

# Swisscanto (LU) Money Market Fund

**Jahresbericht mit geprüftem Jahresabschluss per 31.03.2024**

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

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

Depotbank: CACEIS Investor Services Bank S.A.

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

Weitere Informationen stehen im Internet unter [www.swisscanto-fondsleitungen.com](http://www.swisscanto-fondsleitungen.com) zur Verfügung.

## **Bericht des Réviseur d'entreprises agréé**

An die Anteilscheininhaber des  
Swisscanto (LU) Money Market Fund

### **Prüfungsurteil**

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

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

### **Grundlage für das Prüfungsurteil**

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

### **Sonstige Informationen**

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

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

Im Zusammenhang mit der Prüfung des Jahresabschlusses besteht unsere Verantwortung darin, die sonstigen Informationen zu lesen und dabei zu beurteilen, ob eine wesentliche Unstimmigkeit zwischen diesen

und dem Jahresabschluss oder mit den bei der Abschlussprüfung gewonnenen Erkenntnissen besteht oder auch ansonsten die sonstigen Informationen wesentlich falsch dargestellt erscheinen. Sollten wir auf Basis der von uns durchgeführten Arbeiten schlussfolgern, dass sonstige Informationen wesentliche falsche Darstellungen enthalten, sind wir verpflichtet, diesen Sachverhalt zu berichten. Wir haben diesbezüglich nichts zu berichten.

### **Verantwortung des Verwaltungsrats der Verwaltungsgesellschaft für den Jahresabschluss**

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

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

### **Verantwortung des Réviseur d'entreprises agréé für die Jahresabschlussprüfung**

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

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

- Identifizieren und beurteilen wir das Risiko von wesentlichen falschen Darstellungen im Jahresabschluss aus Unrichtigkeiten oder Verstößen, planen und führen Prüfungshandlungen durch als Antwort auf diese Risiken und erlangen Prüfungsnachweise, die ausreichend und angemessen sind, um als Grundlage für das Prüfungsurteil zu dienen. Das Risiko, dass wesentliche falsche Darstellungen nicht aufgedeckt werden, ist bei Verstößen höher als bei Unrichtigkeiten, da Verstöße betrügerisches Zusammenwirken, Fälschungen, beabsichtigte Unvollständigkeiten, irreführende Angaben bzw. das Außerkraftsetzen interner Kontrollen beinhalten können.

- Gewinnen wir ein Verständnis von dem für die Abschlussprüfung relevanten internen Kontrollsystem, um Prüfungshandlungen zu planen, die unter den gegebenen Umständen angemessen sind, jedoch nicht mit dem Ziel, ein Prüfungsurteil zur Wirksamkeit des internen Kontrollsystems des Fonds abzugeben.
- Beurteilen wir die Angemessenheit der von dem Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft angewandten Bilanzierungsmethoden, der rechnungslegungsrelevanten Schätzungen und den entsprechenden Anhangangaben.
- Schlussfolgern wir über die Angemessenheit der Anwendung des Rechnungslegungsgrundsatzes der Fortführung der Unternehmenstätigkeit durch den Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft sowie auf der Grundlage der erlangten Prüfungsnachweise, ob eine wesentliche Unsicherheit im Zusammenhang mit Ereignissen oder Gegebenheiten besteht, die bedeutsame Zweifel an der Fähigkeit des Fonds oder einem seiner Teilfonds zur Fortführung der Unternehmenstätigkeit aufwerfen könnten. Sollten wir schlussfolgern, dass eine wesentliche Unsicherheit besteht, sind wir verpflichtet im Bericht des Réviseur d'entreprises agréé auf die dazugehörigen Anhangangaben zum Jahresabschluss hinzuweisen oder, falls die Angaben unangemessen sind, das Prüfungsurteil zu modifizieren. Diese Schlussfolgerungen basieren auf der Grundlage der bis zum Datum des Berichts des Réviseur d'entreprises agréé erlangten Prüfungsnachweise. Zukünftige Ereignisse oder Gegebenheiten können jedoch dazu führen, dass der Fonds oder einer seiner Teilfonds seine Unternehmenstätigkeit nicht mehr fortführen kann.
- Beurteilen wir die Gesamtdarstellung, den Aufbau und den Inhalt des Jahresabschlusses einschließlich der Anhangangaben und beurteilen, ob dieser die zugrundeliegenden Geschäftsvorfälle und Ereignisse sachgerecht darstellt.

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

Ernst & Young  
Société anonyme  
Cabinet de révision agréé

Cosimo Ruggiero

Luxemburg, den 29. Juli 2024

## Inhaltsverzeichnis

1	Verwaltung und Organe	6
2	Allgemeine Informationen	7
3	Aktivitätsbericht	8
4	Vermögensaufstellung	12
5	Ertrags- und Aufwandsrechnung und andere Veränderungen des Nettovermögens	15
6	Statistik	17
7	Swisscanto (LU) Money Market Fund Responsible AUD	18
8	Swisscanto (LU) Money Market Fund Responsible CHF	20
9	Swisscanto (LU) Money Market Fund Responsible EUR	23
10	Swisscanto (LU) Money Market Fund Responsible USD	26
11	Erläuterungen	29
12	Ungeprüfte Informationen	34

# 1 Verwaltung und Organe

## **Verwaltungsgesellschaft**

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

## **Verwaltungsrat**

### **Präsident**

Hans Frey, Schweiz, Geschäftsführer Swisscanto Fondsleitung AG, Zürich

### **Mitglieder**

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

## **Geschäftsführung**

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

## **Depotbank, Hauptzahl-, Register- und Transferstelle**

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

## **Zentralverwaltungsstelle**

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

## **Portfolio Manager**

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

## **Zahl- und Vertriebsstellen**

### **Deutschland**

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

### **Liechtenstein**

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

### **Luxemburg**

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

### **Österreich**

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

## **Zahlstelle in der Schweiz**

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

## **Vertreterstelle in der Schweiz**

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

## **Unabhängiger Wirtschaftsprüfer**

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

## 2 Allgemeine Informationen

### **Anlagefonds nach luxemburgischem Recht „Umbrella Construction“**

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

Die Vertragsbedingungen des Anlagefonds wurden am 30. Oktober 1991 von der Verwaltungsgesellschaft festgesetzt.

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

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

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

### **Verkaufsbeschränkungen**

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

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

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

### **Risikomanagementverfahren**

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

## 3 Aktivitätsbericht

### Swisscanto (LU) Money Market Fund Responsible AUD - AUD

#### 1. Marktübersicht

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

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

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

Während gegen das Jahresende wie erwähnt fast alle Assetklassen positiv performten, war die Dynamik im ersten Quartal 2024 deutlich schwieriger zu entschlüsseln. Obwohl die Zinsen deutlich angestiegen sind, ohne dass sich die Wachstumsaussichten wesentlich verbessert hätten, haben die Aktienmärkte weltweit historische Höchststände erreicht und die Spreads von Investment-Grade-Anleihen sind auf Mehrjahrestiefs gefallen. Der S&P500 stieg um mehr als 10%, und in Japan verzeichnete der Nikkei mit +21% die stärkste Performance seit 2009 und übertraf erstmals den Höchststand von 1989.

#### 2. Rückblick auf für den Fonds relevante Kategorien

Obwohl auch in Australien die Inflationsraten sanken, fühlte sich die Reserve Bank of Australia in der Berichtsperiode genötigt, die Zinsen noch zwei Mal um insgesamt 0.5% zu erhöhen. Die Rendite des Geldmarktfonds erhöhte sich entsprechend.

#### 3. Performancerückblick

Da Geldmarktfonds rasch an den Zinsänderungen partizipieren, resultierte mit 4.10% eine in der Berichtsperiode eine sehr ansprechende Bruttorendite. Die relative Performance des Fonds lag bei +10 Basispunkten.

Klasse	ISIN	Valor	Distribution	Performance in %
AT	LU0141249184	001363884	Accumulate	3.79
BT	LU0999462293	23107280	Accumulate	3.85
DT	LU1481721709	33721369	Accumulate	4.15



## Swisscanto (LU) Money Market Fund Responsible USD - USD

### 1. Marktübersicht

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

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

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

Während gegen das Jahresende wie erwähnt fast alle Assetklassen positiv performten, war die Dynamik im ersten Quartal 2024 deutlich schwieriger zu entschlüsseln. Obwohl die Zinsen deutlich angestiegen sind, ohne dass sich die Wachstumsaussichten wesentlich verbessert hätten, haben die Aktienmärkte weltweit historische Höchststände erreicht und die Spreads von Investment-Grade-Anleihen sind auf Mehrjahrestiefs gefallen. Der S&P500 stieg um mehr als 10%, und in Japan verzeichnete der Nikkei mit +21% die stärkste Performance seit 2009 und übertraf erstmals den Höchststand von 1989.

### 2. Rückblick auf für den Fonds relevante Kategorien

Obwohl auch in den USA die Inflationsraten sanken, fühlte sich die Federal Reserve Bank in der Berichtsperiode genötigt, die Zinsen noch zwei Mal um insgesamt 0.5% zu erhöhen. Die Rendite des Geldmarktfonds erhöhte sich entsprechend.

### 3. Performancerückblick

Da Geldmarktfonds rasch an den Zinsänderungen partizipieren, resultierte mit 5.74% eine in der Berichtsperiode eine sehr ansprechende Bruttorendite. Die relative Performance des Fonds lag bei erfreulichen 22 Basispunkten.

Klasse	ISIN	Valor	Distribution	Performance in %
AT	LU0141250786	001363885	Accumulate	5.36
DT	LU1481721378	33721368	Accumulate	5.47
GT	LU0899940471	20858076	Accumulate	5.51
NT	LU1637934826	37269613	Accumulate	5.74

# Swisscanto (LU) Money Market Fund Responsible EUR - EUR

## 1. Marktübersicht

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

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

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

Während gegen das Jahresende wie erwähnt fast alle Assetklassen positiv performten, war die Dynamik im ersten Quartal 2024 deutlich schwieriger zu entschlüsseln. Obwohl die Zinsen deutlich angestiegen sind, ohne dass sich die Wachstumsaussichten wesentlich verbessert hätten, haben die Aktienmärkte weltweit historische Höchststände erreicht und die Spreads von Investment-Grade-Anleihen sind auf Mehrjahrestiefs gefallen. Der S&P500 stieg um mehr als 10%, und in Japan verzeichnete der Nikkei mit +21% die stärkste Performance seit 2009 und übertraf erstmals den Höchststand von 1989.

## 2. Rückblick auf für den Fonds relevante Kategorien

Auch im Jahr 2023 wurde seitens der EZB weiter kräftig an der Zinsschraube gedreht. Dies geschah in Form von sechs Schritten, im Rahmen derer die Zinsen bis im September 2023 von 2.5% auf 4.5% angehoben wurden. In diesem Umfeld bewegten sich die Kreditaufschläge für kurzlaufende Unternehmensanleihen mehrheitlich seitwärts auf einem im historischen Vergleich nach wie vor attraktiven Niveau.

Mit dem Ende des Zinserhöhungszyklus invertierten die Zinskurven ab Oktober 2023 auch am kurzen Ende der Zinskurve. So kam der deutsche 1y-Zinssatz bereits per Ende Oktober rund 15 Basispunkte unter dem 6m-Satz zu liegen. Bis zum Ende des Jahres verstärkte sich die Inversion bis auf knapp 40 Basispunkte und hält seither an. In diesem Umfeld lässt sich eine Reduktion des Wiederanlagerisikos nur durch eine tiefere Rendite erkaufen.

## 3. Performancerückblick

Da Geldmarktfonds rasch an den Zinsänderungen partizipieren, resultierte mit 3.32% in der Berichtsperiode eine sehr ansprechende Bruttorendite. Die relative Performance des Fonds lag bei 6 Basispunkten.

Klasse	ISIN	Valor	Distribution	Performance in %
AT	LU0141249770	001363891	Accumulate	3.49
DT	LU1481720990	33721365	Accumulate	3.57
GT	LU0899940125	20857980	Accumulate	3.59

# Swisscanto (LU) Money Market Fund Responsible CHF - CHF

## 1. Marktübersicht

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

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

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

Während gegen das Jahresende wie erwähnt fast alle Assetklassen positiv performten, war die Dynamik im ersten Quartal 2024 deutlich schwieriger zu entschlüsseln. Obwohl die Zinsen deutlich angestiegen sind, ohne dass sich die Wachstumsaussichten wesentlich verbessert hätten, haben die Aktienmärkte weltweit historische Höchststände erreicht und die Spreads von Investment-Grade-Anleihen sind auf Mehrjahrestiefs gefallen. Der S&P500 stieg um mehr als 10%, und in Japan verzeichnete der Nikkei mit +21% die stärkste Performance seit 2009 und übertraf erstmals den Höchststand von 1989.

## 2. Rückblick auf für den Fonds relevante Kategorien

Die Inflation in der Schweiz lag im letzten Quartal zuletzt bei 1% und ist damit im Zielband der Nationalbank. Auch die Inflationsprognose der Zentralbank zeigt gegen Ende des Prognosehorizonts eine erwartete Inflation unter 2%. Diese Entwicklung veranlasste die Nationalbank den Leitzins im März um 0.25 Prozentpunkte zu senken auf 1.5%. Dieser Entscheid überraschte die meisten Ökonomen, weshalb sich die Zinsen daraufhin nach unten bewegten. Dies hat sich sehr positiv auf die Rendite des Geldmarktfonds ausgewirkt.

## 3. Performancerückblick

Die absolute Performance des Fonds während der Berichtsperiode lag bei 1.85%. Die relative Performance gegenüber Benchmark beträgt +0.30%.

Klasse	ISIN	Valor	Distribution	Performance in %
DT	LU1481723747	33721370	Accumulate	1.73
FT	LU0141249424	001363887	Accumulate	1.70
GT	LU0899940042	020857974	Accumulate	1.75

## 4 Vermögensaufstellung

	Erläuterung	Swisscanto (LU) Money Market Fund Responsible AUD AUD	Swisscanto (LU) Money Market Fund Responsible CHF CHF	Swisscanto (LU) Money Market Fund Responsible EUR EUR	Swisscanto (LU) Money Market Fund Responsible USD USD
<b>VERMÖGENSWERTE</b>					
Wertpapierbestand inklusive Optionen (gekaufte Optionen) zum Marktwert	(2,8)	59'819'446	402'955'381	125'062'200	283'018'009
Bankguthaben		5'737'982	37'003'618	11'039'115	20'228'992
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		0	0	0	3'060'638
Forderung aus Devisenverkäufen		0	0	0	0
Ausstehende Zeichnungsbeträge		0	8'677'123	269'362	547'753
Forderungen aus Swaps und Swaptions		0	0	0	0
Forderungen aus Wertpapiererträgen		329'819	994'553	441'477	1'806'231
Zinsforderungen aus Bankguthaben		13'896	33'471	26'847	88'112
Nicht realisierter Gewinn aus Devisentermingeschäften	(6)	50'897	0	0	0
Nicht realisierter Gewinn aus Termingeschäften	(7)	0	0	0	0
Nicht realisierter Gewinn aus Swapgeschäften	(9)	0	0	0	0
Sonstige Vermögenswerte		0	0	0	0
<b>SUMME DER VERMÖGENSWERTE</b>		<b>65'952'040</b>	<b>449'664'146</b>	<b>136'839'001</b>	<b>308'749'735</b>
<b>VERBINDLICHKEITEN</b>					
Optionen (geschriebene Optionen) zum Marktwert		0	0	0	0
Bankverbindlichkeiten		0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		0	-7'833'165	-679'766	0
Verbindlichkeiten aus Devisenkäufen		0	0	0	0
Ausstehende Zahlungen aus dem Rückkauf von Anteilen		-265'501	-1'276'908	-53'738	-729'911
Verbindlichkeiten aus Swaps und Swaptions		0	0	0	0
Nicht realisierter Verlust aus Devisentermingeschäften		0	0	0	0
Nicht realisierter Verlust aus Termingeschäften	(6)	0	0	0	0
Nicht realisierter Verlust aus Swapgeschäften	(7)	0	0	0	0
Bankzinsen und sonstige Verbindlichkeiten	(9)	-30'833	-52'087	-28'431	-87'714
<b>SUMME DER VERBINDLICHKEITEN</b>		<b>-296'334</b>	<b>-9'162'160</b>	<b>-761'935</b>	<b>-817'625</b>
<b>NETTOVERMÖGEN AM ENDE DES GESCHÄFTSJAHRES</b>		<b>65'655'705</b>	<b>440'501'986</b>	<b>136'077'066</b>	<b>307'932'110</b>

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Berichtes.

	Erläuterung	Konsolidiert CHF
<b>VERMÖGENSWERTE</b>		
Wertpapierbestand inklusive Optionen (gekaufte Optionen) zum Marktwert	(2,8)	814'675'076
Bankguthaben		69'333'923
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		2'756'717
Forderung aus Devisenverkäufen		0
Ausstehende Zeichnungsbeträge		9'432'506
Forderungen aus Swaps und Swaptions		0
Forderungen aus Wertpapiererträgen		3'244'681
Zinsforderungen aus Bankguthaben		147'114
Nicht realisierter Gewinn aus Devisentermingeschäften	(6)	29'908
Nicht realisierter Gewinn aus Termingeschäften	(7)	0
Nicht realisierter Gewinn aus Swapgeschäften	(9)	0
Sonstige Vermögenswerte		0
<b>SUMME DER VERMÖGENSWERTE</b>		<b>899'619'924</b>
<b>VERBINDLICHKEITEN</b>		
Optionen (geschriebene Optionen) zum Marktwert		0
Bankverbindlichkeiten		0
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		-8'494'408
Verbindlichkeiten aus Devisenkäufen		0
Ausstehende Zahlungen aus dem Rückkauf von Anteilen		-2'142'625
Verbindlichkeiten aus Swaps und Swaptions		0
Nicht realisierter Verlust aus Devisentermingeschäften		0
Nicht realisierter Verlust aus Termingeschäften	(6)	0
Nicht realisierter Verlust aus Swapgeschäften	(7)	0
Bankzinsen und sonstige Verbindlichkeiten	(9)	-176'865
<b>SUMME DER VERBINDLICHKEITEN</b>		<b>-10'813'899</b>
<b>NETTOVERMÖGEN AM ENDE DES GESCHÄFTSJAHRES</b>		<b>888'806'025</b>

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Berichtes.

## Entwicklung der Anzahl Anteile

### Swisscanto (LU) Money Market Fund Responsible AUD - AUD

Klasse	Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode	Ausgegebene Anteile	Zurückgenommene Anteile	Bestand am Ende der Rechnungsperiode
AT	256'203.590	72'154.148	-115'730.941	212'626.798
BT	32'450.392	5'645.982	-14'136.627	23'959.747
DT	21'523.896	4'359.000	-7'445.000	18'437.896

### Swisscanto (LU) Money Market Fund Responsible CHF - CHF

Klasse	Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode	Ausgegebene Anteile	Zurückgenommene Anteile	Bestand am Ende der Rechnungsperiode
DT	772'302.942	761'577.310	-648'046.612	885'833.640
FT	1'801'742.982	1'881'408.093	-1'560'509.638	2'122'641.437
GT	891'552.666	922'621.898	-1'273'797.396	540'377.168

### Swisscanto (LU) Money Market Fund Responsible EUR - EUR

Klasse	Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode	Ausgegebene Anteile	Zurückgenommene Anteile	Bestand am Ende der Rechnungsperiode
AT	1'038'621.302	518'850.560	-441'931.204	1'115'540.659
DT	216'266.661	157'489.298	-240'178.706	133'577.253
GT	157'431.233	153'285.838	-258'576.166	52'140.904

### Swisscanto (LU) Money Market Fund Responsible USD - USD

Klasse	Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode	Ausgegebene Anteile	Zurückgenommene Anteile	Bestand am Ende der Rechnungsperiode
AT	944'333.101	332'806.561	-420'987.312	856'152.349
DT	85'256.142	107'473.379	-116'344.234	76'385.287
GT	364'580.931	1'062'177.887	-663'006.130	763'752.688
NT	393'460.637	487'683.000	-732'851.001	148'292.636

## 5 Ertrags- und Aufwandsrechnung und andere Veränderungen des Nettovermögens

Erläuterung	Swisscanto (LU)	Swisscanto (LU)	Swisscanto (LU)	Swisscanto (LU)
	Money Market Fund Responsible	Money Market Fund Responsible	Money Market Fund Responsible	Money Market Fund Responsible
	AUD	CHF	EUR	USD
	AUD	CHF	EUR	USD
<b>NETTOVERMÖGEN ZU BEGINN DES GESCHÄFTSJAHRES</b>	<b>76'474'839</b>	<b>410'194'959</b>	<b>141'925'039</b>	<b>294'777'736</b>
<b>ERTRÄGE</b>				
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	0	0	0	0
Nettozinserträge aus Anleihen und anderen Schuldverschreibungen	2'275'859	2'075'128	1'343'168	5'831'689
Zinserträge aus Bankguthaben	210'929	407'291	351'832	1'158'574
Zinsen aus Swaps, netto	0	0	0	0
Erhaltene Kommissionen (13)	0	0	0	0
Sonstige Erträge	0	0	0	0
<b>GESAMTERTRÄGE</b>	<b>2'486'788</b>	<b>2'482'419</b>	<b>1'695'000</b>	<b>6'990'262</b>
<b>AUFWENDUNGEN</b>				
Transaktionskosten	0	0	0	0
Pauschale Verwaltungskommission (3)	-454'541	-496'523	-333'634	-969'359
Abonnementsteuer ("taxe d'abonnement") (4)	-7'131	-39'874	-13'514	-31'467
Zinsaufwendungen aus Bankverbindlichkeiten	0	-2	0	-2
Zinsaufwendungen aus Swaps, netto	0	0	0	0
Sonstige Aufwendungen	0	-1'177	0	0
<b>GESAMTAUFWENDUNGEN</b>	<b>-461'672</b>	<b>-537'576</b>	<b>-347'148</b>	<b>-1'000'828</b>
<b>ERTRAGSAUSGLEICH</b>	<b>-369'313</b>	<b>16'920</b>	<b>-104'054</b>	<b>-710'973</b>
<b>SUMME DER NETTOERTRÄGE</b>	<b>1'655'804</b>	<b>1'961'763</b>	<b>1'243'798</b>	<b>5'278'462</b>
Nettorealisierte Wertpapiererhöhungen/ (Wertverminderungen) aus Wertpapieren	629'054	2'178'409	1'941'915	8'257'846
Nettorealisierte Werterhöhungen/(Wertverminderungen) aus Swaps	0	0	0	0
Nettorealisierte Werterhöhungen/(Wertverminderungen) aus Optionen	0	0	0	0
Nettorealisierte Werterhöhungen/(Wertverminderungen) aus Devisentermingeschäften	-380'361	38	0	-17
Nettorealisierte Werterhöhungen/(Wertverminderungen) aus Termingeschäften	0	0	0	0
Nettorealisierte Werterhöhungen/(Wertverminderungen) aus Devisengeschäften	59'093	238	11	-260
<b>NETTOGEWINN (-VERLUST) AUS ANLAGEN</b>	<b>1'963'590</b>	<b>4'140'449</b>	<b>3'185'723</b>	<b>13'536'031</b>
<b>NETTOVERÄNDERUNG DES NICHT REAL. ERFOLGES</b>				
- aus Wertpapieren	581'364	3'414'473	1'690'991	3'668'177
- aus Swaps	0	0	0	0
- aus Termingeschäften	0	0	0	0
- aus Devisentermingeschäften	50'897	0	0	0
- aus Optionen	0	0	0	0
<b>NETTOERHÖHUNG/NETTOVERMINDERUNG DES NETTOVERMÖGENS</b>	<b>2'595'851</b>	<b>7'554'921</b>	<b>4'876'714</b>	<b>17'204'208</b>
Zeichnung von Anteilen (2)	21'261'463	426'506'764	84'176'492	260'267'464
Rücknahme von Anteilen (2)	-35'045'761	-403'737'738	-95'005'234	-265'028'271
Ausschüttungen	0	0	0	0
Ertragsausgleich	369'313	-16'920	104'054	710'973
Bewertungsdifferenz (2)				
<b>NETTOVERMÖGEN AM ENDE DES GESCHÄFTSJAHRES</b>	<b>65'655'705</b>	<b>440'501'986</b>	<b>136'077'066</b>	<b>307'932'110</b>

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Berichtes.

	Erläuterung	Konsolidiert CHF
<b>NETTOVERMÖGEN ZU BEGINN DES GESCHÄFTSJAHRES</b>		<b>870'455'376</b>
<b>ERTRÄGE</b>		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto		0
Nettinzinserträge aus Anleihen und anderen Schuldverschreibungen		9'971'631
Zinserträge aus Bankguthaben		1'917'009
Zinsen aus Swaps, netto		0
Erhaltene Kommissionen	(13)	0
Sonstige Erträge		0
<b>GESAMTERTRÄGE</b>		<b>11'888'640</b>
<b>AUFWENDUNGEN</b>		
Transaktionskosten		0
Pauschale Verwaltungskommission	(3)	-1'961'264
Abonnementsteuer ("taxe d'abonnement")	(4)	-85'552
Zinsaufwendungen aus Bankverbindlichkeiten		-3
Zinsaufwendungen aus Swaps, netto		0
Sonstige Aufwendungen		-1'177
<b>GESAMTAUFWENDUNGEN</b>		<b>-2'047'996</b>
<b>ERTRAGSAUSGLEICH</b>		<b>-941'686</b>
<b>SUMME DER NETTOERTRÄGE</b>		<b>8'898'958</b>
Nettorealisierte Wertpapiererhöhungen/ (Wertverminderungen) aus Wertpapieren		11'874'894
Nettorealisierte Werterhöhungen/(Wertverminderungen) aus Swaps		0
Nettorealisierte Werterhöhungen/(Wertverminderungen) aus Optionen		0
Nettorealisierte Werterhöhungen/(Wertverminderungen) aus Devisentermingeschäften		-223'484
Nettorealisierte Werterhöhungen/(Wertverminderungen) aus Termingeschäften		0
Nettorealisierte Werterhöhungen/(Wertverminderungen) aus Devisengeschäften		34'739
<b>NETTOGEWINN (-VERLUST) AUS ANLAGEN</b>		<b>20'585'107</b>
<b>NETTOVERÄNDERUNG DES NICHT REAL. ERFOLGES</b>		
- aus Wertpapieren		8'704'934
- aus Swaps		0
- aus Termingeschäften		0
- aus Devisentermingeschäften		29'908
- aus Optionen		0
<b>NETTOERHÖHUNG/NETTOVERMINDERUNG DES NETTOVERMÖGENS</b>		<b>29'319'949</b>
Zeichnung von Anteilen	(2)	755'306'087
Rücknahme von Anteilen	(2)	-755'458'680
Ausschüttungen		0
Ertragsausgleich		941'686
Bewertungsdifferenz	(2)	-11'758'394
<b>NETTOVERMÖGEN AM ENDE DES GESCHÄFTSJAHRES</b>		<b>888'806'025</b>

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Berichtes.



## 6 Statistik

### Swisscanto (LU) Money Market Fund Responsible AUD - AUD

	Klasse	Y	Y-1	Y-2
Nettovermögen		65'655'705.27	76'528'298.00	86'169'435.00
Nettovermögenswert pro Anteil	AT	286.14	275.69	270.90
Nettovermögenswert pro Anteil	BT	113.66	109.45	107.49
Nettovermögenswert pro Anteil	DT	113.44	108.92	106.66
TER pro Anteil	AT	0.65		
TER pro Anteil	BT	0.60		
TER pro Anteil	DT	0.26		

### Swisscanto (LU) Money Market Fund Responsible CHF - CHF

	Klasse	Y	Y-1	Y-2
Nettovermögen		440'501'986.08	410'427'344.00	262'237'052.00
Nettovermögenswert pro Anteil	DT	97.41	95.75	95.87
Nettovermögenswert pro Anteil	FT	142.43	140.05	140.24
Nettovermögenswert pro Anteil	GT	96.03	94.38	94.49
TER pro Anteil	DT	0.12		
TER pro Anteil	FT	0.15		
TER pro Anteil	GT	0.10		

### Swisscanto (LU) Money Market Fund Responsible EUR - EUR

	Klasse	Y	Y-1	Y-2
Nettovermögen		136'077'066.13	141'936'796.00	96'131'963.00
Nettovermögenswert pro Anteil	AT	105.20	101.65	101.47
Nettovermögenswert pro Anteil	DT	100.94	97.46	97.23
Nettovermögenswert pro Anteil	GT	100.58	97.09	96.82
TER pro Anteil	AT	0.30		
TER pro Anteil	DT	0.19		
TER pro Anteil	GT	0.16		

### Swisscanto (LU) Money Market Fund Responsible USD - USD

	Klasse	Y	Y-1	Y-2
Nettovermögen		307'932'110.29	294'674'752.00	245'500'234.00
Nettovermögenswert pro Anteil	AT	224.66	213.24	208.14
Nettovermögenswert pro Anteil	DT	115.77	109.77	107.04
Nettovermögenswert pro Anteil	GT	117.06	110.95	108.13
Nettovermögenswert pro Anteil	NT	116.89	110.54	107.53
TER pro Anteil	AT	0.43		
TER pro Anteil	DT	0.29		
TER pro Anteil	GT	0.24		
TER pro Anteil	NT	0.01		

## 7 Swisscanto (LU) Money Market Fund Responsible AUD

Wertpapierbestand zum 31.03.2024 (Angaben in AUD)

ISIN Nummer	Bezeichnung	Stückzahl / Nennwert	Währung	Einstandswert	Marktwert	% des Netto- vermögens
<b>Amtlich notierte sowie an anderen geregelten Märkten gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>						
<b>Anleihen</b>						
<b>AU</b>						
AU3TB0000143	ACGB 2 3/4 04/21/24 137	300'000	AUD	297'646	299'728	0.46
AU3CB0287696	TOYOTA 2.93 03/21/25 MTN	800'000	AUD	785'768	786'552	1.20
AU3CB0286789	NAB 2.35 02/25/25 MTN	1'000'000	AUD	979'140	980'440	1.49
AU3CB0282945	TOYOTA 0.85 09/09/24	2'200'000	AUD	2'119'934	2'163'110	3.29
AU3CB0282887	NBNAUS 0 3/4 09/09/24 MTN	1'200'000	AUD	1'157'209	1'179'797	1.80
AU3CB0270387	MQGAU 1.7 02/12/25 MTN	2'800'000	AUD	2'709'728	2'729'356	4.16
AU3CB0269710	ANZ 1.65 01/16/25 MTn	1'700'000	AUD	1'650'755	1'661'784	2.53
AU3CB0267052	DE 1 3/4 10/04/24 MTN	2'900'000	AUD	2'818'094	2'857'956	4.35
AU3CB0266179	ANZ 1.55 08/29/24 MTN	480'000	AUD	467'347	474'055	0.72
AU3CB0265718	INGAU 1.45 08/20/24	800'000	AUD	784'080	790'342	1.20
AU3CB0265593	MQGAU 1 3/4 08/07/24 MTN	500'000	AUD	485'925	495'016	0.75
AU3CB0263275	WSTP 2 1/4 08/16/24 MTN	1'200'000	AUD	1'188'180	1'189'380	1.81
AU3CB0260206	WSTP 3 04/24/24 MTN	1'000'000	AUD	987'590	999'035	1.52
AU3CB0247393	SGSPAA 3 3/4 09/27/24 MTN	1'800'000	AUD	1'786'085	1'790'348	2.73
AU3CB0220879	CBAAU 5 05/08/24 MTN	750'000	AUD	752'963	749'903	1.14
				<b>18'970'444</b>	<b>19'146'801</b>	<b>29.15</b>
<b>CA</b>						
AU3FN0049011	BMO Float 07/17/24 mtN	1'200'000	AUD	1'203'936	1'201'416	1.83
AU3CB0264968	BMO 2.1 07/17/24 MTN	590'000	AUD	577'327	585'274	0.89
AU3CB0264778	TD 2.05 07/10/24	2'900'000	AUD	2'827'777	2'878'163	4.38
AU3CB0223584	MP 4 1/4 03/03/25 MTN	500'000	AUD	498'115	498'305	0.76
AU3CB0223402	ONT 4 1/4 08/22/24 MTN	800'000	AUD	797'305	798'696	1.22
AU3CB0221232	BRCOL 4 1/4 11/27/24 MTN	900'000	AUD	894'960	897'885	1.37
				<b>6'799'420</b>	<b>6'859'739</b>	<b>10.45</b>
<b>DE</b>						
AU3CB0247401	DBHNGR 3 1/2 09/27/24 MTN	1'920'000	AUD	1'900'596	1'907'558	2.91
				<b>1'900'596</b>	<b>1'907'558</b>	<b>2.91</b>
<b>ES</b>						
XS2056573475	SANTAN Float 09/26/24 EMTN	1'600'000	AUD	1'597'700	1'599'296	2.44
				<b>1'597'700</b>	<b>1'599'296</b>	<b>2.44</b>
<b>FR</b>						
AU3FN0050142	BPCEGP Float 09/11/24 MTN	1'000'000	AUD	1'002'220	1'000'990	1.52
AU3CB0266492	BPCEGP 1.8 09/11/24 MTN	210'000	AUD	205'176	206'919	0.32
				<b>1'207'396</b>	<b>1'207'909</b>	<b>1.84</b>
<b>JP</b>						
XS2057887353	MUFG 2.0777 10/01/24 EMTN	2'600'000	AUD	2'520'752	2'559'310	3.90
XS2053050683	CENEXP 1.873 09/26/24 EMTN	1'200'000	AUD	1'159'800	1'180'704	1.80
XS2034071733	SUMIBK Float 10/16/24 EMTN	1'000'000	AUD	999'230	1'002'500	1.53
AU3CB0265551	MIZUHO 1.7 08/07/24 TCD	2'920'000	AUD	2'842'092	2'889'924	4.40
				<b>7'521'874</b>	<b>7'632'438</b>	<b>11.63</b>

ISIN Nummer	Bezeichnung	Stückzahl / Nennwert	Währung	Einstandswert	Marktwert	% des Netto- vermögens
<b>KR</b>						
XS2044908304	EIBKOR 0.93 08/28/24 EMTN	1'047'000	AUD	1'006'691	1'029'295	1.57
AU3CB0266062	KDB 1 1/2 08/29/24	1'600'000	AUD	1'556'416	1'579'248	2.41
				<b>2'563'107</b>	<b>2'608'543</b>	<b>3.98</b>
<b>NL</b>						
XS1987905756	RABOBK 1.51 05/29/24 EMTN	900'000	AUD	872'758	894'924	1.36
AU3CB0220093	RABOBK 5 1/2 04/11/24 MTN	1'800'000	AUD	1'819'516	1'800'288	2.74
AU3CB0219236	NEDFIN 4 3/4 09/11/24 MTN	2'600'000	AUD	2'596'803	2'597'608	3.96
AU3CB0216141	BNG 5 1/4 05/20/24 MTN	2'100'000	AUD	2'112'714	2'101'680	3.20
AU3CB0214765	NEDWBK 5 1/4 04/18/24 MTN	700'000	AUD	712'649	700'154	1.07
				<b>8'114'441</b>	<b>8'094'654</b>	<b>12.33</b>
<b>NO</b>						
AU3CB0217826	KBN 5 1/4 07/15/24 MTN	546'000	AUD	548'621	546'961	0.83
				<b>548'621</b>	<b>546'961</b>	<b>0.83</b>
<b>US</b>						
AU3CB0237907	KO 3 1/4 06/11/24 MTN	1'250'000	AUD	1'236'378	1'246'738	1.90
				<b>1'236'378</b>	<b>1'246'738</b>	<b>1.90</b>
<b>XS</b>						
AU3CB0283638	COE 0.6 10/08/24 MTN	1'470'000	AUD	1'434'411	1'439'586	2.19
AU3CB0265007	IFC 1.45 07/22/24	1'000'000	AUD	969'230	991'120	1.51
AU3CB0263945	EIB 1.7 11/15/24 MTN	600'000	AUD	587'046	590'196	0.90
AU3CB0222370	AFDB 4 01/10/25 MTN	800'000	AUD	795'544	796'832	1.21
				<b>3'786'231</b>	<b>3'817'734</b>	<b>5.81</b>
<b>Summe - Anleihen</b>					<b>54'668'371</b>	
<b>Summe - Amtlich notierte sowie an anderen geregelten Märkten gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>					<b>54'668'371</b>	
<b>Anlagefonds</b>						
<b>Anlagefonds</b>						
<b>LU</b>						
LU1637934826	SWC (LU) MMF Responsible USD NT	14'612	USD	2'215'112	2'618'021	3.99
LU0899940042	SWC (LU) MMF Responsible CHF GT	15'500	CHF	2'177'449	2'533'054	3.86
				<b>4'392'561</b>	<b>5'151'075</b>	<b>7.85</b>
<b>Summe - Anlagefonds</b>					<b>5'151'075</b>	
<b>Summe - Anlagefonds</b>					<b>5'151'075</b>	
<b>SUMME DES WERTPAPIERBESTANDES</b>					<b>59'819'446</b>	<b>91.12</b>

## 8 Swisscanto (LU) Money Market Fund Responsible CHF

Wertpapierbestand zum 31.03.2024 (Angaben in CHF)

ISIN Nummer	Bezeichnung	Stückzahl / Nennwert	Währung	Einstandswert	Marktwert	% des Netto- vermögens
<b>Amtlich notierte sowie an anderen geregelten Märkten gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>						
<b>Anleihen</b>						
<b>AE</b>						
CH0465044680	FABUH 0.401 10/02/24 EMTN	9'025'000	CHF	8'893'768	8'967'691	2.04
				<b>8'893'768</b>	<b>8'967'691</b>	<b>2.04</b>
<b>AT</b>						
CH0474977672	HYNOE 0.1 11/27/24 EMTN	3'000'000	CHF	2'953'200	2'972'700	0.67
CH0027752200	OKB 2 5/8 11/22/24	3'540'000	CHF	3'571'428	3'569'736	0.81
				<b>6'524'628</b>	<b>6'542'436</b>	<b>1.48</b>
<b>AU</b>						
CH0417086060	WSTP 0.4 06/06/24 EMTN	13'585'000	CHF	13'412'879	13'555'113	3.08
				<b>13'412'879</b>	<b>13'555'113</b>	<b>3.08</b>
<b>BM</b>						
CH0575017105	COMQAT 0.735 11/27/24 EMTN	1'880'000	CHF	1'855'022	1'867'780	0.42
				<b>1'855'022</b>	<b>1'867'780</b>	<b>0.42</b>
<b>CA</b>						
CH1177791865	BNS 0.295 04/25/25	550'000	CHF	543'813	543'813	0.12
CH0258404455	Q 0 3/4 11/21/24 EMTn	4'495'000	CHF	4'462'736	4'477'470	1.02
				<b>5'006'549</b>	<b>5'021'282</b>	<b>1.14</b>
<b>CH</b>						
CH1262684413	UBS 2.05 04/28/24	8'000'000	CHF	8'000'410	8'002'640	1.82
CH1181991733	UBS 0.44 04/29/24 EMTN	4'000'000	CHF	3'942'720	3'996'400	0.91
CH1160680141	BKWSW 0 10/18/24	5'905'000	CHF	5'831'207	5'857'465	1.33
CH0550413352	UBS 0 12/17/24 EMTN	5'230'000	CHF	5'134'545	5'177'439	1.18
CH0474178420	RAIFFS 0 1/8 05/07/24	5'000'000	CHF	4'937'080	4'993'000	1.13
CH0471297918	PSHYPO 0 07/29/24 670	9'880'000	CHF	9'712'780	9'849'372	2.24
CH0410155144	VALIAN 0 1/8 04/23/24	6'500'000	CHF	6'433'400	6'494'800	1.47
CH0406415247	PSHYPO 0 1/8 04/26/24 658	3'085'000	CHF	3'051'886	3'082'532	0.70
CH0398633567	PFZENT 0 1/8 10/31/24 506	2'345'000	CHF	2'310'678	2'327'530	0.53
CH0398633260	GLRNKB 0.05 12/06/24	4'585'000	CHF	4'516'163	4'539'838	1.03
CH0394905704	KBBS 0 1/8 04/11/24	2'000'000	CHF	1'965'800	1'999'400	0.45
CH0373476776	GRKPSW 0 1/8 05/29/24	430'000	CHF	425'464	429'097	0.10
CH0358654975	ROSW 0.1 09/23/24 2024	11'380'000	CHF	11'191'664	11'313'427	2.57
CH0353574327	KTBS 0 11/22/24	3'600'000	CHF	3'563'340	3'569'940	0.81
CH0344583809	PFZENT 0 1/8 12/02/24 486	3'000'000	CHF	2'951'700	2'974'800	0.68
CH0336587669	PFZENT 0 06/14/24 482	13'455'000	CHF	13'339'645	13'417'999	3.05
CH0336587644	KBAARG 0.02 10/17/24	7'800'000	CHF	7'674'853	7'745'400	1.76
CH0319415953	UBS 0.55 04/15/24 EMTN	5'420'000	CHF	5'356'194	5'418'645	1.23
CH0302790131	GENEVA 0.02 11/27/24	2'060'000	CHF	2'032'644	2'042'696	0.46
CH0300874267	PFZENT 0 1/8 07/17/24 470	2'000'000	CHF	1'976'400	1'993'900	0.45
				<b>104'348'572</b>	<b>105'226'319</b>	<b>23.90</b>
<b>CL</b>						
CH0471298007	BCICI 0.4 11/22/24 EMTN	600'000	CHF	587'760	595'830	0.14

ISIN Nummer	Bezeichnung	Stückzahl / Nennwert	Währung	Einstandswert	Marktwert	% des Netto- vermögens
CH0465767785	BSANCI 0.384 09/27/24 EMTN	1'000'000	CHF	989'810	993'950	0.23
CH0346190033	BNCHIL 0 1/4 12/05/24	700'000	CHF	691'845	693'210	0.16
				<b>2'269'415</b>	<b>2'282'990</b>	<b>0.53</b>
	<b>DE</b>					
CH0438965532	MUNHYP 0.1 10/31/24 EMTN	7'700'000	CHF	7'578'988	7'671'510	1.74
				<b>7'578'988</b>	<b>7'671'510</b>	<b>1.74</b>
	<b>ES</b>					
CH0508785737	SANSCF 0.15 12/10/24 EMTN	7'000'000	CHF	6'913'030	6'934'550	1.57
				<b>6'913'030</b>	<b>6'934'550</b>	<b>1.57</b>
	<b>FI</b>					
CH0251885791	KUNTA 0 3/4 09/17/24 EMTN	340'000	CHF	336'906	338'960	0.08
				<b>336'906</b>	<b>338'960</b>	<b>0.08</b>
	<b>FR</b>					
FR0014000IY3	BPCEGP Float 09/11/25 EMTN	5'000'000	CHF	5'000'000	4'995'000	1.13
CH0407809778	BFCM 0.366 10/10/24 EMTN	5'150'000	CHF	5'074'940	5'117'555	1.16
CH0379268763	ACAFP 0.3 04/18/24 EMTN	5'260'000	CHF	5'200'227	5'256'844	1.19
CH0355139855	BFCM 0.32 02/10/25 EMTN	13'780'000	CHF	13'620'556	13'663'559	3.10
CH0266842704	ACAFP 1 01/27/25 EMTN	9'490'000	CHF	9'443'120	9'467'224	2.15
CH0247902890	TTEFP 1 08/29/24 EMTN	11'000'000	CHF	10'917'380	10'983'500	2.49
CH0243273759	ACACB 1 1/8 06/05/24 EMTN	13'135'000	CHF	13'070'204	13'125'806	2.98
CH0243069280	BFCM 2 05/22/24 EMTN	4'250'000	CHF	4'253'458	4'252'125	0.97
CH0109155827	AGFRNC 2 5/8 02/18/25 EMTN	10'450'000	CHF	10'563'481	10'563'905	2.40
				<b>77'143'366</b>	<b>77'425'518</b>	<b>17.57</b>
	<b>KR</b>					
CH1231312716	KOROIL 2.15 12/19/24	3'700'000	CHF	3'711'595	3'719'980	0.84
CH0485445958	KOHNPW 0 07/19/24 EMTN	2'500'000	CHF	2'464'150	2'489'000	0.57
CH0461238856	KORAIL 0 11/19/24 EMTN	7'680'000	CHF	7'543'645	7'610'496	1.73
CH0421460400	EIBKOR 0.3825 07/11/24 EMTN	8'780'000	CHF	8'663'732	8'750'148	1.99
CH0419041568	KOROIL 0 10/04/24 GMTN	6'750'000	CHF	6'616'088	6'709'500	1.52
CH0365501508	HIGHWY 0 1/4 06/07/24 GMTN	3'500'000	CHF	3'464'000	3'491'600	0.79
				<b>32'463'209</b>	<b>32'770'724</b>	<b>7.44</b>
	<b>KY</b>					
CH0472691440	ADCBUH 0 1/2 11/29/24 EMTN	4'725'000	CHF	4'680'478	4'685'310	1.06
				<b>4'680'478</b>	<b>4'685'310</b>	<b>1.06</b>
	<b>NL</b>					
CH0465044623	BMW 0.3 09/05/24 EMTN	6'400'000	CHF	6'321'200	6'376'320	1.45
CH0315593860	ABNANV 0.3 12/18/24 EmtN	14'150'000	CHF	13'984'559	14'045'998	3.19
CH0241528741	BNG 1 1/4 04/30/24 EMTn	3'000'000	CHF	2'988'300	2'999'400	0.68
CH0235834154	DBHNGR 1 1/2 08/26/24 EMTN	3'880'000	CHF	3'871'089	3'881'746	0.88
CH0190361029	NEDWBK 1 1/4 08/09/24 EMTN	1'000'000	CHF	996'250	999'150	0.23
				<b>28'161'398</b>	<b>28'302'614</b>	<b>6.43</b>
	<b>NZ</b>					
CH0457206750	ASBBNK 0.45 01/30/25 EMTN	2'000'000	CHF	1'978'550	1'984'900	0.45
CH0398677747	ANZLNZ 0.35 10/22/24 EMTN	4'300'000	CHF	4'261'897	4'274'415	0.97
CH0350030414	ASBBNK 0.2 08/02/24 Emtn	12'635'000	CHF	12'454'519	12'582'565	2.86
				<b>18'694'966</b>	<b>18'841'880</b>	<b>4.28</b>
	<b>SE</b>					

ISIN Nummer	Bezeichnung	Stückzahl / Nennwert	Währung	Einstandswert	Marktwert	% des Netto- vermögens
CH0252511925	LFBANK 0 7/8 09/16/24 EMTn	6'970'000	CHF	6'911'083	6'947'696	1.58
				<b>6'911'083</b>	<b>6'947'696</b>	<b>1.58</b>
	<b>US</b>					
CH0323735594	LLY 0.15 05/24/24 EMTN	9'000'000	CHF	8'930'440	8'983'800	2.04
CH0271171685	AAPL 0 3/8 11/25/24	1'510'000	CHF	1'495'362	1'500'789	0.34
				<b>10'425'802</b>	<b>10'484'589</b>	<b>2.38</b>
	<b>XS</b>					
CH0398677713	CABEI 0.314 09/05/24 EMTN	4'120'000	CHF	4'054'646	4'098'576	0.93
CH0360172727	CAF 0.3 04/07/25 EMTN	6'025'000	CHF	5'949'138	5'954'206	1.35
CH0315955903	CAF 0.304 09/16/24 EMTN	350'000	CHF	344'243	348'408	0.08
CH0233004172	EIB 1 5/8 02/04/25	2'500'000	CHF	2'506'715	2'508'425	0.57
CH0188927450	EIB 1 1/2 08/02/24	4'580'000	CHF	4'575'932	4'581'603	1.04
				<b>17'430'673</b>	<b>17'491'218</b>	<b>3.97</b>
<b>Summe - Anleihen</b>					<b>355'358'178</b>	
<b>Geldmarktpapiere</b>						
	<b>NL</b>					
XS2694039699	RABOBK ECD 0 09/17/24	10'000'000	CHF	9'923'818	9'933'397	2.26
				<b>9'923'818</b>	<b>9'933'397</b>	<b>2.26</b>
<b>Summe - Geldmarktpapiere</b>					<b>9'933'397</b>	
<b>Summe - Amtlich notierte sowie an anderen geregelten Märkten gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>					<b>365'291'575</b>	
<b>Anlagefonds</b>						
	<b>LU</b>					
LU1577895896	LOMBARD ODIER FUNDS SICAV-SHORT-TERM MONEY MARKET	150'928	CHF	18'699'348	18'833'923	4.27
LU0128499158	SHRT TRM MON MKT CHF-I	157'033	CHF	18'693'603	18'829'883	4.27
				<b>37'392'951</b>	<b>37'663'806</b>	<b>8.54</b>
<b>Summe - Anlagefonds</b>					<b>37'663'806</b>	
<b>Summe - Anlagefonds</b>					<b>37'663'806</b>	
<b>SUMME DES WERTPAPIERBESTANDES</b>					<b>402'955'381</b>	<b>91.49</b>

## 9 Swisscanto (LU) Money Market Fund Responsible EUR

Wertpapierbestand zum 31.03.2024 (Angaben in EUR)

ISIN Nummer	Bezeichnung	Stückzahl / Nennwert	Währung	Einstandswert	Marktwert	% des Netto- vermögens
<b>Amtlich notierte sowie an anderen geregelten Märkten gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>						
<b>Anleihen</b>						
<b>AT</b>						
XS2154347293	OMVAV 1 1/2 04/09/24 EMTN	200'000	EUR	197'152	199'918	0.15
XS1982725159	ERSTBK 0 3/8 04/16/24 EMTN	1'800'000	EUR	1'748'808	1'797'642	1.32
				<b>1'945'960</b>	<b>1'997'560</b>	<b>1.47</b>
<b>AU</b>						
XS2003420465	BQDAU 0 1/8 06/04/24 EMTN	700'000	EUR	687'890	695'408	0.51
XS1998797663	NAB 0 1/4 05/20/24 GMTN	1'000'000	EUR	975'400	995'050	0.73
XS1685481332	NAB 0 5/8 09/18/24 GMTN	1'000'000	EUR	967'500	985'120	0.72
				<b>2'630'790</b>	<b>2'675'578</b>	<b>1.96</b>
<b>BE</b>						
BE0312799712	BGTB 0 03/13/25	2'000'000	EUR	1'933'938	1'936'460	1.42
BE0312798706	BGTB 0 01/09/25	2'000'000	EUR	1'938'272	1'946'820	1.43
BE0312797690	BGTB 0 11/07/24	1'700'000	EUR	1'661'171	1'663'331	1.22
BE0312795678	BGTB 0 07/11/24 364D	1'900'000	EUR	1'846'770	1'880'373	1.38
				<b>7'380'151</b>	<b>7'426'984</b>	<b>5.45</b>
<b>CA</b>						
XS1991125896	CM 0 3/8 05/03/24 EMTN	3'400'000	EUR	3'281'276	3'389'868	2.49
XS1985806600	TD 0 3/8 04/25/24 EMTN	1'000'000	EUR	977'720	997'820	0.73
				<b>4'258'996</b>	<b>4'387'688</b>	<b>3.22</b>
<b>CH</b>						
XS2480543102	UBS 2 1/8 05/31/24 EMTN	2'900'000	EUR	2'828'167	2'890'923	2.12
CH1120418079	BAER 0 06/25/24	1'900'000	EUR	1'853'950	1'882'634	1.38
CH0520042489	UBS 0 1/4 01/29/26 EMTN	5'000'000	EUR	4'822'728	4'849'650	3.57
				<b>9'504'845</b>	<b>9'623'207</b>	<b>7.07</b>
<b>CN</b>						
XS2332559470	BCHINA 0 04/28/24 EMTn	1'000'000	EUR	967'820	996'870	0.73
				<b>967'820</b>	<b>996'870</b>	<b>0.73</b>
<b>DE</b>						
XS2063659945	SCBGER 0 1/4 10/15/24 EMTN	2'500'000	EUR	2'435'402	2'452'975	1.80
				<b>2'435'402</b>	<b>2'452'975</b>	<b>1.80</b>
<b>ES</b>						
XS2575952341	SANTAN Float 01/16/25 EMTN	800'000	EUR	802'384	803'264	0.59
XS2476266205	SANTAN Float 05/06/24 eMTN	2'000'000	EUR	2'020'200	2'000'960	1.47
XS2018637913	SANSCF 0 3/8 06/27/24 EMTN	1'100'000	EUR	1'070'135	1'090'892	0.80
XS2014287937	SANTAN 0 1/4 06/19/24 EMTN	1'600'000	EUR	1'547'140	1'587'664	1.17
				<b>5'439'859</b>	<b>5'482'780</b>	<b>4.03</b>
<b>FI</b>						
XS2197342129	OPBANK 0 1/8 07/01/24 EMTN	3'800'000	EUR	3'673'472	3'764'584	2.78
				<b>3'673'472</b>	<b>3'764'584</b>	<b>2.78</b>
<b>FR</b>						
XS1166201035	BFCM 1 1/4 01/14/25 EMTN	600'000	EUR	586'200	588'762	0.43

ISIN Nummer	Bezeichnung	Stückzahl / Nennwert	Währung	Einstandswert	Marktwert	% des Netto- vermögens
XS1111084718	AGFRNC 1 3/8 09/17/24 EMTN	200'000	EUR	196'884	197'614	0.15
FR0128227818	BTF 0 02/26/25 52W	1'700'000	EUR	1'644'659	1'647'980	1.21
FR0128227800	BTF 0 01/29/25 52W	1'500'000	EUR	1'452'063	1'457'310	1.07
FR0128227792	BTF 0 01/02/25 52W	1'500'000	EUR	1'452'438	1'460'820	1.07
FR0128071067	BTF 0 10/30/24 51W	1'500'000	EUR	1'460'459	1'469'175	1.08
FR0128071059	BTF 0 10/02/24 51W	1'100'000	EUR	1'066'514	1'079'881	0.79
FR0014006XE5	BFCM 0.01 03/07/25 EMTN	3'000'000	EUR	2'892'570	2'901'240	2.13
FR0013420023	HSBC 0 1/4 05/17/24 EMTN	1'000'000	EUR	965'900	995'560	0.73
FR0013183431	RATPFP 0 3/8 06/15/24 EMTN	300'000	EUR	292'863	297'636	0.22
FR0012537124	UNEDIC 0 5/8 02/17/25 EMTN	4'000'000	EUR	3'888'000	3'895'480	2.87
FR0011891258	ACAAP 2 3/4 06/20/24	600'000	EUR	594'456	598'230	0.44
FR0011689579	BPCEGP 3 07/19/24 EMTN	1'300'000	EUR	1'287'793	1'296'308	0.95
				<b>17'780'800</b>	<b>17'885'996</b>	<b>13.14</b>
	<b>GB</b>					
XS2109394077	LLOYDS 0 3/8 01/28/25 EMTN	3'500'000	EUR	3'386'702	3'407'285	2.50
XS2002491517	NWG 1 05/28/24 EMTN	200'000	EUR	198'220	199'108	0.15
XS1167204699	LLOYDS 1 1/4 01/13/25 EMTN	380'000	EUR	371'488	372'822	0.27
XS1111559685	SANUK 1 1/4 09/18/24 EMTN	686'000	EUR	676'465	677'898	0.50
IT0006729377	BACR 2.8 06/20/24 DMTN	1'200'000	EUR	1'185'734	1'197'204	0.88
				<b>5'818'608</b>	<b>5'854'317</b>	<b>4.30</b>
	<b>JE</b>					
XS2089242064	ISDB 0.037 12/04/24	2'000'000	EUR	1'935'900	1'948'340	1.43
				<b>1'935'900</b>	<b>1'948'340</b>	<b>1.43</b>
	<b>JP</b>					
XS2132337697	MUFG 0.978 06/09/24	4'000'000	EUR	3'895'015	3'978'480	2.93
XS2004880832	MIZUHO 0.523 06/10/24 EMTN	3'200'000	EUR	3'099'937	3'180'096	2.34
XS1998025008	SUMIBK 0.465 05/30/24 EMTN	3'000'000	EUR	2'903'535	2'983'920	2.19
XS1694219780	SUMIBK 0.934 10/11/24 EMTN	1'000'000	EUR	982'370	984'990	0.72
				<b>10'880'857</b>	<b>11'127'486</b>	<b>8.18</b>
	<b>KY</b>					
XS1577956789	YANTZE 1.3 06/21/24	800'000	EUR	777'600	795'248	0.58
				<b>777'600</b>	<b>795'248</b>	<b>0.58</b>
	<b>NL</b>					
XS2554493119	NWG Float 11/14/24 EMTN	1'000'000	EUR	1'012'590	1'003'060	0.74
XS2348030268	NOVOB 0 06/04/24 EMTN	200'000	EUR	197'460	198'692	0.15
XS1411405662	RDSALN 0 3/4 05/12/24 EMTN	2'500'000	EUR	2'453'000	2'491'675	1.83
XS1041772986	DSM 2 3/8 04/03/24 EMTn	150'000	EUR	148'733	149'993	0.11
XS0792977984	ALLRNV 2 7/8 06/14/24 EMTN	1'600'000	EUR	1'595'504	1'597'120	1.17
				<b>5'407'287</b>	<b>5'440'540</b>	<b>4.00</b>
	<b>NO</b>					
XS2050945984	SCBNOR 0 1/8 09/11/24 EMTN	1'300'000	EUR	1'249'924	1'278'706	0.94
				<b>1'249'924</b>	<b>1'278'706</b>	<b>0.94</b>
	<b>SE</b>					
XS2230884657	VLVY 0 1/8 09/17/24 EMTN	3'650'000	EUR	3'512'395	3'587'877	2.65
XS2020568734	SEB 0.05 07/01/24 EMTN	2'500'000	EUR	2'413'975	2'476'325	1.82
				<b>5'926'370</b>	<b>6'064'202</b>	<b>4.47</b>
	<b>SG</b>					
XS1750083229	UOBSP 0 1/2 01/16/25 EMTN	1'500'000	EUR	1'459'275	1'462'800	1.07



ISIN Nummer	Bezeichnung	Stückzahl / Nennwert	Währung	Einstandswert	Marktwert	% des Netto- vermögens
				<b>1'459'275</b>	<b>1'462'800</b>	<b>1.07</b>
	<b>US</b>					
XS2196322155	XOM 0.142 06/26/24	4'000'000	EUR	3'883'000	3'965'400	2.92
XS2125914593	ABBV 1 1/4 06/01/24	250'000	EUR	247'850	248'968	0.18
XS2091604715	CB 0.3 12/15/24	800'000	EUR	775'032	780'088	0.57
XS1979259220	MET 0 3/8 04/09/24	3'200'000	EUR	3'118'742	3'198'144	2.35
XS1944456109	IBM 0 7/8 01/31/25 EMTN	1'400'000	EUR	1'364'202	1'368'234	1.01
XS1520899532	ABBV 1 3/8 05/17/24	2'600'000	EUR	2'568'020	2'591'836	1.90
XS1112850125	BKNG 2 3/8 09/23/24	1'992'000	EUR	1'975'626	1'977'697	1.45
XS1079726334	BAC 2 3/8 06/19/24 EMTN	2'200'000	EUR	2'166'586	2'192'630	1.61
				<b>16'099'058</b>	<b>16'322'997</b>	<b>11.99</b>
	<b>XS</b>					
EU000A3K4ET2	EUB 0 09/06/24 6M	2'500'000	EUR	2'453'580	2'459'975	1.81
EU000A3K4EQ8	EUB 0 07/05/24 6M	1'600'000	EUR	1'573'120	1'584'496	1.16
EU000A3K4EPO	EUB 0 06/07/24 6M	1'500'000	EUR	1'475'074	1'489'665	1.09
				<b>5'501'774</b>	<b>5'534'136</b>	<b>4.06</b>
<b>Summe - Anleihen</b>					<b>112'522'994</b>	
<b>Summe - Amtlich notierte sowie an anderen geregelten Märkten gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>					<b>112'522'994</b>	
<b>Anlagefonds</b>						
	<b>FR</b>					
FR0007435920	AMUNDI EUR LIQ SH TRM-I CAP	558	EUR	6'211'851	6'279'369	4.62
				<b>6'211'851</b>	<b>6'279'369</b>	<b>4.62</b>
	<b>LU</b>					
LU0128494944	PICTET-SHORT TRM MMKT E-I	43'906	EUR	6'010'360	6'259'837	4.61
				<b>6'010'360</b>	<b>6'259'837</b>	<b>4.61</b>
<b>Summe - Anlagefonds</b>					<b>12'539'206</b>	
<b>Summe - Anlagefonds</b>					<b>12'539'206</b>	
<b>SUMME DES WERTPAPIERBESTANDES</b>					<b>125'062'200</b>	<b>91.90</b>

# 10 Swisscanto (LU) Money Market Fund Responsible USD

Wertpapierbestand zum 31.03.2024 (Angaben in USD)

ISIN Nummer	Bezeichnung	Stückzahl / Nennwert	Währung	Einstandswert	Marktwert	% des Netto- vermögens
<b>Amtlich notierte sowie an anderen geregelten Märkten gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>						
<b>Anleihen</b>						
<b>AU</b>						
US8672ENAL69	SUNAU 3.3 04/15/24 REGS	2'174'000	USD	2'138'683	2'172'196	0.71
US62878V2C39	NBNAUS 0 7/8 10/08/24 REGS	2'000'000	USD	1'947'640	1'952'220	0.63
				<b>4'086'323</b>	<b>4'124'416</b>	<b>1.34</b>
<b>CA</b>						
XS2695395694	BMO 5.894 09/26/24 EMTN	4'000'000	USD	3'996'000	3'997'600	1.30
US89114QCA40	TD 2.65 06/12/24 MTN	1'000'000	USD	973'590	994'400	0.32
US78013XZU52	RY 2.55 07/16/24 GMTN	9'000'000	USD	8'724'650	8'926'740	2.90
US31429KAE38	CCDJ 0.7 05/21/24 144A	6'000'000	USD	5'751'540	5'959'320	1.94
US06418GAB32	BNS Float 06/12/25	2'000'000	USD	2'005'920	2'014'720	0.65
US06417XAK72	BNS Float 04/11/25 MTN	1'933'000	USD	1'929'873	1'941'003	0.63
US0641596E11	BNS 0.65 07/31/24	1'500'000	USD	1'440'525	1'476'270	0.48
US06367TQW35	BMO 0 5/8 07/09/24 MTN	2'000'000	USD	1'894'620	1'973'560	0.64
				<b>26'716'718</b>	<b>27'283'613</b>	<b>8.86</b>
<b>CH</b>						
US22550L2J94	UBS 4 3/4 08/09/24	12'527'000	USD	12'329'924	12'482'279	4.05
US22546QAP28	UBS 3 5/8 09/09/24 MTN	3'700'000	USD	3'604'084	3'666'478	1.19
				<b>15'934'008</b>	<b>16'148'757</b>	<b>5.24</b>
<b>DE</b>						
US251526CJ68	DB 0.898 05/28/24	8'800'000	USD	8'477'254	8'734'528	2.84
				<b>8'477'254</b>	<b>8'734'528</b>	<b>2.84</b>
<b>ES</b>						
US05971KAM18	SANTAN 3.892 05/24/24	2'600'000	USD	2'553'200	2'593'682	0.84
US05971KAD19	SANTAN 2.706 06/27/24	3'400'000	USD	3'312'588	3'376'098	1.10
				<b>5'865'788</b>	<b>5'969'780</b>	<b>1.94</b>
<b>FR</b>						
US22536PAD33	ACAFF 3 1/4 10/04/24 REGS	6'700'000	USD	6'582'110	6'619'667	2.15
US22535WAD92	ACAFF 3 1/4 10/04/24 144A	3'000'000	USD	2'916'900	2'964'090	0.96
				<b>9'499'010</b>	<b>9'583'757</b>	<b>3.11</b>
<b>GB</b>						
XS2423041107	GS 3.26 07/08/24 EMTN	1'050'000	USD	1'026'375	1'040'298	0.34
XS1876165819	HSBC 3.3 09/28/24 emtn	4'260'000	USD	4'201'578	4'360'493	1.42
USG6382GVA77	NWG 0.8 08/12/24 REGS	10'920'000	USD	10'406'740	10'730'210	3.48
US404280DE63	HSBC 4.18 12/09/25	2'500'000	USD	2'467'675	2'470'625	0.80
US06739FHV67	BACR 3 3/4 05/15/24 BKNT	310'000	USD	305'319	309'281	0.10
				<b>18'407'686</b>	<b>18'910'908</b>	<b>6.14</b>
<b>JP</b>						
USJ45992PK42	MIZUHO 3 3/4 04/16/24 REGS	2'000'000	USD	1'963'900	1'998'440	0.65
US86562MBM10	SUMIBK 2.696 07/16/24	7'900'000	USD	7'686'600	7'834'272	2.54
US60687YAW93	MIZUHO 2.839 07/16/25	9'000'000	USD	8'798'050	8'923'500	2.90
US606822CQ57	MUFG 5.063 09/12/25	8'000'000	USD	7'975'600	7'973'280	2.59

ISIN Nummer	Bezeichnung	Stückzahl / Nennwert	Währung	Einstandswert	Marktwert	% des Netto- vermögens
US606822CH58	MUFG 4.788 07/18/25	5'400'000	USD	5'363'600	5'381'748	1.75
				<b>31'787'750</b>	<b>32'111'240</b>	<b>10.43</b>
	<b>KY</b>					
US01609WAQ50	BABA 3.6 11/28/24	1'600'000	USD	1'572'736	1'578'944	0.51
				<b>1'572'736</b>	<b>1'578'944</b>	<b>0.51</b>
	<b>NL</b>					
XS1596070547	MUBAUH 3 04/19/24 GMTN	900'000	USD	886'167	898'056	0.29
US74977RDF82	RABOBK 2 5/8 07/22/24 144A	11'000'000	USD	10'723'798	10'901'110	3.54
US55276VAH50	MUBAUH 2 1/2 11/07/24 144A	2'200'000	USD	2'121'328	2'158'112	0.70
				<b>13'731'293</b>	<b>13'957'278</b>	<b>4.53</b>
	<b>NZ</b>					
US00216NAC39	ASBBNK 3 1/8 05/23/24 REGS	7'100'000	USD	6'971'355	7'073'943	2.30
				<b>6'971'355</b>	<b>7'073'943</b>	<b>2.30</b>
	<b>SE</b>					
US86959LAG86	SHBASS 0.55 06/11/24 144A	2'500'000	USD	2'397'450	2'476'200	0.80
				<b>2'397'450</b>	<b>2'476'200</b>	<b>0.80</b>
	<b>US</b>					
US91282CEH07	T 2 5/8 04/15/25	2'000'000	USD	1'952'188	1'952'227	0.63
US91282CDZ14	T 1 1/2 02/15/25	2'000'000	USD	1'933'305	1'938'164	0.63
US91282CDN83	T 1 12/15/24	600'000	USD	578'766	582'891	0.19
US912828YH74	T 1 1/2 09/30/24	450'000	USD	435'775	441'747	0.14
US912796Y452	B 06/27/24	50'000	USD	48'768	49'360	0.02
US61747YEQ44	MS 3.62 04/17/25	6'000'000	USD	5'976'000	5'994'360	1.95
US61746BDQ68	MS 3 7/8 04/29/24 F	2'000'000	USD	1'975'000	1'997'140	0.65
US46647PDM59	JPM 5.546 12/15/25	11'000'000	USD	10'997'790	10'992'850	3.57
US46647PDE34	JPM 3.845 06/14/25	2'500'000	USD	2'486'725	2'489'950	0.81
US40434CAD74	HSBC 3 1/2 06/23/24	3'800'000	USD	3'730'220	3'780'126	1.23
US40428HTA04	HSBC 3 3/4 05/24/24	3'860'000	USD	3'803'953	3'849'192	1.25
US14913R2P10	CAT 0.6 09/13/24 MTN	1'064'000	USD	1'037'826	1'041'539	0.34
US06051GKT57	BAC Float 04/25/25 0000	2'000'000	USD	2'004'000	2'000'340	0.65
US06051GHW24	BAC 2.456 10/22/25 MTN	6'000'000	USD	5'883'045	5'894'100	1.91
US06051GGT04	BAC 3.093 10/01/25 MtN	2'090'000	USD	2'060'552	2'062'914	0.67
US04686E3A83	ATH Float 05/24/24 REGS	460'000	USD	452'541	460'529	0.15
US04685A3H29	ATH Float 01/07/25 144A	2'715'000	USD	2'655'037	2'719'371	0.88
US04685A3B58	ATH Float 08/19/24 144A	2'475'000	USD	2'454'867	2'476'683	0.80
US04685A3A75	ATH 0.914 08/19/24 144A	1'200'000	USD	1'141'164	1'177'392	0.38
US04685A2X87	ATH Float 05/24/24 144A	2'000'000	USD	1'988'860	2'001'480	0.65
US04685A2J93	ATH 2 3/4 06/25/24 144A	2'500'000	USD	2'433'000	2'482'125	0.81
				<b>56'029'380</b>	<b>56'384'479</b>	<b>18.31</b>
	<b>XS</b>					
XS2045838039	CABEI Float 11/15/24 EMTN	1'400'000	USD	1'404'858	1'407'686	0.46
				<b>1'404'858</b>	<b>1'407'686</b>	<b>0.46</b>
<b>Summe - Anleihen</b>					<b>205'745'527</b>	

ISIN Nummer	Bezeichnung	Stückzahl / Nennwert	Währung	Einstandswert	Marktwert	% des Netto- vermögens
<b>Geldmarktpapiere</b>						
<b>CA</b>						
XS2680384000	0 TD 24 ECP	10'000'000	USD	9'441'184	9'769'405	3.17
				<b>9'441'184</b>	<b>9'769'405</b>	<b>3.17</b>
<b>GB</b>						
XS2771993867	NBADGB ECD 0 01/21/25	10'000'000	USD	9'525'261	9'571'568	3.11
				<b>9'525'261</b>	<b>9'571'568</b>	<b>3.11</b>
<b>SE</b>						
XS2775706539	QNBLON ECD 0 02/24/25	10'000'000	USD	9'455'977	9'526'719	3.09
XS2667586858	SEB ECP 0 06/10/24	10'000'000	USD	9'528'356	9'892'143	3.21
XS2730603755	SWEDBK ECP 0 11/29/24	10'000'000	USD	9'473'699	9'649'847	3.13
				<b>1'404'858</b>	<b>29'068'709</b>	<b>9.44</b>
<b>Summe - Geldmarktpapiere</b>					<b>48'409'682</b>	
<b>Summe - Amtlich notierte sowie an anderen geregelten Märkten gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>					<b>254'155'209</b>	
<b>Anlagefonds</b>						
<b>LU</b>						
LU0619623795	AMUNDI MMKT-S/T USD-PV(C)	12'398	USD	13'524'733	14'417'722	4.68
LU0128497707	PICTET-SHRT TRM MMKT USD-I	90'765	USD	13'409'572	14'445'078	4.69
				<b>26'934'305</b>	<b>28'862'800</b>	<b>9.37</b>
<b>Summe - Anlagefonds</b>					<b>28'862'800</b>	
<b>Summe - Anlagefonds</b>					<b>28'862'800</b>	
<b>SUMME DES WERTPAPIERBESTANDES</b>					<b>283'018'009</b>	<b>91.90</b>

# 11 Erläuterungen

## Erläuterung 1: Finanzberichte

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

## Erläuterung 2: Wichtigste Grundsätze der Rechnungslegung

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

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

### Devisenkurse

---

USD	1.00 = CHF	0.90070000
CHF	1.00 = CHF	1.00000000
AUD	1.00 = CHF	0.58761668
EUR	1.00 = CHF	0.97275172

---

Bewertungsgrundsätze:

a) Wertpapiere, Derivate und andere Anlagen, welche an einer Börse notiert sind, werden zu den letztbekannten Marktpreisen bewertet. Falls diese Wertpapiere, Derivate und anderen Anlagen an mehreren Börsen notiert sind, ist der letztverfügbare Kurs an jener Börse maßgebend, die der Hauptmarkt für dieses Wertpapier ist. Bei Wertpapieren, Derivaten und anderen Anlagen, bei welchen der Handel an einer Börse geringfügig ist und für welche ein Zweitmarkt zwischen Wertpapierhändlern mit marktkonformer Preisbildung besteht, kann die Verwaltungsgesellschaft die Bewertung dieser Wertpapiere, Derivate und anderen Anlagen aufgrund dieser Preise vornehmen.

Wertpapiere, Derivate und andere Anlagen, die nicht an einer Börse notiert sind, die aber an einem anderen geregelten Markt, der anerkannt, für das Publikum offen und dessen Funktionsweise ordnungsgemäß ist, gehandelt werden, werden zum letztverfügbaren Kurs auf diesem Markt bewertet.

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

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

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

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

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

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

h) Berechnung des Nettoinventarwertes

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

Die Verwaltungsgesellschaft ist berechtigt, zeitweilig andere allgemein anerkannte, von Abschlussprüfern nachvollziehbare Bewertungsprinzipien für die Gesamtfondsguthaben und die Guthaben eines Teilfonds anzuwenden, falls die oben erwähnten Kriterien zur Bewertung aufgrund außergewöhnlicher Ereignisse unmöglich oder unzweckmäßig erscheinen.

i) Kapitalgewinne oder -verluste aus Wertpapiergeschäften

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

### Erläuterung 3: Verwaltungskommission

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

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

Im Geschäftsjahr belief sich die effektive pauschale Verwaltungskommission auf:

Teilfonds	Klasse	PVK p.a. in %	PMF p.a. in %	PAF p.a. in %
Swisscanto (LU) Money Market Fund Responsible AUD	AT	0.600	0.550	0.050
Swisscanto (LU) Money Market Fund Responsible AUD	BT	0.550	0.500	0.050
Swisscanto (LU) Money Market Fund Responsible AUD	DT	0.250	0.220	0.030
Swisscanto (LU) Money Market Fund Responsible CHF	DT	0.110	0.080	0.030
Swisscanto (LU) Money Market Fund Responsible CHF	FT	0.140	0.090	0.050
Swisscanto (LU) Money Market Fund Responsible CHF	GT	0.110	0.080	0.030
Swisscanto (LU) Money Market Fund Responsible EUR	AT	0.250	0.200	0.050
Swisscanto (LU) Money Market Fund Responsible EUR	DT	0.180	0.150	0.030
Swisscanto (LU) Money Market Fund Responsible EUR	GT	0.150	0.120	0.030
Swisscanto (LU) Money Market Fund Responsible USD	AT	0.380	0.330	0.050
Swisscanto (LU) Money Market Fund Responsible USD	DT	0.280	0.250	0.030
Swisscanto (LU) Money Market Fund Responsible USD	GT	0.230	0.200	0.030
Swisscanto (LU) Money Market Fund Responsible USD	NT	-	-	-

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

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

Gemäß den in Luxemburg geltenden Bestimmungen unterliegt der Fonds einer vierteljährlich zahlbaren „Taxe d'abonnement“ in Höhe von 0,01% p.a., die auf der Grundlage des Nettovermögens eines jeden Teilfonds am Ende de jeweiligen Quartals berechnet wird.

## Erläuterung 5: Total Expense Ratio (TER)

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

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

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

## Erläuterung 6: Angaben über Devisentermingeschäfte

### Swisscanto (LU) Money Market Fund Responsible AUD - AUD

Währung	Käufe	Währung	Verkäufe	Fälligkeit	Nicht realisiertes Ergebnis (in AUD)
USD	380'000.00	AUD	582'577.26	18.4.2024	-434.57
AUD	3'106'262.98	USD	2'050'000.00	18.4.2024	-34'151.72
CHF	270'000.00	AUD	472'744.20	18.4.2024	-12'454.82
AUD	3'081'338.53	CHF	1'750'000.00	18.4.2024	97'938.09

Die Devisentermingeschäfte wurden mit folgenden Gegenparteien abgeschlossen: CACEIS Investor Services Bank SA/LU, Zürcher Kantonalbank

## Erläuterung 7: Angaben über Termingeschäfte

In der Berichtsperiode nicht relevant

## Erläuterung 8: Eventualverpflichtungen aus Optionen

In der Berichtsperiode nicht relevant

## Erläuterung 9: Swapgeschäfte

In der Berichtsperiode nicht relevant

## **Erläuterung 10: Wertpapierbestandsveränderungen**

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

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

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

## **Erläuterung 12: Transaktionskosten**

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

Swisscanto (LU) Money Market Fund	USD	1.03
Responsible USD		

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

## **Erläuterung 13: Wertpapierleihe (Securities Lending)**

Keinen Securities Lending vorhanden.



## **Erläuterung 14: Gebühren bei Zeichnung und Rückkauf von Zielfonds**

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

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

Zielfonds	Marktwert (in CHF)
Swisscanto (LU) Money Market Fund Responsible CHF	1'488'465.00
Swisscanto (LU) Money Market Fund Responsible USD	1'538'392.61

## **Erläuterung 15: Zusätzliche Informationen**

In der Berichtsperiode nicht relevant

## **Erläuterung 16: Wichtige Ereignisse**

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

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

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

## **Erläuterung 17: Nachfolgende Ereignisse**

In der Berichtsperiode nicht relevant.

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

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

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

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

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

## 12 Ungeprüfte Informationen

### Angaben zur Vergütungspolitik

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

	Anzahl MA	CHF
Gesamtvergütung Swisscanto Asset Management International S.A. und delegiertes Asset Management (01.01.2023 - 31.12.2023)	18	2'709'535.67
davon fester Bestandteil		1'834'778.55
davon variabler Bestandteil*		874'757.12

\* Die Grundlage der variablen Vergütungen, welche jeweils im März des Geschäftsjahres ausbezahlt werden, beziehen sich auf das Vorjahr.

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

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

Weitere Informationen können der Vergütungspolitik auf folgender Internetseite entnommen werden:

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

Die Verwaltungsgesellschaft:

SWISSCANTO ASSET MANAGEMENT INTERNATIONAL S.A., Luxemburg



## Regelmässige Information zum 31.03.2024

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

### Name des Produkts:

Swisscanto (LU) Money Market Fund Responsible USD

### Unternehmenskennung (LEI-Code):

5493004F95ISP2JTIM61

### Benchmark

FTSE 3-Month US Dollar Eurodeposit

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

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

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

### Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

<input checked="" type="radio"/> <input checked="" type="radio"/> <input type="checkbox"/> Ja		<input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> <input checked="" type="checkbox"/> Nein	
<input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel</b> getätigt: _ %	<input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	<input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit <b>ökologische/soziale Merkmale beworben</b> und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es <b>8.54%</b> an nachhaltigen Investitionen	<input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
<input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	<input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel</b> getätigt: _ %	<input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	<input checked="" type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel
<input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel</b> getätigt: _ %		<input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber <b>keine nachhaltigen Investitionen getätigt</b> .	



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

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

1. Ausschlusskriterien
2. ESG-Integration
3. Reduktion der CO<sub>2</sub>e-Intensität

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

### Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

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

### ...und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

## Ausschlusskriterien

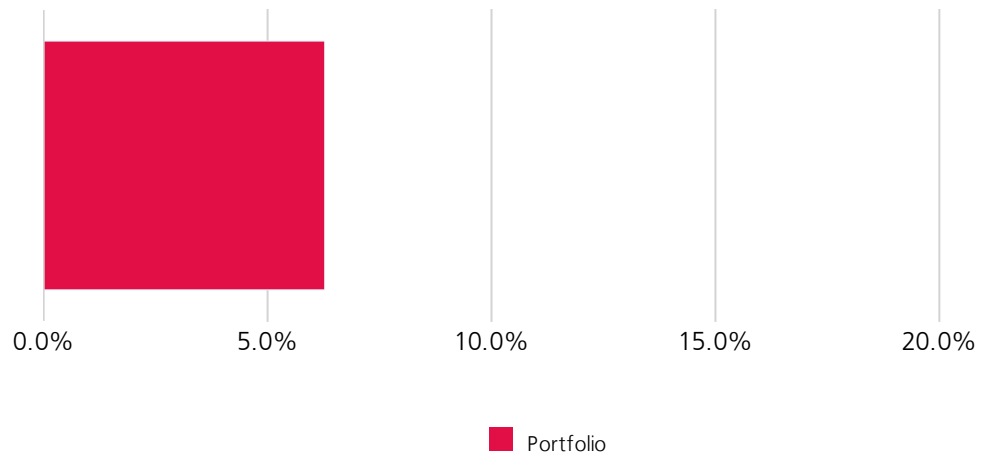
Responsible		Kriterien	Gewicht Portfolio	Kriterien	Gewicht Portfolio	
	Förderung von Kohle (> 5% Umsatz)		0.00%		Ausbeuterische Kinderarbeit	0.00%
	Kohlereserven (ex. Metalproduktion)		0.00%		Herstellung von Kriegstechnik (> 5% Umsatz)	0.00%
	Klimawandel		Gefährdung von Gesellschaft und Gesundheit		Herstellung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

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

Indikator	Berichtsjahr 2023	Berichtsjahr 2024
Portfolio Ausschlusskriterien Total*	0%	0%

\*alle Ausschlusskriterien kumuliert.

# ESG-Integration



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

Die historischen Vergleiche werden in nachfolgender Tabelle gemacht.

	Indikator	Berichtsjahr 2023	Berichtsjahr 2024
Portfolio	Exposition zu ESG Laggards	7.36%	6.27%

# Reduktion der CO<sub>2</sub>e-Intensität



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

	Indikator	Berichtsjahr 2023	Berichtsjahr 2024
Portfolio	CO <sub>2</sub> e-Intensität Corporate	65	2
	Reduktion Corporate	-76%	-99%

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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



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

### Nachteilige Nachhaltigkeitsauswirkungen (PAI) – Corporate Anlagen

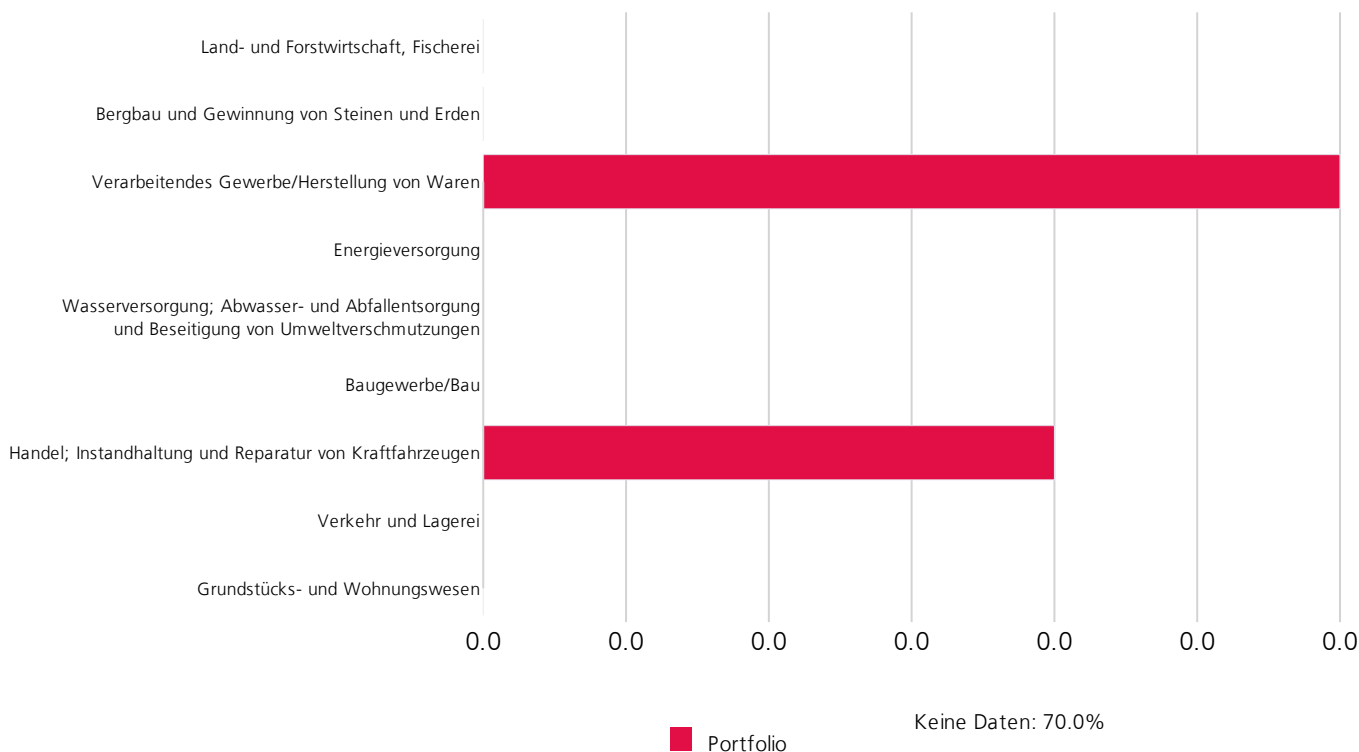
Primäre Indikatoren - Energie und Emissionen

Indikator	Faktor	Portfolio Aktuell	Abdeckung	Portfolio Vorjahr	Erklärung
1. THG-Emissionen	1a. GHG Emissions - Scope 1 per Mio EUR Enterprise Value	537.6	43.93%	787.51	
	1b. GHG Emissions - Scope 2 per Mio EUR Enterprise Value	67.38	43.93%	188.27	
	1c. GHG Emissions - Scope 3 per Mio EUR Enterprise Value	10265.3	43.93%	8913.63	
2. CO <sub>2</sub> -Fussabdruck	2. GHG Emissions - Scope 1+2+3 per Mio EUR Enterprise Value	35	43.93%	41.13	
3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird	3. GHG Emissions - Emissions Intensity - Total Emissions (EUR)	9.85	47.22%	27.59	
4. Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind	4. Fossil Fuel - Involvement (PAI)	0.32%	46.21%	1.8%	

Indikator	Faktor	Portfolio Aktuell	Abdeckung	Portfolio Vorjahr	Erklärung
5. Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen	5a. CR Raw - Energy use - Coal/nuclear/unclear energy sources	24.06%	0.21%	0%	Der Verbrauch nicht-erneuerbarer Energie umfasst den Verbrauch von Energie, die aus nicht-erneuerbaren Quellen erzeugt wird, sowie den Verbrauch von Energie aus Biomasse. Alle Zahlen zum Energieverbrauch, bei denen die Energiequelle unklar ist, sind ebenfalls in diesem Faktor enthalten.
	5b. Non-renewable energy consumption	0.34%	18.7%	0%	
	5c. Non-renewable energy production	0%	45.89%	1.2%	
6. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren	6. Energy consumption intensity (GWh/mEUR)	0.02	28.82%	0.01	



Intensität des Energieverbrauchs pro High Impact Sector (pro Mio. EUR) (PAI 6 siehe oben)



Indikator	Faktor	Portfolio Aktuell	Abdeckung	Portfolio Vorjahr	Erklärung
7. Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken	7. Companies negatively affecting biodiversity-sensitive areas	0%	45.78%	0%	
8. Emissionen in Wasser	8. CR Raw - COD emissions	0	0%	0	
9. Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle	9. CR Raw - Hazardous waste	0	3.98%	0	

Indikator	Faktor	Portfolio Aktuell	Abdeckung	Portfolio Vorjahr	Erklärung
10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen	10. UNGC / OECD Guidelines Violation	0%	45.78%	0%	
11. Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen	11. Lack of processes monitoring UNGC and OECD Guidelines compliance	5.5%	31.86%	1.38%	
12. Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle	12. Unadjusted gender pay gap	0.1%	5.23%	0%	
13. Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen	13. Ratio of female to male board members	60.23%	34.11%	18.19%	
14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)	14. Controversial weapons involvement (APM, CM, Bio, Chem)	0%	46.21%	0%	

## Nachteilige Nachhaltigkeitsauswirkungen (PAI) – Staatliche und Supranationale Vermögenswerte

Primäre Indikatoren

Umwelt					
Indikator	Faktor	Portfolio Aktuell	Abdeckung	Portfolio Vorjahr	Erklärung
15. GHG Intensität	15. GHG Intensity	314.26	12.25%	273.97	

Sozial					
Indikator	Faktor	Portfolio Aktuell	Abdeckung	Portfolio Vorjahr	Erklärung
16. Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen	16a. Countries subject to social violations (#)	1	2.19%	0.75	
	16b. Countries subject to social violations (%)	18.75%	2.19%	8.13%	

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

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



## Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 01.04.2023 - 31.03.2024

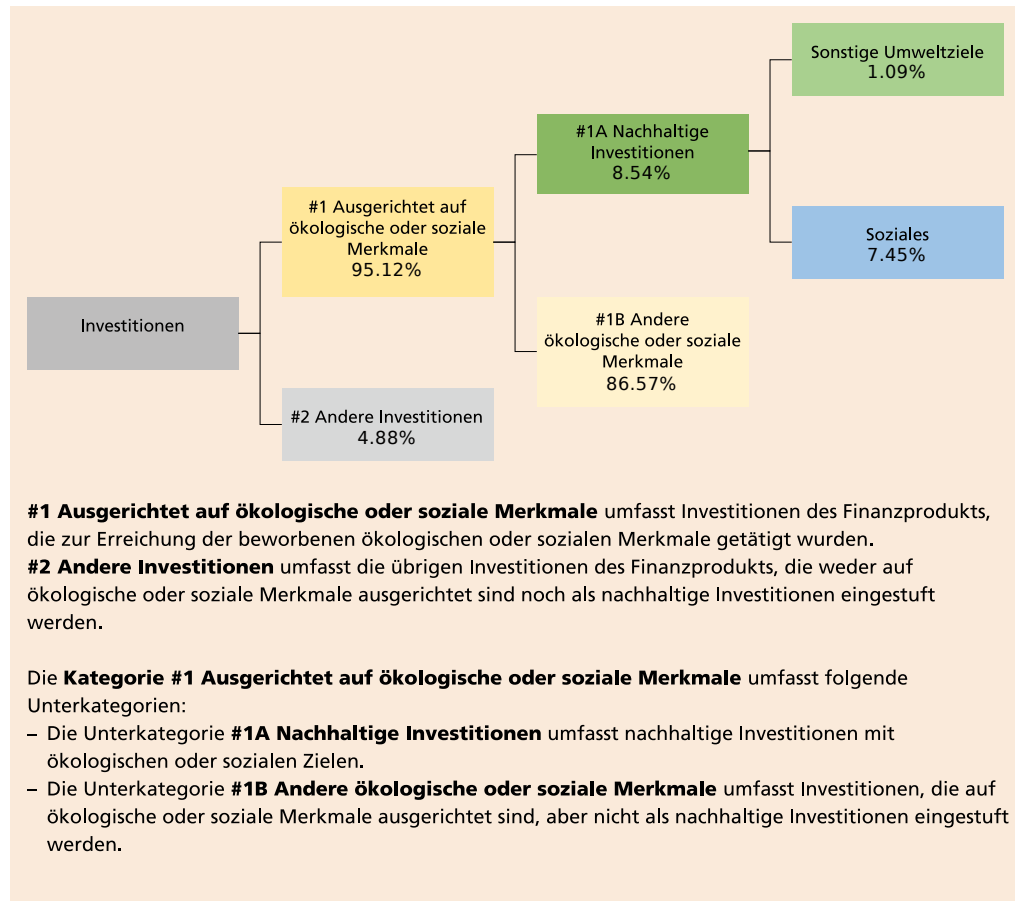
Grösste Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
Amundi Money Market Fund SICAV - Short Term (USD) Capitalisation -PV-	Financial and Insurance Activities	4.27%	France
Pictet SICAV - Pictet - Short-Term Money Market USD Capitalisation I		4.21%	
UBS AG/New York NY 4.75% 09-AUG-2024	Financial and Insurance Activities	2.65%	Switzerland
Sumitomo Mitsui Financial Group Inc 2.696% 16-JUL-2024	Financial and Insurance Activities	2.30%	Japan
NatWest Markets PLC 0.8% 12-AUG-2024 REGS	Financial and Insurance Activities	2.25%	United Kingdom
Bayerische Landesbank 0.0% 03-JAN-2024	Financial and Insurance Activities	2.21%	
Qatar National Bank (London Branch) 0.0% 26-FEB-2024	Financial and Insurance Activities	2.19%	Qatar
BPCE S.A. 0.0% 12-APR-2024	Financial and Insurance Activities	2.18%	France
Government of the United States of America 0.0% 18-JUL-2023	Public Administration and Defence, Compulsory Social Security	2.08%	
Skandinaviska Enskilda Banken AB 0.0% 10-JUN-2024	Financial and Insurance Activities	2.06%	Sweden
Toronto-Dominion Bank 0.0% 04-SEP-2024	Financial and Insurance Activities	2.04%	Canada
Deutsche Bank AG, New York Branch 0.898% 28-MAY-2024	Financial and Insurance Activities	1.92%	United Kingdom
Royal Bank of Canada 2.55% 16-JUL-2024	Financial and Insurance Activities	1.89%	Canada
Federation des caisses Desjardins du Quebec 0.7% 21-MAY-2024 144A	Financial and Insurance Activities	1.88%	
Cooperative Rabobank UA 2.625% 22-JUL-2024 144A	Financial and Insurance Activities	1.64%	USA



## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

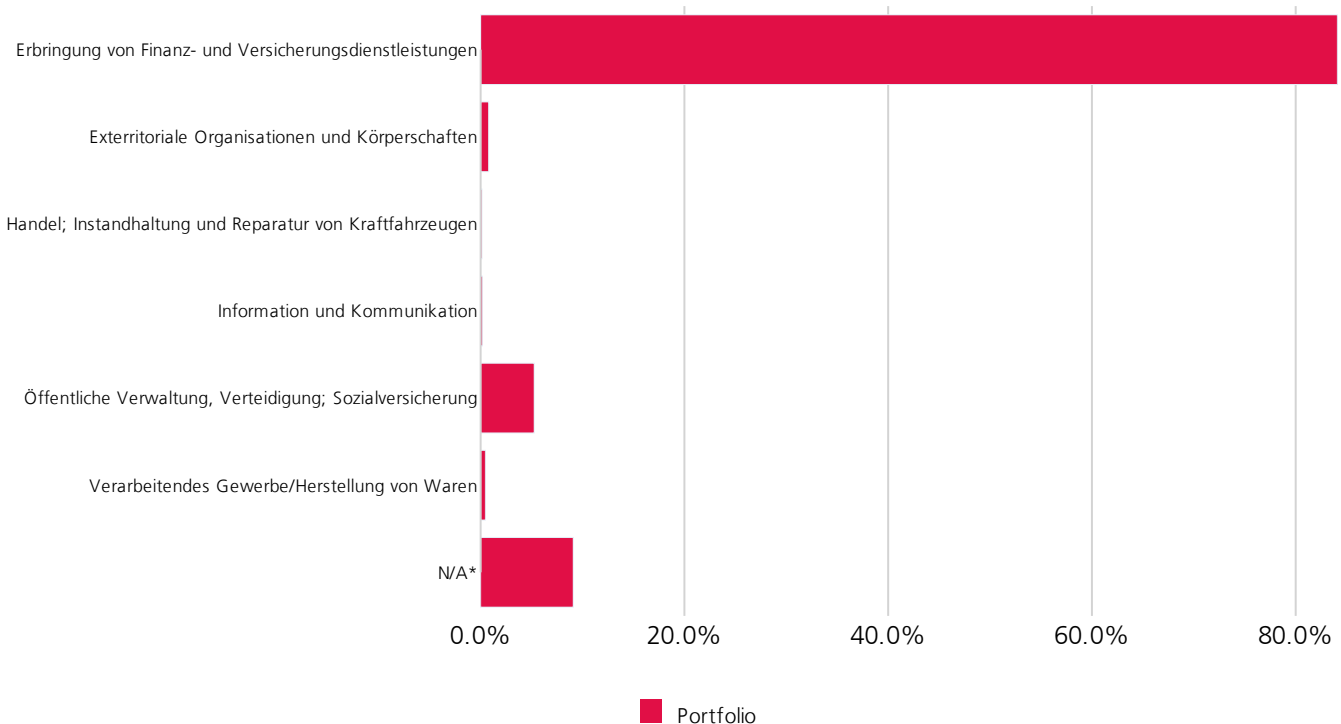
Der Anteil an nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen und Angaben zur Vermögensallokation werden in untenstehender Frage beantwortet.

### Wie sah die Vermögensallokation aus?



### In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Wegen mangelnder Datenverfügbarkeit können Subsektoren nicht angezeigt werden.



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



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

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

**Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomeikonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?**

Ja

In fossiles Gas

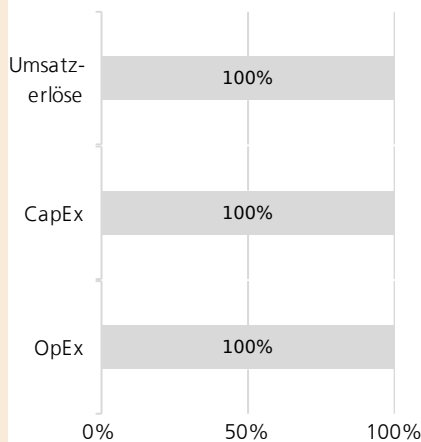
In Kernenergie

Nein

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

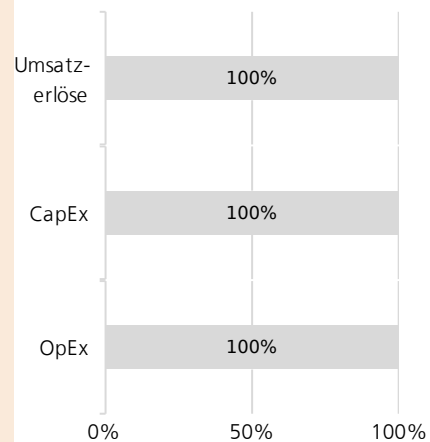
**Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomeikonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzproduktes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

1. Taxonomiekonformität der Investitionen einschliesslich Staatsanleihen\*



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

2. Taxonomiekonformität der Investitionen ohne Staatsanleihen\*



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

Diese Grafik gibt **86.2%** der Gesamtinvestitionen wieder.

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

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

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

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

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

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

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

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

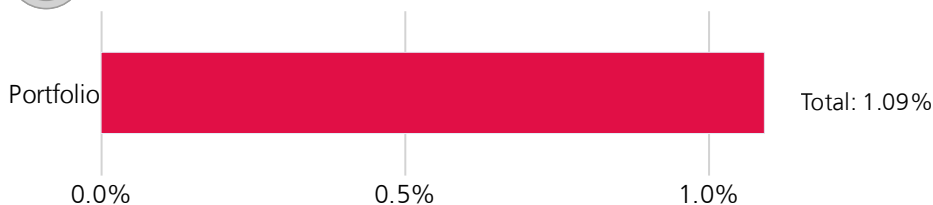
Issuer Name	Nace Sektor	Total Eligible Activity Revenue	Total Aligned Revenue	Total Likely Aligned Revenue	Total Potentially Aligned Revenue	Portfolio Gewicht (Consol.)
-------------	-------------	---------------------------------	-----------------------	------------------------------	-----------------------------------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

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


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

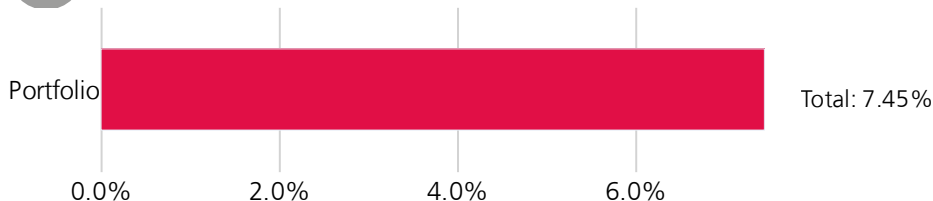
 sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.

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




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

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



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

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

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



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

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

Swisscanto | Proxy Voting Dashboard (issgovernance.com)

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



## Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

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

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

### Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?

Nicht anwendbar.

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

Nicht anwendbar.

### Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?

Nicht anwendbar.

### Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?

Nicht anwendbar.

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





## Regelmässige Information zum 31.03.2024

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

### Name des Produkts:

Swisscanto (LU) Money Market Fund Responsible AUD

### Unternehmenskennung (LEI-Code):

54930001XQA7MBCRCC47

### Benchmark

FTSE 3-Month Australia Dollar Eurodeposit

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

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

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

### Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja		Nein	
<input type="checkbox"/>	Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel</b> getätigt: _ %	<input checked="" type="checkbox"/>	Es wurden damit <b>ökologische/soziale Merkmale beworben</b> und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es <b>24.03%</b> an nachhaltigen Investitionen
<input type="checkbox"/>	in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	<input type="checkbox"/>	mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
<input type="checkbox"/>	in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	<input checked="" type="checkbox"/>	mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
<input type="checkbox"/>	Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel</b> getätigt: _ %	<input checked="" type="checkbox"/>	mit einem sozialen Ziel
<input type="checkbox"/>		<input type="checkbox"/>	Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber <b>keine nachhaltigen Investitionen getätigt</b> .



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

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

1. Ausschlusskriterien
2. ESG-Integration
3. Reduktion der CO<sub>2</sub>e-Intensität

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

### Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

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

### ...und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

## Ausschlusskriterien

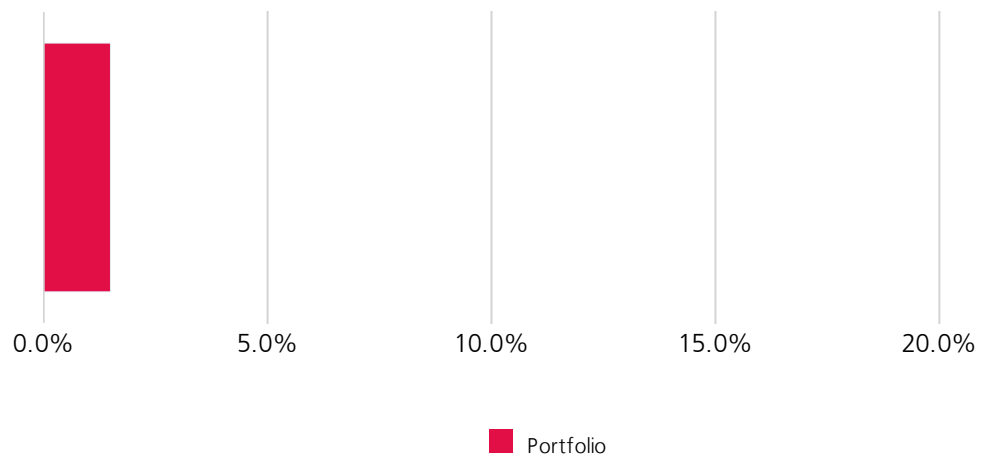
Responsible		Kriterien	Gewicht Portfolio	Kriterien	Gewicht Portfolio	
	Förderung von Kohle (> 5% Umsatz)		0.00%		Ausbeuterische Kinderarbeit	0.00%
	Kohlereserven (ex. Metalproduktion)		0.00%		Herstellung von Kriegstechnik (> 5% Umsatz)	0.00%
	Klimawandel		Gefährdung von Gesellschaft und Gesundheit		Herstellung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

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

Indikator	Berichtsjahr 2023	Berichtsjahr 2024
Portfolio Ausschlusskriterien Total*	0%	0%

\*alle Ausschlusskriterien kumuliert.

# ESG-Integration

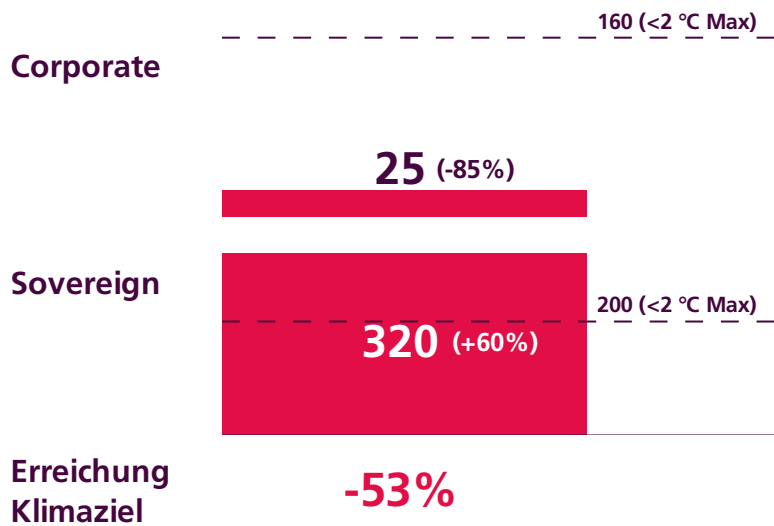


Das Portfolio strebte in der Berichtsperiode eine Allokation zu ESG-Laggards  $\leq 20\%$  an. ESG Laggards sind Unternehmungen mit der schwächsten Umwelt-, Sozial- und Governance- Performance des relevanten Anlageuniversums.

Die historischen Vergleiche werden in nachfolgender Tabelle gemacht.

	Indikator	Berichtsjahr 2023	Berichtsjahr 2024
Portfolio	Exposition zu ESG Laggards	2.47%	1.49%

# Reduktion der CO<sub>2</sub>e-Intensität



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

	Indikator	Berichtsjahr 2023	Berichtsjahr 2024
Portfolio	CO <sub>2</sub> e-Intensität Corporate	20	25
	CO <sub>2</sub> e-Intensität Sovereign	267	320
	Erreichung Klimaziel	-66%	-53%
	Reduktion Corporate	-89%	-85%
	Reduktion Sovereign	23%	60%

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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



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

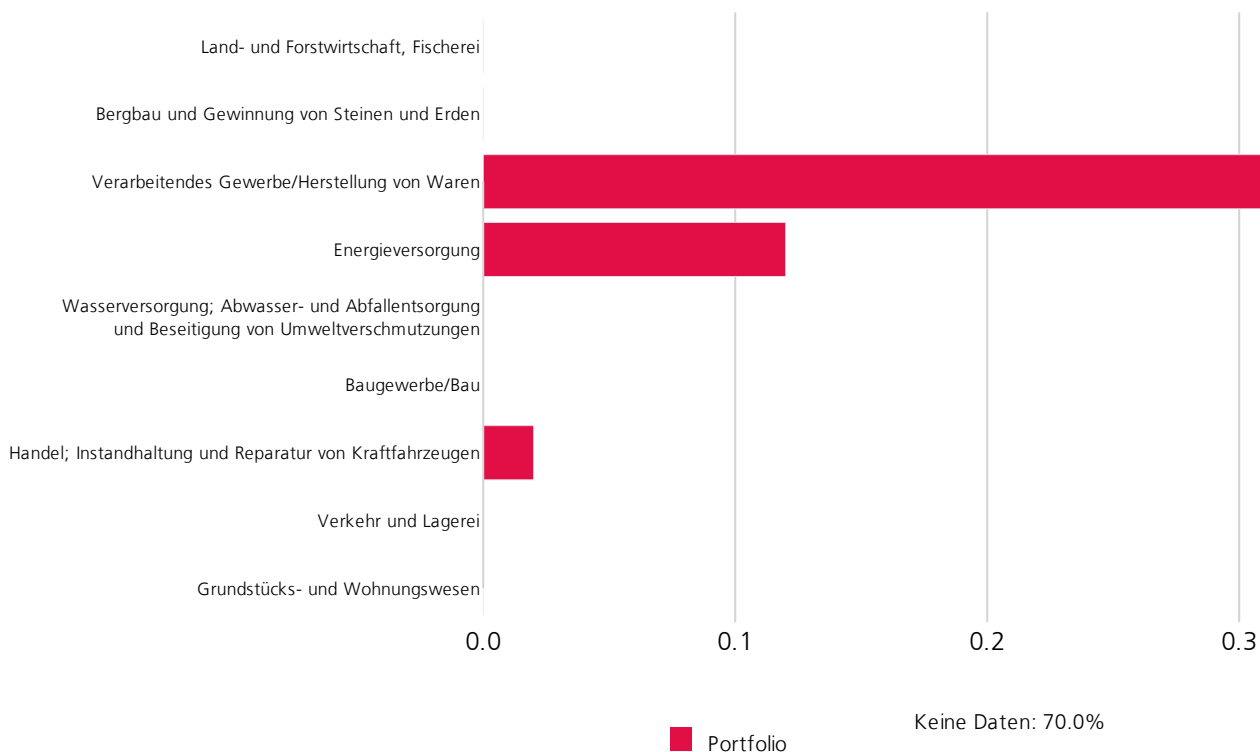
### Nachteilige Nachhaltigkeitsauswirkungen (PAI) – Corporate Anlagen

Primäre Indikatoren - Energie und Emissionen

Indikator	Faktor	Portfolio Aktuell	Abdeckung	Portfolio Vorjahr	Erklärung
1. THG-Emissionen	1a. GHG Emissions - Scope 1 per Mio EUR Enterprise Value	218.83	45.96%	12.82	
	1b. GHG Emissions - Scope 2 per Mio EUR Enterprise Value	174.31	45.96%	8.01	
	1c. GHG Emissions - Scope 3 per Mio EUR Enterprise Value	4640.7	45.96%	641.79	
2. CO <sub>2</sub> -Fussabdruck	2. GHG Emissions - Scope 1+2+3 per Mio EUR Enterprise Value	109.48	45.96%	12.47	
3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird	3. GHG Emissions - Emissions Intensity - Total Emissions (EUR)	29.18	50.48%	5.79	
4. Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind	4. Fossil Fuel - Involvement (PAI)	0.84%	43.85%	0.09%	

Indikator	Faktor	Portfolio Aktuell	Abdeckung	Portfolio Vorjahr	Erklärung
5. Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen	5a. CR Raw - Energy use - Coal/nuclear/unclear energy sources	61.13%	5.08%	34.32%	
	5b. Non-renewable energy consumption	45.23%	12.64%	43.97%	Der Verbrauch nicht-erneuerbarer Energie umfasst den Verbrauch von Energie, die aus nicht-erneuerbaren Quellen erzeugt wird, sowie den Verbrauch von Energie aus Biomasse. Alle Zahlen zum Energieverbrauch, bei denen die Energiequelle unklar ist, sind ebenfalls in diesem Faktor enthalten.
	5c. Non-renewable energy production	0.1%	42.75%	0.07%	
6. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren	6. Energy consumption intensity (GWh/mEUR)	0.1	21.02%	0.01	

Intensität des Energieverbrauchs pro High Impact Sector (pro Mio. EUR) (PAI 6 siehe oben)



Indikator	Faktor	Portfolio Aktuell	Abdeckung	Portfolio Vorjahr	Erklärung
7. Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken	7. Companies negatively affecting biodiversity-sensitive areas	0%	42.43%	0%	
8. Emissionen in Wasser	8. CR Raw - COD emissions	0	0%	3.49	
9. Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle	9. CR Raw - Hazardous waste	0	0.27%	0	

Indikator	Faktor	Portfolio Aktuell	Abdeckung	Portfolio Vorjahr	Erklärung
10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen	10. UNGC / OECD Guidelines Violation	0%	42.43%	0%	
11. Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen	11. Lack of processes monitoring UNGC and OECD Guidelines compliance	6.05%	31.68%	0.9%	
12. Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle	12. Unadjusted gender pay gap	1.1%	5.27%	0.02%	
13. Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen	13. Ratio of female to male board members	63.78%	23.06%	38.85%	
14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)	14. Controversial weapons involvement (APM, CM, Bio, Chem)	0%	44.83%	0%	

## Nachteilige Nachhaltigkeitsauswirkungen (PAI) – Staatliche und Supranationale Vermögenswerte

Primäre Indikatoren

Umwelt					
Indikator	Faktor	Portfolio Aktuell	Abdeckung	Portfolio Vorjahr	Erklärung
15. GHG Intensität	15. GHG Intensity	395.65	19.57%	241.68	

Sozial					
Indikator	Faktor	Portfolio Aktuell	Abdeckung	Portfolio Vorjahr	Erklärung
16. Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen	16a. Countries subject to social violations (#)	1	0.09%	0.75	
	16b. Countries subject to social violations (%)	4.51%	0.09%	3.89%	

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

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





## Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 01.04.2023 - 31.03.2024

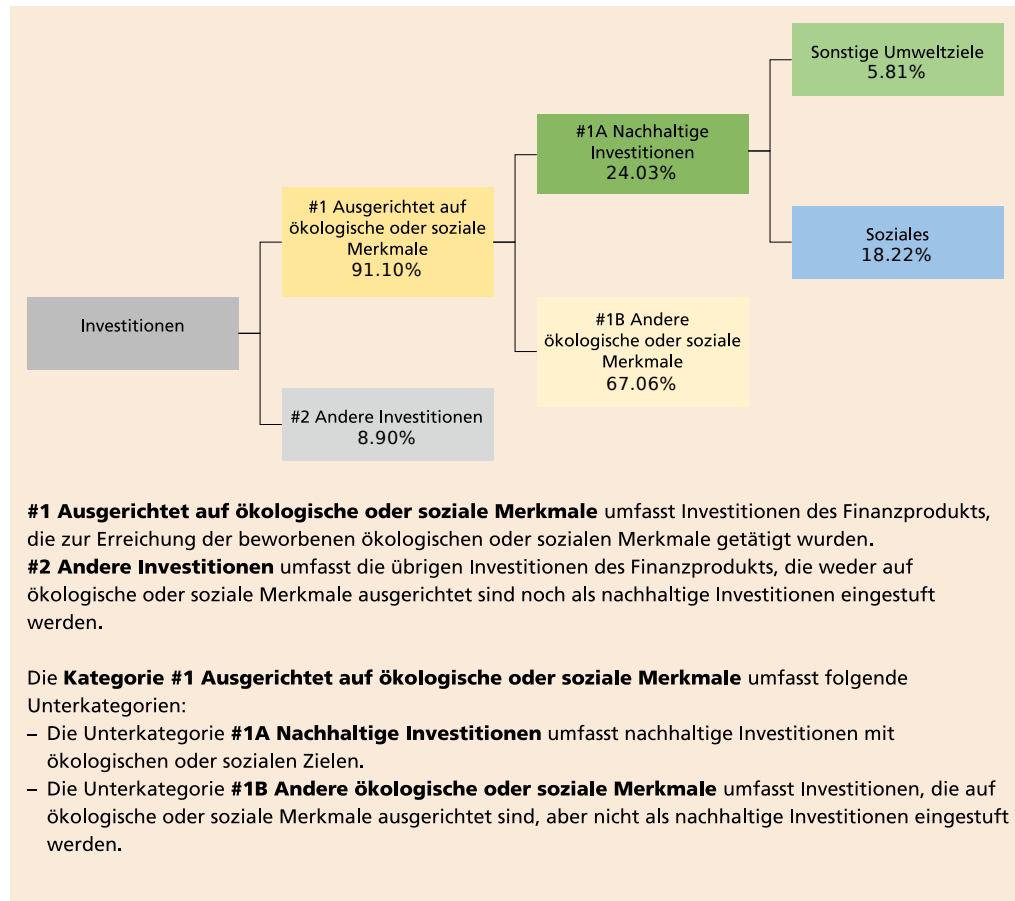
Grösste Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
Swisscanto (LU) Money Market Fund Responsible CHF GT Klasse		3.91%	
Swisscanto (LU) Money Market Fund Responsible USD NT Klasse		3.89%	
Coca-Cola Co/The 3.25% 11-JUN-2024 REGS	Manufacturing	3.47%	USA
Mizuho Bank Ltd/Sydney 1.7% 07-AUG-2024	Financial and Insurance Activities	3.10%	Japan
Cooperatieve Rabobank U.A. (Australia Branch) 5.5% 11-APR-2024 REGS	Financial and Insurance Activities	3.06%	USA
Toronto-Dominion Bank/The 2.05% 10-JUL-2024 REGS	Financial and Insurance Activities	2.99%	Canada
Fonterra Co-operative Group Limited 5.5% 26-FEB-2024	Manufacturing	2.85%	
BNG Bank N.V. 5.25% 20-MAY-2024	Financial and Insurance Activities	2.69%	
African Development Bank 4.75% 06-MAR-2024	Financial and Insurance Activities	2.67%	
Mitsubishi UFJ Financial Group Inc 2.0777% 01-OCT-2024 REGS	Financial and Insurance Activities	2.54%	Japan
Mercedes-Benz Australia/Pacific Pty Ltd 0.75% 22-JAN-2024 REGS	Wholesale and Retail Trade	2.36%	USA
Toyota Finance Australia Ltd 0.85% 09-SEP-2024	Financial and Insurance Activities	2.32%	Japan
John Deere Financial Ltd 1.75% 04-OCT-2024	Financial and Insurance Activities	2.23%	Australia
National Australia Bank Limited 5.155% 11-MAR-2024 REGS	Financial and Insurance Activities	2.11%	Australia
Banco Santander SA FRN 26-SEP-2024 REGS	Financial and Insurance Activities	2.09%	Spain



## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

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

### Wie sah die Vermögensallokation aus?



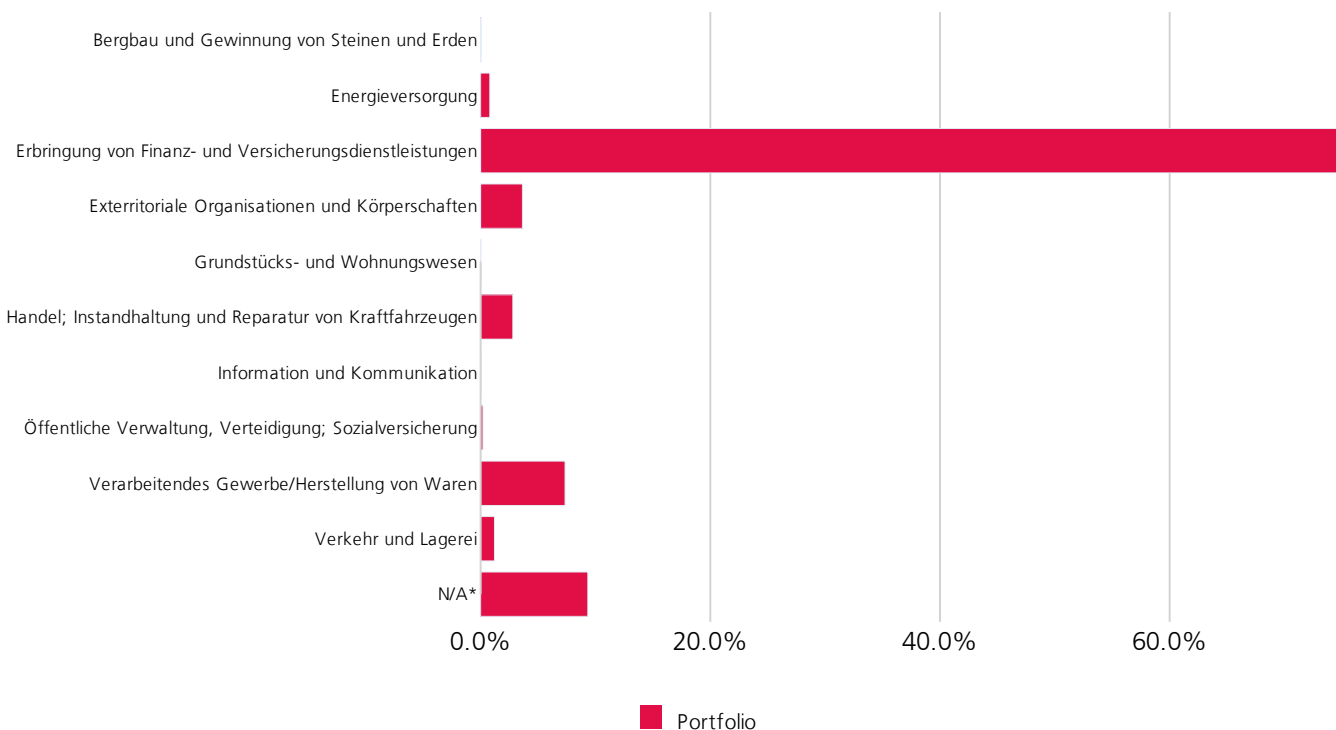
**#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.  
**#2 Andere Investitionen** umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder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

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

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

### In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Wegen mangelnder Datenverfügbarkeit können Subsektoren nicht angezeigt werden.



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



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

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

**Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?**

Ja

In fossiles Gas

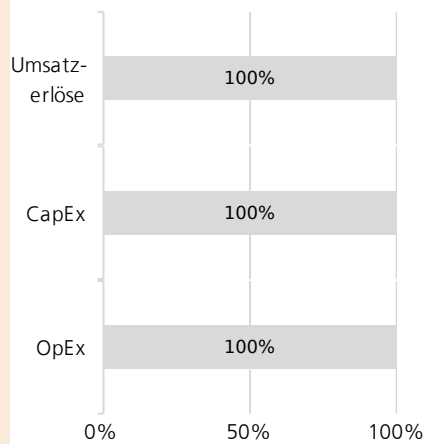
In Kernenergie

Nein

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

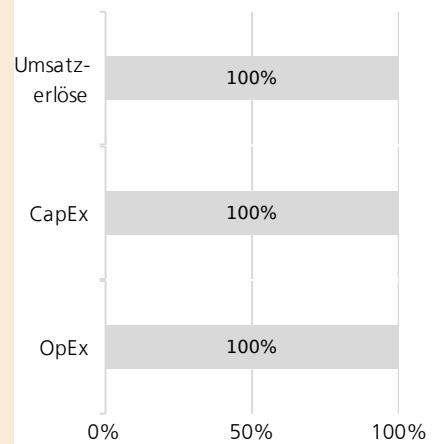
**Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzproduktes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

1. Taxonomiekonformität der Investitionen einschliesslich Staatsanleihen\*



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

2. Taxonomiekonformität der Investitionen ohne Staatsanleihen\*



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

Diese Grafik gibt **78.4%** der Gesamtinvestitionen wieder.

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

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

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

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

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

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

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

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

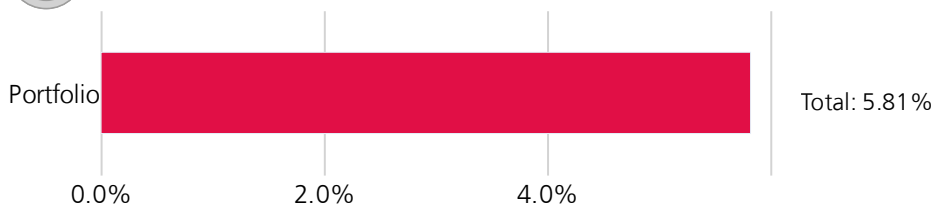
Issuer Name	Nace Sektor	Total Eligible Activity Revenue	Total Aligned Revenue	Total Likely Aligned Revenue	Total Potentially Aligned Revenue	Portfolio Gewicht (Consol.)
BMW International Investment BV	Financial and Insurance Activities	22.83%	2.75%	0.00%	0.00%	0.03%
ABB Ltd.	Manufacturing	9.25%	2.50%	0.00%	0.00%	0.02%
TotalEnergies Capital International SA	Financial and Insurance Activities	4.09%	0.33%	0.00%	1.16%	0.03%
Total Capital International SA	Mining and Quarrying	1.88%	0.33%	0.00%	0.00%	0.04%
PSP Swiss Property AG	Real Estate Activities	75.00%	0.00%	15.00%	0.00%	0.04%
Deutsche Bahn Finance GmbH	Financial and Insurance Activities	18.02%	0.00%	3.60%	0.00%	4.42%
Toyota Finance Australia Limited	Financial and Insurance Activities	59.53%	0.00%	0.08%	0.63%	1.38%
BKW AG	Electricity, Gas, Steam and Air Conditioning Supply	38.36%	0.00%	0.00%	3.56%	0.02%
Korea Hydro & Nuclear Power Co., Ltd.	Electricity, Gas, Steam and Air Conditioning Supply	14.50%	0.00%	0.00%	0.19%	0.01%

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


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

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

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




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

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



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

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

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



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

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

Swisscanto | Proxy Voting Dashboard (issgovernance.com)

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



## Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

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

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

### Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?

Nicht anwendbar.

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

Nicht anwendbar.

### Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?

Nicht anwendbar.

### Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?

Nicht anwendbar.

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



## Regelmässige Information zum 31.03.2024

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

### Name des Produkts:

Swisscanto (LU) Money Market Fund Responsible CHF

### Unternehmenskennung (LEI-Code):

549300RM31NUOY25RP72

### Benchmark

FTSE 3-Month Swiss Franc Eurodeposit

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

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

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

### Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja		Nein	
<input type="checkbox"/>	Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel</b> getätigt: _ %	<input checked="" type="checkbox"/>	Es wurden damit <b>ökologische/soziale Merkmale beworben</b> und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es <b>26.42%</b> an nachhaltigen Investitionen
<input type="checkbox"/>	in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	<input type="checkbox"/>	mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
<input type="checkbox"/>	in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	<input checked="" type="checkbox"/>	mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
<input type="checkbox"/>	Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel</b> getätigt: _ %	<input checked="" type="checkbox"/>	mit einem sozialen Ziel
<input type="checkbox"/>		<input type="checkbox"/>	Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber <b>keine nachhaltigen Investitionen getätigt</b> .



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

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

1. Ausschlusskriterien
2. ESG-Integration
3. Reduktion der CO<sub>2</sub>e-Intensität

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

### Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

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

### ...und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

## Ausschlusskriterien

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

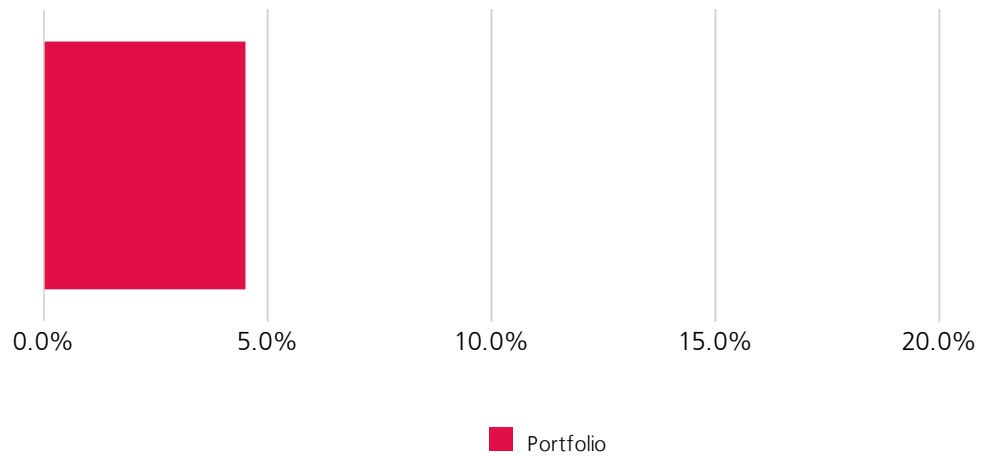
Zwecks Minderung der Nachhaltigkeitsrisiken und mit dem Ziel, nicht in Wertpapiere der oben aufgeführten kontroversen Geschäftsmodellen zu investieren, sind die oben genannten Ausschlusskriterien angewendet worden. Die Tabelle zeigt die jeweilige Portfolio-Exposition. Liegen bei einem Unternehmen mehrere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

Indikator	Berichtsjahr 2023	Berichtsjahr 2024
Portfolio Ausschlusskriterien Total*	0%	0%

\*alle Ausschlusskriterien kumuliert.



# ESG-Integration

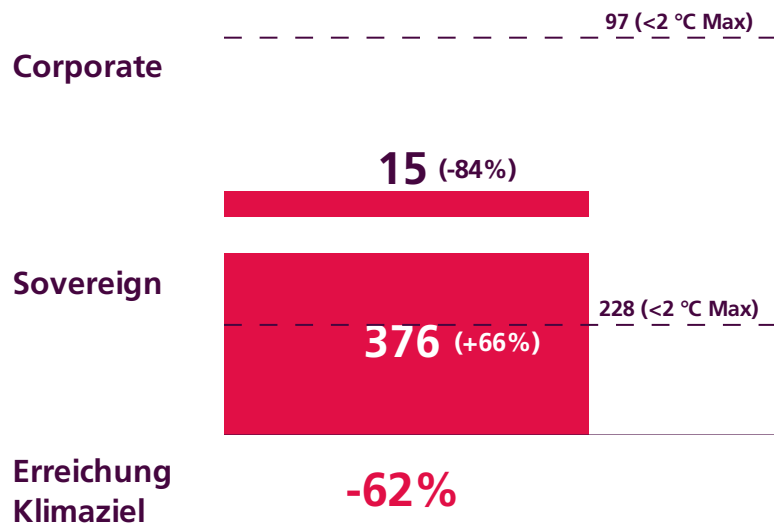


Das Portfolio strebte in der Berichtsperiode eine Allokation zu ESG-Laggards  $\leq 20\%$  an. ESG Laggards sind Unternehmungen mit der schwächsten Umwelt-, Sozial- und Governance- Performance des relevanten Anlageuniversums.

Die historischen Vergleiche werden in nachfolgender Tabelle gemacht.

	Indikator	Berichtsjahr 2023	Berichtsjahr 2024
Portfolio	Exposition zu ESG Laggards	4.52%	4.52%

# Reduktion der CO<sub>2</sub>e-Intensität



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

	Indikator	Berichtsjahr 2023	Berichtsjahr 2024
Portfolio	CO <sub>2</sub> e-Intensität Corporate	10	15
	CO <sub>2</sub> e-Intensität Sovereign	339	376
	Erreichung Klimaziel	-71%	-62%
	Reduktion Corporate	-90%	-84%
	Reduktion Sovereign	36%	66%

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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



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

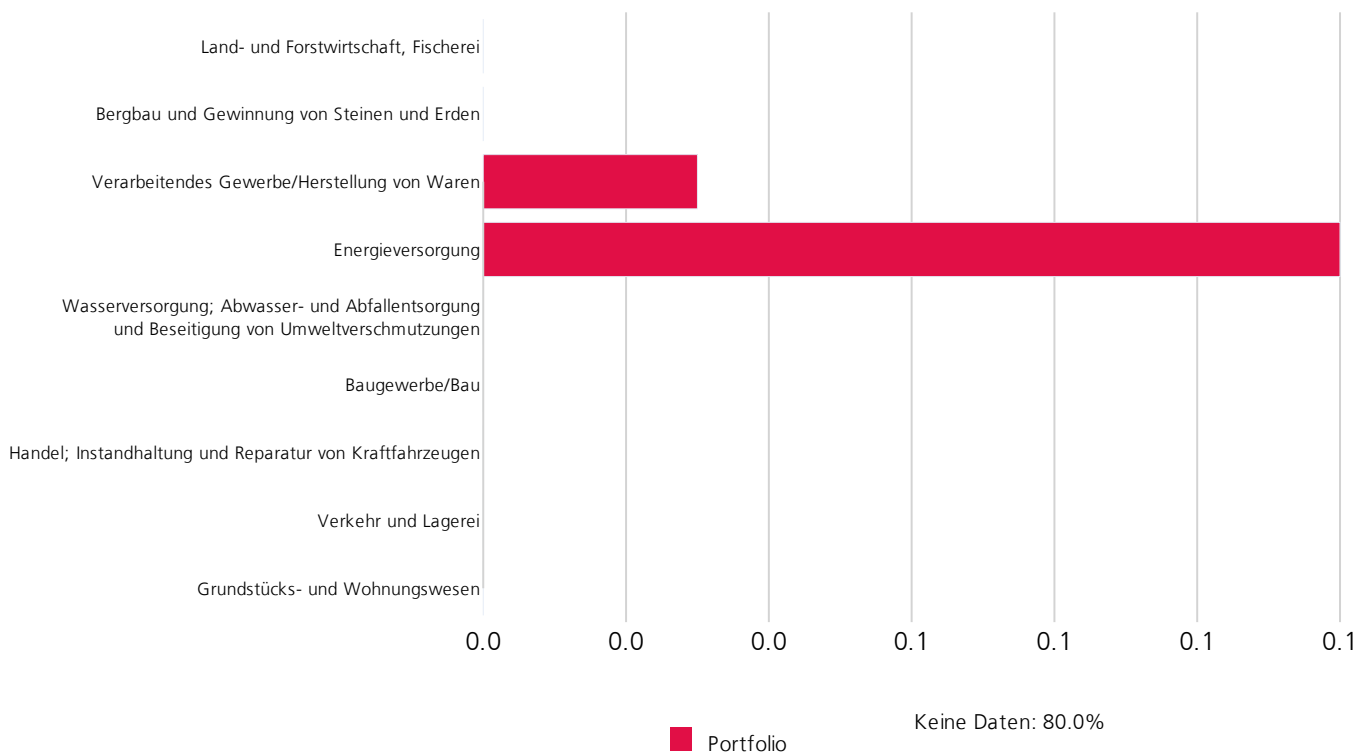
### Nachteilige Nachhaltigkeitsauswirkungen (PAI) – Corporate Anlagen

Primäre Indikatoren - Energie und Emissionen

Indikator	Faktor	Portfolio Aktuell	Abdeckung	Portfolio Vorjahr	Erklärung
1. THG-Emissionen	1a. GHG Emissions - Scope 1 per Mio EUR Enterprise Value	5093.22	40.66%	159.34	
	1b. GHG Emissions - Scope 2 per Mio EUR Enterprise Value	1280.82	40.66%	176.94	
	1c. GHG Emissions - Scope 3 per Mio EUR Enterprise Value	53592.4	40.66%	9270.12	
2. CO <sub>2</sub> -Fussabdruck	2. GHG Emissions - Scope 1+2+3 per Mio EUR Enterprise Value	133.65	40.66%	33.88	
3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird	3. GHG Emissions - Emissions Intensity - Total Emissions (EUR)	49.44	43.84%	9.09	
4. Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind	4. Fossil Fuel - Involvement (PAI)	3.65%	45.21%	0.29%	

Indikator	Faktor	Portfolio Aktuell	Abdeckung	Portfolio Vorjahr	Erklärung
5. Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen	5a. CR Raw - Energy use - Coal/nuclear/unclear energy sources	89.04%	1.74%	46.98%	
	5b. Non-renewable energy consumption	50.28%	5.97%	70.07%	Der Verbrauch nicht-erneuerbarer Energie umfasst den Verbrauch von Energie, die aus nicht-erneuerbaren Quellen erzeugt wird, sowie den Verbrauch von Energie aus Biomasse. Alle Zahlen zum Energieverbrauch, bei denen die Energiequelle unklar ist, sind ebenfalls in diesem Faktor enthalten.
	5c. Non-renewable energy production	2.32%	45.21%	0%	
6. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren	6. Energy consumption intensity (GWh/mEUR)	0.03	15.11%	0.06	

Intensität des Energieverbrauchs pro High Impact Sector (pro Mio. EUR) (PAI 6 siehe oben)



Indikator	Faktor	Portfolio Aktuell	Abdeckung	Portfolio Vorjahr	Erklärung
7. Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken	7. Companies negatively affecting biodiversity-sensitive areas	0%	45.06%	0%	
8. Emissionen in Wasser	8. CR Raw - COD emissions	0	0%	85.59	
9. Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle	9. CR Raw - Hazardous waste	0	2.98%	0	

Indikator	Faktor	Portfolio Aktuell	Abdeckung	Portfolio Vorjahr	Erklärung
10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen	10. UNGC / OECD Guidelines Violation	0%	45.06%	0%	
11. Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen	11. Lack of processes monitoring UNGC and OECD Guidelines compliance	7.9%	30.1%	1.76%	
12. Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle	12. Unadjusted gender pay gap	0.45%	3.84%	0.45%	
13. Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen	13. Ratio of female to male board members	66.87%	16.11%	49.15%	
14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)	14. Controversial weapons involvement (APM, CM, Bio, Chem)	0%	45.59%	0%	

## Nachteilige Nachhaltigkeitsauswirkungen (PAI) – Staatliche und Supranationale Vermögenswerte

Primäre Indikatoren

Umwelt					
Indikator	Faktor	Portfolio Aktuell	Abdeckung	Portfolio Vorjahr	Erklärung
15. GHG Intensität	15. GHG Intensity	464.19	12.78%	335.08	

Sozial					
Indikator	Faktor	Portfolio Aktuell	Abdeckung	Portfolio Vorjahr	Erklärung
16. Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen	16a. Countries subject to social violations (#)	0	0.15%	0	
	16b. Countries subject to social violations (%)	0%	0.15%	0%	

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

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



## Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 01.04.2023 - 31.03.2024

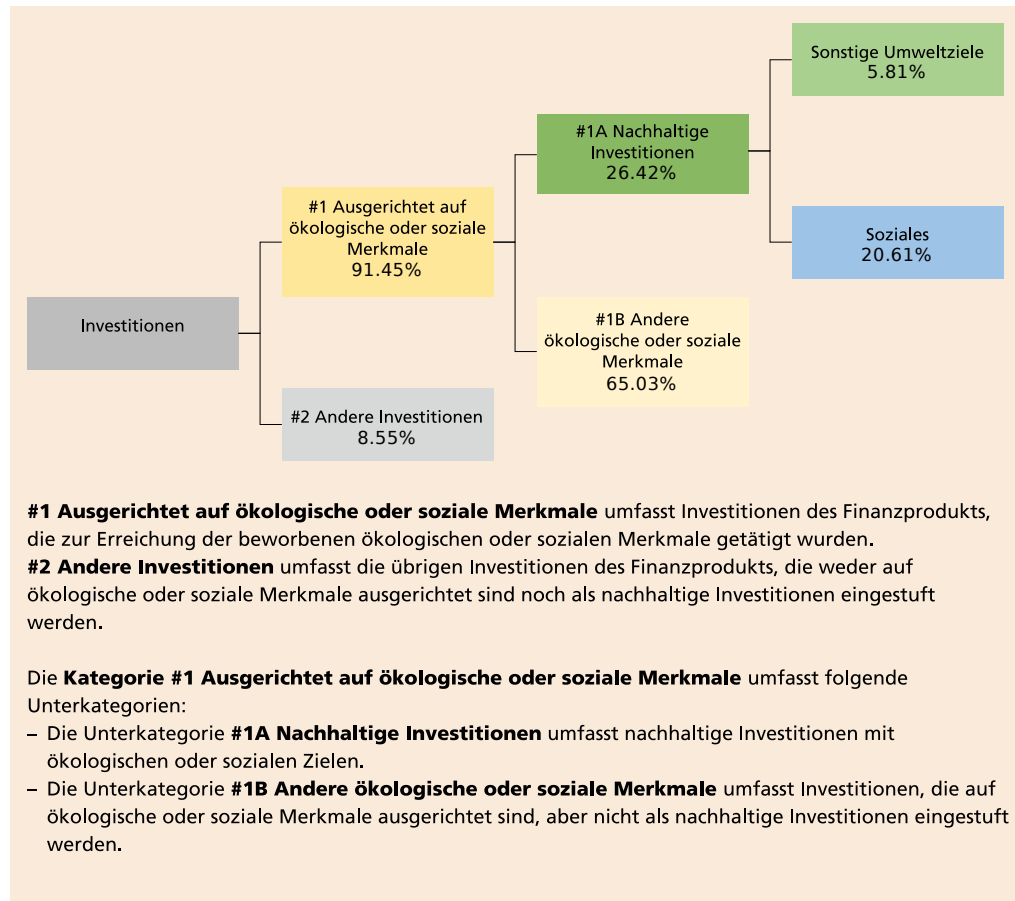
Grösste Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
Lombard Odier Funds SICAV - Short-Term Money Market (CHF) I Capitalisation		4.18%	
Pictet SICAV - Pictet - Short-Term Money Market CHF Capitalisation I		4.18%	
BNG Bank N.V. 0.0% 05-OCT-2023	Financial and Insurance Activities	2.37%	
Westpac Banking Corp 0.4% 06-JUN-2024 REGS	Financial and Insurance Activities	2.37%	USA
Credit Agricole Home Loan SFH SA 1.125% 05-JUN-2024 REGS	Financial and Insurance Activities	1.95%	France
UBS AG London Branch 2.05% 28-APR-2024	Financial and Insurance Activities	1.77%	Jersey
Roche Kapitalmarkt AG 0.1% 23-SEP-2024 REGS	Financial and Insurance Activities	1.71%	Switzerland
La Caisse de Refinancement de l'Habitat SA 2.375% 05-MAR-2024 REGS	Financial and Insurance Activities	1.64%	
Westpac Securities NZ Ltd. (London Branch) 0.375% 05-FEB-2024 REGS	Financial and Insurance Activities	1.64%	New Zealand
Deutsche Bahn Finance GmbH 1.5% 21-FEB-2024	Financial and Insurance Activities	1.60%	Germany
Pfandbriefbank schweizerischer Hypothekarinstitute AG 0% 29-JUL-2024 REGS	Financial and Insurance Activities	1.59%	Switzerland
Pfandbriefzentrale der schweizerischen Kantonalbanken AG 0.125% 12-MAR-2024 REGS	Financial and Insurance Activities	1.58%	Switzerland
Auckland Council 1.125% 07-FEB-2024 REGS	Financial and Insurance Activities	1.57%	
TotalEnergies Capital International SA 1% 29-AUG-2024 REGS	Financial and Insurance Activities	1.56%	France
ASB Bank Ltd 0.2% 02-AUG-2024 REGS	Financial and Insurance Activities	1.55%	Australia



## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

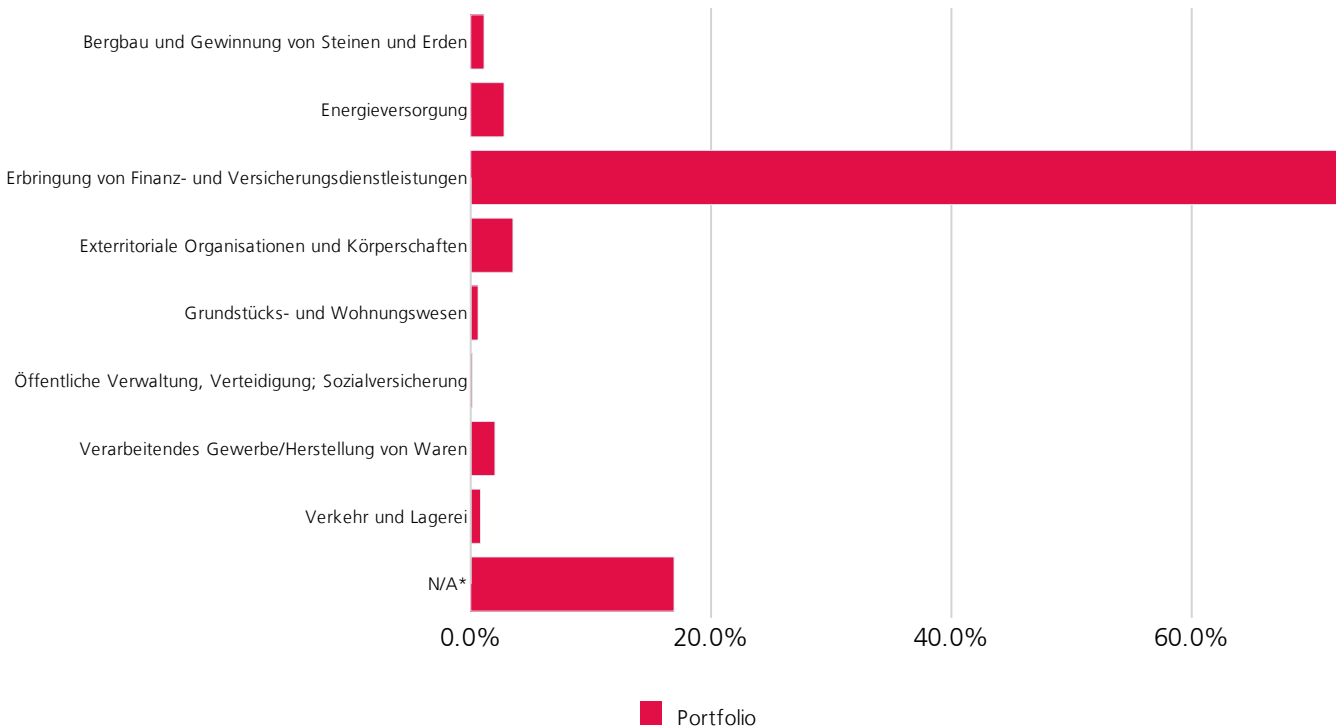
Der Anteil an nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen und Angaben zur Vermögensallokation werden in untenstehender Frage beantwortet.

### Wie sah die Vermögensallokation aus?



### In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Wegen mangelnder Datenverfügbarkeit können Subsektoren nicht angezeigt werden.



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





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

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

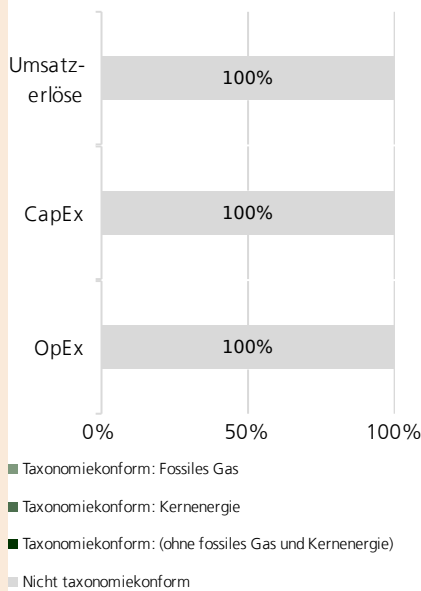
**Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?**

- Ja
- In fossiles Gas  In Kernenergie
- Nein

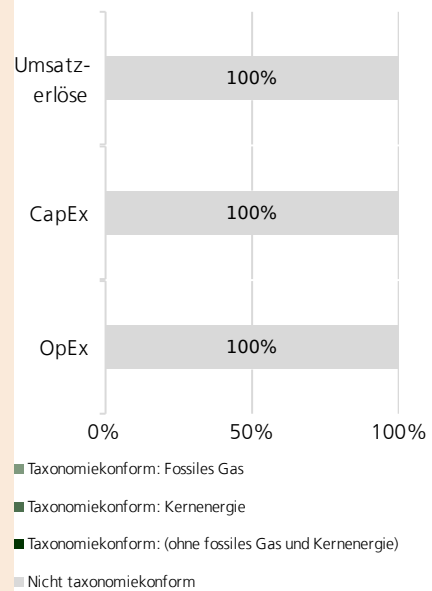
<sup>1</sup>Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels ("Klimaschutz") beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme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

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

1. Taxonomiekonformität der Investitionen einschliesslich Staatsanleihen\*



2. Taxonomiekonformität der Investitionen ohne Staatsanleihen\*



Diese Grafik gibt **84.5%** der Gesamtinvestitionen wieder.

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

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

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

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

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

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

- **Betriebsausgaben** (Opex), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

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

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

Issuer Name	Nace Sektor	Total Eligible Activity Revenue	Total Aligned Revenue	Total Likely Aligned Revenue	Total Potentially Aligned Revenue	Portfolio Gewicht (Consol.)
BMW International Investment BV	Financial and Insurance Activities	22.83%	2.75%	0.00%	0.00%	0.76%
ABB Ltd.	Manufacturing	9.25%	2.50%	0.00%	0.00%	0.46%
TotalEnergies Capital International SA	Financial and Insurance Activities	4.09%	0.33%	0.00%	1.16%	0.71%
Total Capital International SA	Mining and Quarrying	1.88%	0.33%	0.00%	0.00%	1.07%
PSP Swiss Property AG	Real Estate Activities	75.00%	0.00%	15.00%	0.00%	0.81%
Deutsche Bahn Finance GmbH	Financial and Insurance Activities	18.02%	0.00%	3.60%	0.00%	2.65%
BKW AG	Electricity, Gas, Steam and Air Conditioning Supply	38.36%	0.00%	0.00%	3.56%	0.58%
Korea Hydro & Nuclear Power Co., Ltd.	Electricity, Gas, Steam and Air Conditioning Supply	14.50%	0.00%	0.00%	0.19%	0.32%

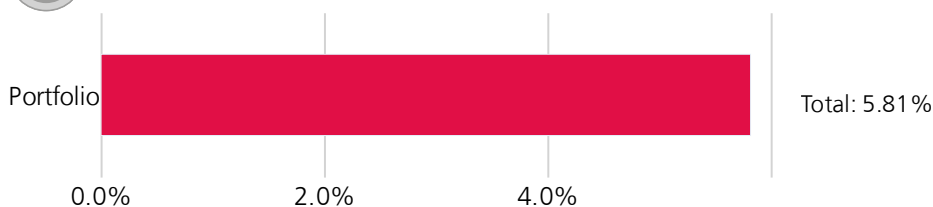
**Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

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

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



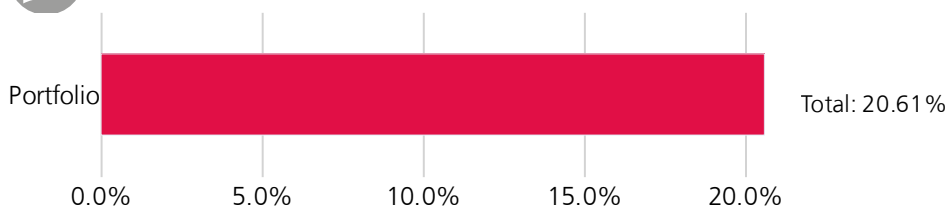
### Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?



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



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



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



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

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



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

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

Swisscanto | Proxy Voting Dashboard (issgovernance.com)

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



## Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

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

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

### ● **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

Nicht anwendbar.

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

Nicht anwendbar.

### ● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**

Nicht anwendbar.

### ● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

Nicht anwendbar.

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



## Regelmässige Information zum 31.03.2024

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

### Name des Produkts:

Swisscanto (LU) Money Market Fund Responsible EUR

### Unternehmenskennung (LEI-Code):

549300Z6J1IGN9YFQ768

### Benchmark

FTSE 3-Month Euro Eurodeposit

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

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

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

### Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

<input checked="" type="radio"/> <input checked="" type="radio"/> <input type="checkbox"/> Ja		<input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> <input checked="" type="checkbox"/> Nein	
<input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel</b> getätigt: _ %	<input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	<input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit <b>ökologische/soziale Merkmale beworben</b> und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es <b>16.41%</b> an nachhaltigen Investitionen	<input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
<input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	<input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel</b> getätigt: _ %	<input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	<input checked="" type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel
<input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel</b> getätigt: _ %		<input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber <b>keine nachhaltigen Investitionen getätigt</b> .	



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

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

1. Ausschlusskriterien
2. ESG-Integration
3. Reduktion der CO<sub>2</sub>e-Intensität

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

### Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

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

### ...und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

## Ausschlusskriterien

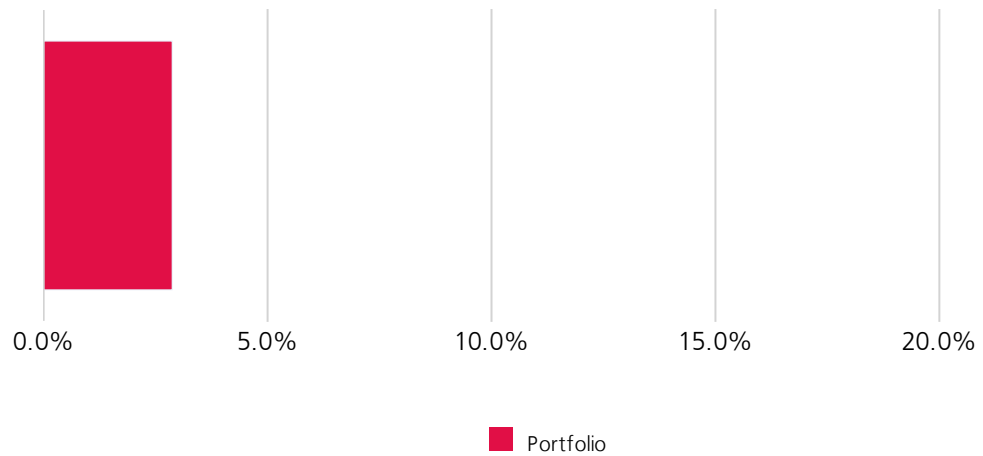
Responsible		Kriterien	Gewicht Portfolio	Kriterien	Gewicht Portfolio	
	Förderung von Kohle (> 5% Umsatz)		0.00%		Ausbeuterische Kinderarbeit	0.00%
	Kohlereserven (ex. Metalproduktion)		0.00%		Herstellung von Kriegstechnik (> 5% Umsatz)	0.00%
	Klimawandel		Gefährdung von Gesellschaft und Gesundheit		Herstellung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

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

Indikator	Berichtsjahr 2023	Berichtsjahr 2024
Portfolio Ausschlusskriterien Total*	0%	0%

\*alle Ausschlusskriterien kumuliert.

# ESG-Integration

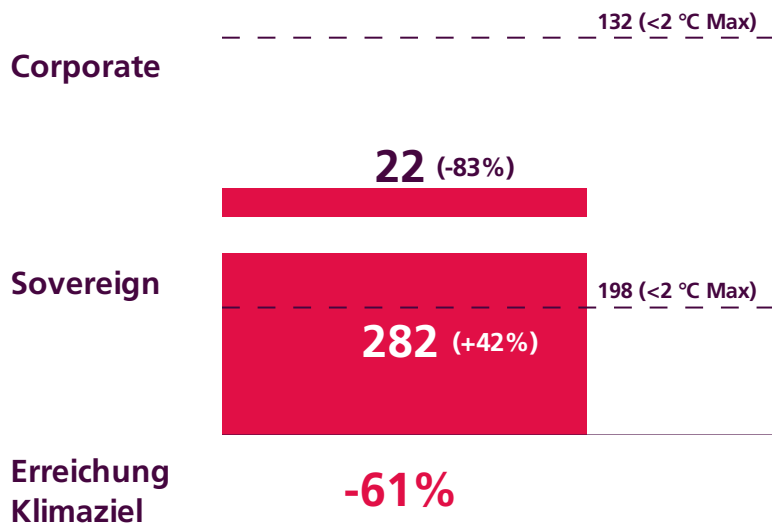


Das Portfolio strebte in der Berichtsperiode eine Allokation zu ESG-Laggards  $\leq 20\%$  an. ESG Laggards sind Unternehmungen mit der schwächsten Umwelt-, Sozial- und Governance- Performance des relevanten Anlageuniversums.

Die historischen Vergleiche werden in nachfolgender Tabelle gemacht.

	Indikator	Berichtsjahr 2023	Berichtsjahr 2024
Portfolio	Exposition zu ESG Laggards	4.91%	2.87%

# Reduktion der CO<sub>2</sub>e-Intensität



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

	Indikator	Berichtsjahr 2023	Berichtsjahr 2024
Portfolio	CO <sub>2</sub> e-Intensität Corporate	15	22
	CO <sub>2</sub> e-Intensität Sovereign	318	282
	Erreichung Klimaziel	-73%	-60%
	Reduktion Corporate	-89%	-83%
	Reduktion Sovereign	49%	42%



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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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



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

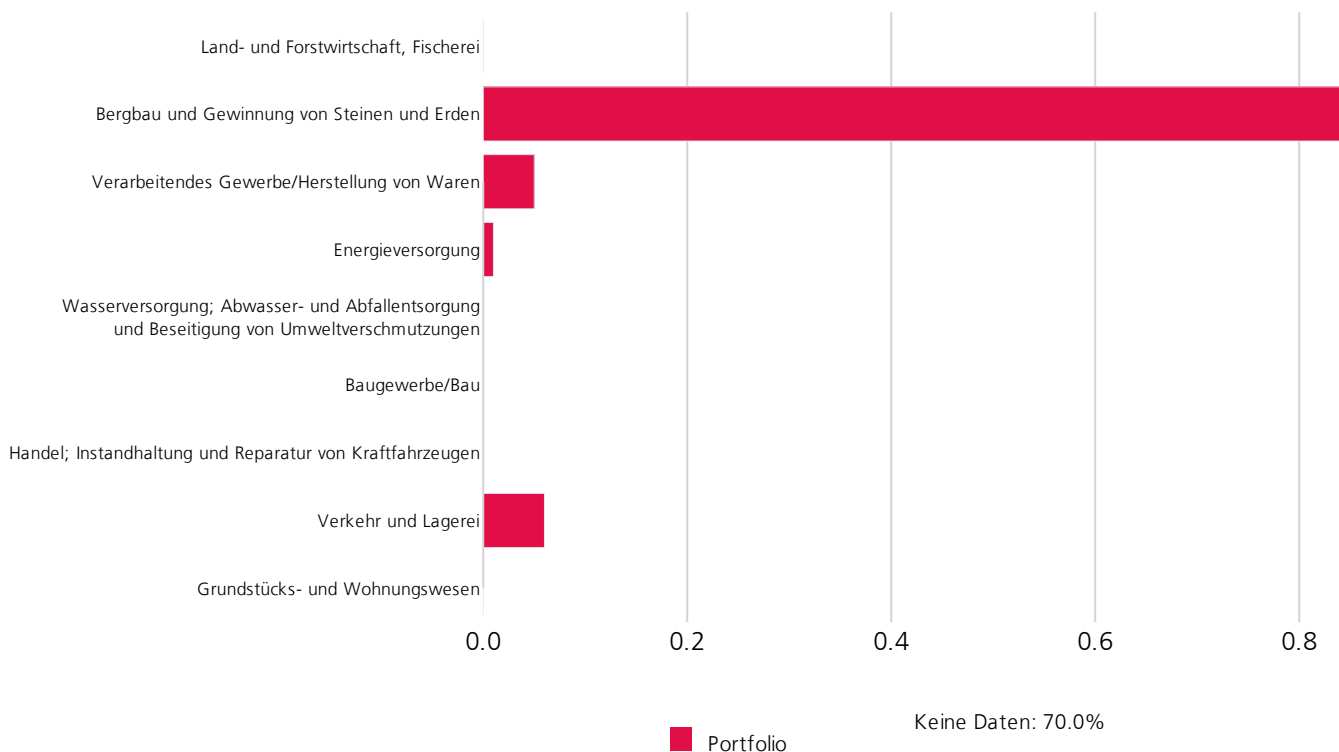
### Nachteilige Nachhaltigkeitsauswirkungen (PAI) – Corporate Anlagen

Primäre Indikatoren - Energie und Emissionen

Indikator	Faktor	Portfolio Aktuell	Abdeckung	Portfolio Vorjahr	Erklärung
1. THG-Emissionen	1a. GHG Emissions - Scope 1 per Mio EUR Enterprise Value	874.55	39.92%	304.89	
	1b. GHG Emissions - Scope 2 per Mio EUR Enterprise Value	135.45	39.92%	128.36	
	1c. GHG Emissions - Scope 3 per Mio EUR Enterprise Value	20869.3	39.92%	3448.73	
2. CO <sub>2</sub> -Fussabdruck	2. GHG Emissions - Scope 1+2+3 per Mio EUR Enterprise Value	150.24	39.92%	41.22	
3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird	3. GHG Emissions - Emissions Intensity - Total Emissions (EUR)	33.81	41.87%	14.73	
4. Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind	4. Fossil Fuel - Involvement (PAI)	2.05%	39.95%	0.81%	

Indikator	Faktor	Portfolio Aktuell	Abdeckung	Portfolio Vorjahr	Erklärung
5. Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen	5a. CR Raw - Energy use - Coal/nuclear/unclear energy sources	39.52%	3.85%	11.43%	
	5b. Non-renewable energy consumption	19.29%	12.14%	22.42%	Der Verbrauch nicht-erneuerbarer Energie umfasst den Verbrauch von Energie, die aus nicht-erneuerbaren Quellen erzeugt wird, sowie den Verbrauch von Energie aus Biomasse. Alle Zahlen zum Energieverbrauch, bei denen die Energiequelle unklar ist, sind ebenfalls in diesem Faktor enthalten.
	5c. Non-renewable energy production	0.07%	37.38%	0%	
6. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren	6. Energy consumption intensity (GWh/mEUR)	0.1	25.16%	0.01	

Intensität des Energieverbrauchs pro High Impact Sector (pro Mio. EUR) (PAI 6 siehe oben)



Indikator	Faktor	Portfolio Aktuell	Abdeckung	Portfolio Vorjahr	Erklärung
7. Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken	7. Companies negatively affecting biodiversity-sensitive areas	0%	39.95%	0%	
8. Emissionen in Wasser	8. CR Raw - COD emissions	0.49	0.02%	1.77	
9. Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle	9. CR Raw - Hazardous waste	0.01	5.74%	0	

Indikator	Faktor	Portfolio Aktuell	Abdeckung	Portfolio Vorjahr	Erklärung
10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen	10. UNGC / OECD Guidelines Violation	0%	39.95%	0%	
11. Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen	11. Lack of processes monitoring UNGC and OECD Guidelines compliance	3.21%	28.94%	1.04%	
12. Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle	12. Unadjusted gender pay gap	0.61%	4.23%	0.03%	
13. Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen	13. Ratio of female to male board members	61.14%	28.53%	48.05%	
14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)	14. Controversial weapons involvement (APM, CM, Bio, Chem)	0%	39.95%	0%	

## Nachteilige Nachhaltigkeitsauswirkungen (PAI) – Staatliche und Supranationale Vermögenswerte

Primäre Indikatoren

Umwelt					
Indikator	Faktor	Portfolio Aktuell	Abdeckung	Portfolio Vorjahr	Erklärung
15. GHG Intensität	15. GHG Intensity	347.33	16.52%	281.62	

Sozial					
Indikator	Faktor	Portfolio Aktuell	Abdeckung	Portfolio Vorjahr	Erklärung
16. Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen	16a. Countries subject to social violations (#)	0	0.9%	0	
	16b. Countries subject to social violations (%)	0%	0.9%	0%	

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

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



## Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 01.04.2023 - 31.03.2024

Grösste Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
Pictet SICAV - Pictet - Short-Term Money Market EUR Capitalisation I		4.18%	
Canadian Imperial Bank of Commerce 0.375% 03-MAY-2024 REGS	Financial and Insurance Activities	2.33%	Canada
Mitsubishi UFJ Financial Group Inc 0.978% 09-JUN-2024 REGS	Financial and Insurance Activities	2.30%	Japan
Westpac Securities NZ Ltd. (London Branch) 4.328% 17-JAN-2024 REGS	Financial and Insurance Activities	2.23%	New Zealand
Amundi Euro Liquidity Short Term SRI FCP Parts -IC-		2.19%	
Banque Federative du Credit Mutuel Societe anonyme 2.625% 18-MAR-2024 REGS	Financial and Insurance Activities	2.06%	France
ASB Finance Ltd. 0.75% 13-MAR-2024 REGS	Financial and Insurance Activities	2.02%	Australia
Exxon Mobil Corp 0.142% 26-JUN-2024	Mining and Quarrying	2.02%	USA
Lombard Odier Funds SICAV - Short-Term Money Market (EUR) I Capitalisation		2.02%	
La Corporacion Andina de Fomento SA 0.625% 30-JAN-2024 REGS	Activities of Extraterritorial Organisations and Bodies	1.99%	
OP Corporate Bank plc 0.125% 01-JUL-2024 REGS	Financial and Insurance Activities	1.92%	
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc. 0.465% 30-MAY-2024 REGS	Financial and Insurance Activities	1.88%	Japan
Volvo Treasury AB 0.125% 17-SEP-2024 REGS	Manufacturing	1.83%	Sweden
Metropolitan Life Global Funding I 0.375% 09-APR-2024 REGS	Financial and Insurance Activities	1.79%	USA
Credit Suisse AG, London Branch 2.125% 31-MAY-2024 REGS	Financial and Insurance Activities	1.74%	Switzerland

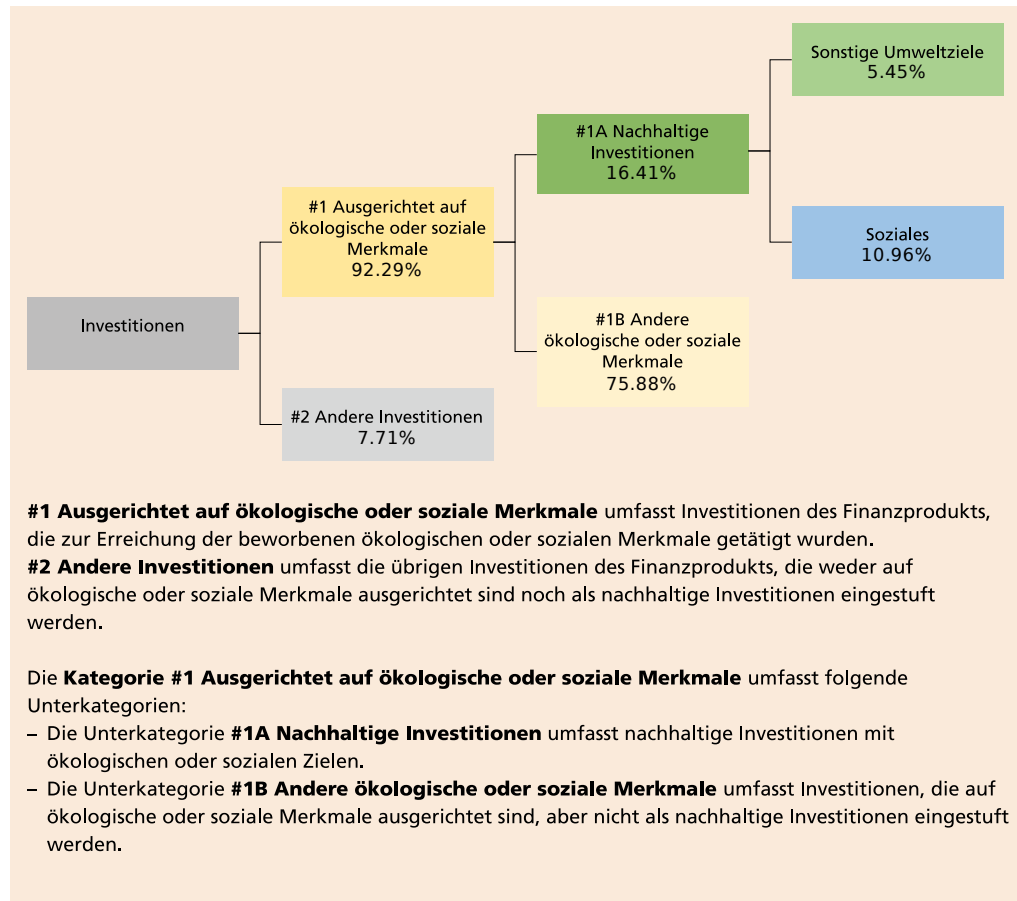


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

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

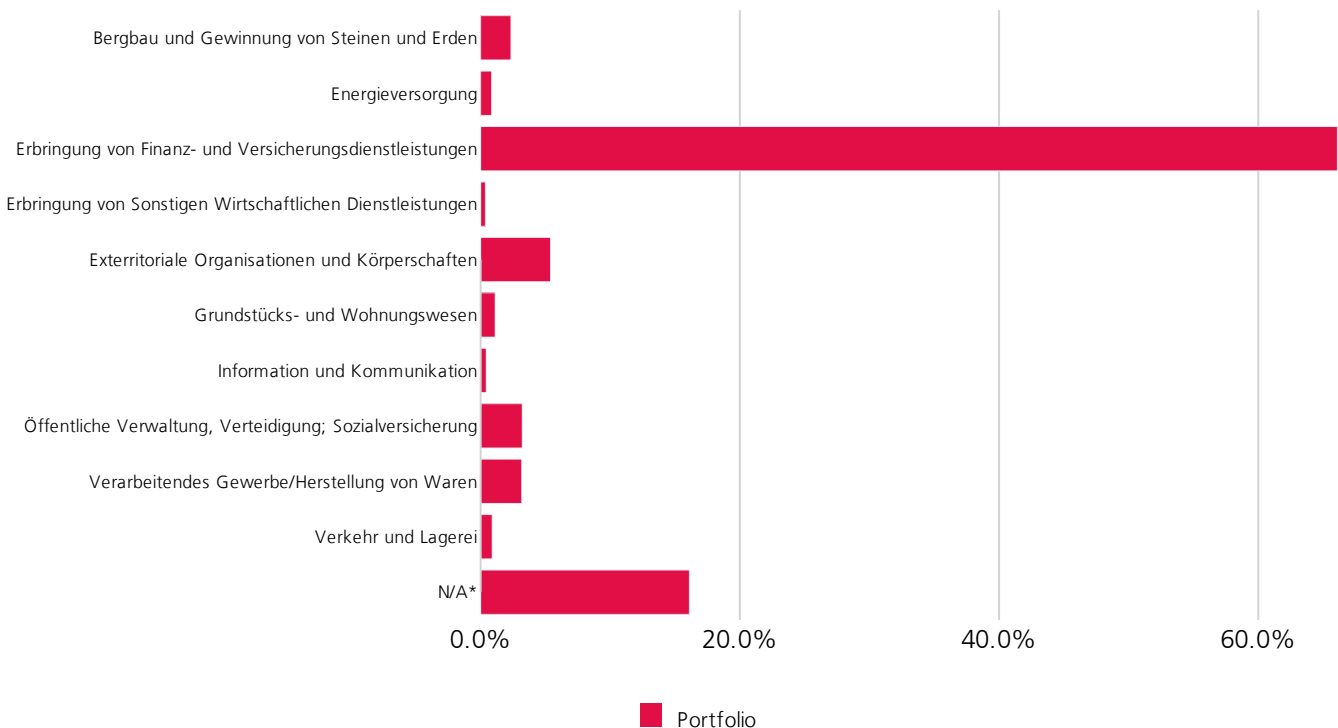
### Wie sah die Vermögensallokation aus?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.



### In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Wegen mangelnder Datenverfügbarkeit können Subsektoren nicht angezeigt werden.



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

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

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

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

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

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

- **Betriebsausgaben** (Opex), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln



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

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

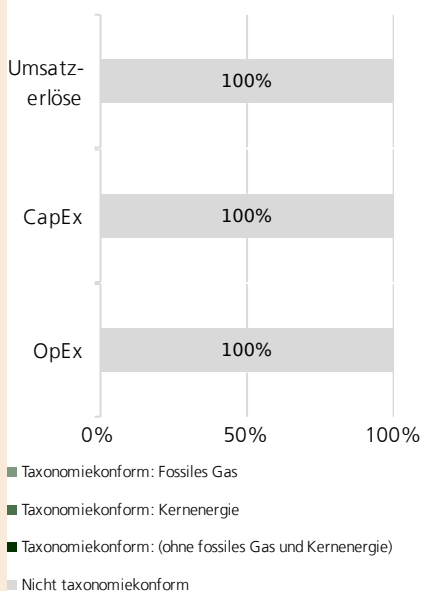
**Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?**

- Ja  
 In fossiles Gas  
 In Kernenergie  
 Nein

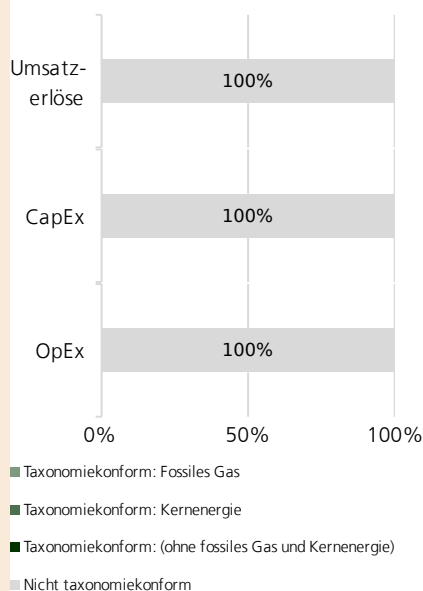
<sup>1</sup>Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels ("Klimaschutz") beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme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

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

1. Taxonomiekonformität der Investitionen einschliesslich Staatsanleihen\*



2. Taxonomiekonformität der Investitionen ohne Staatsanleihen\*



Diese Grafik gibt **80.3%** der Gesamtinvestitionen wieder.

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

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

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

Issuer Name	Nace Sektor	Total Eligible Activity Revenue	Total Aligned Revenue	Total Likely Aligned Revenue	Total Potentially Aligned Revenue	Portfolio Gewicht (Consol.)
Mercedes-Benz International Finance BV	Financial and Insurance Activities	87.02%	2.50%	0.63%	0.00%	0.04%
Total Capital International SA	Mining and Quarrying	1.88%	0.33%	0.00%	0.00%	0.24%
Volvo Treasury AB	Manufacturing	66.40%	0.23%	0.49%	0.00%	2.38%
OMV AG	Mining and Quarrying	28.37%	0.03%	0.00%	0.00%	0.13%
Scentre Group	Real Estate Activities	100.00%	0.00%	15.00%	60.00%	0.92%
Deutsche Bahn Finance GmbH	Financial and Insurance Activities	18.02%	0.00%	3.60%	0.00%	0.43%
Toyota Motor Finance Netherlands BV	Financial and Insurance Activities	82.51%	0.00%	0.08%	0.86%	0.60%
Three Gorges Finance II (Cayman Islands) Ltd.	Electricity, Gas, Steam and Air Conditioning Supply	67.20%	0.00%	0.00%	66.46%	0.69%
Shell International Finance BV	Mining and Quarrying	6.38%	0.00%	0.00%	0.76%	1.14%
DSM B.V.	Manufacturing	15.77%	0.00%	0.00%	0.16%	0.04%

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

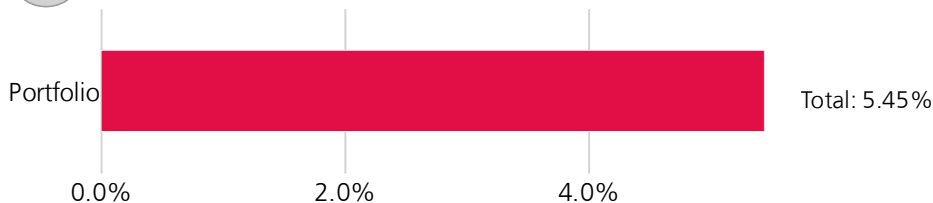
Da im vorangegangenen Berichtsjahr keine Daten verfügbar waren, erübrigt sich ein Vorjahresvergleich.



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



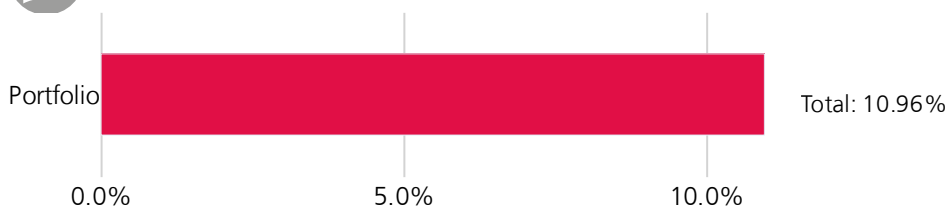
### Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?



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



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



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



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

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



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

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

Swisscanto | Proxy Voting Dashboard (issgovernance.com)

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



## Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

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

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

### Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?

Nicht anwendbar.

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

Nicht anwendbar.

### Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?

Nicht anwendbar.

### Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?

Nicht anwendbar.

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