



# Halbjahresbericht

## **LGT Multi-Assets SICAV**

Investmentgesellschaft mit variablem Kapital  
nach liechtensteinischem Recht

LGT Capital Partners (FL) AG

Per 30. November 2019



# Ungeprüfter Halbjahresbericht per 30. November 2019

## Inhaltsverzeichnis

Organisation	3
Mitteilungen an die Anleger und allgemeine Informationen	6
Konsolidierte Bilanz per 30.11.2019	9
Konsolidierte Erfolgsrechnung vom 01.06.2019 bis 30.11.2019	11
LGT GIM Balanced	13
LGT GIM Growth	27
LGT Alpha Indexing Fund	42
LGT Sustainable Fixed Income Global Opportunities	57
LGT Sustainable Strategy 3 Years	72
LGT Sustainable Strategy 4 Years	93
LGT Sustainable Strategy 5 Years	113
Erläuterungen zum Halbjahresbericht	131
Anhang: Verordnung über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften und der Weiterverwendung (SFTR) (ungeprüft)	139

## Verkaufsrestriktionen

Anteile der Teilfonds dieses OGAW dürfen nicht an Anleger mit Domizil oder Nationalität USA verkauft, angeboten oder ausgeliefert werden.

## Organisation

### **Investmentgesellschaft / OGAW**

LGT Multi-Assets SICAV, Herrengasse 12, 9490 Vaduz, Liechtenstein

### **Verwaltungsrat der Investmentgesellschaft**

*Brigitte Arnold, Präsidentin*

Head Tax and Products, LGT Group Foundation, Vaduz

*Roger Gauch, Mitglied*

Chief Executive Officer, LGT Capital Partners (FL) AG, Vaduz

*Dr. Konrad Bächinger, Mitglied*

### **Verwaltungsgesellschaft**

LGT Capital Partners (FL) AG, Herrengasse 12, 9490 Vaduz, Liechtenstein

### **Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft**

*Dr. André Lagger, Präsident*

Chief Executive Officer, LGT Financial Services AG, Vaduz

*Werner von Baum, Vizepräsident*

Chief Risk Officer, LGT Capital Partners AG, Pfäffikon

*Dr. Magnus Pirovino, Mitglied*

### **Geschäftsleitung der Verwaltungsgesellschaft**

*Roger Gauch*

Chief Executive Officer, LGT Capital Partners (FL) AG, Vaduz

*Lars Inderwildi*

Head Operations, LGT Capital Partners (FL) AG, Vaduz

*Alois Wille*

Head Risk and Project Management, LGT Capital Partners (FL) AG, Vaduz

*Pierre-André Wirth*

Head Legal and Compliance, LGT Capital Partners (FL) AG, Vaduz

### **Verwahrstelle**

LGT Bank AG, Herrengasse 12, 9490 Vaduz, Liechtenstein

### **Asset Manager**

LGT Capital Partners AG, Schützenstrasse 6, 8808 Pfäffikon, Schweiz

Mit teilweiser Delegation für folgende Teilfonds an:

LGT GIM Balanced, LGT GIM Growth

LGT Capital Partners (Asia-Pacific) Ltd., 4203, Two Exchange Square, 8 Connaught Place Central, Hong Kong

**Administrationsstelle**

LGT Financial Services AG, Herrengasse 12, 9490 Vaduz, Liechtenstein

**Wirtschaftsprüfer**

PricewaterhouseCoopers AG, Birchstrasse 160, 8050 Zürich, Schweiz

**Zahlstelle und Vertriebsberechtigter in Liechtenstein**

LGT Bank AG, Herrengasse 12, 9490 Vaduz, Liechtenstein

**Auskunft und Verkauf**

LGT Bank AG, Herrengasse 12, 9490 Vaduz, Liechtenstein

Tel. +423 235 11 22

**Kontaktstellen Schweiz**

*Vertreter*

LGT Capital Partners AG, Schützenstrasse 6, 8808 Pfäffikon, Schweiz

*Zahlstelle*

LGT Bank (Schweiz) AG, Lange Gasse 15, 4002 Basel, Schweiz

**Kontaktstelle Deutschland**

*Zahl- und Informationsstelle*

Landesbank Baden-Württemberg, Am Hauptbahnhof 2, 70173 Stuttgart, Deutschland

**Kontaktstelle Österreich**

*Vertreter, Zahl- und Informationsstelle*

Erste Bank der österreichischen Sparkassen AG, Graben 21, 1010 Wien, Österreich

**Kontaktstelle Italien**

*Zahl- und Informationsstelle*

RBC Investor Services Bank S.A., Via Vittor Pisani 26, 20124 Mailand, Italien

**Kontaktstelle Tschechische Republik**

*Kontaktstelle*

European Investment Centre, Veverí 102, o.c.p., a.s. – org. složka, 616 00 Brunn, Tschechische Republik

## Vertriebszulassungen

Name	Liechtenstein	Deutschland	Italien	Österreich	Rumänien	Schweiz	Singapur	Slowakei	Tschechische Republik	Ungarn
LGT GIM Balanced	X	X	X	X	X	X	X*	X	X	X
LGT GIM Growth	X	X	X	X	X	X	X*	X	X	X
LGT Alpha Indexing Fund	X	X	X	X		X	X*			
LGT Sustainable Fixed Income Global Opportunities	X	X		X		X	X*			
LGT Sustainable Strategy 3 Years	X	X	X	X	X	X	X*	X	X	X
LGT Sustainable Strategy 4 Years	X	X	X	X	X	X	X*	X	X	X
LGT Sustainable Strategy 5 Years	X	X		X		X	X*			

\* nur für institutionelle Kunden

## Mitteilungen an die Anleger und allgemeine Informationen

### Mitteilungen

Keine.

### ISINs

Der Prospekt des OGAW sieht folgende Teilfonds/Anteilsklassen vor:

LGT GIM Balanced		LGT GIM Growth		LGT Alpha Indexing Fund		LGT Sustainable Fixed Income Global Opportunities	
LI0108468880	(USD) B	LI0108469250	(USD) B	LI0101102999	(CHF) B	LI0008232030	(EUR) B
LI0108469029	(CHF) B	LI0108469268	(CHF) B	LI0347021755	(EUR) B	LI0350494675	(CHF) B
LI0108469169	(EUR) B	LI0411121598	(CZK) B	LI0347021748	(USD) B	LI0350494725	(USD) B
LI0379762631	(USD) B1	LI0108469318	(EUR) B	LI0101103005	(CHF) I1	LI0021994863	(EUR) I1
LI0108469227	(USD) IM	LI0379762706	(USD) B1	LI0347021771	(EUR) I1	LI0350494691	(CHF) I1
LI0247528586	(CHF) IM	LI0108469334	(USD) IM	LI0347021763	(USD) I1	LI0350494758	(USD) I1
		LI0247528727	(CHF) IM	LI0247162683	(CHF) C	LI0247156974	(EUR) C
				LI0347021797	(EUR) C	LI0350494683	(CHF) C
				LI0347021789	(USD) C	LI0350494733	(USD) C
				LI0134049852	(CHF) IM	LI0183054555	(EUR) IM

### LGT Sustainable Strategy 3 Years    LGT Sustainable Strategy 4 Years    LGT Sustainable Strategy 5 Years

LI0008232162	(EUR) B	LI0008232220	(EUR) B	LI0019352926	(EUR) B
LI0350494782	(CHF) B	LI0350494907	(CHF) B	LI0350495169	(CHF) B
LI0350494840	(USD) B	LI0350494998	(USD) B	LI0350495227	(USD) B
LI0379762813	(USD) B1	LI0379762839	(USD) B1	LI0379762854	(USD) B1
LI0021995381	(EUR) I1	LI0021995852	(EUR) I1	LI0021996330	(EUR) I1
LI0350494832	(CHF) I1	LI0350494972	(CHF) I1	LI0350495201	(CHF) I1
LI0350494899	(USD) I1	LI0350495029	(USD) I1	LI0350495433	(USD) I1
LI0247157063	(EUR) C	LI0247157188	(EUR) C	LI0247157212	(EUR) C
LI0350494790	(CHF) C	LI0350494915	(CHF) C	LI0350495177	(CHF) C
LI0350494873	(USD) C	LI0350495003	(USD) C	LI0350495409	(USD) C
LI0217218879	(EUR) IM	LI0217218945	(EUR) IM	LI0217219026	(EUR) IM

### Termine

#### Bewertungstag

Mindestens wöchentlich, am ersten Geschäftstag der Woche oder an einem anderen Tag oder an anderen Tagen, den bzw. die der OGAW oder die Verwaltungsgesellschaft (mit Zustimmung der Verwahrstelle) möglicherweise festlegt und den Anteilinhabern im Voraus mitteilt, und am Ende des Geschäftsjahres.

#### Zeichnungstag

Mindestens wöchentlich, am ersten Geschäftstag der Woche und/oder an einem anderen Tag bzw. an anderen Tagen, den bzw. die der OGAW oder die Verwaltungsgesellschaft möglicherweise festlegt.

#### Zeichnungsfrist

LGT GIM Balanced: Bis 14:00 (MEZ) am Geschäftstag vor dem Zeichnungstag.

LGT GIM Growth: Bis 14:00 (MEZ) zwei Geschäftstage vor dem Zeichnungstag.

LGT Sustainable Fixed Income Global Opportunities: Bis 14:00 (MEZ) am Zeichnungstag.

LGT Alpha Indexing Fund, LGT Sustainable Strategy 3 Years, LGT Sustainable Strategy 4 Years, LGT Sustainable Strategy 5 Years: Bis 12:00 (MEZ) am Zeichnungstag.

#### *Zahlungstag für Zeichnungen*

Innerhalb von zwei Abrechnungstagen der Basiswährung der jeweiligen Anteilklasse nach dem Zeichnungstag oder an anderen Tagen, die von Zeit zu Zeit vom OGAW oder der Verwaltungsgesellschaft festgelegt werden.

LGT Alpha Indexing Fund: Innerhalb von zwei Geschäftstagen nach dem entsprechenden Zeichnungstag der Basiswährung der jeweiligen Anteilklasse nach dem Zeichnungstag oder an anderen Tagen, die von Zeit zu Zeit vom OGAW oder der Verwaltungsgesellschaft festgelegt werden.

#### *Rücknahmetag*

Mindestens wöchentlich, am ersten Geschäftstag der Woche und/oder an einem anderen Tag bzw. an anderen Tagen, den bzw. die der OGAW oder die Verwaltungsgesellschaft möglicherweise festlegt.

#### *Rücknahmeschluss*

LGT GIM Balanced: Bis 14:00 (MEZ) am Geschäftstag vor dem Rücknahmetag.

LGT GIM Growth: Bis 14:00 (MEZ) zwei Geschäftstage vor dem Rücknahmetag.

LGT Sustainable Fixed Income Global Opportunities: Bis 14:00 (MEZ) am Rücknahmetag.

LGT Alpha Indexing Fund, LGT Sustainable Strategy 3 Years, LGT Sustainable Strategy 4 Years, LGT Sustainable Strategy 5 Years: Bis 12:00 (MEZ) am Rücknahmetag.

#### *Zahlungstag für Rücknahmen*

Innerhalb von zwei Abrechnungstagen der Basiswährung der jeweiligen Anteilklasse nach dem Rücknahmetag oder an anderen Tagen, die von Zeit zu Zeit vom OGAW oder der Verwaltungsgesellschaft festgelegt werden.

LGT Alpha Indexing Fund: Innerhalb von zwei Geschäftstagen nach dem entsprechenden Rücknahmetag der Basiswährung der jeweiligen Anteilklasse nach dem Rücknahmetag oder an anderen Tagen, die von Zeit zu Zeit vom OGAW oder der Verwaltungsgesellschaft festgelegt werden.

#### *Umwandlungstag*

Mindestens wöchentlich, am ersten Geschäftstag der Woche und/oder an einem anderen Tag bzw. an anderen Tagen, den bzw. die der OGAW oder die Verwaltungsgesellschaft möglicherweise festlegt.

#### *Umtauschfrist*

LGT GIM Balanced: Bis 14:00 (MEZ) am Geschäftstag vor dem Umtauschtag.

LGT GIM Growth: Bis 14:00 (MEZ) zwei Geschäftstage vor dem Umtauschtag.

LGT Sustainable Fixed Income Global Opportunities: Bis 14:00 (MEZ) am Umtauschtag.

LGT Alpha Indexing Fund, LGT Sustainable Strategy 3 Years, LGT Sustainable Strategy 4 Years, LGT Sustainable Strategy 5 Years: Bis 12:00 (MEZ) am Umtauschtag.

### **Kommissionen**

#### *Maximaler Ausgabeaufschlag*

LGT Alpha Indexing Fund, LGT Sustainable Fixed Income Global Opportunities, LGT Sustainable Strategy 3 Years: 3%

LGT Sustainable Strategy 4 Years: 4%

LGT GIM Balanced, LGT GIM Growth, LGT Sustainable Strategy 5 Years: 5%

#### *Maximale Rücknahmegebühr*

Keine



#### *Maximale Umtauschgebühr*

LGT GIM Balanced, LGT GIM Growth, LGT Sustainable Fixed Income Global Opportunities, LGT Sustainable Strategy 3 Years, LGT Sustainable Strategy 4 Years, LGT Sustainable Strategy 5 Years: CHF 100.00 oder entsprechend  
LGT Alpha Indexing Fund: Keine

#### **Fondsdomizil und rechtsverbindliche Sprache**

Das Fondsdomizil ist Vaduz, Liechtenstein.

Die englischsprachige Version des Jahresberichtes ist rechtsverbindlich.

#### **Geschäftsjahr**

Das Geschäftsjahr des OGAW beginnt am 1. Juni und endet am 31. Mai.

#### **Informationen an die Anleger**

Das Veröffentlichungsmedium des OGAW ist die Website des LAFV ([www.lafv.li](http://www.lafv.li)), auf der alle Mitteilungen an die Anteilhaber, darunter auch Mitteilungen über Änderungen der OGAW-Dokumentation, veröffentlicht werden.

Der Nettoinventarwert und der Nettoinventarwert pro Anteil werden auf der Website des LAFV veröffentlicht.

Die Jahres- und Halbjahresberichte werden den Anteilhabern am Sitz der Verwaltungsgesellschaft und der Verwahrstelle sowie auf der Website des LAFV kostenlos zur Verfügung gestellt.

In der Schweiz werden sämtliche Mitteilungen an die Anteilhaber über die elektronische Plattform «[www.fundinfo.com](http://www.fundinfo.com)» veröffentlicht.

Anteilhaber können den Prospekt, die wesentlichen Anlegerinformationsdokumente (KIID), der Satzung sowie die Jahres- und Halbjahresberichte (soweit bereits veröffentlicht) kostenlos beim Vertreter in der Schweiz beziehen.

## Konsolidierte Bilanz per 30.11.2019

Aktiven	30.11.2019 CHF	30.11.2018 CHF
<b>Umlaufvermögen</b>	<b>3'535'249'015.14</b>	<b>3'793'251'620.46</b>
<b>Forderungen</b>	<b>0.00</b>	<b>0.00</b>
Forderungen aus Lieferungen und Leistungen	0.00	0.00
Forderungen gegen verbundene Unternehmen	0.00	0.00
Sonstige Forderungen	0.00	0.00
<b>Wertpapiere</b>	<b>3'443'402'201.43</b>	<b>3'693'204'296.15</b>
Sonstige Wertpapiere	3'443'402'201.43	3'693'204'296.15
Geldmarktinstrumente	0.00	0.00
Aktien und andere Beteiligungspapiere	411'838'152.38	493'313'497.83
Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen	142'637'265.33	139'606'048.12
Anlagefonds	2'486'770'072.23	2'742'063'921.94
Private Equity Anlagen	0.00	0.00
Anteile an Private Equity Portfolios	0.00	0.00
Andere Wertpapiere und Wertrechte	402'156'711.49	318'220'828.26
Sonstige, den Wertpapieren gleichgestellte Rechte	0.00	0.00
Anteile an anderen Portfolios	0.00	0.00
<b>Derivative Finanzinstrumente</b>	<b>-2'454'892.25</b>	<b>-66'705'584.77</b>
<b>Guthaben bei Banken, Postcheckguthaben, Schecks, Kassa</b>	<b>94'301'705.96</b>	<b>166'752'909.08</b>
Bankguthaben auf Sicht	53'224'310.96	96'826'409.08
Bankguthaben auf Zeit	41'077'395.00	69'926'500.00
<b>Rechnungsabgrenzungsposten</b>	<b>1'715'793.70</b>	<b>2'147'003.02</b>
Sonstige Vermögenswerte	1'715'793.70	2'147'003.02
<b>Total Aktiven</b>	<b>3'536'964'808.84</b>	<b>3'795'398'623.48</b>

<b>Passiven</b>	<b>30.11.2019</b>	<b>30.11.2018</b>
	<b>CHF</b>	<b>CHF</b>
<b>Eigenkapital</b>	<b>-3'527'519'653.01</b>	<b>-3'789'790'430.49</b>
Gezeichnetes Kapital	-50'000.00	-50'000.00
Anteilscheinkapital	-3'344'352'441.37	-3'938'230'247.36
Kapitalreserven	0.00	0.00
Gewinnreserven	0.00	0.00
Gesetzliche Reserven	0.00	0.00
Reserve für eigene Aktien oder Anteile	0.00	0.00
Statuarische Reserven	0.00	0.00
Sonstige Reserven	0.00	0.00
Gewinnvortrag / Verlustvortrag	0.00	0.00
Jahresgewinn / Jahresverlust (gezeichnetes Kapital)	0.00	0.00
Jahresgewinn / Jahresverlust (Anteilscheinkapital)	-183'117'211.64	148'489'816.87
<b>Rückstellungen</b>	<b>-3'600.00</b>	<b>-3'600.00</b>
Steuerrückstellungen	-3'600.00	-3'600.00
Sonstige Rückstellungen	0.00	0.00
<b>Verbindlichkeiten (bis 1 Jahr)</b>	<b>-4'907'210.70</b>	<b>-479'469.67</b>
Verbindlichkeiten gegenüber Banken	-4'907'210.70	-479'469.67
Verbindlichkeiten aus Lieferungen und Leistungen	0.00	0.00
Verbindlichkeiten gegenüber verbundenen Unternehmen	0.00	0.00
Sonstige Verbindlichkeiten	0.00	0.00
<b>Rechnungsabgrenzungsposten</b>	<b>-4'534'345.13</b>	<b>-5'125'123.32</b>
<b>Total Passiven</b>	<b>-3'536'964'808.84</b>	<b>-3'795'398'623.48</b>

## Konsolidierte Erfolgsrechnung vom 01.06.2019 bis 30.11.2019

<b>Aufwendungen</b>	<b>01.06.2019 - 30.11.2019 CHF</b>	<b>01.06.2018 - 30.11.2018 CHF</b>
<b>Aufwendungen zur Erzielung der erbrachten Leistungen</b>	<b>26'682'564.63</b>	<b>161'415'028.49</b>
Vertriebskosten an Dritte	0.00	0.00
Allgemeine Verwaltungskosten	0.00	0.00
Rechts- und Beratungsaufwand	0.00	0.00
Werbeaufwand	0.00	0.00
Sonstiger Geschäftsaufwand	0.00	0.00
Reglementarische Vergütung an die Verwaltung	0.00	0.00
Reglementarische Vergütung an die Depotbank	0.00	0.00
Performance Fee	0.00	0.00
Ausrichtung laufender Erträge bei der Rücknahme von Anteilen	-625'151.45	-977'217.96
Hedge Kosten	0.00	0.00
Sonstiger Aufwand	217'554.81	227'629.74
Entschädigungen an Gruppengesellschaften	26'901'287.12	31'437'800.88
Währungsverluste aus Konsolidierung	188'874.15	0.00
Realisierte Kapitalverluste (netto)	0.00	32'117'831.10
Nicht realisierte Kapitalverluste (netto)	0.00	98'608'984.73
<b>Zinsen und ähnliche Aufwendungen</b>	<b>16'914.11</b>	<b>30'397.02</b>
Passivzinsen	16'914.11	30'397.02
<b>Ergebnis der gewöhnlichen Geschäftstätigkeit</b>	<b>0.00</b>	<b>0.00</b>
<b>Ausserordentliche Aufwendungen</b>	<b>0.00</b>	<b>0.00</b>
<b>Steuern vom Einkommen und vom Ertrag</b>	<b>0.00</b>	<b>0.00</b>
<b>Sonstige Steuern</b>	<b>1'800.00</b>	<b>1'800.00</b>
<b>Jahresgewinn / Jahresverlust (gezeichnetes Kapital)</b>	<b>0.00</b>	<b>0.00</b>
<b>Gesamterfolg (Anteilsscheinkapital)</b>	<b>183'117'211.64</b>	<b>-148'489'816.87</b>
<b>Total Aufwendungen</b>	<b>209'818'490.38</b>	<b>12'957'408.64</b>

Erträge	01.06.2019 - 30.11.2019 CHF	01.06.2018 - 30.11.2018 CHF
<b>Nettoumsatzerlöse</b>	<b>0.00</b>	<b>0.00</b>
Vergütungen der Verwaltung	0.00	0.00
<b>Sonstige betriebliche Erträge</b>	<b>207'353'573.37</b>	<b>9'845'636.42</b>
Erträge Geldmarktinstrumente	0.00	0.00
Erträge Aktien und andere Beteiligungspapiere	3'429'932.02	4'365'785.07
Erträge Anteile anderer Investmentunternehmen	4'679'370.08	5'292'191.73
Erträge der derivativen Finanzinstrumente	0.00	0.00
Einkauf in laufende Erträge bei der Ausgabe von Anteilen	-477'667.82	-326'345.26
Erträge aus Securities Lending	35'281.44	80'276.97
Sonstige Erträge	194'738.22	100'607.46
Realisierte Kapitalgewinne (netto)	30'777'304.61	0.00
Nicht realisierte Kapitalgewinne (netto)	168'714'614.82	0.00
Währungsgewinne aus Konsolidierung	0.00	333'120.45
<b>Sonstige Zinsen und ähnliche Erträge</b>	<b>2'464'917.01</b>	<b>3'111'772.22</b>
Erträge Bankguthaben	487'209.74	863'485.27
Erträge Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen	1'977'707.27	2'248'286.95
<b>Ausserordentliche Erträge</b>	<b>0.00</b>	<b>0.00</b>
<b>Total Erträge</b>	<b>209'818'490.38</b>	<b>12'957'408.64</b>

## LGT GIM Balanced OGAW nach liechtensteinischem Recht

### Dreijahresvergleich

Per:	30.11.2019	30.11.2018	30.11.2017
Nettovermögen (USD) B	243'275'738	236'937'313	253'761'814
Anzahl Anteile im Umlauf (USD) B	17'489	18'618	19'261
Nettoinventarwert pro Anteil am Ende der Periode (USD) B	13'910.01	12'726.32	13'175.00
Nettoinventarwert pro Anteil zu Beginn der Periode (USD) B	12'726.32	13'175.00	12'075.30
Veränderung Inventarwert in Prozent gg. Vorjahr (USD) B	9.30%	-3.41%	9.11%
Nettovermögen (CHF) B	197'085'214	206'906'140	225'319'470
Anzahl Anteile im Umlauf (CHF) B	16'055	17'989	18'575
Nettoinventarwert pro Anteil am Ende der Periode (CHF) B	12'275.32	11'501.59	12'130.37
Nettoinventarwert pro Anteil zu Beginn der Periode (CHF) B	11'501.59	12'130.37	11'388.56
Veränderung Inventarwert in Prozent gg. Vorjahr (CHF) B	6.73%	-5.18%	6.51%
Nettovermögen (EUR) B	294'966'090	328'842'912	350'488'283
Anzahl Anteile im Umlauf (EUR) B	21'507	25'827	26'401
Nettoinventarwert pro Anteil am Ende der Periode (EUR) B	13'714.68	12'732.75	13'275.74
Nettoinventarwert pro Anteil zu Beginn der Periode (EUR) B	12'732.75	13'275.74	12'679.27
Veränderung Inventarwert in Prozent gg. Vorjahr (EUR) B	7.71%	-4.09%	4.70%
Nettovermögen (USD) B1	686'986	628'526	n.a.
Anzahl Anteile im Umlauf (USD) B1	65	65	n.a.
Nettoinventarwert pro Anteil am Ende der Periode (USD) B1	10'570.31	9'670.81	n.a.
Nettoinventarwert pro Anteil zu Beginn der Periode (USD) B1	9'670.81	10'000.00 <sup>1</sup>	n.a.
Veränderung Inventarwert in Prozent gg. Vorjahr (USD) B1	9.30%	-3.29% <sup>1</sup>	n.a.
Nettovermögen (USD) IM	22'238'146	20'127'851	20'575'381
Anzahl Anteile im Umlauf (USD) IM	1'388	1'394	1'397
Nettoinventarwert pro Anteil am Ende der Periode (USD) IM	16'016.88	14'438.92	14'728.26
Nettoinventarwert pro Anteil zu Beginn der Periode (USD) IM	14'438.92	14'728.26	13'300.95
Veränderung Inventarwert in Prozent gg. Vorjahr (USD) IM	10.93%	-1.96%	10.73%
Nettovermögen (CHF) IM	4'308'553	3'977'567	3'905'646
Anzahl Anteile im Umlauf (CHF) IM	378	378	357
Nettoinventarwert pro Anteil am Ende der Periode (CHF) IM	11'404.77	10'528.65	10'940.19
Nettoinventarwert pro Anteil zu Beginn der Periode (CHF) IM	10'528.65	10'940.19	10'121.06
Veränderung Inventarwert in Prozent gg. Vorjahr (CHF) IM	8.32%	-3.76%	8.09%

<sup>1</sup> Seit Lancierung am 04.12.2017

Der Fonds verzichtet auf einen Benchmark, da kein vergleichbarer Index existiert.

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

## Vermögensrechnung per 30.11.2019

	<b>30.11.2019</b>
<b>Verkehrswerte</b>	<b>USD</b>
Bankguthaben	
auf Sicht	12'523'885.77
auf Zeit	12'000'000.00
Wertpapiere	
Anlagefonds	674'209'868.77
Andere Wertpapiere und Wertrechte	96'312'704.86
Derivative Finanzinstrumente	-163'168.37
Sonstige Vermögenswerte	87'377.62
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>794'970'668.65</b>
Verbindlichkeiten	-2'050'173.35
<b>Nettovermögen</b>	<b>792'920'495.30</b>



## Erfolgsrechnung für die Zeit vom 01.06.2019 bis 30.11.2019

<b>Ertrag</b>	<b>30.11.2019 USD</b>
Erträge der Bankguthaben	117'976.26
Erträge der Wertpapiere	
Anteile anderer Investmentunternehmen	483'551.07
Einkauf in laufende Erträge bei der Ausgabe von Anteilen	-167'502.66
<b>Total Ertrag</b>	<b>434'024.67</b>
<b>Aufwand</b>	<b>30.11.2019 USD</b>
Passivzinsen	166.04
Reglementarische Vergütungen	6'161'546.25
Sonstige Aufwendungen	20'687.70
Ausrichtung laufender Erträge bei der Rücknahme von Anteilen	-246'041.24
<b>Total Aufwand</b>	<b>5'936'358.75</b>
<b>Nettoertrag</b>	<b>-5'502'334.08</b>
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste	2'987'927.33
<b>Realisierter Erfolg</b>	<b>-2'514'406.75</b>
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste	42'381'342.92
<b>Gesamterfolg</b>	<b>39'866'936.17</b>

## Veränderung des Nettovermögens

	<b>30.11.2019</b>
	<b>USD</b>
Nettovermögen zu Beginn der Berichtsperiode	781'315'700.03
Ausschüttungen	0.00
Saldo aus dem Anteilverkehr	-28'262'140.90
Gesamterfolg	39'866'936.17
<b>Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode</b>	<b>792'920'495.30</b>

## Entwicklung der Anteile im Umlauf

	<b>30.11.2019</b>
	<b>Anzahl</b>
LGT GIM Balanced (USD) B	
Bestand Anzahl Anteile zu Beginn der Berichtsperiode	18'361.522
Ausgegebene Anteile	1'046.066
Zurückgenommene Anteile	-1'918.335
<b>Bestand Anzahl Anteile am Ende der Berichtsperiode</b>	<b>17'489.253</b>

	<b>30.11.2019</b>
	<b>Anzahl</b>
LGT GIM Balanced (CHF) B	
Bestand Anzahl Anteile zu Beginn der Berichtsperiode	16'821.306
Ausgegebene Anteile	776.591
Zurückgenommene Anteile	-1'542.500
<b>Bestand Anzahl Anteile am Ende der Berichtsperiode</b>	<b>16'055.397</b>

	<b>30.11.2019</b>
	<b>Anzahl</b>
LGT GIM Balanced (EUR) B	
Bestand Anzahl Anteile zu Beginn der Berichtsperiode	22'064.887
Ausgegebene Anteile	1'023.592
Zurückgenommene Anteile	-1'581.159
<b>Bestand Anzahl Anteile am Ende der Berichtsperiode</b>	<b>21'507.320</b>

	<b>30.11.2019</b>
	<b>Anzahl</b>
LGT GIM Balanced (USD) B1	
Bestand Anzahl Anteile zu Beginn der Berichtsperiode	64.992
Ausgegebene Anteile	0.000
Zurückgenommene Anteile	0.000
<b>Bestand Anzahl Anteile am Ende der Berichtsperiode</b>	<b>64.992</b>

	<b>30.11.2019</b>
	<b>Anzahl</b>
LGT GIM Balanced (USD) IM	
Bestand Anzahl Anteile zu Beginn der Berichtsperiode	1'394.000
Ausgegebene Anteile	19.419
Zurückgenommene Anteile	-25.000
<b>Bestand Anzahl Anteile am Ende der Berichtsperiode</b>	<b>1'388.419</b>

**30.11.2019**  
**Anzahl**

LGT GIM Balanced (CHF) IM	
Bestand Anzahl Anteile zu Beginn der Berichtsperiode	355.785
Ausgegebene Anteile	34.000
Zurückgenommene Anteile	-12.000
<b>Bestand Anzahl Anteile am Ende der Berichtsperiode</b>	<b>377.785</b>

## Inventar des Fondsvermögens

Bezeichnung	Laufzeit	Bestand 31.05.2019 Anzahl/ Nominal	Kauf <sup>1</sup>	Verkauf <sup>2</sup>	Bestand 30.11.2019 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert in USD <sup>3</sup>	in % <sup>3</sup>
<b>Wertpapiere</b>							
<b>Anlagefonds</b>							
AGX Convergence A USD		0	19'315	0	19'315	24'244'695.38	3.06
Crown CMF A USD		19'117	0	12'350	6'767	7'668'582.33	0.97
Crown LGT Select Bond EMMA A USD		22'183	640	5'680	17'143	20'798'630.45	2.62
Crown Listed Priv Eq O EUR		94'521	0	12'000	82'521	24'716'438.61	3.12
LGT AGX UCITS A USD		11'482	0	11'482	0	0.00	0.00
LGT Crown Liquid Private Equity Opp S		75'500	0	0	75'500	9'317'455.00	1.18
LGT Dyn Pr U A USD		18'158	0	1'670	16'488	16'725'938.33	2.11
LGT Select Bond Emerging Markets (USD) IM		16'181	0	0	16'181	29'851'679.66	3.76
LGT Select Bond High Yield (USD) IM		14'817	0	834	13'983	32'816'562.87	4.14
LGT Select Cat Bond (USD) IM		13'400	0	0	13'400	16'704'708.00	2.11
LGT Select Equity Asia/Pacific ex Jap (USD) IM		6'400	0	0	6'400	13'867'584.00	1.75
LGT Select Equity Emerging Markets (USD) IM		19'940	0	3'600	16'340	29'623'929.80	3.74
LGT Select Equity EMV (USD) IM		19'479	0	1'490	17'989	48'250'848.43	6.09
LGT Select Equity Europe (EUR) IM		11'545	0	0	11'545	23'388'153.90	2.95
LGT Select Equity Global (USD) IM		4'895	0	0	4'895	8'747'854.50	1.10
LGT Select Equity Japan (JPY) IM		1'727'600	0	265'000	1'462'600	19'061'808.46	2.40
LGT Select Equity North America (USD) IM		21'245	1'400	0	22'645	71'786'235.15	9.05
LGT Select REITS (USD) IM		21'769	1'500	969	22'300	41'546'238.00	5.24
LGT Sustainable Equity Europe Sub-Fd B (EUR)		6'150	0	0	6'150	7'806'396.34	0.98
LGT Sustainable Equity Global Sub-Fd B (EUR)		6'540	1'000	2'500	5'040	7'117'271.61	0.90
LGT Sustainable Quality Eq Hdg Sub-Fd B (USD)		9'500	0	1'230	8'270	12'172'364.90	1.54
MA Sustainable Money Market Fund (USD) IM		25'800	1'200	18'800	8'200	8'526'852.00	1.08
MA Sustainable Portfolio Corp Bds (USD) IM		20'205	1'350	788	20'767	39'602'253.66	4.99
MA Sustainable Portfolio Governm Bds (USD) IM		46'099	0	3'700	42'399	54'708'701.67	6.90
MA Sustainable Portfolio Infl Linked Bds (USD) IM		54'235	0	1'500	52'735	65'950'329.72	8.32
Ut iShs MSCI AC Fa USD		132'500	18'000	28'000	122'500	6'501'075.00	0.82
Ut iShs MSCI EM USD		70'500	94'000	133'000	31'500	886'410.00	0.11
Ut iShs S&P 500 USD		68'550	10'400	18'900	60'050	18'742'806.00	2.36
Ut Van USD EM Gov USD		442'500	0	189'000	253'500	13'078'065.00	1.65
<b>Total Anlagefonds</b>						<b>674'209'868.77</b>	<b>85.03</b>

### Andere Wertpapiere und Wertrechte

Andere Wertpapiere und Wertrechte, die an einer Börse gehandelt werden

#### USD

WTM LBMA Gold		0	214'000	0	214'000	30'228'570.00	3.81
WTM Phys Gold		0	227'500	227'500	0	0.00	0.00
<b>Total Andere Wertpapiere und Wertrechte, die an einer Börse gehandelt werden</b>						<b>30'228'570.00</b>	<b>3.81</b>

Bezeichnung	Laufzeit	Bestand		Kauf <sup>1</sup>	Verkauf <sup>2</sup>	Bestand		Verkehrswert in USD <sup>3</sup>	in % <sup>3</sup>
		31.05.2019	Anzahl/ Nominal			30.11.2019	Anzahl/ Nominal		

*Andere Wertpapiere und Wertrechte, die an einem anderen dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden*

#### USD

SS Ct/LGT Crown Alpha Sub-Fd C WFM		21'899	1'971	0	23'870	31'976'381.14	4.03
SS Ct/LGT SEL EQ EM LEA IM WFM		7'772	0	0	7'772	10'025'669.07	1.26
SS Ct/LGT SEL ILS USD IM WFM		19'752	0	0	19'752	24'082'084.65	3.04
<b>Total Andere Wertpapiere und Wertrechte, die an einem anderen dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden</b>						<b>66'084'134.86</b>	<b>8.34</b>

<b>Total Wertpapiere</b>						<b>770'522'573.63</b>	<b>97.18</b>
--------------------------	--	--	--	--	--	-----------------------	--------------

Total Wertpapiere						770'522'573.63	97.18
Bankguthaben auf Sicht						12'523'885.77	1.58
Bankguthaben auf Zeit						12'000'000.00	1.51
Derivative Finanzinstrumente						-163'168.37	-0.02
Sonstige Vermögenswerte						87'377.62	0.01
<b>Gesamtvermögen per 30.11.2019</b>						<b>794'970'668.65</b>	<b>100.26</b>
Verbindlichkeiten						-2'050'173.35	-0.26
<b>Nettovermögen per 30.11.2019</b>						<b>792'920'495.30</b>	<b>100.00</b>

## Derivative Finanzinstrumente

### Am Ende der Berichtsperiode offene derivative Finanzinstrumente

#### Devisentermingeschäfte

Währung		Betrag	gegen	Gegenwert	Verfall	Gegenpartei	Verkehrswert in USD <sup>3</sup>	in % <sup>3</sup>
CHF	Kauf	33'400.00	USD	33'519.33	11.12.2019	LGT Bank AG	-73.54	0.00
CHF	Kauf	4'500.00	USD	4'574.94	11.12.2019	LGT Bank AG	-68.77	0.00
CHF	Kauf	56'200.00	USD	56'621.83	11.12.2019	LGT Bank AG	-344.79	0.00
CHF	Kauf	1'850'000.00	USD	1'882'951.65	11.12.2019	LGT Bank AG	-30'415.53	0.00
CHF	Kauf	3'148'630.00	USD	3'169'415.02	11.12.2019	LGT Bank AG	-16'468.64	0.00
CHF	Kauf	147'356'500.00	USD	148'329'243.18	11.12.2019	LGT Bank AG	-770'735.58	-0.10
CHF	Kauf	2'600'000.00	USD	2'619'515.39	11.12.2019	LGT Bank AG	-15'951.11	0.00
CHF	Kauf	1'440'000.00	USD	1'445'144.72	11.12.2019	LGT Bank AG	-3'170.66	0.00
CHF	Kauf	38'900.00	USD	39'198.69	11.12.2019	LGT Bank AG	-245.36	0.00
EUR	Kauf	212'353'500.00	USD	235'155'594.12	11.12.2019	LGT Bank AG	-857'483.43	-0.11
EUR	Kauf	3'930'000.00	USD	4'371'849.90	11.12.2019	LGT Bank AG	-35'723.70	0.00
EUR	Kauf	1'277'000.00	USD	1'407'586.02	11.12.2019	LGT Bank AG	1'379.16	0.00
EUR	Kauf	6'185'000.00	USD	6'836'521.72	11.12.2019	LGT Bank AG	-12'363.82	0.00
EUR	Kauf	535'000.00	USD	598'194.20	11.12.2019	LGT Bank AG	-7'907.30	0.00
CHF	Verkauf	8'685'051.00	USD	8'742'383.55	11.12.2019	LGT Bank AG	45'426.42	0.01
CHF	Verkauf	230'000.00	USD	233'830.14	11.12.2019	LGT Bank AG	3'514.84	0.00
CHF	Verkauf	600'000.00	USD	610'687.02	11.12.2019	LGT Bank AG	9'864.49	0.00
CHF	Verkauf	1'060'000.00	USD	1'074'625.66	11.12.2019	LGT Bank AG	13'172.53	0.00
CHF	Verkauf	3'410'000.00	USD	3'463'792.70	11.12.2019	LGT Bank AG	49'118.01	0.01
CHF	Verkauf	1'400'000.00	USD	1'410'821.00	11.12.2019	LGT Bank AG	8'901.77	0.00
CHF	Verkauf	71'500.00	USD	72'627.91	11.12.2019	LGT Bank AG	1'029.89	0.00
CHF	Verkauf	26'000.00	USD	26'463.10	11.12.2019	LGT Bank AG	427.46	0.00
CHF	Verkauf	22'400.00	USD	22'709.07	11.12.2019	LGT Bank AG	278.36	0.00
EUR	Verkauf	890'000.00	USD	987'196.90	11.12.2019	LGT Bank AG	5'224.30	0.00
EUR	Verkauf	27'653'000.00	USD	30'622'323.83	11.12.2019	LGT Bank AG	111'662.81	0.01
EUR	Verkauf	1'000'000.00	USD	1'109'210.00	11.12.2019	LGT Bank AG	5'870.00	0.00
EUR	Verkauf	4'000'000.00	USD	4'472'200.00	11.12.2019	LGT Bank AG	58'840.00	0.01
EUR	Verkauf	1'800'000.00	USD	2'012'490.00	11.12.2019	LGT Bank AG	26'478.00	0.00
EUR	Verkauf	4'850'000.00	USD	5'421'718.00	11.12.2019	LGT Bank AG	70'519.00	0.01
GBP	Verkauf	10'340'000.00	USD	13'213'889.26	11.12.2019	LGT Bank AG	-162'855.00	-0.02
HKD	Verkauf	56'520'000.00	USD	7'208'809.44	11.12.2019	LGT Bank AG	-11'432.07	0.00
JPY	Verkauf	3'400'835'000.00	USD	31'389'696.00	11.12.2019	LGT Bank AG	310'650.47	0.04
<b>Total Devisentermingeschäfte</b>							<b>-1'202'881.79</b>	<b>-0.15</b>

## Am Ende der Berichtsperiode offene engagementerhöhende Derivate

### Futures

Bezeichnung	Anzahl Kontrakte	Kontraktgrösse	Verfall	Gegenpartei	Kontraktwert in USD	Verkehrswert in USD <sup>3</sup>	in % <sup>3</sup>
Mini S&P 500 DEC 19	157	50.00	20.12.2019	CME	24'678'437.50	1'098'607.50	0.14
MSCI EM DEC 19	151	50.00	20.12.2019	ICE US	7'836'900.00	-58'894.08	-0.01
<b>Total</b>					<b>32'515'337.50</b>	<b>1'039'713.42</b>	<b>0.13</b>
<b>Total am Ende der Berichtsperiode offene derivative Finanzinstrumente</b>						<b>-163'168.37</b>	<b>-0.02</b>

## Während der Berichtsperiode getätigte derivative Finanzinstrumente

### Devisentermingeschäfte

Verfall	Kauf	Verkauf	Kauf Betrag	Verkauf Betrag
06.06.2019	USD	EUR	2'128'000.00	1'900'000.00
05.07.2019	USD	JPY	1'458'371.79	158'000'000.00
24.07.2019	CHF	USD	400'000.00	407'207.57
24.07.2019	CHF	USD	2'855'000.00	2'858'773.58
24.07.2019	CHF	USD	150'800'000.00	150'999'319.10
24.07.2019	CHF	USD	55'000.00	55'654.50
24.07.2019	CHF	USD	174'000.00	176'813.10
24.07.2019	CHF	USD	16'800.00	16'606.04
24.07.2019	CHF	USD	25'253'051.00	25'533'924.17
24.07.2019	CHF	USD	9'550.00	9'854.91
24.07.2019	CHF	USD	2'240'000.00	2'262'740.54
24.07.2019	CHF	USD	790'000.00	790'941.22
24.07.2019	CHF	USD	18'250.00	18'396.99
24.07.2019	CHF	USD	625'000.00	630'033.97
24.07.2019	CHF	USD	950'000.00	940'128.65
24.07.2019	CHF	USD	323'000.00	328'222.01
24.07.2019	CHF	USD	2'000'000.00	2'023'799.89
24.07.2019	CHF	USD	380'000.00	375'612.84
24.07.2019	CHF	USD	466'000.00	480'878.38
24.07.2019	CHF	USD	800'000.00	790'763.88
24.07.2019	CHF	USD	43'700.00	44'143.64
24.07.2019	CHF	USD	13'150.00	13'386.95
24.07.2019	EUR	USD	3'600'000.00	4'087'800.00
24.07.2019	EUR	USD	3'100'000.00	3'521'321.00
24.07.2019	EUR	USD	665'000.00	759'303.65
24.07.2019	EUR	USD	2'710'000.00	3'053'682.20
24.07.2019	EUR	USD	1'125'000.00	1'263'375.00
24.07.2019	EUR	USD	595'000.00	674'997.75
24.07.2019	EUR	USD	13'760'000.00	15'711'305.60
24.07.2019	EUR	USD	175'000.00	196'987.00
24.07.2019	EUR	USD	917'000.00	1'031'230.69
24.07.2019	EUR	USD	440'000.00	493'838.40
24.07.2019	EUR	USD	940'000.00	1'055'018.40
24.07.2019	EUR	USD	28'703'000.00	32'176'063.00
24.07.2019	EUR	USD	220'490'000.00	251'247'914.02
24.07.2019	EUR	USD	1'750'000.00	1'968'015.00
24.07.2019	GBP	USD	1'200'000.00	1'577'976.00
24.07.2019	GBP	USD	10'580'000.00	13'124'490.00
24.07.2019	HKD	USD	66'020'000.00	8'449'154.06
24.07.2019	JPY	USD	156'400'000.00	1'429'642.22
24.07.2019	JPY	USD	77'000'000.00	713'379.10
24.07.2019	JPY	USD	150'000'000.00	1'386'513.84
24.07.2019	JPY	USD	3'490'700'000.00	32'243'672.64
24.07.2019	NOK	USD	141'285'000.00	16'735'289.03
24.07.2019	USD	CHF	16'673.17	16'670.00
24.07.2019	USD	CHF	125'470.51	125'000.00



Verfall	Kauf	Verkauf	Kauf Betrag	Verkauf Betrag
24.07.2019	USD	CHF	5'005.96	5'000.00
24.07.2019	USD	CHF	172'318.45	174'500.00
24.07.2019	USD	CHF	1'994'355.97	2'000'000.00
24.07.2019	USD	CHF	3'150'131.45	3'115'480.00
24.07.2019	USD	CHF	395'843.64	400'000.00
24.07.2019	USD	CHF	13'034.98	13'200.00
24.07.2019	USD	CHF	22'821.18	22'700.00
24.07.2019	USD	CHF	2'970'564.41	2'970'000.00
24.07.2019	USD	CHF	1'066'975.58	1'050'000.00
24.07.2019	USD	CHF	12'365.01	12'400.00
24.07.2019	USD	CHF	25'834'101.01	25'800'000.00
24.07.2019	USD	CHF	151'178'463.09	149'515'500.00
24.07.2019	USD	CHF	1'291'859.78	1'285'000.00
24.07.2019	USD	CHF	764'910.24	764'000.00
24.07.2019	USD	EUR	199'432.98	177'000.00
24.07.2019	USD	EUR	641'010.60	570'000.00
24.07.2019	USD	EUR	590'352.00	525'000.00
24.07.2019	USD	EUR	400'021.10	355'000.00
24.07.2019	USD	EUR	726'982.40	640'000.00
24.07.2019	USD	EUR	2'674'299.43	2'365'000.00
24.07.2019	USD	EUR	33'957'040.40	29'800'000.00
24.07.2019	USD	EUR	1'374'622.80	1'220'000.00
24.07.2019	USD	EUR	245'659'303.00	219'143'000.00
24.07.2019	USD	EUR	1'124'520.00	1'000'000.00
24.07.2019	USD	EUR	10'023'158.75	8'875'000.00
24.07.2019	USD	EUR	16'237'650.00	14'300'000.00
24.07.2019	USD	GBP	15'431'658.64	11'780'000.00
24.07.2019	USD	HKD	8'430'317.53	66'020'000.00
24.07.2019	USD	JPY	33'959'871.57	3'776'100'000.00
24.07.2019	USD	JPY	906'308.09	98'000'000.00
24.07.2019	USD	NOK	16'464'864.23	141'285'000.00
23.10.2019	CHF	USD	74'500.00	76'589.36
23.10.2019	CHF	USD	8'685'051.00	8'709'437.42
23.10.2019	CHF	USD	2'140'000.00	2'173'184.53
23.10.2019	CHF	USD	750'000.00	778'137.45
23.10.2019	CHF	USD	27'300.00	27'679.49
23.10.2019	CHF	USD	3'800.00	3'850.09
23.10.2019	CHF	USD	878'000.00	891'614.96
23.10.2019	CHF	USD	3'115'480.00	3'176'150.83
23.10.2019	CHF	USD	140'000.00	145'252.32
23.10.2019	CHF	USD	169'000.00	171'345.72
23.10.2019	CHF	USD	22'700.00	22'936.94
23.10.2019	CHF	USD	9'000.00	9'337.65
23.10.2019	CHF	USD	15'700'000.00	15'873'818.31
23.10.2019	CHF	USD	149'515'500.00	152'427'163.68
23.10.2019	CHF	USD	1'150'000.00	1'165'985.66
23.10.2019	CHF	USD	23'350.00	23'943.32
23.10.2019	CHF	USD	10'000.00	10'138.80
23.10.2019	CHF	USD	310'000.00	313'235.73
23.10.2019	EUR	USD	700'000.00	770'728.00
23.10.2019	EUR	USD	1'550'000.00	1'709'402.00

Verfall	Kauf	Verkauf	Kauf Betrag	Verkauf Betrag
23.10.2019	EUR	USD	480'000.00	529'046.40
23.10.2019	EUR	USD	1'473'000.00	1'651'012.05
23.10.2019	EUR	USD	27'653'000.00	30'520'616.10
23.10.2019	EUR	USD	950'000.00	1'068'759.50
23.10.2019	EUR	USD	500'000.00	564'045.00
23.10.2019	EUR	USD	1'220'000.00	1'333'496.60
23.10.2019	EUR	USD	219'143'000.00	247'417'268.15
23.10.2019	EUR	USD	118'000.00	130'919.82
23.10.2019	EUR	USD	700'000.00	770'371.00
23.10.2019	GBP	USD	240'000.00	295'972.80
23.10.2019	GBP	USD	10'340'000.00	13'193'840.00
23.10.2019	HKD	USD	56'520'000.00	7'205'874.85
23.10.2019	JPY	USD	113'215'000.00	1'059'837.30
23.10.2019	JPY	USD	116'650'000.00	1'106'200.98
23.10.2019	JPY	USD	3'400'835'000.00	31'297'947.73
23.10.2019	JPY	USD	101'500'000.00	940'337.22
23.10.2019	JPY	USD	84'000'000.00	796'034.99
23.10.2019	NOK	USD	141'285'000.00	16'501'399.61
23.10.2019	USD	CHF	762'668.44	759'000.00
23.10.2019	USD	CHF	13'602.84	13'500.00
23.10.2019	USD	CHF	34'116.99	33'000.00
23.10.2019	USD	CHF	3'157'470.92	3'148'630.00
23.10.2019	USD	CHF	25'744'828.72	25'253'051.00
23.10.2019	USD	CHF	205'081.93	200'000.00
23.10.2019	USD	CHF	637'556.60	635'000.00
23.10.2019	USD	CHF	655'582.73	638'000.00
23.10.2019	USD	CHF	767'932.75	760'000.00
23.10.2019	USD	CHF	72'100.98	71'000.00
23.10.2019	USD	CHF	502.42	500.00
23.10.2019	USD	CHF	147'770'256.72	147'356'500.00
23.10.2019	USD	CHF	668'229.30	650'000.00
23.10.2019	USD	CHF	1'736'864.96	1'680'000.00
23.10.2019	USD	CHF	15'413.39	15'000.00
23.10.2019	USD	CHF	4'518.12	4'500.00
23.10.2019	USD	CHF	720'372.04	711'000.00
23.10.2019	USD	CHF	801'055.98	795'000.00
23.10.2019	USD	EUR	806'584.35	715'000.00
23.10.2019	USD	EUR	1'339'284.00	1'200'000.00
23.10.2019	USD	EUR	32'406'318.47	28'703'000.00
23.10.2019	USD	EUR	873'648.00	800'000.00
23.10.2019	USD	EUR	838'287.60	760'000.00
23.10.2019	USD	EUR	726'686.40	660'000.00
23.10.2019	USD	EUR	2'812'525.00	2'500'000.00
23.10.2019	USD	EUR	234'374'557.95	212'353'500.00
23.10.2019	USD	EUR	5'777'782.50	5'250'000.00
23.10.2019	USD	EUR	76'444.20	70'000.00
23.10.2019	USD	EUR	948'442.40	860'000.00
23.10.2019	USD	EUR	672'355.95	595'000.00
23.10.2019	USD	EUR	22'850.12	20'500.00
23.10.2019	USD	GBP	13'176'808.10	10'580'000.00
23.10.2019	USD	HKD	8'453'695.85	66'020'000.00

Verfall	Kauf	Verkauf	Kauf Betrag	Verkauf Betrag
23.10.2019	USD	JPY	32'457'618.29	3'490'700'000.00
23.10.2019	USD	JPY	954'116.54	100'000'000.00
23.10.2019	USD	JPY	900'240.37	97'000'000.00
23.10.2019	USD	JPY	1'202'597.99	128'500'000.00
23.10.2019	USD	NOK	15'658'838.26	141'285'000.00
24.10.2019	HKD	USD	9'500'000.00	1'212'477.03

## Während der Berichtsperiode getätigte engagementerhöhende Derivate

### Futures

Bezeichnung	Verfall	Käufe/Kontrakte	Verkäufe/Kontrakte
Mini S&P 500 Jun 19	21.06.2019	0	95
Mini S&P 500 Sep 19	20.09.2019	203	203
TOPIX DEC 19	13.12.2019	56	56
TOPIX Sep 19	13.09.2019	56	56

1 Kauf umfasst die Transaktionen: Gratistitel / Käufe / Konversionen / Namensänderungen / "Splits" / Stock- / Wahldividenden / Titelaufteilungen / Überträge / Umbuchungen in Folge Redenominierung in Euro / Umtausch zwischen Gesellschaften / Zuteilungen aus Bezugs- / Optionsrechten / Zuteilung von Bezugsrechten auf Basistiteln

2 Verkauf umfasst die Transaktionen: Auslosungen / Ausbuchung in Folge Verfall / Ausübung von Bezugs- / Optionsrechten / "Reverse Splits" / Überträge / Umbuchungen in Folge Redenominierung in Fondswährung / Umtausch zwischen Gesellschaften / Verkäufe / Rückzahlungen

3 Allfällige Abweichungen in den Totalisierungen sind auf Rundungsdifferenzen zurückzuführen

## LGT GIM Growth OGAW nach liechtensteinischem Recht

### Dreijahresvergleich

Per:	30.11.2019	30.11.2018	30.11.2017
Nettovermögen (USD) B	328'807'821	354'968'575	360'741'732
Anzahl Anteile im Umlauf (USD) B	21'737	25'898	25'290
Nettoinventarwert pro Anteil am Ende der Periode (USD) B	15'126.55	13'706.44	14'264.46
Nettoinventarwert pro Anteil zu Beginn der Periode (USD) B	13'706.44	14'264.46	12'753.79
Veränderung Inventarwert in Prozent gg. Vorjahr (USD) B	10.36%	-3.91%	11.84%
Nettovermögen (CHF) B	173'288'129	190'152'268	211'259'526
Anzahl Anteile im Umlauf (CHF) B	12'958	15'344	16'096
Nettoinventarwert pro Anteil am Ende der Periode (CHF) B	13'373.20	12'392.55	13'125.34
Nettoinventarwert pro Anteil zu Beginn der Periode (CHF) B	12'392.55	13'125.34	12'034.34
Veränderung Inventarwert in Prozent gg. Vorjahr (CHF) B	7.91%	-5.58%	9.07%
Nettovermögen (CZK) B	85'838'706	54'906'970	n.a.
Anzahl Anteile im Umlauf (CZK) B	361	254	n.a.
Nettoinventarwert pro Anteil am Ende der Periode (CZK) B	237'928.64	216'311.39	n.a.
Nettoinventarwert pro Anteil zu Beginn der Periode (CZK) B	216'311.39	220'914.91 <sup>1</sup>	n.a.
Veränderung Inventarwert in Prozent gg. Vorjahr (CZK) B	9.99%	-2.08% <sup>1</sup>	n.a.
Nettovermögen (EUR) B	341'268'399	353'880'724	368'033'213
Anzahl Anteile im Umlauf (EUR) B	22'480	25'397	25'256
Nettoinventarwert pro Anteil am Ende der Periode (EUR) B	15'181.05	13'934.09	14'571.93
Nettoinventarwert pro Anteil zu Beginn der Periode (EUR) B	13'934.09	14'571.93	13'610.43
Veränderung Inventarwert in Prozent gg. Vorjahr (EUR) B	8.95%	-4.38%	7.06%
Nettovermögen (USD) IM	26'288'331	22'655'132	23'216'851
Anzahl Anteile im Umlauf (USD) IM	1'480	1'431	1'433
Nettoinventarwert pro Anteil am Ende der Periode (USD) IM	17'767.55	15'831.68	16'201.57
Nettoinventarwert pro Anteil zu Beginn der Periode (USD) IM	15'831.68	16'201.57	14'244.93
Veränderung Inventarwert in Prozent gg. Vorjahr (USD) IM	12.23%	-2.28%	13.74%
Nettovermögen (CHF) IM	6'827'507	5'412'564	4'239'965
Anzahl Anteile im Umlauf (CHF) IM	564	491	369
Nettoinventarwert pro Anteil am Ende der Periode (CHF) IM	12'106.67	11'033.82	11'488.12
Nettoinventarwert pro Anteil zu Beginn der Periode (CHF) IM	11'033.82	11'488.12	10'357.53
Veränderung Inventarwert in Prozent gg. Vorjahr (CHF) IM	9.72%	-3.95%	10.92%

<sup>1</sup> Seit Lancierung am 10.09.2018

Der Fonds verzichtet auf einen Benchmark, da kein vergleichbarer Index existiert.

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

## Vermögensrechnung per 30.11.2019

	<b>30.11.2019</b>
<b>Verkehrswerte</b>	<b>USD</b>
Bankguthaben	
auf Sicht	8'360'985.91
auf Zeit	25'000'000.00
Wertpapiere	
Anlagefonds	774'975'049.38
Andere Wertpapiere und Wertrechte	109'176'595.91
Derivative Finanzinstrumente	96'575.46
Sonstige Vermögenswerte	126'566.80
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>917'735'773.46</b>
Verbindlichkeiten	-2'454'032.70
<b>Nettovermögen</b>	<b>915'281'740.76</b>

## Erfolgsrechnung für die Zeit vom 01.06.2019 bis 30.11.2019

<b>Ertrag</b>	<b>30.11.2019 USD</b>
Erträge der Bankguthaben	167'847.88
Erträge der Wertpapiere	
Anteile anderer Investmentunternehmen	600'304.51
Einkauf in laufende Erträge bei der Ausgabe von Anteilen	-170'736.07
<b>Total Ertrag</b>	<b>597'416.32</b>
<b>Aufwand</b>	<b>30.11.2019 USD</b>
Passivzinsen	398.50
Reglementarische Vergütungen	7'870'528.76
Sonstige Aufwendungen	23'247.26
Ausrichtung laufender Erträge bei der Rücknahme von Anteilen	-228'361.59
<b>Total Aufwand</b>	<b>7'665'812.93</b>
<b>Nettoertrag</b>	<b>-7'068'396.61</b>
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste	6'711'527.76
<b>Realisierter Erfolg</b>	<b>-356'868.85</b>
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste	56'485'889.86
<b>Gesamterfolg</b>	<b>56'129'021.01</b>

## Veränderung des Nettovermögens

	<b>30.11.2019</b>
	<b>USD</b>
Nettovermögen zu Beginn der Berichtsperiode	881'289'589.29
Ausschüttungen	0.00
Saldo aus dem Anteilverkehr	-22'136'869.54
Gesamterfolg	56'129'021.01
<b>Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode</b>	<b>915'281'740.76</b>

## Entwicklung der Anteile im Umlauf

	<b>30.11.2019</b>
	<b>Anzahl</b>
LGT GIM Growth (USD) B	
Bestand Anzahl Anteile zu Beginn der Berichtsperiode	22'311.182
Ausgegebene Anteile	1'479.474
Zurückgenommene Anteile	-2'053.525
<b>Bestand Anzahl Anteile am Ende der Berichtsperiode</b>	<b>21'737.131</b>

	<b>30.11.2019</b>
	<b>Anzahl</b>
LGT GIM Growth (CHF) B	
Bestand Anzahl Anteile zu Beginn der Berichtsperiode	13'664.754
Ausgegebene Anteile	347.437
Zurückgenommene Anteile	-1'054.326
<b>Bestand Anzahl Anteile am Ende der Berichtsperiode</b>	<b>12'957.865</b>

	<b>30.11.2019</b>
	<b>Anzahl</b>
LGT GIM Growth (CZK) B	
Bestand Anzahl Anteile zu Beginn der Berichtsperiode	248.505
Ausgegebene Anteile	112.270
Zurückgenommene Anteile	0.000
<b>Bestand Anzahl Anteile am Ende der Berichtsperiode</b>	<b>360.775</b>

	<b>30.11.2019</b>
	<b>Anzahl</b>
LGT GIM Growth (EUR) B	
Bestand Anzahl Anteile zu Beginn der Berichtsperiode	22'977.778
Ausgegebene Anteile	826.380
Zurückgenommene Anteile	-1'324.260
<b>Bestand Anzahl Anteile am Ende der Berichtsperiode</b>	<b>22'479.898</b>

	<b>30.11.2019</b>
	<b>Anzahl</b>
LGT GIM Growth (USD) IM	
Bestand Anzahl Anteile zu Beginn der Berichtsperiode	1'382.000
Ausgegebene Anteile	122.570
Zurückgenommene Anteile	-25.000
<b>Bestand Anzahl Anteile am Ende der Berichtsperiode</b>	<b>1'479.570</b>



**30.11.2019**  
**Anzahl**

LGT GIM Growth (CHF) IM	
Bestand Anzahl Anteile zu Beginn der Berichtsperiode	561.367
Ausgegebene Anteile	28.579
Zurückgenommene Anteile	-26.000
<b>Bestand Anzahl Anteile am Ende der Berichtsperiode</b>	<b>563.946</b>

## Inventar des Fondsvermögens

Bezeichnung	Laufzeit	Bestand 31.05.2019 Anzahl/ Nominal	Kauf <sup>1</sup>	Verkauf <sup>2</sup>	Bestand 30.11.2019 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert in USD <sup>3</sup>	in % <sup>3</sup>
<b>Wertpapiere</b>							
<b>Anlagefonds</b>							
AGX Convergence A USD		0	21'393	0	21'393	26'852'992.90	2.93
Crown CMF A USD		19'523	0	11'900	7'623	8'638'104.97	0.94
Crown LGT Select Bond EMMA A USD		27'075	800	6'100	21'775	26'417'647.75	2.89
Crown Listed Priv Eq O EUR		181'676	0	25'600	156'076	46'747'685.77	5.11
LGT AGX UCITS A USD		13'111	0	13'111	0	0.00	0.00
LGT Crown Liquid Private Equity Opp S		85'000	0	0	85'000	10'489'850.00	1.15
LGT Dyn Pr U A USD		20'807	0	2'307	18'500	18'766'973.50	2.05
LGT Select Bond Emerging Markets (USD) IM		21'045	0	770	20'275	37'404'536.50	4.09
LGT Select Bond High Yield (USD) IM		21'050	0	1'747	19'303	45'302'017.67	4.95
LGT Select Cat Bond (USD) IM		13'380	1'500	0	14'880	18'549'705.60	2.03
LGT Select Equity Asia/Pacific ex Jap (USD) IM		9'940	0	650	9'290	20'129'664.90	2.20
LGT Select Equity Emerging Markets (USD) IM		28'880	0	400	28'480	51'633'385.60	5.64
LGT Select Equity EMV (USD) IM		29'156	0	1'810	27'346	73'349'902.34	8.01
LGT Select Equity Europe (EUR) IM		17'714	0	0	17'714	35'885'470.60	3.92
LGT Select Equity Global (USD) IM		6'260	0	0	6'260	11'187'246.00	1.22
LGT Select Equity Japan (JPY) IM		2'461'711	0	315'000	2'146'711	27'977'706.76	3.06
LGT Select Equity North America (USD) IM		33'105	1'000	0	34'105	108'115'237.35	11.81
LGT Select REITS (USD) IM		30'086	1'650	1'800	29'936	55'772'564.16	6.09
LGT Sustainable Equity Europe Sub-Fd B (EUR)		10'000	0	1'000	9'000	11'423'994.65	1.25
LGT Sustainable Equity Global Sub-Fd B (EUR)		8'200	1'000	0	9'200	12'991'845.00	1.42
LGT Sustainable Quality Eq Hdg Sub-Fd B (USD)		14'250	0	1'730	12'520	18'427'812.40	2.01
MA Sustainable Money Market Fund (USD) IM		20'000	2'500	17'000	5'500	5'719'230.00	0.62
MA Sustainable Portfolio Corp Bds (USD) IM		5'200	0	558	4'642	8'852'201.16	0.97
MA Sustainable Portfolio Governm Bds (USD) IM		7'600	0	800	6'800	8'774'244.00	0.96
MA Sustainable Portfolio Infl Linked Bds (USD) IM		23'745	0	2'717	21'028	26'297'616.80	2.87
Ut iShs MSCI AC Fa USD		129'500	20'000	0	149'500	7'933'965.00	0.87
Ut iShs MSCI EM USD		359'700	150'000	417'000	92'700	2'608'578.00	0.29
Ut iShs S&P 500 USD		108'750	14'500	24'000	99'250	30'977'910.00	3.38
Ut Van USD EM Gov USD		540'000	0	196'000	344'000	17'746'960.00	1.94
<b>Total Anlagefonds</b>						<b>774'975'049.38</b>	<b>84.67</b>

### Andere Wertpapiere und Wertrechte

Andere Wertpapiere und Wertrechte, die an einer Börse gehandelt werden

#### USD

WTM LBMA Gold		0	239'000	0	239'000	33'759'945.00	3.69
WTM Phys Gold		0	254'500	254'500	0	0.00	0.00
<b>Total Andere Wertpapiere und Wertrechte, die an einer Börse gehandelt werden</b>						<b>33'759'945.00</b>	<b>3.69</b>

Bezeichnung	Laufzeit	Bestand	Kauf <sup>1</sup>	Verkauf <sup>2</sup>	Bestand	Verkehrswert in USD <sup>3</sup>	in % <sup>3</sup>
		31.05.2019 Anzahl/ Nominal			30.11.2019 Anzahl/ Nominal		

*Andere Wertpapiere und Wertrechte, die an einem anderen dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden*

#### USD

SS Ct/LGT Crown Alpha Sub-Fd C WFM		24'802	2'426	0	27'228	36'474'847.29	3.99
SS Ct/LGT SEL EQ EM LEA IM WFM		8'631	0	0	8'631	11'132'656.09	1.22
SS Ct/LGT SEL ILS USD IM WFM		22'809	0	0	22'809	27'809'147.53	3.04
<b>Total Andere Wertpapiere und Wertrechte, die an einem anderen dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden</b>						<b>75'416'650.91</b>	<b>8.24</b>

<b>Total Wertpapiere</b>						<b>884'151'645.29</b>	<b>96.60</b>
--------------------------	--	--	--	--	--	-----------------------	--------------

Total Wertpapiere						884'151'645.29	96.60
Bankguthaben auf Sicht						8'360'985.91	0.91
Bankguthaben auf Zeit						25'000'000.00	2.73
Derivative Finanzinstrumente						96'575.46	0.01
Sonstige Vermögenswerte						126'566.80	0.01
<b>Gesamtvermögen per 30.11.2019</b>						<b>917'735'773.46</b>	<b>100.27</b>
Verbindlichkeiten						-2'454'032.70	-0.27
<b>Nettovermögen per 30.11.2019</b>						<b>915'281'740.76</b>	<b>100.00</b>

## Derivative Finanzinstrumente

### Am Ende der Berichtsperiode offene derivative Finanzinstrumente

#### Devisentermingeschäfte

Währung		Betrag	gegen	Gegenwert	Verfall	Gegenpartei	Verkehrswert in USD <sup>3</sup>	in % <sup>3</sup>
CHF	Kauf	43'200.00	USD	43'354.34	11.12.2019	LGT Bank AG	-95.12	0.00
CHF	Kauf	1'080'000.00	USD	1'083'858.54	11.12.2019	LGT Bank AG	-2'377.99	0.00
CHF	Kauf	250'000.00	USD	254'163.19	11.12.2019	LGT Bank AG	-3'820.47	0.00
CHF	Kauf	3'965'000.00	USD	4'035'623.41	11.12.2019	LGT Bank AG	-65'187.88	-0.01
CHF	Kauf	4'705'800.00	USD	4'736'864.36	11.12.2019	LGT Bank AG	-24'613.29	0.00
CHF	Kauf	1'870'000.00	USD	1'884'036.07	11.12.2019	LGT Bank AG	-11'472.53	0.00
CHF	Kauf	59'500.00	USD	59'956.87	11.12.2019	LGT Bank AG	-375.30	0.00
CHF	Kauf	12'150.00	USD	12'352.33	11.12.2019	LGT Bank AG	-185.67	0.00
CHF	Kauf	1'360'000.00	USD	1'370'442.77	11.12.2019	LGT Bank AG	-8'578.38	0.00
CHF	Kauf	83'100.00	USD	83'723.74	11.12.2019	LGT Bank AG	-509.82	0.00
CHF	Kauf	120'812'400.00	USD	121'609'917.84	11.12.2019	LGT Bank AG	-631'898.93	-0.07
CZK	Kauf	59'781'400.00	USD	2'563'007.21	11.12.2019	LGT Bank AG	17'639.12	0.00
CZK	Kauf	350'000.00	USD	15'118.28	11.12.2019	LGT Bank AG	-9.46	0.00
CZK	Kauf	840'000.00	USD	36'539.21	11.12.2019	LGT Bank AG	-278.05	0.00
CZK	Kauf	205'000.00	USD	8'984.53	11.12.2019	LGT Bank AG	-135.08	0.00
CZK	Kauf	635'000.00	USD	27'468.96	11.12.2019	LGT Bank AG	-57.25	0.00
EUR	Kauf	2'785'000.00	USD	3'099'927.80	11.12.2019	LGT Bank AG	-27'125.90	0.00
EUR	Kauf	4'200'000.00	USD	4'672'206.00	11.12.2019	LGT Bank AG	-38'178.00	0.00
EUR	Kauf	2'475'000.00	USD	2'735'714.03	11.12.2019	LGT Bank AG	-4'947.53	0.00
EUR	Kauf	234'761'750.00	USD	259'969'997.19	11.12.2019	LGT Bank AG	-947'967.94	-0.10
EUR	Kauf	1'850'000.00	USD	2'039'181.00	11.12.2019	LGT Bank AG	1'998.00	0.00
CHF	Verkauf	14'242'000.00	USD	14'336'015.59	11.12.2019	LGT Bank AG	74'491.56	0.01
CHF	Verkauf	22'500.00	USD	22'810.45	11.12.2019	LGT Bank AG	279.61	0.00
CHF	Verkauf	100'000.00	USD	101'577.50	11.12.2019	LGT Bank AG	1'440.41	0.00
CHF	Verkauf	810'200.00	USD	824'631.04	11.12.2019	LGT Bank AG	13'320.36	0.00
CHF	Verkauf	900'000.00	USD	912'418.01	11.12.2019	LGT Bank AG	11'184.22	0.00
CHF	Verkauf	2'550'000.00	USD	2'590'226.21	11.12.2019	LGT Bank AG	36'730.47	0.00
CHF	Verkauf	12'300.00	USD	12'519.08	11.12.2019	LGT Bank AG	202.22	0.00
CZK	Verkauf	471'650.00	USD	20'541.17	11.12.2019	LGT Bank AG	180.96	0.00
CZK	Verkauf	74'000.00	USD	3'202.49	11.12.2019	LGT Bank AG	8.05	0.00
CZK	Verkauf	1'250'000.00	USD	54'653.17	11.12.2019	LGT Bank AG	693.11	0.00
EUR	Verkauf	1'250'000.00	USD	1'397'562.50	11.12.2019	LGT Bank AG	18'387.50	0.00
EUR	Verkauf	1'500'000.00	USD	1'663'815.00	11.12.2019	LGT Bank AG	8'805.00	0.00
EUR	Verkauf	7'295'000.00	USD	8'156'174.75	11.12.2019	LGT Bank AG	107'309.45	0.01
EUR	Verkauf	1'170'000.00	USD	1'297'775.70	11.12.2019	LGT Bank AG	6'867.90	0.00
EUR	Verkauf	43'580'000.00	USD	48'259'533.24	11.12.2019	LGT Bank AG	175'976.04	0.02
EUR	Verkauf	4'930'000.00	USD	5'511'148.40	11.12.2019	LGT Bank AG	71'682.20	0.01
GBP	Verkauf	16'230'000.00	USD	20'740'949.97	11.12.2019	LGT Bank AG	-255'622.50	-0.03
HKD	Verkauf	78'940'000.00	USD	10'068'354.87	11.12.2019	LGT Bank AG	-15'966.87	0.00
JPY	Verkauf	4'883'450'000.00	USD	45'074'227.63	11.12.2019	LGT Bank AG	446'080.45	0.05
<b>Total Devisentermingeschäfte</b>							<b>-1'046'127.33</b>	<b>-0.11</b>

## Am Ende der Berichtsperiode offene engagementerhöhende Derivate

### Futures

Bezeichnung	Anzahl Kontrakte	Kontraktgrösse	Verfall	Gegenpartei	Kontraktwert in USD	Verkehrswert in USD <sup>3</sup>	in % <sup>3</sup>
Mini S&P 500 DEC 19	173	50.00	20.12.2019	CME	27'193'437.50	1'210'567.50	0.13
MSCI EM DEC 19	174	50.00	20.12.2019	ICE US	9'030'600.00	-67'864.71	-0.01
<b>Total</b>					<b>36'224'037.50</b>	<b>1'142'702.79</b>	<b>0.12</b>
<b>Total am Ende der Berichtsperiode offene derivative Finanzinstrumente</b>						<b>96'575.46</b>	<b>0.01</b>

## Während der Berichtsperiode getätigte derivative Finanzinstrumente

### Devisentermingeschäfte

Verfall	Kauf	Verkauf	Kauf Betrag	Verkauf Betrag
06.06.2019	USD	EUR	2'016'126.00	1'800'000.00
06.06.2019	USD	EUR	2'352'000.00	2'100'000.00
05.07.2019	USD	JPY	1'698'357.02	184'000'000.00
24.07.2019	CHF	USD	6'750.00	6'775.41
24.07.2019	CHF	USD	4'504'200.00	4'510'153.40
24.07.2019	CHF	USD	1'070'000.00	1'071'274.82
24.07.2019	CHF	USD	1'020'000.00	1'052'566.40
24.07.2019	CHF	USD	6'000.00	6'097.00
24.07.2019	CHF	USD	83'000.00	83'842.62
24.07.2019	CHF	USD	29'000.00	29'522.55
24.07.2019	CHF	USD	23'400.00	24'147.11
24.07.2019	CHF	USD	84'000.00	85'513.59
24.07.2019	CHF	USD	650'000.00	657'734.96
24.07.2019	CHF	USD	39'500.00	39'818.15
24.07.2019	CHF	USD	2'200'000.00	2'222'334.46
24.07.2019	CHF	USD	750'000.00	741'341.14
24.07.2019	CHF	USD	31'982'000.00	32'337'714.86
24.07.2019	CHF	USD	660'000.00	665'315.87
24.07.2019	CHF	USD	1'060'000.00	1'048'985.65
24.07.2019	CHF	USD	54'000.00	53'376.56
24.07.2019	CHF	USD	103'000.00	104'225.69
24.07.2019	CHF	USD	144'000.00	146'328.08
24.07.2019	CHF	USD	123'718'000.00	123'881'523.61
24.07.2019	CZK	USD	530'000.00	23'299.67
24.07.2019	CZK	USD	70'900.00	3'115.11
24.07.2019	CZK	USD	7'730'000.00	341'701.26
24.07.2019	CZK	USD	3'800'000.00	165'550.87
24.07.2019	CZK	USD	35'671'000.00	1'576'314.32
24.07.2019	CZK	USD	10'050'000.00	447'505.99
24.07.2019	CZK	USD	367'000.00	16'351.74
24.07.2019	CZK	USD	740'000.00	32'778.17
24.07.2019	CZK	USD	362'000.00	15'928.89
24.07.2019	EUR	USD	2'660'000.00	2'997'341.20
24.07.2019	EUR	USD	1'900'000.00	2'136'702.00
24.07.2019	EUR	USD	203'000.00	228'744.46
24.07.2019	EUR	USD	1'585'000.00	1'784'139.40
24.07.2019	EUR	USD	4'000'000.00	4'543'640.00
24.07.2019	EUR	USD	44'660'000.00	50'063'860.00
24.07.2019	EUR	USD	4'100'000.00	4'655'550.00
24.07.2019	EUR	USD	234'130'000.00	266'790'666.74
24.07.2019	EUR	USD	1'900'000.00	2'133'700.00
24.07.2019	EUR	USD	15'400'000.00	17'583'874.00
24.07.2019	EUR	USD	240'000.00	272'268.00
24.07.2019	EUR	USD	1'600'000.00	1'826'896.00
24.07.2019	EUR	USD	1'770'000.00	1'990'400.40
24.07.2019	EUR	USD	760'000.00	852'993.60

Verfall	Kauf	Verkauf	Kauf Betrag	Verkauf Betrag
24.07.2019	GBP	USD	1'200'000.00	1'577'976.00
24.07.2019	GBP	USD	16'830'000.00	20'877'615.00
24.07.2019	HKD	USD	92'240'000.00	11'804'755.69
24.07.2019	JPY	USD	220'000'000.00	2'011'005.69
24.07.2019	JPY	USD	113'200'000.00	1'048'759.92
24.07.2019	JPY	USD	5'090'500'000.00	47'021'060.41
24.07.2019	JPY	USD	166'600'000.00	1'539'954.71
24.07.2019	NOK	USD	160'725'000.00	19'037'968.15
24.07.2019	USD	CHF	1'524'250.83	1'500'000.00
24.07.2019	USD	CHF	53'584.53	53'300.00
24.07.2019	USD	CHF	743'287.33	740'500.00
24.07.2019	USD	CHF	16'419.54	16'400.00
24.07.2019	USD	CHF	1'497'954.14	1'490'000.00
24.07.2019	USD	CHF	124'999'898.89	123'624'900.00
24.07.2019	USD	CHF	593'072.91	600'000.00
24.07.2019	USD	CHF	4'754'246.71	4'701'950.00
24.07.2019	USD	CHF	33'006.27	33'000.00
24.07.2019	USD	CHF	32'025'450.69	32'012'000.00
24.07.2019	USD	CHF	175'160.81	177'000.00
24.07.2019	USD	CHF	460'548.05	460'000.00
24.07.2019	USD	CHF	608'298.94	616'000.00
24.07.2019	USD	CHF	865'151.62	867'600.00
24.07.2019	USD	CHF	1'250'237.55	1'250'000.00
24.07.2019	USD	CHF	27'920.98	28'000.00
24.07.2019	USD	CHF	15'997.47	16'200.00
24.07.2019	USD	CZK	7'155.40	165'000.00
24.07.2019	USD	CZK	4'184.01	96'500.00
24.07.2019	USD	CZK	2'557'310.56	58'383'400.00
24.07.2019	USD	CZK	14'984.04	345'000.00
24.07.2019	USD	CZK	11'578.22	265'000.00
24.07.2019	USD	CZK	2'873.79	66'000.00
24.07.2019	USD	EUR	2'253'480.00	2'000'000.00
24.07.2019	USD	EUR	742'156.80	660'000.00
24.07.2019	USD	EUR	3'767'142.00	3'350'000.00
24.07.2019	USD	EUR	450'696.00	400'000.00
24.07.2019	USD	EUR	1'113'334.20	990'000.00
24.07.2019	USD	EUR	18'735'750.00	16'500'000.00
24.07.2019	USD	EUR	2'679'953.34	2'370'000.00
24.07.2019	USD	EUR	1'550'820.93	1'381'750.00
24.07.2019	USD	EUR	52'180'036.48	45'760'000.00
24.07.2019	USD	EUR	268'340'776.25	239'376'250.00
24.07.2019	USD	EUR	2'394'264.40	2'120'000.00
24.07.2019	USD	GBP	23'619'083.64	18'030'000.00
24.07.2019	USD	HKD	11'778'438.18	92'240'000.00
24.07.2019	USD	JPY	1'146'757.17	124'000'000.00
24.07.2019	USD	JPY	48'272'822.93	5'367'600'000.00
24.07.2019	USD	JPY	914'727.39	98'700'000.00
24.07.2019	USD	NOK	18'730'334.46	160'725'000.00
01.08.2019	USD	JPY	965'073.53	105'000'000.00
23.10.2019	CHF	USD	1'125'000.00	1'142'445.14
23.10.2019	CHF	USD	1'370'000.00	1'389'043.79

Verfall	Kauf	Verkauf	Kauf Betrag	Verkauf Betrag
23.10.2019	CHF	USD	525'000.00	532'287.01
23.10.2019	CHF	USD	138'500.00	139'945.64
23.10.2019	CHF	USD	43'000.00	44'205.94
23.10.2019	CHF	USD	1'000'000.00	1'037'516.60
23.10.2019	CHF	USD	17'800'000.00	17'997'067.89
23.10.2019	CHF	USD	123'624'900.00	126'032'370.34
23.10.2019	CHF	USD	800.00	803.22
23.10.2019	CHF	USD	1'390'000.00	1'404'508.57
23.10.2019	CHF	USD	25'300.00	25'651.16
23.10.2019	CHF	USD	49'000.00	49'681.13
23.10.2019	CHF	USD	11'500.00	11'651.59
23.10.2019	CHF	USD	4'701'950.00	4'793'515.74
23.10.2019	CHF	USD	14'242'000.00	14'281'989.57
23.10.2019	CZK	USD	650'000.00	27'570.41
23.10.2019	CZK	USD	690'000.00	29'379.83
23.10.2019	CZK	USD	61'000.00	2'592.48
23.10.2019	CZK	USD	487'000.00	21'183.12
23.10.2019	CZK	USD	940'000.00	40'135.78
23.10.2019	CZK	USD	65'000.00	2'824.60
23.10.2019	CZK	USD	183'500.00	7'846.77
23.10.2019	CZK	USD	58'383'400.00	2'561'234.87
23.10.2019	EUR	USD	239'376'250.00	270'261'052.53
23.10.2019	EUR	USD	43'580'000.00	48'099'246.00
23.10.2019	EUR	USD	65'000.00	73'325.85
23.10.2019	EUR	USD	161'000.00	177'450.98
23.10.2019	EUR	USD	2'340'000.00	2'576'433.60
23.10.2019	EUR	USD	2'235'000.00	2'442'922.05
23.10.2019	EUR	USD	2'530'000.00	2'790'185.20
23.10.2019	EUR	USD	1'200'000.00	1'350'012.00
23.10.2019	EUR	USD	750'000.00	832'117.50
23.10.2019	EUR	USD	815'000.00	896'931.95
23.10.2019	EUR	USD	850'000.00	958'876.50
23.10.2019	GBP	USD	16'230'000.00	20'709'480.00
23.10.2019	GBP	USD	600'000.00	739'932.00
23.10.2019	HKD	USD	78'940'000.00	10'064'256.21
23.10.2019	JPY	USD	150'000'000.00	1'421'491.05
23.10.2019	JPY	USD	4'883'450'000.00	44'942'481.13
23.10.2019	JPY	USD	117'800'000.00	1'089'510.00
23.10.2019	JPY	USD	130'750'000.00	1'223'987.34
23.10.2019	JPY	USD	94'000'000.00	870'854.18
23.10.2019	JPY	USD	220'000'000.00	2'086'277.04
23.10.2019	NOK	USD	160'725'000.00	18'771'896.90
23.10.2019	USD	CHF	2'010'834.73	1'945'000.00
23.10.2019	USD	CHF	249'003.98	240'000.00
23.10.2019	USD	CHF	1'071'064.09	1'060'000.00
23.10.2019	USD	CHF	190'764.97	190'000.00
23.10.2019	USD	CHF	121'182'977.55	120'812'400.00
23.10.2019	USD	CHF	856'474.95	850'000.00
23.10.2019	USD	CHF	72'110.91	69'750.00
23.10.2019	USD	CHF	467'076.67	461'000.00
23.10.2019	USD	CHF	1'553'669.41	1'512'000.00



Verfall	Kauf	Verkauf	Kauf Betrag	Verkauf Betrag
23.10.2019	USD	CHF	70'577.72	69'500.00
23.10.2019	USD	CHF	32'604'817.22	31'982'000.00
23.10.2019	USD	CHF	26'716.54	26'000.00
23.10.2019	USD	CHF	4'719'013.24	4'705'800.00
23.10.2019	USD	CHF	7'536.25	7'500.00
23.10.2019	USD	CHF	476'815.49	465'000.00
23.10.2019	USD	CHF	385'855.97	384'000.00
23.10.2019	USD	CHF	1'208'466.98	1'175'500.00
23.10.2019	USD	CHF	68'994.85	66'500.00
23.10.2019	USD	CHF	25'190.44	25'000.00
23.10.2019	USD	CZK	4'950.43	115'000.00
23.10.2019	USD	CZK	16'805.53	390'000.00
23.10.2019	USD	CZK	23'316.55	550'000.00
23.10.2019	USD	CZK	23'439.53	540'000.00
23.10.2019	USD	CZK	3'669.20	83'500.00
23.10.2019	USD	CZK	2'560'231.26	59'781'400.00
23.10.2019	USD	EUR	1'949'832.26	1'725'500.00
23.10.2019	USD	EUR	2'437'673.95	2'215'000.00
23.10.2019	USD	EUR	1'856'502.00	1'700'000.00
23.10.2019	USD	EUR	351'111.60	315'000.00
23.10.2019	USD	EUR	50'422'122.52	44'660'000.00
23.10.2019	USD	EUR	1'277'769.00	1'140'000.00
23.10.2019	USD	EUR	2'008'926.00	1'800'000.00
23.10.2019	USD	EUR	2'700'024.00	2'400'000.00
23.10.2019	USD	EUR	1'543'976.00	1'400'000.00
23.10.2019	USD	EUR	1'012'956.80	920'000.00
23.10.2019	USD	EUR	163'809.00	150'000.00
23.10.2019	USD	EUR	259'106'543.48	234'761'750.00
23.10.2019	USD	EUR	788'652.15	715'000.00
23.10.2019	USD	GBP	20'960'839.35	16'830'000.00
23.10.2019	USD	HKD	11'811'101.26	92'240'000.00
23.10.2019	USD	JPY	1'078'151.69	113'000'000.00
23.10.2019	USD	JPY	1'614'382.51	172'500'000.00
23.10.2019	USD	JPY	2'041'782.29	220'000'000.00
23.10.2019	USD	JPY	47'333'058.10	5'090'500'000.00
23.10.2019	USD	NOK	17'813'403.97	160'725'000.00
24.10.2019	HKD	USD	13'300'000.00	1'697'467.84

## Während der Berichtsperiode getätigte engagementerhöhende Derivate

### Futures

Bezeichnung	Verfall	Käufe/Kontrakte	Verkäufe/Kontrakte
Mini S&P 500 Jun 19	21.06.2019	0	106
Mini S&P 500 Sep 19	20.09.2019	228	228

Bezeichnung	Verfall	Käufe/Kontrakte	Verkäufe/Kontrakte
TOPIX DEC 19	13.12.2019	63	63
TOPIX Sep 19	13.09.2019	63	63

1 Kauf umfasst die Transaktionen: Gratistitel / Käufe / Konversionen / Namensänderungen / "Splits" / Stock- / Wahldividenden / Titelaufteilungen / Überträge / Umbuchungen in Folge Redenominierung in Euro / Umtausch zwischen Gesellschaften / Zuteilungen aus Bezugs- / Optionsrechten / Zuteilung von Bezugsrechten auf Basistiteln

2 Verkauf umfasst die Transaktionen: Auslosungen / Ausbuchung in Folge Verfall / Ausübung von Bezugs- / Optionsrechten / "Reverse Splits" / Überträge / Umbuchungen in Folge Redenominierung in Fondswährung / Umtausch zwischen Gesellschaften / Verkäufe / Rückzahlungen

3 Allfällige Abweichungen in den Totalisierungen sind auf Rundungsdifferenzen zurückzuführen

## LGT Alpha Indexing Fund OGAW nach liechtensteinischem Recht

### Dreijahresvergleich

Per:	30.11.2019	30.11.2018	30.11.2017
Nettovermögen (CHF) B	230'511'674	220'054'310	194'690'500
Anzahl Anteile im Umlauf (CHF) B	140'978	145'900	123'319
Nettoinventarwert pro Anteil am Ende der Periode (CHF) B	1'635.09	1'508.25	1'578.75
Nettoinventarwert pro Anteil zu Beginn der Periode (CHF) B	1'508.25	1'578.75	1'469.79
Veränderung Inventarwert in Prozent gg. Vorjahr (CHF) B	8.41%	-4.47%	7.41%
Nettovermögen (EUR) B	45'672'547	35'811'273	15'789'474
Anzahl Anteile im Umlauf (EUR) B	42'660	36'650	15'615
Nettoinventarwert pro Anteil am Ende der Periode (EUR) B	1'070.62	977.10	1'011.17
Nettoinventarwert pro Anteil zu Beginn der Periode (EUR) B	977.10	1'011.17	1'000.00 <sup>2</sup>
Veränderung Inventarwert in Prozent gg. Vorjahr (EUR) B	9.57%	-3.37%	1.12% <sup>2</sup>
Nettovermögen (USD) B	1'560'644	20'554'635	1'983'763
Anzahl Anteile im Umlauf (USD) B	1'381	20'227	1'893
Nettoinventarwert pro Anteil am Ende der Periode (USD) B	1'130.05	1'016.20	1'048.17
Nettoinventarwert pro Anteil zu Beginn der Periode (USD) B	1'016.20	1'048.17	1'000.00 <sup>2</sup>
Veränderung Inventarwert in Prozent gg. Vorjahr (USD) B	11.20%	-3.05%	4.82% <sup>2</sup>
Nettovermögen (CHF) I1	102'576'338	103'452'564	42'427'670
Anzahl Anteile im Umlauf (CHF) I1	63'272	69'595	27'432
Nettoinventarwert pro Anteil am Ende der Periode (CHF) I1	1'621.20	1'486.49	1'546.66
Nettoinventarwert pro Anteil zu Beginn der Periode (CHF) I1	1'486.49	1'546.66	1'431.31
Veränderung Inventarwert in Prozent gg. Vorjahr (CHF) I1	9.06%	-3.89%	8.06%
Nettovermögen (EUR) I1	7'989'015	5'787'293	n.a.
Anzahl Anteile im Umlauf (EUR) I1	7'515	6'000	n.a.
Nettoinventarwert pro Anteil am Ende der Periode (EUR) I1	1'063.08	964.55	n.a.
Nettoinventarwert pro Anteil zu Beginn der Periode (EUR) I1	964.55	1'000.00 <sup>3</sup>	n.a.
Veränderung Inventarwert in Prozent gg. Vorjahr (EUR) I1	10.22%	-3.55% <sup>3</sup>	n.a.
Nettovermögen (CHF) C	7'121'284	n.a.	n.a.
Anzahl Anteile im Umlauf (CHF) C	6'520	n.a.	n.a.
Nettoinventarwert pro Anteil am Ende der Periode (CHF) C	1'092.22	n.a.	n.a.
Nettoinventarwert pro Anteil zu Beginn der Periode (CHF) C	1'000.00 <sup>4</sup>	n.a.	n.a.
Veränderung Inventarwert in Prozent gg. Vorjahr (CHF) C	9.22% <sup>4</sup>	n.a.	n.a.

<b>Per:</b>	<b>30.11.2019</b>	<b>30.11.2018</b>	<b>30.11.2017</b>
Nettovermögen (CHF) IM	14'660'735	13'284'536	74'573'469
Anzahl Anteile im Umlauf (CHF) IM	11'069	10'991	59'585
Nettoinventarwert pro Anteil am Ende der Periode (CHF) IM	1'324.54	1'208.67	1'251.56
Nettoinventarwert pro Anteil zu Beginn der Periode (CHF) IM	1'208.67	1'251.56	1'152.67
Veränderung Inventarwert in Prozent gg. Vorjahr (CHF) IM	9.59%	-3.43%	8.58%

  

	<b>1 Jahr</b>	<b>2 Jahre</b>	<b>3 Jahre</b>
Kumulierte Wertentwicklung Fonds in Prozent (CHF) B	8.41%	3.57%	11.25%
Kumulierte Wertentwicklung Benchmark in Prozent <sup>1</sup>	10.72%	9.71%	18.60%

<sup>1</sup> Pictet LPP 40 Plus (CHF) (PI)

<sup>2</sup> Seit Lancierung am 31.03.2017

<sup>3</sup> Seit Lancierung am 07.08.2018

<sup>4</sup> Seit Lancierung am 05.12.2018

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

## Vermögensrechnung per 30.11.2019

	<b>30.11.2019</b>
<b>Verkehrswerte</b>	<b>CHF</b>
Bankguthaben	
auf Sicht	2'006'851.41
auf Zeit	4'097'745.00
Wertpapiere	
Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen	16'761'869.69
Anlagefonds	322'243'736.55
Andere Wertpapiere und Wertrechte	71'423'420.84
Derivative Finanzinstrumente	-799'548.60
Sonstige Vermögenswerte	181'926.34
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>415'916'001.23</b>
Verbindlichkeiten	-354'315.25
<b>Nettovermögen</b>	<b>415'561'685.98</b>

## Erfolgsrechnung für die Zeit vom 01.06.2019 bis 30.11.2019

	<b>30.11.2019</b>
<b>Ertrag</b>	<b>CHF</b>
Erträge der Bankguthaben	55'300.65
Erträge der Wertpapiere	
Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen	163'410.25
Anteile anderer Investmentunternehmen	2'514'608.72
Einkauf in laufende Erträge bei der Ausgabe von Anteilen	11'892.21
<b>Total Ertrag</b>	<b>2'745'211.83</b>
<hr/>	
	<b>30.11.2019</b>
<b>Aufwand</b>	<b>CHF</b>
Passivzinsen	469.18
Reglementarische Vergütungen	2'124'509.93
Sonstige Aufwendungen	7'979.90
Ausrichtung laufender Erträge bei der Rücknahme von Anteilen	19'188.18
<b>Total Aufwand</b>	<b>2'152'147.19</b>
<hr/>	
<b>Nettoertrag</b>	<b>593'064.64</b>
<hr/>	
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste	10'889'997.08
<b>Realisierter Erfolg</b>	<b>11'483'061.72</b>
<hr/>	
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste	10'012'481.39
<b>Gesamterfolg</b>	<b>21'495'543.11</b>

## Veränderung des Nettovermögens

	<b>30.11.2019</b>
	<b>CHF</b>
Nettovermögen zu Beginn der Berichtsperiode	409'622'732.12
Ausschüttungen	0.00
Saldo aus dem Anteilverkehr	-15'556'589.25
Gesamterfolg	21'495'543.11
<b>Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode</b>	<b>415'561'685.98</b>

## Entwicklung der Anteile im Umlauf

	<b>30.11.2019</b>
	<b>Anzahl</b>
LGT Alpha Indexing Fund (CHF) B	
Bestand Anzahl Anteile zu Beginn der Berichtsperiode	142'194.710
Ausgegebene Anteile	8'483.247
Zurückgenommene Anteile	-9'699.906
<b>Bestand Anzahl Anteile am Ende der Berichtsperiode</b>	<b>140'978.051</b>

	<b>30.11.2019</b>
	<b>Anzahl</b>
LGT Alpha Indexing Fund (EUR) B	
Bestand Anzahl Anteile zu Beginn der Berichtsperiode	38'510.264
Ausgegebene Anteile	6'765.079
Zurückgenommene Anteile	-2'615.320
<b>Bestand Anzahl Anteile am Ende der Berichtsperiode</b>	<b>42'660.023</b>

	<b>30.11.2019</b>
	<b>Anzahl</b>
LGT Alpha Indexing Fund (USD) B	
Bestand Anzahl Anteile zu Beginn der Berichtsperiode	18'995.921
Ausgegebene Anteile	236.117
Zurückgenommene Anteile	-17'851.000
<b>Bestand Anzahl Anteile am Ende der Berichtsperiode</b>	<b>1'381.038</b>

	<b>30.11.2019</b>
	<b>Anzahl</b>
LGT Alpha Indexing Fund (CHF) I1	
Bestand Anzahl Anteile zu Beginn der Berichtsperiode	63'217.329
Ausgegebene Anteile	801.853
Zurückgenommene Anteile	-747.156
<b>Bestand Anzahl Anteile am Ende der Berichtsperiode</b>	<b>63'272.026</b>

	<b>30.11.2019</b>
	<b>Anzahl</b>
LGT Alpha Indexing Fund (EUR) I1	
Bestand Anzahl Anteile zu Beginn der Berichtsperiode	7'515.000
Ausgegebene Anteile	0.000
Zurückgenommene Anteile	0.000
<b>Bestand Anzahl Anteile am Ende der Berichtsperiode</b>	<b>7'515.000</b>

**30.11.2019**  
**Anzahl**

---

LGT Alpha Indexing Fund (CHF) C	
Bestand Anzahl Anteile zu Beginn der Berichtsperiode	6'520.000
Ausgegebene Anteile	0.000
Zurückgenommene Anteile	0.000
<b>Bestand Anzahl Anteile am Ende der Berichtsperiode</b>	<b>6'520.000</b>

---

**30.11.2019**  
**Anzahl**

---

LGT Alpha Indexing Fund (CHF) IM	
Bestand Anzahl Anteile zu Beginn der Berichtsperiode	10'872.987
Ausgegebene Anteile	514.203
Zurückgenommene Anteile	-318.619
<b>Bestand Anzahl Anteile am Ende der Berichtsperiode</b>	<b>11'068.571</b>

---



## Inventar des Fondsvermögens

Bezeichnung	Laufzeit	Bestand 31.05.2019 Anzahl/ Nominal	Kauf <sup>1</sup>	Verkauf <sup>2</sup>	Bestand 30.11.2019 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert in CHF <sup>3</sup>	in % <sup>3</sup>
-------------	----------	---	-------------------	----------------------	---	-------------------------------------	-------------------

### Wertpapiere

#### Obligationen

Obligationen, die an einer Börse gehandelt werden

#### USD

1.5000 % USA	2015 - 22	8'000'000	0	1'000'000	7'000'000	6'974'833.64	1.68
2.5000 % USA	2013 - 23	8'150'000	1'350'000	0	9'500'000	9'787'036.05	2.36
<b>Total Obligationen, die an einer Börse gehandelt werden</b>						<b>16'761'869.69</b>	<b>4.03</b>

#### Anlagefonds

AGX Convergence A USD		0	6'386	0	6'386	8'011'533.84	1.93
Crown LGT Select Bond EMMA A USD		22'600	1'100	6'300	17'400	21'098'243.58	5.08
LGT AGX UCITS A USD		4'096	0	4'096	0	0.00	0.00
LGT Crown Liquid Private Equity Opp S		0	149'000	4'000	145'000	17'884'608.05	4.30
LGT Dyn Pr U A USD		8'301	1'073	800	8'574	8'693'288.27	2.09
LGT Select Cat Bond (USD) IM		1'200	500	0	1'700	2'118'088.41	0.51
LGT Sustainable Eq Market Neut Sub-Fd A (USD)		7'800	2'700	500	10'000	10'867'219.74	2.62
LGT Sustainable Quality Eq Hdg Sub-Fd B (USD)		22'000	700	2'530	20'170	29'671'289.71	7.14
MA Sustainable Money Market Fund (USD) IM		30'000	6'000	26'000	10'000	10'392'880.77	2.50
MA Sustainable Portfolio Corp Bds (USD) IM		7'800	0	1'100	6'700	12'769'738.78	3.07
Ut Am IS Prm US Co		0	660'000	48'000	612'000	12'476'404.20	3.00
Ut BGF Swiss Opp D2		11'950	0	0	11'950	6'923'232.50	1.67
Ut Inv EQQQ NASDAQ		68'000	8'700	16'300	60'400	12'453'666.71	3.00
Ut iSh IV Edg Mult USD		3'120'000	166'500	421'500	2'865'000	20'813'515.02	5.01
Ut iSh MSCI Jap SC USD		333'000	12'000	50'000	295'000	12'384'003.24	2.98
Ut iSh MSCI USA		0	3'420'000	0	3'420'000	19'893'452.58	4.79
Ut iShs Asia Pr Yi USD		277'590	40'410	38'600	279'400	8'272'672.53	1.99
Ut iShs Eu Pty EUR		340'500	63'500	70'600	333'400	16'539'813.59	3.98
Ut iShs EUR STO Sm EUR		326'000	33'000	52'000	307'000	12'388'429.11	2.98
Ut iShs FTSE 100 GBP		26'500	0	26'500	0	0.00	0.00
Ut iShs GI Water		300'000	0	300'000	0	0.00	0.00
Ut iShs MSCI EM Sc		0	2'330'000	157'000	2'173'000	11'879'772.53	2.86
Ut iShs MSCI EM USD		450'000	53'500	503'500	0	0.00	0.00
Ut iShs S&P 500 USD		45'100	55'100	86'200	14'000	4'367'276.68	1.05
Ut iShs S&P SC 600 USD		202'000	37'500	51'500	188'000	12'482'910.62	3.00
Ut iShs USD Corp Bd		121'971	13'000	134'971	0	0.00	0.00
Ut iShs USD HY USD		245'100	19'900	20'000	245'000	24'929'731.10	6.00
Ut iShs US Pro Yld		0	275'303	8'000	267'303	8'380'683.20	2.02
Ut Van USD EM Gov USD		410'996	37'560	127'556	321'000	16'551'281.79	3.98
<b>Total Anlagefonds</b>						<b>322'243'736.55</b>	<b>77.54</b>

Bezeichnung	Laufzeit	Bestand 31.05.2019 Anzahl/ Nominal	Kauf <sup>1</sup>	Verkauf <sup>2</sup>	Bestand 30.11.2019 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert in CHF <sup>3</sup>	in % <sup>3</sup>
-------------	----------	---	-------------------	----------------------	---	-------------------------------------	-------------------

#### Andere Wertpapiere und Wertrechte

Andere Wertpapiere und Wertrechte, die an einer Börse gehandelt werden

#### CHF

ZKB Ct/Fd Bsk WFM		0	3'428	238	3'190	32'885'710.00	7.91
<b>Total</b>						<b>32'885'710.00</b>	<b>7.91</b>

#### EUR

ZKB Ct/SXI RE WFM		261'971	14'229	276'200	0	0.00	0.00
<b>Total</b>						<b>0.00</b>	<b>0.00</b>

#### USD

WTM LBMA Gold		0	63'000	4'200	58'800	8'301'225.81	2.00
WTM Phys Gold		0	70'000	70'000	0	0.00	0.00
<b>Total</b>						<b>8'301'225.81</b>	<b>2.00</b>

<b>Total Andere Wertpapiere und Wertrechte, die an einer Börse gehandelt werden</b>						<b>41'186'935.81</b>	<b>9.91</b>
---	--	--	--	--	--	----------------------	-------------

Andere Wertpapiere und Wertrechte, die an einem anderen dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden

#### USD

SS Ct/LGT SEL EQ EM LEA IM WFM		5'264	0	0	5'264	6'785'704.77	1.63
SS Ct/LGT SEL ILS USD IM WFM		19'245	0	0	19'245	23'450'780.26	5.64
<b>Total Andere Wertpapiere und Wertrechte, die an einem anderen dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden</b>						<b>30'236'485.03</b>	<b>7.28</b>

<b>Total Wertpapiere</b>						<b>410'429'027.08</b>	<b>98.76</b>
--------------------------	--	--	--	--	--	-----------------------	--------------

Total Wertpapiere						410'429'027.08	98.76
Bankguthaben auf Sicht						2'006'851.41	0.48
Bankguthaben auf Zeit						4'097'745.00	0.99
Derivative Finanzinstrumente						-799'548.60	-0.19
Sonstige Vermögenswerte						181'926.34	0.04
<b>Gesamtvermögen per 30.11.2019</b>						<b>415'916'001.23</b>	<b>100.09</b>
Verbindlichkeiten						-354'315.25	-0.09
<b>Nettovermögen per 30.11.2019</b>						<b>415'561'685.98</b>	<b>100.00</b>

## Derivative Finanzinstrumente

### Am Ende der Berichtsperiode offene derivative Finanzinstrumente

#### Devisentermingeschäfte

Währung		Betrag	gegen	Gegenwert	Verfall	Gegenpartei	Verkehrswert in CHF <sup>3</sup>	in % <sup>3</sup>
AUD	Kauf	700'000.00	CHF	472'815.00	11.12.2019	LGT Bank AG	126.00	0.00
EUR	Kauf	320'000.00	CHF	351'379.20	11.12.2019	LGT Bank AG	1'206.40	0.00
EUR	Kauf	38'000.00	CHF	41'747.56	11.12.2019	LGT Bank AG	121.98	0.00
EUR	Kauf	270'000.00	CHF	296'627.40	11.12.2019	LGT Bank AG	866.70	0.00
EUR	Kauf	1'400'000.00	CHF	1'539'762.00	11.12.2019	LGT Bank AG	2'800.00	0.00
EUR	Kauf	445'000.00	CHF	489'050.55	11.12.2019	LGT Bank AG	1'263.80	0.00
EUR	Kauf	34'546'000.00	CHF	38'017'251.17	11.12.2019	LGT Bank AG	46'568.01	0.01
EUR	Kauf	6'098'000.00	CHF	6'710'739.24	11.12.2019	LGT Bank AG	8'220.10	0.00
EUR	Kauf	27'000.00	CHF	29'667.33	11.12.2019	LGT Bank AG	82.08	0.00
EUR	Kauf	54'000.00	CHF	59'295.24	11.12.2019	LGT Bank AG	203.58	0.00
EUR	Kauf	22'000.00	CHF	24'177.78	11.12.2019	LGT Bank AG	62.48	0.00
EUR	Kauf	265'000.00	CHF	291'081.30	11.12.2019	LGT Bank AG	903.65	0.00
EUR	Kauf	48'000.00	CHF	52'724.16	11.12.2019	LGT Bank AG	163.68	0.00
USD	Kauf	2'200'000.00	CHF	2'179'848.00	11.12.2019	LGT Bank AG	17'140.20	0.00
USD	Kauf	600'000.00	CHF	592'644.00	11.12.2019	LGT Bank AG	6'534.60	0.00
USD	Kauf	220'000.00	CHF	218'781.20	11.12.2019	LGT Bank AG	917.62	0.00
USD	Kauf	3'000'000.00	CHF	2'947'500.00	11.12.2019	LGT Bank AG	48'393.00	0.01
USD	Kauf	12'000'000.00	CHF	11'977'200.00	11.12.2019	LGT Bank AG	6'372.00	0.00
EUR	Kauf	250'000.00	CHF	271'663.75	23.01.2020	LGT Bank AG	3'645.50	0.00
USD	Kauf	153'000.00	CHF	150'926.85	23.01.2020	LGT Bank AG	1'283.06	0.00
USD	Kauf	70'000.00	CHF	69'414.45	23.01.2020	LGT Bank AG	224.07	0.00
USD	Kauf	89'000.00	CHF	87'800.28	23.01.2020	LGT Bank AG	740.12	0.00
USD	Kauf	220'000.00	CHF	216'980.50	23.01.2020	LGT Bank AG	1'883.42	0.00
USD	Kauf	16'400'000.00	CHF	16'217'960.00	23.01.2020	LGT Bank AG	97'350.40	0.02
USD	Kauf	140'000.00	CHF	137'935.00	23.01.2020	LGT Bank AG	1'342.04	0.00
USD	Kauf	158'000.00	CHF	155'999.72	23.01.2020	LGT Bank AG	1'184.37	0.00
AUD	Verkauf	3'800'000.00	CHF	2'551'612.60	11.12.2019	LGT Bank AG	-15'781.40	0.00
EUR	Verkauf	350'000.00	CHF	385'210.00	11.12.2019	LGT Bank AG	-430.50	0.00
EUR	Verkauf	58'000.00	CHF	63'193.44	11.12.2019	LGT Bank AG	-712.70	0.00
EUR	Verkauf	50'000.00	CHF	55'030.00	11.12.2019	LGT Bank AG	-61.50	0.00
EUR	Verkauf	26'550'000.00	CHF	29'217'797.10	11.12.2019	LGT Bank AG	-35'789.40	-0.01
EUR	Verkauf	1'200'000.00	CHF	1'318'788.00	11.12.2019	LGT Bank AG	-3'408.00	0.00
EUR	Verkauf	330'000.00	CHF	359'548.86	11.12.2019	LGT Bank AG	-4'055.04	0.00
EUR	Verkauf	113'000.00	CHF	124'163.27	11.12.2019	LGT Bank AG	-343.52	0.00
GBP	Verkauf	950'000.00	CHF	1'204'187.70	11.12.2019	LGT Bank AG	-23'135.35	-0.01
GBP	Verkauf	400'000.00	CHF	516'080.00	11.12.2019	LGT Bank AG	-687.60	0.00
HKD	Verkauf	23'900'000.00	CHF	3'029'803.00	11.12.2019	LGT Bank AG	-19'167.80	0.00
JPY	Verkauf	1'900'000'000.00	CHF	17'444'717.00	11.12.2019	LGT Bank AG	105'317.00	0.03
USD	Verkauf	220'000.00	CHF	217'778.00	11.12.2019	LGT Bank AG	-1'920.82	0.00
USD	Verkauf	500'000.00	CHF	493'840.00	11.12.2019	LGT Bank AG	-5'475.50	0.00
USD	Verkauf	1'200'000.00	CHF	1'197'084.00	11.12.2019	LGT Bank AG	-1'273.20	0.00
USD	Verkauf	1'000'000.00	CHF	999'450.00	11.12.2019	LGT Bank AG	819.00	0.00
USD	Verkauf	240'000'000.00	CHF	238'680'480.00	11.12.2019	LGT Bank AG	-990'960.00	-0.24
USD	Verkauf	1'300'000.00	CHF	1'287'052.00	11.12.2019	LGT Bank AG	-11'168.30	0.00

Devisentermingeschäfte

Währung		Betrag	gegen	Gegenwert	Verfall	Gegenpartei	Verkehrswert in CHF <sup>3</sup>	in % <sup>3</sup>
USD	Verkauf	1'500'000.00	CHF	1'477'350.00	11.12.2019	LGT Bank AG	-20'596.50	0.00
USD	Verkauf	2'000'000.00	CHF	1'988'920.00	11.12.2019	LGT Bank AG	-8'342.00	0.00
USD	Verkauf	205'000.00	CHF	201'709.75	23.01.2020	LGT Bank AG	-2'231.63	0.00
USD	Verkauf	15'460'000.00	CHF	15'372'805.60	23.01.2020	LGT Bank AG	-7'358.96	0.00
USD	Verkauf	65'000.00	CHF	64'650.82	23.01.2020	LGT Bank AG	-13.52	0.00
USD	Verkauf	58'000.00	CHF	56'766.34	23.01.2020	LGT Bank AG	-934.15	0.00
USD	Verkauf	211'000.00	CHF	208'474.33	23.01.2020	LGT Bank AG	-1'436.07	0.00
<b>Total am Ende der Berichtsperiode offene derivative Finanzinstrumente</b>							<b>-799'548.60</b>	<b>-0.19</b>

## Während der Berichtsperiode getätigte derivative Finanzinstrumente

### Devisentermingeschäfte

Verfall	Kauf	Verkauf	Kauf Betrag	Verkauf Betrag
24.07.2019	AUD	CHF	7'700'000.00	5'549'621.00
24.07.2019	CHF	AUD	5'336'100.00	7'700'000.00
24.07.2019	CHF	EUR	1'662'675.00	1'500'000.00
24.07.2019	CHF	EUR	33'564.30	30'000.00
24.07.2019	CHF	EUR	75'081.54	67'000.00
24.07.2019	CHF	EUR	36'909.51	33'000.00
24.07.2019	CHF	EUR	777'336.00	700'000.00
24.07.2019	CHF	EUR	796'369.00	700'000.00
24.07.2019	CHF	EUR	61'216'926.00	53'700'000.00
24.07.2019	CHF	EUR	54'134.88	48'000.00
24.07.2019	CHF	EUR	70'438.82	62'000.00
24.07.2019	CHF	EUR	174'248.64	153'000.00
24.07.2019	CHF	EUR	571'516.20	510'000.00
24.07.2019	CHF	EUR	33'819'424.00	30'545'000.00
24.07.2019	CHF	EUR	6'330'969.60	5'718'000.00
24.07.2019	CHF	EUR	357'874.65	315'000.00
24.07.2019	CHF	EUR	948'687.04	833'000.00
24.07.2019	CHF	EUR	446'172.00	400'000.00
24.07.2019	CHF	EUR	1'691'820.00	1'500'000.00
24.07.2019	CHF	EUR	480'942.10	430'000.00
24.07.2019	CHF	EUR	234'950.10	210'000.00
24.07.2019	CHF	EUR	673'362.00	600'000.00
24.07.2019	CHF	EUR	347'748.70	310'000.00
24.07.2019	CHF	EUR	293'230.60	260'000.00
24.07.2019	CHF	GBP	6'679'572.00	5'100'000.00
24.07.2019	CHF	HKD	3'048'707.90	23'900'000.00
24.07.2019	CHF	JPY	848'029.80	93'000'000.00
24.07.2019	CHF	JPY	523'921.20	57'000'000.00
24.07.2019	CHF	JPY	16'914'098.60	1'882'000'000.00
24.07.2019	CHF	USD	975'150.00	1'000'000.00
24.07.2019	CHF	USD	207'310'818.00	207'400'000.00
24.07.2019	CHF	USD	1'095'875.00	1'100'000.00
24.07.2019	CHF	USD	2'445'925.00	2'500'000.00
24.07.2019	CHF	USD	9'884'412.00	10'200'000.00
24.07.2019	CHF	USD	989'950.00	1'000'000.00
24.07.2019	CHF	USD	6'621'208.00	6'700'000.00
24.07.2019	CHF	USD	677'517.40	670'000.00
24.07.2019	CHF	USD	249'895.00	250'000.00
24.07.2019	CHF	USD	186'820.26	186'000.00
24.07.2019	CHF	USD	99'469.00	100'000.00
24.07.2019	CHF	USD	709'114.00	700'000.00
24.07.2019	CHF	USD	15'133'935.00	15'310'000.00
24.07.2019	CHF	USD	818'944.40	830'000.00
24.07.2019	CHF	USD	150'562.50	150'000.00
24.07.2019	CHF	USD	292'487.33	290'000.00
24.07.2019	CHF	USD	2'182'422.00	2'200'000.00

Verfall	Kauf	Verkauf	Kauf Betrag	Verkauf Betrag
24.07.2019	EUR	CHF	220'000.00	245'394.60
24.07.2019	EUR	CHF	180'000.00	200'538.00
24.07.2019	EUR	CHF	1'500'000.00	1'688'670.00
24.07.2019	EUR	CHF	250'000.00	277'762.50
24.07.2019	EUR	CHF	1'150'000.00	1'272'452.00
24.07.2019	EUR	CHF	800'000.00	897'416.00
24.07.2019	EUR	CHF	58'000.00	64'290.10
24.07.2019	EUR	CHF	18'000.00	20'191.86
24.07.2019	EUR	CHF	210'000.00	232'360.80
24.07.2019	EUR	CHF	480'000.00	534'859.20
24.07.2019	EUR	CHF	840'000.00	947'419.20
24.07.2019	EUR	CHF	28'543'000.00	32'538'449.14
24.07.2019	EUR	CHF	56'000'000.00	62'003'200.00
24.07.2019	EUR	CHF	820'000.00	909'052.00
24.07.2019	EUR	CHF	800'000.00	895'048.00
24.07.2019	EUR	CHF	50'000.00	55'552.50
24.07.2019	EUR	CHF	10'000.00	11'278.80
24.07.2019	EUR	CHF	5'567'000.00	6'346'268.66
24.07.2019	EUR	CHF	128'000.00	143'650.56
24.07.2019	EUR	CHF	930'000.00	1'043'711.10
24.07.2019	EUR	CHF	70'000.00	78'000.30
24.07.2019	GBP	CHF	400'000.00	502'876.00
24.07.2019	GBP	CHF	3'000'000.00	3'731'820.00
24.07.2019	GBP	CHF	1'200'000.00	1'468'800.00
24.07.2019	GBP	CHF	500'000.00	621'450.00
24.07.2019	HKD	CHF	23'900'000.00	3'021'963.80
24.07.2019	JPY	CHF	1'924'000'000.00	17'566'120.00
24.07.2019	JPY	CHF	50'000'000.00	460'830.00
24.07.2019	JPY	CHF	58'000'000.00	529'946.00
24.07.2019	USD	CHF	224'500'000.00	221'918'250.00
24.07.2019	USD	CHF	340'000.00	331'551.00
24.07.2019	USD	CHF	900'000.00	890'955.00
24.07.2019	USD	CHF	1'500'000.00	1'505'625.00
24.07.2019	USD	CHF	400'000.00	395'032.00
24.07.2019	USD	CHF	500'000.00	494'225.00
24.07.2019	USD	CHF	1'100'000.00	1'110'516.00
24.07.2019	USD	CHF	100'000.00	101'168.00
24.07.2019	USD	CHF	65'000.00	64'480.65
24.07.2019	USD	CHF	1'000'000.00	994'690.00
24.07.2019	USD	CHF	1'600'000.00	1'603'472.00
24.07.2019	USD	CHF	14'751'000.00	14'744'804.58
24.07.2019	USD	CHF	360'000.00	348'861.60
24.07.2019	USD	CHF	180'000.00	182'019.60
24.07.2019	USD	CHF	340'000.00	336'001.60
24.07.2019	USD	CHF	50'000.00	49'225.00
24.07.2019	USD	CHF	100'000.00	100'542.00
24.07.2019	USD	CHF	1'900'000.00	1'883'660.00
24.07.2019	USD	CHF	1'600'000.00	1'607'056.00
24.07.2019	USD	CHF	500'000.00	500'310.00
25.07.2019	CHF	EUR	232'768.20	210'000.00
25.07.2019	CHF	EUR	133'734.00	120'000.00

Verfall	Kauf	Verkauf	Kauf Betrag	Verkauf Betrag
25.07.2019	CHF	EUR	55'722.50	50'000.00
25.07.2019	CHF	USD	1'212'840.00	1'200'000.00
25.07.2019	CHF	USD	99'208.00	100'000.00
25.07.2019	EUR	CHF	330'000.00	376'148.19
25.07.2019	EUR	CHF	50'000.00	56'992.15
25.07.2019	USD	CHF	100'000.00	101'070.00
23.09.2019	EUR	CHF	52'000.00	56'663.36
23.10.2019	AUD	CHF	3'800'000.00	2'557'780.00
23.10.2019	AUD	CHF	8'000'000.00	5'513'800.00
23.10.2019	CHF	AUD	7'921'812.00	11'800'000.00
23.10.2019	CHF	EUR	62'111'612.16	56'160'000.00
23.10.2019	CHF	EUR	18'464.04	17'000.00
23.10.2019	CHF	EUR	438'032.00	400'000.00
23.10.2019	CHF	EUR	319'893.20	290'000.00
23.10.2019	CHF	EUR	38'323'980.35	34'811'500.00
23.10.2019	CHF	EUR	163'152.00	150'000.00
23.10.2019	CHF	EUR	386'078.00	350'000.00
23.10.2019	CHF	EUR	6'768'113.02	6'147'800.00
23.10.2019	CHF	EUR	120'121.10	110'000.00
23.10.2019	CHF	EUR	22'841.28	21'000.00
23.10.2019	CHF	EUR	94'195.91	86'200.00
23.10.2019	CHF	EUR	78'539.30	71'200.00
23.10.2019	CHF	EUR	327'588.00	300'000.00
23.10.2019	CHF	EUR	511'958.06	468'500.00
23.10.2019	CHF	EUR	672'678.16	616'000.00
23.10.2019	CHF	EUR	1'194'732.00	1'100'000.00
23.10.2019	CHF	EUR	877'280.00	800'000.00
23.10.2019	CHF	EUR	1'965'780.00	1'800'000.00
23.10.2019	CHF	GBP	1'584'555.70	1'300'000.00
23.10.2019	CHF	HKD	2'998'852.50	23'900'000.00
23.10.2019	CHF	JPY	17'539'184.00	1'924'000'000.00
23.10.2019	CHF	JPY	601'555.50	65'000'000.00
23.10.2019	CHF	JPY	780'665.50	85'000'000.00
23.10.2019	CHF	USD	126'882.60	130'000.00
23.10.2019	CHF	USD	187'582.49	193'000.00
23.10.2019	CHF	USD	995'400.00	1'000'000.00
23.10.2019	CHF	USD	136'361.40	140'000.00
23.10.2019	CHF	USD	2'546'492.00	2'600'000.00
23.10.2019	CHF	USD	3'522'420.00	3'600'000.00
23.10.2019	CHF	USD	484'365.00	500'000.00
23.10.2019	CHF	USD	1'465'575.00	1'500'000.00
23.10.2019	CHF	USD	16'180'683.90	16'231'000.00
23.10.2019	CHF	USD	979'810.00	1'000'000.00
23.10.2019	CHF	USD	675'558.30	690'000.00
23.10.2019	CHF	USD	442'021.50	450'000.00
23.10.2019	CHF	USD	220'111'249.50	224'500'000.00
23.10.2019	CHF	USD	101'562.30	105'000.00
23.10.2019	CHF	USD	1'984'880.00	2'000'000.00
23.10.2019	CHF	USD	1'456'845.00	1'500'000.00
23.10.2019	CHF	USD	1'792'548.00	1'800'000.00
23.10.2019	CHF	USD	2'857'950.00	2'900'000.00

Verfall	Kauf	Verkauf	Kauf Betrag	Verkauf Betrag
23.10.2019	CHF	USD	1'082'103.00	1'100'000.00
23.10.2019	CHF	USD	1'855'863.00	1'900'000.00
23.10.2019	EUR	CHF	284'000.00	308'458.08
23.10.2019	EUR	CHF	170'000.00	185'875.28
23.10.2019	EUR	CHF	1'800'000.00	1'971'144.00
23.10.2019	EUR	CHF	462'000.00	503'201.16
23.10.2019	EUR	CHF	42'200.00	46'292.56
23.10.2019	EUR	CHF	30'545'000.00	33'782'036.92
23.10.2019	EUR	CHF	480'000.00	526'574.40
23.10.2019	EUR	CHF	780'000.00	852'839.52
23.10.2019	EUR	CHF	84'000.00	92'150.52
23.10.2019	EUR	CHF	150'000.00	164'622.00
23.10.2019	EUR	CHF	83'000.00	90'352.97
23.10.2019	EUR	CHF	450'000.00	496'323.00
23.10.2019	EUR	CHF	240'000.00	260'071.20
23.10.2019	EUR	CHF	250'000.00	272'720.00
23.10.2019	EUR	CHF	233'000.00	255'596.34
23.10.2019	EUR	CHF	430'000.00	475'661.70
23.10.2019	EUR	CHF	600'000.00	657'960.00
23.10.2019	EUR	CHF	103'000.00	112'793.24
23.10.2019	EUR	CHF	48'000.00	52'205.28
23.10.2019	EUR	CHF	5'718'000.00	6'323'970.77
23.10.2019	EUR	CHF	412'000.00	448'499.08
23.10.2019	EUR	CHF	32'100'000.00	34'846'476.00
23.10.2019	EUR	CHF	26'550'000.00	29'228'895.00
23.10.2019	EUR	CHF	300'000.00	327'627.00
23.10.2019	EUR	CHF	80'000.00	88'206.64
23.10.2019	EUR	CHF	27'000.00	29'909.25
23.10.2019	EUR	CHF	53'000.00	57'880.77
23.10.2019	EUR	CHF	1'180'000.00	1'307'145.00
23.10.2019	EUR	CHF	45'000.00	49'089.60
23.10.2019	GBP	CHF	950'000.00	1'206'880.00
23.10.2019	GBP	CHF	350'000.00	412'658.75
23.10.2019	HKD	CHF	23'900'000.00	3'040'080.00
23.10.2019	JPY	CHF	1'900'000'000.00	17'459'100.00
23.10.2019	JPY	CHF	86'000'000.00	788'697.40
23.10.2019	JPY	CHF	50'000'000.00	467'235.00
23.10.2019	USD	CHF	108'000.00	105'491.16
23.10.2019	USD	CHF	2'200'000.00	2'186'954.00
23.10.2019	USD	CHF	150'000.00	146'913.00
23.10.2019	USD	CHF	245'000.00	241'447.50
23.10.2019	USD	CHF	550'000.00	547'519.50
23.10.2019	USD	CHF	240'000'000.00	239'592'000.00
23.10.2019	USD	CHF	600'000.00	590'208.00
23.10.2019	USD	CHF	93'000.00	89'954.25
23.10.2019	USD	CHF	110'000.00	107'486.50
23.10.2019	USD	CHF	15'380'000.00	15'079'336.38
23.10.2019	USD	CHF	340'000.00	336'447.00
23.10.2019	USD	CHF	1'000'000.00	972'780.00
23.10.2019	USD	CHF	120'000.00	116'587.20
23.10.2019	USD	CHF	2'600'000.00	2'527'018.00



Verfall	Kauf	Verkauf	Kauf Betrag	Verkauf Betrag
23.10.2019	USD	CHF	150'000.00	145'917.00
23.10.2019	USD	CHF	103'000.00	100'920.43

## Während der Berichtsperiode getätigte engagementerhöhende Derivate

### Futures

Bezeichnung	Verfall	Käufe/Kontrakte	Verkäufe/Kontrakte
TOPIX DEC 19	13.12.2019	30	30
TOPIX Sep 19	13.09.2019	30	30

- 1 Kauf umfasst die Transaktionen: Gratistitel / Käufe / Konversionen / Namensänderungen / "Splits" / Stock- / Wahldividenden / Titelaufteilungen / Überträge / Umbuchungen in Folge Redenominierung in Euro / Umtausch zwischen Gesellschaften / Zuteilungen aus Bezugs- / Optionsrechten / Zuteilung von Bezugsrechten auf Basistiteln
- 2 Verkauf umfasst die Transaktionen: Auslosungen / Ausbuchung in Folge Verfall / Ausübung von Bezugs- / Optionsrechten / "Reverse Splits" / Überträge / Umbuchungen in Folge Redenominierung in Fondswährung / Umtausch zwischen Gesellschaften / Verkäufe / Rückzahlungen
- 3 Allfällige Abweichungen in den Totalisierungen sind auf Rundungsdifferenzen zurückzuführen

## LGT Sustainable Fixed Income Global Opportunities OGAW nach liechtensteinischem Recht

### Dreijahresvergleich

Per:	30.11.2019	30.11.2018	30.11.2017
Nettovermögen (EUR) B	63'679'512	73'650'202	118'800'806
Anzahl Anteile im Umlauf (EUR) B	37'705	45'173	70'550
Nettoinventarwert pro Anteil am Ende der Periode (EUR) B	1'688.89	1'630.40	1'683.93
Nettoinventarwert pro Anteil zu Beginn der Periode (EUR) B	1'630.40	1'683.93	1'689.62
Veränderung Inventarwert in Prozent gg. Vorjahr (EUR) B	3.59%	-3.18%	-0.34%
Nettovermögen (CHF) B	38'663'895	44'339'774	62'648'057
Anzahl Anteile im Umlauf (CHF) B	39'873	47'176	64'254
Nettoinventarwert pro Anteil am Ende der Periode (CHF) B	969.67	939.87	975.01
Nettoinventarwert pro Anteil zu Beginn der Periode (CHF) B	939.87	975.01	1'000.00 <sup>1</sup>
Veränderung Inventarwert in Prozent gg. Vorjahr (CHF) B	3.17%	-3.60%	-2.50% <sup>1</sup>
Nettovermögen (USD) B	28'794'539	40'127'456	54'046'660
Anzahl Anteile im Umlauf (USD) B	27'439	40'765	54'509
Nettoinventarwert pro Anteil am Ende der Periode (USD) B	1'049.42	984.35	991.52
Nettoinventarwert pro Anteil zu Beginn der Periode (USD) B	984.35	991.52	1'000.00 <sup>1</sup>
Veränderung Inventarwert in Prozent gg. Vorjahr (USD) B	6.61%	-0.72%	-0.85% <sup>1</sup>
Nettovermögen (EUR) I1	788'615	755'991	775'367
Anzahl Anteile im Umlauf (EUR) I1	789	789	789
Nettoinventarwert pro Anteil am Ende der Periode (EUR) I1	999.92	958.56	983.12
Nettoinventarwert pro Anteil zu Beginn der Periode (EUR) I1	958.56	983.12	1'000.00 <sup>1</sup>
Veränderung Inventarwert in Prozent gg. Vorjahr (EUR) I1	4.31%	-2.50%	-1.69% <sup>1</sup>
Nettovermögen (EUR) C	3'003'666	2'941'277	3'031'563
Anzahl Anteile im Umlauf (EUR) C	2'856	2'913	2'923
Nettoinventarwert pro Anteil am Ende der Periode (EUR) C	1'051.55	1'009.56	1'036.99
Nettoinventarwert pro Anteil zu Beginn der Periode (EUR) C	1'009.56	1'036.99	1'034.79
Veränderung Inventarwert in Prozent gg. Vorjahr (EUR) C	4.16%	-2.65%	0.21%
Nettovermögen (CHF) C	277'332	304'422	671'792
Anzahl Anteile im Umlauf (CHF) C	282	321	687
Nettoinventarwert pro Anteil am Ende der Periode (CHF) C	984.05	948.86	978.53
Nettoinventarwert pro Anteil zu Beginn der Periode (CHF) C	948.86	978.53	1'000.00 <sup>1</sup>
Veränderung Inventarwert in Prozent gg. Vorjahr (CHF) C	3.71%	-3.03%	-2.15% <sup>1</sup>

<b>Per:</b>	<b>30.11.2019</b>	<b>30.11.2018</b>	<b>30.11.2017</b>
Nettovermögen (EUR) IM	35'034	33'424	34'117
Anzahl Anteile im Umlauf (EUR) IM	35	35	35
Nettoinventarwert pro Anteil am Ende der Periode (EUR) IM	1'012.58	966.04	986.06
Nettoinventarwert pro Anteil zu Beginn der Periode (EUR) IM	966.04	986.06	1'000.00 <sup>1</sup>
Veränderung Inventarwert in Prozent gg. Vorjahr (EUR) IM	4.82%	-2.03%	-1.39% <sup>1</sup>

<sup>1</sup> Seit Lancierung am 18.04.2017

Der Fonds verzichtet auf einen Benchmark, da kein vergleichbarer Index existiert.

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

## Vermögensrechnung per 30.11.2019

	<b>30.11.2019</b>
<b>Verkehrswerte</b>	<b>EUR</b>
Bankguthaben	
auf Sicht	4'584'427.91
Wertpapiere	
Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen	87'391'694.33
Anlagefonds	29'660'065.71
Andere Wertpapiere und Wertrechte	6'629'600.00
Derivative Finanzinstrumente	493'649.49
Sonstige Vermögenswerte	684'057.73
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>129'443'495.17</b>
Verbindlichkeiten	-481'726.46
<b>Nettovermögen</b>	<b>128'961'768.71</b>

## Erfolgsrechnung für die Zeit vom 01.06.2019 bis 30.11.2019

	<b>30.11.2019</b>
<b>Ertrag</b>	<b>EUR</b>
Erträge der Bankguthaben	25'410.62
Erträge der Wertpapiere	
Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen	1'411'070.35
Erträge aus Securities Lending	6'553.30
Sonstige Erträge	4'392.49
Einkauf in laufende Erträge bei der Ausgabe von Anteilen	2'259.19
<b>Total Ertrag</b>	<b>1'449'685.95</b>
<b>Aufwand</b>	<b>30.11.2019</b>
	<b>EUR</b>
Passivzinsen	3'823.88
Reglementarische Vergütungen	882'662.84
Sonstige Aufwendungen	14'444.29
Ausrichtung laufender Erträge bei der Rücknahme von Anteilen	40'734.92
<b>Total Aufwand</b>	<b>941'665.93</b>
<b>Nettoertrag</b>	<b>508'020.02</b>
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste	4'891'781.32
<b>Realisierter Erfolg</b>	<b>5'399'801.34</b>
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste	-2'054'531.97
<b>Gesamterfolg</b>	<b>3'345'269.37</b>

## Veränderung des Nettovermögens

	<b>30.11.2019</b>
	<b>EUR</b>
Nettovermögen zu Beginn der Berichtsperiode	134'089'552.20
Ausschüttungen	0.00
Saldo aus dem Anteilverkehr	-8'473'052.86
Gesamterfolg	3'345'269.37
<b>Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode</b>	<b>128'961'768.71</b>

## Entwicklung der Anteile im Umlauf

	<b>30.11.2019</b>
	<b>Anzahl</b>
LGT Sustainable Fixed Income Global Opportunities (EUR) B	
Bestand Anzahl Anteile zu Beginn der Berichtsperiode	39'749.016
Ausgegebene Anteile	3'369.000
Zurückgenommene Anteile	-5'413.121
<b>Bestand Anzahl Anteile am Ende der Berichtsperiode</b>	<b>37'704.895</b>

	<b>30.11.2019</b>
	<b>Anzahl</b>
LGT Sustainable Fixed Income Global Opportunities (CHF) B	
Bestand Anzahl Anteile zu Beginn der Berichtsperiode	41'951.805
Ausgegebene Anteile	0.000
Zurückgenommene Anteile	-2'078.416
<b>Bestand Anzahl Anteile am Ende der Berichtsperiode</b>	<b>39'873.389</b>

	<b>30.11.2019</b>
	<b>Anzahl</b>
LGT Sustainable Fixed Income Global Opportunities (USD) B	
Bestand Anzahl Anteile zu Beginn der Berichtsperiode	31'056.699
Ausgegebene Anteile	0.000
Zurückgenommene Anteile	-3'618.123
<b>Bestand Anzahl Anteile am Ende der Berichtsperiode</b>	<b>27'438.576</b>

	<b>30.11.2019</b>
	<b>Anzahl</b>
LGT Sustainable Fixed Income Global Opportunities (EUR) I1	
Bestand Anzahl Anteile zu Beginn der Berichtsperiode	788.677
Ausgegebene Anteile	0.000
Zurückgenommene Anteile	0.000
<b>Bestand Anzahl Anteile am Ende der Berichtsperiode</b>	<b>788.677</b>

	<b>30.11.2019</b>
	<b>Anzahl</b>
LGT Sustainable Fixed Income Global Opportunities (EUR) C	
Bestand Anzahl Anteile zu Beginn der Berichtsperiode	2'860.415
Ausgegebene Anteile	0.000
Zurückgenommene Anteile	-4.000
<b>Bestand Anzahl Anteile am Ende der Berichtsperiode</b>	<b>2'856.415</b>

**30.11.2019**

**Anzahl**

LGT Sustainable Fixed Income Global Opportunities (CHF) C	
Bestand Anzahl Anteile zu Beginn der Berichtsperiode	283.828
Ausgegebene Anteile	0.000
Zurückgenommene Anteile	-2.000
<b>Bestand Anzahl Anteile am Ende der Berichtsperiode</b>	<b>281.828</b>

**30.11.2019**

**Anzahl**

LGT Sustainable Fixed Income Global Opportunities (EUR) IM	
Bestand Anzahl Anteile zu Beginn der Berichtsperiode	34.599
Ausgegebene Anteile	0.000
Zurückgenommene Anteile	0.000
<b>Bestand Anzahl Anteile am Ende der Berichtsperiode</b>	<b>34.599</b>

## Inventar des Fondsvermögens

Bezeichnung	Laufzeit	Bestand 31.05.2019 Anzahl/ Nominal	Kauf <sup>1</sup>	Verkauf <sup>2</sup>	Bestand 30.11.2019 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert in EUR <sup>3</sup>	in % <sup>3</sup>
<b>Wertpapiere</b>							
<b>Obligationen</b>							
<i>Obligationen, die an einer Börse gehandelt werden</i>							
<b>EUR</b>							
3.3750 % Altice FR	2019 - 28	0	1'000'000	1'000'000	0	0.00	0.00
1.1250 % ANZ	2019 - 29	0	1'000'000	0	1'000'000	999'500.00	0.78
0.5000 % Apple	2019 - 31	0	500'000	0	500'000	502'300.00	0.39
1.0000 % BBVA	2019 - 26	0	3'300'000	2'600'000	700'000	718'830.00	0.56
0.7500 % Bk Zachodni	2018 - 21	3'200'000	0	3'200'000	0	0.00	0.00
0.1000 % BRD	2015 - 26	1'900'000	0	1'900'000	0	0.00	0.00
0.0000 % Casino	2012 - 20	1'200'000	2'700'000	3'900'000	0	0.00	0.00
1.8650 % Casino	2017 - 22	0	3'200'000	3'200'000	0	0.00	0.00
3.5800 % Casino	2014 - 25	500'000	1'600'000	1'300'000	800'000	686'544.00	0.53
4.4070 % Casino	2012 - 19	0	1'000'000	1'000'000	0	0.00	0.00
4.5610 % Casino	2013 - 23	0	200'000	200'000	0	0.00	0.00
1.0330 % Casino WFM	2005 - 99	0	6'400'000	700'000	5'700'000	2'135'961.00	1.66
3.9920 % Casino WFM	2013 - 99	3'700'000	3'200'000	3'400'000	3'500'000	2'065'770.00	1.60
7.8750 % CGG Holding	2018 - 23	1'500'000	700'000	2'200'000	0	0.00	0.00
1.1250 % Covivio	2019 - 31	0	3'700'000	600'000	3'100'000	3'167'859.00	2.46
1.0000 % DANONE	2018 - 25	2'000'000	400'000	2'000'000	400'000	419'080.00	0.32
2.5000 % Digital Euro	2019 - 26	2'800'000	800'000	1'200'000	2'400'000	2'610'720.00	2.02
3.0000 % Dometic Group	2019 - 26	0	300'000	300'000	0	0.00	0.00
1.1250 % Ferr Stato	2019 - 26	0	2'600'000	800'000	1'800'000	1'844'478.00	1.43
2.0000 % Fidelity	2019 - 30	1'400'000	0	1'400'000	0	0.00	0.00
1.1000 % France	2009 - 22	1'900'000	0	1'900'000	0	0.00	0.00
1.8000 % Int Flavors	2018 - 26	0	1'200'000	0	1'200'000	1'272'840.00	0.99
2.1250 % Klepierre	2015 - 25	2'000'000	0	0	2'000'000	2'203'140.00	1.71
0.2500 % Kon Ah Del	2019 - 25	0	2'400'000	0	2'400'000	2'401'200.00	1.86
0.5000 % LG Chem	2019 - 23	900'000	0	900'000	0	0.00	0.00
0.6250 % McDonald's	2017 - 24	1'200'000	0	1'200'000	0	0.00	0.00
1.5000 % McDonald's	2017 - 29	0	500'000	500'000	0	0.00	0.00
1.6000 % McDonald's	2019 - 31	1'500'000	2'100'000	3'600'000	0	0.00	0.00
0.6250 % Mediobc	2017 - 22	0	2'000'000	2'000'000	0	0.00	0.00
2.8750 % Ol Eu Grp	2019 - 25	0	300'000	0	300'000	306'570.00	0.24
0.8750 % OTE	2019 - 26	0	2'000'000	0	2'000'000	2'017'200.00	1.56
1.8750 % Proximus	2015 - 25	0	2'300'000	0	2'300'000	2'518'040.00	1.95
5.8750 % Quatrim	2019 - 24	0	900'000	900'000	0	0.00	0.00
5.8750 % Quatrim	2019 - 24	0	300'000	0	300'000	313'380.00	0.24
0.0000 % Rallye	2017 - 23	0	3'600'000	3'600'000	0	0.00	0.00
0.0000 % Rallye	2014 - 22	0	9'600'000	1'000'000	8'600'000	2'169'522.00	1.68
0.2500 % RBC	2019 - 24	500'000	3'000'000	600'000	2'900'000	2'905'539.00	2.25
0.7500 % RBS	2019 - 25	0	800'000	0	800'000	797'912.00	0.62
2.0000 % Rich Intl Hold	2018 - 38	0	500'000	500'000	0	0.00	0.00



Bezeichnung	Laufzeit	Bestand 31.05.2019 Anzahl/ Nominal	Kauf <sup>1</sup>	Verkauf <sup>2</sup>	Bestand 30.11.2019 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert in EUR <sup>3</sup>	in % <sup>3</sup>
6.7500 % Santander WFM	2017 - 99	800'000	0	800'000	0	0.00	0.00
1.2500 % SAP	2018 - 28	0	1'800'000	0	1'800'000	1'953'180.00	1.51
5.3750 % TAKKO Lux 2	2017 - 23	0	5'650'000	5'650'000	0	0.00	0.00
5.3750 % TAKKO Lux 2	2017 - 23	0	5'600'000	200'000	5'400'000	4'991'706.00	3.87
1.0690 % Telefonica	2019 - 24	0	500'000	0	500'000	518'400.00	0.40
1.0000 % Terna	2018 - 23	2'000'000	0	2'000'000	0	0.00	0.00
1.3750 % Tesco Corp	2018 - 23	0	1'600'000	0	1'600'000	1'654'880.00	1.28
1.7500 % Unibail	2019 - 34	0	1'500'000	0	1'500'000	1'630'800.00	1.26
0.8750 % Verizon	2019 - 27	0	1'000'000	1'000'000	0	0.00	0.00
0.2500 % World Bank	2019 - 29	500'000	2'000'000	2'500'000	0	0.00	0.00
<b>Total</b>						<b>42'805'351.00</b>	<b>33.19</b>

#### GBP

1.2500 % Henkel	2019 - 26	0	300'000	0	300'000	350'755.82	0.27
1.0000 % UK	2018 - 24	0	5'500'000	0	5'500'000	6'588'193.01	5.11
1.8750 % UK	2007 - 22	1'400'000	0	1'400'000	0	0.00	0.00
<b>Total</b>						<b>6'938'948.83</b>	<b>5.38</b>

#### USD

4.0500 % AbbVie	2019 - 39	0	500'000	0	500'000	471'964.82	0.37
4.7500 % ABN AMRO	2015 - 25	1'200'000	600'000	1'800'000	0	0.00	0.00
3.0000 % Apple	2017 - 27	0	3'800'000	500'000	3'300'000	3'149'028.83	2.44
6.5000 % BBVA WFM	2019 - 99	0	2'400'000	1'200'000	1'200'000	1'144'187.15	0.89
3.5000 % Braskem Neth	2017 - 23	200'000	0	200'000	0	0.00	0.00
3.9500 % Camb Soup	2018 - 25	600'000	1'400'000	2'000'000	0	0.00	0.00
4.1500 % Camb Soup	2018 - 28	0	2'700'000	0	2'700'000	2'647'348.36	2.05
4.8000 % Camb Soup	2018 - 48	3'900'000	1'800'000	5'700'000	0	0.00	0.00
5.8946 % CGG	2018 - 24	0	1'500'000	0	1'500'000	1'556'935.62	1.21
9.0000 % CGG Holding	2018 - 23	1'700'000	900'000	2'600'000	0	0.00	0.00
4.8500 % Conagra	2018 - 28	2'900'000	700'000	1'800'000	1'800'000	1'852'094.92	1.44
6.5000 % Coty	2018 - 26	4'600'000	400'000	5'000'000	0	0.00	0.00
3.7500 % Cred Agri	2018 - 23	900'000	2'400'000	3'300'000	0	0.00	0.00
2.7500 % CVS Health	2012 - 22	0	1'800'000	1'800'000	0	0.00	0.00
2.3750 % Diageo Cap	2019 - 29	0	2'200'000	0	2'200'000	1'974'082.99	1.53
3.9500 % Dig Real Tr	2015 - 22	600'000	1'400'000	1'800'000	200'000	189'163.23	0.15
5.7500 % DnB Bk ASA WFM	2015 - 99	1'000'000	1'500'000	700'000	1'800'000	1'641'606.58	1.27
8.3750 % DNO	2019 - 24	1'000'000	1'000'000	2'000'000	0	0.00	0.00
3.9000 % Home Depot	2017 - 47	0	4'400'000	4'400'000	0	0.00	0.00
4.5000 % Hospitality	2014 - 25	1'800'000	0	1'800'000	0	0.00	0.00
4.8500 % Hyatt	2016 - 26	400'000	0	400'000	0	0.00	0.00
6.2500 % JBS Invs	2013 - 23	500'000	0	500'000	0	0.00	0.00
4.5000 % Kellogg	2016 - 46	0	2'500'000	0	2'500'000	2'526'619.19	1.96
3.7000 % Kroger	2017 - 27	0	1'500'000	0	1'500'000	1'454'300.86	1.13
4.4500 % Kroger	2017 - 47	0	400'000	0	400'000	385'252.23	0.30
3.2500 % LG Chem	2019 - 24	600'000	0	600'000	0	0.00	0.00
3.6250 % LG Chem	2019 - 29	1'300'000	800'000	0	2'100'000	1'980'214.23	1.54
3.7500 % Marriott	2016 - 25	400'000	0	400'000	0	0.00	0.00

Bezeichnung	Laufzeit	Bestand 31.05.2019 Anzahl/ Nominal	Kauf <sup>1</sup>	Verkauf <sup>2</sup>	Bestand 30.11.2019 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert in EUR <sup>3</sup>	in % <sup>3</sup>
4.5000 % Marriott	2016 - 34	4'000'000	0	4'000'000	0	0.00	0.00
4.1250 % MPLX	2017 - 27	0	800'000	0	800'000	753'213.64	0.58
2.6250 % PepsiCo	2019 - 29	0	1'500'000	0	1'500'000	1'396'888.52	1.08
2.8750 % PepsiCo	2019 - 49	0	1'200'000	0	1'200'000	1'070'873.49	0.83
7.5000 % RBS WFM	2015 - 99	1'200'000	800'000	0	2'000'000	1'859'633.80	1.44
4.7380 % Sp Spectrum	2018 - 25	3'400'000	0	2'000'000	1'400'000	1'346'528.92	1.04
2.4500 % Starbucks	2016 - 26	3'900'000	1'000'000	4'900'000	0	0.00	0.00
2.6000 % Thermo	2019 - 29	0	3'000'000	900'000	2'100'000	1'886'618.51	1.46
4.0000 % T-Mobile US	2017 - 22	0	1'000'000	1'000'000	0	0.00	0.00
7.1250 % UBS Fundin WFM	2016 - 99	800'000	0	800'000	0	0.00	0.00
7.0000 % UBS Grp WFM	2019 - 99	500'000	900'000	0	1'400'000	1'378'070.33	1.07
2.7500 % USA	2018 - 23	7'500'000	0	3'500'000	4'000'000	3'770'235.80	2.92
2.7500 % Visa	2017 - 27	0	900'000	0	900'000	852'671.22	0.66
4.3000 % Visa	2015 - 45	0	1'400'000	0	1'400'000	1'565'325.26	1.21
<b>Total</b>						<b>36'852'858.50</b>	<b>28.58</b>

#### Total Obligationen, die an einer Börse gehandelt werden

**86'597'158.33 67.15**

Obligationen, die an einem anderen dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden

#### EUR

0.3750 % Abbot IE	2019 - 27	0	1'500'000	700'000	800'000	794'536.00	0.62
-------------------	-----------	---	-----------	---------	---------	------------	------

#### Total Obligationen, die an einem anderen dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden

**794'536.00 0.62**

#### Anlagefonds

Crown LGT Bd EM SF A USD		10'620	880	1'300	10'200	10'568'474.67	8.20
Crown LGT Sustainable Bd Corp A USD		3'720	0	0	3'720	3'806'406.66	2.95
LGT Bond EMMA LC Sub-Fund B (EUR)		7'758	3'000	4'258	6'500	6'644'755.00	5.15
LGT Sustainable Bond Global Sub-Fd B (EUR)		7'500	0	3'800	3'700	4'024'342.00	3.12
MA Sustainable Portfolio Corp Bds (USD) IM		7'600	0	7'600	0	0.00	0.00
Ut Dual R V Mic LC I		11'500	0	0	11'500	1'397'981.44	1.08
Ut Dual R V Microf I USD		28'200	0	0	28'200	3'218'105.94	2.50
<b>Total Anlagefonds</b>						<b>29'660'065.71</b>	<b>23.00</b>

#### Andere Wertpapiere und Wertrechte

Andere Wertpapiere und Wertrechte, die an einer Börse gehandelt werden

#### EUR

JPM Ct/Ref Port 21	2018 - 21	8'000'000	0	0	8'000'000	6'629'600.00	5.14
--------------------	-----------	-----------	---	---	-----------	--------------	------

#### Total Andere Wertpapiere und Wertrechte, die an einer Börse gehandelt werden

**6'629'600.00 5.14**

#### Total Wertpapiere

**123'681'360.04 95.91**

Bezeichnung	Laufzeit	Bestand 31.05.2019 Anzahl/ Nominal	Kauf <sup>1</sup>	Verkauf <sup>2</sup>	Bestand 30.11.2019 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert in EUR <sup>3</sup>	in % <sup>3</sup>
Total Wertpapiere						123'681'360.04	95.91
Bankguthaben auf Sicht						4'584'427.91	3.55
Derivative Finanzinstrumente						493'649.49	0.38
Sonstige Vermögenswerte						684'057.73	0.53
<b>Gesamtvermögen per 30.11.2019</b>						<b>129'443'495.17</b>	<b>100.37</b>
Verbindlichkeiten						-481'726.46	-0.37
<b>Nettovermögen per 30.11.2019</b>						<b>128'961'768.71</b>	<b>100.00</b>

## Derivative Finanzinstrumente

### Am Ende der Berichtsperiode offene derivative Finanzinstrumente

#### Devisentermingeschäfte

Währung		Betrag	gegen	Gegenwert	Verfall	Gegenpartei	Verkehrswert in EUR <sup>3</sup>	in % <sup>3</sup>
USD	Kauf	1'000'000.00	BRL	4'138'500.00	16.01.2020	LGT Bank AG	21'714.15	0.02
USD	Kauf	1'000'000.00	CLP	712'840'000.00	16.01.2020	LGT Bank AG	103'059.28	0.08
USD	Kauf	1'000'000.00	COP	3'454'000'000.00	16.01.2020	LGT Bank AG	18'321.56	0.01
USD	Kauf	1'000'000.00	PEN	3'380'500.00	16.01.2020	LGT Bank AG	6'633.18	0.01
AUD	Kauf	1'000'000.00	EUR	620'176.96	07.02.2020	LGT Bank AG	-8'648.17	-0.01
CAD	Kauf	1'590'000.00	EUR	1'083'277.47	07.02.2020	LGT Bank AG	-2'333.83	0.00
CHF	Kauf	39'050'000.00	EUR	35'432'356.41	07.02.2020	LGT Bank AG	31'567.11	0.02
CHF	Kauf	277'600.00	EUR	251'882.77	07.02.2020	LGT Bank AG	224.40	0.00
NOK	Kauf	24'000'000.00	EUR	2'346'762.52	07.02.2020	LGT Bank AG	6'267.47	0.00
NZD	Kauf	2'800'000.00	EUR	1'604'408.92	07.02.2020	LGT Bank AG	19'569.35	0.02
RUB	Kauf	45'000'000.00	EUR	625'791.80	07.02.2020	LGT Bank AG	613.95	0.00
USD	Kauf	1'800'000.00	EUR	1'615'798.92	07.02.2020	LGT Bank AG	8'807.00	0.01
USD	Kauf	2'700'000.00	EUR	2'422'371.95	07.02.2020	LGT Bank AG	14'536.93	0.01
USD	Kauf	31'300'000.00	EUR	27'862'840.05	07.02.2020	LGT Bank AG	387'251.79	0.30
ARS	Kauf	174'800'000.00	USD	2'000'000.00	20.03.2020	LGT Bank AG	275'615.99	0.21
USD	Kauf	2'155'363.75	ARS	174'800'000.00	20.03.2020	LGT Bank AG	-170'586.86	-0.13
CHF	Verkauf	4'000'000.00	EUR	3'635'187.16	07.02.2020	LGT Bank AG	2'518.94	0.00
CZK	Verkauf	50'000'000.00	EUR	1'950'813.74	07.02.2020	LGT Bank AG	-690.83	0.00
GBP	Verkauf	6'080'000.00	EUR	7'039'473.15	07.02.2020	LGT Bank AG	-74'984.13	-0.06
HUF	Verkauf	550'000'000.00	EUR	1'657'600.10	07.02.2020	LGT Bank AG	13'914.60	0.01
JPY	Verkauf	276'000'000.00	EUR	2'283'543.26	07.02.2020	LGT Bank AG	-2'561.83	0.00
PLN	Verkauf	9'000'000.00	EUR	2'095'916.11	07.02.2020	LGT Bank AG	19'363.78	0.02
RUB	Verkauf	80'000'000.00	EUR	1'111'721.01	07.02.2020	LGT Bank AG	-1'889.21	0.00
SEK	Verkauf	7'000'000.00	EUR	653'864.93	07.02.2020	LGT Bank AG	-8'962.33	-0.01
SEK	Verkauf	3'000'000.00	EUR	280'941.89	07.02.2020	LGT Bank AG	-3'126.93	0.00
THB	Verkauf	50'000'000.00	EUR	1'479'355.59	07.02.2020	LGT Bank AG	-14'010.07	-0.01
TRY	Verkauf	800'000.00	EUR	121'406.19	07.02.2020	LGT Bank AG	-2'509.72	0.00
USD	Verkauf	2'400'000.00	EUR	2'154'824.11	07.02.2020	LGT Bank AG	-11'317.12	-0.01
USD	Verkauf	72'000'000.00	EUR	64'526'999.17	07.02.2020	LGT Bank AG	-457'237.64	-0.35
USD	Verkauf	2'200'000.00	EUR	1'974'386.82	07.02.2020	LGT Bank AG	-11'242.64	-0.01
ZAR	Verkauf	7'000'000.00	EUR	418'605.71	07.02.2020	LGT Bank AG	-8'584.09	-0.01
<b>Total Devisentermingeschäfte</b>							<b>151'294.08</b>	<b>0.12</b>

### Am Ende der Berichtsperiode offene engagementreduzierende Derivate

#### Futures

Bezeichnung	Anzahl Kontrakte	Kontraktgrösse	Verfall	Gegenpartei	Kontraktwert in EUR	Verkehrswert in EUR <sup>3</sup>	in % <sup>3</sup>
Bund DEC 19	-45	100'000.00	10.12.2019	EUREX	-7'698'150.00	255'600.00	0.20
CAN 10Y BD MAR 20	-8	100'000.00	31.03.2020	MSE	-765'225.79	-491.69	0.00
US 10yr Note MAR 20	-260	100'000.00	31.03.2020	CME	-30'505'124.68	58'954.22	0.05

Bezeichnung	Anzahl Kontrakte	Kontraktgrösse	Verfall	Gegenpartei	Kontraktwert in EUR	Verkehrswert in EUR <sup>3</sup>	in % <sup>3</sup>
US 30yr Bd MAR 20	-20	100'000.00	31.03.2020	CME	-2'883'655.02	7'227.56	0.01
10yr JGB DEC 19	-4	100'000'000.00	20.12.2019	JPX	-5'074'829.50	58'647.48	0.05
10yr Lg Gilt MAR 20	-16	100'000.00	31.03.2020	ICE	-2'491'561.09	1'313.72	0.00
<b>Total</b>					<b>-49'418'546.08</b>	<b>381'251.29</b>	<b>0.30</b>

#### Am Ende der Berichtsperiode offene engagementerhöhende Derivate

##### Futures

Bezeichnung	Anzahl Kontrakte	Kontraktgrösse	Verfall	Gegenpartei	Kontraktwert in EUR	Verkehrswert in EUR <sup>3</sup>	in % <sup>3</sup>
AUST 10yr Bd DEC 19	2	100'000.00	16.12.2019	SFE	180'415.04	727.87	0.00
Euro OAT DEC 19	11	100'000.00	10.12.2019	EUREX	1'843'600.00	-35'800.00	-0.03
US 5yr Note MAR 20	77	100'000.00	03.04.2020	CME	8'308'548.73	-6'001.71	0.00
<b>Total</b>					<b>10'332'563.77</b>	<b>-41'073.84</b>	<b>-0.03</b>

#### Am Ende der Berichtsperiode offene engagementreduzierende Derivate

##### Optionen

Bezeichnung	Anzahl Kontrakte	Verfall	Gegenpartei	Verkehrswert in EUR <sup>3</sup>	Anteil am Nettovermögen in % <sup>3</sup>
FX OTC Put Option - EUR/CHF USNY 10:0	10'000'000	23.03.2020	LGT Bank AG	10'172.93	0.01
FX OTC Put Option - EUR/JPY USNY 10:0	1'500'000	08.05.2020	LGT Bank AG	10'250.06	0.01
<b>Total</b>				<b>20'422.99</b>	<b>0.02</b>

#### Am Ende der Berichtsperiode offene engagementerhöhende Derivate

##### Optionen

Bezeichnung	Anzahl Kontrakte	Verfall	Gegenpartei	Verkehrswert in EUR <sup>3</sup>	Anteil am Nettovermögen in % <sup>3</sup>
FX OTC Put Option - EUR/CHF USNY 10:0	-5'000'000	23.03.2020	LGT Bank AG	-18'245.03	-0.01
<b>Total</b>				<b>-18'245.03</b>	<b>-0.01</b>
<b>Total am Ende der Berichtsperiode offene derivative Finanzinstrumente</b>				<b>493'649.49</b>	<b>0.38</b>

## Während der Berichtsperiode getätigte derivative Finanzinstrumente

### Devisentermingeschäfte

Verfall	Kauf	Verkauf	Kauf Betrag	Verkauf Betrag
08.08.2019	EUR	ZAR	428'076.96	7'000'000.00
09.08.2019	AUD	EUR	2'550'000.00	1'595'070.92
09.08.2019	CAD	EUR	1'540'000.00	1'015'516.30
09.08.2019	CHF	EUR	273'700.00	240'994.62
09.08.2019	CHF	EUR	2'000.00	1'796.96
09.08.2019	CHF	EUR	40'650'000.00	35'792'587.90
09.08.2019	EUR	AUD	969'027.46	1'600'000.00
09.08.2019	EUR	CHF	395'583.53	450'000.00
09.08.2019	EUR	CHF	36'522'539.10	39'700'000.00
09.08.2019	EUR	CHF	446'213.43	500'000.00
09.08.2019	EUR	CHF	253'633.85	275'700.00
09.08.2019	EUR	CHF	3'681'626.93	4'200'000.00
09.08.2019	EUR	CZK	1'936'177.62	50'000'000.00
09.08.2019	EUR	GBP	5'255'661.97	4'550'000.00
09.08.2019	EUR	HUF	1'700'916.95	550'000'000.00
09.08.2019	EUR	JPY	3'363'632.72	420'000'000.00
09.08.2019	EUR	PLN	2'087'743.21	9'000'000.00
09.08.2019	EUR	RUB	1'083'130.25	80'000'000.00
09.08.2019	EUR	THB	1'385'271.79	50'000'000.00
09.08.2019	EUR	TRY	1'310'979.84	8'500'000.00
09.08.2019	EUR	USD	2'022'326.48	2'300'000.00
09.08.2019	EUR	USD	28'430'493.27	31'700'000.00
09.08.2019	EUR	USD	707'952.07	800'000.00
09.08.2019	EUR	USD	619'984.77	700'000.00
09.08.2019	EUR	USD	71'566'193.86	80'900'000.00
09.08.2019	GBP	EUR	300'000.00	334'228.32
09.08.2019	GBP	EUR	1'600'000.00	1'807'174.48
09.08.2019	JPY	EUR	140'000'000.00	1'185'636.86
09.08.2019	NOK	EUR	8'000'000.00	802'574.66
09.08.2019	NOK	EUR	9'000'000.00	926'507.38
09.08.2019	NZD	EUR	2'800'000.00	1'655'531.25
09.08.2019	TRY	EUR	15'700'000.00	2'199'156.76
09.08.2019	USD	EUR	3'000'000.00	2'705'300.77
09.08.2019	USD	EUR	1'000'000.00	882'885.27
09.08.2019	USD	EUR	300'000.00	269'186.25
09.08.2019	USD	EUR	31'400'000.00	27'940'666.13
19.09.2019	ARS	EUR	204'150'000.00	3'000'000.00
08.11.2019	AUD	EUR	990'000.00	592'161.93
08.11.2019	CAD	EUR	1'500'000.00	1'002'603.43
08.11.2019	CHF	EUR	275'700.00	253'949.25
08.11.2019	CHF	EUR	1'900.00	1'740.28
08.11.2019	CHF	EUR	39'700'000.00	36'567'954.68
08.11.2019	CHF	EUR	400'000.00	368'578.67
08.11.2019	EUR	CHF	35'403'445.15	39'050'000.00
08.11.2019	EUR	CHF	251'677.24	277'600.00
08.11.2019	EUR	CHF	3'934'342.23	4'300'000.00

Verfall	Kauf	Verkauf	Kauf Betrag	Verkauf Betrag
08.11.2019	EUR	CHF	506'217.27	550'000.00
08.11.2019	EUR	CHF	452'550.12	500'000.00
08.11.2019	EUR	CZK	1'932'026.14	50'000'000.00
08.11.2019	EUR	GBP	3'854'377.35	3'335'000.00
08.11.2019	EUR	GBP	451'569.20	400'000.00
08.11.2019	EUR	GBP	2'890'580.17	2'670'000.00
08.11.2019	EUR	HUF	1'688'458.01	550'000'000.00
08.11.2019	EUR	JPY	2'362'496.01	281'000'000.00
08.11.2019	EUR	PLN	2'074'358.85	9'000'000.00
08.11.2019	EUR	RUB	1'079'865.50	80'000'000.00
08.11.2019	EUR	SEK	276'669.82	3'000'000.00
08.11.2019	EUR	THB	1'443'418.01	50'000'000.00
08.11.2019	EUR	TRY	1'240'463.93	8'000'000.00
08.11.2019	EUR	USD	589'922.31	650'000.00
08.11.2019	EUR	USD	28'036'546.04	31'300'000.00
08.11.2019	EUR	USD	269'708.98	300'000.00
08.11.2019	EUR	USD	2'265'539.33	2'500'000.00
08.11.2019	EUR	USD	71'908'532.35	81'000'000.00
08.11.2019	EUR	ZAR	414'125.22	7'000'000.00
08.11.2019	GBP	EUR	200'000.00	228'128.21
08.11.2019	NOK	EUR	7'000'000.00	697'238.93
08.11.2019	NOK	EUR	17'000'000.00	1'696'234.36
08.11.2019	NZD	EUR	2'800'000.00	1'598'410.72
08.11.2019	TRY	EUR	7'200'000.00	1'123'898.40
08.11.2019	USD	EUR	350'000.00	318'996.71
08.11.2019	USD	EUR	2'000'000.00	1'797'171.25
08.11.2019	USD	EUR	3'500'000.00	3'141'831.24
08.11.2019	USD	EUR	31'700'000.00	28'235'000.71
08.11.2019	USD	EUR	200'000.00	180'354.03
08.11.2019	USD	EUR	3'000'000.00	2'720'903.34
08.11.2019	USD	EUR	2'000'000.00	1'789'810.07

## Während der Berichtsperiode getätigte engagementreduzierende Derivate

### Futures

Bezeichnung	Verfall	Käufe/Kontrakte	Verkäufe/Kontrakte
AUST 10yr Bd Jun 19	17.06.2019	23	0
AUST 10yr Bd Sep 19	16.09.2019	23	23
Bund Jun 19	06.06.2019	120	0
Bund Sep 19	06.09.2019	110	110
CAN 10Y BD Dec 19	18.12.2019	18	18
CAN 10Y BD Sep 19	19.09.2019	25	9
US 10yr Note Dec 19	19.12.2019	455	455
US 10yr Note Sep 19	19.09.2019	290	0
US 30yr Bd Dec 19	19.12.2019	20	20
US 30yr Bd Sep 19	19.09.2019	20	0
10yr JGB Jun 19	20.06.2019	5	0

Bezeichnung	Verfall	Käufe/Kontrakte	Verkäufe/Kontrakte
10yr JGB Sep 19	20.09.2019	5	5
10yr Lg Gilt Dec 19	27.12.2019	21	21
10yr Lg Gilt Sep 19	26.09.2019	11	11

### Während der Berichtsperiode getätigte engagementerhöhende Derivate

#### Futures

Bezeichnung	Verfall	Käufe/Kontrakte	Verkäufe/Kontrakte
AUST 10yr Bd Sep 19	16.09.2019	12	12
EURO BONO Jun 19	06.06.2019	0	28
EURO BONO Sep 19	06.09.2019	28	28
Euro-BTP Jun 19	06.06.2019	0	3
Euro-BTP Sep 19	06.09.2019	3	3
Euro OAT Jun 19	06.06.2019	0	4
Euro OAT Sep 19	06.09.2019	4	4
US 5yr Note Dec 19	31.12.2019	77	77
US 5yr Note Sep 19	30.09.2019	0	77

### Während der Berichtsperiode getätigte engagementreduzierende Derivate

#### Optionen

Bezeichnung	Verfall	Käufe/Kontrakte	Verkäufe/Kontrakte
FX OTC Call Option - USD/TRY GBLO 12:	07.08.2019	2'550'000	0
FX OTC Put Option - USD/TRY GBLO 12:0	07.08.2019	0	2'550'000

### Während der Berichtsperiode getätigte engagementerhöhende Derivate

#### Optionen

Bezeichnung	Verfall	Käufe/Kontrakte	Verkäufe/Kontrakte
FX OTC Call Option - USD/TRY GBLO 12:	07.08.2019	2'550'000	2'550'000
FX OTC Put Option - USD/TRY GBLO 12:0	07.08.2019	2'550'000	2'550'000
US 10yr126.5 C Aug19	26.07.2019	150	150
US 10yr 126.5C Sep19	23.08.2019	150	150

<sup>1</sup> Kauf umfasst die Transaktionen: Gratistitel / Käufe / Konversionen / Namensänderungen / "Splits" / Stock- / Wahldividenden / Titelaufteilungen / Überträge / Umbuchungen in Folge Redenominierung in Euro / Umtausch zwischen Gesellschaften / Zuteilungen aus Bezugs- / Optionsrechten / Zuteilung von Bezugsrechten auf Basistiteln

<sup>2</sup> Verkauf umfasst die Transaktionen: Auslosungen / Ausbuchung in Folge Verfall / Ausübung von Bezugs- / Optionsrechten / "Reverse Splits" / Überträge / Umbuchungen in Folge Redenominierung in Fondswährung / Umtausch zwischen Gesellschaften / Verkäufe / Rückzahlungen

<sup>3</sup> Allfällige Abweichungen in den Totalisierungen sind auf Rundungsdifferenzen zurückzuführen



## LGT Sustainable Strategy 3 Years OGAW nach liechtensteinischem Recht

### Dreijahresvergleich

Per:	30.11.2019	30.11.2018	30.11.2017
Nettovermögen (EUR) B	463'072'364	515'369'993	538'253'342
Anzahl Anteile im Umlauf (EUR) B	261'278	308'945	312'569
Nettoinventarwert pro Anteil am Ende der Periode (EUR) B	1'772.34	1'668.16	1'722.03
Nettoinventarwert pro Anteil zu Beginn der Periode (EUR) B	1'668.16	1'722.03	1'651.10
Veränderung Inventarwert in Prozent gg. Vorjahr (EUR) B	6.25%	-3.13%	4.30%
Nettovermögen (CHF) B	133'349'967	151'342'490	172'491'147
Anzahl Anteile im Umlauf (CHF) B	128'723	153'825	167'726
Nettoinventarwert pro Anteil am Ende der Periode (CHF) B	1'035.95	983.86	1'028.41
Nettoinventarwert pro Anteil zu Beginn der Periode (CHF) B	983.86	1'028.41	1'000.00 <sup>1</sup>
Veränderung Inventarwert in Prozent gg. Vorjahr (CHF) B	5.29%	-4.33%	2.84% <sup>1</sup>
Nettovermögen (USD) B	88'334'142	75'748'705	97'838'247
Anzahl Anteile im Umlauf (USD) B	80'458	74'496	93'733
Nettoinventarwert pro Anteil am Ende der Periode (USD) B	1'097.89	1'016.82	1'043.79
Nettoinventarwert pro Anteil zu Beginn der Periode (USD) B	1'016.82	1'043.79	1'000.00 <sup>1</sup>
Veränderung Inventarwert in Prozent gg. Vorjahr (USD) B	7.97%	-2.58%	4.38% <sup>1</sup>
Nettovermögen (EUR) I1	61'099'894	74'531'429	73'971'757
Anzahl Anteile im Umlauf (EUR) I1	45'583	59'580	57'772
Nettoinventarwert pro Anteil am Ende der Periode (EUR) I1	1'340.41	1'250.95	1'280.41
Nettoinventarwert pro Anteil zu Beginn der Periode (EUR) I1	1'250.95	1'280.41	1'217.28
Veränderung Inventarwert in Prozent gg. Vorjahr (EUR) I1	7.15%	-2.30%	5.19%
Nettovermögen (CHF) I1	8'105'700	7'633'131	8'070'606
Anzahl Anteile im Umlauf (CHF) I1	7'653	7'653	7'807
Nettoinventarwert pro Anteil am Ende der Periode (CHF) I1	1'059.21	997.46	1'033.81
Nettoinventarwert pro Anteil zu Beginn der Periode (CHF) I1	997.46	1'033.81	1'000.00 <sup>1</sup>
Veränderung Inventarwert in Prozent gg. Vorjahr (CHF) I1	6.19%	-3.52%	3.38% <sup>1</sup>
Nettovermögen (EUR) C	298'873	279'344	21'190
Anzahl Anteile im Umlauf (EUR) C	258	258	19
Nettoinventarwert pro Anteil am Ende der Periode (EUR) C	1'158.42	1'082.73	1'109.86
Nettoinventarwert pro Anteil zu Beginn der Periode (EUR) C	1'082.73	1'109.86	1'056.69
Veränderung Inventarwert in Prozent gg. Vorjahr (EUR) C	6.99%	-2.44%	5.03%

<b>Per:</b>	<b>30.11.2019</b>	<b>30.11.2018</b>	<b>30.11.2017</b>
Nettovermögen (EUR) IM	327'871	300'953	118'552
Anzahl Anteile im Umlauf (EUR) IM	267	264	102
Nettoinventarwert pro Anteil am Ende der Periode (EUR) IM	1'230.28	1'140.96	1'160.50
Nettoinventarwert pro Anteil zu Beginn der Periode (EUR) IM	1'140.96	1'160.50	1'096.37
Veränderung Inventarwert in Prozent gg. Vorjahr (EUR) IM	7.83%	-1.68%	5.85%

<sup>1</sup> Seit Lancierung am 18.04.2017

Der Fonds verzichtet auf einen Benchmark, da kein vergleichbarer Index existiert.

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

## Vermögensrechnung per 30.11.2019

	<b>30.11.2019</b>
<b>Verkehrswerte</b>	<b>EUR</b>
Bankguthaben	
auf Sicht	15'680'009.30
Wertpapiere	
Aktien und andere Beteiligungspapiere	199'964'577.20
Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen	26'838'607.43
Anlagefonds	425'094'775.47
Andere Wertpapiere und Wertrechte	68'989'065.40
Derivative Finanzinstrumente	-1'300'325.96
Sonstige Vermögenswerte	313'401.86
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>735'580'110.70</b>
Verbindlichkeiten	-2'294'086.32
<b>Nettovermögen</b>	<b>733'286'024.38</b>

## Erfolgsrechnung für die Zeit vom 01.06.2019 bis 30.11.2019

	<b>30.11.2019</b>
<b>Ertrag</b>	<b>EUR</b>
Erträge der Bankguthaben	68'712.91
Erträge der Wertpapiere	
Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen	235'380.85
Aktien und sonstige Beteiligungspapiere einschliesslich Erträge aus Gratisaktien	1'686'275.36
Anteile anderer Investmentunternehmen	617'718.65
Erträge aus Securities Lending	15'608.96
Sonstige Erträge	80'289.40
Einkauf in laufende Erträge bei der Ausgabe von Anteilen	-120'286.68
<b>Total Ertrag</b>	<b>2'583'699.45</b>
<b>Aufwand</b>	<b>30.11.2019</b>
	<b>EUR</b>
Passivzinsen	7'675.45
Reglementarische Vergütungen	5'614'138.27
Sonstige Aufwendungen	57'239.93
Ausrichtung laufender Erträge bei der Rücknahme von Anteilen	-141'000.55
<b>Total Aufwand</b>	<b>5'538'053.10</b>
<b>Nettoertrag</b>	<b>-2'954'353.65</b>
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste	2'369'703.31
<b>Realisierter Erfolg</b>	<b>-584'650.34</b>
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste	32'275'464.64
<b>Gesamterfolg</b>	<b>31'690'814.30</b>

## Veränderung des Nettovermögens

	<b>30.11.2019</b>
	<b>EUR</b>
Nettovermögen zu Beginn der Berichtsperiode	766'558'836.34
Ausschüttungen	0.00
Saldo aus dem Anteilverkehr	-64'963'626.26
Gesamterfolg	31'690'814.30
<b>Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode</b>	<b>733'286'024.38</b>

## Entwicklung der Anteile im Umlauf

	<b>30.11.2019</b>
	<b>Anzahl</b>
LGT Sustainable Strategy 3 Years (EUR) B	
Bestand Anzahl Anteile zu Beginn der Berichtsperiode	288'749.942
Ausgegebene Anteile	14'835.557
Zurückgenommene Anteile	-42'307.817
<b>Bestand Anzahl Anteile am Ende der Berichtsperiode</b>	<b>261'277.682</b>

	<b>30.11.2019</b>
	<b>Anzahl</b>
LGT Sustainable Strategy 3 Years (CHF) B	
Bestand Anzahl Anteile zu Beginn der Berichtsperiode	138'777.203
Ausgegebene Anteile	2'213.000
Zurückgenommene Anteile	-12'267.629
<b>Bestand Anzahl Anteile am Ende der Berichtsperiode</b>	<b>128'722.574</b>

	<b>30.11.2019</b>
	<b>Anzahl</b>
LGT Sustainable Strategy 3 Years (USD) B	
Bestand Anzahl Anteile zu Beginn der Berichtsperiode	71'001.819
Ausgegebene Anteile	13'277.723
Zurückgenommene Anteile	-3'821.166
<b>Bestand Anzahl Anteile am Ende der Berichtsperiode</b>	<b>80'458.376</b>

	<b>30.11.2019</b>
	<b>Anzahl</b>
LGT Sustainable Strategy 3 Years (EUR) I1	
Bestand Anzahl Anteile zu Beginn der Berichtsperiode	59'652.000
Ausgegebene Anteile	6'449.000
Zurückgenommene Anteile	-20'518.000
<b>Bestand Anzahl Anteile am Ende der Berichtsperiode</b>	<b>45'583.000</b>

	<b>30.11.2019</b>
	<b>Anzahl</b>
LGT Sustainable Strategy 3 Years (CHF) I1	
Bestand Anzahl Anteile zu Beginn der Berichtsperiode	7'652.586
Ausgegebene Anteile	0.000
Zurückgenommene Anteile	0.000
<b>Bestand Anzahl Anteile am Ende der Berichtsperiode</b>	<b>7'652.586</b>

**30.11.2019**  
**Anzahl**

---

LGT Sustainable Strategy 3 Years (EUR) C	
Bestand Anzahl Anteile zu Beginn der Berichtsperiode	258.000
Ausgegebene Anteile	0.000
Zurückgenommene Anteile	0.000
<b>Bestand Anzahl Anteile am Ende der Berichtsperiode</b>	<b>258.000</b>

---

**30.11.2019**  
**Anzahl**

---

LGT Sustainable Strategy 3 Years (EUR) IM	
Bestand Anzahl Anteile zu Beginn der Berichtsperiode	266.502
Ausgegebene Anteile	0.000
Zurückgenommene Anteile	0.000
<b>Bestand Anzahl Anteile am Ende der Berichtsperiode</b>	<b>266.502</b>

---

## Inventar des Fondsvermögens

Bezeichnung	Laufzeit	Bestand 31.05.2019 Anzahl/ Nominal	Kauf <sup>1</sup>	Verkauf <sup>2</sup>	Bestand 30.11.2019 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert in EUR <sup>3</sup>	in % <sup>3</sup>
-------------	----------	---	-------------------	----------------------	---	-------------------------------------	-------------------

### Wertpapiere

#### Aktien und aktienähnliche Wertpapiere

*Aktien und aktienähnliche Wertpapiere, die an einer Börse gehandelt werden*

#### Australien

R Amcor		117'500	0	117'500	0	0.00	0.00
R Mirvac Grp		1'098'500	0	90'000	1'008'500	2'084'869.33	0.28
<b>Total</b>						<b>2'084'869.33</b>	<b>0.28</b>

#### Bermuda

R Haier Elec Grp		331'000	241'000	48'000	524'000	1'320'557.45	0.18
<b>Total</b>						<b>1'320'557.45</b>	<b>0.18</b>

#### Brasilien

R Ambev /ADR		381'400	35'000	64'800	351'600	1'342'556.31	0.18
<b>Total</b>						<b>1'342'556.31</b>	<b>0.18</b>

#### Cayman

R ENN Engy		183'900	23'400	69'900	137'400	1'353'232.47	0.18
R Shenzhou Intl Grp		67'000	46'200	0	113'200	1'353'607.88	0.18
<b>Total</b>						<b>2'706'840.35</b>	<b>0.37</b>

#### Dänemark

R Novo-Nordisk B		54'300	2'800	11'700	45'400	2'316'422.02	0.32
R Vestas Wind		32'000	4'500	13'200	23'300	2'012'768.48	0.27
<b>Total</b>						<b>4'329'190.50</b>	<b>0.59</b>

#### Deutschland

B SAP		25'400	4'700	11'300	18'800	2'321'424.00	0.32
R adidas		8'500	1'400	2'700	7'200	2'035'800.00	0.28
R BASF		22'700	1'200	5'500	18'400	1'255'248.00	0.17
R Vonovia		37'900	10'800	4'700	44'000	2'080'760.00	0.28
<b>Total</b>						<b>7'693'232.00</b>	<b>1.05</b>

#### Frankreich

R DANONE		37'600	4'300	10'000	31'900	2'383'568.00	0.33
R Gecina		14'400	2'000	3'300	13'100	2'054'080.00	0.28
R ILIAD		14'780	13'520	8'900	19'400	2'241'670.00	0.31
R L'Oreal		10'800	1'800	3'600	9'000	2'328'300.00	0.32
R Total		38'300	0	1'900	36'400	1'734'096.00	0.24
R Unib-Rodam-West		13'373	2'900	1'973	14'300	2'029'170.00	0.28
<b>Total</b>						<b>12'770'884.00</b>	<b>1.74</b>

Bezeichnung	Laufzeit	Bestand 31.05.2019 Anzahl/ Nominal	Kauf <sup>1</sup>	Verkauf <sup>2</sup>	Bestand 30.11.2019 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert in EUR <sup>3</sup>	in % <sup>3</sup>
<b>Grossbritannien</b>							
R Diageo		58'900	13'000	10'300	61'600	2'286'855.58	0.31
R Interc Hts		0	42'000	0	42'000	2'466'670.81	0.34
R ITV		1'796'200	256'000	661'000	1'391'200	2'367'779.71	0.32
R M&G		0	142'700	142'700	0	0.00	0.00
R Prudential		122'800	48'200	28'300	142'700	2'304'010.75	0.31
R Reckitt Ben Grp		30'200	7'000	3'800	33'400	2'376'474.65	0.32
R Rio Tinto		35'100	10'400	14'300	31'200	1'537'599.66	0.21
R Sage Grp		264'400	19'500	89'900	194'000	1'715'308.25	0.23
R Smith & Nephew		117'200	0	117'200	0	0.00	0.00
<b>Total</b>						<b>15'054'699.41</b>	<b>2.05</b>
<b>Hong Kong</b>							
R AIA		169'400	15'200	36'800	147'800	1'342'632.78	0.18
R HKT Trt and HKT		838'000	187'000	0	1'025'000	1'363'428.93	0.19
R Link REIT		0	174'000	0	174'000	1'612'894.59	0.22
R Sun Hung Kai Pties		122'000	30'000	23'000	129'000	1'702'472.81	0.23
<b>Total</b>						<b>6'021'429.11</b>	<b>0.82</b>
<b>Irland</b>							
R Medtronic		55'400	2'600	2'800	55'200	5'576'822.60	0.76
<b>Total</b>						<b>5'576'822.60</b>	<b>0.76</b>
<b>Italien</b>							
R Prysmian		153'600	0	93'100	60'500	1'251'745.00	0.17
<b>Total</b>						<b>1'251'745.00</b>	<b>0.17</b>
<b>Japan</b>							
R DAIWA HOUSE IND		68'700	19'500	12'200	76'000	2'108'360.38	0.29
R INPEX		184'000	20'200	46'500	157'700	1'396'450.37	0.19
R Komatsu		69'900	3'400	9'600	63'700	1'354'507.48	0.18
R Mitsubishi Estate		127'200	11'500	12'500	126'200	2'097'561.13	0.29
R NGK Insulators		114'300	3'100	27'800	89'600	1'339'680.77	0.18
R Nintendo		5'200	0	600	4'600	1'613'716.92	0.22
R Nitori Hldgs		13'800	0	3'400	10'400	1'477'452.65	0.20
R OMRON		33'600	0	33'600	0	0.00	0.00
<b>Total</b>						<b>11'387'729.70</b>	<b>1.55</b>
<b>Jersey</b>							
R Amcor /CDI		0	154'300	0	154'300	1'443'473.47	0.20
R Amcor / Deferred		0	117'500	117'500	0	0.00	0.00
<b>Total</b>						<b>1'443'473.47</b>	<b>0.20</b>
<b>Niederlande</b>							
B Heineken		0	26'100	1'600	24'500	2'303'980.00	0.31
B Unilever		0	49'500	7'900	41'600	2'238'080.00	0.31
R ING Group		149'701	34'199	46'900	137'000	1'430'828.00	0.20



Bezeichnung	Laufzeit	Bestand 31.05.2019 Anzahl/ Nominal	Kauf <sup>1</sup>	Verkauf <sup>2</sup>	Bestand 30.11.2019 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert in EUR <sup>3</sup>	in % <sup>3</sup>
R Unilever /NL-Ct		49'100	782	49'882	0	0.00	0.00
<b>Total</b>						<b>5'972'888.00</b>	<b>0.81</b>
<b>Norwegen</b>							
R DNB		98'600	0	98'600	0	0.00	0.00
<b>Total</b>						<b>0.00</b>	<b>0.00</b>
<b>Schweden</b>							
R Assa Abloy B		128'600	10'700	48'300	91'000	1'961'090.37	0.27
R Boliden		104'600	3'100	53'700	54'000	1'264'027.34	0.17
<b>Total</b>						<b>3'225'117.71</b>	<b>0.44</b>
<b>Singapur</b>							
R DBS Grp		88'600	0	10'000	78'600	1'316'406.72	0.18
<b>Total</b>						<b>1'316'406.72</b>	<b>0.18</b>
<b>Spanien</b>							
B Grifols A		0	93'600	16'200	77'400	2'400'174.00	0.33
R Santander		375'300	0	43'800	331'500	1'172'515.50	0.16
<b>Total</b>						<b>3'572'689.50</b>	<b>0.49</b>
<b>Südafrika</b>							
R AngloGold		138'100	8'200	55'900	90'400	1'534'341.93	0.21
<b>Total</b>						<b>1'534'341.93</b>	<b>0.21</b>
<b>Taiwan</b>							
R President Chain		133'000	0	133'000	0	0.00	0.00
<b>Total</b>						<b>0.00</b>	<b>0.00</b>
<b>Vereinigte Staaten von Amerika</b>							
R Affiliated Mgr		40'000	11'200	11'200	40'000	3'097'182.67	0.42
R Agilent Tech		0	100'300	29'900	70'400	5'157'322.50	0.70
R Akamai		58'500	22'600	11'200	69'900	5'523'274.02	0.75
R Alphabet A		4'050	1'550	1'010	4'590	5'429'024.46	0.74
R Cap One Fin		60'900	0	25'800	35'100	3'183'846.28	0.43
R Celgene		85'500	0	85'500	0	0.00	0.00
R Cerner		48'700	26'000	10'400	64'300	4'175'080.78	0.57
R Church & Dwight		0	42'300	0	42'300	2'694'799.25	0.37
R Cognizant Tech A		84'000	5'600	4'200	85'400	4'965'753.93	0.68
R Colgate		72'300	26'900	55'800	43'400	2'669'617.64	0.36
R Comcast A		0	77'100	0	77'100	3'087'355.45	0.42
R Delta		83'200	13'900	37'400	59'700	3'103'175.14	0.42
R Digital Realty		18'000	4'100	3'200	18'900	2'073'333.79	0.28
R Eq Residential		29'900	0	3'700	26'200	2'022'238.62	0.28
R Estee Laud A		33'000	8'100	10'000	31'100	5'513'686.25	0.75
R Halliburton		148'700	10'400	159'100	0	0.00	0.00
R Healthpeak Prop		71'000	0	71'000	0	0.00	0.00

Bezeichnung	Laufzeit	Bestand 31.05.2019 Anzahl/ Nominal	Kauf <sup>1</sup>	Verkauf <sup>2</sup>	Bestand 30.11.2019 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert in EUR <sup>3</sup>	in % <sup>3</sup>
R Healthpeak Prop		0	70'200	4'900	65'300	2'066'406.21	0.28
R Host Hotels		117'500	18'600	0	136'100	2'158'984.29	0.29
R Intercont Ex		45'000	0	8'200	36'800	3'143'127.05	0.43
R KeyCorp		331'100	0	153'500	177'600	3'123'361.97	0.43
R M&T Bk		20'800	0	1'000	19'800	2'958'460.67	0.40
R Microsoft		44'000	0	8'000	36'000	4'942'794.44	0.67
R Mondelez Int		65'900	0	65'900	0	0.00	0.00
R MS		100'500	12'600	43'200	69'900	3'136'955.91	0.43
R NewmontGold		131'400	28'600	34'100	125'900	4'384'887.97	0.60
R Oracle		86'000	14'200	40'300	59'900	3'050'006.60	0.42
R PepsiCo		39'500	2'600	6'000	36'100	4'447'382.17	0.61
R Prologis		0	13'500	0	13'500	1'120'969.16	0.15
R Ross Stores		0	67'100	13'400	53'700	5'657'115.52	0.77
R Simon Pty Grp		12'000	2'600	14'600	0	0.00	0.00
R Starbucks		44'200	6'300	9'400	41'100	3'184'591.83	0.43
R Stryker		20'200	12'600	4'500	28'300	5'258'297.48	0.72
R Tiffany & Co		56'300	0	56'300	0	0.00	0.00
R T-Mobile US		52'800	21'200	11'600	62'400	4'445'619.89	0.61
R Unitedhlth		24'900	5'500	8'400	22'000	5'584'452.18	0.76
R Valero Engy		41'200	10'000	51'200	0	0.00	0.00
<b>Total</b>						<b>111'359'104.12</b>	<b>15.20</b>

<b>Total Aktien und aktienähnliche Wertpapiere, die an einer Börse gehandelt werden</b>	<b>199'964'577.21</b>	<b>27.27</b>
---	-----------------------	--------------

## Obligationen

Obligationen, die an einer Börse gehandelt werden

### EUR

1.0000 % France	2014 - 25	10'070'000	0	2'800'000	7'270'000	7'866'140.00	1.07
<b>Total</b>						<b>7'866'140.00</b>	<b>1.07</b>

### GBP

1.5000 % UK	2016 - 26	4'600'000	0	800'000	3'800'000	4'748'675.02	0.65
<b>Total</b>						<b>4'748'675.02</b>	<b>0.65</b>

### SEK

1.2500 % EIB	2015 - 25	88'670'000	0	16'200'000	72'470'000	7'184'511.05	0.98
<b>Total</b>						<b>7'184'511.05</b>	<b>0.98</b>

### USD

2.8750 % USA	2018 - 25	11'950'000	0	4'670'000	7'280'000	7'039'281.36	0.96
<b>Total</b>						<b>7'039'281.36</b>	<b>0.96</b>

<b>Total Obligationen, die an einer Börse gehandelt werden</b>	<b>26'838'607.43</b>	<b>3.66</b>
--	----------------------	-------------

Bezeichnung	Laufzeit	Bestand 31.05.2019 Anzahl/ Nominal	Kauf <sup>1</sup>	Verkauf <sup>2</sup>	Bestand 30.11.2019 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert in EUR <sup>3</sup>	in % <sup>3</sup>
-------------	----------	---	-------------------	----------------------	---	-------------------------------------	-------------------

### Anlagefonds

Crown LGT Select Bond EMMA A USD		44'660	840	14'155	31'345	34'491'013.48	4.70
LGT Dyn Pr U A USD		39'510	1'206	8'950	31'766	29'227'156.64	3.99
LGT Select Bond High Yield (USD) IM		8'340	0	480	7'860	16'730'804.65	2.28
LGT Select Cat Bond (USD) IM		405	7'000	0	7'405	8'372'606.89	1.14
LGT Select Equity Emerging Markets (USD) IM		2'300	0	2'300	0	0.00	0.00
LGT Sustainable Eq Market Neut Sub-Fd A (USD)		8'348	6'652	0	15'000	14'792'793.11	2.02
MA Sustainable Money Market Fund (USD) IM		13'900	14'100	24'000	4'000	3'772'562.22	0.51
MA Sustainable Portfolio Corp Bds (USD) IM		45'070	3'540	6'190	42'420	73'369'971.48	10.01
MA Sustainable Portfolio Governm Bds (USD) IM		78'070	1'800	3'150	76'720	89'786'478.11	12.24
MA Sustainable Portfolio Infl Linked Bds (USD) IM		78'560	1'260	9'520	70'300	79'739'828.48	10.87
Ut ESPA BD EURO HY IO1		82'598	0	3'300	79'298	8'338'977.68	1.14
Ut iSh MSCI Jap SC USD		125'000	0	125'000	0	0.00	0.00
Ut iShs Asia Pr Yi USD		76'800	0	0	76'800	2'063'579.13	0.28
Ut iShs EM SRI		1'974'000	400'000	240'000	2'134'000	12'996'965.91	1.77
Ut iShs Eu Pty EUR		50'300	0	0	50'300	2'264'506.00	0.31
Ut iShs II J.P. Mo		2'889'680	2'996'392	500'000	5'386'072	27'468'932.74	3.75
Ut iShs Jap SRI		900'000	1'014'800	80'000	1'834'800	10'163'744.87	1.39
Ut iShs JPMorg EM USD		237'140	0	237'140	0	0.00	0.00
Ut iShs MSCI EM USD		300'400	0	300'400	0	0.00	0.00
Ut iShs USD HY USD		145'788	10'012	31'100	124'700	11'514'854.07	1.57
<b>Total Anlagefonds</b>						<b>425'094'775.46</b>	<b>57.97</b>

### Andere Wertpapiere und Wertrechte

Andere Wertpapiere und Wertrechte, die an einer Börse gehandelt werden

#### USD

WTM LBMA Gold		0	228'000	0	228'000	29'210'582.95	3.98
WTM Phys Gold		0	231'500	231'500	0	0.00	0.00
<b>Total Andere Wertpapiere und Wertrechte, die an einer Börse gehandelt werden</b>						<b>29'210'582.95</b>	<b>3.98</b>

Andere Wertpapiere und Wertrechte, die an einem anderen dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden

#### USD

SS CtLGT SEL ILS USD IM WFM		45'122	0	9'150	35'972	39'778'482.45	5.42
<b>Total Andere Wertpapiere und Wertrechte, die an einem anderen dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden</b>						<b>39'778'482.45</b>	<b>5.43</b>

<b>Total Wertpapiere</b>						<b>720'887'025.50</b>	<b>98.31</b>
--------------------------	--	--	--	--	--	-----------------------	--------------

Bezeichnung	Laufzeit	Bestand 31.05.2019 Anzahl/ Nominal	Kauf <sup>1</sup>	Verkauf <sup>2</sup>	Bestand 30.11.2019 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert in EUR <sup>3</sup>	in % <sup>3</sup>
Total Wertpapiere						720'887'025.50	98.31
Bankguthaben auf Sicht						15'680'009.30	2.14
Derivative Finanzinstrumente						-1'300'325.96	-0.18
Sonstige Vermögenswerte						313'401.86	0.04
<b>Gesamtvermögen per 30.11.2019</b>						<b>735'580'110.70</b>	<b>100.31</b>
Verbindlichkeiten						-2'294'086.32	-0.31
<b>Nettovermögen per 30.11.2019</b>						<b>733'286'024.38</b>	<b>100.00</b>

## Derivative Finanzinstrumente

### Am Ende der Berichtsperiode offene derivative Finanzinstrumente

#### Devisentermingeschäfte

Währung		Betrag	gegen	Gegenwert	Verfall	Gegenpartei	Verkehrswert in EUR <sup>3</sup>	in % <sup>3</sup>
CAD	Kauf	2'543'000.00	EUR	1'738'002.45	11.12.2019	LGT Bank AG	-2'572.59	0.00
CHF	Kauf	30'000.00	EUR	27'171.21	11.12.2019	LGT Bank AG	56.22	0.00
CHF	Kauf	560'000.00	EUR	508'157.75	11.12.2019	LGT Bank AG	87.62	0.00
CHF	Kauf	3'000.00	EUR	2'756.23	11.12.2019	LGT Bank AG	-33.49	0.00
CHF	Kauf	23'000.00	EUR	20'974.76	11.12.2019	LGT Bank AG	-100.40	0.00
CHF	Kauf	37'000.00	EUR	33'574.71	11.12.2019	LGT Bank AG	5.79	0.00
CHF	Kauf	570'000.00	EUR	516'252.91	11.12.2019	LGT Bank AG	1'068.27	0.00
CHF	Kauf	31'000.00	EUR	28'197.97	11.12.2019	LGT Bank AG	-62.96	0.00
CHF	Kauf	109'752'000.00	EUR	99'688'994.17	11.12.2019	LGT Bank AG	-80'161.59	-0.01
CHF	Kauf	200'000.00	EUR	182'725.16	11.12.2019	LGT Bank AG	-1'208.96	0.00
CHF	Kauf	6'384'200.00	EUR	5'798'841.72	11.12.2019	LGT Bank AG	-4'662.94	0.00
CHF	Kauf	420'000.00	EUR	382'036.98	11.12.2019	LGT Bank AG	-852.95	0.00
CHF	Kauf	384'000.00	EUR	350'187.31	11.12.2019	LGT Bank AG	-1'676.20	0.00
GBP	Kauf	300'000.00	EUR	346'060.68	11.12.2019	LGT Bank AG	5'695.92	0.00
HKD	Kauf	6'000'000.00	EUR	690'862.20	11.12.2019	LGT Bank AG	3'828.52	0.00
JPY	Kauf	45'000'000.00	EUR	372'707.85	11.12.2019	LGT Bank AG	14.37	0.00
JPY	Kauf	52'000'000.00	EUR	432'216.77	11.12.2019	LGT Bank AG	-1'515.53	0.00
NOK	Kauf	9'572'000.00	EUR	940'150.93	11.12.2019	LGT Bank AG	1'831.53	0.00
USD	Kauf	1'900'000.00	EUR	1'704'586.23	11.12.2019	LGT Bank AG	17'457.75	0.00
USD	Kauf	14'500'000.00	EUR	13'008'684.42	11.12.2019	LGT Bank AG	133'230.13	0.02
USD	Kauf	8'200'000.00	EUR	7'335'313.27	11.12.2019	LGT Bank AG	96'665.99	0.01
USD	Kauf	3'000'000.00	EUR	2'714'755.24	11.12.2019	LGT Bank AG	4'261.56	0.00
USD	Kauf	340'000.00	EUR	305'480.68	23.01.2020	LGT Bank AG	1'668.77	0.00
USD	Kauf	61'838'600.00	EUR	56'109'790.40	23.01.2020	LGT Bank AG	-245'991.30	-0.03
USD	Kauf	270'000.00	EUR	243'709.80	23.01.2020	LGT Bank AG	202.99	0.00
USD	Kauf	230'000.00	EUR	208'065.71	23.01.2020	LGT Bank AG	-288.14	0.00
USD	Kauf	7'900'000.00	EUR	7'045'393.74	23.01.2020	LGT Bank AG	91'313.96	0.01
USD	Kauf	378'000.00	EUR	340'503.73	23.01.2020	LGT Bank AG	974.18	0.00
USD	Kauf	550'000.00	EUR	497'017.89	23.01.2020	LGT Bank AG	-158.49	0.00
AUD	Verkauf	3'992'000.00	EUR	2'431'590.21	11.12.2019	LGT Bank AG	-16'259.61	0.00
CHF	Verkauf	290'000.00	EUR	263'578.86	11.12.2019	LGT Bank AG	380.36	0.00
CHF	Verkauf	200'000.00	EUR	182'079.71	11.12.2019	LGT Bank AG	563.51	0.00
CHF	Verkauf	10'000.00	EUR	9'100.92	11.12.2019	LGT Bank AG	25.11	0.00
CHF	Verkauf	3'920'000.00	EUR	3'567'560.68	11.12.2019	LGT Bank AG	9'843.06	0.00
CHF	Verkauf	23'000.00	EUR	20'904.53	11.12.2019	LGT Bank AG	30.17	0.00
CHF	Verkauf	61'500.00	EUR	55'878.61	11.12.2019	LGT Bank AG	62.38	0.00
CHF	Verkauf	12'000.00	EUR	10'927.17	11.12.2019	LGT Bank AG	36.20	0.00
CHF	Verkauf	1'150'000.00	EUR	1'044'884.61	11.12.2019	LGT Bank AG	1'166.43	0.00
CHF	Verkauf	65'000.00	EUR	59'395.99	11.12.2019	LGT Bank AG	403.22	0.00
CHF	Verkauf	390'000.00	EUR	354'968.19	11.12.2019	LGT Bank AG	1'011.59	0.00
CHF	Verkauf	460'000.00	EUR	418'874.87	11.12.2019	LGT Bank AG	1'387.60	0.00
CHF	Verkauf	13'000.00	EUR	11'832.27	11.12.2019	LGT Bank AG	33.72	0.00
CHF	Verkauf	886'000.00	EUR	804'763.91	11.12.2019	LGT Bank AG	647.12	0.00
CHF	Verkauf	300'000.00	EUR	274'386.06	11.12.2019	LGT Bank AG	2'111.75	0.00

Devisentermingeschäfte

Währung		Betrag	gegen	Gegenwert	Verfall	Gegenpartei	Verkehrswert in EUR <sup>3</sup>	in % <sup>3</sup>
GBP	Verkauf	16'944'000.00	EUR	19'593'241.35	11.12.2019	LGT Bank AG	-273'971.42	-0.04
GBP	Verkauf	1'000'000.00	EUR	1'172'951.73	11.12.2019	LGT Bank AG	429.73	0.00
HKD	Verkauf	41'764'000.00	EUR	4'803'881.02	11.12.2019	LGT Bank AG	-31'629.53	0.00
HKD	Verkauf	18'000'000.00	EUR	2'060'911.38	11.12.2019	LGT Bank AG	-23'160.79	0.00
JPY	Verkauf	2'572'472'000.00	EUR	21'384'429.31	11.12.2019	LGT Bank AG	77'374.14	0.01
JPY	Verkauf	130'000'000.00	EUR	1'074'975.40	11.12.2019	LGT Bank AG	-1'777.69	0.00
JPY	Verkauf	180'000'000.00	EUR	1'491'078.38	11.12.2019	LGT Bank AG	189.49	0.00
SEK	Verkauf	102'546'000.00	EUR	9'460'340.99	11.12.2019	LGT Bank AG	-256'994.34	-0.04
SGD	Verkauf	2'300'000.00	EUR	1'513'042.43	11.12.2019	LGT Bank AG	-11'572.14	0.00
USD	Verkauf	9'000'000.00	EUR	8'051'745.89	11.12.2019	LGT Bank AG	-105'304.52	-0.01
USD	Verkauf	1'900'000.00	EUR	1'718'929.67	11.12.2019	LGT Bank AG	-3'114.31	0.00
USD	Verkauf	3'300'000.00	EUR	2'991'731.94	11.12.2019	LGT Bank AG	813.46	0.00
USD	Verkauf	524'383'000.00	EUR	473'017'551.11	11.12.2019	LGT Bank AG	-2'251'178.38	-0.31
USD	Verkauf	345'000.00	EUR	311'802.40	23.01.2020	LGT Bank AG	136.05	0.00
USD	Verkauf	432'000.00	EUR	388'028.60	23.01.2020	LGT Bank AG	-2'231.87	0.00
USD	Verkauf	508'000.00	EUR	452'936.51	23.01.2020	LGT Bank AG	-5'980.90	0.00
USD	Verkauf	300'000.00	EUR	271'805.60	23.01.2020	LGT Bank AG	791.38	0.00
<b>Total Devisentermingeschäfte</b>							<b>-2'866'661.00</b>	<b>-0.39</b>

Am Ende der Berichtsperiode offene engagementreduzierende Derivate

Futures

Bezeichnung	Anzahl Kontrakte	Kontraktgrösse	Verfall	Gegenpartei	Kontraktwert in EUR	Verkehrswert in EUR <sup>3</sup>	in % <sup>3</sup>
SX5E DEC 19	-333	10.00	20.12.2019	EUREX	-12'327'660.00	-590'410.81	-0.08
<b>Total</b>					<b>-12'327'660.00</b>	<b>-590'410.81</b>	<b>-0.08</b>

Am Ende der Berichtsperiode offene engagementerhöhende Derivate

Futures

Bezeichnung	Anzahl Kontrakte	Kontraktgrösse	Verfall	Gegenpartei	Kontraktwert in EUR	Verkehrswert in EUR <sup>3</sup>	in % <sup>3</sup>
Mini S&P 500 DEC 19	193	50.00	20.12.2019	CME	27'515'465.44	1'431'460.64	0.20
MSCI EM DEC 19	156	50.00	20.12.2019	ICE US	7'343'337.76	-49'495.34	-0.01
<b>Total</b>					<b>34'858'803.20</b>	<b>1'381'965.30</b>	<b>0.19</b>

## Am Ende der Berichtsperiode offene engagementreduzierende Derivate

### Optionen

Bezeichnung	Anzahl Kontrakte	Verfall	Gegenpartei	Verkehrswert in EUR <sup>3</sup>	Anteil am Nettover- mögen in % <sup>3</sup>
SPX 2750 P 18 Jun 20	29	19.06.2020	OCC	130'461.16	0.02
SPX 2850 P 17 Sep 20	27	18.09.2020	OCC	224'071.39	0.03
SX5E 3250 P 19 Jun 20	216	19.06.2020	EUREX	125'928.00	0.02
SX5E 3350 P 18 Dec 20	208	18.12.2020	EUREX	294'320.00	0.04
<b>Total</b>				<b>774'780.55</b>	<b>0.11</b>
<b>Total am Ende der Berichtsperiode offene derivative Finanzinstrumente</b>				<b>-1'300'325.96</b>	<b>-0.18</b>

## Während der Berichtsperiode getätigte derivative Finanzinstrumente

### Devisentermingeschäfte

Verfall	Kauf	Verkauf	Kauf Betrag	Verkauf Betrag
24.07.2019	AUD	EUR	1'892'000.00	1'182'130.58
24.07.2019	AUD	EUR	23'000'000.00	14'474'421.18
24.07.2019	AUD	EUR	2'640'000.00	1'611'328.13
24.07.2019	CAD	EUR	2'543'000.00	1'678'365.06
24.07.2019	CHF	EUR	105'574'000.00	92'691'706.61
24.07.2019	CHF	EUR	56'000.00	50'448.18
24.07.2019	CHF	EUR	46'000.00	41'074.36
24.07.2019	CHF	EUR	131'000.00	115'046.50
24.07.2019	CHF	EUR	2'500'000.00	2'195'543.92
24.07.2019	CHF	EUR	1'100'000.00	994'143.59
24.07.2019	CHF	EUR	1'220'000.00	1'094'268.54
24.07.2019	CHF	EUR	5'719'700.00	5'021'773.87
24.07.2019	CHF	EUR	5'000.00	4'489.50
24.07.2019	CHF	EUR	72'500.00	63'815.37
24.07.2019	CHF	EUR	400'000.00	359'712.23
24.07.2019	CHF	EUR	1'600'000.00	1'418'741.58
24.07.2019	CHF	EUR	930'000.00	837'800.10
24.07.2019	CHF	EUR	3'830'000.00	3'412'725.99
24.07.2019	CHF	EUR	1'280'000.00	1'126'671.30
24.07.2019	CHF	EUR	69'000.00	61'888.96
24.07.2019	CHF	EUR	215'000.00	191'576.00
24.07.2019	CHF	EUR	17'706'000.00	15'944'169.29
24.07.2019	CHF	EUR	835'000.00	745'588.97
24.07.2019	EUR	AUD	17'417'654.89	27'532'000.00
24.07.2019	EUR	CAD	1'735'480.79	2'543'000.00
24.07.2019	EUR	CHF	316'318.42	350'000.00
24.07.2019	EUR	CHF	15'736'329.06	18'000'000.00
24.07.2019	EUR	CHF	628'496.01	700'000.00
24.07.2019	EUR	CHF	228'268.41	260'000.00
24.07.2019	EUR	CHF	463'425.07	520'000.00
24.07.2019	EUR	CHF	18'075.34	20'000.00
24.07.2019	EUR	CHF	438'098.47	490'000.00
24.07.2019	EUR	CHF	180'847.70	206'000.00
24.07.2019	EUR	CHF	427'742.96	475'000.00
24.07.2019	EUR	CHF	1'333'001.56	1'500'000.00
24.07.2019	EUR	CHF	15'199.33	17'000.00
24.07.2019	EUR	CHF	22'280.05	25'000.00
24.07.2019	EUR	CHF	5'586'852.77	6'204'200.00
24.07.2019	EUR	CHF	264'058.94	300'000.00
24.07.2019	EUR	CHF	648'727.43	730'000.00
24.07.2019	EUR	CHF	18'927.96	21'000.00
24.07.2019	EUR	CHF	459'678.95	510'000.00
24.07.2019	EUR	CHF	99'100'405.22	110'051'000.00
24.07.2019	EUR	CHF	1'046'321.91	1'180'000.00
24.07.2019	EUR	CHF	921'141.51	1'050'000.00
24.07.2019	EUR	CHF	356'579.33	400'000.00



Verfall	Kauf	Verkauf	Kauf Betrag	Verkauf Betrag
24.07.2019	EUR	CHF	222'384.35	253'000.00
24.07.2019	EUR	CHF	23'994.03	27'000.00
24.07.2019	EUR	GBP	23'268'420.64	20'260'000.00
24.07.2019	EUR	HKD	6'255'452.83	55'854'000.00
24.07.2019	EUR	HKD	227'077.44	2'000'000.00
24.07.2019	EUR	JPY	818'605.26	100'000'000.00
24.07.2019	EUR	JPY	22'238'840.02	2'817'472'000.00
24.07.2019	EUR	NOK	16'702'191.75	160'792'000.00
24.07.2019	EUR	SEK	553'620.45	6'000'000.00
24.07.2019	EUR	SEK	12'066'244.89	126'056'000.00
24.07.2019	EUR	SGD	1'494'209.94	2'300'000.00
24.07.2019	EUR	USD	1'781'562.61	2'000'000.00
24.07.2019	EUR	USD	2'165'190.80	2'450'000.00
24.07.2019	EUR	USD	15'541'602.65	17'500'000.00
24.07.2019	EUR	USD	3'187'617.88	3'600'000.00
24.07.2019	EUR	USD	230'594.58	260'000.00
24.07.2019	EUR	USD	1'340'099.35	1'500'000.00
24.07.2019	EUR	USD	3'169'265.17	3'600'000.00
24.07.2019	EUR	USD	445'251'329.97	507'363'000.00
24.07.2019	EUR	USD	3'171'275.29	3'600'000.00
24.07.2019	EUR	USD	52'605'974.14	58'997'600.00
24.07.2019	EUR	USD	2'804'754.06	3'200'000.00
24.07.2019	EUR	USD	418'521.82	470'000.00
24.07.2019	EUR	USD	302'151.85	345'000.00
24.07.2019	EUR	USD	106'586.13	120'000.00
24.07.2019	EUR	USD	311'842.90	350'000.00
24.07.2019	EUR	USD	1'931'196.73	2'200'000.00
24.07.2019	EUR	USD	222'317.08	250'000.00
24.07.2019	EUR	USD	327'890.64	370'000.00
24.07.2019	EUR	USD	5'548'216.64	6'300'000.00
24.07.2019	EUR	USD	19'442'814.48	22'200'000.00
24.07.2019	GBP	EUR	1'500'000.00	1'672'483.19
24.07.2019	GBP	EUR	17'994'000.00	19'893'864.01
24.07.2019	GBP	EUR	766'000.00	858'696.26
24.07.2019	HKD	EUR	50'354'000.00	5'743'583.89
24.07.2019	HKD	EUR	7'500'000.00	854'574.25
24.07.2019	JPY	EUR	2'917'472'000.00	24'022'000.82
24.07.2019	NOK	EUR	22'858'000.00	2'333'282.29
24.07.2019	NOK	EUR	137'934'000.00	14'327'455.92
24.07.2019	SEK	EUR	16'000'000.00	1'517'134.13
24.07.2019	SEK	EUR	116'056'000.00	11'034'036.89
24.07.2019	SGD	EUR	2'300'000.00	1'506'912.14
24.07.2019	USD	EUR	5'300'000.00	4'706'475.76
24.07.2019	USD	EUR	2'200'000.00	1'956'390.28
24.07.2019	USD	EUR	550'000.00	484'816.43
24.07.2019	USD	EUR	700'000.00	625'379.69
24.07.2019	USD	EUR	1'470'000.00	1'304'556.18
24.07.2019	USD	EUR	300'000.00	265'392.78
24.07.2019	USD	EUR	5'700'000.00	5'078'946.43
24.07.2019	USD	EUR	53'666'600.00	47'096'703.99
24.07.2019	USD	EUR	524'933'000.00	468'063'308.07

Verfall	Kauf	Verkauf	Kauf Betrag	Verkauf Betrag
24.07.2019	USD	EUR	3'000'000.00	2'657'218.78
24.07.2019	USD	EUR	560'000.00	495'232.50
24.07.2019	USD	EUR	200'000.00	176'856.55
24.07.2019	USD	EUR	5'000'000.00	4'436'635.97
24.07.2019	USD	EUR	28'500'000.00	24'996'272.49
24.07.2019	USD	EUR	1'000'000.00	888'091.58
24.07.2019	USD	EUR	920'000.00	819'518.80
24.07.2019	USD	EUR	356'000.00	312'234.14
24.07.2019	USD	EUR	2'320'000.00	2'043'152.80
23.10.2019	AUD	EUR	3'992'000.00	2'436'226.05
23.10.2019	CAD	EUR	2'543'000.00	1'725'720.98
23.10.2019	CHF	EUR	780'000.00	714'279.17
23.10.2019	CHF	EUR	16'000'000.00	14'645'308.92
23.10.2019	CHF	EUR	1'230'000.00	1'128'937.51
23.10.2019	CHF	EUR	32'000.00	29'067.13
23.10.2019	CHF	EUR	21'000.00	19'379.31
23.10.2019	CHF	EUR	680'000.00	616'187.61
23.10.2019	CHF	EUR	7'000.00	6'426.85
23.10.2019	CHF	EUR	57'000.00	52'361.31
23.10.2019	CHF	EUR	8'000.00	7'352.67
23.10.2019	CHF	EUR	670'000.00	608'592.97
23.10.2019	CHF	EUR	1'040'000.00	946'659.38
23.10.2019	CHF	EUR	886'000.00	804'357.69
23.10.2019	CHF	EUR	975'000.00	895'654.01
23.10.2019	CHF	EUR	110'051'000.00	99'209'844.27
23.10.2019	CHF	EUR	61'000.00	55'525.21
23.10.2019	CHF	EUR	70'000.00	64'248.48
23.10.2019	CHF	EUR	880'000.00	804'593.50
23.10.2019	CHF	EUR	60'000.00	54'369.50
23.10.2019	CHF	EUR	590'000.00	544'858.48
23.10.2019	CHF	EUR	440'000.00	399'672.99
23.10.2019	CHF	EUR	600'000.00	544'944.28
23.10.2019	CHF	EUR	18'000.00	16'574.59
23.10.2019	CHF	EUR	128'000.00	117'259.07
23.10.2019	CHF	EUR	34'000.00	31'398.62
23.10.2019	CHF	EUR	8'000.00	7'311.95
23.10.2019	CHF	EUR	56'000.00	51'201.40
23.10.2019	CHF	EUR	6'204'200.00	5'593'022.47
23.10.2019	CHF	EUR	50'000.00	45'787.13
23.10.2019	EUR	AUD	1'176'707.66	1'892'000.00
23.10.2019	EUR	AUD	1'304'283.02	2'100'000.00
23.10.2019	EUR	CAD	1'742'974.64	2'543'000.00
23.10.2019	EUR	CHF	15'961'776.84	17'706'000.00
23.10.2019	EUR	CHF	42'243.30	46'000.00
23.10.2019	EUR	CHF	5'795'914.66	6'384'200.00
23.10.2019	EUR	CHF	115'047.26	125'000.00
23.10.2019	EUR	CHF	99'638'674.53	109'752'000.00
23.10.2019	EUR	CHF	777'797.10	850'000.00
23.10.2019	EUR	CHF	15'589.47	17'000.00
23.10.2019	EUR	CHF	36'975.75	40'000.00
23.10.2019	EUR	CHF	741'167.75	810'000.00

Verfall	Kauf	Verkauf	Kauf Betrag	Verkauf Betrag
23.10.2019	EUR	CHF	518'627.21	562'000.00
23.10.2019	EUR	CHF	1'775'321.21	1'940'000.00
23.10.2019	EUR	CHF	836'576.42	905'000.00
23.10.2019	EUR	CHF	220'086.57	240'000.00
23.10.2019	EUR	CHF	297'901.15	330'000.00
23.10.2019	EUR	CHF	41'177.49	45'000.00
23.10.2019	EUR	CHF	40'260.96	44'000.00
23.10.2019	EUR	CHF	411'899.31	450'000.00
23.10.2019	EUR	CHF	826'499.41	900'000.00
23.10.2019	EUR	CHF	183'924.96	200'000.00
23.10.2019	EUR	CHF	165'290.77	180'000.00
23.10.2019	EUR	CHF	100'662.54	110'000.00
23.10.2019	EUR	GBP	19'831'311.52	17'994'000.00
23.10.2019	EUR	HKD	5'705'734.83	50'354'000.00
23.10.2019	EUR	JPY	24'010'079.80	2'917'472'000.00
23.10.2019	EUR	JPY	381'120.15	45'000'000.00
23.10.2019	EUR	JPY	1'265'449.02	150'000'000.00
23.10.2019	EUR	NOK	942'803.39	9'572'000.00
23.10.2019	EUR	NOK	1'239'830.80	12'000'000.00
23.10.2019	EUR	NOK	14'534'038.72	145'000'000.00
23.10.2019	EUR	SEK	11'025'586.87	116'056'000.00
23.10.2019	EUR	SGD	1'498'118.56	2'300'000.00
23.10.2019	EUR	USD	280'046.25	310'000.00
23.10.2019	EUR	USD	464'739'066.61	524'933'000.00
23.10.2019	EUR	USD	1'509'232.95	1'700'000.00
23.10.2019	EUR	USD	3'116'596.32	3'500'000.00
23.10.2019	EUR	USD	2'141'232.10	2'400'000.00
23.10.2019	EUR	USD	5'441'851.82	6'150'000.00
23.10.2019	EUR	USD	3'780'139.87	4'200'000.00
23.10.2019	EUR	USD	275'660.92	310'000.00
23.10.2019	EUR	USD	186'669.99	210'000.00
23.10.2019	EUR	USD	56'499'406.12	61'838'600.00
23.10.2019	EUR	USD	399'264.28	445'000.00
23.10.2019	EUR	USD	214'895.87	240'000.00
23.10.2019	GBP	EUR	700'000.00	785'211.11
23.10.2019	GBP	EUR	350'000.00	379'906.22
23.10.2019	GBP	EUR	16'944'000.00	19'629'286.38
23.10.2019	HKD	EUR	4'350'000.00	504'339.05
23.10.2019	HKD	EUR	4'240'000.00	480'927.37
23.10.2019	HKD	EUR	41'764'000.00	4'817'626.02
23.10.2019	JPY	EUR	60'000'000.00	504'178.38
23.10.2019	JPY	EUR	150'000'000.00	1'261'590.87
23.10.2019	JPY	EUR	2'572'472'000.00	21'392'698.54
23.10.2019	JPY	EUR	330'000'000.00	2'809'490.97
23.10.2019	NOK	EUR	5'780'000.00	574'718.36
23.10.2019	NOK	EUR	160'792'000.00	16'622'178.42
23.10.2019	SEK	EUR	102'546'000.00	9'465'202.14
23.10.2019	SEK	EUR	6'000'000.00	563'174.05
23.10.2019	SEK	EUR	7'510'000.00	692'507.37
23.10.2019	SGD	EUR	2'300'000.00	1'517'450.68
23.10.2019	USD	EUR	415'000.00	369'539.28

Verfall	Kauf	Verkauf	Kauf Betrag	Verkauf Betrag
23.10.2019	USD	EUR	170'000.00	151'670.61
23.10.2019	USD	EUR	524'383'000.00	474'597'701.15
23.10.2019	USD	EUR	300'000.00	270'851.01
23.10.2019	USD	EUR	2'000'000.00	1'821'559.98
23.10.2019	USD	EUR	515'000.00	457'265.64
23.10.2019	USD	EUR	550'000.00	496'192.85
23.10.2019	USD	EUR	586'000.00	527'419.51
23.10.2019	USD	EUR	800'000.00	725'399.88
23.10.2019	USD	EUR	3'500'000.00	3'121'738.90
23.10.2019	USD	EUR	700'000.00	619'397.77
23.10.2019	USD	EUR	3'000'000.00	2'688'119.05
23.10.2019	USD	EUR	290'000.00	258'690.67
23.10.2019	USD	EUR	330'000.00	292'968.75
23.10.2019	USD	EUR	3'000'000.00	2'686'198.31
23.10.2019	USD	EUR	6'700'000.00	5'930'305.63
23.10.2019	USD	EUR	58'997'600.00	52'232'360.24

### Während der Berichtsperiode getätigte engagementreduzierende Derivate

#### Futures

Bezeichnung	Verfall	Käufe/Kontrakte	Verkäufe/Kontrakte
STXE Jun 19	21.06.2019	317	0
SX5E SEP 19	20.09.2019	329	329

### Während der Berichtsperiode getätigte engagementerhöhende Derivate

#### Futures

Bezeichnung	Verfall	Käufe/Kontrakte	Verkäufe/Kontrakte
Mini S&P 500 Jun 19	21.06.2019	74	167
Mini S&P 500 Sep 19	20.09.2019	303	303
TOPIX DEC 19	13.12.2019	58	58
TOPIX Sep 19	13.09.2019	58	58

### Während der Berichtsperiode getätigte engagementreduzierende Derivate

#### Optionen

Bezeichnung	Verfall	Käufe/Kontrakte	Verkäufe/Kontrakte
CELG 95 C 21 Jun 19	21.06.2019	855	0
SPX 2350 P 19 Dec 19	20.12.2019	0	36
SPX 2775 P 19 Mar 20	20.03.2020	0	30
STXE 2850 P 20 Dec 19	20.12.2019	0	258

Bezeichnung	Verfall	Käufe/Kontrakte	Verkäufe/Kontrakte
SX5E 3300 P 20 Mar 20	20.03.2020	0	223

- 1 Kauf umfasst die Transaktionen: Gratistitel / Käufe / Konversionen / Namensänderungen / "Splits" / Stock- / Wahldividenden / Titelaufteilungen / Überträge / Umbuchungen in Folge Redenominierung in Euro / Umtausch zwischen Gesellschaften / Zuteilungen aus Bezugs- / Optionsrechten / Zuteilung von Bezugsrechten auf Basistiteln
- 2 Verkauf umfasst die Transaktionen: Auslosungen / Ausbuchung in Folge Verfall / Ausübung von Bezugs- / Optionsrechten / "Reverse Splits" / Überträge / Umbuchungen in Folge Redenominierung in Fondswährung / Umtausch zwischen Gesellschaften / Verkäufe / Rückzahlungen
- 3 Allfällige Abweichungen in den Totalisierungen sind auf Rundungsdifferenzen zurückzuführen

## LGT Sustainable Strategy 4 Years OGAW nach liechtensteinischem Recht

### Dreijahresvergleich

Per:	30.11.2019	30.11.2018	30.11.2017
Nettovermögen (EUR) B	202'941'899	211'640'695	224'678'371
Anzahl Anteile im Umlauf (EUR) B	114'827	128'634	131'769
Nettoinventarwert pro Anteil am Ende der Periode (EUR) B	1'767.37	1'645.29	1'705.10
Nettoinventarwert pro Anteil zu Beginn der Periode (EUR) B	1'645.29	1'705.10	1'604.03
Veränderung Inventarwert in Prozent gg. Vorjahr (EUR) B	7.42%	-3.51%	6.30%
Nettovermögen (CHF) B	91'747'831	107'873'641	120'515'103
Anzahl Anteile im Umlauf (CHF) B	87'669	109'636	116'646
Nettoinventarwert pro Anteil am Ende der Periode (CHF) B	1'046.53	983.93	1'033.17
Nettoinventarwert pro Anteil zu Beginn der Periode (CHF) B	983.93	1'033.17	1'000.00 <sup>1</sup>
Veränderung Inventarwert in Prozent gg. Vorjahr (CHF) B	6.36%	-4.77%	3.32% <sup>1</sup>
Nettovermögen (USD) B	30'464'628	28'046'603	27'256'996
Anzahl Anteile im Umlauf (USD) B	27'576	27'655	26'035
Nettoinventarwert pro Anteil am Ende der Periode (USD) B	1'104.74	1'014.14	1'046.93
Nettoinventarwert pro Anteil zu Beginn der Periode (USD) B	1'014.14	1'046.93	1'000.00 <sup>1</sup>
Veränderung Inventarwert in Prozent gg. Vorjahr (USD) B	8.93%	-3.13%	4.69% <sup>1</sup>
Nettovermögen (EUR) C	817'808	758'976	177'689
Anzahl Anteile im Umlauf (EUR) C	678	681	155
Nettoinventarwert pro Anteil am Ende der Periode (EUR) C	1'206.21	1'114.50	1'146.38
Nettoinventarwert pro Anteil zu Beginn der Periode (EUR) C	1'114.50	1'146.38	1'070.38
Veränderung Inventarwert in Prozent gg. Vorjahr (EUR) C	8.23%	-2.78%	7.10%
Nettovermögen (CHF) C	972'766	1'306'744	522'205
Anzahl Anteile im Umlauf (CHF) C	910	1'310	502
Nettoinventarwert pro Anteil am Ende der Periode (CHF) C	1'068.97	997.51	1'039.63
Nettoinventarwert pro Anteil zu Beginn der Periode (CHF) C	997.51	1'039.63	1'000.00 <sup>1</sup>
Veränderung Inventarwert in Prozent gg. Vorjahr (CHF) C	7.16%	-4.05%	3.96% <sup>1</sup>
Nettovermögen (EUR) IM	89'600	174'867	94'774
Anzahl Anteile im Umlauf (EUR) IM	77	163	87
Nettoinventarwert pro Anteil am Ende der Periode (EUR) IM	1'168.24	1'070.50	1'092.03
Nettoinventarwert pro Anteil zu Beginn der Periode (EUR) IM	1'070.50	1'092.03	1'011.22
Veränderung Inventarwert in Prozent gg. Vorjahr (EUR) IM	9.13%	-1.97%	7.99%

<sup>1</sup> Seit Lancierung am 24.04.2017

Der Fonds verzichtet auf einen Benchmark, da kein vergleichbarer Index existiert.

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

## Vermögensrechnung per 30.11.2019

	<b>30.11.2019</b>
<b>Verkehrswerte</b>	<b>EUR</b>
Bankguthaben	
auf Sicht	5'004'416.90
Wertpapiere	
Aktien und andere Beteiligungspapiere	127'252'079.11
Anlagefonds	155'841'465.36
Andere Wertpapiere und Wertrechte	29'007'651.15
Derivative Finanzinstrumente	-584'329.39
Sonstige Vermögenswerte	92'257.17
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>316'613'540.30</b>
Verbindlichkeiten	-990'000.48
<b>Nettovermögen</b>	<b>315'623'539.82</b>



## Erfolgsrechnung für die Zeit vom 01.06.2019 bis 30.11.2019

	<b>30.11.2019</b>
<b>Ertrag</b>	<b>EUR</b>
Erträge der Bankguthaben	25'893.20
Erträge der Wertpapiere	
Aktien und sonstige Beteiligungspapiere einschliesslich Erträge aus Gratisaktien	1'039'441.42
Anteile anderer Investmentunternehmen	276'465.89
Erträge aus Securities Lending	7'378.34
Sonstige Erträge	61'228.13
Einkauf in laufende Erträge bei der Ausgabe von Anteilen	-7'923.32
<b>Total Ertrag</b>	<b>1'402'483.66</b>
<hr/>	
<b>Aufwand</b>	<b>30.11.2019</b>
	<b>EUR</b>
Passivzinsen	2'260.24
Reglementarische Vergütungen	2'695'604.44
Sonstige Aufwendungen	45'620.34
Ausrichtung laufender Erträge bei der Rücknahme von Anteilen	-37'252.10
<b>Total Aufwand</b>	<b>2'706'232.92</b>
<hr/>	
<b>Nettoertrag</b>	<b>-1'303'749.26</b>
<hr/>	
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste	1'728'583.63
<b>Realisierter Erfolg</b>	<b>424'834.37</b>
<hr/>	
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste	17'798'088.41
<b>Gesamterfolg</b>	<b>18'222'922.78</b>

## Veränderung des Nettovermögens

	<b>30.11.2019</b>
	<b>EUR</b>
Nettovermögen zu Beginn der Berichtsperiode	313'341'070.98
Ausschüttungen	0.00
Saldo aus dem Anteilverkehr	-15'940'453.94
Gesamterfolg	18'222'922.78
<b>Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode</b>	<b>315'623'539.82</b>

## Entwicklung der Anteile im Umlauf

	<b>30.11.2019</b>
	<b>Anzahl</b>
LGT Sustainable Strategy 4 Years (EUR) B	
Bestand Anzahl Anteile zu Beginn der Berichtsperiode	117'449.539
Ausgegebene Anteile	1'733.839
Zurückgenommene Anteile	-4'356.290
<b>Bestand Anzahl Anteile am Ende der Berichtsperiode</b>	<b>114'827.088</b>

	<b>30.11.2019</b>
	<b>Anzahl</b>
LGT Sustainable Strategy 4 Years (CHF) B	
Bestand Anzahl Anteile zu Beginn der Berichtsperiode	100'410.672
Ausgegebene Anteile	457.411
Zurückgenommene Anteile	-13'199.241
<b>Bestand Anzahl Anteile am Ende der Berichtsperiode</b>	<b>87'668.842</b>

	<b>30.11.2019</b>
	<b>Anzahl</b>
LGT Sustainable Strategy 4 Years (USD) B	
Bestand Anzahl Anteile zu Beginn der Berichtsperiode	27'733.371
Ausgegebene Anteile	835.600
Zurückgenommene Anteile	-992.785
<b>Bestand Anzahl Anteile am Ende der Berichtsperiode</b>	<b>27'576.186</b>

	<b>30.11.2019</b>
	<b>Anzahl</b>
LGT Sustainable Strategy 4 Years (EUR) C	
Bestand Anzahl Anteile zu Beginn der Berichtsperiode	678.000
Ausgegebene Anteile	0.000
Zurückgenommene Anteile	0.000
<b>Bestand Anzahl Anteile am Ende der Berichtsperiode</b>	<b>678.000</b>

	<b>30.11.2019</b>
	<b>Anzahl</b>
LGT Sustainable Strategy 4 Years (CHF) C	
Bestand Anzahl Anteile zu Beginn der Berichtsperiode	910.000
Ausgegebene Anteile	0.000
Zurückgenommene Anteile	0.000
<b>Bestand Anzahl Anteile am Ende der Berichtsperiode</b>	<b>910.000</b>

**30.11.2019**  
**Anzahl**

LGT Sustainable Strategy 4 Years (EUR) IM	
Bestand Anzahl Anteile zu Beginn der Berichtsperiode	146.697
Ausgegebene Anteile	0.000
Zurückgenommene Anteile	-70.000
<b>Bestand Anzahl Anteile am Ende der Berichtsperiode</b>	<b>76.697</b>

## Inventar des Fondsvermögens

Bezeichnung	Laufzeit	Bestand 31.05.2019 Anzahl/ Nominal	Kauf <sup>1</sup>	Verkauf <sup>2</sup>	Bestand 30.11.2019 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert in EUR <sup>3</sup>	in % <sup>3</sup>
-------------	----------	---	-------------------	----------------------	---	-------------------------------------	-------------------

### Wertpapiere

#### Aktien und aktienähnliche Wertpapiere

*Aktien und aktienähnliche Wertpapiere, die an einer Börse gehandelt werden*

#### Australien

R Amcor		76'600	0	76'600	0	0.00	0.00
R Mirvac Grp		574'600	0	29'000	545'600	1'127'917.41	0.36
<b>Total</b>						<b>1'127'917.41</b>	<b>0.36</b>

#### Bermuda

R Haier Elec Grp		215'000	156'000	13'000	358'000	902'212.91	0.29
<b>Total</b>						<b>902'212.91</b>	<b>0.29</b>

#### Brasilien

R Ambev /ADR		246'200	34'000	41'900	238'300	909'929.38	0.29
<b>Total</b>						<b>909'929.38</b>	<b>0.29</b>

#### Cayman

R ENN Engy		119'000	15'200	40'400	93'800	923'822.46	0.29
R Shenzhou Intl Grp		44'000	30'400	0	74'400	889'650.41	0.28
<b>Total</b>						<b>1'813'472.87</b>	<b>0.57</b>

#### Dänemark

R Novo-Nordisk B		34'000	1'900	3'500	32'400	1'653'129.37	0.52
R Vestas Wind		20'100	3'100	7'000	16'200	1'399'435.59	0.44
<b>Total</b>						<b>3'052'564.96</b>	<b>0.97</b>

#### Deutschland

B SAP		15'900	3'200	5'700	13'400	1'654'632.00	0.52
R adidas		5'700	1'000	1'700	5'000	1'413'750.00	0.45
R BASF		14'400	1'400	3'000	12'800	873'216.00	0.28
R Vonovia		20'000	6'000	1'900	24'100	1'139'689.00	0.36
<b>Total</b>						<b>5'081'287.00</b>	<b>1.61</b>

#### Frankreich

R DANONE		23'600	3'600	4'400	22'800	1'703'616.00	0.54
R Gecina		7'600	800	1'300	7'100	1'113'280.00	0.35
R ILIAD		9'870	9'230	5'700	13'400	1'548'370.00	0.49
R L'Oreal		6'900	1'300	1'700	6'500	1'681'550.00	0.53
R Total		25'500	0	0	25'500	1'214'820.00	0.38
R Unib-Rodam-West		6'990	1'700	1'090	7'600	1'078'440.00	0.34
<b>Total</b>						<b>8'340'076.00</b>	<b>2.64</b>

Bezeichnung	Laufzeit	Bestand 31.05.2019 Anzahl/ Nominal	Kauf <sup>1</sup>	Verkauf <sup>2</sup>	Bestand 30.11.2019 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert in EUR <sup>3</sup>	in % <sup>3</sup>
<b>Grossbritannien</b>							
R Diageo		39'100	9'500	6'100	42'500	1'577'781.86	0.50
R Interc Hts		0	28'100	0	28'100	1'650'320.23	0.52
R ITV		1'197'500	179'600	388'600	988'500	1'682'396.67	0.53
R M&G		0	101'400	101'400	0	0.00	0.00
R Prudential		81'200	34'100	13'900	101'400	1'637'187.74	0.52
R Reckitt Ben Grp		20'100	3'700	0	23'800	1'693'416.07	0.54
R Rio Tinto		23'400	6'400	7'500	22'300	1'098'989.50	0.35
R Sage Grp		165'800	13'700	39'500	140'000	1'237'851.31	0.39
R Smith & Nephew		77'700	0	77'700	0	0.00	0.00
<b>Total</b>						<b>10'577'943.38</b>	<b>3.35</b>
<b>Hong Kong</b>							
R AIA		109'800	10'200	20'600	99'400	902'961.43	0.29
R HKT Trt and HKT		544'000	157'000	0	701'000	932'452.37	0.30
R Link REIT		0	89'500	0	89'500	829'621.07	0.26
R Sun Hung Kai Pties		64'000	14'000	11'500	66'500	877'631.33	0.28
<b>Total</b>						<b>3'542'666.20</b>	<b>1.12</b>
<b>Irland</b>							
R Medtronic		33'100	1'700	0	34'800	3'515'822.94	1.11
<b>Total</b>						<b>3'515'822.94</b>	<b>1.11</b>
<b>Italien</b>							
R Prysmian		96'400	0	52'400	44'000	910'360.00	0.29
<b>Total</b>						<b>910'360.00</b>	<b>0.29</b>
<b>Japan</b>							
R DAIWA HOUSE IND		36'000	11'000	6'500	40'500	1'123'534.15	0.36
R INPEX		121'900	16'100	31'100	106'900	946'610.94	0.30
R Komatsu		43'100	6'300	6'200	43'200	918'598.48	0.29
R Mitsubishi Estate		66'400	6'300	3'700	69'000	1'146'844.04	0.36
R NGK Insulators		70'400	7'400	16'300	61'500	919'535.35	0.29
R Nintendo		3'200	0	200	3'000	1'052'424.08	0.33
R Nitori Hldgs		8'500	0	1'500	7'000	994'439.28	0.32
R OMRON		20'700	3'200	23'900	0	0.00	0.00
<b>Total</b>						<b>7'101'986.32</b>	<b>2.25</b>
<b>Jersey</b>							
R Amcor /CDI		0	104'300	0	104'300	975'724.45	0.31
R Amcor / Deferred		0	76'600	76'600	0	0.00	0.00
<b>Total</b>						<b>975'724.45</b>	<b>0.31</b>
<b>Niederlande</b>							
B Heineken		0	18'500	1'600	16'900	1'589'276.00	0.50
B Unilever		0	34'600	5'500	29'100	1'565'580.00	0.50
R ING Group		99'297	9'903	13'100	96'100	1'003'668.40	0.32

Bezeichnung	Laufzeit	Bestand 31.05.2019 Anzahl/ Nominal	Kauf <sup>1</sup>	Verkauf <sup>2</sup>	Bestand 30.11.2019 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert in EUR <sup>3</sup>	in % <sup>3</sup>
R Unilever /NL-Ct		30'800	352	31'152	0	0.00	0.00
<b>Total</b>						<b>4'158'524.40</b>	<b>1.32</b>
<b>Norwegen</b>							
R DNB		59'400	0	59'400	0	0.00	0.00
<b>Total</b>						<b>0.00</b>	<b>0.00</b>
<b>Schweden</b>							
R Assa Abloy B		81'500	7'500	26'100	62'900	1'355'522.90	0.43
R Boliden		65'900	5'200	33'400	37'700	882'478.34	0.28
<b>Total</b>						<b>2'238'001.24</b>	<b>0.71</b>
<b>Singapur</b>							
R DBS Grp		57'000	3'000	6'400	53'600	897'702.29	0.28
<b>Total</b>						<b>897'702.29</b>	<b>0.28</b>
<b>Spanien</b>							
B Grifols A		0	63'700	10'000	53'700	1'665'237.00	0.53
R Santander		236'300	17'000	17'700	235'600	833'317.20	0.26
<b>Total</b>						<b>2'498'554.20</b>	<b>0.79</b>
<b>Südafrika</b>							
R AngloGold		89'600	5'300	36'300	58'600	994'606.60	0.32
<b>Total</b>						<b>994'606.60</b>	<b>0.32</b>
<b>Taiwan</b>							
R President Chain		86'000	0	86'000	0	0.00	0.00
<b>Total</b>						<b>0.00</b>	<b>0.00</b>
<b>Vereinigte Staaten von Amerika</b>							
R Affiliated Mgr		23'300	6'400	5'500	24'200	1'873'795.52	0.59
R Agilent Tech		0	60'500	16'500	44'000	3'223'326.56	1.02
R Akamai		35'300	14'300	5'300	44'300	3'500'444.05	1.11
R Alphabet A		2'370	960	460	2'870	3'394'618.78	1.08
R Cap One Fin		36'300	0	14'700	21'600	1'959'290.02	0.62
R Celgene		48'800	0	48'800	0	0.00	0.00
R Cerner		29'100	16'300	5'000	40'400	2'623'223.39	0.83
R Church & Dwight		0	26'500	0	26'500	1'688'231.21	0.53
R Cognizant Tech A		49'000	3'400	0	52'400	3'046'902.88	0.97
R Colgate		43'100	16'900	32'700	27'300	1'679'275.61	0.53
R Comcast A		0	48'400	0	48'400	1'938'106.41	0.61
R Delta		49'300	7'800	20'500	36'600	1'902'449.08	0.60
R Digital Realty		9'500	1'800	1'100	10'200	1'118'942.04	0.35
R Eq Residential		15'600	0	1'500	14'100	1'088'303.99	0.34
R Estee Laud A		19'200	5'000	4'800	19'400	3'439'405.57	1.09
R Halliburton		88'700	6'200	94'900	0	0.00	0.00
R Healthpeak Prop		37'100	0	37'100	0	0.00	0.00

Bezeichnung	Laufzeit	Bestand 31.05.2019 Anzahl/ Nominal	Kauf <sup>1</sup>	Verkauf <sup>2</sup>	Bestand 30.11.2019 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert in EUR <sup>3</sup>	in % <sup>3</sup>
R Healthpeak Prop		0	37'800	2'600	35'200	1'113'897.38	0.35
R Host Hotels		61'400	11'900	0	73'300	1'162'774.05	0.37
R Intercont Ex		26'030	0	3'030	23'000	1'964'454.41	0.62
R KeyCorp		181'300	0	70'500	110'800	1'948'583.93	0.62
R M&T Bk		12'600	0	0	12'600	1'882'656.79	0.60
R Microsoft		26'000	0	3'400	22'600	3'102'976.51	0.98
R Mondelez Int		39'300	0	39'300	0	0.00	0.00
R MS		56'500	11'200	23'800	43'900	1'970'133.97	0.62
R NewmontGold		71'300	18'000	10'000	79'300	2'761'887.34	0.88
R Oracle		49'600	9'900	22'000	37'500	1'909'436.52	0.60
R PepsiCo		23'600	1'700	2'500	22'800	2'808'872.95	0.89
R Prologis		0	7'300	0	7'300	606'153.69	0.19
R Ross Stores		0	40'700	7'400	33'300	3'508'043.71	1.11
R Simon Pty Grp		6'400	1'400	7'800	0	0.00	0.00
R Starbucks		26'400	3'900	4'600	25'700	1'991'338.44	0.63
R Stryker		11'300	7'600	1'700	17'200	3'195'855.71	1.01
R Tiffany & Co		31'400	0	31'400	0	0.00	0.00
R T-Mobile US		29'000	13'200	3'500	38'700	2'757'139.25	0.87
R Unitedhlth		14'000	3'400	3'800	13'600	3'452'206.80	1.09
R Valero Engy		23'000	7'100	30'100	0	0.00	0.00
<b>Total</b>						<b>68'612'726.56</b>	<b>21.74</b>

<b>Total Aktien und aktienähnliche Wertpapiere, die an einer Börse gehandelt werden</b>	<b>127'252'079.11</b>	<b>40.32</b>
---	-----------------------	--------------

#### Anlagefonds

Crown LGT Select Bond EMMA A USD	18'970	380	5'190	14'160	15'581'195.71	4.94
LGT Dyn Pr U A USD	16'170	649	3'105	13'714	12'618'271.41	4.00
LGT Select Bond High Yield (USD) IM	4'440	0	205	4'235	9'014'625.66	2.86
LGT Select Cat Bond (USD) IM	196	2'804	0	3'000	3'392'008.19	1.07
LGT Select Equity Asia/Pacific ex Jap (USD) IM	1'150	350	100	1'400	2'751'378.98	0.87
LGT Select Equity Emerging Markets (USD) IM	5'400	0	3'200	2'200	3'617'552.53	1.15
MA Sustainable Money Market Fund (USD) IM	5'000	5'000	9'500	500	471'570.28	0.15
MA Sustainable Portfolio Corp Bds (USD) IM	8'870	960	750	9'080	15'704'840.67	4.98
MA Sustainable Portfolio Governm Bds (USD) IM	19'890	0	1'300	18'590	21'756'134.36	6.89
MA Sustainable Portfolio Infl Linked Bds (USD) IM	23'620	0	1'700	21'920	24'863'400.29	7.88
Ut ESPA BD EURO HY I01	43'018	0	0	43'018	4'523'772.88	1.43
Ut iSh MSCI Jap SC USD	84'000	0	84'000	0	0.00	0.00
Ut iShs Asia Pr Yi USD	52'000	0	5'000	47'000	1'262'867.44	0.40
Ut iShs EM SRI	1'440'000	557'173	0	1'997'173	12'163'631.40	3.85
Ut iShs Eu Pty EUR	31'100	0	3'100	28'000	1'260'560.00	0.40
Ut iShs II J.P. Mo	3'382'701	0	894'675	2'488'026	12'688'916.68	4.02
Ut iShs Jap SRI	600'000	707'000	0	1'307'000	7'240'034.09	2.29
Ut iShs MSCI EM USD	123'300	0	123'300	0	0.00	0.00
Ut iShs USD HY USD	78'406	0	3'350	75'056	6'930'704.79	2.20
<b>Total Anlagefonds</b>					<b>155'841'465.36</b>	<b>49.37</b>

Bezeichnung	Laufzeit	Bestand 31.05.2019 Anzahl/ Nominal	Kauf <sup>1</sup>	Verkauf <sup>2</sup>	Bestand 30.11.2019 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert in EUR <sup>3</sup>	in % <sup>3</sup>
-------------	----------	---	-------------------	----------------------	---	-------------------------------------	-------------------

#### Andere Wertpapiere und Wertrechte

Andere Wertpapiere und Wertrechte, die an einer Börse gehandelt werden

#### USD

WTM LBMA Gold		0	99'000	0	99'000	12'683'542.60	4.02
WTM Phys Gold		0	100'500	100'500	0	0.00	0.00
<b>Total Andere Wertpapiere und Wertrechte, die an einer Börse gehandelt werden</b>						<b>12'683'542.60</b>	<b>4.02</b>

Andere Wertpapiere und Wertrechte, die an einem anderen dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden

#### USD

SS Ct/LGT SEL ILS USD IM WFM		18'542	0	3'780	14'762	16'324'108.55	5.17
<b>Total Andere Wertpapiere und Wertrechte, die an einem anderen dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden</b>						<b>16'324'108.55</b>	<b>5.17</b>

<b>Total Wertpapiere</b>						<b>312'101'195.62</b>	<b>98.88</b>
--------------------------	--	--	--	--	--	-----------------------	--------------

Total Wertpapiere						312'101'195.62	98.88
Bankguthaben auf Sicht						5'004'416.90	1.59
Derivative Finanzinstrumente						-584'329.39	-0.19
Sonstige Vermögenswerte						92'257.17	0.03
<b>Gesamtvermögen per 30.11.2019</b>						<b>316'613'540.30</b>	<b>100.31</b>
Verbindlichkeiten						-990'000.48	-0.31
<b>Nettovermögen per 30.11.2019</b>						<b>315'623'539.82</b>	<b>100.00</b>



## Derivative Finanzinstrumente

### Am Ende der Berichtsperiode offene derivative Finanzinstrumente

#### Devisentermingeschäfte

Währung		Betrag	gegen	Gegenwert	Verfall	Gegenpartei	Verkehrswert in EUR <sup>3</sup>	in % <sup>3</sup>
CAD	Kauf	695'000.00	EUR	474'994.77	11.12.2019	LGT Bank AG	-703.09	0.00
CHF	Kauf	550'000.00	EUR	499'083.50	11.12.2019	LGT Bank AG	86.06	0.00
CHF	Kauf	350'000.00	EUR	318'561.20	11.12.2019	LGT Bank AG	-907.84	0.00
CHF	Kauf	4'000.00	EUR	3'635.57	11.12.2019	LGT Bank AG	-5.25	0.00
CHF	Kauf	1'000.00	EUR	918.74	11.12.2019	LGT Bank AG	-11.16	0.00
CHF	Kauf	135'000.00	EUR	123'112.73	11.12.2019	LGT Bank AG	-589.29	0.00
CHF	Kauf	3'900.00	EUR	3'556.59	11.12.2019	LGT Bank AG	-17.02	0.00
CHF	Kauf	2'000.00	EUR	1'819.22	11.12.2019	LGT Bank AG	-4.06	0.00
CHF	Kauf	380'000.00	EUR	345'379.19	11.12.2019	LGT Bank AG	-498.40	0.00
CHF	Kauf	2'300.00	EUR	2'083.13	11.12.2019	LGT Bank AG	4.31	0.00
CHF	Kauf	717'550.00	EUR	651'758.85	11.12.2019	LGT Bank AG	-524.09	0.00
CHF	Kauf	6'000.00	EUR	5'444.55	11.12.2019	LGT Bank AG	0.94	0.00
CHF	Kauf	69'574'000.00	EUR	63'194'858.23	11.12.2019	LGT Bank AG	-50'816.05	-0.02
HKD	Kauf	2'600'000.00	EUR	299'373.62	11.12.2019	LGT Bank AG	1'659.03	0.00
JPY	Kauf	21'000'000.00	EUR	174'549.08	11.12.2019	LGT Bank AG	-612.04	0.00
JPY	Kauf	40'000'000.00	EUR	331'295.86	11.12.2019	LGT Bank AG	12.78	0.00
NOK	Kauf	4'844'000.00	EUR	475'772.16	11.12.2019	LGT Bank AG	926.86	0.00
USD	Kauf	3'500'000.00	EUR	3'130'926.40	11.12.2019	LGT Bank AG	41'259.87	0.01
USD	Kauf	1'100'000.00	EUR	991'169.58	11.12.2019	LGT Bank AG	5'803.25	0.00
USD	Kauf	1'000'000.00	EUR	897'150.65	11.12.2019	LGT Bank AG	9'188.28	0.00
USD	Kauf	4'000'000.00	EUR	3'588'602.60	11.12.2019	LGT Bank AG	36'753.14	0.01
USD	Kauf	110'000.00	EUR	98'357.43	23.01.2020	LGT Bank AG	1'014.45	0.00
USD	Kauf	120'000.00	EUR	107'984.07	23.01.2020	LGT Bank AG	421.62	0.00
USD	Kauf	250'000.00	EUR	226'184.98	23.01.2020	LGT Bank AG	-339.80	0.00
USD	Kauf	130'000.00	EUR	115'936.86	23.01.2020	LGT Bank AG	1'502.63	0.00
USD	Kauf	22'281'500.00	EUR	20'217'312.40	23.01.2020	LGT Bank AG	-88'634.85	-0.03
USD	Kauf	54'000.00	EUR	48'696.82	23.01.2020	LGT Bank AG	85.74	0.00
USD	Kauf	156'000.00	EUR	140'972.35	23.01.2020	LGT Bank AG	-44.96	0.00
USD	Kauf	120'000.00	EUR	108'556.02	23.01.2020	LGT Bank AG	-150.33	0.00
USD	Kauf	80'000.00	EUR	71'877.81	23.01.2020	LGT Bank AG	392.65	0.00
USD	Kauf	68'000.00	EUR	61'438.38	23.01.2020	LGT Bank AG	-8.49	0.00
USD	Kauf	132'000.00	EUR	119'147.02	23.01.2020	LGT Bank AG	99.24	0.00
AUD	Verkauf	2'584'000.00	EUR	1'573'955.18	11.12.2019	LGT Bank AG	-10'524.77	0.00
CHF	Verkauf	7'200.00	EUR	6'541.89	11.12.2019	LGT Bank AG	7.31	0.00
CHF	Verkauf	535'000.00	EUR	485'946.61	11.12.2019	LGT Bank AG	390.76	0.00
CHF	Verkauf	2'500.00	EUR	2'276.49	11.12.2019	LGT Bank AG	7.54	0.00
CHF	Verkauf	4'600.00	EUR	4'187.19	11.12.2019	LGT Bank AG	12.32	0.00
CHF	Verkauf	470'000.00	EUR	427'821.12	11.12.2019	LGT Bank AG	1'258.04	0.00
CHF	Verkauf	240'000.00	EUR	218'543.41	11.12.2019	LGT Bank AG	723.96	0.00
CHF	Verkauf	755'000.00	EUR	685'989.46	11.12.2019	LGT Bank AG	765.79	0.00
CHF	Verkauf	450'000.00	EUR	413'928.22	11.12.2019	LGT Bank AG	5'516.76	0.00
CHF	Verkauf	415'000.00	EUR	377'722.56	11.12.2019	LGT Bank AG	1'076.43	0.00
CHF	Verkauf	1'500.00	EUR	1'365.26	11.12.2019	LGT Bank AG	3.89	0.00
CHF	Verkauf	60'000.00	EUR	54'623.91	11.12.2019	LGT Bank AG	169.05	0.00

Devisentermingeschäfte

Währung		Betrag	gegen	Gegenwert	Verfall	Gegenpartei	Verkehrswert in EUR <sup>3</sup>	in % <sup>3</sup>
CHF	Verkauf	250'000.00	EUR	227'523.00	11.12.2019	LGT Bank AG	627.74	0.00
GBP	Verkauf	500'000.00	EUR	586'475.87	11.12.2019	LGT Bank AG	214.87	0.00
GBP	Verkauf	8'408'000.00	EUR	9'722'614.10	11.12.2019	LGT Bank AG	-135'950.88	-0.04
GBP	Verkauf	200'000.00	EUR	231'360.98	11.12.2019	LGT Bank AG	-3'143.42	0.00
HKD	Verkauf	9'500'000.00	EUR	1'087'703.23	11.12.2019	LGT Bank AG	-12'223.75	0.00
HKD	Verkauf	29'856'000.00	EUR	3'434'169.90	11.12.2019	LGT Bank AG	-22'611.13	-0.01
JPY	Verkauf	100'000'000.00	EUR	828'376.88	11.12.2019	LGT Bank AG	105.27	0.00
JPY	Verkauf	35'000'000.00	EUR	289'416.45	11.12.2019	LGT Bank AG	-478.61	0.00
JPY	Verkauf	1'737'980'000.00	EUR	14'447'469.38	11.12.2019	LGT Bank AG	52'274.51	0.02
SEK	Verkauf	21'296'000.00	EUR	1'964'654.12	11.12.2019	LGT Bank AG	-53'370.70	-0.02
SGD	Verkauf	1'720'000.00	EUR	1'131'492.60	11.12.2019	LGT Bank AG	-8'653.95	0.00
USD	Verkauf	500'000.00	EUR	453'802.87	11.12.2019	LGT Bank AG	633.40	0.00
USD	Verkauf	1'100'000.00	EUR	995'169.81	11.12.2019	LGT Bank AG	-1'803.02	0.00
USD	Verkauf	680'000.00	EUR	608'354.13	11.12.2019	LGT Bank AG	-7'956.35	0.00
USD	Verkauf	196'604'000.00	EUR	177'345'838.10	11.12.2019	LGT Bank AG	-844'021.78	-0.27
USD	Verkauf	1'650'000.00	EUR	1'495'865.97	11.12.2019	LGT Bank AG	406.73	0.00
USD	Verkauf	258'000.00	EUR	230'034.68	23.01.2020	LGT Bank AG	-3'037.55	0.00
USD	Verkauf	105'000.00	EUR	94'756.79	23.01.2020	LGT Bank AG	-98.19	0.00
USD	Verkauf	120'000.00	EUR	107'785.72	23.01.2020	LGT Bank AG	-619.97	0.00
USD	Verkauf	190'000.00	EUR	172'143.55	23.01.2020	LGT Bank AG	501.21	0.00
USD	Verkauf	156'000.00	EUR	140'988.91	23.01.2020	LGT Bank AG	61.52	0.00
<b>Total Devisentermingeschäfte</b>							<b>-1'084'392.84</b>	<b>-0.34</b>

Am Ende der Berichtsperiode offene engagementreduzierende Derivate

Futures

Bezeichnung	Anzahl Kontrakte	Kontraktgrösse	Verfall	Gegenpartei	Kontraktwert in EUR	Verkehrswert in EUR <sup>3</sup>	in % <sup>3</sup>
SX5E DEC 19	-216	10.00	20.12.2019	EUREX	-7'996'320.00	-384'337.03	-0.12
<b>Total</b>					<b>-7'996'320.00</b>	<b>-384'337.03</b>	<b>-0.12</b>

Am Ende der Berichtsperiode offene engagementerhöhende Derivate

Futures

Bezeichnung	Anzahl Kontrakte	Kontraktgrösse	Verfall	Gegenpartei	Kontraktwert in EUR	Verkehrswert in EUR <sup>3</sup>	in % <sup>3</sup>
Mini S&P 500 DEC 19	77	50.00	20.12.2019	CME	10'977'672.74	571'100.88	0.18
MSCI EM DEC 19	67	50.00	20.12.2019	ICE US	3'153'869.42	-21'257.61	-0.01
<b>Total</b>					<b>14'131'542.16</b>	<b>549'843.27</b>	<b>0.17</b>

## Am Ende der Berichtsperiode offene engagementreduzierende Derivate

### Optionen

Bezeichnung	Anzahl Kontrakte	Verfall	Gegenpartei	Verkehrswert in EUR <sup>3</sup>	Anteil am Nettover- mögen in % <sup>3</sup>
SPX 2750 P 18 Jun 20	12	19.06.2020	OCC	53'983.93	0.02
SPX 2850 P 17 Sep 20	12	18.09.2020	OCC	99'587.28	0.03
SX5E 3250 P 19 Jun 20	92	19.06.2020	EUREX	53'636.00	0.02
SX5E 3350 P 18 Dec 20	90	18.12.2020	EUREX	127'350.00	0.04
<b>Total</b>				<b>334'557.21</b>	<b>0.11</b>
<b>Total am Ende der Berichtsperiode offene derivative Finanzinstrumente</b>				<b>-584'329.39</b>	<b>-0.19</b>

## Während der Berichtsperiode getätigte derivative Finanzinstrumente

### Devisentermingeschäfte

Verfall	Kauf	Verkauf	Kauf Betrag	Verkauf Betrag
24.07.2019	AUD	EUR	2'384'000.00	1'489'534.52
24.07.2019	AUD	EUR	8'200'000.00	5'160'445.81
24.07.2019	AUD	EUR	1'245'000.00	759'887.70
24.07.2019	CAD	EUR	695'000.00	458'695.92
24.07.2019	CHF	EUR	72'039'000.00	63'259'804.35
24.07.2019	CHF	EUR	5'600.00	5'061.09
24.07.2019	CHF	EUR	655'950.00	576'011.17
24.07.2019	CHF	EUR	250'000.00	221'678.37
24.07.2019	CHF	EUR	2'700'000.00	2'405'838.17
24.07.2019	CHF	EUR	510'000.00	460'921.12
24.07.2019	CHF	EUR	25'500.00	22'721.80
24.07.2019	CHF	EUR	3'400'000.00	3'048'151.83
24.07.2019	CHF	EUR	580'000.00	509'366.19
24.07.2019	CHF	EUR	9'200.00	8'251.86
24.07.2019	CHF	EUR	865'000.00	775'854.34
24.07.2019	CHF	EUR	410'000.00	363'552.53
24.07.2019	CHF	EUR	760'000.00	678'619.90
24.07.2019	CHF	EUR	4'700.00	4'167.55
24.07.2019	CHF	EUR	14'200.00	12'499.01
24.07.2019	CHF	EUR	7'400.00	6'666.37
24.07.2019	CHF	EUR	1'670'000.00	1'469'953.96
24.07.2019	CHF	EUR	7'200.00	6'429.03
24.07.2019	CHF	EUR	7'705'000.00	6'938'316.07
24.07.2019	CHF	EUR	765'000.00	689'158.15
24.07.2019	EUR	AUD	7'483'417.10	11'829'000.00
24.07.2019	EUR	CAD	474'305.60	695'000.00
24.07.2019	EUR	CHF	6'556'803.78	7'500'000.00
24.07.2019	EUR	CHF	2'640.59	3'000.00
24.07.2019	EUR	CHF	2'932.60	3'300.00
24.07.2019	EUR	CHF	2'061'985.06	2'300'000.00
24.07.2019	EUR	CHF	65'479'513.73	72'715'000.00
24.07.2019	EUR	CHF	237'327.17	270'000.00
24.07.2019	EUR	CHF	381'771.53	427'000.00
24.07.2019	EUR	CHF	624'888.41	700'000.00
24.07.2019	EUR	CHF	206'324.96	235'000.00
24.07.2019	EUR	CHF	628'950.92	698'450.00
24.07.2019	EUR	CHF	3'564.81	4'000.00
24.07.2019	EUR	CHF	269'873.48	300'000.00
24.07.2019	EUR	CHF	275'870.75	307'000.00
24.07.2019	EUR	CHF	299'266.80	340'000.00
24.07.2019	EUR	CHF	3'308.09	3'700.00
24.07.2019	EUR	CHF	4'424.35	5'000.00
24.07.2019	EUR	CHF	5'356.19	6'000.00
24.07.2019	EUR	CHF	648'958.51	720'000.00
24.07.2019	EUR	CHF	347'568.80	390'000.00
24.07.2019	EUR	CHF	175'643.51	200'000.00

Verfall	Kauf	Verkauf	Kauf Betrag	Verkauf Betrag
24.07.2019	EUR	CHF	219'488.85	250'000.00
24.07.2019	EUR	CHF	470'993.89	530'000.00
24.07.2019	EUR	CHF	5'678.39	6'300.00
24.07.2019	EUR	CHF	2'940'468.87	3'300'000.00
24.07.2019	EUR	CHF	525'072.20	600'000.00
24.07.2019	EUR	CHF	504'375.68	570'000.00
24.07.2019	EUR	GBP	11'574'488.81	10'078'000.00
24.07.2019	EUR	HKD	3'638'318.48	32'486'000.00
24.07.2019	EUR	HKD	681'378.38	6'000'000.00
24.07.2019	EUR	JPY	409'990.65	50'000'000.00
24.07.2019	EUR	JPY	368'372.37	45'000'000.00
24.07.2019	EUR	JPY	13'694'525.68	1'734'980'000.00
24.07.2019	EUR	NOK	7'016'100.55	67'544'000.00
24.07.2019	EUR	SEK	2'612'808.76	27'296'000.00
24.07.2019	EUR	SGD	844'553.44	1'300'000.00
24.07.2019	EUR	USD	19'518'056.17	21'889'500.00
24.07.2019	EUR	USD	115'204.82	130'000.00
24.07.2019	EUR	USD	166'335'526.70	189'539'000.00
24.07.2019	EUR	USD	1'453'501.18	1'650'000.00
24.07.2019	EUR	USD	1'314'728.46	1'500'000.00
24.07.2019	EUR	USD	93'499.55	105'000.00
24.07.2019	EUR	USD	142'556.76	160'000.00
24.07.2019	EUR	USD	97'703.96	110'000.00
24.07.2019	EUR	USD	115'438.58	130'000.00
24.07.2019	EUR	USD	2'642'007.93	3'000'000.00
24.07.2019	EUR	USD	268'019.87	300'000.00
24.07.2019	EUR	USD	1'416'719.06	1'600'000.00
24.07.2019	EUR	USD	102'126.00	115'000.00
24.07.2019	EUR	USD	772'478.69	880'000.00
24.07.2019	EUR	USD	1'679'127.56	1'900'000.00
24.07.2019	EUR	USD	152'064.88	171'000.00
24.07.2019	EUR	USD	6'218'197.42	7'100'000.00
24.07.2019	EUR	USD	163'492.12	183'000.00
24.07.2019	EUR	USD	574'553.94	645'000.00
24.07.2019	EUR	USD	2'288'913.73	2'600'000.00
24.07.2019	GBP	EUR	150'000.00	168'209.14
24.07.2019	GBP	EUR	500'000.00	565'898.93
24.07.2019	GBP	EUR	9'428'000.00	10'423'438.36
24.07.2019	HKD	EUR	31'486'000.00	3'591'422.38
24.07.2019	HKD	EUR	7'000'000.00	797'602.63
24.07.2019	JPY	EUR	1'812'980'000.00	14'927'789.21
24.07.2019	JPY	EUR	17'000'000.00	139'447.13
24.07.2019	NOK	EUR	56'670'000.00	5'886'416.16
24.07.2019	NOK	EUR	10'874'000.00	1'109'988.26
24.07.2019	SEK	EUR	27'296'000.00	2'595'170.18
24.07.2019	SGD	EUR	1'300'000.00	851'732.95
24.07.2019	USD	EUR	200'000.00	176'750.27
24.07.2019	USD	EUR	83'000.00	73'613.54
24.07.2019	USD	EUR	1'500'000.00	1'328'609.39
24.07.2019	USD	EUR	670'000.00	598'615.14
24.07.2019	USD	EUR	3'000'000.00	2'642'007.93

Verfall	Kauf	Verkauf	Kauf Betrag	Verkauf Betrag
24.07.2019	USD	EUR	107'000.00	93'783.96
24.07.2019	USD	EUR	130'000.00	114'592.97
24.07.2019	USD	EUR	1'300'000.00	1'156'048.80
24.07.2019	USD	EUR	423'000.00	376'800.49
24.07.2019	USD	EUR	94'000.00	83'632.87
24.07.2019	USD	EUR	238'000.00	211'393.96
24.07.2019	USD	EUR	20'487'500.00	17'979'408.48
24.07.2019	USD	EUR	198'804'000.00	177'266'161.39
24.07.2019	USD	EUR	1'200'000.00	1'065'463.88
24.07.2019	USD	EUR	1'000'000.00	886'157.16
24.07.2019	USD	EUR	700'000.00	617'039.09
24.07.2019	USD	EUR	796'000.00	701'012.77
24.07.2019	USD	EUR	125'000.00	109'475.31
24.07.2019	USD	EUR	550'000.00	490'353.41
24.07.2019	USD	EUR	2'100'000.00	1'871'190.79
24.07.2019	USD	EUR	200'000.00	176'928.52
23.10.2019	AUD	EUR	2'584'000.00	1'576'955.94
23.10.2019	CAD	EUR	695'000.00	471'638.25
23.10.2019	CHF	EUR	6'000.00	5'461.50
23.10.2019	CHF	EUR	220'000.00	202'483.18
23.10.2019	CHF	EUR	2'700.00	2'485.02
23.10.2019	CHF	EUR	11'600.00	10'606.01
23.10.2019	CHF	EUR	6'800.00	6'246.61
23.10.2019	CHF	EUR	590'000.00	535'730.50
23.10.2019	CHF	EUR	1'060'000.00	969'169.44
23.10.2019	CHF	EUR	2'400.00	2'197.62
23.10.2019	CHF	EUR	2'500.00	2'270.87
23.10.2019	CHF	EUR	572'000.00	520'662.66
23.10.2019	CHF	EUR	72'715'000.00	65'551'824.39
23.10.2019	CHF	EUR	1'120'000.00	1'027'975.62
23.10.2019	CHF	EUR	11'300.00	10'371.54
23.10.2019	CHF	EUR	370'000.00	334'010.38
23.10.2019	CHF	EUR	3'900.00	3'601.61
23.10.2019	CHF	EUR	698'450.00	629'645.49
23.10.2019	CHF	EUR	535'000.00	485'701.32
23.10.2019	CHF	EUR	2'200.00	2'005.41
23.10.2019	CHF	EUR	440'000.00	402'926.71
23.10.2019	CHF	EUR	4'600.00	4'212.42
23.10.2019	CHF	EUR	6'100.00	5'538.91
23.10.2019	CHF	EUR	400'000.00	366'132.72
23.10.2019	CHF	EUR	4'500.00	4'077.71
23.10.2019	CHF	EUR	400'000.00	362'463.30
23.10.2019	CHF	EUR	600'000.00	551'171.70
23.10.2019	CHF	EUR	390'000.00	360'160.69
23.10.2019	CHF	EUR	6'900'000.00	6'315'789.47
23.10.2019	CHF	EUR	4'000.00	3'661.33
23.10.2019	EUR	AUD	124'217.43	200'000.00
23.10.2019	EUR	AUD	1'482'701.40	2'384'000.00
23.10.2019	EUR	CAD	476'353.67	695'000.00
23.10.2019	EUR	CHF	3'668.11	4'000.00
23.10.2019	EUR	CHF	6'945'978.23	7'705'000.00

Verfall	Kauf	Verkauf	Kauf Betrag	Verkauf Betrag
23.10.2019	EUR	CHF	180'546.15	200'000.00
23.10.2019	EUR	CHF	3'043'174.46	3'310'000.00
23.10.2019	EUR	CHF	6'527.66	7'100.00
23.10.2019	EUR	CHF	6'405.39	7'000.00
23.10.2019	EUR	CHF	320'406.58	348'000.00
23.10.2019	EUR	CHF	1'841.10	2'000.00
23.10.2019	EUR	CHF	651'429.87	717'550.00
23.10.2019	EUR	CHF	92'282.42	100'000.00
23.10.2019	EUR	CHF	1'281'159.63	1'400'000.00
23.10.2019	EUR	CHF	6'061.00	6'600.00
23.10.2019	EUR	CHF	91'578.45	100'000.00
23.10.2019	EUR	CHF	459'976.10	500'000.00
23.10.2019	EUR	CHF	12'811.60	14'000.00
23.10.2019	EUR	CHF	3'038.34	3'300.00
23.10.2019	EUR	CHF	635'963.51	695'000.00
23.10.2019	EUR	CHF	633'649.55	690'000.00
23.10.2019	EUR	CHF	850'970.38	930'000.00
23.10.2019	EUR	CHF	63'162'959.60	69'574'000.00
23.10.2019	EUR	CHF	348'470.40	380'000.00
23.10.2019	EUR	CHF	349'808.07	380'000.00
23.10.2019	EUR	CHF	5'032.62	5'500.00
23.10.2019	EUR	GBP	10'390'663.83	9'428'000.00
23.10.2019	EUR	HKD	3'567'755.63	31'486'000.00
23.10.2019	EUR	HKD	305'709.98	2'700'000.00
23.10.2019	EUR	JPY	14'920'381.24	1'812'980'000.00
23.10.2019	EUR	JPY	423'466.84	50'000'000.00
23.10.2019	EUR	JPY	759'269.41	90'000'000.00
23.10.2019	EUR	NOK	6'284'718.81	62'700'000.00
23.10.2019	EUR	NOK	477'114.46	4'844'000.00
23.10.2019	EUR	SEK	2'593'182.77	27'296'000.00
23.10.2019	EUR	SGD	273'151.19	420'000.00
23.10.2019	EUR	SGD	846'762.66	1'300'000.00
23.10.2019	EUR	USD	176'007'195.96	198'804'000.00
23.10.2019	EUR	USD	231'168.30	258'000.00
23.10.2019	EUR	USD	196'458.44	222'000.00
23.10.2019	EUR	USD	1'636'979.82	1'850'000.00
23.10.2019	EUR	USD	111'462.01	126'000.00
23.10.2019	EUR	USD	20'357'697.58	22'281'500.00
23.10.2019	EUR	USD	1'263'275.67	1'400'000.00
23.10.2019	EUR	USD	1'070'616.05	1'200'000.00
23.10.2019	EUR	USD	196'987.88	220'000.00
23.10.2019	EUR	USD	106'668.56	120'000.00
23.10.2019	EUR	USD	180'675.00	200'000.00
23.10.2019	EUR	USD	892'036.79	1'000'000.00
23.10.2019	EUR	USD	158'220.82	178'000.00
23.10.2019	EUR	USD	126'270.49	142'000.00
23.10.2019	EUR	USD	976'683.89	1'100'000.00
23.10.2019	EUR	USD	1'350'049.95	1'500'000.00
23.10.2019	EUR	USD	1'420'454.55	1'600'000.00
23.10.2019	EUR	USD	498'400.59	550'000.00
23.10.2019	GBP	EUR	8'408'000.00	9'740'500.46

Verfall	Kauf	Verkauf	Kauf Betrag	Verkauf Betrag
23.10.2019	GBP	EUR	250'000.00	275'030.23
23.10.2019	GBP	EUR	250'000.00	271'361.58
23.10.2019	GBP	EUR	300'000.00	339'808.57
23.10.2019	GBP	EUR	220'000.00	244'276.17
23.10.2019	HKD	EUR	2'080'000.00	241'155.23
23.10.2019	HKD	EUR	2'250'000.00	255'209.10
23.10.2019	HKD	EUR	29'856'000.00	3'443'995.85
23.10.2019	JPY	EUR	70'000'000.00	588'208.11
23.10.2019	JPY	EUR	105'000'000.00	893'928.95
23.10.2019	JPY	EUR	40'000'000.00	340'889.72
23.10.2019	JPY	EUR	1'737'980'000.00	14'453'056.13
23.10.2019	NOK	EUR	67'544'000.00	6'982'489.30
23.10.2019	SEK	EUR	3'000'000.00	276'634.10
23.10.2019	SEK	EUR	3'000'000.00	281'587.02
23.10.2019	SEK	EUR	21'296'000.00	1'965'663.65
23.10.2019	SGD	EUR	1'720'000.00	1'134'789.21
23.10.2019	USD	EUR	150'000.00	135'927.43
23.10.2019	USD	EUR	600'000.00	533'342.81
23.10.2019	USD	EUR	335'000.00	297'444.64
23.10.2019	USD	EUR	1'000'000.00	895'399.44
23.10.2019	USD	EUR	158'000.00	140'692.06
23.10.2019	USD	EUR	4'300'000.00	3'822'663.95
23.10.2019	USD	EUR	1'000'000.00	901'623.82
23.10.2019	USD	EUR	1'500'000.00	1'368'450.82
23.10.2019	USD	EUR	190'000.00	171'444.56
23.10.2019	USD	EUR	1'000'000.00	902'250.21
23.10.2019	USD	EUR	1'000'000.00	894'102.50
23.10.2019	USD	EUR	160'000.00	145'062.88
23.10.2019	USD	EUR	1'000'000.00	896'298.29
23.10.2019	USD	EUR	74'000.00	66'010.72
23.10.2019	USD	EUR	1'000'000.00	889'228.77
23.10.2019	USD	EUR	21'889'500.00	19'379'436.61
23.10.2019	USD	EUR	196'604'000.00	177'938'274.96
23.10.2019	USD	EUR	228'000.00	202'414.77
23.10.2019	USD	EUR	280'000.00	247'759.11
23.10.2019	USD	EUR	283'000.00	254'709.42

## Während der Berichtsperiode getätigte engagementreduzierende Derivate

### Futures

Bezeichnung	Verfall	Käufe/Kontrakte	Verkäufe/Kontrakte
STXE Jun 19	21.06.2019	139	0
SX5E SEP 19	20.09.2019	209	209



## Während der Berichtsperiode getätigte engagementerhöhende Derivate

### Futures

Bezeichnung	Verfall	Käufe/Kontrakte	Verkäufe/Kontrakte
Mini S&P 500 Jun 19	21.06.2019	32	73
Mini S&P 500 Sep 19	20.09.2019	132	132
TOPIX DEC 19	13.12.2019	25	25
TOPIX Sep 19	13.09.2019	25	25

## Während der Berichtsperiode getätigte engagementreduzierende Derivate

### Optionen

Bezeichnung	Verfall	Käufe/Kontrakte	Verkäufe/Kontrakte
CELG 95 C 21 Jun 19	21.06.2019	488	0
SPX 2350 P 19 Dec 19	20.12.2019	0	15
SPX 2775 P 19 Mar 20	20.03.2020	0	12
STXE 2850 P 20 Dec 19	20.12.2019	0	107
SX5E 3300 P 20 Mar 20	20.03.2020	0	92

<sup>1</sup> Kauf umfasst die Transaktionen: Gratistitel / Käufe / Konversionen / Namensänderungen / "Splits" / Stock- / Wahldividenden / Titelaufteilungen / Überträge / Umbuchungen in Folge Redenominierung in Euro / Umtausch zwischen Gesellschaften / Zuteilungen aus Bezugs- / Optionsrechten / Zuteilung von Bezugsrechten auf Basistiteln

<sup>2</sup> Verkauf umfasst die Transaktionen: Auslosungen / Ausbuchung in Folge Verfall / Ausübung von Bezugs- / Optionsrechten / "Reverse Splits" / Überträge / Umbuchungen in Folge Redenominierung in Fondswährung / Umtausch zwischen Gesellschaften / Verkäufe / Rückzahlungen

<sup>3</sup> Allfällige Abweichungen in den Totalisierungen sind auf Rundungsdifferenzen zurückzuführen

## LGT Sustainable Strategy 5 Years OGAW nach liechtensteinischem Recht

### Dreijahresvergleich

Per:	30.11.2019	30.11.2018	30.11.2017
Nettovermögen (EUR) B	46'940'413	52'447'759	56'004'461
Anzahl Anteile im Umlauf (EUR) B	25'779	31'141	31'952
Nettoinventarwert pro Anteil am Ende der Periode (EUR) B	1'820.88	1'684.22	1'752.79
Nettoinventarwert pro Anteil zu Beginn der Periode (EUR) B	1'684.22	1'752.79	1'626.15
Veränderung Inventarwert in Prozent gg. Vorjahr (EUR) B	8.11%	-3.91%	7.79%
Nettovermögen (CHF) B	18'931'261	20'795'258	27'857'449
Anzahl Anteile im Umlauf (CHF) B	17'934	21'092	26'762
Nettoinventarwert pro Anteil am Ende der Periode (CHF) B	1'055.63	985.95	1'040.92
Nettoinventarwert pro Anteil zu Beginn der Periode (CHF) B	985.95	1'040.92	1'000.00 <sup>1</sup>
Veränderung Inventarwert in Prozent gg. Vorjahr (CHF) B	7.07%	-5.28%	4.09% <sup>1</sup>
Nettovermögen (USD) B	6'180'624	9'176'171	9'280'744
Anzahl Anteile im Umlauf (USD) B	5'560	9'040	8'792
Nettoinventarwert pro Anteil am Ende der Periode (USD) B	1'111.59	1'015.11	1'055.61
Nettoinventarwert pro Anteil zu Beginn der Periode (USD) B	1'015.11	1'055.61	1'000.00 <sup>1</sup>
Veränderung Inventarwert in Prozent gg. Vorjahr (USD) B	9.50%	-3.84%	5.56% <sup>1</sup>
Nettovermögen (EUR) I1	25'805'464	23'375'687	24'133'671
Anzahl Anteile im Umlauf (EUR) I1	18'058	17'854	17'881
Nettoinventarwert pro Anteil am Ende der Periode (EUR) I1	1'429.01	1'309.27	1'349.68
Nettoinventarwert pro Anteil zu Beginn der Periode (EUR) I1	1'309.27	1'349.68	1'240.34
Veränderung Inventarwert in Prozent gg. Vorjahr (EUR) I1	9.15%	-2.99%	8.82%
Nettovermögen (EUR) IM	1'294'643	1'220'209	1'234'807
Anzahl Anteile im Umlauf (EUR) IM	953	987	976
Nettoinventarwert pro Anteil am Ende der Periode (EUR) IM	1'359.11	1'236.17	1'265.06
Nettoinventarwert pro Anteil zu Beginn der Periode (EUR) IM	1'236.17	1'265.06	1'154.18
Veränderung Inventarwert in Prozent gg. Vorjahr (EUR) IM	9.95%	-2.28%	9.61%

<sup>1</sup> Seit Lancierung am 24.04.2017

Der Fonds verzichtet auf einen Benchmark, da kein vergleichbarer Index existiert.

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

## Vermögensrechnung per 30.11.2019

	<b>30.11.2019</b>
<b>Verkehrswerte</b>	<b>EUR</b>
Bankguthaben	
auf Sicht	2'220'995.24
Wertpapiere	
Aktien und andere Beteiligungspapiere	46'521'167.37
Anlagefonds	39'290'138.90
Andere Wertpapiere und Wertrechte	9'133'556.00
Derivative Finanzinstrumente	-50'798.23
Sonstige Vermögenswerte	33'444.50
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>97'148'503.78</b>
Verbindlichkeiten	-322'354.60
<b>Nettovermögen</b>	<b>96'826'149.18</b>

## Erfolgsrechnung für die Zeit vom 01.06.2019 bis 30.11.2019

	<b>30.11.2019</b>
<b>Ertrag</b>	<b>EUR</b>
Erträge der Bankguthaben	12'696.14
Erträge der Wertpapiere	
Aktien und sonstige Beteiligungspapiere einschliesslich Erträge aus Gratisaktien	386'902.39
Anteile anderer Investmentunternehmen	87'264.52
Erträge aus Securities Lending	2'476.85
Sonstige Erträge	29'178.93
Einkauf in laufende Erträge bei der Ausgabe von Anteilen	-11'540.14
<b>Total Ertrag</b>	<b>506'978.69</b>
<b>Aufwand</b>	<b>30.11.2019</b>
	<b>EUR</b>
Passivzinsen	651.96
Reglementarische Vergütungen	736'677.93
Sonstige Aufwendungen	33'033.49
Ausrichtung laufender Erträge bei der Rücknahme von Anteilen	-16'934.51
<b>Total Aufwand</b>	<b>753'428.87</b>
<b>Nettoertrag</b>	<b>-246'450.18</b>
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste	260'117.90
<b>Realisierter Erfolg</b>	<b>13'667.72</b>
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste	6'329'727.70
<b>Gesamterfolg</b>	<b>6'343'395.42</b>

## Veränderung des Nettovermögens

	<b>30.11.2019</b>
	<b>EUR</b>
Nettovermögen zu Beginn der Berichtsperiode	93'864'864.98
Ausschüttungen	0.00
Saldo aus dem Anteilverkehr	-3'382'111.22
Gesamterfolg	6'343'395.42
<b>Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode</b>	<b>96'826'149.18</b>

## Entwicklung der Anteile im Umlauf

	<b>30.11.2019</b>
	<b>Anzahl</b>
LGT Sustainable Strategy 5 Years (EUR) B	
Bestand Anzahl Anteile zu Beginn der Berichtsperiode	26'424.099
Ausgegebene Anteile	1'364.791
Zurückgenommene Anteile	-2'009.967
<b>Bestand Anzahl Anteile am Ende der Berichtsperiode</b>	<b>25'778.923</b>

	<b>30.11.2019</b>
	<b>Anzahl</b>
LGT Sustainable Strategy 5 Years (CHF) B	
Bestand Anzahl Anteile zu Beginn der Berichtsperiode	20'062.180
Ausgegebene Anteile	802.477
Zurückgenommene Anteile	-2'931.031
<b>Bestand Anzahl Anteile am Ende der Berichtsperiode</b>	<b>17'933.626</b>

	<b>30.11.2019</b>
	<b>Anzahl</b>
LGT Sustainable Strategy 5 Years (USD) B	
Bestand Anzahl Anteile zu Beginn der Berichtsperiode	6'227.541
Ausgegebene Anteile	83.685
Zurückgenommene Anteile	-751.065
<b>Bestand Anzahl Anteile am Ende der Berichtsperiode</b>	<b>5'560.161</b>

	<b>30.11.2019</b>
	<b>Anzahl</b>
LGT Sustainable Strategy 5 Years (EUR) I1	
Bestand Anzahl Anteile zu Beginn der Berichtsperiode	17'883.000
Ausgegebene Anteile	175.235
Zurückgenommene Anteile	0.000
<b>Bestand Anzahl Anteile am Ende der Berichtsperiode</b>	<b>18'058.235</b>

**30.11.2019**  
**Anzahl**

LGT Sustainable Strategy 5 Years (EUR) IM	
Bestand Anzahl Anteile zu Beginn der Berichtsperiode	952.564
Ausgegebene Anteile	0.000
Zurückgenommene Anteile	0.000
<b>Bestand Anzahl Anteile am Ende der Berichtsperiode</b>	<b>952.564</b>

## Inventar des Fondsvermögens

Bezeichnung	Laufzeit	Bestand 31.05.2019 Anzahl/ Nominal	Kauf <sup>1</sup>	Verkauf <sup>2</sup>	Bestand 30.11.2019 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert in EUR <sup>3</sup>	in % <sup>3</sup>
<b>Wertpapiere</b>							
<b>Aktien und aktienähnliche Wertpapiere</b>							
<i>Aktien und aktienähnliche Wertpapiere, die an einer Börse gehandelt werden</i>							
<b>Australien</b>							
R Amcor		34'800	0	34'800	0	0.00	0.00
R Mirvac Grp		229'200	0	29'300	199'900	413'252.73	0.43
<b>Total</b>						<b>413'252.73</b>	<b>0.43</b>
<b>Bermuda</b>							
R Haier Elec Grp		84'000	61'000	3'000	142'000	357'860.99	0.37
<b>Total</b>						<b>357'860.99</b>	<b>0.37</b>
<b>Brasilien</b>							
R Ambev /ADR		96'900	13'000	16'500	93'400	356'640.38	0.37
<b>Total</b>						<b>356'640.38</b>	<b>0.37</b>
<b>Cayman</b>							
R ENN Engy		46'600	5'900	15'700	36'800	362'437.81	0.37
R Shenzhou Intl Grp		17'000	11'700	0	28'700	343'185.04	0.35
<b>Total</b>						<b>705'622.85</b>	<b>0.73</b>
<b>Dänemark</b>							
R Novo-Nordisk B		12'300	700	1'500	11'500	586'758.88	0.61
R Vestas Wind		7'100	1'100	2'450	5'750	496'713.25	0.51
<b>Total</b>						<b>1'083'472.13</b>	<b>1.12</b>
<b>Deutschland</b>							
B SAP		5'700	1'100	2'100	4'700	580'356.00	0.60
R adidas		2'000	400	600	1'800	508'950.00	0.53
R BASF		5'100	400	1'000	4'500	306'990.00	0.32
R Vonovia		8'000	1'500	800	8'700	411'423.00	0.42
<b>Total</b>						<b>1'807'719.00</b>	<b>1.87</b>
<b>Frankreich</b>							
R DANONE		8'500	1'300	1'800	8'000	597'760.00	0.62
R Gecina		3'000	0	400	2'600	407'680.00	0.42
R ILIAD		3'380	3'370	1'950	4'800	554'640.00	0.57
R L'Oreal		2'500	400	650	2'250	582'075.00	0.60
R Total		8'900	0	0	8'900	423'996.00	0.44
R Unib-Rodam-West		2'847	300	347	2'800	397'320.00	0.41
<b>Total</b>						<b>2'963'471.00</b>	<b>3.06</b>

Bezeichnung	Laufzeit	Bestand 31.05.2019 Anzahl/ Nominal	Kauf <sup>1</sup>	Verkauf <sup>2</sup>	Bestand 30.11.2019 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert in EUR <sup>3</sup>	in % <sup>3</sup>
<b>Grossbritannien</b>							
R Diageo		13'600	3'300	1'700	15'200	564'289.04	0.58
R Interc Hts		0	10'000	0	10'000	587'302.57	0.61
R ITV		415'900	62'400	129'200	349'100	594'157.49	0.61
R M&G		0	35'800	35'800	0	0.00	0.00
R Prudential		28'200	12'000	4'400	35'800	578'020.92	0.60
R Reckitt Ben Grp		7'000	1'700	300	8'400	597'676.26	0.62
R Rio Tinto		8'100	2'200	2'400	7'900	389'328.12	0.40
R Sage Grp		59'300	4'800	14'700	49'400	436'784.68	0.45
R Smith & Nephew		27'000	0	27'000	0	0.00	0.00
<b>Total</b>						<b>3'747'559.08</b>	<b>3.87</b>
<b>Hong Kong</b>							
R AIA		42'800	4'000	7'600	39'200	356'097.46	0.37
R HKT Trt and HKT		246'000	32'000	0	278'000	369'788.53	0.38
R Link REIT		0	32'500	0	32'500	301'259.05	0.31
R Sun Hung Kai Pties		25'000	3'000	4'000	24'000	316'739.13	0.33
<b>Total</b>						<b>1'343'884.17</b>	<b>1.39</b>
<b>Irland</b>							
R Medtronic		12'200	600	300	12'500	1'262'867.44	1.30
<b>Total</b>						<b>1'262'867.44</b>	<b>1.30</b>
<b>Italien</b>							
R Prysmian		34'400	0	18'900	15'500	320'695.00	0.33
<b>Total</b>						<b>320'695.00</b>	<b>0.33</b>
<b>Japan</b>							
R DAIWA HOUSE IND		14'100	2'900	2'300	14'700	407'801.28	0.42
R INPEX		47'900	6'200	12'200	41'900	371'028.98	0.38
R Komatsu		17'800	1'800	2'600	17'000	361'485.51	0.37
R Mitsubishi Estate		26'800	2'300	4'100	25'000	415'523.20	0.43
R NGK Insulators		29'000	1'400	6'200	24'200	361'833.42	0.37
R Nintendo		1'300	0	100	1'200	420'969.63	0.43
R Nitori Hldgs		3'500	0	700	2'800	397'775.71	0.41
R OMRON		8'500	700	9'200	0	0.00	0.00
<b>Total</b>						<b>2'736'417.73</b>	<b>2.83</b>
<b>Jersey</b>							
R Amcor /CDI		0	41'400	0	41'400	387'296.19	0.40
R Amcor / Deferred		0	34'800	34'800	0	0.00	0.00
<b>Total</b>						<b>387'296.19</b>	<b>0.40</b>
<b>Niederlande</b>							
B Heineken		0	6'500	500	6'000	564'240.00	0.58
B Unilever		0	12'200	2'000	10'200	548'760.00	0.57
R ING Group		34'627	3'473	4'600	33'500	349'874.00	0.36



Bezeichnung	Laufzeit	Bestand 31.05.2019 Anzahl/ Nominal	Kauf <sup>1</sup>	Verkauf <sup>2</sup>	Bestand 30.11.2019 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert in EUR <sup>3</sup>	in % <sup>3</sup>
R Unilever /NL-Ct		11'100	166	11'266	0	0.00	0.00
<b>Total</b>						<b>1'462'874.00</b>	<b>1.51</b>
<b>Norwegen</b>							
R DNB		19'800	0	19'800	0	0.00	0.00
<b>Total</b>						<b>0.00</b>	<b>0.00</b>
<b>Schweden</b>							
R Assa Abloy B		29'600	2'500	9'600	22'500	484'884.98	0.50
R Boliden		23'900	800	11'300	13'400	313'666.04	0.32
<b>Total</b>						<b>798'551.02</b>	<b>0.82</b>
<b>Singapur</b>							
R DBS Grp		22'400	1'000	2'000	21'400	358'410.99	0.37
<b>Total</b>						<b>358'410.99</b>	<b>0.37</b>
<b>Spanien</b>							
B Grifols A		0	22'400	3'300	19'100	592'291.00	0.61
R Santander		81'600	7'700	6'300	83'000	293'571.00	0.30
<b>Total</b>						<b>885'862.00</b>	<b>0.91</b>
<b>Südafrika</b>							
R AngloGold		35'100	2'100	14'200	23'000	390'374.60	0.40
<b>Total</b>						<b>390'374.60</b>	<b>0.40</b>
<b>Taiwan</b>							
R President Chain		39'000	0	39'000	0	0.00	0.00
<b>Total</b>						<b>0.00</b>	<b>0.00</b>
<b>Vereinigte Staaten von Amerika</b>							
R Affiliated Mgr		8'700	2'400	2'100	9'000	696'866.10	0.72
R Agilent Tech		0	22'400	6'300	16'100	1'179'444.49	1.22
R Akamai		12'800	5'600	2'200	16'200	1'280'072.09	1.32
R Alphabet A		850	350	150	1'050	1'241'933.70	1.28
R Cap One Fin		13'300	0	5'300	8'000	725'662.97	0.75
R Celgene		18'500	0	18'500	0	0.00	0.00
R Cerner		10'700	5'900	1'800	14'800	960'982.82	0.99
R Church & Dwight		0	9'600	0	9'600	611'585.65	0.63
R Cognizant Tech A		18'300	1'300	400	19'200	1'116'422.43	1.15
R Colgate		15'900	6'100	12'200	9'800	602'816.89	0.62
R Comcast A		0	17'900	0	17'900	716'779.02	0.74
R Delta		18'600	2'900	8'000	13'500	701'723.02	0.72
R Digital Realty		3'600	250	150	3'700	405'890.74	0.42
R Eq Residential		6'300	0	1'200	5'100	393'641.87	0.41
R Estee Laud A		7'200	1'900	2'000	7'100	1'258'751.52	1.30
R Halliburton		32'800	2'300	35'100	0	0.00	0.00
R Healthpeak Prop		14'900	0	14'900	0	0.00	0.00

Bezeichnung	Laufzeit	Bestand 31.05.2019 Anzahl/ Nominal	Kauf <sup>1</sup>	Verkauf <sup>2</sup>	Bestand 30.11.2019 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert in EUR <sup>3</sup>	in % <sup>3</sup>
R Healthpeak Prop		0	13'800	1'000	12'800	405'053.59	0.42
R Host Hotels		24'700	1'900	0	26'600	421'961.66	0.44
R Intercont Ex		9'665	0	1'200	8'465	723'004.63	0.75
R KeyCorp		67'700	0	27'100	40'600	714'011.80	0.74
R M&T Bk		4'700	0	0	4'700	702'260.87	0.73
R Microsoft		9'500	0	1'250	8'250	1'132'723.73	1.17
R Mondelez Int		14'500	0	14'500	0	0.00	0.00
R MS		20'300	4'400	8'700	16'000	718'044.27	0.74
R NewmontGold		26'500	6'700	4'000	29'200	1'016'987.52	1.05
R Oracle		18'800	3'700	8'500	14'000	712'856.30	0.74
R PepsiCo		8'700	600	1'100	8'200	1'010'208.69	1.04
R Prologis		0	2'600	0	2'600	215'890.36	0.22
R Ross Stores		0	15'000	2'800	12'200	1'285'229.23	1.33
R Simon Pty Grp		2'450	400	2'850	0	0.00	0.00
R Starbucks		9'700	1'500	1'700	9'500	736'097.87	0.76
R Stryker		4'200	2'700	600	6'300	1'170'575.06	1.21
R Tiffany & Co		11'500	0	11'500	0	0.00	0.00
R T-Mobile US		10'800	4'800	1'400	14'200	1'011'663.50	1.04
R Unitedhlth		5'100	1'250	1'350	5'000	1'269'193.68	1.31
R Valero Engy		8'500	2'600	11'100	0	0.00	0.00
<b>Total</b>						<b>25'138'336.07</b>	<b>25.97</b>

<b>Total Aktien und aktienähnliche Wertpapiere, die an einer Börse gehandelt werden</b>	<b>46'521'167.37</b>	<b>48.05</b>
---	----------------------	--------------

#### Anlagefonds

Crown LGT Select Bond EMMA A USD	6'380	60	1'500	4'940	5'435'812.63	5.61
LGT Dyn Pr U A USD	4'874	214	910	4'178	3'843'696.49	3.97
LGT Select Bond High Yield (USD) IM	1'435	0	15	1'420	3'022'613.56	3.12
LGT Select Cat Bond (USD) IM	44	556	0	600	678'401.64	0.70
LGT Select Equity Asia/Pacific ex Jap (USD) IM	400	250	0	650	1'277'425.95	1.32
LGT Select Equity Emerging Markets (USD) IM	1'880	0	880	1'000	1'644'342.06	1.70
MA Sustainable Money Market Fund (USD) IM	0	4'000	3'300	700	660'198.39	0.68
MA Sustainable Portfolio Corp Bds (USD) IM	300	290	40	550	951'284.40	0.98
MA Sustainable Portfolio Governm Bds (USD) IM	2'570	0	165	2'405	2'814'604.79	2.91
MA Sustainable Portfolio Infl Linked Bds (USD) IM	2'730	0	255	2'475	2'807'341.05	2.90
Ut ESPA BD EURO HY I01	14'355	0	980	13'375	1'406'515.00	1.45
Ut iSh MSCI Jap SC USD	33'200	0	33'200	0	0.00	0.00
Ut iShs Asia Pr Yi USD	14'500	4'000	1'000	17'500	470'216.60	0.49
Ut iShs EM SRI	570'000	131'069	0	701'069	4'269'807.83	4.41
Ut iShs Eu Pty EUR	7'700	3'500	800	10'400	468'208.00	0.48
Ut iShs II J.P. Mo	1'164'280	0	276'322	887'958	4'528'580.12	4.68
Ut iShs Jap SRI	232'700	271'300	0	504'000	2'791'872.36	2.88
Ut iShs MSCI EM USD	37'500	0	37'500	0	0.00	0.00
Ut iShs USD HY USD	25'173	500	1'640	24'033	2'219'218.03	2.29
<b>Total Anlagefonds</b>					<b>39'290'138.90</b>	<b>40.58</b>

Bezeichnung	Laufzeit	Bestand 31.05.2019 Anzahl/ Nominal	Kauf <sup>1</sup>	Verkauf <sup>2</sup>	Bestand 30.11.2019 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert in EUR <sup>3</sup>	in % <sup>3</sup>
-------------	----------	---	-------------------	----------------------	---	-------------------------------------	-------------------

#### Andere Wertpapiere und Wertrechte

Andere Wertpapiere und Wertrechte, die an einer Börse gehandelt werden

#### USD

WTM LBMA Gold		0	30'000	0	30'000	3'843'497.76	3.97
WTM Phys Gold		0	30'700	30'700	0	0.00	0.00
<b>Total Andere Wertpapiere und Wertrechte, die an einer Börse gehandelt werden</b>						<b>3'843'497.76</b>	<b>3.97</b>

Andere Wertpapiere und Wertrechte, die an einem anderen dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden

#### USD

SS Ct/LGT SEL ILS USD IM WFM		5'884	0	1'100	4'784	5'290'058.24	5.46
<b>Total Andere Wertpapiere und Wertrechte, die an einem anderen dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden</b>						<b>5'290'058.24</b>	<b>5.46</b>

<b>Total Wertpapiere</b>						<b>94'944'862.27</b>	<b>98.06</b>
--------------------------	--	--	--	--	--	----------------------	--------------

Total Wertpapiere						94'944'862.27	98.06
Bankguthaben auf Sicht						2'220'995.24	2.29
Derivative Finanzinstrumente						-50'798.23	-0.05
Sonstige Vermögenswerte						33'444.50	0.03
<b>Gesamtvermögen per 30.11.2019</b>						<b>97'148'503.78</b>	<b>100.33</b>
Verbindlichkeiten						-322'354.60	-0.33
<b>Nettovermögen per 30.11.2019</b>						<b>96'826'149.18</b>	<b>100.00</b>

## Derivative Finanzinstrumente

### Am Ende der Berichtsperiode offene derivative Finanzinstrumente

#### Devisentermingeschäfte

Währung		Betrag	gegen	Gegenwert	Verfall	Gegenpartei	Verkehrswert in EUR <sup>3</sup>	in % <sup>3</sup>
CAD	Kauf	198'000.00	EUR	135'322.25	11.12.2019	LGT Bank AG	-200.30	0.00
CHF	Kauf	280'000.00	EUR	255'016.08	11.12.2019	LGT Bank AG	-893.39	0.00
CHF	Kauf	71'000.00	EUR	64'531.37	11.12.2019	LGT Bank AG	-93.12	0.00
CHF	Kauf	90'000.00	EUR	82'075.15	11.12.2019	LGT Bank AG	-392.86	0.00
CHF	Kauf	128'000.00	EUR	116'430.32	11.12.2019	LGT Bank AG	-259.95	0.00
CHF	Kauf	58'000.00	EUR	52'531.00	11.12.2019	LGT Bank AG	108.70	0.00
CHF	Kauf	14'449'000.00	EUR	13'124'191.60	11.12.2019	LGT Bank AG	-10'553.38	-0.01
CHF	Kauf	100'000.00	EUR	90'742.45	11.12.2019	LGT Bank AG	15.65	0.00
HKD	Kauf	600'000.00	EUR	69'086.22	11.12.2019	LGT Bank AG	382.85	0.00
JPY	Kauf	12'000'000.00	EUR	99'388.76	11.12.2019	LGT Bank AG	3.83	0.00
JPY	Kauf	10'000'000.00	EUR	83'118.61	11.12.2019	LGT Bank AG	-291.45	0.00
NOK	Kauf	2'080'000.00	EUR	204'295.23	11.12.2019	LGT Bank AG	397.99	0.00
USD	Kauf	120'000.00	EUR	107'947.65	11.12.2019	LGT Bank AG	813.02	0.00
USD	Kauf	1'300'000.00	EUR	1'166'295.84	11.12.2019	LGT Bank AG	11'944.77	0.01
USD	Kauf	1'070'000.00	EUR	957'168.93	11.12.2019	LGT Bank AG	12'613.73	0.01
USD	Kauf	300'000.00	EUR	269'145.19	11.12.2019	LGT Bank AG	2'756.49	0.00
USD	Kauf	20'000.00	EUR	18'092.67	23.01.2020	LGT Bank AG	-25.06	0.00
USD	Kauf	34'000.00	EUR	30'724.74	23.01.2020	LGT Bank AG	-9.80	0.00
USD	Kauf	20'000.00	EUR	18'035.86	23.01.2020	LGT Bank AG	31.75	0.00
USD	Kauf	4'362'000.00	EUR	3'957'898.56	23.01.2020	LGT Bank AG	-17'351.85	-0.02
USD	Kauf	44'000.00	EUR	39'715.67	23.01.2020	LGT Bank AG	33.08	0.00
USD	Kauf	35'000.00	EUR	31'295.55	23.01.2020	LGT Bank AG	322.78	0.00
USD	Kauf	32'000.00	EUR	28'795.75	23.01.2020	LGT Bank AG	112.43	0.00
USD	Kauf	27'000.00	EUR	24'072.75	23.01.2020	LGT Bank AG	318.53	0.00
AUD	Verkauf	200'000.00	EUR	123'315.21	11.12.2019	LGT Bank AG	677.44	0.00
AUD	Verkauf	835'000.00	EUR	508'611.68	11.12.2019	LGT Bank AG	-3'401.00	0.00
CHF	Verkauf	130'000.00	EUR	118'161.41	11.12.2019	LGT Bank AG	175.88	0.00
CHF	Verkauf	150'000.00	EUR	136'246.71	11.12.2019	LGT Bank AG	109.56	0.00
CHF	Verkauf	100'000.00	EUR	91'025.77	11.12.2019	LGT Bank AG	267.67	0.00
CHF	Verkauf	67'000.00	EUR	60'875.89	11.12.2019	LGT Bank AG	67.96	0.00
CHF	Verkauf	1'040'000.00	EUR	946'495.69	11.12.2019	LGT Bank AG	2'611.42	0.00
CHF	Verkauf	400'000.00	EUR	363'844.75	11.12.2019	LGT Bank AG	812.34	0.00
CHF	Verkauf	90'000.00	EUR	81'915.74	11.12.2019	LGT Bank AG	233.45	0.00
CHF	Verkauf	330'000.00	EUR	303'547.36	11.12.2019	LGT Bank AG	4'045.62	0.00
GBP	Verkauf	2'991'000.00	EUR	3'458'651.14	11.12.2019	LGT Bank AG	-48'362.16	-0.05
GBP	Verkauf	170'000.00	EUR	199'401.79	11.12.2019	LGT Bank AG	73.05	0.00
GBP	Verkauf	65'000.00	EUR	75'733.39	11.12.2019	LGT Bank AG	-480.54	0.00
HKD	Verkauf	11'525'000.00	EUR	1'325'656.76	11.12.2019	LGT Bank AG	-8'728.34	-0.01
HKD	Verkauf	3'500'000.00	EUR	400'732.77	11.12.2019	LGT Bank AG	-4'503.48	0.00
JPY	Verkauf	35'000'000.00	EUR	289'931.91	11.12.2019	LGT Bank AG	36.85	0.00
JPY	Verkauf	667'326'000.00	EUR	5'547'343.44	11.12.2019	LGT Bank AG	20'071.66	0.02
JPY	Verkauf	10'000'000.00	EUR	82'690.42	11.12.2019	LGT Bank AG	-136.74	0.00
SEK	Verkauf	6'673'000.00	EUR	615'615.00	11.12.2019	LGT Bank AG	-16'723.45	-0.02
SGD	Verkauf	690'000.00	EUR	453'912.73	11.12.2019	LGT Bank AG	-3'471.64	0.00

Devisentermingeschäfte

Währung		Betrag	gegen	Gegenwert	Verfall	Gegenpartei	Verkehrswert in EUR <sup>3</sup>	in % <sup>3</sup>
USD	Verkauf	52'852'000.00	EUR	47'674'931.51	11.12.2019	LGT Bank AG	-226'893.86	-0.23
USD	Verkauf	660'000.00	EUR	598'346.39	11.12.2019	LGT Bank AG	162.69	0.00
USD	Verkauf	450'000.00	EUR	407'114.92	11.12.2019	LGT Bank AG	-737.60	0.00
USD	Verkauf	200'000.00	EUR	178'927.69	11.12.2019	LGT Bank AG	-2'340.10	0.00
USD	Verkauf	37'000.00	EUR	33'439.68	23.01.2020	LGT Bank AG	14.59	0.00
USD	Verkauf	18'000.00	EUR	16'167.86	23.01.2020	LGT Bank AG	-92.99	0.00
USD	Verkauf	35'000.00	EUR	31'710.65	23.01.2020	LGT Bank AG	92.32	0.00
USD	Verkauf	43'000.00	EUR	38'339.11	23.01.2020	LGT Bank AG	-506.26	0.00
<b>Total Devisentermingeschäfte</b>							<b>-287'141.22</b>	<b>-0.30</b>

Am Ende der Berichtsperiode offene engagementreduzierende Derivate

Futures

Bezeichnung	Anzahl Kontrakte	Kontraktgrösse	Verfall	Gegenpartei	Kontraktwert in EUR	Verkehrswert in EUR <sup>3</sup>	in % <sup>3</sup>
SX5E DEC 19	-68	10.00	20.12.2019	EUREX	-2'517'360.00	-115'972.16	-0.12
<b>Total</b>					<b>-2'517'360.00</b>	<b>-115'972.16</b>	<b>-0.12</b>

Am Ende der Berichtsperiode offene engagementerhöhende Derivate

Futures

Bezeichnung	Anzahl Kontrakte	Kontraktgrösse	Verfall	Gegenpartei	Kontraktwert in EUR	Verkehrswert in EUR <sup>3</sup>	in % <sup>3</sup>
Mini S&P 500 DEC 19	28	50.00	20.12.2019	CME	3'991'881.00	207'673.05	0.21
MSCI EM DEC 19	20	50.00	20.12.2019	ICE US	941'453.56	-6'345.56	-0.01
<b>Total</b>					<b>4'933'334.56</b>	<b>201'327.49</b>	<b>0.21</b>

Am Ende der Berichtsperiode offene engagementreduzierende Derivate

Optionen

Bezeichnung	Anzahl Kontrakte	Verfall	Gegenpartei	Verkehrswert in EUR <sup>3</sup>	Anteil am Nettover- mögen in % <sup>3</sup>
SPX 2750 P 18 Jun 20	6	19.06.2020	OCC	26'991.96	0.03
SPX 2850 P 17 Sep 20	5	18.09.2020	OCC	41'494.70	0.04
SX5E 3250 P 19 Jun 20	42	19.06.2020	EUREX	24'486.00	0.03
SX5E 3350 P 18 Dec 20	41	18.12.2020	EUREX	58'015.00	0.06
<b>Total</b>				<b>150'987.66</b>	<b>0.16</b>

<b>Total am Ende der Berichtsperiode offene derivative Finanzinstrumente</b>	<b>-50'798.23</b>	<b>-0.05</b>
--	-------------------	--------------

## Während der Berichtsperiode getätigte derivative Finanzinstrumente

### Devisentermingeschäfte

Verfall	Kauf	Verkauf	Kauf Betrag	Verkauf Betrag
24.07.2019	AUD	EUR	2'250'000.00	1'415'975.99
24.07.2019	AUD	EUR	623'000.00	380'332.13
24.07.2019	AUD	EUR	1'015'000.00	634'176.82
24.07.2019	CAD	EUR	198'000.00	130'678.84
24.07.2019	CHF	EUR	110'000.00	98'026.11
24.07.2019	CHF	EUR	150'000.00	133'300.16
24.07.2019	CHF	EUR	95'000.00	84'937.46
24.07.2019	CHF	EUR	330'000.00	294'046.89
24.07.2019	CHF	EUR	130'000.00	114'168.28
24.07.2019	CHF	EUR	230'000.00	206'296.53
24.07.2019	CHF	EUR	522'000.00	456'353.54
24.07.2019	CHF	EUR	180'000.00	162'154.86
24.07.2019	CHF	EUR	165'000.00	149'121.54
24.07.2019	CHF	EUR	13'747'000.00	12'071'690.76
24.07.2019	CHF	EUR	86'000.00	76'791.20
24.07.2019	CHF	EUR	2'372'000.00	2'135'974.79
24.07.2019	CHF	EUR	40'000.00	35'742.37
24.07.2019	CHF	EUR	150'000.00	131'848.43
24.07.2019	CHF	EUR	70'000.00	62'069.94
24.07.2019	CHF	EUR	30'000.00	26'406.36
24.07.2019	EUR	AUD	2'459'677.55	3'888'000.00
24.07.2019	EUR	CAD	135'125.91	198'000.00
24.07.2019	EUR	CHF	13'188'653.76	14'646'000.00
24.07.2019	EUR	CHF	99'242.72	111'000.00
24.07.2019	EUR	CHF	106'944.25	120'000.00
24.07.2019	EUR	CHF	54'335.78	62'000.00
24.07.2019	EUR	CHF	129'566.09	145'000.00
24.07.2019	EUR	CHF	160'436.97	178'000.00
24.07.2019	EUR	CHF	147'295.13	165'000.00
24.07.2019	EUR	CHF	206'667.90	235'000.00
24.07.2019	EUR	CHF	78'895.46	90'000.00
24.07.2019	EUR	CHF	213'280.25	240'000.00
24.07.2019	EUR	CHF	2'036'980.37	2'330'000.00
24.07.2019	EUR	CHF	75'213.92	85'000.00
24.07.2019	EUR	GBP	4'213'812.21	3'669'000.00
24.07.2019	EUR	HKD	1'532'672.18	13'685'000.00
24.07.2019	EUR	HKD	283'846.80	2'500'000.00
24.07.2019	EUR	JPY	155'535.00	19'000'000.00
24.07.2019	EUR	JPY	139'396.82	17'000'000.00
24.07.2019	EUR	JPY	5'725'135.47	725'326'000.00
24.07.2019	EUR	NOK	187'424.25	1'800'000.00
24.07.2019	EUR	NOK	2'122'156.44	20'430'000.00
24.07.2019	EUR	NOK	20'582.46	200'000.00
24.07.2019	EUR	NOK	152'507.22	1'500'000.00
24.07.2019	EUR	SEK	1'001'532.02	10'463'000.00
24.07.2019	EUR	SGD	389'793.90	600'000.00

Verfall	Kauf	Verkauf	Kauf Betrag	Verkauf Betrag
24.07.2019	EUR	USD	46'460'809.94	52'942'000.00
24.07.2019	EUR	USD	1'882'975.28	2'150'000.00
24.07.2019	EUR	USD	26'641.56	30'000.00
24.07.2019	EUR	USD	23'059.46	26'000.00
24.07.2019	EUR	USD	489'071.48	550'000.00
24.07.2019	EUR	USD	309'542.76	350'000.00
24.07.2019	EUR	USD	420'713.11	480'000.00
24.07.2019	EUR	USD	241'399.59	275'000.00
24.07.2019	EUR	USD	574'438.38	650'000.00
24.07.2019	EUR	USD	493'309.49	560'000.00
24.07.2019	EUR	USD	23'975.70	27'000.00
24.07.2019	EUR	USD	819'022.46	930'000.00
24.07.2019	EUR	USD	67'004.97	75'000.00
24.07.2019	EUR	USD	71'471.97	80'000.00
24.07.2019	EUR	USD	4'238'965.67	4'754'000.00
24.07.2019	EUR	USD	70'747.50	80'000.00
24.07.2019	EUR	USD	32'966.25	37'000.00
24.07.2019	EUR	USD	141'671.91	160'000.00
24.07.2019	EUR	USD	28'456.59	32'000.00
24.07.2019	EUR	USD	495'851.67	560'000.00
24.07.2019	EUR	USD	222'695.33	250'000.00
24.07.2019	EUR	USD	551'326.74	620'000.00
24.07.2019	EUR	USD	11'590.17	13'000.00
24.07.2019	EUR	USD	86'255.96	97'000.00
24.07.2019	EUR	USD	484'193.29	550'000.00
24.07.2019	GBP	EUR	93'000.00	104'251.32
24.07.2019	GBP	EUR	3'166'000.00	3'500'276.40
24.07.2019	GBP	EUR	250'000.00	282'949.47
24.07.2019	GBP	EUR	160'000.00	185'647.15
24.07.2019	HKD	EUR	1'350'000.00	152'339.25
24.07.2019	HKD	EUR	2'800'000.00	319'041.05
24.07.2019	HKD	EUR	12'035'000.00	1'372'761.49
24.07.2019	JPY	EUR	30'000'000.00	245'861.33
24.07.2019	JPY	EUR	703'326'000.00	5'791'074.52
24.07.2019	JPY	EUR	28'000'000.00	228'150.51
24.07.2019	NOK	EUR	610'000.00	62'968.12
24.07.2019	NOK	EUR	1'390'000.00	142'058.96
24.07.2019	NOK	EUR	3'729'000.00	380'587.88
24.07.2019	NOK	EUR	18'201'000.00	1'890'571.04
24.07.2019	SEK	EUR	10'463'000.00	994'770.87
24.07.2019	SGD	EUR	600'000.00	393'107.51
24.07.2019	USD	EUR	445'000.00	395'724.40
24.07.2019	USD	EUR	4'435'000.00	3'892'064.75
24.07.2019	USD	EUR	30'000.00	26'818.69
24.07.2019	USD	EUR	38'000.00	33'790.39
24.07.2019	USD	EUR	33'000.00	29'088.99
24.07.2019	USD	EUR	45'000.00	39'964.12
24.07.2019	USD	EUR	50'000.00	44'187.57
24.07.2019	USD	EUR	101'000.00	89'968.91
24.07.2019	USD	EUR	50'000.00	44'485.57
24.07.2019	USD	EUR	197'000.00	173'491.85

Verfall	Kauf	Verkauf	Kauf Betrag	Verkauf Betrag
24.07.2019	USD	EUR	24'000.00	21'035.66
24.07.2019	USD	EUR	30'000.00	26'539.28
24.07.2019	USD	EUR	31'000.00	27'308.20
24.07.2019	USD	EUR	160'000.00	140'907.09
24.07.2019	USD	EUR	700'000.00	620'017.71
24.07.2019	USD	EUR	4'950'000.00	4'401'565.00
24.07.2019	USD	EUR	190'000.00	167'482.04
24.07.2019	USD	EUR	740'000.00	659'371.99
24.07.2019	USD	EUR	400'000.00	356'856.10
24.07.2019	USD	EUR	20'000.00	17'794.23
24.07.2019	USD	EUR	350'000.00	310'182.49
24.07.2019	USD	EUR	20'000.00	17'764.20
24.07.2019	USD	EUR	53'002'000.00	47'259'919.75
24.07.2019	USD	EUR	27'000.00	23'646.67
24.07.2019	USD	EUR	170'000.00	151'563.78
24.07.2019	USD	EUR	40'000.00	35'634.74
23.10.2019	AUD	EUR	180'000.00	111'795.69
23.10.2019	AUD	EUR	835'000.00	509'581.35
23.10.2019	CAD	EUR	198'000.00	134'366.01
23.10.2019	CHF	EUR	340'000.00	313'219.71
23.10.2019	CHF	EUR	14'646'000.00	13'203'218.32
23.10.2019	CHF	EUR	75'000.00	69'060.77
23.10.2019	CHF	EUR	240'000.00	219'434.59
23.10.2019	CHF	EUR	85'000.00	77'181.51
23.10.2019	CHF	EUR	2'100'000.00	1'922'196.80
23.10.2019	CHF	EUR	62'000.00	55'969.31
23.10.2019	CHF	EUR	85'000.00	77'023.45
23.10.2019	CHF	EUR	242'000.00	222'116.16
23.10.2019	CHF	EUR	84'000.00	76'573.87
23.10.2019	CHF	EUR	30'000.00	27'704.67
23.10.2019	CHF	EUR	40'000.00	36'559.73
23.10.2019	CHF	EUR	155'000.00	141'842.67
23.10.2019	CHF	EUR	100'000.00	91'533.18
23.10.2019	CHF	EUR	130'000.00	119'420.53
23.10.2019	CHF	EUR	76'000.00	69'034.43
23.10.2019	CHF	EUR	150'000.00	136'177.94
23.10.2019	CHF	EUR	62'000.00	56'983.20
23.10.2019	CHF	EUR	120'000.00	109'880.05
23.10.2019	CHF	EUR	108'000.00	98'306.94
23.10.2019	EUR	AUD	631'267.59	1'015'000.00
23.10.2019	EUR	CAD	135'709.39	198'000.00
23.10.2019	EUR	CHF	366'045.61	400'000.00
23.10.2019	EUR	CHF	105'729.63	115'000.00
23.10.2019	EUR	CHF	87'367.57	95'000.00
23.10.2019	EUR	CHF	100'758.93	109'000.00
23.10.2019	EUR	CHF	2'138'333.60	2'372'000.00
23.10.2019	EUR	CHF	13'117'566.95	14'449'000.00
23.10.2019	EUR	CHF	118'952.85	130'000.00
23.10.2019	EUR	CHF	76'732.11	85'000.00
23.10.2019	EUR	CHF	100'873.01	110'000.00
23.10.2019	EUR	CHF	146'933.23	160'000.00



Verfall	Kauf	Verkauf	Kauf Betrag	Verkauf Betrag
23.10.2019	EUR	CHF	132'683.03	145'000.00
23.10.2019	EUR	CHF	387'586.17	420'000.00
23.10.2019	EUR	CHF	313'760.23	340'000.00
23.10.2019	EUR	GBP	99'163.17	90'000.00
23.10.2019	EUR	GBP	88'263.20	80'000.00
23.10.2019	EUR	GBP	3'489'270.44	3'166'000.00
23.10.2019	EUR	HKD	1'363'715.27	12'035'000.00
23.10.2019	EUR	HKD	96'242.03	850'000.00
23.10.2019	EUR	JPY	253'089.80	30'000'000.00
23.10.2019	EUR	JPY	84'856.15	10'000'000.00
23.10.2019	EUR	JPY	211'733.42	25'000'000.00
23.10.2019	EUR	JPY	5'788'200.67	703'326'000.00
23.10.2019	EUR	NOK	204'871.61	2'080'000.00
23.10.2019	EUR	NOK	1'924'507.20	19'200'000.00
23.10.2019	EUR	SEK	994'009.06	10'463'000.00
23.10.2019	EUR	SGD	390'813.54	600'000.00
23.10.2019	EUR	SGD	58'532.40	90'000.00
23.10.2019	EUR	USD	374'471.00	415'000.00
23.10.2019	EUR	USD	374'715.62	420'000.00
23.10.2019	EUR	USD	321'133.24	360'000.00
23.10.2019	EUR	USD	284'126.22	320'000.00
23.10.2019	EUR	USD	53'723.97	60'000.00
23.10.2019	EUR	USD	333'012.32	370'000.00
23.10.2019	EUR	USD	28'004.63	31'000.00
23.10.2019	EUR	USD	716'731.70	810'000.00
23.10.2019	EUR	USD	3'985'381.45	4'362'000.00
23.10.2019	EUR	USD	28'444.95	32'000.00
23.10.2019	EUR	USD	469'788.60	517'000.00
23.10.2019	EUR	USD	26'522.38	30'000.00
23.10.2019	EUR	USD	373'991.56	420'000.00
23.10.2019	EUR	USD	18'666.50	21'000.00
23.10.2019	EUR	USD	11'046.98	12'000.00
23.10.2019	EUR	USD	23'434.19	26'000.00
23.10.2019	EUR	USD	683'593.75	770'000.00
23.10.2019	EUR	USD	46'924'274.16	53'002'000.00
23.10.2019	EUR	USD	69'359.84	78'000.00
23.10.2019	GBP	EUR	100'000.00	110'012.09
23.10.2019	GBP	EUR	60'000.00	67'342.03
23.10.2019	GBP	EUR	90'000.00	99'931.16
23.10.2019	GBP	EUR	95'000.00	103'117.40
23.10.2019	GBP	EUR	2'991'000.00	3'465'013.90
23.10.2019	HKD	EUR	510'000.00	59'129.41
23.10.2019	HKD	EUR	850'000.00	96'412.33
23.10.2019	HKD	EUR	11'525'000.00	1'329'449.76
23.10.2019	JPY	EUR	20'000'000.00	169'202.30
23.10.2019	JPY	EUR	7'000'000.00	57'824.00
23.10.2019	JPY	EUR	10'000'000.00	84'237.07
23.10.2019	JPY	EUR	24'000'000.00	204'326.62
23.10.2019	JPY	EUR	12'000'000.00	101'931.60
23.10.2019	JPY	EUR	667'326'000.00	5'549'488.57
23.10.2019	JPY	EUR	28'000'000.00	235'283.24

Verfall	Kauf	Verkauf	Kauf Betrag	Verkauf Betrag
23.10.2019	NOK	EUR	850'000.00	84'517.41
23.10.2019	NOK	EUR	20'430'000.00	2'111'990.06
23.10.2019	SEK	EUR	6'673'000.00	615'931.33
23.10.2019	SEK	EUR	2'000'000.00	186'051.70
23.10.2019	SEK	EUR	700'000.00	65'788.03
23.10.2019	SEK	EUR	1'090'000.00	100'510.39
23.10.2019	SGD	EUR	690'000.00	455'235.20
23.10.2019	USD	EUR	44'000.00	39'601.47
23.10.2019	USD	EUR	37'000.00	32'946.88
23.10.2019	USD	EUR	38'000.00	34'288.91
23.10.2019	USD	EUR	620'000.00	564'755.61
23.10.2019	USD	EUR	63'000.00	57'159.45
23.10.2019	USD	EUR	25'000.00	22'304.50
23.10.2019	USD	EUR	110'000.00	99'662.06
23.10.2019	USD	EUR	38'000.00	34'919.09
23.10.2019	USD	EUR	600'000.00	545'209.20
23.10.2019	USD	EUR	4'754'000.00	4'208'860.03
23.10.2019	USD	EUR	54'000.00	47'940.34
23.10.2019	USD	EUR	850'000.00	752'352.21
23.10.2019	USD	EUR	400'000.00	357'641.00
23.10.2019	USD	EUR	450'000.00	398'918.49
23.10.2019	USD	EUR	52'852'000.00	47'834'193.14
23.10.2019	USD	EUR	620'000.00	551'321.84
23.10.2019	USD	EUR	45'000.00	39'818.43
23.10.2019	USD	EUR	385'000.00	344'728.78
23.10.2019	USD	EUR	71'000.00	63'040.51

### Während der Berichtsperiode getätigte engagementreduzierende Derivate

#### Futures

Bezeichnung	Verfall	Käufe/Kontrakte	Verkäufe/Kontrakte
STXE Jun 19	21.06.2019	46	0
SX5E SEP 19	20.09.2019	67	67

### Während der Berichtsperiode getätigte engagementerhöhende Derivate

#### Futures

Bezeichnung	Verfall	Käufe/Kontrakte	Verkäufe/Kontrakte
Mini S&P 500 Jun 19	21.06.2019	7	19
Mini S&P 500 Sep 19	20.09.2019	44	44
TOPIX DEC 19	13.12.2019	8	8
TOPIX Sep 19	13.09.2019	8	8

## Während der Berichtsperiode getätigte engagementreduzierende Derivate

### Optionen

Bezeichnung	Verfall	Käufe/Kontrakte	Verkäufe/Kontrakte
CELG 95 C 21 Jun 19	21.06.2019	185	0
SPX 2350 P 19 Dec 19	20.12.2019	0	7
SPX 2775 P 19 Mar 20	20.03.2020	0	6
STXE 2850 P 20 Dec 19	20.12.2019	0	51
SX5E 3300 P 20 Mar 20	20.03.2020	0	42

- <sup>1</sup> Kauf umfasst die Transaktionen: Gratistitel / Käufe / Konversionen / Namensänderungen / "Splits" / Stock- / Wahldividenden / Titelaufteilungen / Überträge / Umbuchungen in Folge Redenominierung in Euro / Umtausch zwischen Gesellschaften / Zuteilungen aus Bezugs- / Optionsrechten / Zuteilung von Bezugsrechten auf Basistiteln
- <sup>2</sup> Verkauf umfasst die Transaktionen: Auslosungen / Ausbuchung in Folge Verfall / Ausübung von Bezugs- / Optionsrechten / "Reverse Splits" / Überträge / Umbuchungen in Folge Redenominierung in Fondswährung / Umtausch zwischen Gesellschaften / Verkäufe / Rückzahlungen
- <sup>3</sup> Allfällige Abweichungen in den Totalisierungen sind auf Rundungsdifferenzen zurückzuführen

# Erläuterungen zum Halbjahresbericht

## Wichtigste Grundsätze der Rechnungslegung

### *Bestimmung des Nettoinventarwertes*

Für jeden Teilfonds berechnet die Verwaltungsgesellschaft oder ihr Beauftragter gemäss den in Anhang A des Prospektes für die jeweiligen Teilfonds enthaltenen Vorschriften den Nettoinventarwert, den Nettoinventarwert je Klasse und den Nettoinventarwert je Anteil für jeden als Bewertungstag bezeichneten Tag sowie am Ende des Geschäftsjahres.

Der Nettoinventarwert des Teilfonds wird durch Abzug der Gesamtverbindlichkeiten des Teilfonds (einschließlich der nachstehend beschriebenen Kosten und Gebühren) von den gesamten Vermögenswerten des Teilfonds berechnet.

Der Nettoinventarwert je Klasse wird durch Abzug der dieser Klasse zurechenbaren Verbindlichkeiten eines Teilfonds von den dieser Klasse zurechenbaren Vermögenswerten des Teilfonds berechnet. Die klassenspezifischen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten können unter anderem das Folgende enthalten: alle Kosten oder Gewinne in Verbindung mit einer klassenspezifischen Währungsabsicherung, den Anteil der einer Klasse zurechenbaren Gebühren und Aufwendungen einschließlich Vermögensverwaltungsgebühr, Performance Fee, Verwaltungskosten und anderer Anpassungen wie beispielsweise die Kosten, Rechnungsabgrenzungen, Verluste, Dividenden, Gewinne, Erträge und Einkünfte, von denen die Verwaltungsgesellschaft festlegt, dass sie sich auf diese Klasse beziehen.

Der Nettoinventarwert je Anteil wird durch Division des Nettoinventarwerts je Klasse durch die Zahl der ausgegebenen Anteile dieser Klasse bestimmt.

Der Nettoinventarwert, der Nettoinventarwert je Klasse und der Nettoinventarwert je Anteil werden für jeden Bewertungstag gemäß der Satzung und den nachstehend genannten Grundsätzen bestimmt, sofern die Verwaltungsgesellschaft nichts anderes festlegt:

1. Der Wert von Barmitteln, Krediten, Einlagen oder abrufbaren Guthaben, Wechseln, Sichtschecks, vertraglichen Schuldversprechen, Forderungen, Rechnungsabgrenzungsposten, Bardividenden und angekündigten oder aufgelaufenen und noch nicht vereinnahmten Zinsen wird in voller Höhe - zuzüglich etwaiger aufgelaufener Zinsen - angerechnet, es sei denn, die Verwaltungsgesellschaft hat festgelegt, dass derartige Positionen nicht den vollen Betrag wert sind und die Verwaltungsgesellschaft hat einen angemessenen Abzug festgelegt, durch den der wahre Wert des Vermögenswerts reflektiert wird. In diesen Fällen wird der Wert angesetzt, den die Verwaltungsgesellschaft für den vertretbaren Wert hält.

2. a. Außer im Fall von Rechten an einem verwalteten Sondervermögen, auf das Absatz 3 anwendbar ist, und vorbehaltlich der nachstehenden Absätze 4 und 5 erfolgen alle Berechnungen, die auf dem Wert von Anlagen basieren, die an einer Börse, einer Warenterminbörse, einer Terminbörse oder einem OTC-Markt quotiert, notiert oder gehandelt werden, unter Verwendung des letzten Schlusskurses - oder, falls es keinen Schlusskurs gibt, des letzten verfügbaren Geldkurses - an der Hauptbörse für diese Anlagen zum Geschäftsschluss an diesem Ort an dem Tag, für den diese Berechnung vorzunehmen ist. Bei der Bewertung von Schuldtiteln müssen möglicherweise Stückzinsen hinzugerechnet werden.

b. Gibt es eine solche Börse, Warenterminbörse, Terminbörse oder einen solchen OTC-Markt nicht, sind bei allen Berechnungen, die auf dem Wert von Anlagen basieren, für die eine Person, ein Unternehmen oder ein Institut, die bzw. das den Markt für diese Anlage stellt (und falls es mehr als einen derartigen Marktmacher gibt, dann von demjenigen Marktmacher, den die Verwaltungsgesellschaft bestimmt), Quotierungen anbietet, die letzten dort quotierten Geldkurse zu verwenden. Dies gilt jeweils mit der Maßgabe, dass die an einer anderen Börse als der Hauptbörse geltenden Preise zu verwenden sind, wenn die Verwaltungsgesellschaft diese unter den gegebenen Umständen für ein faireres Kriterium für den Wert einer solchen Anlage hält.

c. Derivatekontrakte, die an einer Börse, einer Warenterminbörse, einer Terminbörse oder außerbörslich gehandelt werden, werden zum Regulierungspreis bewertet, der durch den Markt festgestellt wird, an dem das Derivat gehandelt wird. Ist der Marktpreis nicht verfügbar, kann der Derivatekontrakt gemäß vorstehendem Buchst. b bewertet werden. Derivatekontrakte, die nicht an vorstehend genannten Börsen oder Märkten gehandelt und nicht von einer Clearing-Gegenpartei gecleart werden, werden auf der Basis des Mark-to-Market-Wertes des Derivatekontrakts bewertet. Falls die Marktbedingungen keine Marktbewertung zulassen, kann ein zuverlässiges und konservatives Mark-to-Model-Verfahren verwendet werden. Derivatekontrakte, die zwar nicht an vorstehend genannten Börsen oder Märkten gehandelt, aber von einer Clearing-Gegenpartei gecleart werden, werden auf Basis einer Quotierung bewertet, die von der maßgeblichen Gegenpartei mindestens täglich zur Verfügung gestellt und von einer von dieser Gegenpartei unabhängigen Partei oder einer anderen unabhängigen Partei, die für diesen Zweck von der Verwaltungsgesellschaft genehmigt wurde, mindestens wöchentlich bestätigt wird. Alternativ kann ein Derivatekontrakt, der zwar nicht an einem regulierten Markt gehandelt, aber von einer Clearing-Gegenpartei gecleart wird, anhand einer alternativen Bewertung bewertet werden. Etwaige alternative Bewertungen entsprechen den internationalen Best-Practice-Grundsätzen und den Grundsätzen für die Bewertung von OTC-Instrumenten, die von Organisationen wie dem IOSCO und der AIMA entworfen wurden. Die alternative Bewertung wird von einer sachkundigen Person zur Verfügung gestellt, die von der Verwaltungsgesellschaft oder ihren Vertretern ausgewählt wird, oder anhand anderer Methoden ermittelt, unter der Voraussetzung, dass monatlich ein vollumfänglicher Abgleich der alternativen Bewertung mit der Bewertung der Gegenpartei erfolgt. Jeder erhebliche Unterschied zwischen der alternativen Bewertung und der Gegenpartei-Bewertung wird unverzüglich untersucht und erläutert.

d. Devisentermingeschäfte werden entweder anhand derselben Methode wie Derivatekontrakte, die nicht in einem geregelten Markt gehandelt werden, bewertet oder durch Verwendung des geltenden Kurses, zu dem ein neuer Forward-Kontrakt derselben Größe und Fälligkeit am Bewertungstag geschlossen werden könnte.

3. Im Fall eines Teilfonds, bei dem es sich um einen Geldmarktfonds handelt, kann die Gesellschaft das Vermögen eines Teilfonds anhand der fortgeführten Anschaffungskosten bewerten, falls die Verwendung dieser Bewertungsmethode zulässig ist und vorbehaltlich der Anforderungen der FMA. Ist beabsichtigt, Anlagen nach der Methode der fortgeführten Anschaffungskosten gemäß Nummern zu bewerten, wo wird dies in Anhang A angegeben.

4. Vorbehaltlich der Absätze 3, 4 und 5 entspricht der Wert eines Anteils an einer offenen Treuhänderschaft, einer offenen Kapitalgesellschaft, einer offenen Investmentgesellschaft oder einem ähnlichen offenen Vehikel (ein verwaltetes Sondervermögen) dem letzten für den maßgeblichen Bewertungstag oder einen möglichst nah gelegenen Tag (gegebenenfalls) veröffentlichten Nettoinventarwert je Anteil, Aktie oder sonstiger Beteiligung an diesem verwalteten Sondervermögen oder, falls dieser nicht verfügbar ist, dem geschätzten Nettoinventarwert zum maßgeblichen Bewertungstag oder einem möglichst nah gelegenen Zeitpunkt.

5. Sind weder Nettoinventarwert noch die in Absätzen 2, 3 oder 4 dargelegten Geld- oder Briefkurse oder Kursquotierungen verfügbar, bestimmt sich der Wert des betreffenden Vermögenswerts jeweils auf die Art und Weise, die die Verwaltungsgesellschaft festlegt (einschließlich unter anderem anhand von Preisbildungsmodellen zur Bestimmung des fairen Wertes).

6. Unbeschadet des vorstehend Gesagten kann die Verwaltungsgesellschaft die Verwendung einer anderen Bewertungsmethode verlangen, wenn sie der Ansicht ist, dass eine solche Bewertung einen beizulegenden Zeitwert besser widerspiegelt.

7. Jeder Wert (gleich ob der eines Wertpapiers oder von Bargeld), der nicht in der Basiswährung oder der Währung der Klasse ausgedrückt ist, wird gegebenenfalls zum anwendbaren Wechselkurs in die Basiswährung oder die Währung der Klasse umgerechnet.

8. Der Wert aufgelaufener Schulden, Verbindlichkeiten und Verpflichtungen (einschließlich aufgelaufener Vermögensverwaltungsgebühren, Anreizzahlungen und Honorare für professionelle Leistungen), Kreditoren- und

Eventualverbindlichkeiten, für die Rückstellungen gebildet werden, wird zum vollen Betrag angesetzt, es sei denn, die Verwaltungsgesellschaft trifft andere Bestimmungen.

#### *Swinging Single Pricing*

Der OGAW oder die im Namen des OGAW handelnde Verwaltungsgesellschaft kann für jeden Teilfonds die Anwendung eines SSP-Mechanismus festlegen, um der Verwässerung der Performance zu begegnen, die entsteht, wenn ein Fonds hohe Zu- und Abflüsse verzeichnet, um sicherzustellen, dass langfristige Anteilhaber keine wesentlichen Nachteile durch die negativen Folgen von Rücknahmen und Zeichnungen erleiden.

Der SSP-Mechanismus basiert auf einem einzigen Nettoinventarwert je Anteil für Zeichnungen und Rücknahmen, der im Falle von Nettozu- oder -abflüssen nach oben bzw. nach unten angepasst wird, um Transaktionskosten, Provisionen, Steuern, Spreads und sonstige Kosten, die einem Teilfonds aufgrund von Cashflows entstanden sind, zu berücksichtigen. Hierdurch werden die genannten Kosten von den zeichnenden und den zurückgebenden Anteilhabern getragen. Das Anpassungsfaktor (der «Swing-Faktor») wird üblicherweise angewendet, wenn die Nettozu- oder -abflüsse eine bestimmte Grenze (der «Swing-Schwellenwert») übersteigen. In Anhang A des Prospektes wird angegeben, ob für einen bestimmten Teilfonds eine SSP-Politik angewendet wird und gegebenenfalls werden der höchstmögliche Swing-Faktor sowie der Swing-Schwellenwert festgelegt.

#### *Aussetzung der Bestimmung des Nettoinventarwertes*

Der OGAW oder die im Namen des OGAW handelnde Verwaltungsgesellschaft kann für jeden Teilfonds die Bestimmung des Nettoinventarwertes, des Nettoinventarwertes je Klasse und/oder des Nettoinventarwertes je Anteil aussetzen, wenn der OGAW oder die im Namen des OGAW handelnde Verwaltungsgesellschaft der Ansicht ist, dass diese Aussetzung im Interesse der Anteilhaber, des OGAW und/oder eines Teilfonds ist. Die Aussetzung ist unter anderem unter folgenden Umständen möglich:

1. Falls eine Hauptbörse, eine Commodity-Börse, eine Terminbörse oder ein OTC-Markt, an der bzw. dem ein wesentlicher Teil der Vermögenswerte des Teilfonds notiert, quotiert oder gehandelt wird, geschlossen ist (außer der Schließung an normalen Wochenenden und Feiertagen) oder der Handel erheblich eingeschränkt oder ausgesetzt ist oder
2. falls für einen wesentlichen Teil der Vermögenswerte oder Verbindlichkeiten des Teilfonds vertretbare Bewertungen nicht rechtzeitig zur Verfügung stehen oder
3. wenn Umstände vorliegen, infolge derer es billigerweise nicht möglich ist, den Nettoinventarwert, den Nettoinventarwert je Klasse oder den Nettoinventarwert je Anteil hinreichend genau und zeitnah zu bestimmen oder
4. infolge von Devisenverkehrsbeschränkungen oder sonstigen Einschränkungen, die sich auf die Übertragung von finanziellen Mitteln auswirken, oder wenn Transaktionen des Teilfonds nicht möglich sind oder wenn Käufe und Verkäufe der Anlagen des Teilfonds nicht zu normalen Wechselkursen getätigt werden können oder
5. falls eine Entscheidung über die Liquidierung und Abwicklung des Teilfonds getroffen wurde.

#### **Umrechnungskurse per 30.11.2019**

ARS	1.00	=	CHF	0.0167	AUD	1.00	=	CHF	0.6760
BRL	1.00	=	CHF	0.2363	CAD	1.00	=	CHF	0.7525
CLP	1.00	=	CHF	0.0012	CNY	1.00	=	CHF	0.1422
COP	100.00	=	CHF	0.0284	CZK	1.00	=	CHF	0.0431
DKK	1.00	=	CHF	0.1475	EUR	1.00	=	CHF	1.1019
GBP	1.00	=	CHF	1.2925	HKD	1.00	=	CHF	0.1277

HUF	1.00	=	CHF	0.0033	JPY	100.00	=	CHF	0.9128
MXN	1.00	=	CHF	0.0512	NOK	1.00	=	CHF	0.1085
NZD	1.00	=	CHF	0.6416	PEN	1.00	=	CHF	0.2940
PLN	1.00	=	CHF	0.2555	RUB	1.00	=	CHF	0.0155
SEK	1.00	=	CHF	0.1044	SGD	1.00	=	CHF	0.7309
THB	1.00	=	CHF	0.0331	TRY	1.00	=	CHF	0.1741
TWD	1.00	=	CHF	0.0327	USD	1.00	=	CHF	0.9994
ZAR	1.00	=	CHF	0.0682					

## Effektive Gebühren und Total Expense Ratio (TER)

Name	Management Fee in %	Operations Fee in %	TER 1 in %	TER 2 in %
LGT GIM Balanced (USD) B	1.30	0.30	1.91	1.91
LGT GIM Balanced (CHF) B	1.30	0.30	1.91	1.91
LGT GIM Balanced (EUR) B	1.30	0.30	1.92	1.92
LGT GIM Balanced (USD) B1	1.30	0.30	1.91	1.91
LGT GIM Balanced (USD) IM	0.00	0.12	0.47	0.47
LGT GIM Balanced (CHF) IM	0.00	0.12	0.47	0.47
LGT GIM Growth (USD) B	1.50	0.30	2.18	2.18
LGT GIM Growth (CHF) B	1.50	0.30	2.18	2.18
LGT GIM Growth (CZK) B	1.50	0.30	2.18	2.18
LGT GIM Growth (EUR) B	1.50	0.30	2.18	2.18
LGT GIM Growth (USD) IM	0.00	0.12	0.54	0.54
LGT GIM Growth (CHF) IM	0.00	0.12	0.54	0.54
LGT Alpha Indexing Fund (CHF) B	0.90	0.30	1.53	1.53
LGT Alpha Indexing Fund (EUR) B	0.90	0.30	1.53	1.53
LGT Alpha Indexing Fund (USD) B	0.90	0.30	1.53	1.53
LGT Alpha Indexing Fund (CHF) I1	0.45	0.15	0.96	0.96
LGT Alpha Indexing Fund (EUR) I1	0.45	0.15	0.96	0.96
LGT Alpha Indexing Fund (CHF) C	0.45	0.30	1.08	1.08
LGT Alpha Indexing Fund (CHF) IM	0.00	0.12	0.48	0.48
LGT Sustainable Fixed Income Global Opportunities (EUR) B	1.00	0.30	1.40	1.40
LGT Sustainable Fixed Income Global Opportunities (CHF) B	1.00	0.30	1.40	1.40
LGT Sustainable Fixed Income Global Opportunities (USD) B	1.00	0.30	1.40	1.40
LGT Sustainable Fixed Income Global Opportunities (EUR) I1	0.45	0.15	0.73	0.73
LGT Sustainable Fixed Income Global Opportunities (EUR) C	0.45	0.30	0.85	0.85
LGT Sustainable Fixed Income Global Opportunities (CHF) C	0.45	0.30	0.85	0.85
LGT Sustainable Fixed Income Global Opportunities (EUR) IM	0.00	0.12	0.26	0.26
LGT Sustainable Strategy 3 Years (EUR) B	1.30	0.30	1.68	1.68
LGT Sustainable Strategy 3 Years (CHF) B	1.30	0.30	1.68	1.68
LGT Sustainable Strategy 3 Years (USD) B	1.30	0.30	1.68	1.68
LGT Sustainable Strategy 3 Years (EUR) I1	0.60	0.15	0.86	0.86
LGT Sustainable Strategy 3 Years (CHF) I1	0.60	0.15	0.86	0.86
LGT Sustainable Strategy 3 Years (EUR) C	0.60	0.30	0.98	0.98
LGT Sustainable Strategy 3 Years (EUR) IM	0.00	0.12	0.24	0.24
LGT Sustainable Strategy 4 Years (EUR) B	1.40	0.30	1.81	1.81
LGT Sustainable Strategy 4 Years (CHF) B	1.40	0.30	1.81	1.81
LGT Sustainable Strategy 4 Years (USD) B	1.40	0.30	1.81	1.81
LGT Sustainable Strategy 4 Years (EUR) C	0.65	0.30	1.06	1.06

<b>Name</b>	<b>Management Fee in %</b>	<b>Operations Fee in %</b>	<b>TER 1 in %</b>	<b>TER 2 in %</b>
LGT Sustainable Strategy 4 Years (CHF) C	0.65	0.30	1.06	1.06
LGT Sustainable Strategy 4 Years (EUR) IM	0.00	0.12	0.27	0.27
LGT Sustainable Strategy 5 Years (EUR) B	1.50	0.30	1.96	1.96
LGT Sustainable Strategy 5 Years (CHF) B	1.50	0.30	1.96	1.96
LGT Sustainable Strategy 5 Years (USD) B	1.50	0.30	1.96	1.96
LGT Sustainable Strategy 5 Years (EUR) I1	0.70	0.15	1.04	1.04
LGT Sustainable Strategy 5 Years (EUR) IM	0.00	0.12	0.31	0.31

Die bei der Verwaltung der Teilfonds angefallenen Kommissionen und Kosten sind in der international unter dem Begriff «Total Expense Ratio (TER)» bekannten Kennziffer enthalten. Diese Kennziffer drückt die Gesamtheit derjenigen Kommissionen und Kosten, die laufend dem Teilfondsvermögen belastet werden (Betriebsaufwand), retrospektiv in einem Prozentsatz des Teilfondsvermögens aus.

Die Berechnung der TER erfolgt anhand der Berechnungsmethode der «Ongoing Charges» gem. CESR-Guideline unter Berücksichtigung der TER von Investments in Zielfonds, wenn der vorliegende Fonds substantiell auch in Zielfonds investiert ist. Sofern eine performanceabhängige Vergütung («Performance Fee») im Berichtszeitraum zur Anwendung gelangte, wird auch diese gesondert als prozentualer Anteil des durchschnittlichen Nettovermögens ausgewiesen. In diesem Fall wird zusätzlich zur TER1 auch die TER2 ausgewiesen, welche der Summe der TER1 sowie des prozentualen Anteils der Performance Fee entspricht.

### **Transaktionskosten**

Die Teilfonds tragen sämtliche aus der Verwaltung des Vermögens erwachsenden Nebenkosten für den An- und Verkauf der Anlagen (marktkonforme Courtagen, Kommissionen, Abgaben), wobei die Transaktionskosten der Verwahrstelle (exkl. Währungsabsicherungskosten) in den Verwaltungskosten (Operations Fee) enthalten sind, sowie alle Steuern, die auf das Vermögen des Teilfonds sowie dessen Erträge und Aufwendungen erhoben werden (z.B. Quellensteuern auf ausländischen Erträgen). Die Transaktionskosten entsprechen rund 20% der Verwaltungskosten. Die Teilfonds tragen ferner nachstehende externe Kosten, d.h. Gebühren von Dritten, die beim An- und Verkauf der Anlagen anfallen. Diese Kosten werden direkt mit dem Einstands- bzw. Verkaufswert der betreffenden Anlagen verrechnet.

<b>Name</b>	<b>Währung</b>	<b>Betrag</b>
LGT GIM Balanced	USD	8'386.01
LGT GIM Growth	USD	12'025.07
LGT Alpha Indexing Fund	CHF	17'934.64
LGT Sustainable Fixed Income Global Opportunities	EUR	6'815.10
LGT Sustainable Strategy 3 Years	EUR	85'154.70
LGT Sustainable Strategy 4 Years	EUR	47'914.21
LGT Sustainable Strategy 5 Years	EUR	17'259.47

### **Wertschriftenleihe (Securities Lending)**

Sofern dies in Anhang A des Prospektes für den maßgeblichen Teilfonds geregelt ist, kann der OGAW oder die Verwaltungsgesellschaft ausschließlich zum Zweck des effizienten Portfoliomanagements zur Verbesserung seiner Erträge alle oder einen Teil der von einem Teilfonds gehaltenen Wertpapiere an Dritte verleihen.

Im Allgemeinen dürfen Wertpapierleihgeschäfte nur über anerkannte Clearingorganisationen, wie Clearstream International oder Euroclear, sowie über erstrangige Banken, Wertpapierfirmen, Finanzdienstleistungsinstitute, oder Versicherungsunternehmen, welche auf die Wertpapierleihe spezialisiert sind, innerhalb deren festgesetzten Rahmenbedingungen erfolgen. Bei einem Wertpapierleihgeschäft muss der OGAW oder die Verwaltungsgesellschaft im Namen des OGAW



grundsätzlich Sicherheiten erhalten, deren Wert mindestens der Gesamtbewertung der verliehenen Wertpapiere und den eventuell aufgelaufenen Zinsen entspricht. Derartige Sicherheiten sind in Form einer zulässigen finanziellen Sicherheit zu stellen. Sie sind nicht erforderlich, falls die Wertpapierleihe über Clearstream International oder Euroclear oder irgendeine entsprechende Organisation erfolgt, der dem OGAW oder der im Namen des OGAW handelnden Verwaltungsgesellschaft die Erstattung des Wertes der verliehenen Wertpapiere zusichert. Bei der Einhaltung der Anlagevorschriften sind die verliehenen Wertpapiere konsequent zu berücksichtigen.

Die Verwahrstelle darf bis maximal 50 % der Erträge aus der Wertpapierleihe zur Deckung ihrer direkten und indirekten Kosten einbehalten.

In Verbindung mit Anlagen, die Gegenstand von Wertpapierleiheverträgen sind, erhält die Verwaltungsgesellschaft keine Erstattung von Quellensteuern.

### Derivatdeckung

Derivate werden gemäss Modified Commitment Ansatz eingesetzt. Die entsprechenden Limiten wurden per 30. November 2019 eingehalten und weisen folgende Werte auf:

Name	Derivat- risiko in % des NAV	Gesamt- risiko in % des NAV
LGT GIM Balanced	5.97	102.88
LGT GIM Growth	6.64	103.00
LGT Alpha Indexing Fund	5.80	105.57
LGT Sustainable Strategy 3 Years	7.37	106.48
LGT Sustainable Strategy 4 Years	9.41	109.05
LGT Sustainable Strategy 5 Years	10.70	110.32

### Value-at-Risk

Beim LGT Sustainable Fixed Income Global Opportunities wurde das Gesamtrisiko durch einen Modellansatz ermittelt, der alle allgemeinen und spezifischen Marktrisiken berücksichtigt, die zu einer nicht zu vernachlässigenden Änderung des Portfoliowerts führen können (Value-at-Risk-Ansatz). Die Berechnung des «Value at Risk» (VaR) erfolgt auf Basis eines Konfidenzintervalls von 99%. Die Halteperiode entspricht zum Zwecke der Berechnung des Gesamtrisikos einem Monat (20 Tage). Die Daten betreffen den Zeitraum vom 1. Juni 2019 bis 30. November 2019.

Value-at-Risk	LGT Sustainable Fixed Income Global Opportunities
Art des VaR-Ansatzes	Absolute VaR
VaR Limit in %	20.00
Auslastung des VaR Limits in %	
Tiefstwert	5.30
Höchstwert	11.90
Durchschnitt	8.30
Simulations-Modell	Historical Simulation
Referenzportfolio	n.a.
Durchschnittliche Höhe der Hebelwirkung in %	65.32

### Verwendung des Erfolges

Derzeit sind keine Ausschüttungen vorgesehen. Die erwirtschafteten Gewinne der Teilfonds und/oder Anteilklassen werden thesauriert.

## Erstmission

Name	Datum
LGT GIM Balanced	31.01.2010
LGT GIM Growth	31.01.2010
LGT Alpha Indexing Fund	30.04.2009
LGT Sustainable Fixed Income Global Opportunities	10.11.1999
LGT Sustainable Strategy 3 Years	10.11.1999
LGT Sustainable Strategy 4 Years	10.11.1999
LGT Sustainable Strategy 5 Years	10.11.1999

## Kapital und weitere Angaben zur Investmentgesellschaft

Das Grundkapital des OGAW beträgt CHF 50'000 und ist unterteilt in 50 auf den Namen lautende Gründeraktien mit einem Nominalwert von CHF 1'000 je Aktie.

Sämtliche Dienstleistungen im Zusammenhang mit der Investmentgesellschaft werden von Gesellschaften der LGT Gruppe erbracht. Die Investmentgesellschaft beschäftigt aus diesem Grund nicht direkt eigenes Personal und leistet keine Vergütungen an die Geschäftsleitung.

Beim Mutterunternehmen handelt es sich um die LGT Gruppe Holding AG, Herrengasse 12, 9490 Vaduz. Eine konsolidierte Jahresrechnung kann an oben genannter Adresse oder unter [www.lgt.com](http://www.lgt.com) bezogen werden.

### Angaben zur Vergütungspolitik

Der Verwaltungsrat der LGT Capital Partners (FL) AG (die «Gesellschaft») hat ein Vergütungsreglement verabschiedet, um eine Vergütungspolitik sicherzustellen, die den für OGAW-Manager geltenden gesetzlichen Anforderungen entspricht. Das Vergütungsreglement soll verhindern, dass übermässige Risiken eingegangen werden, und geeignete Massnahmen erhalten, um Interessenskonflikte zu vermeiden und eine nachhaltige Vergütungspolitik zu erreichen.

Informationen über die Vergütungspolitik und -praxis der Gesellschaft sind im Internet unter [www.lgt.com](http://www.lgt.com) (Publikationen ; Regulatory) veröffentlicht. Diese Informationen umfassen eine Beschreibung sowohl der Berechnungsmethode als auch der Zurückbehaltungspolitik in Bezug auf die Vergütung bestimmten Mitarbeitenden, der so genannten «identifizierten Mitarbeitenden», und der für die Genehmigung der Vergütung verantwortlichen Personen oder Stellen.

Die Gesamtzahl der identifizierten Mitarbeitenden, die zum 30. November 2019 bei der Gesellschaft beschäftigt waren, betrug vier. Einer von ihnen gilt als Risikoträger und drei von ihnen sind für bestimmte Kontrollfunktionen verantwortlich. Die identifizierten Mitarbeitenden sind verantwortlich für alle Anlagefonds der Gesellschaft, deren Gesamtvermögen per 30. November 2019 rund CHF 29.1 Milliarden beträgt.

## Hinterlegungsstellen

<i>LGT GIM Balanced</i>	<i>LGT GIM Growth</i>
BNP Paribas Fund Administration Services (Ireland) Ltd., Dublin	BNP Paribas Fund Administration Services (Ireland) Ltd., Dublin
LGT Bank Ltd., Vaduz	LGT Bank Ltd., Vaduz
M M Warburg Luxembourg SA, Luxembourg	M M Warburg Luxembourg SA, Luxembourg
RBC Investor Services Bank S.A., Dublin	RBC Investor Services Bank S.A., Dublin
RBC Investor Services Bank S.A., Zurich	RBC Investor Services Bank S.A., Zurich
SIX SIS AG, Zurich	SIX SIS AG, Zurich
UBS AG, Zurich	UBS AG, Zurich

*LGT Alpha Indexing Fund*

BNP Paribas Fund Administration Services (Ireland) Ltd., Dublin
International Fund Services & Asset Management S.A., Luxembourg
LGT Bank Ltd., Vaduz
M M Warburg Luxembourg SA, Luxembourg
RBC Investor Services Bank S.A., Dublin
RBC Investor Services Bank S.A., Zurich
SIX SIS AG, Zurich

*LGT Sustainable Fixed Income Global Opportunities*

DB Deutsche Bank AG, Frankfurt am Main
EC Euroclear Bank, Brussels
International Fund Services & Asset Management S.A., Luxembourg
RBC Investor Services Bank S.A., Dublin
UBS AG, Zurich
ZKB Zuercher Kantonalbank, Zurich

*LGT Sustainable Strategy 3 Years*

BNP Paribas Fund Administration Services (Ireland) Ltd., Dublin
Citibank NA, Singapore
DB Deutsche Bank AG, Frankfurt am Main
DB Deutsche Bank SAE, Barcelona
Deutsche Bank AG, Amsterdam
EC Euroclear Bank, Brussels
LGT Bank Ltd., Vaduz
M M Warburg Luxembourg SA, Luxembourg
MUFG Bank, Ltd., Tokyo
Nordea Bank AB, Stockholm
Nordea Bank Danmark AS, Copenhagen
RBC Investor Services Bank S.A., Dublin
RBC Investor Services Bank S.A., Zurich
SIX SIS AG, Zurich
Standard Chartered Bank (Hong Kong) Ltd., Hong Kong
UBS AG, Zurich
UBS Switzerland AG (H O), Zurich

*LGT Sustainable Strategy 4 Years*

BNP Paribas Fund Administration Services (Ireland) Ltd., Dublin
Citibank NA, Singapore
DB Deutsche Bank AG, Frankfurt am Main
DB Deutsche Bank SAE, Barcelona
Deutsche Bank AG, Amsterdam
EC Euroclear Bank, Brussels
LGT Bank Ltd., Vaduz
M M Warburg Luxembourg SA, Luxembourg
MUFG Bank, Ltd., Tokyo
Nordea Bank AB, Stockholm
Nordea Bank Danmark AS, Copenhagen
RBC Investor Services Bank S.A., Zurich
SIX SIS AG, Zurich
Standard Chartered Bank (Hong Kong) Ltd., Hong Kong
UBS AG, Zurich
UBS Switzerland AG (H O), Zurich

*LGT Sustainable Strategy 5 Years*

BNP Paribas Fund Administration Services (Ireland) Ltd., Dublin
Citibank NA, Singapore
DB Deutsche Bank AG, Frankfurt am Main
DB Deutsche Bank SAE, Barcelona
Deutsche Bank AG, Amsterdam
EC Euroclear Bank, Brussels
LGT Bank Ltd., Vaduz
M M Warburg Luxembourg SA, Luxembourg
MUFG Bank, Ltd., Tokyo
Nordea Bank AB, Stockholm
Nordea Bank Danmark AS, Copenhagen
RBC Investor Services Bank S.A., Zurich
SIX SIS AG, Zurich
Standard Chartered Bank (Hong Kong) Ltd., Hong Kong
UBS AG, Zurich
UBS Switzerland AG (H O), Zurich

## Anhang: Verordnung über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften und der Weiterverwendung (SFTR) (ungeprüft)

Verordnung (EU) 2015/2365 des europäischen Parlaments und des Rates vom 25. November 2015 über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften und der Weiterverwendung sowie zur Änderung der Verordnung (EU) N 648/2012

### Allgemeine Angaben (Securities Lending)

Umbrella	Währung	Sicherheiten	Gesamt- bewertung	Netto- vermögens- werte	(%) der Vermögenswerte
LGT Multi-Assets SICAV	CHF	40'573'688.05	39'125'605.30	1'401'184'458.23	2.79

Umbrella	Währung	Gesamtbewertung	Investment- Portfolio Marktwert	(%) der verleihbaren Vermögenswerte
LGT Multi-Assets SICAV	CHF	39'125'605.30	338'159'895.23	11.57

### Angaben zur Konzentration

Umbrella	Die zehn wichtigsten Emittenten	Währung	Höhe der Sicherheiten
LGT Multi-Assets SICAV	Roche Kapitalmarkt AG	CHF	4'229'683.01
	Luzerner Kantonalbank AG	CHF	2'642'000.54
	Graubündner Kantonalbank	CHF	2'059'821.71
	Novartis AG	CHF	1'953'909.68
	Deutsche Bahn Finance GmbH	CHF	1'868'505.53
	Canton of Geneva	CHF	1'853'701.58
	Schweizerische Eidgenossenschaft	CHF	1'787'800.00
	Shell International Finance B.	CHF	1'534'842.51
	Basler Kantonalbank	CHF	1'200'820.75
	Republique et canton de Genève	CHF	1'199'345.33

Umbrella	Die zehn wichtigsten Gegenparteien	Währung	Gesamtbewertung
LGT Multi-Assets SICAV	Zürcher Kantonalbank, Zürich	CHF	23'021'080.80
	Credit Suisse (Schweiz) AG, Zürich	CHF	16'104'524.51
	n/a	CHF	n/a
	n/a	CHF	n/a
	n/a	CHF	n/a
	n/a	CHF	n/a
	n/a	CHF	n/a
	n/a	CHF	n/a
	n/a	CHF	n/a
	n/a	CHF	n/a

**Aggregierte Transaktionsdaten für jede Einzelart von Wertpapierfinanzierungsgeschäften, getrennt aufgeschlüsselt nach den folgenden Kategorien**

<b>Umbrella</b>	<b>Art und Qualität der Sicherheiten</b>	<b>Währung</b>	<b>Höhe der Sicherheiten</b>
LGT Multi-Assets SICAV	Obligationen	CHF	27'168'565.95
	Aktien	CHF	2'819'718.07
	Geldmarktinstrumente	CHF	10'585'404.04
	unbekannt	CHF	0.00
	<b>Total</b>	<b>CHF</b>	<b>40'573'688.05</b>
	Hochgradige Sicherheiten	CHF	40'573'688.05

<b>Umbrella</b>	<b>Laufzeit der Sicherheiten</b>	<b>Währung</b>	<b>Höhe der Sicherheiten</b>
LGT Multi-Assets SICAV	unter einem Tag	CHF	0.00
	ein Tag bis eine Woche	CHF	0.00
	eine Woche bis ein Monat	CHF	0.00
	ein bis drei Monate	CHF	711'035.48
	drei Monate bis ein Jahr	CHF	1'330'403.80
	über ein Jahr	CHF	35'712'530.71
	unbefristet	CHF	2'819'718.07
	<b>Total</b>	<b>CHF</b>	<b>40'573'688.05</b>

<b>Umbrella</b>	<b>Währung der Barsicherheiten</b>	<b>Höhe der Sicherheiten</b>
LGT Multi-Assets SICAV	n/a	n/a

<b>Umbrella</b>	<b>Währung der Wertpapiersicherheiten</b>	<b>Höhe der Sicherheiten</b>
LGT Multi-Assets SICAV	CHF	28'935'763.67
	EUR	9'362'805.16
	GBP	1'849'154.01
	USD	425'965.22
	<b>Total</b>	<b>CHF 40'573'688.05</b>

<b>Umbrella</b>	<b>Laufzeit der Wertpapierfinanzierungsgeschäfte</b>	<b>Währung</b>	<b>Gesamtbewertung</b>
LGT Multi-Assets SICAV	unter einem Tag	CHF	0.00
	ein Tag bis eine Woche	CHF	0.00
	eine Woche bis ein Monat	CHF	0.00
	ein bis drei Monate	CHF	0.00
	drei Monate bis ein Jahr	CHF	0.00
	über ein Jahr	CHF	0.00
	unbefristet	CHF	39'125'605.30
	<b>Total</b>	<b>CHF</b>	<b>39'125'605.30</b>

<b>Umbrella</b>	<b>Länder, in dem die Gegenparteien niedergelassen sind</b>	<b>Währung</b>	<b>Gesamtbewertung</b>
LGT Multi-Assets SICAV	Schweiz	CHF	39'125'605.30
	<b>Total</b>	<b>CHF</b>	<b>39'125'605.30</b>

Umbrella	Abwicklung und Clearing	Währung	Gesamtbewertung
LGT Multi-Assets SICAV	bilateral	CHF	39'125'605.30
	trilateral	CHF	0.00

#### Angaben zur Weiterverwendung von Sicherheiten

Umbrella	Weiterverwendung von Sicherheiten	Währung	Höhe der Sicherheiten
LGT Multi-Assets SICAV	Anteil der erhaltenen Sicherheiten, die weiterverwendet werden	CHF	n/a
	Rendite des Organismus für gemeinsame Anlagen aus der Wiederanlage von Barsicherheiten	CHF	n/a

#### Verwahrung von Sicherheiten, die der Organismus für gemeinsame Anlagen im Rahmen von Wertpapierfinanzierungsgeschäften erhalten hat

Umbrella	Name des Verwahrers	Währung	Betrag der als Sicherheit verwahrten Vermögenswerte
LGT Multi-Assets SICAV	Euroclear	CHF	40'573'688.05

#### Verwahrung von Sicherheiten, die vom Organismus für gemeinsame Anlagen im Rahmen von Wertpapierfinanzierungsgeschäften gewährt wurden

Umbrella	Art des Konto
LGT Multi-Assets SICAV	n/a

#### Angaben zu Rendite und Kosten der einzelnen Arten von Wertpapierfinanzierungsgeschäften in CHF

Teilfonds	Währung	Brutto-einkünfte	LGT Einkünfte	Ein-behaltene Steuer	Einkünfte der Verwaltungsgesellschaft	Kunden Einkünfte (nach Steuern)
LGT Sustainable Fixed Income Global Opportunities	CHF	1'423.20	569.28	0.00	0.00	853.92
LGT Sustainable Strategy 3 Years	CHF	617.30	246.92	0.00	0.00	370.38
LGT Sustainable Strategy 4 Years	CHF	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
LGT Sustainable Strategy 5 Years	CHF	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
<b>Total</b>	<b>CHF</b>	<b>2'040.50</b>	<b>816.20</b>	<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	<b>1'224.30</b>

#### Angaben zu Rendite und Kosten der einzelnen Arten von Wertpapierfinanzierungsgeschäften in EUR

Teilfonds	Währung	Brutto-einkünfte	LGT Einkünfte	Ein-behaltene Steuer	Einkünfte der Verwaltungsgesellschaft	Kunden Einkünfte (nach Steuern)
LGT Sustainable Fixed Income Global Opportunities	EUR	3'537.23	1'414.89	0.00	0.00	2'122.34
LGT Sustainable Strategy 3 Years	EUR	22'483.80	8'993.52	0.00	0.00	13'490.28
LGT Sustainable Strategy 4 Years	EUR	12'297.12	4'918.85	0.00	0.00	7'378.27
LGT Sustainable Strategy 5 Years	EUR	4'128.13	1'651.25	0.00	0.00	2'476.88
<b>Total</b>	<b>EUR</b>	<b>42'446.28</b>	<b>16'978.51</b>	<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	<b>25'467.77</b>

**Angaben zu Rendite und Kosten der einzelnen Arten von Wertpapierfinanzierungsgeschäften in USD**

<b>Teilfonds</b>	<b>Währung</b>	<b>Brutto- einkünfte</b>	<b>LGT Einkünfte</b>	<b>Ein- behaltene Steuer</b>	<b>Einkünfte der Verwaltungsgesellschaft</b>	<b>Kunden Einkünfte (nach Steuern)</b>
LGT Sustainable Fixed Income Global Opportunities	USD	6'818.32	2'727.33	0.00	0.00	4'090.99
LGT Sustainable Strategy 3 Years	USD	3'286.52	1'314.61	0.00	0.00	1'971.91
LGT Sustainable Strategy 4 Years	USD	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
LGT Sustainable Strategy 5 Years	USD	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
<b>Total</b>	<b>USD</b>	<b>10'104.83</b>	<b>4'041.93</b>	<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	<b>6'062.90</b>



**LGT Capital Partners (FL) AG**

Herrengasse 12, FL-9490 Vaduz  
Tel. +423 235 25 25, lgt.cp@lgt.com

**LGT Bank AG**

Herrengasse 12, FL-9490 Vaduz  
Tel. +423 235 11 22, info@lgt.com

[www.lgt.com](http://www.lgt.com)

