

SG HAUSSMANN EVO FUND WORLD

INVESTMENTFONDS – FCP (FONDS COMMUN DE PLACEMENT)

ABSCHLUSSSTICHTAG DES GESCHÄFTSJAHRES: 28.2.2025

Inhalt

Informationen zu Anlagen und Verwaltung	4
Verwaltungsbericht	14
Techniken zur effizienten Portfolioverwaltung und derivative Finanzinstrumente	20
Bericht des Abschlussprüfers	22
<u>JAHRESABSCHLUSS</u>	
Bilanz	27
Aktiva	27
Passiva	28
Gewinn- und Verlustrechnung	29
<u>ANHANG</u>	
Verwaltungsstrategie und -profil	32
Aufstellung der charakteristischen Elemente der letzten fünf Geschäftsjahre	33
Bilanzierungs- und Bewertungsmethoden	34
Entwicklung des Eigenkapitals im Geschäftsjahr	37
Entwicklung der Anzahl der Anteile oder Aktien im Geschäftsjahr	38
Aufschlüsselung des Nettovermögens nach Art der Anteile oder Aktien	39
Direkte und indirekte Engagements an den verschiedenen Märkten	40
Direktes Engagement am Aktienmarkt (ohne Wandelanleihen)	40
Engagement am Wandelanleihenmarkt nach Land und Restlaufzeit der Positionen	40
Direktes Engagement am Zinsmarkt (ohne Wandelanleihen)	41
Direktes Engagement am Zinsmarkt (ohne Wandelanleihen) Aufschlüsselung nach Restlaufzeit	42
Direktes Engagement am Devisenmarkt	43
Direktes Engagement an den Kreditmärkten	44
Engagement in Transaktionen, an denen eine Gegenpartei beteiligt ist	45
Indirekte Engagements für Multi-Manage-Fonds	46
Sonstige Angaben zur Bilanz und zur Gewinn- und Verlustrechnung	47
Forderungen und Verbindlichkeiten - Aufschlüsselung nach Art	47
Verwaltungsgebühren, sonstige Kosten und Gebühren	48
Erhaltene und geleistete Zusagen	50
Befristete Wertpapierkäufe	50
Instrumente verbundener Einheiten	51
Ermittlung und Aufschlüsselung der ausschüttungsfähigen Beträge	52
Verwendung der ausschüttungsfähigen Nettoerträge	52
Verwendung der ausschüttungsfähigen Nettogewinne/-verluste	53
Aufstellung der Aktiva und Passiva	54
Aufstellung der FTI (ohne zur Absicherung einer Anteilsklasse verwendete Finanztermininstrumente)	

	57
Aufstellung der Finanztermininstrumente (die zur Absicherung einer Anteilsklasse verwendet werden)	60
Aufstellung der Devisentermingeschäfte (die zur Absicherung einer Anteilsklasse verwendet werden)	60
Zusammenfassende Aufstellung	61
Jahresabschluss zum 29.2.2024	62

Vertriebsgesellschaft	SOCIETE GENERALE 29, boulevard Haussmann - 75009 Paris.
Verwaltungsgesellschaft	SG 29 HAUSSMANN 29, boulevard Haussmann - 75009 Paris.
Depotbank und Verwahrstelle	SOCIETE GENERALE SA 75886 Paris Cedex 18.
Zentralisierungsstelle	SOCIETE GENERALE 32, rue du Champ de Tir - 44000 Nantes.
Wirtschaftsprüfer	PRICEWATERHOUSECOOPERS AUDIT 63, rue de Villiers – 92200 Neuilly sur Seine Vertreten durch Raphaëlle Alezra Cabessa

Informationen zu Anlagen und Verwaltung

Modalitäten zur Ermittlung und Zuweisung der ausschüttungsfähigen Beträge:

Thesaurierender FCP. Bilanzierung nach der Methode der vereinnahmten Zinsen (*méthode des coupons encaissés*).

Garantie:

Garantiegeber: Société Générale

Die von der Société Générale gewährte Garantie zugunsten des FCP bezieht sich auf jeden Nettoinventarwert des FCP (die „garantierten Nettoinventarwerte“) am letzten Werktag jedes Monats (die „Garantiedaten“).

Jeder *garantierte Nettoinventarwert* des FCP wird grundsätzlich mindestens 80% des vorherigen *garantierten Nettoinventarwerts* entsprechen. Der erste *garantierte Nettoinventarwert* wird mindestens 80% des *ursprünglichen Nettoinventarwerts* entsprechen.

Unabhängig vom Zeichnungsdatum der Anteile kommen Anteilinhaber, die eine Rücknahme dieser Anteile an einem *Garantiedatum* beantragen, in den Genuss des *garantierten Nettoinventarwerts*.

Sollte das Nettovermögen des FCP an einem *Garantiedatum* zu niedrig sein und sein Nettoinventarwert somit nicht dem *garantierten Nettoinventarwert* entsprechen, zahlt die Société Générale den zur Erreichung des *garantierten Nettoinventarwerts* fehlenden Betrag an den FCP.

Außer an den *Garantiedaten* unterliegt der Nettoinventarwert der Marktentwicklung und kann somit unter dem *garantierten Nettoinventarwert* liegen.

Unabhängig vom Zeichnungsdatum ihrer Anteile kommen Anteilinhaber, die eine Rücknahme ihrer Anteile an einem anderen Datum als dem *Garantiedatum* beantragen, für diese Rücknahme nicht in den Genuss des *garantierten Nettoinventarwerts*.

Werktag: jeder Werktag im Sinne des französischen Arbeitsgesetzbuches (*Code du travail*) und jeder Tag, an dem die Pariser Börse geöffnet ist.

Anlageziel:

Der FCP ist ein aktiv verwalteter Investmentfonds (OGAW), dessen Anlagestrategie zwar von der Wertentwicklung der internationalen Aktienmärkte abhängt, er kann jedoch in erheblichem Maße von dieser Wertentwicklung abweichen.

Das Anlageziel des FCP besteht darin, in zwei Kategorien von Anlagen zu investieren: *riskante und risikolose Anlagen*. Hierzu setzt er eine von der Wertsicherungsstrategie der Portfolioversicherung abgeleitete Verwaltungstechnik ein (die im nachfolgenden Abschnitt „Anlagestrategie“ ausführlicher beschrieben ist).

Die riskanten Anlagen („*riskanten Anlagen*“) ermöglichen dem FCP eine Exposure in hochgradig diversifizierten Korb aus internationalen Aktien, die an den geregelten Märkten der Industrieländer notiert werden, ohne Beschränkung in Bezug auf die Marktkapitalisierung.

Die risikolosen Anlagen („*risikolosen Anlagen*“) ermöglichen dem FCP eine Exposure in Geldmarktinstrumenten und/oder Schuldtiteln, um den Anteilinhabern an jedem letzten *Werktag* jedes Monats einen Nettoinventarwert von mindestens 80% des am letzten *Werktag* des Vormonats festgestellten Nettoinventarwerts zu bieten.

Der am letzten *Werktag* des ersten Monats berechnete *Nettoinventarwert* ist in Höhe von 80% des *ursprünglichen Nettoinventarwerts* abgesichert.

Der FCP wurde für eine Dauer von 99 Jahren aufgelegt. Sollte er vorzeitig aufgelöst werden, muss das Auflösungsdatum einem *Garantiedatum* entsprechen.

Referenzindex:

Aufgrund seines Anlageziels und der verfolgten Anlagestrategie kann kein aussagekräftiger Referenzindex für diesen FCP angegeben werden.

Anlagestrategie:

Verfolgte Anlagestrategie

Die Managementtechnik, die während der Laufzeit des FCP jeden Monat zum Einsatz kommen wird, ist von der Methode der Portfolioversicherung abgeleitet: Diese Methode besteht in der regelmäßigen und systematischen Anpassung der Aufteilung der Exposure des Portfolios in *riskante Anlagen* und in *risikolose Anlagen*, wobei letztere die zugesagten Garantien und Schutzmechanismen gewährleisten.

Die bei jeder Anpassung berechnete Ziel-Exposure in *riskanten Anlagen* ergibt sich aus einer Berechnung, deren Hauptterm dem Produkt aus der Differenz zwischen dem Wert des FCP und dem Barwert der den Anlegern gewährten Garantie und einem variablen Koeffizienten entspricht, der sich nach dem Risiko der *riskanten Anlagen*, vor allem der historischen Volatilität richtet. Dieser Koeffizient liegt zwischen Null (0) und fünf (5).

Allerdings ist die angestrebte Exposure in *riskanten Anlagen* auf 100% des Nettovermögens des FCP begrenzt.

Die *Verwaltungsgesellschaft* kann jedoch jederzeit von diesem Ziel abweichen, wenn sie bestimmte Risiken oder besondere Situationen erkennt, die eine Erhöhung oder Reduzierung der Risikoengagements des FCP erfordern oder ermöglichen.

Verzeichnet der so verwaltete FCP seit dem Beginn jedes Monats eine positive Performance, wodurch der Wert des FCP vom Barwert der Garantie abweicht, wird das Ziel der maximalen Exposure in *riskanten Anlagen* beibehalten. Nähert sich im gegenteiligen Fall der Wert des FCP dem Barwert seiner Garantie an, wird die Exposure des FCP in *riskanten Anlagen* zur Erreichung dieser Garantie gesenkt.

Dank dieser Managementtechnik kommen die Anleger in den Genuss der Garantie und einer optimierten Allokation auf *riskante Anlagen*. Diese Technik kann jedoch keinen festen Partizipationsatz garantieren, und ihr Endergebnis hängt u.a. von der Wertentwicklung der *riskanten Anlagen* und der Zinsentwicklung ab.

Der FCP wird Engagements in zwei Kategorien von Anlagen aufbauen:

- die *risikolosen Anlagen* umfassen Geldmarktinstrumente und/oder Anleihen,
- die *riskanten Anlagen* umfassen internationale Aktien.

Die Exposure in *riskanten* und *risikolosen Anlagen* kann insbesondere durch den Kauf von internationalen Aktien, Schuldtiteln, Geldmarkt-, Renten- und Indexfonds, sonstigen zulässigen Vermögenswerten, Einlagen, Repo-Geschäfte sowie bedingte oder unbedingte Termingeschäften aufgebaut werden, die an geregelten Märkten (in Frankreich oder im Ausland) sowie außerbörslich abgeschlossen.

Die *riskanten Anlagen* weisen ein hohes Risikoniveau auf.

Die angestrebte Exposure in *riskanten Anlagen* ist auf 100% des Nettovermögens des FCP begrenzt.

Die *Verwaltungsgesellschaft* behält sich die Möglichkeit vor, den in *riskante Anlagen* investierten Teil bis auf 0% zu verringern, um die zugesagten Schutzmechanismen einzuhalten.

2. Bilanzielle Vermögenswerte (außer Finanzinstrumenten mit eingebetteten Derivaten)

Der FCP kann bis zu 100% seines Bruttovermögens in Aktien von Unternehmen mit mittlerer oder hoher Marktkapitalisierung aller Länder investieren, ohne Beschränkung auf bestimmte Sektoren oder geografische Regionen.

Der FCP kann bis zu 100% seines Bruttovermögens in Schuldtitel und Geldmarktinstrumente investieren, ohne Beschränkung auf bestimmte Laufzeiten oder Durationen:

- zwischen 0% und 100% des Bruttovermögens des FCP in Anleihen und andere Schuldtitel, die an den Märkten der OECD-Länder gehandelt werden und ein Kreditrating von mindestens BBB- auf der Ratingskala der Ratingagentur Standard & Poor's oder, andernfalls, ein gleichwertiges Rating einer anderen Ratingagentur (z.B. von Moody's oder Fitch) oder ein von der *Verwaltungsgesellschaft* als gleichwertig eingestuftes Rating aufweisen, wobei sich die *Verwaltungsgesellschaft* zur Bewertung der Kreditqualität der Anleihen auf externe Finanzratings und ihre eigene Analyse stützt;
- zwischen 0% und 100% des Bruttovermögens des FCP in Geldmarktinstrumente (einschließlich Anteilen von OGAW und Investmentfonds allgemeiner Ausrichtung (*Fonds d'investissement à Vocation Générale*, FIVG), die eine gleichwertige Rendite bieten).

Der FCP investiert insgesamt bis zu 100% seines Bruttovermögens in Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren französischen oder ausländischen Rechts, die im Einklang mit der Europäischen Richtlinie 2009/65/EG stehen („OGAW“), und insgesamt höchstens 30% seines Vermögens in alternative Investmentfonds französischen oder ausländischen Rechts, die im Einklang mit der Europäischen Richtlinie 2011/61/EG stehen („AIF“), sofern sie die in Artikel R. 214- 13 des französischen Währungs- und Finanzgesetzbuches (*Code Monétaire et Financier*) vorgesehenen vier Kriterien erfüllen.

Der FCP kann in Investmentfonds investieren, die von der *Verwaltungsgesellschaft* und/oder Einheiten der Société Générale-Gruppe verwaltet werden.

3. Außerbilanzielle Vermögenswerte (derivative Finanzinstrumente)

Zur Erreichung seines Anlageziels kann der FCP Transaktionen mit den folgenden derivativen Finanzinstrumenten durchführen.

- Art der Märkte, an denen der FCP investieren kann:

- geregelte Märkte
- organisierte Märkte
- OTC-Märkte

- **Risiken, die der FCP eingehen will:**

- Aktienrisiko
- Zinsrisiko
- Wechselkursrisiko
- Kreditrisiko

- Art der Transaktionen, wobei diese ausschließlich zur Erreichung des Anlageziels getätigt werden dürfen:

- Absicherung
- Exposure
- Arbitrage
- sonstige Art

- **Art der eingesetzten Finanzinstrumente:**

- Futures
- Optionen
- Swaps: Der FCP kann einen oder mehrere Total Return Swaps abschließen.
- Devisentermingeschäfte
- Kreditderivate
- sonstige Art

- **Einsatz von Derivaten zur Erreichung des Anlageziels:**

- generelle Absicherung des Portfolios durch Aufgabe eines Teils des Aufwärtspotenzials der Aktienmärkte im Gegenzug für eine regelmäßige Rendite – bis zu 100% des Bruttovermögens
- Wiederaufbau einer synthetischen Exposure in Vermögenswerten und Risiken
- Erhöhung der Marktexposure
- sonstige Strategie

Außerdem können Terminfinanzinstrumente für Anpassungen aufgrund von Zeichnungen und Rücknahmen eingesetzt werden, damit die Absicherung entsprechend den oben genannten Fällen aufrechterhalten werden kann.

Zur Erreichung seines Anlageziels kann der FCP einen oder mehrere *Total Return Swaps* abschließen, um den Wert von Vermögenswerten in der Bilanz des FCP (oder gegebenenfalls anderer vom FCP gehaltener Finanzinstrumente oder Vermögenswerte) zu tauschen und auf diese Weise eine Exposure in einer dynamischen Kombination aus *riskanten* und *risikolosen Anlagen* (gemäß der Beschreibung in vorstehendem Absatz 1 dieses Abschnitts) in den nachfolgend beschriebenen Proportionen zu erreichen:

Maximaler Prozentsatz der verwalteten Vermögenswerte, die Gegenstand von *Total Return Swaps* (TRS) sein können: bis zu 110% des Bruttovermögens des FCP.

Erwarteter Prozentsatz der verwalteten Vermögenswerte, die Gegenstand von Total Return Swaps (TRS) sein können: 80% des Bruttovermögens des FCP.

Im Einklang mit ihren Grundsätzen der bestmöglichen Auftragsausführung erachtet die *Verwaltungsgesellschaft* die *Société Générale* als die Gegenpartei, mit der für die genannten Terminfinanzinstrumente (die „Finanzkontrakte“) das bestmögliche Ergebnis erzielt werden kann. Dies kann dazu führen, dass die Verwaltungsgesellschaft Geschäfte mit solchen Finanzinstrumenten mit der *Société Générale* abschließt, ohne dass diese zu anderen Gegenparteien in Konkurrenz tritt.

Die Gegenpartei der vorgenannten *Finanzkontrakte* (die „Gegenpartei“) verfügt weder hinsichtlich der Zusammensetzung des Anlageportfolios des FCP, noch der Basiswerte der *Finanzkontrakte* über eine Verwaltungsvollmacht im Einklang mit den gesetzlich vorgesehenen Beschränkungen und Bedingungen.

Tritt die *Société Générale* als Gegenpartei eines FTI-Kontrakts auf, können Interessenkonflikte zwischen der *Verwaltungsgesellschaft* und der *Société Générale* entstehen; derartige Situationen werden durch die Grundsätze zur Handhabung von Interessenkonflikten der *Verwaltungsgesellschaft* gesteuert.

Im Falle eines Ausfalls einer Gegenpartei eines Total Return-Swaps (TRS) oder der vorzeitigen Kündigung des Kontrakts kann der *Fonds* einen Verlust in Höhe der Wertentwicklung seiner bilanziellen Vermögenswerte gegebenenfalls bis zum Abschluss eines neuen Total Return-Swaps mit einer anderen Gegenpartei erleiden. Bei Eintritt dieses Risikos können dem FCP Verluste und/oder Kosten/Gebühren entstehen und seine Fähigkeit zur Erreichung seines Anlageziels kann gefährdet sein. Wenn der FCP mehrere Total Return-Swaps mit einer oder mehreren Gegenparteien abschließt, beziehen sich die vorstehend genannten Risiken auf den Anteil der Vermögenswerte, die vom gekündigten Kontakt betroffen sind bzw. dessen Gegenpartei ausgefallen ist.

4. Finanzinstrumente mit eingebetteten Derivaten

Entfällt

5. Einlagen

Zur Optimierung seiner Liquiditätssteuerung kann der FCP maximal 20% seines Nettovermögens in Einlagen bei Kreditinstituten investieren.

6. Aufnahme von Barkrediten

Zur Optimierung seiner Liquiditätssteuerung kann der FCP insbesondere vorübergehende Barkredite bis zu 10% seines Nettovermögens aufnehmen.

7. Befristete Käufe und Verkäufe von Wertpapieren

Zur effizienten Verwaltung des FCP behält sich die *Verwaltungsgesellschaft* die Möglichkeit vor, vorübergehende Käufe und Verkäufe von Wertpapieren zu tätigen, darunter:

- Pensionsgeschäfte gegen Zahlung eines Betrags für in Pension genommene Wertpapiere gemäß Artikel R.214-18 des französischen Währungs- und Finanzgesetzbuches (*Code Monétaire et Financier*) bis höchstens 100% des Bruttovermögens;
- Pensionsgeschäfte gegen Zahlung eines Betrags für in Pension gegebene Wertpapiere gemäß Artikel R.214-18 des französischen Währungs- und Finanzgesetzbuches bis höchstens 10% des Bruttovermögens;
- Wertpapierleihgeschäfte gemäß Artikel R.214-18 des französischen Währungs- und Finanzgesetzbuches bis höchstens 10% des Vermögens.

Etwaige befristete Käufe oder Verkäufe von Wertpapieren sowie Wertpapierleihgeschäfte erfolgen gemäß den Marktbedingungen, und ihre etwaigen Erträge fließen vollständig dem FCP zu.

Maximaler Prozentsatz der verwalteten Vermögenswerte, die Gegenstand von Wertpapierfinanzierungsgeschäften sein können: bis zu 100% des Vermögens des FCP. Erwarteter Prozentsatz der verwalteten Vermögenswerte, die Gegenstand von Wertpapierfinanzierungsgeschäften sein können: 0% des Vermögens des FCP.

Hierzu hat die *Verwaltungsgesellschaft* die *Société Générale* als Intermediär (nachstehend der „Vertreter“) ernannt. Im Falle befristeter Verkäufe von Wertpapieren ist der *Vertreter* bevollmächtigt, (i) auf Rechnung des FCP Wertpapierleihgeschäfte durchzuführen, die durch die Rahmenverträge für Wertpapierleihgeschäfte des Typs GMSLA (*Global Master Securities Lending Agreements*), und/oder andere international anerkannte Rahmenverträge geregelt sind, und (ii) die als Garantie im Rahmen dieser Wertpapierleihgeschäfte erhaltenen Barmittel im Einklang mit den im Wertpapierleihvertrag vorgesehenen Grenzen, den Regeln des vorliegenden Prospekts und den geltenden Vorschriften auf Rechnung des FCP investieren.

Es wird darauf hingewiesen, dass die *Verwaltungsgesellschaft* eine Gesellschaft der *Société Générale*-Gruppe und somit ein verbundenes Unternehmen des *Vertreter*s ist.

Wurde die *Société Générale S.A.* zum *Vertreter* ernannt, dann darf sie nicht als Gegenpartei für Wertpapierleihgeschäfte handeln. Im Falle der Durchführung derartiger befristeter Wertpapierverkäufe:

- sind sämtliche Erträge aus diesen Transaktionen abzüglich der direkten und indirekten Betriebskosten und -gebühren an den FCP abzuführen;
- entsprechen die vorstehend genannten Betriebskosten und -gebühren im Zusammenhang mit diesen Techniken zur effizienten Portfolioverwaltung denjenigen, die der *Verwaltungsgesellschaft* dem *Vertreter* (falls vorhanden) und/oder den anderen Intermediären entstehen, die Dienstleistungen im Rahmen dieser Transaktionen erbringen;
- erfolgt die Berechnung dieser direkten oder indirekten Betriebskosten und -gebühren als Prozentsatz der vom *FCP* erzielten Bruttoerträge. Informationen über die direkten und indirekten Betriebskosten/-gebühren sowie die Identität der Rechtsträger, an die diese Kosten/Gebühren gezahlt werden, sind im Jahresbericht des FCP angegeben; und
- die Erträge aus Wertpapierleihgeschäften, von denen die direkten und indirekten Betriebskosten/-gebühren des *Vertreter*s (sofern vorhanden) und der *Verwaltungsgesellschaft* abzuziehen sind, müssen dem FCP gezahlt werden. Da diese direkten und indirekten Kosten nicht die Betriebskosten/-gebühren des FCP erhöhen, werden sie in den laufenden Kosten nicht berücksichtigt.

Der Jahresbericht des FCP umfasst gegebenenfalls auch folgende Angaben:

- die aus den Techniken zur effizienten Portfolioverwaltung resultierende Exposure;
- die Identität der Gegenpartei(en) dieser Techniken zur effizienten Portfolioverwaltung;
- die Art und die Höhe der vom FCP zur Verringerung des Kontrahentenrisikos erhaltenen Garantien, und

- die Erträge aus diesen Techniken zur effizienten Portfolioverwaltung für den gesamten Betrachtungszeitraum sowie die angefallenen, direkten und indirekten Betriebskosten/-gebühren.

8. Informationen über die Finanzgarantien des OGAW:

In allen Fällen, in denen die verfolgte Anlagestrategie ein Kontrahentenrisiko für den FCP zur Folge hat, insbesondere, wenn der FCP außerbörslich gehandelte Termin-Swap-Kontrakte einsetzt und im Rahmen befristeter Käufe und Verkäufe von Wertpapieren, kann er Wertpapiere erhalten, die als Garantien betrachtet werden und das Kontrahentenrisiko im Zusammenhang mit derartigen Transaktionen verringern sollen. Das Portfolio der erhaltenen Garantien kann täglich angepasst werden, damit sein Wert meistens mindestens dem vom FCP eingegangenen Kontrahentenrisiko entspricht oder darüber liegt. Durch diese Anpassung soll erreicht werden, dass das vom FCP eingegangene Kontrahentenrisiko vollständig neutralisiert wird.

Alle vom FCP erhaltenen Finanzgarantien werden in das Volleigentum des FCP integriert und auf einem bei seiner Depotbank eröffneten Konto verbucht. Aus diesem Grund werden die erhaltenen Finanzgarantien als Aktiva in der Bilanz des FCP ausgewiesen. Bei einem Ausfall kann der FCP die von ihr erhaltenen Vermögenswerte zur Tilgung ihrer Schulden gegenüber dem FCP im Rahmen der garantierten Transaktion verwenden.

Alle Finanzgarantien, die der FCP diesbezüglich erhält, müssen die in den geltenden Gesetzen und Vorschriften vorgesehenen Regeln einhalten, insbesondere aber die Bestimmungen für die Liquidität, die Bewertung, die Kreditqualität der Emittenten, die Korrelation und die Risiken aufgrund der Verwaltung der Garantien und der Anwendbarkeit.

Die erhaltenen Garantien müssen insbesondere die folgenden Bedingungen erfüllen:

- alle erhaltenen Garantien müssen hochwertig und sehr liquide sein sowie an einem geregelten Markt oder über ein multilaterales Handelssystem mit transparenter Preisstruktur gehandelt werden, damit sie schnell zu einem Preis verkauft werden können, der nahezu der vorherigen Bewertung entspricht;
- sie müssen mindestens einmal täglich zum Marktpreis (*Mark-to-Market*) bewertet werden, wobei Vermögenswerte, deren Preise starken Schwankungen unterliegen, nicht als Garantie akzeptiert werden dürfen, sofern nicht ein mit der erforderlichen Vorsicht ermittelter Abschlag angewendet wird;
- sie müssen von einem von der Gegenpartei unabhängigen Rechtsträger ausgegeben werden und dürfen keine hohe Korrelation mit der Wertentwicklung der Gegenpartei aufweisen;
- sie müssen in Bezug auf Länder, Märkte und Emittenten ausreichend diversifiziert sein, wobei die Exposure pro Emittent 20% des Nettoinventarwerts des FCP nicht übersteigen darf;
- sie müssen jederzeit von der *Verwaltungsgesellschaft* des FCP ohne vorherige Abstimmung mit der Gegenpartei und ohne deren Genehmigung realisiert werden können.

Abweichend von der in vorstehendem Punkt (d) genannten Bedingung kann der FCP einen Korb von Finanzgarantien erhalten, der eine Exposure von über 20% seines Nettoinventarwerts in ein- und demselben Emittenten zur Folge hat, sofern:

die erhaltenen Finanzgarantien von einem (i) *Mitgliedstaat*, (ii) einer oder mehreren Gebietskörperschaften, (iii) einem Drittland oder (iv) oder von einer internationalen Institution öffentlich-rechtlichen Charakters, der ein oder mehrere *Mitgliedstaaten* der EU angehören, ausgegeben werden; und diese Finanzgarantien zu mindestens sechs verschiedenen Emissionen gehören und die Wertpapiere einer einzigen Emission 30% des Vermögens des FCP nicht übersteigen. Im Einklang mit den vorgenannten Bedingungen können die Garantien des FCP folgende Elemente umfassen:

- Liquide Vermögenswerte oder diesen gleichgestellte Instrumente, darunter insbesondere kurzfristige Bankguthaben und Geldmarktinstrumente;
- Anleihen, die von einem *Mitgliedstaat* der OECD ihren Gebietskörperschaften oder von supranationalen Institutionen und Organismen gemeinschaftlichen, regionalen oder internationalen Charakters oder von einem anderen Land ausgegeben oder verbürgt sind, sofern die (vorstehenden) Bedingungen (a) bis (e) uneingeschränkt erfüllt sind;
- Aktien oder Anteile von Geldmarktfonds mit täglicher Nettoinventarwertberechnung und einem Rating von AAA oder einem gleichwertigen Rating;
- Aktien oder Anteile, die von OGAW ausgegeben werden, die überwiegend in die nachstehend in den Punkten (v) und (vi) angegebenen Anleihen/Aktien investieren;
- Anleihen, die von erstklassigen Emittenten begeben oder garantiert werden und eine angemessene Liquidität aufweisen;
- Aktien, die an einem geregelten Markt in einem *Mitgliedstaat* der EU, an einer Börse in einem *Mitgliedstaat* der OECD oder eines anderen Landes notiert oder gehandelt werden, sofern die (vorstehenden) Bedingungen (a) bis (e) uneingeschränkt erfüllt sind und sofern diese Aktien in einem maßgeblichen Index geführt werden.

Grundsätze zur Festlegung von Abschlägen:

Die *Verwaltungsgesellschaft* des FCP wendet eine Marge auf die von ihm im Rahmen dieses befristeten Wertpapierverkaufs erhaltenen Finanzgarantien an. Die angewandten Margen hängen von den folgenden Kriterien ab:

- Art des als Garantie erhaltenen Vermögenswerts
- Laufzeit des als Garantie erhaltenen Vermögenswerts (falls zutreffend)
- Rating des Emittenten des als Garantie erhaltenen Vermögenswerts (falls zutreffend)

Für erhaltene Finanzgarantien, die auf eine andere Währung als den Euro lauten, könnte eine zusätzliche Marge angewendet werden.

Wiederanlage erhaltener Garantien:

Erhaltene Finanzgarantien, die keine Barmittel darstellen, werden nicht verkauft, reinvestiert oder verpfändet. In Form von Barmitteln erhaltene Finanzgarantien werden nach dem Ermessen des Fondsmanagers entweder:

- (i) in Einlagen bei einem zugelassenen Finanzinstitut investiert;
- (ii) in erstklassige Staatsanleihen angelegt;
- (iii) für Pensionsgeschäfte (*reverse repurchase transactions*) verwendet, sofern diese Geschäfte mit Finanzinstituten abgeschlossen werden, die einer aufsichtsbehördlichen Überwachung unterliegen und der OGAW den Gesamtbetrag der Barmittel einschließlich der aufgelaufenen Zinsen jederzeit abrufen kann;
- (iv) oder in kurzfristige Geldmarktfonds (Organismen für gemeinsame Anlagen) investiert, die in den Grundsätzen der Definition europäischer Organismen für gemeinsame Anlagen auf Gemeinschaftsebene vorgesehen sind.

Als Barmittel erhaltene und reinvestierte Finanzgarantien müssen im Einklang mit den Anforderungen für Finanzgarantien, die keine Barmittel sind, diversifiziert werden.

Bei einem Ausfall der Gegenpartei eines Wertpapierfinanzierungsgeschäfts (außerbörslich gehandelte Total Return-Swap-Kontrakte und/oder befristete Käufe und Verkäufe von Wertpapieren) kann der FCP gezwungen sein, die im Rahmen dieser Transaktion erhaltene Garantien unter ungünstigen Marktbedingungen zu verkaufen, so dass ihm ein Verlust entsteht. Falls der FCP berechtigt ist, die in Form von Barmitteln erhaltenen Garantien zu reinvestieren, kann er einen Verlust erleiden, wenn ein Wertverlust der im Rahmen der Wiederverwendung der Garantien erworbenen Wertpapiere eingetreten ist.

Auswahl der Gegenparteien

Die *Verwaltungsgesellschaft* verwendet ein Verfahren zur Auswahl der Finanzintermediäre und der Gegenparteien an, vor allem für den Abschluss von Finanzkontrakten (FTIs und befristete Käufe und Verkäufe von Wertpapieren) für den FCP. Die Auswahl der Gegenparteien von befristeten Käufen und Verkäufen von Wertpapieren und der Finanzintermediäre erfolgt anhand strenger Regeln aus den Reihen der am Finanzplatz anerkannten Intermediäre unter Berücksichtigung mehrerer Kriterien.

Jede neue Gegenpartei muss anschließend vom Ausschuss für Gegenparteien genehmigt werden, der aus den Leitern des Fondsmanagements, des Middle-Office, dem BCIK und dem Leiter des ständigen Risikomanagements besteht. Sobald eine Gegenpartei eines dieser Kriterien nicht mehr erfüllt, tritt der Ausschuss für Gegenparteien zusammen, um zu ergreifende Maßnahmen zu beschließen.

Darüber hinaus implementiert die *Verwaltungsgesellschaft* ihre „Best Execution“-Politik. Zusätzliche Informationen über diese Politik, insbesondere aber über die Relevanz der verschiedenen Ausführungskriterien für die einzelnen Anlageklassen sind auf unserer Internetseite: <https://sg29haussmann.societegenerale.fr> verfügbar.

Risikoprofil:

Ihr Kapital wird hauptsächlich in von der *Verwaltungsgesellschaft* ausgewählte Finanzinstrumente investiert. Diese Instrumente unterliegen den an den Finanzmärkten üblichen Entwicklungen und Unwägbarkeiten.

Aktienrisiko:

Kursschwankungen von Aktien können sich nachteilig auf den Nettoinventarwert des FCP auswirken. In Baissephasen des Aktienmarktes kann der Nettoinventarwert somit rückläufig sein.

Risiko von Opportunitätsverlusten:

Falls der Anteil der *riskanten Anlagen* des FCP zwischen den Garantiedaten stark gesenkt wird, um die Garantie des FCP zu gewährleisten, würden Anteilinhaber nur in sehr geringem Umfang von einem eventuellen späteren Wertanstieg des Korbs der *riskanten Anlagen* in dem betreffenden Monat profitieren. In einem Krisenszenario, in dem der Wert der *riskanten Anlagen* innerhalb eines einzigen Tages stark sinkt und anschließend wieder steigt und im restlichen Monatsverlauf eine positive Performance erzielt, würden Anteilinhaber nicht oder nur in geringem Maße von dieser positiven Performance profitieren.

Grundsätzlich gilt, dass die Höhe der Partizipation an den im Korb enthaltenen *riskanten Anlagen* unter anderem von der Wertentwicklung dieses Korbs abhängt.

Zinsrisiko:

Anteilinhaber können Zinsschwankungen aufgrund von Finanzinstrumenten unterliegen, die der FCP erwirbt, um die Garantie zu erreichen und die Sensitivität seiner Exposure in *riskanten Anlagen* auszuschalten.

Inflationsrisiken:

Durch ihre Anlagen in den FCP unterliegen die Anteilinhaber dem Risiko einer Geldentwertung.

Marktrisiken:

Anteilinhaber unterliegen aufgrund der Exposure in *riskanten Anlagen* hauptsächlich Aktien-, Zins- und Kreditrisiken. Diese Risiken können im Laufe der Zeit in Abhängigkeit von der Performance des FCP und dem Anteil des in *riskante Anlagen* investierten Fondsvermögens schwanken.

Außer an den Daten, an denen die Garantie in Anspruch genommen werden kann, unterliegt der Nettoinventarwert der Entwicklung dieser Märkte und Risiken. Der Nettoinventarwert des FCP kann demnach sowohl steigen als auch sinken.

Verlust des gesamten Anlagekapitals

Das ursprünglich investierte Kapital ist bei Fälligkeit nicht garantiert.

Risiken von Finanzkontrakten

Zur Erreichung seines Anlageziels und/oder zu Absicherungszwecken kann der FCP *Finanzkontrakte*, insbesondere aber börsennotierte oder außerbörslich gehandelte Terminkontrakte, börsennotierte oder außerbörslich gehandelte Optionen und Swapkontrakte einsetzen.

Anlagen in *Finanzkontrakte* sind mit hohen potenziellen Risiken verbunden.

Der für den Aufbau einer Position in *Finanzkontrakten* erforderliche Kapitaleinsatz liegt deutlich unter der Exposure, die durch diese Kontrakte und den mit ihnen verbundenen „Hebeleffekt“ für jede Transaktion entsteht.

Relativ beschränkte Marktbewegungen können zu unverhältnismäßig hohen Ausschlägen im Ergebnis führen, die für den FCP von Vorteil oder Nachteil sein können.

Der Käufer einer Option riskiert den Totalverlust seiner Kaufprämie. Der Verkäufer einer Option riskiert einen Verlust, welcher der Differenz zwischen der durch den Verkauf der Option vereinnahmten Prämie und dem Preis des Basiswerts, den er im Falle der Ausübung der Option kaufen oder liefern muss, entspricht. Die Höhe dieser Differenz ist theoretisch unbegrenzt.

Der Marktwert von *Finanzkontrakten* ist äußerst volatil und kann deshalb starken Schwankungen unterliegen. Falls die Marktentwicklung den Erwartungen, die den mit den *Finanzkontrakten* verfolgten Strategien zugrunde liegen, entgegen läuft, können die Verluste des FCP höher als ohne den Einsatz von *Finanzkontrakten* sein.

Außerbörsliche Transaktionen können eine geringere Liquidität aufweisen als Transaktionen an organisierten Märkten, da deren Handelsvolumina in der Regel höher sind. Auch unterliegen ihre Preise möglicherweise stärkeren Schwankungen.

Es sei jedoch darauf hingewiesen, dass die angestrebte Exposure in *riskanten Anlagen* maximal 100% des Vermögens des FCP beträgt und dass kein zusätzlicher Hebel zum Einsatz kommt.

Währungsrisiko aufgrund der riskanten Anlagen:

Der FCP unterliegt dem Währungsrisiko, da die im Wertpapiere, aus denen die finanzielle Exposure in *riskanten Anlagen* besteht, auf eine andere als die Währung des FCP lauten, oder Derivate von Wertpapieren sind, die auf eine andere als die Währung des FCP lauten. Folglich können sich Wechselkursschwankungen negativ auf die Exposure in *riskanten Anlagen* auswirken.

Kontrahentenrisiko

Der FCP unterliegt insbesondere dem Kontrahentenrisiko, das mit dem Einsatz von außerbörslich mit der *Société Générale* oder einer anderen Gegenpartei gehandelten derivativen *Finanzkontrakten* (nachstehend die „*OTC-Derivate*“) und/oder Techniken zur effizienten Portfolioverwaltung (nachstehend die „*TEP*“) einher geht. Er unterliegt dem Risiko, dass eine Gegenpartei, mit der er ein *OTC-Derivat* und/oder eine *TEP* abgeschlossen hat, in Konkurs gehen, zahlungsunfähig werden oder anderweitig ausfallen kann. Bei einem Zahlungsausfall der Gegenpartei kann das *OTC-Derivat* und/oder die *TEP* vorzeitig gekündigt werden, wobei der FCP gegebenenfalls ein anderes *OTC-Derivat* und/oder eine andere *TEP* mit einer anderen Gegenpartei zu den bei Eintritt dieses Ereignisses herrschenden Marktbedingungen abschließen kann. Die Konkretisierung dieses Risikos kann Verluste für den FCP verursachen und seine Fähigkeit zur Erreichung seines Anlageziels gefährden. Gemäß den für OGAW geltenden Richtlinien darf das Kontrahentenrisiko 10% des Gesamtvermögens des FCP pro Gegenpartei nicht überschreiten.

Risiko aufgrund des Einsatzes von Techniken zur effizienten Portfolioverwaltung

Falls es zu einem Zahlungsausfall der Gegenpartei der vom FCP eingesetzten Technik zur effizienten Portfolioverwaltung (nachstehend die „*TEP*“) kommt, entsteht für den FCP ein Risiko, dass der Wert der erhaltenen Garantien niedriger ist als der Wert der Vermögenswerte des FCP, die im Rahmen der *TEP* an die Gegenpartei übertragen wurden. Dieses Risiko könnte insbesondere infolge (i) einer falschen Bewertung der Wertpapiere, die Gegenstand des Geschäfts sind, und/oder (ii) ungünstiger Marktbewegungen und/oder (iii) einer Verschlechterung des Kreditratings der Emittenten der als Garantie erhaltenen Wertpapiere und/oder (iv) der Illiquidität am Markt, an dem die erhaltenen Garantien zum Handel zugelassen sind, entstehen. Anteilinhaber werden darauf hingewiesen, dass (i) *TEP* mit der *Société Générale* abgeschlossen werden (die der gleichen Gruppe angehört wie die *Verwaltungsgesellschaft*) und/oder (ii) die *Société Générale* zum *Vertreter* des FCP im Rahmen einer *TEP* ernannt werden kann. Die *Verwaltungsgesellschaft* steuert mögliche Interessenkonflikte aufgrund der Durchführung von Transaktionen innerhalb der Gruppe durch die Umsetzung von Verfahren, die derartige Konflikte identifizieren, begrenzen und gegebenenfalls eine gerechte Lösung ermöglichen.

Risiken aufgrund der Verwaltung der Garantien**- Operatives Risiko**

Der FCP unterliegt möglicherweise einem operativen Risiko aufgrund von Ausfällen oder Fehlern der an der Verwaltung der Garantien von Wertpapierfinanzierungsgeschäften und/oder Total Return-Swaps (TRS) beteiligten Parteien. Dieses Risiko tritt ausschließlich im Rahmen der Verwaltung der Garantien von Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return-Swaps auf, die in der Verordnung (EU) 2015/2365 vorgesehen sind.

- Rechtsrisiko

Der FCP unterliegt einem Rechtsrisiko aufgrund des Abschlusses von Total Return-Swaps (TRS) und/oder Wertpapierfinanzierungsgeschäften im Sinne der Verordnung (EU) 2015/2365.

Nachhaltigkeitsrisiken:

Der FCP berücksichtigt bei seinem Entscheidungsfindungsprozess keine Nachhaltigkeitsfaktoren und unterliegt somit Nachhaltigkeitsrisiken. Das Eintreten dieser Risiken kann sich nachteilig auf die Anlagen des Fonds auswirken. Zusätzliche Informationen sind dem Abschnitt „Nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten“ im Prospekt des FCP zu entnehmen.

Zeichnungsberechtigte Personen und typisches Anlegerprofil:

Der FCP richtet sich an alle Zeichner.

Er wird ausschließlich außerhalb Frankreichs, insbesondere in Deutschland, vertrieben.

Aufgrund seines Risikoprofils eignet sich der FCP für die Zeichnung durch Anteilinhaber, die sich teilweise an den Aktienmärkten engagieren und gleichzeitig von einem *garantierten Nettoinventarwert* in Höhe 80% des vorherigen *garantierten Nettoinventarwerts* profitieren möchten.

Die Höhe einer Anlage in den FCP hängt einzig und allein von der persönlichen Situation des Anlegers ab. Bei der Ermittlung ihres Anlagebetrags sollten Anleger ihre persönliche Vermögenslage, ihren aktuellen und zukünftigen Finanzbedarf während der Laufzeit der Formel sowie ihre Risikobereitschaft bzw. ihre Risikoaversion berücksichtigen. Daneben wird potenziellen Anlegern eine ausreichende Diversifikation ihrer Investitionen empfohlen, damit ihre Anlagerisiken nicht ausschließlich auf diesen FCP entfallen.

Anteilinhabern wird somit empfohlen, ihre persönliche Situation gemeinsam mit ihrem gewohnten Vermögensberater zu prüfen. Der empfohlene Anlagehorizont beträgt 3 Jahre.

Steuerliche Behandlung:

Die Anleger werden darauf hingewiesen, dass die folgenden Angaben lediglich eine allgemeine Zusammenfassung der auf Anlagen in einen thesaurierenden französischen Investmentfonds (*Fonds Commun de Placement, FCP*) anwendbaren Steuervorschriften entsprechend dem gegenwärtigen Stand der französischen Gesetzgebung darstellen. Anteilinhabern wird deshalb empfohlen, ihre jeweilige Situation gemeinsam mit ihrem eigenen Steuerberater zu prüfen.

1. Besteuerung des FCP

In Frankreich sind FCP aufgrund ihres Miteigentumscharakters von Rechts wegen nicht zur Körperschaftsteuer zu veranlagern; sie weisen somit von Natur aus eine gewisse Transparenz auf. Daher werden die vom Fonds im Rahmen seiner Verwaltung vereinnahmten und realisierten Erträge auf Fondsebene nicht besteuert.

Im Ausland (in den Ländern, in denen der Fonds anlegt) können die durch die Veräußerung von ausländischen Wertpapieren realisierten Kapitalgewinne und die vom Fonds erzielten Erträge aus ausländischen Quellen gegebenenfalls einer Steuer (im Allgemeinen in Form eines Quellensteuerabzugs) unterliegen. Die Besteuerung im Ausland kann in einigen wenigen Fällen aufgrund bestehender und gegebenenfalls zur Anwendung kommender Steuerabkommen eingeschränkt sein oder ganz entfallen.

2. Besteuerung der Anteilinhaber des FCP**2.1 Anteilinhaber mit Wohnsitz in Frankreich**

Die vom FCP erzielten Gewinne oder Verluste, die vom FCP an die Anteilinhaber ausgeschütteten Erträge sowie die von den Anteilinhabern erzielten Gewinne oder Verluste unterliegen der geltenden Steuergesetzgebung.

Anteilinhabern wird empfohlen, ihre jeweilige Situation gemeinsam mit ihrem eigenen Steuerberater zu prüfen.

2.2 Anteilinhaber mit Wohnsitz außerhalb Frankreichs

Vorbehaltlich anwendbarer Steuerabkommen können die vom FCP ausgeschütteten Erträge in Frankreich gegebenenfalls einem Abzug oder Einbehalt von Quellensteuer unterliegen.

Gemäß Artikel 244, Absatz 2 C des französischen Steuergesetzbuches (*Code Général des Impôts, CGI*) sind Veräußerungsgewinne aus der Rücknahme/dem Verkauf von Anteilen des FCP in Frankreich nicht steuerpflichtig. Anteilinhaber mit Wohnsitz außerhalb Frankreichs unterliegen den Bestimmungen der in ihrem Wohnsitzland geltenden Steuergesetzgebung.

Informationen über die Verpflichtung zum automatischen Austausch von Informationen im Bereich der Besteuerung

Die *Verwaltungsgesellschaft* kann im Einklang mit Artikel 1649 AC des allgemeinen französischen Steuergesetzbuchs (*Code Général des Impôts*) und der Richtlinie 2014/107/EU des Rates vom 9. Dezember 2014 in Abänderung der Richtlinie 2011/16/EU über die Verpflichtung zum automatischen Austausch von Informationen im Bereich der Besteuerung Informationen über Zeichner von Anteilen des FCP erfassen und an die zuständigen Steuerbehörden weiterleiten.

In diesem Zusammenhang verfügen Zeichner gemäß dem französischen Datenschutzgesetz vom 6. Januar 1978 (*Loi information et libertés*) über das Recht auf Einsicht, Berichtigung und Löschung ihrer personenbezogenen Angaben und können sich diesbezüglich an das Finanzinstitut wenden, verpflichten sich gleichzeitig aber dazu, dem Finanzinstitut auf Anfrage die für die Erklärungen erforderlichen Informationen zur Verfügung zu stellen.

Informationen über das FATCA-Gesetz („LOI FATCA“)

Frankreich und die Vereinigten Staaten haben ein Regierungsabkommen Modell 1 („IGA“) zur Umsetzung des US-amerikanischen „FATCA“-Gesetzes (Kurzbezeichnung für *Foreign Account Tax Compliance Act*) in Frankreich unterzeichnet, das auf die Verhinderung von Steuerhinterziehung durch US-amerikanische Staatsbürger, die Vermögenswerte auf Auslandskonten besitzen, abzielt.

Als „US-amerikanische Steuerpflichtige“ werden alle natürliche Personen, die US-Staatsbürger oder in den USA gebietsansässig sind, und Personengesellschaften oder in den USA oder gemäß US-Bundesgesetz oder dem Gesetz eines US-Bundesstaates gegründete Gesellschaften sowie Trusts bezeichnet, wenn (i) ein in den USA ansässiges Gericht laut Gesetz ermächtigt ist, Verordnungen zu erlassen oder Urteile zu fällen, die alle administrativen Belange des Trusts in wesentlichem Maße betreffen und wenn (ii) ein oder mehrere steuerpflichtige US-Personen ein Kontrollrecht über alle wesentlichen Entscheidungen des Trusts oder über den Nachlass eines Verstorbenen, der Staatsbürger oder Gebietsansässiger in den Vereinigten Staaten von Amerika ist, ausüben können.

Der FCP wurde bei der US-Steuerbehörde als „meldende Finanzinstitution“ eingetragen. In diesem Rahmen ist der FCP seit 2014 verpflichtet, der französischen Steuerbehörde Auskünfte über bestimmte Guthaben oder Beträge zu erteilen, die an bestimmte steuerpflichtige US-Personen oder Nicht-US-Finanzinstitutionen, die als nicht-teilnehmende Finanzinstitute betrachtet werden und dem automatischen Informationsaustausch zwischen den französischen und U-Steuerbehörden unterliegen, gezahlt wurden. Die Investoren sind verpflichtet, ihren FATCA-Status bei ihrem Finanzintermediär bzw. ihrer *Verwaltungsgesellschaft* zu bestätigen.

In Anwendung der für den FCP aufgrund des in Frankreich umgesetzten IGA geltenden Verpflichtungen gilt er als FATCA-konform und wird voraussichtlich von dem gemäß FATCA vorgesehenen Quellensteuerabzug für bestimmte Einkünfte oder Erlöse US-amerikanischer Herkunft befreit.

Investoren, deren Anteile über ein kontoführendes Institut mit Sitz in einer Gerichtsbarkeit gehalten werden, die kein IGA abgeschlossen hat, wird deshalb empfohlen, sich bei ihrem kontoführenden Institut über dessen Vorgehensweise im Hinblick auf das FATCA zu erkundigen. Ferner sind bestimmte kontoführende Institute möglicherweise verpflichtet, zusätzliche Informationen bei ihren Investoren einzuholen, um ihre Verpflichtungen im Rahmen der FATCA-Bestimmungen oder im Sitzland des kontoführenden Instituts zu erfüllen. Darüber hinaus richtet sich der Umfang der Verpflichtungen infolge des FATCA oder eines IGA nach der Gerichtsbarkeit des kontoführenden Instituts. Es wird Investoren deshalb empfohlen, diesbezüglich ihren gewohnten Steuerberater zu Rate zu ziehen.

Nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten

In Anwendung der Verordnung (EU) 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (die „Offenlegungsverordnung“) ist die *Verwaltungsgesellschaft* verpflichtet, die Art und Weise der Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken (wie nachstehend definiert) bei ihren Anlageentscheidungen und die Ergebnisse der Bewertung der zu erwartenden Auswirkungen von Nachhaltigkeitsrisiken auf die Rendite der von ihr verwalteten Fonds offenzulegen.

In Abhängigkeit von anderen spezifischen Risiken, einer Region und/oder einer Anlageklasse, in die die Fonds investiert sind, können zahlreiche und sehr unterschiedliche nachteilige Nachhaltigkeitsauswirkungen entstehen. Wenn eine Anlage einem Nachhaltigkeitsrisiko unterliegt, kann sich dies negativ auf ihren Wert auswirken und zu einem Totalverlust führen, was wiederum erhebliche negative Auswirkungen auf den Nettoinventarwert der betroffenen Fonds haben könnten.

Für jeden Fonds ist die Bewertung zu erwartender Auswirkungen von Nachhaltigkeitsrisiken vorzunehmen. Ausführlichere Informationen sind dem Abschnitt „*Risikoprofil*“ im *Prospekt* des FCP zu entnehmen.

„Nachhaltigkeitsfaktoren“: Umwelt-, Sozial- und Arbeitnehmerbelange, die Achtung der Menschenrechte und die Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

„Nachhaltigkeitsrisiko“: ein Ereignis oder eine Bedingung in den Bereichen Umwelt, Soziales oder Unternehmensführung (ESG), dessen beziehungsweise deren Eintreten tatsächlich oder potenziell wesentliche negative Auswirkungen auf den Wert der Investition haben könnte.

Nachhaltigkeitsrisiken können entweder ein Risiko an sich darstellen oder sich auf andere Risiken wie das Marktrisiko, das operative Risiko, das Liquiditätsrisiko oder das Kontrahentenrisiko auswirken, indem sie maßgeblich zur Exponierung des Fonds gegenüber diesen Risiken beitragen. Die Bewertung der zu erwartenden Auswirkungen von Nachhaltigkeitsrisiken auf die Rendite eines Fonds ist komplex und kann auf ESG-Daten beruhen, die schwer erhältlich, unvollständig, geschätzt, veraltet und/oder ungenau sind. Selbst wenn diese Daten verfügbar sind, gibt es keine Garantie, dass sie auch korrekt bewertet werden.

Nachhaltigkeitsrisiken entstehen unter anderem durch „*klimabedingte*“ Ereignisse infolge des Klimawandels (die „*physischen Risiken*“) oder aufgrund der Reaktion der Gesellschaft auf den Klimawandel (die „*Transitionsrisiken*“), die zu unerwarteten Verlusten für die Anlagen der Fonds führen können. Durch soziale Ereignisse (zum Beispiel Ungleichheit, Inklusivität, Arbeitsbedingungen, Investitionen in das Humankapital, Unfallverhütung, Änderung des Kundenverhaltens usw.) oder eine mangelhafte Unternehmensführung (zum Beispiel bei massiven und wiederholten Verstößen gegen internationale Abkommen, Korruptionsprobleme, Qualität und Sicherheit der Produkte, Verkaufspraktiken usw.) können ebenfalls Nachhaltigkeitsrisiken entstehen.

Durch die Anwendung einer Ausschlusspolitik in Bezug auf Emittenten, deren Praktiken aus ökologischer oder sozialer Sicht und/oder hinsichtlich ihrer Unternehmensführung für bestimmte Anlagestrategien als kontrovers gelten, will die *Verwaltungsgesellschaft* die Nachhaltigkeitsrisiken reduzieren. Wenn ein Fonds zudem einen nicht-finanziellen Ansatz verfolgt (Stock-Picking, thematisch, Impact usw.), können Nachhaltigkeitsrisiken zusätzlich gesenkt werden. In beiden Fällen gilt: Es gibt keine Garantie, dass Nachhaltigkeitsrisiken vollständig neutralisiert werden. Die *Verwaltungsgesellschaft* weist die Anleger darauf hin, dass sie die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (*Principal Adverse Impact, PAI*) auf Nachhaltigkeitsfaktoren für die Verwaltung dieses FCP nicht berücksichtigt.

Zusätzliche Informationen über die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken in Anlageentscheidungen sind auf der Website der *Verwaltungsgesellschaft* verfügbar: <https://sg29haussmann.societegenerale.fr>.

Die von den Fonds getätigten Anlagen berücksichtigen keine europäischen Kriterien zur Identifikation ökologisch nachhaltiger Wirtschaftstätigkeiten (nachstehend die „nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten“), die in der Verordnung (EU) 2020/852 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 18. Juni 2020 über die Einrichtung eines Rahmens zur Erleichterung nachhaltiger Investitionen (in der jeweils gültigen Fassung) vorgesehen sind. Der Mindestanteil der Ausrichtung des FCP auf nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten beträgt daher 0%.

Für alle weiteren Informationen ist der vollständige Prospekt auf einfache Anfrage bei der Verwaltungsgesellschaft erhältlich.

- *Der aktuelle Nettoinventarwert ist in den Geschäftsräumen der Verwaltungsgesellschaft verfügbar. Die letzten Jahresberichte und die Zusammensetzung des Fondsvermögens werden den Anteilhabern auf formlose schriftliche Anfrage an nachstehende Anschrift innerhalb von acht Werktagen zugesandt: SG 29 HAUSSMANN, 29 boulevard Haussmann - 75009 Paris. Internetseite: <https://sg29haussmann.societegenerale.fr>*
- *AMF-Zulassungsdatum: 6. November 2007.*
- *Auflegungsdatum des Fond: 30. Januar 2008*

Verwaltungsbericht

Im Jahr 2024 wird die Weltwirtschaft um 3,2% wachsen, wie bereits 2023. Wichtigster Wachstumsmotor war einmal mehr der Dienstleistungssektor, während die Industrieproduktion stagnierte. Der Rückgang der Inflation sorgte für mehr Einkommen für die privaten Haushalte gesorgt, obwohl das Verbrauchervertrauen in vielen Ländern noch immer schwächer war als vor der Pandemie. Der Druck am Arbeitsmarkt ließ nach, ohne dass die Arbeitslosigkeit zugenommen hätte. Und obwohl die Realzinsen noch „restriktiv“ waren, kamen durch die jüngsten Senkungen der Nominalzinsen erste Signale für eine Erholung an den Wohnimmobilien- und Kreditmärkten.

Die US-Wirtschaft konnte ihre Führungsposition mit einer über dem Potenzialwachstum liegenden Wachstumsrate von 2,8% erneut behaupten. Die Erklärung hierfür sind zumindest teilweise die anhaltenden fiskalischen Stimulierungsmaßnahmen einerseits und die gute finanzielle Verfassung der privaten Haushalte und Unternehmen andererseits. In China sank das Wachstum, das durch die Schwäche der Inlandsnachfrage gedämpft wurde, auf 4,9% und lag damit deutlich unter seinem Durchschnittswert von vor der Covid-Krise. Das Wirtschaftswachstum der Eurozone war mit 0,8% weiterhin niedriger als ihr Potenzialwachstum. Deutschland und Italien wurden durch ihre Abhängigkeit vom Industriesektor belastet, während die spanische Wirtschaft mit einer positiven Überraschung aufwartete. Frankreich verzeichnete ein Wachstum von 1,1%. Zwar sorgten die Olympischen Spiele vorübergehend für Wachstumsimpulse, doch die anhaltend schwache Binnennachfrage überschattete das Bild.

Da sich die Inflation in den meisten Volkswirtschaften den Zielvorgaben der Zentralbanken annäherte, begannen die wichtigsten Notenbanken mit der Senkung ihrer Leitzinsen. So senkte die Europäische Zentralbank (EZB) ihre Zinsen ab Juni von 4% auf 3%. Die Bank of England (BoE) und die Federal Reserve (Fed) zogen nach und senkten die Leitzinsen ihrerseits von 5,25% auf 4,75% bzw. von 5,50% auf 4,50%. Des Weiteren bauten sie ihre durch die unkonventionellen Covid-Hilfsmaßnahmen stark aufgeblähten Bilanzen ab. Die Normalisierung der japanischen Geldpolitik erforderte eine Erhöhung der Zinsen, so dass die Bank of Japan (BoJ) – im Gegensatz zu anderen Notenbanken – ihren Leitzins auf 0,25% anhob.

Die Hälfte der Weltbevölkerung ging 2024 an die Wahlurnen – bei den Europawahlen, die in Frankreich zu vorgezogenen Parlamentswahlen führten, und bei den Präsidentschaftswahlen in den USA. Im Vorfeld der Wahlen zögerten die Regierungen, ihre Haushaltspolitik zurückzufahren, trotz der hohen Staatsverschuldung. Im Jahr 2024 stiegen die Risiken in Bezug auf Handelskonflikte und Protektionismus. Gleiches galt für die geopolitischen Spannungen.

Die Aktienmärkte hoben ab, vor allem in den USA. Die wichtigsten internationalen Börsen verzeichneten im Jahr 2024 Kursgewinne in zweistelliger Höhe. Am besten schnitt erneut der US-Markt ab, der im Jahresverlauf ein Plus von über 28% in US-Dollar erzielte. Japan und Europa verzeichneten zum Jahresbeginn ebenfalls hohe Kurszuwächse (+10% in Europa, +18% in Japan, in Yen). Die französische Börse wurde durch ihre hochgradige Abhängigkeit vom Luxussektor und die politische Unsicherheit im Zusammenhang mit den Wahlen belastet und legte nur um 1% zu. Die Wertentwicklung der Schwellenländer fiel durchwachsen aus, insbesondere der Schwellenländer ohne China (+6,6%).

Erläuterung des Nettoinventarwerts:

Der Nettoinventarwert des FCP SG HAUSSMANN EVO FUND WORLD stieg im Geschäftsjahr um 14,68% und belief sich am 28. Februar 2025 auf 229,35 EUR. Damit liegt seine Performance seit Auflegung bei 129,35%. Der MSCI WORLD™ NTR EUR-Index schloss das Geschäftsjahr mit einem Plus von 20,31%.

Der Fonds konnte erneut von den mit der Société Générale im Einklang mit dem Fondsprospekt ursprünglich abgeschlossenen Finanztermininstrumenten profitieren. Diese Finanzinstrumente wurden bei Bedarf mit der Gegenpartei zur Verwaltung der Zeichnungen und Rücknahmen des FCP angepasst.

In der Vergangenheit erzielte Ergebnisse sind keine Gewähr für zukünftige Renditen. Sie sind im

zeitlichen Verlauf nicht konstant. In der Vergangenheit erzielte Ergebnisse sind keine Gewähr für

zukünftige Renditen. Sie sind im zeitlichen Verlauf nicht konstant.

Wichtigste Veränderungen des Wertpapierbestands im Geschäftsjahr

Wertpapiere	Veränderungen („Rechnungswährung“)	
	Käufe	Verkäufe
ROCHE HOLDING LTD	38.661.655,22	44148075,62
NOVARTIS AG-NOM	35.306.729,99	37302165,45
NOVO NORDISK AS	27.854.434,24	27992912,00
NVIDIA CORP	23.126.464,65	24049326,18
MULTI UNITS FRANCE SICAV AMUNDI MSCI WORLD UCITS EFF	23.975.177,00	22967358,05
NESTLE SA	23.364.773,56	23566738,38
AMUNDI INDEX SOLUTIONS SICAV AMUNDI MSCI WORLD III ETF	22.790.700,00	22383602,20
PROSUS N V	20.627.851,81	18448582,85
NOVONESIS A/S	20.696.761,52	18220150,79
UBS GROUP INC NAMEN AKT	20.878.960,57	16410502,55

AUF SICHTSRECHTLICHE INFORMATIONEN

Transaktionskosten

Die Aufstellung der Kosten für den Wertpapierhandel werden Anteilhabern auf Anfrage an SG 29 HAUSSMANN zugeschickt.

Stimmrechte

Das Dokument „Abstimmungspolitik“, der Bericht der Verwaltungsgesellschaft, der die Bedingungen enthält, unter denen sie die Stimmrechte der von ihr verwalteten OGA ausgeübt hat, und die Informationen über die Abstimmung zu jedem Beschluss können gemäß Artikel 322-75, 322-76 und 322-77 des Standardreglements (*Règlement Général*) der französischen Finanzmarktaufsichtsbehörde AMF entweder auf der Website der Verwaltungsgesellschaft oder am Sitz der Verwaltungsgesellschaft (auf einfache Anfrage) eingesehen werden.

Kriterien ‚Umwelt‘, ‚Soziales‘ und ‚Unternehmensführung‘ (ESG)

Durch die Anwendung einer von SG 29 Haussmann festgelegten Ausschlusspolitik in Bezug auf Emittenten, deren Praktiken aus ökologischer oder sozialer Sicht und/oder hinsichtlich ihrer Unternehmensführung für bestimmte Anlagestrategien als kontrovers gelten, will die *Verwaltungsgesellschaft* die Nachhaltigkeitsrisiken reduzieren. Wenn ein Fonds zudem einen nicht-finanziellen Ansatz verfolgt (Stock-Picking, thematisch, Impact usw.), können Nachhaltigkeitsrisiken zusätzlich gesenkt werden. In beiden Fällen gilt: Es gibt keine Garantie, dass Nachhaltigkeitsrisiken vollständig neutralisiert werden. Zusätzliche Informationen über die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken in Anlageentscheidungen sind auf der Website der *Verwaltungsgesellschaft* verfügbar: <https://sg29haussmann.societegenerale.fr>.

Gesamtrisiko

Die Gesamtrisikoquote wird anhand der Commitment-Methode berechnet.

Verfahren zur Auswahl der Finanzintermediäre

SG 29 HAUSSMANN führt Aufträge nicht direkt aus, sondern leitet sie zur Ausführung an einen Dienstleister weiter.

SG 29 HAUSSMANN hat mit Abteilungen oder Tochtergesellschaften der Gruppe Société Générale (SGBT) Dienstleistungsvereinbarungen zur Ausführung von Aufträgen für die verschiedenen Kategorien von Finanzinstrumenten abgeschlossen.

Diese Auswahl beruht zum einen auf der anerkannten Expertise dieser Einheiten und zum anderen auf der Qualität und der Konnektivität der IT-Systeme (IT), die ein solides System für die Auftragserteilung, die Bestätigung und die Abrechnung der durchgeführten Transaktionen darstellen.

Diese Intermediäre teilen ihre jeweiligen Ausführungsgrundsätze mit und sind gehalten, Ausführung der gehandelten Finanzinstrumente bestmöglich zu erfüllen („Best execution“).

SG 29 HAUSSMANN hat außerdem ein Verfahren zur Auswahl und Bewertung von Dienstleistern für die Fundierung von Anlageentscheidungen (SADIE) implementiert. Diese Dienstleistung wird über einen Mechanismus der geteilten Provision vergütet.

1- Kriterien

Auf der Grundlage der beiden wesentlichen Ziele der MiFID-Richtlinie – dem Kundeninteresse und der Wahrung der Marktintegrität – hat SG 29 HAUSSMANN u.a. die folgenden Hauptkriterien: Preis, Liquidität, Kosten. Diesen Kriterien kommt entsprechend den Parametern des Auftrags eine unterschiedliche Bedeutung zu.

2- Kontrollen

SG 29 HAUSSMANN stellt die Anwendung dieser Grundsätze durch regelmäßige Kontrollen (Kontrolle vor Ort, Datenanalyse) der einzelnen Intermediäre sicher und vergewissert sich hiermit der Qualität der erbrachten Leistung.

Die bestmögliche Ausführung ist Gegenstand einer umfassenden Analyse aller Aufträge, die im Laufe eines gegebenen Zeitraums ausgeführt wurden, wobei bestimmte Aufträge gegebenenfalls einer detaillierten Analyse unterzogen werden können.

Die Intermediäre stellen der SG 29 HAUSSMANN alle für die Rückverfolgbarkeit jedes Auftrags erforderlichen Informationen zur Verfügung.

3- Überprüfung des Verfahrens

Auf Grundlage der durchgeführten Kontrollen und deren Ergebnisse kann SG 29 HAUSSMANN die Auswahlmethode ändern und einen oder mehrere neue Intermediäre wählen.

Vergütungspolitik

Die von SG 29 Haussmann gezahlte Vergütung umfasst eine feste Vergütung und kann, sofern die wirtschaftlichen Bedingungen dies zulassen, eine variable Komponente in Form eines Ermessensbonus enthalten. Dieser Bonus ist nicht an die Wertentwicklung der verwalteten Anlagevehikel geknüpft (er stellt keine Gewinnbeteiligung dar).

SG 29 Haussmann wendet die Vergütungspolitik der Société Générale-Gruppe an. Diese Gruppenpolitik enthält zahlreiche der in Anhang II der OGAW-Richtlinie vorgesehenen Grundsätze, die den aufsichtsrechtlichen Regeln entsprechen und bereits auf Ebene der gesamten Gruppe angewendet werden (siehe Bericht über die Vergütungsgrundsätze und -praktiken der Société Générale-Gruppe). Ferner hat SG 29 Haussmann im Jahr 2014 Änderungen an dieser Vergütungspolitik vorgenommen, um die Sonderbestimmungen der UCITS-Richtlinie über die Verwalter alternativer Investmentfonds zu erfüllen, insbesondere durch die Einführung einer Indexbindung (für einen Korb von 4 Fonds, die für die Tätigkeit der SG 29 Haussmann repräsentativ sind) für alle Mitarbeiter, die eine aufgeschobene Vergütung erhalten, um die Interessen der Mitarbeiter mit denen der Anleger in Einklang zu bringen.

Entsprechend unterliegt die variable Vergütung der Mitarbeiter von SG 29 Haussmann, die unter die OGAW-Richtlinie fallen, den folgenden Bestimmungen und Bedingungen:

- einer aufgeschobenen Anwartschaft in Höhe von mindestens 40% mit einer aufgeschobenen zeitanteiligen Auszahlung über 3 Jahre prorata temporis,
- einer Zahlung von 50% der gesamten variablen Vergütung (erworbener und nicht erworbener Anteil) in Form von Finanzinstrumenten oder gleichwertigen,
- einer Anwartschaft des nicht-erworbenen Anteils, vorbehaltlich der Einhaltung der risikobereinigten Anwesenheits- und Leistungsbedingungen der Einheit.

Die Vergütungspolitik von SG Haussmann hat keine Auswirkungen auf das Risikoprofil des Fonds und ermöglicht die Steuerung sämtlicher Interessenkonflikte in Verbindung mit der Finanzverwaltung der Anlagevehikel.

SG 29H	Gesamtbetrag der fixen Vergütungen (EUR) 2024	Gesamtbetrag der variablen Vergütungen (EUR) 2024 (Including Equal Pay)	Gesamtvergütung (fix und variabel) (EUR)
Mitarbeiter, die das Risikoprofil beeinflussen	9.545.122	3.712.100	13.257.222

Diese Informationen sind auf unserer Website: <https://sg29haussmann.societegenerale.fr> verfügbar.

Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften und der Weiterverwendung von Finanzinstrumenten (SFTR-Verordnung)

(in der Rechnungswährung des Fonds)

1. Allgemeine Informationen
1.1. Betrag der verliehenen Wertpapiere und Waren im Verhältnis zu allen verleihbaren Wertpapieren, die nicht als Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente definiert sind

Wertpapierverleihgeschäfte	
% der verleihbaren Wertpapiere	-

1.2. Betrag der Vermögenswerte, die Gegenstand aller Arten von Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps sind, ausgedrückt als absoluter Wert (in der Währung des Organismus für gemeinsame Anlagen) und im Verhältnis zu den von dem Organismus für gemeinsame Anlagen verwalteten Vermögenswerten

	Wertpapierverleihgeschäfte	Wertpapierentleihgeschäfte	Pensionsgeschäfte	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	TRS
Absoluter Wert	-	-	-	-	3.936.925,40
% des verwalteten Vermögens	-	-	-	-	4,29

⁽¹⁾ Der Betrag der Vermögenswerte, die Gegenstand von Wertpapierverleihgeschäften sind, entspricht dem Marktwert der verliehenen Wertpapiere zum Bilanzstichtag.

⁽²⁾ Der Betrag der Vermögenswerte, die Gegenstand von Wertpapierausleihgeschäften sind, entspricht dem Marktwert der vom Fonds im Rahmen der Wertpapierleihe zum Bilanzstichtag gelieferten Garantien (Barmittel oder Wertpapiere).

⁽³⁾ Der Betrag der Vermögenswerte, die Gegenstand von Pensionsgeschäften sind, entspricht dem Marktwert der in Pension gegebenen Wertpapiere zum Bilanzstichtag.

⁽⁴⁾ Betrag der Vermögenswerte, die Gegenstand von umgekehrten Pensionsgeschäften sind, entspricht dem Marktwert der in Pension genommenen Wertpapiere zum Bilanzstichtag.

⁽⁵⁾ Der Betrag der Vermögenswerte, die Gegenstand von TRS sind, entspricht (i) bei TRS, bei denen sich die Verwaltungsgesellschaft verpflichtet hat, der Gegenpartei des TRS einen Wertpapierkorb zu liefern, dem Marktwert des Wertpapierkorbs, der Gegenstand des TRS ist, zuzüglich des Marktwerts des TRS am Bilanzstichtag und/oder (ii) bei TRS, bei denen die Verwaltungsgesellschaft keinen Wertpapierkorb liefert, dem Nominalwert des TRS am Bilanzstichtag.

2. Daten bezüglich der Konzentration
2.1. Die zehn größten Aussteller von Garantien für alle Arten von Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps (Aufschlüsselung des Volumens der erhaltenen Garantien und Rohstoffe nach Bezeichnung der Aussteller)

1	Bezeichnung	BROADCOM
	Betrag	639.134,80
2	Bezeichnung	AMAZON
	Betrag	629.900,08
3	Bezeichnung	ROBLOX
	Betrag	434.710,15
4	Bezeichnung	COINBASE
	Betrag	344.370,02
5	Bezeichnung	BOLLORE
	Betrag	287.356,68
6	Bezeichnung	DOLLAR TREE
	Betrag	142.707,52

2.2. Die zehn wichtigsten Gegenparteien für alle Arten von Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps einzeln (Bezeichnung der Gegenpartei und Bruttovolumen der offenen Geschäfte)

		Wertpapierverleih- geschäfte	Wertpapier- entleih- geschäfte	Pensions- geschäfte	Umgekehrte Pensions- geschäfte	TRS
1	Bezeichnung	-	-	-	-	SOCIETE GENERALE
	Betrag	-	-	-	-	3.936.925,40

3. Angaben zu sämtlichen Transaktionen mit allen Arten von Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps einzeln, aufgeschlüsselt nach den folgenden Kategorien
3.1. Art und Qualität der Garantien

		Wertpapierverleih- geschäfte	Wertpapier- entleih- geschäfte	Pensions- geschäfte	Umgekehrte Pensions- geschäfte	TRS
	Barmittel	-	-	-	-	-
	Wertpapier	-	-	-	-	2.478.179,25

SG 29 Haussmann sorgt für eine angemessene Diversifikation der als Garantien erhaltenen Wertpapiere sowie auf eine Erhöhung des Werts dieser Garantien durch die Anwendung von Bewertungsabschlägen auf die erhaltenen Wertpapiere.

3.2. Fälligkeit der Garantie

		Wertpapierverleih- geschäfte	Wertpapier- entleih- geschäfte	Pensions- geschäfte	Umgekehrte Pensions- geschäfte	TRS
	Weniger als 1 Tag	-	-	-	-	-
	1 Tag bis 1 Woche	-	-	-	-	-
	1 Woche bis 1 Monat	-	-	-	-	-
	1 bis 3 Monate	-	-	-	-	-
	3 Monate bis 1 Jahr	-	-	-	-	-
	Mehr als 1 Jahr	-	-	-	-	-
	Offen	-	-	-	-	2.478.179,25

3.3. Währung der Garantie

		Wertpapierverleih- geschäfte	Wertpapier- entleih- geschäfte	Pensions- geschäfte	Umgekehrte Pensions- geschäfte	TRS
1	Währung	-	-	-	-	USD
	Betrag	-	-	-	-	2.190.822,57
2	Währung	-	-	-	-	EUR
	Betrag	-	-	-	-	287.356,68

3.4. Fälligkeit der Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total Return Swaps

	Wertpapierverleih- geschäfte	Wertpapier- entleih- geschäfte	Pensions- geschäfte	Umgekehrte Pensions- geschäfte	TRS
Weniger als 1 Tag	-	-	-	-	-
1 Tag bis 1 Woche	-	-	-	-	-
1 Woche bis 1 Monat	-	-	-	-	-
1 bis 3 Monate	-	-	-	-	-
3 Monate bis 1 Jahr	-	-	-	-	3.936.925,40
Mehr als 1 Jahr	-	-	-	-	-
Offen	-	-	-	-	-

3.5. Sitzländer der Gegenparteien

	Wertpapierverleih- geschäfte	Wertpapier- entleih- geschäfte	Pensions- geschäfte	Umgekehrte Pensions- geschäfte	TRS
1 Land	-	-	-	-	FRANKR EICH
Betrag	-	-	-	-	3.936.925,40

3.6. Abrechnung und Clearing

	Wertpapierverleih- geschäfte	Wertpapier- entleih- geschäfte	Pensions- geschäfte	Umgekehrte Pensions- geschäfte	TRS
Tri-Party	-	-	-	-	-
Zentrale Gegenpartei	-	-	-	-	-
Bilateral	-	-	-	-	3.936.925,40

4. Angaben zur Weiterverwendung der Garantien (Sicherheit)

Erhaltene Finanzgarantien, die keine Barmittel darstellen, werden nicht verkauft, reinvestiert oder verpfändet.

5. Verwahrung der Garantien, die der Organismus für gemeinsame Anlagen im Rahmen von Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps erhalten hat

Anzahl der Depotbanken	1
1 Bezeichnung	SOCIETE GENERALE
Betrag	2.478.179,25

6. Verwahrung der Garantien, die der Organismus für gemeinsame Anlagen im Rahmen von Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps gestellt hat

Nicht zutreffend.

7. Erträge und Kosten aller Arten von Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps

Der OGA setzt außerbörslich gehandelte Total Return Swaps (TRS) ein.

Die Erträge und Kosten in Verbindung mit diesen Total Return Swaps sind in der Bewertung dieser Kontrakte berücksichtigt.

TECHNIKEN ZUR EFFIZIENTEN PORTFOLIOVERWALTUNG UND DERIVATIVE FINANZINSTRUMENTE

a) Exposure, die durch Techniken zur effizienten Portfolioverwaltung und durch derivative Finanzinstrumente erzielt wurde

• Exposure, die durch Techniken zur effizienten Portfolioverwaltung erzielt wurde:		-
- Wertpapierverleih- geschäfte:	-	
- Wertpapierentleih- geschäfte:	-	
- Pensionsgeschäfte:	-	
- Umgekehrte Pensionsgeschäfte:	-	
• Exposure in Basiswerten, die durch derivative Finanzinstrumente erzielt wurde:		3.936.925,40
- Devisentermingeschäfte:	-	
- Futures:	-	
- Optionen:	-	
- Swaps:	3.936.925,40	

b) Identität der Gegenpartei(en) der Techniken zur effizienten Portfolioverwaltung und derivativen Finanzinstrumente

Techniken zur effizienten Portfolioverwaltung	Derivative Finanzinstrumente (*)
-	SOCIETE GENERALE
-	-
-	-
-	-
-	-
-	-
-	-
-	-
-	-
-	-

(*) Außer börsennotierte Derivate

c) Vom OGAW erhaltene Finanzgarantien zur Verringerung des Kontrahentenrisikos:

Art von Instrument	Betrag in der Portfoliowährung
Techniken zur effizienten Portfolioverwaltung	
- Termineinlagen	-
- Aktien	2.478.179,25
- Anleihen	-
- Investmentfonds	-
- Barmittel (**)	-
Insgesamt	2.478.179,25
Derivative Finanzinstrumente	
- Termineinlagen	-
- Aktien	-
- Anleihen	-
- Investmentfonds	-
- Barmittel (**)	-
Insgesamt	-

(**) Der Posten ‚Barmittel‘ enthält auch liquide Mittel, die aus Pensionsgeschäften stammen.

d) Betriebliche Erträge und Kosten im Zusammenhang mit Techniken zur effizienten Portfolioverwaltung

Betriebliche Erträge und Kosten	Betrag in der Portfoliowährung
- Erträge (***)	-
- Sonstige Erträge	-
Erträge insgesamt	-
- Direkte betriebliche Kosten	-
- Indirekte betriebliche Kosten	-
- Sonstige Kosten	-
Kosten insgesamt	-

(***) Vereinnahmte Erträge aus Wertpapierverleihgeschäften und in Pension genommenen Wertpapieren

BERICHT DES ABSCHLUSSPRÜFERS



BERICHT DES ABSCHLUSSPRÜFERS ZUM JAHRESABSCHLUSS Am 28. Februar 2025 abgeschlossenes Geschäftsjahr

SG HAUSSMANN EVO FUND WORLD
MIT DER RECHTSFORM EINES FONDS COMMUN DE PLACEMENT AUFGELEGTER OGAW
Im Einklang mit dem französischen Währungs- und Finanzgesetzbuch (*Code monétaire et financier*)

Verwaltungsgesellschaft
SG 29 HAUSSMANN
29, boulevard Haussmann
75009 PARIS

Bestätigungsvermerk

In Ausführung des uns von der Verwaltungsgesellschaft erteilten Auftrags haben wir den Jahresabschluss des in der Form eines *Fonds Commun de Placement* (FCP, Investmentfonds) aufgelegten OGAW SG HAUSSMANN EVO FUND WORLD für das am 28. Februar 2025 abgeschlossene Geschäftsjahr geprüft. Der Jahresabschluss liegt diesem Bericht bei.

Wir bestätigen hiermit, dass der Jahresabschluss hinsichtlich der französischen Rechnungslegungsrichtlinien und -grundsätze vorschriftsmäßig und korrekt erstellt wurde und ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild des Ergebnisses der Geschäftstätigkeit im abgelaufenen Geschäftsjahr sowie der Vermögens- und Finanzlage des mit der Rechtsform eines *Fonds commun de placement* aufgelegten OGAW am Ende dieses Geschäftsjahres vermittelt.

Grundlage für das Prüfungsurteil

Prüfungsgrundlage

Wir haben unsere Abschlussprüfung nach den in Frankreich geltenden Grundsätzen unseres Berufsstandes durchgeführt. Wir sind der Auffassung, dass die geprüften Elemente eine ausreichende und geeignete Grundlage für unsere Stellungnahme darstellen. Unsere Verantwortung nach diesen Grundsätzen ist im Abschnitt „Verantwortung des Abschlussprüfers für die Prüfung des Jahresabschlusses“ beschrieben.

Unabhängigkeit

Wir haben unsere Prüfung in Übereinstimmung mit den im französischen Handelsgesetzbuch (Code de Commerce) und den Berufspflichten für Abschlussprüfer festgelegten Unabhängigkeitsregeln für den Zeitraum vom 1.3.2024 bis zum Datum der Veröffentlichung unseres Berichts durchgeführt.

.....
PricewaterhouseCoopers Audit, 63, rue de Villiers, 92208 Neuilly-sur-Seine Cedex
Tel.: +33 (0)1 56 57 58 59 - Fax: +33 (0) 1 56 57 58 60, www.pwc.fr

Steuerberatungsgesellschaft, eingetragen bei der Wirtschaftsprüferkammer Paris - Ile de France. Wirtschaftsprüfungsgesellschaft, Mitglied der regionalen Wirtschaftsprüfungskammer von Versailles. Vereinfachte Aktiengesellschaft mit einem Kapital von 2.510.460 Euro. Sitz: 63, rue de Villiers, 92200 Neuilly-sur-Seine. HR Nanterre 672 006 672.006.483. MwSt.-Nr. FR 76 672 006 483. Siret 672 006 483 00362. APE-Code 6920 Z Niederlassungen: Bordeaux, Grenoble, Lille, Lyon, Marseille, Metz, Nantes, Nizza, Paris, Poitiers, Rennes, Rouen, Straßburg, Toulouse.



SG HAUSSMANN EVO FUND WORLD

Anmerkung

Ohne die vorstehende Beurteilung in Frage zu stellen, machen wir Sie auf die Auswirkungen der Änderung der Rechnungslegungsmethode aufmerksam, die im Anhang des Jahresabschlusses beschrieben sind.

Begründung der Beurteilungen

In Anwendung der Bestimmungen der Artikel L. L.821-53 und R. 821-180 des französischen Handelsgesetzbuches (Code de Commerce) über die Begründung unserer Beurteilungen setzen wir Sie hiernach von den Beurteilungen in Kenntnis, die wir nach unserem fachlichen Ermessen für die Abschlussprüfung des Jahresabschlusses des Geschäftsjahres am wichtigsten waren.

Diese Beurteilungen sind in unsere Prüfung des Jahresabschlusses im Ganzen und in unser oben ausgesprochenen Prüfungsurteil eingeflossen. Wir geben kein Urteil über einzelne Elemente des Jahresabschlusses ab.

1. Außerbörslich gehandelte Finanzkontrakte:

Die Bewertung außerbörslich gehandelter Finanzkontrakte im Portfolio erfolgt anhand der Methoden, die in der Erläuterung zu den Bilanzierungs- und Bewertungsmethoden beschrieben sind. Die Preise werden von den Gegenparteien der Kontrakte berechnet und von der Verwaltungsgesellschaft anhand von Finanzmodellen validiert. Die verwendeten mathematischen Modelle beruhen auf externen Daten und Markthypothesen. Auf der Grundlage der Elemente, die zur Bestimmung der verwendeten Bewertungen herangezogen wurden, haben wir den von der Verwaltungsgesellschaft angewandten Ansatz beurteilt.

2. Sonstige Finanzinstrumente des Portfolios:

Die wichtigsten Beurteilungen, die wir vorgenommen haben, bezogen sich auf die Angemessenheit der angewendeten Rechnungslegungsgrundsätze und der vorgenommenen wichtigsten Schätzungen.

Spezifische Prüfungen

Ferner haben wir gemäß den in Frankreich geltenden Grundsätzen unseres Berufsstandes die nach den gesetzlichen und aufsichtsrechtlichen Bestimmungen vorgeschriebenen spezifischen Prüfungen vorgenommen.

Wir haben bezüglich der Korrektheit und der Übereinstimmung mit dem Jahresabschluss der im Anlagebericht der Verwaltungsgesellschaft enthaltenen Informationen keinerlei Beanstandungen vorzubringen.

.....
 PricewaterhouseCoopers Audit, 63, rue de Villiers, 92208 Neuilly-sur-Seine Cedex
 Tel.: +33 (0)1 56 57 58 59 - Fax: +33 (0) 1 56 57 58 60, www.pwc.fr

Steuerberatungsgesellschaft, eingetragen bei der Wirtschaftsprüferkammer Paris - Ile de France. Wirtschaftsprüfungsgesellschaft, Mitglied der regionalen Wirtschaftsprüfungskammer von Versailles. Vereinfachte Aktiengesellschaft mit einem Kapital von 2.510.460 Euro. Sitz: 63, rue de Villiers, 92200 Neuilly-sur-Seine. HR Nanterre 672 006 672.006.483. MwSt.-Nr. FR 76 672 006 483. Siret 672 006 483 00362. APE-Code 6920 Z Niederlassungen: Bordeaux, Grenoble, Lille, Lyon, Marseille, Metz, Nantes, Nizza, Paris, Poitiers, Rennes, Rouen, Straßburg, Toulouse.



SG HAUSSMANN EVO FUND WORLD

Verantwortung der Verwaltungsgesellschaft bezüglich des Jahresabschlusses

Es ist Aufgabe der Verwaltungsgesellschaft, einen Jahresabschluss zu erstellen, der gemäß den französischen Rechnungslegungsgrundsätzen ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild vermittelt, und eine interne Kontrolle einzurichten, die sie für erforderlich hält um sicherzustellen, dass der Jahresabschluss keine wesentlichen – vorsätzlich oder irrtümlich gemachten – unzutreffenden Angaben enthält.

Bei der Erstellung des Jahresabschlusses ist es Aufgabe der Verwaltungsgesellschaft, die Fähigkeit des Fonds zur Fortführung seiner Geschäftstätigkeit zu prüfen, gegebenenfalls in seinem Abschluss die Informationen anzugeben, die sich auf die Fortführung der Geschäftstätigkeit beziehen, und den Rechnungslegungsgrundsatz der Fortführung der Geschäftstätigkeit anzuwenden, es sei denn, es ist vorgesehen, den Fonds zu liquidieren oder seine Tätigkeit einzustellen.

Der Jahresabschluss wurde von der Verwaltungsgesellschaft erstellt.

Verantwortung des Abschlussprüfers für die Prüfung des Jahresabschlusses

Zielsetzung und Vorgehensweise

Unsere Aufgabe ist es, einen Bericht über den Jahresabschluss zu erstellen. Unsere Zielsetzung ist, hinreichende Sicherheit darüber zu erlangen, ob der Jahresabschluss als Ganzes frei von wesentlichen Falschdarstellungen ist. Hinreichende Sicherheit entspricht einem hohen Maß an Sicherheit, aber keiner Garantie dafür, dass eine in Übereinstimmung mit den Berufspflichten durchgeführte Prüfung systematisch eine wesentliche Falschdarstellung stets aufdeckt. Falschdarstellungen können durch Verstößen oder Unrichtigkeiten entstehen und werden als wesentlich angesehen, wenn nach vernünftigem Ermessen erwartet werden kann, dass sie einzeln oder zusammen die auf der Grundlage des Jahresabschlusses getroffenen wirtschaftlichen Entscheidungen von Adressaten beeinflussen.

Wie in Artikel L.821-55 des französischen Handelsgesetzbuches erwähnt, besteht unser Auftrag der Bestätigung des Abschlusses nicht darin, die Stichhaltigkeit oder Qualität der Verwaltung des Fonds zu garantieren.

Im Rahmen einer gemäß den in Frankreich geltenden Berufspflichten durchgeführten Prüfung lassen wir während der gesamten Prüfung pflichtgemäßes Ermessen walten. Darüber hinaus:

- Identifizieren und beurteilen wir die Risiken wesentlicher – beabsichtigter oder unbeabsichtigter – Falschdarstellungen im Jahresabschluss, planen und führen Prüfungshandlungen als Reaktion auf diese Risiken durch und erlangen wir Prüfungsnachweise, die wir für ausreichend und geeignet halten, um als Grundlage für unsere Prüfungsurteile zu dienen. Das Risiko, dass wesentliche Falschdarstellungen nicht aufgedeckt werden, ist bei Verstößen höher als bei Unrichtigkeiten, da Verstöße betrügerische Absprachen, Fälschungen, beabsichtigte Auslassungen, irreführende Darstellungen bzw. das Außerkraftsetzen interner Kontrollen beinhalten können;

.....
 PricewaterhouseCoopers Audit, 63, rue de Villiers, 92208 Neuilly-sur-Seine Cedex
 Tel.: +33 (0)1 56 57 58 59 - Fax: +33 (0) 1 56 57 58 60, www.pwc.fr

Steuerberatungsgesellschaft, eingetragen bei der Wirtschaftsprüferkammer Paris - Ile de France. Wirtschaftsprüfungsgesellschaft, Mitglied der regionalen Wirtschaftsprüfungskammer von Versailles. Vereinfachte Aktiengesellschaft mit einem Kapital von 2.510.460 Euro. Sitz: 63, rue de Villiers, 92200 Neuilly-sur-Seine. HR Nanterre 672 006 672.006.483. MwSt.-Nr. FR 76 672 006 483. Siret 672 006 483 00362. APE-Code 6920 Z Niederlassungen: Bordeaux, Grenoble, Lille, Lyon, Marseille, Metz, Nantes, Nizza, Paris, Poitiers, Rennes, Rouen, Straßburg, Toulouse.



SG HAUSSMANN EVO FUND WORLD

- gewinnen wir ein Verständnis von dem für die Prüfung des Jahresabschlusses relevanten internen Kontrollsystem, um Prüfungshandlungen zu planen, die unter den gegebenen Umständen angemessen sind, jedoch nicht mit dem Ziel, ein Prüfungsurteil zur Wirksamkeit des internen Kontrollsystems abzugeben;
- beurteilen wir die Angemessenheit der angewandten Rechnungslegungsmethoden sowie die Vertretbarkeit der von der Verwaltungsgesellschaft dargestellten geschätzten Werte und damit zusammenhängenden Angaben im Jahresabschluss;
- ziehen wir Schlussfolgerungen über die Angemessenheit des von der Verwaltungsgesellschaft angewandten Rechnungslegungsgrundsatzes der Fortführung der Geschäftstätigkeit sowie, auf der Grundlage der erlangten Prüfungsnachweise, ob eine wesentliche Unsicherheit im Zusammenhang mit Ereignissen oder Gegebenheiten besteht, die bedeutsame Zweifel an der Fähigkeit des Fonds zur Fortführung seiner Geschäftstätigkeit aufwerfen können. Diese Schlussfolgerungen stützen sich auf Prüfungsnachweise, die wir bis zum Datum unseres Berichts gesammelt haben. Zukünftige Ereignisse oder Gegebenheiten können jedoch dazu führen, dass die Geschäftstätigkeit nicht mehr fortgeführt werden kann. Falls wir zu dem Schluss kommen, dass eine wesentliche Unsicherheit besteht, machen wir in unserem Bericht auf die diesbezüglichen Angaben im Jahresabschluss aufmerksam oder formulieren wir, falls diese Angaben nicht gemacht wurden oder unangemessen sind, einen Bestätigungsvermerk mit Vorbehalt oder verweigern den Bestätigungsvermerk;
- beurteilen wir die Gesamtdarstellung des Jahresabschlusses und schätzen ein, ob der Jahresabschluss die zugrunde liegenden Geschäftsvorfälle und Ereignisse so darstellt, dass der Jahresabschluss ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild vermittelt.

Neuilly sur Seine, Datum der elektronischen Unterschrift

Durch elektronische Signatur beglaubigtes Dokument

Der Abschlussprüfer
PricewaterhouseCoopers Audit
Raphaëlle Alezra-Cabessa

2025.05.23 12:42:24 +0200

JAHRESABSCHLUSS

Es wird daran erinnert, dass es sich um das erste Geschäftsjahr handelt, für das erstmals ein Rechnungsabschluss gemäß den Vorschriften der Verordnung ANC Nr. 2020-07 erstellt wurde.

Artikel 3 dieser Verordnung sieht folgendes vor:

Für das erste Geschäftsjahr ist keine Pro-Forma-Darstellung der Finanzberichte für das Vorjahr vorgeschrieben. Die Finanzberichte für das Vorjahr und eine Erläuterung der Art der Änderungen zwischen den beiden Darstellungen sind im Anhang enthalten.

BILANZ

Aktiva

	28.2.2025	*29.2.2024
Währung	EUR	EUR
Nettoanlagevermögen	-	-
Finanztitel		
Aktien und aktienähnliche Wertpapiere (A) ⁽¹⁾	63.592.740,21	-
An einem geregelten oder gleichgestellten Markt gehandelt	63.592.740,21	-
Nicht an einem geregelten oder gleichgestellten Markt gehandelt	-	-
In Aktien wandelbare Anleihen (B) ⁽¹⁾	-	-
An einem geregelten oder gleichgestellten Markt gehandelt	-	-
Nicht an einem geregelten oder gleichgestellten Markt gehandelt	-	-
Anleihen und anleihenähnliche Wertpapiere (C) ⁽¹⁾	-	-
An einem geregelten oder gleichgestellten Markt gehandelt	-	-
Nicht an einem geregelten oder gleichgestellten Markt gehandelt	-	-
Schuldtitle (D)	9.957.800,00	-
An einem geregelten oder gleichgestellten Markt gehandelt	9957800,00	-
Nicht an einem geregelten oder gleichgestellten Markt gehandelt	-	-
Anteile von OGA und Investmentfonds (E)	12.953.329,00	-
OGAW	12.953.329,00	-
FIA und vergleichbare Fonds anderer Mitgliedstaaten der Europäischen Union	-	-
Sonstige OGA und Investmentfonds	-	-
Einlagen (F)	-	-
Finanztermininstrumente (G)	65.141.591,78	-
Befristete Wertpapiergeschäfte (H)	-	-
Forderungen aus in Pension genommenen Wertpapieren	-	-
Forderungen aus als Garantie hinterlegten Wertpapieren	-	-
Forderungen aus verliehenen Wertpapieren	-	-
Entlehene Wertpapiere	-	-
In Pension gegebene Wertpapiere	-	-
Sonstige befristete Wertpapiergeschäfte	-	-
Darlehen (I)	-	-
Sonstige zulässige Aktiva (J)	-	-
Zwischensumme zulässige Aktiva I = (A + B + C + D + E + F + G + H + I + J)	151.645.460,99	-
Forderungen und Berichtigungskonten Aktiva	-	-
Geldkonten	6.749.897,62	-
Zwischensumme andere als zulässige Aktiva II	6.749.897,62	-
Summe Aktiva: I + II	158.395.358,61	-

* Für das erste Geschäftsjahr ist keine Pro-Forma-Darstellung der Finanzberichte für das Vorjahr vorgeschrieben. Die Finanzberichte für das Vorjahr und eine Erläuterung der Art der Änderungen zwischen den beiden Darstellungen sind im Anhang enthalten.

⁽¹⁾ Die sonstigen Aktiva sind Vermögenswerte, die nicht zu den zulässigen Aktiva gemäß Definition im Verwaltungsreglement oder der Satzung des OGA mit variablem Kapital gehören und die für den Betrieb des OGA erforderlich sind.

BILANZ

Passiva

	28.2.2025	*29.2.2024
Währung	EUR	EUR
Eigenkapital:		
Kapital	79.995.666,57	-
Saldovortrag des Nettoertrags	-	-
Saldovortrag von realisierten Nettogewinnen/- verlusten	-	-
Nettoergebnis des Geschäftsjahres	11.746.543,50	-
Eigenkapital I	91.742.210,07	-
Finanzierungsverbindlichkeiten II ⁽¹⁾	-	-
Eigenkapital und Finanzierungsverbindlichkeiten (I+II) ⁽¹⁾	-	-
Zulässige Passiva:		
Finanzinstrumente (A)	2.478.179,25	-
Veräußerungen von Finanzinstrumenten	-	-
Befristete Wertpapiergeschäfte	2.478.179,25	-
Finanztermininstrumente (B)	61.204.666,38	-
Darlehen	-	-
Sonstige zulässige Passiva (C)	-	-
Zwischensumme zulässige Passiva III = A + B + C	63.682.845,63	-
Sonstige Passiva:		
Verbindlichkeiten und Berichtigungskonten Passiva	2.970.302,91	-
Verbindlichkeiten gegenüber Kreditinstituten	-	-
Zwischensumme sonstige Passiva IV	2.970.302,91	-
Summe Passiva: I + II + III + IV	158.395.358,61	-

* Für das erste Geschäftsjahr ist keine Pro-Forma-Darstellung der Finanzberichte für das Vorjahr vorgeschrieben. Die Finanzberichte für das Vorjahr und eine Erläuterung der Art der Änderungen zwischen den beiden Darstellungen sind im Anhang enthalten.

⁽¹⁾ Diese Rubrik ist fakultativ und betrifft nur die OFS. Finanzierungsverbindlichkeiten sind vom OFS emittierte Verbindlichkeiten, die nicht zu Anteilen oder Aktien gehören.

GEWINN- UND VERLUSTRECHNUNG

	28.2.2025	*29.2.2024
Währung	EUR	EUR
Nettofinanzerträge		
Erträge aus Finanzgeschäften		
Erträge aus Aktien	-	-
Erträge aus Anleihen	-	-
Erträge aus Schuldtiteln	174.202,48	-
Erträge aus OGA-Anteilen ⁽¹⁾	254.631,71	-
Erträge aus Finanztermininstrumenten	-	-
Erträge aus befristeten Wertpapiergeschäften	-	-
Erträge aus Darlehen und Forderungen	-	-
Erträge aus sonstigen zulässigen Aktiva und Passiva	-	-
Sonstige Finanzerträge	107.868,00	-
Zwischensumme Erträge aus Finanzgeschäften	536.702,19	-
Aufwendungen aus Finanzgeschäften		
Aufwendungen aus Finanzgeschäften	-	-
Aufwendungen aus Finanztermininstrumenten	-	-
Aufwendungen aus befristeten Wertpapiergeschäften	-	-
Aufwendungen für Darlehen	-	-
Aufwendungen aus sonstigen zulässigen Aktiva und Passiva	-	-
Aufwendungen aus Finanzierungsverbindlichkeiten	-	-
Sonstige Finanzaufwendungen	-2.610,41	-
Zwischensumme Aufwendungen aus Finanzgeschäften	-2.610,41	-
Nettofinanzerträge Insgesamt (A)	534.091,78	-
Sonstige Erträge:		
Kick-Backs von Verwaltungsgebühren zugunsten des OGA	-	-
Auszahlungen als Kapital- oder Performancegarantie	-	-
Sonstige Erträge	-	-
Sonstige Aufwendungen:		
Verwaltungsgebühren der Verwaltungsgesellschaft	-1.372.207,59	-
Kosten für Abschlussprüfung und Analysen für Private Equity-Fonds	-	-
Steuern und Abgaben	-	-
Sonstige Aufwendungen	-	-
Zwischensumme Sonstige Erträge und Sonstige Aufwendungen (B)	-1.372.207,59	-
Zwischensumme Nettoerträge vor Rechnungsabgrenzungsposten C = A - B	-838.115,81	-
Abgrenzung der Nettoerträge des Geschäftsjahres (D)	28.202,04	-
Zwischensumme Nettoerträge I = C + D	-809.913,77	-

⁽¹⁾ Gemäß den Grundsätzen der steuerlichen Transparenz konnten die Erträge aus Anteilen von OGA anhand der zugrunde liegenden Erträge aufbereitet werden.

* Für das erste Geschäftsjahr ist keine Pro-Forma-Darstellung der Finanzberichte für das Vorjahr vorgeschrieben. Die Finanzberichte für das Vorjahr und eine Erläuterung der Art der Änderungen zwischen den beiden Darstellungen sind im Anhang enthalten.

Gewinn- und -Verlustrechnung (Fortsetzung)

	28.2.2025	*29.2.2024
Währung	EUR	EUR
Realisierte Nettogewinne/-verluste vor Rechnungsabgrenzungsposten:		
Realisierte Nettogewinne/-verluste	12.442.395,40	-
Kosten für externe Transaktionen und Veräußerungskosten	-17.459,32	-
Research-Kosten	-	-
Anteil der an Versicherungen zurückgegebenen realisierten Gewinne	-	-
Erhaltene Versicherungsleistungen	-	-
Erhaltene Auszahlungen als Kapital- oder Performancegarantie	-	-
Zwischensumme realisierte Nettogewinne/-verluste vor Rechnungsabgrenzungsposten E	12.424.936,08	-
Rechnungsabgrenzungen der realisierten Nettogewinne oder -verluste F	-327.045,58	-
Realisierte Nettogewinne oder -verluste II = E + F	12.097.890,50	-
Nicht realisierte Nettogewinne/-verluste vor Rechnungsabgrenzungsposten:		
Veränderung der nicht realisierten Gewinne oder Verluste einschl. Wechselkursdifferenzen bei den zulässigen Aktiva	666.280,39	-
Wechselkursdifferenzen bei Finanzkonten in Fremdwährung	-	-
Zu vereinnahmende Auszahlungen als Kapital- oder Performancegarantie	-	-
Anteil der an Versicherungen zurückgegebenen nicht realisierten Gewinne	-	-
Zwischensumme nicht realisierte Nettogewinne/-verluste vor Rechnungsabgrenzungsposten G	666.280,39	-
Rechnungsabgrenzungen der nicht realisierten Nettogewinne/-verluste H	-207.713,62	-
Nicht realisierte Nettogewinne/-verluste III = G + H	458.566,77	-
Anzahlungen:		
Geleistete Anzahlungen auf die Nettoerträge für das Geschäftsjahr J	-	-
Geleistete Anzahlungen auf realisierte Nettogewinne/-verluste für das Geschäftsjahr K	-	-
Summe der geleisteten Anzahlungen für das Geschäftsjahr IV = J + K	-	-
Steuern vom Einkommen und Ertrag V	-	-
Nettoergebnis I + II + III - IV - V	11.746.543,50	-

* Für das erste Geschäftsjahr ist keine Pro-Forma-Darstellung der Finanzberichte für das Vorjahr vorgeschrieben. Die Finanzberichte für das Vorjahr und eine Erläuterung der Art der Änderungen zwischen den beiden Darstellungen sind im Anhang enthalten.

ANHANG

The bottom half of the page features abstract, layered blue geometric shapes. These shapes are composed of various polygons and lines, creating a sense of depth and movement. The colors range from a light, airy blue to a more saturated, medium blue. The shapes appear to be layered, with some overlapping others, and they generally trend upwards from left to right, mirroring the overall aesthetic of the document.

VERWALTUNGSSTRATEGIE UND -PROFIL

Anlageziel:

Der FCP ist ein aktiv verwalteter Investmentfonds (OGAW), dessen Anlagestrategie zwar von der Wertentwicklung der internationalen Aktienmärkte abhängt, er kann jedoch in erheblichem Maße von dieser Wertentwicklung abweichen.

Das Anlageziel des FCP besteht darin, in zwei Kategorien von Anlagen zu investieren: *riskante und risikolose Anlagen*. Hierzu setzt er eine von der Wertsicherungsstrategie der Portfolioversicherung abgeleitete Verwaltungstechnik ein (die im nachfolgenden Abschnitt „Anlagestrategie“ ausführlicher beschrieben ist).

Die riskanten Anlagen („*riskanten Anlagen*“) ermöglichen dem FCP eine Exposure in hochgradig diversifizierten Korb aus internationalen Aktien, die an den geregelten Märkten der Industrieländer notiert werden, ohne Beschränkung in Bezug auf die Marktkapitalisierung.

Die risikolosen Anlagen („*risikolosen Anlagen*“) ermöglichen dem FCP eine Exposure in Geldmarktinstrumenten und/oder Schuldtiteln, um den Anteilhabern an jedem letzten *Werktag* jedes Monats einen Nettoinventarwert von mindestens 80% des am letzten *Werktag* des Vormonats festgestellten Nettoinventarwerts zu bieten.

Der am letzten *Werktag* des ersten Monats berechnete *Nettoinventarwert* ist in Höhe von 80% des *ursprünglichen Nettoinventarwerts* abgesichert.

Der FCP wurde für eine Dauer von 99 Jahren aufgelegt. Sollte er vorzeitig aufgelöst werden, muss das Auflösungsdatum einem *Garantiedatum* entsprechen.

AUFSTELLUNG DER CHARAKTERISTISCHEN ELEMENTE DER LETZTEN FÜNF GESCHÄFTSJAHRE

Ausgedrückt in EUR	28.2.2025	29.2.2024	28.2.2023	28.2.2022	26.2.2021
Nettogesamtvermögen	91.742.210,07	83.865.610,52	71.655.127,49	73.736.385,20	63.600.937,13
	28.2.2025	29.2.2024	28.2.2023	28.2.2022	26.2.2021
THESAURIERENDE ANTEILE					
FR0010536821					
Nettovermögen	91.742.210,07	83.865.610,52	71.655.127,49	73.736.385,20	63.600.937,13
Anzahl der Anteile oder Aktien	399.997,00	419.348,000	425.911,000	417.647,000	418.455,000
Nettoinventarwert pro Anteil	229,35	199,99	168,23	176,55	151,98
Ausschüttung je Anteil auf den Nettoertrag (einschließlich Anzahlungen)	-	-	-	-	-
Ausschüttung pro Anteil auf realisierte Nettogewinne/-verluste (einschließlich Anzahlungen)	-	-	-	-	-
Auf die Anteilinhaber übertragene Steuergutschrift pro Anteil (natürliche Personen) ⁽¹⁾	-	-	-	-	-
Thesaurierung pro Anteil ⁽²⁾	28,22	43,07	-2,99	4,94	12,26

⁽¹⁾ In Anwendung der Steuervorschrift des französischen Steuerbehörde vom 4. März 1993 wird die Steuergutschrift je Anteil am Tag der Dividendenausschüttung durch Verteilung des Gesamtbetrags der Steuergutschriften auf die an diesem Tag umlaufenden Anteile ermittelt.

⁽²⁾ Die Beträge der Ausschüttung je Anteil, der Thesaurierung je Anteil und der Steuergutschriften sind in der Rechnungswährung des OGA ausgewiesen. Die Thesaurierung je Anteil entspricht der Summe des Ertrags sowie der Nettogewinne und -verluste aller umlaufenden Anteile. Diese Berechnungsmethode wird seit dem 1. Januar 2013 angewendet.

BILANZIERUNGS- UND BEWERTUNGSMETHODEN

Der Jahresabschluss wird erstmals in der Form vorgelegt, die in der Verordnung ANC Nr. 2020-07 in ihrer durch die Verordnung ANC Nr. 2022-03 abgeänderten Fassung vorgeschrieben ist.

Änderungen der Rechnungslegungsmethoden einschließlich der Darstellung in Bezug auf die Anwendung der neuen Rechnungslegungsverordnung betreffend die Jahresabschlüsse von Organismen für gemeinsame Anlagen mit variablem Kapital (Verordnung ANC Nr. 2020-07 in ihrer abgeänderten Fassung).

Diese neue Verordnung schreibt Änderungen der Rechnungslegungsmethoden vor, darunter Modifikationen der Darstellung des Jahresabschlusses. Daher ist ein Vergleich mit dem Abschluss des Vorjahres nicht möglich.

Gemäß Artikel 3 Absatz 2 der Verordnung ANC Nr. 2020-07 werden in den Finanzberichten somit die Daten des Vorjahres nicht dargestellt; die Finanzberichte des Vorjahres sind im Anhang enthalten.

Die Änderungen der Darstellung betreffen hauptsächlich:

- die Bilanzstruktur, die künftig nach zulässigen Arten von Aktiva und Passiva, einschließlich Krediten und Darlehen, dargestellt wird;
- die Struktur der Gewinn- und Verlustrechnung wurde grundlegend geändert. Die Gewinn- und Verlustrechnung beinhaltet insbesondere: Wechselkursdifferenzen bei Finanzkonten, nicht realisierte Gewinne und Verluste, realisierte Gewinne und Verluste sowie Transaktionskosten;
- die Löschung der Aufstellung der außerbilanziellen Posten (ein Teil der Informationen zu den Elementen in dieser Tabelle sind künftig im Anhang aufgeführt);
- die Annullierung der Möglichkeit eines Ausweises der enthaltenen Kosten zum Einstandspreis (nicht rückwirkend für Fonds, die bisher die Methode der enthaltenen Kosten anwenden);
- die Trennung von Wandelanleihen von den anderen Anleihen sowie ihre jeweiligen Buchungen;
- eine neue Klassifizierung der im Portfolio gehaltenen Zielfonds nach dem Modell: OPCVM/ FIA / Sonstige;
- den Ausweis von Engagements in Devisentermingeschäften, der nicht mehr in der Bilanz erfolgt, sondern außerbilanziell, wobei Informationen über die Devisentermingeschäfte in einem besonderen Teil enthalten sind;
- die Ergänzung von Informationen über direkte und indirekte Engagements an den verschiedenen Märkten;
- die Darstellung des Wertpapierbestands, der künftig zwischen zulässigen Aktiva und Passiva und Finanztermingeschäften unterscheidet;
- die Einführung eines einheitlichen Modells zur Darstellung aller Arten von OPC;
- die Annullierung der Zusammenführung von Konten bei Fonds mit Teilfonds.

Im Geschäftsjahr angewandte Bilanzierungs- und Bewertungsmethoden

Es kommen die allgemeinen Grundsätze ordnungsgemäßer Buchführung zur Anwendung (vorbehaltlich vorstehend beschriebener Änderungen):

- den tatsächlichen Verhältnissen entsprechende Darstellung, Vergleichbarkeit, Fortführung der Unternehmenstätigkeit,
- Stetigkeit in Darstellung und Bewertung, Bilanzwahrheit,
- Vorsicht,
- Kontinuität der Bewertungsmethoden von Geschäftsjahr zu Geschäftsjahr.

Der Ausweis der Erträge aus fest verzinslichen Wertpapieren erfolgt nach der Methode der vereinnahmten Kupons.

Zugänge und Abgänge von Wertpapieren werden ohne Berücksichtigung der Kosten ausgewiesen (zuvor erfolgte der Ausweis unter Berücksichtigung dieser Kosten zum Kauf- oder Verkaufspreis der Wertpapiere. Diese Möglichkeit ist laut Verordnung ANC Nr. 2020-07 künftig untersagt.

Die Dauer des Geschäftsjahres beträgt 12 Monate.

Vorschriften zur Bewertung der Vermögenswerte

Die Bewertung der Vermögenswerte des FCP erfolgt gemäß den geltenden Gesetzen und Vorschriften, insbesondere aber gemäß den Vorschriften der Verordnung des Ausschusses für Rechnungslegungsnormen (*Comité de la Réglementation Comptable*) Nr. 2014-01 vom 14. Januar 2014 in Bezug auf den Kontenplan von Organismen für gemeinsame Anlagen mit variablem Kapital.

Die Bewertung von Finanzinstrumenten, die an geregelten Märkten gehandelt werden, erfolgt anhand ihres Schlusskurses am Tag der Nettoinventarwertberechnung. Werden diese Finanzinstrumente an mehreren geregelten Märkten gleichzeitig gehandelt, wird der Schlusskurs des Marktes berücksichtigt, der als Hauptmarkt dieser Instrumente gilt.

Die Bewertung der folgenden Finanzinstrumente, die nicht Gegenstand umfangreicher Transaktionen an einem geregelten Markt sind, erfolgt anhand der nachstehend beschriebenen Sonderverfahren:

- Die Bewertung handelbarer Schuldtitel mit einer Restlaufzeit von höchstens 3 Monaten zum Zeitpunkt ihres Erwerbs erfolgt nach der linearen Methode, indem die Differenz zwischen Kaufpreis und Rückzahlungswert linear auf die Restlaufzeit verteilt wird.

Die *Verwaltungsgesellschaft* behält sich im Falle einer besonderen Sensitivität gegenüber Marktrisiken (Zinsrisiken usw.) jedoch die Möglichkeit vor, die Bewertung dieser Schuldtitel anhand der Barwertmethode vorzunehmen, wobei der Zinssatz vergleichbarer Wertpapieremissionen zugrunde gelegt wird, auf den ein Differenzbetrag in Abhängigkeit von den spezifischen Risikomerkmale des Emittenten zur Anwendung kommt.

- Die Bewertung handelbarer Schuldtitel mit einer Restlaufzeit von über 3 Monaten zum Zeitpunkt ihres Erwerbs, deren Restlaufzeit zum Stichtag der Nettoinventarwertermittlung aber höchstens 3 Monate beträgt, erfolgt nach der linearen Methode, indem die Differenz zwischen dem zuletzt ermittelten Barwert und dem Rückzahlungswert linear auf die Restlaufzeit verteilt wird. Die *Verwaltungsgesellschaft* behält sich im Falle einer besonderen Sensitivität gegenüber Marktrisiken (Zinsrisiken usw.) jedoch die Möglichkeit vor, die Bewertung dieser Schuldtitel anhand der Barwertmethode vorzunehmen, wobei der Zinssatz vergleichbarer Wertpapieremissionen zugrunde gelegt wird, auf den ein Differenzbetrag in Abhängigkeit von den spezifischen Risikomerkmale des Emittenten zur Anwendung kommt.

- Die Bewertung handelbarer Schuldtitel, deren Restlaufzeit zum Stichtag der Nettoinventarwertermittlung über 3 Monate beträgt, erfolgt nach der Barwertmethode, wobei der Zinssatz vergleichbarer Wertpapieremissionen zugrunde gelegt wird, auf den ein Differenzbetrag in Abhängigkeit von den spezifischen Risikomerkmale des Emittenten zur Anwendung kommt.

Die Bewertung von an organisierten Märkten gehandelten unbedingten Finanzinstrumenten erfolgt anhand ihres Kompensationskurses am Tag der Nettoinventarwertberechnung. Die Bewertung von an organisierten Märkten gehandelten bedingten Finanzinstrumenten erfolgt zu ihrem Marktwert, der am Tag der Nettoinventarwertberechnung festgestellt wurde. Die Bewertung von außerbörslich gehandelten bedingten oder unbedingten Finanzterminstrumenten erfolgt anhand des Preises, der von der Gegenpartei des Finanzinstruments mitgeteilt wird. Die *Verwaltungsgesellschaft* führt ihrerseits eine unabhängige Überprüfung dieser Bewertung durch.

Die Bewertung von Einlagen erfolgt zu ihrem Nominalwert, zuzüglich der entsprechenden aufgelaufenen Zinsen.

Die Bewertung von Bezugsrechten, Kassenscheinen, Solawechseln und Hypothekenswechseln erfolgt zu ihrem wahrscheinlichen Veräußerungswert unter der Verantwortung der *Verwaltungsgesellschaft*.

Die Bewertung von befristeten Käufen und Verkäufen von Wertpapieren erfolgt zu ihrem Marktpreis.

Die Bewertung von an einem geregelten Markt gehandelten Finanzinstrumenten, deren Kurs nicht festgestellt oder berichtigt wurde, erfolgt anhand ihres wahrscheinlichen Veräußerungswerts unter der Verantwortung der *Verwaltungsgesellschaft*.

Die Bewertung von Finanzinstrumenten, die auf eine andere als die Referenzwährung des FCP lauten, erfolgt auf der Grundlage der Wechselkurse, die von der Europäischen Zentralbank am Tag der Nettoinventarwertberechnung des FCP veröffentlicht wurden.

Bewertung der OGAW:

Zum Zeitpunkt der Erstellung dieses Prospekts beruhen die letzten bekannten Nettoinventarwerte der OGAW für ein bestimmtes Datum nicht alle auf ein und demselben Referenzdatum für den Marktpreis. De facto benötigen einige OGAW und AIF des Korbs mehr Zeit für die Berechnung ihres Nettoinventarwerts als andere.

Würde die *Verwaltungsgesellschaft* systematisch den letzten bekannten Nettoinventarwert aller OGAW und AIF verwenden, könnte sie die Einhaltung des Grundsatzes der Gleichbehandlung der Anteilhaber nicht garantieren, da der Nettoinventarwert des FCP von der Uhrzeit der Veröffentlichung der Nettoinventarwerte der OGAW und AIF des Korbs abhängt. Bei Zeichnungen oder Rücknahmen wäre die *Verwaltungsgesellschaft* faktisch nicht in der Lage, Käufe und Verkäufe für die OGAW und AIF in einer Art und Weise durchzuführen, die eine Ausführung zum gleichen Preis wie dem für die Bewertung zugrunde gelegten ermöglichen würde.

Die *Verwaltungsgesellschaft* behält sich daher das Recht vor, zu einem bestimmten Bewertungsdatum nicht die letzten bekannten Nettoinventarwerte der OGAW, sondern diejenigen zu verwenden, die ihr die Einhaltung des Grundsatzes der Gleichbehandlung der Anteilhaber ermöglichen. Hat die *Verwaltungsgesellschaft* Aufträge für OGAW und AIF erteilt, um Zeichnungs-/Rücknahmeaufträge im FCP ausführen zu können, werden diejenigen Nettoinventarwerte zur Bewertung des FCP verwendet, zu denen diese Aufträge ausgeführt wurden. Hat die *Verwaltungsgesellschaft* keine Aufträge erteilt, werden die Nettoinventarwerte zur Bewertung des FCP verwendet, zu denen von ihr theoretisch erteilte Aufträge zur Abwicklung von Zeichnungs-/Rücknahmeaufträgen ausgeführt worden wären.

Bilanzierung der Transaktionskosten

Bei der gewählten Bilanzierungsmethode werden die Transaktionskosten nicht berücksichtigt.

Rechnungswährung

Euro.

Angabe der den Anteilhabern mitzuteilenden buchhalterischen Änderungen

- Änderung erfolgt am: Keine.
- Bevorstehende Änderung am: Keine.

Angabe der den Anteilhabern mitzuteilenden sonstige Änderungen *(nicht vom Abschlussprüfer geprüft)*

- Änderung erfolgt am: Keine.
- Bevorstehende Änderung am: Keine.

Angabe und Begründung von Änderungen der Schätzungen und der Anwendungsmodalitäten

Keine.

Angabe der Art der im Geschäftsjahr berichtigten Fehler

Entfällt.

Angabe der mit jeder Anteilsklasse verbundenen Rechte und Bedingungen

Thesaurierender FCP. Bilanzierung nach der Methode der vereinnahmten Zinsen (*méthode des coupons encaissés*).

ENTWICKLUNG DES EIGENKAPITALS IM GESCHÄFTSJAHR

	28.2.2025	*29.2.2024
Währung	EUR	EUR
Eigenkapital zum Beginn des Geschäftsjahres	83.865.610,52	-
Veränderungen im Geschäftsjahr:		
Zeichnungen (einschließlich des dem OGA zufließenden Ausgabeaufschlags) ⁽¹⁾	9.382.404,78	-
Rücknahmen (abzüglich der dem OGA zufließenden Rücknahmegebühr)	-13.758.905,89	-
Nettoerträge des Geschäftsjahres vor Rechnungsabgrenzungsposten	-838.115,81	-
Realisierte Nettogewinne/-verluste vor Rechnungsabgrenzungsposten	12.424.936,08	-
Veränderung der nicht realisierten Nettogewinne/-verluste vor Rechnungsabgrenzungsposten	666.280,39	-
Ausschüttung im vorherigen Geschäftsjahr aus Nettoerträgen	-	-
Ausschüttung des vorherigen Geschäftsjahres aus Nettogewinnen/-verlusten	-	-
Während des Geschäftsjahres geleistete Anzahlungen aus Nettoerträgen	-	-
Während des Geschäftsjahres geleistete Anzahlungen auf realisierte Nettogewinne/-verluste	-	-
Sonstige Elemente	-	-
Eigenkapital zum Ende des Geschäftsjahres (= Nettovermögen)	91.742.210,07	-

* Für das erste Geschäftsjahr ist keine Pro-Forma-Darstellung der Finanzberichte für das Vorjahr vorgeschrieben. Die Finanzberichte für das Vorjahr und eine Erläuterung der Art der Änderungen zwischen den beiden Darstellungen sind im Anhang enthalten.

⁽¹⁾ Diese Rubrik enthält auch die Beträge, die bei Private Equity-Gesellschaften abgerufenen Beträge.

ENTWICKLUNG DER ANZAHL DER ANTEILE ODER AKTIEN IM GESCHÄFTSJAHR

THESAURIERENDE ANTEILE

FR0010536821	In Anteilen oder Aktien	Als Betrag
Im Geschäftsjahr gezeichnete Anteile oder Aktien	44.762	9.382.404,78
Im Geschäftsjahr zurückgenommene Anteile oder Aktien	-64.113	-13.758.905,89
Nettosaldo der Zeichnungen/Rücknahmen	-19.351	-4.376.501,11
THESAURIERENDE ANTEILE		Als Betrag
Erhaltene Ausgabeaufschläge		-
Erhaltene Rücknahmegebühren		-
Erhaltene Gebühren insgesamt		-

AUFSCHLÜSSELUNG DES NETTOVERMÖGENS NACH ART DER ANTEILE ODER AKTIEN

ISIN-Code des Anteils/der Aktie	Bezeichnung des Anteils/der Aktie	Verwendung der ausschüttungs-fähigen Beträge	Währung des Anteils / der Aktie	Nettovermögen des Anteils/der Aktie <i>EUR</i>	Anzahl der Anteile oder Aktien	Nettoinventarwert in der Währung des Anteils/der Aktie
FR0010536821	THESAURIERENDE ANTEILE	Thesaurierend	EUR	91.742.210,07	399.997	229,35

DIREKTE UND INDIREKTE ENGAGEMENTS AN DEN VERSCHIEDENEN MÄRKTEN

Direktes Engagement am Aktienmarkt (ohne Wandelanleihen)

In tausend EUR	Exposure +/-	Aufschlüsselung bedeutender Engagements nach Ländern				
		USA +/-	Deutschland +/-	Schweiz +/-	Dänemark +/-	Niederlande +/-
Aktiva						
Aktien und aktienähnliche Wertpapiere	63.592,74	23.238,98	13.925,11	13.201,65	5.794,00	5.543,76
Befristete Wertpapiergeschäfte	-	-	-	-	-	-
Passiva						
Veräußerungen von Finanzinstrumenten	-	-	-	-	-	-
Befristete Wertpapiergeschäfte	-2.478,18	-2.190,82	-	-	-	-
Außerbilanzielle Posten						
Futures	-	K. A.	n/a	n/a	Entfällt	n/a
Optionen	-	K. A.	K. A.	K. A.	K. A.	K. A.
Swaps	201.757,92	K. A.	K. A.	K. A.	K. A.	K. A.
Sonstige Finanzinstrumente	-	K. A.	K. A.	K. A.	K. A.	K. A.
Insgesamt	262.872,48	K. A.	K. A.	K. A.	K. A.	K. A.

Engagement am Wandelanleihenmarkt nach Land und Restlaufzeit der Positionen

In tausend EUR	Exposure +/-	Aufschlüsselung des Engagements nach Restlaufzeit			Aufschlüsselung nach Höhe des Delta	
		<= 1 Jahr	<X< = 5 Jahre	> 5 Jahre	<= 0,6	0,6 <X< = 1
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
Sonstige	-	-	-	-	-	-
Insgesamt	-	-	-	-	-	-

Direkte Exposure an den Zinsmärkten *(ohne Wandelanleihen)*

In tausend EUR	Exposure +/-	Aufschlüsselung nach Art der Zinsen			
		Fester Zinssatz +/-	Variabler oder veränderlicher Zinssatz +/-	Indexierter Zinssatz +/-	Sonstige Zinsen ohne Gegenpartei +/-
Aktiva					
Einlagen	-	-	-	-	-
Anleihen	-	-	-	-	-
Schuldtitel	9.957,80	9.957,80	-	-	-
Befristete Wertpapiergeschäfte	-	-	-	-	-
Geldkonten	6.749,90	-	-	-	6.749,90
Passiva					
Veräußerungen von Finanzinstrumenten	-	-	-	-	-
Befristete Wertpapiergeschäfte	-	-	-	-	-
Geldkonten	-	-	-	-	-
Darlehen	-	-	-	-	-
Außerbilanzielle Posten					
Futures	K. A.	-	-	-	-
Optionen	K. A.	-	-	-	-
Swaps	K. A.	-	-	-	-
SONSTIGE FINANZINSTRUMENTE	K. A.	-	-	-	-
Insgesamt	K. A.	9.957,80	-	-	6749,90

Direkte Exposure an den Zinsmärkten *(ohne Wandelanleihen)* Aufschlüsselung nach Fälligkeit

Aufschlüsselung nach Restlaufzeiten								
<i>In tausend</i>	<i>EUR</i>	0 - 3 Monate +/-	3 - 6 Monate +/-	6 Monate - 1 Jahr +/-	1 - 3 Jahre +/-	3 - 5 Jahre +/-	5 - 10 Jahre +/-	>10 Jahre +/-
Aktiva								
Einlagen		-	-	-	-	-	-	-
Anleihen		-	-	-	-	-	-	-
Schuldtitel		9.957,80	-	-	-	-	-	-
Befristete Wertpapiergeschäfte		-	-	-	-	-	-	-
Geldkonten		6.749,90	-	-	-	-	-	-
Passiva								
Veräußerungen von Finanzinstrumenten		-	-	-	-	-	-	-
Befristete Wertpapiergeschäfte		-	-	-	-	-	-	-
Geldkonten		-	-	-	-	-	-	-
Darlehen		-	-	-	-	-	-	-
Außerbilanzielle Posten								
Futures		-	-	-	-	-	-	-
Optionen		-	-	-	-	-	-	-
Swaps		-	-	-	-	-	-	-
Sonstige Finanzinstrumente		-	-	-	-	-	-	-
Insgesamt		16.707,70	-	-	-	-	-	-

Direktes Engagement am Devisenmarkt

<i>In tausend EUR</i>	USD +/-	CHF +/-	DKK +/-	Währung 04 +/-	Sonstige Währungen +/-
Aktiva					
Einlagen	-	-	-	-	-
Aktien und aktienähnliche Wertpapiere	28.347,59	8.880,5	5.794,00	-	-
Anleihen und anleihenähnliche Wertpapiere	-	-	-	-	-
Schuldtitel	-	-	-	-	-
Befristete Wertpapiergeschäfte	-	-	-	-	-
Forderungen	-	-	-	-	-
Geldkonten	-	-	-	-	-
Passiva					
Veräußerungen von Finanzinstrumenten	-	-	-	-	-
Befristete Wertpapiergeschäfte	-2.190,82	-	-	-	-
Verbindlichkeiten	-	-	-	-	-
Geldkonten	-	-	-	-	-
Darlehen	-	-	-	-	-
Außerbilanzielle Posten					
Zu erhaltende Währungen	-	-	-	-	-
Zu liefernde Währungen	-	-	-	-	-
Futures, Optionen, Swaps	-	-	-	-	-
Sonstige Geschäfte	-	-	-	-	-
Insgesamt	26.156,77	8.880,5	5.794,00	-	-

Direktes Engagement an den Kreditmärkten

<i>In tausend EUR</i>	Invest. Grade +/-	Non Invest. Grade +/-	Nicht geratet +/-
Aktiva			
Wandelanleihen	-	-	-
Anleihen und anleihenähnliche Wertpapiere	-	-	-
Schuldtitel	9.957,80	-	-
Befristete Wertpapiergeschäfte	-	-	-
Passiva			
Veräußerungen von Finanzinstrumenten	-	-	-
Befristete Wertpapiergeschäfte	-	-	-
Außerbilanzielle Posten			
Kreditderivate	-	-	-
Nettosaldo	9.957,80	-	-

Verfahren:

Für die Klassifizierung von Wertpapieren mit direktem Engagement an den Zinsmärkten ⁽¹⁾ in die Ratingkategorien „INVESTMENT GRADES“, „NON INVESTMENT GRADES“ und „NICHT GERATET“ werden die maßgebenden Finanzratings herausgezogen.

Für jedes Instrument wird das Rating anhand des Algorithmus des zweitbesten externen Ratings ermittelt.

Das zweitbeste Rating bedeutet, dass der numerische Wert des Ratings dem zweitbesten aller gefundenen Rating entspricht.

Falls nur ein Rating verfügbar ist, wird dieses Rating als das zweitbeste berücksichtigt.

Sollte kein Rating verfügbar sein, ist das Rating des Emittenten zu berücksichtigen.

(1) Die Aktiv- und Passivzinsen werden zum Nettoinventarwert ausgewiesen, um die Übereinstimmung mit den Bilanzposten zu sicherzustellen. Bei den befristeten Wertpapiergeschäften werden nur befristete Veräußerungen ausgewiesen (in Pension gegebene Wertpapiere, verliehene Wertpapiere und als Sicherheit hinterlegte Wertpapiere).

Befristete Wertpapierkäufe sind ausgeschlossen.

Engagement in Transaktionen, an denen eine Gegenpartei beteiligt ist

<i>In tausend Euro</i>	Barwert einer Forderung	Barwert einer Verbindlichkeit
Auf der Aktivseite der Bilanz ausgewiesene Geschäfte		
Einlagen	-	-
Finanztermininstrumente ohne Clearing		
SOCIETE GENERALE PARIS	65.141,59	-
Forderungen aus in Pension genommenen Wertpapieren	-	-
Forderungen aus als Garantie hinterlegten Wertpapieren	-	-
Forderungen aus verliehenen Wertpapieren	-	-
Entlehene Wertpapiere	-	-
Als Garantie erhaltene Wertpapiere		
SOCIETE GENERALE PARIS	2.478,18	-
In Pension gegebene Wertpapiere	-	-
Forderungen		
Barsicherheit	-	-
Geleistete Barsicherheiten	-	-
Auf der Passivseite der Bilanz ausgewiesene Geschäfte		
Verbindlichkeiten für in Pension gegebenen Wertpapieren	-	-
Finanztermininstrumente ohne Clearing		
SOCIETE GENERALE PARIS	-	61.204,67
Verbindlichkeiten		
Barsicherheiten	-	-

Indirekte Engagements für Multi-Manager-Fonds

ISIN-Code	Bezeichnung des Fonds	Verwaltungsgesellschaft	Orientierung der Anlagen / Verwaltungsstil	Domizilie- des rungsland OGA- des Fonds	Währung	Höhe des Engagements
FR0010315770	MULTI UNITS FRANCE SICAV AMUNDI MSCI WORLD UCITS EFF	Amundi Asset Management	Indexfonds (ETF)	Frankreich	EUR	6.762.736,00
LU2572257124	AMUNDI INDEX SOLUTIONS SICAV AMUNDI MSCI WORLD III ETF	Amundi Luxembourg S.A	Aktien	Luxemburg	EUR	6.190.593,00
Insgesamt						12.953.329,00

SONSTIGE ANGABEN ZUR BILANZ UND ZUR GEWINN- UND VERLUSTRECHNUNG

Forderungen und Verbindlichkeiten - Aufschlüsselung nach Art

	28.2.2025
Forderungen	
Forderungen aus Zeichnungen	-
Unverbindliche Zeichnungen	-
Zu vereinnahmende Zinsen	-
Verkäufe mit verzögerter Abrechnung	-
Getilgte Anleihen	-
Hinterlegung von Garantien	-
Verwaltungsgebühren	-
Sonstige Verbindlichkeiten	-
Forderungen insgesamt	-
Verbindlichkeiten	
Verbindlichkeiten aus Zeichnungen	-
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen	-
Käufe mit verzögerter Abrechnung	-
Verwaltungsgebühren	-2.735.813,00
Hinterlegung von Garantien	-232.725,96
Sonstige Forderungen	-1.763,95
Verbindlichkeiten insgesamt	-
Forderungen und Verbindlichkeiten insgesamt	- 2.970.302,91

Verwaltungsgebühren, sonstige Kosten und Gebühren

Betriebs- und Verwaltungskosten:

Diese Kosten decken alle dem FCP direkt berechneten Kosten mit Ausnahme der Transaktionskosten ab. Die Transaktionskosten umfassen die Kosten für den Wertpapierhandel (Maklerprovision, Börsenumsatzsteuern etc.) sowie gegebenenfalls die Umsatzprovision, die u.a. von der Depotbank und der *Verwaltungsgesellschaft* erhoben werden kann.

Die Betriebs- und Verwaltungskosten können sich um folgende Kostenelemente erhöhen:

- Performancegebühren. Diese dienen zur Vergütung der *Verwaltungsgesellschaft*, sofern der FCP seine Anlageziele übertrifft. Sie werden somit dem FCP berechnet;
- Umsatzprovisionen, die dem FCP berechnet werden;
- direkte und indirekte Betriebskosten/-gebühren für befristete Käufe und Verkäufe von Wertpapieren. Weitere Einzelheiten zu den dem FCP effektiv in Rechnung gestellten Gebühren und Provisionen sind dem Kapitel „Kosten“ der Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) zu entnehmen.

Dem FCP berechnete Kosten	Bemessungsgrundlage	Satz und Staffelung
Von der Portfoliomanagementgesellschaft unabhängige externe Kosten für die finanzielle und administrative Verwaltung (Abschlussprüfung, Verwahrung, Vertrieb, Rechtskosten), inkl. Steuern ⁽¹⁾	Nettovermögen	Bis maximal 1,55% inkl. Steuern pro Jahr
Maximale indirekte Kosten (Verwaltungsprovisionen und -gebühren)	Nettovermögen	Maximal 2% inkl. Steuern pro Jahr
Umsatzprovisionen	Zahlbar bei jeder Transaktion	Entfällt
Performancegebühr	Nettovermögen	Entfällt
Direkte und indirekte Betriebskosten/-gebühren für befristete Käufe und Verkäufe von Wertpapieren	Betrag der mit diesen Transaktionen erzielten Erträge	Maximal 20% für die Verwaltungsgesellschaft Maximal 15% für den Vertreter (gegebenenfalls)

Die Research-Kosten sind nicht in diesen Kosten enthalten.

THESAURIERENDE ANTEILE

FR0010536821	28.2.2025
Fixe Gebühren	1.372.207,59
Fixe Gebühren in % aktuell	1,55
Variable Gebühren	-
Variable Gebühren in % aktuell	-
Retrozessionen von Verwaltungsgebühren	-

Erhaltene und geleistete Zusagen

Sonstige Zusagen (nach Art des Produkts)	28.2.2025
Erhaltene Garantien	
Davon als Garantie erhaltene, außerbilanzielle Finanzinstrumente	-
Gestellte Garantien	
Als Garantie gestellte, im ursprünglichen Posten beibehaltene Finanzinstrumente	-
Erhaltene, aber noch nicht gezogene Finanzierungszusagen	-
Gestellte, aber noch nicht gezogene Finanzierungszusagen	-
Sonstige außerbilanzielle Zusagen	-
Insgesamt	-

Befristete Käufe

Sonstige Zusagen (nach Art des Produkts)	28.2.2025
Erworbene Wertpapiere mit Rückkaufsrecht	-
In Pension genommene, gelieferte Wertpapiere	-
Entliehene Wertpapiere	-
Als Garantie erhaltene Wertpapiere	-

Instrumente verbundener Einheiten

	ISIN-Code	Bezeichnung	28.2.2025
	-		-
Insgesamt			-

Ermittlung und Aufschlüsselung der ausschüttungsfähigen Beträge

Verwendung der ausschüttungsfähigen Beträge

	28.2.2025	*29.2.2024
Währung		
Nettoerträge	-809.913,77	-
Geleistete Anzahlungen auf den Nettoertrag für das Geschäftsjahr (*)	-	-
Zu verwendender Ertrag des Geschäftsjahres (**)	-809.913,77	-
Saldovortrag	-	-
Aus dem Nettoertrag ausschüttungsfähige Beträge	-809.913,77	-
Insgesamt	-809.913,77	-

* Für das erste Geschäftsjahr ist keine Pro-Forma-Darstellung der Finanzberichte für das Vorjahr vorgeschrieben. Die Finanzberichte für das Vorjahr und eine Erläuterung der Art der Änderungen zwischen den beiden Darstellungen sind im Anhang enthalten.

THESAURIERENDE ANTEILE

FR0010536821	28.2.2025	*29.2.2024
Währung	EUR	EUR
Verwendung:		
Ausschüttung	-	-
Ergebnisvortrag des Geschäftsjahres	-	-
Thesaurierung	-809.913,77	-
Insgesamt	-809.913,77	-
*Angaben zu geleisteten Anzahlungen		
Betrag pro Anteil	-	-
Steuergutschriften insgesamt	-	-
Steuergutschriften pro Anteil	-	-
**Angaben zu ausschüttenden Anteilen/Aktien		
Anzahl der Anteile/Aktien	-	-
Nach Begleichung von Anzahlungen verbleibende Ausschüttung pro Anteil	-	-
Steuergutschriften aufgrund der Ergebnisausschüttung	-	-

* Für das erste Geschäftsjahr ist keine Pro-Forma-Darstellung der Finanzberichte für das Vorjahr vorgeschrieben. Die Finanzberichte für das Vorjahr und eine Erläuterung der Art der Änderungen zwischen den beiden Darstellungen sind im Anhang enthalten.

Verwendung der ausschüttungsfähigen Nettogewinne/-verluste

	28.2.2025	*29.2.2024
Währung	EUR	EUR
Nettogewinne/-verluste des Geschäftsjahres	12.097.890,50	-
Geleistete Anzahlungen auf realisierte Nettogewinne/-verluste des Geschäftsjahres (*)	-	-
Realisierte Nettogewinne/-verluste des Geschäftsjahres (**)	12.097.890,50	-
Nicht ausgeschüttete realisierte Nettogewinne/-verluste aus Vorperioden	-	-
Ausschüttungsfähige Beträge aus realisierten Gewinnen/-verlusten	12.097.890,50	-

* Für das erste Geschäftsjahr ist keine Pro-Forma-Darstellung der Finanzberichte für das Vorjahr vorgeschrieben. Die Finanzberichte für das Vorjahr und eine Erläuterung der Art der Änderungen zwischen den beiden Darstellung sind im Anhang enthalten.

THESAURIERENDE ANTEILE

FR0010536821	28.2.2025	*29.2.2024
Währung	EUR	EUR
Verwendung:		
Ausschüttung	-	-
Saldovortrag von realisierten Nettogewinnen/-verlusten	-	-
Thesaurierung	12.097.890,50	-
Insgesamt	12.097.890,50	-
(*) Angaben zu den geleistete Anzahlungen		
Geleistete Anzahlungen pro Anteil	-	-
(**) Angaben zu ausschüttenden Aktien/Anteilen, die ein Anrecht auf Ausschüttung gewähren		
Anzahl der Aktien/Anteile	-	-
Nach Begleichung von Anzahlungen verbleibende Ausschüttung pro Anteil	-	-

* Für das erste Geschäftsjahr ist keine Pro-Forma-Darstellung der Finanzberichte für das Vorjahr vorgeschrieben. Die Finanzberichte für das Vorjahr und eine Erläuterung der Art der Änderungen zwischen den beiden Darstellung sind im Anhang enthalten.

AUFSTELLUNG DER AKTIVA UND PASSIVA

Aufstellung der Bilanzposten (ohne FTIs)

Der in der Aufstellung angegebene Sektor entspricht der Hauptaktivität des Emittenten des Finanzinstruments. Die Information stammt aus dem veröffentlichten ICB-Code, sofern vorhanden.

Finanzinstrumente	Währung	Menge	Betrag	% NV
Aktien und aktienähnliche Wertpapiere			63.592.740,21	69,32
An einem geregelten oder gleichgestellten Markt gehandelte Aktien und ähnliche Wertpapiere			63.592.740,21	69,32
Luft- und Raumfahrt			98.596,15	0,11
TRANSDIGM	USD	75	98.596,15	0,11
Immobilien- und Schadenversicherung			1.449.500,19	1,58
ERIE INDEMNITY-A	USD	260	107.017,50	0,12
PROGRESSIVE CORP	USD	4.951	1.342.482,69	1,46
Medien und Entertainment			1.601.872,50	1,75
SPOTIFY TECHNOLOGY SA	USD	2.740	1.601.872,50	1,75
Automobilsektor			3.755.429,68	4,09
DR PORSCHE AKTIENGESELLSCHAFT PREFERRED STOCK	EUR	33.999	1.917.543,60	2,09
TESLA INC	USD	6.524	1.837.886,08	2,00
Banken			7.463.577,15	8,14
UBS GROUP INC NAMEN AKT	CHF	177.970	5.860.577,61	6,39
WELLS FARGO & CO	USD	21.286	1.602.999,54	1,75
Biotechnologie			6.895.508,37	7,52
BIOGEN INC	USD	356	48.094,23	0,05
INCYTE	USD	10.181	71.9522,60	0,79
MODERNA INC	USD	11.216	333.891,69	0,36
NOVONESIS A/S	DKK	99.471	5.793.999,85	6,32
Schuhe			1.481.139,20	1,61
ADIDAS NOM	EUR	6.016	1.481.139,20	1,61
Elektrische Komponenten und Ausrüstungen			132.047,31	0,14
AMPHENOL CORPORATION-A	USD	2.062	132.047,31	0,14
Baumaschinen			224.248,34	0,24
FERROVIAL SE	EUR	5.237	224.248,34	0,24
Wehrtechnik			2.976.220,50	3,24
RHEINMETALL AG	EUR	2.957	2.976.220,50	3,24
Nahrungsmittel-Einzel- und Großhändler			1.198.979,60	1,31
SYSCO CORP	USD	16.507	1.198.979,60	1,31
Baumärkte			252.455,54	0,28
HOME DEPOT INC	USD	252	96.099,23	0,11
LOWE'S COMPANIES INC	USD	654	156.356,31	0,17
Diversifizierte Handelsgesellschaften			5.730.131,19	6,25
AMAZON.COM INC	USD	28.073	5.730.131,19	6,25

Finanzinstrumente	Währung	Menge	Betrag	% NV
Unterhaltungselektronik			67.617,50	0,07
ROBLOX CORPORATION A	USD	1.105	67.617,50	0,07
Telekommunikationsausrüstungen			565.298,09	0,62
F5 INC	USD	353	99.257,49	0,11
MOTOROLA SOLUTIONS INC	USD	1.101	466.040,60	0,51
Elektronische Ausrüstungen			46.785,24	0,05
KEYSIGHT TECHNOLOGIES SHS WI INC	USD	305	46.785,24	0,05
Medizintechnik			365.121,05	0,40
DEXCOM INC	USD	4.297	365.121,05	0,40
Finanzdienstleistungen			1.257.507,20	1,37
DEUTSCHE BOERSE AG	EUR	5.006	1.257.507,20	1,37
Medizinischer Bedarf			3.506.737,36	3,82
ALCON INC	CHF	39.455	3.506.737,36	3,82
Finanzverwaltung			164.882,50	0,18
BLOCK INC	USD	2.626	164.882,50	0,18
Anlagenverwaltung			1.100.504,31	1,20
NORTHERN TRUST CORP	USD	10.384	1.100.504,31	1,20
Internet			3.573.178,82	3,89
ALPHABET INC	USD	4.796	785.252,77	0,85
PROSUS N V	EUR	66.395	2.787.926,05	3,04
Software			5.261.509,89	5,73
ANSYS	USD	1.663	532.879,57	0,58
BROADCOM INC	USD	9.929	1.903.981,22	2,07
SAP SE	EUR	10.647	2.824.649,10	3,08
Immobilienbeteiligungen und -entwicklung			1.820.913,78	1,98
LEG IMMOBILIEN SE	EUR	22.699	1.820.913,78	1,98
Pharmazeutik			347.408,79	0,38
ELI LILLY & CO	USD	118	104.456,10	0,11
PFIZER INC	USD	9.560	242.952,69	0,27
Nahrungsmittel			814.421,00	0,89
DSM FIRMENICH LTD	EUR	7.907	814.421,00	0,89
Rückversicherung			641.510,35	0,70
TALANX AG	EUR	7.319	641.510,35	0,70
Halbleiter			2.531.587,59	2,76
STMICROELECTRONICS NV	EUR	106.683	2.531.587,59	2,76
Wertpapierdienstleistungen			449.692,10	0,49
COINBASE GLOBAL INC	USD	2.169	449.692,10	0,49
Lieferdienste			1.235.630,00	1,35
FEDEX CORP	USD	4.888	1.235.630,00	1,35
Integrierte Erdöl- und Erdgasgesellschaften			79.001,48	0,09
EXXON MOBIL CORP	USD	738	79.001,48	0,09

Finanzinstrumente	Währung	Menge	Betrag	% NV
Drahtgebundene Telekommunikation			1.005.630,25	1,10
DEUTSCHE TELEKOM AG - NAMEN	EUR	28.939	1.005.630,25	1,10
SCHIFFSTRANSPORT			3.019.917,94	3,29
KUEHNE UND NAGEL INTERNATIONAL AG-NAMEN	CHF	13.650	3.019.917,94	3,29
Schuldtitel			9.957.800,00	10,85
An einem geregelten oder gleichgestellten Markt gehandelte Schuldtitel			9.957.800,00	10,85
Staat			9.957.800,00	10,85
FRANCE BONS DU TRESOR ZCP 07/05/2025	EUR	10.000.000	9.957.800,00	10,85
Anteile an OGA und Investmentfonds			12.953.329,00	14,12
OPCVM und vergleichbare Fonds anderer Mitgliedstaaten der Europäischen Union			12.953.329,00	14,12
AMUNDI INDEX SOLUTIONS SICAV AMUNDI MSCI WORLD III ETF	EUR	60.600	6.190.593,00	6,75
MULTI UNITS FRANCE SICAV AMUNDI MSCI WORLD UCITS EFF	EUR	18.800	6.762.736,00	7,37
An einem geregelten oder gleichgestellten Markt gehandelte Aktien und ähnliche Wertpapiere			2.478.179,25	2,70
Diversifizierte Handelsgesellschaften			629.900,08	0,69
AMAZON.COM INC	USD	3.086	629.900,08	0,69
Spezialvertrieb			142.707,52	0,16
DOLLAR TREE INC	USD	2.037	142.707,52	0,16
Unterhaltungselektronik			434.710,15	0,47
ROBLOX CORPORATION A	USD	7.104	434.710,15	0,47
Software			639.134,80	0,70
BROADCOM INC	USD	3.333	639.134,80	0,70
Wertpapierdienstleistungen			344.370,02	0,37
COINBASE GLOBAL INC	USD	1.661	344.370,02	0,37
Transport			287.356,68	0,31
BOLLORE SA	EUR	49.374	28.7356,68	0,31
Verbindlichkeiten aus in Pension erhaltenen Wertpapieren			-2.478.179,25	-2,70
Insgesamt			84.025.689,96	91,59

AUFSTELLUNG DER FTI (außer zur Absicherung einer Anteilskategorie verwendeter FTI)

Aufstellung der Devisentermingeschäfte

Bezeichnung des Instruments	In der Bilanz ausgewiesener Barwert		Betrag des Engagements in Euro (*)			
	Aktiva	Passiva	Zu erhaltende		Zu liefernde	
			Währun g	Betrag (*)	Währun g	Betrag (*)
-	-	-	-	-	-	-
Insgesamt	-	-	-	-	-	-

(*) Der Betrag wurde nach den Bestimmungen der Verordnung über die Darstellung von Engagements („règlement relatif à la présentation des expositions“) ermittelt.

Aufstellung der Finanztermininstrumente - Aktien

Bezeichnung des Instruments	Menge/ Nennwert	In der Bilanz ausgewiesener Barwert		Betrag des Engagements in Euro (*)	
		Aktiva	Passiva		+/-
Futures					
Zwischensumme				-	-
Optionen					
Zwischensumme				-	-
Swaps					
GAP FEES	1	-	90.105,44		1,00
PATTE BRIQUES SPREAD	62.000.000	64.978.876,80		-	62.000.000,00
PATTE BRIQUES VRAC	62.000.000		61.114.560,94		62.000.000,00
PATTE INDEXATION	77.757.917,52	162.714,98		-	77.757.917,52
Zwischensumme		65.141.591,78	61.204.666,38		201.757.918,52
Sonstige Instrumente					
Zwischensumme				-	-
Insgesamt		65.141.591,78	61.204.666,38		201.757.918,52

(*) Der Betrag wurde nach den Bestimmungen der Verordnung über die Darstellung von Engagements („règlement relatif à la présentation des expositions“) ermittelt.

Aufstellung der Finanztermininstrumente - Zinssätze

Bezeichnung des Instruments	Menge/ Nennwert	In der Bilanz ausgewiesener Barwert		Betrag des Engagements in Euro (*)	
		Aktiva	Passiva		+/-
Futures					
Zwischensumme				-	-

Bezeichnung des Instruments	Menge/ Nennwert	In der Bilanz ausgewiesener Barwert		Betrag des Engagements in Euro (*)
		Aktiva	Passiva	+/-
Optionen				
Zwischensumme		-	-	-
Swaps				
Zwischensumme		-	-	-
Sonstige Instrumente				
Zwischensumme		-	-	-
Summe		-	-	-

(*) Der Betrag wurde nach den Bestimmungen der Verordnung über die Darstellung von Engagements („règlement relatif à la présentation des expositions“) ermittelt.

Aufstellung der Terminfinanzinstrumente - Devisen

Bezeichnung des Instruments	Menge/ Nennwert	In der Bilanz ausgewiesener Barwert		Betrag des Engagements in Euro (*)
		Aktiva	Passiva	+/-
Futures				
Zwischensumme		-	-	-
Optionen				
Zwischensumme		-	-	-
Swaps				
Zwischensumme		-	-	-
Sonstige Instrumente				
Zwischensumme		-	-	-
Summe		-	-	-

(*) Der Betrag wurde nach den Bestimmungen der Verordnung über die Darstellung von Engagements („règlement relatif à la présentation des expositions“) ermittelt.

Aufstellung der Finanztermininstrumente - Kreditrisiko

Bezeichnung des Instruments	Menge/ Nennwert	In der Bilanz ausgewiesener Barwert		Betrag des Engagements in Euro (*)
		Aktiva	Passiva	+/-

Zwischensumme

-

-

-

Bezeichnung des Instruments	Menge/ Nennwert	In der Bilanz ausgewiesener Barwert		Betrag des Engagements in Euro (*)
		Aktiva	Passiva	+/-
Optionen				
Zwischensumme		-	-	-
Swaps				
Zwischensumme		-	-	-
Sonstige Instrumente				
Zwischensumme		-	-	-
Summe		-	-	-

(*) Der Betrag wurde nach den Bestimmungen der Verordnung über die Darstellung von Engagements („règlement relatif à la présentation des expositions“) ermittelt.

Aufstellung der Finanztermininstrumente - sonstige Engagements

Bezeichnung des Instruments	Menge/ Nennwert	In der Bilanz ausgewiesener Barwert		Betrag des Engagements in Euro (*)
		Aktiva	Passiva	+/-
Futures				
Zwischensumme		-	-	-
Optionen				
Zwischensumme		-	-	-
Swaps				
Zwischensumme		-	-	-
Sonstige Instrumente				
Zwischensumme		-	-	-
Summe		-	-	-

(*) Der Betrag wurde nach den Bestimmungen der Verordnung über die Darstellung von Engagements („règlement relatif à la présentation des expositions“) ermittelt.

AUFSTELLUNG DER DEWISENTERMINGESCHÄFTE

(die zur Absicherung einer Anteilsklasse verwendet werden)

Bezeichnung des Instruments	In der Bilanz ausgewiesener Barwert		Betrag des Engagements in Euro (*)			Abgesicherte Anteilsklasse
	Aktiva	Passiva	Zu erhaltende Währungen (+)	Zu liefernde Währungen (-)		
			Währung	Betrag (*)	Währung	Betrag (*)
-	-	-	-	-	-	-
Insgesamt	-	-	-	-	-	-

(*) Der Betrag wurde nach den Bestimmungen der Verordnung über die Darstellung von Engagements („règlement relatif à la présentation des expositions“) ermittelt.

AUFSTELLUNG DER FINANZTERMINGESCHÄFTE

(die zur Absicherung einer Anteilsklasse verwendet werden)

Bezeichnung des Instruments	Menge/ Nennwert	In der Bilanz ausgewiesener Barwert		Betrag des Engagements in Euro (*)		Abgesicherte Anteilsklasse
		Aktiva	Passiva		+/-	
Futures						
Zwischensumme		-	-		-	
Optionen						
Zwischensumme		-	-		-	
Swaps						
Zwischensumme		-	-		-	
Sonstige Instrumente						
Zwischensumme		-	-		-	
Summe		-	-		-	

(*) Der Betrag wurde nach den Bestimmungen der Verordnung über die Darstellung von Engagements („règlement relatif à la présentation des expositions“) ermittelt.

Zusammenfassende Aufstellung

der Bilanz ausgewiesener Barwert

Zulässige Aktiva und Passiva insgesamt (ohne FTI)	84.025.689,96
Aufstellung der FTI (ohne zur Absicherung einer Anteilsklasse verwendete Terminfinanzinstrumente):	
Aufstellung der Devisentermingeschäfte insgesamt	-
Summe Finanztermininstrumente - Aktien	3.936.925,40
Summe Terminfinanzinstrumente - Zinssätze	-
Summe Finanztermininstrumente - Devisen	-
Summe Terminfinanzinstrumente - Kreditrisiko	-
Summe Finanztermininstrumente - sonstige Engagements	-
Aufstellung der Finanztermininstrumente, die zur Absicherung einer Anteilsklasse verwendet werden	-
Sonstige Vermögenswerte (+)	6.749.897,62
Sonstige Verbindlichkeiten (-)	-2.970.302,91
Summe = Nettovermögen	91.742.210,07

JAHRESABSCHLUSS ZUM 29.2.2024





BILANZ AKTIVA

	29.2.2024	28.2.2023
Währung	EUR	EUR
Nettoanlagevermögen	-	-
Einlagen	-	-
Finanzinstrumente	82.728.858,55	80.357.095,96
• AKTIEN UND AKTIENÄHNLICHE WERTPAPIERE		
An einem geregelten oder gleichgestellten Markt gehandelt	63.372.682,56	-
Nicht an einem geregelten oder gleichgestellten Markt gehandelt	-	-
• ANLEIHEN UND ANLEIHENÄHNLICHE WERTPAPIERE		
An einem geregelten oder gleichgestellten Markt gehandelt	-	-
Nicht an einem geregelten oder gleichgestellten Markt gehandelt	-	-
• SCHULDITITEL		
An einem geregelten oder gleichgestellten Markt gehandelt		
<i>Handelbare Schuldtitel</i>	6.956.460,00	4.499.865,00
<i>Sonstige Schuldtitel</i>	-	-
Nicht an einem geregelten oder gleichgestellten Markt gehandelt	-	-
• ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN		
Allgemeine OGAW und allgemeine Investmentfonds für nicht professionelle und gleichgestellte Anleger anderer Länder	10.167.938,00	75.857.230,96
Sonstige Fonds, die sich an nicht-professionelle und gleichgestellte Anleger anderer Mitgliedstaaten der Europäischen Union richten	-	-
Allgemeine professionelle und vergleichbare Fonds anderer Mitgliedstaaten der Europäischen Union sowie börsennotierte Verbriefungsorganismen	-	-
Sonstige professionelle und vergleichbare Fonds anderer Mitgliedstaaten der Europäischen Union sowie nicht börsennotierte Verbriefungsorganismen	-	-
Andere nicht-europäische Organismen	-	-
• BEFRISTETE WERTPAPIERTRANSAKTIONEN		
Forderungen aus in Pension genommenen Wertpapieren	-	-
Forderungen aus verliehenen Wertpapieren	-	-
Ausgeliehene Wertpapiere	-	-
In Pension gegebene Wertpapiere	-	-
Sonstige befristete Wertpapiergeschäfte	-	-
• FINANZKONTRAKTE		
Geschäfte an einem geregelten oder gleichgestellten Markt	-	-
Sonstige Geschäfte	2.231.777,99	-
• SONSTIGE FINANZINSTRUMENTE	-	-
Forderungen	-	-
Devisentermingeschäfte	-	-
Sonstige	-	-
Geldkonten	3.761.810,06	463.707,19
Barmittel	3.761.810,06	463.707,19
Sonstige Aktiva	-	-
Summe Aktiva	86.490.668,61	80.820.803,15

BILANZ PASSIVA

	29.2.2024	28.2.2023
Währung	EUR	EUR
Eigenkapital		
• Gezeichnetes Kapital	65.800.155,14	72.930.802,63
• Nicht ausgeschüttete Nettogewinne und -verluste aus Vorperioden	-	-
• Ergebnisvortrag	-	-
• Nettogewinne und -verluste des Geschäftsjahres	18.962.277,25	-328.794,84
• Ergebnis des Geschäftsjahres	-896.821,87	-946.880,30
Summe Eigenkapital <i>(Dieser Betrag entspricht dem Nettovermögen)</i>	83.865.610,52	71.655.127,49
Finanzinstrumente	-	8.972.786,17
• VERÄUSSERUNGEN VON FINANZINSTRUMENTEN	-	-
• BEFRISTETE WERTPAPIERTRANSAKTIONEN		
Verbindlichkeiten aus in Pension gegebenen Wertpapieren	-	-
Verbindlichkeiten aus entliehenen Wertpapieren	-	-
Sonstige befristete Wertpapiergeschäfte	-	-
• FINANZKONTRAKTE		
Geschäfte an einem geregelten oder gleichgestellten Markt	-	-
Sonstige Geschäfte	-	8.972.786,17
Verbindlichkeiten	214.003,34	192.889,49
Devisentermingeschäfte	-	-
Sonstige	214.003,34	192.889,49
Geldkonten	-	-
Verbindlichkeiten gegenüber Kreditinstituten	-	-
Darlehen	-	-
Summe Passiva	145.123.917,62	80.820.803,15

AUßERBILANZIELLE Posten

	29.2.2024	28.2.2023
Währung	EUR	EUR
Absicherungsgeschäfte		
• Verpflichtungen aus Geschäften an geregelten oder gleichgestellten Märkten		
- Markt für unbedingte Termingeschäfte (Futures)	-	-
- Markt für bedingte Termingeschäfte (Optionen)	-	-
- Kreditderivate	-	-
- Swaps	-	-
- Contracts for Difference (CFD)	-	-
• Verpflichtungen aus außerbörslichen Geschäften		
- Markt für unbedingte Termingeschäfte (Futures)	-	-
- Markt für bedingte Termingeschäfte (Optionen)	-	-
- Kreditderivate	-	-
- Swaps	-	-
- Contracts for Difference (CFD)	-	-
• Sonstige Haftungsverhältnisse und finanzielle Verpflichtungen		
- Markt für unbedingte Termingeschäfte (Futures)	-	-
- Markt für bedingte Termingeschäfte (Optionen)	-	-
- Kreditderivate	-	-
- Swaps	-	-
- Contracts for Difference (CFD)	-	-
Sonstige Geschäfte		
• Verpflichtungen aus Geschäften an geregelten oder gleichgestellten Märkten		
- Markt für unbedingte Termingeschäfte (Futures)	-	-
- Markt für bedingte Termingeschäfte (Optionen)	-	-
- Kreditderivate	-	-
- Swaps	-	-
- Contracts for Difference (CFD)	-	-
• Verpflichtungen aus außerbörslichen Geschäften		
- Markt für unbedingte Termingeschäfte (Futures)	-	-
- Markt für bedingte Termingeschäfte (Optionen)	-	-
- Kreditderivate	-	-
- Performance-Swaps	71.692.931,47	56.546.727,71
- Contracts for Difference (CFD)	-	-
• Sonstige Haftungsverhältnisse und finanzielle Verpflichtungen		
- Markt für unbedingte Termingeschäfte (Futures)	-	-
- Markt für bedingte Termingeschäfte (Optionen)	-	-
- Kreditderivate	-	-
- Swaps	-	-
- Contracts for Difference (CFD)	-	-

GEWINN- UND VERLUSTRECHNUNG

	29.2.2024	28.2.2023
Währung	EUR	EUR
Erträge aus Finanzgeschäften		
• Erträge aus Einlagen und Geldkonten	78.808,62	10.353,83
• Erträge aus Aktien und aktienähnlichen Wertpapieren	153.660,46	175.403,35
• Erträge aus Anleihen und anleihenähnlichen Wertpapieren	-	-
• Erträge aus Schuldtiteln	34.985,86	4.342,72
• Erträge aus befristeten Wertpapierkäufen und -verkäufen	-	-
• Erträge aus Geldkonten	-	-
• Sonstige Finanzerträge	-	-
SUMME (I)	267.454,94	190.099,90
Aufwendungen aus Finanzgeschäften		
• Aufwendungen aus befristeten Wertpapierkäufen und -verkäufen	-	-
• Aufwendungen aus Finanzkontrakten	-	-
• Aufwendungen aus Finanzverbindlichkeiten	-14,32	-9.033,11
• Sonstige Finanzaufwendungen	-	-
SUMME (II)	-14,32	-9.033,11
Ergebnis aus Finanzgeschäften (I - II)	267.440,62	181.066,79
Sonstige Erträge (III)	-	-
Verwaltungskosten und Zuführungen zu den Abschreibungen (IV)	-1.190.228,69	-1.126.900,33
Nettoergebnis des Geschäftsjahres (Artikel L.214 -17-1) (I – II + III - IV)	-922.788,07	-945.833,54
Abgrenzung der Erträge des Geschäftsjahres (V)	25.966,20	-1.046,76
Im Geschäftsjahr geleistete Anzahlungen auf das Ergebnis (VI)	-	-
Ergebnis (I - II + III - IV +/- V - VI):	-896.821,87	-946.880,30

1 Bilanzierungs- und Bewertungsmethoden

Der Jahresabschluss wird in der von der Verordnung ANC Nr. 2014-01 in ihrer geltenden Fassung vorgeschriebenen Form vorgelegt.

Vorschriften zur Bewertung der Vermögenswerte

Bewertungsvorschriften

Die Bewertung der Vermögenswerte des FCP erfolgt gemäß den geltenden Gesetzen und Vorschriften, insbesondere aber gemäß den Vorschriften der Verordnung des Ausschusses für Rechnungslegungsnormen (*Comité de la Réglementation Comptable*) Nr. 2014-01 vom 14. Januar 2014 in Bezug auf den Kontenplan von Organismen für gemeinsame Anlagen mit variablem Kapital.

Die Bewertung von Finanzinstrumenten, die an geregelten Märkten gehandelt werden, erfolgt anhand ihres Schlusskurses am Tag der Nettoinventarwertberechnung. Werden diese Finanzinstrumente an mehreren geregelten Märkten gleichzeitig gehandelt, wird der Schlusskurs des Marktes berücksichtigt, der als Hauptmarkt dieser Instrumente gilt.

Die Bewertung der folgenden Finanzinstrumente, die nicht Gegenstand umfangreicher Transaktionen an einem geregelten Markt sind, erfolgt anhand der nachstehend beschriebenen Sonderverfahren:

- Die Bewertung handelbarer Schuldtitel, deren Restlaufzeit bei ihrem Erwerb höchstens 3 Monate beträgt, erfolgt nach der linearen Methode, indem die Differenz zwischen Kaufpreis und Rückzahlungswert linear auf die Restlaufzeit verteilt wird. Die *Verwaltungsgesellschaft* behält sich im Falle einer besonderen Sensitivität gegenüber Marktrisiken (Zinsrisiken usw.) jedoch die Möglichkeit vor, die Bewertung dieser Schuldtitel anhand der Barwertmethode vorzunehmen, wobei der Zinssatz vergleichbarer Wertpapieremissionen zugrunde gelegt wird, auf den ein Differenzbetrag in Abhängigkeit von den spezifischen Risikomerkmale des Emittenten zur Anwendung kommt.
- Die Bewertung handelbarer Schuldtitel mit einer Restlaufzeit von über 3 Monaten zum Zeitpunkt ihres Erwerbs, deren Restlaufzeit zum Stichtag der Nettoinventarwertermittlung aber höchstens 3 Monate beträgt, erfolgt nach der linearen Methode, indem die Differenz zwischen dem zuletzt ermittelten Barwert und dem Rückzahlungswert linear auf die Restlaufzeit verteilt wird. Die *Verwaltungsgesellschaft* behält sich im Falle einer besonderen Sensitivität gegenüber Marktrisiken (Zinsrisiken usw.) jedoch die Möglichkeit vor, die Bewertung dieser Schuldtitel anhand der Barwertmethode vorzunehmen, wobei der Zinssatz vergleichbarer Wertpapieremissionen zugrunde gelegt wird, auf den ein Differenzbetrag in Abhängigkeit von den spezifischen Risikomerkmale des Emittenten zur Anwendung kommt.
- Die Bewertung von handelbaren Schuldtiteln, deren Restlaufzeit zum Stichtag der Nettoinventarwertermittlung über 3 Monate beträgt, erfolgt nach der Barwertmethode, wobei der Zinssatz vergleichbarer Wertpapieremissionen zugrunde gelegt wird, auf den ein Differenzbetrag in Abhängigkeit von den spezifischen Risikomerkmale des Emittenten zur Anwendung kommt.

Die Bewertung von an organisierten Märkten gehandelten unbedingten Finanzinstrumenten erfolgt anhand ihres Kompensationskurses am Tag der Nettoinventarwertberechnung. Die Bewertung von an organisierten Märkten gehandelten bedingten Finanzinstrumenten erfolgt zu ihrem Marktwert, der am Tag der Nettoinventarwertberechnung festgestellt wurde. Die Bewertung von außerbörslich gehandelten bedingten oder unbedingten Finanztermininstrumenten erfolgt anhand des Preises, der von der Gegenpartei des Finanzinstruments mitgeteilt wird. Die *Verwaltungsgesellschaft* führt ihrerseits eine unabhängige Überprüfung dieser Bewertung durch.

Die Bewertung von Einlagen erfolgt zu ihrem Nominalwert, zuzüglich der entsprechenden aufgelaufenen Zinsen.

Die Bewertung von Bezugsrechten, Kassenscheinen, Solawechseln und Hypothekenswechseln erfolgt zu ihrem wahrscheinlichen Veräußerungswert unter der Verantwortung der *Verwaltungsgesellschaft*.

Die Bewertung von befristeten Käufen und Verkäufen von Wertpapieren erfolgt zu ihrem Marktpreis.

Die Bewertung von an einem geregelten Markt gehandelten Finanzinstrumenten, deren Kurs nicht festgestellt oder berichtigt wurde, erfolgt anhand ihres wahrscheinlichen Veräußerungswerts unter der Verantwortung der *Verwaltungsgesellschaft*.

Die Bewertung von Finanzinstrumenten, die auf eine andere als die Referenzwährung des FCP lauten, erfolgt auf der Grundlage der Wechselkurse, die von der Europäischen Zentralbank am Tag der Nettoinventarwertberechnung des FCP veröffentlicht wurden.

Bewertung der OGAW:

Zum Zeitpunkt der Erstellung dieses Prospekts beruhen die letzten bekannten Nettoinventarwerte der OGAW für ein bestimmtes Datum nicht alle auf ein und demselben Referenzdatum für den Marktpreis.

De facto benötigen einige OGAW und AIF des Korbs mehr Zeit für die Berechnung ihres Nettoinventarwerts als andere.

Würde die *Verwaltungsgesellschaft* systematisch den letzten bekannten Nettoinventarwert aller OGAW und AIF verwenden, könnte sie die Einhaltung des Grundsatzes der Gleichbehandlung der Anteilhaber nicht garantieren, da der Nettoinventarwert des FCP von der Uhrzeit der Veröffentlichung der Nettoinventarwerte der OGAW und AIF des Korbs abhängt. Bei Zeichnungen oder Rücknahmen wäre die *Verwaltungsgesellschaft* faktisch nicht in der Lage, Käufe und Verkäufe für die OGAW und AIF in einer Art und Weise durchzuführen, die eine Ausführung zum gleichen Preis wie dem für die Bewertung zugrunde gelegten ermöglichen würde.

Die *Verwaltungsgesellschaft* behält sich daher das Recht vor, zu einem bestimmten Bewertungsdatum nicht die letzten bekannten Nettoinventarwerte der OGAW, sondern diejenigen zu verwenden, die ihr die Einhaltung des Grundsatzes der Gleichbehandlung der Anteilhaber ermöglichen. Hat die *Verwaltungsgesellschaft* Aufträge für OGAW und AIF erteilt, um Zeichnungs-/Rücknahmeaufträge im FCP ausführen zu können, werden diejenigen Nettoinventarwerte zur Bewertung des FCP verwendet, zu denen diese Aufträge ausgeführt wurden. Hat die *Verwaltungsgesellschaft* keine Aufträge erteilt, werden die Nettoinventarwerte zur Bewertung des FCP verwendet, zu denen von ihr theoretisch erteilte Aufträge zur Abwicklung von Zeichnungs-/Rücknahmeaufträgen ausgeführt worden wären.

Bilanzierung der Transaktionskosten

Die Bewertung der Finanzinstrumente erfolgt inklusive ihrer Transaktionskosten.

Bilanzierung der Erträge aus fest verzinslichen Wertpapieren

Der Ausweis der Erträge aus fest verzinslichen Wertpapieren erfolgt nach der Methode der vereinnahmten Zinsen (*méthode des coupons encaissés*).

Ausschüttungspolitik

Thesaurierender FCP.

Als Garantie erhaltende Finanzinstrumente

Diese Finanzinstrumente werden entsprechend ihrer Art im Posten „Finanzinstrumente“ ausgewiesen, und die Verbindlichkeit aus der Verpflichtung zur Rückgabe der Finanzinstrumente wird auf der Passivseite mit dem gleichen Wert im Posten „Sonstige befristete Geschäfte“ verbucht.

Die Bewertung dieser Finanzinstrumente erfolgt nach denselben Bewertungsregeln wie die Bewertung von Finanztiteln gleicher Art, wie oben dargestellt.

Bewertungsmethoden für außerbilanzielle Positionen

Die Bewertung von außerbilanziellen Geschäften erfolgt zu ihrem Verpflichtungswert.

Der Verpflichtungswert von unbedingten Terminkontrakten entspricht dem Kurs (in der Währung des Fonds), der mit der Anzahl der Kontrakte wird, multipliziert mit dem Nominalbetrag.

Der Verpflichtungswert für bedingte Geschäfte entspricht dem Kurs des Basiswerts (in der Währung des Fonds), der mit der Anzahl der Kontrakte multipliziert wird, multipliziert mit dem Delta und multipliziert mit dem Nominalbetrag des Basiswerts.

Der Verpflichtungswert von Swap-Kontrakten entspricht dem Nominalbetrag des Kontrakts (in der Währung der Fonds).

Betriebs- und Verwaltungskosten

Diese Kosten umfassen alle Kosten, die dem FCP unmittelbar in Rechnung gestellt werden, mit Ausnahme der Transaktionskosten. Die Transaktionskosten umfassen die Kosten für den Wertpapierhandel (Maklerprovision, Börsenumsatzsteuern etc.) sowie gegebenenfalls die Umsatzprovision, die u.a. von der Depotbank und der Verwaltungsgesellschaft erhoben werden kann.

Zu den Betriebs- und Verwaltungskosten können folgende Kostenelemente hinzukommen:

- Erfolgsabhängige Provisionen. Diese erhält die Verwaltungsgesellschaft, wenn der FCP seine Ziele übertrifft. Sie werden dem FCP in Rechnung gestellt;
- Umsatzprovisionen, die dem FCP berechnet werden;
- Direkte und indirekte Betriebskosten/-gebühren für befristete Käufe und Verkäufe von Wertpapieren.

Weitere Einzelheiten zu den dem FCP effektiv in Rechnung gestellten Gebühren und Provisionen sind den Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) zu entnehmen.

Dem FCP berechnete Kosten	Bemessungsgrundlage	Satz und Staffelung
Von der Portfoliomanagementgesellschaft unabhängige externe Kosten für die finanzielle und administrative Verwaltung (Abschlussprüfung, Verwahrung, Vertrieb, Rechtskosten), inkl. Steuern ⁽¹⁾	Nettovermögen	Bis maximal 1,55% inkl. Steuern pro Jahr
Maximale indirekte Kosten (Verwaltungsprovisionen und -gebühren)	Nettovermögen	Maximal 2 % inkl. Steuern pro Jahr
Umsatzprovisionen	Zahlbar bei jeder Transaktion	Entfällt
Erfolgsabhängige Provision	Nettovermögen	Entfällt
Direkte und indirekte Betriebskosten/-gebühren für befristete Käufe und Verkäufe von Wertpapieren.	Betrag der mit diesen Transaktionen erzielten Erträge	Maximal 20% für die Verwaltungsgesellschaft Maximal 15% für den Vertreter (gegebenenfalls)

⁽¹⁾ einschließlich aller Kosten außer Transaktionskosten, erfolgsabhängigen Provisionen und Kosten für Anlagen in OGAW, AIF oder Investmentfonds.

Rechnungswährung

Die Rechnungslegung des FCP erfolgt in Euro.

Angabe der den Anteilhabern mitzuteilenden buchhalterische Änderungen

- Änderung erfolgt am: Entfällt.
- Bevorstehende Änderung am: Entfällt.

Angabe der den Anteilhabern mitzuteilenden sonstige Änderungen *(nicht vom Abschlussprüfer geprüft)*

- Änderung erfolgt am: Entfällt.
- Bevorstehende Änderung am: Entfällt.

Angabe und Begründung von Änderungen der Schätzungen und der Anwendungsmodalitäten

Entfällt.

Angabe der Art der im Geschäftsjahr berichtigten Fehler

Entfällt.

Angabe der mit jeder Anteilklasse verbundenen Rechte und Bedingungen

Thesaurierender FCP. Bilanzierung nach der Methode der vereinnahmten Zinsen (*méthode des coupons encaissés*).

Anhängige

2 Veränderung des Nettovermögens

29.2.2024

28.2.2023

Währung	EUR	EUR
Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres	71.655.127,49	73.736.385,20
Zeichnungen (einschließlich der dem Fonds zustehenden Ausgabeaufschläge)	5.716.440,27	11.791.471,03
Rücknahmen (nach Abzug der dem Fonds zustehenden Rücknahmegebühren)	-7.102.331,43	-10.728.637,98
Realisierte Gewinne aus Einlagen und Finanzinstrumenten	32.953.450,14	912.987,45
Realisierte Verluste aus Einlagen und Finanzinstrumenten	-5.939.655,34	-1.995.361,13
Realisierte Gewinne aus Finanzkontrakten	67.679.119,84	7.698.999,50
Realisierte Verluste aus Finanzkontrakten	-74.775.887,91	-6.752.466,46
Transaktionskosten	-17.339,33	-30.754,24
Wechselkursdifferenzen	-303.421,35	175,07
Veränderungen der Bewertungsdifferenz von Einlagen und Finanzinstrumenten:	-16.281.667,95	6.845.124,68
- Bewertungsdifferenz Geschäftsjahr N	3.073.278,42	19.354.946,37
- Bewertungsdifferenz Geschäftsjahr N-1	19.354.946,37	12.509.821,69
Veränderungen der Bewertungsdifferenz von Finanzkontrakten:	11.204.564,16	-8.876.962,09
- Bewertungsdifferenz Geschäftsjahr N	2.231.777,99	-8.972.786,17
- Bewertungsdifferenz Geschäftsjahr N-1	-8.972.786,17	-95.824,08
Ausschüttung des vorherigen Geschäftsjahres aus Nettogewinnen und -verlusten	-	-
Ausschüttung des vorherigen Geschäftsjahres aus dem Ergebnis	-	-
Nettoergebnis des Geschäftsjahres vor Rechnungsabgrenzung	-922.788,07	-945.833,54
Im Geschäftsjahr geleistete Anzahlung(en) auf Nettogewinne und -verluste	-	-
Im Geschäftsjahr geleistete Anzahlung(en) auf das Ergebnis	-	-
Sonstige Elemente	-	-
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres	83.865.610,52	71.655.127,49

3 Zusätzliche Informationen

3.1. Finanzinstrumente: Aufschlüsselung nach der rechtlichen oder wirtschaftlicher Art der Finanzinstrumente

3.1.1. Aufgliederung des Postens „Anleihen und anleihenähnliche Wertpapiere“ nach Art der Finanzinstrumente

	An einem geregelten oder gleichgestellten Markt gehandelt	Nicht an einem geregelten oder gleichgestellten Markt gehandelt
Indexierte Anleihen	-	-
Wandelanleihen	-	-
Festverzinsliche Anleihen	-	-
Variabel verzinsliche Anleihen	-	-
Nullkuponanleihen	-	-
Beteiligungspapiere	-	-
Sonstige Finanzinstrumente	-	-

3.1.2. Aufgliederung des Postens „Handelbare Schuldtitel“ nach rechtlicher oder wirtschaftlicher Art der Finanzinstrumente

	An einem geregelten oder gleichgestellten Markt gehandelt	Nicht an einem geregelten oder gleichgestellten Markt gehandelt
Schatzanweisungen	6.956.460,00	-
Kurzfristige Schuldtitel (NEU CP), die von nicht-finanziellen Emittenten begeben werden	-	-
Kurzfristige Schuldtitel (NEU CP), die von Bankemittenten begeben werden	-	-
Mittelfristige Schuldtitel NEU MTN	-	-
Sonstige Finanzinstrumente	-	-

3.1.3. Aufgliederung des Postens „Verkäufe von Finanzinstrumenten“ nach Art der Finanzinstrumente

	Verkauf von in Pension erhaltenen Wertpapieren	Verkauf entliehener Wertpapiere	Verkauf von mit Rückübertragungspflicht erworbenen Wertpapieren	Leerverkäufe
Aktien	-	-	-	-
Anleihen	-	-	-	-
Schuldtitel	-	-	-	-
Sonstige Finanzinstrumente	-	-	-	-

3.1.4. Aufgliederung der außerbilanziellen Posten nach Art der Märkte (insbesondere Renten-, Aktien-, Devisenmarkt)

	Anleihen	Aktien	Währungen	Sonstige
Absicherungsgeschäfte				
Verpflichtungen aus Geschäften an geregelten oder gleichgestellten Märkten	-	-	-	-
Verpflichtungen aus außerbörslichen Geschäften	-	-	-	-
Sonstige Haftungsverhältnisse und finanzielle Verpflichtungen	-	-	-	-
Sonstige Geschäfte				
Verpflichtungen aus Geschäften an geregelten oder gleichgestellten Märkten	-	-	-	-
Verpflichtungen aus außerbörslichen Geschäften	-	-	-	71.692.931,47
Sonstige Haftungsverhältnisse und finanzielle Verpflichtungen	-	-	-	-

3.2. Aufschlüsselung der Aktiva-, Passiva- und außerbilanziellen Posten nach Art der Verzinsung

	Fester Zinssatz	Variabler Zinssatz	Anpassbarer Zinssatz	Sonstige
Aktiva				
Einlagen	-	-	-	-
Anleihen und anleihenähnliche	-	-	-	-
Wertpapiere Schuldtitel	6.956.460,00	-	-	-
Befristete Wertpapiertransaktionen	-	-	-	-
Geldkonten	-	-	-	3.761.810,06
Passiva				
Befristete Wertpapiertransaktionen	-	-	-	-
Geldkonten	-	-	-	-
Außerbilanzielle Posten				
Absicherungsgeschäfte	-	-	-	-
Sonstige Geschäfte	-	-	-	-

3.3. Aufschlüsselung der Aktiva-, Passiva- und außerbilanziellen Posten nach Restlaufzeit

	0 - 3 Monate	3 Monate - 1 Jahr	1 - 3 Jahre	3 - 5 Jahre	> 5 Jahre
Aktiva					
Einlagen	-	-	-	-	-
Anleihen und anleihenähnliche Wertpapiere	-	-	-	-	-
Schuldtitel	6.956.460,00	-	-	-	-
Befristete Wertpapiertransaktionen	-	-	-	-	-
Geldkonten	3.761.810,06	-	-	-	-
Passiva					
Befristete Wertpapiertransaktionen	-	-	-	-	-
Geldkonten	-	-	-	-	-
Außerbilanzielle Posten					
Absicherungsgeschäfte	-	-	-	-	-
Sonstige Geschäfte	-	-	-	-	-

3.4. Aufgliederung der Aktiva, Passiva und außerbilanziellen Posten nach Notierungs- oder Bewertungswährungen

Diese Aufschlüsselung wird für die wichtigsten Notierungs- oder Bewertungswährungen angegeben, mit Ausnahme der Rechnungswährung.

Nach Hauptwährung	USD	CHF	DKK	Sonstige Währungen
Aktiva				
Einlagen	-	-	-	-
Aktien und aktienähnliche Wertpapiere	25.546.251,24	6.678.107,66	3.268.424,65	5.842.709,45
Anleihen und anleihenähnliche Wertpapiere	-	-	-	-
Schuldtitel	-	-	-	-
Investmentfonds	-	-	-	-
Befristete Wertpapiertransaktionen	-	-	-	-
Forderungen	-	-	-	-
Geldkonten	-	-	-	-
Sonstige Aktiva	-	-	-	-
Passiva				
Verkäufe von Finanzinstrumenten				
Befristete Wertpapiertransaktionen	1.113.946,94	732.586,84	43.546,37	-
Verbindlichkeiten	-	-	-	-
Geldkonten	-	-	-	-
Außerbilanzielle Posten				
Absicherungsgeschäfte	-	-	-	-
Sonstige Geschäfte				

3.5. Forderungen und Verbindlichkeiten: Aufschlüsselung nach Art

Detaillierte Angaben zu den Elementen der Posten „Sonstige Forderungen“ und „Sonstige Verbindlichkeiten“, insbesondere Aufschlüsselung der Devisentermingeschäfte nach Art des Geschäfts (Kauf/Verkauf).

Forderungen		
Devisentermingeschäfte:		-
Devisenterminkäufe		-
Gesamtbetrag der Devisenterminverkäufe		-
Sonstige Forderungen:		-
-		-
-		-
-		-
-		-
-		-
Sonstige Geschäfte		-
Verbindlichkeiten		
Devisentermingeschäfte:		214.003,34
Devisenterminverkäufe		-
Gesamtbetrag der Devisenterminkäufe		-
Sonstige Verbindlichkeiten:		
Zurückgestellte Kosten		213.635,95
Verschiedene Debitoren und Kreditoren		367,39
-		-
-		-
-		-
Sonstige Geschäfte		-

3.6. Eigenkapital

	Zeichnungen		Rücknahmen	
	Anzahl der Anteile	Betrag	Anzahl der Anteile	Betrag
Anzahl der ausgegebenen/zurückgenommenen Anteile im Geschäftsjahr	32.640	5.716.440,27	39.203	7.102.331,43
Ausgabeaufschläge und Rücknahmegebühren		-		-
Kick-Backs		-		-
Dem Fonds zufließende Provisionen		-		-

3.7. Verwaltungskosten

Betriebs- und Verwaltungskosten (fixe Kosten) in % des durchschnittlichen Nettovermögens	1,55
Performancegebühr (variable Kosten): Betrag der Kosten des Geschäftsjahres	-
Kick-Backs von Verwaltungskosten:	
- Betrag der Kick-Backs an den Fonds	-
- Aufschlüsselung nach „Zielfonds“:	
- Fonds 1	-
- Fonds 2	-

3.8. Erhaltene und geleistete Zusagen

- 3.8.1. Beschreibung der von Fonds erhaltenen Garantien mit Angabe der Kapitalgarantien:..... **keine**
- 3.8.2. Beschreibung der sonstigen erhaltenen und/oder geleisteten Zusagen..... **keine**

3.9. Sonstige Informationen

3.9.1. Barwert von Finanzinstrumenten, die Gegenstand befristeter Wertpapierkäufe sind:

- In Pension erhaltene Finanzinstrumente	-
- Sonstige befristete Geschäfte	-

3.9.2. Barwert von als Garantie hinterlegten Finanzinstrumenten: Als Garantie erhaltene, nicht in Bilanz ausgewiesene Finanzinstrumente:

- Aktien	-
- Anleihen	-
- Schuldtitel	-
- Sonstige Finanzinstrumente	-

Als Garantie geleistete, im ursprünglichen Posten beibehaltene Finanzinstrumente:

- Aktien	10.403.543,99
- Anleihen	-
- Schuldtitel	-
- Sonstige Finanzinstrumente	-

3.9.3. Im Portfolio gehaltene Finanzinstrumente, die von verbundenen Rechtseinheiten der Verwaltungsgesellschaft (Fonds) oder Finanzverwaltern (SICAV) und den von diesen Einheiten verwalteten OGA emittiert werden:

- Fondsanteile	-
- Swaps	2.231.777,99

3.10. Übersicht über die Ergebnisverwendung (in der Rechnungswährung des Fonds)

Im Geschäftsjahr geleistete Anzahlungen

Datum	Gesamtbetrag	Betrag je Anteil	Steuergutschriften insgesamt	Steuergutschrift je Anteil
-	-	-	-	-
-	-	-	-	-
-	-	-	-	-
-	-	-	-	-
Anzahlungen insgesamt	-	-	-	-

	29.2.2024	28.2.2023
	EUR	EUR
Ergebnisverwendung		
Zu verwendendes		
Ergebnisvortrag	-	-
Ergebnis	-896.821,87	-946.880,30
Insgesamt	-896.821,87	-946.880,30
Verwendung		
Ausschüttung	-	-
Ergebnisvortrag des Geschäftsjahres	-	-
Thesaurierung	-896.821,87	-946.880,30
Insgesamt	-896.821,87	-946.880,30
Informationen über ausschüttende Anteile		
Anzahl der Anteile	-	-
Ausschüttung je Anteil	-	-
Steuergutschriften aufgrund der Ergebnisausschüttung	-	-

3.11. Übersicht über die Verwendung der ausschüttungsfähigen Nettogewinne/-verluste

(in der Rechnungswährung des Fonds)

Geleistete Anzahlungen auf Nettogewinne/-verluste des Geschäftsjahres

Datum	Gesamtbetrag	Betrag je Anteil
-	-	-
-	-	-
-	-	-
-	-	-
Anzahlungen insgesamt	-	-

	29.2.2024	28.2.2023
	EUR	EUR
Verwendung der Nettogewinne/-verluste		
Zu verwendendes Ergebnis		
Nicht ausgeschüttete Nettogewinne/-verluste aus Vorperioden	-	-
Nettogewinne/-verluste des Geschäftsjahres	18.962.277,25	-328.794,84
Geleistete Anzahlungen auf Nettogewinne/-verluste des Geschäftsjahres	-	-
Insgesamt	18.962.277,25	-328.794,84
Verwendung		
Ausschüttung	-	-
Nicht ausgeschüttete Nettogewinne/-verluste des Geschäftsjahres	-	-
Thesaurierung	18.962.277,25	-328.794,84
Insgesamt	18.962.277,25	-328.794,84
Informationen über ausschüttende Anteile		
Anzahl der Anteile	-	-
Ausschüttung je Anteil	-	-

3.12. Ergebnisaufstellung und sonstige charakteristische Elemente des FCP in den letzten 5 Geschäftsjahren

Währung EUR	29.2.2024	28.2.2023	28.2.2022	26.2.2021	28.2.2020
Nettovermögen	83.865.610,52	71.655.127,49	73.736.385,20	63.600.937,13	57.296.547,61
Anzahl der in Umlauf befindlichen Anteile	419.348	425.911	417.647	418.455	411.789
Nettoinventarwert	199,99	168,23	176,55	151,98	139,14
Ausschüttung von Nettogewinnen/-verlusten je Anteil (einschließlich Anzahlungen)	-	-	-	-	-
Ausschüttung je Anteil (einschließlich Anzahlungen)	-	-	-	-	-
Auf die Anteilinhaber übertragene Steuergutschrift (natürliche Person)⁽¹⁾	-	-	-	-	-
Thesaurierung je Anteil⁽²⁾	43,07	-2,99	4,93	12,26	105,30

⁽¹⁾ In Anwendung der Steuervorschrift des französischen Steuerbehörde vom 4. März 1993 wird die Steuergutschrift je Anteil am Tag der Dividendenausschüttung durch Verteilung des Gesamtbetrags der Steuergutschriften auf die an diesem Tag umlaufenden Anteile ermittelt.

⁽²⁾ Die Thesaurierung je Anteil entspricht der Summe des Ergebnisses sowie der Nettogewinne und -verluste aller umlaufenden Anteile. Diese Berechnungsmethode wird seit dem 1. Januar 2013 angewendet.

Auflegungsdatum des Fonds: 30. Januar 2008.

Zusammensetzung des Fondsvermögens zum

4 29.2.2024

Wertpapier- kennnummer	Bezeichnung des Wertpapiers	Status des Wertpapiers	Anzahl	Börsenwert	Notierungs- währung	% des Netto- vermögens
<i>Wertpapiere</i>						
<i>Aktien</i>						
IE00B4BNMY34	ACCENTURE SHS CLASS A	PGARAN	341,00	118.098,21	USD	0,14
CH0012138605	ADECCO GROUP INC	EIGEN	10.786,00	401.036,81	CHF	0,48
NL0012969182	ADYEN BV	EIGEN	434,00	633.640,00	EUR	0,76
DE0008404005	ALLIANZ SE-NOM	EIGEN	11.451,00	2.906.836,35	EUR	3,47
US02079K3059	ALPHABET INC	EIGEN	5.966,00	763.343,68	USD	0,91
US02079K1079	ALPHABET INC SHS C	EIGEN	10.994,00	1.420.081,62	USD	1,69
US0231351067	AMAZON.COM INC	PGARAN	2.847,00	465.033,24	USD	0,55
US0231351067	AMAZON.COM INC	EIGEN	20.244,00	3.306.685,25	USD	3,94
NL0010273215	ASML HOLDING N.V.	EIGEN	710,00	618.055,00	EUR	0,74
US00206R1023	AT&T INC	EIGEN	15.766,00	246.655,62	USD	0,29
US0533321024	AUTOZONE INC	EIGEN	1.117,00	3.102.827,09	USD	3,70
US0640581007	BANK OF NEW YORK MELLON CORP	PGARAN	8.940,00	463.378,09	USD	0,55
DE000BAY0017	BAYER AG	EIGEN	84.092,00	2.362.144,28	EUR	2,82
US1491231015	CATERPILLAR INC	EIGEN	4.842,00	1.494.279,28	USD	1,78
US22160K1051	COSTCO WHOLESALE	EIGEN	1.140,00	783.657,16	USD	0,93
DE0006062144	COVESTRO AG	EIGEN	8.199,00	412.409,70	EUR	0,49
DE000DTR0CK8	DAIMLER TRUCK HOLDING AG	EIGEN	17.622,00	665.759,16	EUR	0,79
DE0005140008	DEUTSCHE BANK AG-NAMEN	EIGEN	51.941,00	642.094,64	EUR	0,77
DE0005552004	DEUTSCHE POST AG-NAMEN	EIGEN	61.486,00	2.638.364,26	EUR	3,15
US29414B1044	EPAM SYSTEMS	EIGEN	1.215,00	341.769,63	USD	0,41
FR0000121121	EURAZEO SE	PGARAN	5.415,00	422.911,50	EUR	0,50
SE0012673267	EVOLUTION AB	EIGEN	5.017,00	601.009,49	SEK	0,72
US45168D1046	IDEXX LABS	EIGEN	1.737,00	923.323,49	USD	1,10
US4581401001	INTEL CORP	EIGEN	43.636,00	1.735.923,67	USD	2,07
US4781601046	JOHNSON & JOHNSON	EIGEN	2.350,00	350.453,26	USD	0,42

SG HAUSSMANN EVO FUND WORLD

Wertpapier- kennnummer	Bezeichnung des Wertpapiers	Status des Wertpapiers	Anzahl	Börsenwert	Notierungs- währung	% des Netto- vermögens
US49271V1008	KEURIG DR PEPPER INC	EIGEN	5.512,00	152.348,49	USD	0,18
CH0013841017	LONZA GROUP AB-N	PGARAN	1.511,00	732.586,84	CHF	0,87
CH0013841017	LONZA GROUP AB-N	EIGEN	6.845,00	3.318.700,81	CHF	3,96
US5951121038	MICRON TECHNOLOGY INC	EIGEN	7.520,00	629.660,58	USD	0,75
JP3902900004	MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP	EIGEN	145.750,00	1.387.620,44	JPY	1,65
US60855R1005	MOLINA HEALTHCARE	EIGEN	2.799,00	1.018.855,14	USD	1,21
DK0062498333	NOVO NORDISK AS	PGARAN	396,00	43.546,37	DKK	0,05
DK0060336014	NOVONESIS A/S	EIGEN	61.828,00	3.224.878,28	DKK	3,85
DK0060252690	PANDORA AB	EIGEN	5.755,00	859.295,16	DKK	1,02
US7185461040	PHILLIPS 66	EIGEN	10.809,00	1.423.453,86	USD	1,70
CH0012032048	ROCHE HOLDING LTD	EIGEN	18.512,00	4.506.095,50	CHF	5,37
DE0007164600	SAP SE	EIGEN	3.250,00	561.860,00	EUR	0,67
NL00150001QM	STELLANTIS NV	EIGEN	100.555,00	2.426.894,93	EUR	2,89
NL0000226223	STMICROELECTRONICS NV	EIGEN	10.186,00	425.010,85	EUR	0,51
CH0126881561	SWISS RE AG	EIGEN	7.958,00	890.253,75	CHF	1,06
CH0008742519	SWISSCOM N	EIGEN	3.552,00	1.883.913,11	CHF	2,25
US8716071076	SYNOPSIS INC	EIGEN	1.941,00	1.029.071,69	USD	1,23
SE0000667925	TELIA COMPANY AB	EIGEN	22.894,00	50.439,38	SEK	0,06
US8725401090	TJX COMPANIES INC	EIGEN	44.786,00	4.103.020,88	USD	4,89
JP3633400001	TOYOTA MOTOR CORP	EIGEN	70.211,00	1.569.681,12	JPY	1,87
CH0244767585	UBS GROUP INC NAMEN AKT	EIGEN	50.481,00	1.335.529,45	CHF	1,59
FR0013326246	UNIBAIL RODAMCO SE REITS	PGARAN	1.064,00	71.905,12	EUR	0,09
US9113121068	UNITED PARCEL SERVICE-B	EIGEN	4.513,00	618.303,73	USD	0,74
US91324P1021	UNITEDHEALTH GROUP	EIGEN	2.110,00	962.432,20	USD	1,15
US92338C1036	VERALTO CORPORATION	PGARAN	1.172,00	93.595,38	USD	0,11
NO0010208051	YARA INTERNATIONAL ASA	EIGEN	77.647,00	2.233.959,02	NOK	2,66
Aktien insgesamt	AMUNDI MSCI WORLD III ETF			63.372.682,56		75,56
Investmentfonds						
LU2572257124	AMUNDI INDEX SOLUTIONS SICAV	EIGEN	59.000,00	5.121.908,00	EUR	6,11

Wertpapierkennnummer	Bezeichnung des Wertpapiers	Status des Wertpapiers	Anzahl	Börsenwert	Notierungswährung	% des Nettovermögens
FR0010315770	MULTI UNITS FRANCE SICAV AMUNDI MSCI WORLD UCITS EFF	EIGEN	16.500,00	5.046.030,00	EUR	6,02
Investmentfonds insgesamt				10.167.938,00		12,12
Wertpapiere insgesamt				73.540.620,56		87,69
Performance-Swap						
SWAP03826661	GAP FEES	EIGEN	1,00	-82.676,01	EUR	-0,10
SWAP03981884	PATTE BRIQUES SPREAD	EIGEN	62.000.000,00	62.713.496,00	EUR	74,78
SWAP03981885	PATTE BRIQUES VRAC	EIGEN	62.000.000,00	-60.961.627,75	EUR	-72,69
SWAP03981883	PATTE INDEXATION	EIGEN	71.692.931,47	562.585,75	EUR	0,67
Performance-Swaps insgesamt				2.231.777,99		2,66
Barmittel						
SONSTIGE						
	CREDITEUR DIV EUR	EIGEN	-367,39	-367,39	EUR	-0,00
SONSTIGE insgesamt				-367,39		-0,00
BANK ODER AUSSTEHEND						
	BANQUE EUR SGP	EIGEN	3.761.810,06	3.761.810,06	EUR	4,49
Insgesamt BANK ODER AUSSTEHEND				3.761.810,06		4,49
VERWALTUNGSGEBÜHREN						
	PRCOMGESTFIN	EIGEN	-213.635,95	-213.635,95	EUR	-0,25
VERWALTUNGSGEBÜHREN insgesamt				-213.635,95		-0,25
Barmittel insgesamt				3.547.806,72		4,23
Wertpapierleihgeschäfte						
AD1 REME: Sicherheiten hinterlegung (Wertpapierleihe)						
PDC-04100051	PDC LYXOCH0013841017	PGAR1	-698.082,00	-732.586,84	CHF	-0,87
PDC-04100052	PDC LYXODK0062498333	PGAR1	-324.601,20	-43.546,37	DKK	-0,05
PDC-04100053	PDC LYXOFR0000121121	PGAR1	-422.911,50	-422.911,50	EUR	-0,50
PDC-04100054	PDC LYXOFR0013326246	PGAR1	-71.905,12	-71.905,12	EUR	-0,09
PDC-04100048	PDC LYXOIE00B4BNMY34	PGAR1	-128.908,23	-118.098,21	USD	-0,14
PDC-04100049	PDC LYXOUS0231351067	PGAR1	-492.986,52	-465.033,24	USD	-0,55
PDC-04100050	PDC LYXOUS0640581007	PGAR1	-497.421,60	-463.378,09	USD	-0,55
PDC-04100055	PDC LYXOUS92338C1036	PGAR1	-102.632,04	-93.595,38	USD	-0,11
AD1 REME: Sicherheiten hinterlegung (Wertpapierleihe) insgesamt				-2.411.054,75		-2,87
Wertpapierleihgeschäfte insgesamt				-2.411.054,75		-2,87

Wertpapier- kennnummer	Bezeichnung des Wertpapiers	Status des Wertpapiers	Anzahl	Notierungs- währung Börsenwert	% des Netto- vermögens
<i>Handelbare Schuldtitel</i>					
<i>Abgezinste Wertpapiere</i>					
FR0128071034	BTF 0% 02.05.2024	EIGEN	7.000.000,00	6.956.460,00	EUR 8,29
<i>Abgezinste Wertpapiere insgesamt</i>				6.956.460,00	8,29
<i>Handelbare Schuldtitel insgesamt</i>				6.956.460,00	8,29
SG HAUSSMANN EVO FUND WORLD insgesamt				83.865.610,52	100,00