

UBS (Irl) Fund Solutions plc

**Eine offene Umbrella-Investmentgesellschaft mit variablem Kapital und getrennter Haftung zwischen
den Teilfonds**

**HALBJAHRESBERICHT UND UNGEPRÜFTER ZUSAMMENGEFASSTER
HALBJAHRESABSCHLUSS**

FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2023

Registrierungs-Nr. 484724

INHALT

	Seite
INFORMATIONEN ÜBER DIE GESELLSCHAFT	2
ALLGEMEINE INFORMATIONEN	5
ZUSAMMENGEFASSTE BILANZ	10
ZUSAMMENGEFASSTE GESAMTERGEBNISRECHNUNG	18
ZUSAMMENGEFASSTE ENTWICKLUNG DES DEN INHABERN RÜCKKAUFBARER, GEWINNBERECHTIGTER AKTIEN ZUZURECHNENDEN NETTOVERMÖGENS	26
ZUSAMMENGEFASSTE KAPITALFLUSSRECHNUNG	34
ERLÄUTERUNGEN ZUM ZUSAMMENGEFASSTEN HALBJAHRESABSCHLUSS	42
AUFSTELLUNGEN DES WERTPAPIERBESTANDS	76
WESENTLICHE PORTFOLIOTRANSAKTIONEN	149
ANHANG 1 - VERORDNUNG ÜBER DIE TRANSPARENZ VON WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN	167

INFORMATIONEN ÜBER DIE GESELLSCHAFT

VERWALTUNGSRATSMITGLIEDER	Alan White* (Ire) Naomi Daly**,*** (Irin) Audrey Collins** (Irin) Marie Antoinette Petrini* (Spanierin) Markus Goetschi* (Schweizer) *Nicht-geschäftsführende Verwaltungsratsmitglieder **Unabhängiges, nicht-geschäftsführendes Verwaltungsratsmitglied ***Vorsitzende(r) des Verwaltungsrates
EINGETRAGENER GESCHÄFTSSITZ	5 Earlsfort Terrace 2nd Floor, Dublin 2 D02 CK83 Irland
PROMOTER	UBS AG, Niederlassung London 5 Broadgate London EC2M 2QS Großbritannien
VERWALTUNGSGESELLSCHAFT	UBS Fund Management (Ireland) Limited College Park House South Frederick Street Dublin 2 Irland
ANLAGEVERWALTER	UBS Asset Management (UK) Limited 5 Broadgate London EC2M 2QS Großbritannien
ADMINISTRATOR	State Street Fund Services (Ireland) Limited 78 Sir John Rogerson's Quay Dublin 2 Irland
VERWAHRSTELLE	State Street Custodial Services (Ireland) Limited 78 Sir John Rogerson's Quay Dublin 2 Irland
UNABHÄNGIGER ABSCHLUSSPRÜFER	Ernst & Young Chartered Accountants & Statutory Auditors Harcourt Centre Harcourt Street Dublin 2 Irland
RECHTSBERATER IN IRLAND	Dechert 5 Earlsfort Terrace 2nd Floor, Dublin 2 D02 CK83 Irland
SEKRETÄR	Dechert Secretarial Limited 5 Earlsfort Terrace 2nd Floor, Dublin 2 D02 CK83 Irland

INFORMATIONEN ÜBER DIE GESELLSCHAFT (Fortsetzung)

UK FACILITES AGENT	UBS Asset Management (UK) Limited 5 Broadgate London EC2M 2QS Großbritannien
ZENTRAL- UND KORRESPONDENZSTELLE IN FRANKREICH	Société Générale 29 Boulevard Haussmann 75009 Paris Frankreich
DEUTSCHE ZAHL- UND INFORMATIONSTELLE	UBS Europe SE Bockenheimer Landstraße 2-4 60306 Frankfurt Deutschland
VERTRETER IN DER SCHWEIZ	UBS Fund Management (Switzerland) AG P.O. Box Aeschenvorstadt 1 4002 Basel Schweiz
ZAHLSTELLE IN DER SCHWEIZ	UBS Switzerland AG Bahnhofstrasse 45 8001 Zürich Schweiz und ihre Niederlassungen in der Schweiz
AUTORISIERTER TEILNEHMER	UBS AG Aeschenvorstadt 1 4002 Basel und Bahnhofstrasse 45 8001 Zürich Schweiz
VERTRIEBSGESELLSCHAFT	UBS Asset Management Switzerland AG Bahnhofstrasse 45 8001 Zürich Schweiz
SPANISCHER VERTRETER	UBS Europe SE, sucursal en España CI María de Molina, 4 28006, Madrid Spanien
EEA Facilities Agent	UBS Fund Management (Ireland) Limited College Park House South Frederick Street Dublin 2 Irland

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

INFORMATIONEN ÜBER DIE GESELLSCHAFT (Fortsetzung)

Die Satzung, der Verkaufsprospekt, die Basisinformationsblätter, die Jahres- und Halbjahresberichte sowie die Ausgabe- und Rücknahmepreise sind gemäß § 297(1) Kapitalanlagegesetzbuch (KAGB) kostenfrei bei der vorstehend angegebenen Zahl- und Informationsstelle in Deutschland erhältlich.

Anlegern in Deutschland stehen die folgenden Teilfonds offen:

CMCI COMPOSITE SF UCITS ETF
S&P 500 SF UCITS ETF
MSCI USA SF UCITS ETF
MSCI Emerging Markets SF UCITS ETF
Bloomberg Commodity Index SF UCITS ETF
MSCI AC Asia Ex Japan SF UCITS ETF
MSCI ACWI SF UCITS ETF
CMCI EX-AGRICULTURE SF UCITS ETF
Bloomberg Commodity CMCI SF UCITS ETF
CMCI Commodity Carry SF UCITS ETF
MSCI China A SF UCITS ETF
Euro Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF
Euro Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF
US Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF
US Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF
MSCI USA SF Index Fund
CMCI Commodity Carry Ex-Agriculture SF UCITS ETF
CMCI Commodity Transition SF UCITS ETF

ALLGEMEINE INFORMATIONEN

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

Struktur

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

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

Teilfonds	Auflegungsdatum	Währung
CMCI Composite SF UCITS ETF	3. November 2010	USD
Bloomberg Commodity Index SF UCITS ETF	3. November 2010	USD
S&P 500 SF UCITS ETF	15. Dezember 2010	USD
MSCI USA SF UCITS ETF	15. Dezember 2010	USD
MSCI Emerging Markets SF UCITS ETF	27. April 2011	USD
MSCI AC Asia Ex Japan SF UCITS ETF	20. August 2012	USD
MSCI ACWI SF UCITS ETF	11. August 2015	USD
CMCI Ex-Agriculture SF UCITS ETF	24. März 2016	USD
Bloomberg Commodity CMCI SF UCITS ETF	25. Mai 2017	USD
CMCI Commodity Carry SF UCITS ETF	16. Januar 2020	USD
MSCI China A SF UCITS ETF	18. Februar 2020	USD
Euro Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF	8. Juli 2020	EUR
Euro Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF	8. Juli 2020	EUR
US Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF	8. Juli 2020	USD
US Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF	8. Juli 2020	USD
MSCI USA SF Index Fund	9. Oktober 2020	USD
CMCI Commodity Carry Ex-Agriculture SF UCITS ETF	22. Januar 2021	USD
CMCI Commodity Transition SF UCITS ETF	24. Mai 2023	USD

Ausschüttungspolitik

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

Anlageziele

CMCI Composite SF UCITS ETF

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

Bloomberg Commodity Index SF UCITS ETF

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

S&P 500 SF UCITS ETF

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

ALLGEMEINE INFORMATIONEN (Fortsetzung)

Anlageziele (Fortsetzung)

MSCI USA SF UCITS ETF

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

MSCI Emerging Markets SF UCITS ETF

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

MSCI AC Asia Ex Japan SF UCITS ETF

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

MSCI ACWI SF UCITS ETF

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

CMCI Ex-Agriculture SF UCITS ETF

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

Bloomberg Commodity CMCI SF UCITS ETF

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

CMCI Commodity Carry SF UCITS ETF

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

MSCI China A SF UCITS ETF

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

Euro Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF

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

Euro Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF

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

US Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF

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

US Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF

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

ALLGEMEINE INFORMATIONEN (Fortsetzung)

Anlageziele (Fortsetzung)

MSCI USA SF Index Fund

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

CMCI Commodity Carry Ex-Agriculture SF UCITS ETF

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

CMCI Commodity Transition SF UCITS ETF

Anlageziel des CMCI Commodity Transition SF UCITS ETF ist es, den Nettogesamtertrag des Referenzindex (d. h. des UBS CMCI Sustainability Transition Index) zu erzielen.

Registrierung

Bestimmte Aktienklassen der folgenden Teilfonds der Gesellschaft sind am 31. Dezember 2023 für den öffentlichen Vertrieb in folgenden Ländern registriert:

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

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

ALLGEMEINE INFORMATIONEN (Fortsetzung)

Registrierung (Fortsetzung)

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

Teilfonds	Finnland	Norwegen	Chile	Portugal	Belgien
CMCI Composite SF UCITS ETF	Ja	Ja	-	Ja	Ja
Bloomberg Commodity Index SF UCITS ETF	Ja	Ja	-	Ja	-
S&P 500 SF UCITS ETF	Ja	Ja	-	Ja	-
MSCI USA SF UCITS ETF	Ja	Ja	-	Ja	-
MSCI Emerging Markets SF UCITS ETF	Ja	Ja	-	Ja	-
MSCI AC Asia Ex Japan SF UCITS ETF	Ja	Ja	-	Ja	-
MSCI ACWI SF UCITS ETF	Ja	Ja	Ja ²	Ja	-
CMCI Ex-Agriculture SF UCITS ETF	Ja	Ja	-	Ja	-
Bloomberg Commodity CMCI SF UCITS ETF	Ja	Ja	-	Ja	-
CMCI Commodity Carry SF UCITS ETF	Ja	Ja	-	Ja	-
MSCI China A SF UCITS ETF	Ja	Ja	-	Ja	-
Euro Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF	Ja	Ja	-	Ja	-
Euro Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF	Ja	Ja	-	Ja	-
US Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF	Ja	Ja	-	Ja	-
US Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF	Ja	Ja	-	Ja	-
MSCI USA SF Index Fund	-	-	-	Ja	-
CMCI Commodity Carry Ex-Agriculture SF UCITS ETF	Ja	Ja	-	Ja	-
CMCI Commodity Transition SF UCITS ETF	Ja	Ja	-	Ja	-

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

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

ALLGEMEINE INFORMATIONEN (Fortsetzung)

Registrierung (Fortsetzung)

² Die Ausschüttung ist auf die lokalen Pensionsfonds und andere institutionelle (professionelle) Kunden wie Vermögensverwalter beschränkt.

Börsennotierungen

Die Teilfonds der Gesellschaft sind per 31. Dezember 2023 an den folgenden Wertpapierbörsen notiert:

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

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

² Hauptbörsenplatz.

Vermögenspool

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

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

Zum 31. Dezember 2023 existierten zwei Pools (30. Juni 2023: zwei). Zum 31. Dezember 2023 wenden alle Teilfonds Pooling an.

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

**ZUSAMMENGEFASSTE BILANZ
ZUM 31. DEZEMBER 2023**

	Hinweis	CMCI Composite SF UCITS ETF USD	Bloomberg Commodity Index SF UCITS ETF USD	S&P 500 SF UCITS ETF USD	MSCI USA SF UCITS ETF USD	MSCI Emerging Markets SF UCITS ETF USD
UMLAUFVERMÖGEN						
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:						
Wertpapiere	1	1.434.407.615	152.843.242	142.701.497	451.273.487	90.193.589
Swaps zum beizulegenden Zeitwert	1,5(a)	49.077.636	9.728.059	5.808.752	18.161.137	8.585.473
Barsicherheit	5(a)	77.921.453	12.632.021	6.504.248	18.901.240	4.776.488
Swap-Forderungen		-	18	8.255	-	1.025
Sonstige Forderungen		788.202	23.065	43.079	111.075	10.205
Gesamtumlaufvermögen		1.562.194.906	175.226.405	155.065.831	488.446.939	103.566.780
KURZFRISTIGE VERBINDLICHKEITEN						
Zahlbar an Gegenpartei	5(a)	(77.921.453)	(12.632.021)	(6.504.248)	(18.901.240)	(4.776.488)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		-	-	-	(3.260.645)	-
Swap-Verbindlichkeiten		(32)	-	(4.127)	-	(515)
Sonstige Verbindlichkeiten		(788.202)	(23.065)	(43.080)	(111.075)	(10.205)
Kurzfristige Verbindlichkeiten insgesamt		(78.709.687)	(12.655.086)	(6.551.455)	(22.272.960)	(4.787.208)
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnendes Nettovermögen		1.483.485.219	162.571.319	148.514.376	466.173.979	98.779.572

Die beiliegenden Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

**ZUSAMMENGEFASSTE BILANZ (Fortsetzung)
ZUM 31. DEZEMBER 2023**

	Hinweis	MSCI AC Asia Ex Japan SF UCITS ETF USD	MSCI ACWI SF UCITS ETF USD	CMCI Ex-Agriculture SF UCITS ETF USD	Bloomberg Commodity CMCI SF UCITS ETF USD	CMCI Commodity Carry SF UCITS ETF USD
UMLAUFVERMÖGEN						
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:						
Wertpapiere	1	202.552.210	5.946.310.046	147.659.805	756.662.913	202.136.748
Swaps zum beizulegenden Zeitwert	1,5(a)	14.643.785	245.222.903	5.890.031	22.457.950	9.175.714
Barsicherheit	5(a)	8.253.936	174.204.555	7.951.495	35.619.862	7.958.445
Swap-Forderungen		-	-	-	117	-
Sonstige Forderungen		22.200	68.406	72.598	427.247	46.150
Gesamtumlaufvermögen		225.472.131	6.365.805.910	161.573.929	815.168.089	219.317.057
KURZFRISTIGE VERBINDLICHKEITEN						
Zahlbar an Gegenpartei	5(a)	(8.253.936)	(174.204.555)	(7.951.495)	(35.619.862)	(7.958.445)
Swap-Verbindlichkeiten		-	(3.090)	-	-	(25)
Sonstige Verbindlichkeiten		(22.200)	(68.406)	(72.598)	(427.247)	(46.150)
Kurzfristige Verbindlichkeiten insgesamt		(8.276.136)	(174.276.051)	(8.024.093)	(36.047.109)	(8.004.620)
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnendes Nettovermögen		217.195.995	6.191.529.859	153.549.836	779.120.980	211.312.437

Die beiliegenden Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

**ZUSAMMENGEFASSTE BILANZ (Fortsetzung)
ZUM 31. DEZEMBER 2023**

	Hinweis	MSCI China A SF UCITS ETF USD	Euro Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF EUR	Euro Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF EUR	US Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF USD	US Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF USD
UMLAUFVERMÖGEN						
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:						
Wertpapiere	1	87.221.919	3.280.656	29.348.426	4.179.239	17.292.039
Swaps zum beizulegenden Zeitwert	1,5(a)	6.155.139	126.048	1.117.534	169.422	684.142
Barsicherheit	5(a)	4.946.218	230.000	1.468.000	259.287	890.403
Sonstige Forderungen		159.133	287	6.437	289	531
Gesamtumlaufvermögen		98.482.409	3.636.991	31.940.397	4.608.237	18.867.115
KURZFRISTIGE VERBINDLICHKEITEN						
Zahlbar an Gegenpartei	5(a)	(4.946.218)	(230.000)	(1.468.000)	(259.287)	(890.403)
Sonstige Verbindlichkeiten		(159.133)	(287)	(6.437)	(289)	(531)
Kurzfristige Verbindlichkeiten insgesamt		(5.105.351)	(230.287)	(1.474.437)	(259.576)	(890.934)
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnendes Nettovermögen		93.377.058	3.406.704	30.465.960	4.348.661	17.976.181

Die beiliegenden Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

**ZUSAMMENGEFASSTE BILANZ (Fortsetzung)
ZUM 31. DEZEMBER 2023**

	Hinweis	MSCI USA SF Index Fund USD	CMCI Commodity Carry Ex-Agriculture SF UCITS ETF USD	CMCI Commodity Transition SF UCITS ETF USD	Insgesamt USD
UMLAUFVERMÖGEN					
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:					
Wertpapiere	1	1.441.839.115	56.443.967	1.996.209	11.171.755.927
Swaps zum beizulegenden Zeitwert	1,5(a)	61.214.370	2.368.340	57.339	460.773.860
Barsicherheit	5(a)	64.920.342	1.844.801	-	429.460.415
Forderungen aus Zeichnungen		26.676	-	-	26.676
Swap-Forderungen		1.401.646	-	-	1.411.061
Sonstige Forderungen		278.874	13.199	1.061	2.072.741
Gesamtumlaufvermögen		1.569.681.023	60.670.307	2.054.609	12.065.500.680
KURZFRISTIGE VERBINDLICHKEITEN					
Zahlbar an Gegenpartei	5(a)	(64.920.342)	(1.844.801)	-	(429.460.415)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(702.899)	-	-	(3.963.544)
Swap-Verbindlichkeiten		(725.407)	-	-	(733.196)
Sonstige Verbindlichkeiten		(278.874)	(13.199)	(1.061)	(2.072.742)
Kurzfristige Verbindlichkeiten insgesamt		(66.627.522)	(1.858.000)	(1.061)	(436.229.897)
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnendes Nettovermögen		1.503.053.501	58.812.307	2.053.548	11.629.270.783

Die beiliegenden Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

**BILANZ
ZUM 30. JUNI 2023**

	Hinweis	CMCI Composite SF UCITS ETF USD	Bloomberg Commodity Index SF UCITS ETF USD	S&P 500 SF UCITS ETF USD	MSCI USA SF UCITS ETF USD	MSCI Emerging Markets SF UCITS ETF USD
UMLAUFVERMÖGEN						
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:						
Wertpapiere	1	1.319.645.927	458.834.566	143.341.029	448.740.419	95.904.913
Swaps zum beizulegenden Zeitwert	1,5(a)	27.630.735	25.664.403	4.652.417	14.267.811	4.493.452
Barsicherheit	5(a)	37.864.692	25.668.673	4.433.435	13.723.795	5.675.288
Forderungen aus verkauften Anlagen		79.227.791	17.892.723	8.605.789	27.760.353	3.739.841
Swap-Forderungen		-	-	8.255	-	1.025
Sonstige Forderungen		1.669.752	127.926	82.807	218.300	5.603
Gesamtumlaufvermögen		1.466.038.897	528.188.291	161.123.732	504.710.678	109.820.122
KURZFRISTIGE VERBINDLICHKEITEN						
Zahlbar an Gegenpartei	5(a)	(37.864.692)	(25.668.673)	(4.433.435)	(13.723.795)	(5.675.288)
Verbindlichkeiten aus gekauften Anlagen		(79.134.832)	(17.926.281)	(8.595.692)	(26.868.015)	(3.747.261)
Swap-Verbindlichkeiten		(33)	(364)	(4.127)	-	(515)
Sonstige Verbindlichkeiten		(1.669.752)	(127.926)	(82.807)	(218.300)	(5.452)
Kurzfristige Verbindlichkeiten insgesamt		(118.669.309)	(43.723.244)	(13.116.061)	(40.810.110)	(9.428.516)
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnendes Nettovermögen		1.347.369.588	484.465.047	148.007.671	463.900.568	100.391.606

Die beiliegenden Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

BILANZ (Fortsetzung)
ZUM 30. JUNI 2023

	Hinweis	MSCI AC Asia Ex Japan SF UCITS ETF USD	MSCI ACWI SF UCITS ETF USD	CMCI Ex-Agriculture SF UCITS ETF USD	Bloomberg Commodity CMCI SF UCITS ETF USD	CMCI Commodity Carry SF UCITS ETF USD
UMLAUFVERMÖGEN						
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:						
Wertpapiere	1	223.105.817	5.825.977.203	142.330.447	547.932.776	191.344.491
Swaps zum beizulegenden Zeitwert	1,5(a)	3.528.119	127.317.966	3.764.618	11.683.787	2.331.752
Barsicherheit	5(a)	7.849.656	140.629.318	4.746.670	15.933.726	7.417.225
Forderungen aus verkauften Anlagen		13.394.639	349.775.162	8.545.117	32.896.331	11.487.781
Swap-Forderungen		-	-	-	196	-
Sonstige Forderungen		57.019	238.024	166.079	725.611	135.046
Gesamtumlaufvermögen		247.935.250	6.443.937.673	159.552.931	609.172.427	212.716.295
KURZFRISTIGE VERBINDLICHKEITEN						
Zahlbar an Gegenpartei	5(a)	(7.849.656)	(140.629.318)	(4.746.670)	(15.933.726)	(7.417.225)
Verbindlichkeiten aus gekauften Anlagen		(13.378.922)	(349.364.002)	(8.535.074)	(32.857.674)	(11.474.268)
Swap-Verbindlichkeiten		-	(6.757)	-	-	(26)
Sonstige Verbindlichkeiten		(57.019)	(238.024)	(166.079)	(725.611)	(135.046)
Kurzfristige Verbindlichkeiten insgesamt		(21.285.597)	(490.238.101)	(13.447.823)	(49.517.011)	(19.026.565)
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnendes Nettovermögen		226.649.653	5.953.699.572	146.105.108	559.655.416	193.689.730

Die beiliegenden Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

BILANZ (Fortsetzung)
ZUM 30. JUNI 2023

	Hinweis	MSCI China A SF UCITS ETF USD	Euro Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF EUR	Euro Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF EUR	US Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF USD	US Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF USD
UMLAUFVERMÖGEN						
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:						
Wertpapiere	1	115.214.736	5.269.224	26.751.896	6.158.578	20.711.380
Swaps zum beizulegenden Zeitwert	1,5(a)	1.746.134	200.448	517.940	151.777	465.688
Barsicherheit	5(a)	3.622.542	320.147	977.535	252.000	806.554
Forderungen aus verkauften Anlagen		6.917.167	317.395	1.611.419	369.745	1.243.453
Sonstige Forderungen		455.474	896	9.437	806	1.226
Gesamtumlaufvermögen		127.956.053	6.108.110	29.868.227	6.932.906	23.228.301
KURZFRISTIGE VERBINDLICHKEITEN						
Zahlbar an Gegenpartei	5(a)	(3.622.542)	(320.147)	(977.535)	(252.000)	(806.554)
Verbindlichkeiten aus gekauften Anlagen		(6.909.021)	(316.214)	(1.605.432)	(369.307)	(1.241.991)
Sonstige Verbindlichkeiten		(456.697)	(896)	(9.437)	(806)	(1.226)
Kurzfristige Verbindlichkeiten insgesamt		(10.988.260)	(637.257)	(2.592.404)	(622.113)	(2.049.771)
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnendes Nettovermögen		116.967.793	5.470.853	27.275.823	6.310.793	21.178.530

Die beiliegenden Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

BILANZ (Fortsetzung)
ZUM 30. JUNI 2023

	Hinweis	MSCI USA SF Index Fund USD	CMCI Commodity Carry Ex-Agriculture SF UCITS ETF USD	CMCI Commodity Transition SF UCITS ETF ¹ USD	Insgesamt USD
UMLAUFVERMÖGEN					
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:					
Wertpapiere	1	917.684.779	73.221.805	1.961.223	10.567.045.142
Swaps zum beizulegenden Zeitwert	1,5(a)	23.305.209	1.009.509	64.862	252.862.001
Barsicherheit	5(a)	23.648.909	3.196.428	-	296.884.683
Forderungen aus verkauften Anlagen		55.095.188	4.396.028	76.480	623.527.925
Forderungen aus Zeichnungen		81.005	-	-	81.005
Swap-Forderungen		307.045	-	-	316.521
Sonstige Forderungen		414.342	35.175	1.363	4.345.825
Gesamtumlaufvermögen		1.020.536.477	81.858.945	2.103.928	11.745.063.102
KURZFRISTIGE VERBINDLICHKEITEN					
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:					
Swaps zum beizulegenden Zeitwert	1,5(a)	-	-	(5.818)	(5.818)
Zahlbar an Gegenpartei	5(a)	(23.648.909)	(3.196.428)	-	(296.884.683)
Verbindlichkeiten aus gekauften Anlagen		(55.030.525)	(4.390.872)	(76.623)	(621.996.876)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(6.093.101)	-	-	(6.093.101)
Swap-Verbindlichkeiten		-	-	-	(11.822)
Sonstige Verbindlichkeiten		(414.342)	(35.175)	(1.363)	(4.346.898)
Kurzfristige Verbindlichkeiten insgesamt		(85.186.877)	(7.622.475)	(83.804)	(929.339.198)
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnendes Nettovermögen		935.349.600	74.236.470	2.020.124	10.815.723.904

¹ Der Teilfonds wurde am 24. Mai 2023 aufgelegt.

Die beiliegenden Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

**ZUSAMMENGEFASSTE GESAMTERGEBNISRECHNUNG
FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2023**

	Hinweis	CMCI Composite SF UCITS ETF USD	Bloomberg Commodity Index SF UCITS ETF USD	S&P 500 SF UCITS ETF USD	MSCI USA SF UCITS ETF USD	MSCI Emerging Markets SF UCITS ETF USD
Erträge						
Nettogewinn aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten	1	49.389.902	21.916.572	11.114.633	36.252.921	4.698.838
Gesamtanlageerträge		49.389.902	21.916.572	11.114.633	36.252.921	4.698.838
Aufwendungen						
Betriebskosten insgesamt	2,3	(2.413.186)	(274.666)	(136.500)	(334.428)	(97.183)
Aufwendungen insgesamt		(2.413.186)	(274.666)	(136.500)	(334.428)	(97.183)
Nettogewinn		46.976.716	21.641.906	10.978.133	35.918.493	4.601.655
Finanzierungskosten						
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Aktien	8	-	-	-	-	-
Finanzierungskosten gesamt		-	-	-	-	-
Zunahme des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit		46.976.716	21.641.906	10.978.133	35.918.493	4.601.655

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

Die beiliegenden Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

**ZUSAMMENGEFASSTE GESAMTERGEBNISRECHNUNG (Fortsetzung)
FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2023**

	Hinweis	MSCI AC Asia Ex Japan SF UCITS ETF USD	MSCI ACWI SF UCITS ETF USD	CMCI Ex-Agriculture SF UCITS ETF USD	Bloomberg Commodity CMCI SF UCITS ETF USD	CMCI Commodity Carry SF UCITS ETF USD
Erträge/(Kosten)						
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten	1	4.715.991	336.593.248	6.613.895	(1.487.229)	12.545.037
Gesamtanlageerträge/(-kosten)		4.715.991	336.593.248	6.613.895	(1.487.229)	12.545.037
Aufwendungen						
Betriebskosten insgesamt	2,3	(268.453)	(6.030.814)	(222.502)	(1.309.057)	(316.589)
Aufwendungen insgesamt		(268.453)	(6.030.814)	(222.502)	(1.309.057)	(316.589)
Nettogewinn/(-verlust)		4.447.538	330.562.434	6.391.393	(2.796.286)	12.228.448
Finanzierungskosten						
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Aktien	8	-	(4.428.274)	-	-	-
Finanzierungskosten gesamt		-	(4.428.274)	-	-	-
Zunahme/(Abnahme) des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit		4.447.538	326.134.160	6.391.393	(2.796.286)	12.228.448

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

Die beiliegenden Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

**ZUSAMMENGEFASSTE GESAMTERGEBNISRECHNUNG (Fortsetzung)
FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2023**

	Hinweis	MSCI China A SF UCITS ETF USD	Euro Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF EUR	Euro Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF EUR	US Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF USD	US Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF USD
(Kosten)/Erträge						
Netto(verlust)/-gewinn aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten	1	(7.469.035)	906	1.177.533	184.460	770.210
Gesamtanlage(kosten)/-erträge		(7.469.035)	906	1.177.533	184.460	770.210
Aufwendungen						
Betriebskosten insgesamt	2,3	(159.192)	(5.494)	(37.322)	(7.489)	(28.354)
Aufwendungen insgesamt		(159.192)	(5.494)	(37.322)	(7.489)	(28.354)
Netto(verlust)/-gewinn		(7.628.227)	(4.588)	1.140.211	176.971	741.856
Finanzierungskosten						
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Aktien	8	-	-	-	-	-
Finanzierungskosten gesamt		-	-	-	-	-
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnende Netto(abnahme)/-zunahme des Vermögens aus der Geschäftstätigkeit		(7.628.227)	(4.588)	1.140.211	176.971	741.856

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

Die beiliegenden Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

**ZUSAMMENGEFASSTE GESAMTERGEBNISRECHNUNG (Fortsetzung)
FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2023**

	Hinweis	MSCI USA SF Index Fund USD	CMCI Commodity Carry Ex-Agriculture SF UCITS ETF USD	CMCI Commodity Transition SF UCITS ETF USD	Insgesamt USD
Erträge					
Nettogewinn aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten	1	86.718.541	2.719.709	37.006	566.590.757
Gesamtanlageerträge		86.718.541	2.719.709	37.006	566.590.757
Aufwendungen					
Betriebskosten insgesamt	2,3	(601.616)	(111.293)	(3.582)	(12.361.267)
Aufwendungen insgesamt		(601.616)	(111.293)	(3.582)	(12.361.267)
Nettogewinn		86.116.925	2.608.416	33.424	554.229.490
Finanzierungskosten					
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Aktien	8	(198.361)	-	-	(4.626.635)
Finanzierungskosten gesamt		(198.361)	-	-	(4.626.635)
Zunahme des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit		85.918.564	2.608.416	33.424	549.602.855

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

Die beiliegenden Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

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

	Hinweis	CMCI Composite SF UCITS ETF USD	Bloomberg Commodity Index SF UCITS ETF USD	S&P 500 SF UCITS ETF USD	MSCI USA SF UCITS ETF USD	MSCI Emerging Markets SF UCITS ETF USD
(Kosten)/Erträge						
Netto(verlust)/-gewinn aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten	1	(19.178.753)	650.205	3.672.858	10.150.655	(3.308.150)
Gesamtanlage(kosten)/-erträge		(19.178.753)	650.205	3.672.858	10.150.655	(3.308.150)
Aufwendungen						
Betriebskosten insgesamt	2,3	(3.370.760)	(200.010)	(140.110)	(383.592)	(91.324)
Aufwendungen insgesamt		(3.370.760)	(200.010)	(140.110)	(383.592)	(91.324)
Netto(verlust)/-gewinn		(22.549.513)	450.195	3.532.748	9.767.063	(3.399.474)
Finanzierungskosten						
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Aktien	8	-	-	-	-	-
Finanzierungskosten gesamt		-	-	-	-	-
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnende Netto(abnahme)/-zunahme des Vermögens aus der Geschäftstätigkeit		(22.549.513)	450.195	3.532.748	9.767.063	(3.399.474)

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

Die beiliegenden Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

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

	Hinweis	MSCI AC Asia Ex Japan SF UCITS ETF USD	MSCI ACWI SF UCITS ETF USD	CMCI Ex-Agriculture SF UCITS ETF USD	Bloomberg Commodity CMCI SF UCITS ETF USD	CMCI Commodity Carry SF UCITS ETF USD
(Kosten)/Erträge						
Netto(verlust)/-gewinn aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten	1	(7.539.552)	(325.299.378)	2.174.375	14.739.065	18.390.212
Gesamtanlage(kosten)/-erträge		(7.539.552)	(325.299.378)	2.174.375	14.739.065	18.390.212
Aufwendungen						
Betriebskosten insgesamt	2,3	(216.884)	(4.302.998)	(201.771)	(873.901)	(209.552)
Aufwendungen insgesamt		(216.884)	(4.302.998)	(201.771)	(873.901)	(209.552)
Netto(verlust)/-gewinn		(7.756.436)	(329.602.376)	1.972.604	13.865.164	18.180.660
Finanzierungskosten						
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Aktien	8	-	(3.744.707)	-	-	-
Finanzierungskosten gesamt		-	(3.744.707)	-	-	-
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnende Netto(abnahme)/-zunahme des Vermögens aus der Geschäftstätigkeit		(7.756.436)	(333.347.083)	1.972.604	13.865.164	18.180.660

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

Die beiliegenden Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

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

	Hinweis	MSCI China A SF UCITS ETF USD	Euro Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF EUR	Euro Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF EUR	US Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF USD	US Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF USD
(Kosten)/Erträge						
Netto(verlust)/-gewinn aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten	1	(22.400.027)	68.282	644.387	(271.675)	311.745
Gesamtanlage(kosten)/-erträge		(22.400.027)	68.282	644.387	(271.675)	311.745
Aufwendungen						
Betriebskosten insgesamt	2,3	(220.475)	(6.155)	(26.434)	(7.608)	(25.345)
Aufwendungen insgesamt		(220.475)	(6.155)	(26.434)	(7.608)	(25.345)
Netto(verlust)/-gewinn		(22.620.502)	62.127	617.953	(279.283)	286.400
Finanzierungskosten						
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Aktien	8	-	-	-	-	-
Finanzierungskosten gesamt		-	-	-	-	-
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnende Netto(abnahme)/-zunahme des Vermögens aus der Geschäftstätigkeit		(22.620.502)	62.127	617.953	(279.283)	286.400

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

Die beiliegenden Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

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

	Hinweis	MSCI USA SF Index Fund USD	CMCI Commodity Carry Ex-Agriculture SF UCITS ETF USD	Insgesamt USD
Erträge/(Kosten)				
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten	1	7.571.888	10.663.773	(308.949.971)
Gesamtanlageerträge/(-kosten)		7.571.888	10.663.773	(308.949.971)
Aufwendungen				
Betriebskosten insgesamt	2,3	(538.970)	(89.995)	(10.906.347)
Aufwendungen insgesamt		(538.970)	(89.995)	(10.906.347)
Nettogewinn/(-verlust)		7.032.918	10.573.778	(319.856.318)
Finanzierungskosten				
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Aktien	8	(482.575)	-	(4.227.282)
Finanzierungskosten gesamt		(482.575)	-	(4.227.282)
Zunahme/(Abnahme) des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit		6.550.343	10.573.778	(324.083.600)

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

Die beiliegenden Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

**ZUSAMMENGEFASSTE ENTWICKLUNG DES DEN INHABERN RÜCKKAUFBARER, GEWINNBERECHTIGTER AKTIEN
ZUZURECHNENDEN NETTOVERMÖGENS
FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2023**

		CMCI Composite SF UCITS ETF USD	Bloomberg Commodity Index SF UCITS ETF USD	S&P 500 SF UCITS ETF USD	MSCI USA SF UCITS ETF USD	MSCI Emerging Markets SF UCITS ETF USD
	Hinweis					
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnendes Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums		1.347.369.588	484.465.047	148.007.671	463.900.568	100.391.606
Zunahme des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit		46.976.716	21.641.906	10.978.133	35.918.493	4.601.655
Aktientransaktionen						
Ausgabe rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien im Berichtszeitraum	4	272.470.094	19.206.704	-	27.324.058	5.443.262
Rücknahme rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien im Berichtszeitraum	4	(183.331.179)	(362.742.338)	(10.471.428)	(60.969.140)	(11.656.951)
Nettozunahme/(-abnahme) aus Aktientransaktionen		89.138.915	(343.535.634)	(10.471.428)	(33.645.082)	(6.213.689)
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnendes Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums		1.483.485.219	162.571.319	148.514.376	466.173.979	98.779.572

Die beiliegenden Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

**ZUSAMMENGEFASSTE ENTWICKLUNG DES DEN INHABERN RÜCKKAUFBARER, GEWINNBERECHTIGTER AKTIEN
ZUZURECHNENDEN NETTOVERMÖGENS (Fortsetzung)
FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2023**

Hinweis	MSCI AC Asia Ex Japan SF UCITS ETF USD	MSCI ACWI SF UCITS ETF USD	CMCI Ex-Agriculture SF UCITS ETF USD	Bloomberg Commodity CMCI SF UCITS ETF USD	CMCI Commodity Carry SF UCITS ETF USD
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnendes Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums	226.649.653	5.953.699.572	146.105.108	559.655.416	193.689.730
Zunahme/(Abnahme) des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit	4.447.538	326.134.160	6.391.393	(2.796.286)	12.228.448
Aktientransaktionen					
Ausgabe rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien im Berichtszeitraum	20.401.212	1.973.874.575	73.809.589	477.742.418	128.472.703
Rücknahme rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien im Berichtszeitraum	(34.302.408)	(2.062.178.448)	(72.756.254)	(255.480.568)	(123.078.444)
Netto(abnahme)/-zunahme aus Aktientransaktionen	(13.901.196)	(88.303.873)	1.053.335	222.261.850	5.394.259
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnendes Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums	217.195.995	6.191.529.859	153.549.836	779.120.980	211.312.437

Die beiliegenden Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

**ZUSAMMENGEFASSTE ENTWICKLUNG DES DEN INHABERN RÜCKKAUFBARER, GEWINNBERECHTIGTER AKTIEN
ZUZURECHNENDEN NETTOVERMÖGENS (Fortsetzung)
FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2023**

	Hinweis	MSCI China A SF UCITS ETF USD	Euro Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF EUR	Euro Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF EUR	US Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF USD	US Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF USD
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnendes Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums		116.967.793	5.470.853	27.275.823	6.310.793	21.178.530
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnende Netto(abnahme)/-zunahme des Vermögens aus der Geschäftstätigkeit		(7.628.227)	(4.588)	1.140.211	176.971	741.856
Aktientransaktionen						
Ausgabe rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien im Berichtszeitraum	4	17.256.127	-	2.049.926	-	-
Rücknahme rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien im Berichtszeitraum	4	(33.218.635)	(2.059.561)	-	(2.139.103)	(3.944.205)
Netto(abnahme)/-zunahme aus Aktientransaktionen		(15.962.508)	(2.059.561)	2.049.926	(2.139.103)	(3.944.205)
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnendes Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums		93.377.058	3.406.704	30.465.960	4.348.661	17.976.181

Die beiliegenden Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

**ZUSAMMENGEFASSTE ENTWICKLUNG DES DEN INHABERN RÜCKKAUFBARER, GEWINNBERECHTIGTER AKTIEN ZUZURECHNENDEN NETTOVERMÖGENS (Fortsetzung)
FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2023**

	Hinweis	MSCI USA SF Index Fund USD	CMCI Commodity Carry Ex-Agriculture SF UCITS ETF USD	CMCI Commodity Transition SF UCITS ETF USD	Insgesamt USD
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnendes Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums		935.349.600	74.236.470	2.020.124	10.815.723.904
Zunahme des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit		85.918.564	2.608.416	33.424	549.602.855
Aktientransaktionen					
Ausgabe rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien im Berichtszeitraum	4	699.049.033	8.602.521	-	3.725.872.032
Rücknahme rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien im Berichtszeitraum	4	(217.263.696)	(26.635.100)	-	(3.462.398.066)
Nettozunahme/(-abnahme) aus Aktientransaktionen		481.785.337	(18.032.579)	-	263.473.966
Berichtigung aus der Währungsumrechnung	1	-	-	-	470.058
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnendes Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums		1.503.053.501	58.812.307	2.053.548	11.629.270.783

Die beiliegenden Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

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

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

Die beiliegenden Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

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

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

Die beiliegenden Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

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

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

Die beiliegenden Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

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

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

Die beiliegenden Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

**ZUSAMMENGEFASSTE KAPITALFLUSSRECHNUNG
FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2023**

	Hinweis	CMCI Composite SF UCITS ETF USD	Bloomberg Commodity Index SF UCITS ETF USD	S&P 500 SF UCITS ETF USD	MSCI USA SF UCITS ETF USD	MSCI Emerging Markets SF UCITS ETF USD
Cashflow aus laufender Geschäftstätigkeit						
Zunahme des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit		46.976.716	21.641.906	10.978.133	35.918.493	4.601.655
<i>Berichtigung für:</i>		-	-	-	-	-
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Aktien		-	-	-	-	-
Insgesamt		46.976.716	21.641.906	10.978.133	35.918.493	4.601.655
Nettogewinn aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten		(49.389.902)	(21.916.572)	(11.114.633)	(36.252.921)	(4.698.838)
Betriebskosten insgesamt	2,3	2.413.186	274.666	136.500	334.428	97.183
Veränderung nicht abgerechneter Anlagen		92.958	(33.940)	10.098	4.152.983	(7.269)
Kauf von Anlagen		(1.734.851.799)	(936.925.957)	(95.823.629)	(466.168.364)	(108.191.307)
Verkauf von Anlagen		1.645.619.926	1.280.495.531	106.284.959	495.660.463	114.412.265
(Anstieg)/Rückgang der Barsicherheiten		(40.056.761)	13.036.652	(2.070.813)	(5.177.445)	898.800
Zunahme/(Abnahme) der an die Gegenpartei zahlbaren Beträge		40.056.761	(13.036.652)	2.070.813	5.177.445	(898.800)
Nettomittel(abfluss)/-zufluss aus laufender Geschäftstätigkeit		(89.138.915)	343.535.634	10.471.428	33.645.082	6.213.689
Cashflow aus der Finanzierungstätigkeit						
Erlöse aus der Ausgabe rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien im Berichtszeitraum		272.470.094	19.206.704	-	27.324.058	5.443.262
Zahlungen für im Berichtszeitraum zurückgenommene rückkaufbare, gewinnberechtigter Aktien		(183.331.179)	(362.742.338)	(10.471.428)	(60.969.140)	(11.656.951)
Nettomittelzufluss/(-abfluss) aus der Finanzierungstätigkeit		89.138.915	(343.535.634)	(10.471.428)	(33.645.082)	(6.213.689)
Nettoveränderung von Zahlungsmitteln und Zahlungsmitteläquivalenten		-	-	-	-	-
Nettozahlungsmittel und -zahlungsmitteläquivalente zu Beginn des Berichtszeitraums		-	-	-	-	-
Nettozahlungsmittel und -zahlungsmitteläquivalente am Ende des Berichtszeitraums		-	-	-	-	-
Zusätzliche Informationen						
Gezahlte Steuern		(11)	-	(1)	(3)	-
Zinsertrag		12	-	-	3	-
Zinsaufwand		(5)	-	-	(2)	-
Dividendeneinkünfte		13.139.131	-	1.332.981	4.126.080	-

Das Layout der zusammengefassten Kapitalflussrechnung für den laufenden Berichtszeitraum wurde im Vergleich zum Layout der im zusammengefassten Halbjahresabschluss des Vorjahres aufgeführten Kapitalflussrechnung modifiziert. Die an die Inhaber rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile gezahlten Ausschüttungen wurden gesondert als Finanzierungstätigkeit ausgewiesen. Die Vergleichszahlen blieben so eingestuft, wie sie in dem zusammengefassten Halbjahresabschluss des Vorjahres ausgewiesen wurden. Diese Änderung an der Darstellung hat keine Auswirkungen auf die Zunahme/(Abnahme) des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023.

Die beiliegenden Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

**ZUSAMMENGEFASSTE KAPITALFLUSSRECHNUNG (Fortsetzung)
FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2023**

Hinweis	MSCI AC Asia Ex Japan SF UCITS ETF USD	MSCI ACWI SF UCITS ETF USD	CMCI Ex-Agriculture SF UCITS ETF USD	Bloomberg Commodity CMCI SF UCITS ETF USD	CMCI Commodity Carry SF UCITS ETF USD
Cashflow aus laufender Geschäftstätigkeit					
Zunahme/(Abnahme) des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit	4.447.538	326.134.160	6.391.393	(2.796.286)	12.228.448
<i>Berichtigung für:</i>					
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Aktien	-	4.428.274	-	-	-
Insgesamt	4.447.538	330.562.434	6.391.393	(2.796.286)	12.228.448
Netto(gewinn)/-verlust aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten	(4.715.991)	(332.164.974)	(6.613.895)	1.487.229	(12.545.037)
Betriebskosten insgesamt	2,3 268.453	6.030.814	222.502	1.309.057	316.589
Veränderung nicht abgerechneter Anlagen	15.717	407.493	10.043	38.736	13.512
Kauf von Anlagen	(228.386.822)	(11.770.961.821)	(436.936.803)	(2.366.568.466)	(712.861.615)
Verkauf von Anlagen	242.272.301	11.858.858.201	435.873.425	2.144.267.880	707.453.844
Anstieg der Barsicherheiten	(404.280)	(33.575.237)	(3.204.825)	(19.686.136)	(541.220)
Zunahme der an die Gegenpartei zahlbaren Beträge	404.280	33.575.237	3.204.825	19.686.136	541.220
Nettomittelzufluss/(-abfluss) aus laufender Geschäftstätigkeit	13.901.196	92.732.147	(1.053.335)	(222.261.850)	(5.394.259)
Cashflow aus der Finanzierungstätigkeit					
An Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Aktien gezahlte Ausschüttungen	-	(4.428.274)	-	-	-
Erlöse aus der Ausgabe rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien im Berichtszeitraum	20.401.212	1.973.874.575	73.809.589	477.742.418	128.472.703
Zahlungen für im Berichtszeitraum zurückgenommene rückkaufbare, gewinnberechtigter Aktien	(34.302.408)	(2.062.178.448)	(72.756.254)	(255.480.568)	(123.078.444)
Nettomittel(abfluss)/-zufluss aus der Finanzierungstätigkeit	(13.901.196)	(92.732.147)	1.053.335	222.261.850	5.394.259
Nettoveränderung von Zahlungsmitteln und Zahlungsmitteläquivalenten	-	-	-	-	-
Nettozahlungsmittel und -zahlungsmitteläquivalente zu Beginn des Berichtszeitraums	-	-	-	-	-
Nettozahlungsmittel und -zahlungsmitteläquivalente am Ende des Berichtszeitraums	-	-	-	-	-
Zusätzliche Informationen					
Gezahlte Steuern	(2)	(32)	(1)	(6)	(2)
Zinsertrag	3	17	-	3	-
Zinsaufwand	-	(1.678)	-	(19)	-
Dividendeneinkünfte	2.140.184	54.409.592	1.162.441	7.069.712	1.749.327
Dividendenaufwand	-	(4.428.274)	-	-	-

Das Layout der zusammengefassten Kapitalflussrechnung für den laufenden Berichtszeitraum wurde im Vergleich zum Layout der im zusammengefassten Halbjahresabschluss des Vorjahres aufgeführten Kapitalflussrechnung modifiziert. Die an die Inhaber rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile gezahlten Ausschüttungen wurden gesondert als Finanzierungstätigkeit ausgewiesen. Die Vergleichszahlen blieben so eingestuft, wie sie in dem zusammengefassten Halbjahresabschluss des Vorjahres ausgewiesen wurden. Diese Änderung an der Darstellung hat keine Auswirkungen auf die Zunahme/(Abnahme) des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023.

Die beiliegenden Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

**ZUSAMMENGEFASSTE KAPITALFLUSSRECHNUNG (Fortsetzung)
FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2023**

	Hinweis	MSCI	Euro Equity	Defensive	Euro Equity	Defensive	US Equity	Defensive	US Equity	Defensive
		China A	Equity	Covered	Equity	Put	Covered	Put	Covered	Put
		SF UCITS	SF UCITS	SF UCITS	SF UCITS	SF UCITS	SF UCITS	SF UCITS	SF UCITS	SF UCITS
		ETF	ETF	ETF	ETF	ETF	ETF	ETF	ETF	ETF
		USD	EUR	EUR	EUR	EUR	USD	USD	USD	USD
Cashflow aus laufender Geschäftstätigkeit										
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnende Netto(abnahme)/-zunahme des Vermögens aus der Geschäftstätigkeit		(7.628.227)		(4.588)		1.140.211		176.971		741.856
<i>Berichtigung für:</i>										
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Aktien		-		-		-		-		-
Insgesamt		(7.628.227)		(4.588)		1.140.211		176.971		741.856
Nettoverlust/(-gewinn) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten		7.469.035		(906)		(1.177.533)		(184.460)		(770.210)
Betriebskosten insgesamt	2,3	159.192		5.494		37.322		7.489		28.354
Veränderung nicht abgerechneter Anlagen		6.923		1.181		5.987		438		1.462
Kauf von Anlagen		(188.478.732)		(4.370.818)		(22.246.780)		(5.189.432)		(16.351.159)
Verkauf von Anlagen		204.434.317		6.429.198		20.190.867		7.328.097		20.293.902
(Anstieg)/Rückgang der Barsicherheiten		(1.323.676)		90.147		(490.465)		(7.287)		(83.849)
Zunahme/(Abnahme) der an die Gegenpartei zahlbaren Beträge		1.323.676		(90.147)		490.465		7.287		83.849
Nettomittelzufluss/(-abfluss) aus laufender Geschäftstätigkeit		15.962.508		2.059.561		(2.049.926)		2.139.103		3.944.205
Cashflow aus der Finanzierungstätigkeit										
Erlöse aus der Ausgabe rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien im Berichtszeitraum		17.256.127		-		2.049.926		-		-
Zahlungen für im Berichtszeitraum zurückgenommene rückkaufbare, gewinnberechtigter Aktien		(33.218.635)		(2.059.561)		-		(2.139.103)		(3.944.205)
Nettomittel(abfluss)/-zufluss aus der Finanzierungstätigkeit		(15.962.508)		(2.059.561)		2.049.926		(2.139.103)		(3.944.205)
Nettoveränderung von Zahlungsmitteln und Zahlungsmitteläquivalenten		-		-		-		-		-
Nettozahlungsmittel und -zahlungsmitteläquivalente zu Beginn des Berichtszeitraums		-		-		-		-		-
Nettozahlungsmittel und -zahlungsmitteläquivalente am Ende des Berichtszeitraums		-		-		-		-		-
Zusätzliche Informationen										
Gezahlte Steuern		(1)		-		-		-		-
Zinsertrag		-		-		-		-		-
Zinsaufwand		-		-		-		-		-
Dividendeneinkünfte		1.051.116		34.279		270.634		45.147		176.787

Das Layout der zusammengefassten Kapitalflussrechnung für den laufenden Berichtszeitraum wurde im Vergleich zum Layout der im zusammengefassten Halbjahresabschluss des Vorjahres aufgeführten Kapitalflussrechnung modifiziert. Die an die Inhaber rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile gezahlten Ausschüttungen wurden gesondert als Finanzierungstätigkeit ausgewiesen. Die Vergleichszahlen blieben so eingestuft, wie sie in dem zusammengefassten Halbjahresabschluss des Vorjahres ausgewiesen wurden. Diese Änderung an der Darstellung hat keine Auswirkungen auf die Zunahme/(Abnahme) des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023.

Die beiliegenden Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

**ZUSAMMENGEFASSTE KAPITALFLUSSRECHNUNG (Fortsetzung)
FÜR DEN SECHSMONATIGEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2023**

	Hinweis	MSCI USA SF Index Fund USD	CMCI Commodity Carry Ex-Agriculture SF UCITS ETF USD	CMCI Commodity Transition SF UCITS ETF USD	Insgesamt USD
Cashflow aus laufender Geschäftstätigkeit					
Zunahme des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit		85.918.564	2.608.416	33.424	549.602.855
<i>Berichtigung für:</i>					
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Aktien		198.361	-	-	4.626.635
Insgesamt		86.116.925	2.608.416	33.424	554.229.490
Nettogewinn aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten		(86.520.180)	(2.719.709)	(37.006)	(561.964.122)
Betriebskosten insgesamt	2,3	601.616	111.293	3.582	12.361.267
Veränderung nicht abgerechneter Anlagen		(5.640.404)	5.156	(143)	(918.475)
Kauf von Anlagen		(2.509.791.943)	(109.432.282)	(2.275.537)	(21.718.018.189)
Verkauf von Anlagen		2.033.647.010	127.459.705	2.275.680	21.455.462.698
(Anstieg)/Rückgang der Barsicherheiten		(41.271.433)	1.351.627	-	(132.549.362)
Zunahme/(Abnahme) der an die Gegenpartei zahlbaren Beträge		41.271.433	(1.351.627)	-	132.549.362
Nettomittel(abfluss)/-zufluss aus laufender Geschäftstätigkeit		(481.586.976)	18.032.579	-	(258.847.331)
Cashflow aus der Finanzierungstätigkeit					
An Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Aktien gezahlte Ausschüttungen		(198.361)	-	-	(4.626.635)
Erlöse aus der Ausgabe rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien im Berichtszeitraum		699.049.033	8.602.521	-	3.725.872.032
Zahlungen für im Berichtszeitraum zurückgenommene rückkaufbare, gewinnberechtigter Aktien		(217.263.696)	(26.635.100)	-	(3.462.398.066)
Nettomittelzufluss/(-abfluss) aus der Finanzierungstätigkeit		481.586.976	(18.032.579)	-	258.847.331
Nettoveränderung von Zahlungsmitteln und Zahlungsmitteläquivalenten		-	-	-	-
Nettozahlungsmittel und -zahlungsmitteläquivalente zu Beginn des Berichtszeitraums		-	-	-	-
Nettozahlungsmittel und -zahlungsmitteläquivalente am Ende des Berichtszeitraums		-	-	-	-
Zusätzliche Informationen					
Gezahlte Steuern		(7)	(1)	-	(67)
Zinsertrag		175.682	-	37	175.757
Zinsaufwand		(76.840)	-	-	(78.544)
Dividendeneinkünfte		9.153.709	614.476	-	96.500.854
Dividendenaufwand		(198.361)	-	-	(4.626.635)

Das Layout der zusammengefassten Kapitalflussrechnung für den laufenden Berichtszeitraum wurde im Vergleich zum Layout der im zusammengefassten Halbjahresabschluss des Vorjahres aufgeführten Kapitalflussrechnung modifiziert. Die an die Inhaber rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile gezahlten Ausschüttungen wurden gesondert als Finanzierungstätigkeit ausgewiesen. Die Vergleichszahlen blieben so eingestuft, wie sie in dem zusammengefassten Halbjahresabschluss des Vorjahres ausgewiesen wurden. Diese Änderung an der Darstellung hat keine Auswirkungen auf die Zunahme/(Abnahme) des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023.

Die beiliegenden Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

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

	Hinweis	CMCI Composite SF UCITS ETF USD	Bloomberg Commodity Index SF UCITS ETF USD	S&P 500 SF UCITS ETF USD	MSCI USA SF UCITS ETF USD	MSCI Emerging Markets SF UCITS ETF USD
Cashflow aus laufender Geschäftstätigkeit						
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnende Netto(abnahme)/-zunahme des Vermögens aus der Geschäftstätigkeit		(22.549.513)	450.195	3.532.748	9.767.063	(3.399.474)
<i>Berichtigung für:</i>		-	-	-	-	-
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Aktien		-	-	-	-	-
Insgesamt		(22.549.513)	450.195	3.532.748	9.767.063	(3.399.474)
Nettoverlust/(-gewinn) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten		19.178.753	(650.205)	(3.672.858)	(10.150.655)	3.308.150
Betriebskosten insgesamt	2,3	3.370.760	200.010	140.110	383.592	91.324
Veränderung nicht abgerechneter Anlagen		18.357.116	-	(5.841.020)	-	(510)
Kauf von Anlagen		(4.044.624.903)	(902.263.230)	(138.215.045)	(652.606.632)	(190.172.162)
Verkauf von Anlagen		5.093.167.290	1.199.802.988	143.064.849	686.536.671	180.399.993
Rückgang/(Anstieg) der Barsicherheiten		164.458.102	22.535.634	7.570	21.147.401	(450.633)
(Abnahme)/Zunahme der an die Gegenpartei zahlbaren Beträge		(164.458.102)	(22.535.634)	(7.570)	(21.147.401)	450.633
Nettomittelzufluss/(-abfluss) aus laufender Geschäftstätigkeit		1.066.899.503	297.539.758	(991.216)	33.930.039	(9.772.679)
Cashflow aus der Finanzierungstätigkeit						
Erlöse aus der Ausgabe rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien im Berichtszeitraum		32.089.751	14.220.720	8.084.664	24.562.651	17.956.528
Zahlungen für im Berichtszeitraum zurückgenommene rückkaufbare, gewinnberechtigte Aktien		(1.098.989.254)	(311.760.478)	(7.093.448)	(58.492.690)	(8.183.849)
Nettomittel(abfluss)/-zufluss aus der Finanzierungstätigkeit		(1.066.899.503)	(297.539.758)	991.216	(33.930.039)	9.772.679
Nettoveränderung von Zahlungsmitteln und Zahlungsmitteläquivalenten		-	-	-	-	-
Nettozahlungsmittel und -zahlungsmitteläquivalente zu Beginn des Berichtszeitraums		-	-	-	-	-
Nettozahlungsmittel und -zahlungsmitteläquivalente am Ende des Berichtszeitraums		-	-	-	-	-
Zusätzliche Informationen						
Gezahlte Steuern		(532.170)	-	(47.066)	(161.688)	-
Zinsertrag		12.948	1.162	1.079	3.688	681
Zinsaufwand		(12.203)	-	(136)	(458)	-
Dividendeneinkünfte		17.488.861	-	1.500.670	5.100.083	-

Die beiliegenden Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

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

	Hinweis	MSCI AC Asia Ex Japan SF UCITS ETF USD	MSCI ACWI SF UCITS ETF USD	CMCI Ex-Agriculture SF UCITS ETF USD	Bloomberg Commodity CMCI SF UCITS ETF USD	CMCI Commodity Carry SF UCITS ETF USD
Cashflow aus laufender Geschäftstätigkeit						
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnende Netto(abnahme)/-zunahme des Vermögens aus der Geschäftstätigkeit		(7.756.436)	(333.347.083)	1.972.604	13.865.164	18.180.660
<i>Berichtigung für:</i>						
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Aktien		-	3.744.707	-	-	-
Insgesamt		(7.756.436)	(329.602.376)	1.972.604	13.865.164	18.180.660
Nettoverlust/(-gewinn) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten		7.539.552	325.299.378	(2.174.375)	(14.739.065)	(18.390.212)
Betriebskosten insgesamt	2,3	216.884	4.302.998	201.771	873.901	209.552
Veränderung nicht abgerechneter Anlagen		-	2.119	-	-	26
Kauf von Anlagen		(312.899.426)	(22.845.143.024)	(238.894.004)	(1.171.390.421)	(533.445.875)
Verkauf von Anlagen		302.155.515	20.101.433.032	263.041.247	942.057.849	490.853.960
Rückgang/(Anstieg) der Barsicherheiten		6.429.684	(40.150.156)	7.620.000	17.775.050	(5.308.499)
(Abnahme)/Zunahme der an die Gegenpartei zahlbaren Beträge		(6.429.684)	40.150.156	(7.620.000)	(17.775.050)	5.308.499
Nettomittel(abfluss)/-zufluss aus laufender Geschäftstätigkeit		(10.743.911)	(2.743.707.873)	24.147.243	(229.332.572)	(42.591.889)
Cashflow aus der Finanzierungstätigkeit						
Erlöse aus der Ausgabe rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien im Berichtszeitraum		18.019.977	5.997.414.128	9.339.717	259.792.828	100.769.685
Zahlungen für im Berichtszeitraum zurückgenommene rückkaufbare, gewinnberechtigter Aktien		(7.276.066)	(3.253.706.255)	(33.486.960)	(30.460.256)	(58.177.796)
Nettomittelzufluss/(-abfluss) aus der Finanzierungstätigkeit		10.743.911	2.743.707.873	(24.147.243)	229.332.572	42.591.889
Nettoveränderung von Zahlungsmitteln und Zahlungsmitteläquivalenten		-	-	-	-	-
Nettozahlungsmittel und -zahlungsmitteläquivalente zu Beginn des Berichtszeitraums		-	-	-	-	-
Nettozahlungsmittel und -zahlungsmitteläquivalente am Ende des Berichtszeitraums		-	-	-	-	-
Zusätzliche Informationen						
Gezahlte Steuern		(62.854)	(1.836.699)	(36.615)	(207.573)	(51.534)
Zinsertrag		1.348	21.930	826	4.373	896
Zinsaufwand		(168)	(2.894)	(884)	(374)	(381)
Dividendeneinkünfte		1.897.928	45.594.939	1.152.717	6.237.186	1.352.039
Dividendenaufwand		-	(3.744.707)	-	-	-

Die beiliegenden Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

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

	Hinweis	MSCI	Euro Equity Defensive	Euro Equity Defensive	US Equity Defensive	US Equity Defensive
		China A	Covered Call	Put Write	Covered Call	Put Write
		SF UCITS ETF	SF UCITS ETF	SF UCITS ETF	SF UCITS ETF	SF UCITS ETF
		USD	EUR	EUR	USD	USD
Cashflow aus laufender Geschäftstätigkeit						
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnende Netto(abnahme)/-zunahme des Vermögens aus der Geschäftstätigkeit		(22.620.502)	62.127	617.953	(279.283)	286.400
<i>Berichtigung für:</i>						
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Aktien		-	-	-	-	-
Insgesamt		(22.620.502)	62.127	617.953	(279.283)	286.400
Nettoverlust/(-gewinn) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten		22.400.027	(68.282)	(644.387)	271.675	(311.745)
Betriebskosten insgesamt	2,3	220.475	6.155	26.434	7.608	25.345
Veränderung nicht abgerechneter Anlagen		-	-	-	-	-
Kauf von Anlagen		(368.197.388)	(7.692.821)	(35.387.287)	(23.152.662)	(25.141.198)
Verkauf von Anlagen		326.514.501	5.568.039	32.429.548	23.102.740	20.569.362
Rückgang/(Anstieg) der Barsicherheiten		5.009.596	(242.894)	544.121	100.000	390.000
(Abnahme)/Zunahme der an die Gegenpartei zahlbaren Beträge		(5.009.596)	242.894	(544.121)	(100.000)	(390.000)
Nettomittel(abfluss) aus laufender Geschäftstätigkeit		(41.682.887)	(2.124.782)	(2.957.739)	(49.922)	(4.571.836)
Cashflow aus der Finanzierungstätigkeit						
Erlöse aus der Ausgabe rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien im Berichtszeitraum		64.706.046	2.124.782	6.754.086	6.588.170	4.571.836
Zahlungen für im Berichtszeitraum zurückgenommene rückkaufbare, gewinnberechtigter Aktien		(23.023.159)	-	(3.796.347)	(6.538.248)	-
Nettomittelzufluss aus der Finanzierungstätigkeit		41.682.887	2.124.782	2.957.739	49.922	4.571.836
Nettoveränderung von Zahlungsmitteln und Zahlungsmitteläquivalenten		-	-	-	-	-
Nettozahlungsmittel und -zahlungsmitteläquivalente zu Beginn des Berichtszeitraums		-	-	-	-	-
Nettozahlungsmittel und -zahlungsmitteläquivalente am Ende des Berichtszeitraums		-	-	-	-	-
Zusätzliche Informationen						
Gezahlte Steuern		(51.835)	(1.586)	(6.488)	(1.135)	(6.424)
Zinsertrag		1.067	35	142	29	136
Zinsaufwand		(128)	(3)	(16)	(4)	(14)
Dividendeneinkünfte		1.532.347	49.405	207.480	43.582	196.273

Die beiliegenden Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

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

Hinweis	MSCI USA SF Index Fund USD	CMCI Commodity Carry Ex-Agriculture SF UCITS ETF USD	Insgesamt USD
Cashflow aus laufender Geschäftstätigkeit			
Zunahme/(Abnahme) des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit	6.550.343	10.573.778	(324.083.600)
<i>Berichtigung für:</i>			
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Aktien	482.575	-	4.227.282
Insgesamt	7.032.918	10.573.778	(319.856.318)
Netto(gewinn)/-verlust aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten	(7.571.888)	(10.663.773)	308.949.971
Betriebskosten insgesamt	2,3 538.970	89.995	10.906.347
Veränderung nicht abgerechneter Anlagen	-	-	12.517.732
Kauf von Anlagen	(2.056.309.946)	(120.702.311)	(33.666.850.020)
Verkauf von Anlagen	1.978.479.083	120.702.311	31.910.418.497
Rückgang der Barsicherheiten	16.748.525	2.490.000	219.107.778
Abnahme der an die Gegenpartei zahlbaren Beträge	(16.748.525)	(2.490.000)	(219.107.778)
Nettomittel(abfluss) aus laufender Geschäftstätigkeit	(77.830.863)	-	(1.743.913.791)
Cashflow aus der Finanzierungstätigkeit			
Erlöse aus der Ausgabe rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien im Berichtszeitraum	304.941.188	-	6.872.062.826
Zahlungen für im Berichtszeitraum zurückgenommene rückkaufbare, gewinnberechtigte Aktien	(227.110.325)	-	(5.128.149.035)
Nettomittelzufluss aus der Finanzierungstätigkeit	77.830.863	-	1.743.913.791
Nettoveränderung von Zahlungsmitteln und Zahlungsmitteläquivalenten	-	-	-
Nettozahlungsmittel und -zahlungsmitteläquivalente zu Beginn des Berichtszeitraums	-	-	-
Nettozahlungsmittel und -zahlungsmitteläquivalente am Ende des Berichtszeitraums	-	-	-
Zusätzliche Informationen			
Gezahlte Steuern	(312.777)	(18.738)	(3.335.297)
Zinsertrag	107.952	378	158.673
Zinsaufwand	(55.418)	(44)	(73.125)
Dividendeneinkünfte	9.243.287	560.587	92.161.031
Dividendenaufwand	(482.575)	-	(4.227.282)

Die beiliegenden Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

ERLÄUTERUNGEN ZUM ZUSAMMENGEFASSTEN HALBJAHRESABSCHLUSS FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2023

1. WESENTLICHE BILANZIERUNGSGRUNDSÄTZE

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

(a) Grundlage der Aufstellung

Dieser zusammengefasste Halbjahresabschluss für den sechsmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 wurde gemäß den internationalen Rechnungslegungsgrundsätzen („IAS“) 34 „Zwischenberichterstattung“, herausgegeben vom International Accounting Standards Board, und den OGAW-Verordnungen erstellt. Aufgrund dessen enthält dieser Halbjahresabschluss nicht alle Informationen und Offenlegungen, die für Jahresabschlüsse vorgeschrieben sind, und sollte zusammen mit dem geprüften Jahresabschluss der Gesellschaft für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 gelesen werden, der im Einklang mit den International Financial Reporting Standards („IFRS“), wie in der Europäischen Union („EU“) anzuwenden, den Bestimmungen des Irish Companies Act, 2014 und den OGAW-Verordnungen erstellt wurde.

Der zusammengefasste Halbjahresabschluss für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 ist ungeprüft. Wir weisen darauf hin, dass der Bestätigungsvermerk des Abschlussprüfers im geprüften Jahresabschluss zum 30. Juni 2023 ohne Einschränkung erteilt wurde.

Die Bilanzierungsgrundsätze, Schätzungen, Beurteilungen und Berechnungsmethoden in diesem zusammengefassten ungeprüften Halbjahresabschluss entsprechen denen, die für den geprüften Jahresabschluss der Gesellschaft für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 angewandt wurden. In Übereinstimmung mit IAS 34 beziehen sich die Vergleichszahlen für die zusammengefasste Gesamtergebnisrechnung, die zusammengefasste Entwicklung des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnenden Nettovermögens und die zusammengefasste Kapitalflussrechnung auf den vorangegangenen Zwischenberichtszeitraum zum 31. Dezember 2022 und für die zusammengefasste Bilanz auf den vorangegangenen Bilanzstichtag 30. Juni 2023.

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

2. GEBÜHREN UND KOSTEN

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

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

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

	Klasse „A“/„A-UKdis“
Zeichnungsgebühr	Bis 5 %
Rücknahmegebühr	Bis 3 %
Umtauschgebühr	Bis 3 %
Primärmarkt-Transaktionskosten	Bis 1 %

**ERLÄUTERUNGEN ZUM ZUSAMMENGEFASSTEN HALBJAHRESABSCHLUSS
(Fortsetzung)
FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2023**

2. GEBÜHREN UND KOSTEN (Fortsetzung)

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

Folgende Pauschalgebühren gelten seit dem 31. Dezember 2023 und 30. Juni 2023, wie nachstehend beschrieben:

Teilfonds	Währung	In Kraft per 31. Dezember 2023 Klasse „A“/„A-acc“	In Kraft per 30. Juni 2023 Klasse „A“/„A-acc“
CMCI Composite SF UCITS ETF	USD	0,34 % p.a.	0,34 % p.a.
Bloomberg Commodity Index SF UCITS ETF	USD	0,19 % p.a.	0,19 % p.a.
S&P 500 SF UCITS ETF	USD	0,19 % p.a.	0,19 % p.a.
MSCI USA SF UCITS ETF	USD	0,15 % p.a.	0,15 % p.a.
MSCI Emerging Markets SF UCITS ETF ¹	USD	0,14 % p.a.	0,21 % p.a.
MSCI AC Asia Ex Japan SF UCITS ETF	USD	0,23 % p.a.	0,23 % p.a.
MSCI ACWI SF UCITS ETF	USD	0,21 % p.a.	0,21 % p.a.
CMCI Ex-Agriculture SF UCITS ETF	USD	0,34 % p.a.	0,34 % p.a.
Bloomberg Commodity CMCI SF UCITS ETF	USD	0,34 % p.a.	0,34 % p.a.
CMCI Commodity Carry SF UCITS ETF	USD	0,34 % p.a.	0,34 % p.a.
MSCI China A SF UCITS ETF ²	USD	0,24 % p.a.	0,30 % p.a.
Euro Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF	EUR	0,26 % p.a.	0,26 % p.a.
Euro Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF	EUR	0,26 % p.a.	0,26 % p.a.
US Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF	USD	0,29 % p.a.	0,29 % p.a.
US Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF	USD	0,29 % p.a.	0,29 % p.a.
MSCI USA SF Index Fund	USD	0,12 % p.a.	0,12 % p.a.
CMCI Commodity Carry Ex-Agriculture SF UCITS ETF	USD	0,34 % p.a.	0,34 % p.a.
CMCI Commodity Transition SF UCITS ETF	USD	0,34 % p.a.	0,34 % p.a.

¹ Mit Wirkung vom 13. Dezember 2023 wurden die Pauschalgebühren von 0,21 % in 0,14 % geändert.

² Mit Wirkung vom 13. Dezember 2023 wurden die Pauschalgebühren von 0,30 % in 0,24 % geändert.

Die tatsächlichen Transaktionskosten der einzelnen Teilfonds für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022 sind nachstehend aufgeführt:

Teilfonds	Währung	Transaktionskosten für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023¹	Drag Level gesamt Klasse „A“/ „A-acc“/ „A-dis“²
CMCI Composite SF UCITS ETF	USD	4.657.859	0,61 % p.a.
Bloomberg Commodity Index SF UCITS ETF	USD	84.183	0,11 % p.a.
S&P 500 SF UCITS ETF	USD	229.095	0,36 % p.a.
MSCI USA SF UCITS ETF	USD	620.111	0,28 % p.a.
MSCI Emerging Markets SF UCITS ETF	USD	(282.797)	(0,15) % p.a.
MSCI AC Asia Ex Japan SF UCITS ETF	USD	(223.838)	0,14 % p.a.
MSCI ACWI SF UCITS ETF	USD	(10.123.401)	0,04 % p.a.
CMCI Ex-Agriculture SF UCITS ETF	USD	535.545	0,68 % p.a.
Bloomberg Commodity CMCI SF UCITS ETF	USD	2.499.510	0,61 % p.a.
CMCI Commodity Carry SF UCITS ETF	USD	(103.658)	0,26 % p.a.
MSCI China A SF UCITS ETF	USD	(2.279.013)	(1,82) % p.a.
Euro Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF	EUR	(15.134)	(0,10) % p.a.

**ERLÄUTERUNGEN ZUM ZUSAMMENGEFASSTEN HALBJAHRESABSCHLUSS
(Fortsetzung)
FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2023**

2. GEBÜHREN UND KOSTEN (Fortsetzung)

Teilfonds	Währung	Transaktionskosten für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023¹	Drag Level gesamt Klasse „A“/ „A-acc“/„A-dis“²
Euro Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF	EUR	(2.854)	0,25 % p.a.
US Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF	USD	(10.837)	0,08 % p.a.
US Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF	USD	(48.631)	0,04 % p.a.
MSCI USA SF Index Fund	USD	1.441.863	0,22 % p.a.
CMCI Commodity Carry Ex-Agriculture SF UCITS ETF	USD	(50.349)	0,38 % p.a.
CMCI Commodity Transition SF UCITS ETF	USD	6.380	0,64 % p.a.

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

² Die Performance von Aktienklassen, die nicht auf die Basiswährung lauten, kann aufgrund von Währungsabsicherungskosten, die zusätzlich zum Drag Level entstehen, von der Performance der auf die Basiswährung lautenden Aktienklassen abweichen. Das gesamte Drag Level ist das Drag Level zum 31. Dezember 2023, repräsentativ für die Basiswährung des jeweiligen Teilfonds.

Teilfonds	Währung	Transaktionskosten für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2022¹	Drag Level gesamt Klasse „A“/ „A-acc“/„A-dis“²
CMCI Composite SF UCITS ETF	USD	3.231.982	0,59 % p.a.
Bloomberg Commodity Index SF UCITS ETF	USD	42.383	0,09 % p.a.
S&P 500 SF UCITS ETF	USD	70.080	0,29 % p.a.
MSCI USA SF UCITS ETF	USD	217.478	0,24 % p.a.
MSCI Emerging Markets SF UCITS ETF	USD	(104.682)	(0,03) % p.a.
MSCI AC Asia Ex Japan SF UCITS ETF	USD	(39.774)	0,13 % p.a.
MSCI ACWI SF UCITS ETF	USD	(2.841.809)	0,06 % p.a.
CMCI Ex-Agriculture SF UCITS ETF	USD	202.888	0,59 % p.a.
Bloomberg Commodity CMCI SF UCITS ETF	USD	736.202	0,59 % p.a.
CMCI Commodity Carry SF UCITS ETF	USD	(7.055)	0,24 % p.a.
MSCI China A SF UCITS ETF	USD	(2.546.632)	(3,13) % p.a.
Euro Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF	EUR	(8.523)	(0,10) % p.a.
Euro Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF	EUR	(1.016)	0,25 % p.a.
US Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF	USD	(5.521)	0,08 % p.a.
US Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF	USD	(22.255)	0,04 % p.a.
MSCI USA SF Index Fund	USD	698.174	0,24 % p.a.
CMCI Commodity Carry Ex-Agriculture SF UCITS ETF	USD	(20.650)	0,24 % p.a.

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

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

**ERLÄUTERUNGEN ZUM ZUSAMMENGEFASSTEN HALBJAHRESABSCHLUSS
(Fortsetzung)
FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2023**

2. GEBÜHREN UND KOSTEN (Fortsetzung)

Die tatsächlichen Drag Levels der einzelnen Teilfonds für das Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022 sind nachstehend aufgeführt:

Teilfonds	Währung	Kosten für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023	Kosten für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2022
CMCI Composite SF UCITS ETF	USD	4.704.527	6.596.604
Bloomberg Commodity Index SF UCITS ETF	USD	319.602	242.322
S&P 500 SF UCITS ETF	USD	248.018	191.730
MSCI USA SF UCITS ETF	USD	635.412	600.960
MSCI Emerging Markets SF UCITS ETF	USD	(44.904)	(13.364)
MSCI AC Asia Ex Japan SF UCITS ETF	USD	159.956	177.226
MSCI ACWI SF UCITS ETF	USD	583.737	1.340.266
CMCI Ex-Agriculture SF UCITS ETF	USD	443.037	404.615
Bloomberg Commodity CMCI SF UCITS ETF	USD	2.532.316	1.609.905
CMCI Commodity Carry SF UCITS ETF	USD	262.060	202.580
MSCI China A SF UCITS ETF	USD	(983.273)	(2.381.762)
Euro Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF	EUR	(2.114)	(2.367)
Euro Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF	EUR	35.887	25.417
US Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF	USD	2.066	2.099
US Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF	USD	3.422	3.059
MSCI USA SF Index Fund	USD	1.305.409	1.237.328
CMCI Commodity Carry Ex-Agriculture SF UCITS ETF	USD	85.674	69.372
CMCI Commodity Transition SF UCITS ETF ¹	USD	6.655	-

¹ Der Teilfonds wurde am 24. Mai 2023 aufgelegt.

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

Gesamtkostenquote

Gesamtkostenquote (Total Expense Ratio, TER): Diese Kennzahl wird im Einklang mit der „Richtlinie zur Berechnung und Offenlegung der TER von kollektiven Kapitalanlagen“ der Asset Management Association Switzerland (AMAS) in ihrer aktuellen Version berechnet und drückt die Summe aller Kosten und Provisionen aus, die fortlaufend dem Nettovermögen belastet (Betriebskosten) und rückwirkend als Prozentsatz des Nettovermögens erhoben werden. Die in der TER enthaltenen Gesamtbetriebskosten für die neu aufgelegten Aktienklassen wurden annualisiert.

	Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 Gesamtkostenquote %	Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2022 Gesamtkostenquote %
CMCI Composite SF UCITS ETF		
Klasse (CHF) A-acc	0,34	0,34
Klasse (GBP) A-acc	0,34	0,34
Klasse (EUR) A-acc	0,34	0,34
Klasse (USD) A-acc	0,34	0,34
Bloomberg Commodity Index SF UCITS ETF		
Klasse (CHF) A-acc	0,19	0,19
Klasse (EUR) A-acc	0,19	0,19
Klasse (GBP) A-acc	0,19	0,19
Klasse (USD) A-acc	0,19	0,19

**ERLÄUTERUNGEN ZUM ZUSAMMENGEFASSTEN HALBJAHRESABSCHLUSS
(Fortsetzung)
FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2023**

2. GEBÜHREN UND KOSTEN (Fortsetzung)

Gesamtkostenquote (Fortsetzung)

	Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 Gesamtkostenquote %	Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2022 Gesamtkostenquote %
S&P 500 SF UCITS ETF		
Klasse (USD) A-acc	0,19	0,19
MSCI USA SF UCITS ETF		
Klasse (USD) A-acc	0,15	0,15
MSCI Emerging Markets SF UCITS ETF		
Klasse (USD) A-acc	0,20	0,21
MSCI AC Asia Ex Japan SF UCITS ETF		
Klasse (USD) A-acc	0,23	0,23
MSCI ACWI SF UCITS ETF		
Klasse (hedged to CHF) A-acc	0,21	0,21
Klasse (hedged to CHF) A-UKdis	0,21	0,21
Klasse (hedged to EUR) A-acc	0,21	0,21
Klasse (hedged to EUR) A-UKdis	0,21	0,21
Klasse (hedged to GBP) A-UKdis	0,21	0,21
Klasse (hedged to JPY) A-acc	0,21	0,21
Klasse (hedged to SGD) A-acc	0,21	0,21
Klasse (hedged to USD) A-acc	0,21	0,21
Klasse (hedged to USD) A-UKdis	0,21	0,21
Klasse (USD) A-UKdis	0,21	0,21
Klasse (USD) A-acc	0,21	0,21
CMCI Ex-Agriculture SF UCITS ETF		
Klasse (hedged to CHF) A-acc	0,34	0,34
Klasse (hedged to EUR) A-acc	0,34	0,34
Klasse (hedged to GBP) A-acc	0,34	0,34
Klasse (USD) A-acc	0,34	0,34
Bloomberg Commodity CMCI SF UCITS ETF		
Klasse (hedged to CHF) A-acc	0,34	0,34
Klasse (hedged to EUR) A-acc	0,34	0,34
Klasse (hedged to GBP) A-acc	0,34	0,34
Klasse (USD) A-acc	0,34	0,34
CMCI Commodity Carry SF UCITS ETF		
Klasse (hedged to CHF) A-acc	0,34	0,34
Klasse (hedged to EUR) A-acc	0,34	0,34
Klasse (USD) A-acc	0,34	0,34
MSCI China A SF UCITS ETF		
Klasse (USD) A-acc	0,29	0,30
Euro Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF		
Klasse (EUR) A-acc	0,26	0,26

**ERLÄUTERUNGEN ZUM ZUSAMMENGEFASSTEN HALBJAHRESABSCHLUSS
(Fortsetzung)
FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2023**

2. GEBÜHREN UND KOSTEN (Fortsetzung)

Gesamtkostenquote (Fortsetzung)

	Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 Gesamtkostenquote %	Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2022 Gesamtkostenquote %
Euro Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF		
Klasse (EUR) A-acc	0,26	0,26
US Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF		
Klasse (USD) A-acc	0,29	0,29
US Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF		
Klasse (USD) A-acc	0,29	0,29
MSCI USA SF Index Fund		
Klasse (hedged to CHF) A-acc	0,12	0,12
Klasse (hedged to CHF) A-UKdis	0,12	0,12
Klasse (hedged to EUR) A-acc	0,12	0,12
Klasse (hedged to EUR) A-UKdis	0,12	0,12
Klasse (hedged to GBP) A-acc	0,12	0,12
Klasse (hedged to GBP) A-UKdis	0,12	0,12
Klasse (USD) A-acc	0,12	0,12
Klasse (USD) A-UKdis	0,12	0,12
CMCI Commodity Carry Ex-Agriculture SF UCITS ETF		
Klasse (hedged to EUR) A-acc	0,34	0,34
Klasse (USD) A-acc	0,34	0,34
CMCI Commodity Transition SF UCITS ETF		
Klasse (USD) A-acc ¹	0,34	-

¹ Die Aktienklasse wurde am 24. Mai 2023 aufgelegt.

3. GESCHÄFTSVORFÄLLE MIT NAHESTEHENDEN UNTERNEHMEN UND PERSONEN

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

(i) Verwaltungsratsmitglieder

Verwaltungsratsmitglied Naomi Daly ist ein unabhängiges Verwaltungsratsmitglied der Verwaltungsgesellschaft, und Verwaltungsratsmitglied Alan White ist ein Mitarbeiter und stellvertretendes Verwaltungsratsmitglied der Verwaltungsgesellschaft. Zum Ende des Berichtszeitraums hielten Alan White und ein Mitarbeiter der Verwaltungsgesellschaft jeweils eine Zeichneraktie der Gesellschaft im Nennwert von 1 EUR.

Das Verwaltungsratsmitglied Marie Antoinette Petrini ist eine Mitarbeiterin von UBS Europe SE, Niederlassung Madrid.

Das Verwaltungsratsmitglied Markus Goetschi ist ein Mitarbeiter der UBS Asset Management Switzerland AG.

Für dem Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 wurden durch die Verwaltungsgesellschaft Verwaltungsrats honorare in Höhe von 32.500 EUR (31. Dezember 2022: 32.500 EUR) gezahlt.

Per 31. Dezember 2023 waren 16.250 EUR an Verwaltungsratsmitglieder zahlbar (30. Juni 2023: 16.250 EUR). Nicht unabhängige Verwaltungsratsmitglieder der Gesellschaft erhalten für ihre Funktion als Verwaltungsratsmitglieder keine zusätzlichen Honorare.

**ERLÄUTERUNGEN ZUM ZUSAMMENGEFASSTEN HALBJAHRESABSCHLUSS
(Fortsetzung)
FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2023**

3. GESCHÄFTSVORFÄLLE MIT NAHESTEHENDEN UNTERNEHMEN UND PERSONEN (Fortsetzung)

Die Honorare der Verwaltungsratsmitglieder für 2023 wurden im 1. Quartal 2024 ausgezahlt.

Zum 31. Dezember 2023 bzw. zum 31. Dezember 2022 hielt kein Verwaltungsratsmitglied der Gesellschaft Beteiligungen an einem der Teilfonds.

(ii) Barsicherheiten

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

(iii) Gebühren und Kosten nahestehender UBS-Unternehmen

Die UBS Asset Management Switzerland AG handelt als Vertriebsgesellschaft der Gesellschaft. Im Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 bzw. im Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2022 fielen den Teilfonds keine Vertriebsstellengebühren an.

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

Die Verwaltungsgesellschaft ist eine hundertprozentige Tochtergesellschaft der UBS AG. Die von den Teilfonds für den 31. Dezember 2023 in Rechnung gestellten Verwaltungsgebühren und die für den am 31. Dezember 2022 endenden Berichtszeitraum berechneten und zum 30. Juni 2023 fälligen Beträge sind nachstehend aufgeführt:

		Gebühr für den Berichts- zeitraum zum Wäh- rung	Gebühr für den Berichts- zeitraum zum 31. Dezember 2023	Gebühr für den Berichts- zeitraum zum 31. Dezember 2022	Aufge- laufen zum 30. Juni 2023
CMCI Composite SF UCITS ETF	USD	709.760	123.861	991.400	241.528
Bloomberg Commodity Index SF UCITS ETF	USD	43.368	4.083	31.580	15.597
S&P 500 SF UCITS ETF	USD	21.553	3.732	22.123	7.201
MSCI USA SF UCITS ETF	USD	66.885	11.692	76.718	22.979
MSCI Emerging Markets SF UCITS ETF	USD	14.699	2.455	13.365	4.998
MSCI AC Asia Ex Japan SF UCITS ETF	USD	34.565	5.415	27.925	10.494
MSCI ACWI SF UCITS ETF	USD	861.545	153.937	614.714	275.350
CMCI Ex-Agriculture SF UCITS ETF	USD	65.442	10.804	59.344	24.593
Bloomberg Commodity CMCI SF UCITS ETF	USD	385.017	66.729	257.030	107.238
CMCI Commodity Carry SF UCITS ETF	USD	93.114	17.686	61.633	36.572
MSCI China A SF UCITS ETF	USD	32.904	4.758	44.842	12.169
Euro Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF	EUR	1.057	144	1.184	448
Euro Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF	EUR	7.177	1.287	5.083	1.887
US Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF	USD	1.291	181	1.312	504
US Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF	USD	4.889	759	4.370	1.751
MSCI USA SF Index Fund	USD	35.094	7.574	31.440	10.835
CMCI Commodity Carry Ex-Agriculture SF UCITS ETF	USD	32.733	5.487	26.469	12.162
CMCI Commodity Transition SF UCITS ETF ¹	USD	1.053	174	-	206

¹ Der Teilfonds wurde am 24. Mai 2023 aufgelegt.

Die UBS Asset Management (UK) Limited ist der Anlageverwalter der Gesellschaft. Die in Rechnung gestellten Gebühren des Anlageverwalters und die zum 31. Dezember 2023 sowie die für den am 31. Dezember 2022 endenden Berichtszeitraum berechneten und zum 30. Juni 2023 von den Teilfonds zahlbaren Beträge sind nachstehend aufgeführt:

**ERLÄUTERUNGEN ZUM ZUSAMMENGEFASSTEN HALBJAHRESABSCHLUSS
(Fortsetzung)
FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2023**

3. GESCHÄFTSVORFÄLLE MIT NAHESTEHENDEN UNTERNEHMEN UND PERSONEN (Fortsetzung)

		Gebühr für den Berichts- zeitraum zum Wäh- rung	Aufgelaufen zum 31. Dezember 2023	Gebühr für den Berichts- zeitraum zum 31. Dezember 2022	Aufge- laufen zum 30. Juni 2023
CMCI Composite SF UCITS ETF	USD	1.242.081	216.756	1.734.950	422.675
Bloomberg Commodity Index SF UCITS ETF	USD	137.333	12.930	100.005	49.390
S&P 500 SF UCITS ETF	USD	32.329	5.598	33.184	10.801
MSCI USA SF UCITS ETF	USD	100.328	17.538	115.077	34.468
MSCI Emerging Markets SF UCITS ETF	USD	43.438	4.667	42.321	15.826
MSCI AC Asia Ex Japan SF UCITS ETF	USD	109.455	17.146	88.429	33.232
MSCI ACWI SF UCITS ETF	USD	2.728.225	487.466	1.946.594	871.940
CMCI Ex-Agriculture SF UCITS ETF	USD	114.523	18.908	103.853	43.037
Bloomberg Commodity CMCI SF UCITS ETF	USD	673.779	116.776	449.802	187.667
CMCI Commodity Carry SF UCITS ETF	USD	162.950	30.951	107.858	64.000
MSCI China A SF UCITS ETF	USD	66.294	7.655	93.422	25.352
Euro Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF	EUR	3.064	417	3.432	1.300
Euro Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF	EUR	20.814	3.733	14.742	5.473
US Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF	USD	3.744	525	3.804	1.461
US Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF	USD	14.177	2.201	12.673	5.079
MSCI USA SF Index Fund	USD	185.498	40.035	166.182	57.271
CMCI Commodity Carry Ex-Agriculture SF UCITS ETF	USD	57.283	9.601	46.321	21.283
CMCI Commodity Transition SF UCITS ETF ¹	USD	1.844	304	-	361

¹ Der Teilfonds wurde am 24. Mai 2023 aufgelegt.

Die Verwaltungsgebühren und die Gebühren des Anlageverwalters sind unter „Betriebskosten insgesamt“ in der zusammengefassten Gesamtergebnisrechnung erfasst.

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

Die UBS AG ist der autorisierte Teilnehmer und fungiert als Marktmacher (Market Maker) an folgenden Börsen: SIX Swiss Exchange, XETRA, London Stock Exchange und Borsa Italiana. Die UBS Fund Management (Switzerland) AG ist der Vertreter in der Schweiz. Die UBS AG hielt als autorisierter Teilnehmer 100 % (30. Juni 2023: 100 %) der Teilfonds im primären Aktienbuch am 31. Dezember 2023, von denen die Mehrzahl auf dem Sekundärmarkt weiterverkauft wird.

Die UBS Switzerland AG ist die Zahlstelle in der Schweiz.

Verbundene Parteien

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

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

**ERLÄUTERUNGEN ZUM ZUSAMMENGEFASSTEN HALBJAHRESABSCHLUSS
(Fortsetzung)
FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2023**

4. AKTIENKAPITAL

Genehmigt

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

Rückkaufbare, gewinnberechtigte Aktien

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

Die Veränderungen in der Anzahl der rückkaufbaren, gewinnberechtigten Aktien im Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 stellen sich wie folgt dar:

	Anfangsbestand	Gezeichnete rückkaufbare, gewinnberechtigte Aktien	Zurückgenommene rückkaufbare, gewinnberechtigte Aktien	Schlussbestand
CMCI Composite SF UCITS ETF				
Klasse (CHF) A-acc	3.995.960	85.000	(424.317)	3.656.643
Klasse (GBP) A-acc	135.287	-	(28.933)	106.354
Klasse (EUR) A-acc	3.722.689	105.000	(417.767)	3.409.922
Klasse (USD) A-acc	7.239.626	2.534.100	(1.062.526)	8.711.200
Bloomberg Commodity Index SF UCITS ETF				
Klasse (CHF) A-acc	7.098.171	315.000	(5.998.399)	1.414.772
Klasse (EUR) A-acc	557.421	19.000	(176.998)	399.423
Klasse (GBP) A-acc	35.424	-	-	35.424
Klasse (USD) A-acc	1.029.948	-	(104.169)	925.779
S&P 500 SF UCITS ETF				
Klasse (USD) A-acc	1.753.232	-	(122.000)	1.631.232
MSCI USA SF UCITS ETF				
Klasse (USD) A-acc	3.699.877	215.500	(484.100)	3.431.277
MSCI Emerging Markets SF UCITS ETF				
Klasse (USD) A-acc	2.126.702	117.000	(246.000)	1.997.702
MSCI AC Asia Ex Japan SF UCITS ETF				
Klasse (USD) A-acc	1.511.436	134.300	(236.700)	1.409.036

**ERLÄUTERUNGEN ZUM ZUSAMMENGEFASSTEN HALBJAHRESABSCHLUSS
(Fortsetzung)
FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2023**

4. AKTIENKAPITAL (Fortsetzung)

Rückkaufbare, gewinnberechtigte Aktien (Fortsetzung)

	Anfangsbestand	Gezeichnete rückkaufbare, gewinn- berechtigte Aktien	Zurück- genommene rückkaufbare, gewinn- berechtigte Aktien	Schluss- bestand
MSCI ACWI SF UCITS ETF				
Klasse (hedged to EUR) A-acc	6.948.919	2.783.169	(2.314.032)	7.418.056
Klasse (hedged to EUR) A-UKdis	156.621	-	-	156.621
Klasse (hedged to CHF) A-acc	6.221.235	2.907.265	(3.351.709)	5.776.791
Klasse (hedged to CHF) A-UKdis	185.783	16.000	-	201.783
Klasse (hedged to GBP) A-UKdis	602.394	390.699	(372.948)	620.145
Klasse (hedged to JPY) A-acc	12.892.801	-	(2.380.575)	10.512.226
Klasse (hedged to SGD) A-acc	15.000	-	-	15.000
Klasse (hedged to USD) A-acc	9.244.228	3.946.857	(5.072.713)	8.118.372
Klasse (hedged to USD) A-UKdis	210.706	-	(44.000)	166.706
Klasse (USD) A-UKdis	1.719.351	56.000	(168.141)	1.607.210
Klasse (USD) A-acc	7.483.506	401.208	(20.490)	7.864.224
CMCI Ex-Agriculture SF UCITS ETF				
Klasse (hedged to CHF) A-acc	305.800	5.000	(50.373)	260.427
Klasse (hedged to EUR) A-acc	95.127	7.000	(17.000)	85.127
Klasse (hedged to GBP) A-acc	17.500	-	(8.000)	9.500
Klasse (USD) A-acc	414.871	370.000	(309.493)	475.378
Bloomberg Commodity CMCI SF UCITS ETF				
Klasse (hedged to CHF) A-acc	2.693.425	26.055.000	(11.220.000)	17.528.425
Klasse (hedged to EUR) A-acc	5.035.560	795.000	(3.061.629)	2.768.931
Klasse (hedged to GBP) A-acc	1.810.000	1.307.500	(807.716)	2.309.784
Klasse (USD) A-acc	27.735.431	3.546.000	(2.357.330)	28.924.101
CMCI Commodity Carry SF UCITS ETF				
Klasse (USD) A-acc	486.150	675.220	(72.569)	1.088.801
Klasse (hedged to EUR) A-acc	943.500	170.000	(844.731)	268.769
Klasse (hedged to CHF) A-acc	60.000	102.000	(46.538)	115.462
MSCI China A SF UCITS ETF				
Klasse (USD) A-acc	1.013.750	153.000	(300.000)	866.750
Euro Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF				
Klasse (EUR) A-acc	43.618	-	(16.869)	26.749
Euro Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF				
Klasse (EUR) A-acc	215.237	16.000	-	231.237
US Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF				
Klasse (USD) A-acc	44.752	-	(15.533)	29.219
US Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF				
Klasse (USD) A-acc	171.707	-	(31.572)	140.135

**ERLÄUTERUNGEN ZUM ZUSAMMENGEFASSTEN HALBJAHRESABSCHLUSS
(Fortsetzung)
FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2023**

4. AKTIENKAPITAL (Fortsetzung)

Rückkaufbare, gewinnberechtigte Aktien (Fortsetzung)

	Anfangsbestand	Gezeichnete rückkaufbare, gewinnberechtigte Aktien	Zurückgenommene rückkaufbare, gewinnberechtigte Aktien	Schlussbestand
MSCI USA SF Index Fund				
Klasse (USD) A-acc	4.285.083	2.343.518	(427.178)	6.201.423
Klasse (USD) A-UKdis	345.113	177.501	(78.351)	444.263
Klasse (hedged to GBP) A-UKdis	2.500	-	-	2.500
Klasse (hedged to CHF) A-acc	422.022	488.541	(127.542)	783.021
Klasse (hedged to CHF) A-UKdis	14.810	270	(2.210)	12.870
Klasse (hedged to EUR) A-acc	1.691.581	1.849.692	(674.733)	2.866.540
Klasse (hedged to EUR) A-UKdis	61.945	10.358	(33.857)	38.446
Klasse (hedged to GBP) A-acc	272.666	213.674	(299.979)	186.361
CMCI Commodity Carry Ex-Agriculture SF UCITS ETF				
Klasse (hedged to EUR) A-acc	40.000	-	-	40.000
Klasse (USD) A-acc	540.330	71.000	(206.582)	404.748
CMCI Commodity Transition SF UCITS ETF				
Klasse (USD) A-acc ¹	20.000	-	-	20.000

¹ Die Aktienklasse wurde am 24. Mai 2023 aufgelegt.

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

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

**ERLÄUTERUNGEN ZUM ZUSAMMENGEFASSTEN HALBJAHRESABSCHLUSS
(Fortsetzung)
FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2023**

4. AKTIENKAPITAL (Fortsetzung)

Rückkaufbare, gewinnberechtigte Aktien (Fortsetzung)

	Anfangsbestand	Gezeichnete rückkaufbare, gewinnberechtigte Aktien	Zurückgenommene rückkaufbare, gewinnberechtigte Aktien	Schlussbestand
MSCI AC Asia Ex Japan SF UCITS ETF				
Klasse (USD) A-acc	1.207.236	123.000	(50.300)	1.279.936
MSCI ACWI SF UCITS ETF				
Klasse (hedged to EUR) A-acc	4.070.712	8.629.911	(5.191.907)	7.508.716
Klasse (hedged to EUR) A-UKdis	93.821	6.500	(10.700)	89.621
Klasse (hedged to CHF) A-acc	2.827.067	10.681.546	(5.948.589)	7.560.024
Klasse (hedged to CHF) A-UKdis	180.783	7.000	(2.000)	185.783
Klasse (hedged to GBP) A-UKdis	224.186	1.144.590	(630.382)	738.394
Klasse (hedged to JPY) A-acc	10.414.173	1.008.408	-	11.422.581
Klasse (hedged to SGD) A-acc	18.500	-	(3.500)	15.000
Klasse (hedged to USD) A-acc	4.352.710	14.322.697	(7.998.910)	10.676.497
Klasse (hedged to USD) A-UKdis	209.654	6.300	(3.000)	212.954
Klasse (USD) A-UKdis	1.943.084	9.000	(128.000)	1.824.084
Klasse (USD) A-acc	5.873.689	103.800	(1.075.225)	4.902.264
CMCI Ex-Agriculture SF UCITS ETF				
Klasse (hedged to CHF) A-acc	330.800	-	(25.000)	305.800
Klasse (hedged to EUR) A-acc	45.127	-	-	45.127
Klasse (hedged to GBP) A-acc	27.500	-	(10.000)	17.500
Klasse (USD) A-acc	328.871	45.000	(135.000)	238.871
Bloomberg Commodity CMCI SF UCITS ETF				
Klasse (hedged to CHF) A-acc	2.378.425	-	-	2.378.425
Klasse (hedged to EUR) A-acc	1.225.560	6.550.000	(540.000)	7.235.560
Klasse (hedged to GBP) A-acc	187.000	62.000	-	249.000
Klasse (USD) A-acc	21.422.057	10.318.874	(1.390.000)	30.350.931
CMCI Commodity Carry SF UCITS ETF				
Klasse (USD) A-acc	596.150	-	(255.000)	341.150
Klasse (hedged to EUR) A-acc	278.500	735.000	(230.000)	783.500
Klasse (hedged to CHF) A-acc	100.000	215.000	(35.000)	280.000
MSCI China A SF UCITS ETF				
Klasse (USD) A-acc	1.006.610	507.140	(195.000)	1.318.750
Euro Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF				
Klasse (EUR) A-acc	24.210	19.408	-	43.618
Euro Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF				
Klasse (EUR) A-acc	144.029	58.208	(32.900)	169.337
US Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF				
Klasse (USD) A-acc	29.575	53.041	(54.700)	27.916
US Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF				
Klasse (USD) A-acc	130.707	41.000	-	171.707

**ERLÄUTERUNGEN ZUM ZUSAMMENGEFASSTEN HALBJAHRESABSCHLUSS
(Fortsetzung)
FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2023**

4. AKTIENKAPITAL (Fortsetzung)

Rückkaufbare, gewinnberechtigte Aktien (Fortsetzung)

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

5. FINANZRISIKOMANAGEMENT

Die Teilfonds sind durch ihre Aktivitäten verschiedenen finanziellen Risiken ausgesetzt, wie z. B. dem Marktrisiko (einschließlich Marktpreisrisiko, Zinsrisiko und Währungsrisiko), Kreditrisiko und Liquiditätsrisiko. Der Portfoliomanagementprozess zielt darauf ab, Risiken in Einklang mit den jeweiligen Anlagezielen der Teilfonds zu steuern. Die im Berichtszeitraum angewandten Risikomanagementziele und -methoden entsprechen den im geprüften Jahresabschluss für das Geschäftsjahr der Gesellschaft zum 30. Juni 2023 angewandten.

Allgemeiner Risikomanagementprozess

(a) Kreditrisikomanagement und -überwachung

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

**ERLÄUTERUNGEN ZUM ZUSAMMENGEFASSTEN HALBJAHRESABSCHLUSS
(Fortsetzung)
FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2023**

5. FINANZRISIKOMANAGEMENT (Fortsetzung)

Allgemeiner Risikomanagementprozess (Fortsetzung)

(a) Kreditrisikomanagement und -überwachung (Fortsetzung)

Nachstehende Tabelle zeigt den Wert des Swap, der Sicherheit und die Besicherungsquote je Teilfonds zum 31. Dezember 2023:

Zum 31. Dezember 2023

	Wert des Swap USD	Wert der Sicherheit einschließlich gehandelter Positionen in USD	Besicherungs- quote (Wert der Sicherheit/Wert des Swap)
CMCI Composite SF UCITS ETF	49.077.636	77.921.453	158,77 %
Bloomberg Commodity Index SF UCITS ETF	9.728.059	12.632.021	129,85 %
S&P 500 SF UCITS ETF	5.808.752	6.504.248	111,97 %
MSCI USA SF UCITS ETF	18.161.137	18.901.240	104,08 %
MSCI Emerging Markets SF UCITS ETF	8.585.473	4.776.488	55,63 %
MSCI AC Asia Ex Japan SF UCITS ETF	14.643.785	8.253.936	56,36 %
MSCI ACWI SF UCITS ETF	245.222.903	174.204.555	71,04 %
CMCI Ex-Agriculture SF UCITS ETF	5.890.031	7.951.495	135,00 %
Bloomberg Commodity CMCI SF UCITS ETF	22.457.950	35.619.862	158,61 %
CMCI Commodity Carry SF UCITS ETF	9.175.714	7.958.445	86,73 %
MSCI China A SF UCITS ETF	6.155.139	4.946.218	80,36 %
Euro Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF	139.233	360.777	259,12 %
Euro Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF	1.234.435	1.621.562	131,36 %
US Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF	169.422	259.287	153,04 %
US Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF	684.142	890.403	130,15 %
MSCI USA SF Index Fund	61.214.370	64.920.342	106,05 %
CMCI Commodity Carry Ex-Agriculture SF UCITS ETF	2.368.340	1.844.801	77,89 %
CMCI Commodity Transition SF UCITS ETF	57.339	-	-
	460.773.860	429.567.133	

**ERLÄUTERUNGEN ZUM ZUSAMMENGEFASSTEN HALBJAHRESABSCHLUSS
(Fortsetzung)
FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2023**

5. FINANZRISIKOMANAGEMENT (Fortsetzung)

Allgemeiner Risikomanagementprozess (Fortsetzung)

(a) Kreditrisikomanagement und -überwachung (Fortsetzung)

Nachstehende Tabelle zeigt den Wert des Swap, der Sicherheit und die Besicherungsquote je Teilfonds zum 30. Juni 2023:

Zum 30. Juni 2023

	Wert des Swap USD Positionen in USD	Wert der Sicherheit einschließlich gehandelter USD Positionen in USD	Besicherungs- quote (Wert der Sicherheit/Wert des Swap)
CMCI Composite SF UCITS ETF	27.630.735	37.864.692	137,04 %
Bloomberg Commodity Index SF UCITS ETF	25.664.403	25.668.673	100,02 %
S&P 500 SF UCITS ETF	4.652.417	4.433.435	95,29 %
MSCI USA SF UCITS ETF	14.267.811	13.723.795	96,19 %
MSCI Emerging Markets SF UCITS ETF	4.493.452	5.675.288	126,30 %
MSCI AC Asia Ex Japan SF UCITS ETF	3.528.119	7.849.656	222,49 %
MSCI ACWI SF UCITS ETF	127.317.966	140.629.318	110,46 %
CMCI Ex-Agriculture SF UCITS ETF	3.764.618	4.746.670	126,09 %
Bloomberg Commodity CMCI SF UCITS ETF	11.683.787	15.933.726	136,37 %
CMCI Commodity Carry SF UCITS ETF	2.331.752	7.417.225	318,10 %
MSCI China A SF UCITS ETF	1.746.134	3.622.542	207,46 %
Euro Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF	218.689	349.280	159,72 %
Euro Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF	565.073	1.066.492	188,73 %
US Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF	151.777	252.000	166,03 %
US Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF	465.688	806.554	173,20 %
MSCI USA SF Index Fund	23.305.209	23.648.909	101,47 %
CMCI Commodity Carry Ex-Agriculture SF UCITS ETF	1.009.509	3.196.428	316,63 %
CMCI Commodity Transition SF UCITS ETF ¹	59.044	-	-
	252.856.183	296.884.683	

¹ Der Teilfonds wurde am 24. Mai 2023 aufgelegt.

**ERLÄUTERUNGEN ZUM ZUSAMMENGEFASSTEN HALBJAHRESABSCHLUSS
(Fortsetzung)
FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2023**

5. FINANZRISIKOMANAGEMENT (Fortsetzung)

Allgemeiner Risikomanagementprozess (Fortsetzung)

(a) Kreditrisikomanagement und -überwachung (Fortsetzung)

Die nachstehende und umseitige Tabelle fasst den Tracking Error nach Gebühren, Transaktionskosten und Ausgaben für die Berichtszeiträume zum 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022 zusammen:

	Tracking Error 31. Dezember 2023	Tracking Error 31. Dezember 2022
CMCI Composite SF UCITS ETF	0,03 %	0,02 %
Bloomberg Commodity Index SF UCITS ETF	0,03 %	0,00 %
S&P 500 SF UCITS ETF	0,04 %	0,01 %
MSCI USA SF UCITS ETF	0,04 %	0,01 %
MSCI Emerging Markets SF UCITS ETF	0,03 %	0,00 %
MSCI AC Asia Ex Japan SF UCITS ETF	0,02 %	0,00 %
MSCI ACWI SF UCITS ETF	0,01 %	0,00 %
CMCI Ex-Agriculture SF UCITS ETF	0,03 %	0,02 %
Bloomberg Commodity CMCI SF UCITS ETF	0,03 %	0,02 %
CMCI Commodity Carry SF UCITS ETF	0,01 %	0,01 %
MSCI China A SF UCITS ETF	0,09 %	0,11 %
Euro Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF	0,01 %	0,00 %
Euro Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF	0,01 %	0,01 %
US Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF	0,00 %	0,00 %
US Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF	0,02 %	0,00 %
MSCI USA SF Index Fund	0,03 %	0,01 %
CMCI Commodity Carry Ex-Agriculture SF UCITS ETF	0,01 %	0,01 %
CMCI Commodity Transition SF UCITS ETF ¹	0,00 %	-

¹ Der Teilfonds wurde am 24. Mai 2023 aufgelegt.

(b) Schätzung des beizulegenden Zeitwerts

Die Richtlinien der Gesellschaft zur Ermittlung des beizulegenden Zeitwerts von finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten sind im geprüften Jahresabschluss der Gesellschaft für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 in Erläuterung 1(d) (iii) und (iv) dargelegt. Die Gesellschaft wendet bei der Klassifizierung der Bewertung zum beizulegenden Zeitwert eine Bewertungshierarchie an, die die Bedeutung der für die Bewertung verwendeten Daten widerspiegelt. Die Ebene in der Bewertungshierarchie, innerhalb derer die Zeitwertbewertung in ihrer Gesamtheit eingeordnet wird, wird auf Grundlage der Daten der untersten Ebene ermittelt, die für die Zeitwertbewertung in ihrer Gesamtheit bedeutend sind. Zu diesem Zweck wird die Maßgeblichkeit der Parameter für die Zeitwertbewertung in ihrer Gesamtheit beurteilt. Die Beurteilung der Maßgeblichkeit eines bestimmten Parameters für die Zeitwertbewertung in ihrer Gesamtheit erfordert Urteilsvermögen und die Abwägung von Faktoren, die für den Vermögenswert oder die Verbindlichkeit spezifisch sind.

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

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

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

Anlagen der Ebene 3 haben wesentliche nicht beobachtbare Parameter, da diese selten gehandelt werden. Zum 31. Dezember 2023 stufte die Gesellschaft Achillion Pharmaceuticals Inc in Ebene 3 ein.

**ERLÄUTERUNGEN ZUM ZUSAMMENGEFASSTEN HALBJAHRESABSCHLUSS
(Fortsetzung)
FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2023**

5. FINANZRISIKOMANAGEMENT (Fortsetzung)

Allgemeiner Risikomanagementprozess (Fortsetzung)

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

Der Fonds verbucht Übertragungen zwischen den Ebenen der Zeitwerthierarchie am Ende des Berichtszeitraums, in dem die Veränderung stattgefunden hat. Im Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 wurde die Anlage in Achillion Pharmaceuticals Inc von Ebene 2 auf Ebene 3 übertragen. Sie wird auf der Grundlage des letzten gehandelten Marktkurses des Wertpapiers bewertet. Die Übertragung ist in erster Linie auf die Verfügbarkeit von notierten Marktpreisen, Händlernetotierungen oder alternativen Preisquellen zurückzuführen, die durch beobachtbare Parameter unterstützt werden. Für diese Positionen wurden keine Überleitungen der Ebene 3 und keine Sensitivitätsanalyse der in der Ermittlung des beizulegenden Zeitwerts herangezogenen Annahmen verwendet, da die Positionen in der Aufstellung des Wertpapierbestands der Teilfonds für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 und für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023 mit null bewertet wurden.

Im Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 gab es keine weiteren Übertragungen zwischen den Ebenen (Geschäftsjahr zum 30. Juni 2023: keine).

In der folgenden Tabelle wird die Zeitwerthierarchie der zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten der Teilfonds per 31. Dezember 2023 analysiert.

CMCI Composite SF UCITS ETF	Ebene 1 USD	Ebene 2 USD	Ebene 3 USD	Gesamtzeitwert USD
Finanzielle Vermögenswerte				
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
- Aktien	1.434.407.615	-	-	1.434.407.615
- Funded Swaps	-	5.933.939	-	5.933.939
- Unfunded Swaps	-	43.143.697	-	43.143.697
Summe der finanziellen Vermögenswerte	1.434.407.615	49.077.636	-	1.483.485.251

Der CMCI Composite SF UCITS ETF hielt zum 31. Dezember 2023 keine zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten.

Bloomberg Commodity Index SF UCITS ETF	Ebene 1 USD	Ebene 2 USD	Ebene 3 USD	Gesamtzeitwert USD
Finanzielle Vermögenswerte				
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
- Aktien	152.843.242	-	-	152.843.242
- Funded Swaps	-	650.286	-	650.286
- Unfunded Swaps	-	9.077.773	-	9.077.773
Summe der finanziellen Vermögenswerte	152.843.242	9.728.059	-	162.571.301

Der Bloomberg Commodity Index SF UCITS ETF hielt zum 31. Dezember 2023 keine zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten.

S&P 500 SF UCITS ETF	Ebene 1 USD	Ebene 2 USD	Ebene 3 USD	Gesamtzeitwert USD
Finanzielle Vermögenswerte				
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
- Aktien	142.701.497	-	-	142.701.497
- Funded Swaps	-	594.058	-	594.058
- Unfunded Swaps	-	5.214.694	-	5.214.694
Summe der finanziellen Vermögenswerte	142.701.497	5.808.752	-	148.510.249

**ERLÄUTERUNGEN ZUM ZUSAMMENGEFASSTEN HALBJAHRESABSCHLUSS
(Fortsetzung)
FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2023**

5. FINANZRISIKOMANAGEMENT (Fortsetzung)

Allgemeiner Risikomanagementprozess (Fortsetzung)

(b) Schätzung des beizulegenden Zeitwerts (Fortsetzung)

Der S&P 500 SF UCITS ETF hielt zum 31. Dezember 2023 keine zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten.

MSCI USA SF UCITS ETF	Ebene 1 USD	Ebene 2 USD	Ebene 3 USD	Gesamtzeitwert USD
Finanzielle Vermögenswerte				
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
- Aktien	451.273.487	-	-	451.273.487
- Funded Swaps	-	1.877.739	-	1.877.739
- Unfunded Swaps	-	16.283.398	-	16.283.398
Summe der finanziellen Vermögenswerte	451.273.487	18.161.137	-	469.434.624

Der MSCI USA SF UCITS ETF hielt zum 31. Dezember 2023 keine zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten.

MSCI Emerging Markets SF UCITS ETF	Ebene 1 USD	Ebene 2 USD	Ebene 3 USD	Gesamtzeitwert USD
Finanzielle Vermögenswerte				
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
- Aktien	90.193.589	-	-	90.193.589
- Funded Swaps	-	395.118	-	395.118
- Unfunded Swaps	-	8.190.355	-	8.190.355
Summe der finanziellen Vermögenswerte	90.193.589	8.585.473	-	98.779.062

Der MSCI Emerging Markets SF UCITS ETF hielt zum 31. Dezember 2023 keine zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten.

MSCI AC Asia Ex Japan SF UCITS ETF	Ebene 1 USD	Ebene 2 USD	Ebene 3 USD	Gesamtzeitwert USD
Finanzielle Vermögenswerte				
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
- Aktien	202.552.210	-	-	202.552.210
- Funded Swaps	-	868.785	-	868.785
- Unfunded Swaps	-	13.775.000	-	13.775.000
Summe der finanziellen Vermögenswerte	202.552.210	14.643.785	-	217.195.995

Der MSCI AC Asia Ex Japan SF UCITS ETF hielt zum 31. Dezember 2023 keine zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten.

MSCI ACWI SF UCITS ETF	Ebene 1 USD	Ebene 2 USD	Ebene 3 USD	Gesamtzeitwert USD
Finanzielle Vermögenswerte				
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
- Aktien	5.946.310.046	-	-	5.946.310.046
- Funded Swaps	-	24.766.119	-	24.766.119
- Unfunded Swaps	-	220.456.784	-	220.456.784
Summe der finanziellen Vermögenswerte	5.946.310.046	245.222.903	-	6.191.532.949

**ERLÄUTERUNGEN ZUM ZUSAMMENGEFASSTEN HALBJAHRESABSCHLUSS
(Fortsetzung)
FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2023**

5. FINANZRISIKOMANAGEMENT (Fortsetzung)

Allgemeiner Risikomanagementprozess (Fortsetzung)

(b) Schätzung des beizulegenden Zeitwerts (Fortsetzung)

Der MSCI ACWI SF UCITS ETF hielt zum 31. Dezember 2023 keine zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten.

CMCI Ex-Agriculture SF UCITS ETF	Ebene 1 USD	Ebene 2 USD	Ebene 3 USD	Gesamtzeitwert USD
Finanzielle Vermögenswerte				
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
- Aktien	147.659.805	-	-	147.659.805
- Funded Swaps	-	614.198	-	614.198
- Unfunded Swaps	-	5.275.833	-	5.275.833
Summe der finanziellen Vermögenswerte	147.659.805	5.890.031	-	153.549.836

Der CMCI Ex-Agriculture SF UCITS ETF hielt zum 31. Dezember 2023 keine zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten.

Bloomberg Commodity CMCI SF UCITS ETF	Ebene 1 USD	Ebene 2 USD	Ebene 3 USD	Gesamtzeitwert USD
Finanzielle Vermögenswerte				
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
- Aktien	756.662.913	-	-	756.662.913
- Funded Swaps	-	3.116.484	-	3.116.484
- Unfunded Swaps	-	19.341.466	-	19.341.466
Summe der finanziellen Vermögenswerte	756.662.913	22.457.950	-	779.120.863

Der Bloomberg Commodity CMCI SF UCITS ETF hielt zum 31. Dezember 2023 keine zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten.

CMCI Commodity Carry SF UCITS ETF	Ebene 1 USD	Ebene 2 USD	Ebene 3 USD	Gesamtzeitwert USD
Finanzielle Vermögenswerte				
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
- Aktien	202.136.748	-	-	202.136.748
- Funded Swaps	-	845.917	-	845.917
- Unfunded Swaps	-	8.329.797	-	8.329.797
Summe der finanziellen Vermögenswerte	202.136.748	9.175.714	-	211.312.462

Der CMCI Commodity Carry SF UCITS ETF hielt zum 31. Dezember 2023 keine zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten.

MSCI China A SF UCITS ETF	Ebene 1 USD	Ebene 2 USD	Ebene 3 USD	Gesamtzeitwert USD
Finanzielle Vermögenswerte				
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
- Aktien	87.221.919	-	-	87.221.919
- Funded Swaps	-	373.508	-	373.508
- Unfunded Swaps	-	5.781.631	-	5.781.631
Summe der finanziellen Vermögenswerte	87.221.919	6.155.139	-	93.377.058

**ERLÄUTERUNGEN ZUM ZUSAMMENGEFASSTEN HALBJAHRESABSCHLUSS
(Fortsetzung)
FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2023**

5. FINANZRISIKOMANAGEMENT (Fortsetzung)

Allgemeiner Risikomanagementprozess (Fortsetzung)

(b) Schätzung des beizulegenden Zeitwerts (Fortsetzung)

Der MSCI China A SF UCITS ETF hielt zum 31. Dezember 2023 keine zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten.

Euro Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF	Ebene 1 EUR	Ebene 2 EUR	Ebene 3 EUR	Gesamtzeitwert EUR
Finanzielle Vermögenswerte				
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
- Aktien	3.280.656	-	-	3.280.656
- Funded Swaps	-	13.627	-	13.627
- Unfunded Swaps	-	112.421	-	112.421
Summe der finanziellen Vermögenswerte	3.280.656	126.048	-	3.406.704

Der Euro Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF hielt zum 31. Dezember 2023 keine zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten.

Euro Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF	Ebene 1 EUR	Ebene 2 EUR	Ebene 3 EUR	Gesamtzeitwert EUR
Finanzielle Vermögenswerte				
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
- Aktien	29.348.426	-	-	29.348.426
- Funded Swaps	-	121.864	-	121.864
- Unfunded Swaps	-	995.670	-	995.670
Summe der finanziellen Vermögenswerte	29.348.426	1.117.534	-	30.465.960

Der Euro Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF hielt zum 31. Dezember 2023 keine zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten.

US Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF	Ebene 1 USD	Ebene 2 USD	Ebene 3 USD	Gesamtzeitwert USD
Finanzielle Vermögenswerte				
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
- Aktien	4.179.239	-	-	4.179.239
- Funded Swaps	-	17.395	-	17.395
- Unfunded Swaps	-	152.027	-	152.027
Summe der finanziellen Vermögenswerte	4.179.239	169.422	-	4.348.661

Der US Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF hielt zum 31. Dezember 2023 keine zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten.

**ERLÄUTERUNGEN ZUM ZUSAMMENGEFASSTEN HALBJAHRESABSCHLUSS
(Fortsetzung)
FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2023**

5. FINANZRISIKOMANAGEMENT (Fortsetzung)

Allgemeiner Risikomanagementprozess (Fortsetzung)

(b) Schätzung des beizulegenden Zeitwerts (Fortsetzung)

US Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF	Ebene 1 USD	Ebene 2 USD	Ebene 3 USD	Gesamtzeitwert USD
Finanzielle Vermögenswerte				
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
- Aktien	17.292.039	-	-	17.292.039
- Funded Swaps	-	71.905	-	71.905
- Unfunded Swaps	-	612.237	-	612.237
Summe der finanziellen Vermögenswerte	17.292.039	684.142	-	17.976.181

Der US Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF hielt zum 31. Dezember 2023 keine zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten.

MSCI USA SF Index Fund	Ebene 1 USD	Ebene 2 USD	Ebene 3 USD	Gesamtzeitwert USD
Finanzielle Vermögenswerte				
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
- Aktien	1.441.839.115	-	-	1.441.839.115
- Funded Swaps	-	6.037.229	-	6.037.229
- Unfunded Swaps	-	55.177.141	-	55.177.141
Summe der finanziellen Vermögenswerte	1.441.839.115	61.214.370	-	1.503.053.485

Der MSCI USA SF Index Fund hielt zum 31. Dezember 2023 keine zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten.

CMCI Commodity Carry Ex-Agriculture SF UCITS ETF	Ebene 1 USD	Ebene 2 USD	Ebene 3 USD	Gesamtzeitwert USD
Finanzielle Vermögenswerte				
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
- Aktien	56.443.967	-	-	56.443.967
- Funded Swaps	-	235.249	-	235.249
- Unfunded Swaps	-	2.133.091	-	2.133.091
Summe der finanziellen Vermögenswerte	56.443.967	2.368.340	-	58.812.307

Der CMCI Commodity Carry Ex-Agriculture SF UCITS ETF hielt zum 31. Dezember 2023 keine zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten.

CMCI Commodity Transition SF UCITS ETF	Ebene 1 USD	Ebene 2 USD	Ebene 3 USD	Gesamtzeitwert USD
Finanzielle Vermögenswerte				
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
- Aktien	1.996.209	-	-	1.996.209
- Funded Swaps	-	8.240	-	8.240
- Unfunded Swaps	-	49.099	-	49.099
Summe der finanziellen Vermögenswerte	1.996.209	57.339	-	2.053.548

Der CMCI Commodity Transition SF UCITS ETF hielt zum 31. Dezember 2023 keine zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten.

**ERLÄUTERUNGEN ZUM ZUSAMMENGEFASSTEN HALBJAHRESABSCHLUSS
(Fortsetzung)
FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2023**

5. FINANZRISIKOMANAGEMENT (Fortsetzung)

Allgemeiner Risikomanagementprozess (Fortsetzung)

(b) Schätzung des beizulegenden Zeitwerts (Fortsetzung)

In der folgenden Tabelle wird die Zeitwerthierarchie der zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten der Teilfonds per 30. Juni 2023 analysiert.

CMCI Composite SF UCITS ETF	Ebene 1 USD	Ebene 2 USD	Ebene 3 USD	Gesamtzeitwert USD
Finanzielle Vermögenswerte				
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
- Aktien	1.319.645.927	-	-	1.319.645.927
- Funded Swaps	-	5.389.480	-	5.389.480
- Unfunded Swaps	-	22.241.255	-	22.241.255
Summe der finanziellen Vermögenswerte	1.319.645.927	27.630.735	-	1.347.276.662

Der CMCI Composite SF UCITS ETF hielt zum 30. Juni 2023 keine zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten.

Bloomberg Commodity Index SF UCITS ETF	Ebene 1 USD	Ebene 2 USD	Ebene 3 USD	Gesamtzeitwert USD
Finanzielle Vermögenswerte				
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
- Aktien	458.834.566	-	-	458.834.566
- Funded Swaps	-	2.422.326	-	2.422.326
- Unfunded Swaps	-	23.242.077	-	23.242.077
Summe der finanziellen Vermögenswerte	458.834.566	25.664.403	-	484.498.969

Der Bloomberg Commodity Index SF UCITS ETF hielt zum 30. Juni 2023 keine zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten.

S&P 500 SF UCITS ETF	Ebene 1 USD	Ebene 2 USD	Ebene 3 USD	Gesamtzeitwert USD
Finanzielle Vermögenswerte				
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
- Aktien	143.341.029	-	-	143.341.029
- Funded Swaps	-	592.031	-	592.031
- Unfunded Swaps	-	4.060.386	-	4.060.386
Summe der finanziellen Vermögenswerte	143.341.029	4.652.417	-	147.993.446

Der S&P 500 SF UCITS ETF hielt zum 30. Juni 2023 keine zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten.

MSCI USA SF UCITS ETF	Ebene 1 USD	Ebene 2 USD	Ebene 3 USD	Gesamtzeitwert USD
Finanzielle Vermögenswerte				
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
- Aktien	448.740.419	-	-	448.740.419
- Funded Swaps	-	1.855.603	-	1.855.603
- Unfunded Swaps	-	12.412.208	-	12.412.208
Summe der finanziellen Vermögenswerte	448.740.419	14.267.811	-	463.008.230

**ERLÄUTERUNGEN ZUM ZUSAMMENGEFASSTEN HALBJAHRESABSCHLUSS
(Fortsetzung)
FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2023**

5. FINANZRISIKOMANAGEMENT (Fortsetzung)

Allgemeiner Risikomanagementprozess (Fortsetzung)

(b) Schätzung des beizulegenden Zeitwerts (Fortsetzung)

Der MSCI USA SF UCITS ETF hielt zum 30. Juni 2023 keine zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten.

MSCI Emerging Markets SF UCITS ETF	Ebene 1 USD	Ebene 2 USD	Ebene 3 USD	Gesamtzeitwert USD
Finanzielle Vermögenswerte				
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
- Aktien	95.904.913	-	-	95.904.913
- Funded Swaps	-	501.958	-	501.958
- Unfunded Swaps	-	3.991.494	-	3.991.494
Summe der finanziellen Vermögenswerte	95.904.913	4.493.452	-	100.398.365

Der MSCI Emerging Markets SF UCITS ETF hielt zum 30. Juni 2023 keine zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten.

MSCI AC Asia Ex Japan SF UCITS ETF	Ebene 1 USD	Ebene 2 USD	Ebene 3 USD	Gesamtzeitwert USD
Finanzielle Vermögenswerte				
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
- Aktien	223.105.817	-	-	223.105.817
- Funded Swaps	-	906.599	-	906.599
- Unfunded Swaps	-	2.621.520	-	2.621.520
Summe der finanziellen Vermögenswerte	223.105.817	3.528.119	-	226.633.936

Der MSCI AC Asia Ex Japan SF UCITS ETF hielt zum 30. Juni 2023 keine zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten.

MSCI ACWI SF UCITS ETF	Ebene 1 USD	Ebene 2 USD	Ebene 3 USD	Gesamtzeitwert USD
Finanzielle Vermögenswerte				
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
- Aktien	5.825.977.203	-	-	5.825.977.203
- Funded Swaps	-	23.814.802	-	23.814.802
- Unfunded Swaps	-	103.503.164	-	103.503.164
Summe der finanziellen Vermögenswerte	5.825.977.203	127.317.966	-	5.953.295.169

Der MSCI ACWI SF UCITS ETF hielt zum 30. Juni 2023 keine zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten.

CMCI Ex-Agriculture SF UCITS ETF	Ebene 1 USD	Ebene 2 USD	Ebene 3 USD	Gesamtzeitwert USD
Finanzielle Vermögenswerte				
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
- Aktien	142.330.447	-	-	142.330.447
- Funded Swaps	-	584.420	-	584.420
- Unfunded Swaps	-	3.180.198	-	3.180.198
Summe der finanziellen Vermögenswerte	142.330.447	3.764.618	-	146.095.065

**ERLÄUTERUNGEN ZUM ZUSAMMENGEFASSTEN HALBJAHRESABSCHLUSS
(Fortsetzung)
FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2023**

5. FINANZRISIKOMANAGEMENT (Fortsetzung)

Allgemeiner Risikomanagementprozess (Fortsetzung)

(b) Schätzung des beizulegenden Zeitwerts (Fortsetzung)

Der CMCI Ex-Agriculture SF UCITS ETF hielt zum 30. Juni 2023 keine zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten.

Bloomberg Commodity CMCI SF UCITS ETF	Ebene 1 USD	Ebene 2 USD	Ebene 3 USD	Gesamtzeitwert USD
Finanzielle Vermögenswerte				
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
- Aktien	547.932.776	-	-	547.932.776
- Funded Swaps	-	2.238.622	-	2.238.622
- Unfunded Swaps	-	9.445.165	-	9.445.165
Summe der finanziellen Vermögenswerte	547.932.776	11.683.787	-	559.616.563

Der Bloomberg Commodity CMCI SF UCITS ETF hielt zum 30. Juni 2023 keine zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten.

CMCI Commodity Carry SF UCITS ETF	Ebene 1 USD	Ebene 2 USD	Ebene 3 USD	Gesamtzeitwert USD
Finanzielle Vermögenswerte				
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
- Aktien	191.344.491	-	-	191.344.491
- Funded Swaps	-	774.759	-	774.759
- Unfunded Swaps	-	1.556.993	-	1.556.993
Summe der finanziellen Vermögenswerte	191.344.491	2.331.752	-	193.676.243

Der CMCI Commodity Carry SF UCITS ETF hielt zum 30. Juni 2023 keine zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten.

MSCI China A SF UCITS ETF	Ebene 1 USD	Ebene 2 USD	Ebene 3 USD	Gesamtzeitwert USD
Finanzielle Vermögenswerte				
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
- Aktien	115.214.736	-	-	115.214.736
- Funded Swaps	-	467.873	-	467.873
- Unfunded Swaps	-	1.278.261	-	1.278.261
Summe der finanziellen Vermögenswerte	115.214.736	1.746.134	-	116.960.870

Der MSCI China A SF UCITS ETF hielt zum 30. Juni 2023 keine zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten.

Euro Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF	Ebene 1 EUR	Ebene 2 EUR	Ebene 3 EUR	Gesamtzeitwert EUR
Finanzielle Vermögenswerte				
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
- Aktien	5.269.224	-	-	5.269.224
- Funded Swaps	-	21.887	-	21.887
- Unfunded Swaps	-	178.561	-	178.561
Summe der finanziellen Vermögenswerte	5.269.224	200.448	-	5.469.672

**ERLÄUTERUNGEN ZUM ZUSAMMENGEFASSTEN HALBJAHRESABSCHLUSS
(Fortsetzung)
FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2023**

5. FINANZRISIKOMANAGEMENT (Fortsetzung)

Allgemeiner Risikomanagementprozess (Fortsetzung)

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

Der Euro Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF hielt zum 30. Juni 2023 keine zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten.

Euro Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF	Ebene 1 EUR	Ebene 2 EUR	Ebene 3 EUR	Gesamtzeitwert EUR
Finanzielle Vermögenswerte				
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
- Aktien	26.751.896	-	-	26.751.896
- Funded Swaps	-	109.103	-	109.103
- Unfunded Swaps	-	408.837	-	408.837
Summe der finanziellen Vermögenswerte	26.751.896	517.940	-	27.269.836

Der Euro Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF hielt zum 30. Juni 2023 keine zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten.

US Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF	Ebene 1 USD	Ebene 2 USD	Ebene 3 USD	Gesamtzeitwert USD
Finanzielle Vermögenswerte				
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
- Aktien	6.158.578	-	-	6.158.578
- Funded Swaps	-	25.243	-	25.243
- Unfunded Swaps	-	126.534	-	126.534
Summe der finanziellen Vermögenswerte	6.158.578	151.777	-	6.310.355

Der US Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF hielt zum 30. Juni 2023 keine zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten.

US Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF	Ebene 1 USD	Ebene 2 USD	Ebene 3 USD	Gesamtzeitwert USD
Finanzielle Vermögenswerte				
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
- Aktien	20.711.380	-	-	20.711.380
- Funded Swaps	-	84.713	-	84.713
- Unfunded Swaps	-	380.975	-	380.975
Summe der finanziellen Vermögenswerte	20.711.380	465.688	-	21.177.068

Der US Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF hielt zum 30. Juni 2023 keine zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten.

MSCI USA SF Index Fund	Ebene 1 USD	Ebene 2 USD	Ebene 3 USD	Gesamtzeitwert USD
Finanzielle Vermögenswerte				
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
- Aktien	917.684.779	-	-	917.684.779
- Funded Swaps	-	3.350.560	-	3.350.560
- Unfunded Swaps	-	19.954.649	-	19.954.649
Summe der finanziellen Vermögenswerte	917.684.779	23.305.209	-	940.989.988

**ERLÄUTERUNGEN ZUM ZUSAMMENGEFASSTEN HALBJAHRESABSCHLUSS
(Fortsetzung)
FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2023**

5. FINANZRISIKOMANAGEMENT (Fortsetzung)

Allgemeiner Risikomanagementprozess (Fortsetzung)

(b) Schätzung des beizulegenden Zeitwerts (Fortsetzung)

Der MSCI USA SF Index Fund hielt zum 30. Juni 2023 keine zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten.

CMCI Commodity Carry Ex-Agriculture SF UCITS ETF Finanzielle Vermögenswerte	Ebene 1 USD	Ebene 2 USD	Ebene 3 USD	Gesamtzeitwert USD
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
- Aktien	73.221.805	-	-	73.221.805
- Funded Swaps	-	347.078	-	347.078
- Unfunded Swaps	-	662.431	-	662.431
Summe der finanziellen Vermögenswerte	73.221.805	1.009.509	-	74.231.314

Der CMCI Commodity Carry Ex-Agriculture SF UCITS ETF hielt zum 30. Juni 2023 keine zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten.

CMCI Commodity Transition SF UCITS ETF¹ Finanzielle Vermögenswerte	Ebene 1 USD	Ebene 2 USD	Ebene 3 USD	Gesamtzeitwert USD
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
- Aktien	1.961.223	-	-	1.961.223
- Funded Swaps	-	64.862	-	64.862
Summe der finanziellen Vermögenswerte	1.961.223	64.862	-	2.026.085
Finanzielle Verbindlichkeiten				
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
- Unfunded Swaps	-	(5.818)	-	(5.818)
Summe der finanziellen Verbindlichkeiten	-	(5.818)	-	(5.818)
Finanzielle Vermögenswerte, netto	1.961.223	59.044	-	2.020.267

¹ Der Teilfonds wurde am 24. Mai 2023 aufgelegt.

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

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

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

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

**ERLÄUTERUNGEN ZUM ZUSAMMENGEFASSTEN HALBJAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)
FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2023**

5. FINANZRISIKOMANAGEMENT (Fortsetzung)

Allgemeiner Risikomanagementprozess (Fortsetzung)

(b) Schätzung des beizulegenden Zeitwerts (Fortsetzung)

Ein beträchtlicher Anteil der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte aller Teilfonds basiert auf Kursnotierungen eines aktiven Marktes und wird daher Ebene 1 zugeordnet. Infolgedessen ist die Ebene 1 die angemessenste Kategorie für das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien dieser Teilfonds zuzurechnende Nettovermögen (30. Juni 2023: Ebene 1).

(c) Effizientes Portfoliomanagement (EPM)

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

Die Teilfonds setzen keine derivativen Finanzinstrumenten („DFI“) für die Zwecke eines effizienten Portfoliomanagements ein, mit Ausnahme derjenigen Teilfonds, die Aktienklassen ausgegeben haben, die auf eine andere Währung lauten als die jeweilige Basiswährung. In diesen Fällen gehen die Teilfonds einen oder mehrere Swaps in der Währung der jeweiligen Aktienklasse ein, der/die nicht auf die Basiswährung lautet/lauten, wodurch sich das Währungsrisiko zwischen der Basiswährung und der Währung der Aktienklasse reduziert. Diese nicht auf die Basiswährung lautenden Swaps sind in der Vermögensaufstellung aufgeführt. Die Kosten dieser EPM-Techniken für die betreffende Aktienklasse des betreffenden Teilfonds für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 und den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2022 sind in der folgenden Tabelle dargestellt und in den Nettogewinnen/(-verlusten) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten in der zusammengefassten Gesamtergebnisrechnung enthalten. Im Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 und im Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2022 wurden aus diesen EPM-Techniken keine Erlöse erzielt.

Teilfonds	Währung	Kosten für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023	Kosten für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2022
CMCI Composite SF UCITS ETF	USD	434.265	564.171
Bloomberg Commodity Index SF UCITS ETF	USD	162.756	112.143
MSCI ACWI SF UCITS ETF	USD	1.674.404	1.191.525
CMCI Ex-Agriculture SF UCITS ETF	USD	46.431	44.591
Bloomberg Commodity CMCI SF UCITS ETF	USD	223.751	65.125
CMCI Commodity Carry SF UCITS ETF	USD	28.859	46.170
MSCI USA SF Index Fund	USD	129.663	111.610
CMCI Commodity Carry Ex-Agriculture SF UCITS ETF	USD	3.285	2.437

Gesamtrisiko

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

Aufgrund der Richtlinie, der Anwendung eines genau bestimmten Anlageansatzes und der zusätzlichen Beschränkungen, wie in den Verkaufsunterlagen (Gesellschaftsprospekt und Nachträge zu den Teilfonds) beschrieben – zusammen die „Anlageregeln“ – dürfen sämtliche Teilfonds nur ein begrenztes Risiko eingehen. Markt-, Kredit-, und Liquiditätsrisiken innerhalb der Teilfonds werden durch Einhaltung des Exposure der Gesellschaft gemäß den „Anlageregeln“ erzielt. Die Zahlen zum Gesamtrisiko für die Teilfonds zum 31. Dezember 2023 und 30. Juni 2023 spiegeln das Risiko wider, das sich aus der Wiederanlage von Barsicherheiten in Geldmarktfonds ergibt. Das durch DFI erzeugte Gesamtrisiko zum 31. Dezember 2023 und 30. Juni 2023 beträgt für alle Teilfonds null.

**ERLÄUTERUNGEN ZUM ZUSAMMENGEFASSTEN HALBJAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)
FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2023**

5. FINANZRISIKOMANAGEMENT (Fortsetzung)

Allgemeiner Risikomanagementprozess (Fortsetzung)

(c) *Effizientes Portfoliomanagement („EPM“) (Fortsetzung)*

Gesamtrisiko (Fortsetzung)

Teilfonds	Währung	Gesamtrisiko zum 31. Dezember 2023	Gesamtrisiko zum 30. Juni 2023
CMCI Composite SF UCITS ETF	USD	5,13 %	2,80 %
Bloomberg Commodity Index SF UCITS ETF	USD	7,69 %	5,26 %
S&P 500 SF UCITS ETF	USD	4,34 %	2,99 %
MSCI USA SF UCITS ETF	USD	3,87 %	2,95 %
MSCI Emerging Markets SF UCITS ETF	USD	4,79 %	5,62 %
MSCI AC Asia Ex Japan SF UCITS ETF	USD	3,44 %	3,44 %
MSCI ACWI SF UCITS ETF	USD	2,79 %	2,09 %
CMCI Ex-Agriculture SF UCITS ETF	USD	3,57 %	3,24 %
Bloomberg Commodity CMCI SF UCITS ETF	USD	4,13 %	2,82 %
CMCI Commodity Carry SF UCITS ETF	USD	3,24 %	3,80 %
MSCI China A SF UCITS ETF	USD	5,25 %	3,08 %
Euro Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF	EUR	6,68 %	5,77 %
Euro Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF	EUR	4,77 %	3,54 %
US Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF	USD	5,91 %	3,95 %
US Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF	USD	4,91 %	3,78 %
MSCI USA SF Index Fund	USD	4,38 %	2,52 %
CMCI Commodity Carry Ex-Agriculture SF UCITS ETF	USD	2,54 %	4,29 %
CMCI Commodity Transition SF UCITS ETF	USD	- %	- %

(d) *Saisonale/zyklische Änderungen*

Die Gesellschaft unterliegt keinen saisonalen oder zyklischen Änderungen.

6. BESTEUERUNG

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

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

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

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

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

**ERLÄUTERUNGEN ZUM ZUSAMMENGEFASSTEN HALBJAHRESABSCHLUSS
(Fortsetzung)
FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2023**

7. WECHSELKURSE

Mit Ausnahme der nachstehend aufgeführten Teilfonds werden die Abschlüsse der Teilfonds in US-Dollar (USD) aufgestellt. Die folgenden Wechselkurse wurden am Ende des jeweiligen Berichtszeitraums zur Umrechnung der auf andere Währungen als den USD lautenden Vermögenswerte und Verbindlichkeiten verwendet:

Zum	31. Dezember 2023	30. Juni 2023
CAD	1,3186	1,3233
CHF	0,8417	0,8947
CNY	7,0922	7,2748
DKK	6,7484	6,8249
EUR	0,9053	0,9166
GBP	0,7844	0,7866
HKD	7,8086	7,8366
ILS	3,6009	-
JPY	140,9800	144,5350
NOK	10,1557	10,7136
SEK	10,0779	10,8013
SGD	1,3191	1,3534

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

Zum	31. Dezember 2023	30. Juni 2023
CHF	0,9297	0,9761
HKD	-	8,5497
ILS	3,9777	-
JPY	-	157,6877
SEK	11,1325	11,7842
USD	1,1047	1,0910

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

Durchschnittlicher Wechselkurs für den Berichtszeitraum zum	31. Dezember 2023	31. Dezember 2022
EUR	0,9235	0,9860

8. DIVIDENDEN

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

Für die folgenden Aktienklassen wurden im Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 Dividenden festgesetzt:

Teilfonds	Aktienklasse	Ex-Tag	Dividendensatz	Dividende
MSCI ACWI SF UCITS ETF	(hedged to CHF) A-UKdis	31. Juli 2023	1,4687 CHF je Aktie	272.859 CHF
MSCI ACWI SF UCITS ETF	(hedged to EUR) A-UKdis	31. Juli 2023	2,4949 EUR je Aktie	390.742 EUR
MSCI ACWI SF UCITS ETF	(hedged to GBP) A-UKdis	31. Juli 2023	1,3289 GBP je Aktie	800.482 GBP
MSCI ACWI SF UCITS ETF	(hedged to USD) A-UKdis	31. Juli 2023	2,0713 USD je Aktie	409.492 USD

**ERLÄUTERUNGEN ZUM ZUSAMMENGEFASSTEN HALBJAHRESABSCHLUSS (Fortsetzung)
FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2023**

8. DIVIDENDEN (Fortsetzung)

Teilfonds	Aktienklasse	Ex-Tag	Dividendensatz	Dividende
MSCI ACWI SF UCITS ETF	(USD) A-UKdis	31. Juli 2023	1,3306 USD je Aktie	2.277.770 USD
MSCI USA SF Index Fund	(hedged to CHF) A-UKdis	31. Juli 2023	0,7784 CHF je Aktie	11.527 CHF
MSCI USA SF Index Fund	(hedged to EUR) A-UKdis	31. Juli 2023	0,6553 EUR je Aktie	39.405 EUR
MSCI USA SF Index Fund	(hedged to GBP) A-UKdis	31. Juli 2023	0,7372 GBP je Aktie	1.843 GBP
MSCI USA SF Index Fund	(USD) A-UKdis	31. Juli 2023	0,4022 USD je Aktie	140.414 USD

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

Teilfonds	Aktienklasse	Ex-Tag	Dividendensatz	Dividende
MSCI ACWI SF UCITS ETF	(hedged to CHF) A-UKdis	1. Februar 2024	1,3392 CHF je Aktie	292.063 CHF
MSCI ACWI SF UCITS ETF	(hedged to EUR) A-UKdis	1. Februar 2024	1,8053 EUR je Aktie	261.084 EUR
MSCI ACWI SF UCITS ETF	(hedged to GBP) A-UKdis	1. Februar 2024	1,2008 GBP je Aktie	1.170.114 GBP
MSCI ACWI SF UCITS ETF	(hedged to USD) A-UKdis	1. Februar 2024	1,8716 USD je Aktie	315.750 USD
MSCI ACWI SF UCITS ETF	(USD) A-UKdis	1. Februar 2024	1,4470 USD je Aktie	2.253.283 USD
MSCI USA SF Index Fund	(hedged to CHF) A-UKdis	1. Februar 2024	0,7444 CHF je Aktie	8.836 CHF
MSCI USA SF Index Fund	(hedged to EUR) A-UKdis	1. Februar 2024	0,6398 EUR je Aktie	25.737 EUR
MSCI USA SF Index Fund	(hedged to GBP) A-UKdis	1. Februar 2024	0,7228 GBP je Aktie	1.807 GBP
MSCI USA SF Index Fund	(USD) A-UKdis	1. Februar 2024	0,8329 USD je Aktie	381.983 USD

9. SOFT-COMMISSION-VEREINBARUNGEN UND DIRECT BROKERAGE

Weder im Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 noch im vorangegangenen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2022 bestanden Vereinbarungen über geldwerte Vorteile („Soft Commissions“) oder Directed Brokerage.

**ERLÄUTERUNGEN ZUM ZUSAMMENGEFASSTEN HALBJAHRESABSCHLUSS
(Fortsetzung)
FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2023**

10. GESAMT-NETTOINVENTARWERT JE AKTIENKLASSE

	31. Dezember 2023	30. JUNI 2023	31. Dezember 2022
CMCI Composite SF UCITS ETF Klasse (CHF) A-acc	265.334.426 CHF	288.546.015 CHF	311.006.384 CHF
CMCI Composite SF UCITS ETF Klasse (EUR) A-acc	257.794.877 EUR	276.704.908 EUR	309.725.832 EUR
CMCI Composite SF UCITS ETF Klasse (GBP) A-acc	13.609.536 GBP	16.907.136 GBP	48.855.633 GBP
CMCI Composite SF UCITS ETF Klasse (USD) A-acc	866.107.576 USD	701.487.905 USD	946.514.319 USD
Bloomberg Commodity Index SF UCITS ETF Klasse (CHF) A-acc	67.371.160 CHF	345.916.753 CHF	70.374.369 CHF
Bloomberg Commodity Index SF UCITS ETF Klasse (EUR) A-acc	19.865.343 EUR	28.030.388 EUR	24.812.403 EUR
Bloomberg Commodity Index SF UCITS ETF Klasse (GBP) A-acc	1.903.239 GBP	1.910.477 GBP	2.088.351 GBP
Bloomberg Commodity Index SF UCITS ETF Klasse (USD) A-acc	58.154.289 USD	64.826.678 USD	49.830.867 USD
S&P 500 SF UCITS ETF Klasse (USD) A-acc	148.514.376 USD	148.007.670 USD	148.181.159 USD
MSCI USA SF UCITS ETF Klasse (USD) A-acc	466.173.979 USD	463.900.568 USD	481.738.338 USD
MSCI Emerging Markets SF UCITS ETF Klasse (USD) A-acc	98.779.572 USD	100.391.606 USD	92.447.806 USD
MSCI AC Asia Ex Japan SF UCITS ETF Klasse (USD) A-acc	217.195.995 USD	226.649.653 USD	186.500.627 USD
MSCI ACWI SF UCITS ETF Klasse (hedged to CHF) A-acc	964.980.009 CHF	1.000.937.556 CHF	1.088.688.060 CHF
MSCI ACWI SF UCITS ETF Klasse (hedged to CHF) A-UKdis	29.175.279 CHF	26.138.974 CHF	23.645.884 CHF
MSCI ACWI SF UCITS ETF Klasse (hedged to EUR) A-acc	1.325.731.231 EUR	1.174.482.968 EUR	1.125.803.565 EUR
MSCI ACWI SF UCITS ETF Klasse (hedged to EUR) A-UKdis	26.374.444 EUR	25.323.245 EUR	12.953.936 EUR
MSCI ACWI SF UCITS ETF Klasse (hedged to GBP) A-UKdis	113.285.236 GBP	104.183.678 GBP	114.529.192 GBP
MSCI ACWI SF UCITS ETF Klasse (hedged to JPY) A-acc	19.688.298.668 JPY	23.346.335.539 JPY	18.318.373.731 JPY
MSCI ACWI SF UCITS ETF Klasse (hedged to SGD) A-acc	2.134.511 SGD	2.019.912 SGD	1.774.538 SGD
MSCI ACWI SF UCITS ETF Klasse (hedged to USD) A-acc	1.701.158.578 USD	1.807.627.436 USD	1.824.789.500 USD
MSCI ACWI SF UCITS ETF Klasse (hedged to USD) A-UKdis	33.040.246 USD	39.393.615 USD	35.171.674 USD
MSCI ACWI SF UCITS ETF Klasse (USD) A-acc	1.275.621.173 USD	1.131.474.676 USD	650.487.293 USD
MSCI ACWI SF UCITS ETF Klasse (USD) A-UKdis	221.220.885 USD	222.805.022 USD	209.691.407 USD
CMCI Ex-Agriculture SF UCITS ETF Klasse (hedged to CHF) A-acc	38.421.785 CHF	44.679.999 CHF	50.152.056 CHF
CMCI Ex-Agriculture SF UCITS ETF Klasse (hedged to EUR) A-acc	13.032.118 EUR	14.245.747 EUR	7.524.950 EUR
CMCI Ex-Agriculture SF UCITS ETF Klasse (hedged to GBP) A-acc	1.237.386 GBP	2.214.279 GBP	2.444.475 GBP
CMCI Ex-Agriculture SF UCITS ETF Klasse (USD) A-acc	91.925.936 USD	77.809.637 USD	49.089.209 USD
Bloomberg Commodity CMCI SF UCITS ETF Klasse (hedged to CHF) A-acc	219.895.844 CHF	34.356.556 CHF	33.413.779 CHF
Bloomberg Commodity CMCI SF UCITS ETF Klasse (hedged to EUR) A-acc	35.911.928 EUR	65.601.977 EUR	102.938.141 EUR
Bloomberg Commodity CMCI SF UCITS ETF Klasse (hedged to GBP) A-acc	30.105.032 GBP	23.541.364 GBP	3.507.090 GBP
Bloomberg Commodity CMCI SF UCITS ETF Klasse (USD) A-acc	439.805.418 USD	419.756.333 USD	494.061.560 USD
CMCI Commodity Carry SF UCITS ETF Klasse (hedged to CHF) A-acc	13.353.319 CHF	6.757.440 CHF	30.591.288 CHF
CMCI Commodity Carry SF UCITS ETF Klasse (hedged to EUR) A-acc	32.042.613 EUR	108.225.820 EUR	86.413.547 EUR
CMCI Commodity Carry SF UCITS ETF Klasse (USD) A-acc	160.050.916 USD	68.063.868 USD	45.418.357 USD
MSCI China A SF UCITS ETF Klasse (USD) A-acc	93.377.058 USD	116.967.793 USD	160.744.152 USD
Euro Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF Klasse (EUR) A-acc	3.406.704 EUR	5.470.853 EUR	4.805.949 EUR

**ERLÄUTERUNGEN ZUM ZUSAMMENGEFASSTEN HALBJAHRESABSCHLUSS
(Fortsetzung)
FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2023**

10. GESAMT-NETTOINVENTARWERT JE AKTIENKLASSE (Fortsetzung)

	31. Dezember 2023	30. JUNI 2023	31. Dezember 2022
Euro Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF Klasse (EUR) A-acc	30.465.960 EUR	27.275.823 EUR	20.067.315 EUR
US Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF Klasse (USD) A-acc	4.348.661 USD	6.310.793 USD	3.379.531 USD
US Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF Klasse (USD) A-acc	17.976.181 USD	21.178.530 USD	19.794.452 USD
MSCI USA SF Index Fund Klasse (hedged to CHF) A-acc	98.941.594 CHF	50.691.347 CHF	51.797.577 CHF
MSCI USA SF Index Fund Klasse (hedged to CHF) A-UKdis	1.572.358 CHF	1.731.190 CHF	1.368.654 CHF
MSCI USA SF Index Fund Klasse (hedged to EUR) A-acc	372.893.856 EUR	206.006.195 EUR	252.533.520 EUR
MSCI USA SF Index Fund Klasse (hedged to EUR) A-UKdis	4.849.086 EUR	7.353.751 EUR	7.051.311 EUR
MSCI USA SF Index Fund Klasse (hedged to GBP) A-acc	24.881.784 GBP	33.889.584 GBP	21.028.670 GBP
MSCI USA SF Index Fund Klasse (hedged to GBP) A-UKdis	323.629 GBP	303.057 GBP	262.910 GBP
MSCI USA SF Index Fund Klasse (USD) A-acc	873.627.326 USD	556.951.092 USD	514.133.376 USD
MSCI USA SF Index Fund Klasse (USD) A-UKdis	60.595.652 USD	43.564.063 USD	55.216.818 USD
CMCI Commodity Carry Ex-Agriculture SF UCITS ETF Klasse (hedged to EUR) A-acc	4.993.272 EUR	4.890.253 EUR	4.387.532 EUR
CMCI Commodity Carry Ex-Agriculture SF UCITS ETF Klasse (USD) A-acc	53.296.488 USD	68.901.261 USD	55.694.733 USD
CMCI Commodity Transition SF UCITS ETF Klasse (USD) A-acc ¹	2.053.548 USD	2.020.124 USD	-

¹ Die Aktienklasse wurde am 24. Mai 2023 aufgelegt.

**ERLÄUTERUNGEN ZUM ZUSAMMENGEFASSTEN HALBJAHRESABSCHLUSS
(Fortsetzung)
FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2023**
11. NETTOINVENTARWERT JE RÜCKKAUFBARER, GEWINNBERECHTIGTER AKTIE

	31. Dezember 2023	30. JUNI 2023	31. Dezember 2022
CMCI Composite SF UCITS ETF Klasse (CHF) A-acc	72,56 CHF	72,21 CHF	77,44 CHF
CMCI Composite SF UCITS ETF Klasse (EUR) A-acc	75,60 EUR	74,33 EUR	79,06 EUR
CMCI Composite SF UCITS ETF Klasse (GBP) A-acc	127,96 GBP	124,97 GBP	131,83 GBP
CMCI Composite SF UCITS ETF Klasse (USD) A-acc	99,42 USD	96,90 USD	101,47 USD
Bloomberg Commodity Index SF UCITS ETF Klasse (CHF) A-acc	47,62 CHF	48,73 CHF	54,21 CHF
Bloomberg Commodity Index SF UCITS ETF Klasse (EUR) A-acc	49,74 EUR	50,29 EUR	55,46 EUR
Bloomberg Commodity Index SF UCITS ETF Klasse (GBP) A-acc	53,73 GBP	53,93 GBP	58,95 GBP
Bloomberg Commodity Index SF UCITS ETF Klasse (USD) A-acc	62,82 USD	62,94 USD	68,32 USD
S&P 500 SF UCITS ETF Klasse (USD) A-acc	91,04 USD	84,42 USD	72,33 USD
MSCI USA SF UCITS ETF Klasse (USD) A-acc	135,86 USD	125,38 USD	107,19 USD
MSCI Emerging Markets SF UCITS ETF Klasse (USD) A-acc	49,45 USD	47,21 USD	45,02 USD
MSCI AC Asia Ex Japan SF UCITS ETF Klasse (USD) A-acc	154,15 USD	149,96 USD	145,71 USD
MSCI ACWI SF UCITS ETF Klasse (hedged to CHF) A-acc	167,04 CHF	160,89 CHF	144,01 CHF
MSCI ACWI SF UCITS ETF Klasse (hedged to CHF) A-UKdis	144,59 CHF	140,70 CHF	127,28 CHF
MSCI ACWI SF UCITS ETF Klasse (hedged to EUR) A-acc	178,72 EUR	169,02 EUR	149,93 EUR
MSCI ACWI SF UCITS ETF Klasse (hedged to EUR) A-UKdis	168,40 EUR	161,68 EUR	144,54 EUR
MSCI ACWI SF UCITS ETF Klasse (hedged to GBP) A-UKdis	182,68 GBP	172,95 GBP	155,11 GBP
MSCI ACWI SF UCITS ETF Klasse (hedged to JPY) A-acc	1.872,90 JPY	1.810,80 JPY	1.604,00 JPY
MSCI ACWI SF UCITS ETF Klasse (hedged to SGD) A-acc	142,30 SGD	134,66 SGD	118,30 SGD
MSCI ACWI SF UCITS ETF Klasse (hedged to USD) A-acc	209,54 USD	195,54 USD	170,92 USD
MSCI ACWI SF UCITS ETF Klasse (hedged to USD) A-UKdis	198,19 USD	186,96 USD	165,16 USD
MSCI ACWI SF UCITS ETF Klasse (USD) A-acc	162,21 USD	151,20 USD	132,69 USD
MSCI ACWI SF UCITS ETF Klasse (USD) A-UKdis	137,64 USD	129,59 USD	114,96 USD
CMCI Ex-Agriculture SF UCITS ETF Klasse (hedged to CHF) A-acc	147,53 CHF	146,11 CHF	164,00 CHF
CMCI Ex-Agriculture SF UCITS ETF Klasse (hedged to EUR) A-acc	153,09 EUR	149,76 EUR	166,75 EUR
CMCI Ex-Agriculture SF UCITS ETF Klasse (hedged to GBP) A-acc	130,25 GBP	126,53 GBP	139,68 GBP
CMCI Ex-Agriculture SF UCITS ETF Klasse (USD) A-acc	193,37 USD	187,55 USD	205,51 USD
Bloomberg Commodity CMCI SF UCITS ETF Klasse (hedged to CHF) A-acc	12,55 CHF	12,76 CHF	14,05 CHF
Bloomberg Commodity CMCI SF UCITS ETF Klasse (hedged to EUR) A-acc	12,97 EUR	13,03 EUR	14,23 EUR
Bloomberg Commodity CMCI SF UCITS ETF Klasse (hedged to GBP) A-acc	13,03 GBP	13,01 GBP	14,08 GBP
Bloomberg Commodity CMCI SF UCITS ETF Klasse (USD) A-acc	15,21 USD	15,13 USD	16,28 USD
CMCI Commodity Carry SF UCITS ETF Klasse (hedged to CHF) A-acc	115,65 CHF	112,62 CHF	109,25 CHF
CMCI Commodity Carry SF UCITS ETF Klasse (hedged to EUR) A-acc	119,22 EUR	114,71 EUR	110,29 EUR
CMCI Commodity Carry SF UCITS ETF Klasse (USD) A-acc	147,00 USD	140,01 USD	133,13 USD
MSCI China A SF UCITS ETF Klasse (USD) A-acc	107,73 USD	115,38 USD	121,89 USD
Euro Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF Klasse (EUR) A-acc	127,36 EUR	125,43 EUR	110,18 EUR
Euro Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF Klasse (EUR) A-acc	131,75 EUR	126,72 EUR	118,51 EUR
US Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF Klasse (USD) A-acc	148,83 USD	141,02 USD	121,06 USD
US Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF Klasse (USD) A-acc	128,28 USD	123,34 USD	115,28 USD
MSCI USA SF Index Fund Klasse (hedged to CHF) A-acc	126,36 CHF	120,12 CHF	105,06 CHF
MSCI USA SF Index Fund Klasse (hedged to CHF) A-UKdis	122,17 CHF	116,89 CHF	102,83 CHF
MSCI USA SF Index Fund Klasse (hedged to EUR) A-acc	130,09 EUR	121,78 EUR	105,62 EUR
MSCI USA SF Index Fund Klasse (hedged to EUR) A-UKdis	126,13 EUR	118,71 EUR	103,70 EUR
MSCI USA SF Index Fund Klasse (hedged to GBP) A-acc	133,51 GBP	124,29 GBP	107,13 GBP
MSCI USA SF Index Fund Klasse (hedged to GBP) A-UKdis	129,45 GBP	121,22 GBP	105,16 GBP
MSCI USA SF Index Fund Klasse (USD) A-acc	140,88 USD	129,97 USD	111,10 USD

**ERLÄUTERUNGEN ZUM ZUSAMMENGEFASSTEN HALBJAHRESABSCHLUSS
(Fortsetzung)
FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2023**

11. NETTOINVENTARWERT JE RÜCKKAUFBARER, GEWINNBERECHTIGTER AKTIE (Fortsetzung)

	31. Dezember 2023	30. JUNI 2023	31. Dezember 2022
MSCI USA SF Index Fund Klasse (USD) A-UKdis	136,40 USD	126,23 USD	108,66 USD
CMCI Commodity Carry Ex-Agriculture SF UCITS ETF Klasse (hedged to EUR) A-acc	124,83 EUR	122,26 EUR	109,69 EUR
CMCI Commodity Carry Ex-Agriculture SF UCITS ETF Klasse (USD) A-acc	131,68 USD	127,52 USD	113,12 USD
CMCI Commodity Transition SF UCITS ETF Klasse (USD) A-acc ¹	102,68 USD	101,01 USD	-

¹ Die Aktienklasse wurde am 24. Mai 2023 aufgelegt.

12. BANKGUTHABEN UND EINLAGEN

Keiner der Teilfonds hielt zum 31. Dezember 2023 Barguthaben (30. Juni 2023: null). Barsicherheiten, die die Teilfonds von der Gegenpartei erhalten, werden in den UBS (Irl) Fund plc - Select Money Market Fund—EUR, den UBS (Irl) Fund plc - Select Money Market Fund—GBP und den UBS (Irl) Fund plc - Select Money Market Fund—USD reinvestiert, die von einem nahestehenden Unternehmen, der UBS AG, (und ihren Konzerngesellschaften) verwaltet werden.

13. WESENTLICHE EREIGNISSE IM BERICHTSZEITRAUM

Der Krieg in der Ukraine und der andauernde Konflikt im Nahen Osten haben erhebliche Auswirkungen auf die Finanzmärkte, in erster Linie auf russische, ukrainische und israelische Wertpapiere, aber auch auf die breiteren Märkte weltweit. Die Situation ist nach wie vor sehr volatil und wird von der Fondsverwaltungsgesellschaft genau beobachtet, um rasch geeignete Maßnahmen zum Schutz der Interessen der Anleger unserer Fonds zu ergreifen. Sie hat die erforderlichen Maßnahmen ergriffen, um jederzeit die geltenden Gesetze und Vorschriften einzuhalten, insbesondere, aber nicht ausschließlich, die zuletzt erlassenen Sanktionsregelungen in der EU, der Schweiz, in Großbritannien und den USA. Aufgrund der ernsthaften Handelsbeschränkungen über die mit Sanktionen belegten russischen Wertpapiere hinaus wenden wir für alle relevanten Wertpapiere, deren Kursnotierungen (sofern verfügbar) ihren aktuellen Marktwert nicht widerspiegeln, eine Bepreisung zum beizulegenden Zeitwert an. Je nach der künftigen Entwicklung der Finanzmärkte kann es weitere Auswirkungen auf die Anlagestrategien geben. Es ist derzeit unklar, ob dies die Anwendung von Liquiditätsmaßnahmen in bestimmten Fonds erforderlich machen wird. Dazu können alle Maßnahmen gehören, die in den jeweiligen Verkaufsprospekten der Fonds angegeben sind.

Die Zulassung für die Vermarktung des CMCI Composite SF UCITS ETF in Belgien erfolgte am 1. August 2023.

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

14. WESENTLICHE EREIGNISSE SEIT DEM ENDE DES BERICHTSZEITRAUMS

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

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

15. GENEHMIGUNG DES ABSCHLUSSES

Der Abschluss wurde am 21. Februar 2024 vom Verwaltungsrat genehmigt.

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2023**

CMCI COMPOSITE SF UCITS ETF

Aktien – 96,69 % (30. Juni 2023: 97,94 %)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
41.464	3M Co	4.532.850	0,31
72.858	Achillion Pharmaceuticals Inc	-	0,00
2.151	adidas AG	437.545	0,03
73.804	Adobe Inc	44.031.360	2,97
285.446	Advanced Micro Devices Inc	42.077.602	2,84
28.482	Air Liquide SA	5.541.147	0,37
52.510	Alcon Inc	4.095.243	0,28
218.124	Alphabet Inc - Class A	30.469.733	2,05
199.616	Alphabet Inc - Class C	28.131.843	1,90
525.300	Amazon.com Inc	79.814.077	5,38
16.953	American Water Works Co Inc	2.237.627	0,15
24.736	Amgen Inc	7.124.515	0,48
153.573	Amot Investments Ltd	830.794	0,06
1.698	ANSYS Inc	616.091	0,04
442.072	Apple Inc	85.112.078	5,74
85.685	Applied Materials Inc	13.886.949	0,94
483.370	ArcelorMittal SA	13.709.300	0,92
4.367	Arista Networks Inc	1.028.379	0,07
18.939	ASML Holding NV	14.261.778	0,96
465.637	Atlas Copco AB - Class B	6.902.881	0,47
81.488	AXA SA	2.654.560	0,18
27.306	Azrieli Group Ltd	1.775.973	0,12
12.949	Baozun Inc	35.481	0,00
244.513	BASF SE	13.175.557	0,89
3.920	Bayerische Motoren Werke AG (Voting rights)	436.416	0,03
1.477.800	Bezeq The Israeli Telecommunication Corp Ltd	2.021.618	0,14
437.088	BNP Paribas SA	30.220.308	2,04
304	Booking Holdings Inc	1.079.870	0,07
27.278	Boston Scientific Corp	1.576.968	0,11
2.655	Bouygues SA	100.085	0,01
19.691	Broadcom Inc	21.980.387	1,48
1.124	Cadence Design Systems Inc	306.174	0,02
88.140	Carrefour SA	1.612.827	0,11
25.690	CF Industries Holdings Inc	2.042.388	0,14
4.456	Check Point Software Technologies Ltd	680.773	0,05
263	Chipotle Mexican Grill Inc	600.441	0,04
56.701	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA	2.033.121	0,14
8.341	Cintas Corp	5.026.843	0,34
105.141	Citigroup Inc	5.408.448	0,36
118.148	Commerzbank AG	1.404.307	0,09
57.741	Consolidated Edison Inc	5.252.734	0,35
63.012	Covestro AG	3.666.860	0,25
154.897	Credit Agricole SA	2.199.065	0,15
4.867	Crowdstrike Holdings Inc	1.242.549	0,08
8.365	Cummins Inc	2.004.094	0,14
59.594	CVS Health Corp	4.705.558	0,32
3.544	CyberArk Software Ltd	776.407	0,05
86.940	Danone SA	5.635.510	0,38
117.335	Dell Technologies Inc	8.976.132	0,61
23.074	Deutsche Boerse AG	4.753.718	0,32
98.917	Deutsche Post AG	4.901.254	0,33

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2023**

CMCI COMPOSITE SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Aktien – 96,69 % (30. Juni 2023: 97,94 %) (Fortsetzung)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
19.373	Dollar Tree Inc	2.751.869	0,19
8.716	Dropbox Inc	256.933	0,02
395.381	E.ON SE	5.306.604	0,36
20.550	eBay Inc	896.377	0,06
21.967	Eli Lilly & Co	12.805.040	0,86
2.612.376	Enel SpA	19.421.174	1,31
811.395	Eni SpA	13.756.530	0,93
89.600	Enlight Renewable Energy Ltd	1.745.512	0,12
12.095	Euronext NV	1.050.814	0,07
72.201	Evonik Industries AG	1.475.509	0,10
7.877	EXOR NV	787.421	0,05
8.604	F5 Inc	1.539.951	0,10
7.327	Farfetch Ltd	163	0,00
4.272	Fortinet Inc	250.068	0,02
4.179	GEA Group AG	174.007	0,01
11.783	Hilton Worldwide Holdings Inc	2.145.518	0,14
28.799	Home Depot Inc	9.980.390	0,67
29.707	HP Inc	893.873	0,06
587	IDEXX Laboratories Inc	325.849	0,02
2.494	Incyte Corp	156.613	0,01
484.903	Infineon Technologies AG	20.247.519	1,37
250.854	ING Groep NV	3.748.138	0,25
8.199	Insulet Corp	1.779.002	0,12
155.641	Intel Corp	7.820.942	0,53
35.531	International Business Machines Corp	5.811.128	0,39
87.287	International Paper Co	3.155.409	0,21
14.184.651	Intesa Sanpaolo SpA	41.421.205	2,79
4.599	Intuitive Surgical Inc	1.551.639	0,10
215.756	Investor AB - Class B	4.998.976	0,34
3.044	Israel Corp Ltd	777.701	0,05
131.010	Johnson & Johnson	20.534.445	1,38
483.005	Just Eat Takeaway.com NV	7.353.406	0,50
68.376	K+S AG	1.080.863	0,07
22.387	Keysight Technologies Inc	3.561.612	0,24
9.415	KLA Corp	5.472.743	0,37
105.020	Koninklijke Ahold Delhaize NV	3.018.013	0,20
5.791	Laboratory Corp of America Holdings	1.316.163	0,09
5.880	Lam Research Corp	4.605.527	0,31
34.934	Liberty Global Ltd - Class A	620.780	0,04
12.806	Lonza Group AG	5.381.845	0,36
36.041	Marathon Petroleum Corp	5.347.054	0,36
24.838	Marriott International Inc	5.601.199	0,38
105.625	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA	1.307.388	0,09
32.819	Mercedes-Benz Group AG	2.267.643	0,15
11.376	Merck KGaA	1.810.819	0,12
99.587	Meta Platforms Inc	35.249.926	2,38
202.691	Microsoft Corp	76.219.862	5,14
2.626	Moderna Inc	261.106	0,02
23.765	Monster Beverage Corp	1.369.087	0,09
11.827	MTU Aero Engines AG	2.550.877	0,17
12.164	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen	5.040.187	0,34

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2023**

CMCI COMPOSITE SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Aktien – 96,69 % (30. Juni 2023: 97,94 %) (Fortsetzung)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
63.402	Nestle SA	7.345.514	0,50
25.662	Netflix Inc	12.494.090	0,84
13.128	New Oriental Education & Technology Group Inc	961.984	0,06
49.325	Nice Ltd	9.987.094	0,67
82.205	NN Group NV	3.246.384	0,22
20.909	Nova Ltd	2.914.968	0,20
75.131	Novartis AG	7.575.994	0,51
33.978	NVIDIA Corp	16.826.627	1,13
78.765	Oracle Corp	8.304.205	0,56
4.408.920	Orange SA	50.183.713	3,38
852	O'Reilly Automotive Inc	809.071	0,05
25.943	Palo Alto Networks Inc	7.650.186	0,52
12.043	Parker-Hannifin Corp	5.548.356	0,37
20.633	Paychex Inc	2.457.617	0,17
43.686	PayPal Holdings Inc	2.682.774	0,18
65.585	PDD Holdings Inc	9.595.753	0,65
13.803	PepsiCo Inc	2.344.245	0,16
7.536	Pinterest Inc	279.123	0,02
142.350	Poste Italiane SpA	1.615.713	0,11
100.976	Procter & Gamble Co	14.797.034	1,00
870.556	Prosus NV	25.950.399	1,75
101.924	QUALCOMM Inc	14.741.194	0,99
6.144	Regeneron Pharmaceuticals Inc	5.395.816	0,36
61.964	Roche Holding AG (Non-voting rights)	18.000.701	1,21
8.118	Rockwell Automation Inc	2.520.616	0,17
9.897	Royal Caribbean Cruises Ltd	1.281.541	0,09
157.407	RWE AG	7.160.368	0,48
39.686	Salesforce Inc	10.442.955	0,70
40.958	Samsara Inc	1.367.173	0,09
485.543	Sanofi	48.143.239	3,25
5.758	Schindler Holding AG (Voting rights)	1.438.728	0,10
393.826	Securitas AB	3.852.342	0,26
6.669	ServiceNow Inc	4.711.518	0,32
10.502	SGS SA	905.146	0,06
31.970	Siemens AG (Germany listed)	6.000.807	0,40
1.048.976	Societe Generale SA	27.839.009	1,88
71.761	Southern Co	5.031.866	0,34
42.052	Starbucks Corp	4.037.453	0,27
236.254	Stellantis NV (Italy listed)	5.519.693	0,37
37.921	Target Corp	5.400.662	0,36
16.987	TE Connectivity Ltd	2.386.730	0,16
179.813	TeamViewer SE	2.792.740	0,19
23.338	Tesla Inc	5.798.921	0,39
551.356	Teva Pharmaceutical Industries Ltd	5.879.658	0,40
45.617	Texas Instruments Inc	7.775.886	0,52
145.053	thyssenkrupp AG	1.011.392	0,07
1.608.202	TotalEnergies SE	109.432.407	7,38
87.152	Tower Semiconductor Ltd	2.679.255	0,18
31.254	Uber Technologies Inc	1.924.333	0,13
39.200	United Parcel Service Inc	6.163.387	0,42
9.427	United Rentals Inc	5.405.857	0,36

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2023**

CMCI COMPOSITE SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Aktien – 96,69 % (30. Juni 2023: 97,94 %) (Fortsetzung)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
10.189	UnitedHealth Group Inc	5.364.024	0,36
970	VeriSign Inc	199.780	0,01
19.814	Vertex Pharmaceuticals Inc	8.062.073	0,54
63.805	Vinci SA	8.013.808	0,54
44.161	Walgreens Boots Alliance Inc	1.153.050	0,08
105.832	Wartsila OYJ Abp	1.534.414	0,10
5.330	West Pharmaceutical Services Inc	1.876.858	0,13
125.228	Westrock Co	5.199.482	0,35
1.862	Workday Inc	513.917	0,03
2.332	WW Grainger Inc	1.932.590	0,13
6.737	Zoetis Inc	1.329.690	0,09
6.745	Zoom Video Communications Inc	485.055	0,03
Aktien insgesamt		1.434.407.615	96,69

Funded Swaps* – 0,40 % (30. Juni 2023: 0,40 %)

Wäh- rung	Nominalbetrag	Bezeichnung	Fälligkeitstag	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
CHF	14.626	CMCI Composite Index Swap Klasse A CHF**	31. Jul 24	1.261.020	0,09
EUR	13.640	CMCI Composite Index Swap Klasse A EUR**	31. Jul 24	1.139.092	0,08
GBP	425	CMCI Composite Index Swap Klasse A GBP**	31. Jul 24	69.397	0,00
USD	34.845	CMCI Composite Index Swap Klasse A USD	31. Jul 24	3.464.430	0,23
Funded Swaps zum beizulegenden Zeitwert				5.933.939	0,40

Unfunded Swaps* – 2,91 % (30. Juni 2023: 1,65 %)

Wäh- rung	Nominalbetrag	Bezeichnung	Fälligkeitstag	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
CHF	3.642.017	CMCI Composite Net Total Return Index Total Return Swap Klasse A CHF**	31. Jul 24	7.962.796	0,54
EUR	3.396.282	CMCI Composite Net Total Return Index Total Return Swap Klasse A EUR**	31. Jul 24	7.455.096	0,50
GBP	105.929	CMCI Composite Net Total Return Index Total Return Swap Klasse A GBP**	31. Jul 24	516.113	0,04
USD	8.676.355	CMCI Composite Net Total Return Index Total Return Swap Klasse A USD	31. Jul 24	27.209.692	1,83
Unfunded Swaps zum beizulegenden Zeitwert				43.143.697	2,91

Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten (32) (0,00)

Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnendes Nettovermögen **1.483.485.219** **100,00**

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2023**

CMCI COMPOSITE SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Einstufung

* Im Freiverkehr gehandelte derivative Finanzinstrumente.

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

Gegenpartei der Swap-Kontrakte ist die UBS AG.

Analyse des Gesamtvermögens

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

	% des Gesamtver-
	mögens
	91,82
	3,14
	5,04
	<hr/>
	100,00
	<hr/> <hr/>

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2023**

BLOOMBERG COMMODITY INDEX SF UCITS ETF

Aktien – 94,02 % (30. Juni 2023: 94,71 %)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
11.402	Adobe Inc	6.802.695	4,18
58.743	Advanced Micro Devices Inc	8.659.236	5,33
49.556	Alphabet Inc - Class A	6.922.523	4,26
44.386	Amazon.com Inc	6.743.998	4,15
17.807	Cadence Design Systems Inc	4.849.995	2,98
80.896	CVS Health Corp	6.387.563	3,93
96.112	Fortinet Inc	5.625.455	3,46
17.387	Intuitive Surgical Inc	5.865.627	3,61
20.789	Meta Platforms Inc	7.358.649	4,53
24.580	Microsoft Corp	9.242.873	5,68
14.463	Netflix Inc	7.041.872	4,33
61.662	Oracle Corp	6.501.064	4,00
7.361	O'Reilly Automotive Inc	6.993.597	4,30
44.610	PepsiCo Inc	7.576.539	4,66
74.881	Procter & Gamble Co	10.973.002	6,75
8.575	Regeneron Pharmaceuticals Inc	7.531.257	4,63
26.983	Salesforce Inc	7.100.435	4,37
612	Synopsys Inc	315.081	0,19
93.338	Target Corp	13.293.173	8,18
31.089	Texas Instruments Inc	5.299.450	3,26
8.018	UnitedHealth Group Inc	4.221.177	2,60
18.526	Vertex Pharmaceuticals Inc	7.537.981	4,64
Aktien insgesamt		152.843.242	94,02

Funded Swaps* – 0,40 % (30. Juni 2023: 0,50 %)

Wäh- rung	Nominal- betrag	Bezeichnung	Fälligkeitstag	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
CHF	5.659	Bloomberg Commodity Index Swap Klasse A CHF**	31. Jul 24	320.186	0,20
EUR	1.598	Bloomberg Commodity Index Swap Klasse A EUR**	31. Jul 24	87.776	0,05
GBP	142	Bloomberg Commodity Index Swap Klasse A GBP**	31. Jul 24	9.706	0,01
USD	3.703	Bloomberg Commodity Index Swap Klasse A USD	31. Jul 24	232.618	0,14
Funded Swaps zum beizulegenden Zeitwert				650.286	0,40

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2023**

BLOOMBERG COMMODITY INDEX SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Unfunded Swaps* – 5,58 % (30. Juni 2023: 4,80 %)

Wäh- rung	Nominalbetrag	Bezeichnung	Fälligkeitstag	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
CHF	1.409.113	Bloomberg Commodity Net Total Return Index Total Return Swap Klasse A CHF**	31. Jul 24	4.285.416	2,63
EUR	397.825	Bloomberg Commodity Net Total Return Index Total Return Swap Klasse A EUR**	31. Jul 24	1.193.685	0,73
GBP	35.282	Bloomberg Commodity Net Total Return Index Total Return Swap Klasse A GBP**	31. Jul 24	140.300	0,09
USD	922.076	Bloomberg Commodity Net Total Return Index Total Return Swap Klasse A USD	31. Jul 24	3.458.372	2,13
Unfunded Swaps zum beizulegenden Zeitwert				9.077.773	5,58
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten				18	0,00
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnendes Nettovermögen				162.571.319	100,00

Einstufung

* Im Freiverkehr gehandelte derivative Finanzinstrumente.

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

Gegenpartei der Swap-Kontrakte ist die UBS AG.

Analyse des Gesamtvermögens

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

	% des Gesamtver- mögens
Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind	87,23
Im Freiverkehr gehandelte derivative Finanzinstrumente	5,55
Sonstige Vermögenswerte	7,22
	100,00

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2023**

S&P 500 SF UCITS ETF

Aktien – 96,09 % (30. Juni 2023: 96,85 %)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
4.125	3M Co	450.949	0,30
7.248	Achillion Pharmaceuticals Inc	-	0,00
214	adidas AG	43.529	0,03
7.342	Adobe Inc	4.380.443	2,95
28.397	Advanced Micro Devices Inc	4.186.074	2,82
2.833	Air Liquide SA	551.259	0,37
5.224	Alcon Inc	407.414	0,27
21.700	Alphabet Inc - Class A	3.031.270	2,04
19.859	Alphabet Inc - Class C	2.798.686	1,88
52.259	Amazon.com Inc	7.940.273	5,35
1.687	American Water Works Co Inc	222.609	0,15
2.461	Amgen Inc	708.780	0,48
15.278	Amot Investments Ltd	82.651	0,06
169	ANSYS Inc	61.291	0,04
43.979	Apple Inc	8.467.343	5,70
8.524	Applied Materials Inc	1.381.538	0,93
48.088	ArcelorMittal SA	1.363.864	0,92
434	Arista Networks Inc	102.308	0,07
1.884	ASML Holding NV	1.418.827	0,96
46.324	Atlas Copco AB - Class B	686.730	0,46
8.107	AXA SA	264.088	0,18
2.717	Azrieli Group Ltd	176.682	0,12
1.288	Baozun Inc	3.530	0,00
24.325	BASF SE	1.310.765	0,88
390	Bayerische Motoren Werke AG (Voting rights)	43.417	0,03
147.018	Bezeq The Israeli Telecommunication Corp Ltd	201.120	0,14
43.484	BNP Paribas SA	3.006.456	2,02
30	Booking Holdings Inc	107.431	0,07
2.714	Boston Scientific Corp	156.884	0,11
264	Bouygues SA	9.957	0,01
1.959	Broadcom Inc	2.186.710	1,47
112	Cadence Design Systems Inc	30.460	0,02
8.769	Carrefour SA	160.451	0,11
2.556	CF Industries Holdings Inc	203.186	0,14
443	Check Point Software Technologies Ltd	67.726	0,05
26	Chipotle Mexican Grill Inc	59.735	0,04
5.641	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA	202.264	0,14
830	Cintas Corp	500.093	0,34
10.460	Citigroup Inc	538.057	0,36
11.754	Commerzbank AG	139.707	0,09
5.744	Consolidated Edison Inc	522.566	0,35
6.269	Covestro AG	364.796	0,25
15.410	Credit Agricole SA	218.773	0,15
484	Crowdstrike Holdings Inc	123.614	0,08
832	Cummins Inc	199.377	0,13
5.929	CVS Health Corp	468.131	0,31
353	CyberArk Software Ltd	77.241	0,05
8.649	Danone SA	560.646	0,38
11.673	Dell Technologies Inc	892.987	0,60
2.296	Deutsche Boerse AG	472.922	0,32
9.841	Deutsche Post AG	487.599	0,33

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2023**

S&P 500 SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Aktien – 96,09 % (30. Juni 2023: 96,85 %) (Fortsetzung)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
1.927	Dollar Tree Inc	273.769	0,18
867	Dropbox Inc	25.561	0,02
39.334	E.ON SE	527.925	0,36
2.044	eBay Inc	89.176	0,06
2.185	Eli Lilly & Co	1.273.905	0,86
259.891	Enel SpA	1.932.108	1,30
80.721	Eni SpA	1.368.563	0,92
8.914	Enlight Renewable Energy Ltd	173.652	0,12
1.203	Euronext NV	104.540	0,07
7.183	Evonik Industries AG	146.790	0,10
784	EXOR NV	78.336	0,05
856	F5 Inc	153.201	0,10
729	Farfetch Ltd	16	0,00
425	Fortinet Inc	24.878	0,02
416	GEA Group AG	17.311	0,01
1.172	Hilton Worldwide Holdings Inc	213.446	0,14
2.865	Home Depot Inc	992.895	0,67
2.955	HP Inc	88.927	0,06
58	IDEXX Laboratories Inc	32.417	0,02
248	Incyte Corp	15.580	0,01
48.240	Infineon Technologies AG	2.014.317	1,36
24.956	ING Groep NV	372.882	0,25
816	Insulet Corp	176.983	0,12
15.484	Intel Corp	778.063	0,52
3.535	International Business Machines Corp	578.118	0,39
8.684	International Paper Co	313.915	0,21
1.411.155	Intesa Sanpaolo SpA	4.120.773	2,77
458	Intuitive Surgical Inc	154.364	0,10
21.464	Investor AB - Class B	497.321	0,33
303	Israel Corp Ltd	77.369	0,05
13.033	Johnson & Johnson	2.042.862	1,38
48.052	Just Eat Takeaway.com NV	731.551	0,49
6.802	K+S AG	107.529	0,07
2.227	Keysight Technologies Inc	354.326	0,24
937	KLA Corp	544.454	0,37
10.448	Koninklijke Ahold Delhaize NV	300.246	0,20
576	Laboratory Corp of America Holdings	130.938	0,09
585	Lam Research Corp	458.179	0,31
3.475	Liberty Global Ltd - Class A	61.758	0,04
1.274	Lonza Group AG	535.411	0,36
3.586	Marathon Petroleum Corp	531.949	0,36
2.471	Marriott International Inc	557.233	0,37
10.508	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA	130.065	0,09
3.265	Mercedes-Benz Group AG	225.596	0,15
1.132	Merck KGaA	180.149	0,12
9.907	Meta Platforms Inc	3.506.825	2,36
20.165	Microsoft Corp	7.582.704	5,11
261	Moderna Inc	25.976	0,02
2.364	Monster Beverage Corp	136.203	0,09
1.177	MTU Aero Engines AG	253.773	0,17
1.210	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen	501.421	0,34

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2023**

S&P 500 SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Aktien – 96,09 % (30. Juni 2023: 96,85 %) (Fortsetzung)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
6.308	Nestle SA	730.766	0,49
2.553	Netflix Inc	1.242.970	0,84
1.306	New Oriental Education & Technology Group Inc	95.703	0,06
4.907	Nice Ltd	993.562	0,67
8.178	NN Group NV	322.965	0,22
2.080	Nova Ltd	289.995	0,20
7.474	Novartis AG	753.695	0,51
3.380	NVIDIA Corp	1.673.991	1,13
7.836	Oracle Corp	826.141	0,56
438.620	Orange SA	4.992.508	3,36
85	O'Reilly Automotive Inc	80.490	0,05
2.581	Palo Alto Networks Inc	761.076	0,51
1.198	Parker-Hannifin Corp	551.976	0,37
2.053	Paychex Inc	244.495	0,16
4.346	PayPal Holdings Inc	266.895	0,18
6.525	PDD Holdings Inc	954.630	0,64
1.373	PepsiCo Inc	233.216	0,16
750	Pinterest Inc	27.768	0,02
14.162	Poste Italiane SpA	160.739	0,11
10.046	Procter & Gamble Co	1.472.077	0,99
86.607	Prosus NV	2.581.666	1,74
10.140	QUALCOMM Inc	1.466.522	0,99
611	Regeneron Pharmaceuticals Inc	536.800	0,36
6.164	Roche Holding AG (Non-voting rights)	1.790.793	1,21
808	Rockwell Automation Inc	250.763	0,17
985	Royal Caribbean Cruises Ltd	127.494	0,09
15.660	RWE AG	712.346	0,48
3.948	Salesforce Inc	1.038.914	0,70
4.075	Samsara Inc	136.013	0,09
48.304	Sanofi	4.789.512	3,22
573	Schindler Holding AG (Voting rights)	143.131	0,10
39.180	Securitas AB	383.249	0,26
663	ServiceNow Inc	468.724	0,32
1.045	SGS SA	90.048	0,06
3.180	Siemens AG (Germany listed)	596.988	0,40
104.357	Societe Generale SA	2.769.553	1,86
7.139	Southern Co	500.593	0,34
4.184	Starbucks Corp	401.665	0,27
23.504	Stellantis NV (Italy listed)	549.125	0,37
3.772	Target Corp	537.283	0,36
1.690	TE Connectivity Ltd	237.443	0,16
17.889	TeamViewer SE	277.835	0,19
2.322	Tesla Inc	576.903	0,39
54.851	Teva Pharmaceutical Industries Ltd	584.935	0,39
4.538	Texas Instruments Inc	773.581	0,52
14.431	thyssenkrupp AG	100.618	0,07
159.991	TotalEnergies SE	10.886.841	7,33
8.670	Tower Semiconductor Ltd	266.545	0,18
3.109	Uber Technologies Inc	191.441	0,13
3.900	United Parcel Service Inc	613.162	0,41
938	United Rentals Inc	537.800	0,36

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2023**

S&P 500 SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Aktien – 96,09 % (30. Juni 2023: 96,85 %) (Fortsetzung)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventarwerts
1.014	UnitedHealth Group Inc	533.638	0,36
96	VeriSign Inc	19.875	0,01
1.971	Vertex Pharmaceuticals Inc	802.052	0,54
6.348	Vinci SA	797.251	0,54
4.393	Walgreens Boots Alliance Inc	114.711	0,08
10.529	Wartsila OYJ Abp	152.651	0,10
530	West Pharmaceutical Services Inc	186.719	0,13
12.458	Westrock Co	517.268	0,35
185	Workday Inc	51.127	0,03
232	WW Grainger Inc	192.263	0,13
670	Zoetis Inc	132.284	0,09
671	Zoom Video Communications Inc	48.256	0,03
Aktien insgesamt		142.701.497	96,09

Funded Swaps* – 0,40 % (30. Juni 2023: 0,40 %)

Wäh- rung	Nominalbetrag	Bezeichnung	Fälligkeitstag	Zeitwert USD	% des Netto- inventarwerts
USD	6.525	S&P 500 Index Swap Klasse A USD	31. Jul 24	594.058	0,40
Funded Swaps zum beizulegenden Zeitwert				594.058	0,40

Unfunded Swaps* – 3,51 % (30. Juni 2023: 2,74 %)

Wäh- rung	Nominalbetrag	Bezeichnung	Fälligkeitstag	Zeitwert USD	% des Netto- inventarwerts
USD	1.624.707	S&P 500 Net Total Return Index Total Return Swap Klasse A USD	31. Jul 24	5.214.694	3,51
Unfunded Swaps zum beizulegenden Zeitwert				5.214.694	3,51

Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten 4.127 0,00

Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnendes Nettovermögen 148.514.376 100,00

Einstufung

* Im Freiverkehr gehandelte derivative Finanzinstrumente.

Gegenpartei der Swap-Kontrakte ist die UBS AG.

Analyse des Gesamtvermögens

Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind	92,03
Im Freiverkehr gehandelte derivative Finanzinstrumente	3,74
Sonstige Vermögenswerte	4,23
	100,00

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2023**

MSCI USA SF UCITS ETF

Aktien – 96,80 % (30. Juni 2023: 96,73 %)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
13.045	3M Co	1.426.063	0,31
22.921	Achillion Pharmaceuticals Inc	-	0,00
677	adidas AG	137.654	0,03
23.219	Adobe Inc	13.852.537	2,97
89.803	Advanced Micro Devices Inc	13.237.873	2,84
8.961	Air Liquide SA	1.743.279	0,37
16.520	Alcon Inc	1.288.389	0,28
68.623	Alphabet Inc - Class A	9.585.966	2,06
62.800	Alphabet Inc - Class C	8.850.451	1,90
165.263	Amazon.com Inc	25.110.001	5,39
5.334	American Water Works Co Inc	703.971	0,15
7.782	Amgen Inc	2.241.416	0,48
48.315	Amot Investments Ltd	261.373	0,06
534	ANSYS Inc	193.826	0,04
139.079	Apple Inc	26.776.785	5,74
26.957	Applied Materials Inc	4.368.920	0,94
152.071	ArcelorMittal SA	4.313.030	0,93
1.374	Arista Networks Inc	323.534	0,07
5.958	ASML Holding NV	4.486.844	0,96
146.492	Atlas Copco AB - Class B	2.171.689	0,47
25.637	AXA SA	835.141	0,18
8.591	Azrieli Group Ltd	558.732	0,12
4.074	Baozun Inc	11.162	0,00
76.925	BASF SE	4.145.111	0,89
1.233	Bayerische Motoren Werke AG (Voting rights)	137.299	0,03
464.925	Bezeq The Israeli Telecommunication Corp Ltd	636.013	0,14
137.511	BNP Paribas SA	9.507.495	2,04
96	Booking Holdings Inc	339.735	0,07
8.582	Boston Scientific Corp	496.124	0,11
835	Bouygues SA	31.487	0,01
6.195	Broadcom Inc	6.915.165	1,48
354	Cadence Design Systems Inc	96.324	0,02
27.729	Carrefour SA	507.405	0,11
8.082	CF Industries Holdings Inc	642.548	0,14
1.402	Check Point Software Technologies Ltd	214.175	0,05
83	Chipotle Mexican Grill Inc	188.903	0,04
17.838	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA	639.632	0,14
2.624	Cintas Corp	1.581.476	0,34
33.078	Citigroup Inc	1.701.531	0,37
37.170	Commerzbank AG	441.804	0,09
18.166	Consolidated Edison Inc	1.652.542	0,35
19.824	Covestro AG	1.153.617	0,25
48.731	Credit Agricole SA	691.839	0,15
1.531	Crowdstrike Holdings Inc	390.914	0,08
2.632	Cummins Inc	630.500	0,14
18.749	CVS Health Corp	1.480.398	0,32
1.115	CyberArk Software Ltd	244.262	0,05
27.352	Danone SA	1.772.966	0,38
36.914	Dell Technologies Inc	2.823.947	0,61
7.259	Deutsche Boerse AG	1.495.549	0,32
31.120	Deutsche Post AG	1.541.965	0,33

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2023**

MSCI USA SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Aktien – 96,80 % (30. Juni 2023: 96,73 %) (Fortsetzung)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
6.095	Dollar Tree Inc	865.755	0,19
2.742	Dropbox Inc	80.833	0,02
124.389	E.ON SE	1.669.490	0,36
6.465	eBay Inc	282.006	0,06
6.911	Eli Lilly & Co	4.028.544	0,86
821.870	Enel SpA	6.110.021	1,31
255.270	Eni SpA	4.327.889	0,93
28.189	Enlight Renewable Energy Ltd	549.149	0,12
3.805	Euronext NV	330.593	0,07
22.715	Evonik Industries AG	464.204	0,10
2.478	EXOR NV	247.728	0,05
2.707	F5 Inc	484.478	0,10
2.305	Farfetch Ltd	51	0,00
1.344	Fortinet Inc	78.673	0,02
1.315	GEA Group AG	54.744	0,01
3.707	Hilton Worldwide Holdings Inc	674.993	0,14
9.060	Home Depot Inc	3.139.892	0,67
9.346	HP Inc	281.218	0,06
185	IDEXX Laboratories Inc	102.514	0,02
785	Incyte Corp	49.271	0,01
152.554	Infineon Technologies AG	6.369.994	1,37
78.920	ING Groep NV	1.179.187	0,25
2.579	Insulet Corp	559.685	0,12
48.965	Intel Corp	2.460.517	0,53
11.178	International Business Machines Corp	1.828.217	0,39
27.461	International Paper Co	992.711	0,21
4.462.579	Intesa Sanpaolo SpA	13.031.367	2,80
1.447	Intuitive Surgical Inc	488.155	0,10
67.878	Investor AB - Class B	1.572.709	0,34
958	Israel Corp Ltd	244.670	0,05
41.216	Johnson & Johnson	6.460.263	1,39
151.956	Just Eat Takeaway.com NV	2.313.427	0,50
21.512	K+S AG	340.046	0,07
7.043	Keysight Technologies Inc	1.120.505	0,24
2.962	KLA Corp	1.721.759	0,37
33.040	Koninklijke Ahold Delhaize NV	949.486	0,20
1.822	Laboratory Corp of America Holdings	414.073	0,09
1.850	Lam Research Corp	1.448.927	0,31
10.990	Liberty Global Ltd - Class A	195.301	0,04
4.029	Lonza Group AG	1.693.162	0,36
11.339	Marathon Petroleum Corp	1.682.216	0,36
7.814	Marriott International Inc	1.762.172	0,38
33.230	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA	411.312	0,09
10.325	Mercedes-Benz Group AG	713.414	0,15
3.579	Merck KGaA	569.695	0,12
31.331	Meta Platforms Inc	11.089.844	2,38
63.768	Microsoft Corp	23.979.239	5,14
826	Moderna Inc	82.146	0,02
7.477	Monster Beverage Corp	430.723	0,09
3.721	MTU Aero Engines AG	802.522	0,17
3.827	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen	1.585.674	0,34

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2023**

MSCI USA SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Aktien – 96,80 % (30. Juni 2023: 96,73 %) (Fortsetzung)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
19.947	Nestle SA	2.310.944	0,50
8.073	Netflix Inc	3.930.718	0,84
4.130	New Oriental Education & Technology Group Inc	302.646	0,07
15.518	Nice Ltd	3.142.001	0,67
25.862	NN Group NV	1.021.333	0,22
6.578	Nova Ltd	917.067	0,20
23.637	Novartis AG	2.383.455	0,51
10.690	NVIDIA Corp	5.293.761	1,14
24.780	Oracle Corp	2.612.554	0,56
1.387.073	Orange SA	15.788.106	3,39
268	O'Reilly Automotive Inc	254.539	0,05
8.162	Palo Alto Networks Inc	2.406.796	0,52
3.789	Parker-Hannifin Corp	1.745.547	0,37
6.491	Paychex Inc	773.182	0,17
13.744	PayPal Holdings Inc	844.017	0,18
20.633	PDD Holdings Inc	3.018.883	0,65
4.342	PepsiCo Inc	737.514	0,16
2.371	Pinterest Inc	87.814	0,02
44.784	Poste Italiane SpA	508.313	0,11
31.768	Procter & Gamble Co	4.655.238	1,00
273.882	Prosus NV	8.164.156	1,75
32.066	QUALCOMM Inc	4.637.671	0,99
1.933	Regeneron Pharmaceuticals Inc	1.697.557	0,36
19.494	Roche Holding AG (Non-voting rights)	5.663.132	1,21
2.554	Rockwell Automation Inc	793.002	0,17
3.114	Royal Caribbean Cruises Ltd	403.181	0,09
49.521	RWE AG	2.252.696	0,48
12.485	Salesforce Inc	3.285.418	0,70
12.886	Samsara Inc	430.121	0,09
152.755	Sanofi	15.146.160	3,25
1.811	Schindler Holding AG (Voting rights)	452.633	0,10
123.900	Securitas AB	1.211.970	0,26
2.098	ServiceNow Inc	1.482.273	0,32
3.304	SGS SA	284.764	0,06
10.058	Siemens AG (Germany listed)	1.887.891	0,41
330.014	Societe Generale SA	8.758.324	1,88
22.576	Southern Co	1.583.056	0,34
13.230	Starbucks Corp	1.270.208	0,27
74.327	Stellantis NV (Italy listed)	1.736.530	0,37
11.930	Target Corp	1.699.082	0,36
5.344	TE Connectivity Ltd	750.880	0,16
56.570	TeamViewer SE	878.613	0,19
7.342	Tesla Inc	1.824.376	0,39
173.460	Teva Pharmaceutical Industries Ltd	1.849.777	0,40
14.351	Texas Instruments Inc	2.446.342	0,52
45.635	thyssenkrupp AG	318.190	0,07
505.950	TotalEnergies SE	34.428.110	7,39
27.419	Tower Semiconductor Ltd	842.910	0,18
9.833	Uber Technologies Inc	605.407	0,13
12.333	United Parcel Service Inc	1.939.040	0,42
2.966	United Rentals Inc	1.700.716	0,36

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2023**

MSCI USA SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Aktien – 96,80 % (30. Juni 2023: 96,73 %) (Fortsetzung)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventarwerts
3.205	UnitedHealth Group Inc	1.687.555	0,36
305	VeriSign Inc	62.852	0,01
6.234	Vertex Pharmaceuticals Inc	2.536.378	0,54
20.073	Vinci SA	2.521.193	0,54
13.893	Walgreens Boots Alliance Inc	362.757	0,08
33.296	Wartsila OYJ Abp	482.736	0,10
1.677	West Pharmaceutical Services Inc	590.471	0,13
39.398	Westrock Co	1.635.789	0,35
586	Workday Inc	161.681	0,03
734	WW Grainger Inc	608.005	0,13
2.120	Zoetis Inc	418.329	0,09
2.122	Zoom Video Communications Inc	152.601	0,03
Aktien insgesamt		451.273.487	96,80

Funded Swaps* – 0,40 % (30. Juni 2023: 0,40 %)

Wäh- rung	Nominalbetrag	Bezeichnung	Fälligkeitstag	Zeitwert USD	% des Netto- inventarwerts
USD	13.821	MSCI USA Total Return Index Swap Klasse A USD	31. Jul 24	1.877.739	0,40
Funded Swaps zum beizulegenden Zeitwert				1.877.739	0,40

Unfunded Swaps* – 3,50 % (30. Juni 2023: 2,68 %)

Wäh- rung	Nominalbetrag	Bezeichnung	Fälligkeitstag	Zeitwert USD	% des Netto- inventarwerts
USD	3.441.456	MSCI USA Total Return Index Total Return Swap Klasse A USD	31. Jul 24	16.283.398	3,50
Unfunded Swaps zum beizulegenden Zeitwert				16.283.398	3,50

Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten (3.260.645) (0,70)

Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnendes Nettovermögen 466.173.979 100,00

Einstufung

* Im Freiverkehr gehandelte derivative Finanzinstrumente.

Gegenpartei der Swap-Kontrakte ist die UBS AG.

	% des Gesamtver- mögens
Analyse des Gesamtvermögens	
Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind	92,39
Im Freiverkehr gehandelte derivative Finanzinstrumente	3,72
Sonstige Vermögenswerte	3,89
	100,00

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2023**

MSCI EMERGING MARKETS SF UCITS ETF

Aktien – 91,31 % (30. Juni 2023: 95,53 %)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
6.729	Adobe Inc	4.014.306	4,06
34.664	Advanced Micro Devices Inc	5.109.860	5,17
29.244	Alphabet Inc - Class A	4.085.017	4,14
26.192	Amazon.com Inc	3.979.668	4,03
10.508	Cadence Design Systems Inc	2.862.008	2,90
47.737	CVS Health Corp	3.769.334	3,82
56.716	Fortinet Inc	3.319.610	3,36
10.260	Intuitive Surgical Inc	3.461.337	3,50
12.268	Meta Platforms Inc	4.342.377	4,40
14.505	Microsoft Corp	5.454.267	5,52
8.535	Netflix Inc	4.155.445	4,21
36.387	Oracle Corp	3.836.312	3,88
4.344	O'Reilly Automotive Inc	4.126.957	4,18
26.325	PepsiCo Inc	4.470.955	4,53
44.187	Procter & Gamble Co	6.475.226	6,55
5.060	Regeneron Pharmaceuticals Inc	4.444.233	4,50
15.923	Salesforce Inc	4.190.003	4,24
361	Synopsys Inc	185.931	0,19
55.079	Target Corp	7.844.370	7,94
18.346	Texas Instruments Inc	3.127.233	3,17
4.731	UnitedHealth Group Inc	2.490.938	2,52
10.932	Vertex Pharmaceuticals Inc	4.448.202	4,50
Aktien insgesamt		90.193.589	91,31

Funded Swaps* – 0,40 % (30. Juni 2023: 0,50 %)

Wäh- rung	Nominalbetrag	Bezeichnung	Fälligkeitstag	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
USD	7.991	MSCI Emerging Markets Total Return Net Index Swap Klasse A USD	31. Jul 24	395.118	0,40
Funded Swaps zum beizulegenden Zeitwert				395.118	0,40

Unfunded Swaps* – 8,29 % (30. Juni 2023: 3,98 %)

Wäh- rung	Nominalbetrag	Bezeichnung	Fälligkeitstag	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
USD	1.989.711	MSCI Emerging Markets Total Return Net Index Total Return Swap Klasse A USD	31. Jul 24	8.190.355	8,29
Unfunded Swaps zum beizulegenden Zeitwert				8.190.355	8,29

Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten 510 0,00

Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnendes Nettovermögen 98.779.572 100,00

Einstufung

* Im Freiverkehr gehandelte derivative Finanzinstrumente.

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2023**

MSCI EMERGING MARKETS SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Gegenpartei der Swap-Kontrakte ist die UBS AG.

	% des Gesamtver-
	mögens
Analyse des Gesamtvermögens	
Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind	87,09
Im Freiverkehr gehandelte derivative Finanzinstrumente	8,29
Sonstige Vermögenswerte	4,62
	<hr/>
	100,00
	<hr/>

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2023**

MSCI AC ASIA EX JAPAN SF UCITS ETF

Aktien – 93,26 % (30. Juni 2023: 98,43 %)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
5.855	3M Co	640.082	0,29
10.288	Achillion Pharmaceuticals Inc	-	0,00
304	adidas AG	61.785	0,03
10.422	Adobe Inc	6.217.653	2,86
40.308	Advanced Micro Devices Inc	5.941.764	2,74
4.022	Air Liquide SA	782.464	0,36
7.415	Alcon Inc	578.288	0,27
30.801	Alphabet Inc - Class A	4.302.621	1,98
28.188	Alphabet Inc - Class C	3.972.488	1,83
74.177	Amazon.com Inc	11.270.519	5,19
2.394	American Water Works Co Inc	315.975	0,15
3.493	Amgen Inc	1.006.050	0,46
21.686	Amot Investments Ltd	117.316	0,05
240	ANSYS Inc	86.998	0,04
62.425	Apple Inc	12.018.648	5,53
12.099	Applied Materials Inc	1.960.971	0,90
68.257	ArcelorMittal SA	1.935.886	0,89
617	Arista Networks Inc	145.217	0,07
2.674	ASML Holding NV	2.013.901	0,93
65.752	Atlas Copco AB - Class B	974.754	0,45
11.507	AXA SA	374.850	0,17
3.856	Azrieli Group Ltd	250.785	0,12
1.829	Baozun Inc	5.010	0,00
34.528	BASF SE	1.860.516	0,86
554	Bayerische Motoren Werke AG (Voting rights)	61.626	0,03
208.680	Bezeq The Israeli Telecommunication Corp Ltd	285.472	0,13
61.721	BNP Paribas SA	4.267.399	1,96
43	Booking Holdings Inc	152.488	0,07
3.852	Boston Scientific Corp	222.683	0,10
375	Bouygues SA	14.133	0,01
2.781	Broadcom Inc	3.103.843	1,43
159	Cadence Design Systems Inc	43.235	0,02
12.446	Carrefour SA	227.747	0,10
3.628	CF Industries Holdings Inc	288.405	0,13
629	Check Point Software Technologies Ltd	96.132	0,04
37	Chipotle Mexican Grill Inc	84.789	0,04
8.007	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA	287.096	0,13
1.178	Cintas Corp	709.839	0,33
14.847	Citigroup Inc	763.725	0,35
16.684	Commerzbank AG	198.302	0,09
8.154	Consolidated Edison Inc	741.737	0,34
8.898	Covestro AG	517.796	0,24
21.873	Credit Agricole SA	310.529	0,14
687	Crowdstrike Holdings Inc	175.460	0,08
1.181	Cummins Inc	282.997	0,13
8.415	CVS Health Corp	664.470	0,31
500	CyberArk Software Ltd	109.636	0,05
12.277	Danone SA	795.788	0,37
16.569	Dell Technologies Inc	1.267.517	0,58
3.258	Deutsche Boerse AG	671.271	0,31
13.968	Deutsche Post AG	692.104	0,32

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2023**

MSCI AC ASIA EX JAPAN SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Aktien – 93,26 % (30. Juni 2023: 98,43 %) (Fortsetzung)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
2.736	Dollar Tree Inc	388.591	0,18
1.231	Dropbox Inc	36.281	0,02
55.832	E.ON SE	749.344	0,34
2.902	eBay Inc	126.577	0,06
3.102	Eli Lilly & Co	1.808.195	0,83
368.893	Enel SpA	2.742.457	1,26
114.577	Eni SpA	1.942.555	0,89
12.652	Enlight Renewable Energy Ltd	246.483	0,11
1.708	Euronext NV	148.385	0,07
10.195	Evonik Industries AG	208.356	0,10
1.112	EXOR NV	111.191	0,05
1.215	F5 Inc	217.456	0,10
1.035	Farfetch Ltd	23	0,00
603	Fortinet Inc	35.312	0,02
590	GEA Group AG	24.571	0,01
1.664	Hilton Worldwide Holdings Inc	302.968	0,14
4.067	Home Depot Inc	1.409.327	0,65
4.195	HP Inc	126.224	0,06
83	IDEXX Laboratories Inc	46.013	0,02
352	Incyte Corp	22.115	0,01
68.473	Infineon Technologies AG	2.859.145	1,32
35.423	ING Groep NV	529.273	0,24
1.158	Insulet Corp	251.212	0,12
21.978	Intel Corp	1.104.393	0,51
5.017	International Business Machines Corp	820.587	0,38
12.326	International Paper Co	445.574	0,21
2.003.010	Intesa Sanpaolo SpA	5.849.074	2,69
649	Intuitive Surgical Inc	219.107	0,10
30.467	Investor AB - Class B	705.904	0,32
430	Israel Corp Ltd	109.819	0,05
18.500	Johnson & Johnson	2.899.662	1,34
68.205	Just Eat Takeaway.com NV	1.038.372	0,48
9.655	K+S AG	152.628	0,07
3.161	Keysight Technologies Inc	502.934	0,23
1.329	KLA Corp	772.804	0,36
14.830	Koninklijke Ahold Delhaize NV	426.173	0,20
818	Laboratory Corp of America Holdings	185.855	0,09
830	Lam Research Corp	650.345	0,30
4.933	Liberty Global Ltd - Class A	87.660	0,04
1.808	Lonza Group AG	759.969	0,35
5.089	Marathon Petroleum Corp	755.056	0,35
3.507	Marriott International Inc	790.943	0,36
14.915	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA	184.616	0,08
4.634	Mercedes-Benz Group AG	320.213	0,15
1.606	Merck KGaA	255.705	0,12
14.063	Meta Platforms Inc	4.977.630	2,29
28.622	Microsoft Corp	10.762.981	4,96
371	Moderna Inc	36.871	0,02
3.356	Monster Beverage Corp	193.328	0,09
1.670	MTU Aero Engines AG	360.208	0,17
1.718	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen	711.723	0,33

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2023**

MSCI AC ASIA EX JAPAN SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Aktien – 93,26 % (30. Juni 2023: 98,43 %) (Fortsetzung)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
8.953	Nestle SA	1.037.258	0,48
3.624	Netflix Inc	1.764.286	0,81
1.854	New Oriental Education & Technology Group Inc	135.841	0,06
6.965	Nice Ltd	1.410.274	0,65
11.608	NN Group NV	458.421	0,21
2.953	Nova Ltd	411.622	0,19
10.609	Novartis AG	1.069.804	0,49
4.798	NVIDIA Corp	2.376.082	1,09
11.122	Oracle Corp	1.172.634	0,54
622.582	Orange SA	7.086.425	3,26
120	O'Reilly Automotive Inc	114.249	0,05
3.663	Palo Alto Networks Inc	1.080.280	0,50
1.701	Parker-Hannifin Corp	783.481	0,36
2.914	Paychex Inc	347.039	0,16
6.169	PayPal Holdings Inc	378.834	0,17
9.261	PDD Holdings Inc	1.355.013	0,62
1.949	PepsiCo Inc	331.030	0,15
1.064	Pinterest Inc	39.415	0,02
20.101	Poste Italiane SpA	228.154	0,11
14.259	Procter & Gamble Co	2.089.484	0,96
122.931	Prosus NV	3.664.447	1,69
14.393	QUALCOMM Inc	2.081.599	0,96
867	Regeneron Pharmaceuticals Inc	761.941	0,35
8.750	Roche Holding AG (Non-voting rights)	2.541.873	1,17
1.146	Rockwell Automation Inc	355.936	0,16
1.397	Royal Caribbean Cruises Ltd	180.966	0,08
22.227	RWE AG	1.011.113	0,47
5.604	Salesforce Inc	1.474.646	0,68
5.784	Samsara Inc	193.058	0,09
68.563	Sanofi	6.798.290	3,13
813	Schindler Holding AG (Voting rights)	203.162	0,09
55.612	Securitas AB	543.988	0,25
942	ServiceNow Inc	665.312	0,31
1.483	SGS SA	127.815	0,06
4.514	Siemens AG (Germany listed)	847.372	0,39
148.126	Societe Generale SA	3.931.137	1,81
10.133	Southern Co	710.548	0,33
5.938	Starbucks Corp	570.127	0,26
33.361	Stellantis NV (Italy listed)	779.434	0,36
5.355	Target Corp	762.626	0,35
2.399	TE Connectivity Ltd	337.029	0,16
25.391	TeamViewer SE	394.362	0,18
3.295	Tesla Inc	818.864	0,38
77.857	Teva Pharmaceutical Industries Ltd	830.264	0,38
6.442	Texas Instruments Inc	1.098.030	0,51
20.483	thyssenkrupp AG	142.818	0,07
227.094	TotalEnergies SE	15.452.913	7,11
12.307	Tower Semiconductor Ltd	378.337	0,17
4.413	Uber Technologies Inc	271.734	0,13
5.535	United Parcel Service Inc	870.330	0,40
1.331	United Rentals Inc	763.359	0,35

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2023**

MSCI AC ASIA EX JAPAN SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Aktien – 93,26 % (30. Juni 2023: 98,43 %) (Fortsetzung)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventarwerts
1.439	UnitedHealth Group Inc	757.452	0,35
137	VeriSign Inc	28.211	0,01
2.798	Vertex Pharmaceuticals Inc	1.138.442	0,52
9.010	Vinci SA	1.131.627	0,52
6.236	Walgreens Boots Alliance Inc	162.822	0,07
14.945	Wartsila OYJ Abp	216.674	0,10
753	West Pharmaceutical Services Inc	265.031	0,12
17.683	Westrock Co	734.217	0,34
263	Workday Inc	72.570	0,03
329	WW Grainger Inc	272.901	0,13
951	Zoetis Inc	187.765	0,09
952	Zoom Video Communications Inc	68.494	0,03
Aktien insgesamt		202.552.210	93,26

Funded Swaps* – 0,40 % (30. Juni 2023: 0,40 %)

Wäh- rung	Nominalbetrag	Bezeichnung	Fälligkeitstag	Zeitwert USD	% des Netto- inventarwerts
USD	5.636	MSCI AC Asia Ex Japan Total Return Net Index Total Return Swap Klasse A USD	31. Jul 24	868.785	0,40
Funded Swaps zum beizulegenden Zeitwert				868.785	0,40

Unfunded Swaps* – 6,34 % (30. Juni 2023: 1,16 %)

Wäh- rung	Nominalbetrag	Bezeichnung	Fälligkeitstag	Zeitwert USD	% des Netto- inventarwerts
USD	1.403.400	MSCI AC Asia Ex Japan Total Return Net Index Total Return Swap Klasse A USD	31. Jul 24	13.775.000	6,34
Unfunded Swaps zum beizulegenden Zeitwert				13.775.000	6,34

Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten

Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnendes Nettovermögen **217.195.995** **100,00**

Einstufung

* Im Freiverkehr gehandelte derivative Finanzinstrumente.

Gegenpartei der Swap-Kontrakte ist die UBS AG.

	% des Gesamtver- mögens
Analyse des Gesamtvermögens	
Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind	89,83
Im Freiverkehr gehandelte derivative Finanzinstrumente	6,50
Sonstige Vermögenswerte	3,67
	100,00

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2023**

MSCI ACWI SF UCITS ETF

Aktien – 96,04 % (30. Juni 2023: 97,85 %)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
171.888	3M Co	18.790.845	0,30
302.030	Achillion Pharmaceuticals Inc	-	0,00
8.916	adidas AG	1.813.834	0,03
305.952	Adobe Inc	182.531.180	2,95
1.183.311	Advanced Micro Devices Inc	174.431.914	2,82
118.070	Air Liquide SA	22.970.724	0,37
217.680	Alcon Inc	16.976.752	0,27
904.229	Alphabet Inc - Class A	126.311.710	2,04
827.503	Alphabet Inc - Class C	116.620.029	1,88
2.177.621	Amazon.com Inc	330.867.767	5,34
70.278	American Water Works Co Inc	9.276.043	0,15
102.543	Amgen Inc	29.534.543	0,48
636.635	Amot Investments Ltd	3.444.040	0,06
7.038	ANSYS Inc	2.553.994	0,04
1.832.600	Apple Inc	352.830.530	5,70
355.205	Applied Materials Inc	57.568.086	0,93
2.003.803	ArcelorMittal SA	56.831.646	0,92
18.102	Arista Networks Inc	4.263.128	0,07
78.511	ASML Holding NV	59.121.933	0,95
1.930.290	Atlas Copco AB - Class B	28.615.766	0,46
337.806	AXA SA	11.004.429	0,18
113.197	Azrieli Group Ltd	7.362.263	0,12
53.680	Baozun Inc	147.084	0,00
1.013.625	BASF SE	54.619.025	0,88
16.251	Bayerische Motoren Werke AG (Voting rights)	1.809.154	0,03
6.126.193	Bezeq The Israeli Telecommunication Corp Ltd	8.380.578	0,14
1.811.941	BNP Paribas SA	125.277.723	2,02
1.262	Booking Holdings Inc	4.476.581	0,07
113.082	Boston Scientific Corp	6.537.289	0,11
11.008	Bouygues SA	414.901	0,01
81.630	Broadcom Inc	91.119.283	1,47
4.660	Cadence Design Systems Inc	1.269.237	0,02
365.382	Carrefour SA	6.685.946	0,11
106.499	CF Industries Holdings Inc	8.466.683	0,14
18.471	Check Point Software Technologies Ltd	2.822.131	0,05
1.088	Chipotle Mexican Grill Inc	2.489.120	0,04
235.053	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA	8.428.265	0,14
34.578	Cintas Corp	20.838.686	0,34
435.860	Citigroup Inc	22.420.622	0,36
489.779	Commerzbank AG	5.821.529	0,09
239.366	Consolidated Edison Inc	21.775.110	0,35
261.215	Covestro AG	15.200.900	0,25
642.122	Credit Agricole SA	9.116.181	0,15
20.175	Crowdstrike Holdings Inc	5.150.963	0,08
34.679	Cummins Inc	8.307.934	0,13
247.047	CVS Health Corp	19.506.804	0,31
14.693	CyberArk Software Ltd	3.218.582	0,05
360.407	Danone SA	23.361.900	0,38
486.410	Dell Technologies Inc	37.210.389	0,60
95.654	Deutsche Boerse AG	19.706.449	0,32
410.059	Deutsche Post AG	20.318.058	0,33

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2023**

MSCI ACWI SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Aktien – 96,04 % (30. Juni 2023: 97,85 %) (Fortsetzung)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
80.309	Dollar Tree Inc	11.407.822	0,18
36.130	Dropbox Inc	1.065.110	0,02
1.639.044	E.ON SE	21.998.428	0,36
85.188	eBay Inc	3.715.915	0,06
91.064	Eli Lilly & Co	53.083.055	0,86
10.829.556	Enel SpA	80.510.116	1,30
2	Engie SA	29	0,00
3.363.623	Eni SpA	57.027.437	0,92
371.434	Enlight Renewable Energy Ltd	7.235.988	0,12
50.139	Euronext NV	4.356.131	0,07
299.309	Evonik Industries AG	6.116.694	0,10
32.652	EXOR NV	3.264.240	0,05
35.668	F5 Inc	6.383.837	0,10
30.374	Farfetch Ltd	677	0,00
17.712	Fortinet Inc	1.036.654	0,02
17.326	GEA Group AG	721.341	0,01
48.845	Hilton Worldwide Holdings Inc	8.894.205	0,14
119.387	Home Depot Inc	41.373.521	0,67
123.148	HP Inc	3.705.535	0,06
2.434	IDEXX Laboratories Inc	1.350.801	0,02
10.340	Incyte Corp	649.235	0,01
2.010.158	Infineon Technologies AG	83.935.713	1,36
1.039.912	ING Groep NV	15.537.837	0,25
33.988	Insulet Corp	7.374.820	0,12
645.205	Intel Corp	32.421.568	0,52
147.294	International Business Machines Corp	24.089.922	0,39
361.845	International Paper Co	13.080.691	0,21
58.802.208	Intesa Sanpaolo SpA	171.710.834	2,77
19.067	Intuitive Surgical Inc	6.432.291	0,10
894.411	Investor AB - Class B	20.723.163	0,33
12.620	Israel Corp Ltd	3.223.947	0,05
543.098	Johnson & Johnson	85.125.159	1,37
2.002.288	Just Eat Takeaway.com NV	30.483.409	0,49
283.453	K+S AG	4.480.696	0,07
92.807	Keysight Technologies Inc	14.764.597	0,24
39.028	KLA Corp	22.687.153	0,37
435.359	Koninklijke Ahold Delhaize NV	12.511.118	0,20
24.005	Laboratory Corp of America Holdings	5.456.131	0,09
24.375	Lam Research Corp	19.092.126	0,31
144.819	Liberty Global Ltd - Class A	2.573.432	0,04
53.089	Lonza Group AG	22.310.339	0,36
149.408	Marathon Petroleum Corp	22.166.111	0,36
102.965	Marriott International Inc	23.219.666	0,37
437.868	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA	5.419.754	0,09
136.050	Mercedes-Benz Group AG	9.400.471	0,15
47.159	Merck KGaA	7.506.715	0,12
412.837	Meta Platforms Inc	146.127.911	2,36
840.251	Microsoft Corp	315.968.015	5,10
10.884	Moderna Inc	1.082.411	0,02
98.516	Monster Beverage Corp	5.675.524	0,09
49.029	MTU Aero Engines AG	10.574.611	0,17

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2023**

MSCI ACWI SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Aktien – 96,04 % (30. Juni 2023: 97,85 %) (Fortsetzung)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
50.425	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen	20.894.004	0,34
262.833	Nestle SA	30.450.690	0,49
106.379	Netflix Inc	51.794.018	0,84
54.420	New Oriental Education & Technology Group Inc	3.987.889	0,06
204.474	Nice Ltd	41.401.311	0,67
340.780	NN Group NV	13.457.825	0,22
86.679	Nova Ltd	12.083.945	0,19
311.453	Novartis AG	31.406.143	0,51
140.856	NVIDIA Corp	69.754.468	1,13
326.519	Oracle Corp	34.424.927	0,56
18.277.094	Orange SA	208.035.647	3,36
3.530	O'Reilly Automotive Inc	3.353.990	0,05
107.548	Palo Alto Networks Inc	31.713.703	0,51
49.925	Parker-Hannifin Corp	23.000.604	0,37
85.534	Paychex Inc	10.188.008	0,16
181.101	PayPal Holdings Inc	11.121.391	0,18
271.882	PDD Holdings Inc	39.779.013	0,64
57.219	PepsiCo Inc	9.718.022	0,16
31.239	Pinterest Inc	1.157.099	0,02
590.110	Poste Italiane SpA	6.697.909	0,11
418.594	Procter & Gamble Co	61.340.829	0,99
3.608.875	Prosus NV	107.576.893	1,74
422.522	QUALCOMM Inc	61.109.345	0,99
25.468	Regeneron Pharmaceuticals Inc	22.368.253	0,36
256.872	Roche Holding AG (Non-voting rights)	74.621.570	1,21
33.655	Rockwell Automation Inc	10.449.169	0,17
41.027	Royal Caribbean Cruises Ltd	5.312.605	0,09
652.528	RWE AG	29.683.171	0,48
164.517	Salesforce Inc	43.291.076	0,70
169.790	Samsara Inc	5.667.591	0,09
2.012.810	Sanofi	199.576.900	3,22
23.870	Schindler Holding AG (Voting rights)	5.964.221	0,10
1.632.596	Securitas AB	15.969.810	0,26
27.646	ServiceNow Inc	19.531.511	0,32
43.536	SGS SA	3.752.266	0,06
132.530	Siemens AG (Germany listed)	24.876.233	0,40
4.348.511	Societe Generale SA	115.406.094	1,86
297.483	Southern Co	20.859.508	0,34
174.328	Starbucks Corp	16.737.188	0,27
979.388	Stellantis NV (Italy listed)	22.881.785	0,37
157.199	Target Corp	22.388.344	0,36
70.421	TE Connectivity Ltd	9.894.144	0,16
745.410	TeamViewer SE	11.577.251	0,19
96.745	Tesla Inc	24.039.317	0,39
2.285.635	Teva Pharmaceutical Industries Ltd	24.374.012	0,39
189.105	Texas Instruments Inc	32.234.791	0,52
601.316	thyssenkrupp AG	4.192.705	0,07
6.666.770	TotalEnergies SE	453.650.002	7,33
361.287	Tower Semiconductor Ltd	11.106.800	0,18
129.564	Uber Technologies Inc	7.977.285	0,13
162.502	United Parcel Service Inc	25.550.206	0,41

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2023**

MSCI ACWI SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Aktien – 96,04 % (30. Juni 2023: 97,85 %) (Fortsetzung)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
39.081	United Rentals Inc	22.409.880	0,36
42.237	UnitedHealth Group Inc	22.236.461	0,36
4.021	VeriSign Inc	828.183	0,01
82.138	Vertex Pharmaceuticals Inc	33.421.171	0,54
264.502	Vinci SA	33.221.091	0,54
183.070	Walgreens Boots Alliance Inc	4.779.946	0,08
438.726	Wartsila OYJ Abp	6.360.883	0,10
22.096	West Pharmaceutical Services Inc	7.780.480	0,13
519.132	Westrock Co	21.554.356	0,35
7.717	Workday Inc	2.130.433	0,03
9.668	WW Grainger Inc	8.011.519	0,13
27.928	Zoetis Inc	5.512.205	0,09
27.963	Zoom Video Communications Inc	2.010.788	0,03
Aktien insgesamt		5.946.310.046	96,04

Funded Swaps* – 0,40 % (30. Juni 2023: 0,40 %)

Wäh- rung	Nominalbetrag	Bezeichnung	Fälligkeitstag	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
CHF	807	MSCI ACWI Total Return Net Index Swap Klasse A (dist) CHF**	31. Jul 24	138.657	0,00
CHF	23.107	MSCI ACWI Total Return Net Index Swap Klasse A CHF**	31. Jul 24	4.586.134	0,07
EUR	626	MSCI ACWI Total Return Net Index Swap Klasse A (dist) EUR**	31. Jul 24	116.539	0,00
EUR	29.672	MSCI ACWI Total Return Net Index Swap Klasse A EUR**	31. Jul 24	5.857.878	0,10
GBP	2.481	MSCI ACWI Total Return Net Index Swap Klasse A (dist) GBP**	31. Jul 24	577.664	0,01
JPY	42.049	MSCI ACWI Total Return Net Index Swap Klasse A JPY**	31. Jul 24	558.612	0,01
SGD	60	MSCI ACWI Total Return Net Index Swap Klasse A SGD**	31. Jul 24	6.473	0,00
USD	667	MSCI ACWI Total Return Net Index Swap Klasse A (dist) USD	31. Jul 24	132.160	0,00
USD	6.429	MSCI ACWI Total Return Net Index Swap Klasse A (dist) USD	31. Jul 24	884.883	0,02
USD	32.473	MSCI ACWI Total Return Net Index Swap Klasse A USD	31. Jul 24	6.804.635	0,11
USD	31.457	MSCI ACWI Total Return Net Index Swap Klasse A USD	31. Jul 24	5.102.484	0,08
Funded Swaps zum beizulegenden Zeitwert				24.766.119	0,40

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2023**

MSCI ACWI SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Unfunded Swaps* – 3,56 % (30. Juni 2023: 1,74 %)

Wäh- rung	Nominalbetrag	Bezeichnung	Fälligkeitstag	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
CHF	5.753.684	MSCI ACWI Total Return Net Index Total Return Swap Klasse A CHF**	31. Jul 24	37.469.974	0,61
CHF	200.976	MSCI ACWI Total Return Net Index Total Return Swap Klasse A CHF**	31. Jul 24	1.132.868	0,02
EUR	155.995	MSCI ACWI Total Return Net Index Total Return Swap Klasse A (dist) EUR**	31. Jul 24	976.188	0,02
EUR	7.388.384	MSCI ACWI Total Return Net Index Total Return Swap Klasse A EUR**	31. Jul 24	49.068.886	0,79
GBP	617.664	MSCI ACWI Total Return Net Index Total Return Swap Klasse A GBP**	31. Jul 24	5.271.861	0,09
JPY	10.470.177	MSCI ACWI Total Return Net Index Total Return Swap Klasse A JPY**	31. Jul 24	5.214.870	0,08
SGD	14.940	MSCI ACWI Total Return Net Index Total Return Swap Klasse A SGD**	31. Jul 24	58.741	0,00
USD	8.085.899	MSCI ACWI Total Return Net Index Total Return Swap Klasse A USD	31. Jul 24	64.521.970	1,04
USD	166.039	MSCI ACWI Total Return Net Index Total Return Swap Klasse A USD	31. Jul 24	1.252.741	0,02
USD	7.832.767	MSCI ACWI Total Return Net Index Total Return Swap Klasse A USD	31. Jul 24	47.287.936	0,76
USD	1.600.781	MSCI ACWI Total Return Net Index Total Return Swap Klasse A USD	31. Jul 24	8.200.749	0,13

Unfunded Swaps zum beizulegenden Zeitwert

220.456.784

3,56

Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten

(3.090)

(0,00)

Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnendes Nettovermögen

6.191.529.859

100,00

Einstufung

* Im Freiverkehr gehandelte derivative Finanzinstrumente.

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

Gegenpartei der Swap-Kontrakte ist die UBS AG.

Analyse des Gesamtvermögens

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

**% des Gesamtver-
mögens**

93,41

3,85

2,74

100,00

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2023**

CMCI EX-AGRICULTURE SF UCITS ETF

Aktien – 96,16 % (30. Juni 2023: 97,41 %)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
4.268	3M Co	466.618	0,30
7.500	Achillion Pharmaceuticals Inc	-	0,00
221	adidas AG	45.041	0,03
7.597	Adobe Inc	4.532.646	2,95
29.384	Advanced Micro Devices Inc	4.331.524	2,82
2.932	Air Liquide SA	570.413	0,37
5.405	Alcon Inc	421.570	0,27
22.454	Alphabet Inc - Class A	3.136.594	2,04
20.549	Alphabet Inc - Class C	2.895.929	1,89
54.075	Amazon.com Inc	8.216.166	5,35
1.745	American Water Works Co Inc	230.344	0,15
2.546	Amgen Inc	733.407	0,48
15.809	Amot Investments Ltd	85.523	0,06
175	ANSYS Inc	63.421	0,04
45.507	Apple Inc	8.761.549	5,71
8.821	Applied Materials Inc	1.429.541	0,93
49.759	ArcelorMittal SA	1.411.253	0,92
450	Arista Networks Inc	105.863	0,07
1.950	ASML Holding NV	1.468.126	0,96
47.933	Atlas Copco AB - Class B	710.592	0,46
8.388	AXA SA	273.264	0,18
2.811	Azrieli Group Ltd	182.821	0,12
1.333	Baozun Inc	3.652	0,00
25.171	BASF SE	1.356.309	0,88
404	Bayerische Motoren Werke AG (Voting rights)	44.925	0,03
152.127	Bezeq The Israeli Telecommunication Corp Ltd	208.108	0,14
44.994	BNP Paribas SA	3.110.918	2,03
31	Booking Holdings Inc	111.163	0,07
2.808	Boston Scientific Corp	162.335	0,11
273	Bouygues SA	10.303	0,01
2.027	Broadcom Inc	2.262.690	1,47
116	Cadence Design Systems Inc	31.518	0,02
9.073	Carrefour SA	166.027	0,11
2.645	CF Industries Holdings Inc	210.246	0,14
459	Check Point Software Technologies Ltd	70.080	0,05
27	Chipotle Mexican Grill Inc	61.810	0,04
5.837	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA	209.292	0,14
859	Cintas Corp	517.470	0,34
10.823	Citigroup Inc	556.753	0,36
12.162	Commerzbank AG	144.561	0,09
5.944	Consolidated Edison Inc	540.723	0,35
6.487	Covestro AG	377.471	0,25
15.945	Credit Agricole SA	226.375	0,15
501	Crowdstrike Holdings Inc	127.910	0,08
861	Cummins Inc	206.304	0,13
6.135	CVS Health Corp	484.396	0,31
365	CyberArk Software Ltd	79.924	0,05
8.950	Danone SA	580.127	0,38
12.079	Dell Technologies Inc	924.015	0,60
2.375	Deutsche Boerse AG	489.354	0,32
10.183	Deutsche Post AG	504.542	0,33

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2023**

CMCI EX-AGRICULTURE SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Aktien – 96,16 % (30. Juni 2023: 97,41 %) (Fortsetzung)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
1.994	Dollar Tree Inc	283.281	0,18
897	Dropbox Inc	26.449	0,02
40.701	E.ON SE	546.269	0,36
2.115	eBay Inc	92.274	0,06
2.261	Eli Lilly & Co	1.318.167	0,86
268.921	Enel SpA	1.999.241	1,30
83.526	Eni SpA	1.416.115	0,92
9.224	Enlight Renewable Energy Ltd	179.685	0,12
1.245	Euronext NV	108.172	0,07
7.433	Evonik Industries AG	151.891	0,10
811	EXOR NV	81.058	0,05
886	F5 Inc	158.525	0,10
754	Farfetch Ltd	17	0,00
440	Fortinet Inc	25.742	0,02
430	GEA Group AG	17.912	0,01
1.213	Hilton Worldwide Holdings Inc	220.862	0,14
2.965	Home Depot Inc	1.027.395	0,67
3.058	HP Inc	92.016	0,06
60	IDEXX Laboratories Inc	33.543	0,02
257	Incyte Corp	16.122	0,01
49.917	Infineon Technologies AG	2.084.306	1,36
25.823	ING Groep NV	385.838	0,25
844	Insulet Corp	183.133	0,12
16.022	Intel Corp	805.098	0,52
3.658	International Business Machines Corp	598.205	0,39
8.985	International Paper Co	324.822	0,21
1.460.187	Intesa Sanpaolo SpA	4.263.953	2,78
473	Intuitive Surgical Inc	159.728	0,10
22.210	Investor AB - Class B	514.601	0,33
313	Israel Corp Ltd	80.058	0,05
13.486	Johnson & Johnson	2.113.843	1,38
49.721	Just Eat Takeaway.com NV	756.969	0,49
7.039	K+S AG	111.265	0,07
2.305	Keysight Technologies Inc	366.637	0,24
969	KLA Corp	563.372	0,37
10.811	Koninklijke Ahold Delhaize NV	310.678	0,20
596	Laboratory Corp of America Holdings	135.488	0,09
605	Lam Research Corp	474.099	0,31
3.596	Liberty Global Ltd - Class A	63.904	0,04
1.318	Lonza Group AG	554.014	0,36
3.710	Marathon Petroleum Corp	550.433	0,36
2.557	Marriott International Inc	576.595	0,38
10.873	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA	134.584	0,09
3.378	Mercedes-Benz Group AG	233.434	0,15
1.171	Merck KGaA	186.408	0,12
10.252	Meta Platforms Inc	3.628.674	2,36
20.865	Microsoft Corp	7.846.173	5,11
270	Moderna Inc	26.879	0,02
2.446	Monster Beverage Corp	140.936	0,09
1.218	MTU Aero Engines AG	262.591	0,17
1.252	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen	518.844	0,34

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2023**

CMCI EX-AGRICULTURE SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Aktien – 96,16 % (30. Juni 2023: 97,41 %) (Fortsetzung)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
6.527	Nestle SA	756.157	0,49
2.642	Netflix Inc	1.286.158	0,84
1.351	New Oriental Education & Technology Group Inc	99.028	0,06
5.078	Nice Ltd	1.028.085	0,67
8.462	NN Group NV	334.187	0,22
2.152	Nova Ltd	300.071	0,19
7.734	Novartis AG	779.883	0,51
3.498	NVIDIA Corp	1.732.155	1,13
8.108	Oracle Corp	854.846	0,56
453.860	Orange SA	5.165.977	3,36
88	O'Reilly Automotive Inc	83.287	0,05
2.671	Palo Alto Networks Inc	787.520	0,51
1.240	Parker-Hannifin Corp	571.155	0,37
2.124	Paychex Inc	252.990	0,16
4.497	PayPal Holdings Inc	276.168	0,18
6.751	PDD Holdings Inc	987.799	0,64
1.421	PepsiCo Inc	241.320	0,16
776	Pinterest Inc	28.733	0,02
14.654	Poste Italiane SpA	166.324	0,11
10.395	Procter & Gamble Co	1.523.226	0,99
89.616	Prosus NV	2.671.368	1,74
10.492	QUALCOMM Inc	1.517.478	0,99
632	Regeneron Pharmaceuticals Inc	555.453	0,36
6.379	Roche Holding AG (Non-voting rights)	1.853.016	1,21
836	Rockwell Automation Inc	259.476	0,17
1.019	Royal Caribbean Cruises Ltd	131.923	0,09
16.204	RWE AG	737.098	0,48
4.085	Salesforce Inc	1.075.012	0,70
4.216	Samsara Inc	140.739	0,09
49.982	Sanofi	4.955.928	3,23
593	Schindler Holding AG (Voting rights)	148.104	0,10
40.541	Securitas AB	396.565	0,26
687	ServiceNow Inc	485.010	0,32
1.081	SGS SA	93.177	0,06
3.291	Siemens AG (Germany listed)	617.731	0,40
107.983	Societe Generale SA	2.865.784	1,87
7.387	Southern Co	517.987	0,34
4.329	Starbucks Corp	415.621	0,27
24.320	Stellantis NV (Italy listed)	568.204	0,37
3.904	Target Corp	555.951	0,36
1.749	TE Connectivity Ltd	245.693	0,16
18.510	TeamViewer SE	287.488	0,19
2.402	Tesla Inc	596.949	0,39
56.757	Teva Pharmaceutical Industries Ltd	605.260	0,39
4.696	Texas Instruments Inc	800.460	0,52
14.932	thyssenkrupp AG	104.114	0,07
165.550	TotalEnergies SE	11.265.116	7,34
8.972	Tower Semiconductor Ltd	275.806	0,18
3.217	Uber Technologies Inc	198.093	0,13
4.035	United Parcel Service Inc	634.467	0,41
970	United Rentals Inc	556.486	0,36

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2023**

CMCI EX-AGRICULTURE SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Aktien – 96,16 % (30. Juni 2023: 97,41 %) (Fortsetzung)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
1.049	UnitedHealth Group Inc	552.180	0,36
100	VeriSign Inc	20.565	0,01
2.040	Vertex Pharmaceuticals Inc	829.920	0,54
6.568	Vinci SA	824.952	0,54
4.546	Walgreens Boots Alliance Inc	118.696	0,08
10.895	Wartsila OYJ Abp	157.955	0,10
549	West Pharmaceutical Services Inc	193.206	0,13
12.891	Westrock Co	535.242	0,35
192	Workday Inc	52.903	0,03
240	WW Grainger Inc	198.944	0,13
694	Zoetis Inc	136.880	0,09
694	Zoom Video Communications Inc	49.932	0,03
Aktien insgesamt		147.659.805	96,16

Funded Swaps* – 0,40 % (30. Juni 2023: 0,40 %)

Wäh- rung	Nominalbetrag	Bezeichnung	Fälligkeitstag	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
CHF	1.042	CMCI Ex-Agriculture Total Return Index Swap Klasse A CHF**	31. Jul 24	182.601	0,12
EUR	341	CMCI Ex-Agriculture Total Return Index Swap Klasse A EUR**	31. Jul 24	57.584	0,04
GBP	38	CMCI Ex-Agriculture Total Return Index Swap Klasse A GBP**	31. Jul 24	6.310	0,00
USD	1.901	CMCI Ex-Agriculture Total Return Index Swap Klasse A USD	31. Jul 24	367.703	0,24
Funded Swaps zum beizulegenden Zeitwert				614.198	0,40

Unfunded Swaps* – 3,44 % (30. Juni 2023: 2,18 %)

Wäh- rung	Nominalbetrag	Bezeichnung	Fälligkeitstag	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
CHF	259.385	CMCI Ex-Agriculture Total Return Net Index Total Return Swap Klasse A CHF**	31. Jul 24	1.394.914	0,91
EUR	84.786	CMCI Ex-Agriculture Total Return Net Index Total Return Swap Klasse A EUR**	31. Jul 24	453.651	0,29
GBP	9.462	CMCI Ex-Agriculture Total Return Net Index Total Return Swap Klasse A GBP**	31. Jul 24	55.250	0,04
USD	473.477	CMCI Ex-Agriculture Total Return Net Index Total Return Swap Klasse A USD	31. Jul 24	3.372.018	2,20
Unfunded Swaps zum beizulegenden Zeitwert				5.275.833	3,44

Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten

Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnendes Nettovermögen **153.549.836** **100,00**

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2023**

CMCI EX-AGRICULTURE SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Einstufung

* Im Freiverkehr gehandelte derivative Finanzinstrumente.

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

Gegenpartei der Swap-Kontrakte ist die UBS AG.

Analyse des Gesamtvermögens

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

	% des Gesamtver-
	mögens
	91,39
	3,64
	4,97
	<hr/>
	100,00
	<hr/> <hr/>

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2023**

BLOOMBERG COMMODITY CMCI SF UCITS ETF

Aktien – 97,12 % (30. Juni 2023: 97,90 %)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
21.873	3M Co	2.391.119	0,31
38.433	Achillion Pharmaceuticals Inc	-	0,00
1.135	adidas AG	230.809	0,03
38.932	Adobe Inc	23.226.938	2,98
150.575	Advanced Micro Devices Inc	22.196.313	2,85
15.024	Air Liquide SA	2.923.005	0,38
27.700	Alcon Inc	2.160.277	0,28
115.062	Alphabet Inc - Class A	16.073.058	2,06
105.299	Alphabet Inc - Class C	14.839.800	1,90
277.100	Amazon.com Inc	42.102.643	5,40
8.943	American Water Works Co Inc	1.180.369	0,15
13.049	Amgen Inc	3.758.246	0,48
81.011	Amot Investments Ltd	438.251	0,06
896	ANSYS Inc	324.994	0,04
233.197	Apple Inc	44.897.386	5,76
45.200	Applied Materials Inc	7.325.490	0,94
254.982	ArcelorMittal SA	7.231.779	0,93
2.303	Arista Networks Inc	542.479	0,07
9.990	ASML Holding NV	7.523.216	0,97
245.628	Atlas Copco AB - Class B	3.641.332	0,47
42.986	AXA SA	1.400.304	0,18
14.404	Azrieli Group Ltd	936.842	0,12
6.831	Baozun Inc	18.716	0,00
128.983	BASF SE	6.950.225	0,89
2.068	Bayerische Motoren Werke AG (Voting rights)	230.213	0,03
779.553	Bezeq The Israeli Telecommunication Corp Ltd	1.066.422	0,14
230.568	BNP Paribas SA	15.941.484	2,05
161	Booking Holdings Inc	569.641	0,07
14.390	Boston Scientific Corp	831.865	0,11
1.401	Bouygues SA	52.796	0,01
10.387	Broadcom Inc	11.594.852	1,49
593	Cadence Design Systems Inc	161.509	0,02
46.494	Carrefour SA	850.781	0,11
13.552	CF Industries Holdings Inc	1.077.378	0,14
2.350	Check Point Software Technologies Ltd	359.114	0,05
138	Chipotle Mexican Grill Inc	316.739	0,04
29.910	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA	1.072.490	0,14
4.400	Cintas Corp	2.651.705	0,34
55.463	Citigroup Inc	2.853.005	0,37
62.324	Commerzbank AG	740.785	0,09
30.459	Consolidated Edison Inc	2.770.864	0,36
33.239	Covestro AG	1.934.302	0,25
81.709	Credit Agricole SA	1.160.026	0,15
2.567	Crowdstrike Holdings Inc	655.456	0,08
4.413	Cummins Inc	1.057.178	0,14
31.436	CVS Health Corp	2.482.224	0,32
1.870	CyberArk Software Ltd	409.562	0,05
45.861	Danone SA	2.972.782	0,38
61.895	Dell Technologies Inc	4.734.990	0,61
12.172	Deutsche Boerse AG	2.507.629	0,32
52.180	Deutsche Post AG	2.585.456	0,33

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2023**

BLOOMBERG COMMODITY CMCI SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Aktien – 97,12 % (30. Juni 2023: 97,90 %) (Fortsetzung)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
10.219	Dollar Tree Inc	1.451.636	0,19
4.597	Dropbox Inc	135.534	0,02
208.567	E.ON SE	2.799.281	0,36
10.840	eBay Inc	472.847	0,06
11.588	Eli Lilly & Co	6.754.774	0,87
1.378.052	Enel SpA	10.244.844	1,31
428.018	Eni SpA	7.256.693	0,93
47.265	Enlight Renewable Energy Ltd	920.773	0,12
6.380	Euronext NV	554.314	0,07
38.087	Evonik Industries AG	778.344	0,10
4.155	EXOR NV	415.372	0,05
4.539	F5 Inc	812.338	0,10
3.865	Farfetch Ltd	86	0,00
2.254	Fortinet Inc	131.913	0,02
2.205	GEA Group AG	91.790	0,01
6.215	Hilton Worldwide Holdings Inc	1.131.780	0,15
15.192	Home Depot Inc	5.264.745	0,68
15.671	HP Inc	471.526	0,06
310	IDEXX Laboratories Inc	171.888	0,02
1.316	Incyte Corp	82.615	0,01
255.791	Infineon Technologies AG	10.680.748	1,37
132.328	ING Groep NV	1.977.177	0,25
4.325	Insulet Corp	938.440	0,12
82.102	Intel Corp	4.125.617	0,53
18.743	International Business Machines Corp	3.065.422	0,39
46.044	International Paper Co	1.664.507	0,21
7.482.531	Intesa Sanpaolo SpA	21.850.058	2,80
2.426	Intuitive Surgical Inc	818.504	0,10
113.813	Investor AB - Class B	2.637.005	0,34
1.606	Israel Corp Ltd	410.244	0,05
69.109	Johnson & Johnson	10.832.104	1,39
254.789	Just Eat Takeaway.com NV	3.878.988	0,50
36.069	K+S AG	570.165	0,07
11.810	Keysight Technologies Inc	1.878.783	0,24
4.966	KLA Corp	2.886.921	0,37
55.399	Koninklijke Ahold Delhaize NV	1.592.029	0,20
3.055	Laboratory Corp of America Holdings	694.288	0,09
3.102	Lam Research Corp	2.429.456	0,31
18.428	Liberty Global Ltd - Class A	327.467	0,04
6.756	Lonza Group AG	2.838.972	0,36
19.012	Marathon Petroleum Corp	2.820.619	0,36
13.102	Marriott International Inc	2.954.683	0,38
55.718	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA	689.659	0,09
17.312	Mercedes-Benz Group AG	1.196.202	0,15
6.001	Merck KGaA	955.223	0,12
52.533	Meta Platforms Inc	18.594.653	2,39
106.921	Microsoft Corp	40.206.662	5,16
1.385	Moderna Inc	137.736	0,02
12.536	Monster Beverage Corp	722.206	0,09
6.239	MTU Aero Engines AG	1.345.610	0,17
6.417	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen	2.658.744	0,34

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2023**

BLOOMBERG COMMODITY CMCI SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Aktien – 97,12 % (30. Juni 2023: 97,90 %) (Fortsetzung)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
33.445	Nestle SA	3.874.825	0,50
13.537	Netflix Inc	6.590.745	0,85
6.925	New Oriental Education & Technology Group Inc	507.455	0,07
26.019	Nice Ltd	5.268.282	0,68
43.364	NN Group NV	1.712.497	0,22
11.030	Nova Ltd	1.537.672	0,20
39.632	Novartis AG	3.996.405	0,51
17.924	NVIDIA Corp	8.876.197	1,14
41.549	Oracle Corp	4.380.543	0,56
2.325.745	Orange SA	26.472.360	3,40
449	O'Reilly Automotive Inc	426.792	0,05
13.685	Palo Alto Networks Inc	4.035.542	0,52
6.353	Parker-Hannifin Corp	2.926.807	0,38
10.884	Paychex Inc	1.296.415	0,17
23.045	PayPal Holdings Inc	1.415.188	0,18
34.597	PDD Holdings Inc	5.061.846	0,65
7.281	PepsiCo Inc	1.236.610	0,16
3.975	Pinterest Inc	147.240	0,02
75.091	Poste Italiane SpA	852.303	0,11
53.266	Procter & Gamble Co	7.805.568	1,00
459.226	Prosus NV	13.689.069	1,76
53.766	QUALCOMM Inc	7.776.112	1,00
3.241	Regeneron Pharmaceuticals Inc	2.846.341	0,37
32.687	Roche Holding AG (Non-voting rights)	9.495.531	1,22
4.283	Rockwell Automation Inc	1.329.648	0,17
5.221	Royal Caribbean Cruises Ltd	676.025	0,09
83.034	RWE AG	3.777.158	0,48
20.935	Salesforce Inc	5.508.753	0,71
21.606	Samsara Inc	721.196	0,09
256.128	Sanofi	25.395.991	3,26
3.037	Schindler Holding AG (Voting rights)	758.942	0,10
207.746	Securitas AB	2.032.145	0,26
3.518	ServiceNow Inc	2.485.368	0,32
5.540	SGS SA	477.473	0,06
16.864	Siemens AG (Germany listed)	3.165.480	0,41
553.344	Societe Generale SA	14.685.328	1,88
37.854	Southern Co	2.654.355	0,34
22.183	Starbucks Corp	2.129.793	0,27
124.626	Stellantis NV (Italy listed)	2.911.688	0,37
20.003	Target Corp	2.848.898	0,37
8.961	TE Connectivity Ltd	1.259.021	0,16
94.853	TeamViewer SE	1.473.195	0,19
12.311	Tesla Inc	3.058.983	0,39
290.845	Teva Pharmaceutical Industries Ltd	3.101.572	0,40
24.063	Texas Instruments Inc	4.101.850	0,53
76.517	thyssenkrupp AG	533.518	0,07
848.341	TotalEnergies SE	57.726.578	7,41
45.973	Tower Semiconductor Ltd	1.413.331	0,18
16.487	Uber Technologies Inc	1.015.103	0,13
20.678	United Parcel Service Inc	3.251.242	0,42
4.973	United Rentals Inc	2.851.638	0,37

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2023**

BLOOMBERG COMMODITY CMCI SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Aktien – 97,12 % (30. Juni 2023: 97,90 %) (Fortsetzung)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
5.375	UnitedHealth Group Inc	2.829.571	0,36
512	VeriSign Inc	105.386	0,01
10.452	Vertex Pharmaceuticals Inc	4.252.816	0,55
33.658	Vinci SA	4.227.356	0,54
23.295	Walgreens Boots Alliance Inc	608.244	0,08
55.828	Wartsila OYJ Abp	809.417	0,10
2.812	West Pharmaceutical Services Inc	990.059	0,13
66.059	Westrock Co	2.742.774	0,35
982	Workday Inc	271.096	0,03
1.230	WW Grainger Inc	1.019.459	0,13
3.554	Zoetis Inc	701.423	0,09
3.558	Zoom Video Communications Inc	255.871	0,03
Aktien insgesamt		756.662.913	97,12

Funded Swaps* – 0,40 % (30. Juni 2023: 0,40 %)

Wäh- rung	Nominalbetrag	Bezeichnung	Fälligkeitstag	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
CHF	70.114	Bloomberg Commodity Total Return Index Swap Klasse A CHF**	31. Jul 24	1.045.071	0,13
EUR	11.076	Bloomberg Commodity Total Return Index Swap Klasse A EUR**	31. Jul 24	158.680	0,02
GBP	9.239	Bloomberg Commodity Total Return Index Swap Klasse A GBP**	31. Jul 24	153.511	0,02
USD	115.696	Bloomberg Commodity Total Return Index Swap Klasse A USD	31. Jul 24	1.759.222	0,23
Funded Swaps zum beizulegenden Zeitwert				3.116.484	0,40

Unfunded Swaps* – 2,48 % (30. Juni 2023: 1,69 %)

Wäh- rung	Nominalbetrag	Bezeichnung	Fälligkeitstag	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
CHF	17.458.311	Bloomberg Commodity Total Return Index Total Return Swap Klasse A CHF**	31. Jul 24	5.508.371	0,71
EUR	2.757.855	Bloomberg Commodity Total Return Index Total Return Swap Klasse A EUR**	31. Jul 24	872.676	0,11
GBP	2.300.545	Bloomberg Commodity Total Return Index Total Return Swap Klasse A GBP**	31. Jul 24	981.481	0,12
USD	28.808.405	Bloomberg Commodity Total Return Index Total Return Swap Klasse A USD	31. Jul 24	11.978.938	1,54
Unfunded Swaps zum beizulegenden Zeitwert				19.341.466	2,48

Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten 117 0,00

Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnendes Nettovermögen 779.120.980 100,00

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2023**

BLOOMBERG COMMODITY CMCI SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Einstufung

* Im Freiverkehr gehandelte derivative Finanzinstrumente.

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

Gegenpartei der Swap-Kontrakte ist die UBS AG.

Analyse des Gesamtvermögens

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

	% des Gesamtver-
	mögens
	92,82
	2,76
	4,42
	<hr/>
	100,00
	<hr/> <hr/>

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2023**

CMCI COMMODITY CARRY SF UCITS ETF

Aktien – 95,66 % (30. Juni 2023: 98,79 %)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
5.843	3M Co	638.769	0,30
10.267	Achillion Pharmaceuticals Inc	-	0,00
303	adidas AG	61.659	0,03
10.400	Adobe Inc	6.204.900	2,94
40.225	Advanced Micro Devices Inc	5.929.576	2,81
4.014	Air Liquide SA	780.859	0,37
7.400	Alcon Inc	577.102	0,27
30.738	Alphabet Inc - Class A	4.293.795	2,03
28.130	Alphabet Inc - Class C	3.964.340	1,88
74.025	Amazon.com Inc	11.247.401	5,32
2.389	American Water Works Co Inc	315.326	0,15
3.486	Amgen Inc	1.003.987	0,47
21.642	Amot Investments Ltd	117.075	0,06
239	ANSYS Inc	86.819	0,04
62.297	Apple Inc	11.993.995	5,68
12.075	Applied Materials Inc	1.956.949	0,93
68.117	ArcelorMittal SA	1.931.915	0,91
615	Arista Networks Inc	144.919	0,07
2.669	ASML Holding NV	2.009.770	0,95
65.618	Atlas Copco AB - Class B	972.754	0,46
11.483	AXA SA	374.081	0,18
3.848	Azrieli Group Ltd	250.270	0,12
1.825	Baozun Inc	5.000	0,00
34.457	BASF SE	1.856.700	0,88
552	Bayerische Motoren Werke AG (Voting rights)	61.500	0,03
208.252	Bezeq The Israeli Telecommunication Corp Ltd	284.886	0,13
61.594	BNP Paribas SA	4.258.646	2,01
43	Booking Holdings Inc	152.176	0,07
3.844	Boston Scientific Corp	222.226	0,10
374	Bouygues SA	14.104	0,01
2.775	Broadcom Inc	3.097.477	1,47
158	Cadence Design Systems Inc	43.146	0,02
12.421	Carrefour SA	227.280	0,11
3.620	CF Industries Holdings Inc	287.813	0,14
628	Check Point Software Technologies Ltd	95.935	0,05
37	Chipotle Mexican Grill Inc	84.615	0,04
7.990	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA	286.507	0,14
1.175	Cintas Corp	708.383	0,33
14.816	Citigroup Inc	762.159	0,36
16.649	Commerzbank AG	197.895	0,09
8.137	Consolidated Edison Inc	740.215	0,35
8.880	Covestro AG	516.734	0,24
21.828	Credit Agricole SA	309.892	0,15
686	Crowdstrike Holdings Inc	175.100	0,08
1.179	Cummins Inc	282.417	0,13
8.398	CVS Health Corp	663.107	0,31
499	CyberArk Software Ltd	109.411	0,05
12.252	Danone SA	794.156	0,38
16.535	Dell Technologies Inc	1.264.917	0,60
3.252	Deutsche Boerse AG	669.894	0,32
13.939	Deutsche Post AG	690.685	0,33

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2023**

CMCI COMMODITY CARRY SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Aktien – 95,66 % (30. Juni 2023: 98,79 %) (Fortsetzung)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
2.730	Dollar Tree Inc	387.794	0,18
1.228	Dropbox Inc	36.207	0,02
55.717	E.ON SE	747.807	0,35
2.896	eBay Inc	126.318	0,06
3.096	Eli Lilly & Co	1.804.487	0,85
368.136	Enel SpA	2.736.832	1,29
114.342	Eni SpA	1.938.570	0,92
12.626	Enlight Renewable Energy Ltd	245.978	0,12
1.704	Euronext NV	148.081	0,07
10.175	Evonik Industries AG	207.929	0,10
1.110	EXOR NV	110.963	0,05
1.212	F5 Inc	217.010	0,10
1.033	Farfetch Ltd	23	0,00
602	Fortinet Inc	35.240	0,02
589	GEA Group AG	24.521	0,01
1.660	Hilton Worldwide Holdings Inc	302.346	0,14
4.058	Home Depot Inc	1.406.437	0,67
4.186	HP Inc	125.965	0,06
83	IDEXX Laboratories Inc	45.919	0,02
351	Incyte Corp	22.070	0,01
68.333	Infineon Technologies AG	2.853.281	1,35
35.350	ING Groep NV	528.188	0,25
1.155	Insulet Corp	250.697	0,12
21.933	Intel Corp	1.102.127	0,52
5.007	International Business Machines Corp	818.904	0,39
12.300	International Paper Co	444.660	0,21
1.998.901	Intesa Sanpaolo SpA	5.837.077	2,76
648	Intuitive Surgical Inc	218.657	0,10
30.404	Investor AB - Class B	704.456	0,33
429	Israel Corp Ltd	109.594	0,05
18.462	Johnson & Johnson	2.893.714	1,37
68.065	Just Eat Takeaway.com NV	1.036.242	0,49
9.636	K+S AG	152.315	0,07
3.155	Keysight Technologies Inc	501.903	0,24
1.327	KLA Corp	771.219	0,36
14.799	Koninklijke Ahold Delhaize NV	425.299	0,20
816	Laboratory Corp of America Holdings	185.474	0,09
829	Lam Research Corp	649.011	0,31
4.923	Liberty Global Ltd - Class A	87.480	0,04
1.805	Lonza Group AG	758.410	0,36
5.079	Marathon Petroleum Corp	753.507	0,36
3.500	Marriott International Inc	789.321	0,37
14.885	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA	184.237	0,09
4.625	Mercedes-Benz Group AG	319.556	0,15
1.603	Merck KGaA	255.181	0,12
14.034	Meta Platforms Inc	4.967.420	2,35
28.563	Microsoft Corp	10.740.904	5,08
370	Moderna Inc	36.795	0,02
3.349	Monster Beverage Corp	192.932	0,09
1.667	MTU Aero Engines AG	359.469	0,17
1.714	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen	710.263	0,34

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2023**

CMCI COMMODITY CARRY SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Aktien – 95,66 % (30. Juni 2023: 98,79 %) (Fortsetzung)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
8.935	Nestle SA	1.035.130	0,49
3.616	Netflix Inc	1.760.668	0,83
1.850	New Oriental Education & Technology Group Inc	135.563	0,06
6.951	Nice Ltd	1.407.381	0,67
11.584	NN Group NV	457.481	0,22
2.947	Nova Ltd	410.777	0,19
10.587	Novartis AG	1.067.609	0,50
4.788	NVIDIA Corp	2.371.208	1,12
11.100	Oracle Corp	1.170.229	0,55
621.305	Orange SA	7.071.890	3,35
120	O'Reilly Automotive Inc	114.014	0,05
3.656	Palo Alto Networks Inc	1.078.064	0,51
1.697	Parker-Hannifin Corp	781.874	0,37
2.908	Paychex Inc	346.327	0,16
6.156	PayPal Holdings Inc	378.057	0,18
9.242	PDD Holdings Inc	1.352.234	0,64
1.945	PepsiCo Inc	330.351	0,16
1.062	Pinterest Inc	39.334	0,02
20.060	Poste Italiane SpA	227.686	0,11
14.230	Procter & Gamble Co	2.085.198	0,99
122.679	Prosus NV	3.656.931	1,73
14.363	QUALCOMM Inc	2.077.329	0,98
866	Regeneron Pharmaceuticals Inc	760.379	0,36
8.732	Roche Holding AG (Non-voting rights)	2.536.659	1,20
1.144	Rockwell Automation Inc	355.205	0,17
1.395	Royal Caribbean Cruises Ltd	180.595	0,09
22.182	RWE AG	1.009.039	0,48
5.593	Salesforce Inc	1.471.621	0,70
5.772	Samsara Inc	192.662	0,09
68.423	Sanofi	6.784.346	3,21
811	Schindler Holding AG (Voting rights)	202.746	0,10
55.498	Securitas AB	542.872	0,26
940	ServiceNow Inc	663.947	0,31
1.480	SGS SA	127.553	0,06
4.505	Siemens AG (Germany listed)	845.634	0,40
147.822	Societe Generale SA	3.923.074	1,86
10.113	Southern Co	709.091	0,34
5.926	Starbucks Corp	568.958	0,27
33.293	Stellantis NV (Italy listed)	777.835	0,37
5.344	Target Corp	761.061	0,36
2.394	TE Connectivity Ltd	336.338	0,16
25.339	TeamViewer SE	393.553	0,19
3.289	Tesla Inc	817.184	0,39
77.697	Teva Pharmaceutical Industries Ltd	828.561	0,39
6.428	Texas Instruments Inc	1.095.778	0,52
20.441	thyssenkrupp AG	142.525	0,07
226.628	TotalEnergies SE	15.421.217	7,30
12.281	Tower Semiconductor Ltd	377.561	0,18
4.404	Uber Technologies Inc	271.177	0,13
5.524	United Parcel Service Inc	868.545	0,41
1.328	United Rentals Inc	761.794	0,36

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2023**

CMCI COMMODITY CARRY SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Aktien – 95,66 % (30. Juni 2023: 98,79 %) (Fortsetzung)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
1.436	UnitedHealth Group Inc	755.898	0,36
137	VeriSign Inc	28.153	0,01
2.792	Vertex Pharmaceuticals Inc	1.136.107	0,54
8.991	Vinci SA	1.129.306	0,53
6.223	Walgreens Boots Alliance Inc	162.488	0,08
14.914	Wartsila OYJ Abp	216.230	0,10
751	West Pharmaceutical Services Inc	264.487	0,12
17.647	Westrock Co	732.711	0,35
262	Workday Inc	72.421	0,03
329	WW Grainger Inc	272.341	0,13
949	Zoetis Inc	187.380	0,09
951	Zoom Video Communications Inc	68.354	0,03
Aktien insgesamt		202.136.748	95,66

Funded Swaps* – 0,40 % (30. Juni 2023: 0,40 %)

Wäh- rung	Nominalbetrag	Bezeichnung	Fälligkeitstag	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
CHF	462	CMCI Commodity Carry Klasse A CHF**	31. Jul 24	63.463	0,03
EUR	1.075	CMCI Commodity Carry Klasse A EUR**	31. Jul 24	141.584	0,07
USD	4.355	CMCI Commodity Carry Klasse A USD	31. Jul 24	640.870	0,30
Funded Swaps zum beizulegenden Zeitwert				845.917	0,40

Unfunded Swaps* – 3,94 % (30. Juni 2023: 0,80 %)

Wäh- rung	Nominalbetrag	Bezeichnung	Fälligkeitstag	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
CHF	115.000	CMCI Commodity Carry Total Return Swap Klasse A CHF**	31. Jul 24	547.901	0,26
EUR	267.694	CMCI Commodity Carry Total Return Swap Klasse A EUR**	31. Jul 24	1.260.767	0,60
USD	1.084.446	CMCI Commodity Carry Total Return Swap Klasse A USD	31. Jul 24	6.521.129	3,08
Unfunded Swaps zum beizulegenden Zeitwert				8.329.797	3,94

Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten (25) (0,00)

Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnendes Nettovermögen 211.312.437 100,00

Einstufung

* Im Freiverkehr gehandelte derivative Finanzinstrumente.

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

Gegenpartei der Swap-Kontrakte ist die UBS AG.

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2023**

CMCI COMMODITY CARRY SF UCITS ETF (Fortsetzung)

	% des Gesamtver-
	mögens
Analyse des Gesamtvermögens	
Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind	92,17
Im Freiverkehr gehandelte derivative Finanzinstrumente	4,18
Sonstige Vermögenswerte	3,65
	<hr/>
	100,00
	<hr/>

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2023**

MSCI CHINA A SF UCITS ETF

Aktien – 93,41 % (30. Juni 2023: 98,50 %)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
2.521	3M Co	275.629	0,30
4.430	Achillion Pharmaceuticals Inc	-	0,00
131	adidas AG	26.606	0,03
4.488	Adobe Inc	2.677.412	2,87
17.357	Advanced Micro Devices Inc	2.558.610	2,74
1.732	Air Liquide SA	336.940	0,36
3.193	Alcon Inc	249.019	0,27
13.263	Alphabet Inc - Class A	1.852.771	1,98
12.138	Alphabet Inc - Class C	1.710.611	1,83
31.942	Amazon.com Inc	4.853.249	5,20
1.031	American Water Works Co Inc	136.063	0,15
1.504	Amgen Inc	433.220	0,46
9.338	Amot Investments Ltd	50.518	0,05
103	ANSYS Inc	37.463	0,04
26.881	Apple Inc	5.175.404	5,54
5.210	Applied Materials Inc	844.423	0,90
29.392	ArcelorMittal SA	833.620	0,89
266	Arista Networks Inc	62.533	0,07
1.152	ASML Holding NV	867.215	0,93
28.314	Atlas Copco AB - Class B	419.743	0,45
4.955	AXA SA	161.416	0,17
1.660	Azrieli Group Ltd	107.991	0,12
787	Baozun Inc	2.157	0,00
14.868	BASF SE	801.165	0,86
238	Bayerische Motoren Werke AG (Voting rights)	26.537	0,03
89.860	Bezeq The Israeli Telecommunication Corp Ltd	122.928	0,13
26.578	BNP Paribas SA	1.837.604	1,97
19	Booking Holdings Inc	65.663	0,07
1.659	Boston Scientific Corp	95.891	0,10
161	Bouygues SA	6.086	0,01
1.197	Broadcom Inc	1.336.560	1,43
68	Cadence Design Systems Inc	18.618	0,02
5.359	Carrefour SA	98.071	0,10
1.562	CF Industries Holdings Inc	124.191	0,13
271	Check Point Software Technologies Ltd	41.396	0,04
16	Chipotle Mexican Grill Inc	36.511	0,04
3.448	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA	123.628	0,13
507	Cintas Corp	305.667	0,33
6.393	Citigroup Inc	328.871	0,35
7.184	Commerzbank AG	85.392	0,09
3.511	Consolidated Edison Inc	319.403	0,34
3.832	Covestro AG	222.970	0,24
9.419	Credit Agricole SA	133.718	0,14
296	Crowdstrike Holdings Inc	75.556	0,08
509	Cummins Inc	121.863	0,13
3.624	CVS Health Corp	286.130	0,31
216	CyberArk Software Ltd	47.211	0,05
5.287	Danone SA	342.678	0,37
7.135	Dell Technologies Inc	545.811	0,58
1.403	Deutsche Boerse AG	289.059	0,31
6.015	Deutsche Post AG	298.030	0,32

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2023**

MSCI CHINA A SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Aktien – 93,41 % (30. Juni 2023: 98,50 %) (Fortsetzung)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
1.178	Dollar Tree Inc	167.333	0,18
530	Dropbox Inc	15.623	0,02
24.042	E.ON SE	322.678	0,35
1.250	eBay Inc	54.506	0,06
1.336	Eli Lilly & Co	778.635	0,83
158.851	Enel SpA	1.180.942	1,26
49.338	Eni SpA	836.492	0,90
5.448	Enlight Renewable Energy Ltd	106.139	0,11
735	Euronext NV	63.897	0,07
4.390	Evonik Industries AG	89.721	0,10
479	EXOR NV	47.881	0,05
523	F5 Inc	93.640	0,10
446	Farfetch Ltd	10	0,00
260	Fortinet Inc	15.206	0,02
254	GEA Group AG	10.581	0,01
716	Hilton Worldwide Holdings Inc	130.462	0,14
1.751	Home Depot Inc	606.877	0,65
1.806	HP Inc	54.354	0,06
36	IDEXX Laboratories Inc	19.814	0,02
152	Incyte Corp	9.523	0,01
29.485	Infineon Technologies AG	1.231.189	1,32
15.254	ING Groep NV	227.913	0,24
499	Insulet Corp	108.176	0,12
9.464	Intel Corp	475.567	0,51
2.161	International Business Machines Corp	353.357	0,38
5.308	International Paper Co	191.871	0,21
862.525	Intesa Sanpaolo SpA	2.518.696	2,70
280	Intuitive Surgical Inc	94.350	0,10
13.119	Investor AB - Class B	303.972	0,33
185	Israel Corp Ltd	47.290	0,05
7.966	Johnson & Johnson	1.248.636	1,34
29.370	Just Eat Takeaway.com NV	447.138	0,48
4.158	K+S AG	65.724	0,07
1.361	Keysight Technologies Inc	216.571	0,23
572	KLA Corp	332.781	0,36
6.386	Koninklijke Ahold Delhaize NV	183.516	0,20
352	Laboratory Corp of America Holdings	80.032	0,09
358	Lam Research Corp	280.048	0,30
2.124	Liberty Global Ltd - Class A	37.748	0,04
779	Lonza Group AG	327.253	0,35
2.192	Marathon Petroleum Corp	325.138	0,35
1.510	Marriott International Inc	340.592	0,36
6.423	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA	79.498	0,09
1.996	Mercedes-Benz Group AG	137.888	0,15
692	Merck KGaA	110.110	0,12
6.056	Meta Platforms Inc	2.143.440	2,30
12.325	Microsoft Corp	4.634.696	4,96
160	Moderna Inc	15.877	0,02
1.445	Monster Beverage Corp	83.250	0,09
719	MTU Aero Engines AG	155.111	0,17
740	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen	306.478	0,33

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2023**

MSCI CHINA A SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Aktien – 93,41 % (30. Juni 2023: 98,50 %) (Fortsetzung)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
3.855	Nestle SA	446.658	0,48
1.560	Netflix Inc	759.727	0,81
798	New Oriental Education & Technology Group Inc	58.495	0,06
2.999	Nice Ltd	607.284	0,65
4.999	NN Group NV	197.403	0,21
1.271	Nova Ltd	177.250	0,19
4.568	Novartis AG	460.673	0,49
2.066	NVIDIA Corp	1.023.175	1,10
4.789	Oracle Corp	504.953	0,54
268.093	Orange SA	3.051.517	3,27
52	O'Reilly Automotive Inc	49.197	0,05
1.578	Palo Alto Networks Inc	465.184	0,50
732	Parker-Hannifin Corp	337.378	0,36
1.255	Paychex Inc	149.440	0,16
2.656	PayPal Holdings Inc	163.131	0,17
3.988	PDD Holdings Inc	583.488	0,62
839	PepsiCo Inc	142.546	0,15
458	Pinterest Inc	16.973	0,02
8.656	Poste Italiane SpA	98.246	0,11
6.140	Procter & Gamble Co	899.762	0,96
52.936	Prosus NV	1.577.964	1,69
6.198	QUALCOMM Inc	896.367	0,96
374	Regeneron Pharmaceuticals Inc	328.103	0,35
3.768	Roche Holding AG (Non-voting rights)	1.094.567	1,17
494	Rockwell Automation Inc	153.271	0,16
602	Royal Caribbean Cruises Ltd	77.927	0,08
9.571	RWE AG	435.400	0,47
2.413	Salesforce Inc	635.004	0,68
2.491	Samsara Inc	83.134	0,09
29.524	Sanofi	2.927.442	3,13
350	Schindler Holding AG (Voting rights)	87.485	0,09
23.947	Securitas AB	234.249	0,25
406	ServiceNow Inc	286.493	0,31
639	SGS SA	55.039	0,06
1.944	Siemens AG (Germany listed)	364.891	0,39
63.785	Societe Generale SA	1.692.805	1,81
4.364	Southern Co	305.972	0,33
2.557	Starbucks Corp	245.505	0,26
14.366	Stellantis NV (Italy listed)	335.636	0,36
2.306	Target Corp	328.398	0,35
1.033	TE Connectivity Ltd	145.130	0,16
10.934	TeamViewer SE	169.818	0,18
1.419	Tesla Inc	352.614	0,38
33.526	Teva Pharmaceutical Industries Ltd	357.524	0,38
2.774	Texas Instruments Inc	472.828	0,51
8.820	thyssenkrupp AG	61.500	0,07
97.790	TotalEnergies SE	6.654.248	7,13
5.299	Tower Semiconductor Ltd	162.917	0,17
1.900	Uber Technologies Inc	117.013	0,13
2.384	United Parcel Service Inc	374.777	0,40
573	United Rentals Inc	328.714	0,35

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2023**

MSCI CHINA A SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Aktien – 93,41 % (30. Juni 2023: 98,50 %) (Fortsetzung)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventarwerts
620	UnitedHealth Group Inc	326.170	0,35
59	VeriSign Inc	12.148	0,01
1.205	Vertex Pharmaceuticals Inc	490.230	0,52
3.880	Vinci SA	487.295	0,52
2.685	Walgreens Boots Alliance Inc	70.113	0,07
6.435	Wartsila OYJ Abp	93.303	0,10
324	West Pharmaceutical Services Inc	114.126	0,12
7.615	Westrock Co	316.164	0,34
113	Workday Inc	31.250	0,03
142	WW Grainger Inc	117.515	0,13
410	Zoetis Inc	80.854	0,09
410	Zoom Video Communications Inc	29.495	0,03
Aktien insgesamt		87.221.919	93,41

Funded Swaps* – 0,40 % (30. Juni 2023: 0,40 %)

Wäh- rung	Nominalbetrag	Bezeichnung	Fälligkeitstag	Zeitwert USD	% des Netto- inventarwerts
USD	3.467	MSCI China A Klasse A USD	31. Jul 24	373.508	0,40
Funded Swaps zum beizulegenden Zeitwert				373.508	0,40

Unfunded Swaps* – 6,19 % (30. Juni 2023: 1,09 %)

Wäh- rung	Nominalbetrag	Bezeichnung	Fälligkeitstag	Zeitwert USD	% des Netto- inventarwerts
USD	863.283	MSCI China A Total Return Net Index Swap Klasse A USD	31. Jul 24	5.781.631	6,19
Unfunded Swaps zum beizulegenden Zeitwert				5.781.631	6,19

Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten

Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnendes Nettovermögen **93.377.058** **100,00**

Einstufung

* Im Freiverkehr gehandelte derivative Finanzinstrumente.

Gegenpartei der Swap-Kontrakte ist die UBS AG.

Analyse des Gesamtvermögens

Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind	88,57
Im Freiverkehr gehandelte derivative Finanzinstrumente	6,25
Sonstige Vermögenswerte	5,18
	100,00

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2023**

EURO EQUITY DEFENSIVE COVERED CALL SF UCITS ETF

Aktien – 96,30 % (30. Juni 2023: 96,32 %)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert EUR	% des Netto- inventar- werts
105	3M Co	10.367	0,30
184	Achillion Pharmaceuticals Inc	-	0,00
5	adidas AG	1.001	0,03
186	Adobe Inc	100.705	2,96
721	Advanced Micro Devices Inc	96.236	2,82
72	Air Liquide SA	12.673	0,37
133	Alcon Inc	9.366	0,28
551	Alphabet Inc - Class A	69.688	2,05
504	Alphabet Inc - Class C	64.341	1,89
1.327	Amazon.com Inc	182.544	5,36
43	American Water Works Co Inc	5.118	0,15
62	Amgen Inc	16.295	0,48
388	Amot Investments Ltd	1.900	0,06
4	ANSYS Inc	1.409	0,04
1.117	Apple Inc	194.661	5,71
216	Applied Materials Inc	31.761	0,93
1.221	ArcelorMittal SA	31.355	0,92
11	Arista Networks Inc	2.352	0,07
48	ASML Holding NV	32.619	0,96
1.176	Atlas Copco AB - Class B	15.788	0,46
206	AXA SA	6.071	0,18
69	Azrieli Group Ltd	4.062	0,12
33	Baozun Inc	81	0,00
618	BASF SE	30.134	0,88
10	Bayerische Motoren Werke AG (Voting rights)	998	0,03
3.734	Bezeq The Israeli Telecommunication Corp Ltd	4.624	0,14
1.104	BNP Paribas SA	69.117	2,03
1	Booking Holdings Inc	2.469	0,07
69	Boston Scientific Corp	3.607	0,11
7	Bouygues SA	229	0,01
50	Broadcom Inc	50.271	1,48
3	Cadence Design Systems Inc	700	0,02
223	Carrefour SA	3.689	0,11
65	CF Industries Holdings Inc	4.671	0,14
11	Check Point Software Technologies Ltd	1.557	0,05
1	Chipotle Mexican Grill Inc	1.373	0,04
143	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA	4.650	0,14
21	Cintas Corp	11.497	0,34
266	Citigroup Inc	12.370	0,36
298	Commerzbank AG	3.212	0,09
146	Consolidated Edison Inc	12.014	0,35
159	Covestro AG	8.387	0,25
391	Credit Agricole SA	5.030	0,15
12	Crowdstrike Holdings Inc	2.842	0,08
21	Cummins Inc	4.584	0,13
151	CVS Health Corp	10.762	0,32
9	CyberArk Software Ltd	1.776	0,05
220	Danone SA	12.889	0,38
296	Dell Technologies Inc	20.529	0,60
58	Deutsche Boerse AG	10.872	0,32
250	Deutsche Post AG	11.210	0,33

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2023**

EURO EQUITY DEFENSIVE COVERED CALL SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Aktien – 96,30 % (30. Juni 2023: 96,32 %) (Fortsetzung)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert EUR	% des Netto- inventar- werts
49	Dollar Tree Inc	6.294	0,18
22	Dropbox Inc	588	0,02
999	E.ON SE	12.137	0,36
52	eBay Inc	2.050	0,06
55	Eli Lilly & Co	29.287	0,86
6.600	Enel SpA	44.418	1,30
2.050	Eni SpA	31.463	0,92
226	Enlight Renewable Energy Ltd	3.992	0,12
31	Euronext NV	2.403	0,07
182	Evonik Industries AG	3.375	0,10
20	EXOR NV	1.801	0,05
22	F5 Inc	3.522	0,10
18	Farfetch Ltd	-	0,00
11	Fortinet Inc	572	0,02
11	GEA Group AG	398	0,01
30	Hilton Worldwide Holdings Inc	4.907	0,14
73	Home Depot Inc	22.826	0,67
75	HP Inc	2.044	0,06
1	IDEXX Laboratories Inc	745	0,02
6	Incyte Corp	358	0,01
1.225	Infineon Technologies AG	46.308	1,36
634	ING Groep NV	8.572	0,25
21	Insulet Corp	4.069	0,12
393	Intel Corp	17.887	0,53
90	International Business Machines Corp	13.291	0,39
221	International Paper Co	7.217	0,21
35.837	Intesa Sanpaolo SpA	94.735	2,78
12	Intuitive Surgical Inc	3.549	0,10
545	Investor AB - Class B	11.433	0,34
8	Israel Corp Ltd	1.779	0,05
331	Johnson & Johnson	46.965	1,38
1.220	Just Eat Takeaway.com NV	16.818	0,49
173	K+S AG	2.472	0,07
57	Keysight Technologies Inc	8.146	0,24
24	KLA Corp	12.517	0,37
265	Koninklijke Ahold Delhaize NV	6.903	0,20
15	Laboratory Corp of America Holdings	3.010	0,09
15	Lam Research Corp	10.533	0,31
88	Liberty Global Ltd - Class A	1.420	0,04
32	Lonza Group AG	12.309	0,36
91	Marathon Petroleum Corp	12.229	0,36
63	Marriott International Inc	12.811	0,38
267	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA	2.990	0,09
83	Mercedes-Benz Group AG	5.186	0,15
29	Merck KGaA	4.142	0,12
252	Meta Platforms Inc	80.621	2,37
512	Microsoft Corp	174.324	5,12
7	Moderna Inc	597	0,02
60	Monster Beverage Corp	3.131	0,09
30	MTU Aero Engines AG	5.834	0,17
31	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen	11.528	0,34

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2023**

EURO EQUITY DEFENSIVE COVERED CALL SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Aktien – 96,30 % (30. Juni 2023: 96,32 %) (Fortsetzung)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert EUR	% des Netto- inventar- werts
160	Nestle SA	16.800	0,49
65	Netflix Inc	28.575	0,84
33	New Oriental Education & Technology Group Inc	2.200	0,06
125	Nice Ltd	22.842	0,67
208	NN Group NV	7.425	0,22
53	Nova Ltd	6.667	0,20
190	Novartis AG	17.327	0,51
86	NVIDIA Corp	38.484	1,13
199	Oracle Corp	18.993	0,56
11.139	Orange SA	114.776	3,37
2	O'Reilly Automotive Inc	1.850	0,05
66	Palo Alto Networks Inc	17.497	0,51
30	Parker-Hannifin Corp	12.690	0,37
52	Paychex Inc	5.621	0,17
110	PayPal Holdings Inc	6.136	0,18
166	PDD Holdings Inc	21.947	0,64
35	PepsiCo Inc	5.362	0,16
19	Pinterest Inc	638	0,02
360	Poste Italiane SpA	3.695	0,11
255	Procter & Gamble Co	33.843	0,99
2.199	Prosus NV	59.352	1,74
257	QUALCOMM Inc	33.715	0,99
15	Regeneron Pharmaceuticals Inc	12.340	0,36
157	Roche Holding AG (Non-voting rights)	41.170	1,21
20	Rockwell Automation Inc	5.765	0,17
25	Royal Caribbean Cruises Ltd	2.931	0,09
398	RWE AG	16.377	0,48
100	Salesforce Inc	23.884	0,70
103	Samsara Inc	3.127	0,09
1.227	Sanofi	110.109	3,23
15	Schindler Holding AG (Voting rights)	3.290	0,10
995	Securitas AB	8.811	0,26
17	ServiceNow Inc	10.776	0,32
27	SGS SA	2.070	0,06
81	Siemens AG (Germany listed)	13.725	0,40
2.650	Societe Generale SA	63.671	1,87
181	Southern Co	11.508	0,34
106	Starbucks Corp	9.234	0,27
597	Stellantis NV (Italy listed)	12.624	0,37
96	Target Corp	12.352	0,36
43	TE Connectivity Ltd	5.459	0,16
454	TeamViewer SE	6.387	0,19
59	Tesla Inc	13.263	0,39
1.393	Teva Pharmaceutical Industries Ltd	13.447	0,39
115	Texas Instruments Inc	17.784	0,52
366	thyssenkrupp AG	2.313	0,07
4.063	TotalEnergies SE	250.285	7,35
220	Tower Semiconductor Ltd	6.128	0,18
79	Uber Technologies Inc	4.401	0,13
99	United Parcel Service Inc	14.096	0,41
24	United Rentals Inc	12.364	0,36

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2023**

EURO EQUITY DEFENSIVE COVERED CALL SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Aktien – 96,30 % (30. Juni 2023: 96,32 %) (Fortsetzung)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert EUR	% des Netto- inventarwerts
26	UnitedHealth Group Inc	12.268	0,36
2	VeriSign Inc	457	0,01
50	Vertex Pharmaceuticals Inc	18.439	0,54
161	Vinci SA	18.329	0,54
112	Walgreens Boots Alliance Inc	2.637	0,08
267	Wartsila OYJ Abp	3.509	0,10
13	West Pharmaceutical Services Inc	4.292	0,13
316	Westrock Co	11.892	0,35
5	Workday Inc	1.175	0,03
6	WW Grainger Inc	4.420	0,13
17	Zoetis Inc	3.041	0,09
17	Zoom Video Communications Inc	1.109	0,03
Aktien insgesamt		3.280.656	96,30

Funded Swaps* – 0,40 % (30. Juni 2023: 0,40 %)

Wäh- rung	Nominalbetrag	Bezeichnung	Fälligkeitstag	Zeitwert EUR	% des Netto- inventarwerts
EUR	107	Euro Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF Klasse A EUR	31. Jul 24	13.627	0,40
Funded Swaps zum beizulegenden Zeitwert				13.627	0,40

Unfunded Swaps* – 3,30 % (30. Juni 2023: 3,26 %)

Wäh- rung	Nominalbetrag	Bezeichnung	Fälligkeitstag	Zeitwert EUR	% des Netto- inventarwerts
EUR	26.642	Euro Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF Total Return Swap Klasse A EUR	31. Jul 24	112.421	3,30
Unfunded Swaps zum beizulegenden Zeitwert				112.421	3,30

Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten

Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnendes Nettovermögen **3.406.704** **100,00**

Einstufung

* Im Freiverkehr gehandelte derivative Finanzinstrumente.

Gegenpartei der Swap-Kontrakte ist die UBS AG.

	% des Gesamtver- mögens
Analyse des Gesamtvermögens	
Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind	90,20
Im Freiverkehr gehandelte derivative Finanzinstrumente	3,47
Sonstige Vermögenswerte	6,33
	100,00

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2023**

EURO EQUITY DEFENSIVE PUT WRITE SF UCITS ETF

Aktien – 96,33 % (30. Juni 2023: 98,08 %)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert EUR	% des Netto- inventar- werts
937	3M Co	92.744	0,30
1.647	Achillion Pharmaceuticals Inc	-	0,00
49	adidas AG	8.952	0,03
1.668	Adobe Inc	900.895	2,96
6.452	Advanced Micro Devices Inc	860.921	2,83
644	Air Liquide SA	113.374	0,37
1.187	Alcon Inc	83.790	0,28
4.930	Alphabet Inc - Class A	623.420	2,05
4.512	Alphabet Inc - Class C	575.586	1,89
11.873	Amazon.com Inc	1.633.021	5,36
383	American Water Works Co Inc	45.783	0,15
559	Amgen Inc	145.770	0,48
3.471	Amot Investments Ltd	16.998	0,06
38	ANSYS Inc	12.605	0,04
9.991	Apple Inc	1.741.420	5,72
1.937	Applied Materials Inc	284.131	0,93
10.925	ArcelorMittal SA	280.497	0,92
99	Arista Networks Inc	21.041	0,07
428	ASML Holding NV	291.800	0,96
10.524	Atlas Copco AB - Class B	141.235	0,46
1.842	AXA SA	54.313	0,18
617	Azrieli Group Ltd	36.337	0,12
293	Baozun Inc	726	0,00
5.526	BASF SE	269.576	0,88
89	Bayerische Motoren Werke AG (Voting rights)	8.929	0,03
33.400	Bezeq The Israeli Telecommunication Corp Ltd	41.363	0,14
9.879	BNP Paribas SA	618.317	2,03
7	Booking Holdings Inc	22.096	0,07
617	Boston Scientific Corp	32.265	0,11
60	Bouygues SA	2.048	0,01
445	Broadcom Inc	449.725	1,48
25	Cadence Design Systems Inc	6.265	0,02
1.992	Carrefour SA	32.999	0,11
581	CF Industries Holdings Inc	41.788	0,14
101	Check Point Software Technologies Ltd	13.929	0,05
6	Chipotle Mexican Grill Inc	12.285	0,04
1.282	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA	41.598	0,14
189	Cintas Corp	102.851	0,34
2.376	Citigroup Inc	110.659	0,36
2.670	Commerzbank AG	28.733	0,09
1.305	Consolidated Edison Inc	107.473	0,35
1.424	Covestro AG	75.025	0,25
3.501	Credit Agricole SA	44.994	0,15
110	Crowdstrike Holdings Inc	25.423	0,08
189	Cummins Inc	41.004	0,13
1.347	CVS Health Corp	96.277	0,32
80	CyberArk Software Ltd	15.885	0,05
1.965	Danone SA	115.304	0,38
2.652	Dell Technologies Inc	183.654	0,60
522	Deutsche Boerse AG	97.263	0,32
2.236	Deutsche Post AG	100.281	0,33

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2023**

EURO EQUITY DEFENSIVE PUT WRITE SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Aktien – 96,33 % (30. Juni 2023: 98,08 %) (Fortsetzung)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert EUR	% des Netto- inventar- werts
438	Dollar Tree Inc	56.304	0,18
197	Dropbox Inc	5.257	0,02
8.936	E.ON SE	108.575	0,36
464	eBay Inc	18.340	0,06
497	Eli Lilly & Co	261.995	0,86
59.044	Enel SpA	397.363	1,30
18.339	Eni SpA	281.463	0,92
2.025	Enlight Renewable Energy Ltd	35.714	0,12
273	Euronext NV	21.500	0,07
1.632	Evonik Industries AG	30.189	0,10
178	EXOR NV	16.111	0,05
194	F5 Inc	31.508	0,10
166	Farfetch Ltd	3	0,00
97	Fortinet Inc	5.116	0,02
94	GEA Group AG	3.560	0,01
266	Hilton Worldwide Holdings Inc	43.898	0,14
651	Home Depot Inc	204.202	0,67
671	HP Inc	18.289	0,06
13	IDEXX Laboratories Inc	6.667	0,02
56	Incyte Corp	3.204	0,01
10.960	Infineon Technologies AG	414.271	1,36
5.670	ING Groep NV	76.688	0,25
185	Insulet Corp	36.399	0,12
3.518	Intel Corp	160.019	0,53
803	International Business Machines Corp	118.897	0,39
1.973	International Paper Co	64.561	0,21
320.594	Intesa Sanpaolo SpA	847.491	2,78
104	Intuitive Surgical Inc	31.747	0,10
4.876	Investor AB - Class B	102.281	0,34
69	Israel Corp Ltd	15.912	0,05
2.961	Johnson & Johnson	420.141	1,38
10.917	Just Eat Takeaway.com NV	150.453	0,49
1.545	K+S AG	22.115	0,07
506	Keysight Technologies Inc	72.872	0,24
213	KLA Corp	111.974	0,37
2.374	Koninklijke Ahold Delhaize NV	61.749	0,20
131	Laboratory Corp of America Holdings	26.929	0,09
133	Lam Research Corp	94.231	0,31
790	Liberty Global Ltd - Class A	12.701	0,04
289	Lonza Group AG	110.114	0,36
815	Marathon Petroleum Corp	109.402	0,36
561	Marriott International Inc	114.602	0,38
2.387	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA	26.750	0,09
742	Mercedes-Benz Group AG	46.397	0,15
257	Merck KGaA	37.050	0,12
2.251	Meta Platforms Inc	721.224	2,37
4.581	Microsoft Corp	1.559.482	5,12
59	Moderna Inc	5.342	0,02
537	Monster Beverage Corp	28.012	0,09
267	MTU Aero Engines AG	52.192	0,17
275	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen	103.124	0,34

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2023**

EURO EQUITY DEFENSIVE PUT WRITE SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Aktien – 96,33 % (30. Juni 2023: 98,08 %) (Fortsetzung)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert EUR	% des Netto- inventar- werts
1.433	Nestle SA	150.292	0,49
580	Netflix Inc	255.633	0,84
297	New Oriental Education & Technology Group Inc	19.682	0,06
1.115	Nice Ltd	204.339	0,67
1.858	NN Group NV	66.422	0,22
473	Nova Ltd	59.641	0,20
1.698	Novartis AG	155.007	0,51
768	NVIDIA Corp	344.278	1,13
1.780	Oracle Corp	169.907	0,56
99.648	Orange SA	1.026.774	3,37
19	O'Reilly Automotive Inc	16.554	0,05
586	Palo Alto Networks Inc	156.525	0,51
272	Parker-Hannifin Corp	113.521	0,37
466	Paychex Inc	50.284	0,17
987	PayPal Holdings Inc	54.890	0,18
1.482	PDD Holdings Inc	196.332	0,64
312	PepsiCo Inc	47.964	0,16
170	Pinterest Inc	5.711	0,02
3.217	Poste Italiane SpA	33.058	0,11
2.282	Procter & Gamble Co	302.752	0,99
19.676	Prosus NV	530.953	1,74
2.304	QUALCOMM Inc	301.609	0,99
139	Regeneron Pharmaceuticals Inc	110.400	0,36
1.400	Roche Holding AG (Non-voting rights)	368.300	1,21
184	Rockwell Automation Inc	51.573	0,17
224	Royal Caribbean Cruises Ltd	26.221	0,09
3.558	RWE AG	146.503	0,48
897	Salesforce Inc	213.666	0,70
926	Samsara Inc	27.973	0,09
10.974	Sanofi	985.026	3,23
130	Schindler Holding AG (Voting rights)	29.437	0,10
8.901	Securitas AB	78.820	0,26
151	ServiceNow Inc	96.399	0,32
237	SGS SA	18.520	0,06
723	Siemens AG (Germany listed)	122.778	0,40
23.708	Societe Generale SA	569.595	1,87
1.622	Southern Co	102.954	0,34
950	Starbucks Corp	82.608	0,27
5.340	Stellantis NV (Italy listed)	112.935	0,37
857	Target Corp	110.499	0,36
384	TE Connectivity Ltd	48.833	0,16
4.064	TeamViewer SE	57.140	0,19
527	Tesla Inc	118.648	0,39
12.461	Teva Pharmaceutical Industries Ltd	120.300	0,40
1.031	Texas Instruments Inc	159.097	0,52
3.278	thyssenkrupp AG	20.693	0,07
36.348	TotalEnergies SE	2.239.021	7,35
1.970	Tower Semiconductor Ltd	54.818	0,18
706	Uber Technologies Inc	39.372	0,13
886	United Parcel Service Inc	126.105	0,41
213	United Rentals Inc	110.605	0,36

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2023**

EURO EQUITY DEFENSIVE PUT WRITE SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Aktien – 96,33 % (30. Juni 2023: 98,08 %) (Fortsetzung)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert EUR	% des Netto- inventarwerts
230	UnitedHealth Group Inc	109.750	0,36
22	VeriSign Inc	4.087	0,01
448	Vertex Pharmaceuticals Inc	164.952	0,54
1.442	Vinci SA	163.965	0,54
998	Walgreens Boots Alliance Inc	23.592	0,08
2.392	Wartsila OYJ Abp	31.395	0,10
120	West Pharmaceutical Services Inc	38.401	0,13
2.830	Westrock Co	106.383	0,35
42	Workday Inc	10.515	0,03
53	WW Grainger Inc	39.541	0,13
152	Zoetis Inc	27.206	0,09
152	Zoom Video Communications Inc	9.924	0,03
Aktien insgesamt		29.348.426	96,33

Funded Swaps* – 0,40 % (30. Juni 2023: 0,40 %)

Wäh- rung	Nominalbetrag	Bezeichnung	Fälligkeitstag	Zeitwert EUR	% des Netto- inventarwerts
EUR	925	Euro Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF Klasse A EUR	31. Jul 24	121.864	0,40
Funded Swaps zum beizulegenden Zeitwert				121.864	0,40

Unfunded Swaps* – 3,27 % (30. Juni 2023: 1,50 %)

Wäh- rung	Nominalbetrag	Bezeichnung	Fälligkeitstag	Zeitwert EUR	% des Netto- inventarwerts
EUR	230.312	Euro Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF Total Return Swap Klasse A EUR	31. Jul 24	995.670	3,27
Unfunded Swaps zum beizulegenden Zeitwert				995.670	3,27

Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten

Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnendes Nettovermögen **30.465.960** **100,00**

Einstufung

* Im Freiverkehr gehandelte derivative Finanzinstrumente.

Gegenpartei der Swap-Kontrakte ist die UBS AG.

	% des Gesamtver- mögens
Analyse des Gesamtvermögens	
Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind	91,88
Im Freiverkehr gehandelte derivative Finanzinstrumente	3,50
Sonstige Vermögenswerte	4,62
	100,00

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2023**

US EQUITY DEFENSIVE COVERED CALL SF UCITS ETF

Aktien – 96,10 % (30. Juni 2023: 97,59 %)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
121	3M Co	13.207	0,30
212	Achillion Pharmaceuticals Inc	-	0,00
6	adidas AG	1.275	0,03
215	Adobe Inc	128.288	2,95
832	Advanced Micro Devices Inc	122.596	2,82
83	Air Liquide SA	16.144	0,37
153	Alcon Inc	11.932	0,27
636	Alphabet Inc - Class A	88.776	2,04
582	Alphabet Inc - Class C	81.964	1,88
1.531	Amazon.com Inc	232.543	5,35
49	American Water Works Co Inc	6.520	0,15
72	Amgen Inc	20.758	0,48
447	Amot Investments Ltd	2.421	0,06
5	ANSYS Inc	1.795	0,04
1.288	Apple Inc	247.980	5,70
250	Applied Materials Inc	40.460	0,93
1.408	ArcelorMittal SA	39.943	0,92
13	Arista Networks Inc	2.996	0,07
55	ASML Holding NV	41.553	0,96
1.357	Atlas Copco AB - Class B	20.112	0,46
237	AXA SA	7.734	0,18
80	Azrieli Group Ltd	5.174	0,12
38	Baozun Inc	103	0,00
712	BASF SE	38.388	0,88
11	Bayerische Motoren Werke AG (Voting rights)	1.272	0,03
4.306	Bezeq The Israeli Telecommunication Corp Ltd	5.890	0,14
1.274	BNP Paribas SA	88.049	2,02
1	Booking Holdings Inc	3.146	0,07
79	Boston Scientific Corp	4.595	0,11
8	Bouygues SA	292	0,01
57	Broadcom Inc	64.041	1,47
3	Cadence Design Systems Inc	892	0,02
257	Carrefour SA	4.699	0,11
75	CF Industries Holdings Inc	5.951	0,14
13	Check Point Software Technologies Ltd	1.984	0,05
1	Chipotle Mexican Grill Inc	1.750	0,04
165	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA	5.924	0,14
24	Cintas Corp	14.646	0,34
306	Citigroup Inc	15.758	0,36
344	Commerzbank AG	4.092	0,09
168	Consolidated Edison Inc	15.304	0,35
184	Covestro AG	10.684	0,25
451	Credit Agricole SA	6.407	0,15
14	Crowdstrike Holdings Inc	3.620	0,08
24	Cummins Inc	5.839	0,13
174	CVS Health Corp	13.710	0,31
10	CyberArk Software Ltd	2.262	0,05
253	Danone SA	16.419	0,38
342	Dell Technologies Inc	26.153	0,60
67	Deutsche Boerse AG	13.850	0,32
288	Deutsche Post AG	14.280	0,33

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2023**

US EQUITY DEFENSIVE COVERED CALL SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Aktien – 96,10 % (30. Juni 2023: 97,59 %) (Fortsetzung)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
56	Dollar Tree Inc	8.018	0,18
25	Dropbox Inc	749	0,02
1.152	E.ON SE	15.461	0,36
60	eBay Inc	2.612	0,06
64	Eli Lilly & Co	37.308	0,86
7.611	Enel SpA	56.585	1,30
2.364	Eni SpA	40.081	0,92
261	Enlight Renewable Energy Ltd	5.086	0,12
35	Euronext NV	3.062	0,07
210	Evonik Industries AG	4.299	0,10
23	EXOR NV	2.294	0,05
25	F5 Inc	4.487	0,10
21	Farfetch Ltd	-	0,00
12	Fortinet Inc	729	0,02
12	GEA Group AG	507	0,01
34	Hilton Worldwide Holdings Inc	6.251	0,14
84	Home Depot Inc	29.079	0,67
87	HP Inc	2.604	0,06
2	IDEXX Laboratories Inc	949	0,02
7	Incyte Corp	456	0,01
1.413	Infineon Technologies AG	58.992	1,36
731	ING Groep NV	10.920	0,25
24	Insulet Corp	5.183	0,12
453	Intel Corp	22.787	0,52
104	International Business Machines Corp	16.931	0,39
254	International Paper Co	9.193	0,21
41.328	Intesa Sanpaolo SpA	120.683	2,77
13	Intuitive Surgical Inc	4.521	0,10
629	Investor AB - Class B	14.565	0,33
9	Israel Corp Ltd	2.266	0,05
382	Johnson & Johnson	59.828	1,38
1.407	Just Eat Takeaway.com NV	21.425	0,49
199	K+S AG	3.149	0,07
65	Keysight Technologies Inc	10.377	0,24
27	KLA Corp	15.945	0,37
306	Koninklijke Ahold Delhaize NV	8.793	0,20
17	Laboratory Corp of America Holdings	3.835	0,09
17	Lam Research Corp	13.419	0,31
102	Liberty Global Ltd - Class A	1.809	0,04
37	Lonza Group AG	15.680	0,36
105	Marathon Petroleum Corp	15.579	0,36
72	Marriott International Inc	16.319	0,37
308	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA	3.809	0,09
96	Mercedes-Benz Group AG	6.607	0,15
33	Merck KGaA	5.276	0,12
290	Meta Platforms Inc	102.703	2,36
591	Microsoft Corp	222.072	5,11
8	Moderna Inc	761	0,02
69	Monster Beverage Corp	3.989	0,09
34	MTU Aero Engines AG	7.432	0,17
35	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen	14.685	0,34

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2023**

US EQUITY DEFENSIVE COVERED CALL SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Aktien – 96,10 % (30. Juni 2023: 97,59 %) (Fortsetzung)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
185	Nestle SA	21.402	0,49
75	Netflix Inc	36.403	0,84
38	New Oriental Education & Technology Group Inc	2.803	0,06
144	Nice Ltd	29.098	0,67
240	NN Group NV	9.459	0,22
61	Nova Ltd	8.493	0,20
219	Novartis AG	22.073	0,51
99	NVIDIA Corp	49.025	1,13
230	Oracle Corp	24.195	0,56
12.846	Orange SA	146.213	3,36
2	O'Reilly Automotive Inc	2.357	0,05
76	Palo Alto Networks Inc	22.289	0,51
35	Parker-Hannifin Corp	16.166	0,37
60	Paychex Inc	7.160	0,16
127	PayPal Holdings Inc	7.816	0,18
191	PDD Holdings Inc	27.958	0,64
40	PepsiCo Inc	6.830	0,16
22	Pinterest Inc	813	0,02
415	Poste Italiane SpA	4.707	0,11
294	Procter & Gamble Co	43.112	0,99
2.536	Prosus NV	75.608	1,74
297	QUALCOMM Inc	42.949	0,99
18	Regeneron Pharmaceuticals Inc	15.721	0,36
181	Roche Holding AG (Non-voting rights)	52.446	1,21
24	Rockwell Automation Inc	7.344	0,17
29	Royal Caribbean Cruises Ltd	3.734	0,09
459	RWE AG	20.862	0,48
116	Salesforce Inc	30.426	0,70
119	Samsara Inc	3.983	0,09
1.415	Sanofi	140.268	3,23
17	Schindler Holding AG (Voting rights)	4.192	0,10
1.147	Securitas AB	11.224	0,26
19	ServiceNow Inc	13.727	0,32
31	SGS SA	2.637	0,06
93	Siemens AG (Germany listed)	17.484	0,40
3.056	Societe Generale SA	81.111	1,86
209	Southern Co	14.661	0,34
123	Starbucks Corp	11.763	0,27
688	Stellantis NV (Italy listed)	16.082	0,37
111	Target Corp	15.735	0,36
50	TE Connectivity Ltd	6.954	0,16
524	TeamViewer SE	8.137	0,19
68	Tesla Inc	16.896	0,39
1.606	Teva Pharmaceutical Industries Ltd	17.131	0,39
133	Texas Instruments Inc	22.655	0,52
423	thyssenkrupp AG	2.947	0,07
4.686	TotalEnergies SE	318.838	7,33
254	Tower Semiconductor Ltd	7.806	0,18
91	Uber Technologies Inc	5.607	0,13
114	United Parcel Service Inc	17.957	0,41
27	United Rentals Inc	15.750	0,36

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2023**

US EQUITY DEFENSIVE COVERED CALL SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Aktien – 96,10 % (30. Juni 2023: 97,59 %) (Fortsetzung)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventarwerts
30	UnitedHealth Group Inc	15.628	0,36
3	VeriSign Inc	582	0,01
58	Vertex Pharmaceuticals Inc	23.489	0,54
186	Vinci SA	23.349	0,54
129	Walgreens Boots Alliance Inc	3.360	0,08
308	Wartsila OYJ Abp	4.471	0,10
16	West Pharmaceutical Services Inc	5.468	0,13
365	Westrock Co	15.149	0,35
5	Workday Inc	1.497	0,03
7	WW Grainger Inc	5.631	0,13
20	Zoetis Inc	3.874	0,09
20	Zoom Video Communications Inc	1.413	0,03
Aktien insgesamt		4.179.239	96,10

Funded Swaps* – 0,40 % (30. Juni 2023: 0,40 %)

Wäh- rung	Nominalbetrag	Bezeichnung	Fälligkeitstag	Zeitwert USD	% des Netto- inventarwerts
USD	117	US Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF Klasse A USD	31. Jul 24	17.395	0,40
Funded Swaps zum beizulegenden Zeitwert				17.395	0,40

Unfunded Swaps* – 3,50 % (30. Juni 2023: 2,00 %)

Wäh- rung	Nominalbetrag	Bezeichnung	Fälligkeitstag	Zeitwert USD	% des Netto- inventarwerts
USD	29.102	US Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF Total Return Swap Klasse A USD	31. Jul 24	152.027	3,50
Unfunded Swaps zum beizulegenden Zeitwert				152.027	3,50

Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten

Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnendes Nettovermögen **4.348.661** **100,00**

Einstufung

* Im Freiverkehr gehandelte derivative Finanzinstrumente.

Gegenpartei der Swap-Kontrakte ist die UBS AG.

	% des Gesamtver- mögens
Analyse des Gesamtvermögens	
Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind	90,69
Im Freiverkehr gehandelte derivative Finanzinstrumente	3,68
Sonstige Vermögenswerte	5,63
	100,00

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2023**

US EQUITY DEFENSIVE PUT WRITE SF UCITS ETF

Aktien – 96,19 % (30. Juni 2023: 97,79 %)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
500	3M Co	54.644	0,30
878	Achillion Pharmaceuticals Inc	-	0,00
26	adidas AG	5.275	0,03
890	Adobe Inc	530.806	2,95
3.441	Advanced Micro Devices Inc	507.253	2,82
343	Air Liquide SA	66.799	0,37
633	Alcon Inc	49.369	0,27
2.630	Alphabet Inc - Class A	367.318	2,04
2.406	Alphabet Inc - Class C	339.134	1,89
6.333	Amazon.com Inc	962.173	5,35
204	American Water Works Co Inc	26.975	0,15
298	Amgen Inc	85.887	0,48
1.851	Amot Investments Ltd	10.015	0,06
20	ANSYS Inc	7.427	0,04
5.329	Apple Inc	1.026.041	5,71
1.033	Applied Materials Inc	167.410	0,93
5.827	ArcelorMittal SA	165.268	0,92
53	Arista Networks Inc	12.397	0,07
228	ASML Holding NV	171.928	0,96
5.613	Atlas Copco AB - Class B	83.215	0,46
982	AXA SA	32.001	0,18
329	Azrieli Group Ltd	21.410	0,12
156	Baozun Inc	428	0,00
2.948	BASF SE	158.834	0,88
47	Bayerische Motoren Werke AG (Voting rights)	5.261	0,03
17.815	Bezeq The Israeli Telecommunication Corp Ltd	24.371	0,14
5.269	BNP Paribas SA	364.311	2,03
4	Booking Holdings Inc	13.018	0,07
329	Boston Scientific Corp	19.011	0,11
32	Bouygues SA	1.207	0,01
237	Broadcom Inc	264.978	1,47
14	Cadence Design Systems Inc	3.691	0,02
1.063	Carrefour SA	19.443	0,11
310	CF Industries Holdings Inc	24.621	0,14
54	Check Point Software Technologies Ltd	8.207	0,05
3	Chipotle Mexican Grill Inc	7.238	0,04
684	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA	24.510	0,14
101	Cintas Corp	60.599	0,34
1.267	Citigroup Inc	65.200	0,36
1.424	Commerzbank AG	16.929	0,09
696	Consolidated Edison Inc	63.323	0,35
760	Covestro AG	44.205	0,25
1.867	Credit Agricole SA	26.510	0,15
59	Crowdstrike Holdings Inc	14.979	0,08
101	Cummins Inc	24.160	0,13
718	CVS Health Corp	56.726	0,32
43	CyberArk Software Ltd	9.360	0,05
1.048	Danone SA	67.937	0,38
1.415	Dell Technologies Inc	108.209	0,60
278	Deutsche Boerse AG	57.307	0,32
1.192	Deutsche Post AG	59.085	0,33

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2023**

US EQUITY DEFENSIVE PUT WRITE SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Aktien – 96,19 % (30. Juni 2023: 97,79 %) (Fortsetzung)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
234	Dollar Tree Inc	33.174	0,18
105	Dropbox Inc	3.097	0,02
4.766	E.ON SE	63.972	0,36
248	eBay Inc	10.806	0,06
265	Eli Lilly & Co	154.367	0,86
31.493	Enel SpA	234.126	1,30
9.782	Eni SpA	165.837	0,92
1.080	Enlight Renewable Energy Ltd	21.042	0,12
146	Euronext NV	12.668	0,07
870	Evonik Industries AG	17.787	0,10
95	EXOR NV	9.493	0,05
104	F5 Inc	18.564	0,10
88	Farfetch Ltd	2	0,00
52	Fortinet Inc	3.015	0,02
50	GEA Group AG	2.098	0,01
142	Hilton Worldwide Holdings Inc	25.865	0,14
347	Home Depot Inc	120.315	0,67
358	HP Inc	10.776	0,06
7	IDEXX Laboratories Inc	3.928	0,02
30	Incyte Corp	1.888	0,01
5.846	Infineon Technologies AG	244.087	1,36
3.024	ING Groep NV	45.184	0,25
99	Insulet Corp	21.446	0,12
1.876	Intel Corp	94.283	0,52
428	International Business Machines Corp	70.054	0,39
1.052	International Paper Co	38.039	0,21
170.999	Intesa Sanpaolo SpA	499.340	2,78
55	Intuitive Surgical Inc	18.705	0,10
2.601	Investor AB - Class B	60.264	0,33
37	Israel Corp Ltd	9.375	0,05
1.579	Johnson & Johnson	247.546	1,38
5.823	Just Eat Takeaway.com NV	88.647	0,49
824	K+S AG	13.030	0,07
270	Keysight Technologies Inc	42.936	0,24
113	KLA Corp	65.975	0,37
1.266	Koninklijke Ahold Delhaize NV	36.383	0,20
70	Laboratory Corp of America Holdings	15.867	0,09
71	Lam Research Corp	55.521	0,31
421	Liberty Global Ltd - Class A	7.484	0,04
154	Lonza Group AG	64.879	0,36
434	Marathon Petroleum Corp	64.460	0,36
299	Marriott International Inc	67.524	0,38
1.273	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA	15.761	0,09
396	Mercedes-Benz Group AG	27.337	0,15
137	Merck KGaA	21.830	0,12
1.201	Meta Platforms Inc	424.944	2,36
2.443	Microsoft Corp	918.844	5,11
32	Moderna Inc	3.148	0,02
286	Monster Beverage Corp	16.505	0,09
143	MTU Aero Engines AG	30.751	0,17
147	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen	60.760	0,34

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2023**

US EQUITY DEFENSIVE PUT WRITE SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Aktien – 96,19 % (30. Juni 2023: 97,79 %) (Fortsetzung)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
764	Nestle SA	88.551	0,49
309	Netflix Inc	150.618	0,84
158	New Oriental Education & Technology Group Inc	11.597	0,06
595	Nice Ltd	120.396	0,67
991	NN Group NV	39.136	0,22
252	Nova Ltd	35.140	0,20
906	Novartis AG	91.330	0,51
410	NVIDIA Corp	202.848	1,13
950	Oracle Corp	100.109	0,56
53.150	Orange SA	604.974	3,37
10	O'Reilly Automotive Inc	9.754	0,05
313	Palo Alto Networks Inc	92.224	0,51
145	Parker-Hannifin Corp	66.886	0,37
249	Paychex Inc	29.627	0,16
527	PayPal Holdings Inc	32.341	0,18
791	PDD Holdings Inc	115.679	0,64
166	PepsiCo Inc	28.260	0,16
91	Pinterest Inc	3.365	0,02
1.716	Poste Italiane SpA	19.478	0,11
1.217	Procter & Gamble Co	178.381	0,99
10.495	Prosus NV	312.837	1,74
1.229	QUALCOMM Inc	177.708	0,99
74	Regeneron Pharmaceuticals Inc	65.048	0,36
747	Roche Holding AG (Non-voting rights)	217.002	1,21
98	Rockwell Automation Inc	30.386	0,17
119	Royal Caribbean Cruises Ltd	15.449	0,09
1.898	RWE AG	86.319	0,48
478	Salesforce Inc	125.892	0,70
494	Samsara Inc	16.481	0,09
5.853	Sanofi	580.375	3,23
69	Schindler Holding AG (Voting rights)	17.344	0,10
4.748	Securitas AB	46.441	0,26
80	ServiceNow Inc	56.798	0,32
127	SGS SA	10.912	0,06
385	Siemens AG (Germany listed)	72.341	0,40
12.646	Societe Generale SA	335.604	1,87
865	Southern Co	60.660	0,34
507	Starbucks Corp	48.672	0,27
2.848	Stellantis NV (Italy listed)	66.541	0,37
457	Target Corp	65.106	0,36
205	TE Connectivity Ltd	28.772	0,16
2.168	TeamViewer SE	33.667	0,19
281	Tesla Inc	69.907	0,39
6.647	Teva Pharmaceutical Industries Ltd	70.880	0,39
550	Texas Instruments Inc	93.740	0,52
1.749	thyssenkrupp AG	12.192	0,07
19.387	TotalEnergies SE	1.319.227	7,34
1.051	Tower Semiconductor Ltd	32.299	0,18
377	Uber Technologies Inc	23.198	0,13
473	United Parcel Service Inc	74.301	0,41
114	United Rentals Inc	65.169	0,36

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2023**

US EQUITY DEFENSIVE PUT WRITE SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Aktien – 96,19 % (30. Juni 2023: 97,79 %) (Fortsetzung)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventarwerts
123	UnitedHealth Group Inc	64.664	0,36
12	VeriSign Inc	2.408	0,01
239	Vertex Pharmaceuticals Inc	97.190	0,54
769	Vinci SA	96.608	0,54
532	Walgreens Boots Alliance Inc	13.900	0,08
1.276	Wartsila OYJ Abp	18.498	0,10
64	West Pharmaceutical Services Inc	22.626	0,13
1.510	Westrock Co	62.681	0,35
22	Workday Inc	6.195	0,03
28	WW Grainger Inc	23.298	0,13
81	Zoetis Inc	16.030	0,09
81	Zoom Video Communications Inc	5.847	0,03
Aktien insgesamt		17.292.039	96,19

Funded Swaps* – 0,40 % (30. Juni 2023: 0,40 %)

Wäh- rung	Nominalbetrag	Bezeichnung	Fälligkeitstag	Zeitwert USD	% des Netto- inventarwerts
USD	561	US Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF Klasse A USD	31. Jul 24	71.905	0,40
Funded Swaps zum beizulegenden Zeitwert				71.905	0,40

Unfunded Swaps* – 3,41 % (30. Juni 2023: 1,80 %)

Wäh- rung	Nominalbetrag	Bezeichnung	Fälligkeitstag	Zeitwert USD	% des Netto- inventarwerts
USD	139.574	US Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF Total Return Swap Klasse A USD	31. Jul 24	612.237	3,41
Unfunded Swaps zum beizulegenden Zeitwert				612.237	3,41

Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten

Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnendes Nettovermögen **17.976.181** **100,00**

Einstufung

* Im Freiverkehr gehandelte derivative Finanzinstrumente.

Gegenpartei der Swap-Kontrakte ist die UBS AG.

	% des Gesamtver- mögens
Analyse des Gesamtvermögens	
Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind	91,65
Im Freiverkehr gehandelte derivative Finanzinstrumente	3,63
Sonstige Vermögenswerte	4,72
	100,00

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2023**

MSCI USA SF INDEX FUND

Aktien – 95,93 % (30. Juni 2023: 98,11 %)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
41.679	3M Co	4.556.334	0,30
73.235	Achillion Pharmaceuticals Inc	-	0,00
2.162	adidas AG	439.812	0,03
74.186	Adobe Inc	44.259.481	2,94
286.925	Advanced Micro Devices Inc	42.295.601	2,81
28.629	Air Liquide SA	5.569.855	0,37
52.782	Alcon Inc	4.116.460	0,27
219.254	Alphabet Inc - Class A	30.627.593	2,04
200.650	Alphabet Inc - Class C	28.277.590	1,88
528.021	Amazon.com Inc	80.227.584	5,34
17.041	American Water Works Co Inc	2.249.220	0,15
24.864	Amgen Inc	7.161.426	0,48
154.369	Amot Investments Ltd	835.098	0,06
1.707	ANSYS Inc	619.283	0,04
444.362	Apple Inc	85.553.033	5,69
86.129	Applied Materials Inc	13.958.895	0,93
485.875	ArcelorMittal SA	13.780.326	0,92
4.389	Arista Networks Inc	1.033.707	0,07
19.037	ASML Holding NV	14.335.666	0,95
468.050	Atlas Copco AB - Class B	6.938.644	0,46
81.910	AXA SA	2.668.313	0,18
27.448	Azrieli Group Ltd	1.785.174	0,12
13.016	Baozun Inc	35.664	0,00
245.780	BASF SE	13.243.818	0,88
3.940	Bayerische Motoren Werke AG (Voting rights)	438.677	0,03
1.485.456	Bezeq The Israeli Telecommunication Corp Ltd	2.032.091	0,13
439.353	BNP Paribas SA	30.376.876	2,02
306	Booking Holdings Inc	1.085.464	0,07
27.420	Boston Scientific Corp	1.585.138	0,11
2.669	Bouygues SA	100.604	0,01
19.793	Broadcom Inc	22.094.264	1,47
1.130	Cadence Design Systems Inc	307.760	0,02
88.596	Carrefour SA	1.621.183	0,11
25.824	CF Industries Holdings Inc	2.052.970	0,14
4.479	Check Point Software Technologies Ltd	684.300	0,05
264	Chipotle Mexican Grill Inc	603.554	0,04
56.995	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA	2.043.654	0,14
8.384	Cintas Corp	5.052.887	0,34
105.686	Citigroup Inc	5.436.469	0,36
118.760	Commerzbank AG	1.411.583	0,09
58.041	Consolidated Edison Inc	5.279.948	0,35
63.339	Covestro AG	3.685.858	0,24
155.699	Credit Agricole SA	2.210.458	0,15
4.892	Crowdstrike Holdings Inc	1.248.986	0,08
8.409	Cummins Inc	2.014.477	0,13
59.903	CVS Health Corp	4.729.937	0,31
3.563	CyberArk Software Ltd	780.430	0,05
87.390	Danone SA	5.664.706	0,38
117.943	Dell Technologies Inc	9.022.637	0,60
23.194	Deutsche Boerse AG	4.778.346	0,32
99.430	Deutsche Post AG	4.926.647	0,33

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2023**

MSCI USA SF INDEX FUND (Fortsetzung)

Aktien – 95,93 % (30. Juni 2023: 98,11 %) (Fortsetzung)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
19.473	Dollar Tree Inc	2.766.126	0,18
8.761	Dropbox Inc	258.264	0,02
397.429	E.ON SE	5.334.097	0,35
20.656	eBay Inc	901.021	0,06
22.081	Eli Lilly & Co	12.871.381	0,86
2.625.910	Enel SpA	19.521.793	1,30
815.599	Eni SpA	13.827.801	0,92
90.064	Enlight Renewable Energy Ltd	1.754.555	0,12
12.158	Euronext NV	1.056.259	0,07
72.575	Evonik Industries AG	1.483.153	0,10
7.917	EXOR NV	791.501	0,05
8.649	F5 Inc	1.547.929	0,10
7.365	Farfetch Ltd	164	0,00
4.295	Fortinet Inc	251.364	0,02
4.201	GEA Group AG	174.908	0,01
11.844	Hilton Worldwide Holdings Inc	2.156.634	0,14
28.948	Home Depot Inc	10.032.097	0,67
29.861	HP Inc	898.504	0,06
590	IDEXX Laboratories Inc	327.537	0,02
2.507	Incyte Corp	157.424	0,01
487.416	Infineon Technologies AG	20.352.419	1,35
252.154	ING Groep NV	3.767.557	0,25
8.241	Insulet Corp	1.788.219	0,12
156.447	Intel Corp	7.861.461	0,52
35.715	International Business Machines Corp	5.841.235	0,39
87.739	International Paper Co	3.171.757	0,21
14.258.140	Intesa Sanpaolo SpA	41.635.804	2,77
4.623	Intuitive Surgical Inc	1.559.678	0,10
216.873	Investor AB - Class B	5.024.875	0,33
3.060	Israel Corp Ltd	781.731	0,05
131.688	Johnson & Johnson	20.640.832	1,37
485.507	Just Eat Takeaway.com NV	7.391.504	0,49
68.731	K+S AG	1.086.462	0,07
22.503	Keysight Technologies Inc	3.580.065	0,24
9.463	KLA Corp	5.501.097	0,37
105.564	Koninklijke Ahold Delhaize NV	3.033.649	0,20
5.821	Laboratory Corp of America Holdings	1.322.982	0,09
5.910	Lam Research Corp	4.629.388	0,31
35.115	Liberty Global Ltd - Class A	623.996	0,04
12.873	Lonza Group AG	5.409.728	0,36
36.228	Marathon Petroleum Corp	5.374.756	0,36
24.967	Marriott International Inc	5.630.218	0,37
106.173	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA	1.314.162	0,09
32.989	Mercedes-Benz Group AG	2.279.391	0,15
11.435	Merck KGaA	1.820.200	0,12
100.103	Meta Platforms Inc	35.432.552	2,36
203.741	Microsoft Corp	76.614.748	5,10
2.639	Moderna Inc	262.459	0,02
23.888	Monster Beverage Corp	1.376.180	0,09
11.888	MTU Aero Engines AG	2.564.092	0,17
12.227	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen	5.066.301	0,34

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2023**

MSCI USA SF INDEX FUND (Fortsetzung)

Aktien – 95,93 % (30. Juni 2023: 98,11 %) (Fortsetzung)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
63.731	Nestle SA	7.383.570	0,49
25.794	Netflix Inc	12.558.821	0,84
13.196	New Oriental Education & Technology Group Inc	966.968	0,06
49.580	Nice Ltd	10.038.836	0,67
82.631	NN Group NV	3.263.203	0,22
21.018	Nova Ltd	2.930.070	0,19
75.520	Novartis AG	7.615.245	0,51
34.154	NVIDIA Corp	16.913.804	1,12
79.173	Oracle Corp	8.347.228	0,56
4.431.762	Orange SA	50.443.709	3,36
856	O'Reilly Automotive Inc	813.263	0,05
26.078	Palo Alto Networks Inc	7.689.821	0,51
12.106	Parker-Hannifin Corp	5.577.101	0,37
20.740	Paychex Inc	2.470.350	0,16
43.913	PayPal Holdings Inc	2.696.673	0,18
65.925	PDD Holdings Inc	9.645.467	0,64
13.874	PepsiCo Inc	2.356.390	0,16
7.575	Pinterest Inc	280.569	0,02
143.088	Poste Italiane SpA	1.624.084	0,11
101.499	Procter & Gamble Co	14.873.696	0,99
875.067	Prosus NV	26.084.845	1,74
102.452	QUALCOMM Inc	14.817.567	0,99
6.175	Regeneron Pharmaceuticals Inc	5.423.771	0,36
62.285	Roche Holding AG (Non-voting rights)	18.093.960	1,20
8.161	Rockwell Automation Inc	2.533.676	0,17
9.948	Royal Caribbean Cruises Ltd	1.288.181	0,09
158.223	RWE AG	7.197.465	0,48
39.892	Salesforce Inc	10.497.059	0,70
41.170	Samsara Inc	1.374.256	0,09
488.059	Sanofi	48.392.664	3,22
5.788	Schindler Holding AG (Voting rights)	1.446.182	0,10
395.866	Securitas AB	3.872.300	0,26
6.703	ServiceNow Inc	4.735.928	0,31
10.556	SGS SA	909.835	0,06
32.135	Siemens AG (Germany listed)	6.031.897	0,40
1.054.411	Societe Generale SA	27.983.240	1,86
72.133	Southern Co	5.057.936	0,34
42.270	Starbucks Corp	4.058.371	0,27
237.478	Stellantis NV (Italy listed)	5.548.290	0,37
38.117	Target Corp	5.428.642	0,36
17.075	TE Connectivity Ltd	2.399.095	0,16
180.744	TeamViewer SE	2.807.209	0,19
23.458	Tesla Inc	5.828.964	0,39
554.212	Teva Pharmaceutical Industries Ltd	5.910.120	0,39
45.853	Texas Instruments Inc	7.816.172	0,52
145.805	thyssenkrupp AG	1.016.631	0,07
1.616.533	TotalEnergies SE	109.999.363	7,32
87.604	Tower Semiconductor Ltd	2.693.135	0,18
31.416	Uber Technologies Inc	1.934.302	0,13
39.403	United Parcel Service Inc	6.195.319	0,41
9.476	United Rentals Inc	5.433.864	0,36

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2023**

MSCI USA SF INDEX FUND (Fortsetzung)

Aktien – 95,93 % (30. Juni 2023: 98,11 %) (Fortsetzung)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
10.241	UnitedHealth Group Inc	5.391.814	0,36
975	VeriSign Inc	200.815	0,01
19.917	Vertex Pharmaceuticals Inc	8.103.841	0,54
64.135	Vinci SA	8.055.327	0,54
44.390	Walgreens Boots Alliance Inc	1.159.024	0,08
106.381	Wartsila OYJ Abp	1.542.363	0,10
5.358	West Pharmaceutical Services Inc	1.886.582	0,13
125.877	Westrock Co	5.226.420	0,35
1.871	Workday Inc	516.580	0,03
2.344	WW Grainger Inc	1.942.604	0,13
6.772	Zoetis Inc	1.336.579	0,09
6.780	Zoom Video Communications Inc	487.568	0,03
Aktien insgesamt		1.441.839.115	95,93

Funded Swaps* – 0,40 % (30. Juni 2023: 0,36 %)

Wäh- rung	Nominalbetrag	Bezeichnung	Fälligkeitstag	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
CHF	51	MSCI USA SF Index Fund Klasse A CHF**	31. Jul 24	7.473	0,00
CHF	3.116	MSCI USA SF Index Fund Klasse A CHF**	31. Jul 24	467.835	0,03
EUR	154	MSCI USA SF Index Fund Klasse A EUR**	31. Jul 24	21.427	0,00
EUR	11.649	MSCI USA SF Index Fund Klasse A EUR**	31. Jul 24	1.674.003	0,11
GBP	10	MSCI USA SF Index Fund Klasse A GBP**	31. Jul 24	1.650	0,00
GBP	745	MSCI USA SF Index Fund Klasse A GBP**	31. Jul 24	126.735	0,01
USD	24.807	MSCI USA SF Index Fund Klasse A USD	31. Jul 24	3.494.654	0,23
USD	1.785	MSCI USA SF Index Fund Klasse A USD	31. Jul 24	243.452	0,02
Funded Swaps zum beizulegenden Zeitwert				6.037.229	0,40

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2023**

MSCI USA SF INDEX FUND (Fortsetzung)

Unfunded Swaps* – 3,67 % (30. Juni 2023: 2,13 %)

Wäh- rung	Nominalbetrag	Bezeichnung	Fälligkeitstag	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
CHF	12.819	MSCI USA SF Index Fund Total Return Swap Klasse A CHF**	31. Jul 24	61.317	0,00
CHF	779.905	MSCI USA SF Index Fund Total Return Swap Klasse A CHF**	31. Jul 24	3.860.842	0,26
EUR	38.292	MSCI USA SF Index Fund Total Return Swap Klasse A EUR**	31. Jul 24	180.441	0,01
EUR	2.854.891	MSCI USA SF Index Fund Total Return Swap Klasse A EUR**	31. Jul 24	13.849.431	0,92
GBP	2.490	MSCI USA SF Index Fund Total Return Swap Klasse A GBP**	31. Jul 24	15.268	0,00
GBP	185.616	MSCI USA SF Index Fund Total Return Swap Klasse A GBP**	31. Jul 24	1.173.969	0,08
USD	6.176.616	MSCI USA SF Index Fund Total Return Swap Klasse A USD	31. Jul 24	33.699.859	2,24
USD	442.478	MSCI USA SF Index Fund Total Return Swap Klasse A USD	31. Jul 24	2.336.014	0,16
Unfunded Swaps zum beizulegenden Zeitwert				55.177.141	3,67
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten				16	0,00
Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnendes Nettovermögen				1.503.053.501	100,00

Einstufung

* Im Freiverkehr gehandelte derivative Finanzinstrumente.

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

Gegenpartei der Swap-Kontrakte ist die UBS AG.

	% des Gesamtver- mögens
Analyse des Gesamtvermögens	
Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind	91,86
Im Freiverkehr gehandelte derivative Finanzinstrumente	3,90
Sonstige Vermögenswerte	4,24
	100,00

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2023**

CMCI COMMODITY CARRY EX-AGRICULTURE SF UCITS ETF

Aktien – 95,97 % (30. Juni 2023: 98,63 %)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
1.632	3M Co	178.368	0,30
2.867	Achillion Pharmaceuticals Inc	-	0,00
85	adidas AG	17.217	0,03
2.904	Adobe Inc	1.732.635	2,95
11.232	Advanced Micro Devices Inc	1.655.755	2,82
1.121	Air Liquide SA	218.044	0,37
2.066	Alcon Inc	161.148	0,27
8.583	Alphabet Inc - Class A	1.198.985	2,04
7.855	Alphabet Inc - Class C	1.106.989	1,88
20.671	Amazon.com Inc	3.140.685	5,34
667	American Water Works Co Inc	88.051	0,15
973	Amgen Inc	280.350	0,48
6.043	Amot Investments Ltd	32.692	0,06
67	ANSYS Inc	24.243	0,04
17.396	Apple Inc	3.349.162	5,69
3.372	Applied Materials Inc	546.452	0,93
19.021	ArcelorMittal SA	539.461	0,92
172	Arista Networks Inc	40.467	0,07
745	ASML Holding NV	561.202	0,95
18.323	Atlas Copco AB - Class B	271.629	0,46
3.207	AXA SA	104.457	0,18
1.075	Azrieli Group Ltd	69.885	0,12
510	Baozun Inc	1.396	0,00
9.622	BASF SE	518.458	0,88
154	Bayerische Motoren Werke AG (Voting rights)	17.173	0,03
58.151	Bezeq The Israeli Telecommunication Corp Ltd	79.551	0,13
17.199	BNP Paribas SA	1.189.170	2,02
12	Booking Holdings Inc	42.492	0,07
1.073	Boston Scientific Corp	62.054	0,11
105	Bouygues SA	3.938	0,01
775	Broadcom Inc	864.929	1,47
44	Cadence Design Systems Inc	12.048	0,02
3.468	Carrefour SA	63.465	0,11
1.011	CF Industries Holdings Inc	80.368	0,14
175	Check Point Software Technologies Ltd	26.788	0,05
10	Chipotle Mexican Grill Inc	23.627	0,04
2.231	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA	80.003	0,14
328	Cintas Corp	197.806	0,34
4.137	Citigroup Inc	212.823	0,36
4.649	Commerzbank AG	55.260	0,09
2.272	Consolidated Edison Inc	206.695	0,35
2.480	Covestro AG	144.291	0,25
6.095	Credit Agricole SA	86.533	0,15
192	Crowdstrike Holdings Inc	48.894	0,08
329	Cummins Inc	78.861	0,13
2.345	CVS Health Corp	185.164	0,31
139	CyberArk Software Ltd	30.552	0,05
3.421	Danone SA	221.757	0,38
4.617	Dell Technologies Inc	353.211	0,60
908	Deutsche Boerse AG	187.059	0,32
3.892	Deutsche Post AG	192.864	0,33

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2023**

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

Aktien – 95,97 % (30. Juni 2023: 98,63 %) (Fortsetzung)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
762	Dollar Tree Inc	108.286	0,18
343	Dropbox Inc	10.110	0,02
15.558	E.ON SE	208.815	0,35
809	eBay Inc	35.272	0,06
864	Eli Lilly & Co	503.878	0,86
102.797	Enel SpA	764.224	1,30
31.928	Eni SpA	541.320	0,92
3.526	Enlight Renewable Energy Ltd	68.686	0,12
476	Euronext NV	41.350	0,07
2.841	Evonik Industries AG	58.061	0,10
310	EXOR NV	30.985	0,05
339	F5 Inc	60.597	0,10
288	Farfetch Ltd	6	0,00
168	Fortinet Inc	9.840	0,02
164	GEA Group AG	6.847	0,01
464	Hilton Worldwide Holdings Inc	84.426	0,14
1.133	Home Depot Inc	392.728	0,67
1.169	HP Inc	35.174	0,06
23	IDEXX Laboratories Inc	12.822	0,02
98	Incyte Corp	6.163	0,01
19.081	Infineon Technologies AG	796.740	1,35
9.871	ING Groep NV	147.489	0,25
323	Insulet Corp	70.004	0,12
6.124	Intel Corp	307.754	0,52
1.398	International Business Machines Corp	228.668	0,39
3.435	International Paper Co	124.165	0,21
558.166	Intesa Sanpaolo SpA	1.629.925	2,77
181	Intuitive Surgical Inc	61.057	0,10
8.490	Investor AB - Class B	196.710	0,33
120	Israel Corp Ltd	30.603	0,05
5.155	Johnson & Johnson	808.031	1,37
19.006	Just Eat Takeaway.com NV	289.357	0,49
2.691	K+S AG	42.532	0,07
881	Keysight Technologies Inc	140.150	0,24
370	KLA Corp	215.352	0,37
4.133	Koninklijke Ahold Delhaize NV	118.759	0,20
228	Laboratory Corp of America Holdings	51.791	0,09
231	Lam Research Corp	181.228	0,31
1.375	Liberty Global Ltd - Class A	24.428	0,04
504	Lonza Group AG	211.776	0,36
1.418	Marathon Petroleum Corp	210.407	0,36
977	Marriott International Inc	220.407	0,37
4.156	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA	51.446	0,09
1.291	Mercedes-Benz Group AG	89.232	0,15
448	Merck KGaA	71.256	0,12
3.919	Meta Platforms Inc	1.387.085	2,36
7.976	Microsoft Corp	2.999.253	5,10
103	Moderna Inc	10.275	0,02
935	Monster Beverage Corp	53.874	0,09
465	MTU Aero Engines AG	100.377	0,17
479	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen	198.331	0,34

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2023**

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

Aktien – 95,97 % (30. Juni 2023: 98,63 %) (Fortsetzung)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
2.495	Nestle SA	289.046	0,49
1.010	Netflix Inc	491.643	0,84
517	New Oriental Education & Technology Group Inc	37.854	0,06
1.941	Nice Ltd	392.992	0,67
3.235	NN Group NV	127.745	0,22
823	Nova Ltd	114.704	0,19
2.956	Novartis AG	298.115	0,51
1.337	NVIDIA Corp	662.128	1,13
3.099	Oracle Corp	326.771	0,56
173.491	Orange SA	1.974.730	3,36
34	O'Reilly Automotive Inc	31.837	0,05
1.021	Palo Alto Networks Inc	301.035	0,51
474	Parker-Hannifin Corp	218.328	0,37
812	Paychex Inc	96.707	0,16
1.719	PayPal Holdings Inc	105.567	0,18
2.581	PDD Holdings Inc	377.593	0,64
543	PepsiCo Inc	92.246	0,16
297	Pinterest Inc	10.984	0,02
5.602	Poste Italiane SpA	63.578	0,11
3.973	Procter & Gamble Co	582.264	0,99
34.256	Prosus NV	1.021.149	1,74
4.011	QUALCOMM Inc	580.066	0,99
242	Regeneron Pharmaceuticals Inc	212.326	0,36
2.438	Roche Holding AG (Non-voting rights)	708.328	1,20
319	Rockwell Automation Inc	99.186	0,17
389	Royal Caribbean Cruises Ltd	50.429	0,09
6.194	RWE AG	281.761	0,48
1.562	Salesforce Inc	410.930	0,70
1.612	Samsara Inc	53.798	0,09
19.106	Sanofi	1.894.437	3,22
227	Schindler Holding AG (Voting rights)	56.614	0,10
15.497	Securitas AB	151.590	0,26
262	ServiceNow Inc	185.399	0,31
413	SGS SA	35.617	0,06
1.258	Siemens AG (Germany listed)	236.132	0,40
41.277	Societe Generale SA	1.095.466	1,86
2.824	Southern Co	198.004	0,34
1.655	Starbucks Corp	158.874	0,27
9.297	Stellantis NV (Italy listed)	217.200	0,37
1.492	Target Corp	212.516	0,36
668	TE Connectivity Ltd	93.918	0,16
7.076	TeamViewer SE	109.894	0,19
918	Tesla Inc	228.188	0,39
21.696	Teva Pharmaceutical Industries Ltd	231.365	0,39
1.795	Texas Instruments Inc	305.981	0,52
5.708	thyssenkrupp AG	39.798	0,07
63.283	TotalEnergies SE	4.306.167	7,32
3.429	Tower Semiconductor Ltd	105.429	0,18
1.230	Uber Technologies Inc	75.723	0,13
1.543	United Parcel Service Inc	242.529	0,41
371	United Rentals Inc	212.720	0,36

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2023**

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

Aktien – 95,97 % (30. Juni 2023: 98,63 %) (Fortsetzung)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
401	UnitedHealth Group Inc	211.074	0,36
38	VeriSign Inc	7.861	0,01
780	Vertex Pharmaceuticals Inc	317.243	0,54
2.511	Vinci SA	315.343	0,54
1.738	Walgreens Boots Alliance Inc	45.373	0,08
4.165	Wartsila OYJ Abp	60.379	0,10
210	West Pharmaceutical Services Inc	73.854	0,13
4.928	Westrock Co	204.600	0,35
73	Workday Inc	20.223	0,03
92	WW Grainger Inc	76.047	0,13
265	Zoetis Inc	52.323	0,09
265	Zoom Video Communications Inc	19.087	0,03
Aktien insgesamt		56.443.967	95,97

Funded Swaps* – 0,40 % (30. Juni 2023: 0,47 %)

Wäh- rung	Nominalbetrag	Bezeichnung	Fälligkeitstag	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
EUR	160	CMCI Commodity Carry Ex-Agriculture Klasse A EUR**	31. Jul 24	22.063	0,04
USD	1.619	CMCI Commodity Carry Ex-Agriculture Klasse A USD	31. Jul 24	213.186	0,36
Funded Swaps zum beizulegenden Zeitwert				235.249	0,40

Unfunded Swaps* – 3,63 % (30. Juni 2023: 0,89 %)

Wäh- rung	Nominalbetrag	Bezeichnung	Fälligkeitstag	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
EUR	39.840	CMCI Commodity Carry Ex-Agriculture Total Return Net Index Swap Klasse A EUR**	31. Jul 24	174.209	0,30
USD	403.129	CMCI Commodity Carry Ex-Agriculture Total Return Net Index Swap Klasse A USD	31. Jul 24	1.958.882	3,33
Unfunded Swaps zum beizulegenden Zeitwert				2.133.091	3,63

Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten

Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnendes Nettovermögen **58.812.307** **100,00**

Einstufung

* Im Freiverkehr gehandelte derivative Finanzinstrumente.

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

Gegenpartei der Swap-Kontrakte ist die UBS AG.

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2023**

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

	% des Gesamtver-
Analyse des Gesamtvermögens	mögens
Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind	93,04
Im Freiverkehr gehandelte derivative Finanzinstrumente	3,90
Sonstige Vermögenswerte	3,06
	<hr/>
	100,00
	<hr/>

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2023**

CMCI COMMODITY TRANSITION SF UCITS ETF

Aktien – 97,21 % (30. Juni 2023: 97,09 %)

Aktien	Bezeichnung	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
149	Adobe Inc	88.847	4,33
767	Advanced Micro Devices Inc	113.094	5,51
647	Alphabet Inc - Class A	90.412	4,40
580	Amazon.com Inc	88.080	4,29
233	Cadence Design Systems Inc	63.343	3,08
1.057	CVS Health Corp	83.425	4,06
1.255	Fortinet Inc	73.471	3,58
227	Intuitive Surgical Inc	76.608	3,73
271	Meta Platforms Inc	96.108	4,68
321	Microsoft Corp	120.716	5,88
189	Netflix Inc	91.970	4,48
805	Oracle Corp	84.907	4,13
96	O'Reilly Automotive Inc	91.340	4,45
583	PepsiCo Inc	98.953	4,82
978	Procter & Gamble Co	143.313	6,98
112	Regeneron Pharmaceuticals Inc	98.362	4,79
352	Salesforce Inc	92.735	4,52
8	Synopsys Inc	4.115	0,20
1.219	Target Corp	173.616	8,45
406	Texas Instruments Inc	69.213	3,37
105	UnitedHealth Group Inc	55.131	2,69
242	Vertex Pharmaceuticals Inc	98.450	4,79
Aktien insgesamt		1.996.209	97,21

Funded Swaps* – 0,40 % (30. Juni 2023: 3,21 %)

Wäh- rung	Nominalbetrag	Bezeichnung	Fälligkeitstag	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
USD	80	CMCI Commodity Transition Klasse A USD	31. Jul 24	8.240	0,40
Funded Swaps zum beizulegenden Zeitwert				8.240	0,40

Unfunded Swaps* – 2,39 % (30. Juni 2023: (0,29) %)

Wäh- rung	Nominalbetrag	Bezeichnung	Fälligkeitstag	Zeitwert USD	% des Netto- inventar- werts
USD	19.920	CMCI Commodity Transition Total Return Net Index Swap Klasse A USD	31. Jul 24	49.099	2,39
Unfunded Swaps zum beizulegenden Zeitwert				49.099	2,39

Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten

Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Aktien zuzurechnendes Nettovermögen **2.053.548** **100,00**

Einstufung

* Im Freiverkehr gehandelte derivative Finanzinstrumente.

Gegenpartei der Swap-Kontrakte ist die UBS AG.

**VERMÖGENSAUFSTELLUNG
ZUM 31. DEZEMBER 2023**

CMCI COMMODITY TRANSITION SF UCITS ETF (Fortsetzung)

	% des Gesamtver-
Analyse des Gesamtvermögens	mögens
Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind	97,16
Im Freiverkehr gehandelte derivative Finanzinstrumente	2,79
Sonstige Vermögenswerte	0,05
	<hr/>
	100,00
	<hr/>

**WESENTLICHE PORTFOLIOTRANSAKTIONEN
FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2023**

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

CMCI COMPOSITE SF UCITS ETF

Portfoliokäufe	Kosten USD	Portfolioverkäufe	Erlöse USD
Apple Inc	198.981.115	Apple Inc	(209.089.852)
Microsoft Corp	173.690.347	Microsoft Corp	(179.624.343)
Amazon.com Inc	107.709.635	NVIDIA Corp	(123.155.730)
NVIDIA Corp	97.639.243	Intel Corp	(82.475.261)
Telefonaktiebolaget LM Ericsson	65.188.792	Eni SpA	(79.181.642)
Intel Corp	57.914.354	Telefonaktiebolaget LM Ericsson	(65.040.059)
Intesa Sanpaolo SpA	56.428.833	Amazon.com Inc	(62.650.964)
Cisco Systems Inc	50.807.301	Cisco Systems Inc	(56.125.943)
Advanced Micro Devices Inc	50.177.055	Societe Generale SA	(52.177.638)
Eni SpA	49.597.484	Walmart Inc	(47.494.598)
QUALCOMM Inc	45.443.665	Procter & Gamble Co	(46.288.071)
Siemens AG (Germany listed)	42.682.458	UnitedHealth Group Inc	(43.098.492)
ASML Holding NV	39.033.870	Atlas Copco AB - Class A	(41.916.588)
Atlas Copco AB - Class A	36.852.256	Enel SpA	(40.260.855)
Walmart Inc	33.982.936	Alphabet Inc - Class A	(39.458.819)
Procter & Gamble Co	32.225.087	QUALCOMM Inc	(38.752.461)
Meta Platforms Inc	31.672.903	Exxon Mobil Corp	(38.471.281)
Adobe Inc	29.937.966	TotalEnergies SE	(37.951.034)
Prosus NV	29.307.754	Siemens AG (Germany listed)	(37.282.203)
SAP SE	28.326.702	AXA SA	(32.824.560)
Roche Holding AG (Non-voting rights)	27.696.472	Meta Platforms Inc	(30.592.559)
Broadcom Inc	27.479.572	Union Pacific Corp	(29.458.737)
Infineon Technologies AG	26.815.539	Tele2 AB	(29.107.298)
Texas Instruments Inc	25.694.744	BNP Paribas SA	(29.083.520)
Tele2 AB	24.843.754	Engie SA	(28.247.549)
Assa Abloy AB	24.107.774	SAP SE	(27.912.343)
Alphabet Inc - Class C	24.030.368	Assa Abloy AB	(27.315.394)
		Intesa Sanpaolo SpA	(25.183.420)
		ASML Holding NV	(24.612.850)
		Micron Technology Inc	(24.355.550)

**WESENTLICHE PORTFOLIOTRANSAKTIONEN (Fortsetzung)
FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2023**

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

BLOOMBERG COMMODITY INDEX SF UCITS ETF

Portfoliokäufe	Kosten USD	Portfolioverkäufe	Erlöse USD
Apple Inc	37.082.640	Apple Inc	(74.771.430)
Micron Technology Inc	31.634.251	Microsoft Corp	(55.662.347)
Salesforce Inc	28.024.174	Union Pacific Corp	(38.947.812)
Microsoft Corp	27.273.134	Intel Corp	(36.714.578)
Oracle Corp	26.657.500	NVIDIA Corp	(31.400.988)
CVS Health Corp	23.963.663	Micron Technology Inc	(27.654.704)
Intel Corp	21.606.480	PepsiCo Inc	(25.417.077)
Intuitive Surgical Inc	21.270.023	Walmart Inc	(24.927.754)
Vertex Pharmaceuticals Inc	19.809.737	Meta Platforms Inc	(21.262.625)
Target Corp	18.931.149	Salesforce Inc	(21.205.955)
Pinterest Inc	18.297.441	NRG Energy Inc	(21.166.340)
Netflix Inc	17.941.658	Amazon.com Inc	(18.947.143)
PayPal Holdings Inc	16.993.521	Procter & Gamble Co	(18.219.881)
QUALCOMM Inc	16.401.137	PayPal Holdings Inc	(17.315.477)
Walmart Inc	14.655.257	MercadoLibre Inc	(16.609.563)
Union Pacific Corp	12.995.707	Western Digital Corp	(15.913.019)
Procter & Gamble Co	12.489.223	QUALCOMM Inc	(15.708.759)
Regeneron Pharmaceuticals Inc	11.329.192	Intuitive Surgical Inc	(15.076.927)
Texas Instruments Inc	10.961.980	CVS Health Corp	(14.783.127)
Gartner Inc	10.605.307	Adobe Inc	(13.621.611)
UnitedHealth Group Inc	10.313.254	Oracle Corp	(13.496.858)
Amazon.com Inc	9.791.818	Pinterest Inc	(13.199.788)
NRG Energy Inc	9.671.922	Lululemon Athletica Inc	(13.117.202)
Advance Auto Parts Inc	9.629.720	Gartner Inc	(12.355.556)
Bristol-Myers Squibb Co	9.172.697	Fortinet Inc	(11.908.743)
Cisco Systems Inc	9.152.280	Synopsys Inc	(11.638.858)
Fortinet Inc	9.114.341	KLA Corp	(11.328.817)
Dell Technologies Inc	8.816.277	Alphabet Inc - Class A	(9.416.902)
O'Reilly Automotive Inc	7.767.496	Advance Auto Parts Inc	(9.152.143)
PepsiCo Inc	7.407.962	Emerson Electric Co	(8.964.512)
Advanced Micro Devices Inc	7.129.182	Vertex Pharmaceuticals Inc	(8.611.960)
Elevance Health Inc	6.712.728	Ferguson PLC (US listed)	(8.024.077)
NVIDIA Corp	6.681.128	Dell Technologies Inc	(7.855.002)
General Motors Co	5.979.561	Bristol-Myers Squibb Co	(7.803.762)
		PDD Holdings Inc	(7.760.288)

**WESENTLICHE PORTFOLIOTRANSAKTIONEN (Fortsetzung)
FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2023**

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

S&P 500 SF UCITS ETF

Portfoliokäufe	Kosten USD	Portfolioverkäufe	Erlöse USD
Apple Inc	20.430.049	Apple Inc	(21.010.778)
Microsoft Corp	17.867.158	Microsoft Corp	(18.106.358)
Amazon.com Inc	11.234.080	NVIDIA Corp	(12.582.064)
NVIDIA Corp	9.881.150	Intel Corp	(8.389.618)
Telefonaktiebolaget LM Ericsson	6.670.893	Eni SpA	(7.896.543)
Intel Corp	6.033.267	Telefonaktiebolaget LM Ericsson	(6.589.538)
Intesa Sanpaolo SpA	5.758.526	Amazon.com Inc	(6.237.471)
Cisco Systems Inc	5.373.491	Societe Generale SA	(5.648.108)
Advanced Micro Devices Inc	5.221.038	Cisco Systems Inc	(5.504.272)
Eni SpA	4.963.862	Procter & Gamble Co	(5.013.561)
QUALCOMM Inc	4.609.803	Walmart Inc	(4.814.221)
Siemens AG (Germany listed)	4.384.284	UnitedHealth Group Inc	(4.418.790)
ASML Holding NV	3.934.583	Atlas Copco AB - Class A	(4.331.640)
Atlas Copco AB - Class A	3.679.254	Enel SpA	(4.005.633)
Walmart Inc	3.462.480	QUALCOMM Inc	(3.902.655)
Meta Platforms Inc	3.225.769	Exxon Mobil Corp	(3.892.429)
Procter & Gamble Co	3.144.746	Alphabet Inc - Class A	(3.819.188)
Adobe Inc	3.052.063	Siemens AG (Germany listed)	(3.723.174)
Prosus NV	2.981.343	TotalEnergies SE	(3.652.205)
SAP SE	2.937.351	AXA SA	(3.160.640)
Roche Holding AG (Non-voting rights)	2.745.321	Union Pacific Corp	(3.034.006)
Broadcom Inc	2.734.635	Meta Platforms Inc	(2.987.071)
Infineon Technologies AG	2.724.617	Tele2 AB	(2.961.691)
Texas Instruments Inc	2.659.976	Engie SA	(2.942.868)
Assa Abloy AB	2.419.299	BNP Paribas SA	(2.848.937)
Tele2 AB	2.405.017	Assa Abloy AB	(2.820.777)
		SAP SE	(2.755.219)
		Intesa Sanpaolo SpA	(2.603.077)

**WESENTLICHE PORTFOLIOTRANSAKTIONEN (Fortsetzung)
FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2023**

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

MSCI USA SF UCITS ETF

Portfoliokäufe	Kosten USD	Portfolioverkäufe	Erlöse USD
Apple Inc	62.526.897	Apple Inc	(64.856.901)
Microsoft Corp	54.709.742	Microsoft Corp	(55.724.208)
Amazon.com Inc	34.496.162	NVIDIA Corp	(38.743.781)
NVIDIA Corp	30.708.551	Intel Corp	(26.053.043)
Telefonaktiebolaget LM Ericsson	20.718.752	Eni SpA	(24.273.162)
Intel Corp	18.501.022	Telefonaktiebolaget LM Ericsson	(20.217.642)
Intesa Sanpaolo SpA	17.377.525	Amazon.com Inc	(19.362.320)
Cisco Systems Inc	16.558.622	Cisco Systems Inc	(17.373.414)
Advanced Micro Devices Inc	15.828.671	Societe Generale SA	(17.334.508)
Eni SpA	15.587.098	Procter & Gamble Co	(15.364.174)
QUALCOMM Inc	14.247.633	Walmart Inc	(14.866.081)
Siemens AG (Germany listed)	13.623.857	UnitedHealth Group Inc	(13.550.858)
ASML Holding NV	12.275.183	Atlas Copco AB - Class A	(13.214.726)
Atlas Copco AB - Class A	11.452.241	Enel SpA	(12.693.061)
Walmart Inc	10.719.858	Exxon Mobil Corp	(12.049.544)
Meta Platforms Inc	9.991.392	QUALCOMM Inc	(11.927.693)
Procter & Gamble Co	9.737.658	Alphabet Inc - Class A	(11.781.522)
Adobe Inc	9.310.694	Siemens AG (Germany listed)	(11.616.045)
SAP SE	9.090.753	TotalEnergies SE	(11.274.709)
Prosus NV	9.082.886	AXA SA	(9.729.242)
Broadcom Inc	8.642.818	Union Pacific Corp	(9.238.629)
Roche Holding AG (Non-voting rights)	8.616.901	Meta Platforms Inc	(9.175.054)
Infineon Technologies AG	8.241.798	Engie SA	(9.149.706)
Texas Instruments Inc	8.200.221	Tele2 AB	(9.107.191)
Tele2 AB	7.644.059	BNP Paribas SA	(9.085.595)
Alphabet Inc - Class C	7.519.261	Assa Abloy AB	(8.647.481)
Assa Abloy AB	7.430.669	SAP SE	(8.615.714)
		Intesa Sanpaolo SpA	(7.913.215)

**WESENTLICHE PORTFOLIOTRANSAKTIONEN (Fortsetzung)
FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2023**

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

MSCI EMERGING MARKETS SF UCITS ETF

Portfoliokäufe	Kosten USD	Portfolioverkäufe	Erlöse USD
Target Corp	11.233.180	Apple Inc	(25.696.900)
Micron Technology Inc	10.591.760	Micron Technology Inc	(16.753.129)
Microsoft Corp	8.961.342	Microsoft Corp	(16.728.970)
Walmart Inc	8.549.202	Intel Corp	(13.478.815)
Oracle Corp	8.038.414	Union Pacific Corp	(12.945.509)
Salesforce Inc	7.845.889	Salesforce Inc	(12.757.687)
Union Pacific Corp	7.542.391	Meta Platforms Inc	(12.685.808)
Procter & Gamble Co	7.287.991	Amazon.com Inc	(11.368.844)
Apple Inc	7.108.262	Walmart Inc	(10.622.570)
CVS Health Corp	6.888.787	MercadoLibre Inc	(10.128.393)
QUALCOMM Inc	6.623.447	NVIDIA Corp	(8.969.721)
Intuitive Surgical Inc	6.275.330	Pinterest Inc	(7.941.107)
Texas Instruments Inc	6.207.110	Oracle Corp	(7.934.761)
UnitedHealth Group Inc	6.137.699	CVS Health Corp	(7.820.430)
Amazon.com Inc	4.808.380	Lululemon Athletica Inc	(7.686.682)
PepsiCo Inc	4.533.850	Gartner Inc	(7.221.584)
Intel Corp	4.379.909	QUALCOMM Inc	(6.994.058)
Advanced Micro Devices Inc	4.269.220	Synopsys Inc	(6.870.723)
NVIDIA Corp	4.155.921	Adobe Inc	(6.471.157)
Netflix Inc	4.114.295	NRG Energy Inc	(5.955.023)
Vertex Pharmaceuticals Inc	4.036.577	Alphabet Inc - Class A	(5.665.290)
Elevance Health Inc	3.883.533	Vertex Pharmaceuticals Inc	(5.181.030)
Fortinet Inc	3.856.410	Fortinet Inc	(4.959.868)
Pinterest Inc	3.660.841	PepsiCo Inc	(4.871.860)
General Motors Co	3.488.505	Bristol-Myers Squibb Co	(4.738.389)
NRG Energy Inc	3.475.642	PDD Holdings Inc	(4.668.657)
PayPal Holdings Inc	3.463.728	Dell Technologies Inc	(4.600.772)
Bristol-Myers Squibb Co	3.458.397	Elevance Health Inc	(4.269.184)
O'Reilly Automotive Inc	3.096.424	Procter & Gamble Co	(4.194.152)
Cintas Corp	2.460.452	Cisco Systems Inc	(4.155.642)
Regeneron Pharmaceuticals Inc	2.296.571	Target Corp	(3.964.251)
Gartner Inc	2.159.666	Netflix Inc	(3.860.876)
Advance Auto Parts Inc	1.960.999	Texas Instruments Inc	(3.690.879)
		UnitedHealth Group Inc	(3.605.579)
		PayPal Holdings Inc	(3.528.328)
		Western Digital Corp	(3.240.529)
		General Motors Co	(3.212.933)

**WESENTLICHE PORTFOLIOTRANSAKTIONEN (Fortsetzung)
FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2023**

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

MSCI AC ASIA EX JAPAN SF UCITS ETF

Portfoliokäufe	Kosten USD	Portfolioverkäufe	Erlöse USD
Apple Inc	32.538.436	Apple Inc	(34.051.219)
Microsoft Corp	28.407.851	Microsoft Corp	(28.888.812)
Amazon.com Inc	17.813.538	NVIDIA Corp	(20.175.558)
NVIDIA Corp	15.611.480	Intel Corp	(13.767.682)
Telefonaktiebolaget LM Ericsson	11.299.021	Eni SpA	(12.561.690)
Intel Corp	10.071.448	Telefonaktiebolaget LM Ericsson	(10.496.036)
Intesa Sanpaolo SpA	8.831.317	Amazon.com Inc	(10.186.669)
Cisco Systems Inc	8.771.731	Cisco Systems Inc	(9.112.185)
Eni SpA	8.134.458	Societe Generale SA	(9.036.242)
Advanced Micro Devices Inc	8.054.495	Procter & Gamble Co	(7.844.572)
QUALCOMM Inc	7.331.986	Walmart Inc	(7.675.989)
Siemens AG (Germany listed)	7.243.281	UnitedHealth Group Inc	(7.076.227)
ASML Holding NV	6.413.379	Enel SpA	(6.722.035)
Atlas Copco AB - Class A	6.120.101	Atlas Copco AB - Class A	(6.516.291)
Walmart Inc	5.844.906	Exxon Mobil Corp	(6.459.950)
Meta Platforms Inc	5.185.890	Siemens AG (Germany listed)	(6.275.636)
Procter & Gamble Co	4.881.950	QUALCOMM Inc	(6.162.868)
SAP SE	4.880.360	Alphabet Inc - Class A	(6.001.689)
Adobe Inc	4.771.924	TotalEnergies SE	(5.767.553)
Prosus NV	4.518.553	Engie SA	(4.932.168)
Texas Instruments Inc	4.385.006	AXA SA	(4.917.286)
Roche Holding AG (Non-voting rights)	4.226.689	BNP Paribas SA	(4.773.722)
Infineon Technologies AG	4.196.614	Union Pacific Corp	(4.696.132)
Tele2 AB	4.120.577	SAP SE	(4.676.473)
Broadcom Inc	4.094.432	Tele2 AB	(4.649.479)
Assa Abloy AB	3.952.519	Meta Platforms Inc	(4.648.004)
Union Pacific Corp	3.854.863	Assa Abloy AB	(4.191.516)
		Intesa Sanpaolo SpA	(3.954.906)

**WESENTLICHE PORTFOLIOTRANSAKTIONEN (Fortsetzung)
FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2023**

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

MSCI ACWI SF UCITS ETF

Portfoliokäufe	Kosten USD	Portfolioverkäufe	Erlöse USD
Apple Inc	815.344.999	Apple Inc	(738.556.138)
Microsoft Corp	731.125.699	Microsoft Corp	(625.254.230)
Amazon.com Inc	436.987.001	NVIDIA Corp	(514.654.799)
NVIDIA Corp	386.253.891	Intel Corp	(343.033.933)
Telefonaktiebolaget LM Ericsson	273.588.262	Eni SpA	(302.635.531)
Intel Corp	239.928.568	Telefonaktiebolaget LM Ericsson	(259.676.194)
Cisco Systems Inc	219.424.310	Amazon.com Inc	(233.822.038)
Advanced Micro Devices Inc	211.536.540	Societe Generale SA	(223.161.704)
Eni SpA	204.529.260	Cisco Systems Inc	(217.381.722)
Intesa Sanpaolo SpA	197.522.153	Procter & Gamble Co	(203.287.990)
Siemens AG (Germany listed)	179.073.661	Walmart Inc	(197.790.676)
QUALCOMM Inc	178.133.490	UnitedHealth Group Inc	(180.975.611)
ASML Holding NV	162.797.337	Atlas Copco AB - Class A	(177.869.736)
Atlas Copco AB - Class A	152.131.307	Enel SpA	(166.388.831)
Walmart Inc	142.015.651	Siemens AG (Germany listed)	(153.971.630)
Adobe Inc	122.239.637	Exxon Mobil Corp	(150.485.018)
Meta Platforms Inc	121.629.685	QUALCOMM Inc	(147.423.446)
Prosus NV	121.629.555	Union Pacific Corp	(124.175.262)
SAP SE	119.400.858	Alphabet Inc - Class A	(123.259.092)
Procter & Gamble Co	116.006.136	Tele2 AB	(121.973.785)
Broadcom Inc	114.743.475	TotalEnergies SE	(120.269.328)
Roche Holding AG (Non-voting rights)	113.742.948	Engie SA	(118.837.459)
Infineon Technologies AG	104.889.043	Assa Abloy AB	(115.886.198)
Texas Instruments Inc	103.213.884	SAP SE	(114.693.034)
Tele2 AB	100.753.338	BNP Paribas SA	(113.247.170)
Alphabet Inc - Class C	99.683.998	Intesa Sanpaolo SpA	(106.690.231)
Assa Abloy AB	99.566.305	ASML Holding NV	(101.470.360)
Union Pacific Corp	96.281.487	Cigna Group	(96.920.487)
		Meta Platforms Inc	(96.524.365)

**WESENTLICHE PORTFOLIOTRANSAKTIONEN (Fortsetzung)
FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2023**

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

CMCI EX-AGRICULTURE SF UCITS ETF

Portfoliokäufe	Kosten USD	Portfolioverkäufe	Erlöse USD
Apple Inc	17.489.872	Apple Inc	(20.159.093)
Microsoft Corp	15.301.680	Microsoft Corp	(17.053.402)
Amazon.com Inc	10.521.893	NVIDIA Corp	(11.031.528)
NVIDIA Corp	8.753.693	Intel Corp	(7.847.993)
Telefonaktiebolaget LM Ericsson	6.687.711	Eni SpA	(6.683.725)
Intel Corp	6.053.330	Amazon.com Inc	(5.716.982)
Cisco Systems Inc	5.230.714	Telefonaktiebolaget LM Ericsson	(5.629.954)
Intesa Sanpaolo SpA	4.764.164	Societe Generale SA	(5.526.773)
Advanced Micro Devices Inc	4.481.250	Cisco Systems Inc	(4.799.372)
Eni SpA	4.173.728	Walmart Inc	(4.753.345)
QUALCOMM Inc	4.149.765	Procter & Gamble Co	(4.696.357)
Siemens AG (Germany listed)	3.816.989	Exxon Mobil Corp	(4.028.073)
Walmart Inc	3.692.349	UnitedHealth Group Inc	(3.661.180)
ASML Holding NV	3.289.879	Atlas Copco AB - Class A	(3.459.985)
Atlas Copco AB - Class A	3.148.155	Enel SpA	(3.386.793)
Procter & Gamble Co	2.767.730	Siemens AG (Germany listed)	(3.336.822)
Meta Platforms Inc	2.755.828	Alphabet Inc - Class A	(3.326.564)
Texas Instruments Inc	2.653.168	QUALCOMM Inc	(3.291.284)
Adobe Inc	2.567.319	TotalEnergies SE	(3.207.043)
SAP SE	2.547.150	AXA SA	(2.766.264)
Prosus NV	2.476.181	Meta Platforms Inc	(2.615.677)
Broadcom Inc	2.277.545	Union Pacific Corp	(2.594.648)
Infineon Technologies AG	2.258.190	Tele2 AB	(2.588.154)
Roche Holding AG (Non-voting rights)	2.165.629	SAP SE	(2.513.329)
		BNP Paribas SA	(2.451.723)
		Engie SA	(2.408.130)

**WESENTLICHE PORTFOLIOTRANSAKTIONEN (Fortsetzung)
FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2023**

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

BLOOMBERG COMMODITY CMCI SF UCITS ETF

Portfoliokäufe	Kosten USD	Portfolioverkäufe	Erlöse USD
Apple Inc	98.687.577	Apple Inc	(107.581.136)
Microsoft Corp	87.741.752	Microsoft Corp	(93.902.414)
Amazon.com Inc	54.627.481	NVIDIA Corp	(65.635.263)
NVIDIA Corp	54.197.594	Intel Corp	(47.293.613)
Intesa Sanpaolo SpA	34.348.791	Eni SpA	(47.080.509)
Telefonaktiebolaget LM Ericsson	30.697.823	Amazon.com Inc	(34.886.672)
Eni SpA	30.643.069	Telefonaktiebolaget LM Ericsson	(34.128.941)
Advanced Micro Devices Inc	27.775.756	Cisco Systems Inc	(31.850.443)
QUALCOMM Inc	25.691.906	Enel SpA	(25.920.915)
Intel Corp	25.329.947	Walmart Inc	(25.495.372)
Cisco Systems Inc	24.470.553	Atlas Copco AB - Class A	(24.032.920)
ASML Holding NV	23.975.020	Alphabet Inc - Class A	(23.942.465)
Siemens AG (Germany listed)	22.857.506	TotalEnergies SE	(23.221.221)
Procter & Gamble Co	21.429.705	UnitedHealth Group Inc	(22.356.239)
Meta Platforms Inc	18.932.511	Societe Generale SA	(22.243.229)
Atlas Copco AB - Class A	17.809.256	Procter & Gamble Co	(21.394.838)
Prosus NV	16.934.176	Siemens AG (Germany listed)	(19.980.145)
Roche Holding AG (Non-voting rights)	16.348.173	QUALCOMM Inc	(19.856.501)
Adobe Inc	16.314.708	AXA SA	(19.716.509)
Infineon Technologies AG	15.929.485	Meta Platforms Inc	(18.065.263)
Tele2 AB	15.653.467	Engie SA	(18.043.089)
Union Pacific Corp	15.163.274	BNP Paribas SA	(17.917.139)
SAP SE	14.743.838	Tele2 AB	(17.655.213)
Walmart Inc	14.024.944	ASML Holding NV	(17.473.709)
Broadcom Inc	13.566.433	Exxon Mobil Corp	(17.024.721)
Micron Technology Inc	13.305.852	SAP SE	(16.192.638)
		Union Pacific Corp	(15.840.116)
		Assa Abloy AB	(15.604.812)
		Intesa Sanpaolo SpA	(14.572.285)
		Adobe Inc	(14.189.583)
		Micron Technology Inc	(14.139.680)
		Cigna Group	(13.329.339)

**WESENTLICHE PORTFOLIOTRANSAKTIONEN (Fortsetzung)
FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2023**

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

CMCI COMMODITY CARRY SF UCITS ETF

Portfoliokäufe	Kosten USD	Portfolioverkäufe	Erlöse USD
Apple Inc	26.123.999	Apple Inc	(24.532.564)
Microsoft Corp	23.356.794	Microsoft Corp	(22.477.370)
Amazon.com Inc	14.186.309	NVIDIA Corp	(15.822.532)
NVIDIA Corp	12.807.986	Eni SpA	(10.610.640)
Intesa Sanpaolo SpA	7.855.661	Intel Corp	(9.665.254)
Telefonaktiebolaget LM Ericsson	7.335.372	Telefonaktiebolaget LM Ericsson	(8.550.267)
Advanced Micro Devices Inc	7.221.212	Societe Generale SA	(8.133.374)
Cisco Systems Inc	7.161.398	Amazon.com Inc	(7.583.903)
Intel Corp	6.709.546	Procter & Gamble Co	(7.149.328)
Eni SpA	6.345.804	Cisco Systems Inc	(6.806.560)
QUALCOMM Inc	5.706.334	Walmart Inc	(6.090.670)
Siemens AG (Germany listed)	5.186.413	Atlas Copco AB - Class A	(6.079.518)
ASML Holding NV	5.078.476	UnitedHealth Group Inc	(5.571.995)
Atlas Copco AB - Class A	4.435.802	QUALCOMM Inc	(4.988.261)
Prosus NV	4.191.385	Enel SpA	(4.973.493)
Procter & Gamble Co	4.080.938	Alphabet Inc - Class A	(4.859.891)
Adobe Inc	3.993.657	TotalEnergies SE	(4.706.715)
Meta Platforms Inc	3.958.768	Exxon Mobil Corp	(4.441.203)
Walmart Inc	3.861.964	Siemens AG (Germany listed)	(4.372.317)
Infineon Technologies AG	3.739.645	Union Pacific Corp	(4.098.969)
Roche Holding AG (Non-voting rights)	3.721.016	AXA SA	(4.091.667)
Broadcom Inc	3.719.832	Assa Abloy AB	(3.963.168)
SAP SE	3.350.688	Tele2 AB	(3.950.712)
Alphabet Inc - Class C	3.191.758	Meta Platforms Inc	(3.914.365)
		Intesa Sanpaolo SpA	(3.654.107)
		BNP Paribas SA	(3.553.878)
		Engie SA	(3.336.870)
		SAP SE	(3.285.743)
		Cigna Group	(3.221.234)
		Micron Technology Inc	(3.187.242)
		ASML Holding NV	(3.141.192)

**WESENTLICHE PORTFOLIOTRANSAKTIONEN (Fortsetzung)
FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2023**

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

MSCI CHINA A SF UCITS ETF

Portfoliokäufe	Kosten USD	Portfolioverkäufe	Erlöse USD
Apple Inc	15.418.867	Apple Inc	(16.714.419)
Microsoft Corp	13.411.486	Microsoft Corp	(14.452.676)
Amazon.com Inc	8.700.024	NVIDIA Corp	(9.364.447)
NVIDIA Corp	7.503.344	Intel Corp	(6.602.928)
Telefonaktiebolaget LM Ericsson	5.310.074	Eni SpA	(6.087.640)
Intel Corp	4.690.719	Telefonaktiebolaget LM Ericsson	(4.974.584)
Intesa Sanpaolo SpA	4.558.335	Amazon.com Inc	(4.930.260)
Cisco Systems Inc	4.180.990	Cisco Systems Inc	(4.451.120)
Eni SpA	4.087.398	Societe Generale SA	(4.318.651)
Advanced Micro Devices Inc	4.076.613	Procter & Gamble Co	(3.794.330)
QUALCOMM Inc	3.472.917	Walmart Inc	(3.673.904)
Siemens AG (Germany listed)	3.336.513	Enel SpA	(3.326.948)
ASML Holding NV	3.091.043	UnitedHealth Group Inc	(3.270.697)
Atlas Copco AB - Class A	2.859.431	Alphabet Inc - Class A	(3.134.496)
Walmart Inc	2.751.942	Atlas Copco AB - Class A	(3.114.117)
Procter & Gamble Co	2.548.024	Exxon Mobil Corp	(3.095.987)
Meta Platforms Inc	2.486.772	TotalEnergies SE	(3.039.387)
Adobe Inc	2.363.132	QUALCOMM Inc	(3.019.830)
Prosus NV	2.243.773	Siemens AG (Germany listed)	(2.942.075)
SAP SE	2.175.246	AXA SA	(2.631.469)
Infineon Technologies AG	2.164.182	Meta Platforms Inc	(2.462.348)
Texas Instruments Inc	2.051.125	BNP Paribas SA	(2.390.514)
Tele2 AB	2.007.097	Union Pacific Corp	(2.254.281)
Roche Holding AG (Non-voting rights)	1.935.586	Tele2 AB	(2.232.289)
Union Pacific Corp	1.871.761	SAP SE	(2.229.247)
Assa Abloy AB	1.855.599	Engie SA	(2.180.525)
		Assa Abloy AB	(1.994.681)
		ASML Holding NV	(1.966.894)
		Adobe Inc	(1.908.829)
		Intesa Sanpaolo SpA	(1.906.011)

**WESENTLICHE PORTFOLIOTRANSAKTIONEN (Fortsetzung)
FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2023**

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

EURO EQUITY DEFENSIVE COVERED CALL SF UCITS ETF

Portfoliokäufe	Kosten EUR	Portfolioverkäufe	Erlöse EUR
Apple Inc	615.981	Apple Inc	(617.067)
Microsoft Corp	547.998	Microsoft Corp	(520.187)
Amazon.com Inc	331.289	NVIDIA Corp	(386.754)
NVIDIA Corp	281.820	Intel Corp	(252.919)
Telefonaktiebolaget LM Ericsson	231.302	Societe Generale SA	(193.461)
Intel Corp	206.423	Telefonaktiebolaget LM Ericsson	(193.416)
Cisco Systems Inc	176.710	Amazon.com Inc	(182.806)
Eni SpA	165.066	Eni SpA	(182.415)
Siemens AG (Germany listed)	156.162	Cisco Systems Inc	(159.903)
Advanced Micro Devices Inc	133.460	Procter & Gamble Co	(159.858)
Intesa Sanpaolo SpA	131.352	UnitedHealth Group Inc	(143.571)
Atlas Copco AB - Class A	127.314	Enel SpA	(138.195)
Walmart Inc	126.614	Exxon Mobil Corp	(133.553)
QUALCOMM Inc	126.097	Walmart Inc	(131.687)
ASML Holding NV	115.262	QUALCOMM Inc	(114.500)
SAP SE	109.074	Engie SA	(109.961)
Meta Platforms Inc	98.346	Siemens AG (Germany listed)	(107.650)
Texas Instruments Inc	85.132	BNP Paribas SA	(100.719)
Adobe Inc	84.391	Atlas Copco AB - Class A	(99.176)
Assa Abloy AB	78.306	Alphabet Inc - Class A	(98.353)
Procter & Gamble Co	73.805	TotalEnergies SE	(87.690)
Broadcom Inc	70.953	Union Pacific Corp	(79.597)
		Orange SA	(78.554)
		AXA SA	(75.370)
		Eli Lilly & Co	(75.167)
		Meta Platforms Inc	(73.083)
		Tele2 AB	(72.833)
		SAP SE	(71.397)

**WESENTLICHE PORTFOLIOTRANSAKTIONEN (Fortsetzung)
FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2023**

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

EURO EQUITY DEFENSIVE PUT WRITE SF UCITS ETF

Portfoliokäufe	Kosten EUR	Portfolioverkäufe	Erlöse EUR
Apple Inc	4.077.542	Apple Inc	(4.316.072)
Microsoft Corp	3.575.065	Microsoft Corp	(3.717.307)
Amazon.com Inc	2.214.309	NVIDIA Corp	(2.502.545)
NVIDIA Corp	2.013.463	Intel Corp	(1.651.683)
Telefonaktiebolaget LM Ericsson	1.254.374	Eni SpA	(1.620.465)
Intesa Sanpaolo SpA	1.209.903	Telefonaktiebolaget LM Ericsson	(1.330.608)
Intel Corp	1.149.087	Amazon.com Inc	(1.261.868)
Advanced Micro Devices Inc	1.075.602	Cisco Systems Inc	(1.102.434)
Cisco Systems Inc	997.051	Societe Generale SA	(1.030.438)
Eni SpA	994.234	Walmart Inc	(976.278)
QUALCOMM Inc	943.767	Procter & Gamble Co	(943.320)
Siemens AG (Germany listed)	850.988	Atlas Copco AB - Class A	(913.066)
ASML Holding NV	790.441	UnitedHealth Group Inc	(881.222)
Atlas Copco AB - Class A	711.802	Alphabet Inc - Class A	(836.320)
Procter & Gamble Co	691.621	QUALCOMM Inc	(811.240)
Meta Platforms Inc	657.490	TotalEnergies SE	(801.055)
Walmart Inc	651.255	Enel SpA	(785.468)
Prosus NV	634.367	Exxon Mobil Corp	(757.420)
Adobe Inc	629.176	Siemens AG (Germany listed)	(712.294)
Infineon Technologies AG	571.985	AXA SA	(706.261)
Roche Holding AG (Non-voting rights)	563.185	Meta Platforms Inc	(656.875)
SAP SE	561.517	Union Pacific Corp	(627.858)
Broadcom Inc	550.573	Tele2 AB	(605.419)
Texas Instruments Inc	516.157	Assa Abloy AB	(594.090)
		BNP Paribas SA	(574.054)
		Engie SA	(569.580)
		Intesa Sanpaolo SpA	(552.163)
		SAP SE	(530.226)
		ASML Holding NV	(519.983)
		Adobe Inc	(512.064)

**WESENTLICHE PORTFOLIOTRANSAKTIONEN (Fortsetzung)
FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2023**

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

US EQUITY DEFENSIVE COVERED CALL SF UCITS ETF

Portfoliokäufe	Kosten USD	Portfolioverkäufe	Erlöse USD
Apple Inc	749.046	Apple Inc	(746.469)
Microsoft Corp	667.456	Microsoft Corp	(631.652)
Amazon.com Inc	408.990	NVIDIA Corp	(470.916)
NVIDIA Corp	345.007	Intel Corp	(306.050)
Telefonaktiebolaget LM Ericsson	286.154	Telefonaktiebolaget LM Ericsson	(235.648)
Intel Corp	244.825	Societe Generale SA	(233.666)
Cisco Systems Inc	213.305	Eni SpA	(227.982)
Eni SpA	200.395	Cisco Systems Inc	(224.980)
Siemens AG (Germany listed)	186.537	Amazon.com Inc	(221.461)
Advanced Micro Devices Inc	167.442	Procter & Gamble Co	(193.749)
Intesa Sanpaolo SpA	167.076	UnitedHealth Group Inc	(172.765)
Atlas Copco AB - Class A	163.792	Enel SpA	(166.879)
QUALCOMM Inc	154.068	Walmart Inc	(161.169)
Walmart Inc	149.208	Exxon Mobil Corp	(158.641)
ASML Holding NV	147.003	Siemens AG (Germany listed)	(149.790)
SAP SE	129.598	QUALCOMM Inc	(139.393)
Meta Platforms Inc	119.780	Engie SA	(131.061)
Adobe Inc	104.216	Atlas Copco AB - Class A	(126.767)
Texas Instruments Inc	101.998	SAP SE	(121.842)
Assa Abloy AB	94.389	BNP Paribas SA	(121.162)
Tele2 AB	94.039	Alphabet Inc - Class A	(120.875)
Procter & Gamble Co	92.811	TotalEnergies SE	(113.683)
Broadcom Inc	87.979	Union Pacific Corp	(99.183)
Prosus NV	86.776	AXA SA	(93.634)
		Orange SA	(93.000)
		Tele2 AB	(90.758)
		Meta Platforms Inc	(90.641)
		Eli Lilly & Co	(88.361)

**WESENTLICHE PORTFOLIOTRANSAKTIONEN (Fortsetzung)
FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2023**

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

US EQUITY DEFENSIVE PUT WRITE SF UCITS ETF

Portfoliokäufe	Kosten USD	Portfolioverkäufe	Erlöse USD
Apple Inc	2.770.093	Apple Inc	(2.851.655)
Microsoft Corp	2.450.811	Microsoft Corp	(2.440.633)
Amazon.com Inc	1.513.053	NVIDIA Corp	(1.736.521)
NVIDIA Corp	1.327.695	Intel Corp	(1.135.386)
Telefonaktiebolaget LM Ericsson	956.117	Eni SpA	(1.018.944)
Intel Corp	841.138	Telefonaktiebolaget LM Ericsson	(896.469)
Cisco Systems Inc	739.631	Amazon.com Inc	(864.647)
Intesa Sanpaolo SpA	725.453	Cisco Systems Inc	(797.081)
Eni SpA	710.662	Societe Generale SA	(784.385)
Advanced Micro Devices Inc	671.497	Procter & Gamble Co	(681.939)
Siemens AG (Germany listed)	636.491	Walmart Inc	(629.197)
QUALCOMM Inc	605.893	UnitedHealth Group Inc	(618.218)
Atlas Copco AB - Class A	552.236	Enel SpA	(581.645)
ASML Holding NV	541.464	Exxon Mobil Corp	(547.791)
Walmart Inc	494.558	QUALCOMM Inc	(536.007)
Meta Platforms Inc	446.170	Atlas Copco AB - Class A	(533.640)
SAP SE	433.111	Siemens AG (Germany listed)	(530.871)
Procter & Gamble Co	408.845	Alphabet Inc - Class A	(517.641)
Adobe Inc	407.248	TotalEnergies SE	(489.029)
Prosus NV	373.380	Engie SA	(438.230)
Texas Instruments Inc	364.087	AXA SA	(422.092)
Roche Holding AG (Non-voting rights)	348.246	BNP Paribas SA	(421.910)
Infineon Technologies AG	347.014	Meta Platforms Inc	(397.873)
Broadcom Inc	344.388	Union Pacific Corp	(393.449)
Assa Abloy AB	343.114	SAP SE	(377.931)
Tele2 AB	340.756	Tele2 AB	(375.975)
		Assa Abloy AB	(348.473)

**WESENTLICHE PORTFOLIOTRANSAKTIONEN (Fortsetzung)
FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2023**

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

MSCI USA SF INDEX FUND

Portfoliokäufe	Kosten USD	Portfolioverkäufe	Erlöse USD
Apple Inc	139.451.207	Apple Inc	(131.962.955)
Microsoft Corp	124.509.185	Microsoft Corp	(113.169.379)
Amazon.com Inc	73.227.672	NVIDIA Corp	(87.308.004)
NVIDIA Corp	66.099.883	Intel Corp	(54.749.178)
Telefonaktiebolaget LM Ericsson	43.718.778	Eni SpA	(54.494.534)
Intel Corp	38.543.841	Telefonaktiebolaget LM Ericsson	(44.979.008)
Intesa Sanpaolo SpA	38.067.219	Amazon.com Inc	(40.865.528)
Advanced Micro Devices Inc	35.333.042	Cisco Systems Inc	(38.655.388)
Eni SpA	35.272.113	Societe Generale SA	(36.209.405)
Cisco Systems Inc	34.363.656	Atlas Copco AB - Class A	(32.702.674)
QUALCOMM Inc	31.101.170	Procter & Gamble Co	(32.635.068)
Siemens AG (Germany listed)	30.404.741	Walmart Inc	(32.037.172)
ASML Holding NV	27.798.477	UnitedHealth Group Inc	(30.904.462)
Atlas Copco AB - Class A	26.091.700	Enel SpA	(28.305.656)
Broadcom Inc	25.481.393	QUALCOMM Inc	(26.398.873)
Roche Holding AG (Non-voting rights)	23.393.301	Siemens AG (Germany listed)	(25.825.336)
Walmart Inc	22.055.840	Exxon Mobil Corp	(24.613.955)
Meta Platforms Inc	21.994.164	Alphabet Inc - Class A	(24.276.641)
Alphabet Inc - Class C	21.599.573	TotalEnergies SE	(23.183.450)
Adobe Inc	20.943.361	Engie SA	(21.178.332)
Prosus NV	20.749.956	Union Pacific Corp	(20.956.165)
SAP SE	20.504.639	Assa Abloy AB	(20.300.810)
Procter & Gamble Co	20.128.703	Tele2 AB	(20.219.882)
Infineon Technologies AG	18.713.056	BNP Paribas SA	(20.099.959)
Tele2 AB	17.115.578	AXA SA	(19.704.999)
Texas Instruments Inc	17.011.040	SAP SE	(19.149.313)
		Meta Platforms Inc	(18.872.139)
		Micron Technology Inc	(18.816.823)
		Intesa Sanpaolo SpA	(17.892.572)

**WESENTLICHE PORTFOLIOTRANSAKTIONEN (Fortsetzung)
FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2023**

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

CMCI COMMODITY CARRY EX-AGRICULTURE SF UCITS ETF

Portfoliokäufe	Kosten USD	Portfolioverkäufe	Erlöse USD
Apple Inc	9.308.592	Apple Inc	(9.675.436)
Microsoft Corp	8.191.678	Microsoft Corp	(8.288.561)
Amazon.com Inc	5.181.720	NVIDIA Corp	(5.663.641)
NVIDIA Corp	4.670.675	Eni SpA	(3.643.549)
Telefonaktiebolaget LM Ericsson	2.768.069	Intel Corp	(3.624.778)
Intesa Sanpaolo SpA	2.751.484	Telefonaktiebolaget LM Ericsson	(3.038.207)
Intel Corp	2.623.953	Amazon.com Inc	(2.904.758)
Cisco Systems Inc	2.558.136	Societe Generale SA	(2.824.123)
Advanced Micro Devices Inc	2.540.066	Procter & Gamble Co	(2.485.879)
Eni SpA	2.146.255	Cisco Systems Inc	(2.326.266)
QUALCOMM Inc	2.125.681	Walmart Inc	(2.252.952)
Siemens AG (Germany listed)	1.926.253	Atlas Copco AB - Class A	(2.034.540)
ASML Holding NV	1.727.916	UnitedHealth Group Inc	(1.971.682)
Atlas Copco AB - Class A	1.567.651	QUALCOMM Inc	(1.832.714)
Procter & Gamble Co	1.512.299	Alphabet Inc - Class A	(1.828.592)
Meta Platforms Inc	1.469.142	TotalEnergies SE	(1.761.759)
Prosus NV	1.459.143	Exxon Mobil Corp	(1.681.076)
Walmart Inc	1.440.292	Enel SpA	(1.675.682)
Adobe Inc	1.430.259	AXA SA	(1.554.564)
Infineon Technologies AG	1.302.328	Siemens AG (Germany listed)	(1.548.150)
SAP SE	1.280.171	Meta Platforms Inc	(1.469.946)
Roche Holding AG (Non-voting rights)	1.219.484	Union Pacific Corp	(1.448.649)
Texas Instruments Inc	1.149.728	Tele2 AB	(1.416.357)
Broadcom Inc	1.135.451	Assa Abloy AB	(1.326.607)
		Intesa Sanpaolo SpA	(1.273.204)
		BNP Paribas SA	(1.219.007)
		Engie SA	(1.218.173)
		SAP SE	(1.132.332)
		Adobe Inc	(1.127.053)

**WESENTLICHE PORTFOLIOTRANSAKTIONEN (Fortsetzung)
FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 31. DEZEMBER 2023**

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

CMCI COMMODITY TRANSITION SF UCITS ETF

Portfoliokäufe	Kosten USD	Portfolioverkäufe	Erlöse USD
Target Corp	247.789	Apple Inc	(573.387)
Micron Technology Inc	237.418	Micron Technology Inc	(373.197)
Microsoft Corp	199.096	Microsoft Corp	(368.074)
Walmart Inc	196.199	Intel Corp	(302.144)
Oracle Corp	172.747	Salesforce Inc	(289.568)
Union Pacific Corp	171.172	Meta Platforms Inc	(287.630)
Salesforce Inc	170.030	Union Pacific Corp	(284.591)
Procter & Gamble Co	166.506	Amazon.com Inc	(257.275)
Apple Inc	159.904	Walmart Inc	(232.481)
QUALCOMM Inc	149.857	MercadoLibre Inc	(228.177)
CVS Health Corp	148.027	NVIDIA Corp	(194.630)
Texas Instruments Inc	143.989	Oracle Corp	(182.376)
Intuitive Surgical Inc	137.760	Pinterest Inc	(180.244)
UnitedHealth Group Inc	135.506	Lululemon Athletica Inc	(178.391)
Amazon.com Inc	106.180	CVS Health Corp	(177.860)
PepsiCo Inc	99.580	Gartner Inc	(167.966)
NVIDIA Corp	92.610	QUALCOMM Inc	(154.145)
Intel Corp	92.465	Synopsys Inc	(154.136)
Advanced Micro Devices Inc	91.840	Adobe Inc	(145.085)
Elevance Health Inc	90.644	Alphabet Inc - Class A	(128.588)
Netflix Inc	87.253	NRG Energy Inc	(128.257)
Fortinet Inc	84.544	Vertex Pharmaceuticals Inc	(117.597)
Vertex Pharmaceuticals Inc	82.154	Fortinet Inc	(110.820)
General Motors Co	80.519	PepsiCo Inc	(109.848)
NRG Energy Inc	77.706	PDD Holdings Inc	(105.967)
Bristol-Myers Squibb Co	77.544	Dell Technologies Inc	(105.962)
Pinterest Inc	75.985	Bristol-Myers Squibb Co	(105.671)
PayPal Holdings Inc	70.475	Cisco Systems Inc	(93.561)
O'Reilly Automotive Inc	68.361	Elevance Health Inc	(91.839)
Cintas Corp	58.261	Target Corp	(90.881)
Regeneron Pharmaceuticals Inc	48.483	Netflix Inc	(86.897)
Gartner Inc	45.337	Procter & Gamble Co	(86.481)
Advance Auto Parts Inc	41.166	Texas Instruments Inc	(81.237)
		UnitedHealth Group Inc	(79.010)
		PayPal Holdings Inc	(71.810)
		General Motors Co	(70.405)

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

Artikel 13 der EU-Verordnung 2015/2365 über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften (Securities Financing Transactions Regulation, „SFTR“) verlangt die Berichterstattung über und Angaben zu Wertpapierfinanzierungsgeschäften (Securities Financing Transactions, „SFTs“) und Gesamtrendite-Swaps (Total Return Swaps).

SFTs sind nach Artikel 3(11) der SFTR wie folgt konkret definiert:

- ein Pensionsgeschäft/umgekehrtes Pensionsgeschäft
- ein Wertpapier- oder Warenleihgeschäft
- ein Kauf-/Rückverkaufgeschäft oder ein Verkauf-/Rückkaufgeschäft
- ein Lombardgeschäft

Im Berichtszeitraum gingen die Teilfonds Total-Return-Swap-Transaktionen ein.

Es folgt der beizulegende Zeitwert der von den Teilfonds zum 31. Dezember 2023 gehaltenen Total Return Swaps, die bilateral abgerechnet werden. Die UBS AG mit Sitz in der Schweiz ist die Swap-Gegenpartei für alle Teilfonds. Sämtliche Total Return Swaps werden innerhalb eines Jahres nach dem 31. Dezember 2023 fällig.

Teilfonds	Währung	Zeitwert	% des Nettoinventarwerts
CMCI Composite SF UCITS ETF	USD	49.077.636	3,31 %
Bloomberg Commodity Index SF UCITS ETF	USD	9.728.059	5,98 %
S&P 500 SF UCITS ETF	USD	5.808.752	3,91 %
MSCI USA SF UCITS ETF	USD	18.161.137	3,90 %
MSCI Emerging Markets SF UCITS ETF	USD	8.585.473	8,69 %
MSCIACAsia Ex Japan SF UCITS ETF	USD	14.643.785	6,74 %
MSCIACWI SF UCITS ETF	USD	245.222.903	3,96 %
CMCI Ex-Agriculture SF UCITS ETF	USD	5.890.031	3,84 %
Bloomberg Commodity CMCI SF UCITS ETF	USD	22.457.950	2,88 %
CMCI Commodity Carry SF UCITS ETF	USD	9.175.714	4,34 %
MSCI ChinaA SF UCITS ETF	USD	6.155.139	6,59 %
Euro Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF	EUR	126.048	3,70 %
Euro Equity Defensive PutWrite SF UCITS ETF	EUR	1.117.534	3,67 %
US Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF	USD	169.422	3,90 %
US Equity Defensive PutWrite SF UCITS ETF	USD	684.142	3,81 %
MSCI USA SF Index Fund	USD	61.214.370	4,07 %
CMCI Commodity Carry Ex-Agriculture SF UCITS ETF	USD	2.368.340	4,03 %
CMCI CommodityTransition SF UCITS ETF	USD	57.339	2,79 %
		460.773.860	

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

Die folgende Tabelle zeigt eine Analyse der Fälligkeiten der Total Return Swaps zum 31. Dezember 2023.

Teilfonds	Währung	1 bis 3 Monate	3 Monate bis 1 Jahr	Über 1 Jahr
CMCI Composite SF UCITS ETF	USD	-	49.077.636	-
Bloomberg Commodity Index SF UCITS ETF	USD	-	9.728.059	-
S&P 500 SF UCITS ETF	USD	-	5.808.752	-
MSCI USA SF UCITS ETF	USD	-	18.161.137	-
MSCI Emerging Markets SF UCITS ETF	USD	-	8.585.473	-
MSCIACAsia Ex Japan SF UCITS ETF	USD	-	14.643.785	-
MSCIACWI SF UCITS ETF	USD	-	245.222.903	-
CMCI Ex-Agriculture SF UCITS ETF	USD	-	5.890.031	-
Bloomberg Commodity CMCI SF UCITS ETF	USD	-	22.457.950	-
CMCI Commodity Carry SF UCITS ETF	USD	-	9.175.714	-
MSCI ChinaA SF UCITS ETF	USD	-	6.155.139	-
Euro Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF	EUR	-	126.048	-
Euro Equity Defensive PutWrite SF UCITS ETF	EUR	-	1.117.534	-
US Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF	USD	-	169.422	-
US Equity Defensive PutWrite SF UCITS ETF	USD	-	684.142	-
MSCI USA SF Index Fund	USD	-	61.214.370	-
CMCI Commodity Carry Ex-Agriculture SF UCITS ETF	USD	-	2.368.340	-
CMCI CommodityTransition SF UCITS ETF	USD	-	57.339	-

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

Die folgende Tabelle zeigt eine Analyse der Art und Qualität von Sicherheiten zum 31. Dezember 2023. Die Beträge ohne Rating setzen sich ausschließlich aus Barsicherheiten zusammen.

Teilfonds	Währung	Art der Sicherheit	Investment Grade	Qualität der Sicherheiten/Rating	
				Investment Grade	Unter Kein Rating
CMCI Composite SF UCITS ETF	USD	Zahlungsmittel	-	-	77.921.453
Bloomberg Commodity Index SF UCITS ETF	USD	Zahlungsmittel	-	-	12.632.021
S&P 500 SF UCITS ETF	USD	Zahlungsmittel	-	-	6.504.248
MSCI USA SF UCITS ETF	USD	Zahlungsmittel	-	-	18.901.240
MSCI Emerging Markets SF UCITS ETF	USD	Zahlungsmittel	-	-	4.776.488
MSCIACAsia Ex Japan SF UCITS ETF	USD	Zahlungsmittel	-	-	8.253.936
MSCIACWI SF UCITS ETF	USD	Zahlungsmittel	-	-	174.204.555
CMCI Ex-Agriculture SF UCITS ETF	USD	Zahlungsmittel	-	-	7.951.495
Bloomberg Commodity CMCI SF UCITS ETF	USD	Zahlungsmittel	-	-	35.619.862
CMCI Commodity Carry SF UCITS ETF	USD	Zahlungsmittel	-	-	7.958.445
MSCI ChinaA SF UCITS ETF	USD	Zahlungsmittel	-	-	4.946.218
Euro Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF	EUR	Anleihen und Zahlungsmittel	96.611	-	230.000
Euro Equity Defensive PutWrite SF UCITS ETF	EUR	Zahlungsmittel	-	-	1.468.000
US Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF	USD	Zahlungsmittel	-	-	259.287
US Equity Defensive PutWrite SF UCITS ETF	USD	Zahlungsmittel	-	-	890.403
MSCI USA SF Index Fund	USD	Zahlungsmittel	-	-	64.920.342
CMCI Commodity Carry Ex-Agriculture SF UCITS ETF	USD	Zahlungsmittel	-	-	1.844.801
CMCI CommodityTransition SF UCITS ETF	USD	Zahlungsmittel	-	-	-

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

Die folgenden Tabellen zeigen eine Analyse der Währung von Sicherheiten zum 31. Dezember 2023.

	CMCI Composite SF UCITS ETF	Bloomberg Commodity Index SF UCITS ETF	S&P 500 SF UCITS ETF	MSCI USA SF UCITS ETF	MSCI Emerging Markets SF UCITS ETF
Währung	USD	USD	USD	USD	USD
EUR	-	-	6.504.248	-	4.776.488
GBP	57.971.453	12.632.021	-	14.952.240	-
USD	19.950.000	-	-	3.949.000	-
	77.921.453	12.632.021	6.504.248	18.901.240	4.776.488

	MSCI AC Asia Ex Japan SF UCITS ETF	MSCI ACWI SF UCITS ETF	CMCI Ex-Agriculture SF UCITS ETF	Bloomberg Commodity CMCI SF UCITS ETF	CMCI Commodity Carry SF UCITS ETF
Währung	USD	USD	USD	USD	USD
EUR	8.253.936	61.493.007	5.541.495	8.536.619	7.958.445
GBP	-	59.541.548	-	16.053.243	-
USD	-	53.170.000	2.410.000	11.030.000	-
	8.253.936	174.204.555	7.951.495	35.619.862	7.958.445

	MSCI China A SF UCITS ETF	Euro Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF	Euro Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF	US Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF	US Equity Defensive Put Write SF UCITS ETF
Währung	USD	EUR	EUR	USD	USD
EUR	4.946.218	326.611	1.468.000	259.287	890.403
GBP	-	-	-	-	-
USD	-	-	-	-	-
	4.946.218	326.611	1.468.000	259.287	890.403

	CMCI Commodity Carry MSCI USA SF Index Fund	CMCI Commodity Carry Ex-Agriculture SF UCITS ETF	CMCI Commodity Transition SF UCITS ETF
Währung	USD	USD	USD
EUR	27.300.342	1.844.801	-
GBP	-	-	-
USD	37.620.000	-	-
	64.920.342	1.844.801	-

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

Barsicherheiten können in Geldmarktfonds angelegt werden. Die Teilfonds investieren solche Barmittel in die UBS (Irl) Select Money Market Fund EUR/USD Sustainable Fund. Einzelheiten zu diesen Geldmarktfonds finden Sie unter www.ubs.com/funds. Die minimale/maximale Rendite für Geldmarktanlagen als Prozentsatz des durchschnittlichen verwalteten Vermögens für den Zeitraum betrug 0,060 %/0,161 %.

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

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

Die nachstehende Tabelle enthält eine Analyse der Laufzeit der Sicherheiten zum 31. Dezember 2023. Erhaltene Barsicherheiten sind in der nachstehenden Tabelle als unbefristet ausgewiesen:

Teilfonds	Währung	Weniger als 1 Jahr	Über 1 Jahr	Offene Laufzeit
CMCI Composite SF UCITS ETF	USD	-	-	77.921.453
Bloomberg Commodity Index SF UCITS ETF	USD	-	-	12.632.021
S&P 500 SF UCITS ETF	USD	-	-	6.504.248
MSCI USA SF UCITS ETF	USD	-	-	18.901.240
MSCI Emerging Markets SF UCITS ETF	USD	-	-	4.776.488
MSCIACAsia Ex Japan SF UCITS ETF	USD	-	-	8.253.936
MSCIACWI SF UCITS ETF	USD	-	-	174.204.555
CMCI Ex-Agriculture SF UCITS ETF	USD	-	-	7.951.495
Bloomberg Commodity CMCI SF UCITS ETF	USD	-	-	35.619.862
CMCI Commodity Carry SF UCITS ETF	USD	-	-	7.958.445
MSCI ChinaA SF UCITS ETF	USD	-	-	4.946.218
Euro Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF	EUR	-	96.611	230.000
Euro Equity Defensive PutWrite SF UCITS ETF	EUR	-	-	1.468.000
US Equity Defensive Covered Call SF UCITS ETF	USD	-	-	259.287
US Equity Defensive PutWrite SF UCITS ETF	USD	-	-	890.403
MSCI USA SF Index Fund	USD	-	-	64.920.342
CMCI Commodity Carry Ex-Agriculture SF UCITS ETF	USD	-	-	1.844.801
CMCI CommodityTransition SF UCITS ETF	USD	-	-	-

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

In den folgenden Tabellen sind die zehn größten Emittenten von Sachsicherheiten des jeweiligen Teilfonds zum 31. Dezember 2023 aufgeführt. Bei weniger als zehn Emittenten sind alle Emittenten aufgeführt.

	Euro Equity
Sicherheitenemittenten	Defensive Covered
	Call SF UCITS ETF
	EUR
French Government	96.611
	96.611

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

Die Renditen und Kosten der von den Teilfonds für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 gehaltenen Total Return Swaps sind im Folgenden aufgeführt:

CMCI COMPOSITE SF UCITS ETF

Art von Wertpapierfinanzierungsgeschäften	Erl.	Insgesamt	Organismus für gemeinsame Anlagen	Verwaltungsgesellschaft	Dritte
Total Return Swaps	1				
Absolute Werte		USD	USD	USD	USD
Rendite	2	(109.913.476)	(109.913.476)	null	null
Kosten	3,8	(4.704.527)	(4.704.527)	null	null
Wirtschaftlicher Nutzen	4	(105.208.949)	(105.208.949)	null	null
Prozentualer mit der jeweiligen Art erzielter Anteil an der Gesamrendite		% der Gesamrendite	% der Gesamrendite	% der Gesamrendite	% der Gesamrendite
Rendite		(100,00 %)	(100,00 %)	null	null
Kosten	5	(4,28 %)	(4,28 %)	null	null
Wirtschaftlicher Nutzen	4	(104,28 %)	(104,28 %)	null	null
Prozentualer Anteil am NIW		% des NIW	% des NIW	% des NIW	% des NIW
Rendite	6	(7,78 %)	(7,78 %)	null	null
Kosten	7,8	(0,33 %)	(0,33 %)	null	null
Wirtschaftlicher Nutzen	4	(8,11 %)	(8,11 %)	null	null

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

CMCI COMPOSITE SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Hinweis

- 1 Mit Ausnahme von Total Return Swaps hat die Gesellschaft im Berichtszeitraum keine Wertpapierfinanzierungsgeschäfte getätigt.
- 2 Dies betrifft die realisierten und nicht realisierten Gewinne und Verluste aus den Fully Funded Swaps und Total Return Swaps (gemeinsam die „TRS“ gemäß der SFTR-Definition) während der sechs Monate zum 31. Dezember 2023, die in der zusammengefassten Gesamtergebnisrechnung enthalten sind und vor Abzug der mit ihnen im Zusammenhang stehenden Kosten aufgeführt sind.
- 3 Dies betrifft Abzüge auf die Werte der TRS in den sechs Monaten zum 31. Dezember 2023.
- 4 Berechnet als Differenz zwischen der Rendite und den Kosten.
- 5 Berechnet als absoluter Betrag der Kosten in Prozent des absoluten Betrags der Renditen.
- 6 Berechnet als absoluter Betrag der Rendite in Prozent des durchschnittlichen NIW für den Berichtszeitraum.
- 7 Berechnet als absoluter Betrag der Kosten in Prozent des durchschnittlichen NIW für den Berichtszeitraum.
- 8 Die von der Gegenpartei an den Werten der TRS vorgenommenen Abzüge berücksichtigen alle externen Gebühren, zu deren Zahlung sie verpflichtet ist, sowie alle Transaktionskosten und Gebühren, die normalerweise anfallen. Diese werden für die sechs Monate bis zum 31. Dezember 2023 wie folgt analysiert (alle in Prozent des durchschnittlichen NIW für den Berichtszeitraum):

Bezeichnung	Erl.	USD	% des NIW
Verwaltungsgebühren	9	177.440	0,01 %
Verwahrstellengebühren	9	92.269	0,01 %
Treuhändergebühren	9	21.293	0,00 %
Sonstige Aufwendungen	9,10	170.343	0,01 %
Anlageverwaltungsgebühren	9	1.242.081	0,09 %
Gebühren der Verwaltungsgesellschaft	9	709.760	0,05 %
Nicht bedingte Abzüge für Swap-Gegenpartei	11	2.291.341	0,16 %
Insgesamt		4.704.527	0,33 %

- 9 Diese Beträge werden von der TRS-Gegenpartei an den Teilfonds während der sechs Monate bis zum 31. Dezember 2023 gezahlt oder sind von der TRS-Gegenpartei zu zahlen.
- 10 Die sonstigen Aufwendungen sind im Prospekt der Gesellschaft beschrieben. Zum Beispiel (aber nicht beschränkt auf) laufende Organisations- und Eintragungsgebühren, Ausgaben für Rechtsberatung und prüfungsrelevante Leistungen sowie Marketingkosten.
- 11 Diese Beträge werden von der TRS-Gegenpartei des Teilfonds während der sechs Monate bis zum 31. Dezember 2023 einbehalten und beziehen sich auf Swap-Transaktionskosten und Index-Lizenzierungsgebühren.

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

Die Renditen und Kosten der von den Teilfonds für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 gehaltenen Total Return Swaps sind im Folgenden aufgeführt:

BLOOMBERG COMMODITY INDEX SF UCITS ETF

Art von Wertpapierfinanzierungsgeschäften	Erl.	Insgesamt	Organismus für gemeinsame Anlagen	Verwaltungsgesellschaft	Dritte
Total Return Swaps	1				
Absolute Werte		USD	USD	USD	USD
Rendite	2	(11.492.986)	(11.492.986)	null	null
Kosten	3,8	(319.602)	(319.602)	null	null
Wirtschaftlicher Nutzen	4	(11.173.384)	(11.173.384)	null	null
Prozentualer mit der jeweiligen Art erzielter Anteil an der Gesamrendite		% der Gesamtrendite	% der Gesamtrendite	% der Gesamtrendite	% der Gesamtrendite
Rendite		(100,00 %)	(100,00 %)	null	null
Kosten	5	(2,78 %)	(2,78 %)	null	null
Wirtschaftlicher Nutzen	4	(102,78 %)	(102,78 %)	null	null
Prozentualer Anteil am NIW		% des NIW	% des NIW	% des NIW	% des NIW
Rendite	6	(4,00 %)	(4,00 %)	null	null
Kosten	7,8	(0,12 %)	(0,12 %)	null	null
Wirtschaftlicher Nutzen	4	(4,12 %)	(4,12 %)	null	null

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

BLOOMBERG COMMODITY INDEX SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Hinweis

- 1 Mit Ausnahme von Total Return Swaps hat die Gesellschaft im Berichtszeitraum keine Wertpapierfinanzierungsgeschäfte getätigt.
- 2 Dies betrifft die realisierten und nicht realisierten Gewinne und Verluste aus den Fully Funded Swaps und Total Return Swaps (gemeinsam die „TRS“ gemäß der SFTR-Definition) während der sechs Monate zum 31. Dezember 2023, die in der zusammengefassten Gesamtergebnisrechnung enthalten sind und vor Abzug der mit ihnen im Zusammenhang stehenden Kosten aufgeführt sind.
- 3 Dies betrifft Abzüge auf die Werte der TRS in den sechs Monaten zum 31. Dezember 2023.
- 4 Berechnet als Differenz zwischen der Rendite und den Kosten.
- 5 Berechnet als absoluter Betrag der Kosten in Prozent des absoluten Betrags der Renditen.
- 6 Berechnet als absoluter Betrag der Rendite in Prozent des durchschnittlichen NIW für den Berichtszeitraum.
- 7 Berechnet als absoluter Betrag der Kosten in Prozent des durchschnittlichen NIW für den Berichtszeitraum.
- 8 Die von der Gegenpartei an den Werten der TRS vorgenommenen Abzüge berücksichtigen alle externen Gebühren, zu deren Zahlung sie verpflichtet ist, sowie alle Transaktionskosten und Gebühren, die normalerweise anfallen. Diese werden für die sechs Monate bis zum 31. Dezember 2023 wie folgt analysiert (alle in Prozent des durchschnittlichen NIW für den Berichtszeitraum):

Bezeichnung	Erl.	USD	% des NIW
Verwaltungsgebühren	9	36.140	0,01 %
Verwahrstellengebühren	9	18.793	0,01 %
Treuhändergebühren	9	4.337	0,00 %
Sonstige Aufwendungen	9,10	34.695	0,01 %
Anlageverwaltungsgebühren	9	137.333	0,05 %
Gebühren der Verwaltungsgesellschaft	9	43.368	0,02 %
Nicht bedingte Abzüge für Swap-Gegenpartei	11	44.936	0,02 %
Insgesamt		319.602	0,12 %

- 9 Diese Beträge werden von der TRS-Gegenpartei an den Teilfonds während der sechs Monate bis zum 31. Dezember 2023 gezahlt oder sind von der TRS-Gegenpartei zu zahlen.
- 10 Die sonstigen Aufwendungen sind im Prospekt der Gesellschaft beschrieben. Zum Beispiel (aber nicht beschränkt auf) laufende Organisations- und Eintragungsgebühren, Ausgaben für Rechtsberatung und prüfungsrelevante Leistungen sowie Marketingkosten.
- 11 Diese Beträge werden von der TRS-Gegenpartei des Teilfonds während der sechs Monate bis zum 31. Dezember 2023 einbehalten und beziehen sich auf Swap-Transaktionskosten und Index-Lizenzierungsgebühren.

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

Die Renditen und Kosten der von den Teilfonds für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 gehaltenen Total Return Swaps sind im Folgenden aufgeführt:

S&P 500 SF UCITS ETF

Art von Wertpapierfinanzierungsgeschäften	Erl.	Insgesamt	Organismus für gemeinsame Anlagen	Verwaltungsgesellschaft	Dritte
Total Return Swaps	1				
Absolute Werte		USD	USD	USD	USD
Rendite	2	(4.786.640)	(4.786.640)	null	null
Kosten	3,8	(248.018)	(248.018)	null	null
Wirtschaftlicher Nutzen	4	(4.538.622)	(4.538.622)	null	null
Prozentualer mit der jeweiligen Art erzielter Anteil an der Gesamrendite		% der Gesamrendite	% der Gesamrendite	% der Gesamrendite	% der Gesamrendite
Rendite		(100,00 %)	(100,00 %)	null	null
Kosten	5	(5,18 %)	(5,18 %)	null	null
Wirtschaftlicher Nutzen	4	(105,18 %)	(105,18 %)	null	null
Prozentualer Anteil am NIW		% des NIW	% des NIW	% des NIW	% des NIW
Rendite	6	(3,35 %)	(3,35 %)	null	null
Kosten	7,8	(0,17 %)	(0,17 %)	null	null
Wirtschaftlicher Nutzen	4	(3,52 %)	(3,52 %)	null	null

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

S&P 500 SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Hinweis

- 1 Mit Ausnahme von Total Return Swaps hat die Gesellschaft im Berichtszeitraum keine Wertpapierfinanzierungsgeschäfte getätigt.
- 2 Dies betrifft die realisierten und nicht realisierten Gewinne und Verluste aus den Fully Funded Swaps und Total Return Swaps (gemeinsam die „TRS“ gemäß der SFTR-Definition) während der sechs Monate zum 31. Dezember 2023, die in der zusammengefassten Gesamtergebnisrechnung enthalten sind und vor Abzug der mit ihnen im Zusammenhang stehenden Kosten aufgeführt sind.
- 3 Dies betrifft Abzüge auf die Werte der TRS in den sechs Monaten zum 31. Dezember 2023.
- 4 Berechnet als Differenz zwischen der Rendite und den Kosten.
- 5 Berechnet als absoluter Betrag der Kosten in Prozent des absoluten Betrags der Renditen.
- 6 Berechnet als absoluter Betrag der Rendite in Prozent des durchschnittlichen NIW für den Berichtszeitraum.
- 7 Berechnet als absoluter Betrag der Kosten in Prozent des durchschnittlichen NIW für den Berichtszeitraum.
- 8 Die von der Gegenpartei an den Werten der TRS vorgenommenen Abzüge berücksichtigen alle externen Gebühren, zu deren Zahlung sie verpflichtet ist, sowie alle Transaktionskosten und Gebühren, die normalerweise anfallen. Diese werden für die sechs Monate bis zum 31. Dezember 2023 wie folgt analysiert (alle in Prozent des durchschnittlichen NIW für den Berichtszeitraum):

Bezeichnung	Erl.	USD	% des NIW
Verwaltungsgebühren	9	17.961	0,01 %
Verwahrstellengebühren	9	9.339	0,01 %
Treuhändergebühren	9	2.155	0,00 %
Sonstige Aufwendungen	9,10	17.242	0,01 %
Anlageverwaltungsgebühren	9	32.329	0,02 %
Gebühren der Verwaltungsgesellschaft	9	21.553	0,02 %
Nicht bedingte Abzüge für Swap-Gegenpartei	11	147.439	0,10 %
Insgesamt		248.018	0,17 %

- 9 Diese Beträge werden von der TRS-Gegenpartei an den Teilfonds während der sechs Monate bis zum 31. Dezember 2023 gezahlt oder sind von der TRS-Gegenpartei zu zahlen.
- 10 Die sonstigen Aufwendungen sind im Prospekt der Gesellschaft beschrieben. Zum Beispiel (aber nicht beschränkt auf) laufende Organisations- und Eintragungsgebühren, Ausgaben für Rechtsberatung und prüfungsrelevante Leistungen sowie Marketingkosten.
- 11 Diese Beträge werden von der TRS-Gegenpartei des Teilfonds während der sechs Monate bis zum 31. Dezember 2023 einbehalten und beziehen sich auf Swap-Transaktionskosten und Index-Lizenzierungsgebühren.

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

Die Renditen und Kosten der von den Teilfonds für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 gehaltenen Total Return Swaps sind im Folgenden aufgeführt:

MSCI USA SF UCITS ETF

Art von Wertpapierfinanzierungsgeschäften	Erl.	Insgesamt	Organismus für gemeinsame Anlagen	Verwaltungsgesellschaft	Dritte
Total Return Swaps	1				
Absolute Werte		USD	USD	USD	USD
Rendite	2	(11.876.473)	(11.876.473)	null	null
Kosten	3,8	(635.412)	(635.412)	null	null
Wirtschaftlicher Nutzen	4	(11.241.061)	(11.241.061)	null	null
Prozentualer mit der jeweiligen Art erzielter Anteil an der Gesamrendite		% der Gesamrendite	% der Gesamrendite	% der Gesamrendite	% der Gesamrendite
Rendite		(100,00 %)	(100,00 %)	null	null
Kosten	5	(5,35 %)	(5,35 %)	null	null
Wirtschaftlicher Nutzen	4	(105,35 %)	(105,35 %)	null	null
Prozentualer Anteil am NIW		% des NIW	% des NIW	% des NIW	% des NIW
Rendite	6	(2,68 %)	(2,68 %)	null	null
Kosten	7,8	(0,14 %)	(0,14 %)	null	null
Wirtschaftlicher Nutzen	4	(2,82 %)	(2,82 %)	null	null

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

MSCI USA SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Hinweis

- 1 Mit Ausnahme von Total Return Swaps hat die Gesellschaft im Berichtszeitraum keine Wertpapierfinanzierungsgeschäfte getätigt.
- 2 Dies betrifft die realisierten und nicht realisierten Gewinne und Verluste aus den Fully Funded Swaps und Total Return Swaps (gemeinsam die „TRS“ gemäß der SFTR-Definition) während der sechs Monate zum 31. Dezember 2023, die in der zusammengefassten Gesamtergebnisrechnung enthalten sind und vor Abzug der mit ihnen im Zusammenhang stehenden Kosten aufgeführt sind.
- 3 Dies betrifft Abzüge auf die Werte der TRS in den sechs Monaten zum 31. Dezember 2023.
- 4 Berechnet als Differenz zwischen der Rendite und den Kosten.
- 5 Berechnet als absoluter Betrag der Kosten in Prozent des absoluten Betrags der Renditen.
- 6 Berechnet als absoluter Betrag der Rendite in Prozent des durchschnittlichen NIW für den Berichtszeitraum.
- 7 Berechnet als absoluter Betrag der Kosten in Prozent des durchschnittlichen NIW für den Berichtszeitraum.
- 8 Die von der Gegenpartei an den Werten der TRS vorgenommenen Abzüge berücksichtigen alle externen Gebühren, zu deren Zahlung sie verpflichtet ist, sowie alle Transaktionskosten und Gebühren, die normalerweise anfallen. Diese werden für die sechs Monate bis zum 31. Dezember 2023 wie folgt analysiert (alle in Prozent des durchschnittlichen NIW für den Berichtszeitraum):

Bezeichnung	Erl.	USD	% des NIW
Verwaltungsgebühren	9	55.738	0,01 %
Verwahrstellengebühren	9	28.984	0,01 %
Treuhändergebühren	9	6.689	0,00 %
Sonstige Aufwendungen	9,10	15.607	0,00 %
Anlageverwaltungsgebühren	9	100.328	0,02 %
Gebühren der Verwaltungsgesellschaft	9	66.885	0,02 %
Nicht bedingte Abzüge für Swap-Gegenpartei	11	361.181	0,08 %
Insgesamt		635.412	0,14 %

- 9 Diese Beträge werden von der TRS-Gegenpartei an den Teilfonds während der sechs Monate bis zum 31. Dezember 2023 gezahlt oder sind von der TRS-Gegenpartei zu zahlen.
- 10 Die sonstigen Aufwendungen sind im Prospekt der Gesellschaft beschrieben. Zum Beispiel (aber nicht beschränkt auf) laufende Organisations- und Eintragungsgebühren, Ausgaben für Rechtsberatung und prüfungsrelevante Leistungen sowie Marketingkosten.
- 11 Diese Beträge werden von der TRS-Gegenpartei des Teilfonds während der sechs Monate bis zum 31. Dezember 2023 einbehalten und beziehen sich auf Swap-Transaktionskosten und Index-Lizenzierungsgebühren.

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

Die Renditen und Kosten der von den Teilfonds für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 gehaltenen Total Return Swaps sind im Folgenden aufgeführt:

MSCI EMERGING MARKETS SF UCITS ETF

Art von Wertpapierfinanzierungsgeschäften	Erl.	Insgesamt	Organismus für gemeinsame Anlagen	Verwaltungsgesellschaft	Dritte
Total Return Swaps	1				
Absolute Werte		USD	USD	USD	USD
Rendite	2	(5.354.841)	(5.354.841)	null	null
Kosten	3,8	44.904	44.904	null	null
Wirtschaftlicher Nutzen	4	(5.399.745)	(5.399.745)	null	null
Prozentualer mit der jeweiligen Art erzielter Anteil an der Gesamrendite		% der Gesamrendite	% der Gesamrendite	% der Gesamrendite	% der Gesamrendite
Rendite		(100,00 %)	(100,00 %)	null	null
Kosten	5	0,84 %	0,84 %	null	null
Wirtschaftlicher Nutzen	4	(99,16 %)	(99,16 %)	null	null
Prozentualer Anteil am NIW		% des NIW	% des NIW	% des NIW	% des NIW
Rendite	6	(5,49 %)	(5,49 %)	null	null
Kosten	7,8	0,05 %	0,05 %	null	null
Wirtschaftlicher Nutzen	4	(5,44 %)	(5,44 %)	null	null

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

MSCI EMERGING MARKETS SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Hinweis

- 1 Mit Ausnahme von Total Return Swaps hat die Gesellschaft im Berichtszeitraum keine Wertpapierfinanzierungsgeschäfte getätigt.
- 2 Dies betrifft die realisierten und nicht realisierten Gewinne und Verluste aus den Fully Funded Swaps und Total Return Swaps (gemeinsam die „TRS“ gemäß der SFTR-Definition) während der sechs Monate zum 31. Dezember 2023, die in der zusammengefassten Gesamtergebnisrechnung enthalten sind und vor Abzug der mit ihnen im Zusammenhang stehenden Kosten aufgeführt sind.
- 3 Dies betrifft Abzüge auf die Werte der TRS in den sechs Monaten zum 31. Dezember 2023.
- 4 Berechnet als Differenz zwischen der Rendite und den Kosten.
- 5 Berechnet als absoluter Betrag der Kosten in Prozent des absoluten Betrags der Renditen.
- 6 Berechnet als absoluter Betrag der Rendite in Prozent des durchschnittlichen NIW für den Berichtszeitraum.
- 7 Berechnet als absoluter Betrag der Kosten in Prozent des durchschnittlichen NIW für den Berichtszeitraum.
- 8 Die von der Gegenpartei an den Werten der TRS vorgenommenen Abzüge berücksichtigen alle externen Gebühren, zu deren Zahlung sie verpflichtet ist, sowie alle Transaktionskosten und Gebühren, die normalerweise anfallen. Diese werden für die sechs Monate bis zum 31. Dezember 2023 wie folgt analysiert (alle in Prozent des durchschnittlichen NIW für den Berichtszeitraum):

Bezeichnung	Erl.	USD	% des NIW
Verwaltungsgebühren	9	12.249	0,01 %
Verwahrstellengebühren	9	6.369	0,01 %
Treuhändergebühren	9	1.470	0,00 %
Sonstige Aufwendungen	9,10	2.940	0,00 %
Anlageverwaltungsgebühren	9	43.438	0,04 %
Gebühren der Verwaltungsgesellschaft	9	14.699	0,02 %
Nicht bedingte Abzüge für Swap-Gegenpartei	11	(126.069)	(0,13 %)
Insgesamt		(44.904)	(0,05 %)

- 9 Diese Beträge werden von der TRS-Gegenpartei an den Teilfonds während der sechs Monate bis zum 31. Dezember 2023 gezahlt oder sind von der TRS-Gegenpartei zu zahlen.
- 10 Die sonstigen Aufwendungen sind im Prospekt der Gesellschaft beschrieben. Zum Beispiel (aber nicht beschränkt auf) laufende Organisations- und Eintragungsgebühren, Ausgaben für Rechtsberatung und prüfungsrelevante Leistungen sowie Marketingkosten.
- 11 Diese Beträge werden von der TRS-Gegenpartei des Teilfonds während der sechs Monate bis zum 31. Dezember 2023 einbehalten und beziehen sich auf Swap-Transaktionskosten und Index-Lizenzierungsgebühren.

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

Die Renditen und Kosten der von den Teilfonds für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 gehaltenen Total Return Swaps sind im Folgenden aufgeführt:

MSCI AC ASIA EX JAPAN SF UCITS ETF

Art von Wertpapierfinanzierungsgeschäften	Erl.	Insgesamt	Organismus für gemeinsame Anlagen	Verwaltungsgesellschaft	Dritte
Total Return Swaps	1				
Absolute Werte		USD	USD	USD	USD
Rendite	2	(18.759.492)	(18.759.492)	null	null
Kosten	3,8	(159.956)	(159.956)	null	null
Wirtschaftlicher Nutzen	4	(18.599.536)	(18.599.536)	null	null
Prozentualer mit der jeweiligen Art erzielter Anteil an der Gesamrendite		% der Gesamrendite	% der Gesamrendite	% der Gesamrendite	% der Gesamrendite
Rendite		(100,00 %)	(100,00 %)	null	null
Kosten	5	(0,85 %)	(0,85 %)	null	null
Wirtschaftlicher Nutzen	4	(100,85 %)	(100,85 %)	null	null
Prozentualer Anteil am NIW		% des NIW	% des NIW	% des NIW	% des NIW
Rendite	6	(8,18 %)	(8,18 %)	null	null
Kosten	7,8	(0,07 %)	(0,07 %)	null	null
Wirtschaftlicher Nutzen	4	(8,25 %)	(8,25 %)	null	null

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

MSCI AC ASIA EX JAPAN SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Hinweis

- 1 Mit Ausnahme von Total Return Swaps hat die Gesellschaft im Berichtszeitraum keine Wertpapierfinanzierungsgeschäfte getätigt.
- 2 Dies betrifft die realisierten und nicht realisierten Gewinne und Verluste aus den Fully Funded Swaps und Total Return Swaps (gemeinsam die „TRS“ gemäß der SFTR-Definition) während der sechs Monate zum 31. Dezember 2023, die in der zusammengefassten Gesamtergebnisrechnung enthalten sind und vor Abzug der mit ihnen im Zusammenhang stehenden Kosten aufgeführt sind.
- 3 Dies betrifft Abzüge auf die Werte der TRS in den sechs Monaten zum 31. Dezember 2023.
- 4 Berechnet als Differenz zwischen der Rendite und den Kosten.
- 5 Berechnet als absoluter Betrag der Kosten in Prozent des absoluten Betrags der Renditen.
- 6 Berechnet als absoluter Betrag der Rendite in Prozent des durchschnittlichen NIW für den Berichtszeitraum.
- 7 Berechnet als absoluter Betrag der Kosten in Prozent des durchschnittlichen NIW für den Berichtszeitraum.
- 8 Die von der Gegenpartei an den Werten der TRS vorgenommenen Abzüge berücksichtigen alle externen Gebühren, zu deren Zahlung sie verpflichtet ist, sowie alle Transaktionskosten und Gebühren, die normalerweise anfallen. Diese werden für die sechs Monate bis zum 31. Dezember 2023 wie folgt analysiert (alle in Prozent des durchschnittlichen NIW für den Berichtszeitraum):

Bezeichnung	Erl.	USD	% des NIW
Verwaltungsgebühren	9	28.804	0,01 %
Verwahrstellengebühren	9	14.978	0,01 %
Treuhändergebühren	9	3.456	0,00 %
Sonstige Aufwendungen	9,10	33.413	0,01 %
Anlageverwaltungsgebühren	9	109.455	0,05 %
Gebühren der Verwaltungsgesellschaft	9	34.565	0,02 %
Nicht bedingte Abzüge für Swap-Gegenpartei	11	(64.715)	(0,03 %)
Insgesamt		159.956	0,07 %

- 9 Diese Beträge werden von der TRS-Gegenpartei an den Teilfonds während der sechs Monate bis zum 31. Dezember 2023 gezahlt oder sind von der TRS-Gegenpartei zu zahlen.
- 10 Die sonstigen Aufwendungen sind im Prospekt der Gesellschaft beschrieben. Zum Beispiel (aber nicht beschränkt auf) laufende Organisations- und Eintragungsgebühren, Ausgaben für Rechtsberatung und prüfungsrelevante Leistungen sowie Marketingkosten.
- 11 Diese Beträge werden von der TRS-Gegenpartei des Teilfonds während der sechs Monate bis zum 31. Dezember 2023 einbehalten und beziehen sich auf Swap-Transaktionskosten und Index-Lizenzierungsgebühren.

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

Die Renditen und Kosten der von den Teilfonds für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 gehaltenen Total Return Swaps sind im Folgenden aufgeführt:

MSCI ACWI SF UCITS ETF

Art von Wertpapierfinanzierungsgeschäften	Erl.	Insgesamt	Organismus für gemeinsame Anlagen	Verwaltungsgesellschaft	Dritte
Total Return Swaps	1				
Absolute Werte		USD	USD	USD	USD
Rendite	2	(222.157.168)	(222.157.168)	null	null
Kosten	3,8	(583.737)	(583.737)	null	null
Wirtschaftlicher Nutzen	4	(221.573.431)	(221.573.431)	null	null
Prozentualer mit der jeweiligen Art erzielter Anteil an der Gesamrendite		% der Gesamtrendite	% der Gesamtrendite	% der Gesamtrendite	% der Gesamtrendite
Rendite		(100,00 %)	(100,00 %)	null	null
Kosten	5	(0,26 %)	(0,26 %)	null	null
Wirtschaftlicher Nutzen	4	(100,26 %)	(100,26 %)	null	null
Prozentualer Anteil am NIW		% des NIW	% des NIW	% des NIW	% des NIW
Rendite	6	(3,89 %)	(3,89 %)	null	null
Kosten	7,8	(0,02 %)	(0,02 %)	null	null
Wirtschaftlicher Nutzen	4	(3,91 %)	(3,91 %)	null	null

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

MSCI ACWI SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Hinweis

- 1 Mit Ausnahme von Total Return Swaps hat die Gesellschaft im Berichtszeitraum keine Wertpapierfinanzierungsgeschäfte getätigt.
- 2 Dies betrifft die realisierten und nicht realisierten Gewinne und Verluste aus den Fully Funded Swaps und Total Return Swaps (gemeinsam die „TRS“ gemäß der SFTR-Definition) während der sechs Monate zum 31. Dezember 2023, die in der zusammengefassten Gesamtergebnisrechnung enthalten sind und vor Abzug der mit ihnen im Zusammenhang stehenden Kosten aufgeführt sind.
- 3 Dies betrifft Abzüge auf die Werte der TRS in den sechs Monaten zum 31. Dezember 2023.
- 4 Berechnet als Differenz zwischen der Rendite und den Kosten.
- 5 Berechnet als absoluter Betrag der Kosten in Prozent des absoluten Betrags der Renditen.
- 6 Berechnet als absoluter Betrag der Rendite in Prozent des durchschnittlichen NIW für den Berichtszeitraum.
- 7 Berechnet als absoluter Betrag der Kosten in Prozent des durchschnittlichen NIW für den Berichtszeitraum.
- 8 Die von der Gegenpartei an den Werten der TRS vorgenommenen Abzüge berücksichtigen alle externen Gebühren, zu deren Zahlung sie verpflichtet ist, sowie alle Transaktionskosten und Gebühren, die normalerweise anfallen. Diese werden für die sechs Monate bis zum 31. Dezember 2023 wie folgt analysiert (alle in Prozent des durchschnittlichen NIW für den Berichtszeitraum):

Bezeichnung	Erl.	USD	% des NIW
Verwaltungsgebühren	9	717.954	0,01 %
Verwahrstellengebühren	9	373.336	0,01 %
Treuhändergebühren	9	86.155	0,00 %
Sonstige Aufwendungen	9,10	315.900	0,01 %
Anlageverwaltungsgebühren	9	2.728.225	0,05 %
Gebühren der Verwaltungsgesellschaft	9	861.545	0,02 %
Nicht bedingte Abzüge für Swap-Gegenpartei	11	(4.499.378)	(0,08 %)
Insgesamt		583.737	0,02 %

- 9 Diese Beträge werden von der TRS-Gegenpartei an den Teilfonds während der sechs Monate bis zum 31. Dezember 2023 gezahlt oder sind von der TRS-Gegenpartei zu zahlen.
- 10 Die sonstigen Aufwendungen sind im Prospekt der Gesellschaft beschrieben. Zum Beispiel (aber nicht beschränkt auf) laufende Organisations- und Eintragungsgebühren, Ausgaben für Rechtsberatung und prüfungsrelevante Leistungen sowie Marketingkosten.
- 11 Diese Beträge werden von der TRS-Gegenpartei des Teilfonds während der sechs Monate bis zum 31. Dezember 2023 einbehalten und beziehen sich auf Swap-Transaktionskosten und Index-Lizenzierungsgebühren.

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

Die Renditen und Kosten der von den Teilfonds für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 gehaltenen Total Return Swaps sind im Folgenden aufgeführt:

CMCI EX-AGRICULTURE SF UCITS ETF

Art von Wertpapierfinanzierungsgeschäften	Erl.	Insgesamt	Organismus für gemeinsame Anlagen	Verwaltungsgesellschaft	Dritte
Total Return Swaps	1				
Absolute Werte		USD	USD	USD	USD
Rendite	2	(6.849.678)	(6.849.678)	null	null
Kosten	3,8	(443.037)	(443.037)	null	null
Wirtschaftlicher Nutzen	4	(6.406.641)	(6.406.641)	null	null
Prozentualer mit der jeweiligen Art erzielter Anteil an der Gesamrendite		% der Gesamtrendite	% der Gesamtrendite	% der Gesamtrendite	% der Gesamtrendite
Rendite		(100,00 %)	(100,00 %)	null	null
Kosten	5	(6,47 %)	(6,47 %)	null	null
Wirtschaftlicher Nutzen	4	(106,47 %)	(106,47 %)	null	null
Prozentualer Anteil am NIW		% des NIW	% des NIW	% des NIW	% des NIW
Rendite	6	(5,29 %)	(5,29 %)	null	null
Kosten	7,8	(0,34 %)	(0,34 %)	null	null
Wirtschaftlicher Nutzen	4	(5,63 %)	(5,63 %)	null	null

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

CMCI EX-AGRICULTURE SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Hinweis

- 1 Mit Ausnahme von Total Return Swaps hat die Gesellschaft im Berichtszeitraum keine Wertpapierfinanzierungsgeschäfte getätigt.
- 2 Dies betrifft die realisierten und nicht realisierten Gewinne und Verluste aus den Fully Funded Swaps und Total Return Swaps (gemeinsam die „TRS“ gemäß der SFTR-Definition) während der sechs Monate zum 31. Dezember 2023, die in der zusammengefassten Gesamtergebnisrechnung enthalten sind und vor Abzug der mit ihnen im Zusammenhang stehenden Kosten aufgeführt sind.
- 3 Dies betrifft Abzüge auf die Werte der TRS in den sechs Monaten zum 31. Dezember 2023.
- 4 Berechnet als Differenz zwischen der Rendite und den Kosten.
- 5 Berechnet als absoluter Betrag der Kosten in Prozent des absoluten Betrags der Renditen.
- 6 Berechnet als absoluter Betrag der Rendite in Prozent des durchschnittlichen NIW für den Berichtszeitraum.
- 7 Berechnet als absoluter Betrag der Kosten in Prozent des durchschnittlichen NIW für den Berichtszeitraum.
- 8 Die von der Gegenpartei an den Werten der TRS vorgenommenen Abzüge berücksichtigen alle externen Gebühren, zu deren Zahlung sie verpflichtet ist, sowie alle Transaktionskosten und Gebühren, die normalerweise anfallen. Diese werden für die sechs Monate bis zum 31. Dezember 2023 wie folgt analysiert (alle in Prozent des durchschnittlichen NIW für den Berichtszeitraum):

Bezeichnung	Erl.	USD	% des NIW
Verwaltungsgebühren	9	16.361	0,01 %
Verwahrstellengebühren	9	8.507	0,01 %
Treuhändergebühren	9	1.963	0,00 %
Sonstige Aufwendungen	9,10	15.706	0,01 %
Anlageverwaltungsgebühren	9	114.523	0,09 %
Gebühren der Verwaltungsgesellschaft	9	65.442	0,05 %
Nicht bedingte Abzüge für Swap-Gegenpartei	11	220.535	0,17 %
Insgesamt		443.037	0,34 %

- 9 Diese Beträge werden von der TRS-Gegenpartei an den Teilfonds während der sechs Monate bis zum 31. Dezember 2023 gezahlt oder sind von der TRS-Gegenpartei zu zahlen.
- 10 Die sonstigen Aufwendungen sind im Prospekt der Gesellschaft beschrieben. Zum Beispiel (aber nicht beschränkt auf) laufende Organisations- und Eintragungsgebühren, Ausgaben für Rechtsberatung und prüfungsrelevante Leistungen sowie Marketingkosten.
- 11 Diese Beträge werden von der TRS-Gegenpartei des Teilfonds während der sechs Monate bis zum 31. Dezember 2023 einbehalten und beziehen sich auf Swap-Transaktionskosten und Index-Lizenzierungsgebühren.

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

Die Renditen und Kosten der von den Teilfonds für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 gehaltenen Total Return Swaps sind im Folgenden aufgeführt:

BLOOMBERG COMMODITY CMCI SF UCITS ETF

Art von Wertpapierfinanzierungsgeschäften	Erl.	Insgesamt	Organismus für gemeinsame Anlagen	Verwaltungsgesellschaft	Dritte
Total Return Swaps	1				
Absolute Werte		USD	USD	USD	USD
Rendite	2	(81.016.247)	(81.016.247)	null	null
Kosten	3,8	(2.532.316)	(2.532.316)	null	null
Wirtschaftlicher Nutzen	4	(78.483.931)	(78.483.931)	null	null
Prozentualer mit der jeweiligen Art erzielter Anteil an der Gesamrendite		% der Gesamrendite	% der Gesamrendite	% der Gesamrendite	% der Gesamrendite
Rendite		(100,00 %)	(100,00 %)	null	null
Kosten	5	(3,13 %)	(3,13 %)	null	null
Wirtschaftlicher Nutzen	4	(103,13 %)	(103,13 %)	null	null
Prozentualer Anteil am NIW		% des NIW	% des NIW	% des NIW	% des NIW
Rendite	6	(10,59 %)	(10,59 %)	null	null
Kosten	7,8	(0,33 %)	(0,33 %)	null	null
Wirtschaftlicher Nutzen	4	(10,92 %)	(10,92 %)	null	null

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

BLOOMBERG COMMODITY CMCI SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Hinweis

- 1 Mit Ausnahme von Total Return Swaps hat die Gesellschaft im Berichtszeitraum keine Wertpapierfinanzierungsgeschäfte getätigt.
- 2 Dies betrifft die realisierten und nicht realisierten Gewinne und Verluste aus den Fully Funded Swaps und Total Return Swaps (gemeinsam die „TRS“ gemäß der SFTR-Definition) während der sechs Monate zum 31. Dezember 2023, die in der zusammengefassten Gesamtergebnisrechnung enthalten sind und vor Abzug der mit ihnen im Zusammenhang stehenden Kosten aufgeführt sind.
- 3 Dies betrifft Abzüge auf die Werte der TRS in den sechs Monaten zum 31. Dezember 2023.
- 4 Berechnet als Differenz zwischen der Rendite und den Kosten.
- 5 Berechnet als absoluter Betrag der Kosten in Prozent des absoluten Betrags der Renditen.
- 6 Berechnet als absoluter Betrag der Rendite in Prozent des durchschnittlichen NIW für den Berichtszeitraum.
- 7 Berechnet als absoluter Betrag der Kosten in Prozent des durchschnittlichen NIW für den Berichtszeitraum.
- 8 Die von der Gegenpartei an den Werten der TRS vorgenommenen Abzüge berücksichtigen alle externen Gebühren, zu deren Zahlung sie verpflichtet ist, sowie alle Transaktionskosten und Gebühren, die normalerweise anfallen. Diese werden für die sechs Monate bis zum 31. Dezember 2023 wie folgt analysiert (alle in Prozent des durchschnittlichen NIW für den Berichtszeitraum):

Bezeichnung	Erl.	USD	% des NIW
Verwaltungsgebühren	9	96.254	0,01 %
Verwahrstellengebühren	9	50.052	0,01 %
Treuhändergebühren	9	11.551	0,00 %
Sonstige Aufwendungen	9,10	92.404	0,01 %
Anlageverwaltungsgebühren	9	673.779	0,09 %
Gebühren der Verwaltungsgesellschaft	9	385.017	0,05 %
Nicht bedingte Abzüge für Swap-Gegenpartei	11	1.223.259	0,16 %
Insgesamt		2.532.316	0,33 %

- 9 Diese Beträge werden von der TRS-Gegenpartei an den Teilfonds während der sechs Monate bis zum 31. Dezember 2023 gezahlt oder sind von der TRS-Gegenpartei zu zahlen.
- 10 Die sonstigen Aufwendungen sind im Prospekt der Gesellschaft beschrieben. Zum Beispiel (aber nicht beschränkt auf) laufende Organisations- und Eintragungsgebühren, Ausgaben für Rechtsberatung und prüfungsrelevante Leistungen sowie Marketingkosten.
- 11 Diese Beträge werden von der TRS-Gegenpartei des Teilfonds während der sechs Monate bis zum 31. Dezember 2023 einbehalten und beziehen sich auf Swap-Transaktionskosten und Index-Lizenzierungsgebühren.

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

Die Renditen und Kosten der von den Teilfonds für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 gehaltenen Total Return Swaps sind im Folgenden aufgeführt:

CMCI COMMODITY CARRY SF UCITS ETF

Art von Wertpapierfinanzierungsgeschäften	Erl.	Insgesamt	Organismus für gemeinsame Anlagen	Verwaltungsgesellschaft	Dritte
Total Return Swaps	1				
Absolute Werte		USD	USD	USD	USD
Rendite	2	(10.739.211)	(10.739.211)	null	null
Kosten	3,8	(262.060)	(262.060)	null	null
Wirtschaftlicher Nutzen	4	(10.477.151)	(10.477.151)	null	null
Prozentualer mit der jeweiligen Art erzielter Anteil an der Gesamrendite		% der Gesamrendite	% der Gesamrendite	% der Gesamrendite	% der Gesamrendite
Rendite		(100,00 %)	(100,00 %)	null	null
Kosten	5	(2,44 %)	(2,44 %)	null	null
Wirtschaftlicher Nutzen	4	(102,44 %)	(102,44 %)	null	null
Prozentualer Anteil am NIW		% des NIW	% des NIW	% des NIW	% des NIW
Rendite	6	(5,80 %)	(5,80 %)	null	null
Kosten	7,8	(0,14 %)	(0,14 %)	null	null
Wirtschaftlicher Nutzen	4	(5,94 %)	(5,94 %)	null	null

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

CMCI COMMODITY CARRY SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Hinweis

- 1 Mit Ausnahme von Total Return Swaps hat die Gesellschaft im Berichtszeitraum keine Wertpapierfinanzierungsgeschäfte getätigt.
- 2 Dies betrifft die realisierten und nicht realisierten Gewinne und Verluste aus den Fully Funded Swaps und Total Return Swaps (gemeinsam die „TRS“ gemäß der SFTR-Definition) während der sechs Monate zum 31. Dezember 2023, die in der zusammengefassten Gesamtergebnisrechnung enthalten sind und vor Abzug der mit ihnen im Zusammenhang stehenden Kosten aufgeführt sind.
- 3 Dies betrifft Abzüge auf die Werte der TRS in den sechs Monaten zum 31. Dezember 2023.
- 4 Berechnet als Differenz zwischen der Rendite und den Kosten.
- 5 Berechnet als absoluter Betrag der Kosten in Prozent des absoluten Betrags der Renditen.
- 6 Berechnet als absoluter Betrag der Rendite in Prozent des durchschnittlichen NIW für den Berichtszeitraum.
- 7 Berechnet als absoluter Betrag der Kosten in Prozent des durchschnittlichen NIW für den Berichtszeitraum.
- 8 Die von der Gegenpartei an den Werten der TRS vorgenommenen Abzüge berücksichtigen alle externen Gebühren, zu deren Zahlung sie verpflichtet ist, sowie alle Transaktionskosten und Gebühren, die normalerweise anfallen. Diese werden für die sechs Monate bis zum 31. Dezember 2023 wie folgt analysiert (alle in Prozent des durchschnittlichen NIW für den Berichtszeitraum):

Bezeichnung	Erl.	USD	% des NIW
Verwaltungsgebühren	9	23.279	0,01 %
Verwahrstellengebühren	9	12.105	0,01 %
Treuhändergebühren	9	2.793	0,00 %
Sonstige Aufwendungen	9,10	22.348	0,01 %
Anlageverwaltungsgebühren	9	162.950	0,09 %
Gebühren der Verwaltungsgesellschaft	9	93.114	0,05 %
Nicht bedingte Abzüge für Swap-Gegenpartei	11	(54.529)	(0,03 %)
Insgesamt		262.060	0,14 %

- 9 Diese Beträge werden von der TRS-Gegenpartei an den Teilfonds während der sechs Monate bis zum 31. Dezember 2023 gezahlt oder sind von der TRS-Gegenpartei zu zahlen.
- 10 Die sonstigen Aufwendungen sind im Prospekt der Gesellschaft beschrieben. Zum Beispiel (aber nicht beschränkt auf) laufende Organisations- und Eintragungsgebühren, Ausgaben für Rechtsberatung und prüfungsrelevante Leistungen sowie Marketingkosten.
- 11 Diese Beträge werden von der TRS-Gegenpartei des Teilfonds während der sechs Monate bis zum 31. Dezember 2023 einbehalten und beziehen sich auf Swap-Transaktionskosten und Index-Lizenzierungsgebühren.

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

Die Renditen und Kosten der von den Teilfonds für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 gehaltenen Total Return Swaps sind im Folgenden aufgeführt:

MSCI CHINA A SF UCITS ETF

Art von Wertpapierfinanzierungsgeschäften	Erl.	Insgesamt	Organismus für gemeinsame Anlagen	Verwaltungsgesellschaft	Dritte
Total Return Swaps	1				
Absolute Werte		USD	USD	USD	USD
Rendite	2	(17.593.443)	(17.593.443)	null	null
Kosten	3,8	983.273	983.273	null	null
Wirtschaftlicher Nutzen	4	(18.576.716)	(18.576.716)	null	null
Prozentualer mit der jeweiligen Art erzielter Anteil an der Gesamrendite		% der Gesamrendite	% der Gesamrendite	% der Gesamrendite	% der Gesamrendite
Rendite		(100,00 %)	(100,00 %)	null	null
Kosten	5	5,59 %	5,59 %	null	null
Wirtschaftlicher Nutzen	4	(94,41 %)	(94,41 %)	null	null
Prozentualer Anteil am NIW		% des NIW	% des NIW	% des NIW	% des NIW
Rendite	6	(16,13 %)	(16,13 %)	null	null
Kosten	7,8	0,91 %	0,91 %	null	null
Wirtschaftlicher Nutzen	4	(15,22 %)	(15,22 %)	null	null

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

MSCI CHINA A SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Hinweis

- 1 Mit Ausnahme von Total Return Swaps hat die Gesellschaft im Berichtszeitraum keine Wertpapierfinanzierungsgeschäfte getätigt.
- 2 Dies betrifft die realisierten und nicht realisierten Gewinne und Verluste aus den Fully Funded Swaps und Total Return Swaps (gemeinsam die „TRS“ gemäß der SFTR-Definition) während der sechs Monate zum 31. Dezember 2023, die in der zusammengefassten Gesamtergebnisrechnung enthalten sind und vor Abzug der mit ihnen im Zusammenhang stehenden Kosten aufgeführt sind.
- 3 Dies betrifft Abzüge auf die Werte der TRS in den sechs Monaten zum 31. Dezember 2023.
- 4 Berechnet als Differenz zwischen der Rendite und den Kosten.
- 5 Berechnet als absoluter Betrag der Kosten in Prozent des absoluten Betrags der Renditen.
- 6 Berechnet als absoluter Betrag der Rendite in Prozent des durchschnittlichen NIW für den Berichtszeitraum.
- 7 Berechnet als absoluter Betrag der Kosten in Prozent des durchschnittlichen NIW für den Berichtszeitraum.
- 8 Die von der Gegenpartei an den Werten der TRS vorgenommenen Abzüge berücksichtigen alle externen Gebühren, zu deren Zahlung sie verpflichtet ist, sowie alle Transaktionskosten und Gebühren, die normalerweise anfallen. Diese werden für die sechs Monate bis zum 31. Dezember 2023 wie folgt analysiert (alle in Prozent des durchschnittlichen NIW für den Berichtszeitraum):

Bezeichnung	Erl.	USD	% des NIW
Verwaltungsgebühren	9	13.710	0,01 %
Verwahrstellengebühren	9	7.129	0,01 %
Treuhändergebühren	9	1.645	0,00 %
Sonstige Aufwendungen	9,10	14.258	0,01 %
Anlageverwaltungsgebühren	9	66.294	0,06 %
Gebühren der Verwaltungsgesellschaft	9	32.904	0,03 %
Nicht bedingte Abzüge für Swap-Gegenpartei	11	(1.119.213)	(1,03 %)
Insgesamt		(983.273)	(0,91 %)

- 9 Diese Beträge werden von der TRS-Gegenpartei an den Teilfonds während der sechs Monate bis zum 31. Dezember 2023 gezahlt oder sind von der TRS-Gegenpartei zu zahlen.
- 10 Die sonstigen Aufwendungen sind im Prospekt der Gesellschaft beschrieben. Zum Beispiel (aber nicht beschränkt auf) laufende Organisations- und Eintragungsgebühren, Ausgaben für Rechtsberatung und prüfungsrelevante Leistungen sowie Marketingkosten.
- 11 Diese Beträge werden von der TRS-Gegenpartei des Teilfonds während der sechs Monate bis zum 31. Dezember 2023 einbehalten und beziehen sich auf Swap-Transaktionskosten und Index-Lizenzierungsgebühren.

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

Die Renditen und Kosten der von den Teilfonds für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 gehaltenen Total Return Swaps sind im Folgenden aufgeführt:

EURO EQUITY DEFENSIVE COVERED CALL SF UCITS ETF

Art von Wertpapierfinanzierungsgeschäften	Erl.	Insgesamt	Organismus für gemeinsame Anlagen	Verwaltungsgesellschaft	Dritte
Total Return Swaps	1				
Absolute Werte		EUR	EUR	EUR	EUR
Rendite	2	(431.696)	(431.696)	null	null
Kosten	3,8	2.114	2.114	null	null
Wirtschaftlicher Nutzen	4	(433.810)	(433.810)	null	null
Prozentualer mit der jeweiligen Art erzielter Anteil an der Gesamrendite		% der Gesamtrendite	% der Gesamtrendite	% der Gesamtrendite	% der Gesamtrendite
Rendite		(100,00 %)	(100,00 %)	null	null
Kosten	5	0,49 %	0,49 %	null	null
Wirtschaftlicher Nutzen	4	(99,51 %)	(99,51 %)	null	null
Prozentualer Anteil am NIW		% des NIW	% des NIW	% des NIW	% des NIW
Rendite	6	(10,27 %)	(10,27 %)	null	null
Kosten	7,8	0,05 %	0,05 %	null	null
Wirtschaftlicher Nutzen	4	(10,22 %)	(10,22 %)	null	null

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

EURO EQUITY DEFENSIVE COVERED CALL SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Hinweis

- 1 Mit Ausnahme von Total Return Swaps hat die Gesellschaft im Berichtszeitraum keine Wertpapierfinanzierungsgeschäfte getätigt.
- 2 Dies betrifft die realisierten und nicht realisierten Gewinne und Verluste aus den Fully Funded Swaps und Total Return Swaps (gemeinsam die „TRS“ gemäß der SFTR-Definition) während der sechs Monate zum 31. Dezember 2023, die in der zusammengefassten Gesamtergebnisrechnung enthalten sind und vor Abzug der mit ihnen im Zusammenhang stehenden Kosten aufgeführt sind.
- 3 Dies betrifft Abzüge auf die Werte der TRS in den sechs Monaten zum 31. Dezember 2023.
- 4 Berechnet als Differenz zwischen der Rendite und den Kosten.
- 5 Berechnet als absoluter Betrag der Kosten in Prozent des absoluten Betrags der Renditen.
- 6 Berechnet als absoluter Betrag der Rendite in Prozent des durchschnittlichen NIW für den Berichtszeitraum.
- 7 Berechnet als absoluter Betrag der Kosten in Prozent des durchschnittlichen NIW für den Berichtszeitraum.
- 8 Die von der Gegenpartei an den Werten der TRS vorgenommenen Abzüge berücksichtigen alle externen Gebühren, zu deren Zahlung sie verpflichtet ist, sowie alle Transaktionskosten und Gebühren, die normalerweise anfallen. Diese werden für die sechs Monate bis zum 31. Dezember 2023 wie folgt analysiert (alle in Prozent des durchschnittlichen NIW für den Berichtszeitraum):

Bezeichnung	Erl.	EUR	% des NIW
Verwaltungsgebühren	9	528	0,01 %
Verwahrstellengebühren	9	275	0,01 %
Treuhändergebühren	9	63	0,00 %
Sonstige Aufwendungen	9,10	507	0,01 %
Anlageverwaltungsgebühren	9	3.064	0,07 %
Gebühren der Verwaltungsgesellschaft	9	1.057	0,03 %
Nicht bedingte Abzüge für Swap-Gegenpartei	11	(7.608)	(0,18 %)
Insgesamt		(2.114)	(0,05 %)

- 9 Diese Beträge werden von der TRS-Gegenpartei an den Teilfonds während der sechs Monate bis zum 31. Dezember 2023 gezahlt oder sind von der TRS-Gegenpartei zu zahlen.
- 10 Die sonstigen Aufwendungen sind im Prospekt der Gesellschaft beschrieben. Zum Beispiel (aber nicht beschränkt auf) laufende Organisations- und Eintragungsgebühren, Ausgaben für Rechtsberatung und prüfungsrelevante Leistungen sowie Marketingkosten.
- 11 Diese Beträge werden von der TRS-Gegenpartei des Teilfonds während der sechs Monate bis zum 31. Dezember 2023 einbehalten und beziehen sich auf Swap-Transaktionskosten und Index-Lizenzierungsgebühren.

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

Die Renditen und Kosten der von den Teilfonds für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 gehaltenen Total Return Swaps sind im Folgenden aufgeführt:

EURO EQUITY DEFENSIVE PUT WRITE SF UCITS ETF

Art von Wertpapierfinanzierungsgeschäften	Erl.	Insgesamt	Organismus für gemeinsame Anlagen	Verwaltungsgesellschaft	Dritte
Total Return Swaps	1				
Absolute Werte		EUR	EUR	EUR	EUR
Rendite	2	(1.803.619)	(1.803.619)	null	null
Kosten	3,8	(35.887)	(35.887)	null	null
Wirtschaftlicher Nutzen	4	(1.767.732)	(1.767.732)	null	null
Prozentualer mit der jeweiligen Art erzielter Anteil an der Gesamrendite		% der Gesamtrendite	% der Gesamtrendite	% der Gesamtrendite	% der Gesamtrendite
Rendite		(100,00 %)	(100,00 %)	null	null
Kosten	5	(1,99 %)	(1,99 %)	null	null
Wirtschaftlicher Nutzen	4	(101,99 %)	(101,99 %)	null	null
Prozentualer Anteil am NIW		% des NIW	% des NIW	% des NIW	% des NIW
Rendite	6	(6,32 %)	(6,32 %)	null	null
Kosten	7,8	(0,12 %)	(0,12 %)	null	null
Wirtschaftlicher Nutzen	4	(6,44 %)	(6,44 %)	null	null

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

EURO EQUITY DEFENSIVE PUT WRITE SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Hinweis

- 1 Mit Ausnahme von Total Return Swaps hat die Gesellschaft im Berichtszeitraum keine Wertpapierfinanzierungsgeschäfte getätigt.
- 2 Dies betrifft die realisierten und nicht realisierten Gewinne und Verluste aus den Fully Funded Swaps und Total Return Swaps (gemeinsam die „TRS“ gemäß der SFTR-Definition) während der sechs Monate zum 31. Dezember 2023, die in der zusammengefassten Gesamtergebnisrechnung enthalten sind und vor Abzug der mit ihnen im Zusammenhang stehenden Kosten aufgeführt sind.
- 3 Dies betrifft Abzüge auf die Werte der TRS in den sechs Monaten zum 31. Dezember 2023.
- 4 Berechnet als Differenz zwischen der Rendite und den Kosten.
- 5 Berechnet als absoluter Betrag der Kosten in Prozent des absoluten Betrags der Renditen.
- 6 Berechnet als absoluter Betrag der Rendite in Prozent des durchschnittlichen NIW für den Berichtszeitraum.
- 7 Berechnet als absoluter Betrag der Kosten in Prozent des durchschnittlichen NIW für den Berichtszeitraum.
- 8 Die von der Gegenpartei an den Werten der TRS vorgenommenen Abzüge berücksichtigen alle externen Gebühren, zu deren Zahlung sie verpflichtet ist, sowie alle Transaktionskosten und Gebühren, die normalerweise anfallen. Diese werden für die sechs Monate bis zum 31. Dezember 2023 wie folgt analysiert (alle in Prozent des durchschnittlichen NIW für den Berichtszeitraum):

Bezeichnung	Erl.	EUR	% des NIW
Verwaltungsgebühren	9	3.589	0,01 %
Verwahrstellengebühren	9	1.866	0,01 %
Treuhändergebühren	9	431	0,00 %
Sonstige Aufwendungen	9,10	3.445	0,01 %
Anlageverwaltungsgebühren	9	20.814	0,07 %
Gebühren der Verwaltungsgesellschaft	9	7.177	0,03 %
Nicht bedingte Abzüge für Swap-Gegenpartei	11	(1.435)	(0,01 %)
Insgesamt		35.887	0,12 %

- 9 Diese Beträge werden von der TRS-Gegenpartei an den Teilfonds während der sechs Monate bis zum 31. Dezember 2023 gezahlt oder sind von der TRS-Gegenpartei zu zahlen.
- 10 Die sonstigen Aufwendungen sind im Prospekt der Gesellschaft beschrieben. Zum Beispiel (aber nicht beschränkt auf) laufende Organisations- und Eintragungsgebühren, Ausgaben für Rechtsberatung und prüfungsrelevante Leistungen sowie Marketingkosten.
- 11 Diese Beträge werden von der TRS-Gegenpartei des Teilfonds während der sechs Monate bis zum 31. Dezember 2023 einbehalten und beziehen sich auf Swap-Transaktionskosten und Index-Lizenzierungsgebühren.

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

Die Renditen und Kosten der von den Teilfonds für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 gehaltenen Total Return Swaps sind im Folgenden aufgeführt:

US EQUITY DEFENSIVE COVERED CALL SF UCITS ETF

Art von Wertpapierfinanzierungsgeschäften	Erl.	Insgesamt	Organismus für gemeinsame Anlagen	Verwaltungsgesellschaft	Dritte
Total Return Swaps	1				
Absolute Werte		USD	USD	USD	USD
Rendite	2	(297.942)	(297.942)	null	null
Kosten	3,8	(2.066)	(2.066)	null	null
Wirtschaftlicher Nutzen	4	(295.876)	(295.876)	null	null
Prozentualer mit der jeweiligen Art erzielter Anteil an der Gesamtrendite		% der Gesamtrendite	% der Gesamtrendite	% der Gesamtrendite	% der Gesamtrendite
Rendite		(100,00 %)	(100,00 %)	null	null
Kosten	5	(0,69 %)	(0,69 %)	null	null
Wirtschaftlicher Nutzen	4	(100,69 %)	(100,69 %)	null	null
Prozentualer Anteil am NIW		% des NIW	% des NIW	% des NIW	% des NIW
Rendite	6	(5,77 %)	(5,77 %)	null	null
Kosten	7,8	(0,04 %)	(0,04 %)	null	null
Wirtschaftlicher Nutzen	4	(5,81 %)	(5,81 %)	null	null

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

US EQUITY DEFENSIVE COVERED CALL SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Hinweis

- 1 Mit Ausnahme von Total Return Swaps hat die Gesellschaft im Berichtszeitraum keine Wertpapierfinanzierungsgeschäfte getätigt.
- 2 Dies betrifft die realisierten und nicht realisierten Gewinne und Verluste aus den Fully Funded Swaps und Total Return Swaps (gemeinsam die „TRS“ gemäß der SFTR-Definition) während der sechs Monate zum 31. Dezember 2023, die in der zusammengefassten Gesamtergebnisrechnung enthalten sind und vor Abzug der mit ihnen im Zusammenhang stehenden Kosten aufgeführt sind.
- 3 Dies betrifft Abzüge auf die Werte der TRS in den sechs Monaten zum 31. Dezember 2023.
- 4 Berechnet als Differenz zwischen der Rendite und den Kosten.
- 5 Berechnet als absoluter Betrag der Kosten in Prozent des absoluten Betrags der Renditen.
- 6 Berechnet als absoluter Betrag der Rendite in Prozent des durchschnittlichen NIW für den Berichtszeitraum.
- 7 Berechnet als absoluter Betrag der Kosten in Prozent des durchschnittlichen NIW für den Berichtszeitraum.
- 8 Die von der Gegenpartei an den Werten der TRS vorgenommenen Abzüge berücksichtigen alle externen Gebühren, zu deren Zahlung sie verpflichtet ist, sowie alle Transaktionskosten und Gebühren, die normalerweise anfallen. Diese werden für die sechs Monate bis zum 31. Dezember 2023 wie folgt analysiert (alle in Prozent des durchschnittlichen NIW für den Berichtszeitraum):

Bezeichnung	Erl.	USD	% des NIW
Verwaltungsgebühren	9	646	0,01 %
Verwahrstellengebühren	9	336	0,01 %
Treuhändergebühren	9	77	0,00 %
Sonstige Aufwendungen	9,10	491	0,01 %
Anlageverwaltungsgebühren	9	3.744	0,07 %
Gebühren der Verwaltungsgesellschaft	9	1.291	0,03 %
Nicht bedingte Abzüge für Swap-Gegenpartei	11	(4.519)	(0,09 %)
Insgesamt		2.066	0,04 %

- 9 Diese Beträge werden von der TRS-Gegenpartei an den Teilfonds während der sechs Monate bis zum 31. Dezember 2023 gezahlt oder sind von der TRS-Gegenpartei zu zahlen.
- 10 Die sonstigen Aufwendungen sind im Prospekt der Gesellschaft beschrieben. Zum Beispiel (aber nicht beschränkt auf) laufende Organisations- und Eintragungsgebühren, Ausgaben für Rechtsberatung und prüfungsrelevante Leistungen sowie Marketingkosten.
- 11 Diese Beträge werden von der TRS-Gegenpartei des Teilfonds während der sechs Monate bis zum 31. Dezember 2023 einbehalten und beziehen sich auf Swap-Transaktionskosten und Index-Lizenzierungsgebühren.

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

Die Renditen und Kosten der von den Teilfonds für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 gehaltenen Total Return Swaps sind im Folgenden aufgeführt:

US EQUITY DEFENSIVE PUT WRITE SF UCITS ETF

Art von Wertpapierfinanzierungsgeschäften	Erl.	Insgesamt	Organismus für gemeinsame Anlagen	Verwaltungsgesellschaft	Dritte
Total Return Swaps	1				
Absolute Werte		USD	USD	USD	USD
Rendite	2	(1.293.658)	(1.293.658)	null	null
Kosten	3,8	(3.422)	(3.422)	null	null
Wirtschaftlicher Nutzen	4	(1.290.236)	(1.290.236)	null	null
Prozentualer mit der jeweiligen Art erzielter Anteil an der Gesamrendite		% der Gesamtrendite	% der Gesamtrendite	% der Gesamtrendite	% der Gesamtrendite
Rendite		(100,00 %)	(100,00 %)	null	null
Kosten	5	(0,26 %)	(0,26 %)	null	null
Wirtschaftlicher Nutzen	4	(100,26 %)	(100,26 %)	null	null
Prozentualer Anteil am NIW		% des NIW	% des NIW	% des NIW	% des NIW
Rendite	6	(6,65 %)	(6,65 %)	null	null
Kosten	7,8	(0,02 %)	(0,02 %)	null	null
Wirtschaftlicher Nutzen	4	(6,67 %)	(6,67 %)	null	null

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

US EQUITY DEFENSIVE PUT WRITE SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Hinweis

- 1 Mit Ausnahme von Total Return Swaps hat die Gesellschaft im Berichtszeitraum keine Wertpapierfinanzierungsgeschäfte getätigt.
- 2 Dies betrifft die realisierten und nicht realisierten Gewinne und Verluste aus den Fully Funded Swaps und Total Return Swaps (gemeinsam die „TRS“ gemäß der SFTR-Definition) während der sechs Monate zum 31. Dezember 2023, die in der zusammengefassten Gesamtergebnisrechnung enthalten sind und vor Abzug der mit ihnen im Zusammenhang stehenden Kosten aufgeführt sind.
- 3 Dies betrifft Abzüge auf die Werte der TRS in den sechs Monaten zum 31. Dezember 2023.
- 4 Berechnet als Differenz zwischen der Rendite und den Kosten.
- 5 Berechnet als absoluter Betrag der Kosten in Prozent des absoluten Betrags der Renditen.
- 6 Berechnet als absoluter Betrag der Rendite in Prozent des durchschnittlichen NIW für den Berichtszeitraum.
- 7 Berechnet als absoluter Betrag der Kosten in Prozent des durchschnittlichen NIW für den Berichtszeitraum.
- 8 Die von der Gegenpartei an den Werten der TRS vorgenommenen Abzüge berücksichtigen alle externen Gebühren, zu deren Zahlung sie verpflichtet ist, sowie alle Transaktionskosten und Gebühren, die normalerweise anfallen. Diese werden für die sechs Monate bis zum 31. Dezember 2023 wie folgt analysiert (alle in Prozent des durchschnittlichen NIW für den Berichtszeitraum):

Bezeichnung	Erl.	USD	% des NIW
Verwaltungsgebühren	9	2.444	0,01 %
Verwahrstellengebühren	9	1.271	0,01 %
Treuhändergebühren	9	293	0,00 %
Sonstige Aufwendungen	9,10	2.347	0,01 %
Anlageverwaltungsgebühren	9	14.177	0,07 %
Gebühren der Verwaltungsgesellschaft	9	4.889	0,03 %
Nicht bedingte Abzüge für Swap-Gegenpartei	11	(21.999)	(0,11 %)
Insgesamt		3.422	0,02 %

- 9 Diese Beträge werden von der TRS-Gegenpartei an den Teilfonds während der sechs Monate bis zum 31. Dezember 2023 gezahlt oder sind von der TRS-Gegenpartei zu zahlen.
- 10 Die sonstigen Aufwendungen sind im Prospekt der Gesellschaft beschrieben. Zum Beispiel (aber nicht beschränkt auf) laufende Organisations- und Eintragungsgebühren, Ausgaben für Rechtsberatung und prüfungsrelevante Leistungen sowie Marketingkosten.
- 11 Diese Beträge werden von der TRS-Gegenpartei des Teilfonds während der sechs Monate bis zum 31. Dezember 2023 einbehalten und beziehen sich auf Swap-Transaktionskosten und Index-Lizenzierungsgebühren.

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

Die Renditen und Kosten der von den Teilfonds für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 gehaltenen Total Return Swaps sind im Folgenden aufgeführt:

MSCI USA SF INDEX FUND

Art von Wertpapierfinanzierungsgeschäften	Erl.	Insgesamt	Organismus für gemeinsame Anlagen	Verwaltungsgesellschaft	Dritte
Total Return Swaps	1				
Absolute Werte		USD	USD	USD	USD
Rendite	2	(24.810.873)	(24.810.873)	null	null
Kosten	3,8	(1.305.409)	(1.305.409)	null	null
Wirtschaftlicher Nutzen	4	(23.505.464)	(23.505.464)	null	null
Prozentualer mit der jeweiligen Art erzielter Anteil an der Gesamrendite		% der Gesamtrendite	% der Gesamtrendite	% der Gesamtrendite	% der Gesamtrendite
Rendite		(100,00 %)	(100,00 %)	null	null
Kosten	5	(5,26 %)	(5,26 %)	null	null
Wirtschaftlicher Nutzen	4	(105,26 %)	(105,26 %)	null	null
Prozentualer Anteil am NIW		% des NIW	% des NIW	% des NIW	% des NIW
Rendite	6	(2,50 %)	(2,50 %)	null	null
Kosten	7,8	(0,13 %)	(0,13 %)	null	null
Wirtschaftlicher Nutzen	4	(2,63 %)	(2,63 %)	null	null

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

MSCI USA SF INDEX FUND (Fortsetzung)

Hinweis

- 1 Mit Ausnahme von Total Return Swaps hat die Gesellschaft im Berichtszeitraum keine Wertpapierfinanzierungsgeschäfte getätigt.
- 2 Dies betrifft die realisierten und nicht realisierten Gewinne und Verluste aus den Fully Funded Swaps und Total Return Swaps (gemeinsam die „TRS“ gemäß der SFTR-Definition) während der sechs Monate zum 31. Dezember 2023, die in der zusammengefassten Gesamtergebnisrechnung enthalten sind und vor Abzug der mit ihnen im Zusammenhang stehenden Kosten aufgeführt sind.
- 3 Dies betrifft Abzüge auf die Werte der TRS in den sechs Monaten zum 31. Dezember 2023.
- 4 Berechnet als Differenz zwischen der Rendite und den Kosten.
- 5 Berechnet als absoluter Betrag der Kosten in Prozent des absoluten Betrags der Renditen.
- 6 Berechnet als absoluter Betrag der Rendite in Prozent des durchschnittlichen NIW für den Berichtszeitraum.
- 7 Berechnet als absoluter Betrag der Kosten in Prozent des durchschnittlichen NIW für den Berichtszeitraum.
- 8 Die von der Gegenpartei an den Werten der TRS vorgenommenen Abzüge berücksichtigen alle externen Gebühren, zu deren Zahlung sie verpflichtet ist, sowie alle Transaktionskosten und Gebühren, die normalerweise anfallen. Diese werden für die sechs Monate bis zum 31. Dezember 2023 wie folgt analysiert (alle in Prozent des durchschnittlichen NIW für den Berichtszeitraum):

Bezeichnung	Erl.	USD	% des NIW
Verwaltungsgebühren	9	125.337	0,01 %
Verwahrstellengebühren	9	65.175	0,01 %
Treuhändergebühren	9	15.041	0,00 %
Sonstige Aufwendungen	9,10	50.135	0,01 %
Anlageverwaltungsgebühren	9	185.498	0,02 %
Gebühren der Verwaltungsgesellschaft	9	35.094	0,00 %
Nicht bedingte Abzüge für Swap-Gegenpartei	11	829.129	0,08 %
Insgesamt		1.305.409	0,13 %

- 9 Diese Beträge werden von der TRS-Gegenpartei an den Teilfonds während der sechs Monate bis zum 31. Dezember 2023 gezahlt oder sind von der TRS-Gegenpartei zu zahlen.
- 10 Die sonstigen Aufwendungen sind im Prospekt der Gesellschaft beschrieben. Zum Beispiel (aber nicht beschränkt auf) laufende Organisations- und Eintragungsgebühren, Ausgaben für Rechtsberatung und prüfungsrelevante Leistungen sowie Marketingkosten.
- 11 Diese Beträge werden von der TRS-Gegenpartei des Teilfonds während der sechs Monate bis zum 31. Dezember 2023 einbehalten und beziehen sich auf Swap-Transaktionskosten und Index-Lizenzierungsgebühren.

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

Die Renditen und Kosten der von den Teilfonds für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 gehaltenen Total Return Swaps sind im Folgenden aufgeführt:

CMCI COMMODITY CARRY EX-AGRICULTURE SF UCITS ETF

Art von Wertpapierfinanzierungsgeschäften	Erl.	Insgesamt	Organismus für gemeinsame Anlagen	Verwaltungsgesellschaft	Dritte
Total Return Swaps	1				
Absolute Werte		USD	USD	USD	USD
Rendite	2	(5.380.214)	(5.380.214)	null	null
Kosten	3,8	(85.674)	(85.674)	null	null
Wirtschaftlicher Nutzen	4	(5.294.540)	(5.294.540)	null	null
Prozentualer mit der jeweiligen Art erzielter Anteil an der Gesamrendite		% der Gesamtrendite	% der Gesamtrendite	% der Gesamtrendite	% der Gesamtrendite
Rendite		(100,00 %)	(100,00 %)	null	null
Kosten	5	(1,59 %)	(1,59 %)	null	null
Wirtschaftlicher Nutzen	4	(101,59 %)	(101,59 %)	null	null
Prozentualer Anteil am NIW		% des NIW	% des NIW	% des NIW	% des NIW
Rendite	6	(8,25 %)	(8,25 %)	null	null
Kosten	7,8	(0,13 %)	(0,13 %)	null	null
Wirtschaftlicher Nutzen	4	(8,38 %)	(8,38 %)	null	null

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

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

Hinweis

- 1 Mit Ausnahme von Total Return Swaps hat die Gesellschaft im Berichtszeitraum keine Wertpapierfinanzierungsgeschäfte getätigt.
- 2 Dies betrifft die realisierten und nicht realisierten Gewinne und Verluste aus den Fully Funded Swaps und Total Return Swaps (gemeinsam die „TRS“ gemäß der SFTR-Definition) während der sechs Monate zum 31. Dezember 2023, die in der zusammengefassten Gesamtergebnisrechnung enthalten sind und vor Abzug der mit ihnen im Zusammenhang stehenden Kosten aufgeführt sind.
- 3 Dies betrifft Abzüge auf die Werte der TRS in den sechs Monaten zum 31. Dezember 2023.
- 4 Berechnet als Differenz zwischen der Rendite und den Kosten.
- 5 Berechnet als absoluter Betrag der Kosten in Prozent des absoluten Betrags der Renditen.
- 6 Berechnet als absoluter Betrag der Rendite in Prozent des durchschnittlichen NIW für den Berichtszeitraum.
- 7 Berechnet als absoluter Betrag der Kosten in Prozent des durchschnittlichen NIW für den Berichtszeitraum.
- 8 Die von der Gegenpartei an den Werten der TRS vorgenommenen Abzüge berücksichtigen alle externen Gebühren, zu deren Zahlung sie verpflichtet ist, sowie alle Transaktionskosten und Gebühren, die normalerweise anfallen. Diese werden für die sechs Monate bis zum 31. Dezember 2023 wie folgt analysiert (alle in Prozent des durchschnittlichen NIW für den Berichtszeitraum):

Bezeichnung	Erl.	USD	% des NIW
Verwaltungsgebühren	9	8.183	0,01 %
Verwahrstellengebühren	9	4.256	0,01 %
Treuhändergebühren	9	982	0,00 %
Sonstige Aufwendungen	9,10	7.856	0,01 %
Anlageverwaltungsgebühren	9	57.283	0,09 %
Gebühren der Verwaltungsgesellschaft	9	32.733	0,05 %
Nicht bedingte Abzüge für Swap-Gegenpartei	11	(25.619)	(0,04 %)
Insgesamt		85.674	0,13 %

- 9 Diese Beträge werden von der TRS-Gegenpartei an den Teilfonds während der sechs Monate bis zum 31. Dezember 2023 gezahlt oder sind von der TRS-Gegenpartei zu zahlen.
- 10 Die sonstigen Aufwendungen sind im Prospekt der Gesellschaft beschrieben. Zum Beispiel (aber nicht beschränkt auf) laufende Organisations- und Eintragungsgebühren, Ausgaben für Rechtsberatung und prüfungsrelevante Leistungen sowie Marketingkosten.
- 11 Diese Beträge werden von der TRS-Gegenpartei des Teilfonds während der sechs Monate bis zum 31. Dezember 2023 einbehalten und beziehen sich auf Swap-Transaktionskosten und Index-Lizenzierungsgebühren.

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

Die Renditen und Kosten der von den Teilfonds für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 gehaltenen Total Return Swaps sind im Folgenden aufgeführt:

CMCI COMMODITY TRANSITION SF UCITS ETF

Art von Wertpapierfinanzierungsgeschäften	Erl.	Insgesamt	Organismus für gemeinsame Anlagen	Verwaltungsgesellschaft	Dritte
Total Return Swaps	1				
Absolute Werte		USD	USD	USD	USD
Rendite	2	(195.907)	(195.907)	null	null
Kosten	3,8	(6.655)	(6.655)	null	null
Wirtschaftlicher Nutzen	4	(189.252)	(189.252)	null	null
Prozentualer mit der jeweiligen Art erzielter Anteil an der Gesamrendite		% der Gesamrendite	% der Gesamrendite	% der Gesamrendite	% der Gesamrendite
Rendite		(100,00 %)	(100,00 %)	null	null
Kosten	5	(3,40 %)	(3,40 %)	null	null
Wirtschaftlicher Nutzen	4	(103,40 %)	(103,40 %)	null	null
Prozentualer Anteil am NIW		% des NIW	% des NIW	% des NIW	% des NIW
Rendite	6	(9,35 %)	(9,35 %)	null	null
Kosten	7,8	(0,32 %)	(0,32 %)	null	null
Wirtschaftlicher Nutzen	4	(9,67 %)	(9,67 %)	null	null

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

CMCI COMMODITY TRANSITION SF UCITS ETF (Fortsetzung)

Hinweis

- 1 Mit Ausnahme von Total Return Swaps hat die Gesellschaft im Berichtszeitraum keine Wertpapierfinanzierungsgeschäfte getätigt.
- 2 Dies betrifft die realisierten und nicht realisierten Gewinne und Verluste aus den Fully Funded Swaps und Total Return Swaps (gemeinsam die „TRS“ gemäß der SFTR-Definition) während der sechs Monate zum 31. Dezember 2023, die in der zusammengefassten Gesamtergebnisrechnung enthalten sind und vor Abzug der mit ihnen im Zusammenhang stehenden Kosten aufgeführt sind.
- 3 Dies betrifft Abzüge auf die Werte der TRS in den sechs Monaten zum 31. Dezember 2023.
- 4 Berechnet als Differenz zwischen der Rendite und den Kosten.
- 5 Berechnet als absoluter Betrag der Kosten in Prozent des absoluten Betrags der Renditen.
- 6 Berechnet als absoluter Betrag der Rendite in Prozent des durchschnittlichen NIW für den Berichtszeitraum.
- 7 Berechnet als absoluter Betrag der Kosten in Prozent des durchschnittlichen NIW für den Berichtszeitraum.
- 8 Die von der Gegenpartei an den Werten der TRS vorgenommenen Abzüge berücksichtigen alle externen Gebühren, zu deren Zahlung sie verpflichtet ist, sowie alle Transaktionskosten und Gebühren, die normalerweise anfallen. Diese werden für die sechs Monate bis zum 31. Dezember 2023 wie folgt analysiert (alle in Prozent des durchschnittlichen NIW für den Berichtszeitraum):

Bezeichnung	Erl.	USD	% des NIW
Verwaltungsgebühren	9	263	0,01 %
Verwahrstellengebühren	9	137	0,01 %
Treuhändergebühren	9	32	0,00 %
Sonstige Aufwendungen	9,10	253	0,01 %
Anlageverwaltungsgebühren	9	1.844	0,09 %
Gebühren der Verwaltungsgesellschaft	9	1.053	0,05 %
Nicht bedingte Abzüge für Swap-Gegenpartei	11	3.073	0,15 %
Insgesamt		6.655	0,32 %

- 9 Diese Beträge werden von der TRS-Gegenpartei an den Teilfonds während der sechs Monate bis zum 31. Dezember 2023 gezahlt oder sind von der TRS-Gegenpartei zu zahlen.
- 10 Die sonstigen Aufwendungen sind im Prospekt der Gesellschaft beschrieben. Zum Beispiel (aber nicht beschränkt auf) laufende Organisations- und Eintragungsgebühren, Ausgaben für Rechtsberatung und prüfungsrelevante Leistungen sowie Marketingkosten.
- 11 Diese Beträge werden von der TRS-Gegenpartei des Teilfonds während der sechs Monate bis zum 31. Dezember 2023 einbehalten und beziehen sich auf Swap-Transaktionskosten und Index-Lizenzierungsgebühren.