

TKB VERMÖGENSVERWALTUNG - KONSERVATIV ESG (EUR)

Jahresbericht per 31.07.2024

Teilvermögen des TKB Vermögensverwaltung Fonds
Vertraglicher Umbrella-Fonds schweizerischen Rechts der Art
«Übrige Fonds für traditionelle Anlagen»

| Klasse | Valor | Währung |
|---------------|--------------|----------------|
| A | 35765951 | EUR |
| G | 35766051 | EUR |

Rechnungswährung: EUR

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

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich, 27.11.2024

An den Verwaltungsrat der
Swisscanto Fondsleitung AG, Zürich

Zürich, 27. November 2024

Kurzbericht der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

Bericht zur Prüfung der Jahresrechnungen



Prüfungsurteil

Wir haben die Jahresrechnungen des Anlagefonds

TKB Vermögensverwaltung Fonds,

mit den Teilvermögen

- ▶ TKB Vermögensverwaltung – Konservativ ESG (CHF)
- ▶ TKB Vermögensverwaltung – Konservativ ESG (EUR)
- ▶ TKB Vermögensverwaltung – Ausgewogen ESG (CHF)
- ▶ TKB Vermögensverwaltung – Ausgewogen ESG (EUR)
- ▶ TKB Vermögensverwaltung – Wachstum ESG (CHF)
- ▶ TKB Vermögensverwaltung – Aktien ESG (CHF)

bestehend aus den Vermögensrechnungen zum 31. Juli 2024, den Erfolgsrechnungen für das dann endende Jahr, den Angaben über die Verwendung des Erfolges und die Offenlegung der Kosten sowie den weiteren Angaben gemäss Art. 89 Abs. 1 Bst. b-h des schweizerischen Kollektivanlagengesetzes (KAG), geprüft.

Nach unserer Beurteilung entsprechen die beigefügten Jahresrechnungen dem schweizerischen Kollektivanlagengesetz, den dazugehörigen Verordnungen sowie dem Fondsvertrag und dem Prospekt.



Grundlage für das Prüfungsurteil

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

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



Verantwortlichkeiten des Verwaltungsrates der Fondsleitung für die Jahresrechnungen

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



Verantwortlichkeiten der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft für die Prüfung der Jahresrechnungen

Unsere Ziele sind, hinreichende Sicherheit darüber zu erlangen, ob die Jahresrechnungen als Ganzes frei von wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern sind, und einen Bericht abzugeben, der unser Prüfungsurteil beinhaltet.

Hinreichende Sicherheit ist ein hohes Mass an Sicherheit, aber keine Garantie dafür, dass eine in Übereinstimmung mit dem schweizerischen Gesetz und den SA-CH durchgeführte Abschlussprüfung eine wesentliche falsche Darstellung, falls eine solche vorliegt, stets aufdeckt. Falsche Darstellungen können aus dolosen Handlungen oder Irrtümern resultieren und werden als wesentlich gewürdigt, wenn von ihnen einzeln oder insgesamt vernünftigerweise erwartet werden könnte, dass sie die auf der Grundlage dieser Jahresrechnungen getroffenen wirtschaftlichen Entscheidungen von Nutzern beeinflussen.

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

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



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

Ernst & Young AG

Patrick Schwaller
Zugelassener Revisionsexperte
(Leitender Revisor)

Yves Lauber
Zugelassener Revisionsexperte

Beilage

- ▶ Jahresrechnungen bestehend aus den Vermögensrechnungen zum 31. Juli 2024, den Erfolgsrechnungen für das dann endende Jahr, den Angaben über die Verwendung des Erfolges und die Offenlegung der Kosten sowie den weiteren Angaben gemäss Art. 89 Abs. 1 Bst. b-h des schweizerischen Kollektivanlagengesetzes (KAG)

Inhaltsverzeichnis

| | | |
|----|---|----|
| 1 | Organisation und Verwaltung | 2 |
| 2 | Vertriebsorganisation | 3 |
| 3 | Abschlusszahlen | 4 |
| 4 | Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I | 8 |
| 5 | Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung | 8 |
| 6 | Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte | 8 |
| 7 | Verwaltungskommission | 9 |
| 8 | Benchmark | 9 |
| 9 | TER | 9 |
| 10 | Ausschüttung des Nettoertrags 2023 / 2024 | 10 |
| 11 | Thesaurierung des Nettoertrags 2023 / 2024 | 10 |
| 12 | Fussnoten | 10 |
| 13 | Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte | 11 |

1 Organisation und Verwaltung

Fondsleitung

Firma Swisscanto Fondsleitung AG
Sitz Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Verwaltungsrat

Daniel Previdoli, Präsident
Mitglied der Generaldirektion und Leiter Products,
Services & Direct Banking, Zürcher Kantonalbank

Christoph Schenk, Vizepräsident
Mitglied der Direktion und Leiter Investment Solutions,
Zürcher Kantonalbank

Dr. Thomas Fischer, Mitglied
General Counsel, Zürcher Kantonalbank

Regina Kleeb, Mitglied
Unabhängige Verwaltungsrätin, Master of Advanced Studies in Bankmanagement (IFZ)

Geschäftsleitung

Hans Frey
Geschäftsführer
Andreas Hogg
Stellvertretender Geschäftsführer und Leiter Risk, Finance & Services
Silvia Karrer
Leiterin Administration & Operations

Delegationen

Anlageentscheide Thurgauer Kantonalbank, Bankplatz 1, 8570 Weinfelden
Fondsadministration Swisscanto Fondsleitung AG, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Depotbank

Thurgauer Kantonalbank, Bankplatz 1, 8570 Weinfelden

Prüfgesellschaft

Ernst & Young AG, Maagplatz 1, 8005 Zürich

2 Vertriebsorganisation

Zahlstelle

Thurgauer Kantonalbank, Bankplatz 1, 8570 Weinfelden

Vertriebsträger

Thurgauer Kantonalbank, Bankplatz 1, 8570 Weinfelden

3 Abschlusszahlen

Übersicht

| | von | 01.08.2023 | 01.08.2022 | 01.08.2021 | 01.08.2020 |
|--|------------|---------------|---------------|---------------|---------------|
| | bis | 31.07.2024 | 31.07.2023 | 31.07.2022 | 31.07.2021 |
| Konsolidiert | EUR | | | | |
| Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode | | 11'382'630.07 | 13'915'360.86 | 17'938'128.60 | 19'530'360.89 |
| Klasse A | EUR | | | | |
| Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode | | 11'178'607.64 | 13'745'962.88 | 17'732'302.19 | 19'356'891.09 |
| Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode | | 115'201.145 | 150'368.572 | 183'734.137 | 183'320.267 |
| Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾ | | 97.04 | 91.42 | 96.51 | 105.59 |
| Ausschüttung je Anteil | | 1.45 | 0.85 | 1.05 | 1.25 |
| Total Expense Ratio (Synthetische TER) | | 1.33 % | 1.28 % | 1.30 % | 1.31 % |
| Klasse G | EUR | | | | |
| Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode | | 204'022.43 | 169'397.98 | 205'826.41 | 173'469.80 |
| Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode | | 2'153.080 | 1'909.440 | 2'214.695 | 1'723.062 |
| Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾ | | 94.76 | 88.72 | 92.94 | 100.68 |
| Thesaurierung je Anteil | | 1.28 | 0.82 | 0.99 | 0.54 |
| Total Expense Ratio (Synthetische TER) | | 1.33 % | 1.28 % | 1.30 % | 1.31 % |

Die in diesem Bericht enthaltenen Zahlen und Angaben sind vergangenheitsbezogen. Diese dürfen nicht als Garantie für die zukünftige Entwicklung verstanden werden.

Performance

| | 2023 / 2024 | 2023 | 2022 | 2021 |
|----------------------------------|-------------|--------|----------|--------|
| Klasse A | 7.15 % | 8.14 % | -15.34 % | 3.98 % |
| Klasse G (Lancierung 07.07.2021) | 7.16 % | 8.15 % | -15.34 % | 1.09 % |

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

Vermögensrechnung

| (Verkehrswerte) | 31.07.2024 | 31.07.2023 |
|---|----------------------|----------------------|
| Bankguthaben auf Sicht | 264'824.57 | 665'470.81 |
| Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen | 11'123'345.58 | 13'247'981.74 |
| Sonstige Vermögenswerte | 16'726.60 | 25'387.05 |
| Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode | 11'404'896.75 | 13'938'839.60 |
| Andere Verbindlichkeiten | -22'266.68 | -23'478.74 |
| Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode | 11'382'630.07 | 13'915'360.86 |

Entwicklung der Anzahl Anteile

| | von bis | 01.08.2023 31.07.2024 | 01.08.2022 31.07.2023 |
|---|------------|--------------------------|--------------------------|
| Klasse A | | | |
| Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode | | 150'368.572 | 183'734.137 |
| Ausgegebene Anteile | | 1'991.815 | 1'483.906 |
| Zurückgenommene Anteile | | -37'159.242 | -34'849.471 |
| Bestand am Ende der Rechnungsperiode | | 115'201.145 | 150'368.572 |
| Klasse G | | | |
| Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode | | 1'909.440 | 2'214.695 |
| Ausgegebene Anteile | | 274.201 | 378.792 |
| Zurückgenommene Anteile | | -30.561 | -684.047 |
| Bestand am Ende der Rechnungsperiode | | 2'153.080 | 1'909.440 |

Veränderung des Nettofondsvermögens

| | von bis | 01.08.2023 31.07.2024 | 01.08.2022 31.07.2023 |
|--|------------|--------------------------|--------------------------|
| Konsolidiert | | | |
| Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode | | 13'915'360.86 | 17'938'128.60 |
| Ausbezahlte Ausschüttung | | -118'904.62 | -184'562.07 |
| Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer | | -550.06 | -838.61 |
| Saldo aus dem Anteilverkehr | | -3'225'272.58 | -3'051'776.27 |
| Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung | | 811'996.47 | -785'590.79 |
| Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode | | 11'382'630.07 | 13'915'360.86 |

Erfolgsrechnung

| | von bis | 01.08.2023 31.07.2024 | 01.08.2022 31.07.2023 |
|---|------------|--------------------------|--------------------------|
| Konsolidiert | | | |
| Ertrag | | | |
| Erträge der Bankguthaben auf Sicht | | 0.78 | 0.00 |
| Erträge der Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen | | 215'359.53 | 179'434.11 |
| Steuerrechtliche Anpassung aufgrund von Erträgen aus Zielfonds 4) | | 89'809.94 | 100'039.63 |
| Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen | | -562.00 | -515.19 |
| Total Ertrag | | 304'608.25 | 278'958.55 |
| Aufwand | | | |
| Prüfaufwand | | -13'163.04 | -7'986.39 |
| Reglementarische Vergütungen | | -128'356.83 | -161'162.04 |
| Sonstige Aufwendungen | | -1'998.72 | -1'959.88 |
| Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen | | 9'439.83 | 13'581.46 |
| Total Aufwand | | -134'078.76 | -157'526.85 |
| Nettoertrag / Verlust | | 170'529.49 | 121'431.70 |
| Realisierte Kapitalgewinne und -verluste | | -45'675.67 | -727'674.43 |
| Zahlungen aus Kapitaleinlageprinzip | | 74.75 | 0.00 |
| Übertrag von steuerrechtlichem Ausgleich aufgrund von Erträgen aus Zielfonds 4) | | -89'809.94 | -100'039.63 |
| Realisierter Erfolg | | 35'118.63 | -706'282.36 |
| Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste | | 776'877.84 | -79'308.43 |
| Gesamterfolg | | 811'996.47 | -785'590.79 |

Verwendung des Erfolges

| Klasse A | 31.07.2024 | 31.07.2023 |
|---|-------------------|-------------------|
| Nettoertrag | 167'755.82 | 119'860.89 |
| Vortrag des Vorjahres | 923.04 | 8'875.44 |
| Zur Verteilung verfügbarer Erfolg | 168'678.86 | 128'736.33 |
| Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg | 167'041.66 | 127'813.29 |
| Vortrag auf neue Rechnung | 1'637.20 | 923.04 |
| Total | 168'678.86 | 128'736.33 |

| Klasse G | 31.07.2024 | 31.07.2023 |
|--|-------------------|-------------------|
| Nettoertrag | 2'773.67 | 1'570.81 |
| Zur Verteilung verfügbarer Erfolg | 2'773.67 | 1'570.81 |
| Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer | 970.78 | 549.78 |
| Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage | 1'802.89 | 1'021.03 |
| Total | 2'773.67 | 1'570.81 |

Inventar des Fondsvermögens am Ende der Rechnungsperiode und Bestandesveränderungen während der Periode

| ISIN / Fälligkeitsdatum | Bezeichnung | Anz / Nom in Tsd. 01.08.2023 | Kauf Zugang 2) | Verkauf Abgang 3) | Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.07.2024 | Kurs 8) | Kurswert EUR | in % 7) | Kat. |
|--|--|------------------------------------|----------------------|-------------------------|---|------------|-------------------------|--------------------|------|
| Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind | | | | | | | 6'556'336.91 | 57.49 | |
| Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen | | | | | | | 6'556'336.91 | 57.49 | |
| IE00BFNM3P36 | ISHARES MSCI EM IMI ESG SCRNI | 37'800 | 0 | 17'500 | 20'300 USD | 6.61 | 123'965.02 | 1.09 | a) |
| IE00BLDGH553 | ISHARES EURO GOVLT CLIM EUR A | 613'000 | 0 | 134'450 | 478'550 EUR | 4.29 | 2'051'496.00 | 17.99 | a) |
| LU0484968812 | X II EUR CPSRIPABUCITSETF-1D | 12'810 | 470 | 3'545 | 9'735 EUR | 141.18 | 1'374'387.30 | 12.05 | a) |
| DE | | | | | | | 3'549'848.32 | 31.13 | |
| IE00B53HP851 | ISHARES FTSE 100 ACC | 420 | 0 | 420 | 0 GBP | 0.00 | 0.00 | 0.00 | |
| GB | | | | | | | 0.00 | 0.00 | |
| IE00B3DKXQ41 | ISHARE EURO AGGREGATE | 7'310 | 1'600 | 1'515 | 7'395 EUR | 108.23 | 800'360.85 | 7.02 | a) |
| IE00BFM6TC58 | ISH USD TRES 20PLUS YR USD A | 0 | 65'000 | 38'370 | 26'630 USD | 4.67 | 114'865.23 | 1.01 | a) |
| IE00BFNM3B99 | ISHARES MSCI USA ESG SCREEND | 105'500 | 24'800 | 45'500 | 84'800 EUR | 8.20 | 695'275.20 | 6.10 | a) |
| IE00BFNM3G45 | ISHARES MSCI USA ESG SCREEND | 34'800 | 26'750 | 27'700 | 33'850 USD | 11.16 | 348'979.77 | 3.06 | a) |
| IE00BHZPJ908 | ISH MSCI USA ESG EHNCD USD-A | 38'400 | 25'300 | 25'900 | 37'800 USD | 10.00 | 349'216.34 | 3.06 | a) |
| IE00BKP5L730 | ISHARES ESG USD EM BD EUR-HA | 66'400 | 30'500 | 43'900 | 53'000 EUR | 4.43 | 234'556.80 | 2.06 | a) |
| IE00BMP3HN93 | UBS ETF MSCI UK IMI SRI | 8'310 | 0 | 8'310 | 0 GBP | 0.00 | 0.00 | 0.00 | |
| IE | | | | | | | 2'543'254.19 | 22.30 | |
| LU0489337690 | DBX DV EUROPE REAL ESTATE 1C | 34'100 | 13'530 | 28'150 | 19'480 EUR | 23.78 | 463'234.40 | 4.06 | a) |
| LU | | | | | | | 463'234.40 | 4.06 | |
| Wertpapiere, die an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden | | | | | | | 4'567'008.67 | 40.04 | |
| Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen | | | | | | | 4'567'008.67 | 40.04 | |
| CH0011292353 | PICTET CH-SHRT TRM MKT E-IDY | 218 | 277 | 87 | 408 EUR | 972.33 | 396'710.64 | 3.48 | a) |
| CH0117045150 | SWC (CH) INDEX BF EMU GOVLT. NT EUR | 16'954 | 0 | 3'558 | 13'396 EUR | 118.45 | 1'586'795.05 | 13.91 | a) |
| CH0117045192 | SWC (CH) INDEX BF USA GOVLT. NT USD | 2'700 | 0 | 1'620 | 1'080 USD | 114.06 | 113'842.47 | 1.00 | a) |
| CH0215804375 | SWC (CH) INDEX BF AUSTRALIA GOVLT. NT | 0 | 2'000 | 2'000 | 0 AUD | 0.00 | 0.00 | 0.00 | |
| CH0215804417 | SWC (CH) INDEX BF CANADA GOVLT. NT | 1'930 | 0 | 1'930 | 0 CAD | 0.00 | 0.00 | 0.00 | |
| CH0215804458 | SWC (CH) INDEX BF UK GOVLT. NT GBP | 0 | 1'245 | 1'245 | 0 GBP | 0.00 | 0.00 | 0.00 | |
| CH0352765355 | CSIF CH II-GOLD BLUE-QB USD | 368 | 145 | 197 | 316 USD | 2'004.62 | 585'399.32 | 5.13 | a) |
| CH0451461963 | SWC (CH) IX EF SWITZERLAND TOTAL RESP. NT CHF | 2'815 | 1'315 | 1'320 | 2'810 CHF | 154.02 | 454'378.83 | 3.98 | a) |
| CH1140340709 | SWC (CH) IBF TM AAA-BBB CHF RESPONSIBLE NT CHF | 4'480 | 0 | 4'480 | 0 CHF | 0.00 | 0.00 | 0.00 | |
| CH | | | | | | | 3'137'126.31 | 27.51 | |
| IE00BF51KW42 | SEI LIQUID ALTERNATIV-US W P | 7'250 | 1'870 | 9'120 | 0 USD | 0.00 | 0.00 | 0.00 | |
| IE00BYW5ZH19 | SEI LIQUID ALTERNAT-HEURWPA | 0 | 8'700 | 0 | 8'700 EUR | 12.57 | 109'359.00 | 0.96 | a) |
| IE | | | | | | | 109'359.00 | 0.96 | |
| LU0445386955 | NORDEA 1 SCV ALP 10 MA-BIEUR | 15'100 | 590 | 3'600 | 12'090 EUR | 13.73 | 165'960.64 | 1.46 | a) |
| LU1093756911 | FRANKLIN K2 ALTERN-IAEURH1 | 5'450 | 0 | 5'450 | 0 EUR | 0.00 | 0.00 | 0.00 | |
| LU1332601290 | BCV LIQUID ALTERN BETA-C EUR | 1'360 | 0 | 349 | 1'011 EUR | 116.93 | 118'216.23 | 1.04 | a) |
| LU1433232698 | PICTET TR - ATLAS-I EUR | 1'600 | 0 | 260 | 1'340 EUR | 131.42 | 176'102.80 | 1.54 | a) |
| LU1891411578 | CSIF LX EQ JPN ESG BLU-QBXJP | 0 | 49 | 49 | 0 JPY | 0.00 | 0.00 | 0.00 | |
| LU2064528974 | CSIF LX EQ EM ESG BLUE-QBXUS | 142 | 65 | 47 | 160 USD | 1'137.44 | 168'182.79 | 1.47 | a) |
| LU2091502042 | CSIF LU EQ EMU ESG BL-QBXEUR | 510 | 74 | 114 | 470 EUR | 1'472.47 | 692'060.90 | 6.07 | a) |
| LU | | | | | | | 1'320'523.36 | 11.58 | |
| Vermögensaufstellung | | | | | | | Kurswert EUR | in % 7) | |
| Bankguthaben auf Sicht | | | | | | | 264'824.57 | 2.32 | |
| Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen | | | | | | | 11'123'345.58 | 97.53 | |
| Sonstige Vermögenswerte | | | | | | | 16'726.60 | 0.15 | |
| Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode | | | | | | | 11'404'896.75 | 100.00 | |
| Andere Verbindlichkeiten | | | | | | | -22'266.68 | | |
| Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode | | | | | | | 11'382'630.07 | | |

| Bewertungskategorien | | Kurswert EUR | in % 7) |
|-----------------------------|---|-------------------------|--------------------|
| a) | Anlagen, die an einer Börse kotiert oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden; bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden (Art. 88 Abs. 1 KAG); | 11'123'345.58 | 97.53 |
| b) | Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind; bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern; | 0.00 | 0.00 |
| c) | Anlagen, die aufgrund von am Markt nicht beobachtbaren Parametern mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten bewertet werden. | 0.00 | 0.00 |

Devisenkurse

| | | |
|-----|---------|------------|
| CHF | 1 = EUR | 1.04984947 |
| USD | 1 = EUR | 0.92413000 |

4 Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

| Engagement | Währung | Betrag | in % 28) |
|--|----------------|---------------|---------------------|
| Total der engagementerhöhenden Positionen (Basiswertäquivalent) | EUR | - | - |
| Total der engagementreduzierenden Positionen (Basiswertäquivalent) | EUR | - | - |

5 Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung

Periode: 01.08.2023 - 31.07.2024

| Klasse | Währung | Ausgabespesen, Ausgabekomm. in % zu Gunsten 30) | | Rücknahmespesen, Rücknahmekomm. in % zu Gunsten 30) | |
|---------------|----------------|--|---------------------|--|---------------------|
| | | Teilvermögen | Fondsleitung | Teilvermögen | Fondsleitung |
| A | EUR | - | - | - | - |
| G | EUR | - | - | - | - |

6 Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte

| Am Bilanzstichtag ausgeliehene Effekten | Währung | Betrag |
|---|----------------|---------------|
| Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte | EUR | - |
| Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte | EUR | - |
| Andere Wertpapiere | EUR | - |

| Am Bilanzstichtag in Pension gegebene Effekten | Währung | Betrag |
|---|----------------|---------------|
| Keine | EUR | - |

Die Fondsleitung hat keine Vereinbarungen bezüglich sogenannten «soft commissions» geschlossen.

7 Verwaltungskommission

Die Verwaltungskommission (VK) wird verwendet für die Leitung, das Asset Management und den Vertrieb des Teilvermögens, wie auch für die Entschädigung der Depotbank für die von ihr erbrachten Dienstleistungen.

Im Geschäftsjahr effektiv belastete Sätze:

Periode: 01.08.2023 - 31.07.2024

| Klasse | VK p.a. in % | | VK Zielfonds |
|--------|--------------|-------|------------------|
| | Eff | Max | p.a. in % Max |
| A | 1.050 | 1.050 | 3.000 |
| G | 1.050 | 1.050 | 3.000 |

Gemäss den Verhaltensregeln der Asset Management Association Switzerland vom 5. August und 23. September 2021 (in Kraft 1. Januar 2022): Aus der Verwaltungskommission können Gebühren bzw. Entschädigungen (inkl. Retrozessionen) zur Deckung der Vertriebstätigkeit des Fonds bezahlt werden. Als Vertriebstätigkeit gilt insbesondere jede Tätigkeit in Zusammenhang mit dem Angebot, der Werbung und der Vermittlung des Fonds. Die Gesellschaft bzw. die Fondsleitung kann Anlegern aufgrund objektiver Kriterien Rabatte auf den dem Fonds belasteten Gebühren bzw. Kosten gewähren.

8 Benchmark

Dieses Teilvermögen hat keinen Referenzindex.

9 TER

Die TER wurde gemäss «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.

10 Ausschüttung des Nettoertrags 2023 / 2024

Ex-Datum: 12.11.2024 Ausschüttung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 15.11.2024

| Klasse | Affidavit-fähig | Währung | Brutto je Anteil | Abzgl. 35% Eidg. Vst | Netto je Anteil |
|--------|-----------------|---------|------------------|----------------------|-----------------|
| A | Ja | EUR | 1.45000 | 0.50750 | 0.94250 |

11 Thesaurierung des Nettoertrags 2023 / 2024

Ex-Datum: 12.11.2024 Thesaurierung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 15.11.2024

| Klasse | Affidavit-fähig | Währung | Brutto je Anteil | Abzgl. 35% Eidg. Vst | Netto je Anteil |
|--------|-----------------|---------|------------------|----------------------|-----------------|
| G | Ja | EUR | 1.288 | 0.450 | 0.838 |

12 Fussnoten

- 1) Der Nettoinventarwert wird mathematisch auf 0.01 der Rechnungseinheit gerundet.
- 2) Käufe umfassen unter anderem die Transaktionen: Käufe / Gratistitel / Konversionen / Namensänderungen / Splits / Stock-/ Wahldividenden / Titelaufteilungen / Überträge / Umtausch zwischen Gesellschaften / Zuteilungen aus Bezugs-/Optionsrechten / Sacheinlagen.
- 3) Verkäufe umfassen unter anderem die Transaktionen: Verkäufe / Auslosungen / Ausbuchungen infolge Verfall / Ausübungen von Bezugs-/Optionsrechten / Konversionen / Reverse Splits / Rückzahlungen / Überträge / Umtausch zwischen Gesellschaften / Sachauslagen.
- 4) Gemäss Kreisschreiben 24 vom 20.11.2017 und 25 vom 23.02.2018 der Eidgenössischen Steuerverwaltung.
- 7) Allfällige Abweichungen in den Totalisierungen sind auf Rundungsdifferenzen zurückzuführen.
- 8) Kursangabe der britischen Titel in Pence.
- 28) Sämtliche engagementerhöhenden Derivate (netto nach Verrechnung gegenläufiger Positionen) sind durch geldnahe Mittel gedeckt. Sämtliche engagementreduzierenden Derivate (netto nach Verrechnung gegenläufiger Positionen) sind durch die entsprechenden Basiswerte gedeckt.
- 30) Darstellung der Angaben in Prozent des Nettoinventarwertes.

13 Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte

1. Der Nettoinventarwert jedes Teilvermögens und der Anteil der einzelnen Klassen (Quoten) wird zum Verkehrswert auf Ende des Rechnungsjahres sowie für jeden Tag, an dem Anteile ausgegeben oder zurückgenommen werden, in der Rechnungseinheit des entsprechenden Teilvermögens berechnet. Für Tage, an welchen die Börsen bzw. Märkte der Hauptanlageländer eines Teilvermögens geschlossen sind (z.B. Banken- und Börsenfeiertage), findet keine Berechnung des Vermögens des entsprechenden Teilvermögens statt.
2. An einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelte Anlagen sind mit den am Hauptmarkt bezahlten aktuellen Kursen zu bewerten. Andere Anlagen oder Anlagen, für die keine aktuellen Kurse verfügbar sind, sind mit dem Preis zu bewerten, der bei sorgfältigem Verkauf im Zeitpunkt der Schätzung wahrscheinlich erzielt würde. Die Fondsleitung wendet in diesem Fall zur Ermittlung des Verkehrswertes angemessene und in der Praxis anerkannte Bewertungsmodelle und -grundsätze an.
3. Offene kollektive Kapitalanlagen werden mit ihrem Rücknahmepreis bzw. Nettoinventarwert bewertet. Werden sie regelmässig an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt, so kann die Fondsleitung diese gemäss Ziff. 2 bewerten.
4. Der Wert von Geldmarktinstrumenten, welche nicht an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden, wird wie folgt bestimmt: Der Bewertungspreis solcher Anlagen wird, ausgehend vom Nettoerwerbspreis, unter Konstanthaltung der daraus berechneten Anlagerendite, sukzessiv dem Rückzahlungspreis angeglichen. Bei wesentlichen Änderungen der Marktbedingungen wird die Bewertungsgrundlage der einzelnen Anlagen der neuen Marktrendite angepasst. Dabei wird bei fehlendem aktuellem Marktpreis in der Regel auf die Bewertung von Geldmarktinstrumenten mit gleichen Merkmalen (Qualität und Sitz des Emittenten, Ausgabebewährung, Laufzeit) abgestellt.
5. Bankguthaben werden mit ihrem Forderungsbetrag plus aufgelaufene Zinsen bewertet. Bei wesentlichen Änderungen der Marktbedingungen oder der Bonität wird die Bewertungsgrundlage für Bankguthaben auf Zeit den neuen Verhältnissen angepasst.
6. Der Nettoinventarwert eines Anteils einer Klasse eines Teilvermögen ergibt sich aus der der betreffenden Anteilsklasse am Verkehrswert des Vermögens dieses Teilvermögens zukommenden Quote, vermindert um allfällige Verbindlichkeiten dieses Teilvermögens, die der betreffenden Anteilsklasse zugeteilt sind, dividiert durch die Anzahl der im Umlauf befindlichen Anteile der entsprechenden Klasse. Er wird auf 1/100 der Rechnungseinheit des entsprechenden Teilvermögens gerundet.
7. Die Quoten am Verkehrswert des Nettofondsvermögens (Fondsvermögen abzüglich der Verbindlichkeiten), welche den jeweiligen Anteilsklassen zuzurechnen sind, werden erstmals bei der Erstausgabe mehrerer Anteilsklassen (wenn diese gleichzeitig erfolgt) oder der Erstausgabe einer weiteren Anteilsklasse auf der Basis der dem Fonds für jede Anteilsklasse zufließenden Betreffnisse bestimmt. Die Quote wird bei folgenden Ereignissen jeweils neu berechnet:
 - a. bei der Ausgabe und Rücknahme von Anteilen;
 - b. auf den Stichtag von Ausschüttungen, sofern (i) solche Ausschüttungen nur auf einzelnen Anteilsklassen (Ausschüttungsklassen) anfallen oder sofern (ii) die Ausschüttungen der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten ihres jeweiligen Nettoinventarwertes unterschiedlich ausfallen oder sofern (iii) auf den Ausschüttungen der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten der Ausschüttung unterschiedliche Kommissions- oder Kostenbelastungen anfallen;

- c. bei der Inventarwertberechnung, im Rahmen der Zuweisung von Verbindlichkeiten (einschliesslich der fälligen oder aufgelaufenen Kosten und Kommissionen) an die verschiedenen Anteilsklassen, sofern die Verbindlichkeiten der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten ihres jeweiligen Nettoinventarwertes unterschiedlich ausfallen, namentlich, wenn (i) für die verschiedenen Anteilsklassen unterschiedliche Kommissionssätze zur Anwendung gelangen oder wenn (ii) klassenspezifische Kostenbelastungen erfolgen;
- d. bei der Inventarwertberechnung, im Rahmen der Zuweisung von Erträgen oder Kapitalerträgen an die verschiedenen Anteilsklassen, sofern Erträge oder Kapitalerträge aus Transaktionen anfallen, die nur im Interesse einer Anteilsklasse oder im Interesse mehrerer Anteilsklassen, nicht jedoch proportional zu deren Quote am Nettofondsvermögen, getätigt wurden.