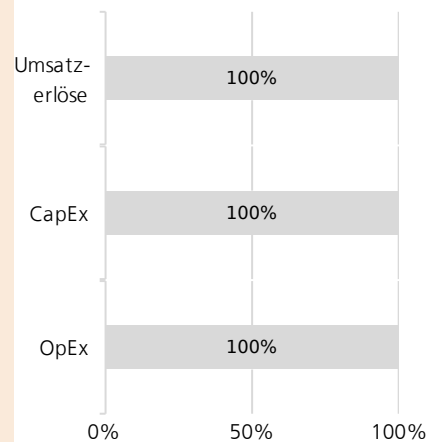
Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomeikonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzproduktes einschliesslich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzproduktes zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.

1. Taxonomiekonformität der Investitionen einschliesslich Staatsanleihen*



- Taxonomiekonform: Fossiles Gas
- Taxonomiekonform: Kernenergie
- Taxonomiekonform: (ohne fossiles Gas und Kernenergie)
- Nicht taxonomiekonform

2. Taxonomiekonformität der Investitionen ohne Staatsanleihen*



- Taxonomiekonform: Fossiles Gas
- Taxonomiekonform: Kernenergie
- Taxonomiekonform: (ohne fossiles Gas und Kernenergie)
- Nicht taxonomiekonform

Diese Grafik gibt 99.7% der Gesamtinvestitionen wieder.

*Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff "Staatsanleihen" alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Mit Blick auf die EU-Taxonomeikonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf erneuerbare Energie oder CO2-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO2-armen Alternativen gibt und die Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomeikonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:
- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

Investitionsausgaben (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, z.B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft
- **Betriebsausgaben** (Opex), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Angaben zu Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten werden in der Tabelle zusammengefasst. Wenn keine Angaben verfügbar sind, wird die Tabelle ebenfalls keine Angaben enthalten.

| Issuer Name | Nace Sektor | Total Eligible Activity Revenue | Total Aligned Revenue | Total Likely Aligned Revenue | Total Potentially Aligned Revenue | Portfolio Gewicht (Consol.) |
|-------------|-------------|---------------------------------|-----------------------|------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------|
|-------------|-------------|---------------------------------|-----------------------|------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------|

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

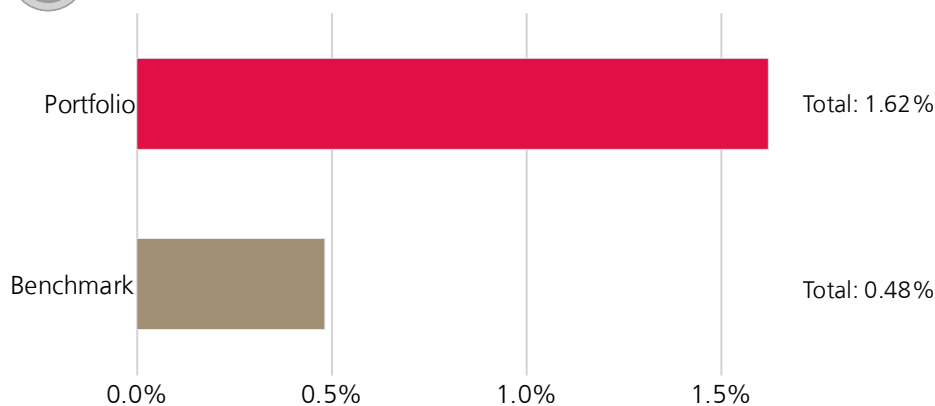
Da im vorangegangenen Berichtsjahr keine Daten verfügbar waren, erübrigt sich ein Vorjahresvergleich.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



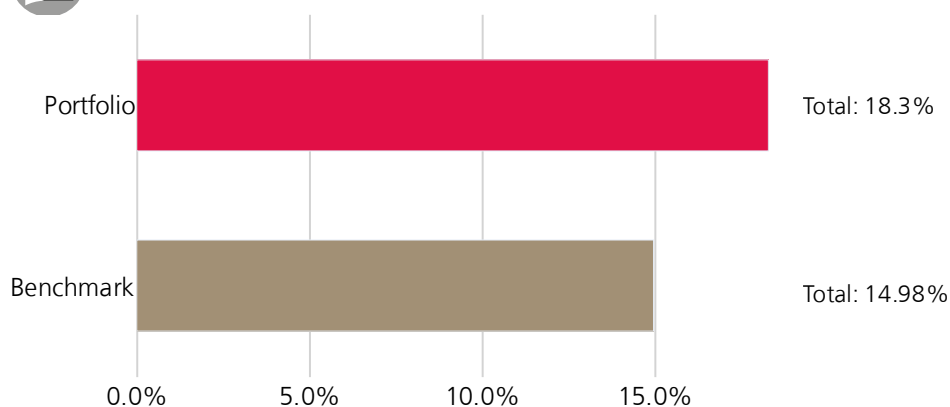
Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?



Das Diagramm zeigt die prozentualen Umsätze der im Portfolio des Fonds enthaltenen Unternehmungen und der der Benchmark, welche nicht EU-Taxonomie konform, jedoch im Einklang mit den sich aus den SDGs ergebenden Umweltzielen gemäss Art. 2 (17) SFDR investiert worden sind.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?



Das Diagramm zeigt die prozentualen Umsätze der im Portfolio des Fonds enthaltenen Unternehmungen und der der Benchmark, welche nicht EU-Taxonomie konform, jedoch im Einklang mit den sich aus den SDGs ergebenden sozialen Zielen gemäss Art. 2 (17) SFDR investiert worden sind.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Diese Vermögenswerte haben die in der spezifischen Anlagepolitik vorgesehenen Anlagen umfasst, einschliesslich Derivate zu Absicherungszwecken und flüssige Mittel. Die Anlagen, ausgenommen Derivate und flüssige Mittel, haben die Grundsätze des ökologischen oder sozialen Mindestschutzes umgesetzt.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Im Berichtszeitraum förderte der Vermögensverwalter durch Investment Stewardship und Kapitalallokation nachhaltige Geschäftspraktiken und die Einhaltung anerkannter internationaler Prinzipien und ESG-Best-Practice-Standards. Dementsprechend stand er im Dialog mit den Managementteams der investierten Unternehmen. Darüber hinaus hat er sich im Rahmen der United Nations Collaboration Platform for Responsible Investment (UN PRI) und bei Investoreninitiativen engagiert. Das Abstimmungsverhalten basierte auf den schweizerischen und internationalen Corporate-Governance-Regeln sowie auf den Prinzipien des UN Global Compact und den 17 Zielen für nachhaltige Entwicklung (UN SDGs). Weitere Informationen finden Sie unter: Swisscanto | Proxy Voting Dashboard (issgovernance.com) <https://www.swisscanto.com/int/de/nachhaltigkeit/investment-stewardship.html>

Swisscanto | Proxy Voting Dashboard (issgovernance.com)

<https://www.swisscanto.com/int/de/nachhaltigkeit/investment-stewardship.html>



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Es wurde kein Index als Referenzwert bestimmt, um festzustellen, ob dieses Finanzprodukt auf die beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet ist.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?

Nicht anwendbar.

Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?

Nicht anwendbar.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?

Nicht anwendbar.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?

Nicht anwendbar.

Das Dokument wurde von Swisscanto mit geschäftsüblicher Sorgfalt erstellt und kann Informationen aus sorgfältig ausgewählten Drittquellen enthalten. Anleger sollten beachten, dass die zuvor für 2023 berechneten und veröffentlichten Daten für dieses in 2024 veröffentlichte Dokument neu berechnet wurden. Dementsprechend kann es zu Abweichungen bei diesen in den Jahren 2023 und 2024 veröffentlichten historischen Daten kommen.



Regelmässige Information zum 31.01.2024

Regelmässige Informationen zu den in Artikel 8, Absätze 1, 2, 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts:

Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Corporate Hybrid

Unternehmenskennung (LEI-Code):

549300GAYISEMK2SEE06

Benchmark

ICE BofA Gl. Hybrid Non-Financial Corp. Index
(TR) (Constrained 3% per Issuer) hedged in EUR

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. In dieser Verordnung ist kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten festgelegt. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

| <input checked="" type="radio"/> <input checked="" type="radio"/> <input type="checkbox"/> Ja | <input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> <input checked="" type="checkbox"/> Nein |
|---|---|
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: _ % <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: _ % | <input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 49.52% an nachhaltigen Investitionen <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input checked="" type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel <input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt. |



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die von dem Teilfonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale wurden durch folgende Aktivitäten erreicht:

1. Ausschlusskriterien
2. ESG-Integration
3. Reduktion der CO₂e-Intensität
4. Nachhaltige Investitionen

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Aus Übersichtsgründen werden die Angaben zur Performance (siehe Details am Ende des Reports) der Nachhaltigkeitsindikatoren direkt mit dem historischen Vergleich in der nächsten Frage beantwortet.

...und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Ausschlusskriterien

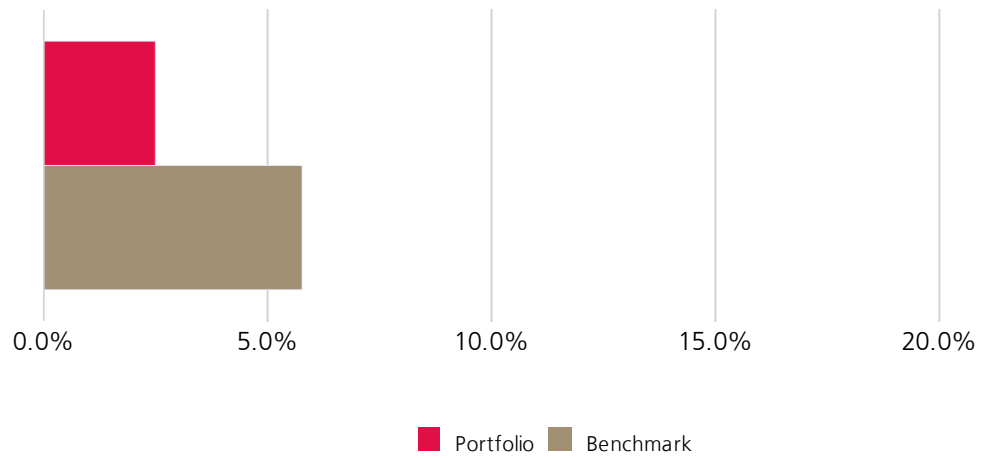
| Responsible | | | | | | | |
|--------------------------------------|-------------------|--|------------------------------|---|-------------------|-------------------|------------------------------|
| Kriterien | Gewicht Portfolio | Gewicht Benchmark | Anzahl Unternehmen Benchmark | Kriterien | Gewicht Portfolio | Gewicht Benchmark | Anzahl Unternehmen Benchmark |
| Kohlereserven (ex. Metallproduktion) | 0.00% | 4.99% | 2 | UN Global Compact Verstöße | 0.00% | 1.50% | 1 |
| Förderung von Kohle (> 5% Umsatz) | 0.00% | 0.30% | 0 | Ausbeuterische Kinderarbeit | 0.00% | 0.00% | 0 |
| Klimawandel | | Gefährdung von Gesellschaft und Gesundheit | | Herstellung von Kriegstechnik (> 5% Umsatz) | 0.00% | 0.00% | 0 |
| | | | | Herstellung von Pornografie | 0.00% | 0.00% | 0 |
| | | | | Herstellung von Waffen & Munition | 0.00% | 0.00% | 0 |
| | | | | Kontroverse Waffen | 0.00% | 0.00% | 0 |

Zwecks Minderung der Nachhaltigkeitsrisiken und mit dem Ziel, nicht in Wertpapiere der oben aufgeführten kontroversen Geschäftsmodellen zu investieren, sind die oben genannten Ausschlusskriterien angewendet worden. Die Tabelle zeigt die Anzahl der Unternehmen, die gegen die Ausschlusskriterien verstossen haben, sowie die jeweilige Portfolio- und Benchmark-Exposition. Liegen bei einem Unternehmen mehrere Verstöße vor, werden diese für jedes Kriterium separat aufgeführt. Daher ist die Summe aller Positionen in diesem Bericht in der Regel höher als die effektive Allokation zu den oben abgebildeten Kriterien. Die historischen Vergleiche werden in nachfolgender Tabelle gemacht. Aus Übersichtsgründen werden die Ausschlusskriterien aggregiert.

| | Indikator | Datum 2023 | Datum 2024 |
|-----------|----------------------------|------------|------------|
| Portfolio | Ausschlusskriterien Total* | 0% | 0% |
| Benchmark | Ausschlusskriterien Total* | 4.64% | 6.78% |

*alle Ausschlusskriterien kumuliert.

ESG-Integration



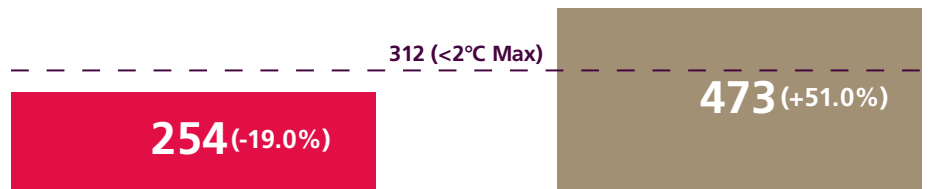
Das Portfolio strebte in der Berichtsperiode im Vergleich zur Benchmark eine geringere Exposition zu ESG-Laggards an. ESG-Laggards sind Unternehmungen mit der schwächsten Umwelt-, Sozial und Governance- Performance des relevanten Anlageuniversums.

Die historischen Vergleiche werden in nachfolgender Tabelle gemacht.

| | Indikator | Datum 2023 | Datum 2024 |
|-----------|----------------------------|------------|------------|
| Portfolio | Exposition zu ESG Laggards | 17.03% | 2.49% |
| Benchmark | Exposition zu ESG Laggards | 9.5% | 5.77% |

Reduktion der CO₂e-Intensität

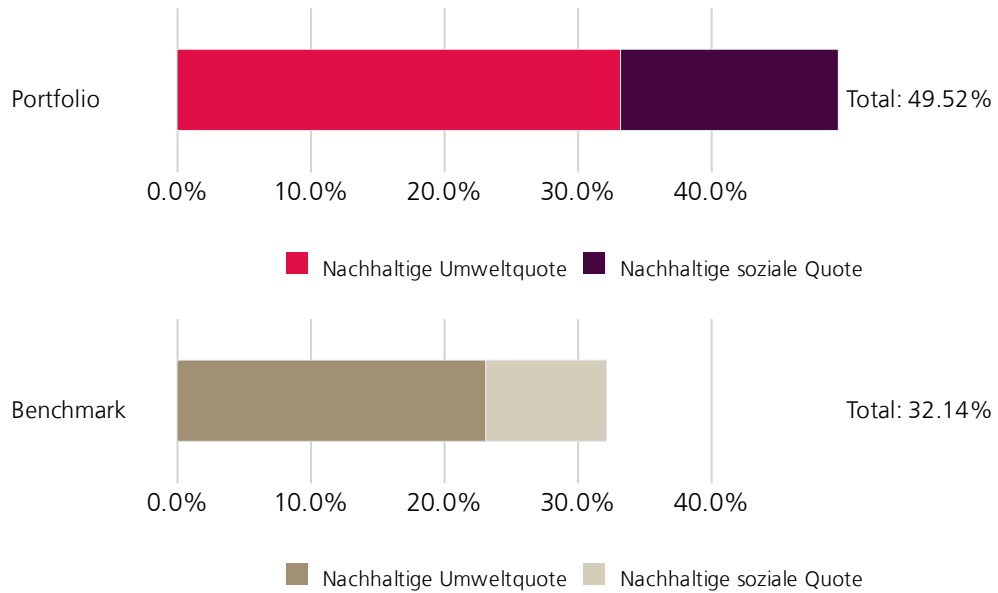
Corporate



Im Einklang mit dem < 2° Pariser Klimaziel ("<2°C Max") zielte die Investitionstätigkeit des Fonds während der Berichtsperiode darauf ab, die CO₂e-Emissionen des Portfolios, um mindestens 4 % pro Jahr zu reduzieren. Der Absenkpfad berechnet sich aus den gewichteten CO₂e-Intensitäten der Benchmark, diskontiert mit 4 % pro Jahr zuzüglich des realen Wirtschaftswachstums. Die gestrichelten 2° Max-Linie zeigt den Maximalwert an. Die Balken stellen die CO₂e-Intensitäten des Portfolios und der Benchmark dar. CO₂e-Intensitäten unterhalb der 2° Max-Linie zeigen an, dass das Portfolio oder die Benchmark das <2°-Klimaziel erfüllen. Werte bei "Erreichung Klimaziel" setzen das Portfolio und die Benchmark in Relation zum Klimaziel. Negative Werte bedeuten, dass das Ziel erreicht wurde. Die historischen Vergleiche werden in nachfolgender Tabelle gemacht.

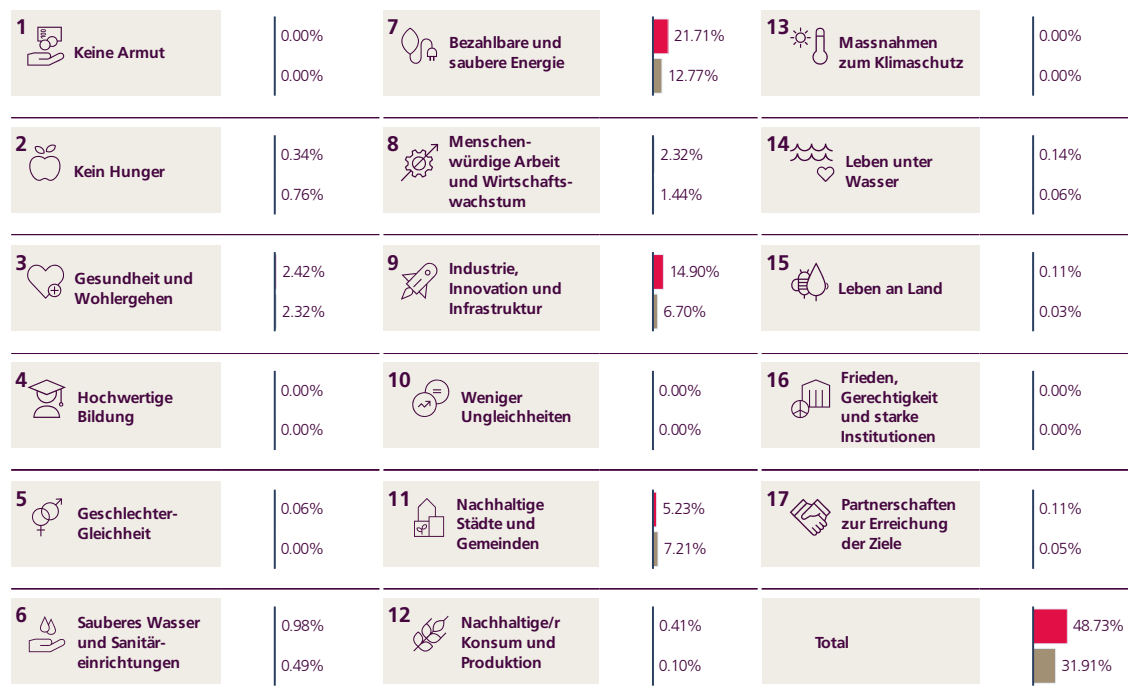
| | Indikator | Datum 2023 | Datum 2024 |
|-----------|--|------------|------------|
| Portfolio | CO ₂ e-Intensität Corporate | 309 | 252 |
| | Reduktion Corporate | -9% | -19% |
| Benchmark | CO ₂ e-Intensität Corporate | 557 | 473 |
| | Reduktion Corporate | 64% | 51% |

Nachhaltige Investitionen



Das Diagramm zeigt die prozentualen Umsätze der im Portfolio des Fonds enthaltenen Unternehmungen und der der Benchmark, welche nicht EU-Taxonomie konform, jedoch im Einklang mit den sich aus den UN Sustainable Development Goals (SDGs) ergebenden Umwelt- und sozialen Zielen gemäss Art. 2 (17) SFDR investiert worden sind. Der Fonds hat keine Investitionen in ökologisch nachhaltige Aktivitäten im Sinne der EU Taxonomie-Verordnung angestrebt. Der Investmentmanager des (Teil-)Fonds hat eine Methodologie zur Definition nachhaltiger Investitionen entwickelt, die den Anforderungen des Art. 2 (17) SFDR entspricht. Die Methodologie ist detailliert in den Vorvertraglichen Informationen beschrieben. Die Aufteilung der nachhaltigen Investitionen in UN SDGswerten in folgender Grafik gemacht. Die historischen Vergleiche werden in nachfolgender Tabelle gemacht.

| | Indikator | Datum 2023 | Datum 2024 |
|-----------|---|------------|------------|
| Portfolio | Anteil nachhaltige Investitionen mit Umweltziel | 29.77% | 33.2% |
| | Anteil sozial nachhaltige Investitionen | 14.42% | 16.35% |
| | Total nachhaltige Quote | 44.19% | 49.55% |
| Benchmark | Anteil nachhaltige Investitionen mit Umweltziel | 20.95% | 23.13% |
| | Anteil sozial nachhaltige Investitionen | 7.6% | 9.08% |
| | Total nachhaltige Quote | 28.56% | 32.2% |



 Portfolio
  Benchmark

Aufgrund der unterschiedlichen Behandlung von Green, Social und Sustainable Bonds kann das SDG-Exposure von den prozentualen Umsätzen der im Portfolio des Fonds enthaltenen Unternehmungen und den der Benchmark, welche im Einklang mit den sich aus den SDGs ergebenden Umweltzielen gemäss Art. 2 (17) SFDR investiert worden sind, abweichen.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Im Berichtszeitraum konzentrierte sich der Vermögensverwalter auf Wertpapiere von Unternehmen, welche Umsätze aus dem Verkauf von Produkten und Dienstleistungen mit einem positiven Beitrag zu den 17 SDGs erzielten und dabei keine DNSH- und/oder Minimum Safeguards-Verletzungen aufgewiesen haben.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Emittenten mit einem negativen Nettobeitrag zu den SDGs wurden in der Berichtsperiode aus dem Anlageuniversum des Finanzproduktes entfernt. Darüber hinaus berücksichtigte der Teilfonds nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (engl: Principal Adverse Impacts - PAI). Zu diesem Zweck wurden die obligatorischen Indikatoren Anhang 1 der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1288 zur Ergänzung der Verordnung (EU) 2019/2088 zugrunde gelegt. Unternehmen, die der Vermögensverwalter gemäss PAI als besonders schädlich einstufte, wurden entsprechend nicht zu den nachhaltigen Anlagen gezählt. Emittenten, welche die PAls 7 (Biodiversität), 10 (Global Compact der Vereinten Nationen (UNGC)/OECD Leitsätze für multinationale Unternehmen) oder 14 (Engagement in umstrittenen Waffen) verletzen, haben einen PAI-Score von null erhalten. Aus den restlichen PAI-Indikatoren wurde ein PAI-Score berechnet. Instrumente von Emittenten mit einem Score < 10 wurden nicht den nachhaltigen Investitionen angerechnet.

● **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Die nachteiligen Auswirkungen (PAI) sind systematisch im Anlageprozess berücksichtigt worden.

● **Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:**

Bei der Anlageanalyse für nachhaltige Investitionen wurden in der Berichtsperiode die folgenden Normverletzungen berücksichtigt: Global Compact der Vereinten Nationen (UNGC), die UN Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte (UNGP) und das Übereinkommen der Internationalen Arbeitsorganisation (ILO). Jeder schwerwiegende Verstoß gegen diese Normen führte zum Ausschluss des Emittenten aus dem investierbaren Universum des Finanzprodukts.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

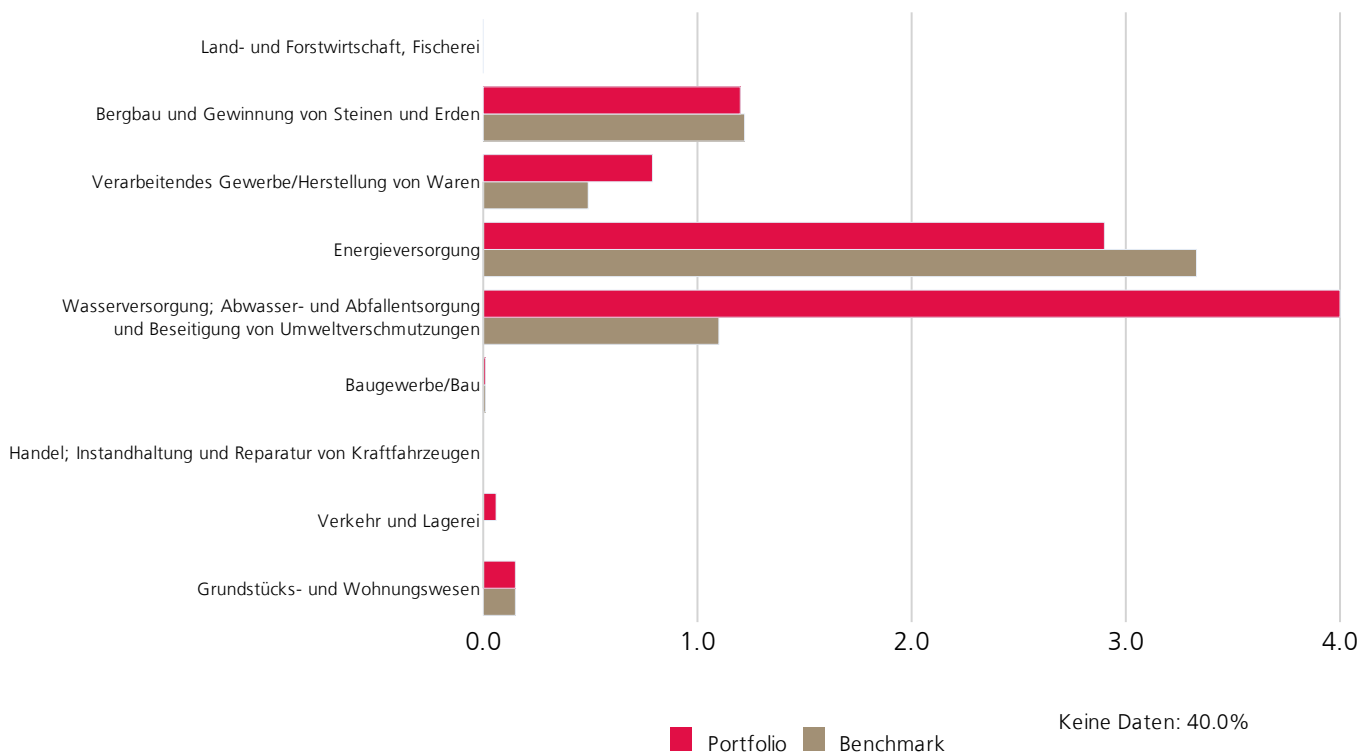
Nachteilige Nachhaltigkeitsauswirkungen (PAI) – Corporate Anlagen

Primäre Indikatoren - Energie und Emissionen

| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Benchmark Aktuell | Benchmark Vorjahr | Erklärung |
|--|--|-------------------|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|-----------|
| 1. THG-Emissionen | 1a. GHG Emissions - Scope 1 per Mio EUR Enterprise Value | 19723.1 | 103.73% | 14886.2 | 24437.8 | 18666.3 | |
| | 1b. GHG Emissions - Scope 2 per Mio EUR Enterprise Value | 2606.04 | 103.73% | 1530.94 | 2499.17 | 1924.31 | |
| | 1c. GHG Emissions - Scope 3 per Mio EUR Enterprise Value | 99872.8 | 103.73% | 79658.9 | 99489.5 | 74547.4 | |
| 2. CO ₂ -Fussabdruck | 2. GHG Emissions - Scope 1+2+3 per Mio EUR Enterprise Value | 1140.03 | 103.73% | 1133.65 | 1181.03 | 1121.12 | |
| 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird | 3. GHG Emissions - Emissions Intensity - Total Emissions (EUR) | 383.04 | 103.73% | 380.86 | 601.49 | 659.36 | |
| 4. Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind | 4. Fossil Fuel - Involvement (PAI) | 47.46% | 99.35% | 49.61% | 39.4% | 36.92% | |

| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Benchmark Aktuell | Benchmark Vorjahr | Erklärung |
|--|--|-------------------|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|---|
| 5. Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen | 5a. CR Raw - Energy use - Coal/nuclear/undear energy sources | 50.89% | 47.09% | 48.91% | 46.23% | 43.73% | |
| | 5b. Non-renewable energy consumption | 62.07% | 48.48% | 86.95% | 63.47% | 88.37% | Der Verbrauch nicht-erneuerbarer Energie umfasst den Verbrauch von Energie, die aus nicht-erneuerbaren Quellen erzeugt wird, sowie den Verbrauch von Energie aus Biomasse. Alle Zahlen zum Energieverbrauch, bei denen die Energiequelle unklar ist, sind ebenfalls in diesem Faktor enthalten. |
| | 5c. Non-renewable energy production | 22.35% | 88.46% | 25.86% | 22.74% | 22.82% | |
| 6. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren | 6. Energy consumption intensity (GWh/mEUR) | 1.49 | 52.59% | 1.87 | 1.75 | 2.05 | |

Intensität des Energieverbrauchs pro High Impact Sector (pro Mio. EUR)



| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Benchmark Aktuell | Benchmark Vorjahr | Erklärung |
|---|--|-------------------|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|-----------|
| 7. Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken | 7. Companies negatively affecting biodiversity-sensitive areas | 0% | 99,35% | 0% | 0% | 0% | |
| 8. Emissionen in Wasser | 8. CR Raw - COD emissions | 243.44 | 7.58% | 285.99 | 188.75 | 209.03 | |
| 9. Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle | 9. CR Raw - Hazardous waste | 0.4 | 12.54% | 0 | 0.28 | 0 | |

| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Benchmark Aktuell | Benchmark Vorjahr | Erklärung |
|--|--|-------------------|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|-----------|
| 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | 10. UNGC / OECD Guidelines Violation | 0% | 99,35% | 0% | 149,99% | 0% | |
| 11. Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen | 11. Lack of processes monitoring UNGC and OECD Guidelines compliance | 1.1% | 85,35% | 2,98% | 1,8% | 3,56% | |
| 12. Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle | 12. Unadjusted gender pay gap | 0,56% | 17,84% | 1,1% | 0,19% | 0,09% | |
| 13. Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen | 13. Ratio of female to male board members | 79,4% | 65,68% | 77,43% | 75,44% | 76,31% | |
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) | 14. Controversial weapons involvement (APM, CM, Bio, Chem) | 0% | 99,35% | 0% | 0% | 0% | |

Nachteilige Nachhaltigkeitsauswirkungen (PAI) – Staatliche und Supranationale Vermögenswerte

Primäre Indikatoren

| Umwelt | | | | | | | Erklärung |
|--------------------|-------------------|-------------------|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|-----------|
| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Benchmark Aktuell | Benchmark Vorjahr | |
| 15. GHG Intensität | 15. GHG Intensity | 159.6 | 1.77% | 168.64 | 54.79 | 0 | |

| Sozial | | | | | | | Erklärung |
|--|---|-------------------|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|-----------|
| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Benchmark Aktuell | Benchmark Vorjahr | |
| 16. Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen | 16a. Countries subject to social violations (#) | 0 | 0% | 0 | 0 | 0 | |
| | 16b. Countries subject to social violations (%) | 0% | 0% | 0% | 0% | 0% | |

| Indikator | Metrik |
|-----------|---|
| 1a | Scope-1-Treibhausgas-Emissionen |
| 1b | Scope-2-Treibhausgas-Emissionen |
| 1c | Scope-3-Treibhausgas-Emissionen |
| 2. | CO2-Fussabdruck pro Mio EUR |
| 3. | THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird |
| 4. | Anteil der Investitionen in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind |
| 5a | Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung der Unternehmen, in die investiert wird, aus nicht erneuerbaren Energiequellen im Vergleich zu erneuerbaren Energiequellen, ausgedrückt in Prozent der gesamten Energiequellen |
| 5b | Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung der Unternehmen, in die investiert wird, aus nicht erneuerbaren Energiequellen im Vergleich zu erneuerbaren Energiequellen, ausgedrückt in Prozent der gesamten Energiequellen |
| 5c | Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung der Unternehmen, in die investiert wird, aus nicht erneuerbaren Energiequellen im Vergleich zu erneuerbaren Energiequellen, ausgedrückt in Prozent der gesamten Energiequellen |
| 6. | Energieverbrauch in GWh pro einer Million EUR Umsatz der Unternehmen, in die investiert wird, aufgeschlüsselt nach klimaintensiven Sektoren |
| 7. | Anteil der Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird, mit Standorten/Betrieben in oder in der Nähe von Gebieten mit schutzbedürftiger Biodiversität, sofern sich die Tätigkeiten dieser Unternehmen nachteilig auf diese Gebiete auswirken |
| 8. | Tonnen Emissionen in Wasser, die von den Unternehmen, in die investiert wird, pro investierter Million EUR verursacht werden, ausgedrückt als gewichteter Durchschnitt |
| 9. | Tonnen gefährlicher und radioaktiver Abfälle, die von den Unternehmen, in die investiert wird, pro investierter Million EUR erzeugt werden, ausgedrückt als gewichteter Durchschnitt |
| 10. | Anteil der Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird, die an Verstößen gegen die UNGC-Grundsätze oder gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen beteiligt waren |
| 11. | Anteil der Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird, die keine Richtlinien zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen oder keine Verfahren zur Bearbeitung von Beschwerden wegen Verstößen gegen die UNGC-Grundsätze und OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen eingerichtet haben |
| 12. | Durchschnittliches unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle bei den Unternehmen, in die investiert wird |
| 13. | Durchschnittliches Verhältnis von Frauen zu Männern in den Leitungs- und Kontrollorganen der Unternehmen, in die investiert wird, ausgedrückt als Prozentsatz aller Mitglieder der Leitungs- und Kontrollorgane |
| 14. | Anteil der Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird, die an der Herstellung oder am Verkauf von umstrittenen Waffen beteiligt sind |
| 15. | THG-Emissionsintensität der Länder, in die investiert wird |
| 16a | Anzahl der Länder, in die investiert wird, die nach Maßgabe internationaler Verträge und Übereinkommen, der Grundsätze der Vereinten Nationen oder, falls anwendbar, nationaler Rechtsvorschriften gegen soziale Bestimmungen verstoßen (absolute Zahl und relative Zahl, geteilt durch alle Länder, in die investiert wird) |
| 16b | Anzahl der Länder, in die investiert wird, die nach Maßgabe internationaler Verträge und Übereinkommen, der Grundsätze der Vereinten Nationen oder, falls anwendbar, nationaler Rechtsvorschriften gegen soziale Bestimmungen verstoßen (absolute Zahl und relative Zahl, geteilt durch alle Länder, in die investiert wird) |

Das Dokument wurde von Swisscanto mit geschäftsüblicher Sorgfalt erstellt und kann Informationen aus sorgfältig ausgewählten Drittquellen enthalten. Anleger sollten beachten, dass die zuvor für 2023 berechneten und veröffentlichten Daten für dieses in 2024 veröffentlichte Dokument neu berechnet wurden. Dementsprechend kann es zu Abweichungen bei diesen in den Jahren 2023 und 2024 veröffentlichten historischen Daten kommen.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 01.02.2023 - 31.01.2024

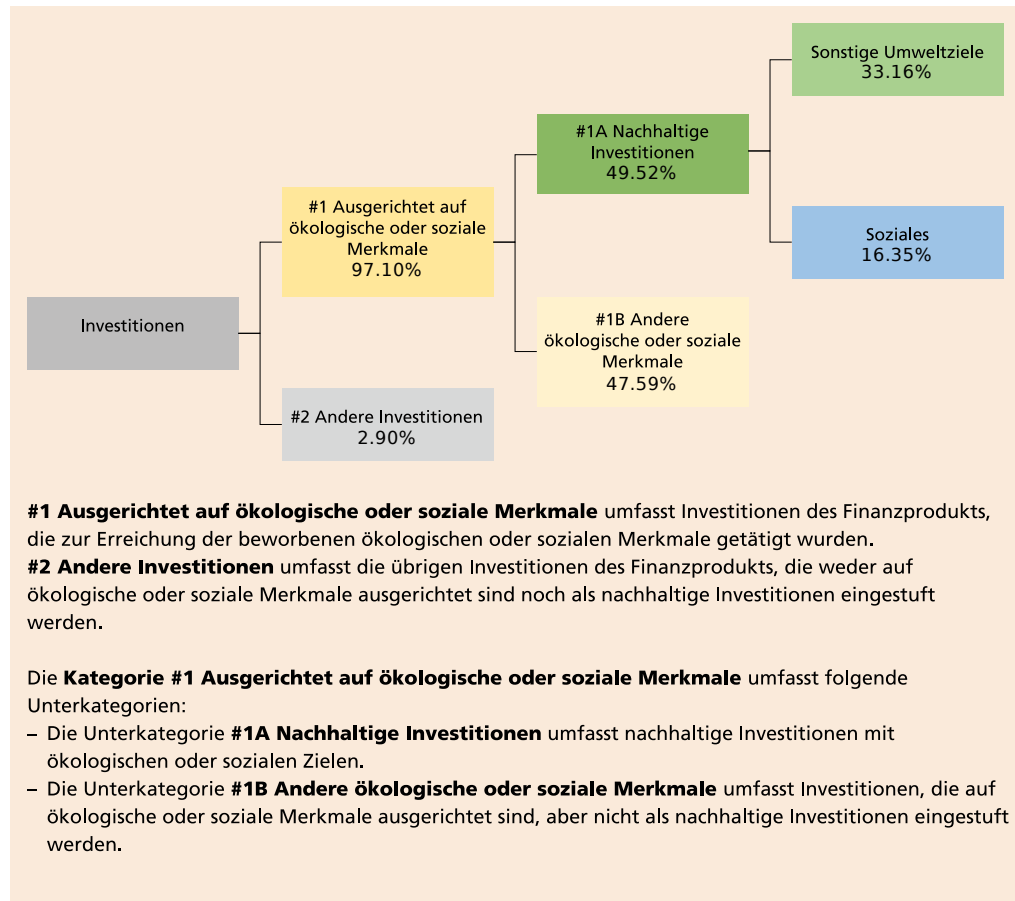
| Grösste Investitionen | Sektor | In % der Vermögenswerte | Land |
|---|---|-------------------------|----------------|
| TotalEnergies SE 2% PERP REGS | Mining and Quarrying | 0.85% | France |
| Enel SpA 1.375% PERP REGS | Electricity, Gas, Steam and Air Conditioning Supply | 0.81% | Italy |
| OMV AG 2.5% PERP REGS | Mining and Quarrying | 0.79% | Austria |
| Telia Co AB 4.625% 21-DEC-2082 REGS | Information and Communication | 0.73% | Sweden |
| ELM BV for Firmenich International SA 3.75% PERP REGS | Mining and Quarrying | 0.72% | |
| EUR Cash | | 0.66% | |
| BP Capital Markets PLC 4.375% PERP | Financial and Insurance Activities | 0.64% | United Kingdom |
| BP Capital Markets PLC 3.625% PERP REGS | Financial and Insurance Activities | 0.64% | United Kingdom |
| Orsted AS 1.75% 09-DEC-3019 REGS | Electricity, Gas, Steam and Air Conditioning Supply | 0.63% | Denmark |
| Orange SA 1.75% PERP REGS | Information and Communication | 0.62% | France |
| Engie SA 1.5% PERP REGS | Electricity, Gas, Steam and Air Conditioning Supply | 0.61% | France |
| Total SE 1.625% PERP REGS | Mining and Quarrying | 0.61% | France |
| SSE PLC 3.74% PERP REGS | Electricity, Gas, Steam and Air Conditioning Supply | 0.52% | United Kingdom |
| Koninklijke KPN NV 6% PERP REGS | Information and Communication | 0.51% | Netherlands |
| Vodafone Group PLC 8% 30-AUG-2086 REGS | Information and Communication | 0.50% | United Kingdom |



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

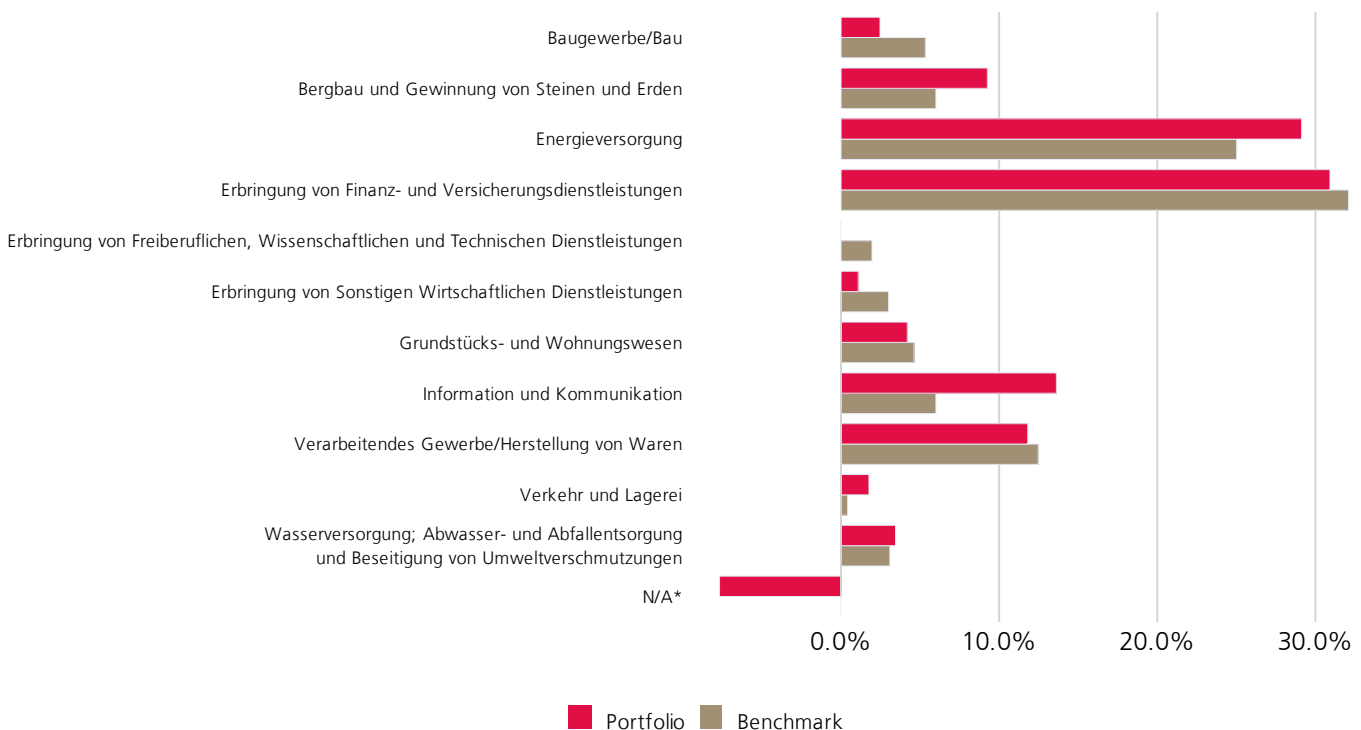
Der Anteil an nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen und Angaben zur Vermögensallokation werden in untenstehender Frage beantwortet.

Wie sah die Vermögensallokation aus?



In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Wegen mangelnder Datenverfügbarkeit können Subsektoren nicht angezeigt werden.



*Diese Klassifizierung umfasst alle Bestände, für die keine NACE-Klassifizierung gefunden oder geschätzt werden kann; Liquidität ist darin enthalten.
225/449



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Obwohl keine Investitionen getätigt wurden, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind, wird in untenstehender Grafik die Alignment der nachhaltigen Investitionen mit der EU-Taxonomie offengelegt.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomeikonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert¹?

Ja

In fossiles Gas

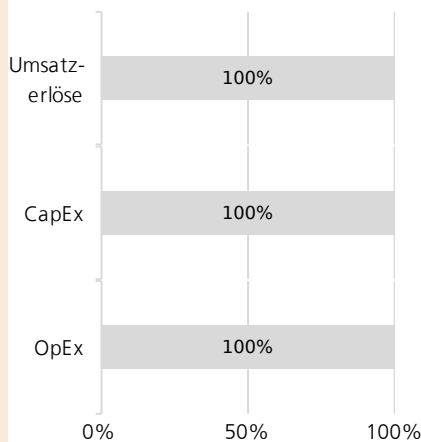
In Kernenergie

Nein

¹Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomeikonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels ("Klimaschutz") beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomeikonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

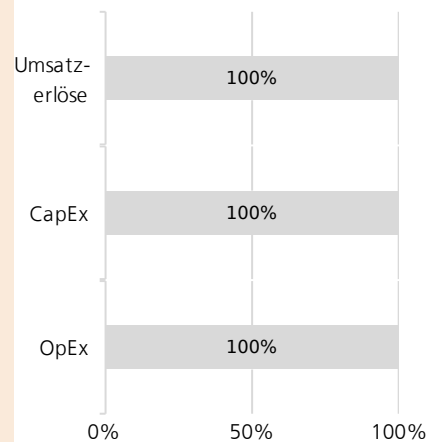
Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomeikonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzproduktes einschliesslich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzproduktes zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.

1. Taxonomiekonformität der Investitionen einschliesslich Staatsanleihen*



- Taxonomiekonform: Fossiles Gas
- Taxonomiekonform: Kernenergie
- Taxonomiekonform: (ohne fossiles Gas und Kernenergie)
- Nicht taxonomiekonform

2. Taxonomiekonformität der Investitionen ohne Staatsanleihen*



- Taxonomiekonform: Fossiles Gas
- Taxonomiekonform: Kernenergie
- Taxonomiekonform: (ohne fossiles Gas und Kernenergie)
- Nicht taxonomiekonform

Diese Grafik gibt 98.4% der Gesamtinvestitionen wieder.

*Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff "Staatsanleihen" alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Mit Blick auf die EU-Taxonomeikonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf erneuerbare Energie oder CO2-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO2-armen Alternativen gibt und die Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomeikonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:
- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

Investitionsausgaben (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, z.B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft
- **Betriebsausgaben** (Opex), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Angaben zu Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten werden in der Tabelle zusammengefasst. Wenn keine Angaben verfügbar sind, wird die Tabelle ebenfalls keine Angaben enthalten.

| Issuer Name | Nace Sektor | Total Eligible Activity Revenue | Total Aligned Revenue | Total Likely Aligned Revenue | Total Potentially Aligned Revenue | Portfolio Gewicht (Consol.) |
|-----------------------------|---|---------------------------------|-----------------------|------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------|
| Elia Group SA/NV | Construction | 99.98% | 24.95% | 15.00% | 0.00% | 0.97% |
| Terna S.p.A. | Electricity, Gas, Steam and Air Conditioning Supply | 87.76% | 21.75% | 13.10% | 0.00% | 1.67% |
| Redeia Corporacion SA | Construction | 84.35% | 19.80% | 12.73% | 0.00% | 1.14% |
| Orsted | Electricity, Gas, Steam and Air Conditioning Supply | 56.27% | 18.25% | 31.86% | 0.00% | 3.48% |
| NGG Finance Plc | Financial and Insurance Activities | 19.17% | 16.75% | 0.00% | 0.36% | 1.50% |
| EDP-Energias de Portugal SA | Electricity, Gas, Steam and Air Conditioning Supply | 77.52% | 12.25% | 0.00% | 32.43% | 3.12% |
| Electricite de France SA | Electricity, Gas, Steam and Air Conditioning Supply | 71.56% | 9.50% | 0.00% | 7.23% | 2.75% |
| Iberdrola International BV | Electricity, Gas, Steam and Air Conditioning Supply | 61.60% | 9.13% | 0.00% | 15.60% | 2.03% |
| Iberdrola Finanzas SA | Electricity, Gas, Steam and Air Conditioning Supply | 61.60% | 9.13% | 0.00% | 15.60% | 1.23% |
| Veolia Environnement SA | Water Supply, Sewerage, Waste Management and Remediation Activities | 68.52% | 8.28% | 30.01% | 0.00% | 1.74% |

Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

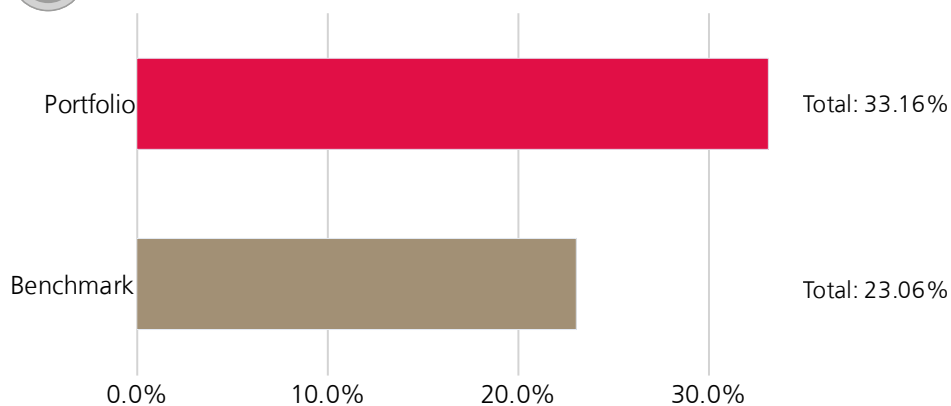
Da im vorangegangenen Berichtsjahr keine Daten verfügbar waren, erübrigt sich ein Vorjahresvergleich.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



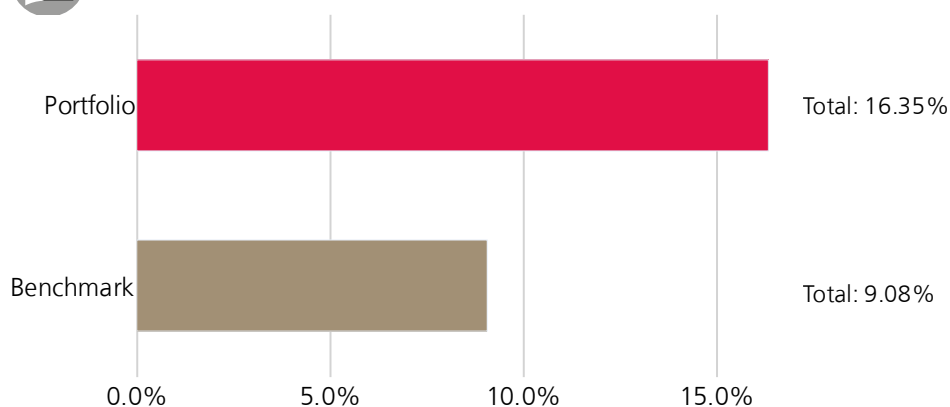
Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?



Das Diagramm zeigt die prozentualen Umsätze der im Portfolio des Fonds enthaltenen Unternehmungen und der der Benchmark, welche nicht EU-Taxonomie konform, jedoch im Einklang mit den sich aus den SDGs ergebenden Umweltzielen gemäss Art. 2 (17) SFDR investiert worden sind.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?



Das Diagramm zeigt die prozentualen Umsätze der im Portfolio des Fonds enthaltenen Unternehmungen und der der Benchmark, welche nicht EU-Taxonomie konform, jedoch im Einklang mit den sich aus den SDGs ergebenden sozialen Zielen gemäss Art. 2 (17) SFDR investiert worden sind.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Diese Vermögenswerte haben die in der spezifischen Anlagepolitik vorgesehenen Anlagen umfasst, einschliesslich Derivate zu Absicherungszwecken und flüssige Mittel. Die Anlagen, ausgenommen Derivate und flüssige Mittel, haben die Grundsätze des ökologischen oder sozialen Mindestschutzes umgesetzt.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Im Berichtszeitraum förderte der Vermögensverwalter durch Investment Stewardship und Kapitalallokation nachhaltige Geschäftspraktiken und die Einhaltung anerkannter internationaler Prinzipien und ESG-Best-Practice-Standards. Dementsprechend stand er im Dialog mit den Managementteams der investierten Unternehmen. Darüber hinaus hat er sich im Rahmen der United Nations Collaboration Platform for Responsible Investment (UN PRI) und bei Investoreninitiativen engagiert. Das Abstimmungsverhalten basierte auf den schweizerischen und internationalen Corporate-Governance-Regeln sowie auf den Prinzipien des UN Global Compact und den 17 Zielen für nachhaltige Entwicklung (UN SDGs). Weitere Informationen finden Sie unter: Swisscanto | Proxy Voting Dashboard (issgovernance.com) <https://www.swisscanto.com/int/de/nachhaltigkeit/investment-stewardship.html>

Swisscanto | Proxy Voting Dashboard (issgovernance.com)

<https://www.swisscanto.com/int/de/nachhaltigkeit/investment-stewardship.html>



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Es wurde kein Index als Referenzwert bestimmt, um festzustellen, ob dieses Finanzprodukt auf die beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet ist.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?

Nicht anwendbar.

Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?

Nicht anwendbar.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?

Nicht anwendbar.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?

Nicht anwendbar.

Das Dokument wurde von Swisscanto mit geschäftsüblicher Sorgfalt erstellt und kann Informationen aus sorgfältig ausgewählten Drittquellen enthalten. Anleger sollten beachten, dass die zuvor für 2023 berechneten und veröffentlichten Daten für dieses in 2024 veröffentlichte Dokument neu berechnet wurden. Dementsprechend kann es zu Abweichungen bei diesen in den Jahren 2023 und 2024 veröffentlichten historischen Daten kommen.



Regelmässige Information zum 31.01.2024

Regelmässige Informationen zu den in Artikel 8, Absätze 1, 2, 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts:

Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Emerging Markets Opportunities

Unternehmenskennung (LEI-Code):

549300J68T7Q0GVJ6Z95

Benchmark

JP Morgan JEMB Sovereign-only 50-50 (TR) in USD

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. In dieser Verordnung ist kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten festgelegt. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

| <input checked="" type="radio"/> <input checked="" type="radio"/> <input type="checkbox"/> Ja | | <input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> <input checked="" type="checkbox"/> Nein | |
|--|--|--|---|
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: _ % | <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind | <input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 1.99% an nachhaltigen Investitionen | <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind |
| <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind | <input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: _ % | <input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind | <input checked="" type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel |
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: _ % | | <input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt . | |



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die von dem Teilfonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale wurden durch folgende Aktivitäten erreicht:

1. Ausschlusskriterien
2. ESG-Integration
3. Reduktion der CO₂e-Intensität

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Aus Übersichtsgründen werden die Angaben zur Performance (siehe Details am Ende des Reports) der Nachhaltigkeitsindikatoren direkt mit dem historischen Vergleich in der nächsten Frage beantwortet.

...und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Ausschlusskriterien

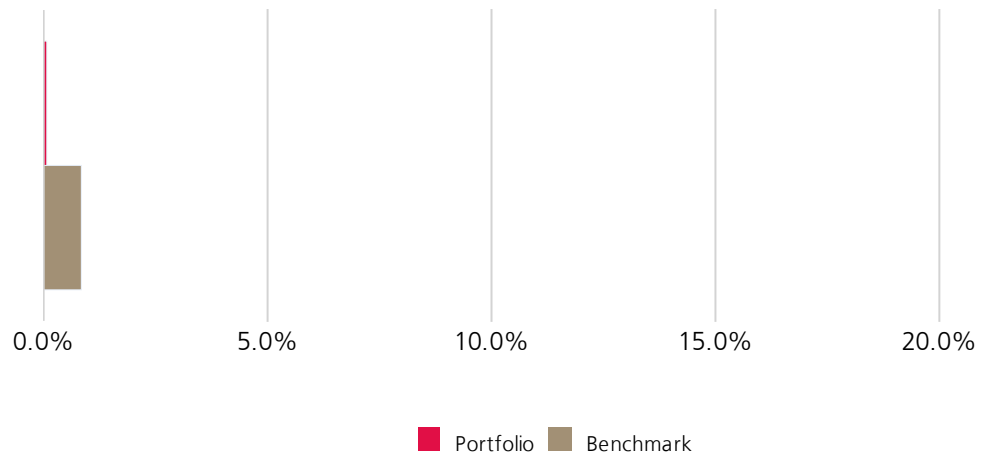
| Responsible | | | | Responsible | | | |
|-------------------------------------|-------------------|--|------------------------------|---|-------------------|-------------------|------------------------------|
| Kriterien | Gewicht Portfolio | Gewicht Benchmark | Anzahl Unternehmen Benchmark | Kriterien | Gewicht Portfolio | Gewicht Benchmark | Anzahl Unternehmen Benchmark |
| Förderung von Kohle (> 5% Umsatz) | 0.00% | 0.08% | 1 | UN Global Compact Verstöße | 0.00% | 0.88% | 3 |
| Kohlereserven (ex. Metalproduktion) | 0.00% | 0.08% | 1 | Ausbeuterische Kinderarbeit | 0.00% | 0.00% | 0 |
| Klimawandel | | Gefährdung von Gesellschaft und Gesundheit | | Herstellung von Kriegstechnik (> 5% Umsatz) | 0.00% | 0.00% | 0 |
| | | | | Herstellung von Pornografie | 0.00% | 0.00% | 0 |
| | | | | Herstellung von Waffen & Munition | 0.00% | 0.00% | 0 |
| | | | | Kontroverse Waffen | 0.00% | 0.00% | 0 |

Zwecks Minderung der Nachhaltigkeitsrisiken und mit dem Ziel, nicht in Wertpapiere der oben aufgeführten kontroversen Geschäftsmodellen zu investieren, sind die oben genannten Ausschlusskriterien angewendet worden. Die Tabelle zeigt die Anzahl der Unternehmen, die gegen die Ausschlusskriterien verstossen haben, sowie die jeweilige Portfolio- und Benchmark-Exposition. Liegen bei einem Unternehmen mehrere Verstöße vor, werden diese für jedes Kriterium separat aufgeführt. Daher ist die Summe aller Positionen in diesem Bericht in der Regel höher als die effektive Allokation zu den oben abgebildeten Kriterien. Die historischen Vergleiche werden in nachfolgender Tabelle gemacht. Aus Übersichtsgründen werden die Ausschlusskriterien aggregiert.

| | Indikator | Datum 2023 | Datum 2024 |
|-----------|----------------------------|------------|------------|
| Portfolio | Ausschlusskriterien Total* | 0% | 0% |
| Benchmark | Ausschlusskriterien Total* | 0.4% | 0.96% |

*alle Ausschlusskriterien kumuliert.

ESG-Integration



Das Portfolio strebte in der Berichtsperiode eine Allokation zu ESG-Laggards \leq 20% an. ESG Laggards sind Unternehmungen mit der schwächsten Umwelt-, Sozial- und Governance- Performance des relevanten Anlageuniversums.

Die historischen Vergleiche werden in nachfolgender Tabelle gemacht.

| | Indikator | Datum 2023 | Datum 2024 |
|-----------|----------------------------|------------|------------|
| Portfolio | Exposition zu ESG Laggards | 0% | 0.07% |
| Benchmark | Exposition zu ESG Laggards | 0.05% | 0.84% |

Reduktion der CO₂e-Intensität

Portfolio

CO₂e-Intensität (Sovereign)
Tonnen CO₂e / Mio. USD BIP

751

Benchmark

CO₂e-Intensität (Sovereign)
Tonnen CO₂e / Mio. USD BIP

834

Das Portfolio strebte eine tiefere CO₂e-Intensität gegenüber dem Benchmark an.
Die historischen Vergleiche werden in nachfolgender Tabelle gemacht.

| | Indikator | Datum 2023 | Datum 2024 |
|-----------|--|------------|------------|
| Portfolio | CO ₂ e-Intensität Sovereign | 796 | 751 |
| Benchmark | CO ₂ e-Intensität Sovereign | 915 | 834 |

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Dieser Teilfonds hatte in der Berichtsperiode kein Ziel nachhaltige Investitionen zu tätigen. Ein Vergleich zu früheren Perioden ist deswegen nicht möglich.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Dieser Teilfonds hatte in der Berichtsperiode kein Ziel nachhaltige Investitionen zu tätigen. Ein Vergleich zu früheren Perioden ist deswegen nicht möglich.

● **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Dieser Teilfonds hatte in der Berichtsperiode kein Ziel nachhaltige Investitionen zu tätigen. Ein Vergleich zu früheren Perioden ist deswegen nicht möglich.

● **Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:**

Dieser Teilfonds hatte in der Berichtsperiode kein Ziel nachhaltige Investitionen zu tätigen. Ein Vergleich zu früheren Perioden ist deswegen nicht möglich.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

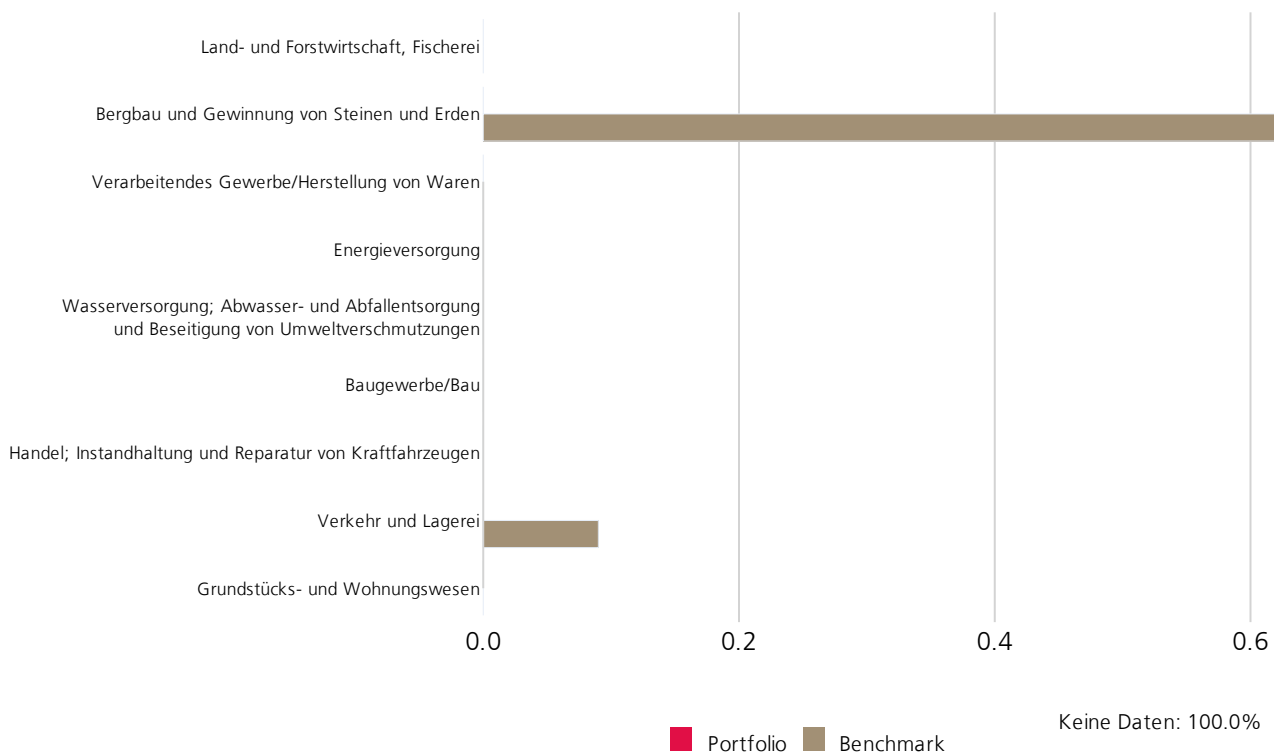
Nachteilige Nachhaltigkeitsauswirkungen (PAI) – Corporate Anlagen

Primäre Indikatoren - Energie und Emissionen

| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Benchmark Aktuell | Benchmark Vorjahr | Erklärung |
|--|--|-------------------|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|-----------|
| 1. THG-Emissionen | 1a. GHG Emissions - Scope 1 per Mio EUR Enterprise Value | 1237.7 | 1.26% | 3811 | 11647.2 | 7449.13 | |
| | 1b. GHG Emissions - Scope 2 per Mio EUR Enterprise Value | 29.71 | 1.26% | 115.72 | 693.96 | 522.59 | |
| | 1c. GHG Emissions - Scope 3 per Mio EUR Enterprise Value | 4673.18 | 1.26% | 9219.8 | 22349.3 | 9419.53 | |
| 2. CO ₂ -Fussabdruck | 2. GHG Emissions - Scope 1+2+3 per Mio EUR Enterprise Value | 16.07 | 1.26% | 58.32 | 84.4 | 78.19 | |
| 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird | 3. GHG Emissions - Emissions Intensity - Total Emissions (EUR) | 1007 | 1.45% | 1429.75 | 1972.89 | 2377.4 | |
| 4. Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind | 4. Fossil Fuel - Involvement (PAI) | 1.04% | 5.94% | 3.56% | 3.96% | 3.13% | |

| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Benchmark Aktuell | Benchmark Vorjahr | Erklärung |
|--|--|-------------------|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|---|
| 5. Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen | 5a. CR Raw - Energy use - Coal/nuclear/undear energy sources | 25% | 0.42% | 75% | 98.45% | 95.07% | |
| | 5b. Non-renewable energy consumption | 25.11% | 0.75% | 75% | 75.23% | 100% | Der Verbrauch nicht-erneuerbarer Energie umfasst den Verbrauch von Energie, die aus nicht-erneuerbaren Quellen erzeugt wird, sowie den Verbrauch von Energie aus Biomasse. Alle Zahlen zum Energieverbrauch, bei denen die Energiequelle unklar ist, sind ebenfalls in diesem Faktor enthalten. |
| | 5c. Non-renewable energy production | 5.17% | 5.47% | 13.64% | 3.93% | 5.44% | |
| 6. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren | 6. Energy consumption intensity (GWh/mEUR) | 0 | 0.33% | 0 | 0.56 | 0.46 | |

Intensität des Energieverbrauchs pro High Impact Sector (pro Mio. EUR)



| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Benchmark Aktuell | Benchmark Vorjahr | Erklärung |
|---|--|-------------------|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|-----------|
| 7. Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken | 7. Companies negatively affecting biodiversity-sensitive areas | 0% | 5.94% | 0% | 0.44% | 0.29% | |
| 8. Emissionen in Wasser | 8. CR Raw - COD emissions | 0 | 0% | 0 | 0 | 0 | |
| 9. Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle | 9. CR Raw - Hazardous waste | 0 | 0.33% | 0 | 0.02 | 0 | |

| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Benchmark Aktuell | Benchmark Vorjahr | Erklärung |
|--|--|-------------------|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|-----------|
| 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | 10. UNGC / OECD Guidelines Violation | 0% | 5.94% | 0% | 88.28% | 16.01% | |
| 11. Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen | 11. Lack of processes monitoring UNGC and OECD Guidelines compliance | 0.23% | 1.19% | 0.73% | 0.5% | 0.64% | |
| 12. Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle | 12. Unadjusted gender pay gap | 0% | 0% | 0% | 0% | 0% | |
| 13. Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen | 13. Ratio of female to male board members | 0% | 0% | 0% | 13.71% | 14.24% | |
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) | 14. Controversial weapons involvement (APM, CM, Bio, Chem) | 0% | 5.94% | 0% | 0% | 0% | |

Nachteilige Nachhaltigkeitsauswirkungen (PAI) – Staatliche und Supranationale Vermögenswerte

Primäre Indikatoren

| Umwelt | | | | | | | Erklärung |
|--------------------|-------------------|-------------------|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|-----------|
| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Benchmark Aktuell | Benchmark Vorjahr | |
| 15. GHG Intensität | 15. GHG Intensity | 870.54 | 93.99% | 928.37 | 918.19 | 1009 | |

| Sozial | | | | | | | Erklärung |
|--|---|-------------------|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|-----------|
| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Benchmark Aktuell | Benchmark Vorjahr | |
| 16. Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen | 16a. Countries subject to social violations (#) | 16 | 34.86% | 14 | 30 | 32.5 | |
| | 16b. Countries subject to social violations (%) | 35.88% | 34.86% | 35.44% | 19.61% | 22.08% | |

| Indikator | Metrik |
|-----------|---|
| 1a | Scope-1-Treibhausgas-Emissionen |
| 1b | Scope-2-Treibhausgas-Emissionen |
| 1c | Scope-3-Treibhausgas-Emissionen |
| 2. | CO2-Fussabdruck pro Mio EUR |
| 3. | THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird |
| 4. | Anteil der Investitionen in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind |
| 5a | Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung der Unternehmen, in die investiert wird, aus nicht erneuerbaren Energiequellen im Vergleich zu erneuerbaren Energiequellen, ausgedrückt in Prozent der gesamten Energiequellen |
| 5b | Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung der Unternehmen, in die investiert wird, aus nicht erneuerbaren Energiequellen im Vergleich zu erneuerbaren Energiequellen, ausgedrückt in Prozent der gesamten Energiequellen |
| 5c | Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung der Unternehmen, in die investiert wird, aus nicht erneuerbaren Energiequellen im Vergleich zu erneuerbaren Energiequellen, ausgedrückt in Prozent der gesamten Energiequellen |
| 6. | Energieverbrauch in GWh pro einer Million EUR Umsatz der Unternehmen, in die investiert wird, aufgeschlüsselt nach klimaintensiven Sektoren |
| 7. | Anteil der Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird, mit Standorten/Betrieben in oder in der Nähe von Gebieten mit schutzbedürftiger Biodiversität, sofern sich die Tätigkeiten dieser Unternehmen nachteilig auf diese Gebiete auswirken |
| 8. | Tonnen Emissionen in Wasser, die von den Unternehmen, in die investiert wird, pro investierter Million EUR verursacht werden, ausgedrückt als gewichteter Durchschnitt |
| 9. | Tonnen gefährlicher und radioaktiver Abfälle, die von den Unternehmen, in die investiert wird, pro investierter Million EUR erzeugt werden, ausgedrückt als gewichteter Durchschnitt |
| 10. | Anteil der Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird, die an Verstößen gegen die UNGC-Grundsätze oder gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen beteiligt waren |
| 11. | Anteil der Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird, die keine Richtlinien zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen oder keine Verfahren zur Bearbeitung von Beschwerden wegen Verstößen gegen die UNGC-Grundsätze und OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen eingerichtet haben |
| 12. | Durchschnittliches unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle bei den Unternehmen, in die investiert wird |
| 13. | Durchschnittliches Verhältnis von Frauen zu Männern in den Leitungs- und Kontrollorganen der Unternehmen, in die investiert wird, ausgedrückt als Prozentsatz aller Mitglieder der Leitungs- und Kontrollorgane |
| 14. | Anteil der Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird, die an der Herstellung oder am Verkauf von umstrittenen Waffen beteiligt sind |
| 15. | THG-Emissionsintensität der Länder, in die investiert wird |
| 16a | Anzahl der Länder, in die investiert wird, die nach Maßgabe internationaler Verträge und Übereinkommen, der Grundsätze der Vereinten Nationen oder, falls anwendbar, nationaler Rechtsvorschriften gegen soziale Bestimmungen verstoßen (absolute Zahl und relative Zahl, geteilt durch alle Länder, in die investiert wird) |
| 16b | Anzahl der Länder, in die investiert wird, die nach Maßgabe internationaler Verträge und Übereinkommen, der Grundsätze der Vereinten Nationen oder, falls anwendbar, nationaler Rechtsvorschriften gegen soziale Bestimmungen verstoßen (absolute Zahl und relative Zahl, geteilt durch alle Länder, in die investiert wird) |

Das Dokument wurde von Swisscanto mit geschäftsüblicher Sorgfalt erstellt und kann Informationen aus sorgfältig ausgewählten Drittquellen enthalten. Anleger sollten beachten, dass die zuvor für 2023 berechneten und veröffentlichten Daten für dieses in 2024 veröffentlichte Dokument neu berechnet wurden. Dementsprechend kann es zu Abweichungen bei diesen in den Jahren 2023 und 2024 veröffentlichten historischen Daten kommen.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 01.02.2023 - 31.01.2024

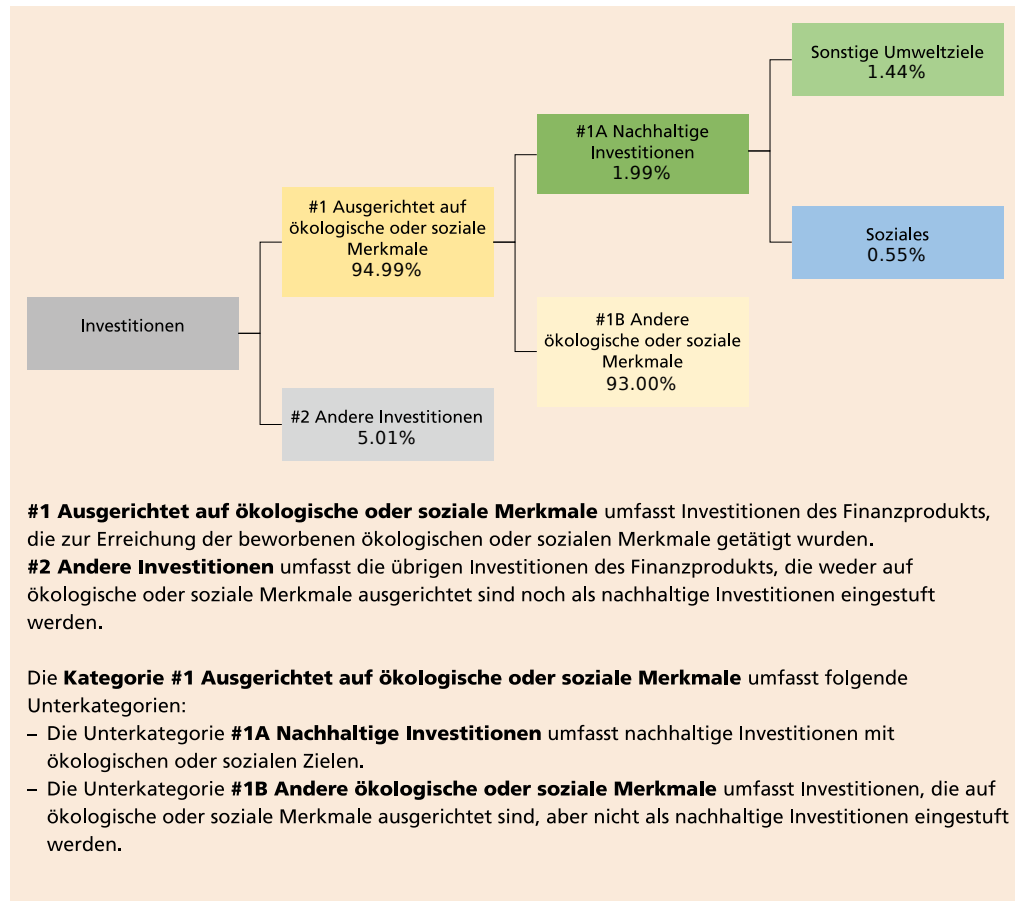
| Grösste Investitionen | Sektor | In % der Vermögenswerte | Land |
|---|---|-------------------------|--------------|
| Government of Brazil 10.0% 01-JAN-2029 | Public Administration and Defence, Compulsory Social Security | 4.04% | Brazil |
| Government of Mexico 7.75% 29-MAY-2031 | Financial and Insurance Activities | 3.97% | |
| Government of Malaysia 2.632% 15-APR-2031 | Public Administration and Defence, Compulsory Social Security | 3.67% | Malaysia |
| Government of South Africa 8.25% 31-MAR-2032 | Public Administration and Defence, Compulsory Social Security | 2.98% | South Africa |
| Government of Indonesia 7.0% 15-SEP-2030 | Public Administration and Defence, Compulsory Social Security | 2.92% | Indonesia |
| Government of Mexico 8.5% 31-MAY-2029 | Financial and Insurance Activities | 2.89% | |
| USD Cash | | 2.87% | |
| Government of South Africa 8.5% 31-JAN-2037 | Public Administration and Defence, Compulsory Social Security | 2.41% | South Africa |
| Government of the United States of America 0.0% 25-JAN-2024 | Public Administration and Defence, Compulsory Social Security | 2.38% | USA |
| Government of Poland 1.25% 25-OCT-2030 | Financial and Insurance Activities | 2.19% | |
| Government of Brazil 10.0% 01-JAN-2025 | Public Administration and Defence, Compulsory Social Security | 2.15% | Brazil |
| Government of Oman 6.25% 25-JAN-2031 REGS | Financial and Insurance Activities | 2.03% | |
| Government of Mexico 2.659% 24-MAY-2031 | Financial and Insurance Activities | 1.89% | |
| Government of Thailand 3.39% 17-JUN-2037 | Public Administration and Defence, Compulsory Social Security | 1.87% | Thailand |
| Government of Indonesia 6.125% 15-MAY-2028 | Public Administration and Defence, Compulsory Social Security | 1.80% | Indonesia |



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Der Anteil an nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen und Angaben zur Vermögensallokation werden in untenstehender Frage beantwortet.

Wie sah die Vermögensallokation aus?



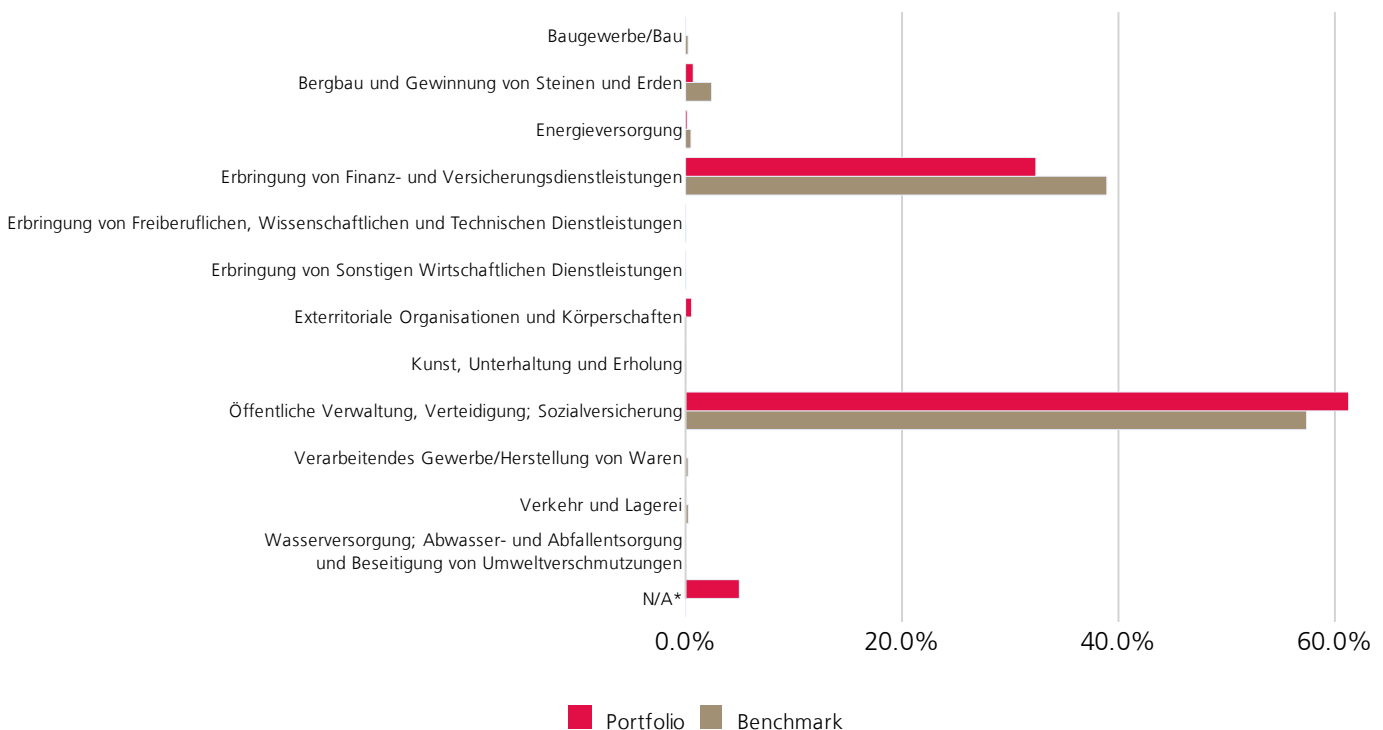
#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.
#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die **Kategorie #1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst nachhaltige Investitionen mit ökologischen oder sozialen Zielen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Wegen mangelnder Datenverfügbarkeit können Subsektoren nicht angezeigt werden.



*Diese Klassifizierung umfasst alle Bestände, für die keine NACE-Klassifizierung gefunden oder geschätzt werden kann; Liquidität ist darin enthalten.
 239/449



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Obwohl keine Investitionen getätigt wurden, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind, wird in untenstehender Grafik die Alignment der nachhaltigen Investitionen mit der EU-Taxonomie offengelegt.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomeikonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert¹?

Ja

In fossiles Gas

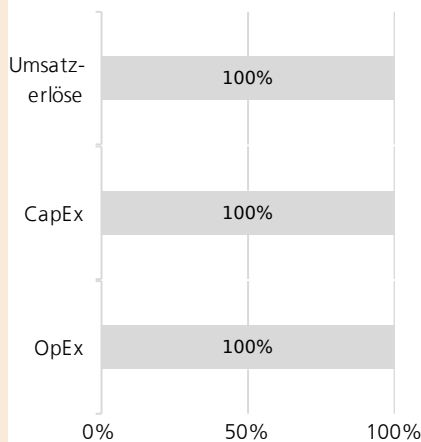
In Kernenergie

Nein

¹Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomeikonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels ("Klimaschutz") beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomeikonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

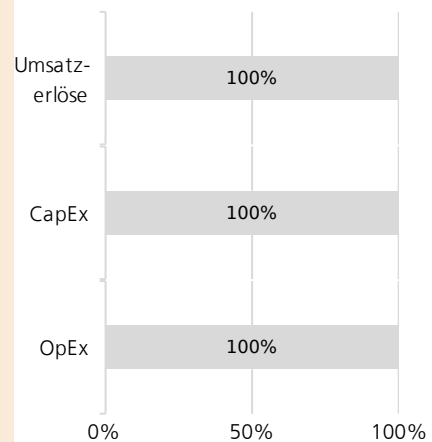
Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomeikonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzproduktes einschliesslich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzproduktes zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.

1. Taxonomiekonformität der Investitionen einschliesslich Staatsanleihen*



- Taxonomiekonform: Fossiles Gas
- Taxonomiekonform: Kernenergie
- Taxonomiekonform: (ohne fossiles Gas und Kernenergie)
- Nicht taxonomiekonform

2. Taxonomiekonformität der Investitionen ohne Staatsanleihen*



- Taxonomiekonform: Fossiles Gas
- Taxonomiekonform: Kernenergie
- Taxonomiekonform: (ohne fossiles Gas und Kernenergie)
- Nicht taxonomiekonform

Diese Grafik gibt 1.1% der Gesamtinvestitionen wieder.

*Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff "Staatsanleihen" alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Mit Blick auf die EU-Taxonomeikonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf erneuerbare Energie oder CO2-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO2-armen Alternativen gibt und die Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomeikonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:
- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

Investitionsausgaben (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, z.B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft
- **Betriebsausgaben** (Opex), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Angaben zu Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten werden in der Tabelle zusammengefasst. Wenn keine Angaben verfügbar sind, wird die Tabelle ebenfalls keine Angaben enthalten.

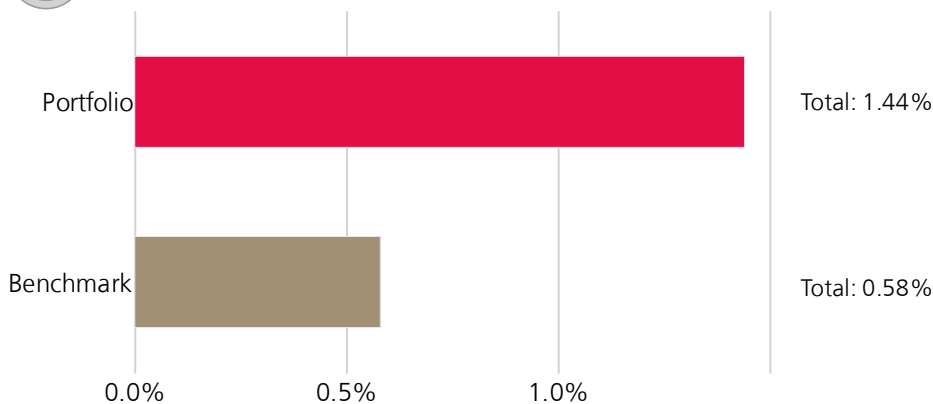
| Issuer Name | Nace Sektor | Total Eligible Activity Revenue | Total Aligned Revenue | Total Likely Aligned Revenue | Total Potentially Aligned Revenue | Portfolio Gewicht (Consol.) |
|-----------------------------|----------------------|---------------------------------|-----------------------|------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------|
| Petrobras Global Finance BV | Mining and Quarrying | 2.42% | 0.00% | 0.00% | 0.01% | 35.62% |

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**


Da im vorangegangenen Berichtsjahr keine Daten verfügbar waren, erübrigt sich ein Vorjahresvergleich.

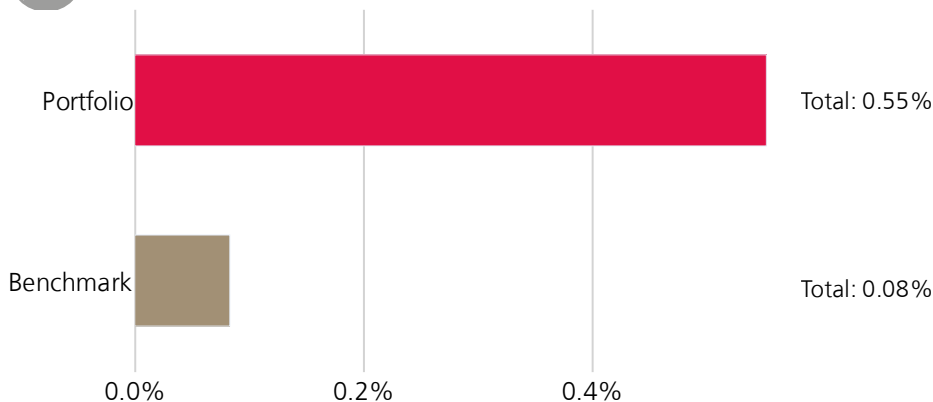
 sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.

 **Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**




Das Diagramm zeigt die prozentualen Umsätze der im Portfolio des Fonds enthaltenen Unternehmungen und der der Benchmark, welche nicht EU-Taxonomie konform, jedoch im Einklang mit den sich aus den UN Sustainable Development Goals (SDGs) ergebenden Umweltzielen gemäss Art. 2 (17) SFDR investiert worden sind.

 **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**



Das Diagramm zeigt die prozentualen Umsätze der im Portfolio des Fonds enthaltenen Unternehmungen und der der Benchmark, welche nicht EU-Taxonomie konform, jedoch im Einklang mit den sich aus den SDGs ergebenden sozialen Zielen gemäss Art. 2 (17) SFDR investiert worden sind.

 **Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

Diese Vermögenswerte haben die in der spezifischen Anlagepolitik vorgesehenen Anlagen umfasst, einschliesslich Derivate zu Absicherungszwecken und flüssige Mittel. Die Anlagen, ausgenommen Derivate und flüssige Mittel, haben die Grundsätze des ökologischen oder sozialen Mindestschutzes umgesetzt.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Im Berichtszeitraum förderte der Vermögensverwalter durch Investment Stewardship und Kapitalallokation nachhaltige Geschäftspraktiken und die Einhaltung anerkannter internationaler Prinzipien und ESG-Best-Practice-Standards. Dementsprechend stand er im Dialog mit den Managementteams der investierten Unternehmen. Darüber hinaus hat er sich im Rahmen der United Nations Collaboration Platform for Responsible Investment (UN PRI) und bei Investoreninitiativen engagiert. Das Abstimmungsverhalten basierte auf den schweizerischen und internationalen Corporate-Governance-Regeln sowie auf den Prinzipien des UN Global Compact und den 17 Zielen für nachhaltige Entwicklung (UN SDGs). Weitere Informationen finden Sie unter: Swisssanto | Proxy Voting Dashboard (issgovernance.com) <https://www.swisssanto.com/int/de/nachhaltigkeit/investment-stewardship.html>

Swisssanto | Proxy Voting Dashboard (issgovernance.com)

<https://www.swisssanto.com/int/de/nachhaltigkeit/investment-stewardship.html>



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Es wurde kein Index als Referenzwert bestimmt, um festzustellen, ob dieses Finanzprodukt auf die beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet ist.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?

Nicht anwendbar.

Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?

Nicht anwendbar.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?

Nicht anwendbar.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?

Nicht anwendbar.

Das Dokument wurde von Swisssanto mit geschäftsüblicher Sorgfalt erstellt und kann Informationen aus sorgfältig ausgewählten Drittquellen enthalten. Anleger sollten beachten, dass die zuvor für 2023 berechneten und veröffentlichten Daten für dieses in 2024 veröffentlichte Dokument neu berechnet wurden. Dementsprechend kann es zu Abweichungen bei diesen in den Jahren 2023 und 2024 veröffentlichten historischen Daten kommen.



Regelmässige Information zum 31.01.2024

Regelmässige Informationen zu den in Artikel 8, Absätze 1, 2, 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts:

Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Absolute Return

Unternehmenskennung (LEI-Code):

5493000621Y00HOW1538

Benchmark

FTSE 3-Month US Dollar Eurodeposit

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. In dieser Verordnung ist kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten festgelegt. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

| Ja | | Nein | |
|--------------------------|---|-------------------------------------|---|
| <input type="checkbox"/> | Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: _ % | <input checked="" type="checkbox"/> | Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 49.59% an nachhaltigen Investitionen |
| <input type="checkbox"/> | in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind | <input type="checkbox"/> | mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind |
| <input type="checkbox"/> | in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind | <input checked="" type="checkbox"/> | mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind |
| <input type="checkbox"/> | Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: _ % | <input checked="" type="checkbox"/> | mit einem sozialen Ziel |
| <input type="checkbox"/> | | <input type="checkbox"/> | Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt . |



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die von dem Teilfonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale wurden durch folgende Aktivitäten erreicht:

1. Ausschlusskriterien
2. ESG-Integration
3. Reduktion der CO₂e-Intensität
4. Nachhaltige Investitionen

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Aus Übersichtsgründen werden die Angaben zur Performance (siehe Details am Ende des Reports) der Nachhaltigkeitsindikatoren direkt mit dem historischen Vergleich in der nächsten Frage beantwortet.

...und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Ausschlusskriterien

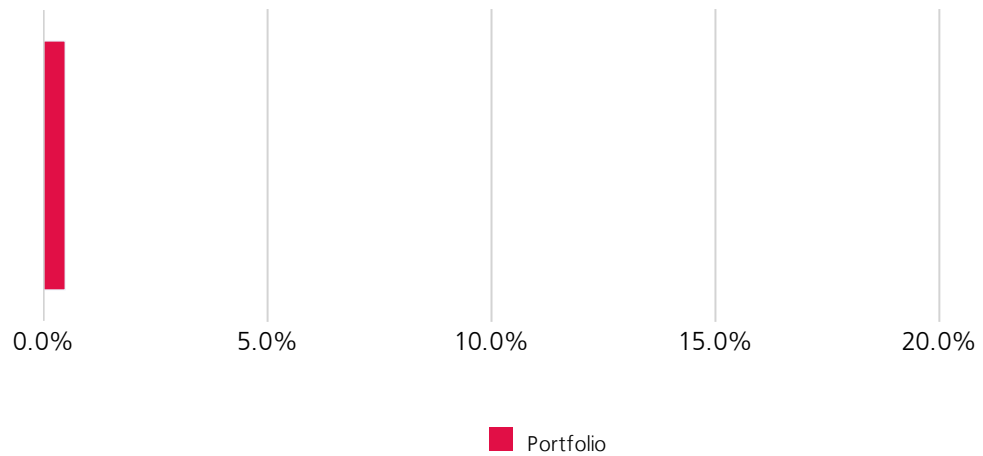
| Responsible | | Kriterien | Gewicht Portfolio | Kriterien | Gewicht Portfolio |
|---------------------------------------|--|-----------------|-------------------|---------------------------------------|--|
| Förderung von Kohle (> 5% Umsatz) | Kohlereserven (ex. Metallproduktion) | Klimawandel | 0.00% | Ausbeuterische Kinderarbeit | 0.00% |
| | | | 0.00% | | Gefährdung von Gesellschaft und Gesundheit |
| | | | | Herstellung von Pornografie | 0.00% |
| | | | | Herstellung von Waffen & Munition | 0.00% |
| | | | | Kontroverse Waffen | 0.00% |
| | | | | UN Global Compact Verstöße | 0.00% |

Zwecks Minderung der Nachhaltigkeitsrisiken und mit dem Ziel, nicht in Wertpapiere der oben aufgeführten kontroversen Geschäftsmodellen zu investieren, sind die oben genannten Ausschlusskriterien angewendet worden. Die Tabelle zeigt die jeweilige Portfolio-Exposition. Liegen bei einem Unternehmen mehrere Verstöße vor, werden diese für jedes Kriterium separat aufgeführt. Daher ist die Summe aller Positionen in diesem Bericht in der Regel höher als die effektive Allokation zu den oben abgebildeten Kriterien. Die historischen Vergleiche werden in nachfolgender Tabelle gemacht. Aus Übersichtsgründen werden die Ausschlusskriterien aggregiert.

| Indikator | Datum 2023 | Datum 2024 |
|--------------------------------------|------------|------------|
| Portfolio Ausschlusskriterien Total* | 0% | 0% |

*alle Ausschlusskriterien kumuliert.

ESG-Integration

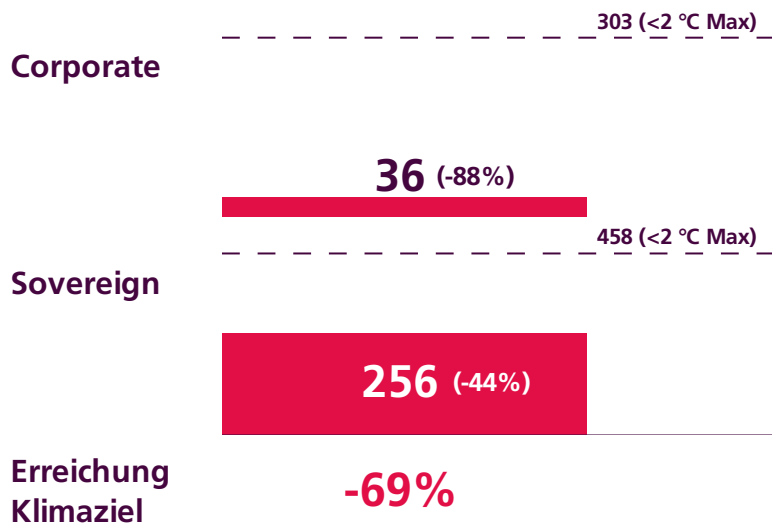


Das Portfolio strebte in der Berichtsperiode eine Allokation zu ESG-Laggards \leq 20% an. ESG Laggards sind Unternehmungen mit der schwächsten Umwelt-, Sozial- und Governance- Performance des relevanten Anlageuniversums.

Die historischen Vergleiche werden in nachfolgender Tabelle gemacht.

| | Indikator | Datum 2023 | Datum 2024 |
|-----------|----------------------------|------------|------------|
| Portfolio | Exposition zu ESG Laggards | 4.2% | 0.48% |

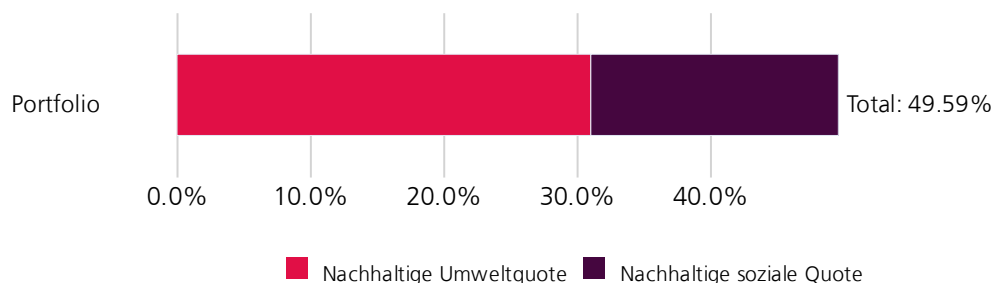
Reduktion der CO₂e-Intensität



Im Einklang mit dem < 2° Pariser Klimaziel ("<2°C Max") zielte die Investitionstätigkeit des Fonds während der Berichtsperiode darauf ab, die CO₂e-Emissionen des Portfolios, um mindestens 4 % pro Jahr zu reduzieren. Der Absenkpfad berechnet sich aus den gewichteten CO₂e-Intensitäten des Investment Universums der Benchmark, diskontiert mit 4 % pro Jahr zuzüglich des realen Wirtschaftswachstums. Die gestrichelten 2° Max-Linie zeigt den Maximalwert an. Die Balken stellen die CO₂e-Intensitäten des Portfolios dar. CO₂e-Intensitäten unterhalb der 2° Max-Linie zeigen an, dass das Portfolio das <2°-Klimaziel erfüllen. Werte bei " "Erreichung Klimaziel" " setzen das Portfolio in Relation zum Klimaziel. Negative Werte bedeuten, dass das Ziel erreicht wurde. Die historischen Vergleiche werden in nachfolgender Tabelle gemacht.

| | Indikator | Datum 2023 | Datum 2024 |
|-----------|--|------------|------------|
| Portfolio | CO ₂ e-Intensität Corporate | 61 | 36 |
| | CO ₂ e-Intensität Sovereign | 244 | 256 |
| | Erreichung Klimaziel | -70% | -69% |
| | Reduktion Corporate | -81% | -88% |
| | Reduktion Sovereign | -51% | -44% |


















Nachhaltige Investitionen



Das Diagramm zeigt die prozentualen Umsätze der im Portfolio des Fonds enthaltenen Unternehmungen, welche nicht EU-Taxonomie konform, jedoch im Einklang mit den sich aus den UN Sustainable Development Goals (SDGs) ergebenden Umwelt- und sozialen Zielen gemäss Art. 2 (17) SFDR investiert worden sind.

Der Fonds hat keine Investitionen in ökologisch nachhaltige Aktivitäten im Sinne der EU Taxonomie-Verordnung angestrebt. Der Investmentmanager des (Teil-)Fonds hat eine Methodologie zur Definition nachhaltiger Investitionen entwickelt, die den Anforderungen des Art. 2 (17) SFDR entspricht. Die Methodologie ist detailliert in den Vorvertraglichen Informationen beschrieben. Die Aufteilung der nachhaltigen Investitionen in UN SDGs werden in folgender Grafik gemacht. Die historischen Vergleiche werden in nachfolgender Tabelle gemacht.

| | Indikator | Datum 2023 | Datum 2024 |
|-----------|---|---------------|---------------|
| Portfolio | Anteil nachhaltige Investitionen mit Umweltziel | 47.76% | 31% |
| | Anteil sozial nachhaltige Investitionen | 26.7% | 18.59% |
| | Total nachhaltige Quote | 74.46% | 49.59% |

| | | | | | |
|---|-------|---|--------|---|---------------|
| 1  Keine Armut | 2.25% | 7  Bezahlbare und saubere Energie | 12.82% | 13  Massnahmen zum Klimaschutz | 0.00% |
| 2  Kein Hunger | 0.23% | 8  Menschenwürdige Arbeit und Wirtschaftswachstum | 3.96% | 14  Leben unter Wasser | 0.68% |
| 3  Gesundheit und Wohlergehen | 7.61% | 9  Industrie, Innovation und Infrastruktur | 5.01% | 15  Leben an Land | 0.39% |
| 4  Hochwertige Bildung | 0.31% | 10  Weniger Ungleichheiten | 0.00% | 16  Frieden, Gerechtigkeit und starke Institutionen | 0.00% |
| 5  Geschlechtergleichheit | 0.03% | 11  Nachhaltige Städte und Gemeinden | 7.33% | 17  Partnerschaften zur Erreichung der Ziele | 1.26% |
| 6  Sauberes Wasser und Sanitäreinrichtungen | 1.77% | 12  Nachhaltige/r Konsum und Produktion | 0.65% | Total | 44.32% |

■ Portfolio

Aufgrund der unterschiedlichen Behandlung von Green, Social und Sustainable Bonds kann das SDG-Exposure von den prozentualen Umsätzen der im Portfolio des Fonds enthaltenen Unternehmungen und den der Benchmark, welche im Einklang mit den sich aus den SDGs ergebenden Umweltzielen gemäss Art. 2 (17) SFDR investiert worden sind, abweichen.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Im Berichtszeitraum konzentrierte sich der Vermögensverwalter auf Wertpapiere von Unternehmen, welche Umsätze aus dem Verkauf von Produkten und Dienstleistungen mit einem positiven Beitrag zu den 17 SDGs erzielten und dabei keine DNSH- und/oder Minimum Safeguards-Verletzungen aufgewiesen haben.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Emittenten mit einem negativen Nettobeitrag zu den SDGs wurden in der Berichtsperiode aus dem Anlageuniversum des Finanzproduktes entfernt. Darüber hinaus berücksichtigte der Teilfonds nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (engl: Principal Adverse Impacts - PAI). Zu diesem Zweck wurden die obligatorischen Indikatoren Anhang 1 der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1288 zur Ergänzung der Verordnung (EU) 2019/2088 zugrunde gelegt. Unternehmen, die der Vermögensverwalter gemäss PAI als besonders schädlich einstufte, wurden entsprechend nicht zu den nachhaltigen Anlagen gezählt. Emittenten, welche die PAIs 7 (Biodiversität), 10 (Global Compact der Vereinten Nationen (UNGC)/OECD Leitsätze für multinationale Unternehmen) oder 14 (Engagement in umstrittenen Waffen) verletzen, haben einen PAI-Score von null erhalten. Aus den restlichen PAI-Indikatoren wurde ein PAI-Score berechnet. Instrumente von Emittenten mit einem Score < 10 wurden nicht den nachhaltigen Investitionen angerechnet.

● **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Die nachteiligen Auswirkungen (PAI) sind systematisch im Anlageprozess berücksichtigt worden.

● **Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:**

Bei der Anlageanalyse für nachhaltige Investitionen wurden in der Berichtsperiode die folgenden Normverletzungen berücksichtigt: Global Compact der Vereinten Nationen (UNGC), die UN Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte (UNGP) und das Übereinkommen der Internationalen Arbeitsorganisation (ILO). Jeder schwerwiegende Verstoß gegen diese Normen führte zum Ausschluss des Emittenten aus dem investierbaren Universum des Finanzprodukts.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

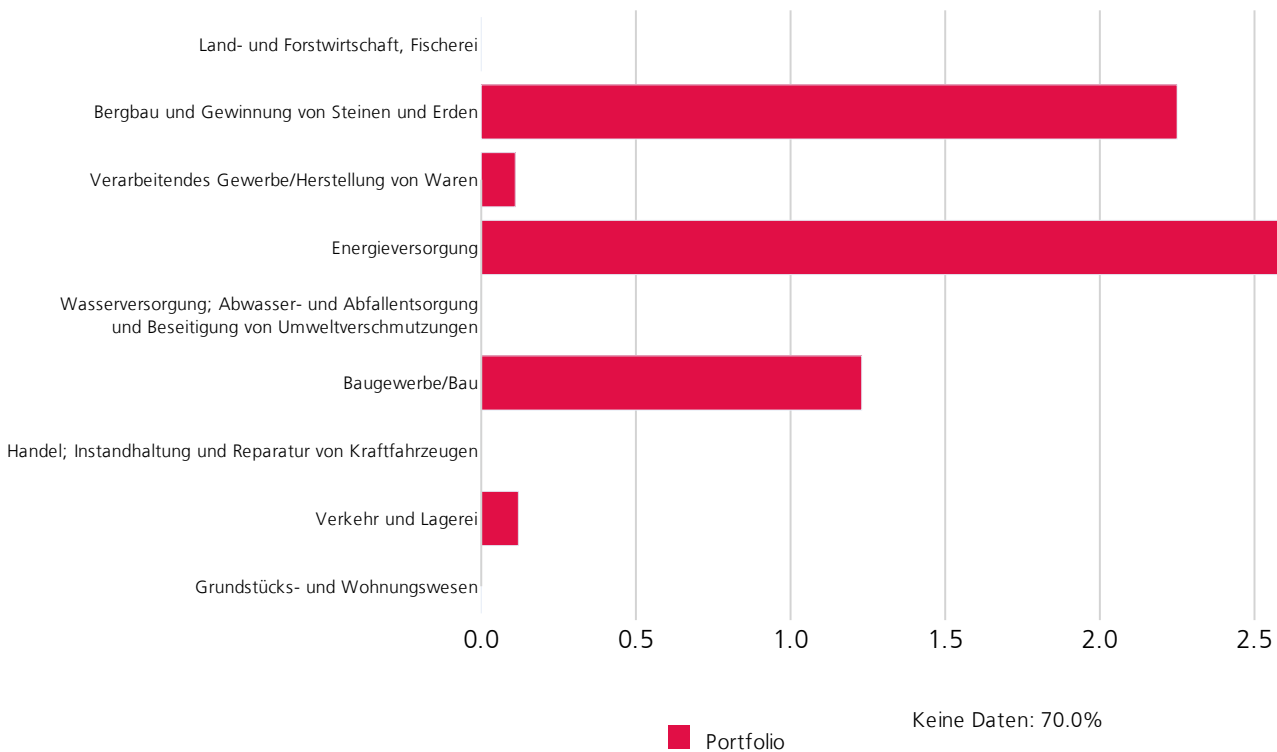
Nachteilige Nachhaltigkeitsauswirkungen (PAI) – Corporate Anlagen

Primäre Indikatoren - Energie und Emissionen

| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Erklärung |
|--|--|-------------------|-----------|-------------------|-----------|
| 1. THG-Emissionen | 1a. GHG Emissions - Scope 1 per Mio EUR Enterprise Value | 2091.66 | 38.1% | 3274.39 | |
| | 1b. GHG Emissions - Scope 2 per Mio EUR Enterprise Value | 643.47 | 38.1% | 1372.62 | |
| | 1c. GHG Emissions - Scope 3 per Mio EUR Enterprise Value | 29452 | 38.1% | 54761.3 | |
| 2. CO ₂ -Fussabdruck | 2. GHG Emissions - Scope 1+2+3 per Mio EUR Enterprise Value | 105.8 | 38.1% | 201.8 | |
| 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird | 3. GHG Emissions - Emissions Intensity - Total Emissions (EUR) | 60.65 | 39.38% | 112.49 | |
| 4. Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind | 4. Fossil Fuel - Involvement (PAI) | 3% | 42.51% | 4.22% | |

| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Erklärung |
|--|---|-------------------|-----------|-------------------|---|
| 5. Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen | 5a. CR Raw - Energy use - Coal/nuclear/unclear energy sources | 55.29% | 6.88% | 53.31% | |
| | 5b. Non-renewable energy consumption | 56.85% | 11.65% | 69.93% | Der Verbrauch nicht-erneuerbarer Energie umfasst den Verbrauch von Energie, die aus nicht-erneuerbaren Quellen erzeugt wird, sowie den Verbrauch von Energie aus Biomasse. Alle Zahlen zum Energieverbrauch, bei denen die Energiequelle unklar ist, sind ebenfalls in diesem Faktor enthalten. |
| | 5c. Non-renewable energy production | 1.23% | 41.22% | 0.28% | |
| 6. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren | 6. Energy consumption intensity (GWh/mEUR) | 0.27 | 21.95% | 0.23 | |

Intensität des Energieverbrauchs pro High Impact Sector (pro Mio. EUR)



| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Erklärung |
|---|--|-------------------|-----------|-------------------|-----------|
| 7. Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken | 7. Companies negatively affecting biodiversity-sensitive areas | 0.21% | 42.98% | 0.1% | |
| 8. Emissionen in Wasser | 8. CR Raw - COD emissions | 5.01 | 0.65% | 7.14 | |
| 9. Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle | 9. CR Raw - Hazardous waste | 0.02 | 3.91% | 0 | |

| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Erklärung |
|--|--|-------------------|-----------|-------------------|-----------|
| 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | 10. UNGC / OECD Guidelines Violation | 0% | 42.98% | 0% | |
| 11. Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen | 11. Lack of processes monitoring UNGC and OECD Guidelines compliance | 5.14% | 34.39% | 5.87% | |
| 12. Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle | 12. Unadjusted gender pay gap | 0.45% | 5.43% | 0.45% | |
| 13. Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen | 13. Ratio of female to male board members | 67.21% | 26.04% | 57.34% | |
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) | 14. Controversial weapons involvement (APM, CM, Bio, Chem) | 0% | 42.98% | 0% | |

Nachteilige Nachhaltigkeitsauswirkungen (PAI) – Staatliche und Supranationale Vermögenswerte

Primäre Indikatoren

| Umwelt | | | | | |
|--|---|-------------------|-----------|-------------------|-----------|
| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Erklärung |
| 15. GHG Intensität | 15. GHG Intensity | 308.38 | 39.77% | 289.45 | |
| Sozial | | | | | |
| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Erklärung |
| 16. Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen | 16a. Countries subject to social violations (#) | 3.75 | 8.75% | 5.25 | |
| | 16b. Countries subject to social violations (%) | 9.17% | 8.75% | 15% | |
| Indikator | Metrik | | | | |
| 1a | Scope-1-Treibhausgas-Emissionen | | | | |
| 1b | Scope-2-Treibhausgas-Emissionen | | | | |
| 1c | Scope-3-Treibhausgas-Emissionen | | | | |
| 2. | CO2-Fussabdruck pro Mio EUR | | | | |
| 3. | THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird | | | | |
| 4. | Anteil der Investitionen in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind | | | | |
| 5a | Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung der Unternehmen, in die investiert wird, aus nicht erneuerbaren Energiequellen im Vergleich zu erneuerbaren Energiequellen, ausgedrückt in Prozent der gesamten Energiequellen | | | | |
| 5b | Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung der Unternehmen, in die investiert wird, aus nicht erneuerbaren Energiequellen im Vergleich zu erneuerbaren Energiequellen, ausgedrückt in Prozent der gesamten Energiequellen | | | | |
| 5c | Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung der Unternehmen, in die investiert wird, aus nicht erneuerbaren Energiequellen im Vergleich zu erneuerbaren Energiequellen, ausgedrückt in Prozent der gesamten Energiequellen | | | | |
| 6. | Energieverbrauch in GWh pro einer Million EUR Umsatz der Unternehmen, in die investiert wird, aufgeschlüsselt nach klimaintensiven Sektoren | | | | |
| 7. | Anteil der Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird, mit Standorten/Betrieben in oder in der Nähe von Gebieten mit schutzbedürftiger Biodiversität, sofern sich die Tätigkeiten dieser Unternehmen nachteilig auf diese Gebiete auswirken | | | | |
| 8. | Tonnen Emissionen in Wasser, die von den Unternehmen, in die investiert wird, pro investierter Million EUR verursacht werden, ausgedrückt als gewichteter Durchschnitt | | | | |
| 9. | Tonnen gefährlicher und radioaktiver Abfälle, die von den Unternehmen, in die investiert wird, pro investierter Million EUR erzeugt werden, ausgedrückt als gewichteter Durchschnitt | | | | |
| 10. | Anteil der Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird, die an Verstößen gegen die UNGC-Grundsätze oder gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen beteiligt waren | | | | |
| 11. | Anteil der Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird, die keine Richtlinien zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen oder keine Verfahren zur Bearbeitung von Beschwerden wegen Verstößen gegen die UNGC-Grundsätze und OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen eingerichtet haben | | | | |
| 12. | Durchschnittliches unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle bei den Unternehmen, in die investiert wird | | | | |
| 13. | Durchschnittliches Verhältnis von Frauen zu Männern in den Leitungs- und Kontrollorganen der Unternehmen, in die investiert wird, ausgedrückt als Prozentsatz aller Mitglieder der Leitungs- und Kontrollorgane | | | | |
| 14. | Anteil der Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird, die an der Herstellung oder am Verkauf von umstrittenen Waffen beteiligt sind | | | | |
| 15. | THG-Emissionsintensität der Länder, in die investiert wird | | | | |
| 16a | Anzahl der Länder, in die investiert wird, die nach Maßgabe internationaler Verträge und Übereinkommen, der Grundsätze der Vereinten Nationen oder, falls anwendbar, nationaler Rechtsvorschriften gegen soziale Bestimmungen verstoßen (absolute Zahl und relative Zahl, geteilt durch alle Länder, in die investiert wird) | | | | |
| 16b | Anzahl der Länder, in die investiert wird, die nach Maßgabe internationaler Verträge und Übereinkommen, der Grundsätze der Vereinten Nationen oder, falls anwendbar, nationaler Rechtsvorschriften gegen soziale Bestimmungen verstoßen (absolute Zahl und relative Zahl, geteilt durch alle Länder, in die investiert wird) | | | | |

Das Dokument wurde von Swisscanto mit geschäftsüblicher Sorgfalt erstellt und kann Informationen aus sorgfältig ausgewählten Drittquellen enthalten. Anleger sollten beachten, dass die zuvor für 2023 berechneten und veröffentlichten Daten für dieses in 2024 veröffentlichte Dokument neu berechnet wurden. Dementsprechend kann es zu Abweichungen bei diesen in den Jahren 2023 und 2024 veröffentlichten historischen Daten kommen.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 01.02.2023 - 31.01.2024

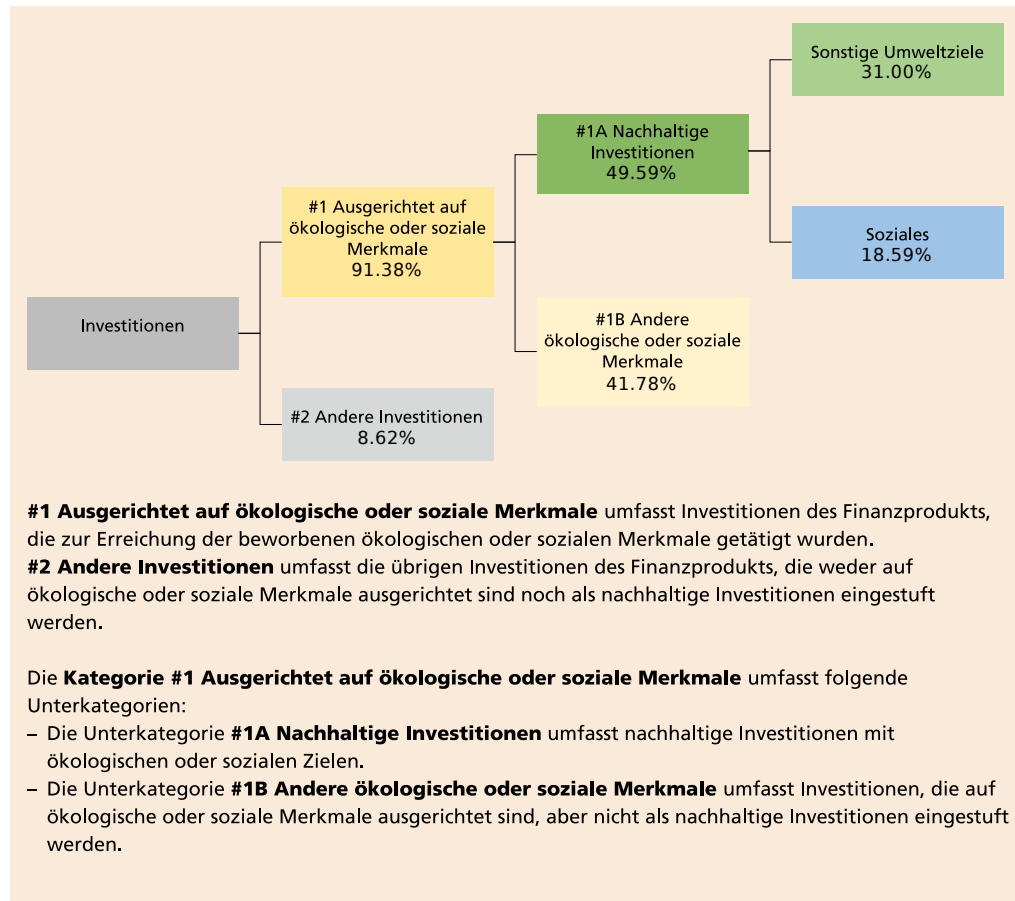
| Grösste Investitionen | Sektor | In % der Vermögenswerte | Land |
|---|---|-------------------------|--------------|
| USD Cash | | 2.62% | |
| International Bank for Reconstruction & Development 4.25% 22-JAN-2026 | Financial and Insurance Activities | 1.88% | |
| Government of Norway 3.5% 06-OCT-2042 | Public Administration and Defence, Compulsory Social Security | 1.81% | Norway |
| Corp Andina de Fomento 6.82% 22-FEB-2031 REGS | Activities of Extraterritorial Organisations and Bodies | 1.61% | Venezuela |
| KommuneKredit 0.5% 28-JAN-2026 REGS | Public Administration and Defence, Compulsory Social Security | 1.55% | Denmark |
| Government of South Africa 8.0% 31-JAN-2030 | Public Administration and Defence, Compulsory Social Security | 1.48% | South Africa |
| EUR Cash | | 1.47% | |
| Government of New Zealand 2.5% 20-SEP-2035 | Public Administration and Defence, Compulsory Social Security | 1.32% | |
| Inter-American Development Bank 3.5% 12-APR-2033 | Activities of Extraterritorial Organisations and Bodies | 1.32% | USA |
| Future Option Call on ERM4 Comdty, 17.06.2024, 97.500 | | 1.26% | |
| International Bank for Reconstruction & Development 5% 22-JAN-2026 | Financial and Insurance Activities | 1.25% | |
| Government of Mexico 8.5% 31-MAY-2029 | Financial and Insurance Activities | 1.23% | |
| Government of Germany 0.0% 15-AUG-2050 REGS | Financial and Insurance Activities | 1.07% | |
| ZKB Tracker-Zertifikat (Dynamisch) auf Long-Short Bond-Futures Basket 'Systematic Global Rates' | | 1.07% | |
| Government of the United States of America 0.125% 15-APR-2027 | Public Administration and Defence, Compulsory Social Security | 1.01% | USA |



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Der Anteil an nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen und Angaben zur Vermögensallokation werden in untenstehender Frage beantwortet.

Wie sah die Vermögensallokation aus?



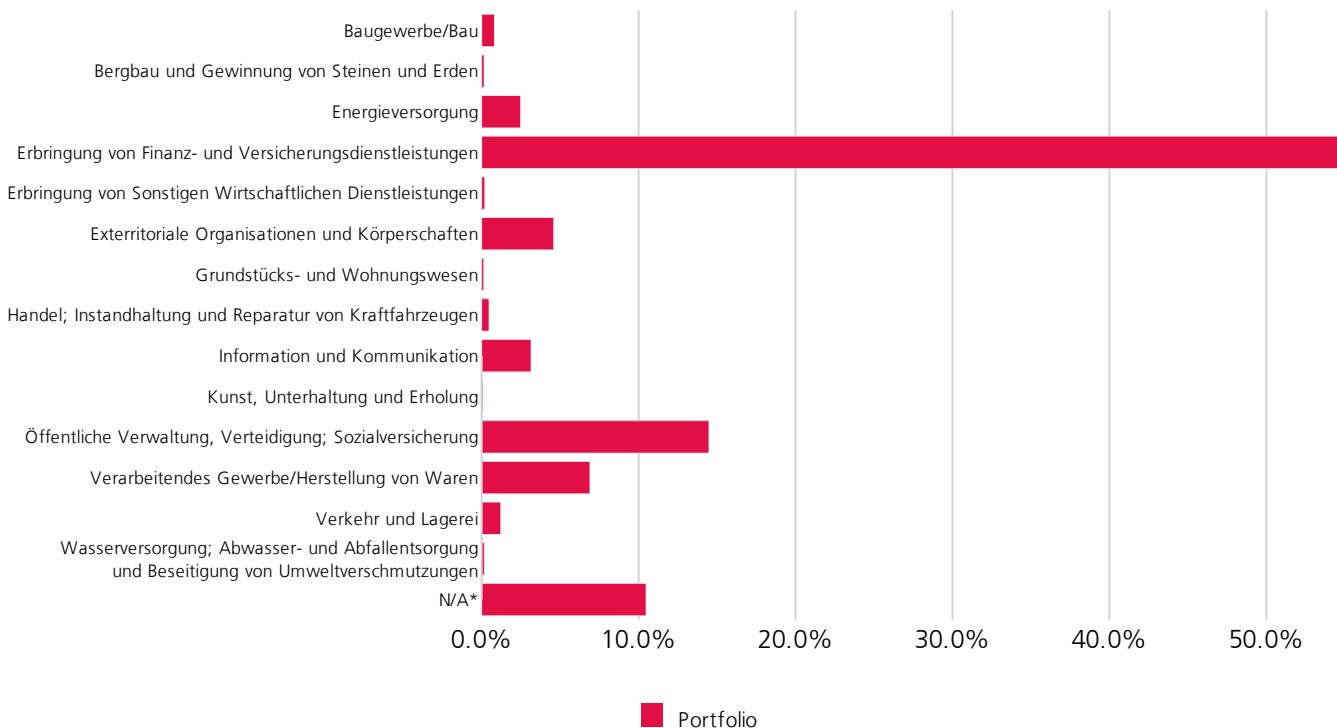
#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.
#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die **Kategorie #1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst nachhaltige Investitionen mit ökologischen oder sozialen Zielen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Wegen mangelnder Datenverfügbarkeit können Subsektoren nicht angezeigt werden.



*Diese Klassifizierung umfasst alle Bestände, für die keine NACE-Klassifizierung gefunden oder geschätzt werden kann; Liquidität ist darin enthalten.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Obwohl keine Investitionen getätigt wurden, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind, wird in untenstehender Grafik die Alignierung der nachhaltigen Investitionen mit der EU-Taxonomie offengelegt.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomeikonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert¹?

Ja

In fossiles Gas

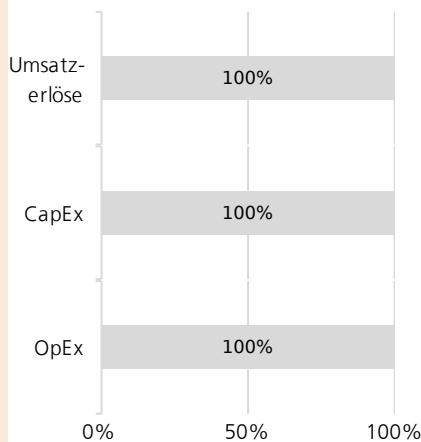
In Kernenergie

Nein

¹Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomeikonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels ("Klimaschutz") beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomeikonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

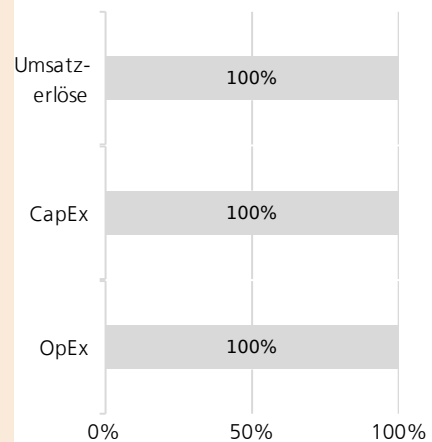
Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomeikonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzproduktes einschliesslich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzproduktes zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.

1. Taxonomiekonformität der Investitionen einschliesslich Staatsanleihen*



- Taxonomiekonform: Fossiles Gas
- Taxonomiekonform: Kernenergie
- Taxonomiekonform: (ohne fossiles Gas und Kernenergie)
- Nicht taxonomiekonform

2. Taxonomiekonformität der Investitionen ohne Staatsanleihen*



- Taxonomiekonform: Fossiles Gas
- Taxonomiekonform: Kernenergie
- Taxonomiekonform: (ohne fossiles Gas und Kernenergie)
- Nicht taxonomiekonform

Diese Grafik gibt 55.5% der Gesamtinvestitionen wieder.

*Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff "Staatsanleihen" alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Mit Blick auf die EU-Taxonomeikonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf erneuerbare Energie oder CO2-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO2-armen Alternativen gibt und die Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomeikonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:
- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

Investitionsausgaben (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, z.B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft
- **Betriebsausgaben** (Opex), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Angaben zu Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten werden in der Tabelle zusammengefasst. Wenn keine Angaben verfügbar sind, wird die Tabelle ebenfalls keine Angaben enthalten.

| Issuer Name | Nace Sektor | Total Eligible Activity Revenue | Total Aligned Revenue | Total Likely Aligned Revenue | Total Potentially Aligned Revenue | Portfolio Gewicht (Consol.) |
|-----------------------------|---|---------------------------------|-----------------------|------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------|
| Orsted | Electricity, Gas, Steam and Air Conditioning Supply | 56.27% | 18.25% | 31.86% | 0.00% | 1.08% |
| EDP-Energias de Portugal SA | Electricity, Gas, Steam and Air Conditioning Supply | 77.52% | 12.25% | 0.00% | 32.43% | 0.34% |
| EDP Finance BV | Electricity, Gas, Steam and Air Conditioning Supply | 77.52% | 12.25% | 0.00% | 32.43% | 0.22% |
| CTP N.V. | Real Estate Activities | 100.00% | 11.60% | 0.00% | 0.00% | 0.23% |
| VERBUND AG Class A | Electricity, Gas, Steam and Air Conditioning Supply | 50.94% | 11.23% | 36.58% | 0.00% | 0.18% |
| Electricite de France SA | Electricity, Gas, Steam and Air Conditioning Supply | 71.56% | 9.50% | 0.00% | 7.23% | 0.08% |
| Iberdrola International BV | Electricity, Gas, Steam and Air Conditioning Supply | 61.60% | 9.13% | 0.00% | 15.60% | 1.03% |
| Neste Corporation | Manufacturing | 36.90% | 7.25% | 5.60% | 22.41% | 0.13% |
| Enel SpA | Electricity, Gas, Steam and Air Conditioning Supply | 33.21% | 5.35% | 0.00% | 8.48% | 0.12% |
| ENGIE SA. | Electricity, Gas, Steam and Air Conditioning Supply | 32.14% | 3.75% | 0.00% | 8.00% | 0.23% |

Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?


Da im vorangegangenen Berichtsjahr keine Daten verfügbar waren, erübrigt sich ein Vorjahresvergleich.

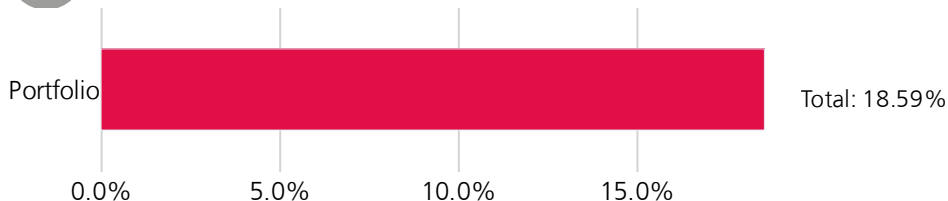
 sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.

 **Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**




Das Diagramm zeigt die prozentualen Umsätze der im Portfolio des Fonds enthaltenen Unternehmungen, welche nicht EU-Taxonomie konform, jedoch im Einklang mit den sich aus den SDGs ergebenden Umweltzielen gemäss Art. 2 (17) SFDR investiert worden sind.

 **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**



Das Diagramm zeigt die prozentualen Umsätze der im Portfolio des Fonds enthaltenen Unternehmungen und der der Benchmark, welche nicht EU-Taxonomie konform, jedoch im Einklang mit den sich aus den SDGs ergebenden sozialen Zielen gemäss Art. 2 (17) SFDR investiert worden sind.

 **Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

Diese Vermögenswerte haben die in der spezifischen Anlagepolitik vorgesehenen Anlagen umfasst, einschliesslich Derivate zu Absicherungszwecken und flüssige Mittel. Die Anlagen, ausgenommen Derivate und flüssige Mittel, haben die Grundsätze des ökologischen oder sozialen Mindestschutzes umgesetzt.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Im Berichtszeitraum förderte der Vermögensverwalter durch Investment Stewardship und Kapitalallokation nachhaltige Geschäftspraktiken und die Einhaltung anerkannter internationaler Prinzipien und ESG-Best-Practice-Standards. Dementsprechend stand er im Dialog mit den Managementteams der investierten Unternehmen. Darüber hinaus hat er sich im Rahmen der United Nations Collaboration Platform for Responsible Investment (UN PRI) und bei Investoreninitiativen engagiert. Das Abstimmungsverhalten basierte auf den schweizerischen und internationalen Corporate-Governance-Regeln sowie auf den Prinzipien des UN Global Compact und den 17 Zielen für nachhaltige Entwicklung (UN SDGs). Weitere Informationen finden Sie unter: Swisscanto | Proxy Voting Dashboard (issgovernance.com) <https://www.swisscanto.com/int/de/nachhaltigkeit/investment-stewardship.html>

Swisscanto | Proxy Voting Dashboard (issgovernance.com)

<https://www.swisscanto.com/int/de/nachhaltigkeit/investment-stewardship.html>



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Es wurde kein Index als Referenzwert bestimmt, um festzustellen, ob dieses Finanzprodukt auf die beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet ist.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?

Nicht anwendbar.

Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?

Nicht anwendbar.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?

Nicht anwendbar.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?

Nicht anwendbar.

Das Dokument wurde von Swisscanto mit geschäftsüblicher Sorgfalt erstellt und kann Informationen aus sorgfältig ausgewählten Drittquellen enthalten. Anleger sollten beachten, dass die zuvor für 2023 berechneten und veröffentlichten Daten für dieses in 2024 veröffentlichte Dokument neu berechnet wurden. Dementsprechend kann es zu Abweichungen bei diesen in den Jahren 2023 und 2024 veröffentlichten historischen Daten kommen.



Regelmässige Information zum 31.01.2024

Regelmässige Informationen zu den in Artikel 8, Absätze 1, 2, 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts:

Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Convertible Hedged

Unternehmenskennung (LEI-Code):

549300BEZ1CJCP4C0A88

Benchmark

Thomson Reuters Global Focus Convertible Index (TR) hedged in USD

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. In dieser Verordnung ist kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten festgelegt. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

| Ja | | Nein | |
|--------------------------|---|-------------------------------------|--|
| <input type="checkbox"/> | Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: _ % | <input checked="" type="checkbox"/> | Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 34.3% an nachhaltigen Investitionen |
| <input type="checkbox"/> | in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind | <input type="checkbox"/> | mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind |
| <input type="checkbox"/> | in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind | <input checked="" type="checkbox"/> | mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind |
| <input type="checkbox"/> | Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: _ % | <input checked="" type="checkbox"/> | mit einem sozialen Ziel |
| <input type="checkbox"/> | | <input type="checkbox"/> | Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt . |



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die von dem Teilfonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale wurden durch folgende Aktivitäten erreicht:

1. Ausschlusskriterien
2. ESG-Integration
3. Reduktion der CO₂e-Intensität
4. Nachhaltige Investitionen

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Aus Übersichtsgründen werden die Angaben zur Performance (siehe Details am Ende des Reports) der Nachhaltigkeitsindikatoren direkt mit dem historischen Vergleich in der nächsten Frage beantwortet.

...und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Ausschlusskriterien

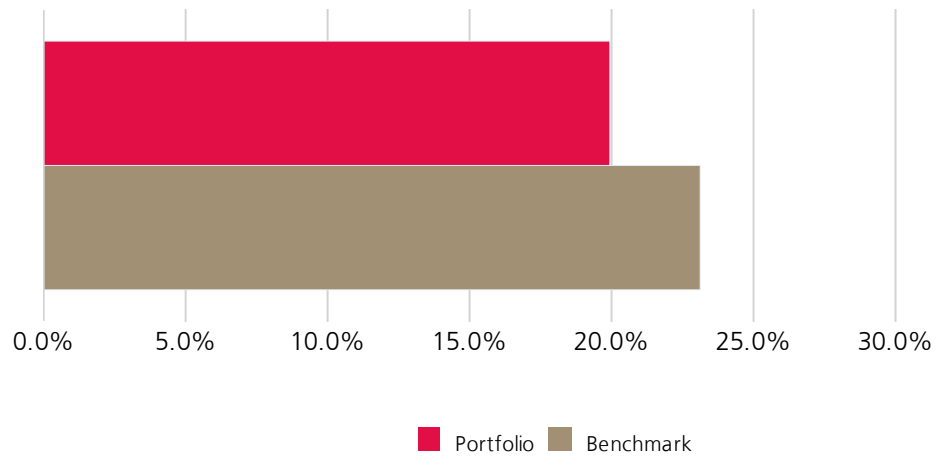
| Responsible | | | | | | | |
|--------------------------------------|-------------------|--|------------------------------|---|-------------------|-------------------|------------------------------|
| Kriterien | Gewicht Portfolio | Gewicht Benchmark | Anzahl Unternehmen Benchmark | Kriterien | Gewicht Portfolio | Gewicht Benchmark | Anzahl Unternehmen Benchmark |
| Kohlereserven (ex. Metallproduktion) | 0.00% | 1.57% | 2 | Herstellung von Kriegstechnik (> 5% Umsatz) | 0.00% | 2.05% | 2 |
| Förderung von Kohle (> 5% Umsatz) | 0.00% | 0.10% | 0 | UN Global Compact Verstöße | 0.00% | 0.71% | 2 |
| Klimawandel | | Gefährdung von Gesellschaft und Gesundheit | | Herstellung von Waffen & Munition | 0.00% | 0.19% | 1 |
| | | | | Ausbeuterische Kinderarbeit | 0.00% | 0.00% | 0 |
| | | | | Herstellung von Pornografie | 0.00% | 0.00% | 0 |
| | | | | Kontroverse Waffen | 0.00% | 0.00% | 0 |

Zwecks Minderung der Nachhaltigkeitsrisiken und mit dem Ziel, nicht in Wertpapiere der oben aufgeführten kontroversen Geschäftsmodellen zu investieren, sind die oben genannten Ausschlusskriterien angewendet worden. Die Tabelle zeigt die Anzahl der Unternehmen, die gegen die Ausschlusskriterien verstossen haben, sowie die jeweilige Portfolio- und Benchmark-Exposition. Liegen bei einem Unternehmen mehrere Verstöße vor, werden diese für jedes Kriterium separat aufgeführt. Daher ist die Summe aller Positionen in diesem Bericht in der Regel höher als die effektive Allokation zu den oben abgebildeten Kriterien. Die historischen Vergleiche werden in nachfolgender Tabelle gemacht. Aus Übersichtsgründen werden die Ausschlusskriterien aggregiert.

| | Indikator | Datum 2023 | Datum 2024 |
|-----------|----------------------------|------------|------------|
| Portfolio | Ausschlusskriterien Total* | 0% | 0% |
| Benchmark | Ausschlusskriterien Total* | 1.75% | 4.53% |

*alle Ausschlusskriterien kumuliert.

ESG-Integration

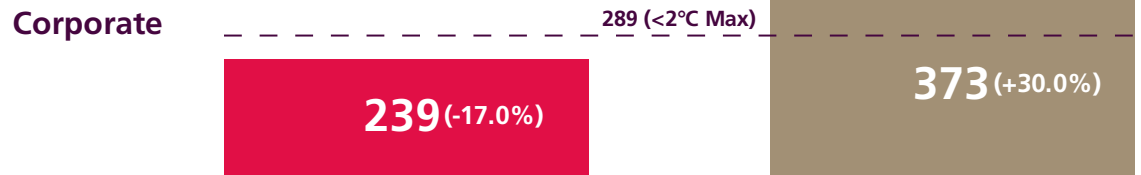


Das Portfolio strebte in der Berichtsperiode im Vergleich zur Benchmark eine geringere Exposition zu ESG-Laggards an. ESG-Laggards sind Unternehmungen mit der schwächsten Umwelt-, Sozial und Governance- Performance des relevanten Anlageuniversums.

Die historischen Vergleiche werden in nachfolgender Tabelle gemacht.

| | Indikator | Datum 2023 | Datum 2024 |
|-----------|----------------------------|------------|------------|
| Portfolio | Exposition zu ESG Laggards | 27.54% | 19.94% |
| Benchmark | Exposition zu ESG Laggards | 31.91% | 23.12% |

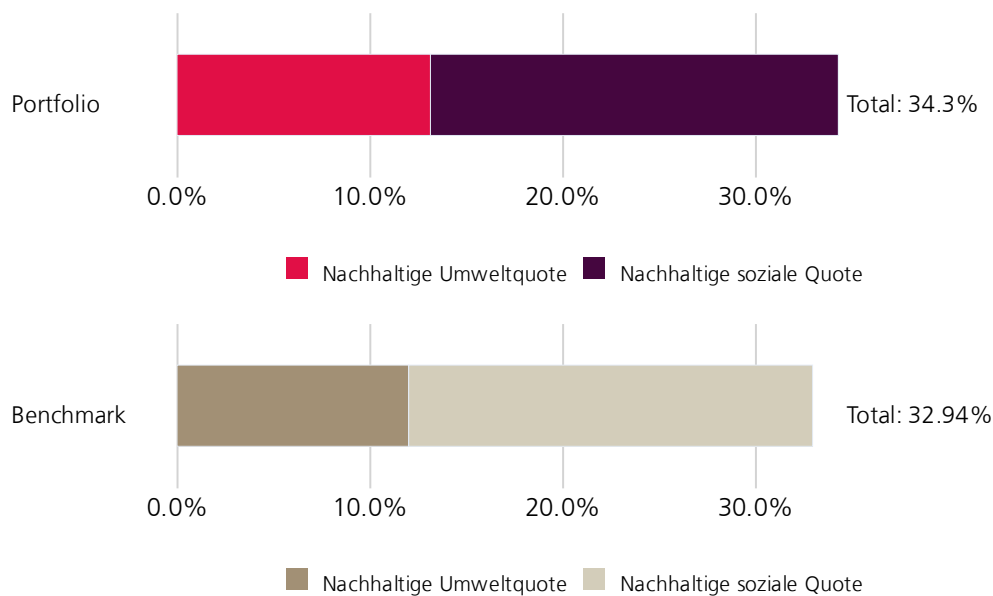
Reduktion der CO₂e-Intensität



Im Einklang mit dem < 2° Pariser Klimaziel ("<2°C Max") zielte die Investitionstätigkeit des Fonds während der Berichtsperiode darauf ab, die CO₂e-Emissionen des Portfolios, um mindestens 4 % pro Jahr zu reduzieren. Der Absenkpfad berechnet sich aus den gewichteten CO₂e-Intensitäten der Benchmark, diskontiert mit 4 % pro Jahr zuzüglich des realen Wirtschaftswachstums. Die gestrichelten 2° Max-Linie zeigt den Maximalwert an. Die Balken stellen die CO₂e-Intensitäten des Portfolios und der Benchmark dar. CO₂e-Intensitäten unterhalb der 2° Max-Linie zeigen an, dass das Portfolio oder die Benchmark das <2°-Klimaziel erfüllen. Werte bei "Erreichung Klimaziel" setzen das Portfolio und die Benchmark in Relation zum Klimaziel. Negative Werte bedeuten, dass das Ziel erreicht wurde. Die historischen Vergleiche werden in nachfolgender Tabelle gemacht.

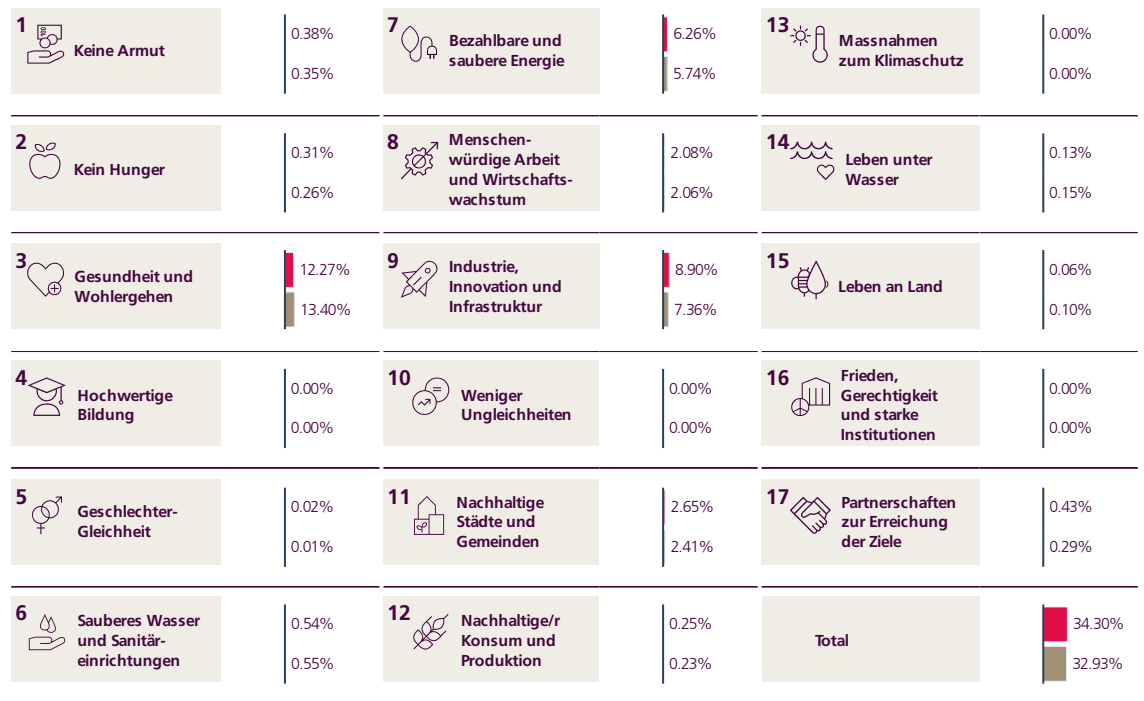
| | Indikator | Datum 2023 | Datum 2024 |
|-----------|--|------------|------------|
| Portfolio | CO ₂ e-Intensität Corporate | 168 | 239 |
| | Reduktion Corporate | -1% | -17% |
| Benchmark | CO ₂ e-Intensität Corporate | 223 | 373 |
| | Reduktion Corporate | 30% | 30% |

Nachhaltige Investitionen



Das Diagramm zeigt die prozentualen Umsätze der im Portfolio des Fonds enthaltenen Unternehmungen und der der Benchmark, welche nicht EU-Taxonomie konform, jedoch im Einklang mit den sich aus den UN Sustainable Development Goals (SDGs) ergebenden Umwelt- und sozialen Zielen gemäss Art. 2 (17) SFDR investiert worden sind. Der Fonds hat keine Investitionen in ökologisch nachhaltige Aktivitäten im Sinne der EU Taxonomie-Verordnung angestrebt. Der Investmentmanager des (Teil-)Fonds hat eine Methodologie zur Definition nachhaltiger Investitionen entwickelt, die den Anforderungen des Art. 2 (17) SFDR entspricht. Die Methodologie ist detailliert in den Vorvertraglichen Informationen beschrieben. Die Aufteilung der nachhaltigen Investitionen in UN SDGs werden in folgender Grafik gemacht. Die historischen Vergleiche werden in nachfolgender Tabelle gemacht.

| | Indikator | Datum 2023 | Datum 2024 |
|-----------|---|------------|------------|
| Portfolio | Anteil nachhaltige Investitionen mit Umweltziel | 7.95% | 13.19% |
| | Anteil sozial nachhaltige Investitionen | 18.49% | 21.12% |
| | Total nachhaltige Quote | 26.44% | 34.30% |
| Benchmark | Anteil nachhaltige Investitionen mit Umweltziel | 8.11% | 12.06% |
| | Anteil sozial nachhaltige Investitionen | 19.36% | 20.88% |
| | Total nachhaltige Quote | 27.47% | 32.94% |



■ Portfolio
 ■ Benchmark

Aufgrund der unterschiedlichen Behandlung von Green, Social und Sustainable Bonds kann das SDG-Exposure von den prozentualen Umsätzen der im Portfolio des Fonds enthaltenen Unternehmungen und den der Benchmark, welche im Einklang mit den sich aus den SDGs ergebenden Umweltzielen gemäss Art. 2 (17) SFDR investiert worden sind, abweichen.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Im Berichtszeitraum konzentrierte sich der Vermögensverwalter auf Wertpapiere von Unternehmen, welche Umsätze aus dem Verkauf von Produkten und Dienstleistungen mit einem positiven Beitrag zu den 17 SDGs erzielten und dabei keine DNSH- und/oder Minimum Safeguards-Verletzungen aufgewiesen haben.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Emittenten mit einem negativen Nettobeitrag zu den SDGs wurden in der Berichtsperiode aus dem Anlageuniversum des Finanzproduktes entfernt. Darüber hinaus berücksichtigte der Teilfonds nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (engl: Principal Adverse Impacts - PAI). Zu diesem Zweck wurden die obligatorischen Indikatoren Anhang 1 der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1288 zur Ergänzung der Verordnung (EU) 2019/2088 zugrunde gelegt. Unternehmen, die der Vermögensverwalter gemäss PAI als besonders schädlich einstufte, wurden entsprechend nicht zu den nachhaltigen Anlagen gezählt. Emittenten, welche die PAIs 7 (Biodiversität), 10 (Global Compact der Vereinten Nationen (UNGC)/OECD Leitsätze für multinationale Unternehmen) oder 14 (Engagement in umstrittenen Waffen) verletzen, haben einen PAI-Score von null erhalten. Aus den restlichen PAI-Indikatoren wurde ein PAI-Score berechnet. Instrumente von Emittenten mit einem Score < 10 wurden nicht den nachhaltigen Investitionen angerechnet.

● **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Die nachteiligen Auswirkungen (PAI) sind systematisch im Anlageprozess berücksichtigt worden.

● **Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:**

Bei der Anlageanalyse für nachhaltige Investitionen wurden in der Berichtsperiode die folgenden Normverletzungen berücksichtigt: Global Compact der Vereinten Nationen (UNGC), die UN Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte (UNGP) und das Übereinkommen der Internationalen Arbeitsorganisation (ILO). Jeder schwerwiegende Verstoß gegen diese Normen führte zum Ausschluss des Emittenten aus dem investierbaren Universum des Finanzprodukts.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

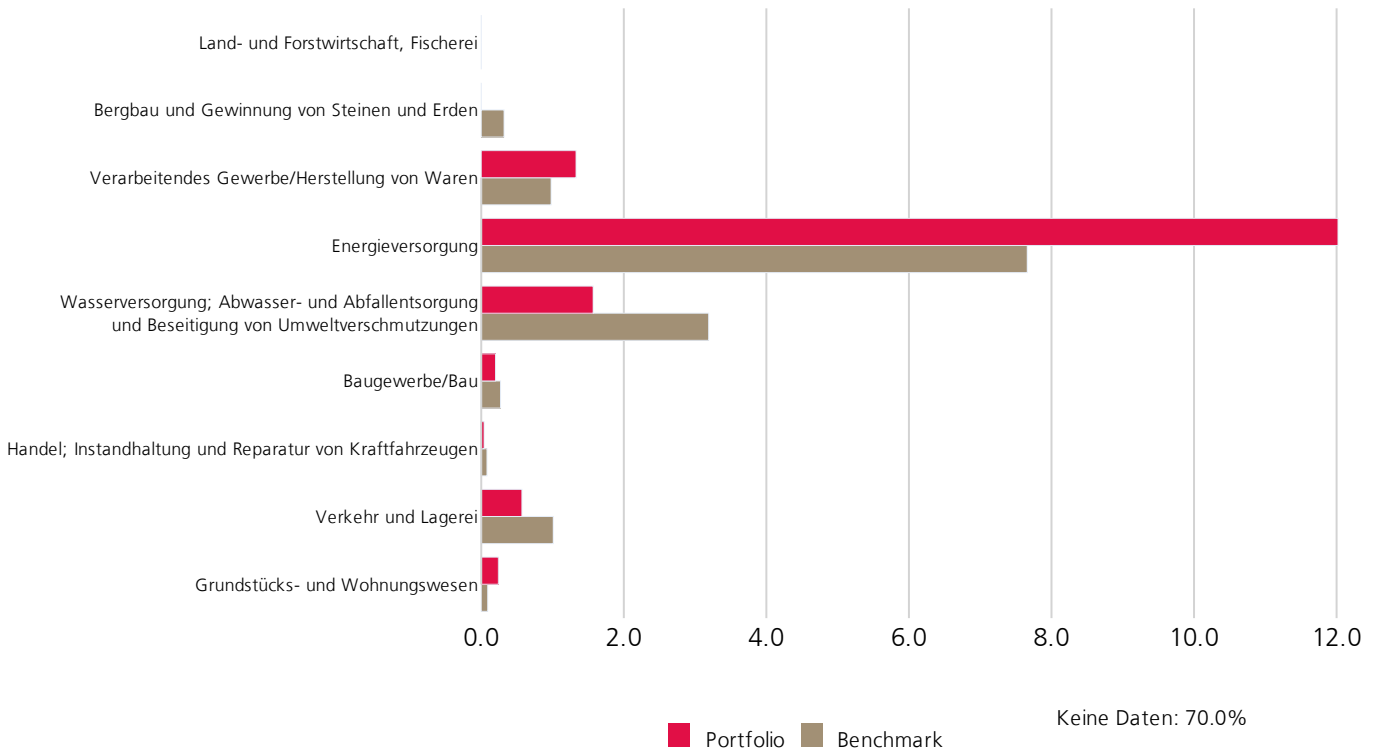
Nachteilige Nachhaltigkeitsauswirkungen (PAI) – Corporate Anlagen

Primäre Indikatoren - Energie und Emissionen

| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Benchmark Aktuell | Benchmark Vorjahr | Erklärung |
|--|--|-------------------|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|-----------|
| 1. THG-Emissionen | 1a. GHG Emissions - Scope 1 per Mio EUR Enterprise Value | 6403.85 | 86.05% | 5625.42 | 10648.5 | 10110.3 | |
| | 1b. GHG Emissions - Scope 2 per Mio EUR Enterprise Value | 1700.01 | 86.05% | 1127.66 | 1708.4 | 1700.41 | |
| | 1c. GHG Emissions - Scope 3 per Mio EUR Enterprise Value | 33714.2 | 86.05% | 48172.8 | 44234.5 | 46056.4 | |
| 2. CO ₂ -Fussabdruck | 2. GHG Emissions - Scope 1+2+3 per Mio EUR Enterprise Value | 526.08 | 86.05% | 524.67 | 709.58 | 547.15 | |
| 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird | 3. GHG Emissions - Emissions Intensity - Total Emissions (EUR) | 312.1 | 86.05% | 215.72 | 455.7 | 291.31 | |
| 4. Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind | 4. Fossil Fuel - Involvement (PAI) | 3.26% | 87.67% | 2.77% | 8.29% | 4.76% | |

| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Benchmark Aktuell | Benchmark Vorjahr | Erklärung |
|--|--|-------------------|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|---|
| 5. Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen | 5a. CR Raw - Energy use - Coal/nuclear/undear energy sources | 83.05% | 64.5% | 82.88% | 82.42% | 84.63% | |
| | 5b. Non-renewable energy consumption | 64.87% | 42.03% | 85.09% | 65.72% | 87.42% | Der Verbrauch nicht-erneuerbarer Energie umfasst den Verbrauch von Energie, die aus nicht-erneuerbaren Quellen erzeugt wird, sowie den Verbrauch von Energie aus Biomasse. Alle Zahlen zum Energieverbrauch, bei denen die Energiequelle unklar ist, sind ebenfalls in diesem Faktor enthalten. |
| | 5c. Non-renewable energy production | 1.91% | 85.26% | 0.97% | 5.2% | 2.03% | |
| 6. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren | 6. Energy consumption intensity (GWh/mEUR) | 1.5 | 29.26% | 0.53 | 1.41 | 0.76 | |

Intensität des Energieverbrauchs pro High Impact Sector (pro Mio. EUR)



| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Benchmark Aktuell | Benchmark Vorjahr | Erklärung |
|---|--|-------------------|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|-----------|
| 7. Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken | 7. Companies negatively affecting biodiversity-sensitive areas | 0% | 87.67% | 0% | 0% | 0% | |
| 8. Emissionen in Wasser | 8. CR Raw - COD emissions | 35.84 | 3.54% | 20.07 | 26.19 | 29.88 | |
| 9. Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle | 9. CR Raw - Hazardous waste | 1.53 | 9.11% | 0 | 0.6 | 0 | |

| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Benchmark Aktuell | Benchmark Vorjahr | Erklärung |
|--|--|-------------------|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|-----------|
| 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | 10. UNGC / OECD Guidelines Violation | 0% | 87.67% | 0% | 0.71% | 0.38% | |
| 11. Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen | 11. Lack of processes monitoring UNGC and OECD Guidelines compliance | 39.1% | 80.97% | 35.74% | 38.54% | 40.96% | |
| 12. Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle | 12. Unadjusted gender pay gap | 0.21% | 5.58% | 0.12% | 0.21% | 0.11% | |
| 13. Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen | 13. Ratio of female to male board members | 46.93% | 80.61% | 45.7% | 47.84% | 45.72% | |
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) | 14. Controversial weapons involvement (APM, CM, Bio, Chem) | 0% | 87.67% | 0% | 0% | 0% | |

Nachteilige Nachhaltigkeitsauswirkungen (PAI) – Staatliche und Supranationale Vermögenswerte

Primäre Indikatoren

| Umwelt | | | | | | | |
|--------------------|-------------------|-------------------|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|-----------|
| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Benchmark Aktuell | Benchmark Vorjahr | Erklärung |
| 15. GHG Intensität | 15. GHG Intensity | 0 | 0% | 0 | 0 | 0 | |

| Sozial | | | | | | | |
|--|---|-------------------|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|-----------|
| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Benchmark Aktuell | Benchmark Vorjahr | Erklärung |
| 16. Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen | 16a. Countries subject to social violations (#) | 0 | 0% | 0 | 0 | 0 | |
| | 16b. Countries subject to social violations (%) | 0% | 0% | 0% | 0% | 0% | |

| Indikator | Metrik |
|-----------|---|
| 1a | Scope-1-Treibhausgas-Emissionen |
| 1b | Scope-2-Treibhausgas-Emissionen |
| 1c | Scope-3-Treibhausgas-Emissionen |
| 2. | CO2-Fussabdruck pro Mio EUR |
| 3. | THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird |
| 4. | Anteil der Investitionen in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind |
| 5a | Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung der Unternehmen, in die investiert wird, aus nicht erneuerbaren Energiequellen im Vergleich zu erneuerbaren Energiequellen, ausgedrückt in Prozent der gesamten Energiequellen |
| 5b | Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung der Unternehmen, in die investiert wird, aus nicht erneuerbaren Energiequellen im Vergleich zu erneuerbaren Energiequellen, ausgedrückt in Prozent der gesamten Energiequellen |
| 5c | Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung der Unternehmen, in die investiert wird, aus nicht erneuerbaren Energiequellen im Vergleich zu erneuerbaren Energiequellen, ausgedrückt in Prozent der gesamten Energiequellen |
| 6. | Energieverbrauch in GWh pro einer Million EUR Umsatz der Unternehmen, in die investiert wird, aufgeschlüsselt nach klimaintensiven Sektoren |
| 7. | Anteil der Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird, mit Standorten/Betrieben in oder in der Nähe von Gebieten mit schutzbedürftiger Biodiversität, sofern sich die Tätigkeiten dieser Unternehmen nachteilig auf diese Gebiete auswirken |
| 8. | Tonnen Emissionen in Wasser, die von den Unternehmen, in die investiert wird, pro investierter Million EUR verursacht werden, ausgedrückt als gewichteter Durchschnitt |
| 9. | Tonnen gefährlicher und radioaktiver Abfälle, die von den Unternehmen, in die investiert wird, pro investierter Million EUR erzeugt werden, ausgedrückt als gewichteter Durchschnitt |
| 10. | Anteil der Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird, die an Verstößen gegen die UNGC-Grundsätze oder gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen beteiligt waren |
| 11. | Anteil der Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird, die keine Richtlinien zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen oder keine Verfahren zur Bearbeitung von Beschwerden wegen Verstößen gegen die UNGC-Grundsätze und OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen eingerichtet haben |
| 12. | Durchschnittliches unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle bei den Unternehmen, in die investiert wird |
| 13. | Durchschnittliches Verhältnis von Frauen zu Männern in den Leitungs- und Kontrollorganen der Unternehmen, in die investiert wird, ausgedrückt als Prozentsatz aller Mitglieder der Leitungs- und Kontrollorgane |
| 14. | Anteil der Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird, die an der Herstellung oder am Verkauf von umstrittenen Waffen beteiligt sind |
| 15. | THG-Emissionsintensität der Länder, in die investiert wird |
| 16a | Anzahl der Länder, in die investiert wird, die nach Maßgabe internationaler Verträge und Übereinkommen, der Grundsätze der Vereinten Nationen oder, falls anwendbar, nationaler Rechtsvorschriften gegen soziale Bestimmungen verstoßen (absolute Zahl und relative Zahl, geteilt durch alle Länder, in die investiert wird) |
| 16b | Anzahl der Länder, in die investiert wird, die nach Maßgabe internationaler Verträge und Übereinkommen, der Grundsätze der Vereinten Nationen oder, falls anwendbar, nationaler Rechtsvorschriften gegen soziale Bestimmungen verstoßen (absolute Zahl und relative Zahl, geteilt durch alle Länder, in die investiert wird) |

Das Dokument wurde von Swisscanto mit geschäftsüblicher Sorgfalt erstellt und kann Informationen aus sorgfältig ausgewählten Drittquellen enthalten. Anleger sollten beachten, dass die zuvor für 2023 berechneten und veröffentlichten Daten für dieses in 2024 veröffentlichte Dokument neu berechnet wurden. Dementsprechend kann es zu Abweichungen bei diesen in den Jahren 2023 und 2024 veröffentlichten historischen Daten kommen.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 01.02.2023 - 31.01.2024

| Grösste Investitionen | Sektor | In % der Vermögenswerte | Land |
|--|------------------------------------|-------------------------|--------------------------|
| USD Cash | | 1.83% | |
| STMicroelectronics N.V. 0.0% 04-AUG-2027 | Manufacturing | 1.64% | Netherlands |
| Ford Motor Company 0.0% 15-MAR-2026 | Manufacturing | 1.61% | USA |
| ANA Holdings Inc. 0.0% 10-DEC-2031 REGS | Transporting and Storage | 1.54% | Japan |
| America Movil, S.A.B. de C.V 0.0% 02-MAR-2024 REGS | Information and Communication | 1.45% | Mexico |
| Jazz Investments I Ltd. 2.0% 15-JUN-2026 | Financial and Insurance Activities | 1.34% | Bermuda |
| NIPPON STEEL CORP. 0.0% 05-OCT-2026 REGS | Manufacturing | 1.34% | Japan |
| SK hynix Inc. 1.75% 11-APR-2030 REGS | Manufacturing | 1.30% | South Korea |
| Southwest Airlines Co. 1.25% 01-MAY-2025 | Transporting and Storage | 1.24% | USA |
| Akamai Technologies, Inc. 0.125% 01-MAY-2025 | Information and Communication | 1.22% | USA |
| ON Semiconductor Corporation 0.5% 01-MAR-2029 | Manufacturing | 1.17% | USA |
| ANLLIAN Capital Ltd. 0.0% 05-FEB-2025 REGS | Financial and Insurance Activities | 1.11% | Virgin Islands (British) |
| Splunk Inc. 1.125% 15-SEP-2025 | Information and Communication | 1.07% | USA |
| Middleby Corporation 1.0% 01-SEP-2025 | Manufacturing | 1.00% | USA |
| Akamai Technologies, Inc. 0.375% 01-SEP-2027 | Information and Communication | 0.96% | USA |

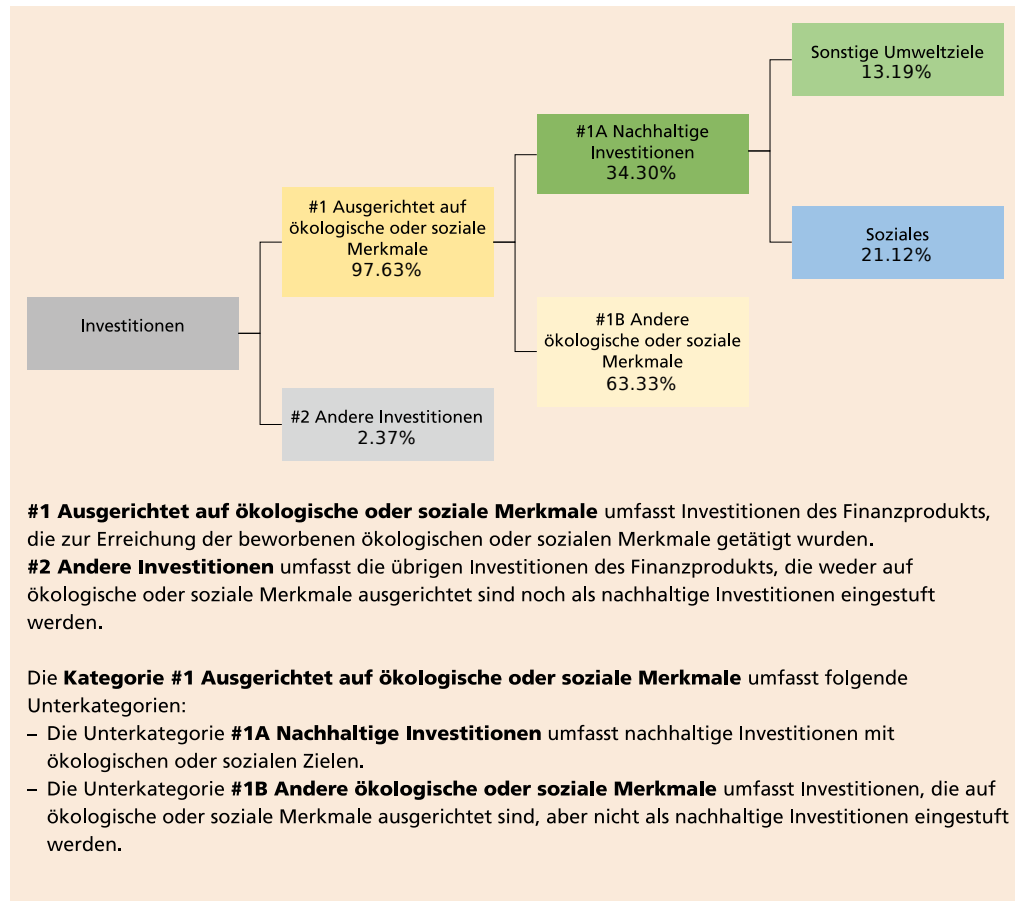


Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Der Anteil an nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen und Angaben zur Vermögensallokation werden in untenstehender Frage beantwortet.

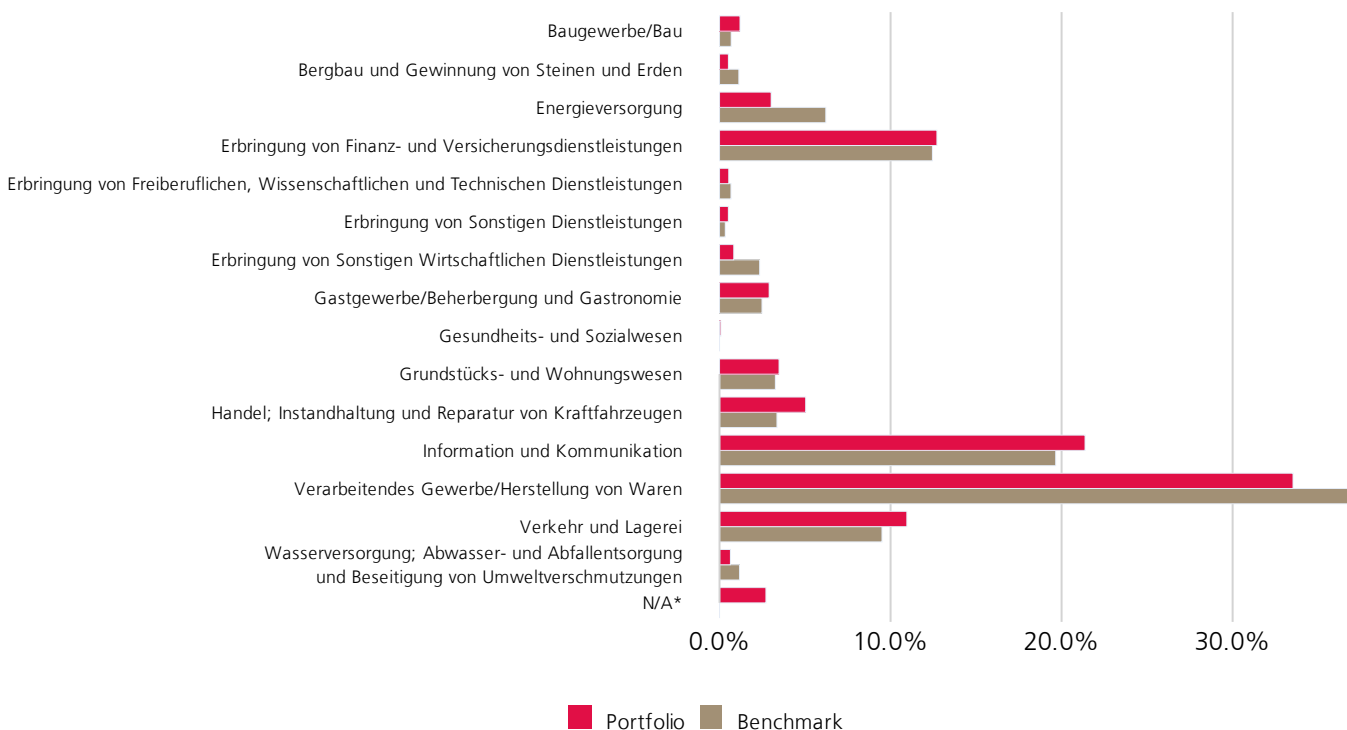
Wie sah die Vermögensallokation aus?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.



In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Wegen mangelnder Datenverfügbarkeit können Subsektoren nicht angezeigt werden.



*Diese Klassifizierung umfasst alle Bestände, für die keine NACE-Klassifizierung gefunden oder geschätzt werden kann; Liquidität ist darin enthalten.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Obwohl keine Investitionen getätigt wurden, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind, wird in untenstehender Grafik die Alignment der nachhaltigen Investitionen mit der EU-Taxonomie offengelegt.

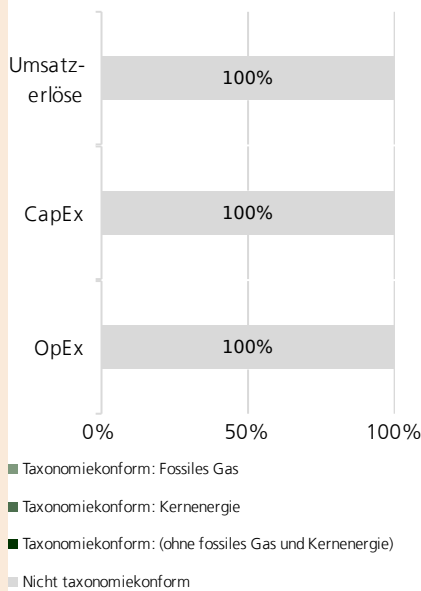
Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomeikonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert¹?

- Ja
 In fossiles Gas In Kernenergie
 Nein

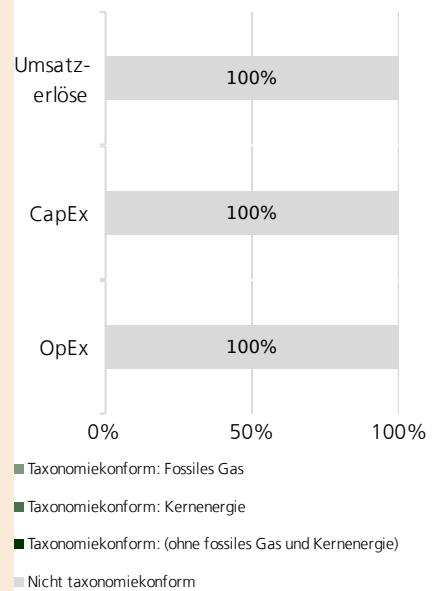
¹Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomeikonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels ("Klimaschutz") beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomeikonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomeikonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzproduktes einschliesslich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzproduktes zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.

1. Taxonomiekonformität der Investitionen einschliesslich Staatsanleihen*



2. Taxonomiekonformität der Investitionen ohne Staatsanleihen*



Diese Grafik gibt **100.0%** der Gesamtinvestitionen wieder.

*Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff "Staatsanleihen" alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Mit Blick auf die EU-Taxonomeikonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomeikonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:
 - **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

Investitionsausgaben (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, z.B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft
 - **Betriebsausgaben** (Opex), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Angaben zu Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten werden in der Tabelle zusammengefasst. Wenn keine Angaben verfügbar sind, wird die Tabelle ebenfalls keine Angaben enthalten.

| Issuer Name | Nace Sektor | Total Eligible Activity Revenue | Total Aligned Revenue | Total Likely Aligned Revenue | Total Potentially Aligned Revenue | Portfolio Gewicht (Consol.) |
|-----------------------------|---|---------------------------------|-----------------------|------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------|
| SPIE SA | Professional, Scientific and Technical Activities | 83.99% | 11.50% | 13.95% | 0.00% | 0.28% |
| Iberdrola Finanzas SA | Electricity, Gas, Steam and Air Conditioning Supply | 61.60% | 9.13% | 0.00% | 15.60% | 0.17% |
| Veolia Environnement SA | Water Supply, Sewerage, Waste Management and Remediation Activities | 68.52% | 8.28% | 30.01% | 0.00% | 0.24% |
| Pirelli & C. S.p.A. | Manufacturing | 15.75% | 6.25% | 0.00% | 0.00% | 0.11% |
| Schneider Electric SE | Manufacturing | 18.50% | 5.00% | 0.00% | 0.00% | 0.62% |
| Snam S.p.A. | Water Supply, Sewerage, Waste Management and Remediation Activities | 5.25% | 5.00% | 0.00% | 0.00% | 0.15% |
| Groupe Bruxelles Lambert SA | Financial and Insurance Activities | 3.73% | 3.38% | 0.00% | 0.00% | 0.33% |
| Deutsche Post AG | Transporting and Storage | 55.94% | 3.00% | 8.51% | 0.00% | 0.62% |
| LEG Immobilien SE | Real Estate Activities | 99.85% | 2.95% | 0.00% | 0.00% | 0.55% |
| Prysmian S.p.A. | Manufacturing | 10.30% | 2.85% | 0.00% | 0.00% | 0.60% |

Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

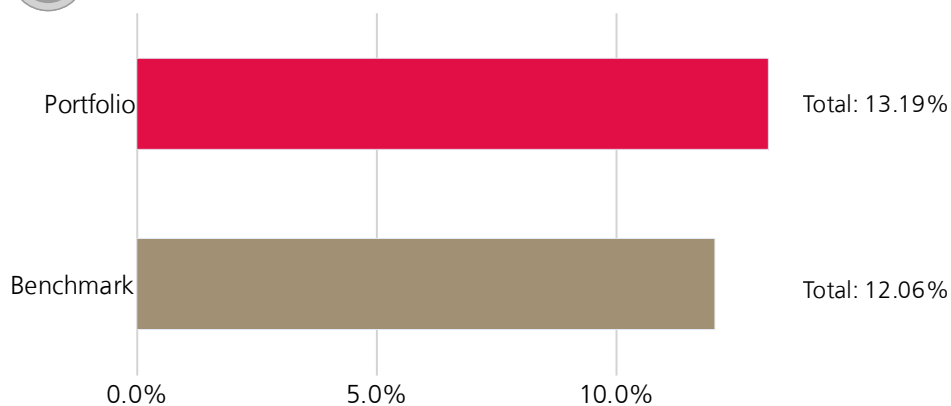
Da im vorangegangenen Berichtsjahr keine Daten verfügbar waren, erübrigt sich ein Vorjahresvergleich.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



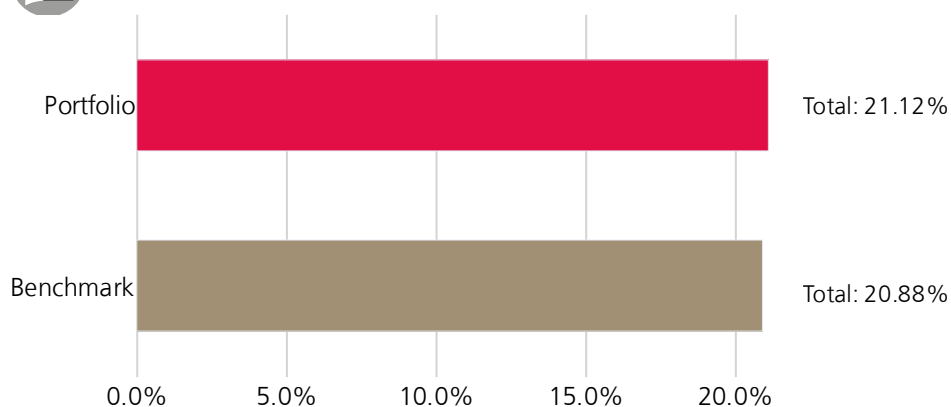
Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?



Das Diagramm zeigt die prozentualen Umsätze der im Portfolio des Fonds enthaltenen Unternehmungen und der der Benchmark, welche nicht EU-Taxonomie konform, jedoch im Einklang mit den sich aus den SDGs ergebenden Umweltzielen gemäss Art. 2 (17) SFDR investiert worden sind.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?



Das Diagramm zeigt die prozentualen Umsätze der im Portfolio des Fonds enthaltenen Unternehmungen und der der Benchmark, welche nicht EU-Taxonomie konform, jedoch im Einklang mit den sich aus den SDGs ergebenden sozialen Zielen gemäss Art. 2 (17) SFDR investiert worden sind.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Diese Vermögenswerte haben die in der spezifischen Anlagepolitik vorgesehenen Anlagen umfasst, einschliesslich Derivate zu Absicherungszwecken und flüssige Mittel. Die Anlagen, ausgenommen Derivate und flüssige Mittel, haben die Grundsätze des ökologischen oder sozialen Mindestschutzes umgesetzt.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Im Berichtszeitraum förderte der Vermögensverwalter durch Investment Stewardship und Kapitalallokation nachhaltige Geschäftspraktiken und die Einhaltung anerkannter internationaler Prinzipien und ESG-Best-Practice-Standards. Dementsprechend stand er im Dialog mit den Managementteams der investierten Unternehmen. Darüber hinaus hat er sich im Rahmen der United Nations Collaboration Platform for Responsible Investment (UN PRI) und bei Investoreninitiativen engagiert. Das Abstimmungsverhalten basierte auf den schweizerischen und internationalen Corporate-Governance-Regeln sowie auf den Prinzipien des UN Global Compact und den 17 Zielen für nachhaltige Entwicklung (UN SDGs). Weitere Informationen finden Sie unter: Swisssanto | Proxy Voting Dashboard (issgovernance.com) <https://www.swisssanto.com/int/de/nachhaltigkeit/investment-stewardship.html>

Swisssanto | Proxy Voting Dashboard (issgovernance.com)

<https://www.swisssanto.com/int/de/nachhaltigkeit/investment-stewardship.html>



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Es wurde kein Index als Referenzwert bestimmt, um festzustellen, ob dieses Finanzprodukt auf die beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet ist.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?

Nicht anwendbar.

Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?

Nicht anwendbar.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?

Nicht anwendbar.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?

Nicht anwendbar.

Das Dokument wurde von Swisssanto mit geschäftsüblicher Sorgfalt erstellt und kann Informationen aus sorgfältig ausgewählten Drittquellen enthalten. Anleger sollten beachten, dass die zuvor für 2023 berechneten und veröffentlichten Daten für dieses in 2024 veröffentlichte Dokument neu berechnet wurden. Dementsprechend kann es zu Abweichungen bei diesen in den Jahren 2023 und 2024 veröffentlichten historischen Daten kommen.



Regelmässige Information zum 31.01.2024

Regelmässige Informationen zu den in Artikel 8, Absätze 1, 2, 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts:

Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Corporate

Unternehmenskennung (LEI-Code):

5493000JNVEMQLD6378

Benchmark

ICE BofA Global Corporate Bond Index (TR) hedged in USD

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. In dieser Verordnung ist kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten festgelegt. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

| Ja | | Nein | |
|--------------------------|---|-------------------------------------|---|
| <input type="checkbox"/> | Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: _ % | <input checked="" type="checkbox"/> | Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 49.44% an nachhaltigen Investitionen |
| <input type="checkbox"/> | in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind | <input type="checkbox"/> | mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind |
| <input type="checkbox"/> | in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind | <input checked="" type="checkbox"/> | mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind |
| <input type="checkbox"/> | Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: _ % | <input checked="" type="checkbox"/> | mit einem sozialen Ziel |
| <input type="checkbox"/> | | <input type="checkbox"/> | Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt . |



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die von dem Teilfonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale wurden durch folgende Aktivitäten erreicht:

1. Ausschlusskriterien
2. ESG-Integration
3. Reduktion der CO2e-Intensität
4. Nachhaltige Investitionen










Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Aus Übersichtsgründen werden die Angaben zur Performance (siehe Details am Ende des Reports) der Nachhaltigkeitsindikatoren direkt mit dem historischen Vergleich in der nächsten Frage beantwortet.

...und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Ausschlusskriterien

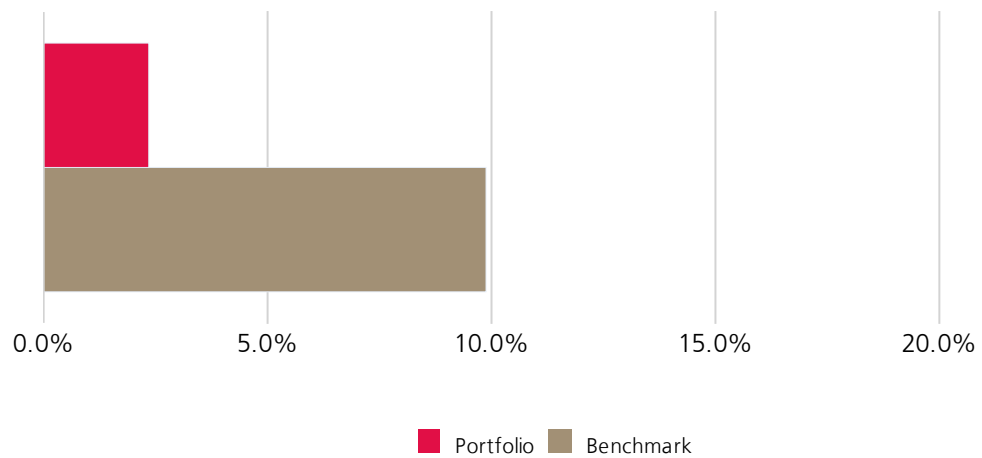
| Responsible | | | | | | | |
|---|-------------------|-------------------|--|--|-------------------|-------------------|------------------------------|
| Kriterien | Gewicht Portfolio | Gewicht Benchmark | Anzahl Unternehmen Benchmark | Kriterien | Gewicht Portfolio | Gewicht Benchmark | Anzahl Unternehmen Benchmark |
|  Kohlereserven (ex. Metallproduktion) | 0.00% | 1.72% | 26 |  Herstellung von Kriegstechnik (> 5% Umsatz) | 0.00% | 1.20% | 18 |
| Förderung von Kohle (> 5% Umsatz) | 0.00% | 0.15% | 3 |  Ausbeuterische Kinderarbeit | 0.00% | 0.88% | 6 |
|  Klimawandel | | | |  Herstellung von Waffen & Munition | 0.00% | 0.79% | 8 |
| | | |  Gefährdung von Gesellschaft und Gesundheit |  Kontroverse Waffen | 0.00% | 0.58% | 3 |
| | | | |  UN Global Compact Verstöße | 0.00% | 0.50% | 5 |
| | | | |  Herstellung von Pornografie | 0.00% | 0.00% | 0 |

Zwecks Minderung der Nachhaltigkeitsrisiken und mit dem Ziel, nicht in Wertpapiere der oben aufgeführten kontroversen Geschäftsmodellen zu investieren, sind die oben genannten Ausschlusskriterien angewendet worden. Die Tabelle zeigt die Anzahl der Unternehmen, die gegen die Ausschlusskriterien verstossen haben, sowie die jeweilige Portfolio- und Benchmark-Exposition. Liegen bei einem Unternehmen mehrere Verstöße vor, werden diese für jedes Kriterium separat aufgeführt. Daher ist die Summe aller Positionen in diesem Bericht in der Regel höher als die effektive Allokation zu den oben abgebildeten Kriterien. Die historischen Vergleiche werden in nachfolgender Tabelle gemacht. Aus Übersichtsgründen werden die Ausschlusskriterien aggregiert.

| | Indikator | Datum 2023 | Datum 2024 |
|-----------|----------------------------|------------|------------|
| Portfolio | Ausschlusskriterien Total* | 0% | 0% |
| Benchmark | Ausschlusskriterien Total* | 3.91% | 4.51% |

*alle Ausschlusskriterien kumuliert.

ESG-Integration

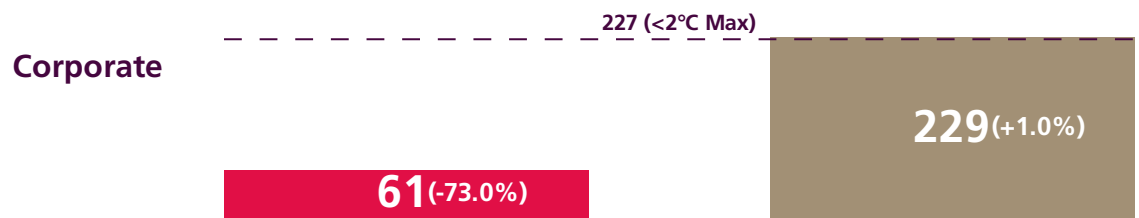


Das Portfolio strebte in der Berichtsperiode im Vergleich zur Benchmark eine geringere Exposition zu ESG-Laggards an. ESG-Laggards sind Unternehmungen mit der schwächsten Umwelt-, Sozial und Governance- Performance des relevanten Anlageuniversums.

Die historischen Vergleiche werden in nachfolgender Tabelle gemacht.

| | Indikator | Datum 2023 | Datum 2024 |
|-----------|----------------------------|------------|------------|
| Portfolio | Exposition zu ESG Laggards | 6.54% | 2.35% |
| Benchmark | Exposition zu ESG Laggards | 14.45% | 9.88% |

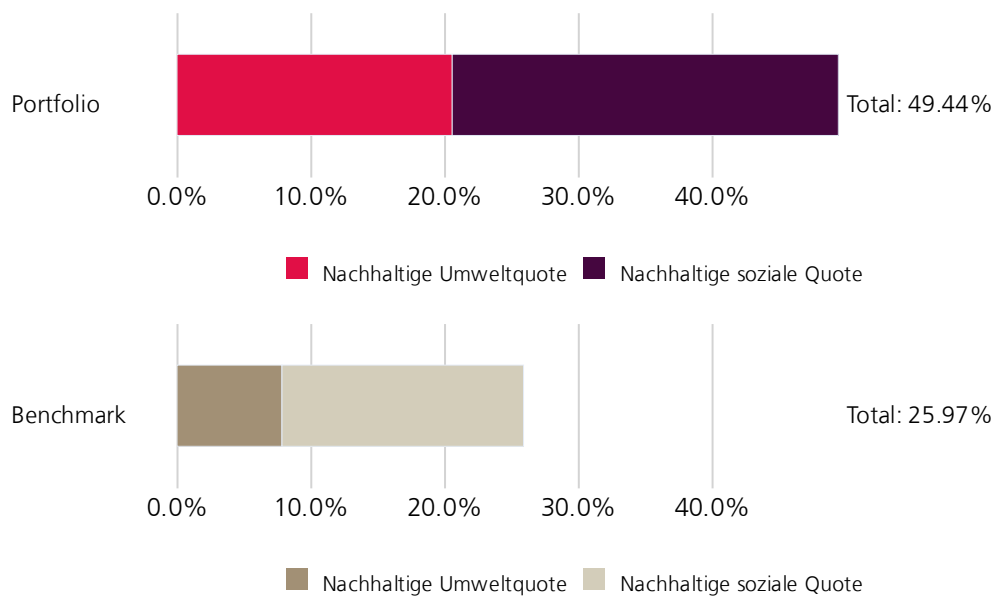
Reduktion der CO₂e-Intensität



Im Einklang mit dem < 2° Pariser Klimaziel ("<2°C Max") zielt die Investitionstätigkeit des Fonds während der Berichtsperiode darauf ab, die CO₂e-Emissionen des Portfolios, um mindestens 4 % pro Jahr zu reduzieren. Der Absenkpfad berechnet sich aus den gewichteten CO₂e-Intensitäten der Benchmark, diskontiert mit 4 % pro Jahr zuzüglich des realen Wirtschaftswachstums. Die gestrichelten 2° Max-Linie zeigt den Maximalwert an. Die Balken stellen die CO₂e-Intensitäten des Portfolios und der Benchmark dar. CO₂e-Intensitäten unterhalb der 2° Max-Linie zeigen an, dass das Portfolio oder die Benchmark das <2°-Klimaziel erfüllen. Werte bei "Erreichung Klimaziel" setzen das Portfolio und die Benchmark in Relation zum Klimaziel. Negative Werte bedeuten, dass das Ziel erreicht wurde. Die historischen Vergleiche werden in nachfolgender Tabelle gemacht.

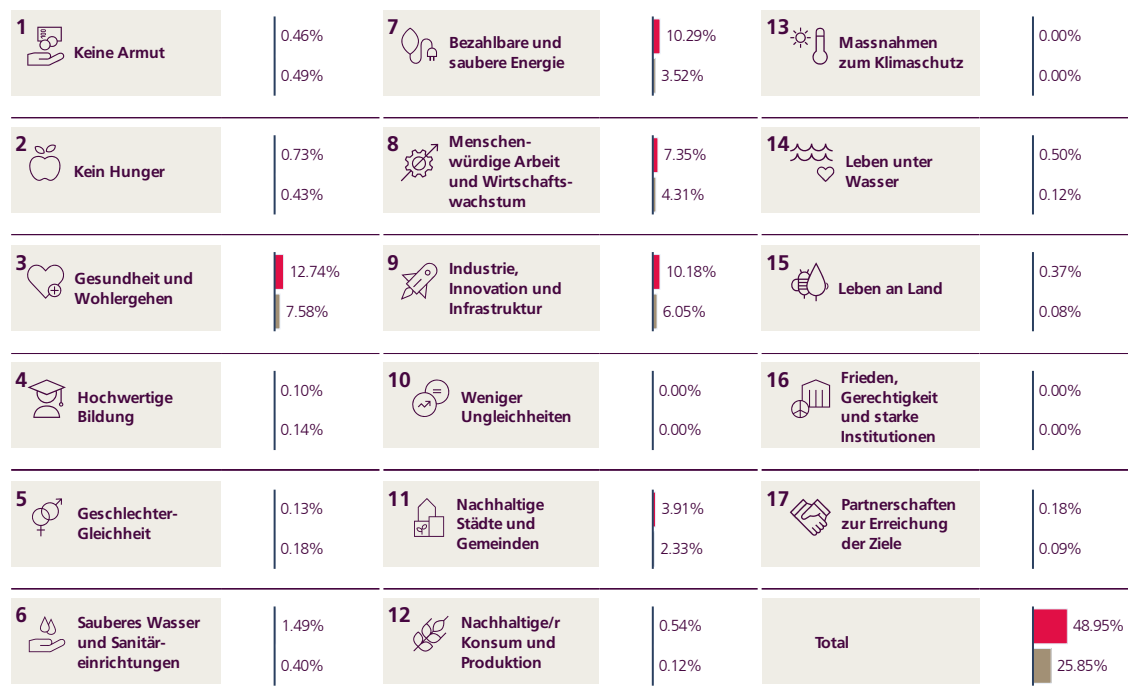
| | Indikator | Datum 2023 | Datum 2024 |
|-----------|--|------------|------------|
| Portfolio | CO ₂ e-Intensität Corporate | 68 | 61 |
| | Reduktion Corporate | -72% | -73% |
| Benchmark | CO ₂ e-Intensität Corporate | 250 | 229 |
| | Reduktion Corporate | 1% | 1% |

Nachhaltige Investitionen



Das Diagramm zeigt die prozentualen Umsätze der im Portfolio des Fonds enthaltenen Unternehmungen und der der Benchmark, welche nicht EU-Taxonomie konform, jedoch im Einklang mit den sich aus den UN Sustainable Development Goals (SDGs) ergebenden Umwelt- und sozialen Zielen gemäss Art. 2 (17) SFDR investiert worden sind. Der Fonds hat keine Investitionen in ökologisch nachhaltige Aktivitäten im Sinne der EU Taxonomie-Verordnung angestrebt. Der Investmentmanager des (Teil-)Fonds hat eine Methodologie zur Definition nachhaltiger Investitionen entwickelt, die den Anforderungen des Art. 2 (17) SFDR entspricht. Die Methodologie ist detailliert in den Vorvertraglichen Informationen beschrieben. Die Aufteilung der nachhaltigen Investitionen in UN SDGs werden in folgender Grafik gemacht. Die historischen Vergleiche werden in nachfolgender Tabelle gemacht.

| | Indikator | Datum 2023 | Datum 2024 |
|-----------|---|------------|------------|
| Portfolio | Anteil nachhaltige Investitionen mit Umweltziel | 21.97% | 20.59% |
| | Anteil sozial nachhaltige Investitionen | 29.05% | 28.85% |
| | Total nachhaltige Quote | 51.02% | 49.44% |
| Benchmark | Anteil nachhaltige Investitionen mit Umweltziel | 6.86% | 7.9% |
| | Anteil sozial nachhaltige Investitionen | 17.06% | 18.07% |
| | Total nachhaltige Quote | 23.93% | 25.97% |



■ Portfolio
 ■ Benchmark

Aufgrund der unterschiedlichen Behandlung von Green, Social und Sustainable Bonds kann das SDG-Exposure von den prozentualen Umsätzen der im Portfolio des Fonds enthaltenen Unternehmungen und den der Benchmark, welche im Einklang mit den sich aus den SDGs ergebenden Umweltzielen gemäss Art. 2 (17) SFDR investiert worden sind, abweichen.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Im Berichtszeitraum konzentrierte sich der Vermögensverwalter auf Wertpapiere von Unternehmen, welche Umsätze aus dem Verkauf von Produkten und Dienstleistungen mit einem positiven Beitrag zu den 17 SDGs erzielten und dabei keine DNSH- und/oder Minimum Safeguards-Verletzungen aufgewiesen haben.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Emittenten mit einem negativen Nettobeitrag zu den SDGs wurden in der Berichtsperiode aus dem Anlageuniversum des Finanzproduktes entfernt. Darüber hinaus berücksichtigte der Teilfonds nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (engl: Principal Adverse Impacts - PAI). Zu diesem Zweck wurden die obligatorischen Indikatoren Anhang 1 der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1288 zur Ergänzung der Verordnung (EU) 2019/2088 zugrunde gelegt. Unternehmen, die der Vermögensverwalter gemäss PAI als besonders schädlich einstufte, wurden entsprechend nicht zu den nachhaltigen Anlagen gezählt. Emittenten, welche die PAIs 7 (Biodiversität), 10 (Global Compact der Vereinten Nationen (UNGC)/OECD Leitsätze für multinationale Unternehmen) oder 14 (Engagement in umstrittenen Waffen) verletzen, haben einen PAI-Score von null erhalten. Aus den restlichen PAI-Indikatoren wurde ein PAI-Score berechnet. Instrumente von Emittenten mit einem Score < 10 wurden nicht den nachhaltigen Investitionen angerechnet.

● **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Die nachteiligen Auswirkungen (PAI) sind systematisch im Anlageprozess berücksichtigt worden.

● **Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:**

Bei der Anlageanalyse für nachhaltige Investitionen wurden in der Berichtsperiode die folgenden Normverletzungen berücksichtigt: Global Compact der Vereinten Nationen (UNGC), die UN Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte (UNGP) und das Übereinkommen der Internationalen Arbeitsorganisation (ILO). Jeder schwerwiegende Verstoß gegen diese Normen führte zum Ausschluss des Emittenten aus dem investierbaren Universum des Finanzprodukts.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

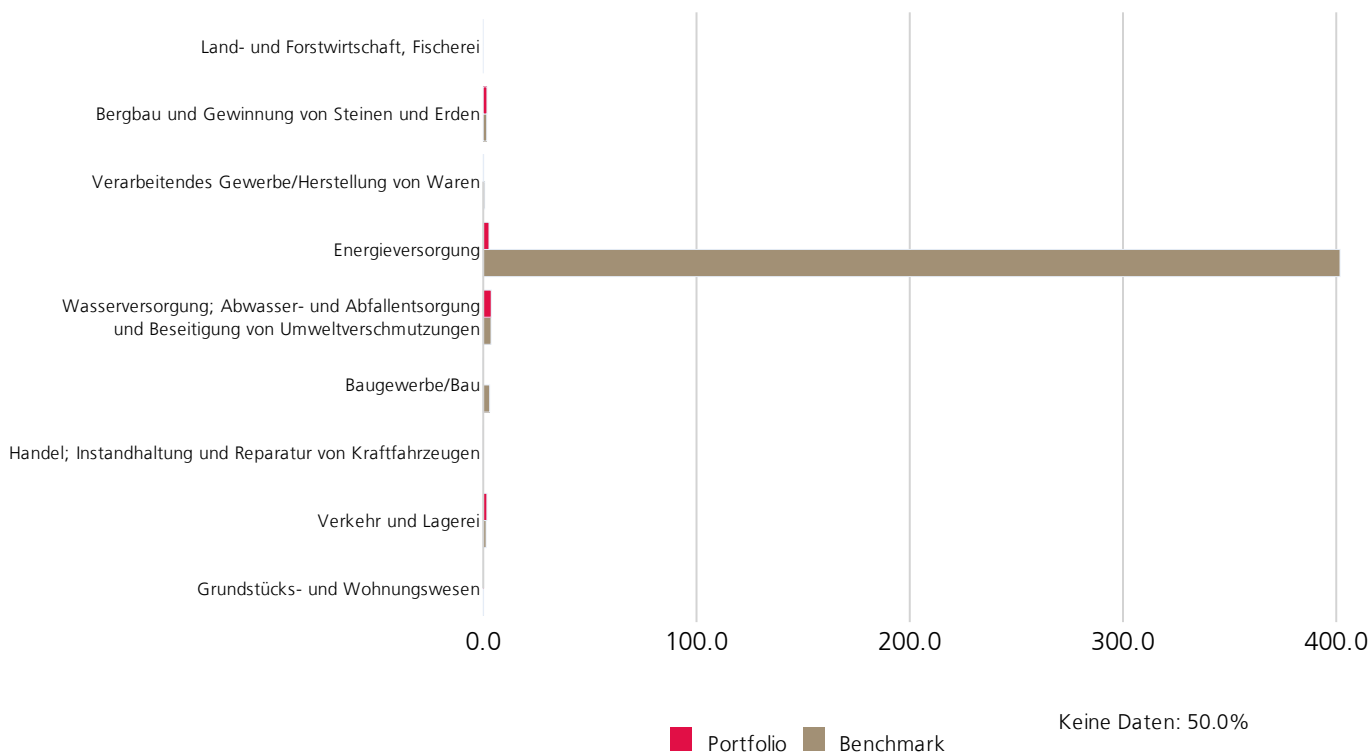
Nachteilige Nachhaltigkeitsauswirkungen (PAI) – Corporate Anlagen

Primäre Indikatoren - Energie und Emissionen

| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Benchmark Aktuell | Benchmark Vorjahr | Erklärung |
|--|--|-------------------|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|-----------|
| 1. THG-Emissionen | 1a. GHG Emissions - Scope 1 per Mio EUR Enterprise Value | 7419.24 | 91.96% | 6025.07 | 22231.2 | 445109 | |
| | 1b. GHG Emissions - Scope 2 per Mio EUR Enterprise Value | 2297.47 | 91.96% | 1819.52 | 3683.93 | 30493.9 | |
| | 1c. GHG Emissions - Scope 3 per Mio EUR Enterprise Value | 76671.9 | 91.96% | 59543.4 | 136344 | 1.74778e+006 | |
| 2. CO ₂ -Fussabdruck | 2. GHG Emissions - Scope 1+2+3 per Mio EUR Enterprise Value | 274.72 | 91.96% | 222.49 | 510.97 | 7722.92 | |
| 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird | 3. GHG Emissions - Emissions Intensity - Total Emissions (EUR) | 102.04 | 93.86% | 100.41 | 283.08 | 259.25 | |
| 4. Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind | 4. Fossil Fuel - Involvement (PAI) | 7.07% | 92.53% | 5.73% | 12.81% | 10.78% | |

| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Benchmark Aktuell | Benchmark Vorjahr | Erklärung |
|--|--|-------------------|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|---|
| 5. Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen | 5a. CR Raw - Energy use - Coal/nuclear/undear energy sources | 58.25% | 33.1% | 58.51% | 60.28% | 60.93% | |
| | 5b. Non-renewable energy consumption | 56.29% | 35.45% | 77.18% | 62.45% | 82.37% | Der Verbrauch nicht-erneuerbarer Energie umfasst den Verbrauch von Energie, die aus nicht-erneuerbaren Quellen erzeugt wird, sowie den Verbrauch von Energie aus Biomasse. Alle Zahlen zum Energieverbrauch, bei denen die Energiequelle unklar ist, sind ebenfalls in diesem Faktor enthalten. |
| | 5c. Non-renewable energy production | 2.21% | 89.3% | 1.34% | 4.91% | 4.42% | |
| 6. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren | 6. Energy consumption intensity (GWh/mEUR) | 0.37 | 48.85% | 0.27 | 26.39 | 10.38 | |

Intensität des Energieverbrauchs pro High Impact Sector (pro Mio. EUR)



| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Benchmark Aktuell | Benchmark Vorjahr | Erklärung |
|---|--|-------------------|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|-----------|
| 7. Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken | 7. Companies negatively affecting biodiversity-sensitive areas | 0% | 92.68% | 0% | 0.18% | 0.12% | |
| 8. Emissionen in Wasser | 8. CR Raw - COD emissions | 9.05 | 0.46% | 16.17 | 95.58 | 83.81 | |
| 9. Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle | 9. CR Raw - Hazardous waste | 0.06 | 7.79% | 0 | 0.09 | 0 | |

| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Benchmark Aktuell | Benchmark Vorjahr | Erklärung |
|--|--|-------------------|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|-----------|
| 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | 10. UNGC / OECD Guidelines Violation | 0% | 92.68% | 0% | 50.36% | 20.6% | |
| 11. Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen | 11. Lack of processes monitoring UNGC and OECD Guidelines compliance | 8.75% | 76.17% | 6.48% | 16.82% | 14.16% | |
| 12. Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle | 12. Unadjusted gender pay gap | 0.78% | 12.87% | 0.71% | 0.53% | 0.51% | |
| 13. Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen | 13. Ratio of female to male board members | 63.21% | 72.12% | 60.13% | 57.5% | 57.06% | |
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) | 14. Controversial weapons involvement (APM, CM, Bio, Chem) | 0% | 93.35% | 0% | 0.13% | 0.16% | |

Nachteilige Nachhaltigkeitsauswirkungen (PAI) – Staatliche und Supranationale Vermögenswerte

Primäre Indikatoren

| Umwelt | | | | | | | |
|--------------------|-------------------|-------------------|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|-----------|
| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Benchmark Aktuell | Benchmark Vorjahr | Erklärung |
| 15. GHG Intensität | 15. GHG Intensity | 172.54 | -0.04% | 196.59 | 569.87 | 647.23 | |

| Sozial | | | | | | | |
|--|---|-------------------|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|-----------|
| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Benchmark Aktuell | Benchmark Vorjahr | Erklärung |
| 16. Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen | 16a. Countries subject to social violations (#) | 0 | 0% | 0 | 0 | 0 | |
| | 16b. Countries subject to social violations (%) | 0% | 0% | 0% | 0% | 0% | |

| Indikator | Metrik |
|-----------|---|
| 1a | Scope-1-Treibhausgas-Emissionen |
| 1b | Scope-2-Treibhausgas-Emissionen |
| 1c | Scope-3-Treibhausgas-Emissionen |
| 2. | CO2-Fussabdruck pro Mio EUR |
| 3. | THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird |
| 4. | Anteil der Investitionen in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind |
| 5a | Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung der Unternehmen, in die investiert wird, aus nicht erneuerbaren Energiequellen im Vergleich zu erneuerbaren Energiequellen, ausgedrückt in Prozent der gesamten Energiequellen |
| 5b | Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung der Unternehmen, in die investiert wird, aus nicht erneuerbaren Energiequellen im Vergleich zu erneuerbaren Energiequellen, ausgedrückt in Prozent der gesamten Energiequellen |
| 5c | Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung der Unternehmen, in die investiert wird, aus nicht erneuerbaren Energiequellen im Vergleich zu erneuerbaren Energiequellen, ausgedrückt in Prozent der gesamten Energiequellen |
| 6. | Energieverbrauch in GWh pro einer Million EUR Umsatz der Unternehmen, in die investiert wird, aufgeschlüsselt nach klimaintensiven Sektoren |
| 7. | Anteil der Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird, mit Standorten/Betrieben in oder in der Nähe von Gebieten mit schutzbedürftiger Biodiversität, sofern sich die Tätigkeiten dieser Unternehmen nachteilig auf diese Gebiete auswirken |
| 8. | Tonnen Emissionen in Wasser, die von den Unternehmen, in die investiert wird, pro investierter Million EUR verursacht werden, ausgedrückt als gewichteter Durchschnitt |
| 9. | Tonnen gefährlicher und radioaktiver Abfälle, die von den Unternehmen, in die investiert wird, pro investierter Million EUR erzeugt werden, ausgedrückt als gewichteter Durchschnitt |
| 10. | Anteil der Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird, die an Verstößen gegen die UNGC-Grundsätze oder gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen beteiligt waren |
| 11. | Anteil der Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird, die keine Richtlinien zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen oder keine Verfahren zur Bearbeitung von Beschwerden wegen Verstößen gegen die UNGC-Grundsätze und OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen eingerichtet haben |
| 12. | Durchschnittliches unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle bei den Unternehmen, in die investiert wird |
| 13. | Durchschnittliches Verhältnis von Frauen zu Männern in den Leitungs- und Kontrollorganen der Unternehmen, in die investiert wird, ausgedrückt als Prozentsatz aller Mitglieder der Leitungs- und Kontrollorgane |
| 14. | Anteil der Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird, die an der Herstellung oder am Verkauf von umstrittenen Waffen beteiligt sind |
| 15. | THG-Emissionsintensität der Länder, in die investiert wird |
| 16a | Anzahl der Länder, in die investiert wird, die nach Maßgabe internationaler Verträge und Übereinkommen, der Grundsätze der Vereinten Nationen oder, falls anwendbar, nationaler Rechtsvorschriften gegen soziale Bestimmungen verstoßen (absolute Zahl und relative Zahl, geteilt durch alle Länder, in die investiert wird) |
| 16b | Anzahl der Länder, in die investiert wird, die nach Maßgabe internationaler Verträge und Übereinkommen, der Grundsätze der Vereinten Nationen oder, falls anwendbar, nationaler Rechtsvorschriften gegen soziale Bestimmungen verstoßen (absolute Zahl und relative Zahl, geteilt durch alle Länder, in die investiert wird) |

Das Dokument wurde von Swisscanto mit geschäftsüblicher Sorgfalt erstellt und kann Informationen aus sorgfältig ausgewählten Drittquellen enthalten. Anleger sollten beachten, dass die zuvor für 2023 berechneten und veröffentlichten Daten für dieses in 2024 veröffentlichte Dokument neu berechnet wurden. Dementsprechend kann es zu Abweichungen bei diesen in den Jahren 2023 und 2024 veröffentlichten historischen Daten kommen.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 01.02.2023 - 31.01.2024

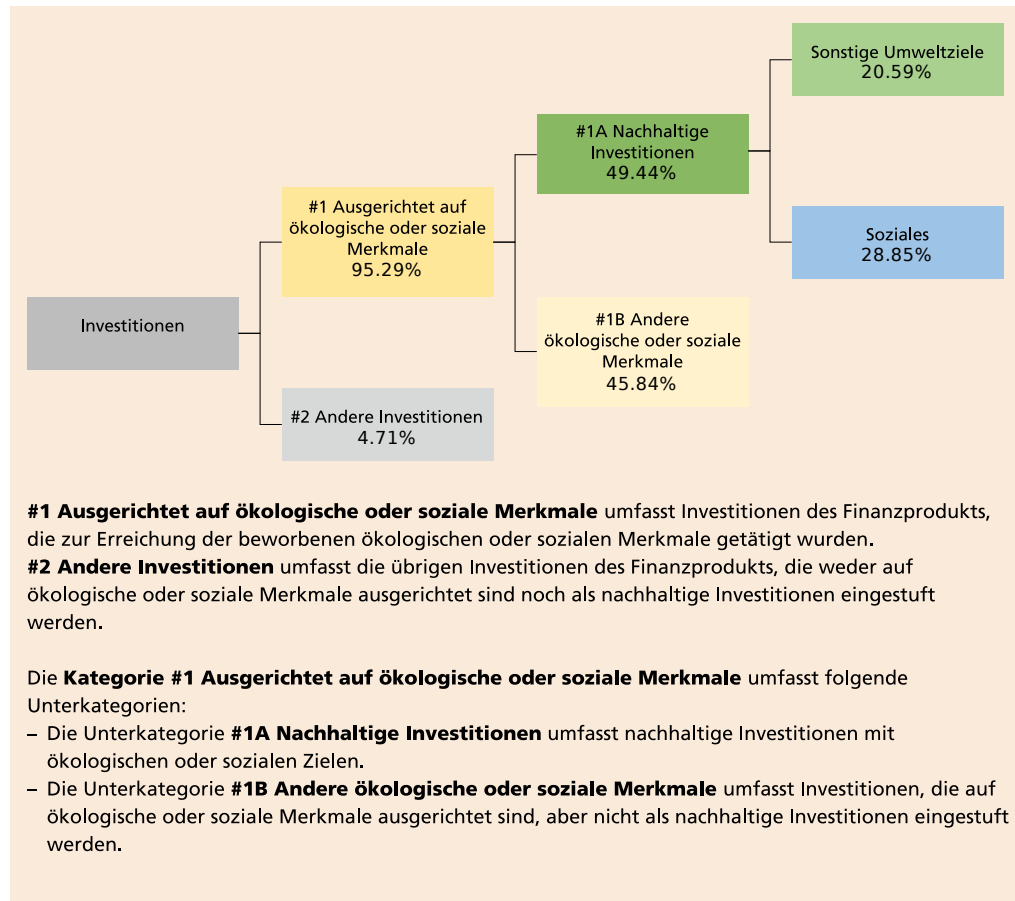
| Grösste Investitionen | Sektor | In % der Vermögenswerte | Land |
|---|------------------------------------|-------------------------|--------------------------|
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Corporate Hybrid STH USD Klasse | | 4.09% | |
| USD Cash | | 2.85% | |
| UnitedHealth Group Inc 5.875% 15-FEB-2053 | Financial and Insurance Activities | 1.26% | USA |
| EUR Cash | | 0.83% | |
| AbbVie Inc 4.5% 14-MAY-2035 | Manufacturing | 0.80% | USA |
| Bank of America Corp 6.204% 10-NOV-2028 | Financial and Insurance Activities | 0.76% | USA |
| Eli Lilly & Co 4.875% 27-FEB-2053 | Manufacturing | 0.72% | USA |
| DBS Group Holdings Ltd 1.822% 10-MAR-2031 REGS | Financial and Insurance Activities | 0.71% | Singapore |
| Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd 5.3% 19-MAY-2053 | Financial and Insurance Activities | 0.68% | Virgin Islands (British) |
| Broadcom Inc 4.926% 15-MAY-2037 144A | Manufacturing | 0.65% | USA |
| Oracle Corp 6.15% 09-NOV-2029 | Information and Communication | 0.62% | USA |
| Morgan Stanley 6.296% 18-OCT-2028 | Financial and Insurance Activities | 0.60% | USA |
| Telefonica Europe BV 7.125% PERP REGS | Financial and Insurance Activities | 0.59% | Netherlands |
| Alpek SAB de CV 4.25% 18-SEP-2029 REGS | Manufacturing | 0.58% | Mexico |
| General Motors Co 5.4% 15-OCT-2029 | Manufacturing | 0.57% | USA |



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

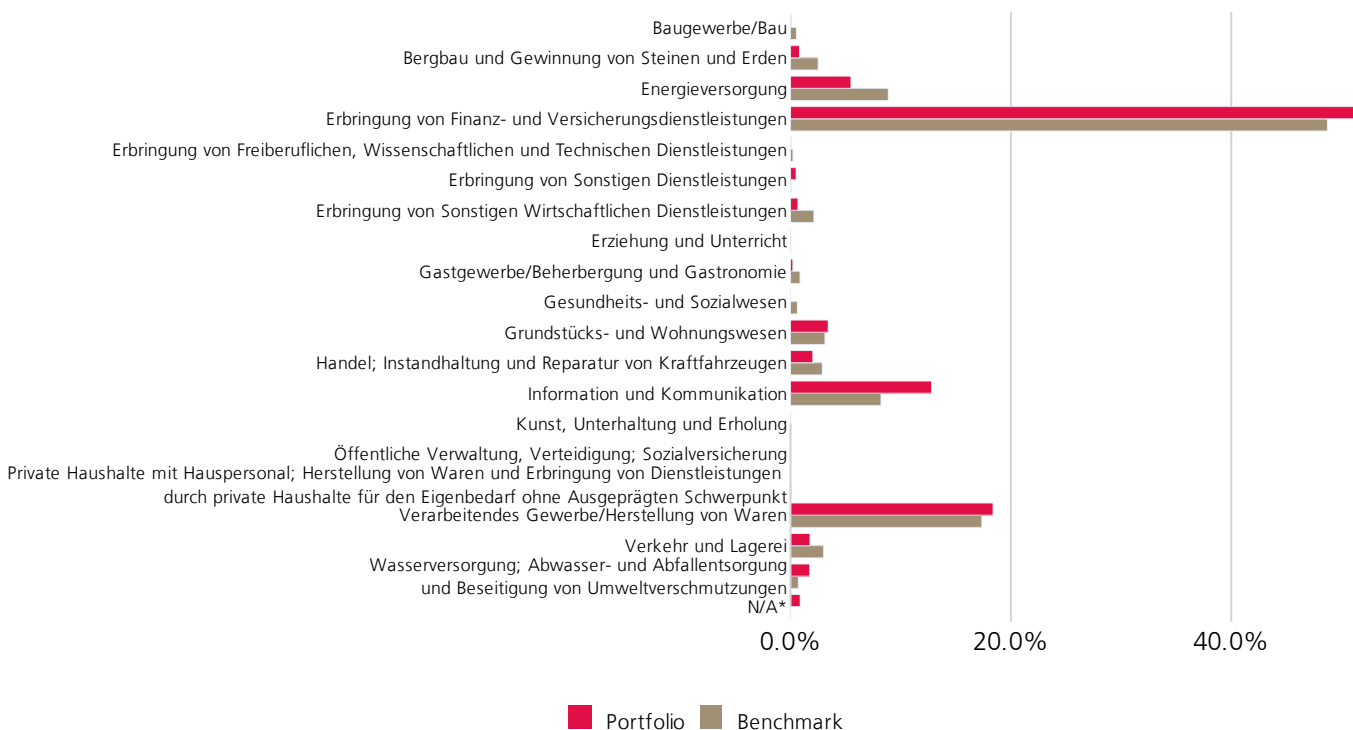
Der Anteil an nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen und Angaben zur Vermögensallokation werden in untenstehender Frage beantwortet.

Wie sah die Vermögensallokation aus?



In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Wegen mangelnder Datenverfügbarkeit können Subsektoren nicht angezeigt werden.



*Diese Klassifizierung umfasst alle Bestände, für die keine NACE-Klassifizierung gefunden oder geschätzt werden kann; Liquidität ist darin enthalten.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Obwohl keine Investitionen getätigt wurden, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind, wird in untenstehender Grafik die Alignment der nachhaltigen Investitionen mit der EU-Taxonomie offengelegt.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomeikonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert¹?

Ja

In fossiles Gas

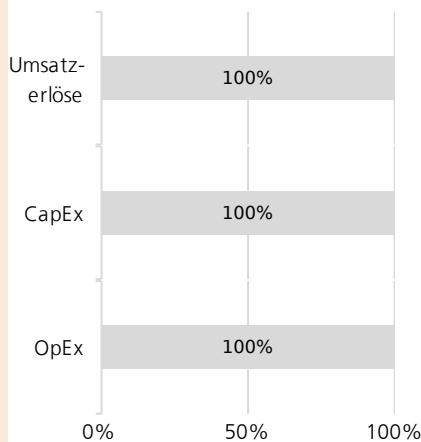
In Kernenergie

Nein

¹Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomeikonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels ("Klimaschutz") beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomeikonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

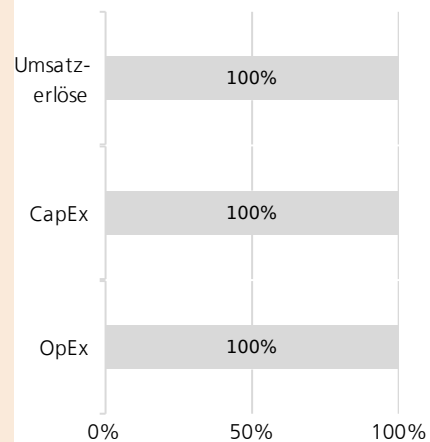
Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomeikonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzproduktes einschliesslich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzproduktes zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.

1. Taxonomiekonformität der Investitionen einschliesslich Staatsanleihen*



- Taxonomiekonform: Fossiles Gas
- Taxonomiekonform: Kernenergie
- Taxonomiekonform: (ohne fossiles Gas und Kernenergie)
- Nicht taxonomiekonform

2. Taxonomiekonformität der Investitionen ohne Staatsanleihen*



- Taxonomiekonform: Fossiles Gas
- Taxonomiekonform: Kernenergie
- Taxonomiekonform: (ohne fossiles Gas und Kernenergie)
- Nicht taxonomiekonform

Diese Grafik gibt **100.0%** der Gesamtinvestitionen wieder.

*Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff "Staatsanleihen" alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Mit Blick auf die EU-Taxonomeikonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf erneuerbare Energie oder CO2-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO2-armen Alternativen gibt und die Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomeikonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:
- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

Investitionsausgaben (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, z.B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft
- **Betriebsausgaben** (Opex), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Angaben zu Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten werden in der Tabelle zusammengefasst. Wenn keine Angaben verfügbar sind, wird die Tabelle ebenfalls keine Angaben enthalten.

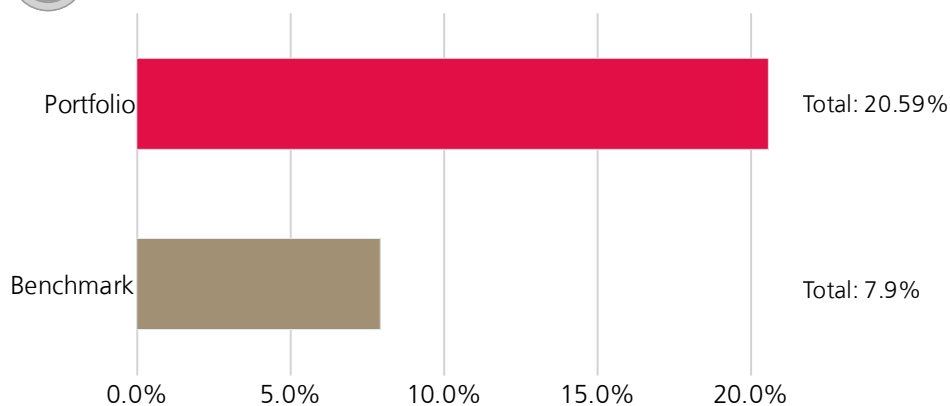
| Issuer Name | Nace Sektor | Total Eligible Activity Revenue | Total Aligned Revenue | Total Likely Aligned Revenue | Total Potentially Aligned Revenue | Portfolio Gewicht (Consol.) |
|--|---|---------------------------------|-----------------------|------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------|
| Elia Group SA/NV | Construction | 99.98% | 24.95% | 15.00% | 0.00% | 0.04% |
| Terna S.p.A. | Electricity, Gas, Steam and Air Conditioning Supply | 87.76% | 21.75% | 13.10% | 0.00% | 0.06% |
| Redeia Corporacion SA | Construction | 84.35% | 19.80% | 12.73% | 0.00% | 0.04% |
| Orsted | Electricity, Gas, Steam and Air Conditioning Supply | 56.27% | 18.25% | 31.86% | 0.00% | 0.35% |
| National Grid plc | Electricity, Gas, Steam and Air Conditioning Supply | 19.17% | 16.75% | 0.00% | 0.36% | 0.45% |
| National Grid Electricity Transmission Plc | Electricity, Gas, Steam and Air Conditioning Supply | 19.17% | 16.75% | 0.00% | 0.36% | 0.17% |
| NGG Finance Plc | Financial and Insurance Activities | 19.17% | 16.75% | 0.00% | 0.36% | 0.05% |
| EDP-Energias de Portugal SA | Electricity, Gas, Steam and Air Conditioning Supply | 77.52% | 12.25% | 0.00% | 32.43% | 0.64% |
| EDP Finance BV | Electricity, Gas, Steam and Air Conditioning Supply | 77.52% | 12.25% | 0.00% | 32.43% | 0.39% |
| Electricite de France SA | Electricity, Gas, Steam and Air Conditioning Supply | 71.56% | 9.50% | 0.00% | 7.23% | 0.10% |

Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?


Da im vorangegangenen Berichtsjahr keine Daten verfügbar waren, erübrigt sich ein Vorjahresvergleich.

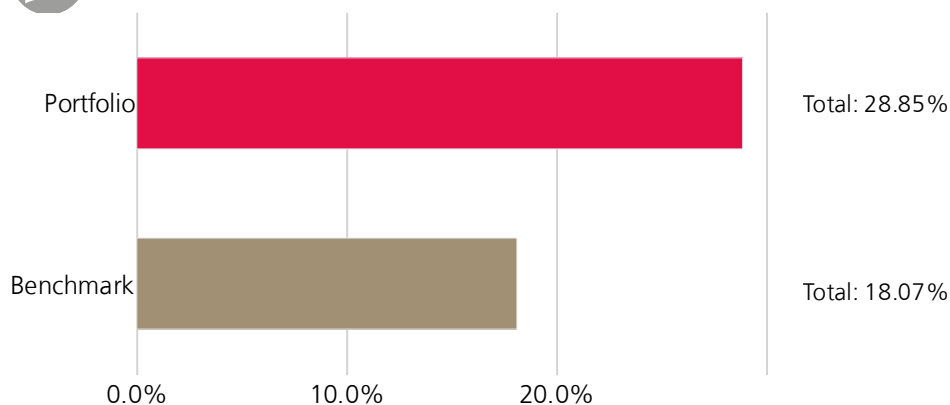
 sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.

 **Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**




Das Diagramm zeigt die prozentualen Umsätze der im Portfolio des Fonds enthaltenen Unternehmungen und der der Benchmark, welche nicht EU-Taxonomie konform, jedoch im Einklang mit den sich aus den SDGs ergebenden Umweltzielen gemäss Art. 2 (17) SFDR investiert worden sind.

 **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**



Das Diagramm zeigt die prozentualen Umsätze der im Portfolio des Fonds enthaltenen Unternehmungen und der der Benchmark, welche nicht EU-Taxonomie konform, jedoch im Einklang mit den sich aus den SDGs ergebenden sozialen Zielen gemäss Art. 2 (17) SFDR investiert worden sind.

 **Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

Diese Vermögenswerte haben die in der spezifischen Anlagepolitik vorgesehenen Anlagen umfasst, einschliesslich Derivate zu Absicherungszwecken und flüssige Mittel. Die Anlagen, ausgenommen Derivate und flüssige Mittel, haben die Grundsätze des ökologischen oder sozialen Mindestschutzes umgesetzt.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Im Berichtszeitraum förderte der Vermögensverwalter durch Investment Stewardship und Kapitalallokation nachhaltige Geschäftspraktiken und die Einhaltung anerkannter internationaler Prinzipien und ESG-Best-Practice-Standards. Dementsprechend stand er im Dialog mit den Managementteams der investierten Unternehmen. Darüber hinaus hat er sich im Rahmen der United Nations Collaboration Platform for Responsible Investment (UN PRI) und bei Investoreninitiativen engagiert. Das Abstimmungsverhalten basierte auf den schweizerischen und internationalen Corporate-Governance-Regeln sowie auf den Prinzipien des UN Global Compact und den 17 Zielen für nachhaltige Entwicklung (UN SDGs). Weitere Informationen finden Sie unter: Swisscanto | Proxy Voting Dashboard (issgovernance.com) <https://www.swisscanto.com/int/de/nachhaltigkeit/investment-stewardship.html>

Swisscanto | Proxy Voting Dashboard (issgovernance.com)

<https://www.swisscanto.com/int/de/nachhaltigkeit/investment-stewardship.html>



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Es wurde kein Index als Referenzwert bestimmt, um festzustellen, ob dieses Finanzprodukt auf die beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet ist.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?

Nicht anwendbar.

Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?

Nicht anwendbar.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?

Nicht anwendbar.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?

Nicht anwendbar.

Das Dokument wurde von Swisscanto mit geschäftsüblicher Sorgfalt erstellt und kann Informationen aus sorgfältig ausgewählten Drittquellen enthalten. Anleger sollten beachten, dass die zuvor für 2023 berechneten und veröffentlichten Daten für dieses in 2024 veröffentlichte Dokument neu berechnet wurden. Dementsprechend kann es zu Abweichungen bei diesen in den Jahren 2023 und 2024 veröffentlichten historischen Daten kommen.



Regelmässige Information zum 31.01.2024

Regelmässige Informationen zu den in Artikel 8, Absätze 1, 2, 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts:

Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Global Rates

Unternehmenskennung (LEI-Code):

5493007MXNV1316JL462

Benchmark

Bloomberg Global Treasury Index (TR) in USD

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. In dieser Verordnung ist kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten festgelegt. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

| <input checked="" type="radio"/> <input checked="" type="radio"/> <input type="checkbox"/> Ja | | <input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> <input checked="" type="checkbox"/> Nein | |
|--|--|--|---|
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: _ % | <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind | <input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 12.7% an nachhaltigen Investitionen | <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind |
| <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind | <input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: _ % | <input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind | <input checked="" type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel |
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: _ % | | <input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt . | |



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Der Teilfonds wurde im September 2023 repositioniert. Die beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale haben Gültigkeit mit Stichtag der Repositionierung. Die von dem Teilfonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale wurden durch folgende Aktivitäten erreicht:

1. Ausschlusskriterien
2. ESG-Integration
3. Reduktion der CO2e-Intensität

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Aus Übersichtsgründen werden die Angaben zur Performance (siehe Details am Ende des Reports) der Nachhaltigkeitsindikatoren direkt mit dem historischen Vergleich in der nächsten Frage beantwortet.

...und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Ausschlusskriterien

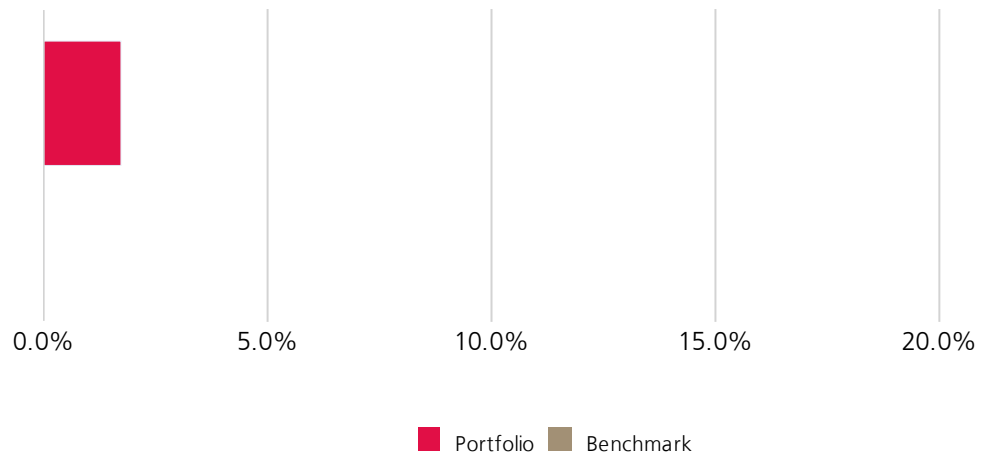
| Responsible | | | | | | | |
|-------------------------------------|-------------------|--|------------------------------|---|-------------------|-------------------|------------------------------|
| Kriterien | Gewicht Portfolio | Gewicht Benchmark | Anzahl Unternehmen Benchmark | Kriterien | Gewicht Portfolio | Gewicht Benchmark | Anzahl Unternehmen Benchmark |
| Förderung von Kohle (> 5% Umsatz) | 0.00% | 0.00% | 0 | Ausbeuterische Kinderarbeit | 0.00% | 0.00% | 0 |
| Kohlereserven (ex. Metalproduktion) | 0.00% | 0.00% | 0 | Herstellung von Kriegstechnik (> 5% Umsatz) | 0.00% | 0.00% | 0 |
| Klimawandel | | Gefährdung von Gesellschaft und Gesundheit | | Herstellung von Pornografie | 0.00% | 0.00% | 0 |
| | | | | Herstellung von Waffen & Munition | 0.00% | 0.00% | 0 |
| | | | | Kontroverse Waffen | 0.00% | 0.00% | 0 |
| | | | | UN Global Compact Verstöße | 0.00% | 0.00% | 0 |

Zwecks Minderung der Nachhaltigkeitsrisiken und mit dem Ziel, nicht in Wertpapiere der oben aufgeführten kontroversen Geschäftsmodellen zu investieren, sind die oben genannten Ausschlusskriterien angewendet worden. Die Tabelle zeigt die Anzahl der Unternehmen, die gegen die Ausschlusskriterien verstossen haben, sowie die jeweilige Portfolio- und Benchmark-Exposition. Liegen bei einem Unternehmen mehrere Verstöße vor, werden diese für jedes Kriterium separat aufgeführt. Daher ist die Summe aller Positionen in diesem Bericht in der Regel höher als die effektive Allokation zu den oben abgebildeten Kriterien. Die historischen Vergleiche werden in nachfolgender Tabelle gemacht. Aus Übersichtsgründen werden die Ausschlusskriterien aggregiert.

| | Indikator | Datum 2023 | Datum 2024 |
|-----------|----------------------------|------------|------------|
| Portfolio | Ausschlusskriterien Total* | 0% | 0% |
| Benchmark | Ausschlusskriterien Total* | 0.31% | 0% |

*alle Ausschlusskriterien kumuliert.

ESG-Integration



Das Portfolio strebte in der Berichtsperiode eine Allokation zu ESG-Laggards \leq 20% an. ESG Laggards sind Unternehmungen mit der schwächsten Umwelt-, Sozial- und Governance- Performance des relevanten Anlageuniversums.

Die historischen Vergleiche werden in nachfolgender Tabelle gemacht.

| | Indikator | Datum 2023 | Datum 2024 |
|-----------|----------------------------|------------|------------|
| Portfolio | Exposition zu ESG Laggards | 6.45% | 1.73% |
| Benchmark | Exposition zu ESG Laggards | 1.72% | 0% |

Reduktion der CO₂e-Intensität

Portfolio

CO₂e-Intensität (Sovereign)
Tonnen CO₂e / Mio. USD BIP

272

Benchmark

CO₂e-Intensität (Sovereign)
Tonnen CO₂e / Mio. USD BIP

304

Das Portfolio strebte eine tiefere CO₂e-Intensität gegenüber dem Benchmark an.
Die historischen Vergleiche werden in nachfolgender Tabelle gemacht.

| | Indikator | Datum 2023 | Datum 2024 |
|-----------|--|------------|------------|
| Portfolio | CO ₂ e-Intensität Corporate | 198 | 0 |
| | CO ₂ e-Intensität Sovereign | 645 | 272 |
| | Reduktion Corporate | 25% | 0% |
| Benchmark | CO ₂ e-Intensität Corporate | 76 | 0 |
| | CO ₂ e-Intensität Sovereign | 450 | 304 |
| | Reduktion Corporate | 24% | 0% |

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Dieser Teilfonds hatte in der Berichtsperiode kein Ziel nachhaltige Investitionen zu tätigen. Ein Vergleich zu früheren Perioden ist deswegen nicht möglich.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Dieser Teilfonds hatte in der Berichtsperiode kein Ziel nachhaltige Investitionen zu tätigen. Ein Vergleich zu früheren Perioden ist deswegen nicht möglich.

● **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Dieser Teilfonds hatte in der Berichtsperiode kein Ziel nachhaltige Investitionen zu tätigen. Ein Vergleich zu früheren Perioden ist deswegen nicht möglich.

● **Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:**

Dieser Teilfonds hatte in der Berichtsperiode kein Ziel nachhaltige Investitionen zu tätigen. Ein Vergleich zu früheren Perioden ist deswegen nicht möglich.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

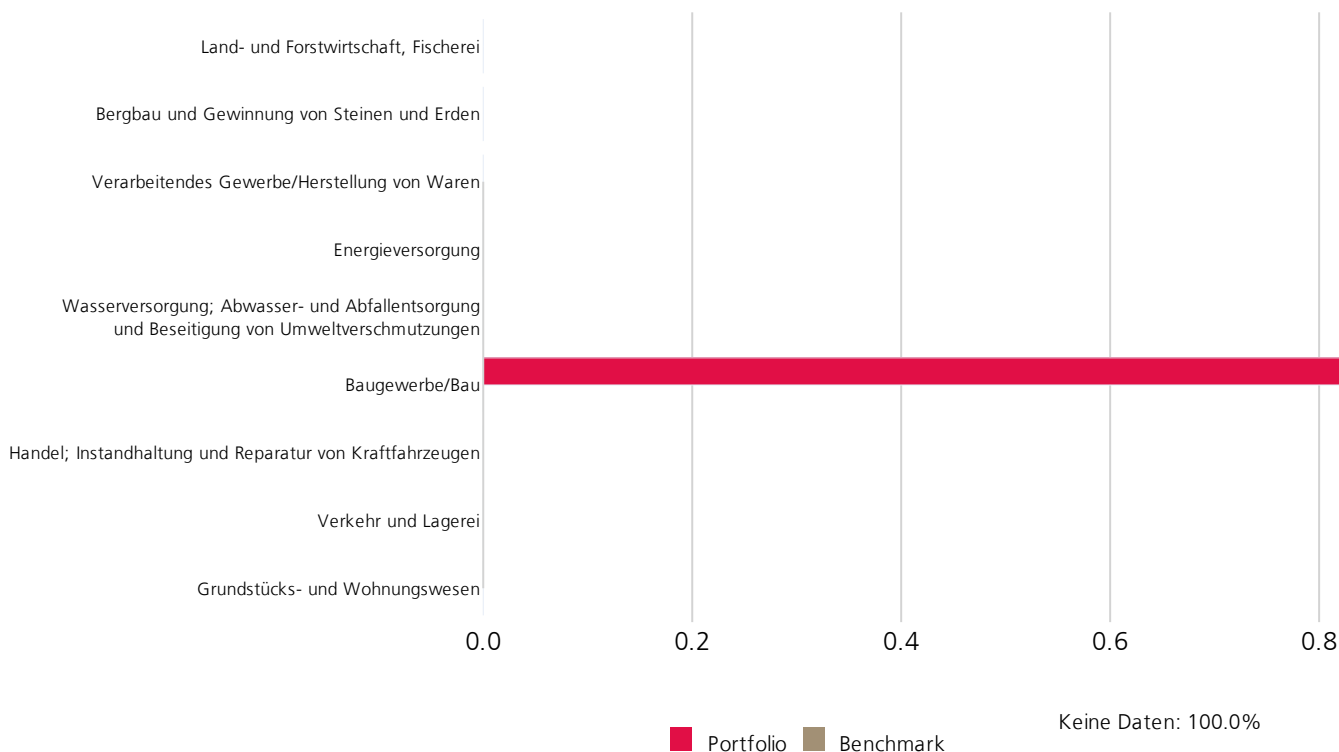
Nachteilige Nachhaltigkeitsauswirkungen (PAI) – Corporate Anlagen

Primäre Indikatoren - Energie und Emissionen

| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Benchmark Aktuell | Benchmark Vorjahr | Erklärung |
|--|--|-------------------|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|-----------|
| 1. THG-Emissionen | 1a. GHG Emissions - Scope 1 per Mio EUR Enterprise Value | 0.19 | 2.53% | 2843.33 | 0 | 2334.01 | |
| | 1b. GHG Emissions - Scope 2 per Mio EUR Enterprise Value | 0.47 | 2.53% | 573.42 | 0 | 399.16 | |
| | 1c. GHG Emissions - Scope 3 per Mio EUR Enterprise Value | 16.2 | 2.53% | 27138.9 | 0 | 11951.3 | |
| 2. CO ₂ -Fussabdruck | 2. GHG Emissions - Scope 1+2+3 per Mio EUR Enterprise Value | 0.35 | 2.53% | 376.39 | 0 | 185 | |
| 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird | 3. GHG Emissions - Emissions Intensity - Total Emissions (EUR) | 39.27 | 3.28% | 280.73 | 0 | 244.52 | |
| 4. Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind | 4. Fossil Fuel - Involvement (PAI) | 0.72% | 7.49% | 4.73% | 0% | 3.32% | |

| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Benchmark Aktuell | Benchmark Vorjahr | Erklärung |
|--|--|-------------------|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|---|
| 5. Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen | 5a. CR Raw - Energy use - Coal/nuclear/undear energy sources | 45.36% | 1.73% | 72.6% | 0% | 41.52% | |
| | 5b. Non-renewable energy consumption | 44.49% | 1.73% | 89.74% | 0% | 46.25% | Der Verbrauch nicht-erneuerbarer Energie umfasst den Verbrauch von Energie, die aus nicht-erneuerbaren Quellen erzeugt wird, sowie den Verbrauch von Energie aus Biomasse. Alle Zahlen zum Energieverbrauch, bei denen die Energiequelle unklar ist, sind ebenfalls in diesem Faktor enthalten. |
| | 5c. Non-renewable energy production | 0% | 6.78% | 0.96% | 0% | 1.33% | |
| 6. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren | 6. Energy consumption intensity (GWh/mEUR) | 0.82 | 1.43% | 1.44 | 0 | 144.19 | |

Intensität des Energieverbrauchs pro High Impact Sector (pro Mio. EUR)



| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Benchmark Aktuell | Benchmark Vorjahr | Erklärung |
|---|--|-------------------|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|-----------|
| 7. Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken | 7. Companies negatively affecting biodiversity-sensitive areas | 0% | 8.25% | 0% | 0% | 0.14% | |
| 8. Emissionen in Wasser | 8. CR Raw - COD emissions | 0 | 0% | 14.02 | 0 | 3.17 | |
| 9. Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle | 9. CR Raw - Hazardous waste | 0 | 1.1% | 0 | 0 | 0 | |

| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Benchmark Aktuell | Benchmark Vorjahr | Erklärung |
|--|--|-------------------|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|-----------|
| 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | 10. UNGC / OECD Guidelines Violation | 0% | 8.25% | 0% | 0% | 9.68% | |
| 11. Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen | 11. Lack of processes monitoring UNGC and OECD Guidelines compliance | 2.46% | 4.1% | 5.7% | 0% | 5.51% | |
| 12. Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle | 12. Unadjusted gender pay gap | 0% | 0% | 0.18% | 0% | 0.08% | |
| 13. Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen | 13. Ratio of female to male board members | 0% | 0% | 55.95% | 0% | 20.64% | |
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) | 14. Controversial weapons involvement (APM, CM, Bio, Chem) | 0% | 7.49% | 0% | 0% | 0% | |

Nachteilige Nachhaltigkeitsauswirkungen (PAI) – Staatliche und Supranationale Vermögenswerte

Primäre Indikatoren

| Umwelt | | | | | | | |
|--------------------|-------------------|-------------------|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|-----------|
| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Benchmark Aktuell | Benchmark Vorjahr | Erklärung |
| 15. GHG Intensität | 15. GHG Intensity | 306.31 | 87.32% | 708.53 | 335.29 | 636.29 | |

| Sozial | | | | | | | |
|--|---|-------------------|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|-----------|
| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Benchmark Aktuell | Benchmark Vorjahr | Erklärung |
| 16. Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen | 16a. Countries subject to social violations (#) | 3 | 49.8% | 8 | 6 | 22 | |
| | 16b. Countries subject to social violations (%) | 9.11% | 49.8% | 22.58% | 11.43% | 15.51% | |

| Indikator | Metrik |
|-----------|---|
| 1a | Scope-1-Treibhausgas-Emissionen |
| 1b | Scope-2-Treibhausgas-Emissionen |
| 1c | Scope-3-Treibhausgas-Emissionen |
| 2. | CO2-Fussabdruck pro Mio EUR |
| 3. | THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird |
| 4. | Anteil der Investitionen in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind |
| 5a | Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung der Unternehmen, in die investiert wird, aus nicht erneuerbaren Energiequellen im Vergleich zu erneuerbaren Energiequellen, ausgedrückt in Prozent der gesamten Energiequellen |
| 5b | Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung der Unternehmen, in die investiert wird, aus nicht erneuerbaren Energiequellen im Vergleich zu erneuerbaren Energiequellen, ausgedrückt in Prozent der gesamten Energiequellen |
| 5c | Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung der Unternehmen, in die investiert wird, aus nicht erneuerbaren Energiequellen im Vergleich zu erneuerbaren Energiequellen, ausgedrückt in Prozent der gesamten Energiequellen |
| 6. | Energieverbrauch in GWh pro einer Million EUR Umsatz der Unternehmen, in die investiert wird, aufgeschlüsselt nach klimaintensiven Sektoren |
| 7. | Anteil der Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird, mit Standorten/Betrieben in oder in der Nähe von Gebieten mit schutzbedürftiger Biodiversität, sofern sich die Tätigkeiten dieser Unternehmen nachteilig auf diese Gebiete auswirken |
| 8. | Tonnen Emissionen in Wasser, die von den Unternehmen, in die investiert wird, pro investierter Million EUR verursacht werden, ausgedrückt als gewichteter Durchschnitt |
| 9. | Tonnen gefährlicher und radioaktiver Abfälle, die von den Unternehmen, in die investiert wird, pro investierter Million EUR erzeugt werden, ausgedrückt als gewichteter Durchschnitt |
| 10. | Anteil der Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird, die an Verstößen gegen die UNGC-Grundsätze oder gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen beteiligt waren |
| 11. | Anteil der Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird, die keine Richtlinien zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen oder keine Verfahren zur Bearbeitung von Beschwerden wegen Verstößen gegen die UNGC-Grundsätze und OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen eingerichtet haben |
| 12. | Durchschnittliches unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle bei den Unternehmen, in die investiert wird |
| 13. | Durchschnittliches Verhältnis von Frauen zu Männern in den Leitungs- und Kontrollorganen der Unternehmen, in die investiert wird, ausgedrückt als Prozentsatz aller Mitglieder der Leitungs- und Kontrollorgane |
| 14. | Anteil der Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird, die an der Herstellung oder am Verkauf von umstrittenen Waffen beteiligt sind |
| 15. | THG-Emissionsintensität der Länder, in die investiert wird |
| 16a | Anzahl der Länder, in die investiert wird, die nach Maßgabe internationaler Verträge und Übereinkommen, der Grundsätze der Vereinten Nationen oder, falls anwendbar, nationaler Rechtsvorschriften gegen soziale Bestimmungen verstoßen (absolute Zahl und relative Zahl, geteilt durch alle Länder, in die investiert wird) |
| 16b | Anzahl der Länder, in die investiert wird, die nach Maßgabe internationaler Verträge und Übereinkommen, der Grundsätze der Vereinten Nationen oder, falls anwendbar, nationaler Rechtsvorschriften gegen soziale Bestimmungen verstoßen (absolute Zahl und relative Zahl, geteilt durch alle Länder, in die investiert wird) |

Das Dokument wurde von Swisscanto mit geschäftsüblicher Sorgfalt erstellt und kann Informationen aus sorgfältig ausgewählten Drittquellen enthalten. Anleger sollten beachten, dass die zuvor für 2023 berechneten und veröffentlichten Daten für dieses in 2024 veröffentlichte Dokument neu berechnet wurden. Dementsprechend kann es zu Abweichungen bei diesen in den Jahren 2023 und 2024 veröffentlichten historischen Daten kommen.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 01.02.2023 - 31.01.2024

| Grösste Investitionen | Sektor | In % der Vermögenswerte | Land |
|---|---|-------------------------|------------|
| Government of the United States of America 1.125% 28-FEB-2027 | Public Administration and Defence, Compulsory Social Security | 6.23% | USA |
| Government of the United States of America 0.375% 15-SEP-2024 | Public Administration and Defence, Compulsory Social Security | 4.81% | USA |
| Government of Japan 0.3% 20-DEC-2025 | Public Administration and Defence, Compulsory Social Security | 4.67% | Japan |
| Government of the United States of America 0.25% 30-SEP-2025 | Public Administration and Defence, Compulsory Social Security | 4.58% | USA |
| Government of the United States of America 4.125% 31-AUG-2030 | Public Administration and Defence, Compulsory Social Security | 3.92% | USA |
| Government of the United States of America 3.875% 15-AUG-2033 | Public Administration and Defence, Compulsory Social Security | 3.83% | USA |
| Government of Japan 0.5% 20-JUN-2038 | Public Administration and Defence, Compulsory Social Security | 3.28% | Japan |
| Government of Japan 0.1% 20-SEP-2030 | Public Administration and Defence, Compulsory Social Security | 3.23% | Japan |
| Government of the United States of America 4.125% 15-AUG-2053 | Public Administration and Defence, Compulsory Social Security | 2.42% | USA |
| Government of Japan 0.4% 20-JUN-2033 | Public Administration and Defence, Compulsory Social Security | 2.24% | Japan |
| Government of Austria 2.9% 23-MAY-2029 | Financial and Insurance Activities | 2.17% | |
| Government of Japan 1.1% 20-MAR-2043 | Public Administration and Defence, Compulsory Social Security | 2.02% | Japan |
| Government of United Kingdom 4.75% 07-DEC-2038 | Financial and Insurance Activities | 1.78% | |
| Entidad Publica Empresarial ADIF-Alta Velocidad 3.5% 30-JUL-2028 REGS | Construction | 1.73% | Spain |
| Government of China 3.13% 21-NOV-2029 | Financial and Insurance Activities | 1.43% | Luxembourg |

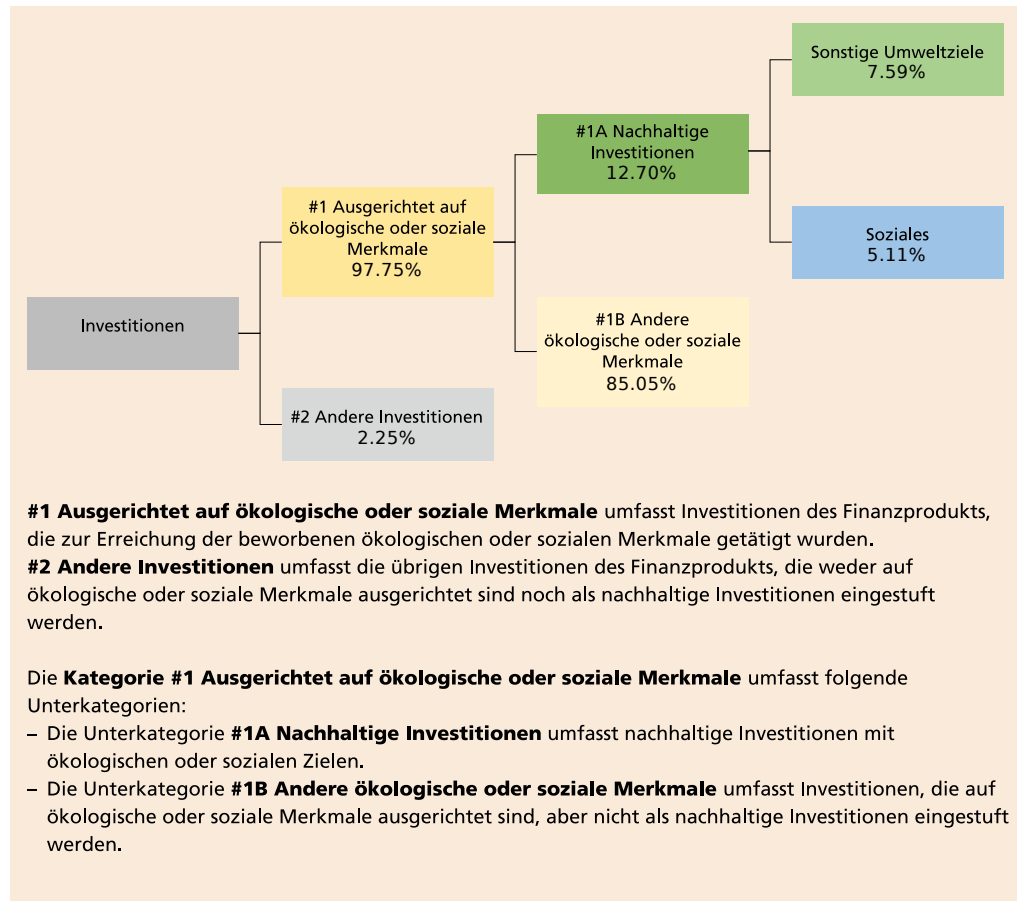


Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Der Anteil an nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen und Angaben zur Vermögensallokation werden in untenstehender Frage beantwortet.

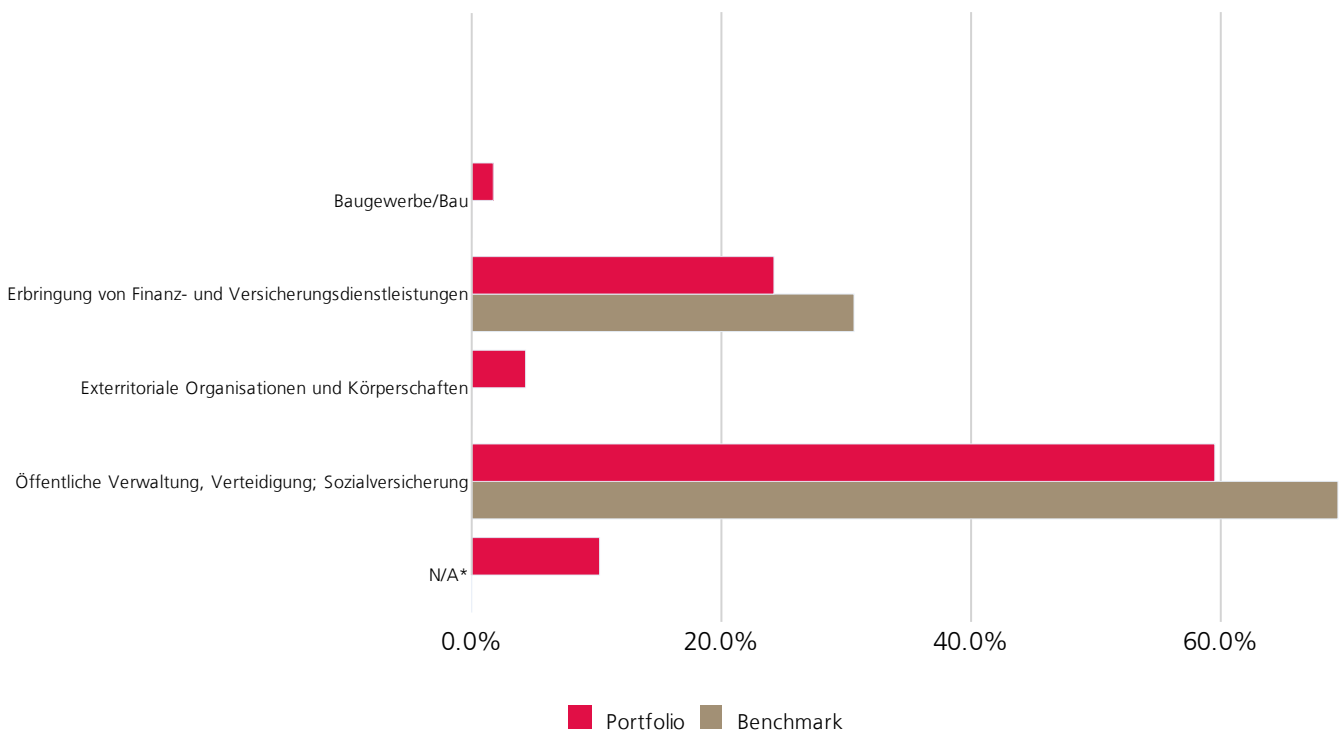
Wie sah die Vermögensallokation aus?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.



In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Wegen mangelnder Datenverfügbarkeit können Subsektoren nicht angezeigt werden.



*Diese Klassifizierung umfasst alle Bestände, für die keine NACE-Klassifizierung gefunden oder geschätzt werden kann; Liquidität ist darin enthalten.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Obwohl keine Investitionen getätigt wurden, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind, wird in untenstehender Grafik die Alignment der nachhaltigen Investitionen mit der EU-Taxonomie offengelegt.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomeikonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert¹?

Ja

In fossiles Gas

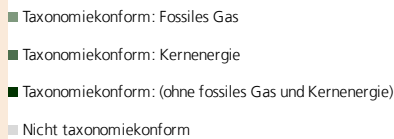
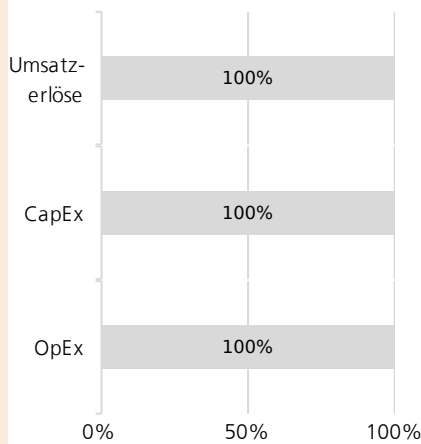
In Kernenergie

Nein

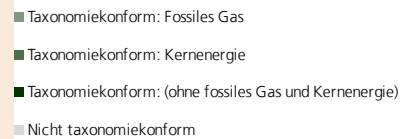
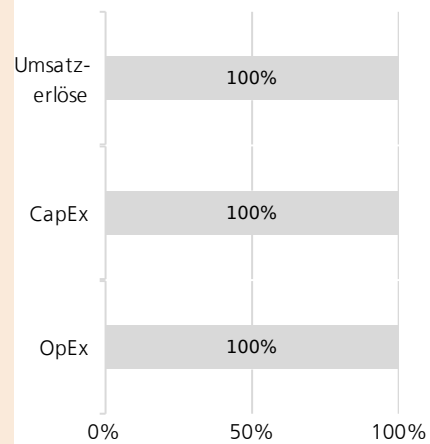
¹Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomeikonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels ("Klimaschutz") beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomeikonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomeikonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzproduktes einschliesslich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzproduktes zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.

1. Taxonomiekonformität der Investitionen einschliesslich Staatsanleihen*



2. Taxonomiekonformität der Investitionen ohne Staatsanleihen*



Diese Grafik gibt 2.7% der Gesamtinvestitionen wieder.

*Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff "Staatsanleihen" alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Mit Blick auf die EU-Taxonomeikonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf erneuerbare Energie oder CO2-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO2-armen Alternativen gibt und die Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomeikonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:
- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

Investitionsausgaben (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, z.B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft
- **Betriebsausgaben** (Opex), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Angaben zu Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten werden in der Tabelle zusammengefasst. Wenn keine Angaben verfügbar sind, wird die Tabelle ebenfalls keine Angaben enthalten.

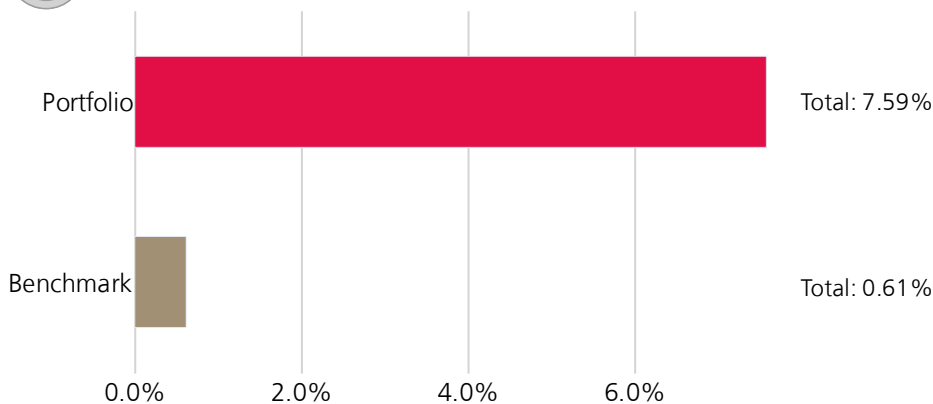
| Issuer Name | Nace Sektor | Total Eligible Activity Revenue | Total Aligned Revenue | Total Likely Aligned Revenue | Total Potentially Aligned Revenue | Portfolio Gewicht (Consol.) |
|-------------|-------------|---------------------------------|-----------------------|------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------|
|-------------|-------------|---------------------------------|-----------------------|------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------|

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**


Da im vorangegangenen Berichtsjahr keine Daten verfügbar waren, erübrigt sich ein Vorjahresvergleich.

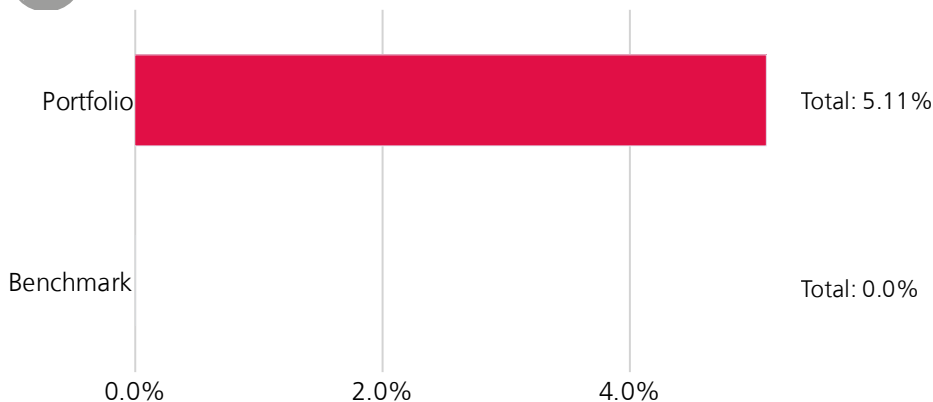
 sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.

 **Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**




Das Diagramm zeigt die prozentualen Umsätze der im Portfolio des Fonds enthaltenen Unternehmungen und der der Benchmark, welche nicht EU-Taxonomie konform, jedoch im Einklang mit den sich aus den UN Sustainable Development Goals SDGs ergebenden Umweltzielen gemäss Art. 2 (17) SFDR investiert worden sind.

 **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**



Das Diagramm zeigt die prozentualen Umsätze der im Portfolio des Fonds enthaltenen Unternehmungen und der der Benchmark, welche nicht EU-Taxonomie konform, jedoch im Einklang mit den sich aus den SDGs ergebenden sozialen Zielen gemäss Art. 2 (17) SFDR investiert worden sind.

 **Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

Diese Vermögenswerte haben die in der spezifischen Anlagepolitik vorgesehenen Anlagen umfasst, einschliesslich Derivate zu Absicherungszwecken und flüssige Mittel. Die Anlagen, ausgenommen Derivate und flüssige Mittel, haben die Grundsätze des ökologischen oder sozialen Mindestschutzes umgesetzt.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Im Berichtszeitraum förderte der Vermögensverwalter durch Investment Stewardship und Kapitalallokation nachhaltige Geschäftspraktiken und die Einhaltung anerkannter internationaler Prinzipien und ESG-Best-Practice-Standards. Dementsprechend stand er im Dialog mit den Managementteams der investierten Unternehmen. Darüber hinaus hat er sich im Rahmen der United Nations Collaboration Platform for Responsible Investment (UN PRI) und bei Investoreninitiativen engagiert. Das Abstimmungsverhalten basierte auf den schweizerischen und internationalen Corporate-Governance-Regeln sowie auf den Prinzipien des UN Global Compact und den 17 Zielen für nachhaltige Entwicklung (UN SDGs). Weitere Informationen finden Sie unter: Swisssanto | Proxy Voting Dashboard (issgovernance.com) <https://www.swisssanto.com/int/de/nachhaltigkeit/investment-stewardship.html>

Swisssanto | Proxy Voting Dashboard (issgovernance.com)

<https://www.swisssanto.com/int/de/nachhaltigkeit/investment-stewardship.html>



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Es wurde kein Index als Referenzwert bestimmt, um festzustellen, ob dieses Finanzprodukt auf die beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet ist.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?

Nicht anwendbar.

Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?

Nicht anwendbar.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?

Nicht anwendbar.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?

Nicht anwendbar.

Das Dokument wurde von Swisssanto mit geschäftsüblicher Sorgfalt erstellt und kann Informationen aus sorgfältig ausgewählten Drittquellen enthalten. Anleger sollten beachten, dass die zuvor für 2023 berechneten und veröffentlichten Daten für dieses in 2024 veröffentlichte Dokument neu berechnet wurden. Dementsprechend kann es zu Abweichungen bei diesen in den Jahren 2023 und 2024 veröffentlichten historischen Daten kommen.



Regelmässige Information zum 31.01.2024

Regelmässige Informationen zu den in Artikel 8, Absätze 1, 2, 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts:

Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Secured High Yield

Unternehmenskennung (LEI-Code):

549300OW4OTO4HNXLS12

Benchmark

ICE BofA 50% Secured HY EUR & ICE BofA 50% Secured HY USD (TR) hedged in USD

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. In dieser Verordnung ist kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten festgelegt. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

| <input checked="" type="radio"/> Ja | | <input checked="" type="radio"/> Nein | |
|--|---|--|--|
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: _ % | <input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 30.74% an nachhaltigen Investitionen | | |
| <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind | <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind | | |
| <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind | <input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind | | |
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: _ % | <input checked="" type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel | | |
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: _ % | <input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt . | | |



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die von dem Teilfonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale wurden durch folgende Aktivitäten erreicht:

1. Ausschlusskriterien
2. ESG-Integration
3. Reduktion der CO₂e-Intensität
4. Nachhaltige Investitionen





Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Aus Übersichtsgründen werden die Angaben zur Performance (siehe Details am Ende des Reports) der Nachhaltigkeitsindikatoren direkt mit dem historischen Vergleich in der nächsten Frage beantwortet.

...und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Ausschlusskriterien

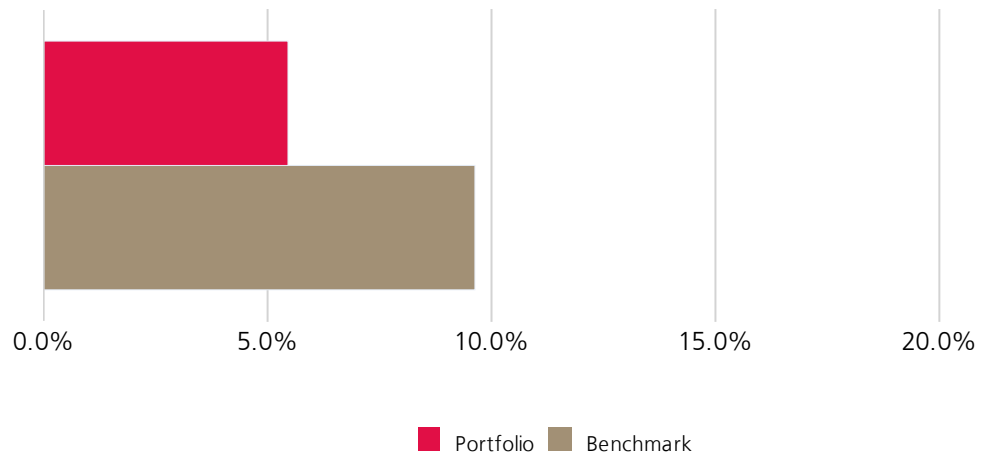
| Responsible | | | | | | | |
|---|-------------------|--|------------------------------|--|-------------------|-------------------|------------------------------|
| Kriterien | Gewicht Portfolio | Gewicht Benchmark | Anzahl Unternehmen Benchmark | Kriterien | Gewicht Portfolio | Gewicht Benchmark | Anzahl Unternehmen Benchmark |
|  Kohlereserven (ex. Metallproduktion) | 0.00% | 0.08% | 1 |  Herstellung von Pornografie | 0.00% | 1.27% | 2 |
| Förderung von Kohle (> 5% Umsatz) | 0.00% | 0.00% | 0 | Ausbeuterische Kinderarbeit | 0.00% | 0.00% | 0 |
|  Klimawandel | |  Gefährdung von Gesellschaft und Gesundheit | | Herstellung von Kriegstechnik (> 5% Umsatz) | 0.00% | 0.00% | 0 |
| | | | | Herstellung von Waffen & Munition | 0.00% | 0.00% | 0 |
| | | | | Kontroverse Waffen | 0.00% | 0.00% | 0 |
| | | | | UN Global Compact Verstöße | 0.00% | 0.00% | 0 |

Zwecks Minderung der Nachhaltigkeitsrisiken und mit dem Ziel, nicht in Wertpapiere der oben aufgeführten kontroversen Geschäftsmodellen zu investieren, sind die oben genannten Ausschlusskriterien angewendet worden. Die Tabelle zeigt die Anzahl der Unternehmen, die gegen die Ausschlusskriterien verstossen haben, sowie die jeweilige Portfolio- und Benchmark-Exposition. Liegen bei einem Unternehmen mehrere Verstöße vor, werden diese für jedes Kriterium separat aufgeführt. Daher ist die Summe aller Positionen in diesem Bericht in der Regel höher als die effektive Allokation zu den oben abgebildeten Kriterien. Die historischen Vergleiche werden in nachfolgender Tabelle gemacht. Aus Übersichtsgründen werden die Ausschlusskriterien aggregiert.

| | Indikator | Datum 2023 | Datum 2024 |
|-----------|----------------------------|------------|------------|
| Portfolio | Ausschlusskriterien Total* | 0% | 0% |
| Benchmark | Ausschlusskriterien Total* | 1.02% | 1.35% |

*alle Ausschlusskriterien kumuliert.

ESG-Integration



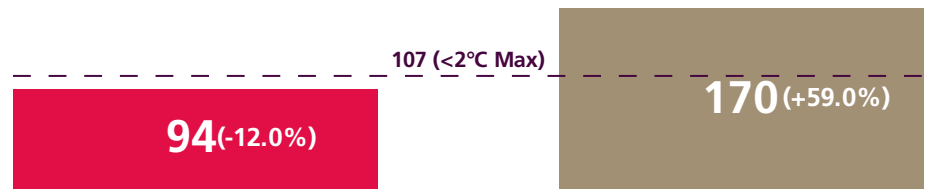
Das Portfolio strebte in der Berichtsperiode im Vergleich zur Benchmark eine geringere Exposition zu ESG-Laggards an. ESG-Laggards sind Unternehmungen mit der schwächsten Umwelt-, Sozial und Governance- Performance des relevanten Anlageuniversums.

Die historischen Vergleiche werden in nachfolgender Tabelle gemacht.

| | Indikator | Datum 2023 | Datum 2024 |
|-----------|----------------------------|------------|------------|
| Portfolio | Exposition zu ESG Laggards | 9.9% | 5.46% |
| Benchmark | Exposition zu ESG Laggards | 12.2% | 9.63% |

Reduktion der CO₂e-Intensität

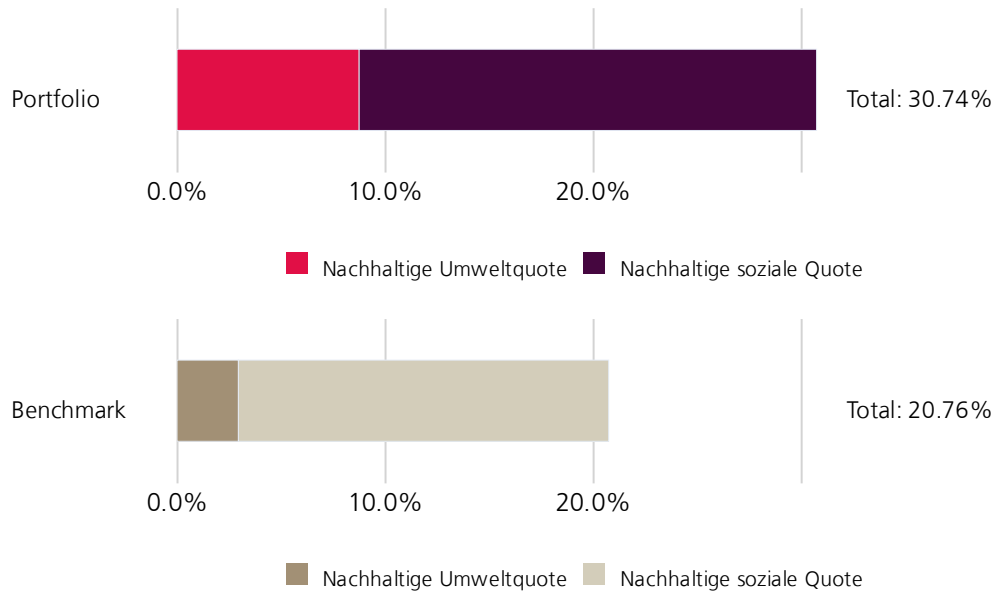
Corporate



Im Einklang mit dem < 2° Pariser Klimaziel ("<2°C Max") zielte die Investitionstätigkeit des Fonds während der Berichtsperiode darauf ab, die CO₂e-Emissionen des Portfolios, um mindestens 4 % pro Jahr zu reduzieren. Der Absenkpfad berechnet sich aus den gewichteten CO₂e-Intensitäten der Benchmark, diskontiert mit 4 % pro Jahr zuzüglich des realen Wirtschaftswachstums. Die gestrichelten 2° Max-Linie zeigt den Maximalwert an. Die Balken stellen die CO₂e-Intensitäten des Portfolios und der Benchmark dar. CO₂e-Intensitäten unterhalb der 2° Max-Linie zeigen an, dass das Portfolio oder die Benchmark das <2°-Klimaziel erfüllen. Werte bei "Erreichung Klimaziel" setzen das Portfolio und die Benchmark in Relation zum Klimaziel. Negative Werte bedeuten, dass das Ziel erreicht wurde. Die historischen Vergleiche werden in nachfolgender Tabelle gemacht.

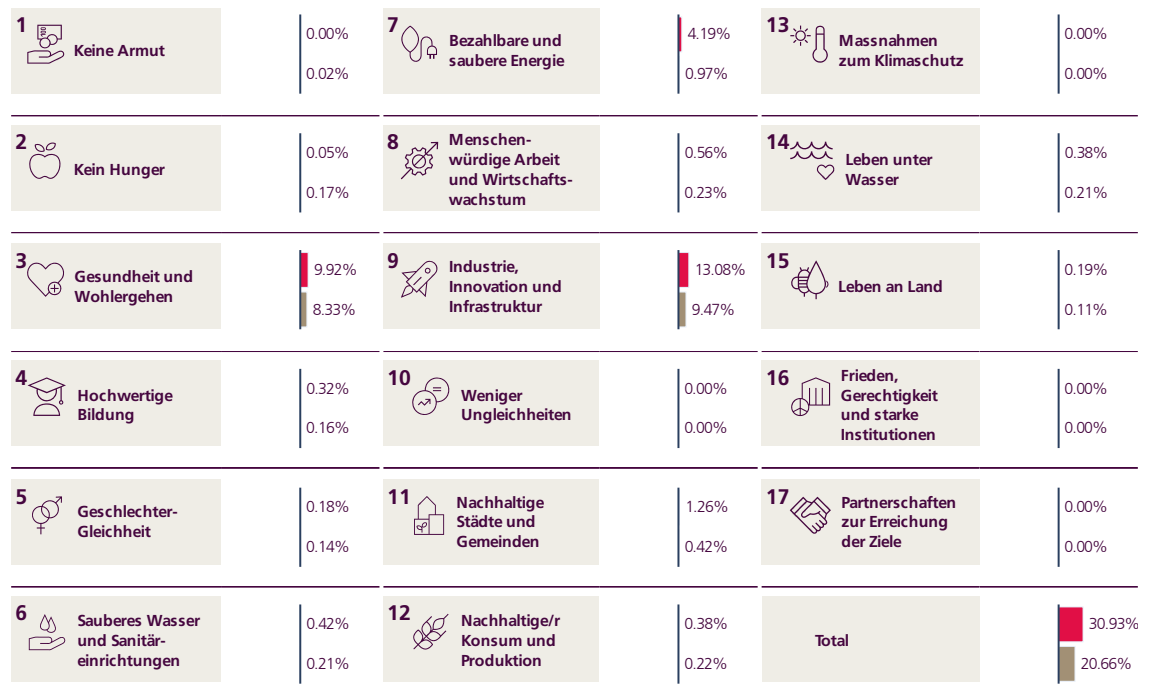
| | Indikator | Datum 2023 | Datum 2024 |
|-----------|--|------------|------------|
| Portfolio | CO ₂ e-Intensität Corporate | 111 | 94 |
| | Reduktion Corporate | -4% | -12% |
| Benchmark | CO ₂ e-Intensität Corporate | 179 | 170 |
| | Reduktion Corporate | 57% | 59% |

Nachhaltige Investitionen



Das Diagramm zeigt die prozentualen Umsätze der im Portfolio des Fonds enthaltenen Unternehmungen und der der Benchmark, welche nicht EU-Taxonomie konform, jedoch im Einklang mit den sich aus den UN Sustainable Development Goals (SDGs) ergebenden Umwelt- und sozialen Zielen gemäss Art. 2 (17) SFDR investiert worden sind. Der Fonds hat keine Investitionen in ökologisch nachhaltige Aktivitäten im Sinne der EU Taxonomie-Verordnung angestrebt. Der Investmentmanager des (Teil-)Fonds hat eine Methodologie zur Definition nachhaltiger Investitionen entwickelt, die den Anforderungen des Art. 2 (17) SFDR entspricht. Die Methodologie ist detailliert in den Vorvertraglichen Informationen beschrieben. Die Aufteilung der nachhaltigen Investitionen in UN SDGs werden in folgender Grafik gemacht. Die historischen Vergleiche werden in nachfolgender Tabelle gemacht.

| | Indikator | Datum 2023 | Datum 2024 |
|-----------|---|------------|------------|
| Portfolio | Anteil nachhaltige Investitionen mit Umweltziel | 7.33% | 8.73% |
| | Anteil sozial nachhaltige Investitionen | 17.89% | 22.01% |
| | Total nachhaltige Quote | 25.21% | 30.74% |
| Benchmark | Anteil nachhaltige Investitionen mit Umweltziel | 2.81% | 2.99% |
| | Anteil sozial nachhaltige Investitionen | 14.17% | 17.77% |
| | Total nachhaltige Quote | 16.98% | 20.76% |



■ Portfolio
 ■ Benchmark

Aufgrund der unterschiedlichen Behandlung von Green, Social und Sustainable Bonds kann das SDG-Exposure von den prozentualen Umsätzen der im Portfolio des Fonds enthaltenen Unternehmungen und den der Benchmark, welche im Einklang mit den sich aus den SDGs ergebenden Umweltzielen gemäss Art. 2 (17) SFDR investiert worden sind, abweichen.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Im Berichtszeitraum konzentrierte sich der Vermögensverwalter auf Wertpapiere von Unternehmen, welche Umsätze aus dem Verkauf von Produkten und Dienstleistungen mit einem positiven Beitrag zu den 17 SDGs erzielten und dabei keine DNSH- und/oder Minimum Safeguards-Verletzungen aufgewiesen haben.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Emittenten mit einem negativen Nettobeitrag zu den SDGs wurden in der Berichtsperiode aus dem Anlageuniversum des Finanzproduktes entfernt. Darüber hinaus berücksichtigte der Teilfonds nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (engl: Principal Adverse Impacts - PAI). Zu diesem Zweck wurden die obligatorischen Indikatoren Anhang 1 der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1288 zur Ergänzung der Verordnung (EU) 2019/2088 zugrunde gelegt. Unternehmen, die der Vermögensverwalter gemäss PAI als besonders schädlich einstufte, wurden entsprechend nicht zu den nachhaltigen Anlagen gezählt. Emittenten, welche die PAIs 7 (Biodiversität), 10 (Global Compact der Vereinten Nationen (UNGC)/OECD Leitsätze für multinationale Unternehmen) oder 14 (Engagement in umstrittenen Waffen) verletzen, haben einen PAI-Score von null erhalten. Aus den restlichen PAI-Indikatoren wurde ein PAI-Score berechnet. Instrumente von Emittenten mit einem Score < 10 wurden nicht den nachhaltigen Investitionen angerechnet.

● **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Die nachteiligen Auswirkungen (PAI) sind systematisch im Anlageprozess berücksichtigt worden.

● **Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:**

Bei der Anlageanalyse für nachhaltige Investitionen wurden in der Berichtsperiode die folgenden Normverletzungen berücksichtigt: Global Compact der Vereinten Nationen (UNGC), die UN Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte (UNGP) und das Übereinkommen der Internationalen Arbeitsorganisation (ILO). Jeder schwerwiegende Verstoß gegen diese Normen führte zum Ausschluss des Emittenten aus dem investierbaren Universum des Finanzprodukts.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

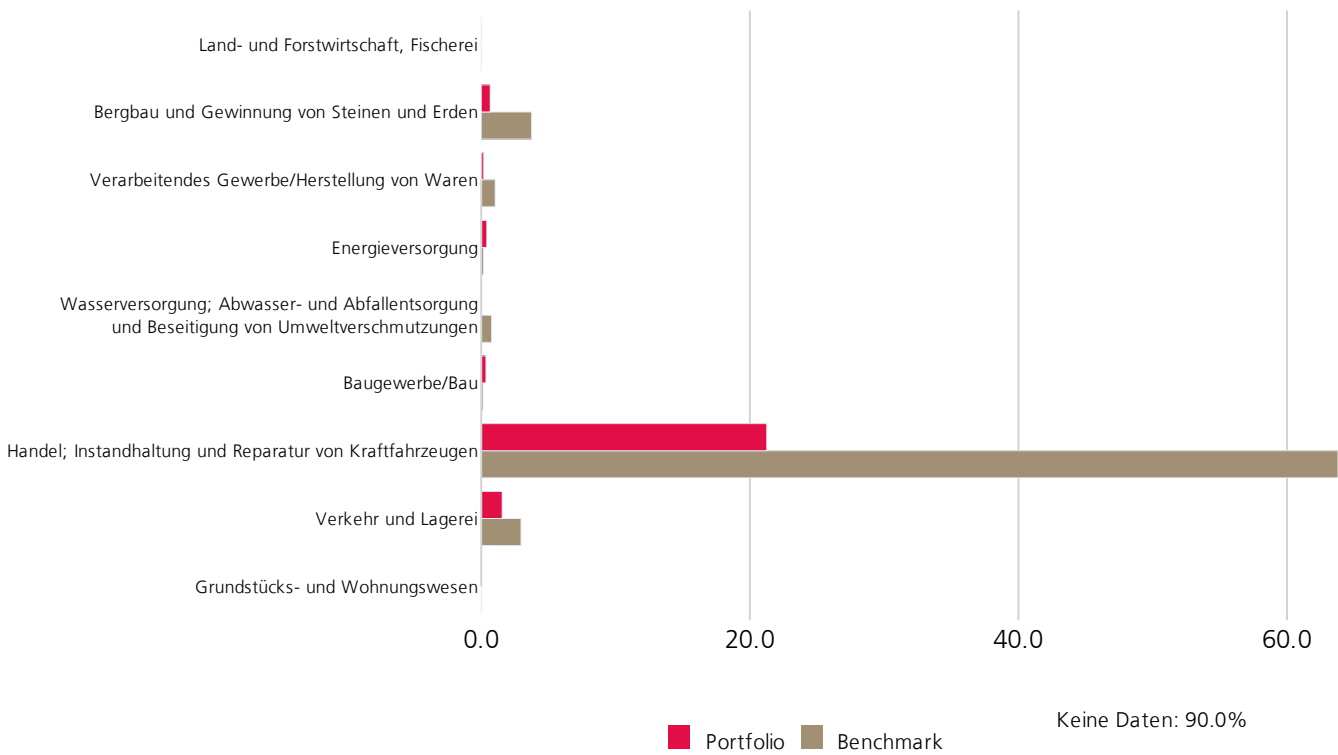
Nachteilige Nachhaltigkeitsauswirkungen (PAI) – Corporate Anlagen

Primäre Indikatoren - Energie und Emissionen

| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Benchmark Aktuell | Benchmark Vorjahr | Erklärung |
|--|--|-------------------|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|-----------|
| 1. THG-Emissionen | 1a. GHG Emissions - Scope 1 per Mio EUR Enterprise Value | 3130.59 | 40.78% | 3732.22 | 4380.25 | 5122.97 | |
| | 1b. GHG Emissions - Scope 2 per Mio EUR Enterprise Value | 877.06 | 40.78% | 948.18 | 1113.01 | 1435.8 | |
| | 1c. GHG Emissions - Scope 3 per Mio EUR Enterprise Value | 28113.6 | 40.78% | 29134 | 18963.4 | 26635.9 | |
| 2. CO ₂ -Fussabdruck | 2. GHG Emissions - Scope 1+2+3 per Mio EUR Enterprise Value | 271.19 | 40.78% | 281.99 | 208.12 | 276.46 | |
| 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird | 3. GHG Emissions - Emissions Intensity - Total Emissions (EUR) | 213.87 | 45.72% | 284.07 | 295.13 | 412.02 | |
| 4. Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind | 4. Fossil Fuel - Involvement (PAI) | 4.41% | 51.9% | 4.84% | 3.08% | 3.87% | |

| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Benchmark Aktuell | Benchmark Vorjahr | Erklärung |
|--|--|-------------------|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|---|
| 5. Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen | 5a. CR Raw - Energy use - Coal/nuclear/undear energy sources | 85.24% | 17.71% | 84.2% | 87.24% | 91.12% | |
| | 5b. Non-renewable energy consumption | 72.61% | 8.6% | 95.44% | 73.03% | 97.94% | Der Verbrauch nicht-erneuerbarer Energie umfasst den Verbrauch von Energie, die aus nicht-erneuerbaren Quellen erzeugt wird, sowie den Verbrauch von Energie aus Biomasse. Alle Zahlen zum Energieverbrauch, bei denen die Energiequelle unklar ist, sind ebenfalls in diesem Faktor enthalten. |
| | 5c. Non-renewable energy production | 0.03% | 50.64% | 0.02% | 0.6% | 0.66% | |
| 6. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren | 6. Energy consumption intensity (GWh/mEUR) | 1.64 | 6.88% | 5.45 | 5.1 | 8.05 | |

Intensität des Energieverbrauchs pro High Impact Sector (pro Mio. EUR)



| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Benchmark Aktuell | Benchmark Vorjahr | Erklärung |
|---|--|-------------------|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|-----------|
| 7. Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken | 7. Companies negatively affecting biodiversity-sensitive areas | 0% | 52.09% | 0% | 0% | 0% | |
| 8. Emissionen in Wasser | 8. CR Raw - COD emissions | 22.78 | 0.91% | 23.91 | 15.73 | 15.2 | |
| 9. Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle | 9. CR Raw - Hazardous waste | 0.12 | 2.38% | 0 | 0.03 | 0 | |

| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Benchmark Aktuell | Benchmark Vorjahr | Erklärung |
|--|--|-------------------|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|-----------|
| 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | 10. UNGC / OECD Guidelines Violation | 0% | 52.09% | 0% | 0% | 0% | |
| 11. Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen | 11. Lack of processes monitoring UNGC and OECD Guidelines compliance | 12.07% | 25.38% | 9.92% | 13.17% | 12.18% | |
| 12. Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle | 12. Unadjusted gender pay gap | 0.56% | 2.54% | 0.35% | 0.39% | 0.29% | |
| 13. Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen | 13. Ratio of female to male board members | 50.63% | 21.39% | 45.67% | 43.09% | 43.02% | |
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) | 14. Controversial weapons involvement (APM, CM, Bio, Chem) | 0% | 52.56% | 0% | 0% | 0% | |

Nachteilige Nachhaltigkeitsauswirkungen (PAI) – Staatliche und Supranationale Vermögenswerte

Primäre Indikatoren

| Umwelt | | | | | | | |
|--------------------|-------------------|-------------------|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|-----------|
| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Benchmark Aktuell | Benchmark Vorjahr | Erklärung |
| 15. GHG Intensität | 15. GHG Intensity | 87.23 | 1.45% | 140.7 | 76.43 | 298.7 | |

| Sozial | | | | | | | |
|--|---|-------------------|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|-----------|
| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Benchmark Aktuell | Benchmark Vorjahr | Erklärung |
| 16. Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen | 16a. Countries subject to social violations (#) | 0 | 0% | 0 | 0 | 0 | |
| | 16b. Countries subject to social violations (%) | 0% | 0% | 0% | 0% | 0% | |

| Indikator | Metrik |
|-----------|---|
| 1a | Scope-1-Treibhausgas-Emissionen |
| 1b | Scope-2-Treibhausgas-Emissionen |
| 1c | Scope-3-Treibhausgas-Emissionen |
| 2. | CO2-Fussabdruck pro Mio EUR |
| 3. | THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird |
| 4. | Anteil der Investitionen in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind |
| 5a | Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung der Unternehmen, in die investiert wird, aus nicht erneuerbaren Energiequellen im Vergleich zu erneuerbaren Energiequellen, ausgedrückt in Prozent der gesamten Energiequellen |
| 5b | Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung der Unternehmen, in die investiert wird, aus nicht erneuerbaren Energiequellen im Vergleich zu erneuerbaren Energiequellen, ausgedrückt in Prozent der gesamten Energiequellen |
| 5c | Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung der Unternehmen, in die investiert wird, aus nicht erneuerbaren Energiequellen im Vergleich zu erneuerbaren Energiequellen, ausgedrückt in Prozent der gesamten Energiequellen |
| 6. | Energieverbrauch in GWh pro einer Million EUR Umsatz der Unternehmen, in die investiert wird, aufgeschlüsselt nach klimaintensiven Sektoren |
| 7. | Anteil der Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird, mit Standorten/Betrieben in oder in der Nähe von Gebieten mit schutzbedürftiger Biodiversität, sofern sich die Tätigkeiten dieser Unternehmen nachteilig auf diese Gebiete auswirken |
| 8. | Tonnen Emissionen in Wasser, die von den Unternehmen, in die investiert wird, pro investierter Million EUR verursacht werden, ausgedrückt als gewichteter Durchschnitt |
| 9. | Tonnen gefährlicher und radioaktiver Abfälle, die von den Unternehmen, in die investiert wird, pro investierter Million EUR erzeugt werden, ausgedrückt als gewichteter Durchschnitt |
| 10. | Anteil der Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird, die an Verstößen gegen die UNGC-Grundsätze oder gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen beteiligt waren |
| 11. | Anteil der Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird, die keine Richtlinien zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen oder keine Verfahren zur Bearbeitung von Beschwerden wegen Verstößen gegen die UNGC-Grundsätze und OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen eingerichtet haben |
| 12. | Durchschnittliches unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle bei den Unternehmen, in die investiert wird |
| 13. | Durchschnittliches Verhältnis von Frauen zu Männern in den Leitungs- und Kontrollorganen der Unternehmen, in die investiert wird, ausgedrückt als Prozentsatz aller Mitglieder der Leitungs- und Kontrollorgane |
| 14. | Anteil der Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird, die an der Herstellung oder am Verkauf von umstrittenen Waffen beteiligt sind |
| 15. | THG-Emissionsintensität der Länder, in die investiert wird |
| 16a | Anzahl der Länder, in die investiert wird, die nach Maßgabe internationaler Verträge und Übereinkommen, der Grundsätze der Vereinten Nationen oder, falls anwendbar, nationaler Rechtsvorschriften gegen soziale Bestimmungen verstoßen (absolute Zahl und relative Zahl, geteilt durch alle Länder, in die investiert wird) |
| 16b | Anzahl der Länder, in die investiert wird, die nach Maßgabe internationaler Verträge und Übereinkommen, der Grundsätze der Vereinten Nationen oder, falls anwendbar, nationaler Rechtsvorschriften gegen soziale Bestimmungen verstoßen (absolute Zahl und relative Zahl, geteilt durch alle Länder, in die investiert wird) |

Das Dokument wurde von Swisscanto mit geschäftsüblicher Sorgfalt erstellt und kann Informationen aus sorgfältig ausgewählten Drittquellen enthalten. Anleger sollten beachten, dass die zuvor für 2023 berechneten und veröffentlichten Daten für dieses in 2024 veröffentlichte Dokument neu berechnet wurden. Dementsprechend kann es zu Abweichungen bei diesen in den Jahren 2023 und 2024 veröffentlichten historischen Daten kommen.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 01.02.2023 - 31.01.2024

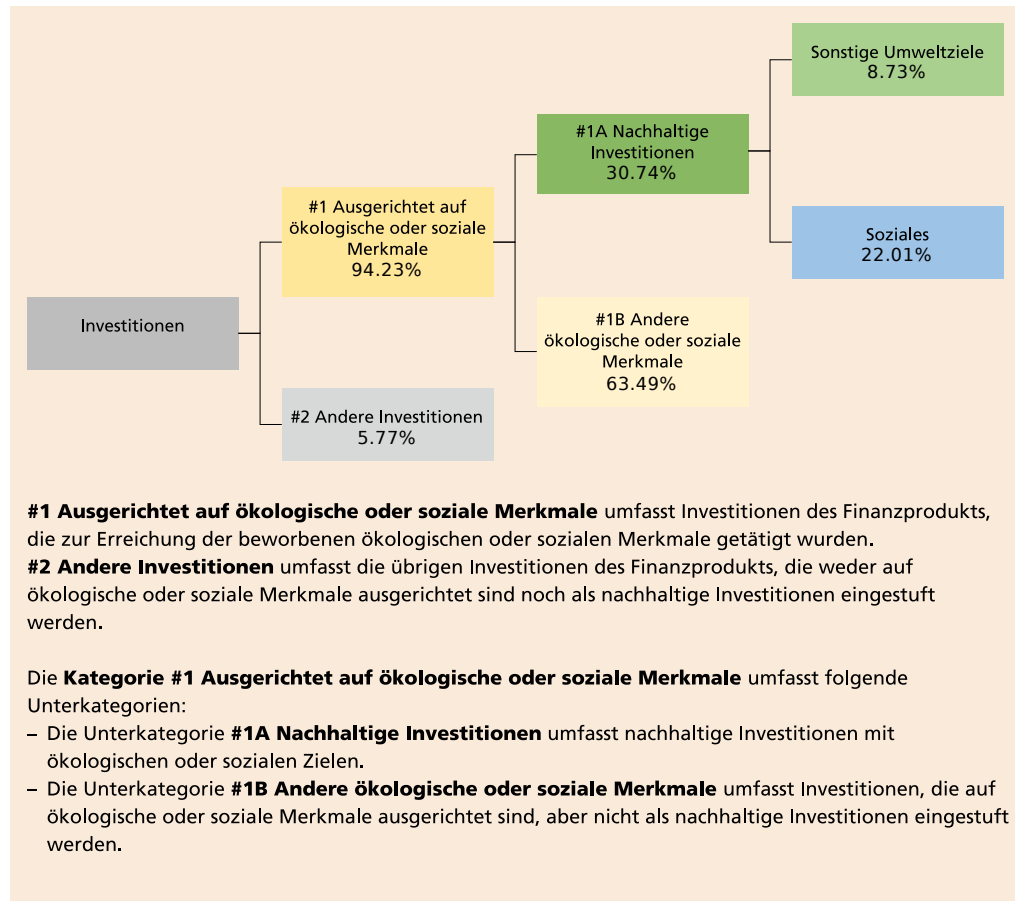
| Grösste Investitionen | Sektor | In % der Vermögenswerte | Land |
|---|---|-------------------------|-------------|
| USD Cash | | 4.29% | |
| Lorca Telecom Bondco SA 4% 18-SEP-2027 REGS | Information and Communication | 1.54% | |
| HT Troplast GmbH 9.375% 15-JUL-2028 REGS | Manufacturing | 1.33% | |
| Tenet Healthcare Corp 6.125% 15-JUN-2030 | Human Health and Social Work Activities | 1.28% | USA |
| Shs Ishares Ii Plc - Ishares Usd High Yield Corporate Bond Ucits Etf Exchange Traded Fund Usd | | 1.09% | |
| Fiber Bidco Spa 11% 25-OCT-2027 REGS | Financial and Insurance Activities | 1.07% | |
| 888 Acquisitions Ltd 7.558% 15-JUL-2027 REGS | Arts, Entertainment and Recreation | 1.03% | Gibraltar |
| Trivium Packaging Finance BV 3.75% 15-AUG-2026 REGS | Financial and Insurance Activities | 1.02% | Netherlands |
| iShares Fallen Angels High Yield Corp Bond UCITS ETF | | 0.99% | |
| EUR Cash | | 0.98% | |
| BCP V Modular Services Finance II PLC 4.75% 30-NOV-2028 REGS | Financial and Insurance Activities | 0.97% | |
| Cirsa Finance International Sarl 10.375% 30-NOV-2027 REGS | Financial and Insurance Activities | 0.96% | |
| Grifols SA 2.25% 15-NOV-2027 REGS | Manufacturing | 0.91% | Spain |
| CHS/Community Health Systems Inc 8% 15-DEC-2027 144A | Human Health and Social Work Activities | 0.90% | USA |
| Benteler International AG 9.375% 15-MAY-2028 REGS | Arts, Entertainment and Recreation | 0.89% | |



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Der Anteil an nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen und Angaben zur Vermögensallokation werden in untenstehender Frage beantwortet.

Wie sah die Vermögensallokation aus?



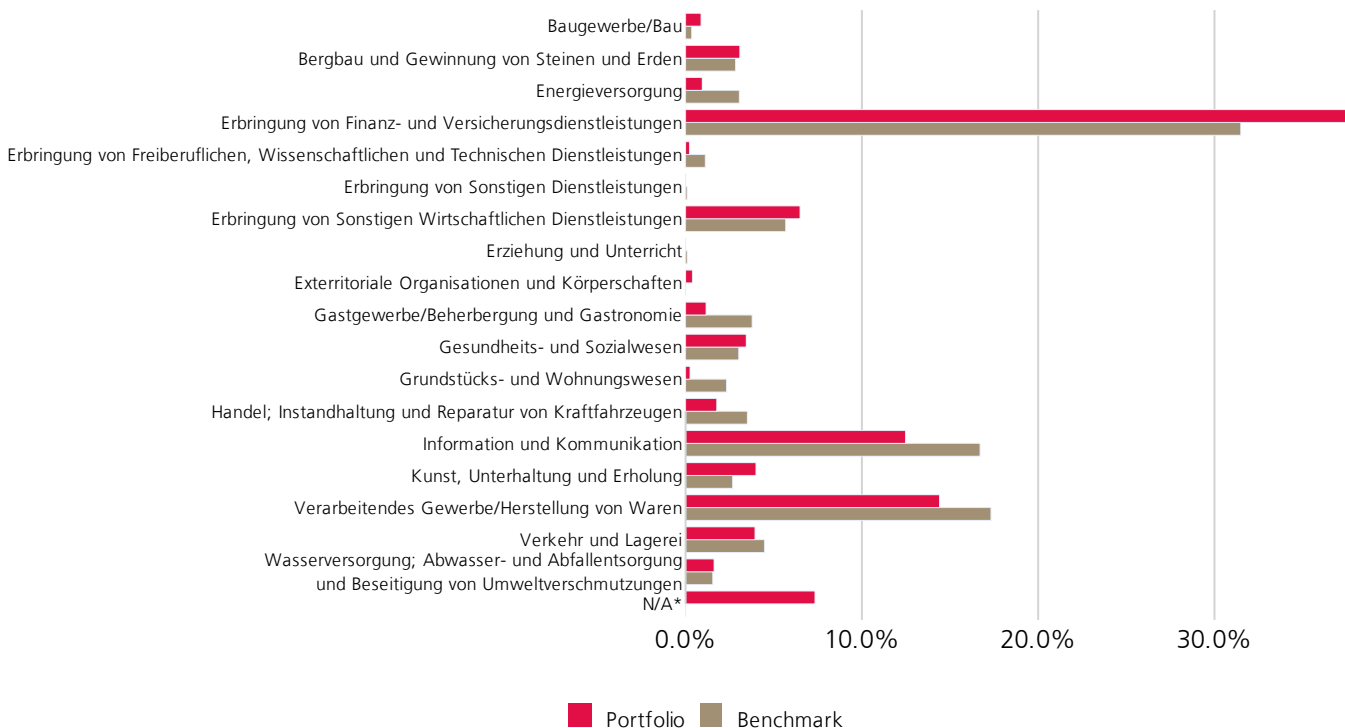
#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.
#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die **Kategorie #1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst nachhaltige Investitionen mit ökologischen oder sozialen Zielen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Wegen mangelnder Datenverfügbarkeit können Subsektoren nicht angezeigt werden.



*Diese Klassifizierung umfasst alle Bestände, für die keine NACE-Klassifizierung gefunden oder geschätzt werden kann; Liquidität ist darin enthalten.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Obwohl keine Investitionen getätigt wurden, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind, wird in untenstehender Grafik die Alignierung der nachhaltigen Investitionen mit der EU-Taxonomie offengelegt.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomeikonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert¹?

Ja

In fossiles Gas

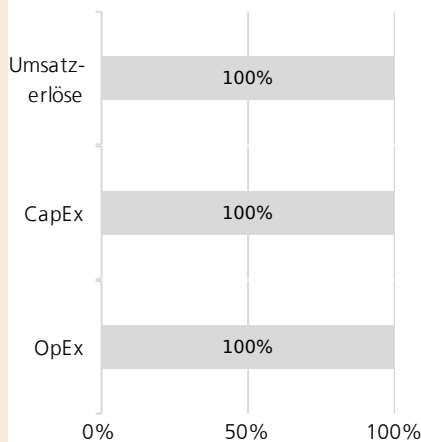
In Kernenergie

Nein

¹Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomeikonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels ("Klimaschutz") beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomeikonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

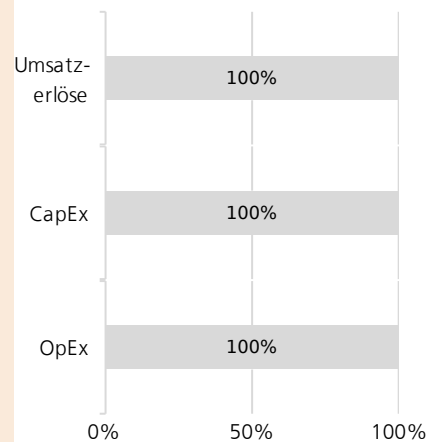
Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomeikonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzproduktes einschliesslich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzproduktes zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.

1. Taxonomiekonformität der Investitionen einschliesslich Staatsanleihen*



- Taxonomiekonform: Fossiles Gas
- Taxonomiekonform: Kernenergie
- Taxonomiekonform: (ohne fossiles Gas und Kernenergie)
- Nicht taxonomiekonform

2. Taxonomiekonformität der Investitionen ohne Staatsanleihen*



- Taxonomiekonform: Fossiles Gas
- Taxonomiekonform: Kernenergie
- Taxonomiekonform: (ohne fossiles Gas und Kernenergie)
- Nicht taxonomiekonform

Diese Grafik gibt 98.5% der Gesamtinvestitionen wieder.

*Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff "Staatsanleihen" alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Mit Blick auf die EU-Taxonomeikonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf erneuerbare Energie oder CO2-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO2-armen Alternativen gibt und die Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomeikonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:
- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

Investitionsausgaben (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, z.B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft
- **Betriebsausgaben** (Opex), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Angaben zu Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten werden in der Tabelle zusammengefasst. Wenn keine Angaben verfügbar sind, wird die Tabelle ebenfalls keine Angaben enthalten.

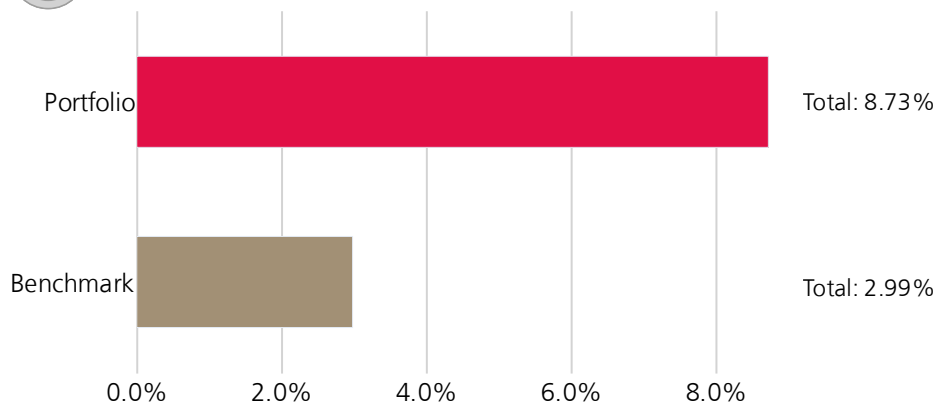
| Issuer Name | Nace Sektor | Total Eligible Activity Revenue | Total Aligned Revenue | Total Likely Aligned Revenue | Total Potentially Aligned Revenue | Portfolio Gewicht (Consol.) |
|-----------------------------|---|---------------------------------|-----------------------|------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------|
| Getlink SE | Transporting and Storage | 99.00% | 23.25% | 14.85% | 0.00% | 0.39% |
| Webuild SpA | Construction | 20.18% | 10.40% | 0.00% | 0.00% | 0.66% |
| Webuild S.p.A. | Construction | 20.18% | 10.40% | 0.00% | 0.00% | 0.23% |
| Gatwick Airport Finance Plc | Financial and Insurance Activities | 33.15% | 5.00% | 4.53% | 0.00% | 0.85% |
| Mundys Spa | Transporting and Storage | 95.42% | 1.58% | 0.00% | 0.00% | 0.18% |
| Forvia SE | Manufacturing | 20.57% | 0.93% | 3.93% | 11.79% | 0.24% |
| Neptune Energy Bondco Plc | Administrative and Support Service Activities | 3.03% | 0.15% | 0.00% | 0.07% | 0.54% |
| Telecom Italia S.p.A. | Information and Communication | 1.10% | 0.00% | 0.00% | 0.00% | 0.41% |
| Constellium SE Class A | Transporting and Storage | 75.89% | 0.00% | 13.43% | 21.78% | 0.26% |
| Grupo Antolin-Irausa SA | Manufacturing | 30.09% | 0.00% | 5.77% | 0.00% | 0.66% |

Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?


Da im vorangegangenen Berichtsjahr keine Daten verfügbar waren, erübrigt sich ein Vorjahresvergleich.

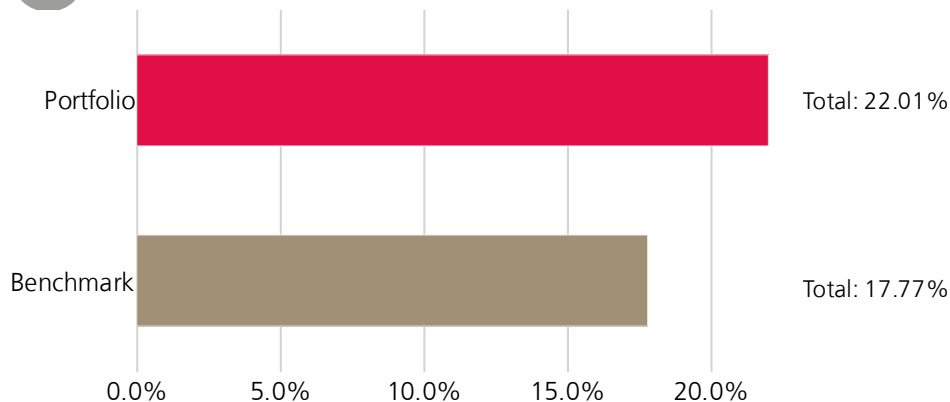
 sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.

 **Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**




Das Diagramm zeigt die prozentualen Umsätze der im Portfolio des Fonds enthaltenen Unternehmungen und der der Benchmark, welche nicht EU-Taxonomie konform, jedoch im Einklang mit den sich aus den SDGs ergebenden Umweltzielen gemäss Art. 2 (17) SFDR investiert worden sind.

 **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**



Das Diagramm zeigt die prozentualen Umsätze der im Portfolio des Fonds enthaltenen Unternehmungen und der der Benchmark, welche nicht EU-Taxonomie konform, jedoch im Einklang mit den sich aus den SDGs ergebenden sozialen Zielen gemäss Art. 2 (17) SFDR investiert worden sind.

 **Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

Diese Vermögenswerte haben die in der spezifischen Anlagepolitik vorgesehenen Anlagen umfasst, einschliesslich Derivate zu Absicherungszwecken und flüssige Mittel. Die Anlagen, ausgenommen Derivate und flüssige Mittel, haben die Grundsätze des ökologischen oder sozialen Mindestschutzes umgesetzt.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Im Berichtszeitraum förderte der Vermögensverwalter durch Investment Stewardship und Kapitalallokation nachhaltige Geschäftspraktiken und die Einhaltung anerkannter internationaler Prinzipien und ESG-Best-Practice-Standards. Dementsprechend stand er im Dialog mit den Managementteams der investierten Unternehmen. Darüber hinaus hat er sich im Rahmen der United Nations Collaboration Platform for Responsible Investment (UN PRI) und bei Investoreninitiativen engagiert. Das Abstimmungsverhalten basierte auf den schweizerischen und internationalen Corporate-Governance-Regeln sowie auf den Prinzipien des UN Global Compact und den 17 Zielen für nachhaltige Entwicklung (UN SDGs). Weitere Informationen finden Sie unter: Swisscanto | Proxy Voting Dashboard (issgovernance.com) <https://www.swisscanto.com/int/de/nachhaltigkeit/investment-stewardship.html>

Swisscanto | Proxy Voting Dashboard (issgovernance.com)

<https://www.swisscanto.com/int/de/nachhaltigkeit/investment-stewardship.html>



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Es wurde kein Index als Referenzwert bestimmt, um festzustellen, ob dieses Finanzprodukt auf die beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet ist.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?

Nicht anwendbar.

Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?

Nicht anwendbar.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?

Nicht anwendbar.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?

Nicht anwendbar.

Das Dokument wurde von Swisscanto mit geschäftsüblicher Sorgfalt erstellt und kann Informationen aus sorgfältig ausgewählten Drittquellen enthalten. Anleger sollten beachten, dass die zuvor für 2023 berechneten und veröffentlichten Daten für dieses in 2024 veröffentlichte Dokument neu berechnet wurden. Dementsprechend kann es zu Abweichungen bei diesen in den Jahren 2023 und 2024 veröffentlichten historischen Daten kommen.



Regelmässige Information zum 31.01.2024

Regelmässige Informationen zu den in Artikel 9 Absätze 1 bis 4a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 5 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts:

Swisscanto (LU) Bond Fund Sustainable Global Aggregate

Unternehmenskennung (LEI-Code):

5493007MXNV1316JL462

Benchmark

Bloomberg Barclays Global Aggregate Index (TR) in CHF

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. In dieser Verordnung ist kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten festgelegt. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Nachhaltiges Investitionsziel

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

| <input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> <input checked="" type="radio"/> Ja | <input type="radio"/> <input type="radio"/> <input type="radio"/> Nein |
|--|---|
| <input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: 24.2% <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input checked="" type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind | <input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es _% an nachhaltigen Investitionen <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel |
| <input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: 28.16% | <input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt . |



Inwieweit wurde das nachhaltige Investitionsziel dieses Finanzprodukts erreicht?

Der Teilfonds wurde im September 2023 repositioniert. Die Nachhaltigen Indikatoren haben Gültigkeit mit Stichtag der Repositionierung. Der Portfolio Manager strebte mit diesem Finanzprodukt primär nachhaltige Investitionen mit einer Quote von mindestens 80% an, indem das Portfolio auf eine Reduktion der CO2e-Emissionen im Sinn von Artikel 9(3) der Verordnung (EU) 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzsektor (im Folgenden: SFDR) ausgerichtet wird. Die Quote der nachhaltigen Investitionen nach Artikel 9(3) SFDR betrug in der Berichtsperiode 87.03%.

Zudem wurden folgende Nachhaltigkeitsindikatoren zur Bemessung der nachhaltigen Investitionsziele herangezogen:

1. Reduktion der CO2e-Intensität
2. Ausschlusskriterien
3. Nachhaltige Investitionen nach Artikel 9(2) SFDR







Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Aus Übersichtsgründen werden die Angaben zur Performance (siehe Details am Ende des Reports) der Nachhaltigkeitsindikatoren direkt mit dem historischen Vergleich in der nächsten Frage beantwortet.

... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Ausschlusskriterien

Sustainable

| Kriterien | Gewicht Portfolio | Gewicht Benchmark | Anzahl Unternehmen Benchmark | Kriterien | Gewicht Portfolio | Gewicht Benchmark | Anzahl Unternehmen Benchmark |
|---|--|---|------------------------------|--|-------------------|-------------------|------------------------------|
|  Gentechnik: GVO-Freisetzung | 0.00% | 0.23% | 9 |  Kernenergie | 0.00% | 1.19% | 65 |
| Nichtnachhaltige Waldwirtschaft | 0.00% | 0.05% | 12 | Herstellung von Kriegstechnik | 0.00% | 0.52% | 40 |
| Nicht zertifiziertes Palmöl (<50% RSPO) | 0.00% | 0.04% | 10 | Herstellung von Alkohol (> 5% Umsatz) | 0.00% | 0.24% | 16 |
| Nichtnachhaltige Fischerei & Fischzucht | 0.00% | 0.00% | 2 | Herstellung von Tabak & Raucherwaren | 0.00% | 0.22% | 14 |
|  Förderung fossiler Energieträger | 0.00% | 2.64% | 107 | Ausbeuterische Kinderarbeit | 0.00% | 0.18% | 6 |
| Betrieb von fossilen Kraftwerken | 0.00% | 1.34% | 110 | Herstellung von Waffen & Munition | 0.00% | 0.15% | 9 |
| Herstellung von Automobilen & Flugzeugen | 0.00% | 0.78% | 28 | Kontroverse Waffen | 0.00% | 0.11% | 3 |
| Kohlereserven | 0.00% | 0.51% | 50 | UN Global Compact Verstöße | 0.00% | 0.11% | 6 |
| Fluggesellschaften | 0.00% | 0.06% | 25 | Massentierhaltung | 0.00% | 0.09% | 19 |
| Förderung von Kohle (> 5% Umsatz) | 0.00% | 0.04% | 4 | Glücksspiel (> 5% Umsatz) | 0.00% | 0.03% | 5 |
| Kreuzfahrt-gesellschaften | 0.00% | 0.01% | 1 | Gentechnik: Humanmedizin | 0.00% | 0.00% | 1 |
|  Rückgang der Artenvielfalt |  Klimawandel |  Gefährdung von Gesellschaft und Gesundheit | | Herstellung von Pornografie | 0.00% | 0.00% | 0 |

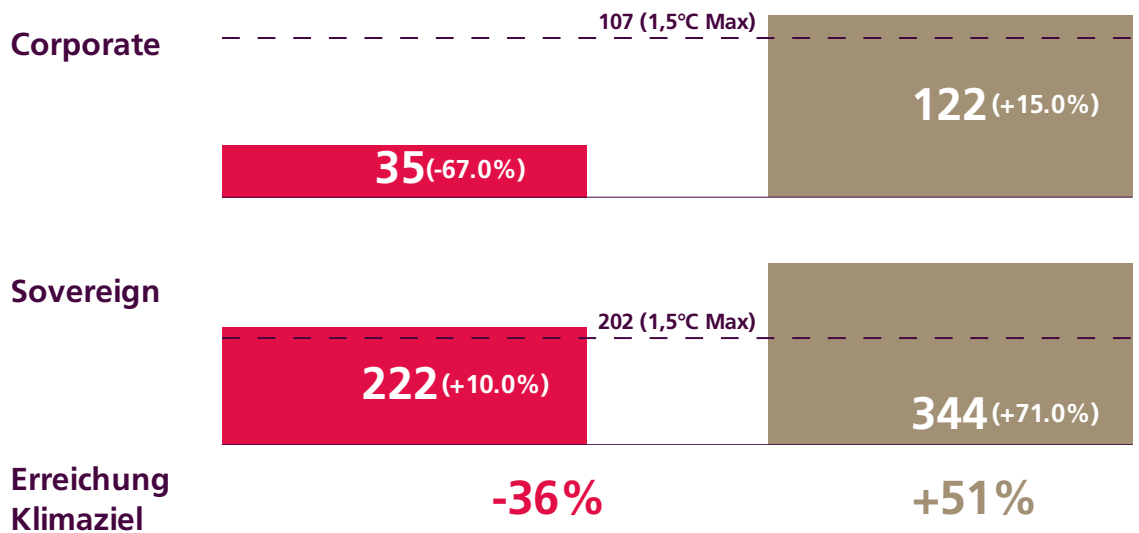
Zwecks Minderung der Nachhaltigkeitsrisiken und mit dem Ziel, nicht in Wertpapiere der oben aufgeführten kontroversen Geschäftsmodellen zu investieren, sind die oben genannten Ausschlusskriterien angewendet worden. Die Tabelle zeigt die Anzahl der Unternehmen, die gegen die Ausschlusskriterien verstossen haben, sowie die jeweilige Portfolio- und Benchmark-Exposition. Liegen bei einem Unternehmen mehrere Verstösse vor, werden diese für jedes Kriterium separat aufgeführt. Daher ist die Summe aller Positionen in diesem Bericht in der Regel höher als das effektive Gewicht, der im Portfolio bzw. in der Benchmark ausgeschlossenen Unternehmen.

Die historischen Vergleiche werden in nachfolgender Tabelle gemacht. Aus Übersichtsründen werden die Ausschlusskriterien aggregiert.

| | Indikator | Datum 2023 | Datum 2024 |
|-----------|----------------------------|------------|------------|
| Portfolio | Ausschlusskriterien Total* | 0% | 0% |
| Benchmark | Ausschlusskriterien Total* | 4.5% | 4.35% |

*alle Ausschlusskriterien kumuliert.

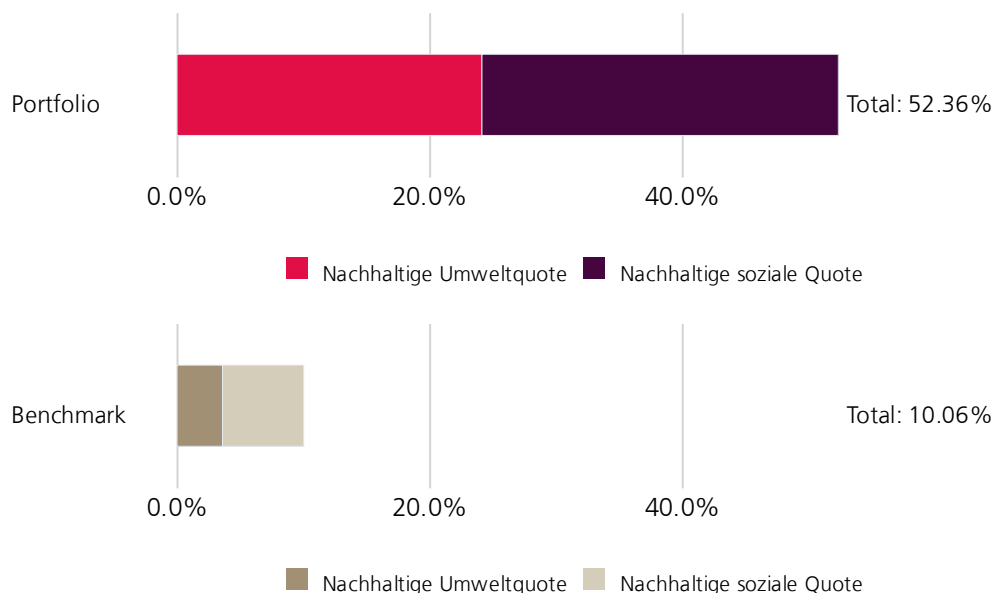
Reduktion der CO₂e-Intensität



Im Einklang mit dem 1.5° Pariser Klimaziel zielte die Investitionstätigkeit des Fonds während der Berichtsperiode darauf ab, die CO₂e-Emissionen des Portfolios, um mindestens 7.5 % pro Jahr zu reduzieren. Der Absenkpfad berechnet sich aus den gewichteten CO₂e-Intensitäten der Benchmark, diskontiert mit 7.5 % pro Jahr zuzüglich des realen Wirtschaftswachstums. Die gestrichelten 1.5° Max-Linie zeigt den Maximalwert an. Die Balken stellen die CO₂e-Intensitäten des Portfolios und der Benchmark dar. CO₂e-Intensitäten unterhalb der 1.5° Max-Linie zeigen an, dass das Portfolio oder die Benchmark das 1.5°-Klimaziel erfüllen. Werte bei "Erreichung Klimaziel" setzen das Portfolio und die Benchmark in Relation zum Klimaziel. Negative Werte bedeuten, dass das Ziel erreicht wurde. Die historischen Vergleiche werden in nachfolgender Tabelle gemacht.

| | Indikator | Datum 2023 | Datum 2024 |
|-----------|--|------------|------------|
| Portfolio | CO ₂ e-Intensität Corporate | 84 | 35 |
| | CO ₂ e-Intensität Sovereign | 340 | 222 |
| | Erreichung Klimaziel | -9% | -36% |
| | Reduktion Corporate | -39% | -67% |
| | Reduktion Sovereign | 30% | 10% |
| Benchmark | CO ₂ e-Intensität Corporate | 136 | 122 |
| | CO ₂ e-Intensität Sovereign | 364 | 344 |
| | Erreichung Klimaziel | 26% | 51% |
| | Reduktion Corporate | -1% | 15% |
| | Reduktion Sovereign | 40% | 71% |

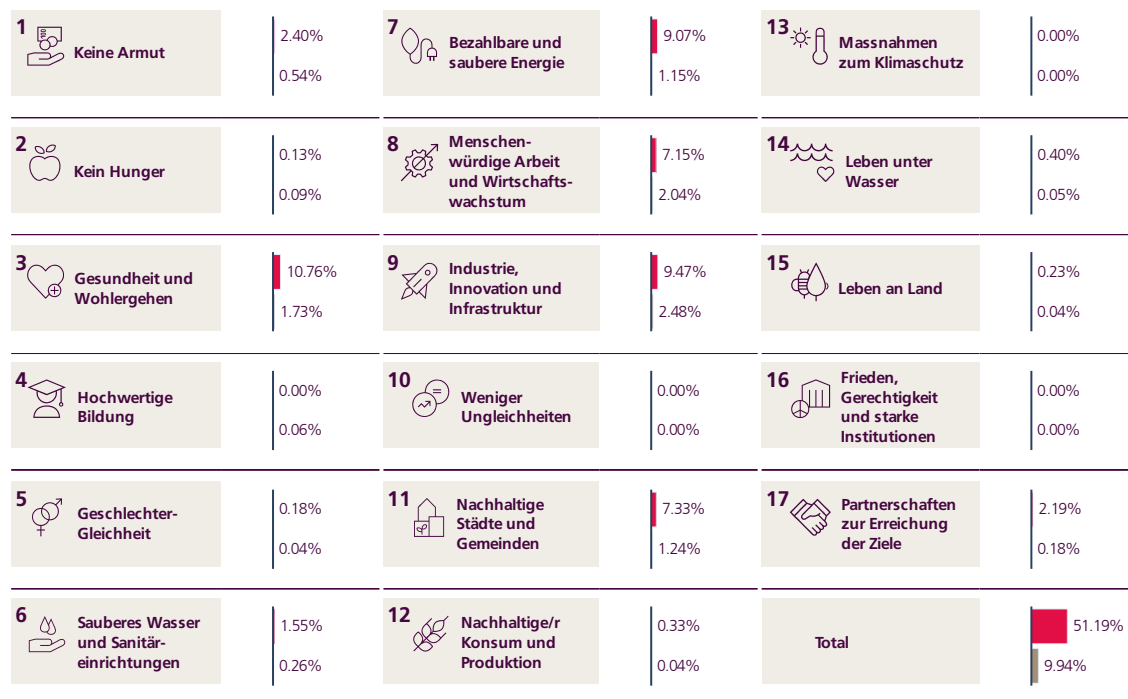
Nachhaltige Investitionen nach Artikel 9(2) SFDR



Das Diagramm zeigt die prozentualen Umsätze der im Portfolio des Fonds enthaltenen Unternehmungen und der der Benchmark, welche nicht EU-Taxonomie konform, jedoch im Einklang mit den sich aus den UN Sustainable Development Goals (SDGs) ergebenden Umwelt- und sozialen Zielen gemäss Art. 2 (17) SFDR investiert worden sind.

Der Fonds hat keine Investitionen in ökologisch nachhaltige Aktivitäten im Sinne der EU Taxonomie-Verordnung angestrebt. Der Investmentmanager des (Teil-)Fonds hat eine Methodologie zur Definition nachhaltiger Investitionen entwickelt, die den Anforderungen des Art. 2 (17) SFDR entspricht. Die Methodologie ist detailliert in den Vorvertraglichen Informationen beschrieben. Die historischen Vergleiche werden in nachfolgender Tabelle gemacht.

| | Indikator | Datum 2023 | Datum 2024 |
|-----------|---|------------|------------|
| Portfolio | Anteil nachhaltige Investitionen mit Umweltziel | 15.77% | 24.20% |
| | Anteil sozial nachhaltige Investitionen | 25.43% | 28.16% |
| | Total nachhaltige Quote | 41.19% | 52.36% |
| Benchmark | Anteil nachhaltige Investitionen mit Umweltziel | 2.41% | 3.65% |
| | Anteil sozial nachhaltige Investitionen | 6.34% | 6.41% |
| | Total nachhaltige Quote | 8.75% | 10.06% |



■ Portfolio
 ■ Benchmark

Aufgrund der unterschiedlichen Behandlung von Green, Social und Sustainable Bonds kann das SDG-Exposure von den prozentualen Umsätzen der im Portfolio des Fonds enthaltenen Unternehmungen und den der Benchmark, welche im Einklang mit den sich aus den SDGs ergebenden Umweltzielen gemäss Art. 2 (17) SFDR investiert worden sind, abweichen.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

● **Inwiefern wurden nachhaltige Investitionsziele durch die nachhaltigen Investitionen nicht erheblich beeinträchtigt?**

Emittenten mit einem negativen Nettobeitrag zu den SDGs wurden in der Berichtsperiode aus dem Anlageuniversum des Finanzproduktes entfernt. Darüber hinaus berücksichtigte der Teilfonds nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (engl: Principal Adverse Impacts - PAI). Zu diesem Zweck wurden die obligatorischen Indikatoren Anhang 1 der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1288 zur Ergänzung der Verordnung (EU) 2019/2088 zugrunde gelegt. Unternehmen, die der Vermögensverwalter gemäss PAI als besonders schädlich einstufte, wurden entsprechend nicht zu den nachhaltigen Anlagen gezählt. Emittenten, welche die PAIs 7 (Biodiversität), 10 (Global Compact der Vereinten Nationen (UNGC)/OECD Leitsätze für multinationale Unternehmen) oder 14 (Engagement in umstrittenen Waffen) verletzen, haben einen PAI-Score von null erhalten. Aus den restlichen PAI-Indikatoren wurde ein PAI-Score berechnet. Instrumente von Emittenten mit einem Score < 10 wurden nicht den nachhaltigen Investitionen angerechnet.

● **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Die nachteiligen Auswirkungen (PAI) sind systematisch im Anlageprozess berücksichtigt worden.

● **Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:**

Bei der Anlageanalyse für nachhaltige Investitionen wurden in der Berichtsperiode die folgenden Normverletzungen berücksichtigt: Global Compact der Vereinten Nationen (UNGC), die UNLeitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte (UNGP) und das Übereinkommen der Internationalen Arbeitsorganisation (ILO). Jeder schwerwiegende Verstoß gegen diese Normen führte zum Ausschluss des Emittenten aus dem investierbaren Universum des Finanzproduktes.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

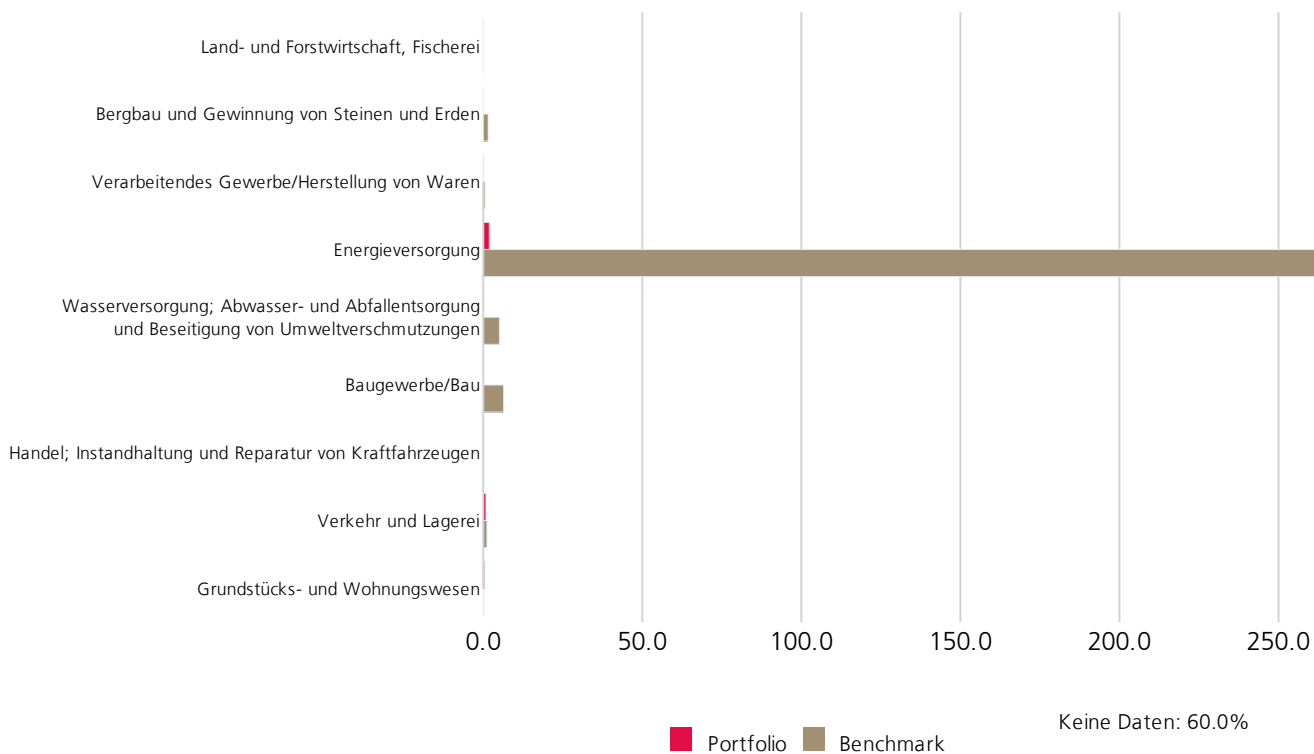
Nachteilige Nachhaltigkeitsauswirkungen (PAI) – Corporate Anlagen

Primäre Indikatoren - Energie und Emissionen

| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Benchmark Aktuell | Benchmark Vorjahr | Erklärung |
|--|--|-------------------|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|-----------|
| 1. THG-Emissionen | 1a. GHG Emissions - Scope 1 per Mio EUR Enterprise Value | 172.64 | 54.52% | 1442.3 | 1014.22 | 1273.52 | |
| | 1b. GHG Emissions - Scope 2 per Mio EUR Enterprise Value | 126.28 | 54.52% | 321.06 | 174.11 | 228.04 | |
| | 1c. GHG Emissions - Scope 3 per Mio EUR Enterprise Value | 3758.27 | 54.52% | 10019.6 | 6870 | 7663.7 | |
| 2. CO ₂ -Fussabdruck | 2. GHG Emissions - Scope 1+2+3 per Mio EUR Enterprise Value | 52.39 | 54.52% | 114.49 | 104.53 | 86.81 | |
| 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird | 3. GHG Emissions - Emissions Intensity - Total Emissions (EUR) | 30.61 | 58.72% | 127.38 | 206.97 | 206.96 | |
| 4. Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind | 4. Fossil Fuel - Involvement (PAI) | 0.92% | 58.89% | 1.8% | 2.6% | 2.17% | |

| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Benchmark Aktuell | Benchmark Vorjahr | Erklärung |
|--|--|-------------------|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|---|
| 5. Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen | 5a. CR Raw - Energy use - Coal/nuclear/undear energy sources | 51.97% | 16.04% | 55.65% | 60.64% | 61% | |
| | 5b. Non-renewable energy consumption | 34.3% | 24.3% | 75.49% | 42.17% | 81.24% | Der Verbrauch nicht-erneuerbarer Energie umfasst den Verbrauch von Energie, die aus nicht-erneuerbaren Quellen erzeugt wird, sowie den Verbrauch von Energie aus Biomasse. Alle Zahlen zum Energieverbrauch, bei denen die Energiequelle unklar ist, sind ebenfalls in diesem Faktor enthalten. |
| | 5c. Non-renewable energy production | 0.09% | 58.54% | 0.23% | 3.3% | 2.99% | |
| 6. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren | 6. Energy consumption intensity (GWh/mEUR) | 0.09 | 33.48% | 0.17 | 15.62 | 18.4 | |

Intensität des Energieverbrauchs pro High Impact Sector (pro Mio. EUR)



| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Benchmark Aktuell | Benchmark Vorjahr | Erklärung |
|---|--|-------------------|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|-----------|
| 7. Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken | 7. Companies negatively affecting biodiversity-sensitive areas | 0% | 58.69% | 0% | 0.03% | 0.03% | |
| 8. Emissionen in Wasser | 8. CR Raw - COD emissions | 14.7 | 1.41% | 100.95 | 19.71 | 15.68 | |
| 9. Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle | 9. CR Raw - Hazardous waste | 0.01 | 9.46% | 0 | 0.04 | 0 | |

| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Benchmark Aktuell | Benchmark Vorjahr | Erklärung |
|--|--|-------------------|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|-----------|
| 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | 10. UNGC / OECD Guidelines Violation | 0% | 58.69% | 0% | 0.11% | 0.04% | |
| 11. Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen | 11. Lack of processes monitoring UNGC and OECD Guidelines compliance | 6.32% | 46.23% | 3.01% | 6.03% | 6.39% | |
| 12. Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle | 12. Unadjusted gender pay gap | 0.15% | 3.4% | 0.25% | 0.12% | 0.11% | |
| 13. Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen | 13. Ratio of female to male board members | 60.64% | 35.09% | 58.61% | 59.19% | 58.32% | |
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) | 14. Controversial weapons involvement (APM, CM, Bio, Chem) | 0% | 58.89% | 0% | 0.03% | 0.03% | |

Nachteilige Nachhaltigkeitsauswirkungen (PAI) – Staatliche und Supranationale Vermögenswerte

Primäre Indikatoren

| Umwelt | | | | | | | Erklärung |
|--------------------|-------------------|-------------------|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|-----------|
| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Benchmark Aktuell | Benchmark Vorjahr | |
| 15. GHG Intensität | 15. GHG Intensity | 252.19 | 35.89% | 402.62 | 379.41 | 404.68 | |

| Sozial | | | | | | | Erklärung |
|--|---|-------------------|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|-----------|
| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Benchmark Aktuell | Benchmark Vorjahr | |
| 16. Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen | 16a. Countries subject to social violations (#) | 0 | 4.21% | 16.5 | 13 | 14 | |
| | 16b. Countries subject to social violations (%) | 0% | 4.21% | 17.69% | 2.68% | 3.06% | |

| Indikator | Metrik |
|-----------|---|
| 1a | Scope-1-Treibhausgas-Emissionen |
| 1b | Scope-2-Treibhausgas-Emissionen |
| 1c | Scope-3-Treibhausgas-Emissionen |
| 2. | CO2-Fussabdruck pro Mio EUR |
| 3. | THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird |
| 4. | Anteil der Investitionen in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind |
| 5a | Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung der Unternehmen, in die investiert wird, aus nicht erneuerbaren Energiequellen im Vergleich zu erneuerbaren Energiequellen, ausgedrückt in Prozent der gesamten Energiequellen |
| 5b | Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung der Unternehmen, in die investiert wird, aus nicht erneuerbaren Energiequellen im Vergleich zu erneuerbaren Energiequellen, ausgedrückt in Prozent der gesamten Energiequellen |
| 5c | Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung der Unternehmen, in die investiert wird, aus nicht erneuerbaren Energiequellen im Vergleich zu erneuerbaren Energiequellen, ausgedrückt in Prozent der gesamten Energiequellen |
| 6. | Energieverbrauch in GWh pro einer Million EUR Umsatz der Unternehmen, in die investiert wird, aufgeschlüsselt nach klimaintensiven Sektoren |
| 7. | Anteil der Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird, mit Standorten/Betrieben in oder in der Nähe von Gebieten mit schutzbedürftiger Biodiversität, sofern sich die Tätigkeiten dieser Unternehmen nachteilig auf diese Gebiete auswirken |
| 8. | Tonnen Emissionen in Wasser, die von den Unternehmen, in die investiert wird, pro investierter Million EUR verursacht werden, ausgedrückt als gewichteter Durchschnitt |
| 9. | Tonnen gefährlicher und radioaktiver Abfälle, die von den Unternehmen, in die investiert wird, pro investierter Million EUR erzeugt werden, ausgedrückt als gewichteter Durchschnitt |
| 10. | Anteil der Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird, die an Verstößen gegen die UNGC-Grundsätze oder gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen beteiligt waren |
| 11. | Anteil der Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird, die keine Richtlinien zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen oder keine Verfahren zur Bearbeitung von Beschwerden wegen Verstößen gegen die UNGC-Grundsätze und OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen eingerichtet haben |
| 12. | Durchschnittliches unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle bei den Unternehmen, in die investiert wird |
| 13. | Durchschnittliches Verhältnis von Frauen zu Männern in den Leitungs- und Kontrollorganen der Unternehmen, in die investiert wird, ausgedrückt als Prozentsatz aller Mitglieder der Leitungs- und Kontrollorgane |
| 14. | Anteil der Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird, die an der Herstellung oder am Verkauf von umstrittenen Waffen beteiligt sind |
| 15. | THG-Emissionsintensität der Länder, in die investiert wird |
| 16a | Anzahl der Länder, in die investiert wird, die nach Maßgabe internationaler Verträge und Übereinkommen, der Grundsätze der Vereinten Nationen oder, falls anwendbar, nationaler Rechtsvorschriften gegen soziale Bestimmungen verstoßen (absolute Zahl und relative Zahl, geteilt durch alle Länder, in die investiert wird) |
| 16b | Anzahl der Länder, in die investiert wird, die nach Maßgabe internationaler Verträge und Übereinkommen, der Grundsätze der Vereinten Nationen oder, falls anwendbar, nationaler Rechtsvorschriften gegen soziale Bestimmungen verstoßen (absolute Zahl und relative Zahl, geteilt durch alle Länder, in die investiert wird) |

Das Dokument wurde von Swisscanto mit geschäftsüblicher Sorgfalt erstellt und kann Informationen aus sorgfältig ausgewählten Drittquellen enthalten. Anleger sollten beachten, dass die zuvor für 2023 berechneten und veröffentlichten Daten für dieses in 2024 veröffentlichte Dokument neu berechnet wurden. Dementsprechend kann es zu Abweichungen bei diesen in den Jahren 2023 und 2024 veröffentlichten historischen Daten kommen.



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 01.02.2023 - 31.01.2024

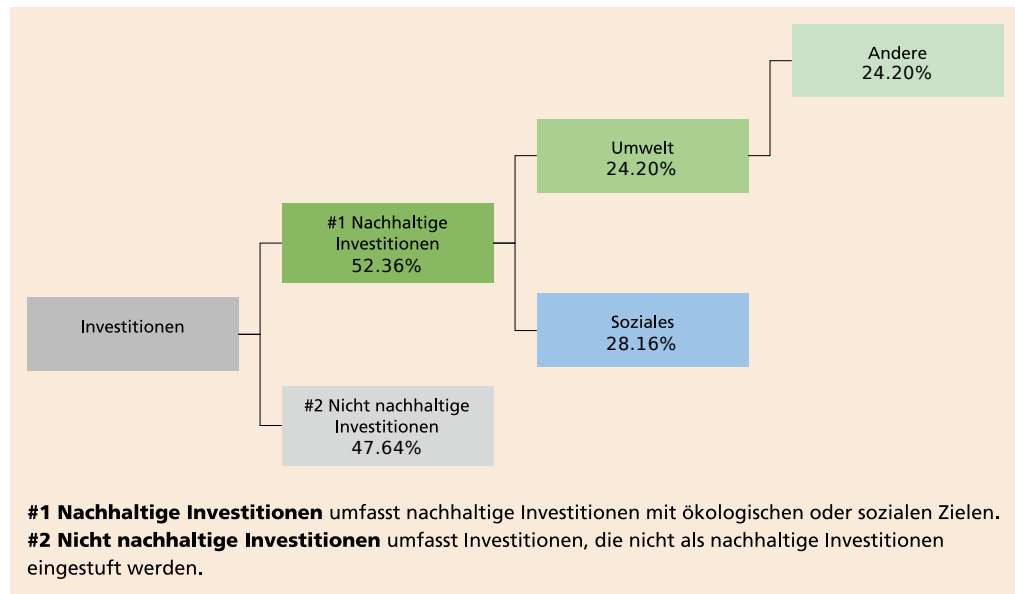
| Grösste Investitionen | Sektor | In % der Vermögenswerte | Land |
|---|---|-------------------------|----------------|
| European Investment Bank 2.15% 18-JAN-2027 | Activities of Extraterritorial Organisations and Bodies | 3.06% | Luxembourg |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Sustainable Global High Yield NT USD Klasse | | 2.38% | |
| Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 2.6% 20-JUN-2037 | Financial and Insurance Activities | 2.00% | |
| Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 2.9% 24-FEB-2026 REGS | Financial and Insurance Activities | 1.73% | |
| International Bank for Reconstruction & Development 2.25% 19-JAN-2029 | Financial and Insurance Activities | 1.67% | |
| International Bank for Reconstruction & Development 2.5% 13-JAN-2031 | Financial and Insurance Activities | 1.67% | |
| BPCE SA 0.444% 22-JUN-2029 REGS | Financial and Insurance Activities | 1.55% | France |
| KfW 2.7% 25-MAR-2024 REGS | Financial and Insurance Activities | 1.38% | |
| Asian Development Bank 2.5% 15-FEB-2027 | Activities of Extraterritorial Organisations and Bodies | 1.20% | Philippines |
| International Bank for Reconstruction & Development 4% 25-JUL-2030 | Financial and Insurance Activities | 1.13% | |
| CNY Cash | | 1.11% | |
| International Bank for Reconstruction & Development 2.5% 22-NOV-2027 | Financial and Insurance Activities | 1.08% | |
| SNCF Reseau 5.25% 07-DEC-2028 REGS | Transporting and Storage | 0.96% | France |
| Barclays Bank PLC 4.0% 24-MAR-2024 REGS | Financial and Insurance Activities | 0.87% | United Kingdom |
| Bank of Montreal 3.85% 17-JUN-2025 | Financial and Insurance Activities | 0.86% | Canada |



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

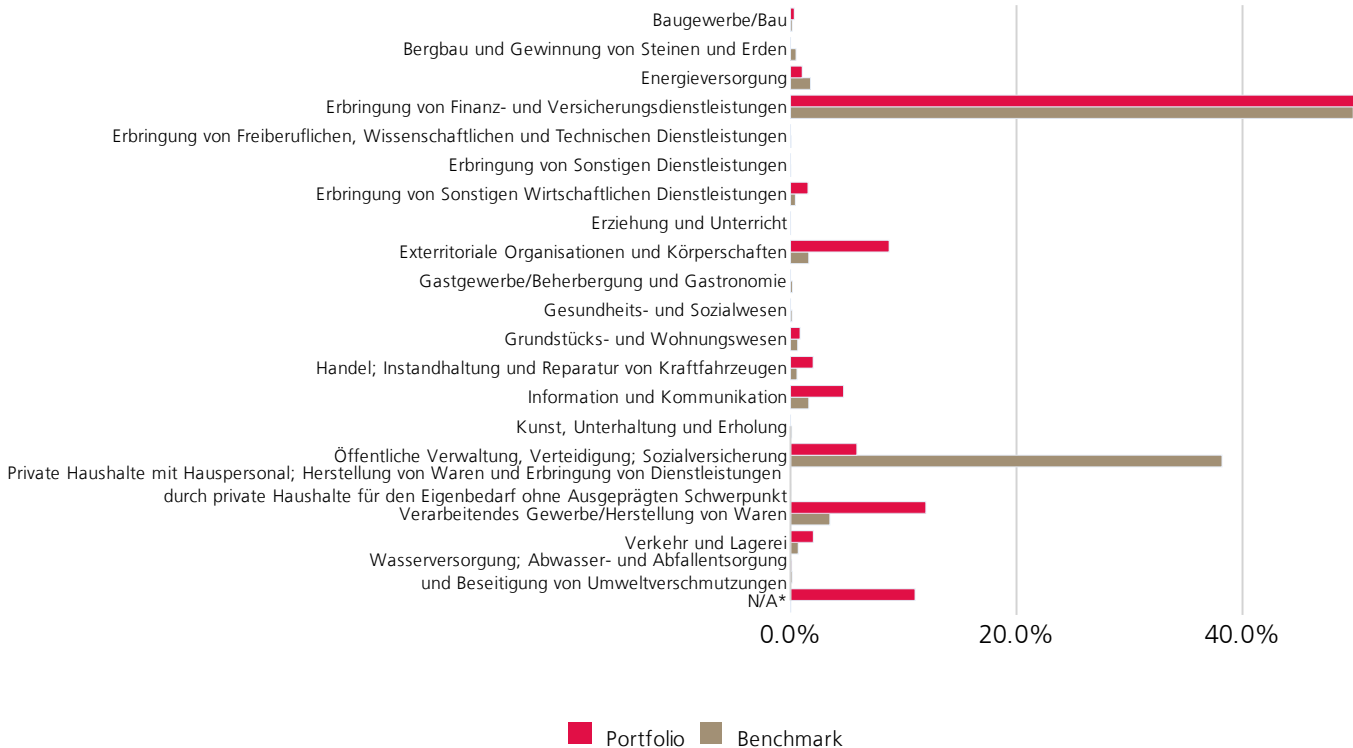
Der Anteil an nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen nach Artikel 9(2) und Angaben zur Vermögensallokation werden in untenstehender Frage beantwortet.

Wie sah die Vermögensallokation aus?



In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Wegen mangelnder Datenverfügbarkeit können Subsektoren nicht angezeigt werden.



*Diese Klassifizierung umfasst alle Bestände, für die keine NACE-Klassifizierung gefunden oder geschätzt werden kann; Liquidität ist darin enthalten.

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Wirtschaftstätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

Investitionsausgaben (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, z.B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft

- **Betriebsausgaben (Opex)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln



Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?

Obwohl keine Investitionen getätigt wurden, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind, wird in untenstehender Grafik die Alignment der nachhaltigen Investitionen mit der EU-Taxonomie offengelegt.

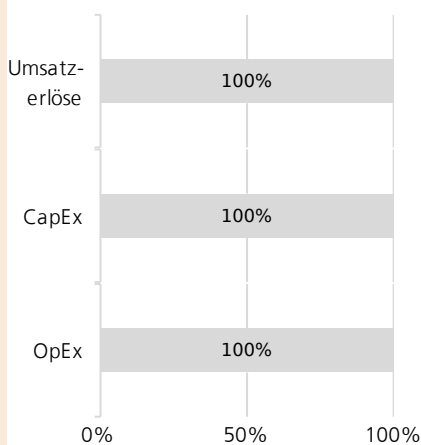
Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert¹?

- Ja
 In fossiles Gas
 In Kernenergie
 Nein

¹Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels ("Klimaschutz") beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

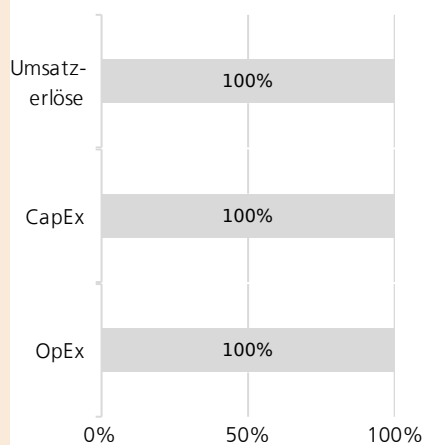
Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in grüner Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzproduktes einschliesslich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.

1. Taxonomiekonformität der Investitionen einschliesslich Staatsanleihen*



Taxonomiekonform: Fossiles Gas
 Taxonomiekonform: Kernenergie
 Taxonomiekonform: (ohne fossiles Gas und Kernenergie)
 Nicht taxonomiekonform

2. Taxonomiekonformität der Investitionen ohne Staatsanleihen*



Taxonomiekonform: Fossiles Gas
 Taxonomiekonform: Kernenergie
 Taxonomiekonform: (ohne fossiles Gas und Kernenergie)
 Nicht taxonomiekonform

Diese Grafik gibt **59.9%** der Gesamtinvestitionen wieder.

*Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff "Staatsanleihen" alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Angaben zu Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten werden in der Tabelle zusammengefasst. Wenn keine Angaben verfügbar sind, wird die Tabelle ebenfalls keine Angaben enthalten.

| Issuer Name | Nace Sektor | Total Eligible Activity Revenue | Total Aligned Revenue | Total Likely Aligned Revenue | Total Potentially Aligned Revenue | Portfolio Gewicht (Consol.) |
|------------------------------------|---|---------------------------------|-----------------------|------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------|
| Orsted | Electricity, Gas, Steam and Air Conditioning Supply | 61.85% | 36.50% | 21.24% | 0.00% | 0.38% |
| VERBUND AG Class A | Electricity, Gas, Steam and Air Conditioning Supply | 51.30% | 22.45% | 24.39% | 0.00% | 0.14% |
| Iberdrola International BV | Water Supply, Sewerage, Waste Management and Remediation Activities | 59.83% | 18.25% | 0.00% | 10.40% | 0.22% |
| ABB Finance BV | Financial and Insurance Activities | 18.50% | 5.00% | 0.00% | 0.00% | 0.18% |
| Merck KGaA | Manufacturing | 0.02% | 0.02% | 0.00% | 0.00% | 0.40% |
| Merck Financial Services GmbH | Financial and Insurance Activities | 0.02% | 0.02% | 0.00% | 0.00% | 0.39% |
| United Utilities Water Finance Plc | Water Supply, Sewerage, Waste Management and Remediation Activities | 100.00% | 0.00% | 99.60% | 0.04% | 0.16% |
| Waste Connections, Inc. | Transporting and Storage | 87.82% | 0.00% | 38.21% | 43.00% | 0.48% |
| SNCF Réseau | Transporting and Storage | 100.00% | 0.00% | 19.49% | 0.00% | 1.92% |
| Vicinity Centres Re Ltd. | Real Estate Activities | 95.08% | 0.00% | 19.02% | 76.06% | 0.36% |

Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

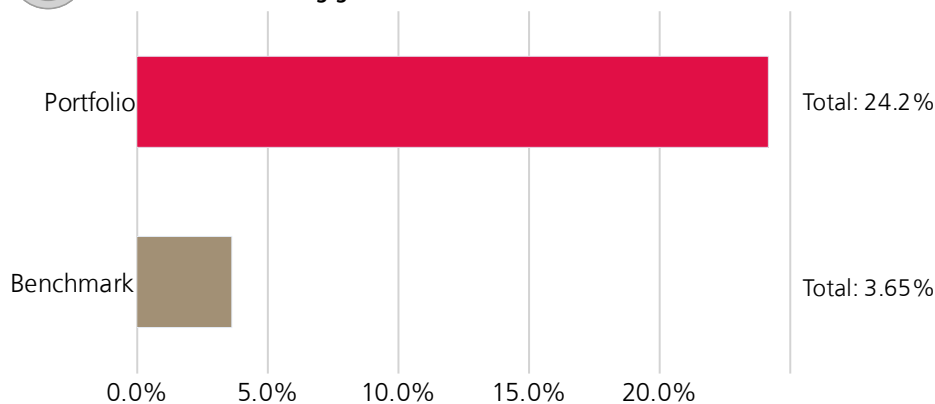
Da im vorangegangenen Berichtsjahr keine Daten verfügbar waren, erübrigt sich ein Vorjahresvergleich.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der EU-Taxonomie **nicht berücksichtigen**.



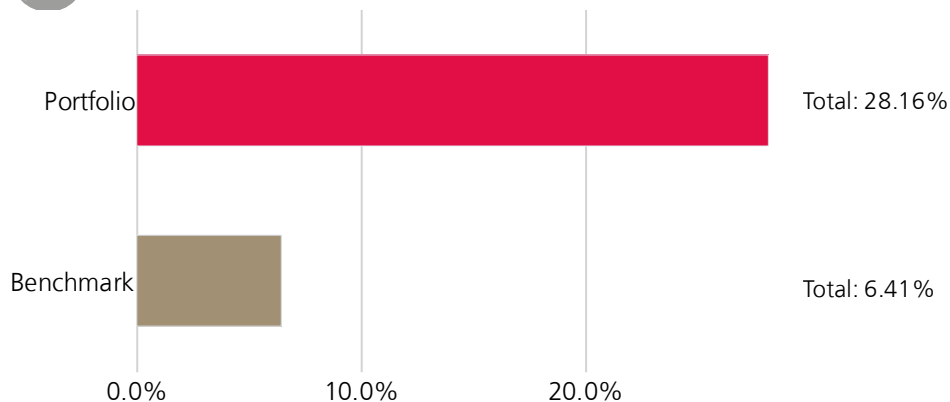
Wie hoch war der Anteil der nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden?



Das Diagramm zeigt die prozentualen Umsätze der im Portfolio des Fonds enthaltenen Unternehmungen und der der Benchmark, welche nicht EU-Taxonomie konform, jedoch im Einklang mit den sich aus den SDGs ergebenden Umweltzielen gemäss Art. 2 (17) SFDR investiert worden sind. Darüber hinaus strebte der Portfolio Manager mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen mit einer Quote von 87.03% an, indem das Portfolio auf eine Reduktion der CO₂e-Emissionen im Sinn von Artikel 9(3) SFDR ausgerichtet wurde.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?



Das Diagramm zeigt die prozentualen Umsätze der im Portfolio des Fonds enthaltenen Unternehmungen und der der Benchmark, welche nicht EU-Taxonomie konform, jedoch im Einklang mit den sich aus den SDGs ergebenden sozialen Zielen gemäss Art. 2 (17) SFDR investiert worden sind.



Welche Investitionen fallen unter „nicht nachhaltige Investitionen“, welcher Anlagezweck wird mit ihnen verfolgt und gibt es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Diese Vermögenswerte haben die in der spezifischen Anlagepolitik vorgesehenen Anlagen umfasst, einschliesslich Derivate zu Absicherungszwecken und flüssige Mittel. Die Anlagen, ausgenommen Derivate und flüssige Mittel, haben die Grundsätze des ökologischen oder sozialen Mindestschutzes umgesetzt.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung des nachhaltigen Investitionsziel ergriffen?

Im Berichtszeitraum förderte der Vermögensverwalter durch Investment Stewardship und Kapitalallokation nachhaltige Geschäftspraktiken und die Einhaltung anerkannter internationaler Prinzipien und ESG-Best-Practice-Standards. Dementsprechend stand er im Dialog mit den Managementteams der investierten Unternehmen. Darüber hinaus hat er sich im Rahmen der United Nations Collaboration Platform for Responsible Investment (UN PRI) und bei Investoreninitiativen engagiert. Das Abstimmungsverhalten basierte auf den schweizerischen und internationalen Corporate-Governance-Regeln sowie auf den Prinzipien des UN Global Compact und den 17 Zielen für nachhaltige Entwicklung (UN SDGs). Weitere Informationen finden Sie unter: Swisssanto | Proxy Voting Dashboard ([issgovernance.com](https://www.swisssanto.com/int/de/nachhaltigkeit/investment-stewardship.html)) <https://www.swisssanto.com/int/de/nachhaltigkeit/investment-stewardship.html>

Swisssanto | Proxy Voting Dashboard ([issgovernance.com](https://www.swisssanto.com/int/de/nachhaltigkeit/investment-stewardship.html))

<https://www.swisssanto.com/int/de/nachhaltigkeit/investment-stewardship.html>



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Nachhaltigkeitsreferenzwert abgeschnitten?

Es wurde kein Index als Referenzwert zur Erreichung der nachhaltigen Investitionsziele bestimmt.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das nachhaltige Ziel des Finanzprodukts erreicht wird.

Wie unterschied sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?

Nicht anwendbar.

Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf das nachhaltige Investitionsziel bestimmt wird?

Nicht anwendbar.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?

Nicht anwendbar.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?

Nicht anwendbar.

Das Dokument wurde von Swisssanto mit geschäftsüblicher Sorgfalt erstellt und kann Informationen aus sorgfältig ausgewählten Drittquellen enthalten. Anleger sollten beachten, dass die zuvor für 2023 berechneten und veröffentlichten Daten für dieses in 2024 veröffentlichte Dokument neu berechnet wurden. Dementsprechend kann es zu Abweichungen bei diesen in den Jahren 2023 und 2024 veröffentlichten historischen Daten kommen.



Regelmässige Information zum 31.01.2024

Regelmässige Informationen zu den in Artikel 9 Absätze 1 bis 4a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 5 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts:

Swisscanto (LU) Bond Fund Sustainable Global Credit

Unternehmenskennung (LEI-Code):

5493000B02IZLS3ZZF50

Benchmark

ICE BofA Global Corporate Bond Index (TR) hedged in CHF

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. In dieser Verordnung ist kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten festgelegt. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Nachhaltiges Investitionsziel

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

| <input checked="" type="radio"/> <input checked="" type="radio"/> X Ja | <input type="radio"/> <input type="radio"/> Nein |
|---|--|
| <p><input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: 36.79%</p> <p><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</p> <p><input checked="" type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</p> | <p><input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es _ % an nachhaltigen Investitionen</p> <p><input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</p> <p><input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</p> <p><input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel</p> |
| <p><input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: 25.82%</p> | <p><input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt.</p> |



Inwieweit wurde das nachhaltige Investitionsziel dieses Finanzprodukts erreicht?

Der Portfolio Manager strebte mit diesem Finanzprodukt primär nachhaltige Investitionen mit einer Quote von mindestens 80% an, indem das Portfolio auf eine Reduktion der CO₂e-Emissionen im Sinn von Artikel 9(3) der Verordnung (EU) 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzsektor (im Folgenden: SFDR) ausgerichtet wird. Die Quote der nachhaltigen Investitionen nach Artikel 9(3) SFDR betrug in der Berichtsperiode 96.73%.

Zudem wurden folgende Nachhaltigkeitsindikatoren zur Bemessung der nachhaltigen Investitionsziele herangezogen:




1. Reduktion der CO₂e-Intensität
2. Ausschlusskriterien
3. Nachhaltige Investitionen nach Artikel 9(2) SFDR

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Aus Übersichtsgründen werden die Angaben zur Performance (siehe Details am Ende des Reports) der Nachhaltigkeitsindikatoren direkt mit dem historischen Vergleich in der nächsten Frage beantwortet.

... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Ausschlusskriterien

| Sustainable | | | | | | | |
|---|--|---|------------------------------------|--|-------------------|-------------------|------------------------------|
| Kriterien | Gewicht Portfolio | Gewicht Benchmark | Anzahl Unternehmen Benchmark | Kriterien | Gewicht Portfolio | Gewicht Benchmark | Anzahl Unternehmen Benchmark |
|  Gentechnik: GVO-Freisetzung | 0.00% | 1.18% | 9 |  Kernenergie | 0.00% | 6.10% | 68 |
| Nichtnachhaltige Waldwirtschaft | 0.00% | 0.23% | 13 | Herstellung von Kriegstechnik | 0.00% | 2.58% | 41 |
| Nicht zertifiziertes Palmöl (<50% RSPO) | 0.00% | 0.15% | 8 | Herstellung von Alkohol (> 5% Umsatz) | 0.00% | 1.24% | 15 |
| Nichtnachhaltige Fischerei & Fischzucht | 0.00% | 0.01% | 2 | Herstellung von Tabak & Raucherwaren | 0.00% | 1.07% | 13 |
|  Förderung fossiler Energieträger | 0.00% | 13.56% | 107 | Ausbeuterische Kinderarbeit | 0.00% | 0.88% | 6 |
| Betrieb von fossilen Kraftwerken | 0.00% | 6.88% | 112 | Herstellung von Waffen & Munition | 0.00% | 0.78% | 8 |
| Herstellung von Automobilen & Flugzeugen | 0.00% | 3.77% | 27 | Kontroverse Waffen | 0.00% | 0.58% | 3 |
| Kohlereserven | 0.00% | 2.67% | 53 | UN Global Compact Verstöße | 0.00% | 0.50% | 5 |
| Fluggesellschaften | 0.00% | 0.19% | 11 | Massentierhaltung | 0.00% | 0.37% | 16 |
| Förderung von Kohle (> 5% Umsatz) | 0.00% | 0.15% | 3 | Glücksspiel (> 5% Umsatz) | 0.00% | 0.14% | 4 |
| Kreuzfahrt-gesellschaften | 0.00% | 0.06% | 1 | Gentechnik: Humanmedizin | 0.00% | 0.01% | 0 |
|  Rückgang der Artenvielfalt |  Klimawandel |  Gefährdung von Gesellschaft und Gesundheit | Herstellung von Pornografie | 0.00% | 0.00% | 0 | |

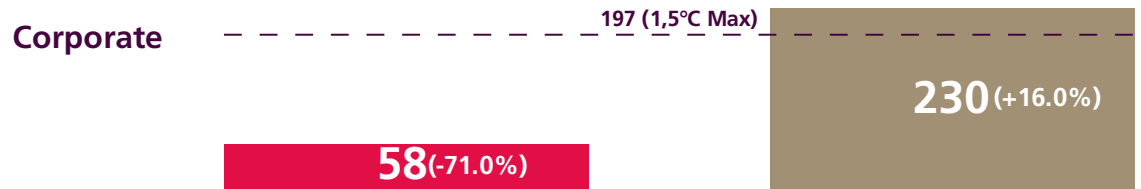
Zwecks Minderung der Nachhaltigkeitsrisiken und mit dem Ziel, nicht in Wertpapiere der oben aufgeführten kontroversen Geschäftsmodellen zu investieren, sind die oben genannten Ausschlusskriterien angewendet worden. Die Tabelle zeigt die Anzahl der Unternehmen, die gegen die Ausschlusskriterien verstossen haben, sowie die jeweilige Portfolio- und Benchmark-Exposition. Liegen bei einem Unternehmen mehrere Verstösse vor, werden diese für jedes Kriterium separat aufgeführt. Daher ist die Summe aller Positionen in diesem Bericht in der Regel höher als das effektive Gewicht, der im Portfolio bzw. in der Benchmark ausgeschlossenen Unternehmen.

Die historischen Vergleiche werden in nachfolgender Tabelle gemacht. Aus Übersichtsründen werden die Ausschlusskriterien aggregiert.

| | Indikator | Datum 2023 | Datum 2024 |
|-----------|----------------------------|------------|------------|
| Portfolio | Ausschlusskriterien Total* | 0% | 0% |
| Benchmark | Ausschlusskriterien Total* | 21.63% | 21.5% |

*alle Ausschlusskriterien kumuliert.

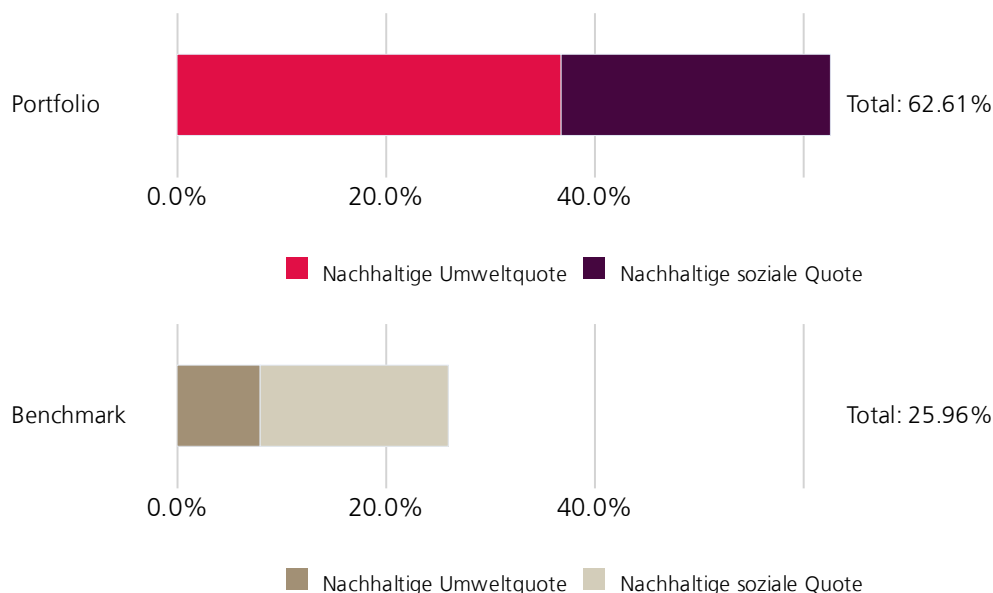
Reduktion der CO₂e-Intensität



Im Einklang mit dem 1.5° Pariser Klimaziel zielte die Investitionstätigkeit des Fonds während der Berichtsperiode darauf ab, die CO₂e-Emissionen des Portfolios, um mindestens 7.5 % pro Jahr zu reduzieren. Der Absenkpfad berechnet sich aus den gewichteten CO₂e-Intensitäten der Benchmark, diskontiert mit 7.5 % pro Jahr zuzüglich des realen Wirtschaftswachstums. Die gestrichelten 1.5° Max-Linie zeigt den Maximalwert an. Die Balken stellen die CO₂e-Intensitäten des Portfolios und der Benchmark dar. CO₂e-Intensitäten unterhalb der 1.5° Max-Linie zeigen an, dass das Portfolio oder die Benchmark das 1.5°-Klimaziel erfüllen. Werte bei "Erreichung Klimaziel" setzen das Portfolio und die Benchmark in Relation zum Klimaziel. Negative Werte bedeuten, dass das Ziel erreicht wurde. Die historischen Vergleiche werden in nachfolgender Tabelle gemacht.

| | Indikator | Datum 2023 | Datum 2024 |
|-----------|--|------------|------------|
| Portfolio | CO ₂ e-Intensität Corporate | 64 | 58 |
| | Reduktion Corporate | -72% | -71% |
| Benchmark | CO ₂ e-Intensität Corporate | 251 | 230 |
| | Reduktion Corporate | 8% | 16% |

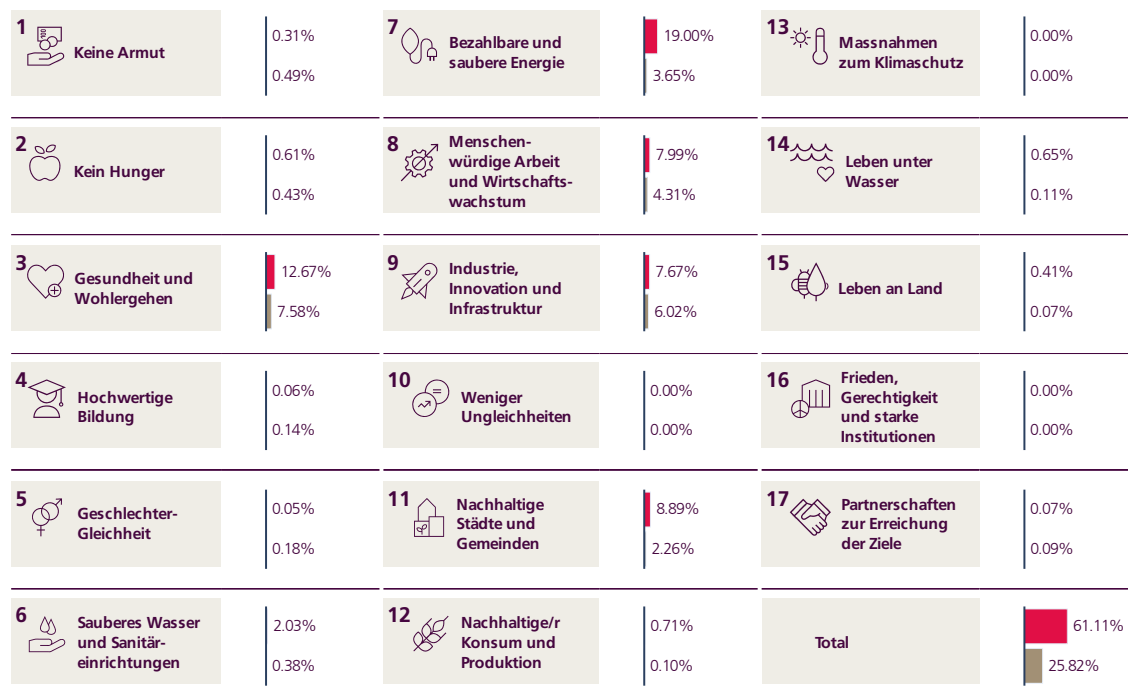
Nachhaltige Investitionen nach Artikel 9(2) SFDR



Das Diagramm zeigt die prozentualen Umsätze der im Portfolio des Fonds enthaltenen Unternehmungen und der der Benchmark, welche nicht EU-Taxonomie konform, jedoch im Einklang mit den sich aus den UN Sustainable Development Goals (SDGs) ergebenden Umwelt- und sozialen Zielen gemäss Art. 2 (17) SFDR investiert worden sind.

Der Fonds hat keine Investitionen in ökologisch nachhaltige Aktivitäten im Sinne der EU Taxonomie-Verordnung angestrebt. Der Investmentmanager des (Teil-)Fonds hat eine Methodologie zur Definition nachhaltiger Investitionen entwickelt, die den Anforderungen des Art. 2 (17) SFDR entspricht. Die Methodologie ist detailliert in den Vorvertraglichen Informationen beschrieben. Die historischen Vergleiche werden in nachfolgender Tabelle gemacht.

| | Indikator | Datum 2023 | Datum 2024 |
|-----------|---|------------|------------|
| Portfolio | Anteil nachhaltige Investitionen mit Umweltziel | 38.1% | 36.79% |
| | Anteil sozial nachhaltige Investitionen | 24.27% | 25.82% |
| | Total nachhaltige Quote | 62.37% | 62.61% |
| Benchmark | Anteil nachhaltige Investitionen mit Umweltziel | 6.9% | 7.89% |
| | Anteil sozial nachhaltige Investitionen | 17.14% | 18.07% |
| | Total nachhaltige Quote | 24.04% | 25.96% |



 Portfolio
  Benchmark

Aufgrund der unterschiedlichen Behandlung von Green, Social und Sustainable Bonds kann das SDG-Exposure von den prozentualen Umsätzen der im Portfolio des Fonds enthaltenen Unternehmungen und den der Benchmark, welche im Einklang mit den sich aus den SDGs ergebenden Umweltzielen gemäss Art. 2 (17) SFDR investiert worden sind, abweichen.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

● **Inwiefern wurden nachhaltige Investitionsziele durch die nachhaltigen Investitionen nicht erheblich beeinträchtigt?**

Emittenten mit einem negativen Nettobeitrag zu den SDGs wurden in der Berichtsperiode aus dem Anlageuniversum des Finanzproduktes entfernt. Darüber hinaus berücksichtigte der Teilfonds nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (engl: Principal Adverse Impacts - PAI). Zu diesem Zweck wurden die obligatorischen Indikatoren Anhang 1 der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1288 zur Ergänzung der Verordnung (EU) 2019/2088 zugrunde gelegt. Unternehmen, die der Vermögensverwalter gemäss PAI als besonders schädlich einstufte, wurden entsprechend nicht zu den nachhaltigen Anlagen gezählt. Emittenten, welche die PAIs 7 (Biodiversität), 10 (Global Compact der Vereinten Nationen (UNGC)/OECD Leitsätze für multinationale Unternehmen) oder 14 (Engagement in umstrittenen Waffen) verletzen, haben einen PAI-Score von null erhalten. Aus den restlichen PAI-Indikatoren wurde ein PAI-Score berechnet. Instrumente von Emittenten mit einem Score < 10 wurden nicht den nachhaltigen Investitionen angerechnet.

● **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Die nachteiligen Auswirkungen (PAI) sind systematisch im Anlageprozess berücksichtigt worden.

● **Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:**

Bei der Anlageanalyse für nachhaltige Investitionen wurden in der Berichtsperiode die folgenden Normverletzungen berücksichtigt: Global Compact der Vereinten Nationen (UNGC), die UNLeitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte (UNGP) und das Übereinkommen der Internationalen Arbeitsorganisation (ILO). Jeder schwerwiegende Verstoß gegen diese Normen führte zum Ausschluss des Emittenten aus dem investierbaren Universum des Finanzproduktes.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

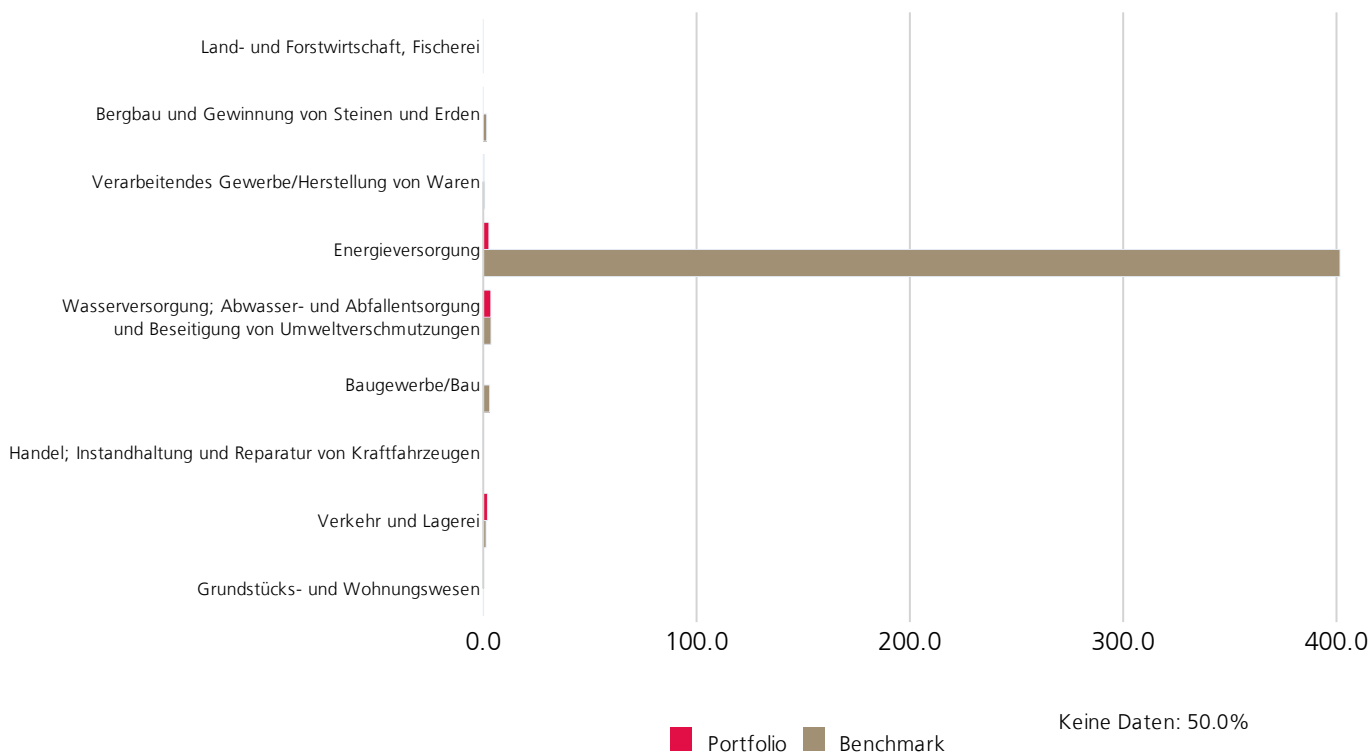
Nachteilige Nachhaltigkeitsauswirkungen (PAI) – Corporate Anlagen

Primäre Indikatoren - Energie und Emissionen

| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Benchmark Aktuell | Benchmark Vorjahr | Erklärung |
|--|--|-------------------|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|-----------|
| 1. THG-Emissionen | 1a. GHG Emissions - Scope 1 per Mio EUR Enterprise Value | 3106.18 | 90.59% | 2289.01 | 11213.5 | 281102 | |
| | 1b. GHG Emissions - Scope 2 per Mio EUR Enterprise Value | 1064.19 | 90.59% | 1227.2 | 1855.09 | 19121.4 | |
| | 1c. GHG Emissions - Scope 3 per Mio EUR Enterprise Value | 31236.8 | 90.59% | 30310.7 | 69272.7 | 1.10139e+006 | |
| 2. CO ₂ -Fussabdruck | 2. GHG Emissions - Scope 1+2+3 per Mio EUR Enterprise Value | 217.29 | 90.59% | 198.41 | 511.02 | 7885.2 | |
| 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird | 3. GHG Emissions - Emissions Intensity - Total Emissions (EUR) | 103.36 | 92.75% | 94.42 | 283.03 | 259.22 | |
| 4. Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind | 4. Fossil Fuel - Involvement (PAI) | 2.62% | 91.78% | 2.54% | 12.81% | 10.83% | |

| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Benchmark Aktuell | Benchmark Vorjahr | Erklärung |
|--|--|-------------------|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|---|
| 5. Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen | 5a. CR Raw - Energy use - Coal/nuclear/undear energy sources | 60.56% | 32.21% | 64.86% | 60.28% | 60.92% | |
| | 5b. Non-renewable energy consumption | 59.49% | 37.39% | 82.16% | 62.45% | 82.37% | Der Verbrauch nicht-erneuerbarer Energie umfasst den Verbrauch von Energie, die aus nicht-erneuerbaren Quellen erzeugt wird, sowie den Verbrauch von Energie aus Biomasse. Alle Zahlen zum Energieverbrauch, bei denen die Energiequelle unklar ist, sind ebenfalls in diesem Faktor enthalten. |
| | 5c. Non-renewable energy production | 1% | 91.25% | 0.25% | 4.91% | 4.42% | |
| 6. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren | 6. Energy consumption intensity (GWh/mEUR) | 0.33 | 52.13% | 0.81 | 26.4 | 10.38 | |

Intensität des Energieverbrauchs pro High Impact Sector (pro Mio. EUR)



| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Benchmark Aktuell | Benchmark Vorjahr | Erklärung |
|---|--|-------------------|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|-----------|
| 7. Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken | 7. Companies negatively affecting biodiversity-sensitive areas | 0% | 91.59% | 0% | 0.18% | 0.12% | |
| 8. Emissionen in Wasser | 8. CR Raw - COD emissions | 89.29 | 2.39% | 96 | 95.62 | 84.27 | |
| 9. Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle | 9. CR Raw - Hazardous waste | 0.03 | 7.16% | 0 | 0.09 | 0 | |

| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Benchmark Aktuell | Benchmark Vorjahr | Erklärung |
|--|--|-------------------|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|-----------|
| 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | 10. UNGC / OECD Guidelines Violation | 0% | 91.59% | 0% | 0.5% | 0.21% | |
| 11. Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen | 11. Lack of processes monitoring UNGC and OECD Guidelines compliance | 6.16% | 78.19% | 5.14% | 16.81% | 14.22% | |
| 12. Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle | 12. Unadjusted gender pay gap | 1.07% | 13.8% | 0.97% | 0.53% | 0.51% | |
| 13. Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen | 13. Ratio of female to male board members | 63.96% | 73.9% | 60.12% | 57.51% | 57.07% | |
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) | 14. Controversial weapons involvement (APM, CM, Bio, Chem) | 0% | 92.33% | 0% | 0.13% | 0.16% | |

Nachteilige Nachhaltigkeitsauswirkungen (PAI) – Staatliche und Supranationale Vermögenswerte

Primäre Indikatoren

| Umwelt | | | | | | | |
|--------------------|-------------------|-------------------|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|-----------|
| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Benchmark Aktuell | Benchmark Vorjahr | Erklärung |
| 15. GHG Intensität | 15. GHG Intensity | 52.3 | 0.1% | 149.76 | 569.92 | 647.11 | |

| Sozial | | | | | | | |
|--|---|-------------------|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|-----------|
| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Benchmark Aktuell | Benchmark Vorjahr | Erklärung |
| 16. Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen | 16a. Countries subject to social violations (#) | 0 | 0% | 0 | 0 | 0 | |
| | 16b. Countries subject to social violations (%) | 0% | 0% | 0% | 0% | 0% | |

| Indikator | Metrik |
|-----------|---|
| 1a | Scope-1-Treibhausgas-Emissionen |
| 1b | Scope-2-Treibhausgas-Emissionen |
| 1c | Scope-3-Treibhausgas-Emissionen |
| 2. | CO2-Fussabdruck pro Mio EUR |
| 3. | THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird |
| 4. | Anteil der Investitionen in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind |
| 5a | Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung der Unternehmen, in die investiert wird, aus nicht erneuerbaren Energiequellen im Vergleich zu erneuerbaren Energiequellen, ausgedrückt in Prozent der gesamten Energiequellen |
| 5b | Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung der Unternehmen, in die investiert wird, aus nicht erneuerbaren Energiequellen im Vergleich zu erneuerbaren Energiequellen, ausgedrückt in Prozent der gesamten Energiequellen |
| 5c | Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung der Unternehmen, in die investiert wird, aus nicht erneuerbaren Energiequellen im Vergleich zu erneuerbaren Energiequellen, ausgedrückt in Prozent der gesamten Energiequellen |
| 6. | Energieverbrauch in GWh pro einer Million EUR Umsatz der Unternehmen, in die investiert wird, aufgeschlüsselt nach klimaintensiven Sektoren |
| 7. | Anteil der Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird, mit Standorten/Betrieben in oder in der Nähe von Gebieten mit schutzbedürftiger Biodiversität, sofern sich die Tätigkeiten dieser Unternehmen nachteilig auf diese Gebiete auswirken |
| 8. | Tonnen Emissionen in Wasser, die von den Unternehmen, in die investiert wird, pro investierter Million EUR verursacht werden, ausgedrückt als gewichteter Durchschnitt |
| 9. | Tonnen gefährlicher und radioaktiver Abfälle, die von den Unternehmen, in die investiert wird, pro investierter Million EUR erzeugt werden, ausgedrückt als gewichteter Durchschnitt |
| 10. | Anteil der Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird, die an Verstößen gegen die UNGC-Grundsätze oder gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen beteiligt waren |
| 11. | Anteil der Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird, die keine Richtlinien zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen oder keine Verfahren zur Bearbeitung von Beschwerden wegen Verstößen gegen die UNGC-Grundsätze und OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen eingerichtet haben |
| 12. | Durchschnittliches unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle bei den Unternehmen, in die investiert wird |
| 13. | Durchschnittliches Verhältnis von Frauen zu Männern in den Leitungs- und Kontrollorganen der Unternehmen, in die investiert wird, ausgedrückt als Prozentsatz aller Mitglieder der Leitungs- und Kontrollorgane |
| 14. | Anteil der Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird, die an der Herstellung oder am Verkauf von umstrittenen Waffen beteiligt sind |
| 15. | THG-Emissionsintensität der Länder, in die investiert wird |
| 16a | Anzahl der Länder, in die investiert wird, die nach Maßgabe internationaler Verträge und Übereinkommen, der Grundsätze der Vereinten Nationen oder, falls anwendbar, nationaler Rechtsvorschriften gegen soziale Bestimmungen verstoßen (absolute Zahl und relative Zahl, geteilt durch alle Länder, in die investiert wird) |
| 16b | Anzahl der Länder, in die investiert wird, die nach Maßgabe internationaler Verträge und Übereinkommen, der Grundsätze der Vereinten Nationen oder, falls anwendbar, nationaler Rechtsvorschriften gegen soziale Bestimmungen verstoßen (absolute Zahl und relative Zahl, geteilt durch alle Länder, in die investiert wird) |

Das Dokument wurde von Swisscanto mit geschäftsüblicher Sorgfalt erstellt und kann Informationen aus sorgfältig ausgewählten Drittquellen enthalten. Anleger sollten beachten, dass die zuvor für 2023 berechneten und veröffentlichten Daten für dieses in 2024 veröffentlichte Dokument neu berechnet wurden. Dementsprechend kann es zu Abweichungen bei diesen in den Jahren 2023 und 2024 veröffentlichten historischen Daten kommen.



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 01.02.2023 - 31.01.2024

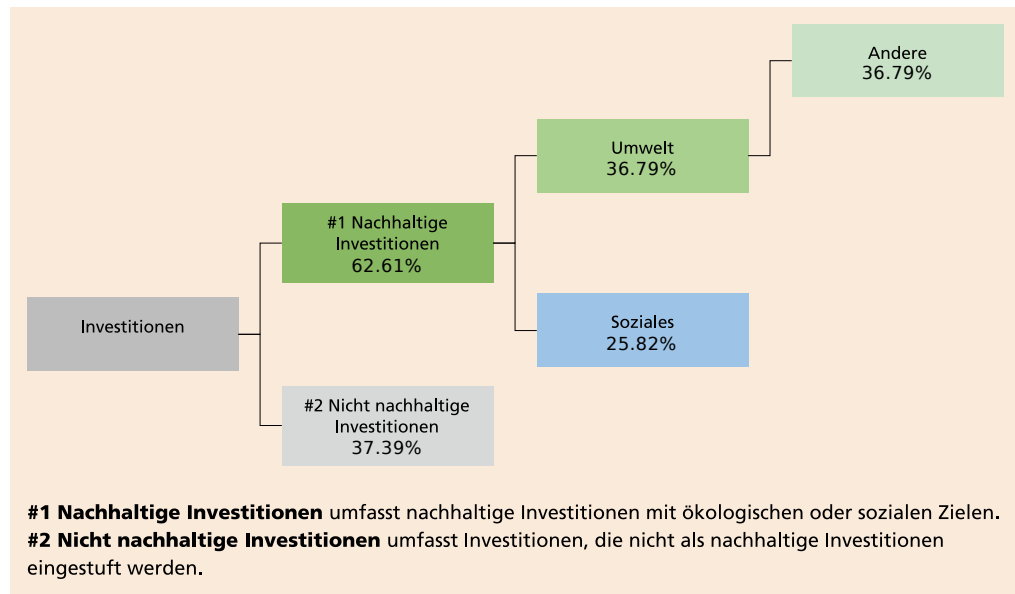
| Grösste Investitionen | Sektor | In % der Vermögenswerte | Land |
|--|------------------------------------|-------------------------|----------------|
| CHF Cash | | 1.52% | |
| Bank of America Corp 6.204% 10-NOV-2028 | Financial and Insurance Activities | 1.21% | USA |
| HSBC Holdings PLC 6.5% 02-MAY-2036 | Financial and Insurance Activities | 1.18% | United Kingdom |
| Toronto-Dominion Bank/The 4.108% 08-JUN-2027 | Financial and Insurance Activities | 0.85% | Canada |
| UBS Group AG 5.959% 12-JAN-2034 REGS | Financial and Insurance Activities | 0.84% | Switzerland |
| ASR Nederland NV 7% 07-DEC-2043 REGS | Financial and Insurance Activities | 0.83% | Netherlands |
| Redeia Corp SA 4.625% PERP REGS | Construction | 0.76% | Spain |
| State Street Corp 3.031% 01-NOV-2034 | Financial and Insurance Activities | 0.76% | USA |
| Honda Motor Co Ltd 2.534% 10-MAR-2027 | Manufacturing | 0.75% | Japan |
| Union Pacific Corp 2.8% 14-FEB-2032 | Transporting and Storage | 0.75% | USA |
| ING Groep NV 4.625% 06-JAN-2026 REGS | Financial and Insurance Activities | 0.74% | Netherlands |
| Banco Santander SA 2.749% 03-DEC-2030 | Financial and Insurance Activities | 0.73% | Spain |
| American Express Co 4.05% 03-MAY-2029 | Financial and Insurance Activities | 0.73% | USA |
| Allianz SE 3.5% PERP 144A | Financial and Insurance Activities | 0.70% | Germany |
| AT&T Inc 2.25% 01-FEB-2032 | Information and Communication | 0.69% | USA |



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

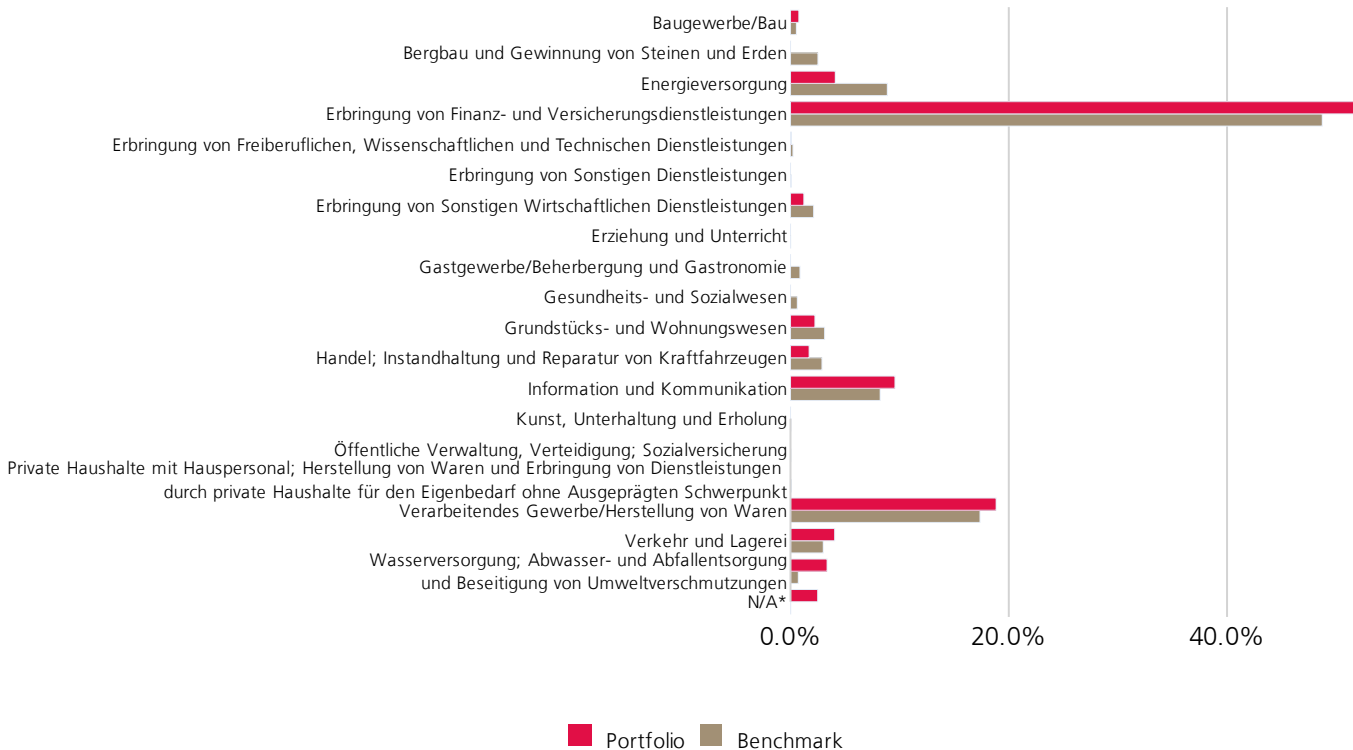
Der Anteil an nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen nach Artikel 9(2) und Angaben zur Vermögensallokation werden in untenstehender Frage beantwortet.

Wie sah die Vermögensallokation aus?



In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Wegen mangelnder Datenverfügbarkeit können Subsektoren nicht angezeigt werden.



*Diese Klassifizierung umfasst alle Bestände, für die keine NACE-Klassifizierung gefunden oder geschätzt werden kann; Liquidität ist darin enthalten.

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Wirtschaftstätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

Investitionsausgaben (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, z.B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft

- **Betriebsausgaben (Opex)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln



Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?

Obwohl keine Investitionen getätigt wurden, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind, wird in untenstehender Grafik die Alignment der nachhaltigen Investitionen mit der EU-Taxonomie offengelegt.

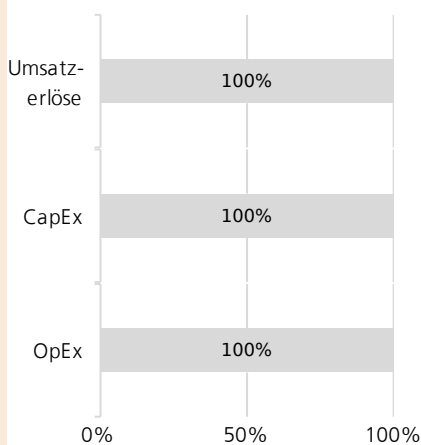
Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert¹?

Ja
 In fossiles Gas
 In Kernenergie
 Nein

¹Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels ("Klimaschutz") beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

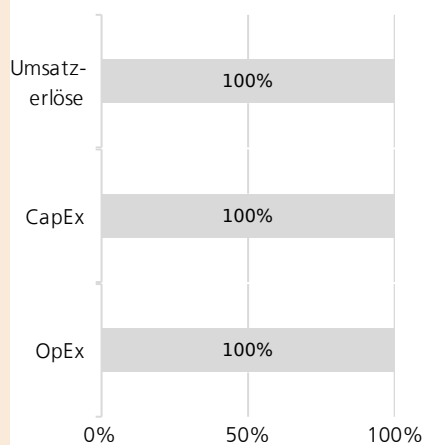
Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in grüner Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzproduktes einschliesslich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.

1. Taxonomiekonformität der Investitionen einschliesslich Staatsanleihen*



Taxonomiekonform: Fossiles Gas
 Taxonomiekonform: Kernenergie
 Taxonomiekonform: (ohne fossiles Gas und Kernenergie)
 Nicht taxonomiekonform

2. Taxonomiekonformität der Investitionen ohne Staatsanleihen*



Taxonomiekonform: Fossiles Gas
 Taxonomiekonform: Kernenergie
 Taxonomiekonform: (ohne fossiles Gas und Kernenergie)
 Nicht taxonomiekonform

Diese Grafik gibt **99.9%** der Gesamtinvestitionen wieder.

*Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff "Staatsanleihen" alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Angaben zu Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten werden in der Tabelle zusammengefasst. Wenn keine Angaben verfügbar sind, wird die Tabelle ebenfalls keine Angaben enthalten.

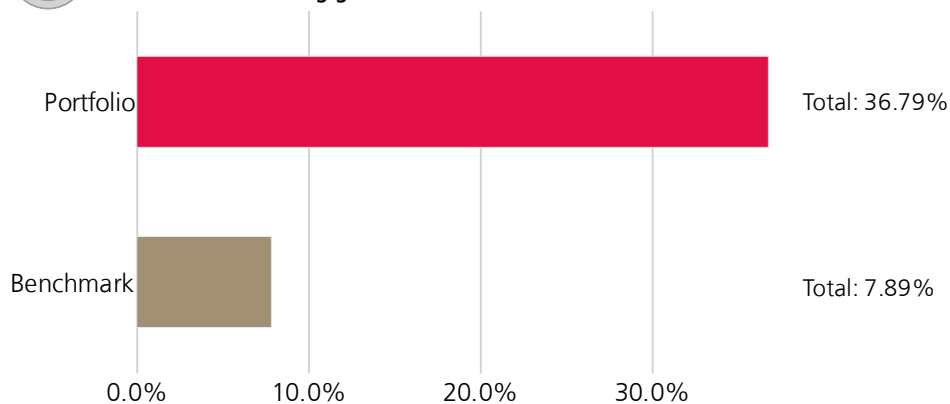
| Issuer Name | Nace Sektor | Total Eligible Activity Revenue | Total Aligned Revenue | Total Likely Aligned Revenue | Total Potentially Aligned Revenue | Portfolio Gewicht (Consol.) |
|---|---|---------------------------------|-----------------------|------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------|
| Terna S.p.A. | Electricity, Gas, Steam and Air Conditioning Supply | 87.76% | 21.75% | 13.10% | 0.00% | 0.50% |
| Redeia Corporacion SA | Construction | 84.35% | 19.80% | 12.73% | 0.00% | 0.55% |
| Orsted | Electricity, Gas, Steam and Air Conditioning Supply | 56.27% | 18.25% | 31.86% | 0.00% | 0.47% |
| National Grid Electricity Distribution (South West) Plc | Financial and Insurance Activities | 19.17% | 16.75% | 0.00% | 0.36% | 0.08% |
| Acciona Energia Financiacion Filiales SA | Professional, Scientific and Technical Activities | 82.21% | 13.62% | 0.00% | 0.00% | 0.09% |
| EDP-Energias de Portugal SA | Electricity, Gas, Steam and Air Conditioning Supply | 77.52% | 12.25% | 0.00% | 32.43% | 0.89% |
| CTP N.V. | Real Estate Activities | 100.00% | 11.60% | 0.00% | 0.00% | 0.24% |
| Iberdrola International BV | Electricity, Gas, Steam and Air Conditioning Supply | 61.60% | 9.13% | 0.00% | 15.60% | 0.61% |
| Iberdrola Finanzas SA | Electricity, Gas, Steam and Air Conditioning Supply | 61.60% | 9.13% | 0.00% | 15.60% | 0.12% |
| Vigie SA | Water Supply, Sewerage, Waste Management and Remediation Activities | 68.52% | 8.28% | 30.01% | 0.00% | 0.36% |

Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?


Da im vorangegangenen Berichtsjahr keine Daten verfügbar waren, erübrigt sich ein Vorjahresvergleich.

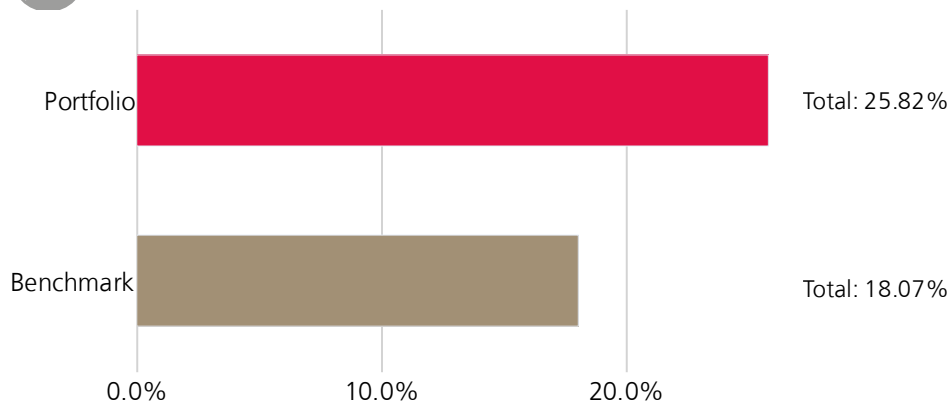
 sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der EU-Taxonomie **nicht berücksichtigen**.

 **Wie hoch war der Anteil der nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden?**




Das Diagramm zeigt die prozentualen Umsätze der im Portfolio des Fonds enthaltenen Unternehmungen und der der Benchmark, welche nicht EU-Taxonomie konform, jedoch im Einklang mit den sich aus den SDGs ergebenden Umweltzielen gemäss Art. 2 (17) SFDR investiert worden sind. Darüber hinaus erreichte der Portfolio Manager mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen mit einer Quote von 96.73% an, indem das Portfolio auf eine Reduktion der CO2e-Emissionen im Sinn von Artikel 9(3) SFDR ausgerichtet wurde.

 **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**



Das Diagramm zeigt die prozentualen Umsätze der im Portfolio des Fonds enthaltenen Unternehmungen und der der Benchmark, welche nicht EU-Taxonomie konform, jedoch im Einklang mit den sich aus den SDGs ergebenden sozialen Zielen gemäss Art. 2 (17) SFDR investiert worden sind.

 **Welche Investitionen fallen unter „nicht nachhaltige Investitionen“, welcher Anlagezweck wird mit ihnen verfolgt und gibt es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

Diese Vermögenswerte haben die in der spezifischen Anlagepolitik vorgesehenen Anlagen umfasst, einschliesslich Derivate zu Absicherungszwecken und flüssige Mittel. Die Anlagen, ausgenommen Derivate und flüssige Mittel, haben die Grundsätze des ökologischen oder sozialen Mindestschutzes umgesetzt.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung des nachhaltigen Investitionsziel ergriffen?

Im Berichtszeitraum förderte der Vermögensverwalter durch Investment Stewardship und Kapitalallokation nachhaltige Geschäftspraktiken und die Einhaltung anerkannter internationaler Prinzipien und ESG-Best-Practice-Standards. Dementsprechend stand er im Dialog mit den Managementteams der investierten Unternehmen. Darüber hinaus hat er sich im Rahmen der United Nations Collaboration Platform for Responsible Investment (UN PRI) und bei Investoreninitiativen engagiert. Das Abstimmungsverhalten basierte auf den schweizerischen und internationalen Corporate-Governance-Regeln sowie auf den Prinzipien des UN Global Compact und den 17 Zielen für nachhaltige Entwicklung (UN SDGs). Weitere Informationen finden Sie unter: Swisssanto | Proxy Voting Dashboard (issgovernance.com) <https://www.swisssanto.com/int/de/nachhaltigkeit/investment-stewardship.html>

Swisssanto | Proxy Voting Dashboard (issgovernance.com)

<https://www.swisssanto.com/int/de/nachhaltigkeit/investment-stewardship.html>



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Nachhaltigkeitsreferenzwert abgeschnitten?

Es wurde kein Index als Referenzwert zur Erreichung der nachhaltigen Investitionsziele bestimmt.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das nachhaltige Ziel des Finanzprodukts erreicht wird.

Wie unterschied sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?

Nicht anwendbar.

Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf das nachhaltige Investitionsziel bestimmt wird?

Nicht anwendbar.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?

Nicht anwendbar.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?

Nicht anwendbar.

Das Dokument wurde von Swisssanto mit geschäftsüblicher Sorgfalt erstellt und kann Informationen aus sorgfältig ausgewählten Drittquellen enthalten. Anleger sollten beachten, dass die zuvor für 2023 berechneten und veröffentlichten Daten für dieses in 2024 veröffentlichte Dokument neu berechnet wurden. Dementsprechend kann es zu Abweichungen bei diesen in den Jahren 2023 und 2024 veröffentlichten historischen Daten kommen.



Regelmässige Information zum 31.01.2024

Regelmässige Informationen zu den in Artikel 9 Absätze 1 bis 4a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 5 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts:

Swisscanto (LU) Bond Fund Sustainable Global High Yield

Unternehmenskennung (LEI-Code):

549300QT8R0DJRSOJL97

Benchmark

ICE BofA Global High Yield Index (TR) hedged in USD

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. In dieser Verordnung ist kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten festgelegt. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Nachhaltiges Investitionsziel

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

| <input checked="" type="radio"/> <input checked="" type="radio"/> X Ja | <input type="radio"/> <input type="radio"/> Nein |
|---|---|
| <p><input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: 29.62%</p> <p><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</p> <p><input checked="" type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</p> | <p><input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es _% an nachhaltigen Investitionen</p> <p><input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</p> <p><input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</p> <p><input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel</p> |
| <p><input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: 31.21%</p> | <p><input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt.</p> |



Inwieweit wurde das nachhaltige Investitionsziel dieses Finanzprodukts erreicht?

Der Portfolio Manager strebte mit diesem Finanzprodukt primär nachhaltige Investitionen mit einer Quote von mindestens 80% an, indem das Portfolio auf eine Reduktion der CO₂e-Emissionen im Sinn von Artikel 9(3) der Verordnung (EU) 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzsektor (im Folgenden: SFDR) ausgerichtet wird. Die Quote der nachhaltigen Investitionen nach Artikel 9(3) SFDR betrug in der Berichtsperiode 96.07%.

Zudem wurden folgende Nachhaltigkeitsindikatoren zur Bemessung der nachhaltigen Investitionsziele herangezogen:

1. Reduktion der CO₂e-Intensität
2. Ausschlusskriterien
3. Nachhaltige Investitionen nach Artikel 9(2) SFDR







Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Aus Übersichtsgründen werden die Angaben zur Performance (siehe Details am Ende des Reports) der Nachhaltigkeitsindikatoren direkt mit dem historischen Vergleich in der nächsten Frage beantwortet.

... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Ausschlusskriterien

Sustainable

| Kriterien | Gewicht Portfolio | Gewicht Benchmark | Anzahl Unternehmen Benchmark | Kriterien | Gewicht Portfolio | Gewicht Benchmark | Anzahl Unternehmen Benchmark |
|--|---|--|------------------------------|---|-------------------|-------------------|------------------------------|
|  Gentechnik: GVO-Freisetzung | 0.00% | 0.48% | 7 |  Glücksspiel (> 5% Umsatz) | 0.00% | 2.70% | 34 |
| Nicht zertifiziertes Palmöl (<50% RSPO) | 0.00% | 0.20% | 2 | UN Global Compact Verstöße | 0.00% | 2.14% | 5 |
| Nichtnachhaltige Waldwirtschaft | 0.00% | 0.12% | 5 | Kernenergie | 0.00% | 1.61% | 15 |
| Nichtnachhaltige Fischerei & Fischzucht | 0.00% | 0.02% | 1 | Herstellung von Kriegstechnik | 0.00% | 1.06% | 20 |
|  Förderung fossiler Energieträger | 0.00% | 15.90% | 79 | Massentierhaltung | 0.00% | 0.69% | 11 |
| Herstellung von Automobilen & Flugzeugen | 0.00% | 2.51% | 10 | Herstellung von Pornografie | 0.00% | 0.57% | 3 |
| Betrieb von fossilen Kraftwerken | 0.00% | 2.34% | 32 | Herstellung von Tabak & Raucherwaren | 0.00% | 0.35% | 6 |
| Kohlereserven | 0.00% | 1.42% | 22 | Herstellung von Waffen & Munition | 0.00% | 0.21% | 5 |
| Fluggesellschaften | 0.00% | 1.41% | 16 | Ausbeuterische Kinderarbeit | 0.00% | 0.08% | 1 |
| Kreuzfahrtgesellschaften | 0.00% | 1.16% | 5 | Herstellung von Alkohol (> 5% Umsatz) | 0.00% | 0.04% | 2 |
| Förderung von Kohle (> 5% Umsatz) | 0.00% | 0.15% | 7 | Gentechnik: Humanmedizin | 0.00% | 0.00% | 0 |
|  Rückgang der Artenvielfalt |  Klimawandel |  Gefährdung von Gesellschaft und Gesundheit | | Kontroverse Waffen | 0.00% | 0.00% | 0 |

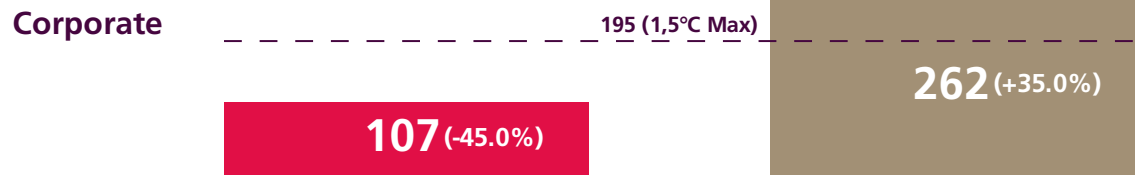
Zwecks Minderung der Nachhaltigkeitsrisiken und mit dem Ziel, nicht in Wertpapiere der oben aufgeführten kontroversen Geschäftsmodellen zu investieren, sind die oben genannten Ausschlusskriterien angewendet worden. Die Tabelle zeigt die Anzahl der Unternehmen, die gegen die Ausschlusskriterien verstossen haben, sowie die jeweilige Portfolio- und Benchmark-Exposition. Liegen bei einem Unternehmen mehrere Verstösse vor, werden diese für jedes Kriterium separat aufgeführt. Daher ist die Summe aller Positionen in diesem Bericht in der Regel höher als das effektive Gewicht, der im Portfolio bzw. in der Benchmark ausgeschlossenen Unternehmen.

Die historischen Vergleiche werden in nachfolgender Tabelle gemacht. Aus Übersichtsründen werden die Ausschlusskriterien aggregiert.

| | Indikator | Datum 2023 | Datum 2024 |
|-----------|----------------------------|------------|------------|
| Portfolio | Ausschlusskriterien Total* | 0% | 0% |
| Benchmark | Ausschlusskriterien Total* | 20.99% | 20.86% |

*alle Ausschlusskriterien kumuliert.

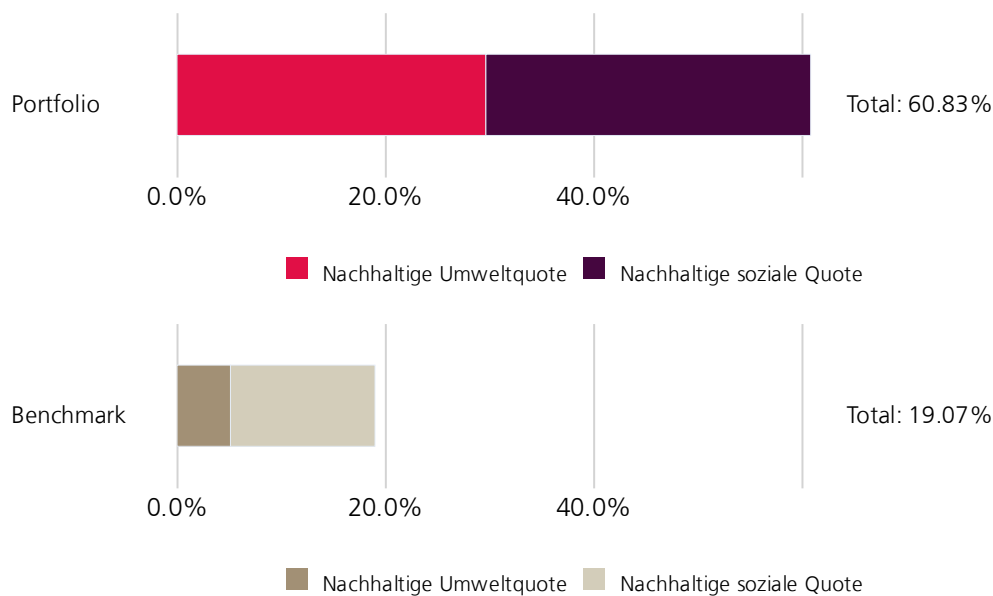
Reduktion der CO₂e-Intensität



Im Einklang mit dem 1.5° Pariser Klimaziel zielte die Investitionstätigkeit des Fonds während der Berichtsperiode darauf ab, die CO₂e-Emissionen des Portfolios, um mindestens 7.5 % pro Jahr zu reduzieren. Der Absenkpfad berechnet sich aus den gewichteten CO₂e-Intensitäten der Benchmark, diskontiert mit 7.5 % pro Jahr zuzüglich des realen Wirtschaftswachstums. Die gestrichelten 1.5° Max-Linie zeigt den Maximalwert an. Die Balken stellen die CO₂e-Intensitäten des Portfolios und der Benchmark dar. CO₂e-Intensitäten unterhalb der 1.5° Max-Linie zeigen an, dass das Portfolio oder die Benchmark das 1.5°-Klimaziel erfüllen. Werte bei "Erreichung Klimaziel" setzen das Portfolio und die Benchmark in Relation zum Klimaziel. Negative Werte bedeuten, dass das Ziel erreicht wurde. Die historischen Vergleiche werden in nachfolgender Tabelle gemacht.

| | Indikator | Datum 2023 | Datum 2024 |
|-----------|--|------------|------------|
| Portfolio | CO ₂ e-Intensität Corporate | 116 | 107 |
| | Reduktion Corporate | -41% | -45% |
| Benchmark | CO ₂ e-Intensität Corporate | 288 | 262 |
| | Reduktion Corporate | 44% | 35% |

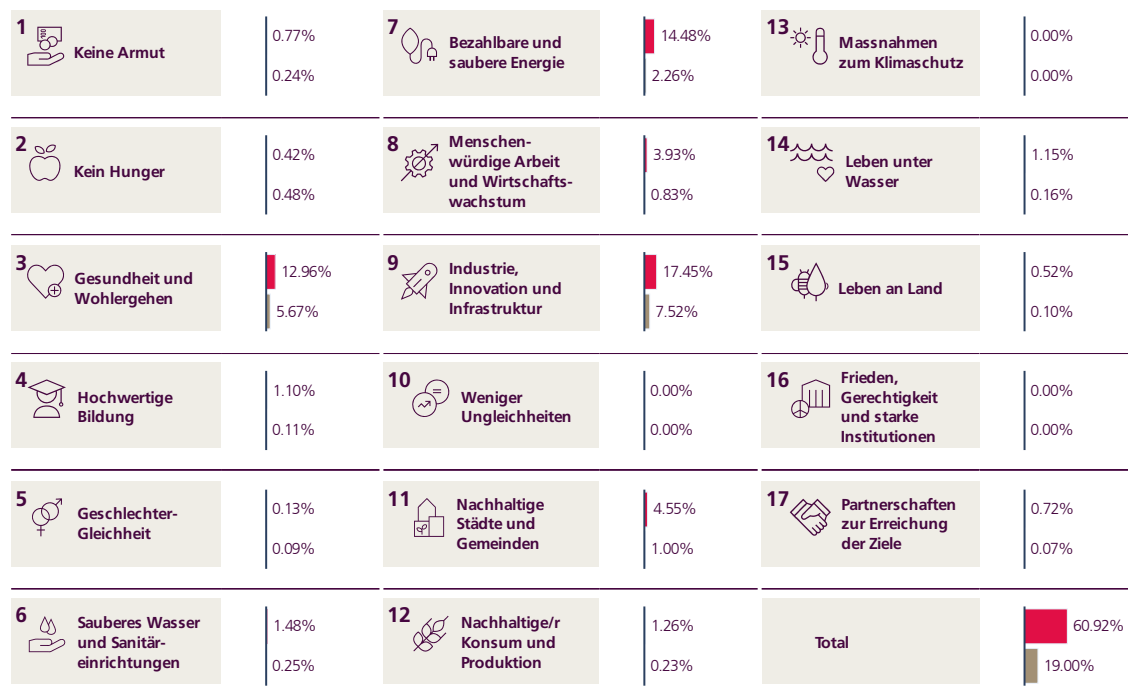
Nachhaltige Investitionen nach Artikel 9(2) SFDR



Das Diagramm zeigt die prozentualen Umsätze der im Portfolio des Fonds enthaltenen Unternehmungen und der der Benchmark, welche nicht EU-Taxonomie konform, jedoch im Einklang mit den sich aus den UN Sustainable Development Goals (SDGs) ergebenden Umwelt- und sozialen Zielen gemäss Art. 2 (17) SFDR investiert worden sind.

Der Fonds hat keine Investitionen in ökologisch nachhaltige Aktivitäten im Sinne der EU Taxonomie-Verordnung angestrebt. Der Investmentmanager des (Teil-)Fonds hat eine Methodologie zur Definition nachhaltiger Investitionen entwickelt, die den Anforderungen des Art. 2 (17) SFDR entspricht. Die Methodologie ist detailliert in den Vorvertraglichen Informationen beschrieben. Die historischen Vergleiche werden in nachfolgender Tabelle gemacht.

| | Indikator | Datum 2023 | Datum 2024 |
|-----------|---|------------|------------|
| Portfolio | Anteil nachhaltige Investitionen mit Umweltziel | 20.1% | 29.62% |
| | Anteil sozial nachhaltige Investitionen | 24.22% | 31.21% |
| | Total nachhaltige Quote | 44.33% | 60.83% |
| Benchmark | Anteil nachhaltige Investitionen mit Umweltziel | 3.85% | 5.05% |
| | Anteil sozial nachhaltige Investitionen | 13.09% | 14.02% |
| | Total nachhaltige Quote | 16.94% | 19.07% |



■ Portfolio ■ Benchmark

Aufgrund der unterschiedlichen Behandlung von Green, Social und Sustainable Bonds kann das SDG-Exposure von den prozentualen Umsätzen der im Portfolio des Fonds enthaltenen Unternehmungen und den der Benchmark, welche im Einklang mit den sich aus den SDGs ergebenden Umweltzielen gemäss Art. 2 (17) SFDR investiert worden sind, abweichen.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

● **Inwiefern wurden nachhaltige Investitionsziele durch die nachhaltigen Investitionen nicht erheblich beeinträchtigt?**

Emittenten mit einem negativen Nettobeitrag zu den SDGs wurden in der Berichtsperiode aus dem Anlageuniversum des Finanzproduktes entfernt. Darüber hinaus berücksichtigte der Teilfonds nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (engl: Principal Adverse Impacts - PAI). Zu diesem Zweck wurden die obligatorischen Indikatoren Anhang 1 der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1288 zur Ergänzung der Verordnung (EU) 2019/2088 zugrunde gelegt. Unternehmen, die der Vermögensverwalter gemäss PAI als besonders schädlich einstufte, wurden entsprechend nicht zu den nachhaltigen Anlagen gezählt. Emittenten, welche die PAIs 7 (Biodiversität), 10 (Global Compact der Vereinten Nationen (UNGC)/OECD Leitsätze für multinationale Unternehmen) oder 14 (Engagement in umstrittenen Waffen) verletzen, haben einen PAI-Score von null erhalten. Aus den restlichen PAI-Indikatoren wurde ein PAI-Score berechnet. Instrumente von Emittenten mit einem Score < 10 wurden nicht den nachhaltigen Investitionen angerechnet.

● **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Die nachteiligen Auswirkungen (PAI) sind systematisch im Anlageprozess berücksichtigt worden.

● **Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:**

Bei der Anlageanalyse für nachhaltige Investitionen wurden in der Berichtsperiode die folgenden Normverletzungen berücksichtigt: Global Compact der Vereinten Nationen (UNGC), die UNLeitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte (UNGP) und das Übereinkommen der Internationalen Arbeitsorganisation (ILO). Jeder schwerwiegende Verstoß gegen diese Normen führte zum Ausschluss des Emittenten aus dem investierbaren Universum des Finanzproduktes.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

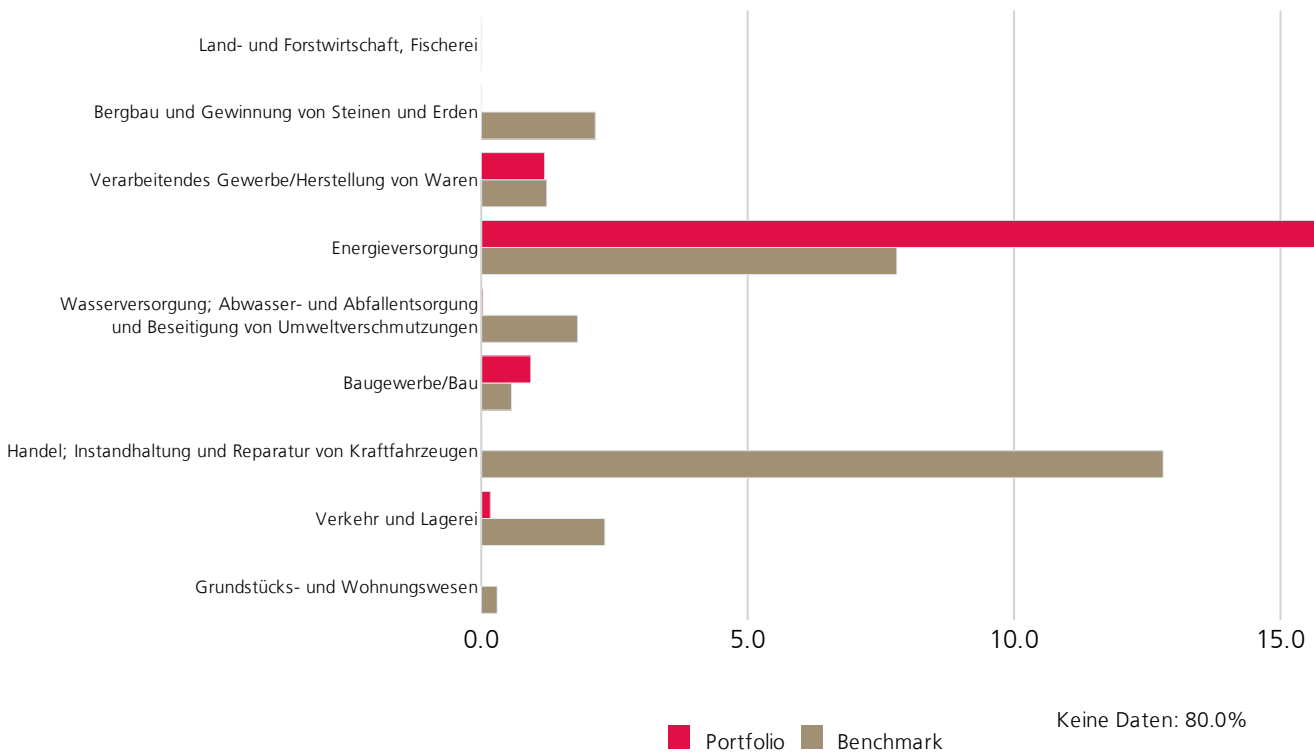
Nachteilige Nachhaltigkeitsauswirkungen (PAI) – Corporate Anlagen

Primäre Indikatoren - Energie und Emissionen

| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Benchmark Aktuell | Benchmark Vorjahr | Erklärung |
|--|--|-------------------|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|-----------|
| 1. THG-Emissionen | 1a. GHG Emissions - Scope 1 per Mio EUR Enterprise Value | 4066.6 | 78.42% | 3792.6 | 6359.91 | 8150.59 | |
| | 1b. GHG Emissions - Scope 2 per Mio EUR Enterprise Value | 1123.25 | 78.42% | 1076.13 | 912.27 | 1193.37 | |
| | 1c. GHG Emissions - Scope 3 per Mio EUR Enterprise Value | 31019.7 | 78.42% | 57410.4 | 35749.8 | 46246.7 | |
| 2. CO ₂ -Fussabdruck | 2. GHG Emissions - Scope 1+2+3 per Mio EUR Enterprise Value | 610.33 | 78.42% | 726.02 | 734.82 | 694.42 | |
| 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird | 3. GHG Emissions - Emissions Intensity - Total Emissions (EUR) | 266.64 | 80.62% | 208.01 | 476.74 | 529.88 | |
| 4. Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind | 4. Fossil Fuel - Involvement (PAI) | 3.27% | 78.29% | 3.02% | 11.48% | 11.11% | |

| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Benchmark Aktuell | Benchmark Vorjahr | Erklärung |
|--|--|-------------------|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|---|
| 5. Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen | 5a. CR Raw - Energy use - Coal/nuclear/undear energy sources | 76.14% | 34.4% | 78.26% | 81.26% | 82.69% | |
| | 5b. Non-renewable energy consumption | 65.97% | 24.99% | 89.32% | 69.29% | 91.62% | Der Verbrauch nicht-erneuerbarer Energie umfasst den Verbrauch von Energie, die aus nicht-erneuerbaren Quellen erzeugt wird, sowie den Verbrauch von Energie aus Biomasse. Alle Zahlen zum Energieverbrauch, bei denen die Energiequelle unklar ist, sind ebenfalls in diesem Faktor enthalten. |
| | 5c. Non-renewable energy production | 0.87% | 73.76% | 0.64% | 4.11% | 4.54% | |
| 6. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren | 6. Energy consumption intensity (GWh/mEUR) | 2.24 | 22.43% | 5.01 | 1.5 | 1.65 | |

Intensität des Energieverbrauchs pro High Impact Sector (pro Mio. EUR)



| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Benchmark Aktuell | Benchmark Vorjahr | Erklärung |
|---|--|-------------------|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|-----------|
| 7. Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken | 7. Companies negatively affecting biodiversity-sensitive areas | 0% | 78.29% | 0% | 0.05% | 0.09% | |
| 8. Emissionen in Wasser | 8. CR Raw - COD emissions | 16.89 | 0.56% | 0 | 15.54 | 11.78 | |
| 9. Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle | 9. CR Raw - Hazardous waste | 0.08 | 3.38% | 0 | 0.11 | 0 | |

| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Benchmark Aktuell | Benchmark Vorjahr | Erklärung |
|--|--|-------------------|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|-----------|
| 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | 10. UNGC / OECD Guidelines Violation | 0% | 78.29% | 0% | 2.14% | 0.28% | |
| 11. Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen | 11. Lack of processes monitoring UNGC and OECD Guidelines compliance | 20.49% | 59.06% | 17.02% | 19.08% | 17.56% | |
| 12. Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle | 12. Unadjusted gender pay gap | 0.77% | 7.85% | 0.69% | 0.31% | 0.27% | |
| 13. Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen | 13. Ratio of female to male board members | 53.83% | 50.09% | 52.09% | 46.28% | 43.99% | |
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) | 14. Controversial weapons involvement (APM, CM, Bio, Chem) | 0% | 78.29% | 0% | 0% | 0% | |

Nachteilige Nachhaltigkeitsauswirkungen (PAI) – Staatliche und Supranationale Vermögenswerte

Primäre Indikatoren

| Umwelt | | | | | | | |
|--------------------|-------------------|-------------------|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|-----------|
| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Benchmark Aktuell | Benchmark Vorjahr | Erklärung |
| 15. GHG Intensität | 15. GHG Intensity | 76.41 | 1.3% | 102.09 | 884.18 | 1103.15 | |

| Sozial | | | | | | | |
|--|---|-------------------|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|-----------|
| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Benchmark Aktuell | Benchmark Vorjahr | Erklärung |
| 16. Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen | 16a. Countries subject to social violations (#) | 0 | 0% | 0 | 0 | 0 | |
| | 16b. Countries subject to social violations (%) | 0% | 0% | 0% | 0% | 0% | |

| Indikator | Metrik |
|-----------|---|
| 1a | Scope-1-Treibhausgas-Emissionen |
| 1b | Scope-2-Treibhausgas-Emissionen |
| 1c | Scope-3-Treibhausgas-Emissionen |
| 2. | CO2-Fussabdruck pro Mio EUR |
| 3. | THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird |
| 4. | Anteil der Investitionen in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind |
| 5a | Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung der Unternehmen, in die investiert wird, aus nicht erneuerbaren Energiequellen im Vergleich zu erneuerbaren Energiequellen, ausgedrückt in Prozent der gesamten Energiequellen |
| 5b | Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung der Unternehmen, in die investiert wird, aus nicht erneuerbaren Energiequellen im Vergleich zu erneuerbaren Energiequellen, ausgedrückt in Prozent der gesamten Energiequellen |
| 5c | Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung der Unternehmen, in die investiert wird, aus nicht erneuerbaren Energiequellen im Vergleich zu erneuerbaren Energiequellen, ausgedrückt in Prozent der gesamten Energiequellen |
| 6. | Energieverbrauch in GWh pro einer Million EUR Umsatz der Unternehmen, in die investiert wird, aufgeschlüsselt nach klimaintensiven Sektoren |
| 7. | Anteil der Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird, mit Standorten/Betrieben in oder in der Nähe von Gebieten mit schutzbedürftiger Biodiversität, sofern sich die Tätigkeiten dieser Unternehmen nachteilig auf diese Gebiete auswirken |
| 8. | Tonnen Emissionen in Wasser, die von den Unternehmen, in die investiert wird, pro investierter Million EUR verursacht werden, ausgedrückt als gewichteter Durchschnitt |
| 9. | Tonnen gefährlicher und radioaktiver Abfälle, die von den Unternehmen, in die investiert wird, pro investierter Million EUR erzeugt werden, ausgedrückt als gewichteter Durchschnitt |
| 10. | Anteil der Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird, die an Verstößen gegen die UNGC-Grundsätze oder gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen beteiligt waren |
| 11. | Anteil der Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird, die keine Richtlinien zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen oder keine Verfahren zur Bearbeitung von Beschwerden wegen Verstößen gegen die UNGC-Grundsätze und OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen eingerichtet haben |
| 12. | Durchschnittliches unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle bei den Unternehmen, in die investiert wird |
| 13. | Durchschnittliches Verhältnis von Frauen zu Männern in den Leitungs- und Kontrollorganen der Unternehmen, in die investiert wird, ausgedrückt als Prozentsatz aller Mitglieder der Leitungs- und Kontrollorgane |
| 14. | Anteil der Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird, die an der Herstellung oder am Verkauf von umstrittenen Waffen beteiligt sind |
| 15. | THG-Emissionsintensität der Länder, in die investiert wird |
| 16a | Anzahl der Länder, in die investiert wird, die nach Maßgabe internationaler Verträge und Übereinkommen, der Grundsätze der Vereinten Nationen oder, falls anwendbar, nationaler Rechtsvorschriften gegen soziale Bestimmungen verstoßen (absolute Zahl und relative Zahl, geteilt durch alle Länder, in die investiert wird) |
| 16b | Anzahl der Länder, in die investiert wird, die nach Maßgabe internationaler Verträge und Übereinkommen, der Grundsätze der Vereinten Nationen oder, falls anwendbar, nationaler Rechtsvorschriften gegen soziale Bestimmungen verstoßen (absolute Zahl und relative Zahl, geteilt durch alle Länder, in die investiert wird) |

Das Dokument wurde von Swisscanto mit geschäftsüblicher Sorgfalt erstellt und kann Informationen aus sorgfältig ausgewählten Drittquellen enthalten. Anleger sollten beachten, dass die zuvor für 2023 berechneten und veröffentlichten Daten für dieses in 2024 veröffentlichte Dokument neu berechnet wurden. Dementsprechend kann es zu Abweichungen bei diesen in den Jahren 2023 und 2024 veröffentlichten historischen Daten kommen.



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 01.02.2023 - 31.01.2024

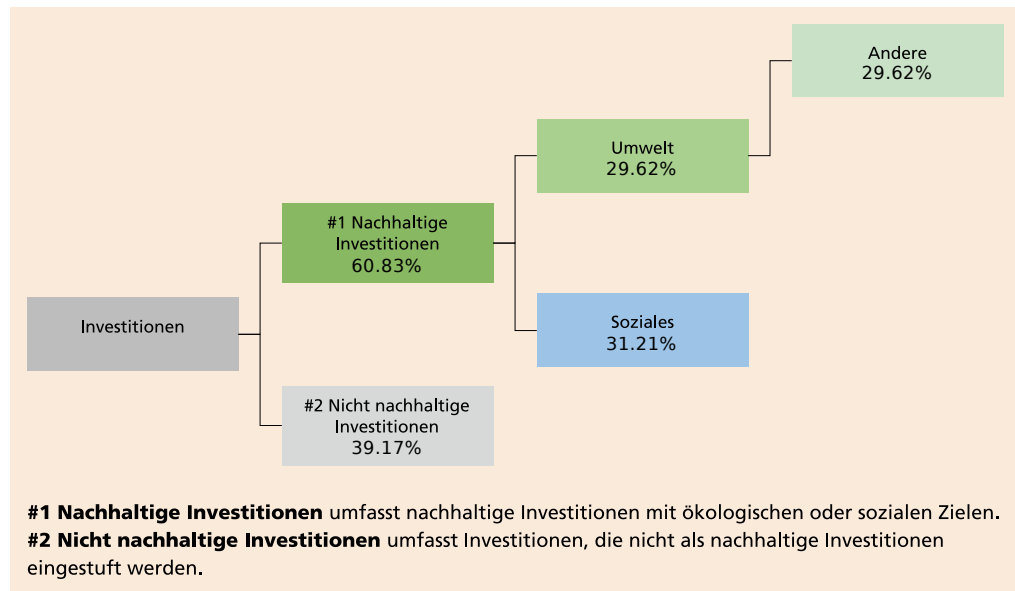
| Grösste Investitionen | Sektor | In % der Vermögenswerte | Land |
|---|---|-------------------------|----------------|
| USD Cash | | 1.51% | |
| Ford Motor Co 3.25% 12-FEB-2032 | Manufacturing | 1.00% | USA |
| HT Troplast GmbH 9.375% 15-JUL-2028 REGS | Manufacturing | 0.86% | |
| Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 3.75% 09-MAY-2027 | Financial and Insurance Activities | 0.81% | Curacao |
| Telefonica Europe BV 2.88% PERP REGS | Financial and Insurance Activities | 0.75% | Netherlands |
| Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 8.375% PERP REGS | Financial and Insurance Activities | 0.69% | Spain |
| Darling Ingredients Inc 6% 15-JUN-2030 144A | Manufacturing | 0.68% | USA |
| Iliad Holding SASU 6.5% 15-OCT-2026 144A | Information and Communication | 0.66% | France |
| Vodafone Group PLC 6.25% 03-OCT-2078 REGS | Information and Communication | 0.66% | United Kingdom |
| Novelis Sheet Ingot GmbH 3.375% 15-APR-2029 REGS | Manufacturing | 0.65% | Germany |
| EDP - Energias de Portugal SA 5.943% 23-APR-2083 REGS | Electricity, Gas, Steam and Air Conditioning Supply | 0.63% | Portugal |
| Cemex SAB de CV 9.125% PERP REGS | Manufacturing | 0.59% | Mexico |
| Hilton Domestic Operating Co Inc 4.875% 15-JAN-2030 | Professional, Scientific and Technical Activities | 0.59% | USA |
| Frontier Communications Holdings LLC 8.75% 15-MAY-2030 144A | Financial and Insurance Activities | 0.58% | USA |
| ACI Worldwide Inc 5.75% 15-AUG-2026 144A | Information and Communication | 0.57% | USA |



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

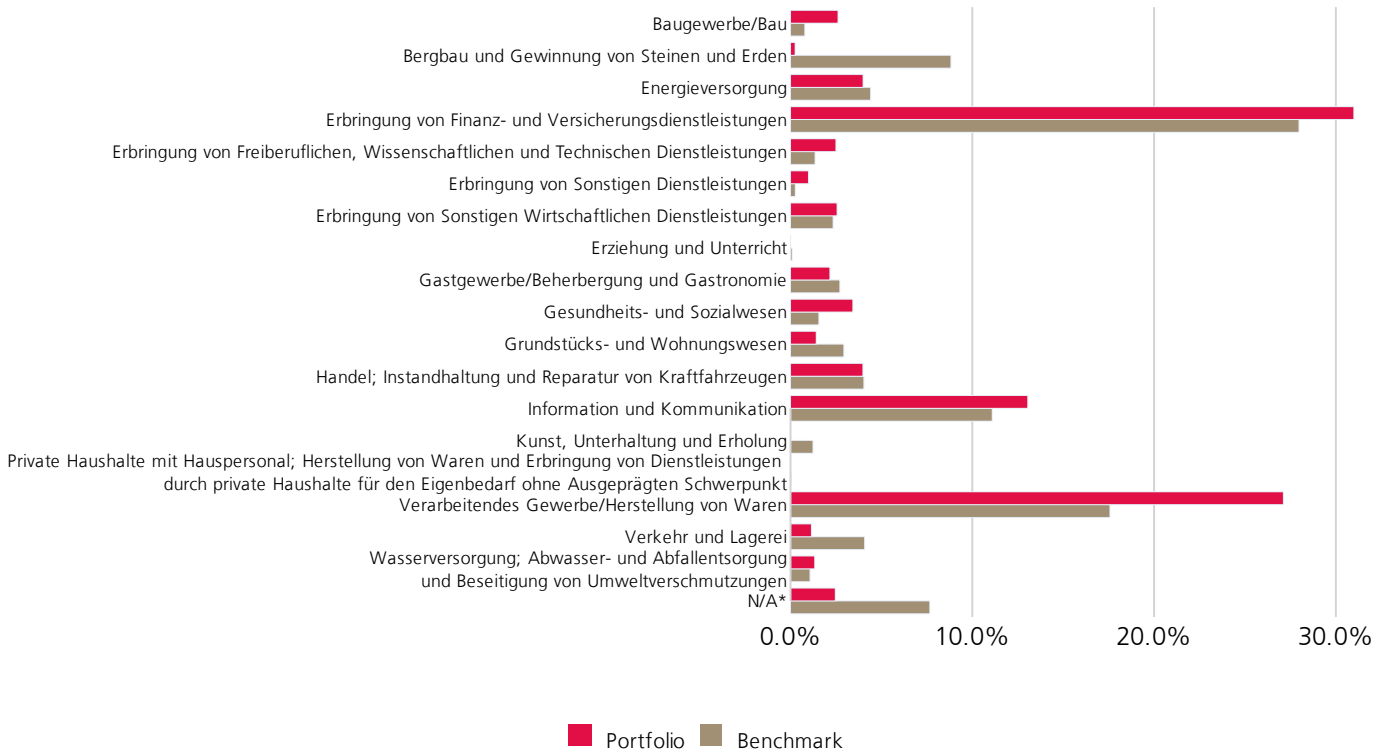
Der Anteil an nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen nach Artikel 9(2) und Angaben zur Vermögensallokation werden in untenstehender Frage beantwortet.

Wie sah die Vermögensallokation aus?



In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Wegen mangelnder Datenverfügbarkeit können Subsektoren nicht angezeigt werden.



*Diese Klassifizierung umfasst alle Bestände, für die keine NACE-Klassifizierung gefunden oder geschätzt werden kann; Liquidität ist darin enthalten.

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Wirtschaftstätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

Investitionsausgaben (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, z.B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft

- **Betriebsausgaben (Opex)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln



Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?

Obwohl keine Investitionen getätigt wurden, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind, wird in untenstehender Grafik die Alignment der nachhaltigen Investitionen mit der EU-Taxonomie offengelegt.

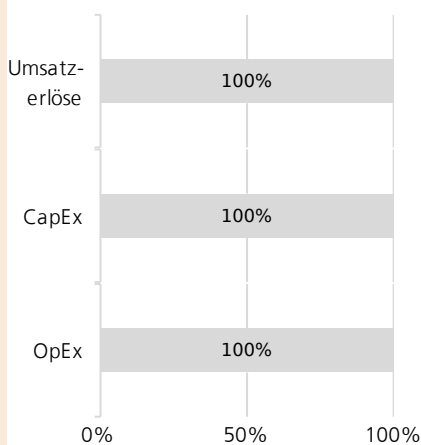
Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert¹?

Ja
 In fossiles Gas
 In Kernenergie
 Nein

¹Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels ("Klimaschutz") beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

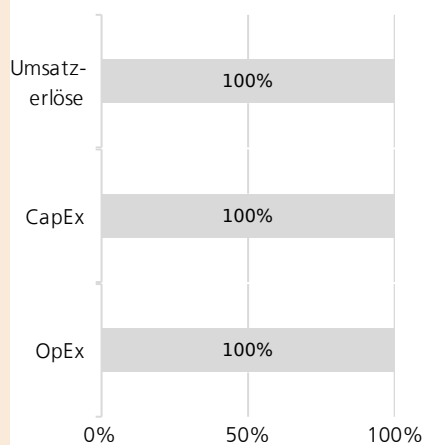
Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in grüner Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzproduktes einschliesslich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.

1. Taxonomiekonformität der Investitionen einschliesslich Staatsanleihen*



Taxonomiekonform: Fossiles Gas
 Taxonomiekonform: Kernenergie
 Taxonomiekonform: (ohne fossiles Gas und Kernenergie)
 Nicht taxonomiekonform

2. Taxonomiekonformität der Investitionen ohne Staatsanleihen*



Taxonomiekonform: Fossiles Gas
 Taxonomiekonform: Kernenergie
 Taxonomiekonform: (ohne fossiles Gas und Kernenergie)
 Nicht taxonomiekonform

Diese Grafik gibt **98.7%** der Gesamtinvestitionen wieder.

*Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff "Staatsanleihen" alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Angaben zu Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten werden in der Tabelle zusammengefasst. Wenn keine Angaben verfügbar sind, wird die Tabelle ebenfalls keine Angaben enthalten.

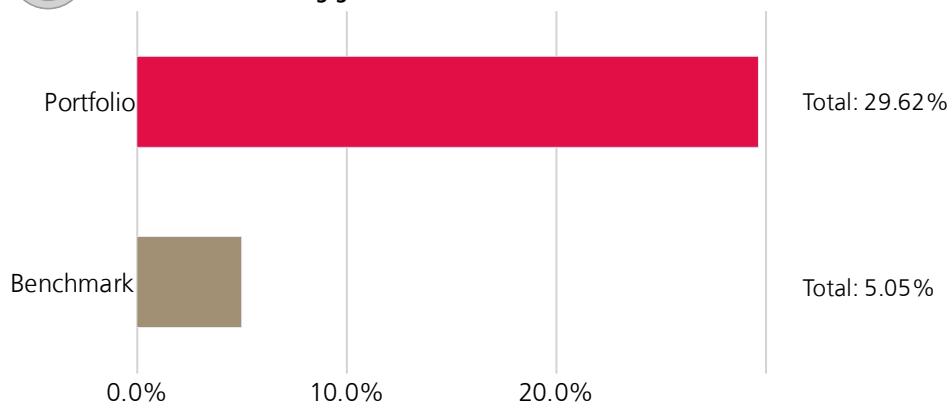
| Issuer Name | Nace Sektor | Total Eligible Activity Revenue | Total Aligned Revenue | Total Likely Aligned Revenue | Total Potentially Aligned Revenue | Portfolio Gewicht (Consol.) |
|--|---|---------------------------------|-----------------------|------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------|
| Elia Group SA/NV | Construction | 99.98% | 24.95% | 15.00% | 0.00% | 0.71% |
| Orsted | Electricity, Gas, Steam and Air Conditioning Supply | 56.27% | 18.25% | 31.86% | 0.00% | 0.35% |
| EDP-Energias de Portugal SA | Electricity, Gas, Steam and Air Conditioning Supply | 77.52% | 12.25% | 0.00% | 32.43% | 0.88% |
| Webuild SpA | Construction | 20.18% | 10.40% | 0.00% | 0.00% | 0.40% |
| Webuild S.p.A. | Construction | 20.18% | 10.40% | 0.00% | 0.00% | 0.19% |
| Castellum Helsinki Finance Holding Abp | Financial and Insurance Activities | 100.00% | 8.14% | 15.00% | 7.50% | 0.19% |
| Castellum AB | Real Estate Activities | 100.00% | 8.14% | 15.00% | 7.50% | 0.06% |
| Gatwick Airport Finance Plc | Financial and Insurance Activities | 33.15% | 5.00% | 4.53% | 0.00% | 0.37% |
| Forvia SE | Manufacturing | 20.57% | 0.93% | 3.93% | 11.79% | 0.53% |
| Atos SE | Information and Communication | 76.13% | 0.63% | 15.00% | 0.00% | 0.10% |

Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?


Da im vorangegangenen Berichtsjahr keine Daten verfügbar waren, erübrigt sich ein Vorjahresvergleich.

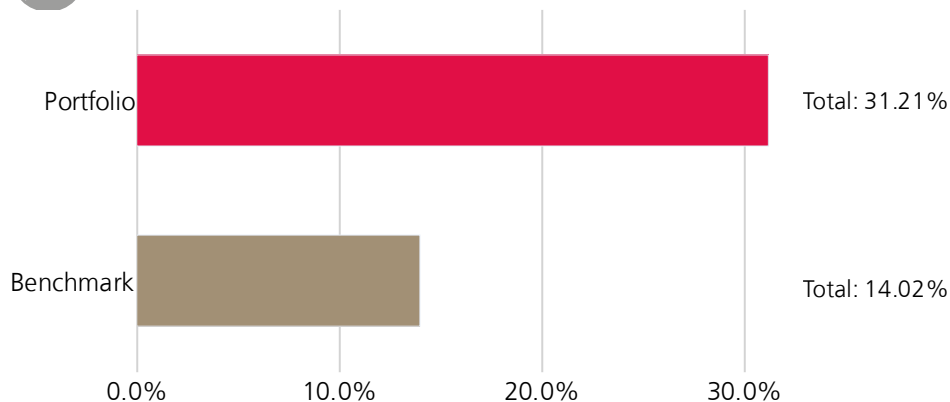
 sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der EU-Taxonomie **nicht berücksichtigen**.

 **Wie hoch war der Anteil der nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden?**




Das Diagramm zeigt die prozentualen Umsätze der im Portfolio des Fonds enthaltenen Unternehmungen und der der Benchmark, welche nicht EU-Taxonomie konform, jedoch im Einklang mit den sich aus den SDGs ergebenden Umweltzielen gemäss Art. 2 (17) SFDR investiert worden sind. Darüber hinaus strebte der Portfolio Manager mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen mit einer Quote von 96.07% an, indem das Portfolio auf eine Reduktion der CO₂e-Emissionen im Sinn von Artikel 9(3) SFDR ausgerichtet wurde.

 **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**



Das Diagramm zeigt die prozentualen Umsätze der im Portfolio des Fonds enthaltenen Unternehmungen und der der Benchmark, welche nicht EU-Taxonomie konform, jedoch im Einklang mit den sich aus den SDGs ergebenden sozialen Zielen gemäss Art. 2 (17) SFDR investiert worden sind.

 **Welche Investitionen fallen unter „nicht nachhaltige Investitionen“, welcher Anlagezweck wird mit ihnen verfolgt und gibt es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

Diese Vermögenswerte haben die in der spezifischen Anlagepolitik vorgesehenen Anlagen umfasst, einschliesslich Derivate zu Absicherungszwecken und flüssige Mittel. Die Anlagen, ausgenommen Derivate und flüssige Mittel, haben die Grundsätze des ökologischen oder sozialen Mindestschutzes umgesetzt.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung des nachhaltigen Investitionsziel ergriffen?

Im Berichtszeitraum förderte der Vermögensverwalter durch Investment Stewardship und Kapitalallokation nachhaltige Geschäftspraktiken und die Einhaltung anerkannter internationaler Prinzipien und ESG-Best-Practice-Standards. Dementsprechend stand er im Dialog mit den Managementteams der investierten Unternehmen. Darüber hinaus hat er sich im Rahmen der United Nations Collaboration Platform for Responsible Investment (UN PRI) und bei Investoreninitiativen engagiert. Das Abstimmungsverhalten basierte auf den schweizerischen und internationalen Corporate-Governance-Regeln sowie auf den Prinzipien des UN Global Compact und den 17 Zielen für nachhaltige Entwicklung (UN SDGs). Weitere Informationen finden Sie unter: Swisssanto | Proxy Voting Dashboard ([issgovernance.com](https://www.swisssanto.com/int/de/nachhaltigkeit/investment-stewardship.html)) <https://www.swisssanto.com/int/de/nachhaltigkeit/investment-stewardship.html>

Swisssanto | Proxy Voting Dashboard ([issgovernance.com](https://www.swisssanto.com/int/de/nachhaltigkeit/investment-stewardship.html))

<https://www.swisssanto.com/int/de/nachhaltigkeit/investment-stewardship.html>



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Nachhaltigkeitsreferenzwert abgeschnitten?

Es wurde kein Index als Referenzwert zur Erreichung der nachhaltigen Investitionsziele bestimmt.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das nachhaltige Ziel des Finanzprodukts erreicht wird.

Wie unterschied sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?

Nicht anwendbar.

Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf das nachhaltige Investitionsziel bestimmt wird?

Nicht anwendbar.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?

Nicht anwendbar.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?

Nicht anwendbar.

Das Dokument wurde von Swisssanto mit geschäftsüblicher Sorgfalt erstellt und kann Informationen aus sorgfältig ausgewählten Drittquellen enthalten. Anleger sollten beachten, dass die zuvor für 2023 berechneten und veröffentlichten Daten für dieses in 2024 veröffentlichte Dokument neu berechnet wurden. Dementsprechend kann es zu Abweichungen bei diesen in den Jahren 2023 und 2024 veröffentlichten historischen Daten kommen.



Regelmässige Information zum 31.01.2024

Regelmässige Informationen zu den in Artikel 8, Absätze 1, 2, 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts:

Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible AUD

Unternehmenskennung (LEI-Code):

549300G7JSDUD5I1ZE39

Benchmark

Bloomberg Barclays Australian Aggregate 300MN Bond Index in AUD

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. In dieser Verordnung ist kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten festgelegt. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

| Ja | | Nein | |
|--------------------------|---|-------------------------------------|---|
| <input type="checkbox"/> | Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: _ % | <input checked="" type="checkbox"/> | Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 17.57% an nachhaltigen Investitionen |
| <input type="checkbox"/> | in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind | <input type="checkbox"/> | mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind |
| <input type="checkbox"/> | in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind | <input checked="" type="checkbox"/> | mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind |
| <input type="checkbox"/> | Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: _ % | <input checked="" type="checkbox"/> | mit einem sozialen Ziel |
| <input type="checkbox"/> | | <input type="checkbox"/> | Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt . |



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die von dem Teilfonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale wurden durch folgende Aktivitäten erreicht:

1. Ausschlusskriterien
2. ESG-Integration
3. Reduktion der CO2e-Intensität
4. Nachhaltige Investitionen





Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Aus Übersichtsgründen werden die Angaben zur Performance (siehe Details am Ende des Reports) der Nachhaltigkeitsindikatoren direkt mit dem historischen Vergleich in der nächsten Frage beantwortet.

...und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Ausschlusskriterien

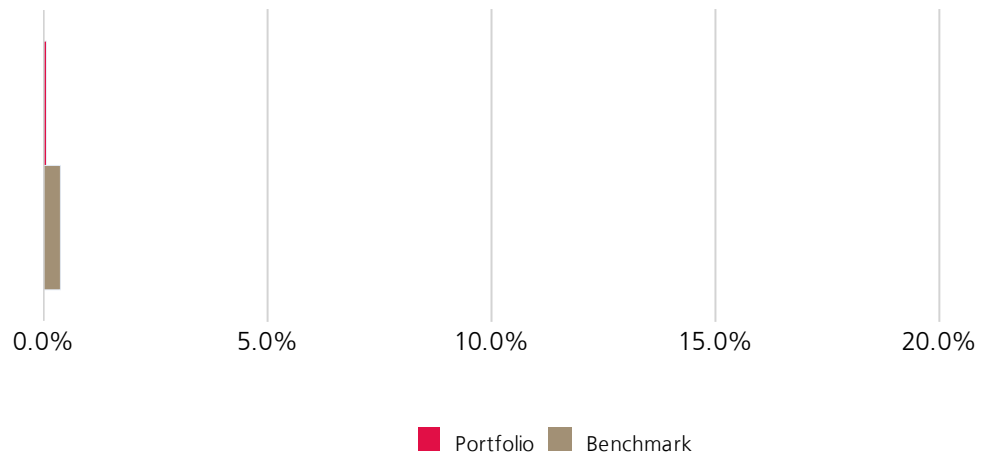
| Responsible | | | | | | | |
|--|-------------------|--|------------------------------|---|-------------------|-------------------|------------------------------|
| Kriterien | Gewicht Portfolio | Gewicht Benchmark | Anzahl Unternehmen Benchmark | Kriterien | Gewicht Portfolio | Gewicht Benchmark | Anzahl Unternehmen Benchmark |
|  Förderung von Kohle (> 5% Umsatz) | 0.00% | 0.00% | 0 |  UN Global Compact Verstöße | 0.00% | 0.02% | 1 |
| Kohlereserven (ex. Metalproduktion) | 0.00% | 0.00% | 0 | Ausbeuterische Kinderarbeit | 0.00% | 0.00% | 0 |
|  Klimawandel | |  Gefährdung von Gesellschaft und Gesundheit | | Herstellung von Kriegstechnik (> 5% Umsatz) | 0.00% | 0.00% | 0 |
| | | | | Herstellung von Pornografie | 0.00% | 0.00% | 0 |
| | | | | Herstellung von Waffen & Munition | 0.00% | 0.00% | 0 |
| | | | | Kontroverse Waffen | 0.00% | 0.00% | 0 |

Zwecks Minderung der Nachhaltigkeitsrisiken und mit dem Ziel, nicht in Wertpapiere der oben aufgeführten kontroversen Geschäftsmodellen zu investieren, sind die oben genannten Ausschlusskriterien angewendet worden. Die Tabelle zeigt die Anzahl der Unternehmen, die gegen die Ausschlusskriterien verstossen haben, sowie die jeweilige Portfolio- und Benchmark-Exposition. Liegen bei einem Unternehmen mehrere Verstöße vor, werden diese für jedes Kriterium separat aufgeführt. Daher ist die Summe aller Positionen in diesem Bericht in der Regel höher als die effektive Allokation zu den oben abgebildeten Kriterien. Die historischen Vergleiche werden in nachfolgender Tabelle gemacht. Aus Übersichtsgründen werden die Ausschlusskriterien aggregiert.

| | Indikator | Datum 2023 | Datum 2024 |
|-----------|----------------------------|------------|------------|
| Portfolio | Ausschlusskriterien Total* | 0% | 0% |
| Benchmark | Ausschlusskriterien Total* | 0.03% | 0.02% |

*alle Ausschlusskriterien kumuliert.

ESG-Integration

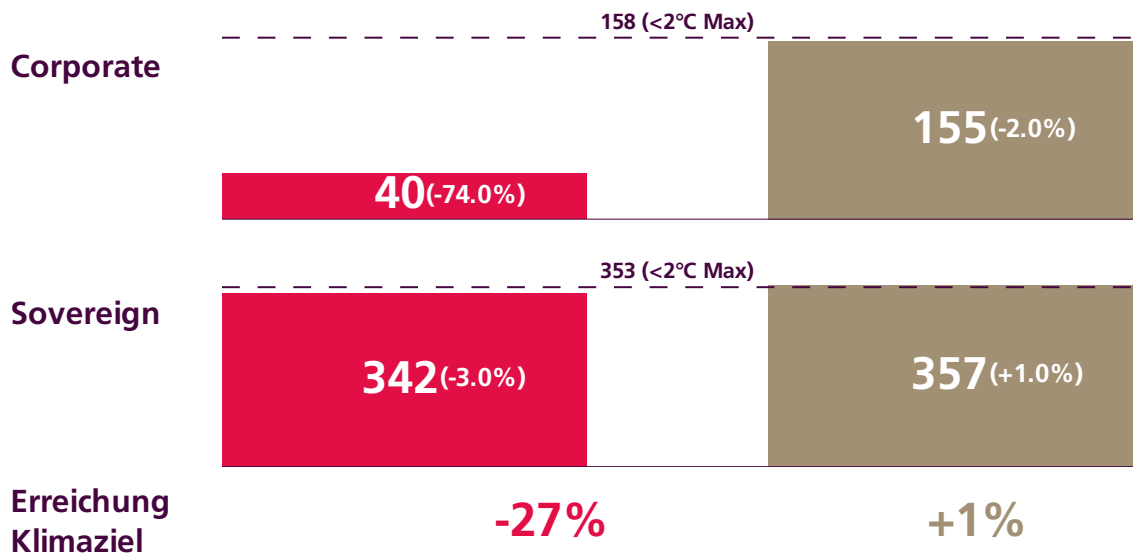


Das Portfolio strebte in der Berichtsperiode im Vergleich zur Benchmark eine geringere Exposition zu ESG-Laggards an. ESG-Laggards sind Unternehmungen mit der schwächsten Umwelt-, Sozial und Governance- Performance des relevanten Anlageuniversums.

Die historischen Vergleiche werden in nachfolgender Tabelle gemacht.

| | Indikator | Datum 2023 | Datum 2024 |
|-----------|----------------------------|------------|------------|
| Portfolio | Exposition zu ESG Laggards | 2.33% | 0.06% |
| Benchmark | Exposition zu ESG Laggards | 0.33% | 0.37% |

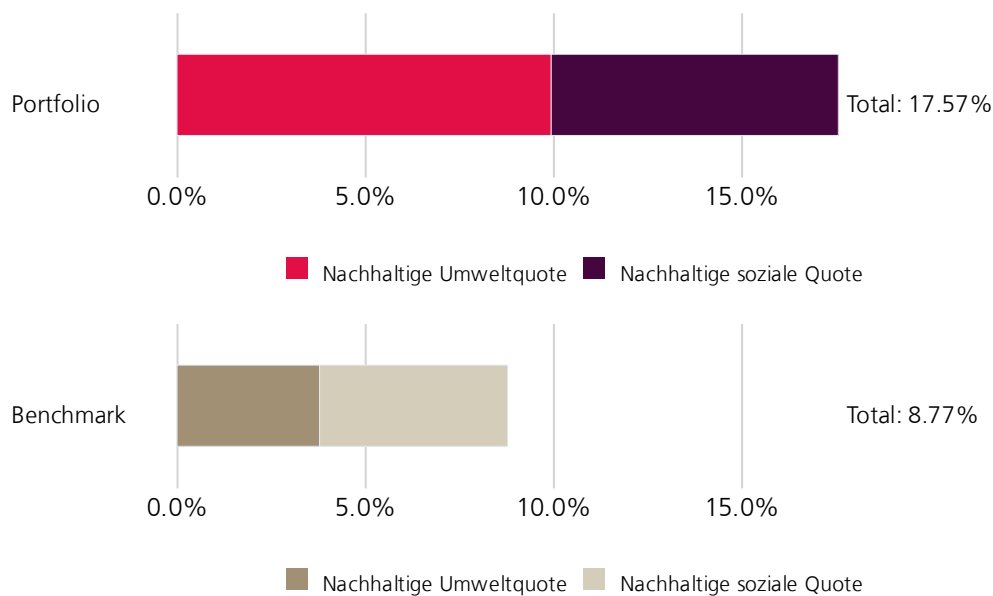
Reduktion der CO₂e-Intensität



Im Einklang mit dem < 2° Pariser Klimaziel ("<2°C Max") zielte die Investitionstätigkeit des Fonds während der Berichtsperiode darauf ab, die CO₂e-Emissionen des Portfolios, um mindestens 4 % pro Jahr zu reduzieren. Der Absenkpfad berechnet sich aus den gewichteten CO₂e-Intensitäten der Benchmark, diskontiert mit 4 % pro Jahr zuzüglich des realen Wirtschaftswachstums. Die gestrichelten 2° Max-Linie zeigt den Maximalwert an. Die Balken stellen die CO₂e-Intensitäten des Portfolios und der Benchmark dar. CO₂e-Intensitäten unterhalb der 2° Max-Linie zeigen an, dass das Portfolio oder die Benchmark das <2°-Klimaziel erfüllen. Werte bei "Erreichung Klimaziel" setzen das Portfolio und die Benchmark in Relation zum Klimaziel. Negative Werte bedeuten, dass das Ziel erreicht wurde. Die historischen Vergleiche werden in nachfolgender Tabelle gemacht.

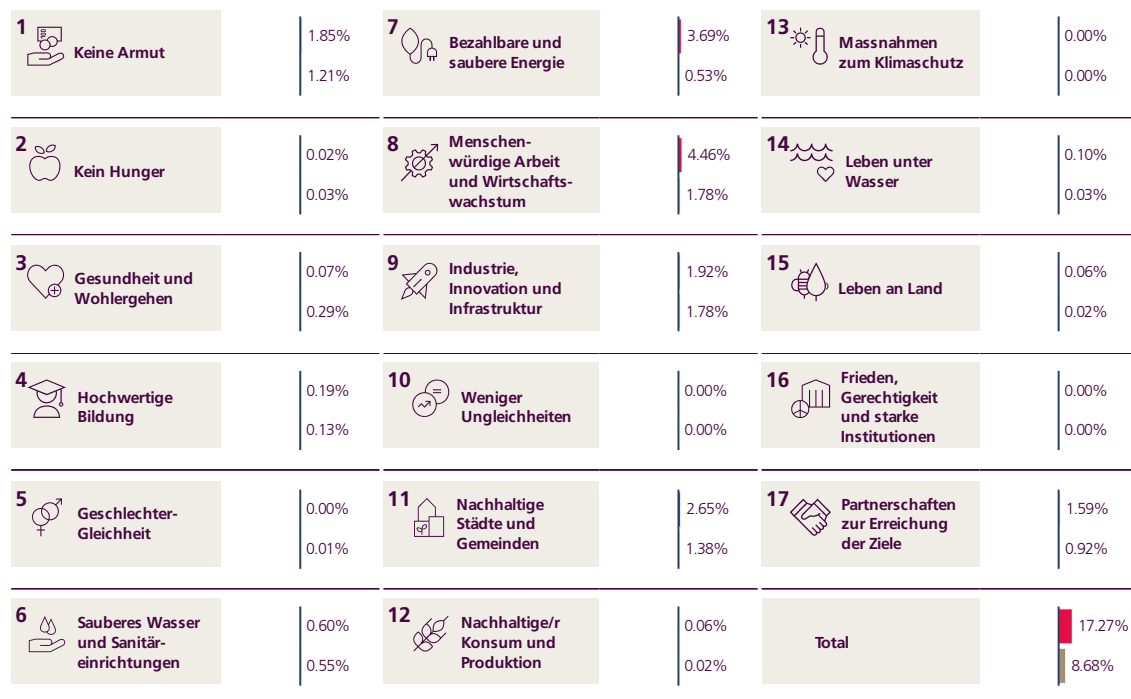
| | Indikator | Datum 2023 | Datum 2024 |
|-----------|--|------------|------------|
| Portfolio | CO ₂ e-Intensität Corporate | 51 | 40 |
| | CO ₂ e-Intensität Sovereign | 356 | 342 |
| | Erreichung Klimaziel | -40% | -27% |
| | Reduktion Corporate | -70% | -74% |
| | Reduktion Sovereign | -7% | -3% |
| Benchmark | CO ₂ e-Intensität Corporate | 203 | 155 |
| | CO ₂ e-Intensität Sovereign | 408 | 357 |
| | Erreichung Klimaziel | 7% | 1% |
| | Reduktion Corporate | 18% | -2% |
| | Reduktion Sovereign | 6% | 1% |

Nachhaltige Investitionen



Das Diagramm zeigt die prozentualen Umsätze der im Portfolio des Fonds enthaltenen Unternehmungen und der der Benchmark, welche nicht EU-Taxonomie konform, jedoch im Einklang mit den sich aus den UN Sustainable Development Goals (SDGs) ergebenden Umwelt- und sozialen Zielen gemäss Art. 2 (17) SFDR investiert worden sind. Der Fonds hat keine Investitionen in ökologisch nachhaltige Aktivitäten im Sinne der EU Taxonomie-Verordnung angestrebt. Der Investmentmanager des (Teil-)Fonds hat eine Methodologie zur Definition nachhaltiger Investitionen entwickelt, die den Anforderungen des Art. 2 (17) SFDR entspricht. Die Methodologie ist detailliert in den Vorvertraglichen Informationen beschrieben. Die Aufteilung der nachhaltigen Investitionen in UN SDGs werden in folgender Grafik gemacht. Die historischen Vergleiche werden in nachfolgender Tabelle gemacht.

| | Indikator | Datum 2023 | Datum 2024 |
|-----------|---|------------|------------|
| Portfolio | Anteil nachhaltige Investitionen mit Umweltziel | 7.9% | 9.96% |
| | Anteil sozial nachhaltige Investitionen | 8.53% | 7.62% |
| | Total nachhaltige Quote | 16.43% | 17.57% |
| Benchmark | Anteil nachhaltige Investitionen mit Umweltziel | 3.38% | 3.77% |
| | Anteil sozial nachhaltige Investitionen | 5.31% | 4.99% |
| | Total nachhaltige Quote | 8.69% | 8.77% |



■ Portfolio
 ■ Benchmark

Aufgrund der unterschiedlichen Behandlung von Green, Social und Sustainable Bonds kann das SDG-Exposure von den prozentualen Umsätzen der im Portfolio des Fonds enthaltenen Unternehmungen und den der Benchmark, welche im Einklang mit den sich aus den SDGs ergebenden Umweltzielen gemäss Art. 2 (17) SFDR investiert worden sind, abweichen.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Im Berichtszeitraum konzentrierte sich der Vermögensverwalter auf Wertpapiere von Unternehmen, welche Umsätze aus dem Verkauf von Produkten und Dienstleistungen mit einem positiven Beitrag zu den 17 SDGs erzielten und dabei keine DNSH- und/oder Minimum Safeguards-Verletzungen aufgewiesen haben.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Emittenten mit einem negativen Nettobeitrag zu den SDGs wurden in der Berichtsperiode aus dem Anlageuniversum des Finanzproduktes entfernt. Darüber hinaus berücksichtigte der Teilfonds nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (engl: Principal Adverse Impacts - PAI). Zu diesem Zweck wurden die obligatorischen Indikatoren Anhang 1 der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1288 zur Ergänzung der Verordnung (EU) 2019/2088 zugrunde gelegt. Unternehmen, die der Vermögensverwalter gemäss PAI als besonders schädlich einstufte, wurden entsprechend nicht zu den nachhaltigen Anlagen gezählt. Emittenten, welche die PAIs 7 (Biodiversität), 10 (Global Compact der Vereinten Nationen (UNGC)/OECD Leitsätze für multinationale Unternehmen) oder 14 (Engagement in umstrittenen Waffen) verletzen, haben einen PAI-Score von null erhalten. Aus den restlichen PAI-Indikatoren wurde ein PAI-Score berechnet. Instrumente von Emittenten mit einem Score < 10 wurden nicht den nachhaltigen Investitionen angerechnet.

● **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Die nachteiligen Auswirkungen (PAI) sind systematisch im Anlageprozess berücksichtigt worden.

● **Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:**

Bei der Anlageanalyse für nachhaltige Investitionen wurden in der Berichtsperiode die folgenden Normverletzungen berücksichtigt: Global Compact der Vereinten Nationen (UNGC), die UN Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte (UNGP) und das Übereinkommen der Internationalen Arbeitsorganisation (ILO). Jeder schwerwiegende Verstoß gegen diese Normen führte zum Ausschluss des Emittenten aus dem investierbaren Universum des Finanzprodukts.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

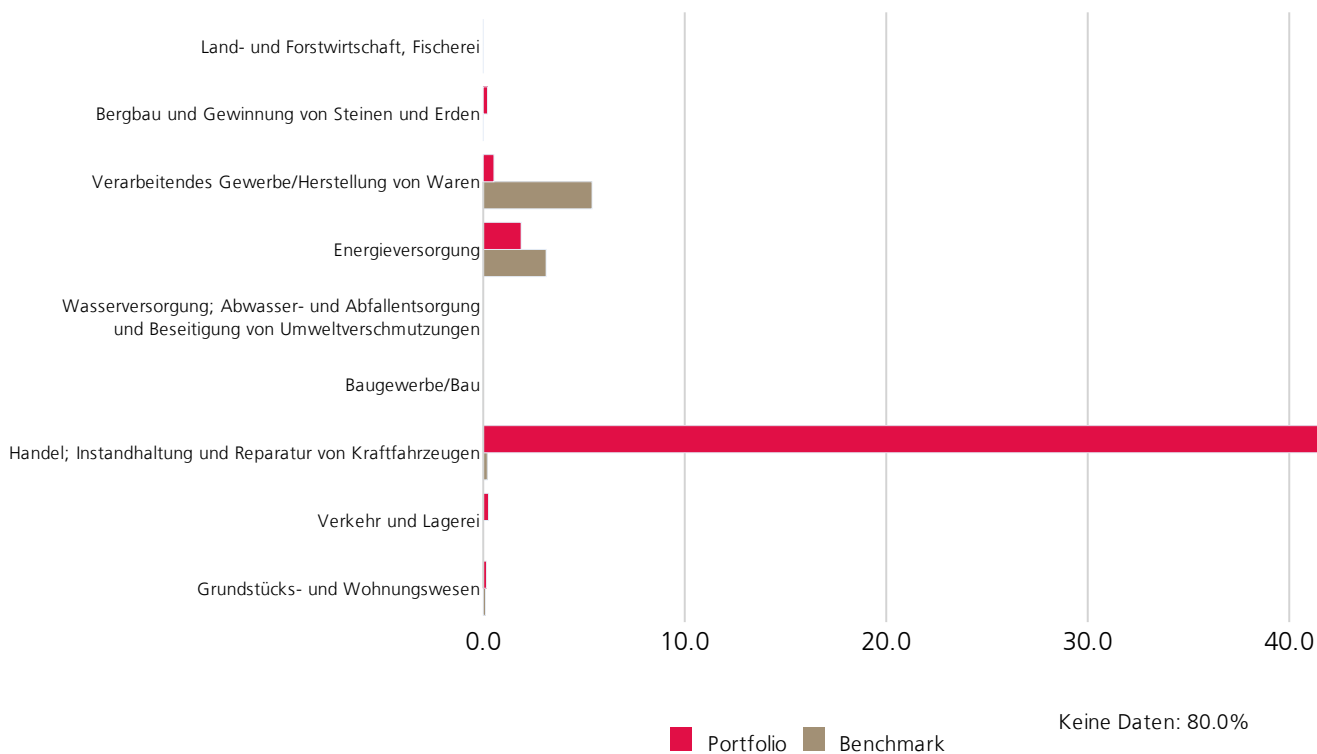
Nachteilige Nachhaltigkeitsauswirkungen (PAI) – Corporate Anlagen

Primäre Indikatoren - Energie und Emissionen

| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Benchmark Aktuell | Benchmark Vorjahr | Erklärung |
|--|--|-------------------|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|-----------|
| 1. THG-Emissionen | 1a. GHG Emissions - Scope 1 per Mio EUR Enterprise Value | 251.39 | 22.65% | 600.68 | 178.74 | 177.63 | |
| | 1b. GHG Emissions - Scope 2 per Mio EUR Enterprise Value | 148.38 | 22.65% | 182.58 | 47.83 | 45.6 | |
| | 1c. GHG Emissions - Scope 3 per Mio EUR Enterprise Value | 3866.49 | 22.65% | 6782.72 | 959.87 | 683.12 | |
| 2. CO ₂ -Fussabdruck | 2. GHG Emissions - Scope 1+2+3 per Mio EUR Enterprise Value | 47.22 | 22.65% | 63.66 | 13.23 | 7.9 | |
| 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird | 3. GHG Emissions - Emissions Intensity - Total Emissions (EUR) | 31.82 | 23.05% | 64.74 | 93.73 | 86.23 | |
| 4. Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind | 4. Fossil Fuel - Involvement (PAI) | 0.31% | 21.95% | 0.16% | 0.18% | 0.16% | |

| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Benchmark Aktuell | Benchmark Vorjahr | Erklärung |
|--|--|-------------------|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|---|
| 5. Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen | 5a. CR Raw - Energy use - Coal/nuclear/undear energy sources | 87.14% | 0.93% | 85.72% | 86.43% | 79.38% | |
| | 5b. Non-renewable energy consumption | 72.69% | 4% | 89.65% | 71.25% | 90.39% | Der Verbrauch nicht-erneuerbarer Energie umfasst den Verbrauch von Energie, die aus nicht-erneuerbaren Quellen erzeugt wird, sowie den Verbrauch von Energie aus Biomasse. Alle Zahlen zum Energieverbrauch, bei denen die Energiequelle unklar ist, sind ebenfalls in diesem Faktor enthalten. |
| | 5c. Non-renewable energy production | 0.3% | 21.75% | 0.1% | 0.39% | 0.27% | |
| 6. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren | 6. Energy consumption intensity (GWh/mEUR) | 0.04 | 11.4% | 0.06 | 0.11 | 0.15 | |

Intensität des Energieverbrauchs pro High Impact Sector (pro Mio. EUR)



| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Benchmark Aktuell | Benchmark Vorjahr | Erklärung |
|---|--|-------------------|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|-----------|
| 7. Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken | 7. Companies negatively affecting biodiversity-sensitive areas | 0% | 22.05% | 0% | 0% | 0% | |
| 8. Emissionen in Wasser | 8. CR Raw - COD emissions | 0.37 | 0.09% | 0.43 | 0 | 0 | |
| 9. Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle | 9. CR Raw - Hazardous waste | 0 | 1.28% | 0 | 0.04 | 0 | |

| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Benchmark Aktuell | Benchmark Vorjahr | Erklärung |
|--|--|-------------------|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|-----------|
| 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | 10. UNGC / OECD Guidelines Violation | 0% | 22.05% | 0% | 1.74% | 0% | |
| 11. Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen | 11. Lack of processes monitoring UNGC and OECD Guidelines compliance | 3.32% | 18.81% | 2.11% | 1.36% | 0.24% | |
| 12. Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle | 12. Unadjusted gender pay gap | 0.3% | 2.65% | 0.41% | 0.07% | 0.05% | |
| 13. Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen | 13. Ratio of female to male board members | 61.67% | 12.8% | 66.26% | 70.74% | 64.97% | |
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) | 14. Controversial weapons involvement (APM, CM, Bio, Chem) | 0% | 22.11% | 0% | 0% | 0% | |

Nachteilige Nachhaltigkeitsauswirkungen (PAI) – Staatliche und Supranationale Vermögenswerte

Primäre Indikatoren

| Umwelt | | | | | | | |
|--------------------|-------------------|-------------------|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|-----------|
| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Benchmark Aktuell | Benchmark Vorjahr | Erklärung |
| 15. GHG Intensität | 15. GHG Intensity | 396.15 | 46.83% | 420.08 | 393.27 | 449.8 | |

| Sozial | | | | | | | |
|--|---|-------------------|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|-----------|
| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Benchmark Aktuell | Benchmark Vorjahr | Erklärung |
| 16. Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen | 16a. Countries subject to social violations (#) | 16.5 | 0.83% | 15.25 | 0 | 0 | |
| | 16b. Countries subject to social violations (%) | 21.68% | 0.83% | 21.4% | 0% | 0% | |

| Indikator | Metrik |
|-----------|---|
| 1a | Scope-1-Treibhausgas-Emissionen |
| 1b | Scope-2-Treibhausgas-Emissionen |
| 1c | Scope-3-Treibhausgas-Emissionen |
| 2. | CO2-Fussabdruck pro Mio EUR |
| 3. | THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird |
| 4. | Anteil der Investitionen in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind |
| 5a | Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung der Unternehmen, in die investiert wird, aus nicht erneuerbaren Energiequellen im Vergleich zu erneuerbaren Energiequellen, ausgedrückt in Prozent der gesamten Energiequellen |
| 5b | Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung der Unternehmen, in die investiert wird, aus nicht erneuerbaren Energiequellen im Vergleich zu erneuerbaren Energiequellen, ausgedrückt in Prozent der gesamten Energiequellen |
| 5c | Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung der Unternehmen, in die investiert wird, aus nicht erneuerbaren Energiequellen im Vergleich zu erneuerbaren Energiequellen, ausgedrückt in Prozent der gesamten Energiequellen |
| 6. | Energieverbrauch in GWh pro einer Million EUR Umsatz der Unternehmen, in die investiert wird, aufgeschlüsselt nach klimaintensiven Sektoren |
| 7. | Anteil der Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird, mit Standorten/Betrieben in oder in der Nähe von Gebieten mit schutzbedürftiger Biodiversität, sofern sich die Tätigkeiten dieser Unternehmen nachteilig auf diese Gebiete auswirken |
| 8. | Tonnen Emissionen in Wasser, die von den Unternehmen, in die investiert wird, pro investierter Million EUR verursacht werden, ausgedrückt als gewichteter Durchschnitt |
| 9. | Tonnen gefährlicher und radioaktiver Abfälle, die von den Unternehmen, in die investiert wird, pro investierter Million EUR erzeugt werden, ausgedrückt als gewichteter Durchschnitt |
| 10. | Anteil der Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird, die an Verstößen gegen die UNGC-Grundsätze oder gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen beteiligt waren |
| 11. | Anteil der Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird, die keine Richtlinien zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen oder keine Verfahren zur Bearbeitung von Beschwerden wegen Verstößen gegen die UNGC-Grundsätze und OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen eingerichtet haben |
| 12. | Durchschnittliches unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle bei den Unternehmen, in die investiert wird |
| 13. | Durchschnittliches Verhältnis von Frauen zu Männern in den Leitungs- und Kontrollorganen der Unternehmen, in die investiert wird, ausgedrückt als Prozentsatz aller Mitglieder der Leitungs- und Kontrollorgane |
| 14. | Anteil der Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird, die an der Herstellung oder am Verkauf von umstrittenen Waffen beteiligt sind |
| 15. | THG-Emissionsintensität der Länder, in die investiert wird |
| 16a | Anzahl der Länder, in die investiert wird, die nach Maßgabe internationaler Verträge und Übereinkommen, der Grundsätze der Vereinten Nationen oder, falls anwendbar, nationaler Rechtsvorschriften gegen soziale Bestimmungen verstoßen (absolute Zahl und relative Zahl, geteilt durch alle Länder, in die investiert wird) |
| 16b | Anzahl der Länder, in die investiert wird, die nach Maßgabe internationaler Verträge und Übereinkommen, der Grundsätze der Vereinten Nationen oder, falls anwendbar, nationaler Rechtsvorschriften gegen soziale Bestimmungen verstoßen (absolute Zahl und relative Zahl, geteilt durch alle Länder, in die investiert wird) |

Das Dokument wurde von Swisscanto mit geschäftsüblicher Sorgfalt erstellt und kann Informationen aus sorgfältig ausgewählten Drittquellen enthalten. Anleger sollten beachten, dass die zuvor für 2023 berechneten und veröffentlichten Daten für dieses in 2024 veröffentlichte Dokument neu berechnet wurden. Dementsprechend kann es zu Abweichungen bei diesen in den Jahren 2023 und 2024 veröffentlichten historischen Daten kommen.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 01.02.2023 - 31.01.2024

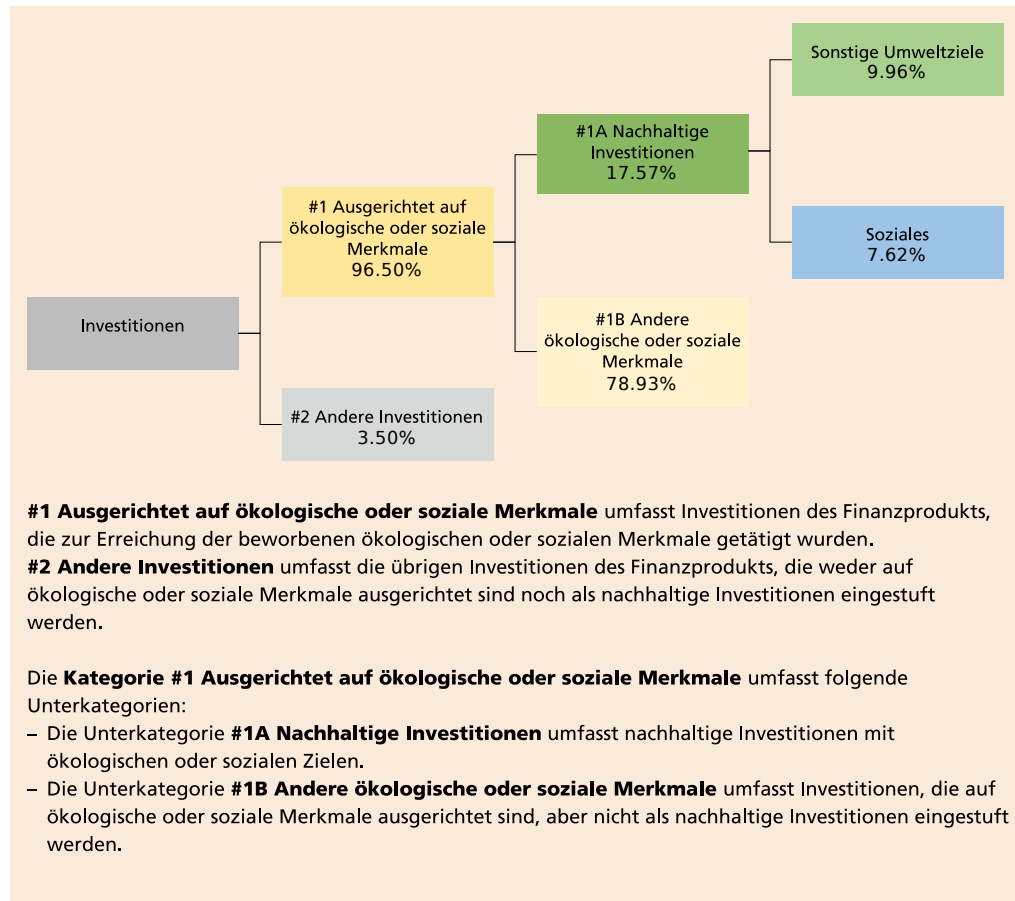
| Grösste Investitionen | Sektor | In % der Vermögenswerte | Land |
|--|---|-------------------------|------------|
| Government of Australia 2.5% 21-MAY-2030 REGS | Financial and Insurance Activities | 2.36% | |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Emerging Markets Opportunities NT USD Klasse | | 2.19% | |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible COCO NT USD Klasse | | 2.09% | |
| Government of Australia 1.0% 21-DEC-2030 REGS | Financial and Insurance Activities | 1.50% | |
| Government of Australia 1.25% 21-MAY-2032 | Financial and Insurance Activities | 1.44% | |
| Government of Australia 2.75% 21-NOV-2029 REGS | Financial and Insurance Activities | 1.43% | |
| International Finance Corp 4.45% 14-MAY-2027 | Activities of Extraterritorial Organisations and Bodies | 1.37% | USA |
| Government of Australia 3.0% 21-NOV-2033 REGS | Financial and Insurance Activities | 1.36% | |
| Government of Australia 1.0% 21-NOV-2031 REGS | Financial and Insurance Activities | 1.35% | |
| Government of Australia 3.5% 21-DEC-2034 REGS | Financial and Insurance Activities | 1.34% | |
| Government of Australia 1.5% 21-JUN-2031 | Financial and Insurance Activities | 1.32% | |
| Government of Australia 3.25% 21-APR-2029 REGS | Financial and Insurance Activities | 1.31% | |
| Government of Australia 2.75% 21-MAY-2041 REGS | Financial and Insurance Activities | 1.27% | |
| Export Finance Australia 1.465% 18-AUG-2031 | Financial and Insurance Activities | 1.24% | |
| European Investment Bank 4.75% 20-JAN-2033 | Activities of Extraterritorial Organisations and Bodies | 1.22% | Luxembourg |



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

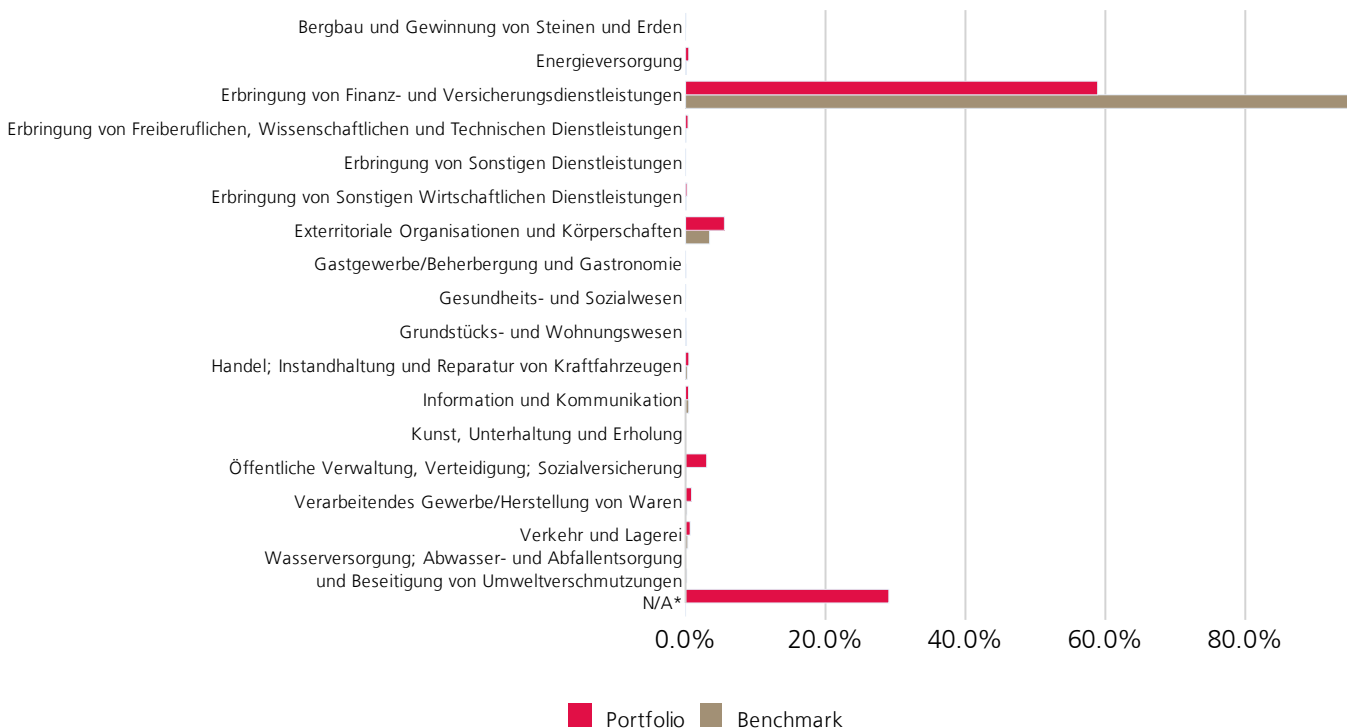
Der Anteil an nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen und Angaben zur Vermögensallokation werden in untenstehender Frage beantwortet.

Wie sah die Vermögensallokation aus?



In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Wegen mangelnder Datenverfügbarkeit können Subsektoren nicht angezeigt werden.



*Diese Klassifizierung umfasst alle Bestände, für die keine NACE-Klassifizierung gefunden oder geschätzt werden kann; Liquidität ist darin enthalten.
381/449



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Obwohl keine Investitionen getätigt wurden, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind, wird in untenstehender Grafik die Alignierung der nachhaltigen Investitionen mit der EU-Taxonomie offengelegt.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomeikonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert¹?

Ja

In fossiles Gas

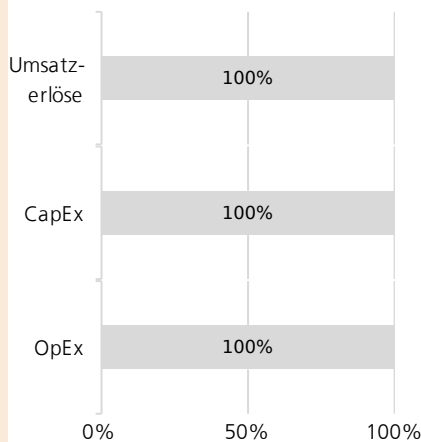
In Kernenergie

Nein

¹Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomeikonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels ("Klimaschutz") beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomeikonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

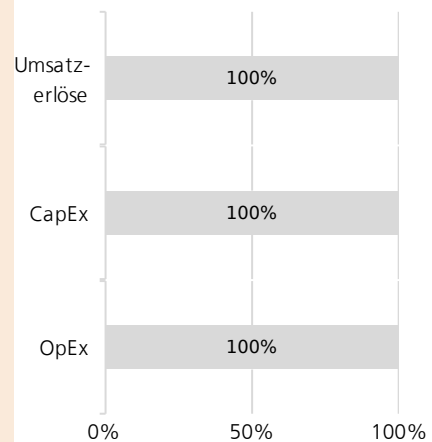
Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomeikonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzproduktes einschliesslich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzproduktes zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.

1. Taxonomiekonformität der Investitionen einschliesslich Staatsanleihen*



- Taxonomiekonform: Fossiles Gas
- Taxonomiekonform: Kernenergie
- Taxonomiekonform: (ohne fossiles Gas und Kernenergie)
- Nicht taxonomiekonform

2. Taxonomiekonformität der Investitionen ohne Staatsanleihen*



- Taxonomiekonform: Fossiles Gas
- Taxonomiekonform: Kernenergie
- Taxonomiekonform: (ohne fossiles Gas und Kernenergie)
- Nicht taxonomiekonform

Diese Grafik gibt **34.4%** der Gesamtinvestitionen wieder.

*Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff "Staatsanleihen" alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Mit Blick auf die EU-Taxonomeikonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf erneuerbare Energie oder CO2-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO2-armen Alternativen gibt und die Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomeikonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:
- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

Investitionsausgaben (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, z.B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft
- **Betriebsausgaben** (Opex), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Angaben zu Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten werden in der Tabelle zusammengefasst. Wenn keine Angaben verfügbar sind, wird die Tabelle ebenfalls keine Angaben enthalten.

| Issuer Name | Nace Sektor | Total Eligible Activity Revenue | Total Aligned Revenue | Total Likely Aligned Revenue | Total Potentially Aligned Revenue | Portfolio Gewicht (Consol.) |
|-----------------------------|---|---------------------------------|-----------------------|------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------|
| Orsted | Electricity, Gas, Steam and Air Conditioning Supply | 56.27% | 18.25% | 31.86% | 0.00% | 0.00% |
| EDP-Energias de Portugal SA | Electricity, Gas, Steam and Air Conditioning Supply | 77.52% | 12.25% | 0.00% | 32.43% | 0.00% |
| Electricite de France SA | Electricity, Gas, Steam and Air Conditioning Supply | 71.56% | 9.50% | 0.00% | 7.23% | 0.00% |
| Iberdrola International BV | Electricity, Gas, Steam and Air Conditioning Supply | 61.60% | 9.13% | 0.00% | 15.60% | 0.00% |
| Enel SpA | Electricity, Gas, Steam and Air Conditioning Supply | 33.21% | 5.35% | 0.00% | 8.48% | 0.00% |
| Aroundtown SA | Real Estate Activities | 99.33% | 4.18% | 0.00% | 0.00% | 0.27% |
| Forvia SE | Manufacturing | 20.57% | 0.93% | 3.93% | 11.79% | 0.00% |
| Atos SE | Information and Communication | 76.13% | 0.63% | 15.00% | 0.00% | 0.01% |
| Telefonica Europe BV | Financial and Insurance Activities | 2.30% | 0.33% | 0.00% | 0.00% | 0.00% |
| Merck KGaA | Manufacturing | 0.01% | 0.01% | 0.00% | 0.00% | 0.01% |

Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

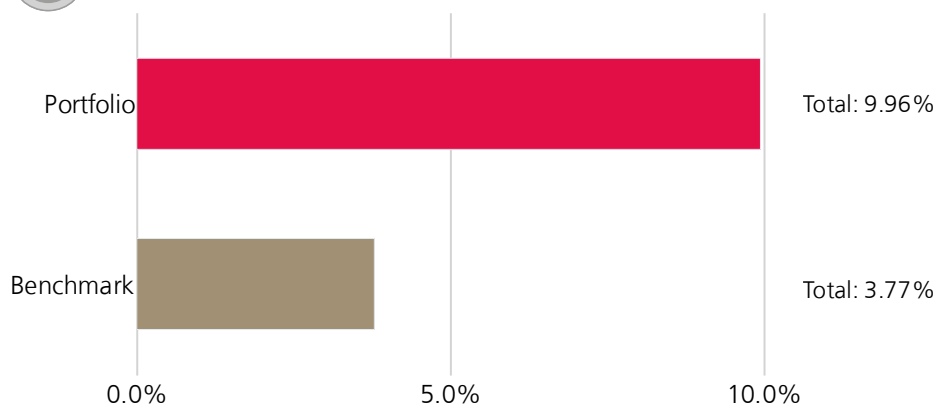
Da im vorangegangenen Berichtsjahr keine Daten verfügbar waren, erübrigt sich ein Vorjahresvergleich.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



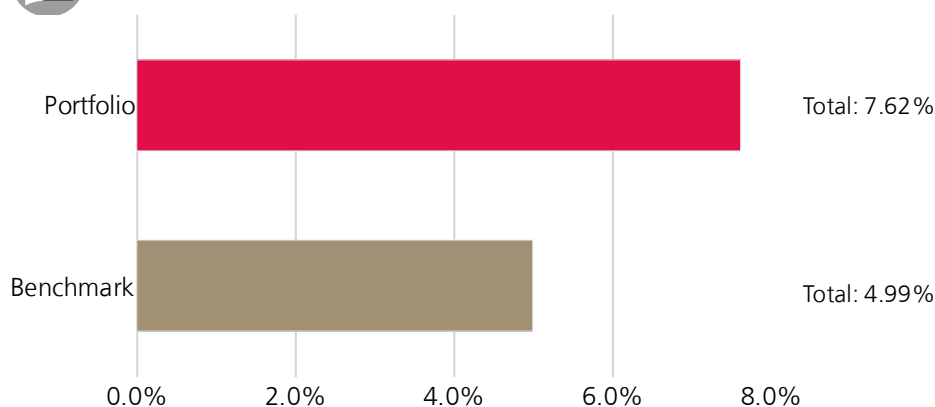
Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?



Das Diagramm zeigt die prozentualen Umsätze der im Portfolio des Fonds enthaltenen Unternehmungen und der der Benchmark, welche nicht EU-Taxonomie konform, jedoch im Einklang mit den sich aus den SDGs ergebenden Umweltzielen gemäss Art. 2 (17) SFDR investiert worden sind.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?



Das Diagramm zeigt die prozentualen Umsätze der im Portfolio des Fonds enthaltenen Unternehmungen und der der Benchmark, welche nicht EU-Taxonomie konform, jedoch im Einklang mit den sich aus den SDGs ergebenden sozialen Zielen gemäss Art. 2 (17) SFDR investiert worden sind.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Diese Vermögenswerte haben die in der spezifischen Anlagepolitik vorgesehenen Anlagen umfasst, einschliesslich Derivate zu Absicherungszwecken und flüssige Mittel. Die Anlagen, ausgenommen Derivate und flüssige Mittel, haben die Grundsätze des ökologischen oder sozialen Mindestschutzes umgesetzt.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Im Berichtszeitraum förderte der Vermögensverwalter durch Investment Stewardship und Kapitalallokation nachhaltige Geschäftspraktiken und die Einhaltung anerkannter internationaler Prinzipien und ESG-Best-Practice-Standards. Dementsprechend stand er im Dialog mit den Managementteams der investierten Unternehmen. Darüber hinaus hat er sich im Rahmen der United Nations Collaboration Platform for Responsible Investment (UN PRI) und bei Investoreninitiativen engagiert. Das Abstimmungsverhalten basierte auf den schweizerischen und internationalen Corporate-Governance-Regeln sowie auf den Prinzipien des UN Global Compact und den 17 Zielen für nachhaltige Entwicklung (UN SDGs). Weitere Informationen finden Sie unter: Swisssanto | Proxy Voting Dashboard (issgovernance.com) <https://www.swisssanto.com/int/de/nachhaltigkeit/investment-stewardship.html>

Swisssanto | Proxy Voting Dashboard (issgovernance.com)

<https://www.swisssanto.com/int/de/nachhaltigkeit/investment-stewardship.html>



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Es wurde kein Index als Referenzwert bestimmt, um festzustellen, ob dieses Finanzprodukt auf die beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet ist.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?

Nicht anwendbar.

Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?

Nicht anwendbar.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?

Nicht anwendbar.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?

Nicht anwendbar.

Das Dokument wurde von Swisssanto mit geschäftsüblicher Sorgfalt erstellt und kann Informationen aus sorgfältig ausgewählten Drittquellen enthalten. Anleger sollten beachten, dass die zuvor für 2023 berechneten und veröffentlichten Daten für dieses in 2024 veröffentlichte Dokument neu berechnet wurden. Dementsprechend kann es zu Abweichungen bei diesen in den Jahren 2023 und 2024 veröffentlichten historischen Daten kommen.



Regelmässige Information zum 31.01.2024

Regelmässige Informationen zu den in Artikel 8, Absätze 1, 2, 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts:

Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible CAD

Unternehmenskennung (LEI-Code):

5493002H8R636PLBUX16

Benchmark

Bloomberg Barclays Canadian Aggregate 300MN Bond Index in CAD

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. In dieser Verordnung ist kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten festgelegt. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

| Ja | | Nein | |
|--------------------------|---|-------------------------------------|--|
| <input type="checkbox"/> | Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: _ % | <input checked="" type="checkbox"/> | Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 14.6% an nachhaltigen Investitionen |
| <input type="checkbox"/> | in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind | <input type="checkbox"/> | mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind |
| <input type="checkbox"/> | in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind | <input checked="" type="checkbox"/> | mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind |
| <input type="checkbox"/> | Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: _ % | <input checked="" type="checkbox"/> | mit einem sozialen Ziel |
| <input type="checkbox"/> | | <input type="checkbox"/> | Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt . |



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die von dem Teilfonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale wurden durch folgende Aktivitäten erreicht:

1. Ausschlusskriterien
2. ESG-Integration
3. Reduktion der CO₂e-Intensität
4. Nachhaltige Investitionen





Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Aus Übersichtsgründen werden die Angaben zur Performance (siehe Details am Ende des Reports) der Nachhaltigkeitsindikatoren direkt mit dem historischen Vergleich in der nächsten Frage beantwortet.

...und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Ausschlusskriterien

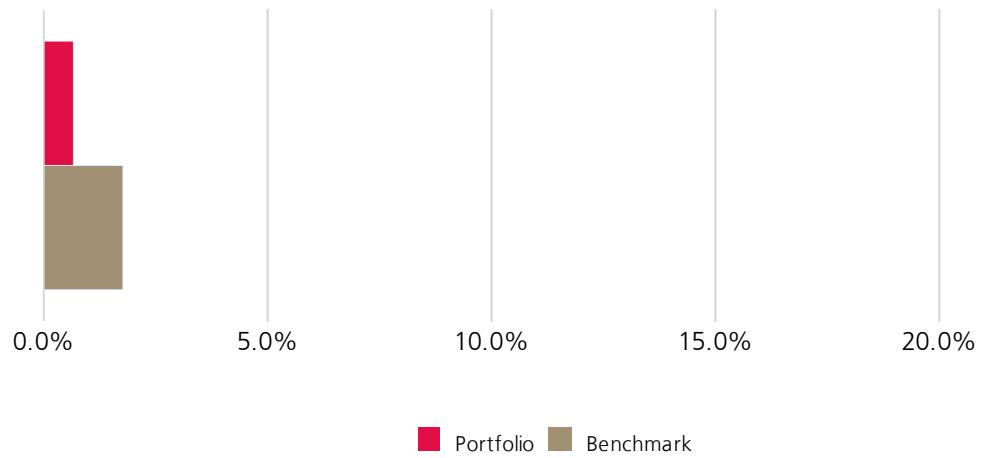
| Responsible | | | | | | | |
|---|-------------------|--|------------------------------|---|-------------------|-------------------|------------------------------|
| Kriterien | Gewicht Portfolio | Gewicht Benchmark | Anzahl Unternehmen Benchmark | Kriterien | Gewicht Portfolio | Gewicht Benchmark | Anzahl Unternehmen Benchmark |
|  Kohlereserven (ex. Metallproduktion) | 0.00% | 0.23% | 2 |  UN Global Compact Verstöße | 0.00% | 0.06% | 1 |
| Förderung von Kohle (> 5% Umsatz) | 0.00% | 0.00% | 0 | Ausbeuterische Kinderarbeit | 0.00% | 0.00% | 0 |
|  Klimawandel | |  Gefährdung von Gesellschaft und Gesundheit | | Herstellung von Kriegstechnik (> 5% Umsatz) | 0.00% | 0.00% | 0 |
| | | | | Herstellung von Pornografie | 0.00% | 0.00% | 0 |
| | | | | Herstellung von Waffen & Munition | 0.00% | 0.00% | 0 |
| | | | | Kontroverse Waffen | 0.00% | 0.00% | 0 |

Zwecks Minderung der Nachhaltigkeitsrisiken und mit dem Ziel, nicht in Wertpapiere der oben aufgeführten kontroversen Geschäftsmodellen zu investieren, sind die oben genannten Ausschlusskriterien angewendet worden. Die Tabelle zeigt die Anzahl der Unternehmen, die gegen die Ausschlusskriterien verstossen haben, sowie die jeweilige Portfolio- und Benchmark-Exposition. Liegen bei einem Unternehmen mehrere Verstöße vor, werden diese für jedes Kriterium separat aufgeführt. Daher ist die Summe aller Positionen in diesem Bericht in der Regel höher als die effektive Allokation zu den oben abgebildeten Kriterien. Die historischen Vergleiche werden in nachfolgender Tabelle gemacht. Aus Übersichtsgründen werden die Ausschlusskriterien aggregiert.

| | Indikator | Datum 2023 | Datum 2024 |
|-----------|----------------------------|------------|------------|
| Portfolio | Ausschlusskriterien Total* | 0% | 0% |
| Benchmark | Ausschlusskriterien Total* | 0.24% | 0.29% |

*alle Ausschlusskriterien kumuliert.

ESG-Integration

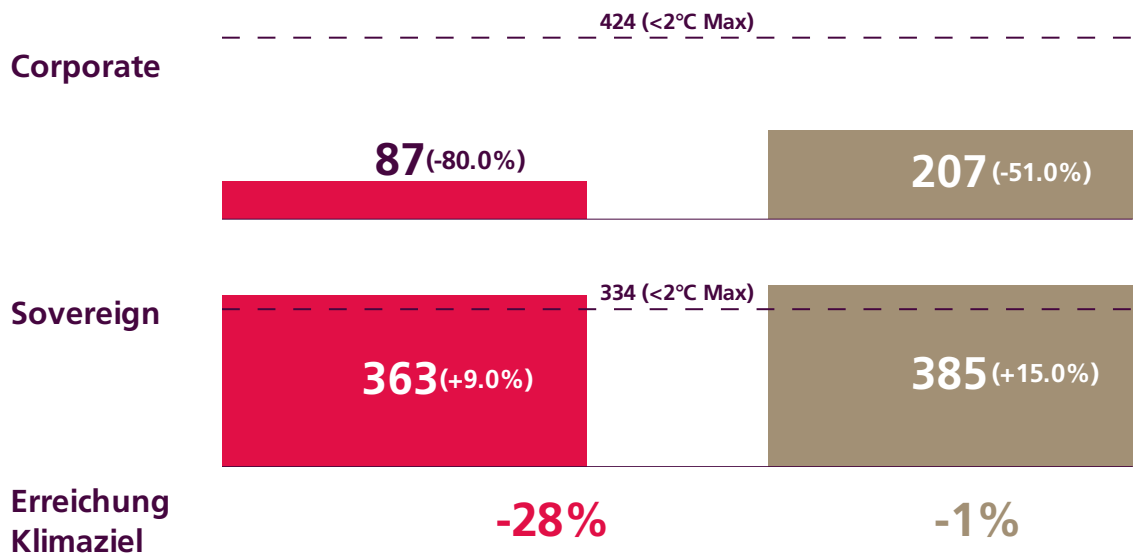


Das Portfolio strebte in der Berichtsperiode im Vergleich zur Benchmark eine geringere Exposition zu ESG-Laggards an. ESG-Laggards sind Unternehmungen mit der schwächsten Umwelt-, Sozial und Governance- Performance des relevanten Anlageuniversums.

Die historischen Vergleiche werden in nachfolgender Tabelle gemacht.

| | Indikator | Datum 2023 | Datum 2024 |
|-----------|----------------------------|------------|------------|
| Portfolio | Exposition zu ESG Laggards | 1.17% | 0.66% |
| Benchmark | Exposition zu ESG Laggards | 1.26% | 1.77% |

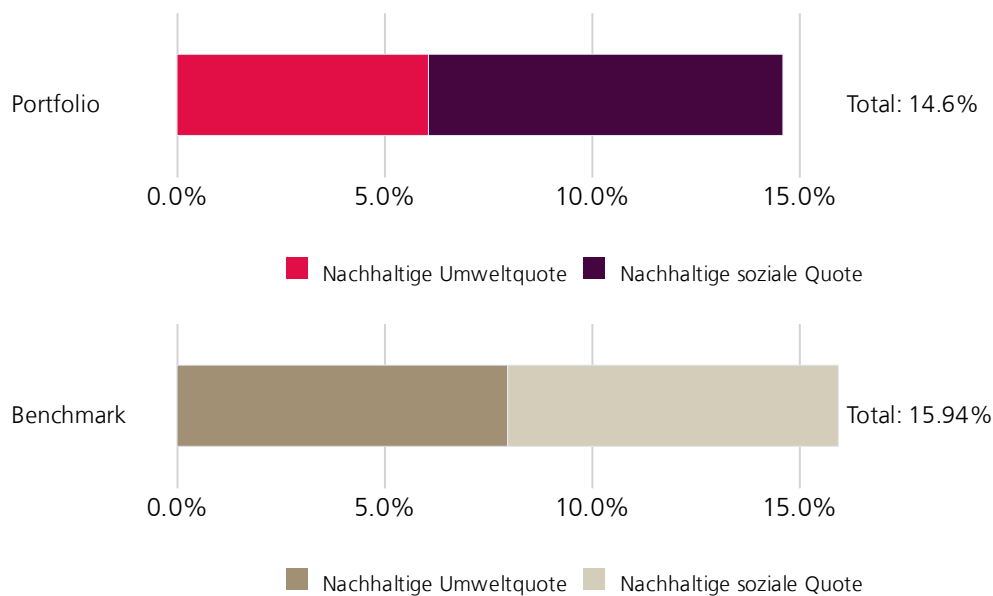
Reduktion der CO₂e-Intensität



Im Einklang mit dem < 2° Pariser Klimaziel ("<2°C Max") zielte die Investitionstätigkeit des Fonds während der Berichtsperiode darauf ab, die CO₂e-Emissionen des Portfolios, um mindestens 4 % pro Jahr zu reduzieren. Der Absenkpfad berechnet sich aus den gewichteten CO₂e-Intensitäten der Benchmark, diskontiert mit 4 % pro Jahr zuzüglich des realen Wirtschaftswachstums. Die gestrichelten 2° Max-Linie zeigt den Maximalwert an. Die Balken stellen die CO₂e-Intensitäten des Portfolios und der Benchmark dar. CO₂e-Intensitäten unterhalb der 2° Max-Linie zeigen an, dass das Portfolio oder die Benchmark das <2°-Klimaziel erfüllen. Werte bei "Erreichung Klimaziel" setzen das Portfolio und die Benchmark in Relation zum Klimaziel. Negative Werte bedeuten, dass das Ziel erreicht wurde. Die historischen Vergleiche werden in nachfolgender Tabelle gemacht.


















| | Indikator | Datum 2023 | Datum 2024 |
|-----------|--|------------|------------|
| Portfolio | CO ₂ e-Intensität Corporate | 118 | 87 |
| | CO ₂ e-Intensität Sovereign | 396 | 363 |
| | Erreichung Klimaziel | -25% | -28% |
| | Reduktion Corporate | -74% | -80% |
| | Reduktion Sovereign | 9% | 9% |
| Benchmark | CO ₂ e-Intensität Corporate | 285 | 207 |
| | CO ₂ e-Intensität Sovereign | 429 | 385 |
| | Erreichung Klimaziel | 4% | -1% |
| | Reduktion Corporate | -39% | -51% |
| | Reduktion Sovereign | 18% | 15% |

Nachhaltige Investitionen



Das Diagramm zeigt die prozentualen Umsätze der im Portfolio des Fonds enthaltenen Unternehmungen und der der Benchmark, welche nicht EU-Taxonomie konform, jedoch im Einklang mit den sich aus den UN Sustainable Development Goals (SDGs) ergebenden Umwelt- und sozialen Zielen gemäss Art. 2 (17) SFDR investiert worden sind. Der Fonds hat keine Investitionen in ökologisch nachhaltige Aktivitäten im Sinne der EU Taxonomie-Verordnung angestrebt. Der Investmentmanager des (Teil-)Fonds hat eine Methodologie zur Definition nachhaltiger Investitionen entwickelt, die den Anforderungen des Art. 2 (17) SFDR entspricht. Die Methodologie ist detailliert in den Vorvertraglichen Informationen beschrieben. Die Aufteilung der nachhaltigen Investitionen in UN SDGs werden in folgender Grafik gemacht. Die historischen Vergleiche werden in nachfolgender Tabelle gemacht.

| | Indikator | Datum 2023 | Datum 2024 |
|-----------|---|------------|------------|
| Portfolio | Anteil nachhaltige Investitionen mit Umweltziel | 6.44% | 6.08% |
| | Anteil sozial nachhaltige Investitionen | 9.31% | 8.52% |
| | Total nachhaltige Quote | 15.74% | 14.6% |
| Benchmark | Anteil nachhaltige Investitionen mit Umweltziel | 2.46% | 7.99% |
| | Anteil sozial nachhaltige Investitionen | 11.68% | 7.94% |
| | Total nachhaltige Quote | 14.14% | 15.94% |

| | | | | | |
|---|----------------|---|----------------|---|--------------------------------|
| 1  Keine Armut | 1.27% 1.53% | 7  Bezahlbare und saubere Energie | 1.63% 1.56% | 13  Massnahmen zum Klimaschutz | 0.00% 0.00% |
| 2  Kein Hunger | 0.24% 0.10% | 8  Menschenwürdige Arbeit und Wirtschaftswachstum | 2.71% 2.65% | 14  Leben unter Wasser | 0.09% 0.04% |
| 3  Gesundheit und Wohlergehen | 0.62% 0.18% | 9  Industrie, Innovation und Infrastruktur | 3.78% 4.56% | 15  Leben an Land | 0.05% 0.03% |
| 4  Hochwertige Bildung | 0.00% 0.04% | 10  Weniger Ungleichheiten | 0.00% 0.00% | 16  Frieden, Gerechtigkeit und starke Institutionen | 0.00% 0.00% |
| 5  Geschlechtergleichheit | 0.00% 0.00% | 11  Nachhaltige Städte und Gemeinden | 2.32% 2.46% | 17  Partnerschaften zur Erreichung der Ziele | 0.81% 1.47% |
| 6  Sauberes Wasser und Sanitäreinrichtungen | 0.50% 0.99% | 12  Nachhaltige/r Konsum und Produktion | 0.07% 0.04% | Total | 14.09% 15.64% |

■ Portfolio ■ Benchmark

Aufgrund der unterschiedlichen Behandlung von Green, Social und Sustainable Bonds kann das SDG-Exposure von den prozentualen Umsätzen der im Portfolio des Fonds enthaltenen Unternehmungen und den der Benchmark, welche im Einklang mit den sich aus den SDGs ergebenden Umweltzielen gemäss Art. 2 (17) SFDR investiert worden sind, abweichen.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Im Berichtszeitraum konzentrierte sich der Vermögensverwalter auf Wertpapiere von Unternehmen, welche Umsätze aus dem Verkauf von Produkten und Dienstleistungen mit einem positiven Beitrag zu den 17 SDGs erzielten und dabei keine DNSH- und/oder Minimum Safeguards-Verletzungen aufgewiesen haben.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Emittenten mit einem negativen Nettobeitrag zu den SDGs wurden in der Berichtsperiode aus dem Anlageuniversum des Finanzproduktes entfernt. Darüber hinaus berücksichtigte der Teilfonds nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (engl: Principal Adverse Impacts - PAI). Zu diesem Zweck wurden die obligatorischen Indikatoren Anhang 1 der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1288 zur Ergänzung der Verordnung (EU) 2019/2088 zugrunde gelegt. Unternehmen, die der Vermögensverwalter gemäss PAI als besonders schädlich einstufte, wurden entsprechend nicht zu den nachhaltigen Anlagen gezählt. Emittenten, welche die PAIs 7 (Biodiversität), 10 (Global Compact der Vereinten Nationen (UNGC)/OECD Leitsätze für multinationale Unternehmen) oder 14 (Engagement in umstrittenen Waffen) verletzen, haben einen PAI-Score von null erhalten. Aus den restlichen PAI-Indikatoren wurde ein PAI-Score berechnet. Instrumente von Emittenten mit einem Score < 10 wurden nicht den nachhaltigen Investitionen angerechnet.

● **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Die nachteiligen Auswirkungen (PAI) sind systematisch im Anlageprozess berücksichtigt worden.

● **Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:**

Bei der Anlageanalyse für nachhaltige Investitionen wurden in der Berichtsperiode die folgenden Normverletzungen berücksichtigt: Global Compact der Vereinten Nationen (UNGC), die UN Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte (UNGP) und das Übereinkommen der Internationalen Arbeitsorganisation (ILO). Jeder schwerwiegende Verstoß gegen diese Normen führte zum Ausschluss des Emittenten aus dem investierbaren Universum des Finanzprodukts.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

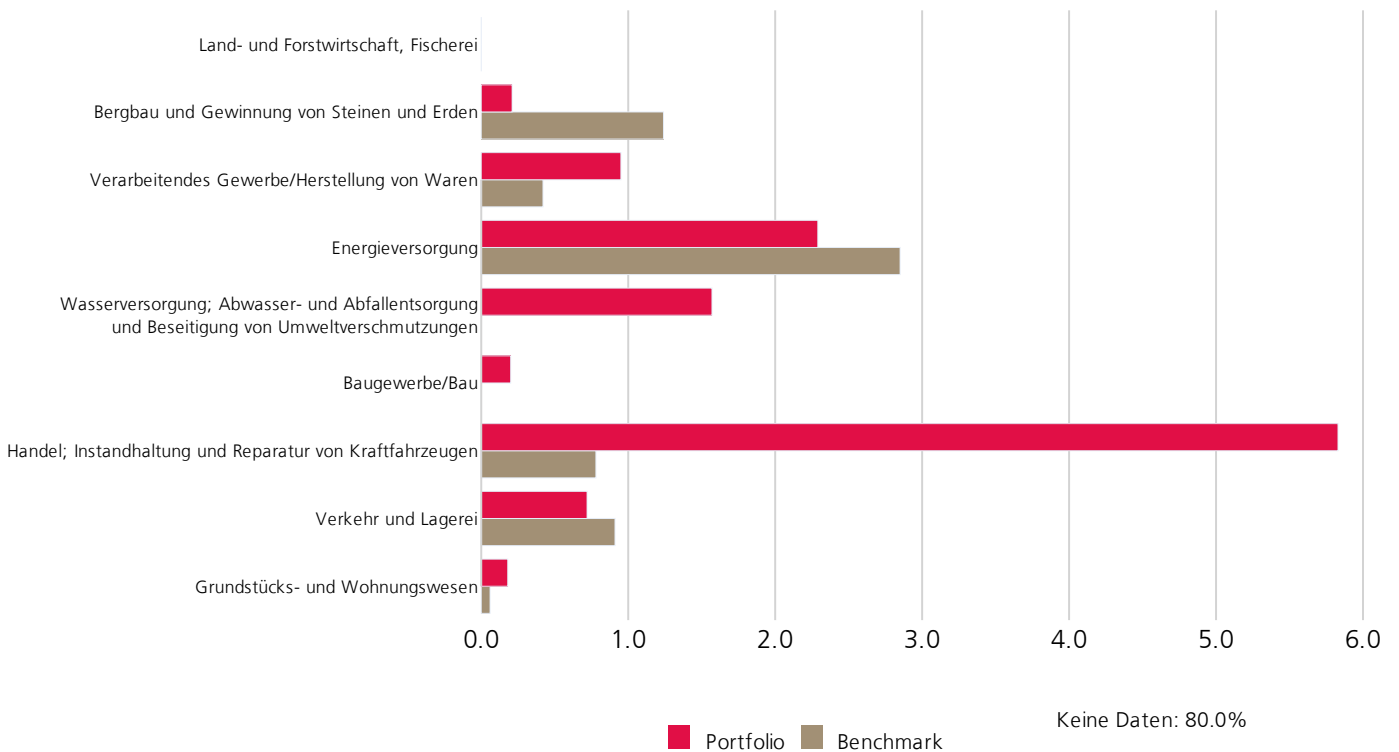
Nachteilige Nachhaltigkeitsauswirkungen (PAI) – Corporate Anlagen

Primäre Indikatoren - Energie und Emissionen

| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Benchmark Aktuell | Benchmark Vorjahr | Erklärung |
|--|--|-------------------|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|-----------|
| 1. THG-Emissionen | 1a. GHG Emissions - Scope 1 per Mio EUR Enterprise Value | 370.47 | 33.77% | 668.32 | 553.99 | 700.89 | |
| | 1b. GHG Emissions - Scope 2 per Mio EUR Enterprise Value | 127.97 | 33.77% | 193.78 | 122.53 | 124.76 | |
| | 1c. GHG Emissions - Scope 3 per Mio EUR Enterprise Value | 5361.57 | 33.77% | 6718.28 | 3922.91 | 3594.36 | |
| 2. CO ₂ -Fussabdruck | 2. GHG Emissions - Scope 1+2+3 per Mio EUR Enterprise Value | 83.51 | 33.77% | 88.14 | 67.98 | 50.79 | |
| 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird | 3. GHG Emissions - Emissions Intensity - Total Emissions (EUR) | 121.96 | 33.84% | 162.04 | 271.01 | 286.14 | |
| 4. Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind | 4. Fossil Fuel - Involvement (PAI) | 2.74% | 34.29% | 3.97% | 3.53% | 2.55% | |

| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Benchmark Aktuell | Benchmark Vorjahr | Erklärung |
|--|--|-------------------|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|---|
| 5. Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen | 5a. CR Raw - Energy use - Coal/nuclear/undear energy sources | 69.22% | 5.43% | 56.38% | 63.11% | 60.12% | |
| | 5b. Non-renewable energy consumption | 65.82% | 9.47% | 94.71% | 62.47% | 86.78% | Der Verbrauch nicht-erneuerbarer Energie umfasst den Verbrauch von Energie, die aus nicht-erneuerbaren Quellen erzeugt wird, sowie den Verbrauch von Energie aus Biomasse. Alle Zahlen zum Energieverbrauch, bei denen die Energiequelle unklar ist, sind ebenfalls in diesem Faktor enthalten. |
| | 5c. Non-renewable energy production | 2.38% | 33.05% | 0.99% | 2.13% | 1.07% | |
| 6. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren | 6. Energy consumption intensity (GWh/mEUR) | 0.16 | 21.71% | 0.15 | 0.31 | 0.19 | |

Intensität des Energieverbrauchs pro High Impact Sector (pro Mio. EUR)



| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Benchmark Aktuell | Benchmark Vorjahr | Erklärung |
|---|--|-------------------|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|-----------|
| 7. Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken | 7. Companies negatively affecting biodiversity-sensitive areas | 0% | 31.8% | 0% | 0% | 0% | |
| 8. Emissionen in Wasser | 8. CR Raw - COD emissions | 0.44 | 0.04% | 0.42 | 0 | 0 | |
| 9. Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle | 9. CR Raw - Hazardous waste | 0.02 | 2.21% | 0 | 0.01 | 0 | |

| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Benchmark Aktuell | Benchmark Vorjahr | Erklärung |
|--|--|-------------------|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|-----------|
| 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | 10. UNGC / OECD Guidelines Violation | 0% | 31.8% | 0% | 6.38% | 0% | |
| 11. Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen | 11. Lack of processes monitoring UNGC and OECD Guidelines compliance | 4.88% | 28.65% | 2.19% | 3.95% | 2.36% | |
| 12. Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle | 12. Unadjusted gender pay gap | 0.22% | 3.53% | 0.19% | 0.03% | 0.03% | |
| 13. Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen | 13. Ratio of female to male board members | 66.36% | 28.81% | 70.61% | 64.36% | 67.27% | |
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) | 14. Controversial weapons involvement (APM, CM, Bio, Chem) | 0% | 33.93% | 0% | 0% | 0% | |

Nachteilige Nachhaltigkeitsauswirkungen (PAI) – Staatliche und Supranationale Vermögenswerte

Primäre Indikatoren

| Umwelt | | | | | | | |
|--------------------|-------------------|-------------------|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|-----------|
| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Benchmark Aktuell | Benchmark Vorjahr | Erklärung |
| 15. GHG Intensität | 15. GHG Intensity | 417.71 | 50.03% | 465.24 | 423.63 | 473.15 | |

| Sozial | | | | | | | |
|--|---|-------------------|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|-----------|
| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Benchmark Aktuell | Benchmark Vorjahr | Erklärung |
| 16. Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen | 16a. Countries subject to social violations (#) | 16.5 | 0.63% | 15.25 | 0 | 0 | |
| | 16b. Countries subject to social violations (%) | 23.14% | 0.63% | 21.24% | 0% | 0% | |

| Indikator | Metrik |
|-----------|---|
| 1a | Scope-1-Treibhausgas-Emissionen |
| 1b | Scope-2-Treibhausgas-Emissionen |
| 1c | Scope-3-Treibhausgas-Emissionen |
| 2. | CO2-Fussabdruck pro Mio EUR |
| 3. | THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird |
| 4. | Anteil der Investitionen in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind |
| 5a | Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung der Unternehmen, in die investiert wird, aus nicht erneuerbaren Energiequellen im Vergleich zu erneuerbaren Energiequellen, ausgedrückt in Prozent der gesamten Energiequellen |
| 5b | Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung der Unternehmen, in die investiert wird, aus nicht erneuerbaren Energiequellen im Vergleich zu erneuerbaren Energiequellen, ausgedrückt in Prozent der gesamten Energiequellen |
| 5c | Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung der Unternehmen, in die investiert wird, aus nicht erneuerbaren Energiequellen im Vergleich zu erneuerbaren Energiequellen, ausgedrückt in Prozent der gesamten Energiequellen |
| 6. | Energieverbrauch in GWh pro einer Million EUR Umsatz der Unternehmen, in die investiert wird, aufgeschlüsselt nach klimaintensiven Sektoren |
| 7. | Anteil der Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird, mit Standorten/Betrieben in oder in der Nähe von Gebieten mit schutzbedürftiger Biodiversität, sofern sich die Tätigkeiten dieser Unternehmen nachteilig auf diese Gebiete auswirken |
| 8. | Tonnen Emissionen in Wasser, die von den Unternehmen, in die investiert wird, pro investierter Million EUR verursacht werden, ausgedrückt als gewichteter Durchschnitt |
| 9. | Tonnen gefährlicher und radioaktiver Abfälle, die von den Unternehmen, in die investiert wird, pro investierter Million EUR erzeugt werden, ausgedrückt als gewichteter Durchschnitt |
| 10. | Anteil der Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird, die an Verstößen gegen die UNGC-Grundsätze oder gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen beteiligt waren |
| 11. | Anteil der Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird, die keine Richtlinien zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen oder keine Verfahren zur Bearbeitung von Beschwerden wegen Verstößen gegen die UNGC-Grundsätze und OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen eingerichtet haben |
| 12. | Durchschnittliches unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle bei den Unternehmen, in die investiert wird |
| 13. | Durchschnittliches Verhältnis von Frauen zu Männern in den Leitungs- und Kontrollorganen der Unternehmen, in die investiert wird, ausgedrückt als Prozentsatz aller Mitglieder der Leitungs- und Kontrollorgane |
| 14. | Anteil der Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird, die an der Herstellung oder am Verkauf von umstrittenen Waffen beteiligt sind |
| 15. | THG-Emissionsintensität der Länder, in die investiert wird |
| 16a | Anzahl der Länder, in die investiert wird, die nach Maßgabe internationaler Verträge und Übereinkommen, der Grundsätze der Vereinten Nationen oder, falls anwendbar, nationaler Rechtsvorschriften gegen soziale Bestimmungen verstoßen (absolute Zahl und relative Zahl, geteilt durch alle Länder, in die investiert wird) |
| 16b | Anzahl der Länder, in die investiert wird, die nach Maßgabe internationaler Verträge und Übereinkommen, der Grundsätze der Vereinten Nationen oder, falls anwendbar, nationaler Rechtsvorschriften gegen soziale Bestimmungen verstoßen (absolute Zahl und relative Zahl, geteilt durch alle Länder, in die investiert wird) |

Das Dokument wurde von Swisscanto mit geschäftsüblicher Sorgfalt erstellt und kann Informationen aus sorgfältig ausgewählten Drittquellen enthalten. Anleger sollten beachten, dass die zuvor für 2023 berechneten und veröffentlichten Daten für dieses in 2024 veröffentlichte Dokument neu berechnet wurden. Dementsprechend kann es zu Abweichungen bei diesen in den Jahren 2023 und 2024 veröffentlichten historischen Daten kommen.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 01.02.2023 - 31.01.2024

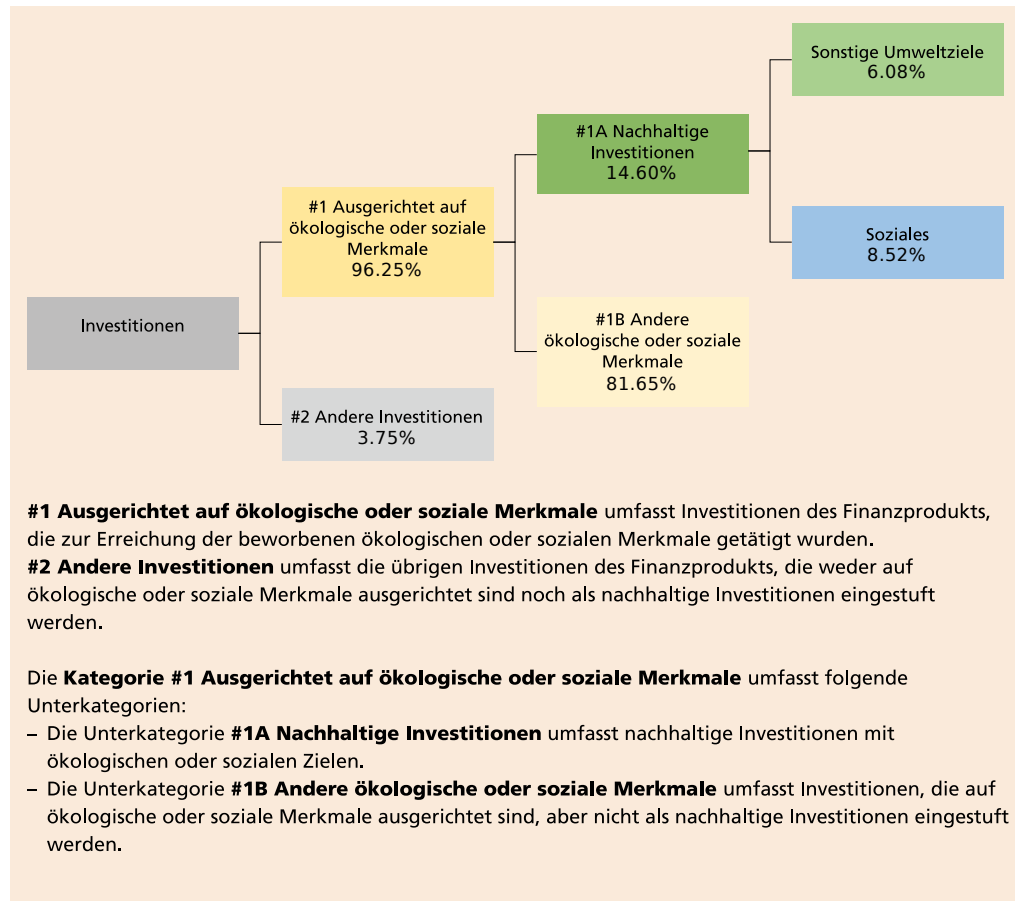
| Grösste Investitionen | Sektor | In % der Vermögenswerte | Land |
|--|------------------------------------|-------------------------|----------------|
| Government of Canada 4.0% 01-JUN-2041 | Financial and Insurance Activities | 1.88% | |
| Government of Canada 5.75% 01-JUN-2033 | Financial and Insurance Activities | 1.84% | |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Emerging Markets Opportunities NT USD Klasse | | 1.64% | |
| Government of Canada 3.5% 01-DEC-2045 | Financial and Insurance Activities | 1.55% | |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Sustainable Global High Yield NT USD Klasse | | 1.49% | |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible COCO NT USD Klasse | | 1.44% | |
| Canada Housing Trust No. 1 3.1% 15-JUN-2028 144A | Financial and Insurance Activities | 1.26% | |
| Government of Canada 3.5% 01-MAR-2028 | Financial and Insurance Activities | 1.26% | |
| Barclays PLC 2.166% 23-JUN-2027 REGS | Financial and Insurance Activities | 1.17% | United Kingdom |
| Morgan Stanley 1.779% 04-AUG-2027 | Financial and Insurance Activities | 1.17% | USA |
| USD Cash | | 1.15% | |
| Bank of Nova Scotia/The 1.4% 01-NOV-2027 | Financial and Insurance Activities | 1.13% | Canada |
| Royal Bank of Canada 2.352% 02-JUL-2024 | Financial and Insurance Activities | 1.08% | Canada |
| Bank of America Corp 3.515% 24-MAR-2026 | Financial and Insurance Activities | 1.07% | USA |
| Government of Canada 2.75% 01-DEC-2048 | Financial and Insurance Activities | 1.07% | |



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Der Anteil an nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen und Angaben zur Vermögensallokation werden in untenstehender Frage beantwortet.

Wie sah die Vermögensallokation aus?



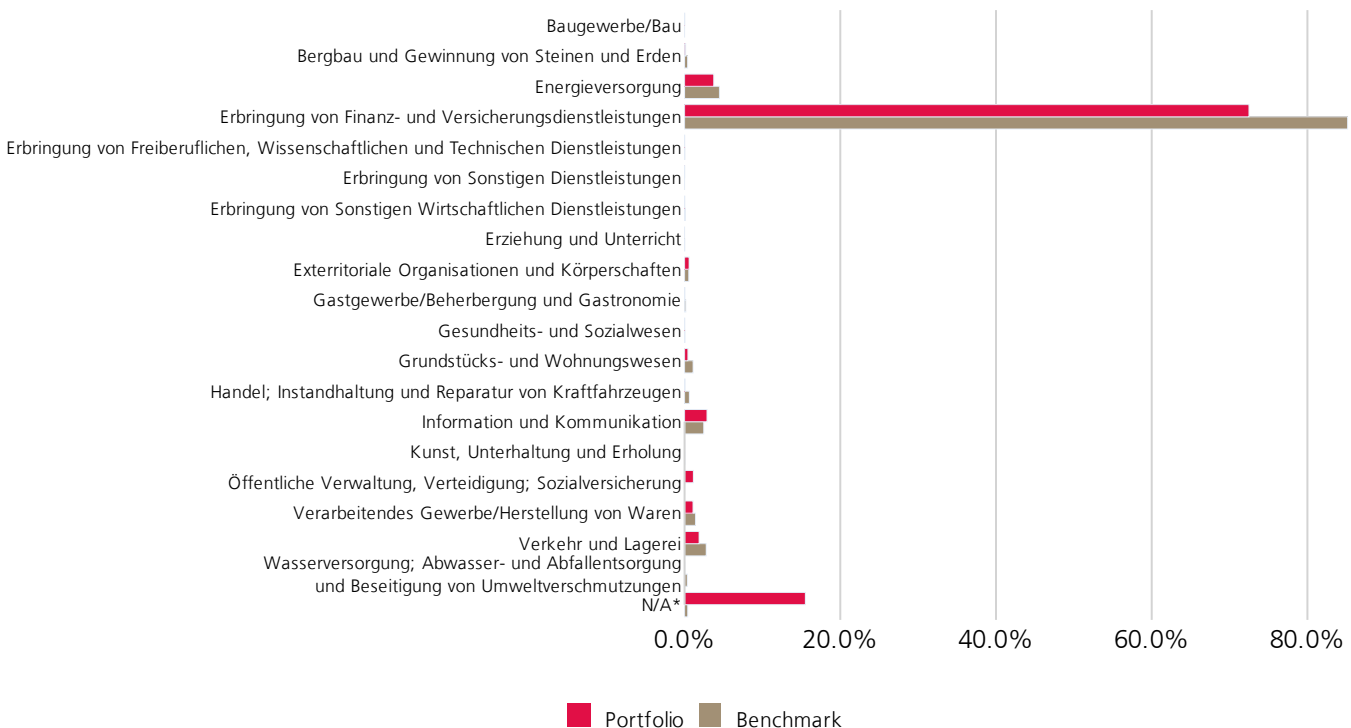
#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.
#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die **Kategorie #1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst nachhaltige Investitionen mit ökologischen oder sozialen Zielen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Wegen mangelnder Datenverfügbarkeit können Subsektoren nicht angezeigt werden.



*Diese Klassifizierung umfasst alle Bestände, für die keine NACE-Klassifizierung gefunden oder geschätzt werden kann; Liquidität ist darin enthalten.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Obwohl keine Investitionen getätigt wurden, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind, wird in untenstehender Grafik die Alignierung der nachhaltigen Investitionen mit der EU-Taxonomie offengelegt.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomeikonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert¹?

Ja

In fossiles Gas

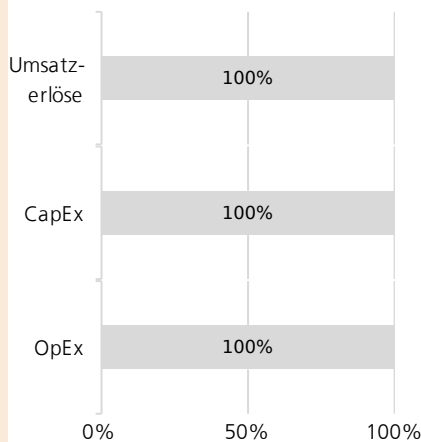
In Kernenergie

Nein

¹Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomeikonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels ("Klimaschutz") beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomeikonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

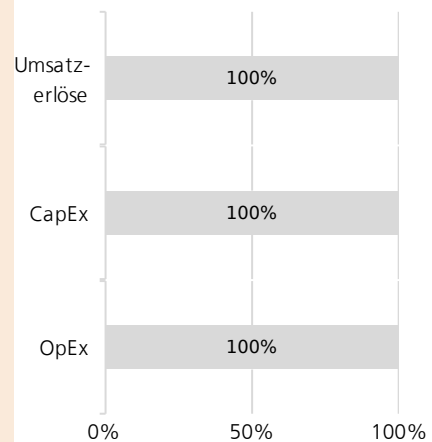
Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomeikonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzproduktes einschliesslich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzproduktes zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.

1. Taxonomiekonformität der Investitionen einschliesslich Staatsanleihen*



- Taxonomiekonform: Fossiles Gas
- Taxonomiekonform: Kernenergie
- Taxonomiekonform: (ohne fossiles Gas und Kernenergie)
- Nicht taxonomiekonform

2. Taxonomiekonformität der Investitionen ohne Staatsanleihen*



- Taxonomiekonform: Fossiles Gas
- Taxonomiekonform: Kernenergie
- Taxonomiekonform: (ohne fossiles Gas und Kernenergie)
- Nicht taxonomiekonform

Diese Grafik gibt 41.4% der Gesamtinvestitionen wieder.

*Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff "Staatsanleihen" alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Mit Blick auf die EU-Taxonomeikonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf erneuerbare Energie oder CO2-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO2-armen Alternativen gibt und die Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomeikonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:
- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

Investitionsausgaben (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, z.B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft
- **Betriebsausgaben** (Opex), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Angaben zu Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten werden in der Tabelle zusammengefasst. Wenn keine Angaben verfügbar sind, wird die Tabelle ebenfalls keine Angaben enthalten.

| Issuer Name | Nace Sektor | Total Eligible Activity Revenue | Total Aligned Revenue | Total Likely Aligned Revenue | Total Potentially Aligned Revenue | Portfolio Gewicht (Consol.) |
|-----------------------------|---|---------------------------------|-----------------------|------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------|
| Orsted | Electricity, Gas, Steam and Air Conditioning Supply | 56.27% | 18.25% | 31.86% | 0.00% | 0.00% |
| EDP-Energias de Portugal SA | Electricity, Gas, Steam and Air Conditioning Supply | 77.52% | 12.25% | 0.00% | 32.43% | 0.00% |
| SPIE SA | Professional, Scientific and Technical Activities | 83.99% | 11.50% | 13.95% | 0.00% | 0.01% |
| Electricite de France SA | Electricity, Gas, Steam and Air Conditioning Supply | 71.56% | 9.50% | 0.00% | 7.23% | 0.00% |
| Iberdrola Finanzas SA | Electricity, Gas, Steam and Air Conditioning Supply | 61.60% | 9.13% | 0.00% | 15.60% | 0.00% |
| Iberdrola International BV | Electricity, Gas, Steam and Air Conditioning Supply | 61.60% | 9.13% | 0.00% | 15.60% | 0.00% |
| Veolia Environnement SA | Water Supply, Sewerage, Waste Management and Remediation Activities | 68.52% | 8.28% | 30.01% | 0.00% | 0.01% |
| Pirelli & C. S.p.A. | Manufacturing | 15.75% | 6.25% | 0.00% | 0.00% | 0.00% |
| Enel SpA | Electricity, Gas, Steam and Air Conditioning Supply | 33.21% | 5.35% | 0.00% | 8.48% | 0.00% |
| Schneider Electric SE | Manufacturing | 18.50% | 5.00% | 0.00% | 0.00% | 0.02% |

Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

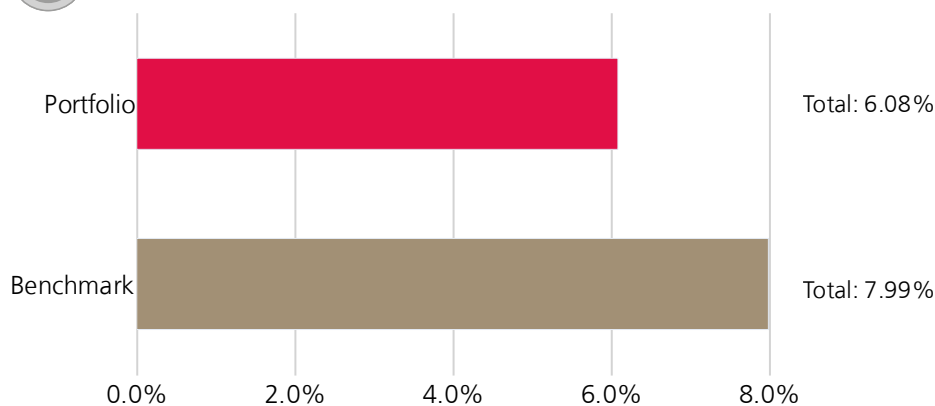
Da im vorangegangenen Berichtsjahr keine Daten verfügbar waren, erübrigt sich ein Vorjahresvergleich.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



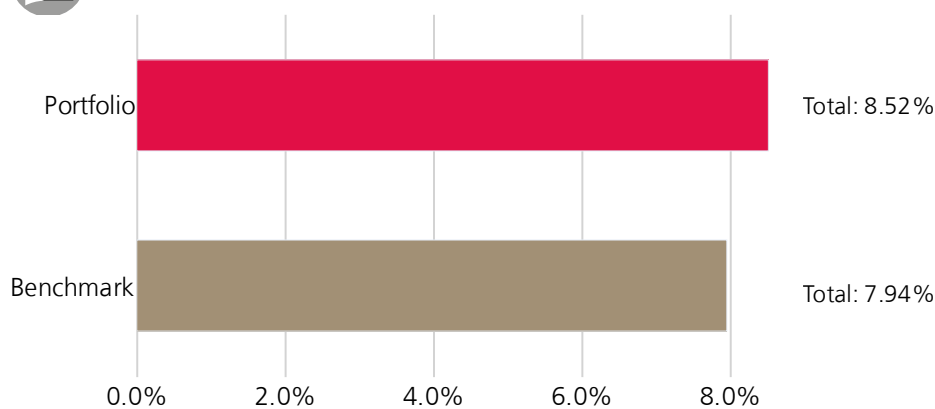
Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?



Das Diagramm zeigt die prozentualen Umsätze der im Portfolio des Fonds enthaltenen Unternehmungen und der der Benchmark, welche nicht EU-Taxonomie konform, jedoch im Einklang mit den sich aus den SDGs ergebenden Umweltzielen gemäss Art. 2 (17) SFDR investiert worden sind.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?



Das Diagramm zeigt die prozentualen Umsätze der im Portfolio des Fonds enthaltenen Unternehmungen und der der Benchmark, welche nicht EU-Taxonomie konform, jedoch im Einklang mit den sich aus den SDGs ergebenden sozialen Zielen gemäss Art. 2 (17) SFDR investiert worden sind.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Diese Vermögenswerte haben die in der spezifischen Anlagepolitik vorgesehenen Anlagen umfasst, einschliesslich Derivate zu Absicherungszwecken und flüssige Mittel. Die Anlagen, ausgenommen Derivate und flüssige Mittel, haben die Grundsätze des ökologischen oder sozialen Mindestschutzes umgesetzt.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Im Berichtszeitraum förderte der Vermögensverwalter durch Investment Stewardship und Kapitalallokation nachhaltige Geschäftspraktiken und die Einhaltung anerkannter internationaler Prinzipien und ESG-Best-Practice-Standards. Dementsprechend stand er im Dialog mit den Managementteams der investierten Unternehmen. Darüber hinaus hat er sich im Rahmen der United Nations Collaboration Platform for Responsible Investment (UN PRI) und bei Investoreninitiativen engagiert. Das Abstimmungsverhalten basierte auf den schweizerischen und internationalen Corporate-Governance-Regeln sowie auf den Prinzipien des UN Global Compact und den 17 Zielen für nachhaltige Entwicklung (UN SDGs). Weitere Informationen finden Sie unter: Swisssanto | Proxy Voting Dashboard (issgovernance.com) <https://www.swisssanto.com/int/de/nachhaltigkeit/investment-stewardship.html>

Swisssanto | Proxy Voting Dashboard (issgovernance.com)

<https://www.swisssanto.com/int/de/nachhaltigkeit/investment-stewardship.html>



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Es wurde kein Index als Referenzwert bestimmt, um festzustellen, ob dieses Finanzprodukt auf die beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet ist.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?

Nicht anwendbar.

Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?

Nicht anwendbar.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?

Nicht anwendbar.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?

Nicht anwendbar.

Das Dokument wurde von Swisssanto mit geschäftsüblicher Sorgfalt erstellt und kann Informationen aus sorgfältig ausgewählten Drittquellen enthalten. Anleger sollten beachten, dass die zuvor für 2023 berechneten und veröffentlichten Daten für dieses in 2024 veröffentlichte Dokument neu berechnet wurden. Dementsprechend kann es zu Abweichungen bei diesen in den Jahren 2023 und 2024 veröffentlichten historischen Daten kommen.



Regelmässige Information zum 31.01.2024

Regelmässige Informationen zu den in Artikel 8, Absätze 1, 2, 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts:

Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible CHF

Unternehmenskennung (LEI-Code):

5493008SXJPFYX70JQ61

Benchmark

Swiss Bond Index® Foreign AAA-BBB (TR) in CHF

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. In dieser Verordnung ist kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten festgelegt. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

| Ja | | Nein | |
|--------------------------|---|-------------------------------------|---|
| <input type="checkbox"/> | Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: _ % | <input checked="" type="checkbox"/> | Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 25.82% an nachhaltigen Investitionen |
| <input type="checkbox"/> | in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind | <input type="checkbox"/> | mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind |
| <input type="checkbox"/> | in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind | <input checked="" type="checkbox"/> | mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind |
| <input type="checkbox"/> | Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: _ % | <input checked="" type="checkbox"/> | mit einem sozialen Ziel |
| <input type="checkbox"/> | | <input type="checkbox"/> | Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt. |



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die von dem Teilfonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale wurden durch folgende Aktivitäten erreicht:

1. Ausschlusskriterien
2. ESG-Integration
3. Reduktion der CO₂e-Intensität
4. Nachhaltige Investitionen





Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Aus Übersichtsgründen werden die Angaben zur Performance (siehe Details am Ende des Reports) der Nachhaltigkeitsindikatoren direkt mit dem historischen Vergleich in der nächsten Frage beantwortet.

...und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Ausschlusskriterien

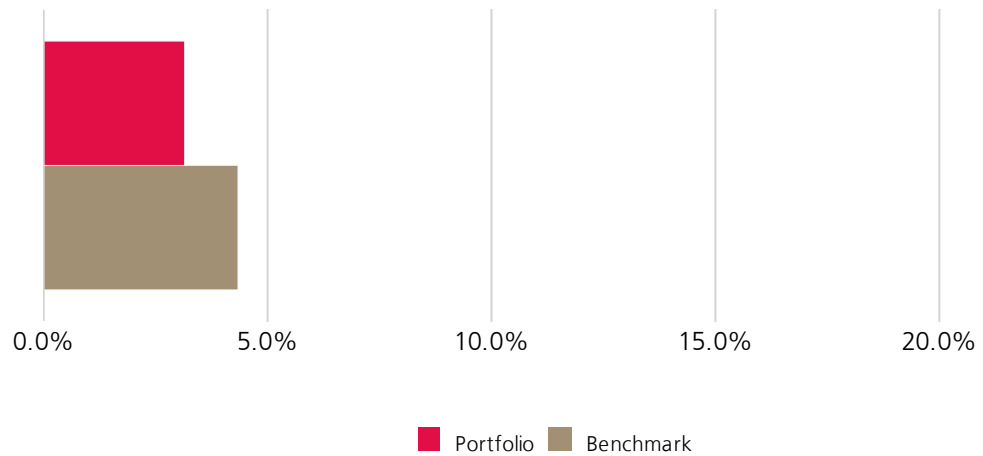
| Responsible | | | | | | | |
|--|-------------------|--|------------------------------|---|-------------------|-------------------|------------------------------|
| Kriterien | Gewicht Portfolio | Gewicht Benchmark | Anzahl Unternehmen Benchmark | Kriterien | Gewicht Portfolio | Gewicht Benchmark | Anzahl Unternehmen Benchmark |
|  Förderung von Kohle (> 5% Umsatz) | 0.00% | 0.14% | 0 |  UN Global Compact Verstöße | 0.00% | 0.66% | 1 |
| Kohlereserven (ex. Metalproduktion) | 0.00% | 0.00% | 0 | Ausbeuterische Kinderarbeit | 0.00% | 0.28% | 1 |
|  Klimawandel | |  Gefährdung von Gesellschaft und Gesundheit | | Herstellung von Kriegstechnik (> 5% Umsatz) | 0.00% | 0.00% | 0 |
| | | | | Herstellung von Pornografie | 0.00% | 0.00% | 0 |
| | | | | Herstellung von Waffen & Munition | 0.00% | 0.00% | 0 |
| | | | | Kontroverse Waffen | 0.00% | 0.00% | 0 |

Zwecks Minderung der Nachhaltigkeitsrisiken und mit dem Ziel, nicht in Wertpapiere der oben aufgeführten kontroversen Geschäftsmodellen zu investieren, sind die oben genannten Ausschlusskriterien angewendet worden. Die Tabelle zeigt die Anzahl der Unternehmen, die gegen die Ausschlusskriterien verstossen haben, sowie die jeweilige Portfolio- und Benchmark-Exposition. Liegen bei einem Unternehmen mehrere Verstöße vor, werden diese für jedes Kriterium separat aufgeführt. Daher ist die Summe aller Positionen in diesem Bericht in der Regel höher als die effektive Allokation zu den oben abgebildeten Kriterien. Die historischen Vergleiche werden in nachfolgender Tabelle gemacht. Aus Übersichtsgründen werden die Ausschlusskriterien aggregiert.

| | Indikator | Datum 2023 | Datum 2024 |
|-----------|----------------------------|------------|------------|
| Portfolio | Ausschlusskriterien Total* | 0% | 0% |
| Benchmark | Ausschlusskriterien Total* | 1% | 0.94% |

*alle Ausschlusskriterien kumuliert.

ESG-Integration

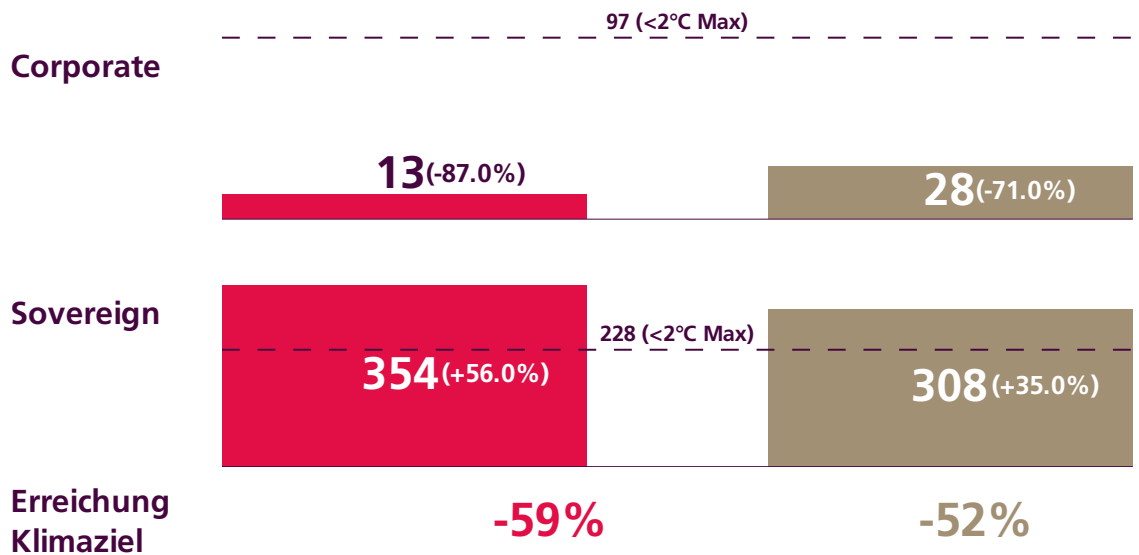


Das Portfolio strebte in der Berichtsperiode im Vergleich zur Benchmark eine geringere Exposition zu ESG-Laggards an. ESG-Laggards sind Unternehmungen mit der schwächsten Umwelt-, Sozial und Governance- Performance des relevanten Anlageuniversums.

Die historischen Vergleiche werden in nachfolgender Tabelle gemacht.

| | Indikator | Datum 2023 | Datum 2024 |
|-----------|----------------------------|------------|------------|
| Portfolio | Exposition zu ESG Laggards | 3.4% | 3.15% |
| Benchmark | Exposition zu ESG Laggards | 7.03% | 4.34% |

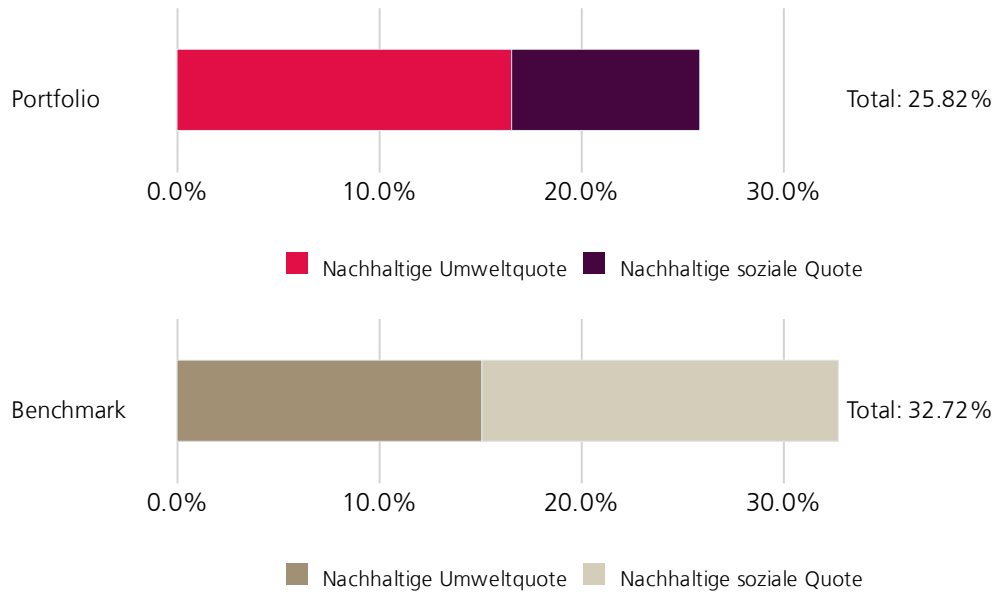
Reduktion der CO₂e-Intensität



Im Einklang mit dem < 2° Pariser Klimaziel ("<2°C Max") zielte die Investitionstätigkeit des Fonds während der Berichtsperiode darauf ab, die CO₂e-Emissionen des Portfolios, um mindestens 4 % pro Jahr zu reduzieren. Der Absenkpfad berechnet sich aus den gewichteten CO₂e-Intensitäten der Benchmark, diskontiert mit 4 % pro Jahr zuzüglich des realen Wirtschaftswachstums. Die gestrichelten 2° Max-Linie zeigt den Maximalwert an. Die Balken stellen die CO₂e-Intensitäten des Portfolios und der Benchmark dar. CO₂e-Intensitäten unterhalb der 2° Max-Linie zeigen an, dass das Portfolio oder die Benchmark das <2°-Klimaziel erfüllen. Werte bei "Erreichung Klimaziel" setzen das Portfolio und die Benchmark in Relation zum Klimaziel. Negative Werte bedeuten, dass das Ziel erreicht wurde. Die historischen Vergleiche werden in nachfolgender Tabelle gemacht.

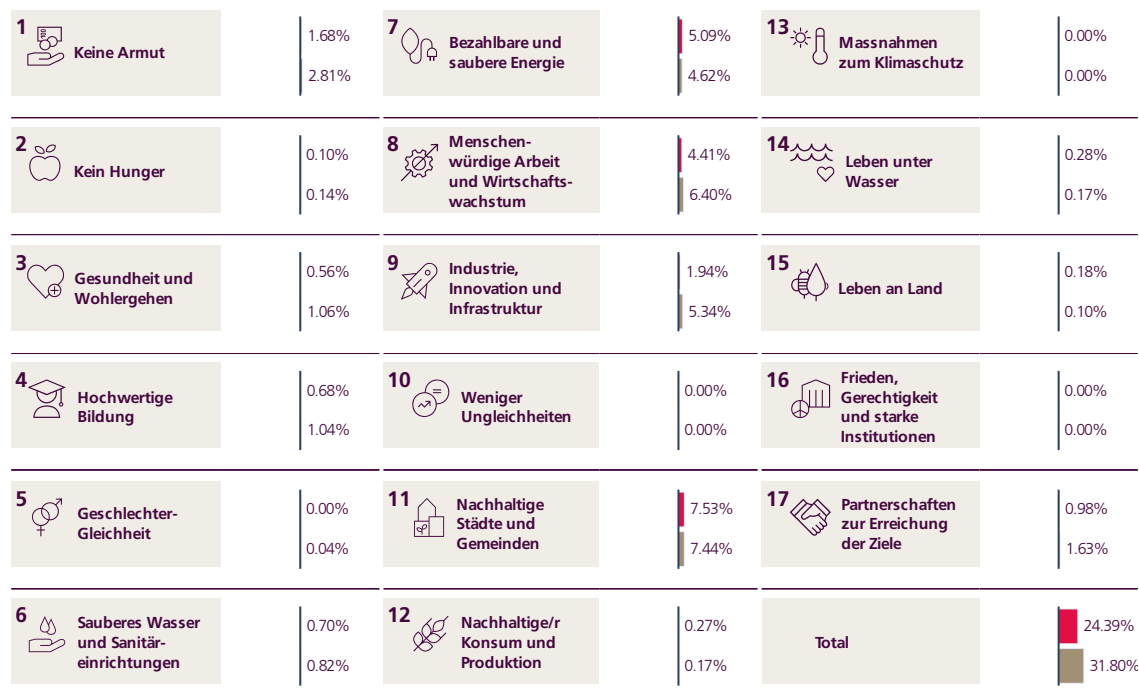
| | Indikator | Datum 2023 | Datum 2024 |
|-----------|--|------------|------------|
| Portfolio | CO ₂ e-Intensität Corporate | 20 | 13 |
| | CO ₂ e-Intensität Sovereign | 328 | 354 |
| | Erreichung Klimaziel | -61% | -59% |
| | Reduktion Corporate | -81% | -87% |
| | Reduktion Sovereign | 32% | 56% |
| Benchmark | CO ₂ e-Intensität Corporate | 64 | 28 |
| | CO ₂ e-Intensität Sovereign | 310 | 308 |
| | Erreichung Klimaziel | -27% | -52% |
| | Reduktion Corporate | -40% | -71% |
| | Reduktion Sovereign | 25% | 35% |

Nachhaltige Investitionen



Das Diagramm zeigt die prozentualen Umsätze der im Portfolio des Fonds enthaltenen Unternehmungen und der der Benchmark, welche nicht EU-Taxonomie konform, jedoch im Einklang mit den sich aus den UN Sustainable Development Goals (SDGs) ergebenden Umwelt- und sozialen Zielen gemäss Art. 2 (17) SFDR investiert worden sind. Der Fonds hat keine Investitionen in ökologisch nachhaltige Aktivitäten im Sinne der EU Taxonomie-Verordnung angestrebt. Der Investmentmanager des (Teil-)Fonds hat eine Methodologie zur Definition nachhaltiger Investitionen entwickelt, die den Anforderungen des Art. 2 (17) SFDR entspricht. Die Methodologie ist detailliert in den Vorvertraglichen Informationen beschrieben. Die Aufteilung der nachhaltigen Investitionen in UN SDGs werden in folgender Grafik gemacht. Die historischen Vergleiche werden in nachfolgender Tabelle gemacht.

| | Indikator | Datum 2023 | Datum 2024 |
|-----------|---|------------|------------|
| Portfolio | Anteil nachhaltige Investitionen mit Umweltziel | 11.5% | 16.55% |
| | Anteil sozial nachhaltige Investitionen | 12.69% | 9.27% |
| | Total nachhaltige Quote | 24.19% | 25.82% |
| Benchmark | Anteil nachhaltige Investitionen mit Umweltziel | 11.92% | 15.12% |
| | Anteil sozial nachhaltige Investitionen | 18.32% | 17.6% |
| | Total nachhaltige Quote | 30.24% | 32.72% |



■ Portfolio
 ■ Benchmark

Aufgrund der unterschiedlichen Behandlung von Green, Social und Sustainable Bonds kann das SDG-Exposure von den prozentualen Umsätzen der im Portfolio des Fonds enthaltenen Unternehmungen und den der Benchmark, welche im Einklang mit den sich aus den SDGs ergebenden Umweltzielen gemäss Art. 2 (17) SFDR investiert worden sind, abweichen.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Im Berichtszeitraum konzentrierte sich der Vermögensverwalter auf Wertpapiere von Unternehmen, welche Umsätze aus dem Verkauf von Produkten und Dienstleistungen mit einem positiven Beitrag zu den 17 SDGs erzielten und dabei keine DNSH- und/oder Minimum Safeguards-Verletzungen aufgewiesen haben.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Emittenten mit einem negativen Nettobeitrag zu den SDGs wurden in der Berichtsperiode aus dem Anlageuniversum des Finanzproduktes entfernt. Darüber hinaus berücksichtigte der Teilfonds nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (engl: Principal Adverse Impacts - PAI). Zu diesem Zweck wurden die obligatorischen Indikatoren Anhang 1 der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1288 zur Ergänzung der Verordnung (EU) 2019/2088 zugrunde gelegt. Unternehmen, die der Vermögensverwalter gemäss PAI als besonders schädlich einstufte, wurden entsprechend nicht zu den nachhaltigen Anlagen gezählt. Emittenten, welche die PAls 7 (Biodiversität), 10 (Global Compact der Vereinten Nationen (UNGC)/OECD Leitsätze für multinationale Unternehmen) oder 14 (Engagement in umstrittenen Waffen) verletzen, haben einen PAI-Score von null erhalten. Aus den restlichen PAI-Indikatoren wurde ein PAI-Score berechnet. Instrumente von Emittenten mit einem Score < 10 wurden nicht den nachhaltigen Investitionen angerechnet.

● **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Die nachteiligen Auswirkungen (PAI) sind systematisch im Anlageprozess berücksichtigt worden.

● **Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:**

Bei der Anlageanalyse für nachhaltige Investitionen wurden in der Berichtsperiode die folgenden Normverletzungen berücksichtigt: Global Compact der Vereinten Nationen (UNGC), die UN Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte (UNGP) und das Übereinkommen der Internationalen Arbeitsorganisation (ILO). Jeder schwerwiegende Verstoß gegen diese Normen führte zum Ausschluss des Emittenten aus dem investierbaren Universum des Finanzprodukts.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

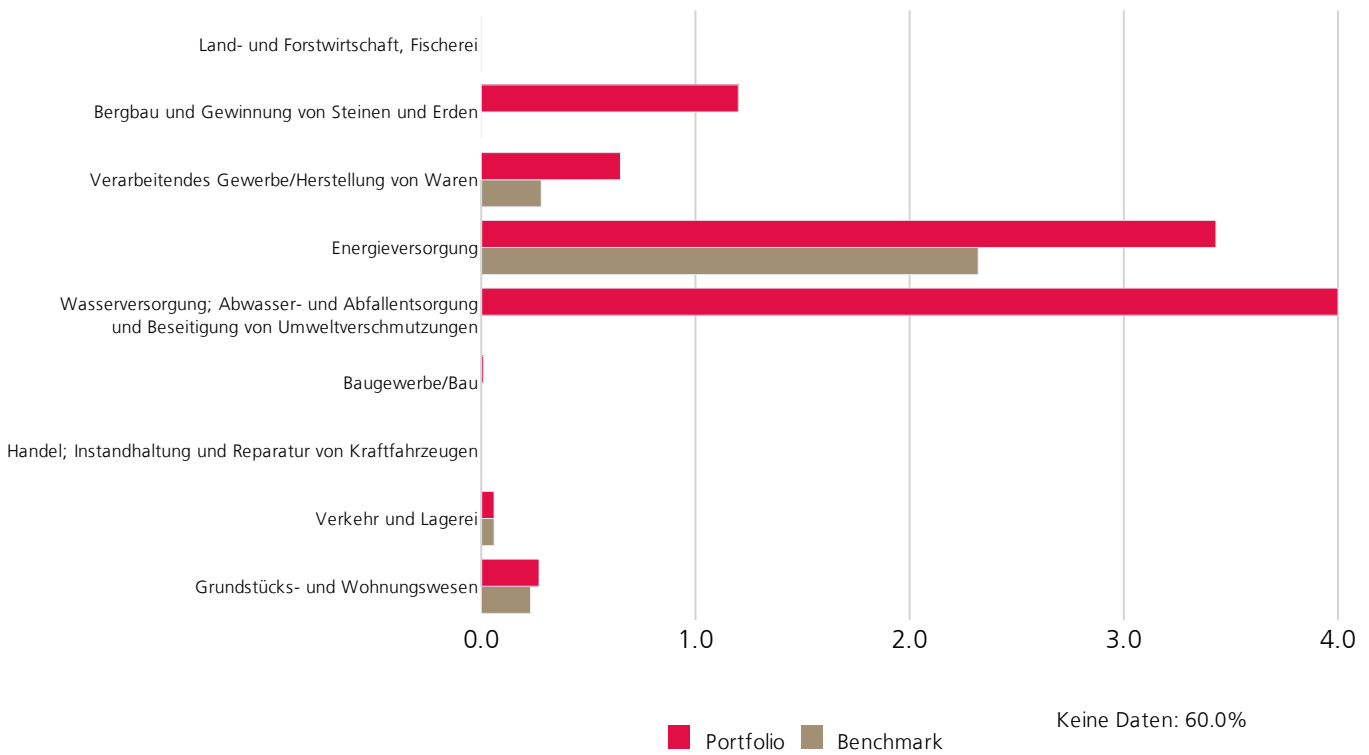
Nachteilige Nachhaltigkeitsauswirkungen (PAI) – Corporate Anlagen

Primäre Indikatoren - Energie und Emissionen

| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Benchmark Aktuell | Benchmark Vorjahr | Erklärung |
|--|--|-------------------|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|-----------|
| 1. THG-Emissionen | 1a. GHG Emissions - Scope 1 per Mio EUR Enterprise Value | 1692.32 | 62.61% | 872.34 | 3794.57 | 3051.11 | |
| | 1b. GHG Emissions - Scope 2 per Mio EUR Enterprise Value | 787.76 | 62.61% | 634.9 | 1177.06 | 882.84 | |
| | 1c. GHG Emissions - Scope 3 per Mio EUR Enterprise Value | 16483.5 | 62.61% | 10175.8 | 34912.5 | 28901.4 | |
| 2. CO ₂ -Fussabdruck | 2. GHG Emissions - Scope 1+2+3 per Mio EUR Enterprise Value | 82.05 | 62.61% | 54.47 | 174.78 | 153.4 | |
| 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird | 3. GHG Emissions - Emissions Intensity - Total Emissions (EUR) | 29.43 | 67.08% | 32.27 | 54.64 | 67.38 | |
| 4. Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind | 4. Fossil Fuel - Involvement (PAI) | 1.28% | 65.99% | 0.21% | 4.01% | 3.95% | |

| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Benchmark Aktuell | Benchmark Vorjahr | Erklärung |
|--|--|-------------------|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|---|
| 5. Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen | 5a. CR Raw - Energy use - Coal/nuclear/undear energy sources | 66.97% | 3.45% | 80.38% | 65.7% | 60.42% | |
| | 5b. Non-renewable energy consumption | 65.22% | 11.12% | 90.62% | 58.3% | 79.26% | Der Verbrauch nicht-erneuerbarer Energie umfasst den Verbrauch von Energie, die aus nicht-erneuerbaren Quellen erzeugt wird, sowie den Verbrauch von Energie aus Biomasse. Alle Zahlen zum Energieverbrauch, bei denen die Energiequelle unklar ist, sind ebenfalls in diesem Faktor enthalten. |
| | 5c. Non-renewable energy production | 0.89% | 65.8% | 0.06% | 2.55% | 2.47% | |
| 6. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren | 6. Energy consumption intensity (GWh/mEUR) | 0.1 | 35.76% | 0.04 | 0.11 | 0.08 | |

Intensität des Energieverbrauchs pro High Impact Sector (pro Mio. EUR)



| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Benchmark Aktuell | Benchmark Vorjahr | Erklärung |
|---|--|-------------------|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|-----------|
| 7. Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken | 7. Companies negatively affecting biodiversity-sensitive areas | 0% | 66,34% | 0% | 0% | 0% | |
| 8. Emissionen in Wasser | 8. CR Raw - COD emissions | 4.08 | 0.13% | 0.62 | 0 | 6.3 | |
| 9. Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle | 9. CR Raw - Hazardous waste | 0.01 | 4.23% | 0 | 0 | 0 | |

| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Benchmark Aktuell | Benchmark Vorjahr | Erklärung |
|--|--|-------------------|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|-----------|
| 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | 10. UNGC / OECD Guidelines Violation | 0% | 66.34% | 0% | 65.64% | 52.84% | |
| 11. Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen | 11. Lack of processes monitoring UNGC and OECD Guidelines compliance | 7.27% | 53% | 3.31% | 7.14% | 3.61% | |
| 12. Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle | 12. Unadjusted gender pay gap | 0.91% | 8.38% | 0.61% | 0.69% | 0.65% | |
| 13. Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen | 13. Ratio of female to male board members | 73.18% | 40.19% | 63.46% | 74.37% | 69.99% | |
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) | 14. Controversial weapons involvement (APM, CM, Bio, Chem) | 0% | 66.34% | 0% | 0% | 0% | |

Nachteilige Nachhaltigkeitsauswirkungen (PAI) – Staatliche und Supranationale Vermögenswerte

Primäre Indikatoren

| Umwelt | | | | | | | |
|--------------------|-------------------|-------------------|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|-----------|
| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Benchmark Aktuell | Benchmark Vorjahr | Erklärung |
| 15. GHG Intensität | 15. GHG Intensity | 397.1 | 18.04% | 382.29 | 339.42 | 342.03 | |

| Sozial | | | | | | | |
|--|---|-------------------|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|-----------|
| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Benchmark Aktuell | Benchmark Vorjahr | Erklärung |
| 16. Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen | 16a. Countries subject to social violations (#) | 16 | 0.69% | 12.5 | 0 | 0 | |
| | 16b. Countries subject to social violations (%) | 26.23% | 0.69% | 23.8% | 0% | 0% | |

| Indikator | Metrik |
|-----------|---|
| 1a | Scope-1-Treibhausgas-Emissionen |
| 1b | Scope-2-Treibhausgas-Emissionen |
| 1c | Scope-3-Treibhausgas-Emissionen |
| 2. | CO2-Fussabdruck pro Mio EUR |
| 3. | THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird |
| 4. | Anteil der Investitionen in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind |
| 5a | Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung der Unternehmen, in die investiert wird, aus nicht erneuerbaren Energiequellen im Vergleich zu erneuerbaren Energiequellen, ausgedrückt in Prozent der gesamten Energiequellen |
| 5b | Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung der Unternehmen, in die investiert wird, aus nicht erneuerbaren Energiequellen im Vergleich zu erneuerbaren Energiequellen, ausgedrückt in Prozent der gesamten Energiequellen |
| 5c | Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung der Unternehmen, in die investiert wird, aus nicht erneuerbaren Energiequellen im Vergleich zu erneuerbaren Energiequellen, ausgedrückt in Prozent der gesamten Energiequellen |
| 6. | Energieverbrauch in GWh pro einer Million EUR Umsatz der Unternehmen, in die investiert wird, aufgeschlüsselt nach klimaintensiven Sektoren |
| 7. | Anteil der Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird, mit Standorten/Betrieben in oder in der Nähe von Gebieten mit schutzbedürftiger Biodiversität, sofern sich die Tätigkeiten dieser Unternehmen nachteilig auf diese Gebiete auswirken |
| 8. | Tonnen Emissionen in Wasser, die von den Unternehmen, in die investiert wird, pro investierter Million EUR verursacht werden, ausgedrückt als gewichteter Durchschnitt |
| 9. | Tonnen gefährlicher und radioaktiver Abfälle, die von den Unternehmen, in die investiert wird, pro investierter Million EUR erzeugt werden, ausgedrückt als gewichteter Durchschnitt |
| 10. | Anteil der Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird, die an Verstößen gegen die UNGC-Grundsätze oder gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen beteiligt waren |
| 11. | Anteil der Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird, die keine Richtlinien zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen oder keine Verfahren zur Bearbeitung von Beschwerden wegen Verstößen gegen die UNGC-Grundsätze und OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen eingerichtet haben |
| 12. | Durchschnittliches unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle bei den Unternehmen, in die investiert wird |
| 13. | Durchschnittliches Verhältnis von Frauen zu Männern in den Leitungs- und Kontrollorganen der Unternehmen, in die investiert wird, ausgedrückt als Prozentsatz aller Mitglieder der Leitungs- und Kontrollorgane |
| 14. | Anteil der Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird, die an der Herstellung oder am Verkauf von umstrittenen Waffen beteiligt sind |
| 15. | THG-Emissionsintensität der Länder, in die investiert wird |
| 16a | Anzahl der Länder, in die investiert wird, die nach Maßgabe internationaler Verträge und Übereinkommen, der Grundsätze der Vereinten Nationen oder, falls anwendbar, nationaler Rechtsvorschriften gegen soziale Bestimmungen verstoßen (absolute Zahl und relative Zahl, geteilt durch alle Länder, in die investiert wird) |
| 16b | Anzahl der Länder, in die investiert wird, die nach Maßgabe internationaler Verträge und Übereinkommen, der Grundsätze der Vereinten Nationen oder, falls anwendbar, nationaler Rechtsvorschriften gegen soziale Bestimmungen verstoßen (absolute Zahl und relative Zahl, geteilt durch alle Länder, in die investiert wird) |

Das Dokument wurde von Swisscanto mit geschäftsüblicher Sorgfalt erstellt und kann Informationen aus sorgfältig ausgewählten Drittquellen enthalten. Anleger sollten beachten, dass die zuvor für 2023 berechneten und veröffentlichten Daten für dieses in 2024 veröffentlichte Dokument neu berechnet wurden. Dementsprechend kann es zu Abweichungen bei diesen in den Jahren 2023 und 2024 veröffentlichten historischen Daten kommen.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 01.02.2023 - 31.01.2024

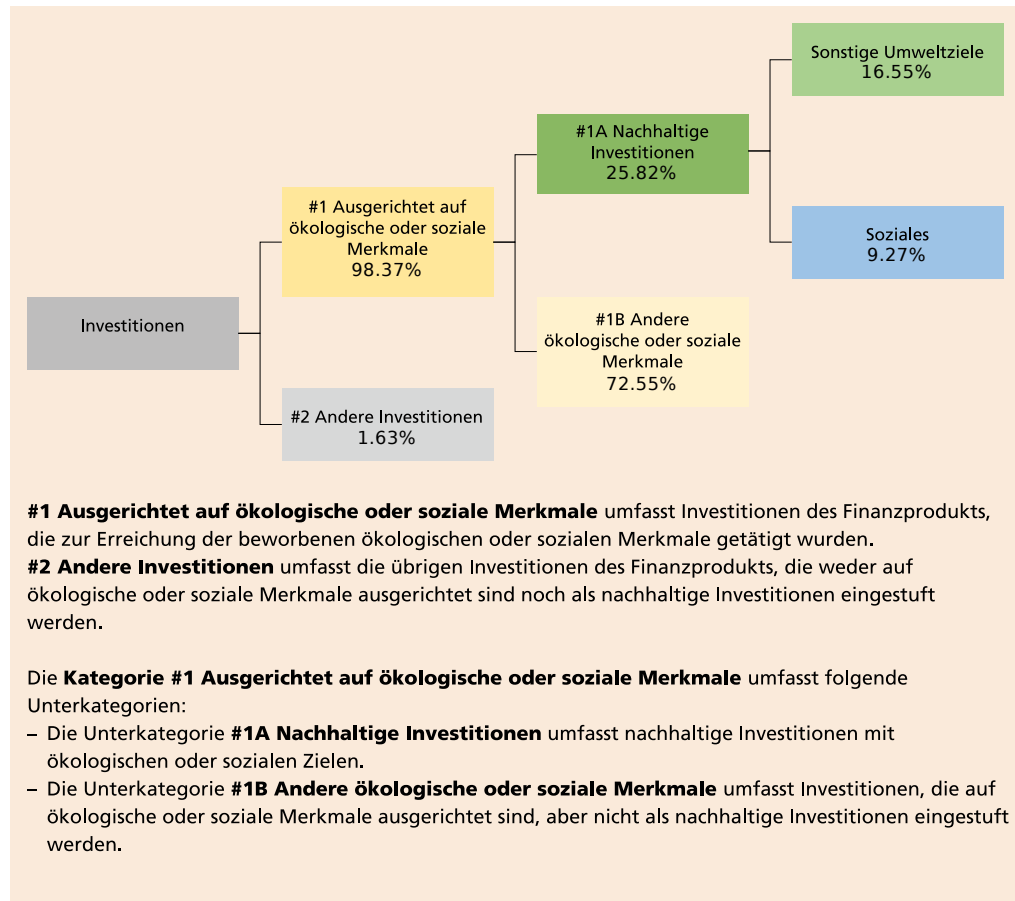
| Grösste Investitionen | Sektor | In % der Vermögenswerte | Land |
|---|---|-------------------------|-------------|
| Agence Francaise de Developpement 1.875% 12-NOV-2029 | Financial and Insurance Activities | 2.49% | France |
| Muenchener Hypothekenbank eG 0.5% 14-JUN-2028 REGS | Financial and Insurance Activities | 2.06% | Germany |
| Reseau Ferre de France EPIC 2.625% 11-MAR-2037 | Transporting and Storage | 2.03% | France |
| Oesterreichische Kontrollbank AG 2.875% 25-FEB-2030 REGS | Financial and Insurance Activities | 2.02% | Austria |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Emerging Markets Opportunities NTH CHF Klasse | | 1.93% | |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Sustainable Global High Yield NTH CHF Klasse | | 1.89% | |
| Metropolitan Life Global Funding I 0.125% 25-SEP-2028 REGS | Financial and Insurance Activities | 1.67% | USA |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible COCO NTH CHF Klasse | | 1.62% | |
| Bank of Nova Scotia/The 0.278% 01-APR-2027 REGS | Financial and Insurance Activities | 1.52% | Canada |
| Corp Andina de Fomento 0.45% 24-FEB-2027 REGS | Activities of Extraterritorial Organisations and Bodies | 1.41% | Venezuela |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible Corporate Hybrid NTH CHF Klasse | | 1.39% | |
| St Galler Kantonalbank AG 1.7% PERP REGS | Financial and Insurance Activities | 1.36% | Switzerland |
| Bank of America Corp 0.2525% 12-JUN-2026 REGS | Financial and Insurance Activities | 1.32% | USA |
| Canadian Imperial Bank of Commerce 0.05% 15-OCT-2026 REGS | Financial and Insurance Activities | 1.29% | Canada |
| Credit Agricole SA 2.5075% 27-APR-2027 | Financial and Insurance Activities | 1.29% | France |



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

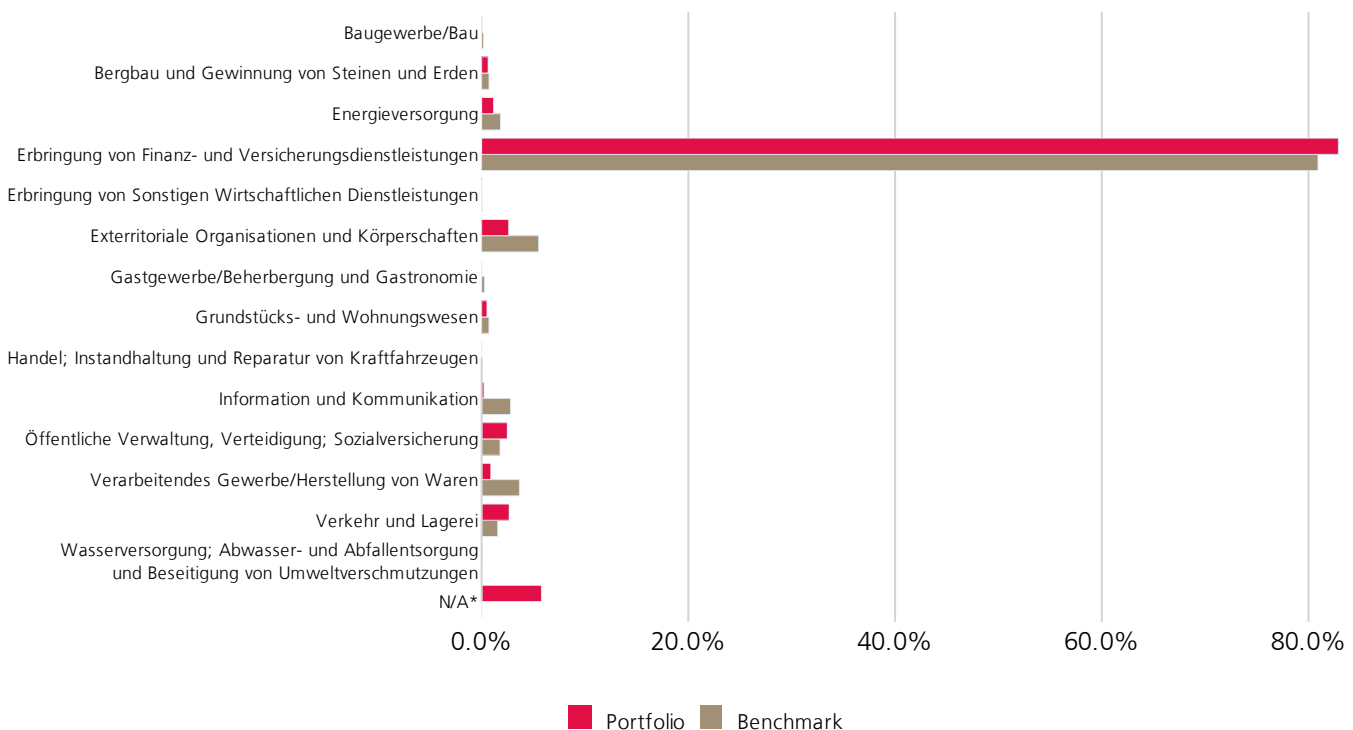
Der Anteil an nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen und Angaben zur Vermögensallokation werden in untenstehender Frage beantwortet.

Wie sah die Vermögensallokation aus?



In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Wegen mangelnder Datenverfügbarkeit können Subsektoren nicht angezeigt werden.



*Diese Klassifizierung umfasst alle Bestände, für die keine NACE-Klassifizierung gefunden oder geschätzt werden kann; Liquidität ist darin enthalten.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Obwohl keine Investitionen getätigt wurden, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind, wird in untenstehender Grafik die Alignment der nachhaltigen Investitionen mit der EU-Taxonomie offengelegt.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomeikonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert¹?

Ja

In fossiles Gas

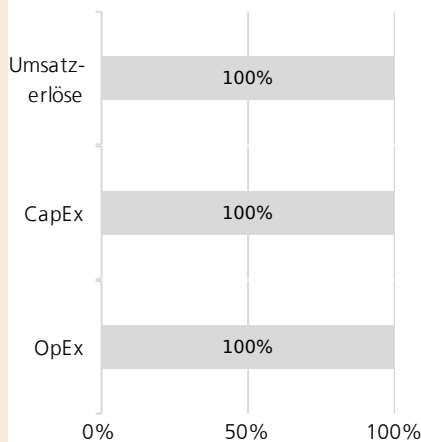
In Kernenergie

Nein

¹Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomeikonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels ("Klimaschutz") beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomeikonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

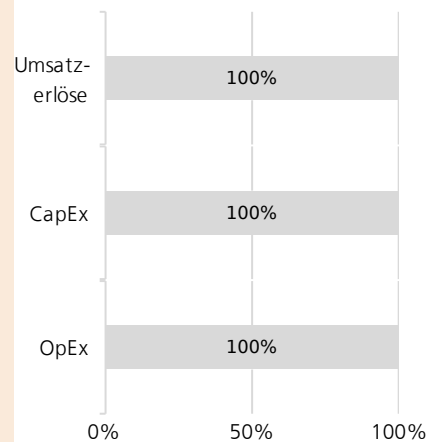
Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomeikonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzproduktes einschliesslich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzproduktes zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.

1. Taxonomiekonformität der Investitionen einschliesslich Staatsanleihen*



- Taxonomiekonform: Fossiles Gas
- Taxonomiekonform: Kernenergie
- Taxonomiekonform: (ohne fossiles Gas und Kernenergie)
- Nicht taxonomiekonform

2. Taxonomiekonformität der Investitionen ohne Staatsanleihen*



- Taxonomiekonform: Fossiles Gas
- Taxonomiekonform: Kernenergie
- Taxonomiekonform: (ohne fossiles Gas und Kernenergie)
- Nicht taxonomiekonform

Diese Grafik gibt **80.8%** der Gesamtinvestitionen wieder.

*Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff "Staatsanleihen" alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Mit Blick auf die EU-Taxonomeikonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf erneuerbare Energie oder CO2-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO2-armen Alternativen gibt und die Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomeikonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:
- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

Investitionsausgaben (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, z.B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft
- **Betriebsausgaben** (Opex), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Angaben zu Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten werden in der Tabelle zusammengefasst. Wenn keine Angaben verfügbar sind, wird die Tabelle ebenfalls keine Angaben enthalten.

| Issuer Name | Nace Sektor | Total Eligible Activity Revenue | Total Aligned Revenue | Total Likely Aligned Revenue | Total Potentially Aligned Revenue | Portfolio Gewicht (Consol.) |
|-----------------------------|---|---------------------------------|-----------------------|------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------|
| Elia Group SA/NV | Construction | 99.98% | 24.95% | 15.00% | 0.00% | 0.02% |
| Terna S.p.A. | Electricity, Gas, Steam and Air Conditioning Supply | 87.76% | 21.75% | 13.10% | 0.00% | 0.03% |
| Redeia Corporacion SA | Construction | 84.35% | 19.80% | 12.73% | 0.00% | 0.02% |
| Orsted | Electricity, Gas, Steam and Air Conditioning Supply | 56.27% | 18.25% | 31.86% | 0.00% | 0.07% |
| NGG Finance Plc | Financial and Insurance Activities | 19.17% | 16.75% | 0.00% | 0.36% | 0.03% |
| EDP-Energias de Portugal SA | Electricity, Gas, Steam and Air Conditioning Supply | 77.52% | 12.25% | 0.00% | 32.43% | 0.06% |
| Electricite de France SA | Electricity, Gas, Steam and Air Conditioning Supply | 71.56% | 9.50% | 0.00% | 7.23% | 0.06% |
| Iberdrola International BV | Electricity, Gas, Steam and Air Conditioning Supply | 61.60% | 9.13% | 0.00% | 15.60% | 0.04% |
| Iberdrola Finanzas SA | Electricity, Gas, Steam and Air Conditioning Supply | 61.60% | 9.13% | 0.00% | 15.60% | 0.03% |
| Veolia Environnement SA | Water Supply, Sewerage, Waste Management and Remediation Activities | 68.52% | 8.28% | 30.01% | 0.00% | 0.04% |

Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

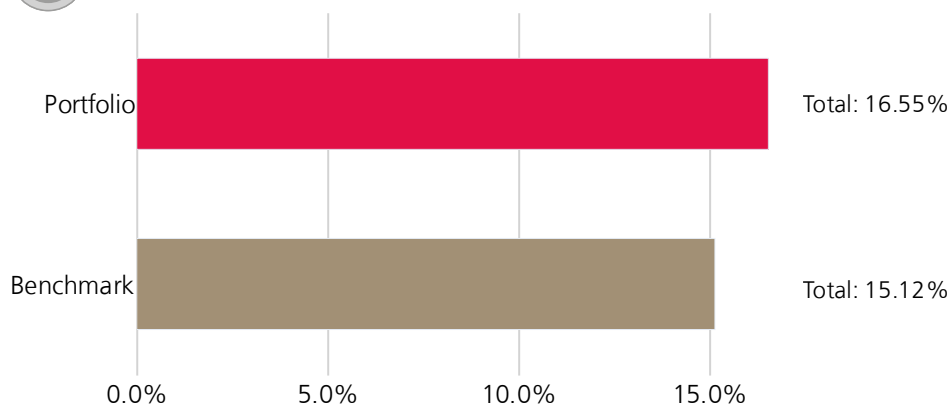
Da im vorangegangenen Berichtsjahr keine Daten verfügbar waren, erübrigt sich ein Vorjahresvergleich.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



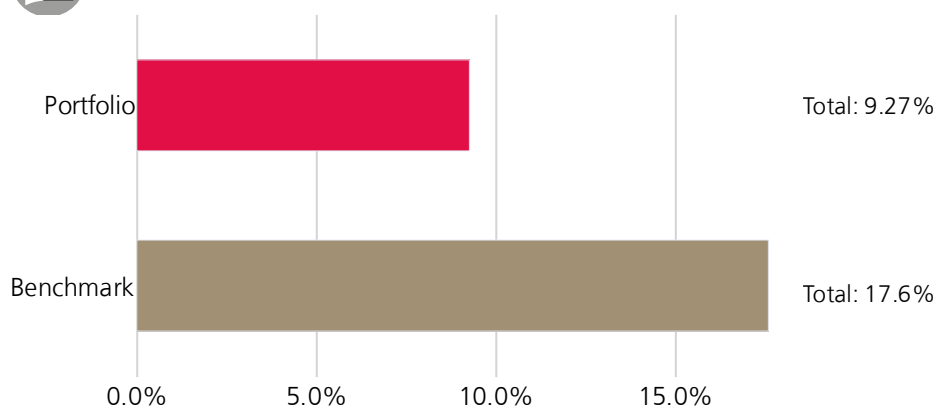
Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?



Das Diagramm zeigt die prozentualen Umsätze der im Portfolio des Fonds enthaltenen Unternehmungen und der der Benchmark, welche nicht EU-Taxonomie konform, jedoch im Einklang mit den sich aus den SDGs ergebenden Umweltzielen gemäss Art. 2 (17) SFDR investiert worden sind.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?



Das Diagramm zeigt die prozentualen Umsätze der im Portfolio des Fonds enthaltenen Unternehmungen und der der Benchmark, welche nicht EU-Taxonomie konform, jedoch im Einklang mit den sich aus den SDGs ergebenden sozialen Zielen gemäss Art. 2 (17) SFDR investiert worden sind.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Diese Vermögenswerte haben die in der spezifischen Anlagepolitik vorgesehenen Anlagen umfasst, einschliesslich Derivate zu Absicherungszwecken und flüssige Mittel. Die Anlagen, ausgenommen Derivate und flüssige Mittel, haben die Grundsätze des ökologischen oder sozialen Mindestschutzes umgesetzt.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Im Berichtszeitraum förderte der Vermögensverwalter durch Investment Stewardship und Kapitalallokation nachhaltige Geschäftspraktiken und die Einhaltung anerkannter internationaler Prinzipien und ESG-Best-Practice-Standards. Dementsprechend stand er im Dialog mit den Managementteams der investierten Unternehmen. Darüber hinaus hat er sich im Rahmen der United Nations Collaboration Platform for Responsible Investment (UN PRI) und bei Investoreninitiativen engagiert. Das Abstimmungsverhalten basierte auf den schweizerischen und internationalen Corporate-Governance-Regeln sowie auf den Prinzipien des UN Global Compact und den 17 Zielen für nachhaltige Entwicklung (UN SDGs). Weitere Informationen finden Sie unter: Swisssanto | Proxy Voting Dashboard (issgovernance.com) <https://www.swisssanto.com/int/de/nachhaltigkeit/investment-stewardship.html>

Swisssanto | Proxy Voting Dashboard (issgovernance.com)

<https://www.swisssanto.com/int/de/nachhaltigkeit/investment-stewardship.html>



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Es wurde kein Index als Referenzwert bestimmt, um festzustellen, ob dieses Finanzprodukt auf die beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet ist.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?

Nicht anwendbar.

Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?

Nicht anwendbar.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?

Nicht anwendbar.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?

Nicht anwendbar.

Das Dokument wurde von Swisssanto mit geschäftsüblicher Sorgfalt erstellt und kann Informationen aus sorgfältig ausgewählten Drittquellen enthalten. Anleger sollten beachten, dass die zuvor für 2023 berechneten und veröffentlichten Daten für dieses in 2024 veröffentlichte Dokument neu berechnet wurden. Dementsprechend kann es zu Abweichungen bei diesen in den Jahren 2023 und 2024 veröffentlichten historischen Daten kommen.



Regelmässige Information zum 31.01.2024

Regelmässige Informationen zu den in Artikel 8, Absätze 1, 2, 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts:

Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible EUR

Unternehmenskennung (LEI-Code):

549300OZ5ONRSYC73L87

Benchmark

Bloomberg Barclays Euro Aggregate Bond Index (TR) in EUR

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. In dieser Verordnung ist kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten festgelegt. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

| Ja | | Nein | |
|--------------------------|---|-------------------------------------|---|
| <input type="checkbox"/> | Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: _ % | <input checked="" type="checkbox"/> | Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 30.86% an nachhaltigen Investitionen |
| <input type="checkbox"/> | in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind | <input type="checkbox"/> | mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind |
| <input type="checkbox"/> | in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind | <input checked="" type="checkbox"/> | mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind |
| <input type="checkbox"/> | Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: _ % | <input checked="" type="checkbox"/> | mit einem sozialen Ziel |
| <input type="checkbox"/> | | <input type="checkbox"/> | Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt . |



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die von dem Teilfonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale wurden durch folgende Aktivitäten erreicht:

1. Ausschlusskriterien
2. ESG-Integration
3. Reduktion der CO2e-Intensität
4. Nachhaltige Investitionen

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Aus Übersichtsgründen werden die Angaben zur Performance (siehe Details am Ende des Reports) der Nachhaltigkeitsindikatoren direkt mit dem historischen Vergleich in der nächsten Frage beantwortet.

...und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Ausschlusskriterien

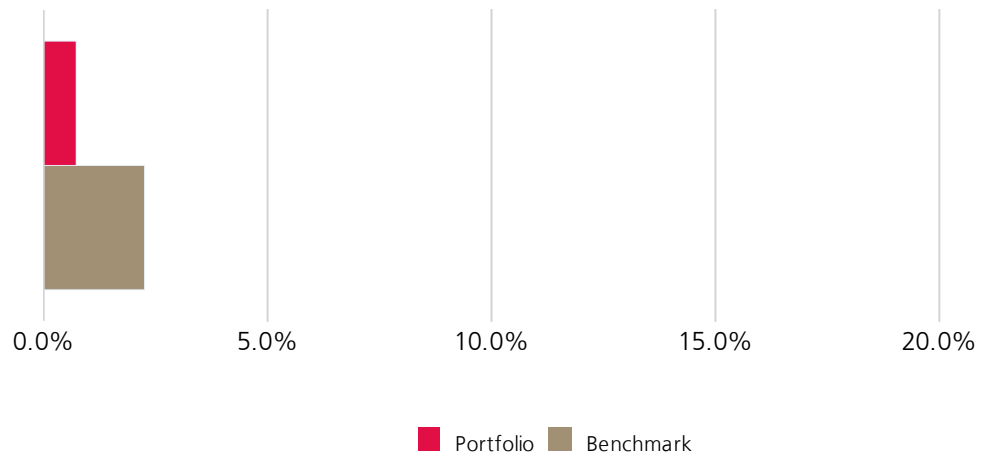
| Responsible | | | | | | | |
|--------------------------------------|-------------------|--|------------------------------|---|-------------------|-------------------|------------------------------|
| Kriterien | Gewicht Portfolio | Gewicht Benchmark | Anzahl Unternehmen Benchmark | Kriterien | Gewicht Portfolio | Gewicht Benchmark | Anzahl Unternehmen Benchmark |
| Kohlereserven (ex. Metallproduktion) | 0.00% | 0.10% | 6 | UN Global Compact Verstöße | 0.00% | 0.21% | 2 |
| Förderung von Kohle (> 5% Umsatz) | 0.00% | 0.02% | 1 | Ausbeuterische Kinderarbeit | 0.00% | 0.13% | 5 |
| Klimawandel | | Gefährdung von Gesellschaft und Gesundheit | | Herstellung von Kriegstechnik (> 5% Umsatz) | 0.00% | 0.10% | 5 |
| | | | | Herstellung von Waffen & Munition | 0.00% | 0.08% | 3 |
| | | | | Herstellung von Pornografie | 0.00% | 0.00% | 0 |
| | | | | Kontroverse Waffen | 0.00% | 0.00% | 0 |

Zwecks Minderung der Nachhaltigkeitsrisiken und mit dem Ziel, nicht in Wertpapiere der oben aufgeführten kontroversen Geschäftsmodellen zu investieren, sind die oben genannten Ausschlusskriterien angewendet worden. Die Tabelle zeigt die Anzahl der Unternehmen, die gegen die Ausschlusskriterien verstossen haben, sowie die jeweilige Portfolio- und Benchmark-Exposition. Liegen bei einem Unternehmen mehrere Verstöße vor, werden diese für jedes Kriterium separat aufgeführt. Daher ist die Summe aller Positionen in diesem Bericht in der Regel höher als die effektive Allokation zu den oben abgebildeten Kriterien. Die historischen Vergleiche werden in nachfolgender Tabelle gemacht. Aus Übersichtsgründen werden die Ausschlusskriterien aggregiert.

| | Indikator | Datum 2023 | Datum 2024 |
|-----------|----------------------------|------------|------------|
| Portfolio | Ausschlusskriterien Total* | 0% | 0% |
| Benchmark | Ausschlusskriterien Total* | 0.37% | 0.58% |

*alle Ausschlusskriterien kumuliert.

ESG-Integration

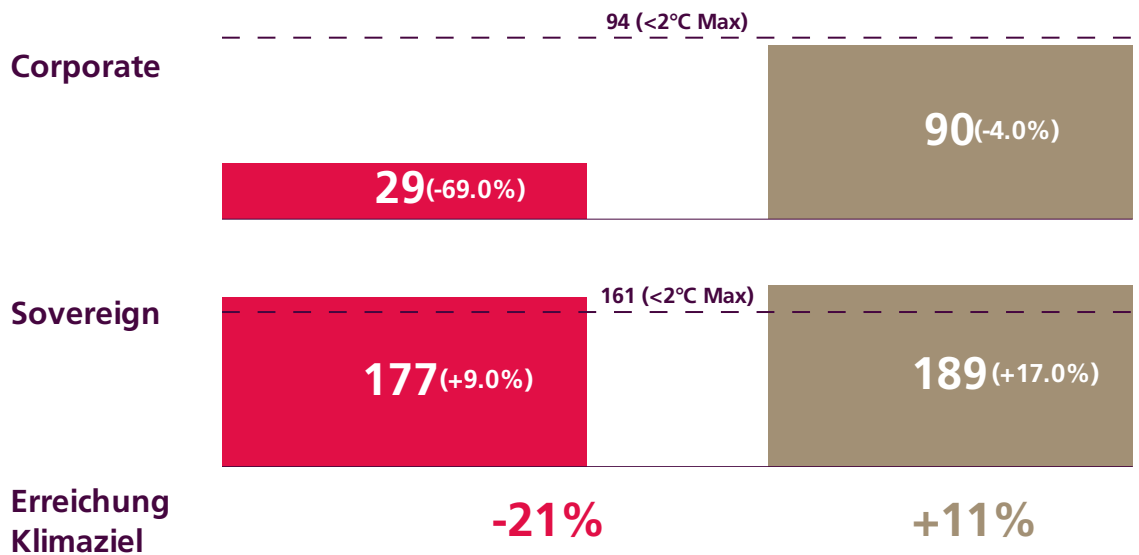


Das Portfolio strebte in der Berichtsperiode im Vergleich zur Benchmark eine geringere Exposition zu ESG-Laggards an. ESG-Laggards sind Unternehmungen mit der schwächsten Umwelt-, Sozial und Governance- Performance des relevanten Anlageuniversums.

Die historischen Vergleiche werden in nachfolgender Tabelle gemacht.

| | Indikator | Datum 2023 | Datum 2024 |
|-----------|----------------------------|------------|------------|
| Portfolio | Exposition zu ESG Laggards | 3.25% | 0.73% |
| Benchmark | Exposition zu ESG Laggards | 3.73% | 2.25% |

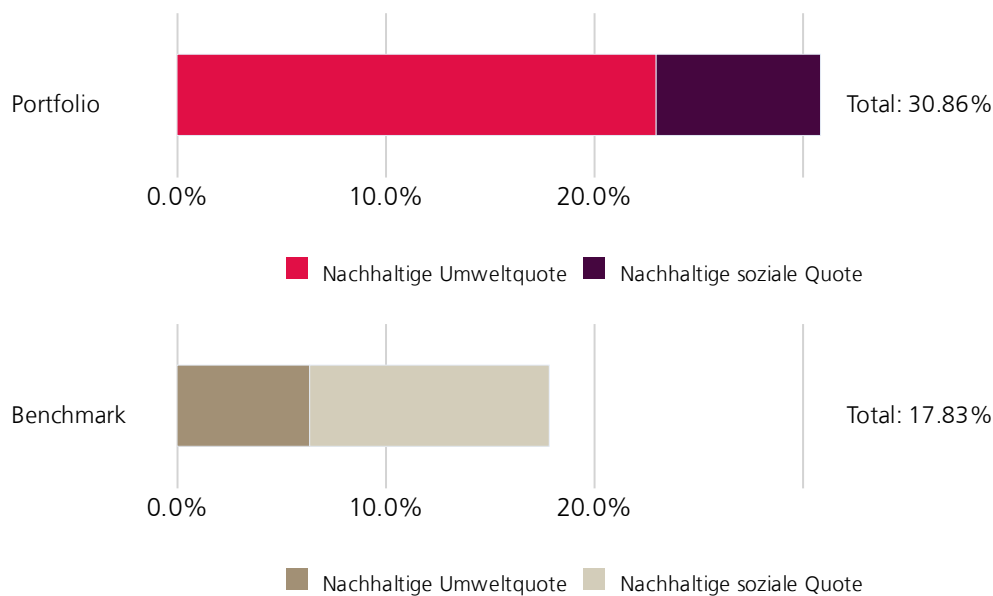
Reduktion der CO₂e-Intensität



Im Einklang mit dem < 2° Pariser Klimaziel ("<2°C Max") zielte die Investitionstätigkeit des Fonds während der Berichtsperiode darauf ab, die CO₂e-Emissionen des Portfolios, um mindestens 4 % pro Jahr zu reduzieren. Der Absenkpfad berechnet sich aus den gewichteten CO₂e-Intensitäten der Benchmark, diskontiert mit 4 % pro Jahr zuzüglich des realen Wirtschaftswachstums. Die gestrichelten 2° Max-Linie zeigt den Maximalwert an. Die Balken stellen die CO₂e-Intensitäten des Portfolios und der Benchmark dar. CO₂e-Intensitäten unterhalb der 2° Max-Linie zeigen an, dass das Portfolio oder die Benchmark das <2°-Klimaziel erfüllen. Werte bei "Erreichung Klimaziel" setzen das Portfolio und die Benchmark in Relation zum Klimaziel. Negative Werte bedeuten, dass das Ziel erreicht wurde. Die historischen Vergleiche werden in nachfolgender Tabelle gemacht.

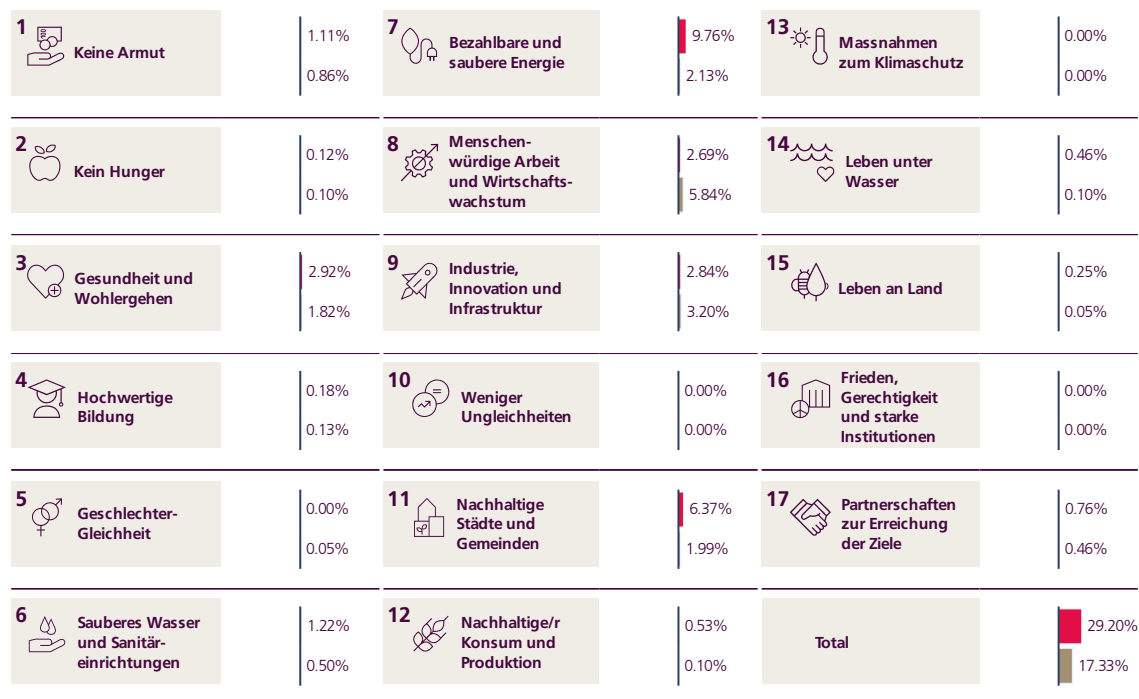
| | Indikator | Datum 2023 | Datum 2024 |
|-----------|--|------------|------------|
| Portfolio | CO ₂ e-Intensität Corporate | 52 | 29 |
| | CO ₂ e-Intensität Sovereign | 189 | 177 |
| | Erreichung Klimaziel | -18% | -21% |
| | Reduktion Corporate | -50% | -69% |
| | Reduktion Sovereign | 8% | 9% |
| Benchmark | CO ₂ e-Intensität Corporate | 105 | 90 |
| | CO ₂ e-Intensität Sovereign | 199 | 189 |
| | Erreichung Klimaziel | 10% | 11% |
| | Reduktion Corporate | 3% | -4% |
| | Reduktion Sovereign | 13% | 17% |

Nachhaltige Investitionen



Das Diagramm zeigt die prozentualen Umsätze der im Portfolio des Fonds enthaltenen Unternehmungen und der der Benchmark, welche nicht EU-Taxonomie konform, jedoch im Einklang mit den sich aus den UN Sustainable Development Goals (SDGs) ergebenden Umwelt- und sozialen Zielen gemäss Art. 2 (17) SFDR investiert worden sind. Der Fonds hat keine Investitionen in ökologisch nachhaltige Aktivitäten im Sinne der EU Taxonomie-Verordnung angestrebt. Der Investmentmanager des (Teil-)Fonds hat eine Methodologie zur Definition nachhaltiger Investitionen entwickelt, die den Anforderungen des Art. 2 (17) SFDR entspricht. Die Methodologie ist detailliert in den Vorvertraglichen Informationen beschrieben. Die Aufteilung der nachhaltigen Investitionen in UN SDGswerten in folgender Grafik gemacht. Die historischen Vergleiche werden in nachfolgender Tabelle gemacht.

| | Indikator | Datum 2023 | Datum 2024 |
|-----------|---|------------|------------|
| Portfolio | Anteil nachhaltige Investitionen mit Umweltziel | 18.86% | 22.99% |
| | Anteil sozial nachhaltige Investitionen | 8.68% | 7.87% |
| | Total nachhaltige Quote | 27.55% | 30.86% |
| Benchmark | Anteil nachhaltige Investitionen mit Umweltziel | 4.86% | 6.35% |
| | Anteil sozial nachhaltige Investitionen | 11.68% | 11.48% |
| | Total nachhaltige Quote | 16.54% | 17.83% |



■ Portfolio
 ■ Benchmark

Aufgrund der unterschiedlichen Behandlung von Green, Social und Sustainable Bonds kann das SDG-Exposure von den prozentualen Umsätzen der im Portfolio des Fonds enthaltenen Unternehmungen und den der Benchmark, welche im Einklang mit den sich aus den SDGs ergebenden Umweltzielen gemäss Art. 2 (17) SFDR investiert worden sind, abweichen.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Im Berichtszeitraum konzentrierte sich der Vermögensverwalter auf Wertpapiere von Unternehmen, welche Umsätze aus dem Verkauf von Produkten und Dienstleistungen mit einem positiven Beitrag zu den 17 SDGs erzielten und dabei keine DNSH- und/oder Minimum Safeguards-Verletzungen aufgewiesen haben.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Emittenten mit einem negativen Nettobeitrag zu den SDGs wurden in der Berichtsperiode aus dem Anlageuniversum des Finanzproduktes entfernt. Darüber hinaus berücksichtigte der Teilfonds nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (engl: Principal Adverse Impacts - PAI). Zu diesem Zweck wurden die obligatorischen Indikatoren Anhang 1 der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1288 zur Ergänzung der Verordnung (EU) 2019/2088 zugrunde gelegt. Unternehmen, die der Vermögensverwalter gemäss PAI als besonders schädlich einstufte, wurden entsprechend nicht zu den nachhaltigen Anlagen gezählt. Emittenten, welche die PAIs 7 (Biodiversität), 10 (Global Compact der Vereinten Nationen (UNGC)/OECD Leitsätze für multinationale Unternehmen) oder 14 (Engagement in umstrittenen Waffen) verletzen, haben einen PAI-Score von null erhalten. Aus den restlichen PAI-Indikatoren wurde ein PAI-Score berechnet. Instrumente von Emittenten mit einem Score < 10 wurden nicht den nachhaltigen Investitionen angerechnet.

● **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Die nachteiligen Auswirkungen (PAI) sind systematisch im Anlageprozess berücksichtigt worden.

● **Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:**

Bei der Anlageanalyse für nachhaltige Investitionen wurden in der Berichtsperiode die folgenden Normverletzungen berücksichtigt: Global Compact der Vereinten Nationen (UNGC), die UN Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte (UNGP) und das Übereinkommen der Internationalen Arbeitsorganisation (ILO). Jeder schwerwiegende Verstoß gegen diese Normen führte zum Ausschluss des Emittenten aus dem investierbaren Universum des Finanzprodukts.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

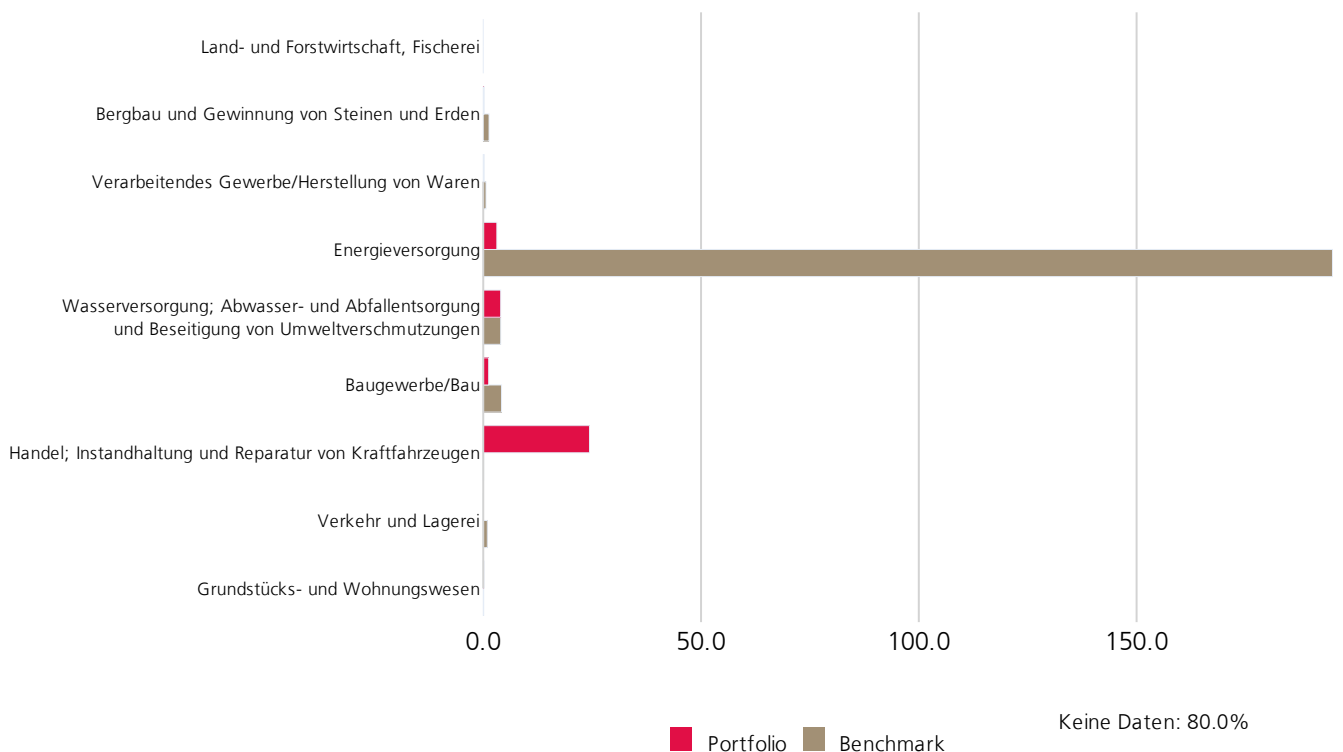
Nachteilige Nachhaltigkeitsauswirkungen (PAI) – Corporate Anlagen

Primäre Indikatoren - Energie und Emissionen

| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Benchmark Aktuell | Benchmark Vorjahr | Erklärung |
|--|--|-------------------|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|-----------|
| 1. THG-Emissionen | 1a. GHG Emissions - Scope 1 per Mio EUR Enterprise Value | 1247.98 | 26.79% | 868.66 | 2267.97 | 252208 | |
| | 1b. GHG Emissions - Scope 2 per Mio EUR Enterprise Value | 303.51 | 26.79% | 427.11 | 450.09 | 16479.5 | |
| | 1c. GHG Emissions - Scope 3 per Mio EUR Enterprise Value | 9950.18 | 26.79% | 11752.6 | 17895.1 | 982487 | |
| 2. CO ₂ -Fussabdruck | 2. GHG Emissions - Scope 1+2+3 per Mio EUR Enterprise Value | 74.51 | 26.79% | 87.03 | 130.19 | 6894.37 | |
| 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird | 3. GHG Emissions - Emissions Intensity - Total Emissions (EUR) | 78.62 | 29.41% | 75.24 | 128.83 | 141.16 | |
| 4. Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind | 4. Fossil Fuel - Involvement (PAI) | 1.6% | 29.55% | 0.59% | 2.66% | 2.35% | |

| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Benchmark Aktuell | Benchmark Vorjahr | Erklärung |
|--|--|-------------------|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|---|
| 5. Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen | 5a. CR Raw - Energy use - Coal/nuclear/undear energy sources | 59.21% | 3.88% | 68.13% | 53.65% | 54.55% | |
| | 5b. Non-renewable energy consumption | 59.51% | 7.3% | 77.48% | 61.88% | 82.76% | Der Verbrauch nicht-erneuerbarer Energie umfasst den Verbrauch von Energie, die aus nicht-erneuerbaren Quellen erzeugt wird, sowie den Verbrauch von Energie aus Biomasse. Alle Zahlen zum Energieverbrauch, bei denen die Energiequelle unklar ist, sind ebenfalls in diesem Faktor enthalten. |
| | 5c. Non-renewable energy production | 1.9% | 28.77% | 0.55% | 3.89% | 3.9% | |
| 6. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren | 6. Energy consumption intensity (GWh/mEUR) | 0.44 | 15.7% | 0.17 | 23.49 | 7.85 | |

Intensität des Energieverbrauchs pro High Impact Sector (pro Mio. EUR)



| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Benchmark Aktuell | Benchmark Vorjahr | Erklärung |
|---|--|-------------------|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|-----------|
| 7. Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken | 7. Companies negatively affecting biodiversity-sensitive areas | 0% | 29.51% | 0% | 0.03% | 0.02% | |
| 8. Emissionen in Wasser | 8. CR Raw - COD emissions | 2.42 | 0.47% | 0.66 | 55.88 | 48.92 | |
| 9. Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle | 9. CR Raw - Hazardous waste | 0.04 | 2.89% | 0 | 0.05 | 0 | |

| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Benchmark Aktuell | Benchmark Vorjahr | Erklärung |
|--|--|-------------------|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|-----------|
| 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | 10. UNGC / OECD Guidelines Violation | 0% | 29.51% | 0% | 20.62% | 2.61% | |
| 11. Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen | 11. Lack of processes monitoring UNGC and OECD Guidelines compliance | 2.74% | 24.67% | 1.55% | 2.52% | 1.96% | |
| 12. Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle | 12. Unadjusted gender pay gap | 0.41% | 4.07% | 0.44% | 0.2% | 0.2% | |
| 13. Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen | 13. Ratio of female to male board members | 69.98% | 19.81% | 59.53% | 70.18% | 69.32% | |
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) | 14. Controversial weapons involvement (APM, CM, Bio, Chem) | 0% | 29.63% | 0% | 0% | 0% | |

Nachteilige Nachhaltigkeitsauswirkungen (PAI) – Staatliche und Supranationale Vermögenswerte

Primäre Indikatoren

| Umwelt | | | | | | | |
|--------------------|-------------------|-------------------|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|-----------|
| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Benchmark Aktuell | Benchmark Vorjahr | Erklärung |
| 15. GHG Intensität | 15. GHG Intensity | 199.86 | 54.84% | 223.5 | 207.9 | 218.89 | |

| Sozial | | | | | | | |
|--|---|-------------------|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|-----------|
| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Benchmark Aktuell | Benchmark Vorjahr | Erklärung |
| 16. Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen | 16a. Countries subject to social violations (#) | 3.5 | 21.92% | 9.5 | 3.75 | 4.5 | |
| | 16b. Countries subject to social violations (%) | 5.43% | 21.92% | 16.58% | 2% | 2.69% | |

| Indikator | Metrik |
|-----------|---|
| 1a | Scope-1-Treibhausgas-Emissionen |
| 1b | Scope-2-Treibhausgas-Emissionen |
| 1c | Scope-3-Treibhausgas-Emissionen |
| 2. | CO2-Fussabdruck pro Mio EUR |
| 3. | THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird |
| 4. | Anteil der Investitionen in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind |
| 5a | Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung der Unternehmen, in die investiert wird, aus nicht erneuerbaren Energiequellen im Vergleich zu erneuerbaren Energiequellen, ausgedrückt in Prozent der gesamten Energiequellen |
| 5b | Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung der Unternehmen, in die investiert wird, aus nicht erneuerbaren Energiequellen im Vergleich zu erneuerbaren Energiequellen, ausgedrückt in Prozent der gesamten Energiequellen |
| 5c | Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung der Unternehmen, in die investiert wird, aus nicht erneuerbaren Energiequellen im Vergleich zu erneuerbaren Energiequellen, ausgedrückt in Prozent der gesamten Energiequellen |
| 6. | Energieverbrauch in GWh pro einer Million EUR Umsatz der Unternehmen, in die investiert wird, aufgeschlüsselt nach klimaintensiven Sektoren |
| 7. | Anteil der Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird, mit Standorten/Betrieben in oder in der Nähe von Gebieten mit schutzbedürftiger Biodiversität, sofern sich die Tätigkeiten dieser Unternehmen nachteilig auf diese Gebiete auswirken |
| 8. | Tonnen Emissionen in Wasser, die von den Unternehmen, in die investiert wird, pro investierter Million EUR verursacht werden, ausgedrückt als gewichteter Durchschnitt |
| 9. | Tonnen gefährlicher und radioaktiver Abfälle, die von den Unternehmen, in die investiert wird, pro investierter Million EUR erzeugt werden, ausgedrückt als gewichteter Durchschnitt |
| 10. | Anteil der Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird, die an Verstößen gegen die UNGC-Grundsätze oder gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen beteiligt waren |
| 11. | Anteil der Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird, die keine Richtlinien zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen oder keine Verfahren zur Bearbeitung von Beschwerden wegen Verstößen gegen die UNGC-Grundsätze und OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen eingerichtet haben |
| 12. | Durchschnittliches unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle bei den Unternehmen, in die investiert wird |
| 13. | Durchschnittliches Verhältnis von Frauen zu Männern in den Leitungs- und Kontrollorganen der Unternehmen, in die investiert wird, ausgedrückt als Prozentsatz aller Mitglieder der Leitungs- und Kontrollorgane |
| 14. | Anteil der Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird, die an der Herstellung oder am Verkauf von umstrittenen Waffen beteiligt sind |
| 15. | THG-Emissionsintensität der Länder, in die investiert wird |
| 16a | Anzahl der Länder, in die investiert wird, die nach Maßgabe internationaler Verträge und Übereinkommen, der Grundsätze der Vereinten Nationen oder, falls anwendbar, nationaler Rechtsvorschriften gegen soziale Bestimmungen verstoßen (absolute Zahl und relative Zahl, geteilt durch alle Länder, in die investiert wird) |
| 16b | Anzahl der Länder, in die investiert wird, die nach Maßgabe internationaler Verträge und Übereinkommen, der Grundsätze der Vereinten Nationen oder, falls anwendbar, nationaler Rechtsvorschriften gegen soziale Bestimmungen verstoßen (absolute Zahl und relative Zahl, geteilt durch alle Länder, in die investiert wird) |

Das Dokument wurde von Swisscanto mit geschäftsüblicher Sorgfalt erstellt und kann Informationen aus sorgfältig ausgewählten Drittquellen enthalten. Anleger sollten beachten, dass die zuvor für 2023 berechneten und veröffentlichten Daten für dieses in 2024 veröffentlichte Dokument neu berechnet wurden. Dementsprechend kann es zu Abweichungen bei diesen in den Jahren 2023 und 2024 veröffentlichten historischen Daten kommen.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 01.02.2023 - 31.01.2024

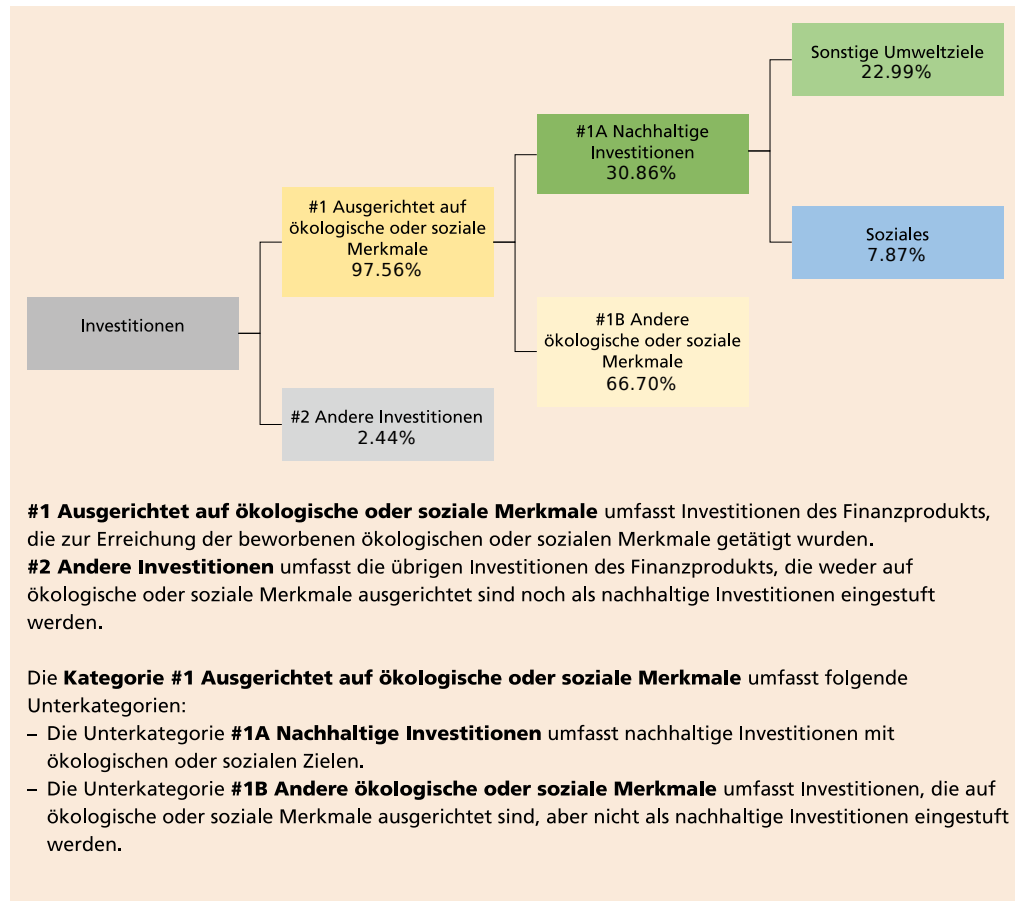
| Grösste Investitionen | Sektor | In % der Vermögenswerte | Land |
|--|---|-------------------------|-------------|
| Government of Spain 1.95% 30-APR-2026 | Public Administration and Defence, Compulsory Social Security | 1.65% | Spain |
| Government of Italy 1.6% 01-JUN-2026 | Public Administration and Defence, Compulsory Social Security | 1.38% | Italy |
| Government of Germany 0.0% 15-AUG-2030 REGS | Financial and Insurance Activities | 1.36% | |
| Government of France 0.75% 25-MAY-2028 REGS | Financial and Insurance Activities | 1.32% | |
| Government of France 0.1% 01-MAR-2025 REGS | Financial and Insurance Activities | 1.28% | |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Responsible COCO NTH EUR Klasse | | 1.22% | |
| EUR Cash | | 1.08% | |
| Swisscanto (LU) Bond Fund Sustainable Global High Yield NTH EUR Klasse | | 1.01% | |
| Government of Italy 4.0% 30-OCT-2031 | Public Administration and Defence, Compulsory Social Security | 1.00% | Italy |
| Government of France 0.0% 25-FEB-2025 REGS | Financial and Insurance Activities | 0.94% | |
| Government of Spain 2.35% 30-JUL-2033 REGS | Public Administration and Defence, Compulsory Social Security | 0.89% | Spain |
| Government of the Netherlands 0.75% 15-JUL-2028 144A | Public Administration and Defence, Compulsory Social Security | 0.89% | Netherlands |
| Government of Spain 1.5% 30-APR-2027 | Public Administration and Defence, Compulsory Social Security | 0.85% | Spain |
| Government of France 1.25% 25-MAY-2034 REGS | Financial and Insurance Activities | 0.81% | |
| Government of Spain 0.1% 30-APR-2031 | Public Administration and Defence, Compulsory Social Security | 0.76% | Spain |



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

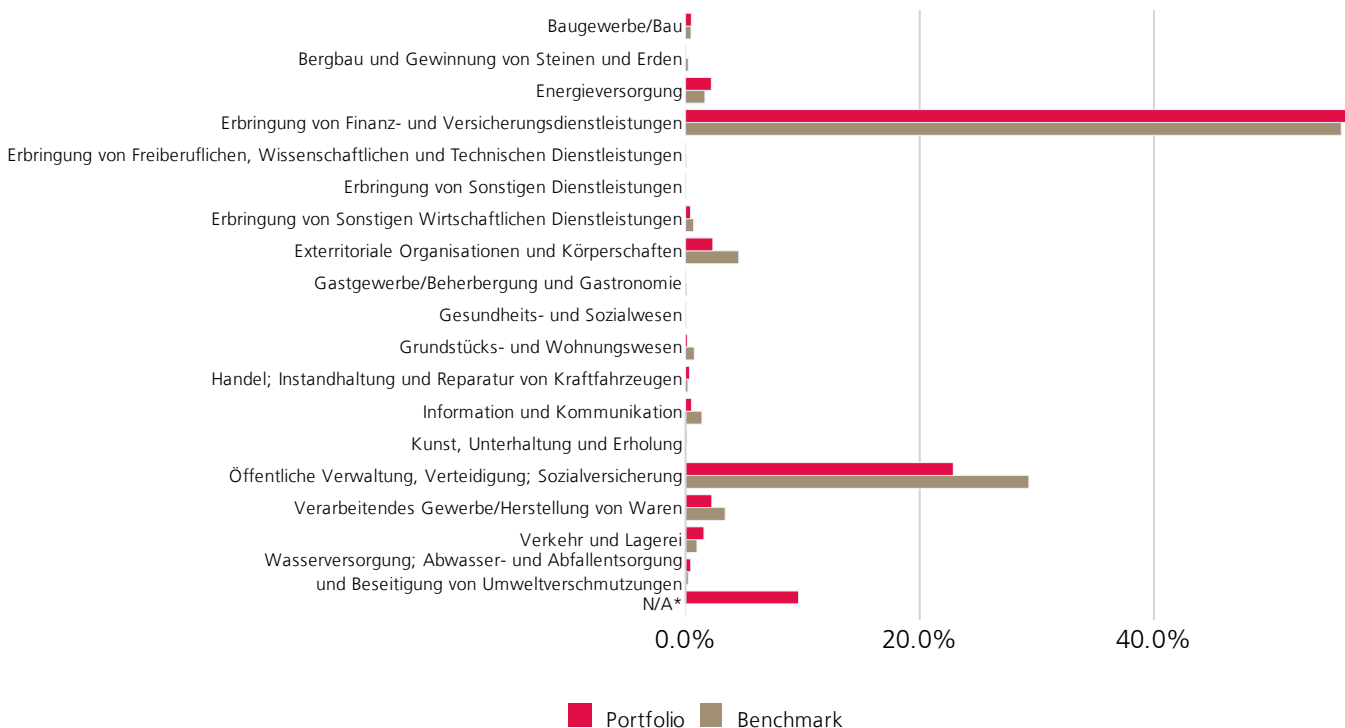
Der Anteil an nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen und Angaben zur Vermögensallokation werden in untenstehender Frage beantwortet.

Wie sah die Vermögensallokation aus?



In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Wegen mangelnder Datenverfügbarkeit können Subsektoren nicht angezeigt werden.



*Diese Klassifizierung umfasst alle Bestände, für die keine NACE-Klassifizierung gefunden oder geschätzt werden kann; Liquidität ist darin enthalten. 429/449



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Obwohl keine Investitionen getätigt wurden, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind, wird in untenstehender Grafik die Alignment der nachhaltigen Investitionen mit der EU-Taxonomie offengelegt.

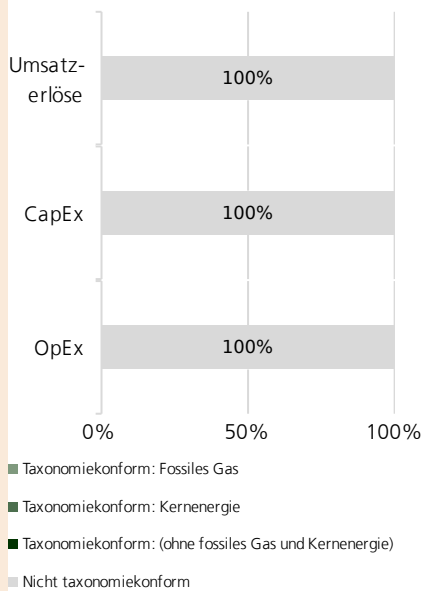
Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert¹?

- Ja
- In fossiles Gas In Kernenergie
- Nein

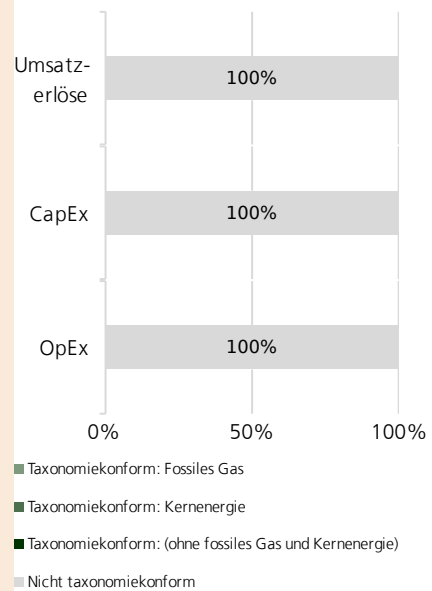
¹Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels ("Klimaschutz") beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzproduktes einschliesslich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzproduktes zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.

1. Taxonomiekonformität der Investitionen einschliesslich Staatsanleihen*



2. Taxonomiekonformität der Investitionen ohne Staatsanleihen*



Diese Grafik gibt **39.1%** der Gesamtinvestitionen wieder.

*Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff "Staatsanleihen" alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf erneuerbare Energie oder CO2-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO2-armen Alternativen gibt und die Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

Investitionsausgaben (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, z.B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft

- **Betriebsausgaben** (Opex), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Angaben zu Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten werden in der Tabelle zusammengefasst. Wenn keine Angaben verfügbar sind, wird die Tabelle ebenfalls keine Angaben enthalten.

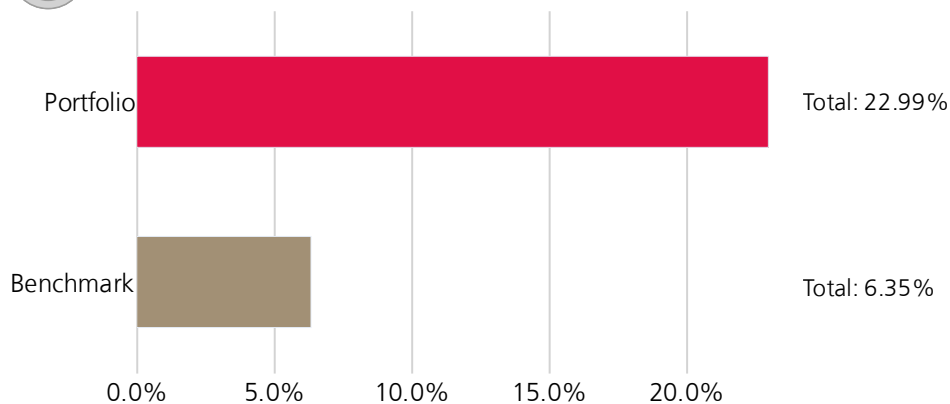
| Issuer Name | Nace Sektor | Total Eligible Activity Revenue | Total Aligned Revenue | Total Likely Aligned Revenue | Total Potentially Aligned Revenue | Portfolio Gewicht (Consol.) |
|-----------------------------|---|---------------------------------|-----------------------|------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------|
| Orsted | Electricity, Gas, Steam and Air Conditioning Supply | 56.27% | 18.25% | 31.86% | 0.00% | 0.67% |
| EDP-Energias de Portugal SA | Electricity, Gas, Steam and Air Conditioning Supply | 77.52% | 12.25% | 0.00% | 32.43% | 0.95% |
| EDP Finance BV | Electricity, Gas, Steam and Air Conditioning Supply | 77.52% | 12.25% | 0.00% | 32.43% | 0.33% |
| CTP N.V. | Real Estate Activities | 100.00% | 11.60% | 0.00% | 0.00% | 0.17% |
| Electricite de France SA | Electricity, Gas, Steam and Air Conditioning Supply | 71.56% | 9.50% | 0.00% | 7.23% | 0.00% |
| Iberdrola International BV | Electricity, Gas, Steam and Air Conditioning Supply | 61.60% | 9.13% | 0.00% | 15.60% | 2.12% |
| Iberdrola Finanzas SA | Electricity, Gas, Steam and Air Conditioning Supply | 61.60% | 9.13% | 0.00% | 15.60% | 0.00% |
| Vigie SA | Water Supply, Sewerage, Waste Management and Remediation Activities | 68.52% | 8.28% | 30.01% | 0.00% | 0.64% |
| Veolia Environnement SA | Water Supply, Sewerage, Waste Management and Remediation Activities | 68.52% | 8.28% | 30.01% | 0.00% | 0.23% |
| Neste Corporation | Manufacturing | 36.90% | 7.25% | 5.60% | 22.41% | 0.20% |

Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?


Da im vorangegangenen Berichtsjahr keine Daten verfügbar waren, erübrigt sich ein Vorjahresvergleich.

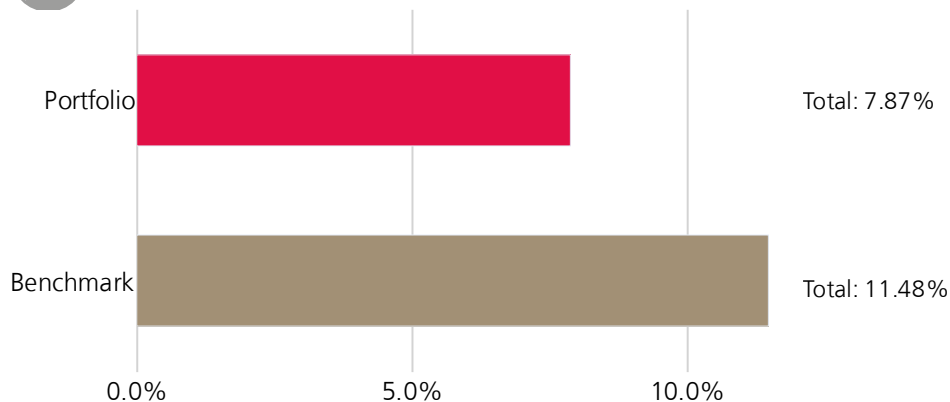
 sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.

 **Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**




Das Diagramm zeigt die prozentualen Umsätze der im Portfolio des Fonds enthaltenen Unternehmungen und der der Benchmark, welche nicht EU-Taxonomie konform, jedoch im Einklang mit den sich aus den SDGs ergebenden Umweltzielen gemäss Art. 2 (17) SFDR investiert worden sind.

 **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**



Das Diagramm zeigt die prozentualen Umsätze der im Portfolio des Fonds enthaltenen Unternehmungen und der der Benchmark, welche nicht EU-Taxonomie konform, jedoch im Einklang mit den sich aus den SDGs ergebenden sozialen Zielen gemäss Art. 2 (17) SFDR investiert worden sind.

 **Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

Diese Vermögenswerte haben die in der spezifischen Anlagepolitik vorgesehenen Anlagen umfasst, einschliesslich Derivate zu Absicherungszwecken und flüssige Mittel. Die Anlagen, ausgenommen Derivate und flüssige Mittel, haben die Grundsätze des ökologischen oder sozialen Mindestschutzes umgesetzt.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Im Berichtszeitraum förderte der Vermögensverwalter durch Investment Stewardship und Kapitalallokation nachhaltige Geschäftspraktiken und die Einhaltung anerkannter internationaler Prinzipien und ESG-Best-Practice-Standards. Dementsprechend stand er im Dialog mit den Managementteams der investierten Unternehmen. Darüber hinaus hat er sich im Rahmen der United Nations Collaboration Platform for Responsible Investment (UN PRI) und bei Investoreninitiativen engagiert. Das Abstimmungsverhalten basierte auf den schweizerischen und internationalen Corporate-Governance-Regeln sowie auf den Prinzipien des UN Global Compact und den 17 Zielen für nachhaltige Entwicklung (UN SDGs). Weitere Informationen finden Sie unter: Swisssanto | Proxy Voting Dashboard (issgovernance.com) <https://www.swisssanto.com/int/de/nachhaltigkeit/investment-stewardship.html>

Swisssanto | Proxy Voting Dashboard (issgovernance.com)

<https://www.swisssanto.com/int/de/nachhaltigkeit/investment-stewardship.html>



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Es wurde kein Index als Referenzwert bestimmt, um festzustellen, ob dieses Finanzprodukt auf die beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet ist.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?

Nicht anwendbar.

Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?

Nicht anwendbar.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?

Nicht anwendbar.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?

Nicht anwendbar.

Das Dokument wurde von Swisssanto mit geschäftsüblicher Sorgfalt erstellt und kann Informationen aus sorgfältig ausgewählten Drittquellen enthalten. Anleger sollten beachten, dass die zuvor für 2023 berechneten und veröffentlichten Daten für dieses in 2024 veröffentlichte Dokument neu berechnet wurden. Dementsprechend kann es zu Abweichungen bei diesen in den Jahren 2023 und 2024 veröffentlichten historischen Daten kommen.



Regelmässige Information zum 31.01.2024

Regelmässige Informationen zu den in Artikel 8, Absätze 1, 2, 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts:

Swisscanto (LU) Bond Fund Vision Responsible GBP

Unternehmenskennung (LEI-Code):

549300BWFQKZQUQG0265

Benchmark

Bloomberg Barclays Sterling Aggregate Bond Index (TR) in GBP

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. In dieser Verordnung ist kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten festgelegt. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

| Ja | | Nein | |
|--------------------------|---|-------------------------------------|---|
| <input type="checkbox"/> | Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: _ % | <input checked="" type="checkbox"/> | Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 13.55% an nachhaltigen Investitionen |
| <input type="checkbox"/> | in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind | <input type="checkbox"/> | mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind |
| <input type="checkbox"/> | in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind | <input checked="" type="checkbox"/> | mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind |
| <input type="checkbox"/> | Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: _ % | <input checked="" type="checkbox"/> | mit einem sozialen Ziel |
| <input type="checkbox"/> | | <input type="checkbox"/> | Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt . |



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die von dem Teilfonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale wurden durch folgende Aktivitäten erreicht:

1. Ausschlusskriterien
2. ESG-Integration
3. Reduktion der CO₂e-Intensität
4. Nachhaltige Investitionen






Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Aus Übersichtsgründen werden die Angaben zur Performance (siehe Details am Ende des Reports) der Nachhaltigkeitsindikatoren direkt mit dem historischen Vergleich in der nächsten Frage beantwortet.

...und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Ausschlusskriterien

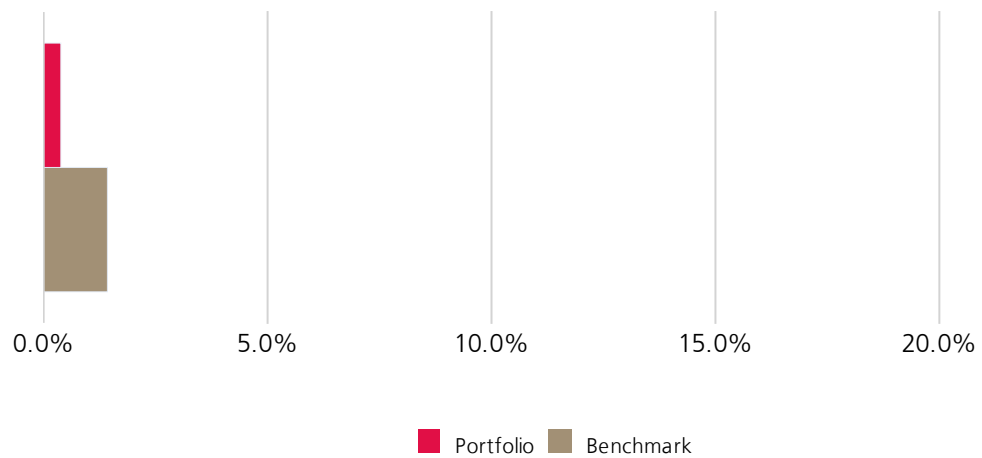
| Responsible | | | | | | | |
|---|-------------------|--|------------------------------|--|-------------------|-------------------|------------------------------|
| Kriterien | Gewicht Portfolio | Gewicht Benchmark | Anzahl Unternehmen Benchmark | Kriterien | Gewicht Portfolio | Gewicht Benchmark | Anzahl Unternehmen Benchmark |
|  Kohlereserven (ex. Metallproduktion) | 0.00% | 0.11% | 1 |  Ausbeuterische Kinderarbeit | 0.00% | 0.18% | 2 |
| Förderung von Kohle (> 5% Umsatz) | 0.00% | 0.04% | 1 |  UN Global Compact Verstöße | 0.00% | 0.13% | 2 |
|  Klimawandel | |  Gefährdung von Gesellschaft und Gesundheit | | Herstellung von Kriegstechnik (> 5% Umsatz) | 0.00% | 0.00% | 0 |
| | | | | Herstellung von Pornografie | 0.00% | 0.00% | 0 |
| | | | | Herstellung von Waffen & Munition | 0.00% | 0.00% | 0 |
| | | | | Kontroverse Waffen | 0.00% | 0.00% | 0 |

Zwecks Minderung der Nachhaltigkeitsrisiken und mit dem Ziel, nicht in Wertpapiere der oben aufgeführten kontroversen Geschäftsmodellen zu investieren, sind die oben genannten Ausschlusskriterien angewendet worden. Die Tabelle zeigt die Anzahl der Unternehmen, die gegen die Ausschlusskriterien verstossen haben, sowie die jeweilige Portfolio- und Benchmark-Exposition. Liegen bei einem Unternehmen mehrere Verstöße vor, werden diese für jedes Kriterium separat aufgeführt. Daher ist die Summe aller Positionen in diesem Bericht in der Regel höher als die effektive Allokation zu den oben abgebildeten Kriterien. Die historischen Vergleiche werden in nachfolgender Tabelle gemacht. Aus Übersichtsgründen werden die Ausschlusskriterien aggregiert.

| | Indikator | Datum 2023 | Datum 2024 |
|-----------|----------------------------|------------|------------|
| Portfolio | Ausschlusskriterien Total* | 0% | 0% |
| Benchmark | Ausschlusskriterien Total* | 0.38% | 0.46% |

*alle Ausschlusskriterien kumuliert.

ESG-Integration

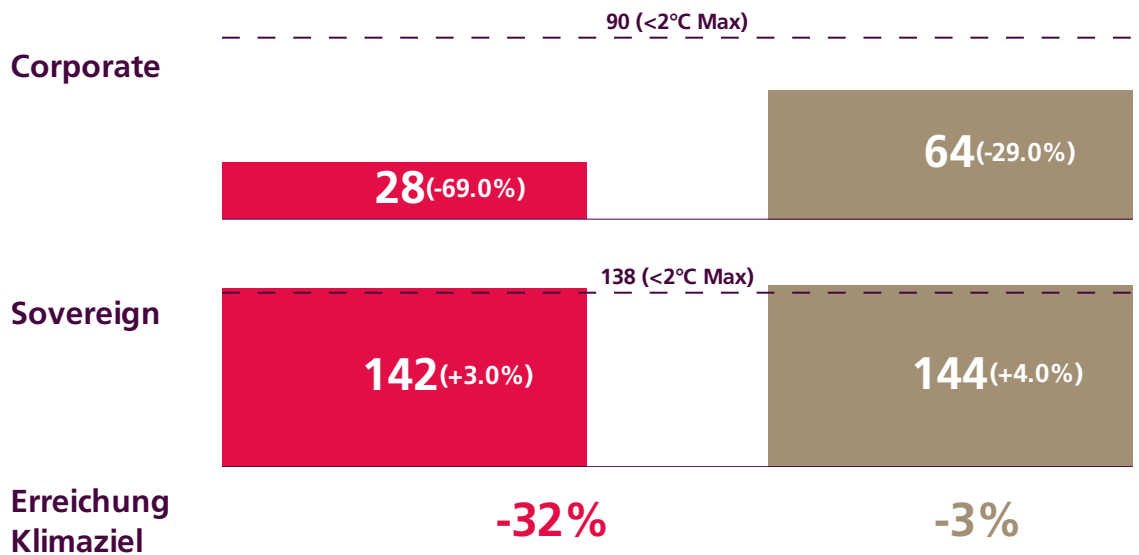


Das Portfolio strebte in der Berichtsperiode im Vergleich zur Benchmark eine geringere Exposition zu ESG-Laggards an. ESG-Laggards sind Unternehmungen mit der schwächsten Umwelt-, Sozial und Governance- Performance des relevanten Anlageuniversums.

Die historischen Vergleiche werden in nachfolgender Tabelle gemacht.

| | Indikator | Datum 2023 | Datum 2024 |
|-----------|----------------------------|------------|------------|
| Portfolio | Exposition zu ESG Laggards | 2.99% | 0.38% |
| Benchmark | Exposition zu ESG Laggards | 1.86% | 1.42% |

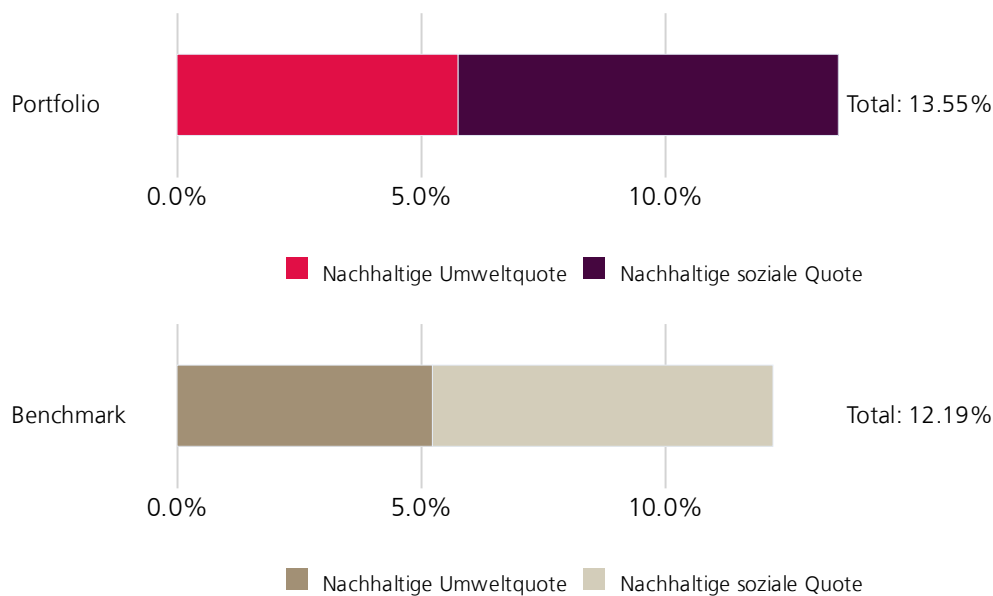
Reduktion der CO₂e-Intensität



Im Einklang mit dem < 2° Pariser Klimaziel ("<2°C Max") zielte die Investitionstätigkeit des Fonds während der Berichtsperiode darauf ab, die CO₂e-Emissionen des Portfolios, um mindestens 4 % pro Jahr zu reduzieren. Der Absenkpfad berechnet sich aus den gewichteten CO₂e-Intensitäten der Benchmark, diskontiert mit 4 % pro Jahr zuzüglich des realen Wirtschaftswachstums. Die gestrichelten 2° Max-Linie zeigt den Maximalwert an. Die Balken stellen die CO₂e-Intensitäten des Portfolios und der Benchmark dar. CO₂e-Intensitäten unterhalb der 2° Max-Linie zeigen an, dass das Portfolio oder die Benchmark das <2°-Klimaziel erfüllen. Werte bei "Erreichung Klimaziel" setzen das Portfolio und die Benchmark in Relation zum Klimaziel. Negative Werte bedeuten, dass das Ziel erreicht wurde. Die historischen Vergleiche werden in nachfolgender Tabelle gemacht.



















| | Indikator | Datum 2023 | Datum 2024 |
|-----------|--|------------|------------|
| Portfolio | CO ₂ e-Intensität Corporate | 53 | 28 |
| | CO ₂ e-Intensität Sovereign | 152 | 142 |
| | Erreichung Klimaziel | -24% | -32% |
| | Reduktion Corporate | -46% | -69% |
| | Reduktion Sovereign | 2% | 3% |
| Benchmark | CO ₂ e-Intensität Corporate | 85 | 64 |
| | CO ₂ e-Intensität Sovereign | 154 | 144 |
| | Erreichung Klimaziel | -1% | -3% |
| | Reduktion Corporate | -13% | -29% |
| | Reduktion Sovereign | 3% | 4% |

Nachhaltige Investitionen



Das Diagramm zeigt die prozentualen Umsätze der im Portfolio des Fonds enthaltenen Unternehmungen und der der Benchmark, welche nicht EU-Taxonomie konform, jedoch im Einklang mit den sich aus den UN Sustainable Development Goals SDGs ergebenden Umwelt- und sozialen Zielen gemäss Art. 2 (17) SFDR investiert worden sind. Der Fonds hat keine Investitionen in ökologisch nachhaltige Aktivitäten im Sinne der EU Taxonomie-Verordnung angestrebt. Der Investmentmanager des (Teil-)Fonds hat eine Methodologie zur Definition nachhaltiger Investitionen entwickelt, die den Anforderungen des Art. 2 (17) SFDR entspricht. Die Methodologie ist detailliert in den Vorvertraglichen Informationen beschrieben. Die Aufteilung der nachhaltigen Investitionen in UN SDGs werden in folgender Grafik gemacht. Die historischen Vergleiche werden in nachfolgender Tabelle gemacht.

| | Indikator | Datum 2023 | Datum 2024 |
|-----------|---|------------|------------|
| Portfolio | Anteil nachhaltige Investitionen mit Umweltziel | 6.48% | 5.77% |
| | Anteil sozial nachhaltige Investitionen | 10.82% | 7.78% |
| | Total nachhaltige Quote | 17.3% | 13.55% |
| Benchmark | Anteil nachhaltige Investitionen mit Umweltziel | 4% | 5.23% |
| | Anteil sozial nachhaltige Investitionen | 7.11% | 6.97% |
| | Total nachhaltige Quote | 11.11% | 12.19% |

| | | | | | |
|---|----------------|---|----------------|---|--|
| 1  Keine Armut | 0.35% 1.06% | 7  Bezahlbare und saubere Energie | 2.93% 1.59% | 13  Massnahmen zum Klimaschutz | 0.00% 0.00% |
| 2  Kein Hunger | 0.03% 0.04% | 8  Menschenwürdige Arbeit und Wirtschaftswachstum | 2.88% 2.71% | 14  Leben unter Wasser | 0.11% 0.14% |
| 3  Gesundheit und Wohlergehen | 2.03% 0.74% | 9  Industrie, Innovation und Infrastruktur | 2.90% 2.60% | 15  Leben an Land | 0.07% 0.07% |
| 4  Hochwertige Bildung | 0.00% 0.06% | 10  Weniger Ungleichheiten | 0.00% 0.00% | 16  Frieden, Gerechtigkeit und starke Institutionen | 0.00% 0.00% |
| 5  Geschlechtergleichheit | 0.01% 0.03% | 11  Nachhaltige Städte und Gemeinden | 1.27% 1.72% | 17  Partnerschaften zur Erreichung der Ziele | 0.04% 0.58% |
| 6  Sauberes Wasser und Sanitäreinrichtungen | 0.71% 0.72% | 12  Nachhaltige/r Konsum und Produktion | 0.11% 0.10% | Total |  13.45% 12.14% |

 Portfolio  Benchmark

Aufgrund der unterschiedlichen Behandlung von Green, Social und Sustainable Bonds kann das SDG-Exposure von den prozentualen Umsätzen der im Portfolio des Fonds enthaltenen Unternehmungen und den der Benchmark, welche im Einklang mit den sich aus den SDGs ergebenden Umweltzielen gemäss Art. 2 (17) SFDR investiert worden sind, abweichen.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Im Berichtszeitraum konzentrierte sich der Vermögensverwalter auf Wertpapiere von Unternehmen, welche Umsätze aus dem Verkauf von Produkten und Dienstleistungen mit einem positiven Beitrag zu den 17 SDGs erzielten und dabei keine DNSH- und/oder Minimum Safeguards-Verletzungen aufgewiesen haben.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Emittenten mit einem negativen Nettobeitrag zu den SDGs wurden in der Berichtsperiode aus dem Anlageuniversum des Finanzproduktes entfernt. Darüber hinaus berücksichtigte der Teilfonds nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (engl: Principal Adverse Impacts - PAI). Zu diesem Zweck wurden die obligatorischen Indikatoren Anhang 1 der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1288 zur Ergänzung der Verordnung (EU) 2019/2088 zugrunde gelegt. Unternehmen, die der Vermögensverwalter gemäss PAI als besonders schädlich einstufte, wurden entsprechend nicht zu den nachhaltigen Anlagen gezählt. Emittenten, welche die PAIs 7 (Biodiversität), 10 (Global Compact der Vereinten Nationen (UNGC)/OECD Leitsätze für multinationale Unternehmen) oder 14 (Engagement in umstrittenen Waffen) verletzen, haben einen PAI-Score von null erhalten. Aus den restlichen PAI-Indikatoren wurde ein PAI-Score berechnet. Instrumente von Emittenten mit einem Score < 10 wurden nicht den nachhaltigen Investitionen angerechnet.

● **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Die nachteiligen Auswirkungen (PAI) sind systematisch im Anlageprozess berücksichtigt worden.

● **Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:**

Bei der Anlageanalyse für nachhaltige Investitionen wurden in der Berichtsperiode die folgenden Normverletzungen berücksichtigt: Global Compact der Vereinten Nationen (UNGC), die UN Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte (UNGP) und das Übereinkommen der Internationalen Arbeitsorganisation (ILO). Jeder schwerwiegende Verstoß gegen diese Normen führte zum Ausschluss des Emittenten aus dem investierbaren Universum des Finanzprodukts.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

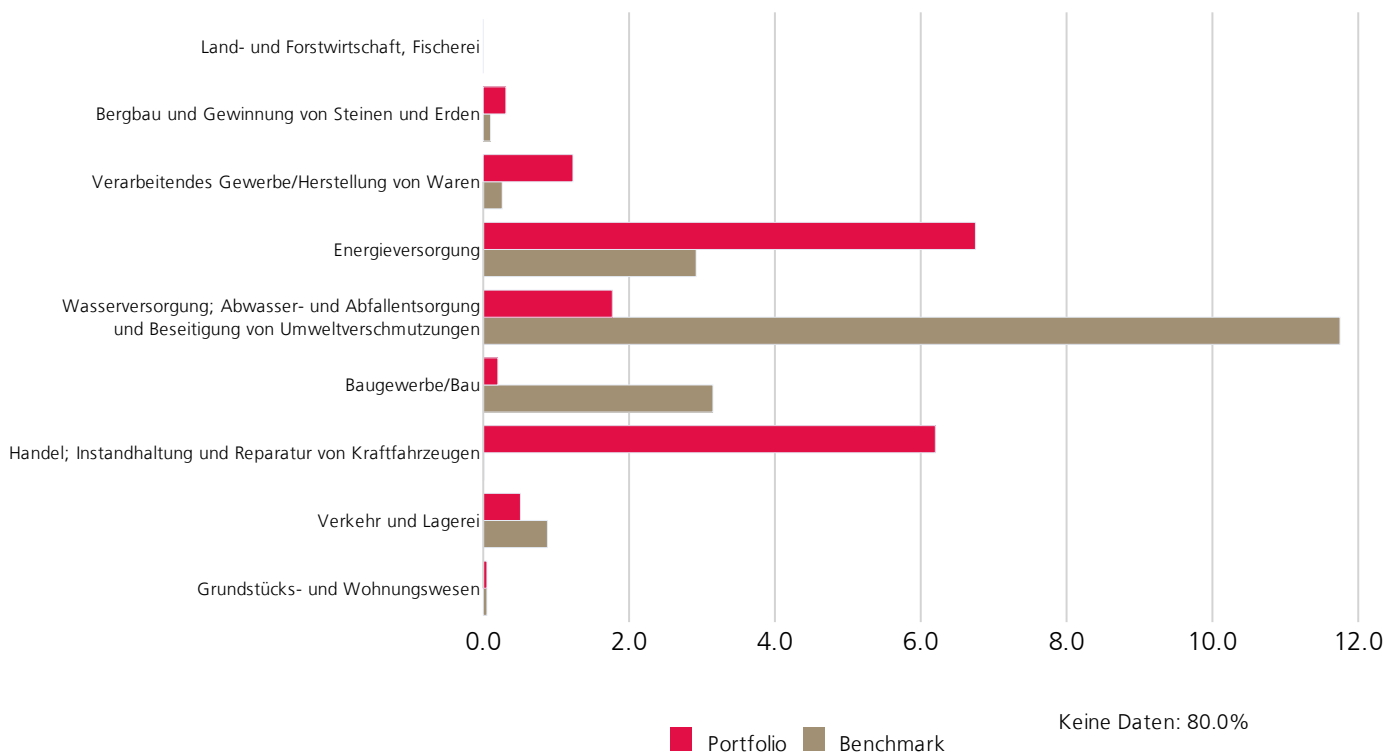
Nachteilige Nachhaltigkeitsauswirkungen (PAI) – Corporate Anlagen

Primäre Indikatoren - Energie und Emissionen

| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Benchmark Aktuell | Benchmark Vorjahr | Erklärung |
|--|--|-------------------|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|-----------|
| 1. THG-Emissionen | 1a. GHG Emissions - Scope 1 per Mio EUR Enterprise Value | 126.04 | 31.53% | 241.71 | 216.91 | 292.14 | |
| | 1b. GHG Emissions - Scope 2 per Mio EUR Enterprise Value | 37.76 | 31.53% | 93.32 | 47.65 | 62.41 | |
| | 1c. GHG Emissions - Scope 3 per Mio EUR Enterprise Value | 3310.97 | 31.53% | 9005.75 | 2143.11 | 2602.78 | |
| 2. CO ₂ -Fussabdruck | 2. GHG Emissions - Scope 1+2+3 per Mio EUR Enterprise Value | 89.8 | 31.53% | 188.84 | 70.6 | 59.83 | |
| 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird | 3. GHG Emissions - Emissions Intensity - Total Emissions (EUR) | 66.23 | 36.03% | 71.41 | 99.18 | 113.85 | |
| 4. Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind | 4. Fossil Fuel - Involvement (PAI) | 2.31% | 40.46% | 3.69% | 2.49% | 2.21% | |

| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Benchmark Aktuell | Benchmark Vorjahr | Erklärung |
|--|--|-------------------|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|---|
| 5. Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen | 5a. CR Raw - Energy use - Coal/nuclear/undear energy sources | 63.49% | 4.45% | 68.64% | 62.99% | 66.25% | |
| | 5b. Non-renewable energy consumption | 69.24% | 5.86% | 82.14% | 64.57% | 84.74% | Der Verbrauch nicht-erneuerbarer Energie umfasst den Verbrauch von Energie, die aus nicht-erneuerbaren Quellen erzeugt wird, sowie den Verbrauch von Energie aus Biomasse. Alle Zahlen zum Energieverbrauch, bei denen die Energiequelle unklar ist, sind ebenfalls in diesem Faktor enthalten. |
| | 5c. Non-renewable energy production | 0.94% | 40.16% | 2.73% | 6.33% | 6.38% | |
| 6. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren | 6. Energy consumption intensity (GWh/mEUR) | 0.11 | 16.47% | 0.28 | 0.47 | 0.35 | |

Intensität des Energieverbrauchs pro High Impact Sector (pro Mio. EUR)



| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Benchmark Aktuell | Benchmark Vorjahr | Erklärung |
|---|--|-------------------|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|-----------|
| 7. Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken | 7. Companies negatively affecting biodiversity-sensitive areas | 0% | 40.47% | 0% | 0% | 0% | |
| 8. Emissionen in Wasser | 8. CR Raw - COD emissions | 0.58 | 0.05% | 0.66 | 17.68 | 16.52 | |
| 9. Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle | 9. CR Raw - Hazardous waste | 0.02 | 1.62% | 0 | 0 | 0 | |

| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Benchmark Aktuell | Benchmark Vorjahr | Erklärung |
|--|--|-------------------|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|-----------|
| 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | 10. UNGC / OECD Guidelines Violation | 0% | 40.47% | 0% | 13.48% | 1.77% | |
| 11. Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen | 11. Lack of processes monitoring UNGC and OECD Guidelines compliance | 9.08% | 29.29% | 6.56% | 2.44% | 1.51% | |
| 12. Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle | 12. Unadjusted gender pay gap | 0.74% | 7.77% | 0.63% | 0.41% | 0.33% | |
| 13. Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen | 13. Ratio of female to male board members | 74.7% | 22.22% | 65.77% | 69.3% | 68.26% | |
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) | 14. Controversial weapons involvement (APM, CM, Bio, Chem) | 0% | 40.48% | 0% | 0% | 0% | |

Nachteilige Nachhaltigkeitsauswirkungen (PAI) – Staatliche und Supranationale Vermögenswerte

Primäre Indikatoren

| Umwelt | | | | | | | |
|--------------------|-------------------|-------------------|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|-----------|
| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Benchmark Aktuell | Benchmark Vorjahr | Erklärung |
| 15. GHG Intensität | 15. GHG Intensity | 167.32 | 42.75% | 177.83 | 158.52 | 169.92 | |

| Sozial | | | | | | | |
|--|---|-------------------|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|-----------|
| Indikator | Faktor | Portfolio Aktuell | Abdeckung | Portfolio Vorjahr | Benchmark Aktuell | Benchmark Vorjahr | Erklärung |
| 16. Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen | 16a. Countries subject to social violations (#) | 3.5 | 0.07% | 9.5 | 0 | 0 | |
| | 16b. Countries subject to social violations (%) | 8.14% | 0.07% | 22.7% | 0% | 0% | |

| Indikator | Metrik |
|-----------|---|
| 1a | Scope-1-Treibhausgas-Emissionen |
| 1b | Scope-2-Treibhausgas-Emissionen |
| 1c | Scope-3-Treibhausgas-Emissionen |
| 2. | CO2-Fussabdruck pro Mio EUR |
| 3. | THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird |
| 4. | Anteil der Investitionen in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind |
| 5a | Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung der Unternehmen, in die investiert wird, aus nicht erneuerbaren Energiequellen im Vergleich zu erneuerbaren Energiequellen, ausgedrückt in Prozent der gesamten Energiequellen |
| 5b | Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung der Unternehmen, in die investiert wird, aus nicht erneuerbaren Energiequellen im Vergleich zu erneuerbaren Energiequellen, ausgedrückt in Prozent der gesamten Energiequellen |
| 5c | Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung der Unternehmen, in die investiert wird, aus nicht erneuerbaren Energiequellen im Vergleich zu erneuerbaren Energiequellen, ausgedrückt in Prozent der gesamten Energiequellen |
| 6. | Energieverbrauch in GWh pro einer Million EUR Umsatz der Unternehmen, in die investiert wird, aufgeschlüsselt nach klimaintensiven Sektoren |
| 7. | Anteil der Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird, mit Standorten/Betrieben in oder in der Nähe von Gebieten mit schutzbedürftiger Biodiversität, sofern sich die Tätigkeiten dieser Unternehmen nachteilig auf diese Gebiete auswirken |
| 8. | Tonnen Emissionen in Wasser, die von den Unternehmen, in die investiert wird, pro investierter Million EUR verursacht werden, ausgedrückt als gewichteter Durchschnitt |
| 9. | Tonnen gefährlicher und radioaktiver Abfälle, die von den Unternehmen, in die investiert wird, pro investierter Million EUR erzeugt werden, ausgedrückt als gewichteter Durchschnitt |
| 10. | Anteil der Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird, die an Verstößen gegen die UNGC-Grundsätze oder gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen beteiligt waren |
| 11. | Anteil der Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird, die keine Richtlinien zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen oder keine Verfahren zur Bearbeitung von Beschwerden wegen Verstößen gegen die UNGC-Grundsätze und OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen eingerichtet haben |
| 12. | Durchschnittliches unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle bei den Unternehmen, in die investiert wird |
| 13. | Durchschnittliches Verhältnis von Frauen zu Männern in den Leitungs- und Kontrollorganen der Unternehmen, in die investiert wird, ausgedrückt als Prozentsatz aller Mitglieder der Leitungs- und Kontrollorgane |
| 14. | Anteil der Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird, die an der Herstellung oder am Verkauf von umstrittenen Waffen beteiligt sind |
| 15. | THG-Emissionsintensität der Länder, in die investiert wird |
| 16a | Anzahl der Länder, in die investiert wird, die nach Maßgabe internationaler Verträge und Übereinkommen, der Grundsätze der Vereinten Nationen oder, falls anwendbar, nationaler Rechtsvorschriften gegen soziale Bestimmungen verstoßen (absolute Zahl und relative Zahl, geteilt durch alle Länder, in die investiert wird) |
| 16b | Anzahl der Länder, in die investiert wird, die nach Maßgabe internationaler Verträge und Übereinkommen, der Grundsätze der Vereinten Nationen oder, falls anwendbar, nationaler Rechtsvorschriften gegen soziale Bestimmungen verstoßen (absolute Zahl und relative Zahl, geteilt durch alle Länder, in die investiert wird) |

Das Dokument wurde von Swisscanto mit geschäftsüblicher Sorgfalt erstellt und kann Informationen aus sorgfältig ausgewählten Drittquellen enthalten. Anleger sollten beachten, dass die zuvor für 2023 berechneten und veröffentlichten Daten für dieses in 2024 veröffentlichte Dokument neu berechnet wurden. Dementsprechend kann es zu Abweichungen bei diesen in den Jahren 2023 und 2024 veröffentlichten historischen Daten kommen.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 01.02.2023 - 31.01.2024

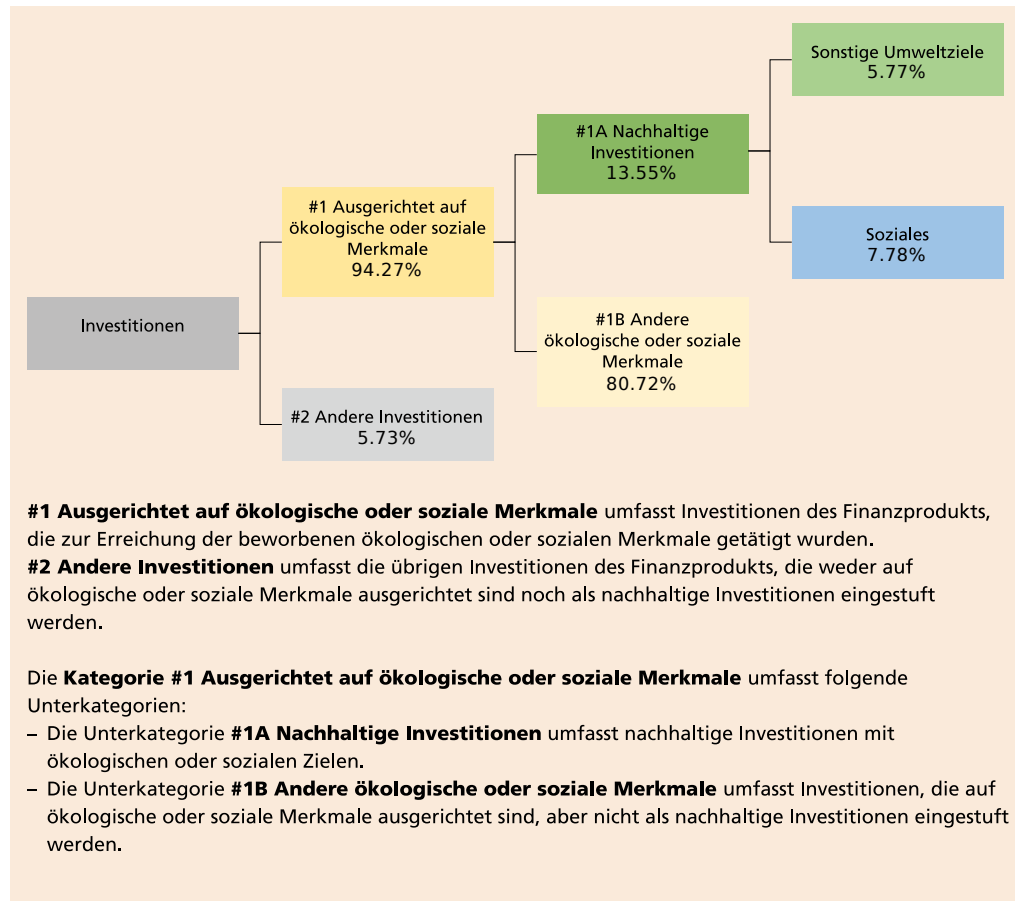
| Grösste Investitionen | Sektor | In % der Vermögenswerte | Land |
|---|---|-------------------------|----------------|
| Government of United Kingdom 0.625% 31-JUL-2035 REGS | Financial and Insurance Activities | 5.46% | |
| Government of United Kingdom 0.25% 31-JUL-2031 | Financial and Insurance Activities | 4.96% | |
| Government of United Kingdom 0.625% 22-OCT-2050 REGS | Financial and Insurance Activities | 4.16% | |
| Government of United Kingdom 1.5% 22-JUL-2047 | Financial and Insurance Activities | 4.06% | |
| Government of United Kingdom 1.75% 07-SEP-2037 | Financial and Insurance Activities | 3.94% | |
| Government of United Kingdom 1.25% 22-OCT-2041 | Financial and Insurance Activities | 2.39% | |
| New York Life Global Funding 4.35% 16-SEP-2025 REGS | Financial and Insurance Activities | 2.10% | USA |
| Government of United Kingdom 3.25% 22-JAN-2044 REGS | Financial and Insurance Activities | 2.06% | |
| Government of United Kingdom 0.125% 31-JAN-2024 | Financial and Insurance Activities | 1.98% | |
| Lloyds Bank Corporate Markets PLC 1.75% 11-JUL-2024 REGS | Financial and Insurance Activities | 1.89% | United Kingdom |
| DNB Bank ASA 2.625% 10-JUN-2026 REGS | Financial and Insurance Activities | 1.88% | Norway |
| Euroclear Bank SA 1.25% 30-SEP-2024 REGS | Financial and Insurance Activities | 1.88% | Belgium |
| Banque Federative du Credit Mutuel SA 5% 19-JAN-2026 REGS | Financial and Insurance Activities | 1.81% | France |
| International Finance Facility for Immunisation Co 2.75% 07-JUN-2025 REGS | Human Health and Social Work Activities | 1.77% | United Kingdom |
| Intesa Sanpaolo SpA 6.5% 14-MAR-2029 REGS | Financial and Insurance Activities | 1.77% | Italy |



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Der Anteil an nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen und Angaben zur Vermögensallokation werden in untenstehender Frage beantwortet.

Wie sah die Vermögensallokation aus?



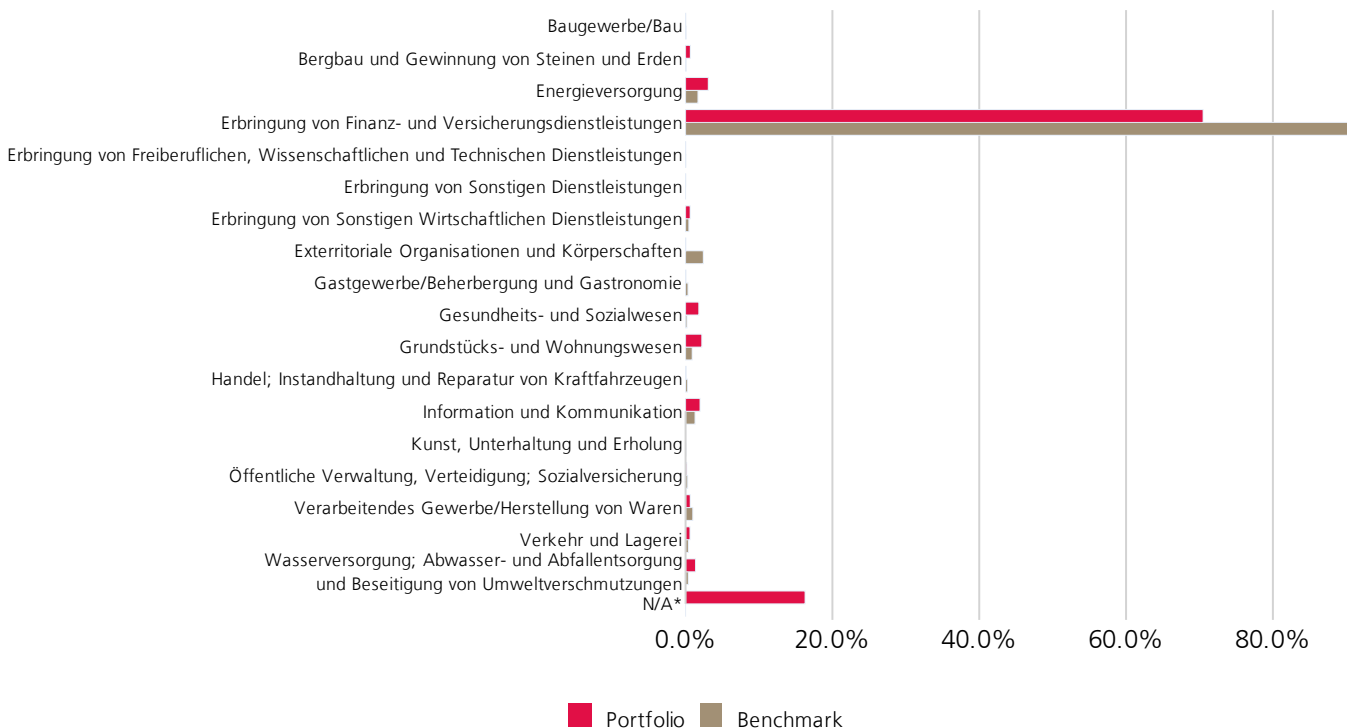
#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.
#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die **Kategorie #1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst nachhaltige Investitionen mit ökologischen oder sozialen Zielen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Wegen mangelnder Datenverfügbarkeit können Subsektoren nicht angezeigt werden.



*Diese Klassifizierung umfasst alle Bestände, für die keine NACE-Klassifizierung gefunden oder geschätzt werden kann; Liquidität ist darin enthalten. 445/449



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Obwohl keine Investitionen getätigt wurden, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind, wird in untenstehender Grafik die Alignment der nachhaltigen Investitionen mit der EU-Taxonomie offengelegt.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomeikonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert¹?

Ja

In fossiles Gas

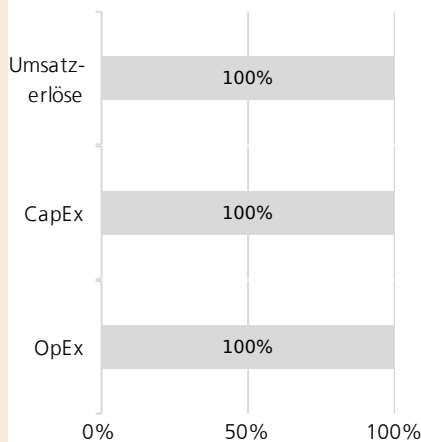
In Kernenergie

Nein

¹Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomeikonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels ("Klimaschutz") beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomeikonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

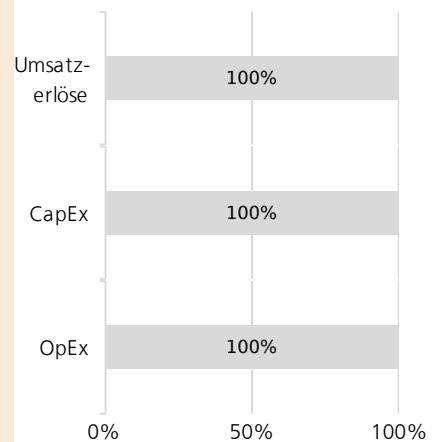
Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomeikonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzproduktes einschliesslich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzproduktes zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.

1. Taxonomiekonformität der Investitionen einschliesslich Staatsanleihen*



- Taxonomiekonform: Fossiles Gas
- Taxonomiekonform: Kernenergie
- Taxonomiekonform: (ohne fossiles Gas und Kernenergie)
- Nicht taxonomiekonform

2. Taxonomiekonformität der Investitionen ohne Staatsanleihen*



- Taxonomiekonform: Fossiles Gas
- Taxonomiekonform: Kernenergie
- Taxonomiekonform: (ohne fossiles Gas und Kernenergie)
- Nicht taxonomiekonform

Diese Grafik gibt **48.8%** der Gesamtinvestitionen wieder.

*Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff "Staatsanleihen" alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Mit Blick auf die EU-Taxonomeikonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomeikonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:
- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

Investitionsausgaben (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, z.B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft
- **Betriebsausgaben** (Opex), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Angaben zu Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten werden in der Tabelle zusammengefasst. Wenn keine Angaben verfügbar sind, wird die Tabelle ebenfalls keine Angaben enthalten.

| Issuer Name | Nace Sektor | Total Eligible Activity Revenue | Total Aligned Revenue | Total Likely Aligned Revenue | Total Potentially Aligned Revenue | Portfolio Gewicht (Consol.) |
|--|---|---------------------------------|-----------------------|------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------|
| Orsted | Electricity, Gas, Steam and Air Conditioning Supply | 56.27% | 18.25% | 31.86% | 0.00% | 0.34% |
| National Grid Electricity Distribution (West Midlands) Plc | Electricity, Gas, Steam and Air Conditioning Supply | 19.17% | 16.75% | 0.00% | 0.36% | 3.17% |
| National Grid Electricity Distribution (South West) Plc | Financial and Insurance Activities | 19.17% | 16.75% | 0.00% | 0.36% | 0.33% |
| EDP-Energias de Portugal SA | Electricity, Gas, Steam and Air Conditioning Supply | 77.52% | 12.25% | 0.00% | 32.43% | 0.00% |
| SPIE SA | Professional, Scientific and Technical Activities | 83.99% | 11.50% | 13.95% | 0.00% | 0.01% |
| Electricite de France SA | Electricity, Gas, Steam and Air Conditioning Supply | 71.56% | 9.50% | 0.00% | 7.23% | 0.00% |
| Iberdrola Finanzas SA | Electricity, Gas, Steam and Air Conditioning Supply | 61.60% | 9.13% | 0.00% | 15.60% | 0.01% |
| Iberdrola International BV | Electricity, Gas, Steam and Air Conditioning Supply | 61.60% | 9.13% | 0.00% | 15.60% | 0.00% |
| Veolia Environnement SA | Water Supply, Sewerage, Waste Management and Remediation Activities | 68.52% | 8.28% | 30.01% | 0.00% | 0.01% |
| Pirelli & C. S.p.A. | Manufacturing | 15.75% | 6.25% | 0.00% | 0.00% | 0.00% |

Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

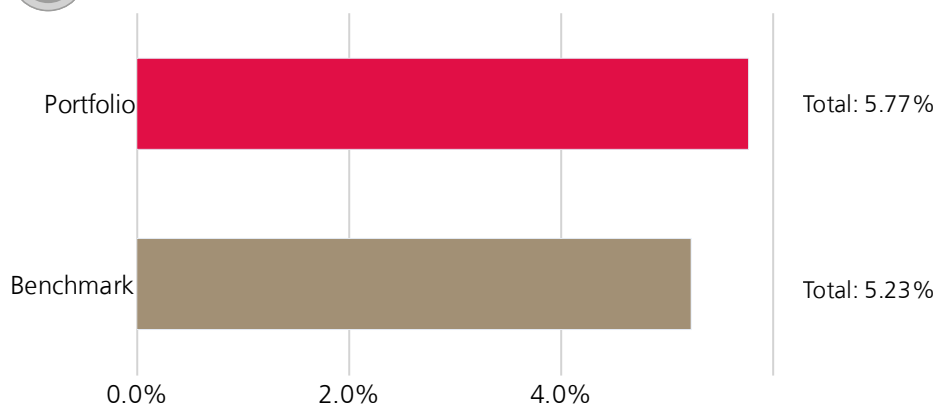
Da im vorangegangenen Berichtsjahr keine Daten verfügbar waren, erübrigt sich ein Vorjahresvergleich.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



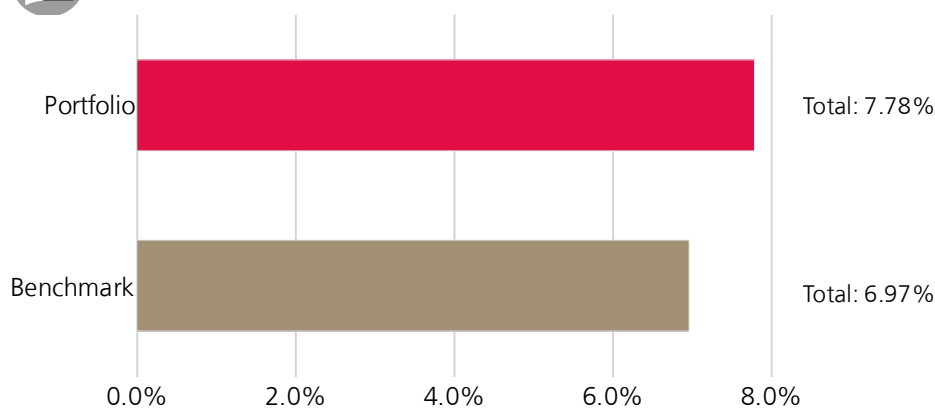
Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?



Das Diagramm zeigt die prozentualen Umsätze der im Portfolio des Fonds enthaltenen Unternehmungen und der der Benchmark, welche nicht EU-Taxonomie konform, jedoch im Einklang mit den sich aus den SDGs ergebenden Umweltzielen gemäss Art. 2 (17) SFDR investiert worden sind.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?



Das Diagramm zeigt die prozentualen Umsätze der im Portfolio des Fonds enthaltenen Unternehmungen und der der Benchmark, welche nicht EU-Taxonomie konform, jedoch im Einklang mit den sich aus den SDGs ergebenden sozialen Zielen gemäss Art. 2 (17) SFDR investiert worden sind.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Diese Vermögenswerte haben die in der spezifischen Anlagepolitik vorgesehenen Anlagen umfasst, einschliesslich Derivate zu Absicherungszwecken und flüssige Mittel. Die Anlagen, ausgenommen Derivate und flüssige Mittel, haben die Grundsätze des ökologischen oder sozialen Mindestschutzes umgesetzt.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Im Berichtszeitraum förderte der Vermögensverwalter durch Investment Stewardship und Kapitalallokation nachhaltige Geschäftspraktiken und die Einhaltung anerkannter internationaler Prinzipien und ESG-Best-Practice-Standards. Dementsprechend stand er im Dialog mit den Managementteams der investierten Unternehmen. Darüber hinaus hat er sich im Rahmen der United Nations Collaboration Platform for Responsible Investment (UN PRI) und bei Investoreninitiativen engagiert. Das Abstimmungsverhalten basierte auf den schweizerischen und internationalen Corporate-Governance-Regeln sowie auf den Prinzipien des UN Global Compact und den 17 Zielen für nachhaltige Entwicklung (UN SDGs). Weitere Informationen finden Sie unter: Swisscanto | Proxy Voting Dashboard (issgovernance.com) <https://www.swisscanto.com/int/de/nachhaltigkeit/investment-stewardship.html>

Swisscanto | Proxy Voting Dashboard (issgovernance.com)

<https://www.swisscanto.com/int/de/nachhaltigkeit/investment-stewardship.html>



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Es wurde kein Index als Referenzwert bestimmt, um festzustellen, ob dieses Finanzprodukt auf die beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet ist.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?

Nicht anwendbar.

Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?

Nicht anwendbar.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?

Nicht anwendbar.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?

Nicht anwendbar.

Das Dokument wurde von Swisscanto mit geschäftsüblicher Sorgfalt erstellt und kann Informationen aus sorgfältig ausgewählten Drittquellen enthalten. Anleger sollten beachten, dass die zuvor für 2023 berechneten und veröffentlichten Daten für dieses in 2024 veröffentlichte Dokument neu berechnet wurden. Dementsprechend kann es zu Abweichungen bei diesen in den Jahren 2023 und 2024 veröffentlichten historischen Daten kommen.