



# Jahresbericht inklusive geprüftem Jahresabschluss

zum 30. Juni 2024

## Swiss Rock (Lux) Sicav

-Anlagefonds nach Luxemburger Recht-

Eine Investmentgesellschaft mit variablem Kapital («Société d'Investissement à Capital Variable»)(„SICAV“) gemäß Teil I des Luxemburger Gesetzes vom 17. Dezember 2010 über Organismen für gemeinsame Anlagen

**Handelsregister-Nr. B 135.671**

Der vorliegende Bericht für die  
**«Swiss Rock (Lux) Sicav»**  
umfasst folgende Teilfonds:

- Global Equity / Aktien Welt ESG
- European Equity / Aktien Europa ESG
- Emerging Equity / Aktien Schwellenländer ESG
- Absolute Return Bond Fund ESG
- Absolute Return Bond Fund Plus ESG

# Inhaltsverzeichnis

	Seite
Informationen an die Aktionäre	4
Management und Verwaltung	5
Bericht über den Geschäftsverlauf	7
<b>Teilfonds Global Equity / Aktien Welt ESG</b>	<b>12</b>
Zusammensetzung des Netto-Fondsvermögens des Teilfonds	12
Währungs-Übersicht des Teilfonds	12
Wertpapierkategorie-Übersicht des Teilfonds	12
Länder-Übersicht des Wertpapiervermögens des Teilfonds	12
Vermögensaufstellung des Teilfonds	13
Ertrags- und Aufwandsrechnung des Teilfonds	23
Vermögensentwicklung des Teilfonds	23
Entwicklung des Teilfonds im Jahresvergleich	24
<b>Teilfonds European Equity / Aktien Europa ESG</b>	<b>25</b>
Zusammensetzung des Netto-Fondsvermögens des Teilfonds	25
Währungs-Übersicht des Teilfonds	25
Wertpapierkategorie-Übersicht des Teilfonds	25
Länder-Übersicht des Wertpapiervermögens des Teilfonds	25
Vermögensaufstellung des Teilfonds	26
Ertrags- und Aufwandsrechnung des Teilfonds	31
Vermögensentwicklung des Teilfonds	31
Entwicklung des Teilfonds im Jahresvergleich	32

## Inhaltsverzeichnis

<b>Teilfonds Emerging Equity / Aktien Schwellenländer ESG</b>	<b>33</b>
Zusammensetzung des Netto-Fondsvermögens des Teilfonds	33
Währungs-Übersicht des Teilfonds	33
Wertpapierkategorie-Übersicht des Teilfonds	33
Länder-Übersicht des Wertpapiervermögens des Teilfonds	33
Vermögensaufstellung des Teilfonds	34
Ertrags- und Aufwandsrechnung des Teilfonds	42
Vermögensentwicklung des Teilfonds	42
Entwicklung des Teilfonds im Jahresvergleich	43
<b>Teilfonds Absolute Return Bond Fund ESG</b>	<b>44</b>
Zusammensetzung des Netto-Fondsvermögens des Teilfonds	44
Währungs-Übersicht des Teilfonds	44
Wertpapierkategorie-Übersicht des Teilfonds	44
Länder-Übersicht des Wertpapiervermögens des Teilfonds	44
Vermögensaufstellung des Teilfonds	45
Ertrags- und Aufwandsrechnung des Teilfonds	50
Vermögensentwicklung des Teilfonds	50
Entwicklung des Teilfonds im Jahresvergleich	51
<b>Teilfonds Absolute Return Bond Fund Plus ESG</b>	<b>52</b>
Zusammensetzung des Netto-Fondsvermögens des Teilfonds	52
Währungs-Übersicht des Teilfonds	52
Wertpapierkategorie-Übersicht des Teilfonds	52
Länder-Übersicht des Wertpapiervermögens des Teilfonds	52
Vermögensaufstellung des Teilfonds	53
Ertrags- und Aufwandsrechnung des Teilfonds	60
Vermögensentwicklung des Teilfonds	60
Entwicklung des Teilfonds im Jahresvergleich	61

## Inhaltsverzeichnis

Zusammenfassung des Swiss Rock (Lux) Sicav	62
Anhang zum Jahresabschluss	63
Prüfungsvermerk	73
Zusätzliche Informationen zum Jahresbericht (ungeprüft)	76
Zusatzinformationen für Anleger in der Schweiz (ungeprüft)	82
Angaben zu Artikel 8 der Verordnung (EU) 2019/2088 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 27. November 2019 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (ungeprüft)	86

## Informationen an die Aktionäre

Die geprüften Jahresberichte werden spätestens vier Monate nach Ablauf eines jeden Geschäftsjahres und die ungeprüften Halbjahresberichte spätestens zwei Monate nach Ablauf der ersten Hälfte des Geschäftsjahres veröffentlicht.

Das Geschäftsjahr des Fonds beginnt am 1. Juli eines jeden Jahres und endet am 30. Juni des darauf folgenden Jahres.

Zeichnungen können nur auf Basis des jeweils gültigen Verkaufsprospektes (nebst Anhängen) und der jeweils gültigen Basisinformationsblätter, sowie mit dem zuletzt erschienenen Jahresbericht und, wenn der Stichtag des letzteren länger als acht Monate zurückliegt, zusätzlich mit dem jeweils aktuellen Halbjahresbericht, erfolgen.

Die Berichte sowie der jeweils gültige Verkaufsprospekt / Emissionsdokument (nebst Anhängen) und die jeweils gültigen Basisinformationsblätter sind bei der Verwahrstelle, der Verwaltungsgesellschaft und den Zahl- und Informationsstellen kostenlos erhältlich.

Der Verwaltungsrat der SICAV bestätigt, sich während des Geschäftsjahres in seiner Tätigkeit für den Fonds in allen wesentlichen Belangen an die von der ALFI im "ALFI Code of Conduct for Luxembourg Investment Funds" von 2009 (in der letzten Fassung vom Juni 2022) festgelegten Grundsätze gehalten zu haben.

### Hinweis über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten

**Der Fonds und alle seine Teilfonds unterliegen Artikel 8 der Verordnung (EU) 2019/2088 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 27. November 2019 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor. Die diesen Finanzprodukten zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen grundsätzlich Produkte mit ökologischen und/ oder sozialen Merkmalen.**

Die Gesellschaft, die Verwaltungsgesellschaft, die Register- und Transferstelle und sonstige Beauftragte dürfen Informationen über Investoren an externe Parteien weitergeben, z.B. an den Fondsiniciator, autorisierte Vertriebsstellen oder wie notwendig erachtet von der Gesellschaft, von der Verwaltungsgesellschaft, von der Register- und Transferstelle oder von sonstigen Beauftragten, die von ihnen zur Bereitstellung von erweiterten Anlegerdiensten genutzt werden, sowie - insbesondere in Bezug auf die Register- und Transferstelle - für die Delegation von Datenverarbeitungsvorgängen als Teil der Aufgaben der Register- und Transferstelle. Der Antragssteller ist ferner damit einverstanden, dass Informationen über Investoren (vorbehaltlich der Anwendungen örtlicher Gesetze und/oder Vorschriften) außerhalb Luxemburgs genutzt werden können und daher möglicherweise der Prüfung durch Aufsichts- und Steuerbehörden außerhalb Luxemburgs unterliegen. Wenn Informationen über Investoren an Länder übermittelt werden, die in Bezug auf Datenschutzvorschriften nicht als gleichwertig betrachtet werden, ist es gesetzlich erforderlich, dass die Gesellschaft, die Verwaltungsgesellschaft, die Register- und Transferstelle oder sonstige Beauftragte angemessene Maßnahmen ergreifen.

## Management und Verwaltung

### Gesellschaftssitz

9A, rue Gabriel Lippmann  
L-5365 Munsbach

### Verwaltungsrat der Gesellschaft

#### Vorsitzender

Dr. Roman von Ah  
Geschäftsführender Partner  
Swiss Rock Asset Management AG,  
Zürich/Schweiz

#### Mitglieder

bis zum 30. November 2023:

Lobsang Gangshontsang  
Senior Operations Manager  
Swiss Rock Asset Management AG,  
Zürich/Schweiz

seit dem 1. Dezember 2023:

Markus Herbert Rellstab  
Leiter Logistik Chief Operating Officer  
Swiss Rock Asset Management AG,  
Zürich/Schweiz

Christian Raschke  
Head of NAV-Oversight ManCo Services  
LRI Invest S.A., Munsbach/Luxemburg

Christian Lehnertz  
Head of Fund Consulting & Structuring  
LRI Invest S.A., Munsbach/Luxemburg

### Verwahrstelle, Register- und Transferstelle sowie Hauptzahlstelle in Luxemburg

CACEIS Investor Services Bank S.A.<sup>1)</sup>  
14, Porte de France  
L-4360 Esch-sur-Alzette  
[www.caceis.com](http://www.caceis.com)

### Zahl- und Informationsstelle in der Bundesrepublik Deutschland

Landesbank Baden-Württemberg  
Große Bleiche 54-56  
D-55116 Mainz  
[www.lbbw.de](http://www.lbbw.de)

### Zahlstelle in der Schweiz

CACEIS Investor Services Bank S.A.<sup>1)</sup>  
Esch-sur-Alzette, Zweigniederlassung Zürich  
Bleicherweg 7  
CH-8027 Zürich  
[www.caceis.com](http://www.caceis.com)

### Verwaltungsgesellschaft, Promoter

LRI Invest S.A.  
9A, rue Gabriel Lippmann  
L-5365 Munsbach  
[www.lri-group.lu](http://www.lri-group.lu)

### Managing Board der Verwaltungsgesellschaft

bis zum 30. September 2023:

Utz Schüller  
Mitglied des Managing Board  
LRI Invest S.A., Munsbach/Luxemburg

Frank Alexander de Boer  
Mitglied des Managing Board  
LRI Invest S.A., Munsbach/Luxemburg

Marc-Oliver Scharwath  
Mitglied des Managing Board  
LRI Invest S.A., Munsbach/Luxemburg

### Aufsichtsrat der Verwaltungsgesellschaft

David Rhydderch (Vorsitzender)  
Global Head Financial Solutions  
Apex Fund Services  
London/Großbritannien

Dr. Dirk Franz  
Mitglied der Geschäftsführung  
LBBW Asset Management Investment-  
gesellschaft mbH  
Stuttgart/Deutschland

Thomas Rosenfeld (Mitglied des Aufsichtsrats)  
Generalbevollmächtigter  
Fürstlich Castell'sche Bank  
Würzbank/Deutschland

seit dem 1. September 2023:  
Karen Armenakyan (Mitglied des Aufsichtsrats)  
Bereichsleiter Vermögensverwaltung und  
Wertpapiere  
Baden-Württembergische Bank  
Stuttgart/Deutschland

<sup>1)</sup> Mit Wirkung zum 3. Juli 2023 fand eine Übernahme der RBC Investor Services Bank durch die CACEIS Investor Services Bank S.A. statt. Hierzu verweisen wir auf das Kapitel "Wichtige Ereignisse während des Geschäftsjahres" im Anhang dieses Berichts.

## Management und Verwaltung

### **Fondsmanager und Hauptvertriebsstelle, sowie Vertreter in der Schweiz**

Swiss Rock Asset Management AG  
Rigistraße 60  
CH-8006 Zürich  
[www.swiss-rock.ch](http://www.swiss-rock.ch)

### **Zentralverwaltungsstelle**

Apex Fund Services S.A.  
3, rue Gabriel Lippmann  
L-5365 Munsbach  
[www.apexfundservices.com](http://www.apexfundservices.com)

### **Abschlussprüfer**

PricewaterhouseCoopers, Société coopérative  
2, rue Gerhard Mercator  
L-2182 Luxemburg  
[www.pwc.com/lu](http://www.pwc.com/lu)

## **Bericht über den Geschäftsverlauf**

### **Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav – European Equity / Aktien Europe ESG**

Der Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav – European Equity / Aktien Europe ESG A erzielte in der Berichtsperiode eine Rendite von 16,5% (in EUR). Über den gleichen Zeitraum hat der Index MSCI Europa ESG Universal eine Nettorendite von 14,9% erreicht.

Die Berichtsperiode war geprägt vom Ende des raschen Zinserhöhungszyklus in den USA und der Frage, ob die Inflation nun nachhaltig gesunken ist.

Das Ende der Zinserhöhungen wurde Ende Juni 2023 mit einer FED Fund Rate von 5,5% erreicht. Es dauerte dann doch bis Ende Oktober 2023, bis der Markt zu einer Rally bis zum Ende der Berichtsperiode ansetzte. Dieses Rally profitierte vor allem von den stark gesunkenen Renditen der US-Staatsanleihen, die auf rund 4,3% fielen.

Tiefere Zinsen und ein anhaltender Boom von AI (künstliche Intelligenz) hat in Europa den Technologiesektor angetrieben. Softwarefirmen und Halbleiterproduzenten konnten im Schnitt über 30% in den letzten 12 Monaten zulegen. SAP gehörte mit dem erheblichen Anteil an Cloudbusiness zu den Gewinnern. Bei den Halbleitern konnten sich die beiden holländischen Firmen ASML und ASM praktisch Monopolstellungen für die Produktion von AI-Chips sichern. ASML ist vor allem in der Lithografie tätig, während ASM in Beschichtungsprozessen führend ist.

Aufgrund der generell höheren Zinsen haben auch die Finanzwerte zugelegt. Vor allem die Banken aus Italien (UniCredit, Intesa Sanpaolo) sind um über 50% gewachsen. Eher konservativ aufgestellte Banken hatten das Nachsehen. Bei den Versicherungsinstituten haben die Rückversicherer vom Wirtschaftswachstum und den höheren Versicherungsprämien profitieren können. Dass die Schadenfälle im 2023 ebenfalls eher klein waren, hat der Profitabilität ebenfalls geholfen.

Neben AI hat ein weiteres Thema die Märkte geprägt: die neuen Methoden zur Bekämpfung von Fettleibigkeit. Novo Nordisk hat mit dem Produkt Ozempic und Wegovy Zulassungen für die grössten Märkte in den USA und China erhalten. Damit ist Novo das wertvollste Unternehmen in Europa geworden.

Nicht zyklische Konsumgüter konnten vom Aufschwung in der Berichtsperiode kaum profitieren. Vor allem der Nahrungsmittelgigant Nestlé hatte wegen der defensiven Positionierung unter Abgaben zu leiden.

Für eine detaillierte Darstellung der Anlagepolitik des Teilfonds verweisen wir auf das aktuelle Verkaufsprospekt.



## **Bericht über den Geschäftsverlauf**

### **Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav – Global Equity / Aktien Welt ESG**

Der Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav – Global Equity / Aktien Welt ESG A erzielte in der Berichtsperiode eine Rendite von 23,5% (in EUR). Über den gleichen Zeitraum hat der Index MSCI Welt ESG Universal eine Nettorendite von 23% erreicht. Der klassische Aktien Welt Index ohne ESG Berücksichtigung hat 22,4% gemacht.

Die Berichtsperiode war geprägt vom Ende des raschen Zinserhöhungszyklus in den USA und der Frage, ob die Inflation nun nachhaltig gesunken ist.

Das Ende der Zinserhöhungen wurde Ende Juni 2023 mit einer FED Fund Rate von 5,5% erreicht. Es dauerte dann doch bis Ende Oktober 2023, bis der Markt zu einer Rally bis zum Ende der Berichtsperiode ansetzte. Dieses Rally profitierte vor allem von den stark gesunkenen Renditen der US-Staatsanleihen, die auf rund 4,3% fielen.

Tiefere Zinsen und ein anhaltender Boom von AI (künstliche Intelligenz) hat vor allem den US-Markt mit dem hohen Anteil an Technologieunternehmen angetrieben. Der US-Markt legte 29,5% in Euro in der Berichtsperiode zu. In USD waren es sogar 31,2%.

Technologieaktien sind in den USA der gewichtigste Sektor und haben mit einer Rendite von 50% in der Berichtsperiode alle anderen Sektoren geschlagen. Dank dem AI Gewinner Nvidia, der in Euro knapp 200% zulegte, waren die Halbleiterproduzenten die gesuchtesten Werte. Neben Nvidia profitieren auch Micron Technology, Broadcom KLA Corp oder Qualcomm von der grossen Nachfrage nach Rechenprozessoren. Softwaretitel haben mit knapp 30% eine beinahe bescheidene Rendite erzielt. Allerdings sind die Unterschiede auch hier sehr gross, Cloudunternehmen, Internet-Sicherheitsfirmen oder Webprovider legten deutlich zu, die Schwergewichte im Sektor wie Microsoft, Adobe oder Salesforce bremsen.

Bei den Finanzwerten überzeugten nach der Regionalbankenkrise die grösseren Institute wie JP Morgan oder Bank of America. Neben den klassischen Banken konnten die vielen Service Firmen im Finanzsektor ebenfalls von den höheren Zinsen profitieren.

Regional waren neben den USA auch die Märkte in Japan und Europa sehr attraktiv. Japan profitierte von Bestrebungen, den Markt attraktiver für Investoren zu gestalten. Dies führte zu mehr Investitionen und einer Reduktion des Eigenkapitals.

Für eine detaillierte Darstellung der Anlagepolitik des Teilfonds verweisen wir auf das aktuelle Verkaufsprospekt.

## Bericht über den Geschäftsverlauf

### Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav – Emerging Equity / Aktien Schwellenländer

Der Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav – Emerging Equity / Aktien Schwellenländer erzielte in der Berichtsperiode eine Rendite von 16,10% (in EUR) für die Anteilklasse B.

Die Performance der Schwellenländermärkte (11,95% in EUR, MSCI EM Universal ESG Net) liegt in der Berichtsperiode deutlich tiefer als jene der Industrienationen (22,96% in EUR, MSCI World Universal ESG Net).

Im zweiten Halbjahr 2023 wurde deutlich, dass die Wiedereröffnung Chinas nach der COVID-19-Pandemie das weltweite Wachstum nicht wie erwartet ankurbeln würde. Zwar kehrten die Verbraucher in Restaurants und Kinos zurück, doch größere Anschaffungen blieben weitgehend aus. Diese Entwicklung wurde durch Daten zum Verbrauchervertrauen untermauert, die eine negative Tendenz zeigten. Die wirtschaftliche Lethargie in China war hauptsächlich auf Probleme in der Immobilienbranche zurückzuführen, die nicht nur die Immobilienunternehmen, sondern auch die kommunalen Finanzen und letztlich die Gesamtwirtschaft beeinträchtigten.

China steht im Jahr 2024 an einem entscheidenden Punkt. Neue politische Initiativen zielen darauf ab, den Immobilienmarkt zu stabilisieren und das Wachstum in wichtigen Wirtschaftssegmenten angesichts mehrerer struktureller Herausforderungen wieder anzukurbeln.

Ende 2023 wurde prognostiziert, dass das globale Wachstum im Jahr 2024 bei 2,7% liegen würde. Diese Prognose wurde nun deutlich nach oben korrigiert und liegt aktuell bei 3%, trotz eines höheren als erwarteten Zinsumfelds. Der größte Motor des globalen Wachstums bleibt wie erwartet Indien, doch auch die Schwellenländer Indonesien und China werden voraussichtlich stärker als der globale Durchschnitt wachsen.

Der Aufstieg Indiens stellt eine interessante Opportunität dar. Mit einer jungen und wachsenden Bevölkerung und einem gesunden Wirtschaftswachstum verfügt das Land über attraktive Anlagemerkmale. Die Zusammensetzung der Sektoren ist gut diversifiziert und nicht von einer bestimmten Branche abhängig; Finanz-, Technologie- und Energiesektor machen zusammen etwa die Hälfte des indischen Referenzindex aus.

Die lateinamerikanischen Märkte können bis Ende 2023 auf sehr greifbare und signifikante Fortschritte an der Inflationsfront, eine Verbesserung des Wirtschaftswachstums, eine Stärkung der Aussenbilanzen durch höhere Leistungsbilanzsalden und eine starke Performance ihrer Währungen zurückblicken, insbesondere des COP, des MXN und des BRL. Eine Ausnahme bildet Argentinien, das nicht Teil unseres Anlageuniversums ist.

Für das Gesamtjahr 2024 wird für alle großen Schwellenländer ein Gewinnwachstum erwartet. Südkorea sticht mit einem erwarteten Gewinnwachstum von über 80% gegenüber dem Vorjahr hervor. Allerdings erscheinen die Bewertungen etwas überzogen, wenn auch nicht so extrem wie in Indien und Taiwan. Die Gewinne Südkoreas und Taiwans werden von der starken Nachfrage nach Halbleitern inmitten des KI-Booms profitieren.

Ob die erwartete Gewinnwende in China nach einigen schwierigen Jahren gelingt, ist schwer einzuschätzen. Dies wird davon abhängen, wie sich die verschiedenen Runden der geldpolitischen Lockerung auf die Wirtschaft und die Verbraucherstimmung auswirken werden.

Für eine detaillierte Darstellung der Anlagepolitik des Teilfonds verweisen wir auf das aktuelle Verkaufsprospekt.

## Bericht über den Geschäftsverlauf

### Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund

Die Aktienklasse A (EUR) des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund erzielte in der Berichtsperiode eine Rendite von 5,33%, die Rendite der Aktienklasse C (CHF) betrug 2,94%. Die Entwicklung der risikolosen Zinsen in Europa war im Berichtszeitraum von Unsicherheit und damit einhergehender Volatilität geprägt. Aufgrund gestiegener Rohstoffpreise, Engpässen in Lieferketten und steigender Nachfrage stiegen die Verbraucherpreise in vielen Ländern stark an. Entsprechend war zu Beginn der Berichtsperiode ein Anstieg der Zinsen zu beobachten. Im vierten Quartal 2023 setzte ein markanter Rückgang der Zinsen ein, der wiederum seit Anfang 2024 durch einen kontinuierlichen Anstieg der langfristigen Zinsen abgelöst wurde. Die Entspannung an der Inflationsfront führte zu einer intensiveren Diskussion über die Geldpolitik und die potenziellen Auswirkungen auf die wirtschaftliche Erholung. Nach dem Vorpreschen der SNB hat auch die EZB den Pfad einer wieder expansiveren Geldpolitik eingeschlagen und mit Zinssenkungen begonnen. In den USA war in Erwartung einer Zinssenkung durch das FED eine ähnliches Muster der Zinsentwicklung wie in Europa zu beobachten. Das Ergebnis dieser Markteinschätzung sind inverse Zinskurven, sprich die langfristigen Zinsen sind tiefer als die kurzfristigen. Aufgrund der hartnäckigen Inflation hat sich gegen Ende der Berichtsperiode die Erwartung stark fallender Zinsen am kurzen Ende der Kurve etwas verflüchtigt und die Normalisierung der Zinsen schritt insgesamt etwas langsamer voran als erwartet. Die reale Wirtschaft entwickelte sich solide, was sich auch in steigenden Aktienmärkten manifestierte. Dies widerspiegeln auch die tieferen Kreditrisikoprämien. Die Befürchtungen ansteigender Firmenkonkurse haben sich nicht materialisiert. Die Bonitätsprämie für Euro-Unternehmensanleihen mit einem Investment Grade Rating ist um rund ein halbes Prozent gefallen und notiert am Ende der Berichtsperiode nur noch leicht über einem Prozent. Die positive Performance über die Berichtsperiode erklärt sich weitestgehend durch die Reduktion der Kreditrisikoprämien über das Jahr. Wir investierten vor allem in Neuemissionen solider Firmen und untergewichteten High Yield. Die aktuellen Kreditrisikoprämien überkompensieren das durchschnittliche Konkursrisiko für Anleihen bester Qualität und entsprechend favorisierten wir eine Strategie, welche selektiv in attraktiv bewertete Neuemissionen investierte. Der Einfluss der risikolosen Zinsen auf die Performance war gering aufgrund der tiefen Zinsduration im Fonds.

Für eine detaillierte Darstellung der Anlagepolitik des Teilfonds verweisen wir auf das aktuelle Verkaufsprospekt.

## Bericht über den Geschäftsverlauf

### Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund Plus

Die Aktienklasse A (EUR) des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund Plus erzielte in der Berichtsperiode eine Rendite von 5,66%, die Rendite der Aktienklasse C (CHF) betrug 3,34%. Die Entwicklung der risikolosen Zinsen in Europa war im Berichtszeitraum von Unsicherheit und damit einhergehender Volatilität geprägt. Aufgrund gestiegener Rohstoffpreise, Engpässen in Lieferketten und steigender Nachfrage stiegen die Verbraucherpreise in vielen Ländern stark an. Entsprechend war zu Beginn der Berichtsperiode ein Anstieg der Zinsen zu beobachten. Im vierten Quartal 2023 setzte ein markanter Rückgang der Zinsen ein, der wiederum seit Anfang 2024 durch einen kontinuierlichen Anstieg der langfristigen Zinsen abgelöst wurde. Die Entspannung an der Inflationsfront führte zu einer intensiveren Diskussion über die Geldpolitik und die potenziellen Auswirkungen auf die wirtschaftliche Erholung. Nach dem Vorpreschen der SNB hat auch die EZB den Pfad einer wieder expansiveren Geldpolitik eingeschlagen und mit Zinssenkungen begonnen. In den USA war in Erwartung einer Zinssenkung durch das FED ein ähnliches Muster der Zinsentwicklung wie in Europa zu beobachten. Das Ergebnis dieser Markteinschätzung sind inverse Zinskurven, sprich die langfristigen Zinsen sind tiefer als die kurzfristigen. Aufgrund der hartnäckigen Inflation hat sich gegen Ende der Berichtsperiode die Erwartung stark fallender Zinsen am kurzen Ende der Kurve etwas verflüchtigt und die Normalisierung der Zinsen schritt insgesamt etwas langsamer voran als erwartet. Die reale Wirtschaft entwickelte sich solide, was sich auch in steigenden Aktienmärkten manifestierte. Dies widerspiegeln auch die tieferen Kreditrisikoprämien. Die Befürchtungen ansteigender Firmenkonkurse haben sich nicht materialisiert. Die Bonitätsprämie für Euro-Unternehmensanleihen mit einem Investment Grade Rating ist um rund ein halbes Prozent gefallen und notiert am Ende der Berichtsperiode nur noch leicht über einem Prozent. Die positive Performance über die Berichtsperiode erklärt sich weitestgehend durch die Reduktion der Kreditrisikoprämien über das Jahr. Wir investierten vor allem in Neuemissionen solider Firmen und untergewichteten High Yield. Die aktuellen Kreditrisikoprämien überkompensieren das durchschnittliche Konkursrisiko für Anleihen bester Qualität und entsprechend favorisierten wir eine Strategie, welche selektiv in attraktiv bewertete Neuemissionen investierte. Der Einfluss der risikolosen Zinsen auf die Performance war gering aufgrund der tiefen Zinsduration im Fond.

Für eine detaillierte Darstellung der Anlagepolitik des Teilfonds verweisen wir auf das aktuelle Verkaufsprospekt.

Der Fonds und alle seine Teilfonds unterliegen Artikel 8 der Verordnung (EU) 2019/2088 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 27. November 2019 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor. Die diesen Finanzprodukten zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen grundsätzlich Produkte mit ökologischen und/ oder sozialen Merkmalen. Für die regelmäßigen Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten verweisen wir auf die Angaben im ungeprüften Anhang dieses Berichtes.

### Hinweis zum Russland / Ukraine Konflikt

Aufgrund des Konflikts zwischen Russland und der Ukraine hat die LRI Invest S.A. in Übereinstimmung mit den Empfehlungen der CSSF geprüft, ob und inwiefern die LRI Invest S.A. oder die von der LRI Invest S.A. verwalteten Fonds von den beschlossenen Sanktionen betroffen sind. Im Rahmen der durchgeführten Analysen wurde festgestellt, dass eine Aufrechterhaltung des Geschäftsbetriebes bei der LRI Invest S.A. weiterhin gewährleistet ist. Es erfolgt eine laufende Überwachung des direkten und indirekten Exposures gegenüber russischen und/oder ukrainischen Emittenten, um entsprechende Gegenmaßnahmen für den Fonds einleiten zu können.

Munsbach, im September 2024

Der Verwaltungsrat

## Swiss Rock (Lux) Sicav - Global Equity / Aktien Welt ESG

### Zusammensetzung des Netto-Fondsvermögens des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Global Equity / Aktien Welt ESG per 30. Juni 2024

Position	Betrag in EUR
Wertpapiervermögen	101.347.177,09
(Wertpapiereinstandskosten EUR 64.073.512,59)	
Derivate	-20.338,59
Bankguthaben	951.873,56
Sonstige Vermögensgegenstände	88.622,81
<b>Summe Aktiva</b>	<b>102.367.334,87</b>
Bankverbindlichkeiten	-2.892,97
Sonstige Verbindlichkeiten	-622.259,63
<b>Summe Passiva</b>	<b>-625.152,60</b>
<b>Netto-Teilfondsvermögen</b>	<b>101.742.182,27</b>

### Währungs-Übersicht des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Global Equity / Aktien Welt ESG

Währung	Kurswert in Mio. EUR	in % des Netto- Teilfondsvermögens
USD	71,42	70,21
EUR	9,87	9,70
JPY	5,99	5,88
CAD	3,66	3,59
GBP	3,50	3,44
AUD	2,14	2,10
CHF	2,05	2,02
DKK	1,44	1,41
SEK	1,26	1,24
Sonstige Währungen	0,41	0,41
<b>Summe</b>	<b>101,74</b>	<b>100,00</b>

### Wertpapierkategorie-Übersicht des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Global Equity / Aktien Welt ESG

Wertpapierkategorie	Kurswert in Mio. EUR	in % des Netto- Teilfondsvermögens
Aktien	100,07	98,35
REITS	1,05	1,04
Genussscheine	0,23	0,22
<b>Summe</b>	<b>101,35</b>	<b>99,61</b>

### Länder-Übersicht des Wertpapiervermögens des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Global Equity / Aktien Welt ESG

Länder	Kurswert in Mio. EUR	in % des Netto- Teilfondsvermögens
USA	68,97	67,78
Japan	5,91	5,81
Kanada	3,94	3,87
Großbritannien	3,44	3,38
Frankreich	2,70	2,65
Schweiz	2,54	2,50
Bundesrepublik Deutschland	2,47	2,43
Niederlande	2,35	2,31
Australien	2,14	2,10
Sonstige Länder	6,89	6,78
<b>Summe</b>	<b>101,35</b>	<b>99,61</b>

Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

# Swiss Rock (Lux) Sicav - Global Equity / Aktien Welt ESG

## Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2024 des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Global Equity / Aktien Welt ESG

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg in 1.000	Bestand	Kurs zum 28.06.2024	Kurswert in EUR	in % des Netto- Teilfonds- vermögens
<b>Amtlich gehandelte Wertpapiere / Regulierter Markt</b>						
<b>Aktien</b>						
ANZ Group Holdings Ltd. Registered Shares o.N.	AU000000ANZ3	STK	14.000,00 AUD	28,2400	246.360,92	0,24
Aristocrat Leisure Ltd. Registered Shares o.N.	AU000000ALL7	STK	4.500,00 AUD	49,7600	139.531,41	0,14
AUB Group Ltd. Registered Shares o.N.	AU000000AUB9	STK	2.097,00 AUD	31,6900	41.409,48	0,04
Cochlear Ltd. Registered Shares o.N.	AU000000COH5	STK	500,00 AUD	332,1500	103.486,42	0,10
Coles Group Ltd. Registered Shares o.N.	AU00000030678	STK	9.100,00 AUD	17,0300	96.568,42	0,09
Commonwealth Bank of Australia Registered Shares o.N.	AU000000CBA7	STK	2.600,00 AUD	127,3800	206.373,38	0,20
Fortescue Ltd. Registered Shares o.N.	AU000000FMG4	STK	10.000,00 AUD	21,4100	133.412,26	0,13
Harvey Norman Holdings Ltd. Registered Shares o.N.	AU000000HVN7	STK	10.000,00 AUD	4,1700	25.984,55	0,03
Incitec Pivot Ltd. Registered Shares o.N.	AU000000IPL1	STK	11.090,00 AUD	2,9000	20.040,50	0,02
Insurance Australia Group Ltd. Registered Shares o.N.	AU000000IAG3	STK	20.500,00 AUD	7,1400	91.207,63	0,09
Origin Energy Ltd. Registered Shares o.N.	AU000000ORG5	STK	6.360,00 AUD	10,8600	43.039,38	0,04
Premier Investments Ltd. Registered Shares o.N.	AU000000PMV2	STK	1.100,00 AUD	31,1500	21.351,57	0,02
QBE Insurance Group Ltd. Registered Shares o.N.	AU000000QBE9	STK	11.525,00 AUD	17,3900	124.887,68	0,12
REA Group Ltd. Registered Shares o.N.	AU000000REA9	STK	700,00 AUD	196,6600	85.781,41	0,08
Reece Ltd. Registered Shares o.N.	AU000000REH4	STK	3.400,00 AUD	25,1700	53.326,27	0,05
Rio Tinto Ltd. Registered Shares o.N.	AU000000RIO1	STK	900,00 AUD	119,0000	66.737,29	0,07
Santos Ltd. Registered Shares o.N.	AU000000STO6	STK	15.500,00 AUD	7,6600	73.984,30	0,07
Steadfast Group Ltd Registered Shares o.N.	AU000000SDF8	STK	14.862,00 AUD	6,1800	57.232,78	0,06
Suncorp Group Ltd. Registered Shares o.N.	AU000000SUN6	STK	6.300,00 AUD	17,4100	68.346,83	0,07
Super Retail Group Ltd. Registered Shares o.N.	AU000000SUL0	STK	3.670,00 AUD	13,9500	31.902,11	0,03
The Lottery Corporation Ltd. Registered Shares o.N.	AU0000219529	STK	21.600,00 AUD	5,0700	68.240,28	0,07
Wesfarmers Ltd. Registered Shares o.N.	AU000000WES1	STK	3.000,00 AUD	65,1800	121.846,96	0,12
WiseTech Global Ltd. Registered Shares o.N.	AU000000WTC3	STK	900,00 AUD	100,3000	56.250,00	0,06
Alimentation Couche-Tard Inc. Registered Shares o.N.	CA01626P1484	STK	3.800,00 CAD	76,7700	198.919,91	0,20
Bank of Nova Scotia, The Registered Shares o.N.	CA0641491075	STK	6.000,00 CAD	62,5800	256.029,46	0,25
Canadian Imperial Bk of Comm. Registered Shares o.N.	CA1360691010	STK	4.700,00 CAD	65,0500	208.472,26	0,20
Canadian National Railway Co. Registered Shares o.N.	CA1363751027	STK	2.000,00 CAD	161,6600	220.462,99	0,22
Canadian Paci.Kansas City Ltd. Registered Shares o.N.	CA13646K1084	STK	2.000,00 CAD	107,7400	146.929,87	0,14
Constellation Software Inc. Registered Shares o.N.	CA21037X1006	STK	100,00 CAD	3.941,8800	268.785,93	0,26
Enbridge Inc. Registered Shares o.N.	CA29250N1050	STK	7.000,00 CAD	48,6700	232.307,12	0,23
IA Financial Corporation Inc. Registered Shares o.N.	CA45075E1043	STK	3.000,00 CAD	85,9100	175.738,98	0,17
Manulife Financial Corp. Registered Shares o.N.	CA56501R1064	STK	18.300,00 CAD	36,4300	454.583,21	0,45
National Bank of Canada Registered Shares o.N.	CA6330671034	STK	2.000,00 CAD	108,5100	147.979,95	0,15
Nutrien Ltd Registered Shares o.N.	CA67077M1086	STK	4.100,00 CAD	69,6500	194.718,90	0,19
Power Corporation of Canada Reg. Shares (Sub. Vtg) o.N.	CA7392391016	STK	7.500,00 CAD	38,0200	194.435,92	0,19
Suncor Energy Inc. Registered Shares o.N.	CA8672241079	STK	8.300,00 CAD	52,1500	295.145,07	0,29
Thomson Reuters Corp. Registered Shares o.N.	CA8849038085	STK	1.300,00 CAD	230,6100	204.420,58	0,20
Toronto-Dominion Bank, The Registered Shares o.N.	CA8911605092	STK	6.235,00 CAD	75,2000	319.710,89	0,31
West Fraser Timber Co. Ltd. Registered Shares o.N.	CA9528451052	STK	2.000,00 CAD	105,0700	143.288,67	0,14
ABB Ltd. Namens-Aktien SF 0,12	CH0012221716	STK	4.926,00 CHF	49,9200	255.340,76	0,25
Cie Financière Richemont AG Namens-Aktien SF 1	CH0210483332	STK	500,00 CHF	140,2500	72.815,53	0,07
Givaudan SA Namens-Aktien SF 10	CH0010645932	STK	21,00 CHF	4.260,0000	92.892,37	0,09
Holcim Ltd. Namens-Aktien SF 2	CH0012214059	STK	1.980,00 CHF	79,6200	163.696,17	0,16
Kühne + Nagel Internat. AG Namens-Aktien SF 1	CH0025238863	STK	253,00 CHF	258,4000	67.883,50	0,07
Nestlé S.A. Namens-Aktien SF -,10	CH0038863350	STK	2.485,00 CHF	91,7200	236.669,12	0,23
Novartis AG Namens-Aktien SF 0,49	CH0012005267	STK	5.052,00 CHF	96,1700	504.491,81	0,50
Partners Group Holding AG Namens-Aktien SF -,01	CH0024608827	STK	40,00 CHF	1.154,0000	47.931,05	0,05
Schindler Holding AG Namens-Aktien SF -,10	CH0024638212	STK	130,00 CHF	224,0000	30.237,27	0,03
Swiss Life Holding AG Namens-Aktien SF 0,10	CH0014852781	STK	156,00 CHF	660,6000	107.007,53	0,11
Swiss Re AG Namens-Aktien SF -,10	CH0126881561	STK	632,00 CHF	111,5000	73.171,69	0,07
Swisscom AG Namens-Aktien SF 1	CH0008742519	STK	100,00 CHF	505,5000	52.489,49	0,05
UBS Group AG Namens-Aktien SF -,10	CH0244767585	STK	7.000,00 CHF	26,4500	192.253,78	0,19
VAT Group AG Namens-Aktien SF -,10	CH0311864901	STK	140,00 CHF	509,4000	74.052,23	0,07

Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

## Swiss Rock (Lux) Sicav - Global Equity / Aktien Welt ESG

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg in 1.000	Bestand	Kurs zum 28.06.2024	Kurswert in EUR	in % des Netto- Teilfonds- vermögens
Zurich Insurance Group AG Nam.-Aktien SF 0,10	CH0011075394	STK	502,00	CHF 479,1000	249.735,94	0,25
A.P.Møller-Mærsk A/S Navne-Aktier B DK 1000	DK0010244508	STK	40,00	DKK 12.105,0000	64.928,36	0,06
Carlsberg AS Navne-Aktier B DK 20	DK0010181759	STK	489,00	DKK 835,6000	54.791,97	0,05
Demant AS Navne Aktier A DK 0,2	DK0060738599	STK	1.300,00	DKK 301,4000	52.540,75	0,05
DSV A/S Indehaver Bonus-Aktier DK 1	DK0060079531	STK	515,00	DKK 1.067,0000	73.685,38	0,07
Novo-Nordisk AS Navne-Aktier B DK 0,1	DK0062498333	STK	7.840,00	DKK 1.005,6000	1.057.184,96	1,04
Novonosis A/S Navne-Aktier B DK 2	DK0060336014	STK	942,00	DKK 426,1000	53.823,52	0,05
Rockwool A/S Navne-Aktier B DK 10	DK0010219153	STK	200,00	DKK 2.826,0000	75.789,98	0,07
Svitzer Group A/S Almindelig Aktie DK 10	DK0062616637	STK	80,00	DKK 259,5500	2.784,33	0,00
ACCOR S.A. Actions Port. EO 3	FR0000120404	STK	1.500,00	EUR 38,3000	57.450,00	0,06
Acerinox SA (CE Fab.Acero In.) Acciones Nom. EO -,25	ES0132105018	STK	4.000,00	EUR 9,6900	38.760,00	0,04
Aena SME S.A. Acciones Port. EO 10	ES0105046009	STK	350,00	EUR 188,0000	65.800,00	0,06
Ahold Delhaize N.V., Koninkl. Aandelen aan toonder EO -,01	NL0011794037	STK	5.025,00	EUR 27,5900	138.639,75	0,14
Air Liquide-SA Ét.Expl.P.G.CI. Actions Port. EO 5,50	FR0000120073	STK	694,00	EUR 161,2800	111.928,32	0,11
Airbus SE Aandelen aan toonder EO 1	NL0000235190	STK	757,00	EUR 128,2600	97.092,82	0,10
Allianz SE vink.Namens-Aktien o.N.	DE0008404005	STK	953,00	EUR 259,5000	247.303,50	0,24
Andritz AG Inhaber-Aktien o.N.	AT0000730007	STK	1.275,00	EUR 57,8500	73.758,75	0,07
Anheuser-Busch InBev S.A./N.V. Actions au Port. o.N.	BE0974293251	STK	2.651,00	EUR 54,1200	143.472,12	0,14
ArcelorMittal S.A. Actions Nouvelles Nominat. oN	LU1598757687	STK	1.500,00	EUR 21,3700	32.055,00	0,03
ASM International N.V. Bearer Shares EO 0,04	NL0000334118	STK	150,00	EUR 711,8000	106.770,00	0,10
ASML Holding N.V. Aandelen op naam EO -,09	NL0010273215	STK	934,00	EUR 964,2000	900.562,80	0,89
AXA S.A. Actions Port. EO 2,29	FR0000120628	STK	3.272,00	EUR 30,4950	99.779,64	0,10
Banco Bilbao Vizcaya Argent. Acciones Nom. EO 0,49	ES0113211835	STK	15.431,00	EUR 9,3520	144.310,71	0,14
Banco Santander S.A. Acciones Nom. EO 0,50	ES0113900J37	STK	36.000,00	EUR 4,3305	155.898,00	0,15
BAWAG Group AG Inhaber-Aktien o.N.	AT0000BAWAG2	STK	700,00	EUR 59,1000	41.370,00	0,04
Bca Monte dei Paschi di Siena Azioni nom. o.N.	IT0005508921	STK	7.335,00	EUR 4,3860	32.171,31	0,03
Beiersdorf AG Inhaber-Aktien o.N.	DE0005200000	STK	452,00	EUR 136,5500	61.720,60	0,06
BNP Paribas S.A. Actions Port. EO 2	FR0000131104	STK	2.907,00	EUR 59,5300	173.053,71	0,17
Bouygues S.A. Actions Port. EO 1	FR0000120503	STK	1.874,00	EUR 29,9700	56.163,78	0,06
BPER Banca S.p.A. Azioni nom. EO 3	IT0000066123	STK	6.705,00	EUR 4,7210	31.654,31	0,03
Brunello Cucinelli S.P.A. Azioni nom. o. N.	IT0004764699	STK	372,00	EUR 93,5000	34.782,00	0,03
Bureau Veritas SA Actions au Porteur EO -,12	FR0006174348	STK	1.259,00	EUR 25,8400	32.532,56	0,03
BUZZI S.p.A. Azioni nom. o.N.	IT0001347308	STK	1.902,00	EUR 37,5800	71.477,16	0,07
Capgemini SE Actions Port. EO 8	FR0000125338	STK	425,00	EUR 185,7000	78.922,50	0,08
Cie Génle ÉtS Michelin SCpA Actions Nom. EO -,50	FR001400AJ45	STK	2.800,00	EUR 36,1100	101.108,00	0,10
Compagnie de Saint-Gobain S.A. Actions au Porteur (C.R.) EO 4	FR0000125007	STK	1.422,00	EUR 72,5800	103.208,76	0,10
CTS Eventim AG & Co. KGaA Inhaber-Aktien o.N.	DE0005470306	STK	431,00	EUR 77,9000	33.574,90	0,03
Danone S.A. Actions Port. EO-,25	FR0000120644	STK	1.876,00	EUR 57,0800	107.082,08	0,11
Deutsche Börse AG Namens-Aktien o.N.	DE0005810055	STK	750,00	EUR 191,1000	143.325,00	0,14
Deutsche Post AG Namens-Aktien o.N.	DE0005552004	STK	2.900,00	EUR 37,7900	109.591,00	0,11
Deutsche Telekom AG Namens-Aktien o.N.	DE0005557508	STK	5.136,00	EUR 23,4800	120.593,28	0,12
E.ON SE Namens-Aktien o.N.	DE000ENAG999	STK	7.000,00	EUR 12,2550	85.785,00	0,08
Eckert & Ziegler SE Inhaber-Aktien o.N.	DE0005659700	STK	800,00	EUR 45,8600	36.688,00	0,04
Endesa S.A. Acciones Port. EO 1,20	ES0130670112	STK	2.272,00	EUR 17,5350	39.839,52	0,04
ENEL S.p.A. Azioni nom. EO 1	IT0003128367	STK	12.645,00	EUR 6,4940	82.116,63	0,08
Engie S.A. Actions Port. EO 1	FR0010208488	STK	4.491,00	EUR 13,3350	59.887,49	0,06
ENI S.p.A. Azioni nom. o.N.	IT0003132476	STK	6.451,00	EUR 14,3540	92.597,65	0,09
Eramet S.A. Actions Port. EO 3,05	FR0000131757	STK	333,00	EUR 94,1500	31.351,95	0,03
Erste Group Bank AG Inhaber-Aktien o.N.	AT0000652011	STK	1.435,00	EUR 44,2400	63.484,40	0,06
Ferrari N.V. Aandelen op naam EO -,01	NL0011585146	STK	201,00	EUR 380,7000	76.520,70	0,08
Ferrovial SE Registered Shares EO-,01	NL0015001FS8	STK	1.600,00	EUR 36,2800	58.048,00	0,06
Fincombank Banca Fineco S.p.A. Azioni nom. EO -,33	IT0000072170	STK	2.500,00	EUR 13,9200	34.800,00	0,03
Generali S.p.A. Azioni nom. o.N.	IT0000062072	STK	4.434,00	EUR 23,2900	103.267,86	0,10
Heidelberg Materials AG Inhaber-Aktien o.N.	DE0006047004	STK	747,00	EUR 96,8200	72.324,54	0,07
Heineken Holding N.V. Aandelen aan toonder EO 1,60	NL0000008977	STK	700,00	EUR 73,6500	51.555,00	0,05
Heineken N.V. Aandelen aan toonder EO 1,60	NL0000009165	STK	677,00	EUR 90,3000	61.133,10	0,06
Henkel AG & Co. KGaA Inhaber-Vorzugsaktien o.St.o.N	DE0006048432	STK	849,00	EUR 83,2200	70.653,78	0,07
Hermes International S.C.A. Actions au Porteur o.N.	FR0000052292	STK	85,00	EUR 2.140,0000	181.900,00	0,18
Iberdrola S.A. Acciones Port. EO -,75	ES0144580Y14	STK	16.651,00	EUR 12,1150	201.726,87	0,20

Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

## Swiss Rock (Lux) Sicav - Global Equity / Aktien Welt ESG

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg in 1.000	Bestand	Kurs zum 28.06.2024	Kurswert in EUR	in % des Netto- Teilfonds- vermögens
Indra Sistemas S.A. Acciones Port. EO 0,20	ES0118594417	STK	3.144,00	EUR 19,3100	60.710,64	0,06
Industria de Diseño Textil SA Acciones Port. EO 0,03	ES0148396007	STK	4.049,00	EUR 46,3600	187.711,64	0,18
Infineon Technologies AG Namens-Aktien o.N.	DE0006231004	STK	3.913,00	EUR 34,3050	134.235,47	0,13
ING Groep N.V. Aandelen op naam EO -,01	NL0011821202	STK	9.500,00	EUR 15,9620	151.639,00	0,15
Intesa Sanpaolo S.p.A. Azioni nom. o.N.	IT0000072618	STK	25.000,00	EUR 3,4710	86.775,00	0,09
KBC Groep N.V. Parts Sociales Port. o.N.	BE0003565737	STK	1.000,00	EUR 65,9000	65.900,00	0,06
Kingspan Group PLC Registered Shares EO -,13	IE0004927939	STK	1.020,00	EUR 79,5000	81.090,00	0,08
L'Oréal S.A. Actions Port. EO 0,2	FR0000120321	STK	483,00	EUR 410,0500	198.054,15	0,19
Legrand S.A. Actions au Port. EO 4	FR0010307819	STK	900,00	EUR 92,6400	83.376,00	0,08
LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE Actions Port. (C.R.) EO 0,3	FR0000121014	STK	417,00	EUR 713,6000	297.571,20	0,29
Meliá Hotels International Acciones Port.EO 0,20	ES0176252718	STK	5.000,00	EUR 7,6650	38.325,00	0,04
Mercedes-Benz Group AG Namens-Aktien o.N.	DE0007100000	STK	1.403,00	EUR 64,5700	90.591,71	0,09
Münchener Rückvers.-Ges. AG vink.Namens-Aktien o.N.	DE0008430026	STK	488,00	EUR 467,0000	227.896,00	0,22
N.V. Bekaert S.A. Parts Sociales au Port. o.N.	BE0974258874	STK	1.332,00	EUR 39,0800	52.054,56	0,05
Nemetschek SE Inhaber-Aktien o.N.	DE0006452907	STK	451,00	EUR 91,8500	41.424,35	0,04
Publicis Groupe S.A. Actions Port. EO 0,40	FR0000130577	STK	1.039,00	EUR 99,1000	102.964,90	0,10
RATIONAL AG Inhaber-Aktien o.N.	DE0007010803	STK	51,00	EUR 777,5000	39.652,50	0,04
Rheinmetall AG Inhaber-Aktien o.N.	DE0007030009	STK	100,00	EUR 475,7000	47.570,00	0,05
Sanofi S.A. Actions Port. EO 2	FR0000120578	STK	1.134,00	EUR 89,9400	101.991,96	0,10
SAP SE Inhaber-Aktien o.N.	DE0007164600	STK	2.166,00	EUR 189,5200	410.500,32	0,40
Schaeffler AG Inhaber-Vorzugsakt.o.St. o.N.	DE000SHA0159	STK	10.479,00	EUR 5,3750	56.324,63	0,06
Schneider Electric SE Actions Port. EO 4	FR0000121972	STK	1.450,00	EUR 224,3000	325.235,00	0,32
Siemens AG Namens-Aktien o.N.	DE0007236101	STK	1.734,00	EUR 173,7200	301.230,48	0,30
Smurfit Kappa Group PLC Registered Shares EO -,001	IE00B1RR8406	STK	1.179,00	EUR 41,6000	49.046,40	0,05
Stellantis N.V. Aandelen op naam EO -,01	NL00150001Q9	STK	3.616,00	EUR 18,4220	66.613,95	0,07
STMicroelectronics N.V. Aandelen aan toonder EO 1,04	NL0000226223	STK	2.055,00	EUR 36,8650	75.757,58	0,07
Syensqo S.A. Actions au Porteur o.N.	BE0974464977	STK	448,00	EUR 83,5700	37.439,36	0,04
Symrise AG Inhaber-Aktien o.N.	DE000SYM9999	STK	600,00	EUR 114,3000	68.580,00	0,07
Tecnicas Reunidas S.A. Acciones Port. EO -,10	ES0178165017	STK	2.652,00	EUR 12,6300	33.494,76	0,03
thyssenkrupp AG Inhaber-Aktien o.N.	DE0007500001	STK	7.000,00	EUR 4,0380	28.266,00	0,03
TotalEnergies SE Actions au Porteur EO 2,50	FR0000120271	STK	4.913,00	EUR 62,3300	306.227,29	0,30
UniCredit S.p.A. Azioni nom. o.N.	IT0005239360	STK	4.639,00	EUR 34,6050	160.532,60	0,16
Universal Music Group N.V. Aandelen op naam EO1	NL00150001Y2	STK	3.000,00	EUR 27,7800	83.340,00	0,08
Veolia Environnement S.A. Actions au Porteur EO 5	FR0000124141	STK	1.816,00	EUR 27,9200	50.702,72	0,05
Wacker Chemie AG Inhaber-Aktien o.N.	DE000WCH8881	STK	407,00	EUR 101,8000	41.432,60	0,04
Wolters Kluwer N.V. Aandelen op naam EO -,12	NL0000395903	STK	1.000,00	EUR 154,8000	154.800,00	0,15
Anglo American PLC Registered Shares DL -,54945	GB00B1XZS820	STK	1.500,00	GBP 25,2000	44.264,91	0,04
Associated British Foods PLC Registered Shares LS -,0568	GB0006731235	STK	2.500,00	GBP 24,7400	72.949,22	0,07
AstraZeneca PLC Registered Shares DL -,25	GB0009895292	STK	2.801,00	GBP 123,5600	408.199,04	0,40
BAE Systems PLC Registered Shares LS -,025	GB0002634946	STK	8.500,00	GBP 13,2000	132.334,73	0,13
Balfour Beatty PLC Registered Shares LS -,50	GB0000961622	STK	10.000,00	GBP 3,6520	43.073,66	0,04
Barratt Developments PLC Registered Shares LS -,10	GB0000811801	STK	9.976,00	GBP 4,7220	55.560,15	0,05
Berkeley Group Holdings PLC Reg.Ordinary Shares LS-,054141	GB00BLJNXL82	STK	700,00	GBP 45,8800	37.879,34	0,04
BP PLC Registered Shares DL -,25	GB0007980591	STK	15.560,00	GBP 4,7520	87.210,14	0,09
British American Tobacco PLC Registered Shares LS -,25	GB0002875804	STK	3.075,00	GBP 24,3000	88.131,75	0,09
Bunzl PLC Registered Shares LS -,3214857	GB00B0744B38	STK	1.500,00	GBP 30,1000	53.252,34	0,05
Compass Group PLC Registered Shares LS -,1105	GB00BD6K4575	STK	3.037,00	GBP 21,6000	77.371,23	0,08
Computacenter PLC Registered Shares LS -,075555	GB00BV9FP302	STK	1.483,00	GBP 28,7200	50.235,02	0,05
Cranswick PLC Registered Shares LS -,10	GB0002318888	STK	900,00	GBP 44,4500	47.184,05	0,05
CRH PLC Registered Shares EO -,32	IE0001827041	STK	600,00	GBP 58,9600	41.724,36	0,04
GSK PLC Registered Shares LS-,3125	GB00BN7SWP63	STK	8.972,00	GBP 15,2950	161.852,62	0,16
HSBC Holdings PLC Registered Shares DL -,50	GB0005405286	STK	38.183,00	GBP 6,8390	307.994,97	0,30
Imperial Brands PLC Registered Shares LS -,10	GB0004544929	STK	1.900,00	GBP 20,2400	45.357,08	0,04
Investec PLC Registered Shares LS -,0002	GB00B17BBQ50	STK	9.434,00	GBP 5,7350	63.813,16	0,06
ITV PLC Registered Shares LS -,10	GB0033986497	STK	37.104,00	GBP 0,8050	35.228,78	0,03
London Stock Exchange GroupPLC Reg. Shares LS 0,069186047	GB00B0S0WJX34	STK	500,00	GBP 94,0000	55.434,33	0,05
National Grid PLC Reg. Shares LS -,12431289	GB00BDR05C01	STK	6.315,00	GBP 8,8260	65.738,27	0,06
NatWest Group PLC Registered Shares LS 1,0769	GB00BM8PJY71	STK	21.747,00	GBP 3,1180	79.975,40	0,08
NEXT PLC Registered Shares LS 0,10	GB0032089863	STK	750,00	GBP 90,3600	79.931,59	0,08

Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.



## Swiss Rock (Lux) Sicav - Global Equity / Aktien Welt ESG

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg in 1.000	Bestand	Kurs zum 28.06.2024	Kurswert in EUR	in % des Netto- Teilfonds- vermögens
Paragon Banking Group PLC Registered Shares LS 1	GB00B2NGPM57	STK	3.778,00	GBP 7,3500	32.751,43	0,03
Redrow PLC Registered Shares LS -,105	GB00BG11K365	STK	4.680,00	GBP 6,6700	36.817,36	0,04
Relx PLC Registered Shares LS -,144397	GB00B2B0DG97	STK	2.000,00	GBP 36,3900	85.840,66	0,08
Rio Tinto PLC Registered Shares LS -,10	GB0007188757	STK	1.682,00	GBP 52,0100	103.179,60	0,10
Rolls Royce Holdings PLC Registered Shares LS 0.20	GB00B63H8491	STK	10.122,00	GBP 4,5680	54.534,76	0,05
Sainsbury PLC, J. Registered Shs LS -,28571428	GB00B019KW72	STK	10.804,00	GBP 2,5500	32.494,19	0,03
Serco Group PLC Registered Shares LS -,02	GB0007973794	STK	20.925,00	GBP 1,7970	44.350,09	0,04
Shell PLC Reg. Shares Class EO -,07	GB00BP6MXD84	STK	12.500,00	GBP 28,3400	417.821,55	0,41
Standard Chartered PLC Registered Shares DL -,50	GB0004082847	STK	5.238,00	GBP 7,1600	44.234,33	0,04
Taylor Wimpey PLC Registered Shares LS -,01	GB0008782301	STK	25.389,00	GBP 1,4215	42.567,04	0,04
Tesco PLC Registered Shs LS-,0633333	GB00BLGZ9862	STK	27.834,00	GBP 3,0600	100.456,50	0,10
Unilever PLC Registered Shares LS -,031111	GB00B10RZP78	STK	5.116,00	GBP 43,4500	262.181,05	0,26
Vistry Group PLC Registered Shares LS -,50	GB0001859296	STK	3.235,00	GBP 11,8300	45.137,76	0,04
Vodafone Group PLC Registered Shares DL 0,2095238	GB00BH4HKS39	STK	53.277,00	GBP 0,6976	43.835,63	0,04
AIA Group Ltd Registered Shares o.N.	HK0000069689	STK	8.800,00	HKD 53,0000	55.738,80	0,05
ASMPT Ltd. Registered Shares New HD-,10	KYG0535Q1331	STK	3.500,00	HKD 108,9000	45.550,70	0,04
PCCW Ltd. Reg. Cons. Shares o.N.	HK0008011667	STK	43.000,00	HKD 3,9100	20.092,98	0,02
SITC International Hldg.Co.Ltd Registered Shs REG S HD -,10	KYG8187G1055	STK	16.000,00	HKD 21,2000	40.537,31	0,04
WH Group Ltd Registered Shares DL -,0001	KYG960071028	STK	200.000,00	HKD 5,1400	122.854,82	0,12
Advantest Corp. Registered Shares o.N.	JP3122400009	STK	2.800,00	JPY 6.425,0000	104.349,32	0,10
AMADA Co. Ltd. Registered Shares o.N.	JP3122800000	STK	12.400,00	JPY 1.777,0000	127.810,80	0,13
Astellas Pharma Inc. Registered Shares o.N.	JP3942400007	STK	7.200,00	JPY 1.590,0000	66.403,06	0,07
Bridgestone Corp. Registered Shares o.N.	JP3830800003	STK	2.500,00	JPY 6.322,0000	91.675,43	0,09
Canon Inc. Registered Shares o.N.	JP3242800005	STK	4.300,00	JPY 4.354,0000	108.596,38	0,11
Chugai Pharmaceutical Co. Ltd. Registered Shares o.N.	JP3519400000	STK	3.000,00	JPY 5.716,0000	99.465,38	0,10
Daiichi Sankyo Co. Ltd. Registered Shares o.N.	JP3475350009	STK	4.500,00	JPY 5.524,0000	144.186,51	0,14
Daiwa House Industry Co. Ltd. Registered Shares o.N.	JP3505000004	STK	2.400,00	JPY 4.077,0000	56.755,82	0,06
Daiwa Securities Group Inc. Registered Shares o.N.	JP3502200003	STK	28.800,00	JPY 1.227,0000	204.972,46	0,20
DMG Mori Co. Ltd. Registered Shares o.N.	JP3924800000	STK	4.100,00	JPY 4.177,0000	99.336,03	0,10
Financial Partners Grp.Co.Ltd. Registered Shares o.N.	JP3166990006	STK	2.000,00	JPY 2.238,0000	25.962,62	0,03
Hoya Corp. Registered Shares o.N.	JP3837800006	STK	800,00	JPY 18.705,0000	86.797,29	0,09
Hulic Co. Ltd. Registered Shares o.N.	JP3360800001	STK	13.100,00	JPY 1.424,5000	108.241,10	0,11
Isuzu Motors Ltd. Registered Shares o.N.	JP3137200006	STK	7.000,00	JPY 2.131,0000	86.524,67	0,09
Japan Exchange Group Inc. Registered Shares o.N.	JP3183200009	STK	6.400,00	JPY 3.752,0000	139.284,01	0,14
Japan Tobacco Inc. Registered Shares o.N.	JP3726800000	STK	6.300,00	JPY 4.348,0000	158.887,06	0,16
Kajima Corp. Registered Shares o.N.	JP3210200006	STK	2.000,00	JPY 2.781,5000	32.267,66	0,03
KDDI Corp. Registered Shares o.N.	JP3496400007	STK	4.500,00	JPY 4.254,0000	111.037,19	0,11
Keyence Corp. Registered Shares o.N.	JP3236200006	STK	300,00	JPY 70.550,0000	122.765,61	0,12
Komatsu Ltd. Registered Shares o.N.	JP3304200003	STK	6.500,00	JPY 4.671,0000	176.109,05	0,17
Marubeni Corp. Registered Shares o.N.	JP3877600001	STK	8.600,00	JPY 2.975,5000	148.428,35	0,15
Meitec Group Holdings Inc. Registered Shares o.N.	JP3919200000	STK	5.300,00	JPY 3.258,0000	100.157,95	0,10
Mitsubishi Corp. Registered Shares o.N.	JP3898400001	STK	7.500,00	JPY 3.148,0000	136.947,61	0,13
Mitsubishi Electric Corp. Registered Shares o.N.	JP3902400005	STK	9.000,00	JPY 2.567,5000	134.032,90	0,13
Mitsubishi HC Capital Inc. Registered Shares o.N.	JP3499800005	STK	11.900,00	JPY 1.062,0000	73.304,38	0,07
Mitsubishi UFJ Finl Grp Inc. Registered Shares o.N.	JP3902900004	STK	20.200,00	JPY 1.729,0000	202.583,85	0,20
Mitsui & Co. Ltd. Registered Shares o.N.	JP3893600001	STK	6.400,00	JPY 3.651,0000	135.534,63	0,13
Mitsui O.S.K. Lines Ltd. Registered Shares o.N.	JP3362700001	STK	2.000,00	JPY 4.818,0000	55.892,72	0,05
Mizuho Financial Group Inc. Registered Shares o.N.	JP3885780001	STK	7.650,00	JPY 3.358,0000	149.004,91	0,15
Nichias Corp. Registered Shares o.N.	JP3660400007	STK	3.100,00	JPY 4.720,0000	84.871,55	0,08
Nintendo Co. Ltd. Registered Shares o.N.	JP3756600007	STK	2.000,00	JPY 8.556,0000	99.256,56	0,10
Nippon Steel Corp. Registered Shares o.N.	JP3381000003	STK	4.800,00	JPY 3.401,0000	94.690,48	0,09
Nippon Tel. and Tel. Corp. Registered Shares o.N.	JP3735400008	STK	144.600,00	JPY 151,8000	127.320,55	0,13
Niterra Co. Ltd. Registered Shares o.N.	JP3738600000	STK	3.800,00	JPY 4.670,0000	102.934,02	0,10
Nomura Research Institute Ltd. Registered Shares o.N.	JP3762800005	STK	2.800,00	JPY 4.521,0000	73.426,19	0,07
Panasonic Holdings Corp. Registered Shares o.N.	JP3866800000	STK	9.900,00	JPY 1.317,0000	75.627,44	0,07
Recruit Holdings Co. Ltd. Registered Shares o.N.	JP3970300004	STK	2.600,00	JPY 8.607,0000	129.802,66	0,13
SCSK Corp. Registered Shares o.N.	JP3400400002	STK	6.000,00	JPY 3.213,0000	111.820,24	0,11
Sekisui House Ltd. Registered Shares o.N.	JP3420600003	STK	8.500,00	JPY 3.563,0000	175.668,22	0,17
Shin-Etsu Chemical Co. Ltd. Registered Shares o.N.	JP3371200001	STK	4.000,00	JPY 6.238,0000	144.731,75	0,14

Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

## Swiss Rock (Lux) Sicav - Global Equity / Aktien Welt ESG

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg in 1.000	Bestand	Kurs zum 28.06.2024	Kurswert in EUR	in % des Netto- Teilfonds- vermögens
SoftBank Corp. Registered Shares o.N.	JP3732000009	STK	16.600,00	JPY 1.964,5000	189.155,33	0,19
Sony Group Corp. Registered Shares o.N.	JP3435000009	STK	2.200,00	JPY 13.640,0000	174.058,61	0,17
Sumitomo Corp. Registered Shares o.N.	JP3404600003	STK	6.500,00	JPY 4.017,0000	151.451,52	0,15
Sundrug Co. Ltd. Registered Shares o.N.	JP3336600006	STK	2.700,00	JPY 4.054,0000	63.490,09	0,06
Tokyo Electron Ltd. Registered Shares o.N.	JP3571400005	STK	1.500,00	JPY 34.900,0000	303.651,30	0,30
Toyota Motor Corp. Registered Shares o.N.	JP3633400001	STK	17.300,00	JPY 3.290,0000	330.141,76	0,32
USS Co. Ltd. Registered Shares o.N.	JP3944130008	STK	10.600,00	JPY 1.353,5000	83.219,02	0,08
Yamaha Motor Co. Ltd. Registered Shares o.N.	JP3942800008	STK	12.600,00	JPY 1.489,0000	108.823,75	0,11
Equinor ASA Navne-Aksjer NK 2,50	NO0010096985	STK	4.913,00	NOK 303,9500	130.859,78	0,13
AAK AB Namn-Aktier SK 1,67	SE0011337708	STK	2.032,00	SEK 310,6000	55.606,98	0,05
Assa-Abloy AB Namn-Aktier B SK -,33	SE0007100581	STK	3.400,00	SEK 299,6000	89.748,02	0,09
Atlas Copco AB Namn-Aktier A SK -,052125	SE0017486889	STK	10.592,00	SEK 199,2000	185.896,60	0,18
Atlas Copco AB Namn-Aktier B (fria) o.N.	SE0017486897	STK	3.500,00	SEK 171,1500	52.777,53	0,05
Epiroc AB Namn-Aktier A o.N.	SE0015658109	STK	3.329,00	SEK 211,5000	62.033,79	0,06
Epiroc AB Namn-Aktier B o.N.	SE0015658117	STK	2.136,00	SEK 193,8000	36.471,96	0,04
Essity AB Namn-Aktier B	SE0009922164	STK	3.104,00	SEK 271,4000	74.222,52	0,07
Evolution AB (publ) Namn-Aktier SK-,003	SE0012673267	STK	452,00	SEK 1.104,0000	43.965,46	0,04
Indutrade AB Aktier SK 1	SE0001515552	STK	2.000,00	SEK 271,6000	47.859,03	0,05
Lagercrantz Group AB Namn-Aktier Ser.B o.N.	SE0014990966	STK	3.109,00	SEK 172,2000	47.169,15	0,05
Lifco AB Namn-Aktier B o.N.	SE0015949201	STK	3.199,00	SEK 291,0000	82.018,41	0,08
Saab AB Namn-Aktier B o.N.	SE0021921269	STK	2.400,00	SEK 255,0000	53.920,70	0,05
Sandvik AB Namn-Aktier o.N.	SE0000667891	STK	4.000,00	SEK 212,4000	74.854,63	0,07
Scandic Hotels Group AB Namn-Aktier EO -,25	SE0007640156	STK	8.349,00	SEK 64,2000	47.225,18	0,05
Sectra AB Namn-Aktier Ser.B o.N.	SE0020539310	STK	1.926,00	SEK 242,2000	41.099,31	0,04
Skandinaviska Enskilda Banken Namn-Aktier A (fria) SK 10	SE0000148884	STK	6.852,00	SEK 156,5000	94.479,12	0,09
Sweco AB Namn-Aktier B SK 1,-	SE0014960373	STK	2.511,00	SEK 145,4000	32.167,35	0,03
Swedbank AB Namn-Aktier A o.N.	SE0000242455	STK	2.800,00	SEK 218,1000	53.804,41	0,05
Volvo (publ), AB Namn-Aktier B (fria) o.N.	SE0000115446	STK	3.406,00	SEK 271,1000	81.353,89	0,08
3M Co. Registered Shares DL -,01	US88579Y1010	STK	2.400,00	USD 102,1900	228.836,95	0,22
Abbott Laboratories Registered Shares o.N.	US0028241000	STK	2.000,00	USD 103,9100	193.907,16	0,19
AbbVie Inc. Registered Shares DL -,01	US00287Y1091	STK	1.900,00	USD 171,5200	304.070,91	0,30
Accenture PLC Reg.Shares Class A DL-,0000225	IE00B4BNMY34	STK	1.100,00	USD 303,4100	311.407,51	0,31
Acuity Brands Inc. Registered Shares DL -,01	US00508Y1029	STK	700,00	USD 241,4400	157.693,49	0,15
Adobe Inc. Registered Shares o.N.	US00724F1012	STK	1.200,00	USD 555,5400	622.018,19	0,61
Advanced Drainage Systems Inc. Registered Shares DL -,01	US00790R1041	STK	1.300,00	USD 160,3900	194.548,17	0,19
Advanced Micro Devices Inc. Registered Shares DL -,01	US0079031078	STK	2.700,00	USD 162,2100	408.646,61	0,40
AerCap Holdings N.V. Aandelen op naam EO -,01	NL0000687663	STK	700,00	USD 93,2000	60.872,40	0,06
Agilent Technologies Inc. Registered Shares DL -,01	US00846U1016	STK	1.700,00	USD 129,6300	205.617,91	0,20
Airbnb Inc. Registered Shares DL -,01	US0090661010	STK	1.900,00	USD 151,6300	268.809,89	0,26
Ally Financial Inc. Registered Shares DL -,10	US02005N1000	STK	8.700,00	USD 39,6700	322.023,79	0,32
Alphabet Inc. Reg. Shs Cap.Stk Cl. C DL-,001	US02079K1079	STK	5.640,00	USD 183,4200	965.233,31	0,95
Alphabet Inc. Reg. Shs Cl. A DL-,001	US02079K3059	STK	9.000,00	USD 182,1500	1.529.601,12	1,50
Altria Group Inc. Registered Shares DL -,333	US02209S1033	STK	6.700,00	USD 45,5500	284.753,91	0,28
Amazon.com Inc. Registered Shares DL -,01	US0231351067	STK	12.100,00	USD 193,2500	2.181.782,13	2,14
Amdocs Ltd. Registered Shares LS -,01	GB0022569080	STK	5.378,00	USD 78,9200	396.017,50	0,39
American Electric Power Co.Inc Registered Shares DL 6,50	US0255371017	STK	2.800,00	USD 87,7400	229.225,10	0,23
American Express Co. Registered Shares DL -,20	US0258161092	STK	2.500,00	USD 231,5500	540.121,30	0,53
AMETEK Inc. Registered Shares DL -,01	US0311001004	STK	900,00	USD 166,7100	139.994,40	0,14
Amgen Inc. Registered Shares DL -,0001	US0311621009	STK	1.360,00	USD 312,4500	396.484,25	0,39
Apple Inc. Registered Shares o.N.	US0378331005	STK	15.100,00	USD 210,6200	2.967.447,63	2,92
Applied Materials Inc. Registered Shares o.N.	US0382221051	STK	3.300,00	USD 235,9900	726.631,21	0,71
Arista Networks Inc. Registered Shares DL -,0001	US0404131064	STK	700,00	USD 350,4800	228.911,59	0,22
AT & T Inc. Registered Shares DL 1	US00206R1023	STK	12.904,00	USD 19,1100	230.086,72	0,23
Automatic Data Processing Inc. Registered Shares DL -,10	US0530151036	STK	600,00	USD 238,6900	133.626,31	0,13
AutoZone Inc. Registered Shares DL -,01	US0533321024	STK	130,00	USD 2.964,1000	359.536,27	0,35
Axon Enterprise Inc. Registered Shares DL -,00001	US05464C1018	STK	700,00	USD 294,2400	192.179,15	0,19
Bank of America Corp. Registered Shares DL 0,01	US0605051046	STK	12.700,00	USD 39,7700	471.265,69	0,46
Becton, Dickinson & Co. Registered Shares DL 1	US0758871091	STK	1.000,00	USD 233,7100	218.063,91	0,21
Berkshire Hathaway Inc. Reg.Shares B New DL -,00333	US0846707026	STK	1.817,00	USD 406,8000	689.671,66	0,68

Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

## Swiss Rock (Lux) Sicav - Global Equity / Aktien Welt ESG

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg in 1.000	Bestand	Kurs zum 28.06.2024	Kurswert in EUR	in % des Netto- Teilfonds- vermögens
Boston Scientific Corp. Registered Shares DL -,01	US1011371077	STK	2.300,00	USD 77,0100	165.265,22	0,16
Broadcom Inc. Registered Shares DL -,001	US11135F1012	STK	800,00	USD 1.605,5300	1.198.436,20	1,18
Cadence Design Systems Inc. Registered Shares DL 0,01	US1273871087	STK	1.100,00	USD 307,7500	315.861,91	0,31
Capital One Financial Corp. Registered Shares DL -,01	US14040H1059	STK	2.600,00	USD 138,4500	335.871,24	0,33
Caterpillar Inc. Registered Shares DL 1	US1491231015	STK	1.200,00	USD 333,1000	372.960,11	0,37
CBRE Group Inc. Reg. Shares Class A DL -,01	US12504L1098	STK	1.900,00	USD 89,1100	157.974,34	0,16
Cencora Inc. Registered Shares DL -,01	US03073E1055	STK	1.500,00	USD 225,3000	315.325,40	0,31
Chevron Corp. Registered Shares DL -,75	US1667641005	STK	3.500,00	USD 156,4200	510.818,75	0,50
Chubb Ltd. Registered Shares SF 24,15	CH0044328745	STK	200,00	USD 255,0800	47.600,65	0,05
Cigna Group, The Registered Shares DL 1	US1255231003	STK	1.000,00	USD 330,5700	308.439,47	0,30
Cintas Corp. Registered Shares o.N.	US1729081059	STK	300,00	USD 700,2600	196.014,00	0,19
Cisco Systems Inc. Registered Shares DL-,001	US17275R1023	STK	10.000,00	USD 47,5100	443.293,68	0,44
Citigroup Inc. Registered Shares DL -,01	US1729674242	STK	4.900,00	USD 63,4600	290.136,69	0,29
Citizens Financial Group Inc. Registered Shares DL -,01	US1746101054	STK	7.800,00	USD 36,0300	262.219,73	0,26
CME Group Inc. Registered Shares DL-,01	US12572Q1058	STK	1.100,00	USD 196,6000	201.782,13	0,20
Coca-Cola Co., The Registered Shares DL -,25	US1912161007	STK	8.111,00	USD 63,6500	481.702,96	0,47
Comcast Corp. Reg. Shares Class A DL -,01	US20030N1019	STK	9.800,00	USD 39,1600	358.076,04	0,35
ConocoPhillips Registered Shares DL -,01	US20825C1045	STK	1.900,00	USD 114,3800	202.773,03	0,20
Consolidated Edison Inc. Registered Shares DL -,01	US2091151041	STK	2.100,00	USD 89,4200	175.210,64	0,17
Constellation Brands Inc. Reg. Shs Cl.A DL -,01	US21036P1084	STK	900,00	USD 257,2800	216.050,38	0,21
Costco Wholesale Corp. Registered Shares DL -,005	US22160K1051	STK	1.000,00	USD 849,9900	793.086,07	0,78
CrowdStrike Holdings Inc Registered Shs Cl.A DL-,0005	US22788C1053	STK	900,00	USD 383,1900	321.783,07	0,32
CSX Corp. Registered Shares DL 1	US1264081035	STK	4.600,00	USD 33,4500	143.568,93	0,14
CVS Health Corp. Registered Shares DL-,01	US1266501006	STK	4.100,00	USD 59,0600	225.935,15	0,22
D.R. Horton Inc. Registered Shares DL -,01	US23331A1097	STK	1.500,00	USD 140,9300	197.242,83	0,19
Discover Financial Services Registered Shares DL -,01	US2547091080	STK	2.200,00	USD 130,8100	268.515,98	0,26
DocuSign Inc. Registered Shares DL-,0001	US2561631068	STK	2.500,00	USD 53,5000	124.795,89	0,12
Dominos Pizza Inc. Registered Shares DL -,01	US25754A2015	STK	400,00	USD 516,3300	192.705,39	0,19
Dow Inc. Reg. Shares DL -,01	US2605571031	STK	4.000,00	USD 53,0500	197.993,94	0,19
Duke Energy Corp. Registered Shares New DL -,001	US26441C2044	STK	2.000,00	USD 100,2300	187.039,89	0,18
Eaton Corporation PLC Registered Shares DL -,01	IE00B8KQN827	STK	650,00	USD 313,5500	190.163,28	0,19
Ecolab Inc. Registered Shares DL 1	US2788651006	STK	1.700,00	USD 238,0000	377.513,41	0,37
Edwards Lifesciences Corp. Registered Shares DL 1	US28176E1082	STK	2.500,00	USD 92,3700	215.465,36	0,21
Elevance Health Inc. Registered Shares DL -,01	US0367521038	STK	900,00	USD 541,8600	455.025,89	0,45
Eli Lilly and Company Registered Shares o.N.	US5324571083	STK	1.600,00	USD 905,3800	1.351.628,64	1,33
Emcor Group Inc. Registered Shares DL -,01	US29084Q1004	STK	600,00	USD 365,0800	204.383,48	0,20
Emerson Electric Co. Registered Shares DL -,50	US2910111044	STK	2.158,00	USD 110,1600	221.810,38	0,22
EOG Resources Inc. Registered Shares DL -,01	US26875P1012	STK	1.700,00	USD 125,8700	199.653,84	0,20
Exxon Mobil Corp. Registered Shares o.N.	US30231G1022	STK	9.223,00	USD 115,1200	990.671,11	0,97
Fifth Third Bancorp Registered Shares o.N.	US3167731005	STK	8.000,00	USD 36,4900	272.376,95	0,27
First Horizon Corp. Registered Shares DL -,625	US3205171057	STK	16.000,00	USD 15,7700	235.428,04	0,23
Fortinet Inc. Registered Shares DL -,001	US34959E1091	STK	2.700,00	USD 60,2700	151.834,85	0,15
Fox Corp. Registered Shares A DL -,01	US35137L1052	STK	5.300,00	USD 34,3700	169.965,94	0,17
Garmin Ltd. Namens-Aktien SF 0,10	CH0114405324	STK	300,00	USD 162,9200	45.603,92	0,04
GE Aerospace Registered Shares DL -,06	US3696043013	STK	1.700,00	USD 158,9700	252.156,75	0,25
Gilead Sciences Inc. Registered Shares DL -,001	US3755581036	STK	3.600,00	USD 68,6100	230.460,46	0,23
Home Depot Inc., The Registered Shares DL -,05	US4370761029	STK	2.500,00	USD 344,2400	802.985,77	0,79
Honeywell International Inc. Registered Shares DL 1	US4385161066	STK	2.000,00	USD 213,5400	398.488,45	0,39
HP Inc. Registered Shares DL -,01	US40434L1052	STK	11.000,00	USD 35,0200	359.430,84	0,35
HubSpot Inc. Registered Shares DL -,001	US4435731009	STK	700,00	USD 589,7900	385.213,90	0,38
Huntington Bancshares Inc. Registered Shares DL-,01	US4461501045	STK	16.900,00	USD 13,1800	207.830,18	0,20
Intercontinental Exchange Inc. Registered Shares DL -,01	US45866F1049	STK	2.100,00	USD 136,8900	268.223,93	0,26
Intl Business Machines Corp. Registered Shares DL -,20	US4592001014	STK	3.000,00	USD 172,9500	484.114,77	0,48
Intuit Inc. Registered Shares DL -,01	US4612021034	STK	1.000,00	USD 657,2100	613.212,04	0,60
JPMorgan Chase & Co. Registered Shares DL 1	US46625H1005	STK	1.188,00	USD 202,2600	224.198,63	0,22
KLA Corp. Registered Shares DL 0,001	US4824801009	STK	400,00	USD 824,5100	307.724,75	0,30
Kroger Co., The Registered Shares DL 1	US5010441013	STK	4.300,00	USD 49,9300	200.325,64	0,20
Lam Research Corp. Registered Shares DL -,001	US5128071082	STK	500,00	USD 1.064,8500	496.780,97	0,49
Lennox International Inc. Registered Shares DL -,01	US5261071071	STK	600,00	USD 534,9800	299.498,95	0,29

Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

## Swiss Rock (Lux) Sicav - Global Equity / Aktien Welt ESG

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg in 1.000	Bestand	Kurs zum 28.06.2024	Kurswert in EUR	in % des Netto- Teilfonds- vermögens
Linde plc Registered Shares EO -,001	IE000S9YS762	STK	430,00	USD 438,8100	176.056,26	0,17
Lowe's Companies Inc. Registered Shares DL -,50	US5486611073	STK	1.800,00	USD 220,4600	370.261,72	0,36
Lululemon Athletica Inc. Registered Shares o.N.	US5500211090	STK	600,00	USD 298,7000	167.221,83	0,16
Lyondellbasell Industries NV Registered Shares A EO -,04	NL0009434992	STK	1.000,00	USD 95,6600	89.255,89	0,09
Marathon Petroleum Corp. Registered Shares DL -,01	US56585A1025	STK	2.700,00	USD 173,4800	437.038,49	0,43
Marsh & McLennan Cos. Inc. Registered Shares DL 1	US5717481023	STK	1.426,00	USD 210,7200	280.370,16	0,28
Masco Corp. Registered Shares DL 1	US5745991068	STK	3.900,00	USD 66,6700	242.606,02	0,24
Masimo Corp. Registered Shares DL -,001	US5747951003	STK	1.300,00	USD 125,9400	152.761,37	0,15
Mastercard Inc. Registered Shares A DL -,0001	US57636Q1040	STK	1.000,00	USD 441,1600	411.625,85	0,40
McDonald's Corp. Registered Shares DL-,01	US5801351017	STK	1.300,00	USD 254,8400	309.113,13	0,30
McKesson Corp. Registered Shares DL -,01	US58155Q1031	STK	800,00	USD 584,0000	435.952,41	0,43
Medtronic PLC Registered Shares DL -,0001	IE00BTN1Y115	STK	1.600,00	USD 78,7100	117.505,02	0,12
Merck & Co. Inc. Registered Shares DL-,01	US58933Y1055	STK	6.800,00	USD 123,8000	785.481,69	0,77
Meta Platforms Inc. Reg.Shares Cl.A DL-,000006	US30303M1027	STK	1.600,00	USD 504,2200	752.742,71	0,74
MetLife Inc. Registered Shares DL -,01	US59156R1086	STK	5.100,00	USD 70,1900	334.004,20	0,33
Microsoft Corp. Registered Shares DL-,00000625	US5949181045	STK	14.334,00	USD 446,9500	5.977.682,58	5,88
Mondelez International Inc. Registered Shares Class A o.N.	US6092071058	STK	2.500,00	USD 65,4400	152.647,54	0,15
Motorola Solutions Inc. Registered Shares DL -,01	US6200763075	STK	800,00	USD 386,0500	288.164,22	0,28
Netflix Inc. Registered Shares DL -,001	US64110L1061	STK	500,00	USD 674,8800	314.849,55	0,31
Nextera Energy Inc. Registered Shares DL -,01	US65339F1012	STK	6.300,00	USD 70,8100	416.237,93	0,41
NIKE Inc. Registered Shares Class B o.N.	US6541061031	STK	2.100,00	USD 75,3700	147.680,90	0,15
Nucor Corp. Registered Shares DL -,40	US6703461052	STK	1.100,00	USD 158,0800	162.246,79	0,16
NVIDIA Corp. Registered Shares DL-,001	US67066G1040	STK	64.300,00	USD 123,5400	7.411.823,65	7,28
NXP Semiconductors NV Aandelen aan toonder EO -,20	NL0009538784	STK	700,00	USD 269,0900	175.752,74	0,17
Oracle Corp. Registered Shares DL -,01	US68389X1054	STK	2.800,00	USD 141,2000	368.892,00	0,36
Owens Corning (New) Registered Shares DL -,01	US6907421019	STK	1.100,00	USD 173,7200	178.299,04	0,18
Palo Alto Networks Inc. Registered Shares DL -,0001	US6974351057	STK	900,00	USD 339,0100	284.683,00	0,28
PepsiCo Inc. Registered Shares DL -,0166	US7134481081	STK	2.765,00	USD 164,9300	425.501,70	0,42
Pfizer Inc. Registered Shares DL -,05	US7170811035	STK	10.089,00	USD 27,9800	263.391,85	0,26
Philip Morris Internat. Inc. Registered Shares o.N.	US7181721090	STK	1.700,00	USD 101,3300	160.728,71	0,16
Phillips 66 Registered Shares DL -,01	US7185461040	STK	2.100,00	USD 141,1700	276.610,22	0,27
Pinterest Inc. Registered Shares DL-,00001	US72352L1061	STK	4.400,00	USD 44,0700	180.926,52	0,18
PNC Financial Services Group Registered Shares DL 5	US6934751057	STK	1.000,00	USD 155,4800	145.071,15	0,14
Procter & Gamble Co., The Registered Shares o.N.	US7427181091	STK	1.789,00	USD 164,9200	275.289,83	0,27
Public Service Ent. Group Inc. Registered Shares o.N.	US7445731067	STK	3.600,00	USD 73,7000	247.557,73	0,24
Pulte Group Inc. Registered Shares DL -,01	US7458671010	STK	2.000,00	USD 110,1000	205.458,36	0,20
QUALCOMM Inc. Registered Shares DL -,0001	US7475251036	STK	3.000,00	USD 199,1800	595.536,74	0,55
Regeneron Pharmaceuticals Inc. Registered Shares DL -,001	US75886F1075	STK	200,00	USD 1.051,0300	196.133,43	0,19
Regions Financial Corp. Registered Shares DL -,01	US7591EP1005	STK	12.200,00	USD 20,0400	228.120,36	0,22
ResMed Inc. Registered Shares DL -,004	US7611521078	STK	1.200,00	USD 191,4200	214.326,10	0,21
Roper Technologies Inc. Registered Shares DL -,01	US7766961061	STK	400,00	USD 563,6600	210.369,96	0,21
RTX Corp. Registered Shares DL -,01	US75513E1010	STK	2.400,00	USD 100,3900	224.806,16	0,22
Salesforce Inc. Registered Shares DL -,001	US79466L3024	STK	1.600,00	USD 257,1000	383.820,85	0,38
Samsara Inc. Registered Shares A DL -,0001	US79589L1061	STK	4.000,00	USD 33,7000	125.775,60	0,12
Sempra Registered Shares o.N.	US8168511090	STK	2.800,00	USD 76,0600	198.710,52	0,20
ServiceNow Inc. Registered Shares DL-,001	US81762P1021	STK	700,00	USD 786,6700	513.803,59	0,51
Sherwin-Williams Co. Registered Shares DL 1	US8243481061	STK	600,00	USD 298,4300	167.070,68	0,16
Smith Corp., A.O. Registered Shares DL 1	US8318652091	STK	2.000,00	USD 81,7800	152.610,22	0,15
Snap Inc. Registered Shares A DL -,00001	US83304A1060	STK	10.400,00	USD 16,6100	161.179,38	0,16
Southern Co., The Registered Shares DL 5	US8425871071	STK	3.500,00	USD 77,5700	253.319,34	0,25
Stryker Corp. Registered Shares DL -,10	US8636671013	STK	1.000,00	USD 340,2500	317.471,43	0,31
Synchrony Financial Registered Shares DL -,001	US87165B1035	STK	7.500,00	USD 47,1900	330.230,93	0,32
Synopsys Inc. Registered Shares DL -,01	US8716071076	STK	400,00	USD 595,0600	222.089,11	0,22
T-Mobile US Inc. Registered Shares DL-,00001	US8725901040	STK	1.300,00	USD 176,1800	213.700,96	0,21
Target Corp. Registered Shares DL -,0833	US87612E1064	STK	1.500,00	USD 148,0400	207.193,84	0,20
Texas Instruments Inc. Registered Shares DL 1	US8825081040	STK	2.098,00	USD 194,5300	380.801,44	0,37
TJX Companies Inc. Registered Shares DL 1	US8725401090	STK	3.700,00	USD 110,1000	380.097,97	0,37
Toast Inc. Reg. Shares Cl.A DL -,000001	US8887871080	STK	7.000,00	USD 25,7700	168.313,51	0,17
Tractor Supply Co. Registered Shares DL -,008	US8923561067	STK	800,00	USD 270,0000	201.539,54	0,20

Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

## Swiss Rock (Lux) Sicav - Global Equity / Aktien Welt ESG

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg in 1.000	Bestand	Kurs zum 28.06.2024	Kurswert in EUR	in % des Netto- Teilfonds- vermögens	
Trane Technologies PLC Registered Shares DL 1	IE00BK9ZQ967	STK	700,00	USD	328,9300	214.836,48	0,21
U.S. Bancorp Registered Shares DL -,01	US9029733048	STK	8.300,00	USD	39,7000	307.450,43	0,30
Uber Technologies Inc. Registered Shares DL -,00001	US90353T1007	STK	3.500,00	USD	72,6800	237.350,13	0,23
Union Pacific Corp. Registered Shares DL 2,50	US9078181081	STK	1.200,00	USD	226,2600	253.335,20	0,25
UnitedHealth Group Inc. Registered Shares DL -,01	US91324P1021	STK	1.400,00	USD	509,2600	665.233,50	0,65
Valero Energy Corp. Registered Shares DL -,01	US91913Y1001	STK	1.900,00	USD	156,7600	277.904,36	0,27
Veralto Corp. Registered Shares o.N.	US92338C1036	STK	2.000,00	USD	95,4700	178.157,22	0,18
Vertex Pharmaceuticals Inc. Registered Shares DL -,01	US92532F1003	STK	600,00	USD	468,7200	262.404,48	0,26
Vertiv Holdings Co. Registered Shares A DL -,0001	US92537N1081	STK	1.500,00	USD	86,5700	121.161,65	0,12
VISA Inc. Reg. Shares Class A DL -,0001	US92826C8394	STK	2.500,00	USD	262,4700	612.246,33	0,60
Walmart Inc. Registered Shares DL -,10	US9311421039	STK	6.300,00	USD	67,7100	398.015,40	0,39
Waste Connections Inc. Registered Shares o.N.	CA94106B1013	STK	1.700,00	USD	175,3600	278.154,42	0,27
Waste Management Inc. Registered Shares DL -,01	US94106L1098	STK	1.600,00	USD	213,3400	318.492,19	0,31
West Pharmaceutic.Services Inc Registered Shares DL -,25	US9553061055	STK	500,00	USD	329,3900	153.669,23	0,15
Williams Cos.Inc., The Registered Shares DL 1	US9694571004	STK	10.300,00	USD	42,5000	408.444,13	0,40
Workday Inc. Registered Shares A DL -,001	US98138H1014	STK	1.000,00	USD	223,5600	208.593,42	0,21
Zoetis Inc. Registered Shares Cl.A DL -,01	US98978V1035	STK	1.300,00	USD	173,3600	210.280,38	0,21
<b>Genussscheine</b>							
Roche Holding AG Inhaber-Genußscheine o.N.	CH0012032048	STK	880,00	CHF	249,5000	227.984,01	0,22
<b>REITS</b>							
DEXUS Reg.Stapled Secs (Units) o.N.	AU000000DXS1	STK	11.741,00	AUD	6,4800	47.408,82	0,05
Goodman Group Registered Stapled Secs o.N.	AU000000GMG2	STK	4.000,00	AUD	34,7500	86.615,15	0,09
Stockland Reg. Stapled Secs o.N.	AU000000SGP0	STK	10.423,00	AUD	4,1700	27.083,69	0,03
Unibail-Rodamco-Westfield SE Stapled Shares EO-,05	FR0013326246	STK	542,00	EUR	73,5200	39.847,84	0,04
Avalonbay Communities Inc. Registered Shares DL -,01	US0534841012	STK	1.500,00	USD	206,8900	289.559,13	0,28
Vici Properties Inc. Registered Shares DL -,01	US9256521090	STK	8.000,00	USD	28,6400	213.781,20	0,21
Welltower Inc. Registered Shares DL 1	US95040Q1040	STK	3.600,00	USD	104,2500	350.174,95	0,34
<b>Summe Wertpapiervermögen</b>				<b>EUR</b>		<b>101.347.177,09</b>	<b>99,61</b>
<b>Derivate</b>							
<b>Aktienindex-Terminkontrakte</b>							
S&P 500 E-Mini Index Future 20.09.24		STK	3	USD	5.521,5000	-5.374,38	-0,01
<b>Optionsscheine auf Renten</b>							
Constellation Software Inc. WTS 31.03.40		CAD	100	CAD	0,0001	0,01	0,00
<b>Devisenterminkontrakte Kauf</b>							
<b>offen (Kontrahent Verwahrstelle)</b>							
Devisenterminkontrakt Kauf AUD / CHF 12.07.24		AUD	3.294	EUR		26,28	0,00
Devisenterminkontrakt Kauf CAD / CHF 12.07.24		CAD	7.718	EUR		30,73	0,00
Devisenterminkontrakt Kauf DKK / CHF 12.07.24		DKK	10.144	EUR		-0,44	0,00
Devisenterminkontrakt Kauf EUR / CHF 12.07.24		EUR	13.949	EUR		25,77	0,00
Devisenterminkontrakt Kauf EUR / USD 02.07.24		EUR	261	EUR		0,21	0,00
Devisenterminkontrakt Kauf EUR / USD 08.07.24		EUR	3.418	EUR		-0,88	0,00
Devisenterminkontrakt Kauf GBP / CHF 12.07.24		GBP	4.550	EUR		-12,81	0,00
Devisenterminkontrakt Kauf JPY / CHF 12.07.24		JPY	1.435.072	EUR		-144,28	0,00
Devisenterminkontrakt Kauf SEK / CHF 12.07.24		SEK	12.829	EUR		-7,77	0,00
Devisenterminkontrakt Kauf USD / CHF 12.07.24		USD	107.973	EUR		241,60	0,00
<b>Devisenterminkontrakte Verkauf</b>							
<b>offen (Kontrahent Verwahrstelle)</b>							
Devisenterminkontrakt Verkauf AUD / CHF 12.07.24		AUD	-1.365.496	EUR		-11.256,02	-0,01
Devisenterminkontrakt Verkauf CAD / CHF 12.07.24		CAD	-2.197.319	EUR		-11.325,34	-0,01
Devisenterminkontrakt Verkauf DKK / CHF 12.07.24		DKK	-4.291.146	EUR		-126,72	0,00
Devisenterminkontrakt Verkauf EUR / CHF 12.07.24		EUR	-3.952.717	EUR		-184,00	0,00
Devisenterminkontrakt Verkauf GBP / CHF 12.07.24		GBP	-1.284.335	EUR		6.496,80	0,01
Devisenterminkontrakt Verkauf JPY / CHF 12.07.24		JPY	-402.207.642	EUR		55.650,85	0,05
Devisenterminkontrakt Verkauf SEK / CHF 12.07.24		SEK	-5.601.972	EUR		3.026,33	0,00
Devisenterminkontrakt Verkauf USD / CHF 12.07.24		USD	-30.624.086	EUR		-57.404,53	-0,06
<b>Summe Derivate</b>				<b>EUR</b>		<b>-20.338,59</b>	<b>-0,02</b>

Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

## Swiss Rock (Lux) Sicav - Global Equity / Aktien Welt ESG

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg in 1.000	Bestand	Kurs zum 28.06.2024	Kurswert in EUR	in % des Netto- Teilfonds- vermögens
<b>Bankguthaben</b>						
<b>Bankkonten</b>						
Bankkonto CACEIS Investor Services Bank S.A.		CAD	0,26	EUR	0,18	0,00
Bankkonto CACEIS Investor Services Bank S.A.		CHF	14,67	EUR	15,23	0,00
Bankkonto CACEIS Investor Services Bank S.A.		EUR	513.948,25	EUR	513.948,25	0,51
Bankkonto CACEIS Investor Services Bank S.A.		GBP	6,21	EUR	7,32	0,00
Bankkonto CACEIS Investor Services Bank S.A.		SEK	-0,05	EUR	0,00	0,00
Bankkonto CACEIS Investor Services Bank S.A.		USD	307,24	EUR	286,67	0,00
Bankkonto UBS Ltd London		EUR	44.126,57	EUR	44.126,57	0,04
Bankkonto UBS Ltd London		JPY	1.366.635,00	EUR	7.927,04	0,01
Bankkonto UBS Ltd London		USD	372.066,39	EUR	347.157,82	0,34
Forderungen aus Variation Margin		USD	5.760,00	EUR	5.374,39	0,01
Initial Margin UBS Ltd London		USD	35.400,00	EUR	33.030,09	0,03
<b>Summe Bankguthaben</b>				<b>EUR</b>	<b>951.873,56</b>	<b>0,94</b>
<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>						
Dividendenforderungen		AUD	17.485,95	EUR	10.896,02	0,01
Dividendenforderungen		CAD	8.271,56	EUR	5.640,15	0,01
Dividendenforderungen		EUR	6.278,74	EUR	6.278,74	0,01
Dividendenforderungen		GBP	11.075,20	EUR	13.062,69	0,01
Dividendenforderungen		JPY	2.015.249,00	EUR	11.689,25	0,01
Dividendenforderungen		USD	44.001,71	EUR	41.055,96	0,04
<b>Summe Sonstige Vermögensgegenstände</b>				<b>EUR</b>	<b>88.622,81</b>	<b>0,09</b>
<b>Bankverbindlichkeiten</b>						
Bankverbindlichkeiten CACEIS Investor Services Bank S.A.		AUD	-0,04	EUR	-0,02	0,00
Bankverbindlichkeiten CACEIS Investor Services Bank S.A.		JPY	-512,00	EUR	-2,97	0,00
Bankverbindlichkeiten UBS Ltd London		GBP	-2.450,27	EUR	-2.889,98	0,00
<b>Summe Bankverbindlichkeiten</b>				<b>EUR</b>	<b>-2.892,97</b>	<b>0,00</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>						
Sonstige Verbindlichkeiten		CHF	-380.250,27	EUR	-394.839,64	-0,39
Sonstige Verbindlichkeiten		EUR	-227.419,99	EUR	-227.419,99	-0,22
<b>Summe Sonstige Verbindlichkeiten <sup>1)</sup></b>				<b>EUR</b>	<b>-622.259,63</b>	<b>-0,61</b>
<b>Netto-Teilfondsvermögen</b>				<b>EUR</b>	<b>101.742.182,27</b>	<b>100,00<sup>*)</sup></b>

\*) Durch Rundungen bei der Berechnung können geringe Differenzen entstanden sein.

1) In den 'Sonstigen Verbindlichkeiten' sind Fondsmanagervergütung, performanceabhängige Fondsmanagervergütung, Risikomanagementgebühr, Taxe d'abonnement, Transaktionskosten, Verbindlichkeiten MwSt., Verwahrstellenvergütung, Verwaltungsvergütung und Zentralverwaltungsstellenvergütung enthalten.

Nettoinventarwert pro Aktie des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Global Equity / Aktien Welt ESG A	EUR	35,58
Nettoinventarwert pro Aktie des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Global Equity / Aktien Welt ESG C	CHF	17,28
Nettoinventarwert pro Aktie des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Global Equity / Aktien Welt ESG B	EUR	27,27
Nettoinventarwert pro Aktie des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Global Equity / Aktien Welt ESG X	CHF	22,80
Umlaufende Aktien des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Global Equity / Aktien Welt ESG A	STK	639.956,720
Umlaufende Aktien des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Global Equity / Aktien Welt ESG C	STK	2.465.859,000
Umlaufende Aktien des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Global Equity / Aktien Welt ESG B	STK	1.149.475,369
Umlaufende Aktien des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Global Equity / Aktien Welt ESG X	STK	142.191,809
Anteil der Wertpapiere am Netto-Teilfondsvermögen	%	99,61
Anteil der Derivate am Netto-Teilfondsvermögen	%	-0,02

Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

## Swiss Rock (Lux) Sicav - Global Equity / Aktien Welt ESG

### Verpflichtungen aus Derivaten

Devisentermingeschäfte Käufe	Währung	Nominal	Währung	Nominal	offene Positionen in EUR
Devisenterminkontrakt Kauf DKK / CHF 12.07.24	DKK	10.143,77	CHF	-1.309,48	1.359,28
Devisenterminkontrakt Kauf CAD / CHF 12.07.24	CAD	7.717,84	CHF	-5.033,15	5.257,00
Devisenterminkontrakt Kauf AUD / CHF 12.07.24	AUD	3.294,22	CHF	-1.949,51	2.050,58
Devisenterminkontrakt Kauf GBP / CHF 12.07.24	GBP	4.549,50	CHF	-5.173,53	5.359,22
Devisenterminkontrakt Kauf EUR / CHF 12.07.24	EUR	13.948,82	CHF	-13.397,78	13.937,59
Devisenterminkontrakt Kauf EUR / USD 02.07.24	EUR	261,41	USD	-280,00	261,46
Devisenterminkontrakt Kauf EUR / USD 08.07.24	EUR	3.417,85	USD	-3.665,20	3.418,94
Devisenterminkontrakt Kauf JPY / CHF 12.07.24	JPY	1.435.072,00	CHF	-8.158,27	8.326,99
Devisenterminkontrakt Kauf SEK / CHF 12.07.24	SEK	12.829,19	CHF	-1.095,19	1.129,44
Devisenterminkontrakt Kauf USD / CHF 12.07.24	USD	107.972,89	CHF	-96.661,56	100.611,84
<b>Summe Devisentermingeschäfte Käufe</b>					<b>141.712,34</b>

Devisentermingeschäfte Verkäufe	Währung	Nominal	Währung	Nominal	offene Positionen in EUR
Devisenterminkontrakt Verkauf DKK / CHF 12.07.24	DKK	-4.291.145,88	CHF	553.650,93	575.019,95
Devisenterminkontrakt Verkauf CAD / CHF 12.07.24	CAD	-2.197.319,01	CHF	1.430.489,83	1.496.699,76
Devisenterminkontrakt Verkauf AUD / CHF 12.07.24	AUD	-1.365.496,32	CHF	807.745,69	849.993,05
Devisenterminkontrakt Verkauf GBP / CHF 12.07.24	GBP	-1.284.335,24	CHF	1.463.273,96	1.512.919,60
Devisenterminkontrakt Verkauf EUR / CHF 12.07.24	EUR	-3.952.716,53	CHF	3.803.422,43	3.949.534,94
Devisenterminkontrakt Verkauf JPY / CHF 12.07.24	JPY	-402.207.642,00	CHF	2.301.167,05	2.333.806,66
Devisenterminkontrakt Verkauf SEK / CHF 12.07.24	SEK	-5.601.972,07	CHF	477.871,92	493.180,42
Devisenterminkontrakt Verkauf USD / CHF 12.07.24	USD	-30.624.085,51	CHF	27.426.589,91	28.536.289,23
<b>Summe Devisentermingeschäfte Verkäufe</b>					<b>39.747.443,61</b>

Futures Kauf	Währung	Kontrakte	Kontraktgröße	Kurs Underlying	Dev. Kurs	Verpflichtungen aus Derivaten in EUR
S&P 500 E-Mini Index Future 20.09.24	USD	3,00	50,00	5.521,5000	0,933053	772.778,17
<b>Summe Futures Kauf</b>						<b>772.778,17</b>

### Devisenkurse (in Mengennotiz)

				per	28.06.2024
Australischer Dollar	AUD	1,604800	=1		EUR
Britisches Pfund	GBP	0,847850	=1		EUR
Dänische Kronen	DKK	7,457450	=1		EUR
Hongkong Dollar	HKD	8,367600	=1		EUR
Japanischer Yen	JPY	172,401700	=1		EUR
Kanadischer Dollar	CAD	1,466550	=1		EUR
Norwegische Kronen	NOK	11,411500	=1		EUR
Schwedische Kronen	SEK	11,350000	=1		EUR
Schweizer Franken	CHF	0,963050	=1		EUR
US-Dollar	USD	1,071750	=1		EUR

Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

## Swiss Rock (Lux) Sicav - Global Equity / Aktien Welt ESG

### Ertrags- und Aufwandsrechnung des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Global Equity / Aktien Welt ESG im Zeitraum vom 1. Juli 2023 bis 30. Juni 2024

	EUR
<b>Erträge</b>	
Zinsen aus Geldanlagen	47.294,06
Dividendenerträge	1.528.581,20
Erträge aus REITs	26.105,56
Ordentlicher Ertragsausgleich	-22.116,63
<b>Erträge insgesamt</b>	<b>1.579.864,19</b>
<b>Aufwendungen</b>	
Fondsmanagervergütung	-917.353,75
Performanceabhängige Fondsmanagervergütung	-336.177,29
Verwaltungsvergütung	-48.689,65
Zentralverwaltungsstellenvergütung	-25.104,58
Verwahrstellenvergütung	-57.135,03
Prüfungskosten	-11.407,32
Taxe d'abonnement	-45.731,03
Veröffentlichungskosten	-8.634,86
Register- und Transferstellenvergütung	-650,00
Regulatorische Kosten	-3.921,59
Zinsaufwendungen	-7.159,82
Sonstige Aufwendungen	-51.190,95
Ordentlicher Aufwandsausgleich	25.161,45
<b>Aufwendungen insgesamt</b>	<b>-1.487.994,42</b>
<b>Ordentlicher Nettoertrag</b>	<b>91.869,77</b>
<b>Veräußerungsgeschäfte</b>	
Realisierte Gewinne	13.683.613,76
Ertragsausgleich auf realisierte Gewinne	-403.782,26
Realisierte Verluste	-9.306.575,45
Aufwandsausgleich auf realisierte Verluste	350.136,93
<b>Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften</b>	<b>4.323.392,98</b>
<b>Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>	<b>4.415.262,75</b>
<b>Veränderung der nicht realisierten Gewinne und Verluste</b>	
Veränderung der nicht realisierten Gewinne	14.411.320,20
Veränderung der nicht realisierten Verluste	-541.309,45
<b>Nettoveränderung des nicht realisierten Ergebnisses des Geschäftsjahres</b>	<b>13.870.010,75</b>
<b>Ergebnis des Geschäftsjahres inkl. Ertrags-/Aufwandsausgleich</b>	<b>18.285.273,50</b>

### Vermögensentwicklung des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Global Equity / Aktien Welt ESG

	EUR
<b>Netto-Teilfondsvermögen zum Beginn des Geschäftsjahres</b>	<b>87.044.901,47</b>
Mittelzuflüsse	6.669.090,98
Mittelabflüsse	-10.307.684,19
Mittelzufluss/ -abfluss netto	-3.638.593,21
Ertrags- und Aufwandsausgleich	50.600,51
<b>Ergebnis des Geschäftsjahres inkl. Ertrags-/Aufwandsausgleich</b>	<b>18.285.273,50</b>
<b>Netto-Teilfondsvermögen zum Ende des Geschäftsjahres</b>	<b>101.742.182,27</b>

Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.



## Swiss Rock (Lux) Sicav - Global Equity / Aktien Welt ESG

### Entwicklung des Teilfonds im Jahresvergleich Swiss Rock (Lux) Sicav - Global Equity / Aktien Welt ESG A

Stichtag	Umlaufende Aktien	Währung	Netto-Teilfondsvermögen	Nettoinventarwert pro Aktie
30.06.2024	639.956,720	EUR	22.772.580,61	35,58
30.06.2023	711.340,820	EUR	20.500.159,40	28,82
30.06.2022	721.304,815	EUR	18.858.031,28	26,14

### Entwicklung des Teilfonds im Jahresvergleich Swiss Rock (Lux) Sicav - Global Equity / Aktien Welt ESG C

Stichtag	Umlaufende Aktien	Währung	Netto-Teilfondsvermögen	Nettoinventarwert pro Aktie
30.06.2024	2.465.859,000	CHF	42.619.697,46	17,28
30.06.2023	2.572.544,000	CHF	37.708.629,93	14,66
30.06.2022	2.632.451,000	CHF	35.135.123,79	13,35

### Entwicklung des Teilfonds im Jahresvergleich Swiss Rock (Lux) Sicav - Global Equity / Aktien Welt ESG B

Stichtag	Umlaufende Aktien	Währung	Netto-Teilfondsvermögen	Nettoinventarwert pro Aktie
30.06.2024	1.149.475,369	EUR	31.348.605,45	27,27
30.06.2023	1.151.272,922	EUR	25.223.467,17	21,91
30.06.2022	1.108.654,390	EUR	21.927.619,95	19,78

### Entwicklung des Teilfonds im Jahresvergleich Swiss Rock (Lux) Sicav - Global Equity / Aktien Welt ESG X

Stichtag	Umlaufende Aktien	Währung	Netto-Teilfondsvermögen	Nettoinventarwert pro Aktie
30.06.2024	142.191,809	CHF	3.241.702,94	22,80
30.06.2023	142.191,809	CHF	2.623.000,44	18,45
30.06.2022	142.171,809	CHF	2.412.461,78	16,97

## Swiss Rock (Lux) Sicav - European Equity / Aktien Europa ESG

### Zusammensetzung des Netto-Fondsvermögens des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - European Equity / Aktien Europa ESG per 30. Juni 2024

Position	Betrag in EUR
Wertpapiervermögen	42.588.248,77
(Wertpapiereinstandskosten EUR 29.876.578,83)	
Derivate	-6.373,04
Bankguthaben	1.543.857,07
Sonstige Vermögensgegenstände	34.197,66
<b>Summe Aktiva</b>	<b>44.159.930,46</b>
Bankverbindlichkeiten	-5.244,70
Sonstige Verbindlichkeiten	-316.000,75
<b>Summe Passiva</b>	<b>-321.245,45</b>
<b>Netto-Teilfondsvermögen</b>	<b>43.838.685,01</b>

### Währungs-Übersicht des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - European Equity / Aktien Europa ESG

Währung	Kurswert in Mio. EUR	in % des Netto- Teilfondsvermögens
EUR	23,11	52,72
GBP	8,46	19,30
CHF	5,61	12,79
DKK	3,00	6,83
SEK	2,96	6,76
NOK	0,59	1,35
USD	0,11	0,25
<b>Summe</b>	<b>43,84</b>	<b>100,00</b>

### Wertpapierkategorie-Übersicht des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - European Equity / Aktien Europa ESG

Wertpapierkategorie	Kurswert in Mio. EUR	in % des Netto- Teilfondsvermögens
Aktien	41,88	95,53
Genussscheine	0,52	1,19
Andere Wertpapiere	0,14	0,33
REITS	0,05	0,10
<b>Summe</b>	<b>42,59</b>	<b>97,15</b>

### Länder-Übersicht des Wertpapiervermögens des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - European Equity / Aktien Europa ESG

Länder	Kurswert in Mio. EUR	in % des Netto- Teilfondsvermögens
Großbritannien	8,17	18,63
Frankreich	6,85	15,63
Schweiz	5,61	12,79
Bundesrepublik Deutschland	5,14	11,73
Niederlande	4,24	9,68
Dänemark	3,00	6,83
Schweden	2,96	6,76
Spanien	2,43	5,55
Italien	1,83	4,17
Sonstige Länder	2,36	5,38
<b>Summe</b>	<b>42,59</b>	<b>97,15</b>

Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

# Swiss Rock (Lux) Sicav - European Equity / Aktien Europa ESG

## Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2024 des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - European Equity / Aktien Europa ESG

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg in 1.000	Bestand	Kurs zum 28.06.2024	Kurswert in EUR	in % des Netto- Teilfonds- vermögens
<b>Amtlich gehandelte Wertpapiere / Regulierter Markt</b>						
<b>Aktien</b>						
ABB Ltd. Namens-Aktien SF 0,12	CH0012221716	STK	10.000,00	CHF 49,9200	518.353,15	1,18
Cie Financière Richemont AG Namens-Aktien SF 1	CH0210483332	STK	1.900,00	CHF 140,2500	276.699,03	0,63
Givaudan SA Namens-Aktien SF 10	CH0010645932	STK	56,00	CHF 4.260,0000	247.713,00	0,57
Holcim Ltd. Namens-Aktien SF 2	CH0012214059	STK	4.333,00	CHF 79,6200	358.230,06	0,82
Inficon Holding AG Nam.-Aktien SF 5	CH0011029946	STK	50,00	CHF 1.366,0000	70.920,51	0,16
Julius Baer Gruppe AG Namens-Aktien SF -,02	CH0102484968	STK	2.137,00	CHF 50,2000	111.393,39	0,25
Kühne + Nagel Internat. AG Namens-Aktien SF 1	CH0025238863	STK	364,00	CHF 258,4000	97.666,37	0,22
Logitech International S.A. Namens-Aktien SF -,25	CH0025751329	STK	1.209,00	CHF 86,9200	109.118,20	0,25
Nestlé S.A. Namens-Aktien SF -,10	CH0038863350	STK	4.965,00	CHF 91,7200	472.862,05	1,08
Novartis AG Namens-Aktien SF 0,49	CH0012005267	STK	12.164,00	CHF 96,1700	1.214.694,85	2,77
Schindler Holding AG Namens-Aktien SF -,10	CH0024638212	STK	400,00	CHF 224,0000	93.037,74	0,21
Swiss Life Holding AG Namens-Aktien SF 0,10	CH0014852781	STK	148,00	CHF 660,6000	101.519,96	0,23
Swiss Re AG Namens-Aktien SF -,10	CH0126881561	STK	1.448,00	CHF 111,5000	167.646,54	0,38
Swissquote Grp Holding S.A. Namens-Aktien SF 0,20	CH0010675863	STK	300,00	CHF 283,6000	88.344,32	0,20
UBS Group AG Namens-Aktien SF -,10	CH0244767585	STK	18.769,00	CHF 26,4500	515.487,31	1,18
VAT Group AG Namens-Aktien SF -,10	CH0311864901	STK	251,00	CHF 509,4000	132.765,07	0,30
Zehnder Group AG Namens-Aktien SF-,05	CH0276534614	STK	1.100,00	CHF 52,8000	60.308,40	0,14
Zurich Insurance Group AG Nam.-Aktien SF 0,10	CH0011075394	STK	899,00	CHF 479,1000	447.236,28	1,02
A.P.Møller-Mærsk A/S Navne-Aktier B DK 1000	DK0010244508	STK	82,00	DKK 12.105,0000	133.103,14	0,30
Ambu A/S Navne-Aktier B DK -,50	DK0060946788	STK	5.000,00	DKK 134,0000	89.843,04	0,20
Carlsberg AS Navne-Aktier B DK 20	DK0010181759	STK	900,00	DKK 835,6000	100.844,12	0,23
Novo-Nordisk AS Navne-Aktier B DK 0,1	DK0062498333	STK	17.912,00	DKK 1.005,6000	2.415.344,01	5,51
Novonosis A/S Navne-Aktier B DK 2	DK0060336014	STK	2.398,00	DKK 426,1000	137.015,71	0,31
Rockwool A/S Navne-Aktier B DK 10	DK0010219153	STK	300,00	DKK 2.826,0000	113.684,97	0,26
Svitzer Group A/S Almindelig Aktie DK 10	DK0062616637	STK	164,00	DKK 259,5500	5.707,88	0,01
ACCOR S.A. Actions Port. EO 3	FR0000120404	STK	2.211,00	EUR 38,3000	84.681,30	0,19
Ahold Delhaize N.V., Konkinkl. Aandelen aan toonder EO -,01	NL0011794037	STK	8.565,00	EUR 27,5900	236.308,35	0,54
Air Liquide-SA Ét.Expl.P.G.Cl. Actions Port. EO 5,50	FR0000120073	STK	1.815,00	EUR 161,2800	292.723,20	0,67
Airbus SE Aandelen aan toonder EO 1	NL0000235190	STK	829,00	EUR 128,2600	106.327,54	0,24
Allianz SE vink.Namens-Aktien o.N.	DE0008404005	STK	2.106,00	EUR 259,5000	546.507,00	1,25
Andritz AG Inhaber-Aktien o.N.	AT0000730007	STK	2.400,00	EUR 57,8500	138.840,00	0,32
Anheuser-Busch InBev S.A./N.V. Actions au Port. o.N.	BE0974293251	STK	5.861,00	EUR 54,1200	317.197,32	0,72
ASM International N.V. Bearer Shares EO 0,04	NL0000334118	STK	426,00	EUR 711,8000	303.226,80	0,69
ASML Holding N.V. Aandelen op naam EO -,09	NL0010273215	STK	2.163,00	EUR 964,2000	2.085.564,60	4,76
Atresmedia Corp.d.Medio.d.Com. Acciones Nom. EO -,75	ES0109427734	STK	20.000,00	EUR 4,4250	88.500,00	0,20
AXA S.A. Actions Port. EO 2,29	FR0000120628	STK	2.590,00	EUR 30,4950	78.982,05	0,18
Banco Bilbao Vizcaya Argent. Acciones Nom. EO 0,49	ES0113211835	STK	35.000,00	EUR 9,3520	327.320,00	0,75
Banco Santander S.A. Acciones Nom. EO 0,50	ES011390037	STK	92.915,00	EUR 4,3305	402.368,41	0,92
Bayerische Motoren Werke AG Vorzugsaktien o.St. EO 1	DE0005190037	STK	1.000,00	EUR 82,4500	82.450,00	0,19
BNP Paribas S.A. Actions Port. EO 2	FR0000131104	STK	5.555,00	EUR 59,5300	330.689,15	0,75
Bouygues S.A. Actions Port. EO 1	FR0000120503	STK	2.680,00	EUR 29,9700	80.319,60	0,18
Bureau Veritas SA Actions au Porteur EO -,12	FR0006174348	STK	3.501,00	EUR 25,8400	90.465,84	0,21
BUZZI S.p.A. Azioni nom. o.N.	IT0001347308	STK	4.310,00	EUR 37,5800	161.969,80	0,37
Capgemini SE Actions Port. EO 8	FR0000125338	STK	1.002,00	EUR 185,7000	186.071,40	0,42
Cargotec Corp. Registered Shares Class B o.N.	FI0009013429	STK	1.302,00	EUR 74,9500	97.584,90	0,22
Carrefour S.A. Actions Port. EO 2,5	FR0000120172	STK	7.000,00	EUR 13,2000	92.400,00	0,21
Cie Génle ÉtS Michelin SCpA Actions Nom. EO -,50	FR001400AJ45	STK	7.160,00	EUR 36,1100	258.547,60	0,59
Commerzbank AG Inhaber-Aktien o.N.	DE000CBK1001	STK	6.724,00	EUR 14,1850	95.379,94	0,22
Compagnie de Saint-Gobain S.A. Actions au Porteur (C.R.) EO 4	FR0000125007	STK	3.258,00	EUR 72,5800	236.465,64	0,54
CTS Eventim AG & Co. KGaA Inhaber-Aktien o.N.	DE0005470306	STK	1.267,00	EUR 77,9000	98.699,30	0,23
Danone S.A. Actions Port. EO-,25	FR0000120644	STK	5.013,00	EUR 57,0800	286.142,04	0,65
De' Longhi S.p.A. Azioni nom. EO 1,5	IT0003115950	STK	2.043,00	EUR 29,2000	59.655,60	0,14
Deutsche Börse AG Namens-Aktien o.N.	DE0005810055	STK	1.694,00	EUR 191,1000	323.723,40	0,74

Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

## Swiss Rock (Lux) Sicav - European Equity / Aktien Europa ESG

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg in 1.000	Bestand	Kurs zum 28.06.2024	Kurswert in EUR	in % des Netto- Teilfonds- vermögens
Deutsche Telekom AG Namens-Aktien o.N.	DE0005557508	STK	8.854,00	EUR 23,4800	207.891,92	0,47
E.ON SE Namens-Aktien o.N.	DE000ENAG999	STK	17.000,00	EUR 12,2550	208.335,00	0,48
Eiffage S.A. Actions Port. EO 4	FR0000130452	STK	939,00	EUR 85,7600	80.528,64	0,18
Endesa S.A. Acciones Port. EO 1,20	ES0130670112	STK	6.403,00	EUR 17,5350	112.276,61	0,26
ENEL S.p.A. Azioni nom. EO 1	IT0003128367	STK	46.466,00	EUR 6,4940	301.750,20	0,69
Engie S.A. Actions Port. EO 1	FR0010208488	STK	11.111,00	EUR 13,3350	148.165,19	0,34
ENI S.p.A. Azioni nom. o.N.	IT0003132476	STK	9.176,00	EUR 14,3540	131.712,30	0,30
Esprinet S.p.A. Azioni nom. EO -,15	IT0003850929	STK	5.363,00	EUR 5,0750	27.217,23	0,06
EssilorLuxottica S.A. Actions Port. EO 0,18	FR0000121667	STK	944,00	EUR 201,2000	189.932,80	0,43
Euronext N.V. Aandelen aan toonder WI EO 1,60	NL0006294274	STK	1.000,00	EUR 86,5000	86.500,00	0,20
Ferrari N.V. Aandelen op naam EO -,01	NL0011585146	STK	443,00	EUR 380,7000	168.650,10	0,38
Ferrovial SE Registered Shares EO-,01	NL0015001FS8	STK	2.662,00	EUR 36,2800	96.577,36	0,22
Fincombank Banca Fineco S.p.A. Azioni nom. EO -,33	IT0000072170	STK	6.553,00	EUR 13,9200	91.217,76	0,21
Generali S.p.A. Azioni nom. o.N.	IT0000062072	STK	10.750,00	EUR 23,2900	250.367,50	0,57
GFT Technologies SE Inhaber-Aktien o.N.	DE0005800601	STK	1.330,00	EUR 24,9500	33.183,50	0,08
Heidelberg Materials AG Inhaber-Aktien o.N.	DE0006047004	STK	2.280,00	EUR 96,8200	220.749,60	0,50
Heineken Holding N.V. Aandelen aan toonder EO 1,60	NL0000008977	STK	1.443,00	EUR 73,6500	106.276,95	0,24
Heineken N.V. Aandelen aan toonder EO 1,60	NL0000009165	STK	1.568,00	EUR 90,3000	141.590,40	0,32
Henkel AG & Co. KGaA Inhaber-Vorzugsaktien o.St.o.N.	DE0006048432	STK	1.875,00	EUR 83,2200	156.037,50	0,36
Hermes International S.C.A. Actions au Porteur o.N.	FR0000052292	STK	203,00	EUR 2.140,0000	434.420,00	0,99
Iberdrola S.A. Acciones Port. EO -,75	ES0144580Y14	STK	44.149,00	EUR 12,1150	534.865,14	1,22
Indra Sistemas S.A. Acciones Port. EO 0,20	ES0118594417	STK	8.168,00	EUR 19,3100	157.724,08	0,36
Industria de Diseño Textil SA Acciones Port. EO 0,03	ES0148396007	STK	7.638,00	EUR 46,3600	354.097,68	0,81
ING Groep N.V. Aandelen op naam EO -,01	NL0011821202	STK	19.000,00	EUR 15,9620	303.278,00	0,69
Intesa Sanpaolo S.p.A. Azioni nom. o.N.	IT0000072618	STK	102.829,00	EUR 3,4710	356.919,46	0,81
IPSOS S.A. Actions Port. EO -,25	FR0000073298	STK	1.035,00	EUR 58,9000	60.961,50	0,14
KBC Groep N.V. Parts Sociales Port. o.N.	BE0003565737	STK	2.056,00	EUR 65,9000	135.490,40	0,31
Kingspan Group PLC Registered Shares EO -,13	IE0004927939	STK	1.700,00	EUR 79,5000	135.150,00	0,31
Konecranes Oyj Registered Shares o.N.	FI0009005870	STK	1.331,00	EUR 52,9500	70.476,45	0,16
L'Oréal S.A. Actions Port. EO 0,2	FR0000120321	STK	899,00	EUR 410,0500	368.634,95	0,84
Legrand S.A. Actions au Port. EO 4	FR0010307819	STK	1.828,00	EUR 92,6400	169.345,92	0,39
LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE Actions Port. (C.R.) EO 0,3	FR0000121014	STK	1.290,00	EUR 713,6000	920.544,00	2,10
Meliá Hotels International Acciones Port. EO 0,20	ES0176252718	STK	10.000,00	EUR 7,6650	76.650,00	0,17
Mercedes-Benz Group AG Namens-Aktien o.N.	DE0007100000	STK	3.672,00	EUR 64,5700	237.101,04	0,54
Münchener Rückvers.-Ges. AG vink.Namens-Aktien o.N.	DE0008430026	STK	1.019,00	EUR 467,0000	475.873,00	1,09
N.V. Bekaert S.A. Parts Sociales au Port. o.N.	BE0974258874	STK	2.610,00	EUR 39,0800	101.998,80	0,23
Nemetschek SE Inhaber-Aktien o.N.	DE0006452907	STK	1.000,00	EUR 91,8500	91.850,00	0,21
Nokia Oyj Registered Shares EO 0,06	FI0009000681	STK	45.243,00	EUR 3,5585	160.997,22	0,37
Orange S.A. Actions Port. EO 4	FR0000133308	STK	14.000,00	EUR 9,3540	130.956,00	0,30
Outokumpu Oyj Registered Shares Cl.A o.N.	FI0009002422	STK	20.000,00	EUR 3,3700	67.400,00	0,15
Prosus N.V. Registered Shares EO -,05	NL0013654783	STK	3.000,00	EUR 33,2600	99.780,00	0,23
Prismian S.p.A. Azioni nom. EO 0,10	IT0004176001	STK	2.170,00	EUR 57,8200	125.469,40	0,29
Publicis Groupe S.A. Actions Port. EO 0,40	FR0000130577	STK	2.336,00	EUR 99,1000	231.497,60	0,53
Randstad N.V. Aandelen aan toonder EO 0,10	NL0000379121	STK	1.770,00	EUR 42,3300	74.924,10	0,17
RATIONAL AG Inhaber-Aktien o.N.	DE0007010803	STK	115,00	EUR 777,5000	89.412,50	0,20
Redeia Corporacion S.A. Acciones Port. EO -,50	ES0173093024	STK	9.608,00	EUR 16,3200	156.802,56	0,36
Repsol S.A. Acciones Port. EO 1	ES0173516115	STK	10.000,00	EUR 14,7350	147.350,00	0,34
Rexel S.A. Actions au Porteur EO 5	FR0010451203	STK	5.000,00	EUR 24,1600	120.800,00	0,28
Rheinmetall AG Inhaber-Aktien o.N.	DE0007030009	STK	401,00	EUR 475,7000	190.755,70	0,44
Sampo OYJ Registered Shares Cl.A o.N.	FI4000552500	STK	3.932,00	EUR 40,1000	157.673,20	0,36
Sanofi S.A. Actions Port. EO 2	FR0000120578	STK	2.000,00	EUR 89,9400	179.880,00	0,41
SAP SE Inhaber-Aktien o.N.	DE0007164600	STK	5.773,00	EUR 189,5200	1.094.098,96	2,50
Schaeffler AG Inhaber-Vorzugsakt.o.St. o.N.	DE000SHA0159	STK	21.000,00	EUR 5,3750	112.875,00	0,26
Schneider Electric SE Actions Port. EO 4	FR0000121972	STK	2.985,00	EUR 224,3000	669.535,50	1,53
Siemens AG Namens-Aktien o.N.	DE0007236101	STK	4.269,00	EUR 173,7200	741.610,68	1,69
Smurfit Kappa Group PLC Registered Shares EO -,001	IE00B1RR8406	STK	2.000,00	EUR 41,6000	83.200,00	0,19
Stellantis N.V. Aandelen op naam EO -,01	NL00150001Q9	STK	4.875,00	EUR 18,4220	89.807,25	0,20
Symrise AG Inhaber-Aktien o.N.	DE000SYM9999	STK	1.203,00	EUR 114,3000	137.502,90	0,31
Television Fse 1 S.A. (TF1) Actions Port. EO 0,2	FR0000054900	STK	9.000,00	EUR 7,2900	65.610,00	0,15

Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

## Swiss Rock (Lux) Sicav - European Equity / Aktien Europa ESG

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg in 1.000	Bestand	Kurs zum 28.06.2024	Kurswert in EUR	in % des Netto- Teilfonds- vermögens	
TotalEnergies SE Actions au Porteur EO 2,50	FR0000120271	STK	11.400,00	EUR	62,3300	710.562,00	1,62
UniCredit S.p.A. Azioni nom. o.N.	IT0005239360	STK	9.345,00	EUR	34,6050	323.383,73	0,74
Universal Music Group N.V. Aandelen op naam EO1	NL0015000Y2	STK	4.388,00	EUR	27,7800	121.898,64	0,28
Veolia Environnement S.A. Actions au Porteur EO 5	FR0000124141	STK	4.000,00	EUR	27,9200	111.680,00	0,25
VINCI S.A. Actions Port. EO 2,50	FR0000125486	STK	2.013,00	EUR	98,0900	197.455,17	0,45
Wolters Kluwer N.V. Aandelen op naam EO -,12	NL0000395903	STK	1.435,00	EUR	154,8000	222.138,00	0,51
Associated British Foods PLC Registered Shares LS -,0568	GB0006731235	STK	4.933,00	GBP	24,7400	143.943,41	0,33
AstraZeneca PLC Registered Shares DL -,25	GB0009895292	STK	5.868,00	GBP	123,5600	855.163,15	1,95
Aviva PLC Registered Shares LS -,33	GB00BPQY8M80	STK	19.000,00	GBP	4,7660	106.804,27	0,24
BAE Systems PLC Registered Shares LS -,025	GB0002634946	STK	20.463,00	GBP	13,2000	318.584,18	0,73
Balfour Beatty PLC Registered Shares LS -,50	GB0000961622	STK	16.079,00	GBP	3,6520	69.258,13	0,16
Barclays PLC Registered Shares LS 0,25	GB0031348658	STK	81.601,00	GBP	2,0890	201.055,01	0,46
Barratt Developments PLC Registered Shares LS -,10	GB0000811801	STK	10.000,00	GBP	4,7220	55.693,81	0,13
Berkeley Group Holdings PLC Reg.Ordinary Shares LS-,054141	GB00BLJNXL82	STK	700,00	GBP	45,8800	37.879,34	0,09
BP PLC Registered Shares DL -,25	GB0007980591	STK	45.831,00	GBP	4,7520	256.871,98	0,59
Britvic PLC Registered Shares LS -,20	GB00B0N8QD54	STK	12.000,00	GBP	11,8100	167.152,21	0,38
Bunzl PLC Registered Shares LS -,3214857	GB00B0744B38	STK	3.513,00	GBP	30,1000	124.716,99	0,28
Centrica PLC Reg. Shares LS -,061728395	GB00B033F229	STK	57.076,00	GBP	1,3490	90.812,67	0,21
Compass Group PLC Registered Shares LS -,1105	GB00BD6K4575	STK	6.613,00	GBP	21,6000	168.474,14	0,38
CRH PLC Registered Shares EO -,32	IE0001827041	STK	4.318,00	GBP	58,9600	300.276,32	0,68
Diageo PLC Reg. Shares LS -,28935185	GB0002374006	STK	2.846,00	GBP	24,8950	83.565,69	0,19
DS Smith PLC Registered Shares LS -,10	GB0008220112	STK	24.770,00	GBP	4,2100	122.995,46	0,28
EasyJet PLC Registered Shares LS-,27285714	GB00B7KR2P84	STK	10.000,00	GBP	4,5770	53.983,61	0,12
EnQuest PLC Registered Shares LS -,05	GB00B635TG28	STK	60.000,00	GBP	0,1358	9.610,19	0,02
Forterra PLC Registered Shares LS -,01	GB00BYW3C20	STK	15.000,00	GBP	1,5900	28.129,98	0,06
GSK PLC Registered Shares LS -,3125	GB00BN7SWP63	STK	23.122,00	GBP	15,2950	417.115,04	0,95
HSBC Holdings PLC Registered Shares DL -,50	GB0005405286	STK	85.088,00	GBP	6,8390	686.344,08	1,57
IMI PLC Registered Shares LS -,2857	GB00BGLP8L22	STK	3.769,00	GBP	17,6400	78.416,18	0,18
Informa PLC Registered Shares LS -,001	GB00BMJ6DW54	STK	15.323,00	GBP	8,5580	154.666,79	0,35
InterContinental Hotels Group Reg.Shares LS -,208521303	GB00BHJYC057	STK	1.428,00	GBP	83,2600	140.231,50	0,32
Internat. Cons. Airl. Group SA Acciones Nom. EO -,10	ES0177542018	STK	40.000,00	GBP	1,6225	76.546,56	0,17
Legal & General Group PLC Registered Shares LS -,025	GB0005603997	STK	30.000,00	GBP	2,2700	80.320,81	0,18
Lloyds Banking Group PLC Registered Shares LS -,10	GB0008706128	STK	175.357,00	GBP	0,5474	113.216,28	0,26
London Stock Exchange GroupPLC Reg. Shares LS 0,069186047	GB00B0SWJX34	STK	742,00	GBP	94,0000	82.264,55	0,19
Marks & Spencer Group PLC Registered Shares LS -,01	GB0031274896	STK	38.976,00	GBP	2,8650	131.705,18	0,30
NatWest Group PLC Registered Shares LS 1,0769	GB00BM8PJY71	STK	30.000,00	GBP	3,1180	110.326,12	0,25
NEXT PLC Registered Shares LS 0,10	GB0032089863	STK	1.600,00	GBP	90,3600	179.520,73	0,39
Phoenix Group Holdings PLC Registered Shares LS -,10	GB00BGXQNP29	STK	13.000,00	GBP	5,2150	79.961,08	0,18
Relx PLC Registered Shares LS -,144397	GB00B2B0DG97	STK	9.143,00	GBP	36,3900	392.420,56	0,90
Rio Tinto PLC Registered Shares LS -,10	GB0007188757	STK	2.331,00	GBP	52,0100	142.991,46	0,33
Rolls Royce Holdings PLC Registered Shares LS 0,20	GB00B63H8491	STK	40.000,00	GBP	4,5680	215.509,82	0,49
Sage Group PLC, The Registered Shares LS-,01051948	GB00B8C3BL03	STK	7.500,00	GBP	10,8850	96.287,67	0,22
Sainsbury PLC, J. Registered Shs LS -,28571428	GB00B019KW72	STK	30.816,00	GBP	2,5500	92.682,43	0,21
Savills PLC Registered Shares LS -,025	GB00B135BJ46	STK	6.290,00	GBP	11,1400	82.645,04	0,19
Serco Group PLC Registered Shares LS -,02	GB0007973794	STK	45.000,00	GBP	1,7970	95.376,54	0,22
Shell PLC Reg. Shares Class EO -,07	GB00BP6MXD84	STK	27.244,00	GBP	28,3400	910.650,42	2,08
Taylor Wimpey PLC Registered Shares LS -,01	GB0008782301	STK	46.735,00	GBP	1,4215	78.355,61	0,18
Tesco PLC Registered Shs LS-,0633333	GB00BLGZ9862	STK	63.570,00	GBP	3,0600	229.432,33	0,52
Unilever PLC Registered Shares LS -,031111	GB00B10RZP78	STK	8.373,00	GBP	43,4500	429.093,41	0,98
DNB Bank ASA Navne-Aksjer NK 100	NO0010161896	STK	6.811,00	NOK	209,7000	125.160,29	0,29
Equinor ASA Navne-Aksjer NK 2,50	NO0010096985	STK	9.000,00	NOK	303,9500	239.718,70	0,55
Kongsberg Gruppen AS Navne-Aksjer NK 1,25	NO0003043309	STK	1.091,00	NOK	870,0000	83.176,62	0,19
SpareBank 1 Nord-Norge Navne-Aksjer NK 18	NO0006000801	STK	7.043,00	NOK	99,1400	61.187,66	0,14
Telenor ASA Navne-Aksjer NK 6	NO0010063308	STK	7.940,00	NOK	121,7000	84.677,56	0,19
Addtech AB Namn-Aktier B SK -,1875	SE0014781795	STK	3.000,00	SEK	263,4000	69.621,15	0,16
Assa-Abloy AB Namn-Aktier B SK -,33	SE0007100581	STK	7.758,00	SEK	299,6000	204.783,86	0,47
Atlas Copco AB Namn-Aktier A SK-,052125	SE0017486889	STK	18.316,00	SEK	199,2000	321.457,90	0,73
Atlas Copco AB Namn-Aktier B(fria) o.N.	SE0017486897	STK	14.902,00	SEK	171,1500	224.711,66	0,51
Avanza Bank Holding AB Namn-Aktier SK 0,50	SE0012454072	STK	3.000,00	SEK	257,5000	68.061,67	0,16

Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

## Swiss Rock (Lux) Sicav - European Equity / Aktien Europa ESG

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg in 1.000	Bestand		Kurs zum 28.06.2024	Kurswert in EUR	in % des Netto- Teilfonds- vermögens
Beijer Alma AB Namn-Aktier B SK 2,083	SE0011090547	STK	3.182,00	SEK	207,0000	58.032,95	0,13
Betsson AB Namn-Aktier Ser.B o.N.	SE0021626777	STK	14.023,00	SEK	123,9000	153.079,27	0,35
Bilia AB Namn-Aktier A (fria) SK 2,50	SE0009921588	STK	10.000,00	SEK	141,5000	124.669,60	0,28
BioGaia AB Namn-Aktier B o.N.	SE0017769995	STK	5.940,00	SEK	123,7000	64.738,15	0,15
Essity AB Namn-Aktier B	SE0009922164	STK	6.000,00	SEK	271,4000	143.471,37	0,33
Evolution AB (publ) Namn-Aktier SK-,003	SE0012673267	STK	720,00	SEK	1.104,0000	70.033,48	0,16
H & M Hennes & Mauritz AB Namn-Aktier B SK 0,125	SE0000106270	STK	7.000,00	SEK	167,6500	103.396,48	0,24
Indutrade AB Aktier SK 1	SE0001515552	STK	3.100,00	SEK	271,6000	74.181,50	0,17
Lagercrantz Group AB Namn-Aktier Ser.B o.N.	SE0014990966	STK	8.000,00	SEK	172,2000	121.374,45	0,28
Lifco AB Namn-Aktier B o.N.	SE0015949201	STK	4.000,00	SEK	291,0000	102.555,07	0,23
Mycronic AB Namn-Aktier SK 1	SE0000375115	STK	2.130,00	SEK	408,6000	76.680,00	0,17
Nordnet AB Namn-Aktier AK o.N.	SE0015192067	STK	4.000,00	SEK	221,4000	78.026,43	0,18
Saab AB Namn-Aktier B o.N.	SE0021921269	STK	6.500,00	SEK	255,0000	146.035,24	0,33
Sandvik AB Namn-Aktier o.N.	SE0000667891	STK	9.000,00	SEK	212,4000	168.422,91	0,38
Sectra AB Namn-Aktier Ser.B o.N.	SE0020539310	STK	3.000,00	SEK	242,2000	64.017,62	0,15
Skandinaviska Enskilda Banken Namn-Aktier A (fria) SK 10	SE0000148884	STK	16.325,00	SEK	156,5000	225.098,02	0,51
Swedbank AB Namn-Aktier A o.N.	SE0000242455	STK	4.386,00	SEK	218,1000	84.280,76	0,19
Volvo (publ), AB Namn-Aktier B (fria) o.N.	SE0000115446	STK	8.997,00	SEK	271,1000	214.897,51	0,49
Coca-Cola Europacific Pa. PLC Registered Shares EO -,01	GB00BDCPN049	STK	1.600,00	USD	72,8700	108.786,56	0,25
<b>Genussscheine</b>							
Roche Holding AG Inhaber-Genußscheine o.N.	CH0012032048	STK	2.021,00	CHF	249,5000	523.586,00	1,19
<b>REITs</b>							
Unibail-Rodamco-Westfield SE Stapled Shares EO-,05	FR0013326246	STK	620,00	EUR	73,5200	45.582,40	0,10
<b>Andere Wertpapiere</b>							
3i Group PLC Registered Shares LS -,738636	GB00B1YW4409	STK	4.000,00	GBP	30,6600	144.648,23	0,33
<b>Summe Wertpapiervermögen</b>				<b>EUR</b>		<b>42.588.248,77</b>	<b>97,15</b>
<b>Derivate</b>							
<b>Aktienindex-Terminkontrakte</b>							
Euro STOXX 50 Future 20.09.24		STK	22	EUR	4.926,0000	-5.170,00	-0,01
FTSE 100 Future 20.09.24		STK	3	GBP	8.212,0000	-1.203,04	0,00
<b>Summe Derivate</b>				<b>EUR</b>		<b>-6.373,04</b>	<b>-0,01</b>
<b>Bankguthaben</b>							
<b>Bankkonten</b>							
Bankkonto CACEIS Investor Services Bank S.A.		DKK	31,70	EUR		4,25	0,00
Bankkonto CACEIS Investor Services Bank S.A.		EUR	1.369.954,10	EUR		1.369.954,10	3,12
Bankkonto CACEIS Investor Services Bank S.A.		GBP	146,22	EUR		172,46	0,00
Bankkonto CACEIS Investor Services Bank S.A.		NOK	90,81	EUR		7,96	0,00
Bankkonto CACEIS Investor Services Bank S.A.		SEK	3.304,36	EUR		291,13	0,00
Bankkonto CACEIS Investor Services Bank S.A.		USD	13,78	EUR		12,86	0,00
Bankkonto UBS Ltd London		EUR	77.187,04	EUR		77.187,04	0,18
Bankkonto UBS Ltd London		USD	250,22	EUR		233,47	0,00
Forderungen aus Variation Margin		EUR	5.170,00	EUR		5.170,00	0,01
Forderungen aus Variation Margin		GBP	1.020,00	EUR		1.203,04	0,00
Initial Margin UBS Ltd London		EUR	75.789,30	EUR		75.789,30	0,17
Initial Margin UBS Ltd London		GBP	11.727,00	EUR		13.831,46	0,03
<b>Summe Bankguthaben</b>				<b>EUR</b>		<b>1.543.857,07</b>	<b>3,52</b>
<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>							
Dividendenforderungen		EUR	9.006,00	EUR		9.006,00	0,02
Dividendenforderungen		GBP	20.275,82	EUR		23.914,41	0,05
Dividendenforderungen		USD	1.368,89	EUR		1.277,25	0,00
<b>Summe Sonstige Vermögensgegenstände</b>				<b>EUR</b>		<b>34.197,66</b>	<b>0,08</b>

Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

## Swiss Rock (Lux) Sicav - European Equity / Aktien Europa ESG

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg in 1.000	Bestand	Kurs zum 28.06.2024	Kurswert in EUR	in % des Netto- Teilfonds- vermögens
<b>Bankverbindlichkeiten</b>						
Bankverbindlichkeiten CACEIS Investor Services Bank S.A.		CHF	-7,97	EUR	-8,28	0,00
Bankverbindlichkeiten UBS Ltd London		GBP	-4.439,70	EUR	-5.236,42	-0,01
<b>Summe Bankverbindlichkeiten</b>				EUR	<b>-5.244,70</b>	<b>-0,01</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten <sup>1)</sup></b>				EUR	<b>-316.000,75</b>	<b>-0,72</b>
<b>Netto-Teilfondsvermögen</b>				EUR	<b>43.838.685,01</b>	<b>100,00<sup>*)</sup></b>

\*) Durch Rundungen bei der Berechnung können geringe Differenzen entstanden sein.

1) In den 'Sonstigen Verbindlichkeiten' sind Fondsmanagervergütung, performanceabhängige Fondsmanagervergütung, Risikomanagementgebühr, Taxe d'abonnement, Transaktionskosten, Verbindlichkeiten MwSt., Verwahrstellenvergütung, Verwaltungsvergütung und Zentralverwaltungsstellenvergütung enthalten.

Nettoinventarwert pro Aktie des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - European Equity / Aktien Europa ESG A	EUR	23,71
Nettoinventarwert pro Aktie des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - European Equity / Aktien Europa ESG B	EUR	19,88
Nettoinventarwert pro Aktie des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - European Equity / Aktien Europa ESG X	EUR	21,08
Umlaufende Aktien des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - European Equity / Aktien Europa ESG A	STK	975.458,104
Umlaufende Aktien des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - European Equity / Aktien Europa ESG B	STK	949.912,792
Umlaufende Aktien des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - European Equity / Aktien Europa ESG X	STK	86.591,253
Anteil der Wertpapiere am Netto-Teilfondsvermögen	%	97,15
Anteil der Derivate am Netto-Teilfondsvermögen	%	-0,01

### Verpflichtungen aus Derivaten

Futures Kauf	Währung	Kontrakte	Kontraktgröße	Kurs Underlying	Dev. Kurs	Verpflichtungen aus Derivaten in EUR
Euro STOXX 50 Future 20.09.24	EUR	22,00	10,00	4.926,0000	1,000000	1.083.720,00
FTSE 100 Future 20.09.24	GBP	3,00	10,00	8.212,0000	1,179454	290.570,27
<b>Summe Futures Kauf</b>						<b>1.374.290,27</b>

### Devisenkurse (in Mengennotiz)

		per	28.06.2024
Britisches Pfund	GBP	0,847850	=1 EUR
Dänische Kronen	DKK	7,457450	=1 EUR
Norwegische Kronen	NOK	11,411500	=1 EUR
Schwedische Kronen	SEK	11,350000	=1 EUR
Schweizer Franken	CHF	0,963050	=1 EUR
US-Dollar	USD	1,071750	=1 EUR

Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

## Swiss Rock (Lux) Sicav - European Equity / Aktien Europa ESG

### Ertrags- und Aufwandsrechnung des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - European Equity / Aktien Europa ESG im Zeitraum vom 1. Juli 2023 bis 30. Juni 2024

	EUR
<b>Erträge</b>	
Zinsen aus Geldanlagen	21.498,36
Dividendenerträge	1.288.062,29
Erträge aus REITs	1.550,00
Ordentlicher Ertragsausgleich	-7.226,67
<b>Erträge insgesamt</b>	<b>1.303.883,98</b>
<b>Aufwendungen</b>	
Fondsmanagervergütung	-294.832,60
Performanceabhängige Fondsmanagervergütung	-218.904,99
Verwaltungsvergütung	-20.455,07
Zentralverwaltungsstellenvergütung	-11.119,89
Verwahrstellenvergütung	-32.423,40
Prüfungskosten	-11.407,32
Taxe d'abonnement	-20.043,05
Veröffentlichungskosten	-8.634,87
Register- und Transferstellenvergütung	-650,00
Regulatorische Kosten	-3.819,03
Zinsaufwendungen	-499,16
Sonstige Aufwendungen	-30.048,55
Ordentlicher Aufwandsausgleich	12.197,11
<b>Aufwendungen insgesamt</b>	<b>-640.640,82</b>
<b>Ordentlicher Nettoertrag</b>	<b>663.243,16</b>
<b>Veräußerungsgeschäfte</b>	
Realisierte Gewinne	2.266.994,44
Ertragsausgleich auf realisierte Gewinne	-39.705,03
Realisierte Verluste	-841.507,32
Aufwandsausgleich auf realisierte Verluste	20.452,70
<b>Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften</b>	<b>1.406.234,79</b>
<b>Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>	<b>2.069.477,95</b>
<b>Veränderung der nicht realisierten Gewinne und Verluste</b>	
Veränderung der nicht realisierten Gewinne	4.541.177,57
Veränderung der nicht realisierten Verluste	-123.210,66
<b>Nettoveränderung des nicht realisierten Ergebnisses des Geschäftsjahres</b>	<b>4.417.966,91</b>
<b>Ergebnis des Geschäftsjahres inkl. Ertrags-/Aufwandsausgleich</b>	<b>6.487.444,86</b>

### Vermögensentwicklung des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - European Equity / Aktien Europa ESG

	EUR
<b>Netto-Teilfondsvermögen zum Beginn des Geschäftsjahres</b>	<b>39.181.764,28</b>
Mittelzuflüsse	4.072.091,29
Mittelabflüsse	-5.916.897,31
Mittelzufluss/ -abfluss netto	-1.844.806,02
Ertrags- und Aufwandsausgleich	14.281,89
Ergebnis des Geschäftsjahres inkl. Ertrags-/Aufwandsausgleich	6.487.444,86
<b>Netto-Teilfondsvermögen zum Ende des Geschäftsjahres</b>	<b>43.838.685,01</b>

Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.



## Swiss Rock (Lux) Sicav - European Equity / Aktien Europa ESG

### Entwicklung des Teilfonds im Jahresvergleich

#### Swiss Rock (Lux) Sicav - European Equity / Aktien Europa ESG A

Stichtag	Umlaufende Aktien	Währung	Netto-Teilfondsvermögen	Nettoinventarwert pro Aktie
30.06.2024	975.458,104	EUR	23.127.505,66	23,71
30.06.2023	1.015.738,588	EUR	20.673.386,84	20,35
30.06.2022	1.095.524,069	EUR	19.328.477,31	17,64

### Entwicklung des Teilfonds im Jahresvergleich

#### Swiss Rock (Lux) Sicav - European Equity / Aktien Europa ESG B

Stichtag	Umlaufende Aktien	Währung	Netto-Teilfondsvermögen	Nettoinventarwert pro Aktie
30.06.2024	949.912,792	EUR	18.885.432,35	19,88
30.06.2023	1.007.845,495	EUR	16.980.869,23	16,85
30.06.2022	980.015,211	EUR	14.215.559,79	14,51

### Entwicklung des Teilfonds im Jahresvergleich

#### Swiss Rock (Lux) Sicav - European Equity / Aktien Europa ESG X

Stichtag	Umlaufende Aktien	Währung	Netto-Teilfondsvermögen	Nettoinventarwert pro Aktie
30.06.2024	86.591,253	EUR	1.825.747,00	21,08
30.06.2023	85.983,253	EUR	1.527.508,21	17,77
30.06.2022	85.983,253	EUR	1.307.417,58	15,21

## Swiss Rock (Lux) Sicav - Emerging Equity / Aktien Schwellenländer ESG

### Zusammensetzung des Netto-Fondsvermögens des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Emerging Equity / Aktien Schwellenländer ESG per 30. Juni 2024

Position	Betrag in EUR
Wertpapiervermögen	124.413.681,58
(Wertpapiereinstandskosten EUR 100.726.716,95)	
Derivate	-112.741,99
Bankguthaben	2.931.254,25
Sonstige Vermögensgegenstände	435.143,18
<b>Summe Aktiva</b>	<b>127.667.337,02</b>
Bankverbindlichkeiten	-437.591,88
Sonstige Verbindlichkeiten	-667.859,41
<b>Summe Passiva</b>	<b>-1.105.451,29</b>
<b>Netto-Teilfondsvermögen</b>	<b>126.561.885,73</b>

### Währungs-Übersicht des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Emerging Equity / Aktien Schwellenländer ESG

Währung	Kurswert in Mio. EUR	in % des Netto- Teilfondsvermögens
HKD	24,91	19,70
USD	19,14	15,12
TWD	18,38	14,52
KRW	16,77	13,25
EUR	12,37	9,77
ZAR	6,38	5,04
BRL	5,78	4,57
SAR	3,21	2,53
MYR	3,09	2,44
Sonstige Währungen	16,53	13,06
<b>Summe</b>	<b>126,56</b>	<b>100,00</b>

### Wertpapierkategorie-Übersicht des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Emerging Equity / Aktien Schwellenländer ESG

Wertpapierkategorie	Kurswert in Mio. EUR	in % des Netto- Teilfondsvermögens
Aktien	111,53	88,13
Wertpapier-Investmentanteile	12,14	9,59
Andere Wertpapiere	0,74	0,58
<b>Summe</b>	<b>124,41</b>	<b>98,30</b>

### Länder-Übersicht des Wertpapiervermögens des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Emerging Equity / Aktien Schwellenländer ESG

Länder	Kurswert in Mio. EUR	in % des Netto- Teilfondsvermögens
Taiwan	22,58	17,85
Südkorea	16,77	13,25
China	14,38	11,36
Kaimaninseln	12,68	10,02
Irland	12,14	9,59
Indien	10,06	7,95
Brasilien	5,59	4,42
Republik Südafrika	5,24	4,14
Saudi-Arabien	3,20	2,53
Sonstige Länder	21,77	17,19
<b>Summe</b>	<b>124,41</b>	<b>98,30</b>

Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

# Swiss Rock (Lux) Sicav - Emerging Equity / Aktien Schwellenländer ESG

## Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2024 des Teilfonds

### Swiss Rock (Lux) Sicav - Emerging Equity / Aktien Schwellenländer ESG

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg in 1.000	Bestand	Kurs zum 28.06.2024	Kurswert in EUR	in % des Netto- Teilfonds- vermögens
<b>Amtlich gehandelte Wertpapiere / Regulierter Markt</b>						
<b>Aktien</b>						
Abu Dhabi Islamic Bank Inhaber-Aktien VE 10	AEA000801018	STK	122.737,00	AED 11,5800	361.050,78	0,29
Emirates NBD PJSC Inhaber-Aktien VE 1	AEE000801010	STK	163.845,00	AED 16,5000	686.754,26	0,54
Banco do Brasil S.A. Registered Shares o.N.	BRBBASACNOR3	STK	83.400,00	BRL 26,7100	374.203,38	0,30
Cia En. de Minas Gerais-CEMIG Reg. Preferred Shares RB 5	BRCMIGACNPR3	STK	355.938,70	BRL 9,8900	591.342,74	0,47
Cielo S.A. Registered Shares o.N.	BRCIELACNOR3	STK	98.500,00	BRL 5,6300	93.156,33	0,07
CPFL Energia SA Registered Shares o.N.	BRCPFACNOR0	STK	21.600,00	BRL 32,7300	118.759,27	0,09
Cyrela Brazil Realty Emp. e P. Registered Shares o.N.	BRCYREACNOR7	STK	38.900,00	BRL 18,8500	123.176,74	0,10
EcoRodovias Infraestr. e Log. Registered Shares o.N.	BRECORACNOR8	STK	36.000,00	BRL 6,6000	39.912,98	0,03
Gerdau S.A. Reg. Preferred Shares o.N.	BRGGBRACNPR8	STK	163.200,00	BRL 18,3800	503.887,32	0,40
Intelbras SA Ind.d.Tel.El.Bra. Registered Shares o.N.	BRINTBACNOR9	STK	93.400,00	BRL 23,0900	362.275,17	0,29
Itau Unibanco Holding S.A. Reg. Preferred Shares o.N.	BRITUBACNPR1	STK	174.100,00	BRL 32,4100	947.862,99	0,75
Petroleo Brasileiro S.A. Reg. Preferred Shares o.N.	BRPETRACNPR6	STK	100.000,00	BRL 38,0500	639.178,89	0,51
Petroleo Brasileiro S.A. Registered Shares o.N.	BRPETRACNOR9	STK	80.000,00	BRL 40,3800	542.655,32	0,43
Santos Brasil Participacoes SA Registered Shares o.N.	BRSTBPACNOR3	STK	47.900,00	BRL 13,6500	109.833,78	0,09
SLC Agricola S.A. Registered Shares o.N.	BRSLCEACNOR2	STK	38.100,00	BRL 17,4500	111.683,28	0,09
Suzano S.A. Registered Shares o.N.	BRSUZBACNOR0	STK	36.300,00	BRL 57,0100	347.636,55	0,27
Ultrapar Participações S.A. Reg. Shares o.N.	BRUGPAACNOR8	STK	50.000,00	BRL 21,6000	181.422,66	0,14
UNIPAR Carbochloro S.A. Reg. Pref. Shares Class B o.N.	BRUNIPACNPB8	STK	21.120,00	BRL 48,7900	173.098,18	0,14
Anhui Gujing Distillery Co.Ltd Registered Shares A YC 1	CNE000000MD5	STK	1.200,00	CNY 211,0700	32.524,85	0,03
China Meheco Group Co. Ltd. Registered Shares A YC 1	CNE000000Q29	STK	161.900,00	CNY 10,1200	210.394,74	0,17
China National Medicine Registered Shares A YC 1	CNE000001D56	STK	21.500,00	CNY 30,7900	85.007,19	0,07
Chongqing Zhif.Biol.Pr.Co.Ltd. Registered Shares A YC 1	CNE100000V20	STK	69.900,00	CNY 28,0300	251.598,35	0,20
CN Res.Sanjia Med.&Phar.Co.Ltd Registered Shares A YC 1	CNE0000011K8	STK	41.990,00	CNY 42,5800	229.593,21	0,18
Dashenlin Pharmaceutical Group Registered Shares A YC 1	CNE100002RG2	STK	42.360,00	CNY 14,3000	77.785,65	0,06
ENN Natural Gas Co. Ltd. Registered Shares A YC 1	CNE000000DG7	STK	47.100,00	CNY 20,8000	125.803,22	0,10
Henan Shuanghui In.&De.Co.Ltd. Registered Shares A YC 1	CNE000000XM3	STK	135.100,00	CNY 23,7700	412.374,73	0,33
NARI Technology Co. Ltd. Registered Shares A YC 1	CNE000001G38	STK	27.700,00	CNY 24,9600	88.783,42	0,07
NAURA Technology Group Co.Ltd. Registered Shares A YC 1	CNE100000ML7	STK	3.500,00	CNY 319,8900	143.772,63	0,11
Sailun Group Co Ltd. Registered Shares A YC 1	CNE1000015F7	STK	27.000,00	CNY 14,0000	48.539,95	0,04
Shenzhen Mindray Bio-Med.Elec. Registered Shares A YC1	CNE100003G67	STK	1.700,00	CNY 290,9100	63.506,05	0,05
Shenzhen New Ind.Biomed.Eng.Co Registered Shares Cl.A YC 1	CNE100003T39	STK	22.300,00	CNY 67,4400	193.121,20	0,15
Sieyuan Electric Co. Ltd . Registered Shares A YC 1	CNE000001KM8	STK	8.000,00	CNY 66,9000	68.726,40	0,05
WUS Printed Circuit[Kushan]Co. Registered Shares A YC 1	CNE100000SP5	STK	99.900,00	CNY 36,5000	468.237,15	0,37
Yifeng Pharmacy Chain Co. Ltd. Registered Shares A YC 1	CNE100001TS5	STK	42.504,00	CNY 24,5500	133.995,07	0,11
Zhej. Ding. Machinery Co. Ltd. Registered Shares A YC 1	CNE1000023M7	STK	14.800,00	CNY 60,4200	114.828,57	0,09
Alpha Services and Holdings SA Namens-Aktien EO -,29	GRS015003007	STK	43.086,00	EUR 1,5235	65.641,52	0,05
Eurobank Ergasias Ser.Hold.SA Namens-Aktien EO -,22	GRS323003012	STK	80.000,00	EUR 2,0210	161.680,00	0,13
Jumbo S.A. Namens-Aktien EO 0,88	GRS282183003	STK	18.584,00	EUR 26,8800	499.537,92	0,39
Metlen Energy & Metals S.A. Namens-Aktien EO 0,97	GRS393503008	STK	2.780,00	EUR 34,8600	96.910,80	0,08
National Bank of Greece S.A. Namens-Aktien EO 1	GRS003003035	STK	20.000,00	EUR 7,7840	155.680,00	0,12
Piraeus Financial Holdings SA Namens-Aktien EO 0,93	GRS014003032	STK	76.113,00	EUR 3,4060	259.240,88	0,20
AAC Technologies Holdings Inc. Registered Shares New DL -,01	KYG2953R1149	STK	96.500,00	HKD 30,7000	354.050,15	0,28
Agricult. Bk of China, The Registered Shares H YC 1	CNE100000Q43	STK	2.091.000,00	HKD 3,3400	834.640,76	0,66
Alibaba Group Holding Ltd. Registered Shares o.N.	KYG017191142	STK	161.700,00	HKD 70,5000	1.362.379,89	1,08
Aluminum Corp. of China Ltd. Registered Shares H YC 1	CNE1000001T8	STK	736.000,00	HKD 5,3300	468.817,82	0,37
Bank of China Ltd. Registered Shares H YC 1	CNE1000001Z5	STK	1.871.000,00	HKD 3,8500	860.862,13	0,68
Bank of Communications Co.Ltd. Registered Shares H YC 1	CNE100000205	STK	415.000,00	HKD 6,1300	304.023,85	0,24
Beijing Enterprises Wtr Gr.Ltd Reg. Cons. Shares HD -,10	BMG0957L1090	STK	766.000,00	HKD 2,4000	219.704,57	0,17
Bosideng Intl Hldgs Ltd. Registered Shares DL-,00001	KYG126521064	STK	718.000,00	HKD 4,8700	417.880,87	0,33
China CITIC Bank Corp. Ltd. Registered Shares H YC 1	CNE1000001Q4	STK	110.000,00	HKD 5,0100	65.861,18	0,05
China Cmncnts Srvcs Corp.Ltd. Registered Shares H YC 1	CNE1000002G3	STK	516.000,00	HKD 4,2100	259.615,66	0,21
China Construction Bank Corp. Registered Shares H YC 1	CNE1000002H1	STK	2.504.000,00	HKD 5,7700	1.726.669,53	1,36
China Everbright Bank Co. Ltd. Registered Shares H YC 1	CNE100001QW3	STK	133.000,00	HKD 2,4300	38.623,98	0,03

Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

## Swiss Rock (Lux) Sicav - Emerging Equity / Aktien Schwellenländer ESG

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg in 1.000	Bestand	Kurs zum 28.06.2024	Kurswert in EUR	in % des Netto- Teilfonds- vermögens
China Everbright Envi.Grp.Ltd. Registered Shares o.N.	HK0257001336	STK	430.000,00	HKD 3,9200	201.443,66	0,16
China Minsheng Banking Corp. Registered Shares H YC 1	CNE100000HF9	STK	150.000,00	HKD 2,7000	48.400,98	0,04
China Petroleum & Chemi. Corp. Registered Shares H YC 1	CNE1000002Q2	STK	450.000,00	HKD 5,0600	272.121,04	0,22
China Railway Group Ltd. Registered Shares H YC 1	CNE1000007Z2	STK	490.000,00	HKD 4,3100	252.390,17	0,20
China Resources Gas Group Ltd. Registered Shares HD -,10	BMG2113B1081	STK	77.000,00	HKD 27,3500	251.679,10	0,20
China Resources Pharm.Grp.Ltd. Registered Shares o.N.	HK0000311099	STK	370.000,00	HKD 5,7900	256.023,23	0,20
China Resources Power Hldgs Co Registered Shares o.N.	HK0836012952	STK	70.000,00	HKD 23,9500	200.356,14	0,16
China Tower Corp. Ltd. Registered Shares H YC 1	CNE100003688	STK	3.300.000,00	HKD 1,0100	398.322,10	0,31
China Tradition.C.Med.Hldg.Co. Registered Shares o.N.	HK0000056256	STK	1.158.000,00	HKD 3,6300	502.359,10	0,40
CMOC Group Ltd. Registered Shares H YC -,20	CNE100000114	STK	198.000,00	HKD 7,1400	168.951,67	0,13
COSCO SHIPPING Holdings Co.Ltd Registered Shares H YC 1	CNE1000002J7	STK	403.600,00	HKD 13,6600	658.871,84	0,52
Dongyue Group Ltd. Registered Shares o.N.	KYG2816P1072	STK	474.000,00	HKD 8,4900	480.933,60	0,38
Fuyao Glass Industry Group Co. Registered Shares H YC 1	CNE100001TR7	STK	121.600,00	HKD 45,3500	659.037,24	0,52
Grand Pharmaceutical Group Ltd Reg.Ajusted Shares HD -,01	BMG210A71016	STK	58.000,00	HKD 4,6500	32.231,46	0,03
Great Wall Motor Co. Ltd. Registered Shares H YC 1	CNE100000338	STK	200.000,00	HKD 12,0400	287.776,66	0,23
Haier Smart Home Co. Ltd. Registered Shares H YC 1	CNE1000048K8	STK	98.400,00	HKD 26,1000	306.926,72	0,24
Haitian Intl Hldgs Ltd. Registered Shares HD -,10	KYG4232C1087	STK	109.000,00	HKD 22,2000	289.186,86	0,23
Hansoh Pharmaceutical Group Co Registered Shares HD -,00001	KYG549581067	STK	292.000,00	HKD 16,3200	569.510,97	0,45
Health & Happiness (H&H) Int. Registered Shares HD -,01	KYG4387E1070	STK	45.000,00	HKD 8,9400	48.078,30	0,04
Huatai Securities Co. Ltd. Registered Shares H YC 1	CNE100001YQ9	STK	178.200,00	HKD 8,6300	183.788,18	0,15
Industr. & Commerc.Bk of China Registered Shares H YC 1	CNE1000003G1	STK	2.924.000,00	HKD 4,6400	1.621.415,94	1,28
Jiangxi Copper Co. Ltd. Registered Shares H YC 1	CNE1000003K3	STK	240.000,00	HKD 15,5800	446.866,49	0,35
Kunlun Energy Co. Ltd. Registered Shares HD -,01	BMG5320C1082	STK	286.000,00	HKD 8,1000	276.853,58	0,22
Lenovo Group Ltd. Registered Shares o.N.	HK0992009065	STK	434.000,00	HKD 11,0200	571.571,30	0,45
NongFu Spring Co. Ltd. Registered Shares H YC 1	CNE100004272	STK	138.800,00	HKD 37,0500	614.577,66	0,49
Orient Overseas (Intl.) Ltd. Registered Shares New DL -,10	BMG677491539	STK	19.500,00	HKD 126,7000	295.263,87	0,23
People's Ins.Co.(Gr.) o.Ch.Ltd Registered Shares H YC 1	CNE100001MK7	STK	391.000,00	HKD 2,6800	125.230,65	0,10
PICC Property & Casualty Co. Registered Shares H YC 1	CNE100000593	STK	70.000,00	HKD 9,7000	81.146,33	0,06
Pop Mart International Group Registered Shares DL-,0001	KYG7170M1033	STK	59.600,00	HKD 38,2500	272.443,71	0,22
Sinopharm Group Co. Ltd. Registered Shares H YC 1	CNE100000FN7	STK	78.400,00	HKD 20,7500	194.416,56	0,15
Sinotruk Hong Kong Ltd. Registered Shares o.N.	HK3808041546	STK	154.500,00	HKD 20,3000	374.820,74	0,30
Tencent Holdings Ltd. Reg. Shares HD -,00002	KYG875721634	STK	88.700,00	HKD 372,4000	3.947.593,10	3,12
Theme International Hldgs Ltd. Registered Shares HD-,0025	BMG8800F1876	STK	930.000,00	HKD 0,4900	54.460,06	0,04
Tianneng Power Intern. Ltd. Registered Shares HD -,1	KYG8655K1094	STK	86.000,00	HKD 5,6100	57.658,11	0,05
Tongcheng Travel Holdings Ltd. Registered Shares DL-,0005	KYG8918W1069	STK	94.800,00	HKD 15,5400	176.059,09	0,14
Trip.com Group Ltd. Registered Shares DL -,00125	KYG9066F1019	STK	13.000,00	HKD 374,6000	581.982,89	0,46
VTech Holdings Ltd. Reg.Shs (BL 100) DL -,05	BMG9400S1329	STK	31.400,00	HKD 58,4000	219.150,05	0,17
Want Want China Holdings Ltd. Registered Shares DL -,02	KYG9431R1039	STK	125.000,00	HKD 4,7200	70.510,06	0,06
Weichai Power Co. Ltd. Registered Shares H YC 1	CNE1000004L9	STK	315.000,00	HKD 14,9400	562.419,33	0,44
Xiaomi Corp. Registered Shares Cl.B o.N.	KYG9830T1067	STK	394.600,00	HKD 16,4800	777.165,26	0,61
Yankuang Energy Group Co. Ltd. Registered Shares H YC 1	CNE1000004Q8	STK	144.300,00	HKD 11,1600	192.455,18	0,15
Yue Yuen Indust.(Hldgs) Ltd. Registered Shares HD -,25	BMG988031446	STK	150.000,00	HKD 15,1000	270.686,94	0,21
OTP Bank Nyrt. Namens-Aktien UF 100	HU0000061726	STK	16.731,00	HUF 18.325,0000	776.338,74	0,61
AKR Corporindo Tbk Registered Shares RP 20	ID1000106701	STK	554.000,00	IDR 1.620,0000	51.138,73	0,04
Ciputra Development, PT Registered Shares RP 250	ID1000115306	STK	2.377.700,00	IDR 1.130,0000	153.094,89	0,12
Medco Energi Intl TBK, PT Registered Shares RP 25	ID1000053705	STK	588.800,00	IDR 1.335,0000	44.789,30	0,04
Pabrik Kertas Tjiwi Kimia, PT Registered Shares RP 1000	ID1000060403	STK	251.300,00	IDR 8.700,0000	124.576,73	0,10
PT Bank Mandiri (Persero) TBK Registered Shares RP 125	ID1000095003	STK	412.200,00	IDR 6.150,0000	144.446,92	0,11
PT Bank Tabung.Neg.(Pers.)Tbk Registered Shares RP 500	ID1000113707	STK	922.100,00	IDR 1.265,0000	66.465,11	0,05
PT Indosat TBK Registered Shares RP 100	ID1000097405	STK	70.700,00	IDR 10.700,0000	43.105,07	0,03
PT Jasa Marga (Persero) Tbk Registered Shares RP 500	ID1000108103	STK	311.700,00	IDR 4.980,0000	88.448,67	0,07
PT XL Axiata TBK Registered Shares RP 100	ID1000102502	STK	1.424.600,00	IDR 2.160,0000	175.336,31	0,14
CJ CheilJedang Corp. Registered Shares SW 5000	KR7097950000	STK	781,00	KRW 385.500,0000	204.082,47	0,16
DB Insurance Co. Ltd. Registered Shares SW 500	KR7005830005	STK	5.829,00	KRW 114.500,0000	452.407,53	0,36
Doosan Bobcat Inc. Registered Shares SW 500	KR7241560002	STK	5.000,00	KRW 51.300,0000	173.867,20	0,14
GS Holdings Corp. Registered Shares SW 5000	KR7078930005	STK	1.089,00	KRW 46.900,0000	34.620,31	0,03
Hana Financial Group Inc. Registered Shares SW 5000	KR7086790003	STK	18.981,00	KRW 60.700,0000	780.976,68	0,62
Hankook Tire&Technology Co.Ltd Registered Shares SW 500	KR7161390000	STK	12.985,00	KRW 45.200,0000	397.842,04	0,31
Hanmi Pharmaceutical Co. Ltd. Registered Shares SW 2500	KR7128940004	STK	638,00	KRW 270.500,0000	116.981,78	0,09

Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

## Swiss Rock (Lux) Sicav - Emerging Equity / Aktien Schwellenländer ESG

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg in 1.000	Bestand	Kurs zum 28.06.2024	Kurswert in EUR	in % des Netto- Teilfonds- vermögens
HD Hyundai Co. Ltd. Registered Shares SW 1000	KR7267250009	STK	1.722,00	KRW 74.500,0000	86.960,03	0,07
HD Korea Shiph. & Offs. Engin. Registered Shares SW 5000	KR7009540006	STK	4.928,00	KRW 158.800,0000	530.458,58	0,42
Hyundai Glovis Co. Ltd. Registered Shares SW 500	KR7086280005	STK	2.746,00	KRW 219.000,0000	407.638,25	0,32
HYUNDAI MOBIS Registered Shares SW 5000	KR7012330007	STK	979,00	KRW 251.500,0000	166.897,94	0,13
Industrial Bank of Korea Registered Shares SW 5000	KR7024110009	STK	20.000,00	KRW 14.020,0000	190.067,69	0,15
KB Financial Group Inc. Registered Shares SW 5000	KR7105560007	STK	25.252,00	KRW 78.500,0000	1.343.679,60	1,06
Kia Corp. Registered Shares SW 5000	KR7000270009	STK	9.593,00	KRW 129.300,0000	840.781,71	0,66
Korean Air Lines Co. Ltd. Registered Shares SW 5000	KR7003490000	STK	38.179,00	KRW 23.250,0000	601.696,92	0,48
KT Corp. Registered Shares SW 5000	KR7030200000	STK	10.007,00	KRW 37.400,0000	253.691,42	0,20
KT&G Corp. Registered Shares SW 5000	KR7033780008	STK	4.229,00	KRW 88.200,0000	252.834,63	0,20
LG Uplus Corp. Registered Shares SW 5000	KR7032640005	STK	11.429,00	KRW 9.820,0000	76.076,41	0,06
NH Investment & Securities Co. Registered Shares SW 5000	KR7005940002	STK	3.561,00	KRW 12.690,0000	30.631,19	0,02
Samsung C&T Corp. Registered Shares SW 100	KR7028260008	STK	4.598,00	KRW 142.000,0000	442.575,73	0,35
Samsung Electronics Co. Ltd. Reg Pref. Shares SW 100	KR7005931001	STK	15.246,00	KRW 63.600,0000	657.269,25	0,52
Samsung Electronics Co. Ltd. Registered Shares SW 100	KR7005930003	STK	79.039,00	KRW 81.500,0000	4.366.458,43	3,45
Samsung Fire&Marine Ins.Co.Ltd Registered Shares SW 500	KR7000810002	STK	1.876,00	KRW 389.000,0000	494.666,75	0,39
Samsung Life Insurance Co. Ltd Registered Shares SW 5000	KR7032830002	STK	2.092,00	KRW 88.500,0000	125.497,55	0,10
Samsung SDS Co. Ltd. Registered Shares SW 500	KR7018260000	STK	4.570,00	KRW 148.500,0000	460.016,00	0,36
Shinhan Financial Group Co.Ltd Registered Shares SW 5000	KR7055550008	STK	27.765,00	KRW 48.150,0000	906.200,41	0,72
SK Hynix Inc. Registered Shares SW 5000	KR7000660001	STK	12.269,00	KRW 236.500,0000	1.966.847,08	1,55
SK Telecom Co. Ltd. Registered Shares SW 100	KR7017670001	STK	5.199,00	KRW 51.500,0000	181.491,94	0,14
Woori Financial Group Inc. Registered Shares SW 5000	KR7316140003	STK	23.000,00	KRW 14.690,0000	229.023,43	0,18
Banco del Bajío S.A. Registered Shares Ser. O MN 2	MX41BB000000	STK	64.600,00	MXN 55,510	182.980,23	0,14
Gruma S.A.B. de C.V. Registered Shares Class B o.N.	MXP4948K1056	STK	23.945,00	MXN 333,7900	407.838,85	0,32
Grupo Financ.Banorte SAB de CV Registered Shares Class O o.N.	MXP370711014	STK	105.000,00	MXN 142,5600	763.813,66	0,60
Kimberly-Clark d.Mex.SAB de CV Registered Shares Class A o.N.	MXP606941179	STK	221.200,00	MXN 31,6500	357.239,33	0,28
Bursa Malaysia Berhad Registered Shares MR -,50	MYL18180O003	STK	25.200,00	MYR 8,8400	44.060,13	0,03
CIMB Group Holdings Bhd Registered Shares o.N.	MYL10230O000	STK	350.000,00	MYR 6,8000	470.727,85	0,37
Fraser & Neave Holdings Berhad Registered Shares MR 1	MYL3689O0006	STK	73.800,00	MYR 31,7800	463.877,37	0,37
Gamuda Berhad Registered Shares MR 1	MYL5398O0002	STK	335.100,00	MYR 6,5800	436.107,20	0,34
Genting Berhad Registered Shares MR -,10	MYL3182O0002	STK	200.000,00	MYR 4,7100	186.313,29	0,15
KPJ Healthcare Berhad Registered Shares MR o.N.	MYL5878O0003	STK	600.000,00	MYR 1,9300	229.034,81	0,18
Malayan Banking Berhad Registered Shares MR 1	MYL1155O0000	STK	200.000,00	MYR 9,9600	393.987,34	0,31
Malaysia Airports Hldgs Bhd Registered Shares MR 1	MYL5014O0005	STK	147.700,00	MYR 9,9000	289.206,88	0,23
MISC Bhd Reg. Shares (Foreign) MR 1	MYL3816O0005	STK	30.000,00	MYR 8,5200	50.553,80	0,04
My E.G. Services Bhd Registered Shares MR -,10	MYQ0138O0006	STK	538.300,00	MYR 1,0200	108.596,91	0,09
Sime Darby Bhd Registered Shares o.N.	MYL4197O0009	STK	420.500,00	MYR 2,6200	217.901,50	0,17
Telekom Malaysia Bhd Registered Shares MR 1	MYL4863O0006	STK	50.500,00	MYR 6,7600	67.519,78	0,05
Tenaga Nasional Berhad Registered Shares MR 1	MYL5347O0009	STK	50.000,00	MYR 13,7800	136.273,73	0,11
Ayala Corp. Registered Shares PP 50	PHY0486V1154	STK	35.000,00	PHP 582,0000	324.289,73	0,26
Ayala Land Inc. Registered Shares PP 1	PHY0488F1004	STK	1.135.500,00	PHP 28,5000	515.198,00	0,41
Intl Container Term. Svcs Inc. Registered Shares PP 1	PHY411571011	STK	11.680,00	PHP 349,8000	65.043,64	0,05
Manila Electric Co. Registered Shares PP 10	PHY5764J1483	STK	12.390,00	PHP 366,0000	72.192,91	0,06
Metropolitan Bank & Trust Co. Registered Shares PP 20	PHY6028G1361	STK	269.900,00	PHP 67,5500	290.248,78	0,23
PLDT Inc. Registered Shares PP 5	PHY7072Q1032	STK	14.575,00	PHP 1.437,0000	333.432,17	0,26
Orlen S.A. Inhaber-Aktien ZY 1,25	PLPKN0000018	STK	47.418,00	PLN 67,6900	744.974,91	0,59
Powszechna K.O.(PKO)Bk Polski Inhaber-Aktien ZY 1	PLPKO0000016	STK	30.204,00	PLN 62,9200	441.089,86	0,35
Powszechny Zakład Ubezpieczeń Namens-Aktien ZY 0,10	PLPZU0000011	STK	53.729,00	PLN 51,5400	642.727,78	0,51
Santander Bank Polska S.A. Inhaber-Aktien ZY 10	PLBZ00000044	STK	1.300,00	PLN 541,2000	163.295,81	0,13
Al Jazirah Bank Registered Shares RS 50	SA0007879055	STK	156.250,00	SAR 16,5000	641.205,00	0,51
Alinma Bank Registered Shares RS 10	SA122050HV19	STK	30.000,00	SAR 31,1000	232.046,26	0,18
Arab National Bank Registered Shares RS 50	SA0007879105	STK	100.000,00	SAR 20,2600	503.886,09	0,40
Bank Albilad Registered Shares RS 50	SA000A0D9HK3	STK	20.000,00	SAR 32,6000	162.158,80	0,13
Etihad Etisalat Co. Registered Shares RS 10	SA000A0DM9P2	STK	22.000,00	SAR 53,4000	292.184,29	0,23
Mobile Telecommunications Co. Registered Shares RS 10	SA121053DR18	STK	100.000,00	SAR 11,7200	291.487,91	0,23
Saudi Arabian Oil Co. Registered Shares RS 10	SA14TG012N13	STK	59.219,00	SAR 27,7000	407.975,20	0,32
Saudi Awwal Bank Registered Shares RS 50	SA0007879089	STK	70.000,00	SAR 38,6500	672.884,41	0,53
Charoen Pokphand Foods PCL Reg. Shares (NVDRs) BA 10	TH0101010R14	STK	1.123.200,00	THB 22,9000	653.977,12	0,52
PTT PCL Reg. Shares (NVDRs) BA 1	TH0646010R18	STK	400.000,00	THB 32,5000	330.531,86	0,26

Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

## Swiss Rock (Lux) Sicav - Emerging Equity / Aktien Schwellenländer ESG

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg in 1.000	Bestand	Kurs zum 28.06.2024	Kurswert in EUR	in % des Netto- Teilfonds- vermögens	
Thai Oil PCL Reg. Shares (NVDRs) BA 10	TH0796010R11	STK	412.500,00	THB	53,0000	555.865,61	0,44
TMBThanachart Bank PCL Reg. Shares (NVDRs) BA 0,95	TH0068010R15	STK	9.000.000,00	THB	1,7100	391.298,88	0,31
True Corporation PCL Reg. Shs (NVDRs) BA 4	THB231010R11	STK	3.555.300,00	THB	8,7500	790.959,57	0,62
BIM Birllesik Magazalar A.S. Inhaber-Aktien TN 1	TREBIMM00018	STK	23.389,00	TRY	545,0000	362.793,02	0,29
Turk Hava Yollari A.S. Namens-Aktien TN 1	TRATHYAO91M5	STK	16.000,00	TRY	308,7500	140.597,54	0,11
Acer Inc. Registered Shares TA 10	TW0002353000	STK	220.000,00	TWD	46,8500	296.440,95	0,23
ASUSTeK Computer Inc. Registered Shares TA 10	TW0002357001	STK	40.000,00	TWD	498,0000	572.921,68	0,45
Catcher Technology Co. Ltd. Registered Shares TA 10	TW0002474004	STK	38.000,00	TWD	232,0000	253.558,11	0,20
Cathay Financial Hldg Co. Ltd. Registered Shares TA 10	TW0002882008	STK	400.000,00	TWD	59,0000	678.762,64	0,54
China Develop. Finl Hldg Corp. Registered Shares TA 10	TW0002883006	STK	391.000,00	TWD	15,1000	169.808,58	0,13
CTBC Financial Holding Co.Ltd. Registered Shares TA 10	TW0002891009	STK	1.147.000,00	TWD	37,8500	1.248.634,21	0,99
EVA Airways Corp. Registered Shares TA 10	TW0002618006	STK	224.000,00	TWD	38,1500	245.781,10	0,19
Far Eastern New Century Corp. Registered Shares TA 10	TW0001402006	STK	279.000,00	TWD	35,2500	282.858,51	0,22
Far Eastone Telecom. Co. Ltd. Registered Shares TA 10	TW0004904008	STK	126.000,00	TWD	84,1000	304.770,18	0,24
Fubon Financial Hldg Co. Ltd. Registered Shares TA 10	TW0002881000	STK	300.000,00	TWD	79,3000	684.227,25	0,54
Genius Electronic Opt.Co.Ltd. Registered Shares TA 10	TW0003406005	STK	7.000,00	TWD	662,0000	133.279,07	0,11
Hon Hai Precision Ind. Co.Ltd. Registered Shares TA 10	TW0002317005	STK	286.000,00	TWD	214,0000	1.760.296,12	1,39
Hua Nan Financial Hldg Co.Ltd. Registered Shares TA 10	TW0002880002	STK	664.000,00	TWD	26,4000	504.171,08	0,40
Intl Games Sys Co. Ltd. Registered Shares TA 10	TW0003293007	STK	18.000,00	TWD	1.355,0000	701.483,93	0,55
Makalot Industrial Co.Ltd. Registered Shares TA 10	TW0001477008	STK	46.000,00	TWD	421,0000	556.988,02	0,44
MediaTek Inc. Registered Shares TA 10	TW0002454006	STK	22.000,00	TWD	1.400,0000	885.842,77	0,70
Pegatron Corp. Registered Shares TA 10	TW0004938006	STK	70.000,00	TWD	104,5000	210.387,66	0,17
Phison Electronics Corp. Registered Shares TA 10	TW0008299009	STK	5.000,00	TWD	617,0000	88.728,08	0,07
Powertech Technology Inc. Registered Shares TA 10	TW0006239007	STK	30.000,00	TWD	188,0000	162.212,77	0,13
POYA International Co. Ltd. Registered Shares TA 10	TW0005904007	STK	15.301,00	TWD	492,0000	216.516,42	0,17
Simplo Technology Co. Ltd. Registered Shares TA 10	TW0006121007	STK	20.000,00	TWD	427,5000	245.907,65	0,19
SinoPac Financial Hldgs Co.Ltd Registered Shares TA 10	TW0002890001	STK	1.191.000,00	TWD	25,4000	870.064,41	0,69
Synnex Technology Intl Corp. Registered Shares TA 10	TW0002347002	STK	279.000,00	TWD	73,1000	586.580,34	0,46
Taiwan Mobile Co. Ltd. Registered Shares TA 10	TW0003045001	STK	229.000,00	TWD	107,0000	704.733,94	0,56
Taiwan Semiconduct.Manufact.Co Registered Shares TA 10	TW0002330008	STK	136.000,00	TWD	966,0000	3.778.522,05	2,99
Topco Scientific Co. Ltd. Registered Shares TA 10	TW0005434005	STK	53.502,00	TWD	275,0000	423.163,93	0,33
Tung Ho Steel Enterprise Corp. Registered Shares TA 10	TW0002006004	STK	21.000,00	TWD	69,6000	42.037,27	0,03
Uni-President Enterprises Corp Registered Shares TA 10	TW0001216000	STK	130.000,00	TWD	81,3000	303.976,37	0,24
Union Bank of Taiwan Registered Shares TA 10	TW0002838000	STK	119.087,00	TWD	16,3500	56.000,00	0,04
United Integrated Ser.Co.Ltd. Registered Shares TA 10	TW0002404001	STK	44.000,00	TWD	366,0000	463.169,22	0,37
Wisdom Marine Lines Co.Ltd Registered Shares TA 10	KYG9721M1033	STK	160.000,00	TWD	68,0000	312.921,08	0,25
Wiwynn Corp. Registered Shares TWD 10	TW0006669005	STK	5.000,00	TWD	2.645,0000	380.365,93	0,30
Yuanta Financial Hldg Co. Ltd. Registered Shares TA 10	TW0002885001	STK	180.000,00	TWD	32,0500	165.922,95	0,13
Afya Ltd. Registered Shs Cl. A DL -,00005	KYG011251066	STK	3.700,00	USD	17,6500	60.933,05	0,05
Axis Bank Ltd. Reg. Shs (GDRs Reg.S)/5 IR 10	US05462W1099	STK	14.383,00	USD	76,0000	1.019.928,15	0,81
Banco de Chile Reg. Shs (Sp.ADRs)/200 o.N.	US0595201064	STK	16.610,00	USD	22,6300	350.720,13	0,28
Bancolombia S.A. Reg.Prf.Shs(Sp.ADRs)/4 KP 500	US05968L1026	STK	7.918,00	USD	32,6500	241.215,49	0,19
Credicorp Ltd. Registered Shares DL 5	BMG2519Y1084	STK	2.700,00	USD	161,3300	406.429,67	0,32
Dr Reddy's Laboratories Ltd. Reg. Shares (Sp.ADRs)/1 IR 5	US2561352038	STK	20.078,00	USD	76,1900	1.427.331,77	1,13
Himax Technologies Inc. Reg.Shares (Sp.ADRs) 1/o.N.	US43289P1066	STK	31.400,00	USD	7,9400	232.625,15	0,18
ICICI Bank Ltd. Reg.Shs (Spons.ADRs)/2 IR 10	US45104G1040	STK	71.000,00	USD	28,8100	1.908.570,10	1,51
Infosys Ltd. Reg. Shs (Spons.ADRs)/1 IR 5	US4567881085	STK	63.881,00	USD	18,6200	1.109.833,66	0,88
JOYY Inc. Reg.Shs (sp.ADRs)/20 Cl.A o.N.	US46591M1099	STK	5.500,00	USD	30,0900	154.415,68	0,12
MINISO Group Holding Ltd. Reg.Shares(Sp.ADS)/4 o.N.	US66981J1025	STK	9.800,00	USD	19,0700	174.374,62	0,14
Pagesguro Digital Ltd. Reg.Shs. Cl. A DL -,000025	KYG687071012	STK	6.000,00	USD	11,6900	65.444,37	0,05
PDD Holdings Inc. Reg. Shs (Spon.ADRs)/4 o.N.	US7223041028	STK	9.200,00	USD	132,9500	1.141.254,96	0,90
Qifu Technology Inc. Reg.Shs(Spons.ADRs)/2 o.N.	US88557W1018	STK	10.000,00	USD	19,7300	184.091,44	0,15
Taiwan Semiconduct.Manufact.Co Reg.Shs (Spons.ADRs)/5 TA 10	US8740391003	STK	28.337,00	USD	173,8100	4.595.525,05	3,63
Tencent Music Entertainment Gr Reg.Shares (Sp. ADRs) o.N.	US88034P1093	STK	26.300,00	USD	14,0500	344.777,23	0,27
Vipshop Holdings Ltd. Reg.Shares (Sp.ADRs)/2 o.N.	US92763W1036	STK	49.700,00	USD	13,0200	603.773,27	0,48
Avi Ltd. Registered Shares RC -,05	ZAE000049433	STK	48.556,00	ZAR	94,5900	234.689,67	0,19
Bid Corp. Ltd. Registered Shares o.N.	ZAE000216537	STK	20.028,00	ZAR	424,8700	434.809,97	0,34
Bidvest Group Ltd. Registered Shares New RC -,05	ZAE000117321	STK	35.707,00	ZAR	284,4400	518.979,11	0,41
Exxaro Resources Ltd. Registered Shares RC 0,01	ZAE000084992	STK	12.000,00	ZAR	178,0000	109.145,82	0,09

Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

# Swiss Rock (Lux) Sicav - Emerging Equity / Aktien Schwellenländer ESG

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg in 1.000	Bestand		Kurs zum 28.06.2024	Kurswert in EUR	in % des Netto- Teilfonds- vermögens
Foschini Group Ltd., The Registered Shares RC -,0125	ZAE000148466	STK	36.914,00	ZAR	127,5100	240.514,46	0,19
Harmony Gold Mining Co. Ltd. Registered Shares RC -,50	ZAE000015228	STK	43.708,00	ZAR	168,0500	375.323,10	0,30
Kumba Iron Ore Ltd. Registered Shares RC 0,01	ZAE000085346	STK	27.093,00	ZAR	439,6300	608.625,67	0,48
Mr. Price Group Ltd. Registered Shares RC -,025	ZAE000200457	STK	16.170,00	ZAR	205,9200	170.143,12	0,13
Naspers Ltd. Registered Shares N RC 100	ZAE000325783	STK	3.000,00	ZAR	3.567,2200	546.835,87	0,43
NEPI Rockcastle N.V. Aand.op naam EO -,01	NL0015000RT3	STK	100.000,00	ZAR	131,3700	671.277,43	0,53
Shoprite Holdings Ltd. Registered Shares RC 1,134	ZAE000012084	STK	10.000,00	ZAR	284,0300	145.134,30	0,11
Standard Bank Group Ltd. Registered Shares RC-,10	ZAE000109815	STK	78.947,00	ZAR	210,8100	850.418,47	0,67
Tiger Brands Ltd. Registered Shares RC -,10	ZAE000071080	STK	47.049,00	ZAR	198,9700	478.347,87	0,38
Truworths International Ltd. Registered Shares RC-,00015	ZAE000028296	STK	110.822,00	ZAR	93,2800	528.226,72	0,42
<b>Andere Wertpapiere</b>							
Coca-Cola FEMSA S.A.B. de C.V. Registered Units o.N.	MX01KO000002	STK	23.095,00	MXN	156,8700	184.866,53	0,15
Fomento Econom.Mexica.SAB D.CV Reg.Uts(1Share B + 4 Shs D)oN	MXP320321310	STK	55.000,00	MXN	196,8300	552.400,95	0,44
<b>Organisierter Markt</b>							
<b>Aktien</b>							
Neoenergia S.A. Registered Shares o.N.	BRNEOEACNOR3	STK	106.200,00	BRL	18,5700	331.286,84	0,26
Mahindra & Mahindra Ltd. Reg. Shs (GDRs Reg.S)/1 IR 10	USY541641194	STK	32.655,00	USD	34,2000	1.042.034,99	0,82
Reliance Industries Ltd. Reg.Eqy Shs(GDRs144A)/2 IR 10	US7594701077	STK	34.500,00	USD	74,6000	2.401.399,58	1,90
State Bank of India Reg.Shs(GDRs Reg.S)/10IR 10	US8565522039	STK	12.195,00	USD	101,0000	1.149.237,23	0,91
<b>Wertpapier-Investmentanteile</b>							
UTI Gold.PLC-UTI Ind.Dyn.Eq.Fd Reg. Shares EUR Class o.N.	IE00BYPC7T68	ANT	476.668,66	EUR	25,4714	12.141.418,11	9,59
<b>Sonstige Wertpapiere</b>							
<b>Aktien</b>							
China Forestry Hldgs Co. i.L. Reg. Shares Reg S DL -,001	KYG2113A1004	STK	400.000,00	HKD	0,0000	0,00	0,00
Gazprom PJSC Registered Shares RL 5	RU0007661625	STK	22.330,00	RUB	12,9831	3.136,28	0,00
Inter RAO UES PJSC Registered Shares RL 2,809767	RU000A0JPNM1	STK	2.383.300,00	RUB	0,0605	1.560,09	0,00
LUKOIL PJSC Registered Shares RL -,025	RU0009024277	STK	1.900,00	RUB	38,3773	788,81	0,00
Novolipetskiy Metallurg. Komb. Registered Shares RL 1	RU0009046452	STK	65.110,00	RUB	1,1911	838,97	0,00
PIK-specialized Homebuil. PJSC Registered Shares RL 62,50	RU000A0JP7J7	STK	11.914,00	RUB	10,6583	1.373,70	0,00
Polyus PJSC Registered Shares RL 1	RU000A0JNAA8	STK	883,00	RUB	291,5744	2.785,21	0,00
Rosneft Oil Company Registered Shares RL -,01	RU000A0J2Q06	STK	14.460,00	RUB	6,5393	1.022,94	0,00
Sberbank of Russia PJSC Namensaktien RL 3	RU0009029540	STK	176.390,00	RUB	0,7623	1.454,67	0,00
Solidcore Resources PLC Registered Shares DL-,03 1)	JE00B6T5S470	STK	10.000,00	RUB	180,2000	19.494,04	0,02
Surgutneftegas PJSC Registered Pfd Shares RL 1	RU0009029524	STK	192.400,00	RUB	0,6730	1.400,85	0,00
Tatneft PJSC Registered Shares RL 1	RU0009033591	STK	50.000,00	RUB	15,4216	8.341,52	0,01
X 5 Retail Group N.V. Reg.Sh(spon.GDRs Reg S)1/4/EO1	US98387E2054	STK	9.329,00	RUB	124,2572	12.540,18	0,01
LUKOIL PJSC Reg. Shs (Sp. ADRs)/1 RL-,025	US69343P1057	STK	2.361,00	USD	0,3770	830,42	0,00
Magnit PJSC Reg.Shs(Sp.GDRsREGS)1/5/RL-,01	US55953Q2021	STK	13.143,00	USD	0,0065	79,61	0,00
Novolipetskiy Metallurg. Komb. Reg.Shs(Sp.GDRs RegS)/10 RL 1	US67011E2046	STK	5.456,00	USD	0,1655	842,76	0,00
<b>Summe Wertpapiervermögen</b>				<b>EUR</b>		<b>124.413.681,58</b>	<b>98,30</b>
<b>Derivate</b>							
<b>Aktienindex-Terminkontrakte</b>							
MSCI Emerging Markets Index Future 20.09.24		STK	42	USD	1.088,2000	-4.889,20	0,00
<b>Devisenterminkontrakte Kauf</b>							
<b>offen (Kontrahent Verwahrstelle)</b>							
Devisenterminkontrakt Kauf BRL / CHF 12.07.24		BRL	774.962	EUR		-3.297,88	0,00
Devisenterminkontrakt Kauf CNH / CHF 12.07.24		CNH	2.625.625	EUR		850,81	0,00
Devisenterminkontrakt Kauf EUR / CHF 12.07.24		EUR	2.040.966	EUR		1.913,21	0,00
Devisenterminkontrakt Kauf EUR / HKD 03.07.24		EUR	4.113	EUR		1,77	0,00
Devisenterminkontrakt Kauf EUR / ZAR 01.07.24		EUR	736.101	EUR		4.692,99	0,00
Devisenterminkontrakt Kauf MXN / CHF 12.07.24		MXN	4.106.951	EUR		-126,84	0,00

Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

# Swiss Rock (Lux) Sicav - Emerging Equity / Aktien Schwellenländer ESG

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg in 1.000	Bestand	Kurs zum 28.06.2024	Kurswert in EUR	in % des Netto- Teilfonds- vermögens
<b>Devisenterminkontrakte Verkauf</b>						
<b>offen (Kontrahent Verwahrstelle)</b>						
Devisenterminkontrakt Verkauf BRL / CHF 12.07.24		BRL	-14.683.067	EUR	85.815,36	0,07
Devisenterminkontrakt Verkauf CHF / EUR 01.07.24		CHF	-2.830	EUR	12,67	0,00
Devisenterminkontrakt Verkauf CHF / EUR 02.07.24		CHF	-23.609	EUR	34,39	0,00
Devisenterminkontrakt Verkauf CHF / EUR 03.07.24		CHF	-17.375	EUR	-16,38	0,00
Devisenterminkontrakt Verkauf CHF / TRY 12.07.24		CHF	-19.105	EUR	250,16	0,00
Devisenterminkontrakt Verkauf CNH / CHF 12.07.24		CNH	-17.844.262	EUR	7.940,18	0,01
Devisenterminkontrakt Verkauf EUR / CHF 12.07.24		EUR	-2.040.966	EUR	-5.575,66	0,00
Devisenterminkontrakt Verkauf EUR / ZAR 01.07.24		EUR	-197.219	EUR	-1.257,37	0,00
Devisenterminkontrakt Verkauf HKD / CHF 12.07.24		HKD	-89.811.970	EUR	-15.694,54	-0,01
Devisenterminkontrakt Verkauf HUF / CHF 12.07.24		HUF	-127.087.936	EUR	-989,39	0,00
Devisenterminkontrakt Verkauf IDR / CHF 12.07.24		IDR	-16.798.791.340	EUR	2.119,73	0,00
Devisenterminkontrakt Verkauf INR / CHF 12.07.24		INR	-828.512.750	EUR	-48.948,86	-0,04
Devisenterminkontrakt Verkauf KRW / CHF 12.07.24		KRW	-10.270.489.780	EUR	-24.350,37	-0,02
Devisenterminkontrakt Verkauf MXN / CHF 12.07.24		MXN	-24.084.501	EUR	-15.508,94	-0,01
Devisenterminkontrakt Verkauf MYR / CHF 12.07.24		MYR	-4.843.381	EUR	-2.872,56	0,00
Devisenterminkontrakt Verkauf PHP / CHF 12.07.24		PHP	-45.647.761	EUR	-3.641,32	0,00
Devisenterminkontrakt Verkauf PLN / CHF 12.07.24		PLN	-3.583.906	EUR	-6.563,16	-0,01
Devisenterminkontrakt Verkauf TRY / CHF 12.07.24		TRY	-8.523.510	EUR	-2.185,22	0,00
Devisenterminkontrakt Verkauf TWD / CHF 12.07.24		TWD	-370.625.534	EUR	-7.398,51	-0,01
Devisenterminkontrakt Verkauf USD / CHF 12.07.24		USD	-2.613.475	EUR	-3.104,04	0,00
Devisenterminkontrakt Verkauf ZAR / CHF 12.07.24		ZAR	-53.825.224	EUR	-69.953,02	-0,06
<b>Summe Derivate</b>				<b>EUR</b>	<b>-112.741,99</b>	<b>-0,09</b>
<b>Bankguthaben</b>						
<b>Bankkonten</b>						
Bankkonto CACEIS Investor Services Bank S.A.		BRL	26.234,39	EUR	4.406,96	0,00
Bankkonto CACEIS Investor Services Bank S.A.		CHF	26.457,99	EUR	27.473,12	0,02
Bankkonto CACEIS Investor Services Bank S.A.		HKD	476.704,07	EUR	56.970,23	0,05
Bankkonto CACEIS Investor Services Bank S.A.		IDR	24.511.340.326,23	EUR	1.396.664,97	1,10
Bankkonto CACEIS Investor Services Bank S.A.		KRW	8.402,00	EUR	5,70	0,00
Bankkonto CACEIS Investor Services Bank S.A.		MXN	858.955,58	EUR	43.829,97	0,03
Bankkonto CACEIS Investor Services Bank S.A.		MYR	3.861,98	EUR	763,84	0,00
Bankkonto CACEIS Investor Services Bank S.A.		PHP	23.876.178,00	EUR	380.107,97	0,30
Bankkonto CACEIS Investor Services Bank S.A.		SAR	16.108,27	EUR	4.006,28	0,00
Bankkonto CACEIS Investor Services Bank S.A.		TRY	0,01	EUR	0,00	0,00
Bankkonto CACEIS Investor Services Bank S.A.		TWD	24.465,00	EUR	703,64	0,00
Bankkonto CACEIS Investor Services Bank S.A.		USD	32.587,91	EUR	30.406,26	0,02
Bankkonto CACEIS Investor Services Bank S.A.		ZAR	10.482.358,65	EUR	535.629,96	0,42
Bankkonto UBS Ltd London		USD	409.907,32	EUR	382.465,43	0,30
Forderungen aus Variation Margin		USD	5.240,00	EUR	4.889,20	0,00
Initial Margin UBS Ltd London		USD	67.446,00	EUR	62.930,72	0,05
<b>Summe Bankguthaben</b>				<b>EUR</b>	<b>2.931.254,25</b>	<b>2,32</b>
<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>						
Dividendenforderungen		BRL	617.161,10	EUR	103.673,17	0,08
Dividendenforderungen		CNY	148.851,00	EUR	19.114,34	0,02
Dividendenforderungen		EUR	4.101,62	EUR	4.101,62	0,00
Dividendenforderungen		HKD	990.967,00	EUR	118.429,07	0,09
Dividendenforderungen		IDR	44.971.360,00	EUR	2.562,48	0,00
Dividendenforderungen		KRW	27.757.614,30	EUR	18.815,36	0,01
Dividendenforderungen		MYR	6.000,00	EUR	1.186,71	0,00
Dividendenforderungen		TWD	3.210.687,54	EUR	92.342,99	0,07
Dividendenforderungen		USD	80.292,78	EUR	74.917,44	0,06
<b>Summe Sonstige Vermögensgegenstände</b>				<b>EUR</b>	<b>435.143,18</b>	<b>0,34</b>

Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.



## Swiss Rock (Lux) Sicav - Emerging Equity / Aktien Schwellenländer ESG

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg in 1.000	Bestand	Kurs zum 28.06.2024	Kurswert in EUR	in % des Netto- Teilfonds- vermögens
<b>Bankverbindlichkeiten</b>						
Bankverbindlichkeiten CACEIS Investor Services Bank S.A.		CNY	-8,18	EUR	-1,05	0,00
Bankverbindlichkeiten CACEIS Investor Services Bank S.A.		EUR	-437.590,79	EUR	-437.590,79	-0,35
Bankverbindlichkeiten CACEIS Investor Services Bank S.A.		THB	-1,46	EUR	-0,04	0,00
<b>Summe Bankverbindlichkeiten</b>				<b>EUR</b>	<b>-437.591,88</b>	<b>-0,35</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>						
Sonstige Verbindlichkeiten		CHF	-64.384,28	EUR	-66.854,60	-0,05
Sonstige Verbindlichkeiten		EUR	-576.863,49	EUR	-576.863,49	-0,46
Sonstige Verbindlichkeiten		USD	-25.873,47	EUR	-24.141,32	-0,02
<b>Summe Sonstige Verbindlichkeiten 2)</b>				<b>EUR</b>	<b>-667.859,41</b>	<b>-0,53</b>
<b>Netto-Teilfondsvermögen</b>				<b>EUR</b>	<b>126.561.885,73</b>	<b>100,00<sup>*)</sup></b>

\*) Durch Rundungen bei der Berechnung können geringe Differenzen entstanden sein.

1) Namensänderung Emittent; bis zum 16. Juni 2024: Polymetal International PLC

2) In den 'Sonstigen Verbindlichkeiten' sind Fondsmanagervergütung, performanceabhängige Fondsmanagervergütung, Risikomanagementgebühr, Transaktionskosten, Taxe d'abonnement, Verbindlichkeiten MwSt., Verwahrstellenvergütung, Verwaltungsvergütung und Zentralverwaltungsstellenvergütung enthalten.

Nettoinventarwert pro Aktie des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Emerging Equity / Aktien Schwellenländer ESG A	EUR	18,63
Nettoinventarwert pro Aktie des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Emerging Equity / Aktien Schwellenländer ESG B	EUR	17,60
Nettoinventarwert pro Aktie des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Emerging Equity / Aktien Schwellenländer ESG X	CHF	15,01
Nettoinventarwert pro Aktie des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Emerging Equity / Aktien Schwellenländer ESG E	USD	13,72
Nettoinventarwert pro Aktie des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Emerging Equity / Aktien Schwellenländer ESG C	CHF	11,38
Umlaufende Aktien des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Emerging Equity / Aktien Schwellenländer ESG A	STK	1.773.178,736
Umlaufende Aktien des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Emerging Equity / Aktien Schwellenländer ESG B	STK	1.178.138,326
Umlaufende Aktien des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Emerging Equity / Aktien Schwellenländer ESG X	STK	174.760,575
Umlaufende Aktien des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Emerging Equity / Aktien Schwellenländer ESG E	STK	946.994,106
Umlaufende Aktien des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Emerging Equity / Aktien Schwellenländer ESG C	STK	4.904.214,821
Anteil der Wertpapiere am Netto-Teilfondsvermögen	%	98,30
Anteil der Derivate am Netto-Teilfondsvermögen	%	-0,09

### Verpflichtungen aus Derivaten

Devisentermingeschäfte Käufe	Währung	Nominal	Währung	Nominal	offene Positionen in EUR
Devisenterminkontrakt Kauf BRL / CHF 12.07.24	BRL	774.962,24	CHF	-128.224,82	129.846,63
Devisenterminkontrakt Kauf CNH / CHF 12.07.24	CNH	2.625.624,79	CHF	-322.327,22	335.544,98
Devisenterminkontrakt Kauf EUR / HKD 03.07.24	EUR	4.112,59	HKD	-34.400,00	4.112,86
Devisenterminkontrakt Kauf EUR / CHF 12.07.24	EUR	2.040.965,54	CHF	-1.962.127,26	2.039.322,75
Devisenterminkontrakt Kauf EUR / ZAR 01.07.24	EUR	736.100,84	ZAR	-14.318.683,63	736.352,36
Devisenterminkontrakt Kauf MXN / CHF 12.07.24	MXN	4.106.950,92	CHF	-201.349,65	208.948,13
<b>Summe Devisentermingeschäfte Käufe</b>					<b>3.454.127,71</b>

Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

## Swiss Rock (Lux) Sicav - Emerging Equity / Aktien Schwellenländer ESG

Devisentermingeschäfte Verkäufe	Währung	Nominal	Währung	Nominal	offene Positionen in EUR
Devisenterminkontrakt Verkauf CHF / TRY 12.07.24	CHF	-19.104,90	TRY	715.081,18	20.101,80
Devisenterminkontrakt Verkauf CHF / EUR 03.07.24	CHF	-17.374,56	EUR	18.031,45	18.047,83
Devisenterminkontrakt Verkauf CHF / EUR 02.07.24	CHF	-23.608,90	EUR	24.557,43	24.523,04
Devisenterminkontrakt Verkauf CHF / EUR 01.07.24	CHF	-2.830,34	EUR	2.952,52	2.939,85
Devisenterminkontrakt Verkauf BRL / CHF 12.07.24	BRL	-14.683.066,83	CHF	2.451.921,07	2.460.180,24
Devisenterminkontrakt Verkauf CNH / CHF 12.07.24	CNH	-17.844.262,06	CHF	2.203.814,54	2.280.429,63
Devisenterminkontrakt Verkauf EUR / CHF 12.07.24	EUR	-2.040.965,54	CHF	1.958.600,14	2.039.322,75
Devisenterminkontrakt Verkauf EUR / ZAR 01.07.24	EUR	-197.219,40	ZAR	3.836.325,11	197.286,79
Devisenterminkontrakt Verkauf HKD / CHF 12.07.24	HKD	-89.811.969,92	CHF	10.311.091,70	10.722.398,97
Devisenterminkontrakt Verkauf INR / CHF 12.07.24	INR	-828.512.750,09	CHF	8.866.246,31	9.255.372,52
Devisenterminkontrakt Verkauf IDR / CHF 12.07.24	IDR	-16.798.791.339,88	CHF	922.512,44	955.787,38
Devisenterminkontrakt Verkauf MYR / CHF 12.07.24	MYR	-4.843.380,88	CHF	919.248,03	957.390,01
Devisenterminkontrakt Verkauf MXN / CHF 12.07.24	MXN	-24.084.500,99	CHF	1.165.127,84	1.225.340,04
Devisenterminkontrakt Verkauf TWD / CHF 12.07.24	TWD	-370.625.533,77	CHF	10.256.916,91	10.657.849,59
Devisenterminkontrakt Verkauf PHP / CHF 12.07.24	PHP	-45.647.761,31	CHF	695.422,80	725.745,88
Devisenterminkontrakt Verkauf ZAR / CHF 12.07.24	ZAR	-53.825.223,97	CHF	2.575.772,81	2.744.552,27
Devisenterminkontrakt Verkauf KRW / CHF 12.07.24	KRW	-10.270.489.780,32	CHF	6.676.433,16	6.956.942,82
Devisenterminkontrakt Verkauf TRY / CHF 12.07.24	TRY	-8.523.509,87	CHF	228.452,95	239.403,39
Devisenterminkontrakt Verkauf HUF / CHF 12.07.24	HUF	-127.087.935,78	CHF	308.905,01	321.746,37
Devisenterminkontrakt Verkauf USD / CHF 12.07.24	USD	-2.613.474,88	CHF	2.342.327,56	2.435.301,29
Devisenterminkontrakt Verkauf PLN / CHF 12.07.24	PLN	-3.583.906,32	CHF	793.630,21	830.643,12
<b>Summe Devisentermingeschäfte Verkäufe</b>					<b>55.071.305,58</b>

Futures Kauf	Währung	Kontrakte	Kontraktgröße	Kurs Underlying	Dev. Kurs	Verpflichtungen aus Derivaten in EUR
MSCI Emerging Markets Index Future 20.09.24	USD	42,00	50,00	1.088,2000	0,933053	2.132.232,33
<b>Summe Futures Kauf</b>						<b>2.132.232,33</b>

### Devisenkurse (in Mengennotiz)

			per	28.06.2024
Brasilianischer Real	BRL	5,952950	=1	EUR
Hongkong Dollar	HKD	8,367600	=1	EUR
Indonesische Rupiah	IDR	17.549,907000	=1	EUR
Malaysische Ringgit	MYR	5,056000	=1	EUR
Mexikanischer Peso	MXN	19,597450	=1	EUR
Neue Taiwan Dollar	TWD	34,769150	=1	EUR
Neue Türkische Lira	TRY	35,135750	=1	EUR
Philippinische Pesos	PHP	62,814200	=1	EUR
Polnischer Zloty	PLN	4,308500	=1	EUR
Russischer Rubel	RUB	92,438500	=1	EUR
Saudi-Riyal	SAR	4,020750	=1	EUR
Schweizer Franken	CHF	0,963050	=1	EUR
Südafrikanischer Rand	ZAR	19,570150	=1	EUR
Südkoreanischer Won	KRW	1.475,263900	=1	EUR
Thailändische Baht	THB	39,330550	=1	EUR
US-Dollar	USD	1,071750	=1	EUR
Ungarischer Forint	HUF	394,925000	=1	EUR
VAE-Dirham	AED	3,936550	=1	EUR
Yuan Renminbi	CNY	7,787400	=1	EUR

Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

## Swiss Rock (Lux) Sicav - Emerging Equity / Aktien Schwellenländer ESG

### Ertrags- und Aufwandsrechnung des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Emerging Equity / Aktien Schwellenländer ESG im Zeitraum vom 1. Juli 2023 bis 30. Juni 2024

	EUR
<b>Erträge</b>	
Zinsen aus Geldanlagen	85.710,81
Dividendenerträge	3.318.670,60
Erträge aus Bestandsprovisionen	15.172,40
Sonstige Erträge	1.489,38
Ordentlicher Ertragsausgleich	-69.673,33
<b>Erträge insgesamt</b>	<b>3.351.369,86</b>
<b>Aufwendungen</b>	
Fondsmanagervergütung	-808.130,65
Performanceabhängige Fondsmanagervergütung	-374.935,29
Verwaltungsvergütung	-63.621,65
Zentralverwaltungsstellenvergütung	-32.186,23
Verwahrstellenvergütung	-197.545,17
Prüfungskosten	-11.407,30
Taxe d'abonnement	-58.946,12
Veröffentlichungskosten	-8.634,90
Register- und Transferstellenvergütung	-649,99
Regulatorische Kosten	-3.964,83
Zinsaufwendungen	-14.939,67
Sonstige Aufwendungen	-66.729,51
Ordentlicher Aufwandsausgleich	96.709,12
<b>Aufwendungen insgesamt</b>	<b>-1.544.982,19</b>
<b>Ordentlicher Nettoertrag</b>	<b>1.806.387,67</b>
<b>Veräußerungsgeschäfte</b>	
Realisierte Gewinne	16.560.588,01
Ertragsausgleich auf realisierte Gewinne	161.707,45
Realisierte Verluste	-19.715.442,44
Aufwandsausgleich auf realisierte Verluste	24.459,90
<b>Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften</b>	<b>-2.968.687,08</b>
<b>Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>	<b>-1.162.299,41</b>
<b>Veränderung der nicht realisierten Gewinne und Verluste</b>	
Veränderung der nicht realisierten Gewinne	19.081.569,01
Veränderung der nicht realisierten Verluste	-923.247,98
<b>Nettoveränderung des nicht realisierten Ergebnisses des Geschäftsjahres</b>	<b>18.158.321,03</b>
<b>Ergebnis des Geschäftsjahres inkl. Ertrags-/Aufwandsausgleich</b>	<b>16.996.021,62</b>

### Vermögensentwicklung des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Emerging Equity / Aktien Schwellenländer ESG

		EUR
<b>Netto-Teilfondsvermögen zum Beginn des Geschäftsjahres</b>		<b>113.158.178,27</b>
Mittelzuflüsse	10.713.606,44	
Mittelabflüsse	-14.092.717,46	
Mittelzufluss/ -abfluss netto		-3.379.111,02
Ertrags- und Aufwandsausgleich		-213.203,14
Ergebnis des Geschäftsjahres inkl. Ertrags-/Aufwandsausgleich		16.996.021,62
<b>Netto-Teilfondsvermögen zum Ende des Geschäftsjahres</b>		<b>126.561.885,73</b>

Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

## Swiss Rock (Lux) Sicav - Emerging Equity / Aktien Schwellenländer ESG

### Entwicklung des Teilfonds im Jahresvergleich

#### Swiss Rock (Lux) Sicav - Emerging Equity / Aktien Schwellenländer ESG A

Stichtag	Umlaufende Aktien	Währung	Netto-Teilfondsvermögen	Nettoinventarwert pro Aktie
30.06.2024	1.773.178,736	EUR	33.032.884,39	18,63
30.06.2023	2.146.678,369	EUR	34.880.069,16	16,25
30.06.2022	2.120.399,904	EUR	35.336.327,24	16,66

### Entwicklung des Teilfonds im Jahresvergleich

#### Swiss Rock (Lux) Sicav - Emerging Equity / Aktien Schwellenländer ESG B

Stichtag	Umlaufende Aktien	Währung	Netto-Teilfondsvermögen	Nettoinventarwert pro Aktie
30.06.2024	1.178.138,326	EUR	20.741.052,25	17,60
30.06.2023	1.187.182,175	EUR	17.991.993,82	15,16
30.06.2022	1.177.058,711	EUR	18.098.353,63	15,38

### Entwicklung des Teilfonds im Jahresvergleich

#### Swiss Rock (Lux) Sicav - Emerging Equity / Aktien Schwellenländer ESG X

Stichtag	Umlaufende Aktien	Währung	Netto-Teilfondsvermögen	Nettoinventarwert pro Aktie
30.06.2024	174.760,575	CHF	2.623.934,58	15,01
30.06.2023	161.960,575	CHF	2.105.296,57	13,00
30.06.2022	168.909,575	CHF	2.266.240,01	13,42

### Entwicklung des Teilfonds im Jahresvergleich

#### Swiss Rock (Lux) Sicav - Emerging Equity / Aktien Schwellenländer ESG E

Stichtag	Umlaufende Aktien	Währung	Netto-Teilfondsvermögen	Nettoinventarwert pro Aktie
30.06.2024	946.994,106	USD	12.997.127,87	13,72
30.06.2023	1.022.884,937	USD	12.303.670,35	12,03
30.06.2022	282.791,087	USD	3.306.753,55	11,69

### Entwicklung des Teilfonds im Jahresvergleich

#### Swiss Rock (Lux) Sicav - Emerging Equity / Aktien Schwellenländer ESG C

Stichtag	Umlaufende Aktien	Währung	Netto-Teilfondsvermögen	Nettoinventarwert pro Aktie
30.06.2024	4.904.214,821	CHF	55.795.578,41	11,38
30.06.2023	4.550.262,700	CHF	45.729.635,88	10,05
08.02.2023 <sup>1)</sup>	4.244.294,050	CHF	42.442.940,50	10,00

1) Datum der ersten Anteilwertberechnung für die Anteilklasse.

Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

## Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund ESG

### Zusammensetzung des Netto-Fondsvermögens des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund ESG per 30. Juni 2024

Position	Betrag in EUR
Wertpapiervermögen	61.111.822,69
(Wertpapiereinstandskosten EUR 62.820.286,96)	
Derivate	407.065,64
Bankguthaben	6.685.245,49
Sonstige Vermögensgegenstände	672.999,24
<b>Summe Aktiva</b>	<b>68.877.133,06</b>
Sonstige Verbindlichkeiten	-158.468,33
<b>Summe Passiva</b>	<b>-158.468,33</b>
<b>Netto-Teilfondsvermögen</b>	<b>68.718.664,73</b>

### Währungs-Übersicht des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund ESG

Währung	Kurswert in Mio. EUR	in % des Netto- Teilfondsvermögens
EUR	60,49	88,03
USD	6,54	9,51
GBP	1,09	1,59
CHF	0,60	0,87
<b>Summe</b>	<b>68,72</b>	<b>100,00</b>

### Wertpapierkategorie-Übersicht des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund ESG

Wertpapierkategorie	Kurswert in Mio. EUR	in % des Netto- Teilfondsvermögens
Verzinsliche Wertpapiere	59,42	86,47
Wertpapier-Investmentanteile	1,69	2,46
<b>Summe</b>	<b>61,11</b>	<b>88,93</b>

### Länder-Übersicht des Wertpapiervermögens des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund ESG

Länder	Kurswert in Mio. EUR	in % des Netto- Teilfondsvermögens
Frankreich	13,57	19,75
USA	11,66	16,96
Niederlande	7,40	10,77
Bundesrepublik Deutschland	5,96	8,67
Großbritannien	3,09	4,49
Italien	2,57	3,74
Spanien	2,18	3,17
Liechtenstein	1,69	2,46
Irland	1,41	2,06
Sonstige Länder	11,58	16,86
<b>Summe</b>	<b>61,11</b>	<b>88,93</b>

# Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund ESG

## Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2024 des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund ESG

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg in 1.000	Bestand	Kurs zum 28.06.2024	Kurswert in EUR	in % des Netto- vermögens	
<b>Amtlich gehandelte Wertpapiere / Regulierter Markt</b>							
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>							
0,000% Niederlande EO-Anl. 2020(27)	NL0015031501	EUR	400,00	%	93,2900	373.160,00	0,54
0,250% LeasePlan Corporation N.V. EO-Medium-Term Notes 2021(26)	XS2305244241	EUR	300,00	%	94,5500	283.650,00	0,41
0,250% Siemens Finan.maatschappij NV EO-Medium-Term Notes 2020(29)	XS2118276026	EUR	300,00	%	87,8400	263.520,00	0,38
0,250% SKF AB EO-Notes 2021(21/31)	XS2297204815	EUR	200,00	%	79,7800	159.560,00	0,23
0,250% V.F. Corp. EO-Notes 2020(20/28)	XS2123970167	EUR	200,00	%	84,2200	168.440,00	0,25
0,375% Münchener Hypothekbank MTN-IHS Serie 1927 v.21(29)	DE000MHB64E1	EUR	300,00	%	84,6000	253.800,00	0,37
0,375% Woolworths Group Ltd. EO-Medium-Term Nts 2021(21/28)	XS2384274440	EUR	200,00	%	86,7200	173.440,00	0,25
0,500% Alstom S.A. EO-Notes 2021(21/30)	FR0014004R72	EUR	300,00	%	82,3700	247.110,00	0,36
0,500% Banco Bilbao Vizcaya Argent. EO-Non-Preferred MTN 2020(27)	XS2101349723	EUR	500,00	%	92,5800	462.900,00	0,67
0,500% Italgas S.P.A. EO-Medium-Term Notes 2021(33)	XS2299002423	EUR	300,00	%	74,5600	223.680,00	0,33
0,500% Merck & Co. Inc. EO-Notes 2016(16/24)	XS1513055555	EUR	700,00	%	98,8500	691.950,00	1,01
0,500% Niederlande EO-Anl. 2016(26)	NL0011819040	EUR	500,00	%	95,4280	477.140,00	0,69
0,625% Banco de Sabadell S.A. EO-FLR Preferred MTN 19(24/25) FTF	XS2076079594	EUR	500,00	%	98,8700	494.350,00	0,72
0,625% Kreditanst.f.Wiederaufbau Anl.v.2017 (2027)	DE000A2DAR65	EUR	1.500,00	%	94,1180	1.411.770,00	2,05
0,625% Nordea Bank Abp EO-Medium-Term Nts 2021(26/31) FTF	XS2343459074	EUR	300,00	%	93,5100	280.530,00	0,41
0,750% Aareal Bank AG MTN-IHS v.22(28)	DE000AAR0322	EUR	200,00	%	87,1700	174.340,00	0,25
0,750% Dover Corp. EO-Notes 2019(19/27)	XS2010038730	EUR	300,00	%	91,5500	274.650,00	0,40
0,750% Kering S.A. EO-Med.-Term Notes 2020(20/28)	FR0013512407	EUR	200,00	%	90,6100	181.220,00	0,26
0,750% Tele2 AB EO-Medium-Term Nts 2021(30/31)	XS2314267449	EUR	300,00	%	85,4100	256.230,00	0,37
0,830% BP Capital Markets PLC EO-Med.-Term Nts 2016(24/24)	XS1492671158	EUR	200,00	%	99,3100	198.620,00	0,29
0,875% Cie Génle Étis Michelin ScpA EO-Obl. 2018(18/25)	FR0013357845	EUR	500,00	%	96,9400	484.700,00	0,71
0,875% Coöperatieve Rabobank U.A. EO-FLR Non-Pref.MTN 20(27/28) FTF	XS2168285000	EUR	200,00	%	92,7900	185.580,00	0,27
0,875% Kojamo Oyj EO-Medium-Term Notes 21(21/29)	XS2345877497	EUR	300,00	%	84,8900	254.670,00	0,37
0,875% Nykredit Realkredit A/S EO-FLR Med.-T. Nts 2021(26/31) FTF	DK0030487996	EUR	200,00	%	93,5800	187.160,00	0,27
0,875% Orange S.A. EO-Med.-Term Notes 2016(16/27)	FR0013217114	EUR	500,00	%	93,8700	469.350,00	0,68
0,875% PPG Industries Inc. EO-Notes 2016(16/25)	XS1405769487	EUR	500,00	%	96,3100	481.550,00	0,70
0,875% Verizon Communications Inc. EO-Notes 2016(16/25)	XS1405766897	EUR	400,00	%	98,0100	392.040,00	0,57
0,875% Vivendi SE EO-Med.-Term Notes 2017(17/24)	FR0013282571	EUR	300,00	%	99,3730	298.119,00	0,43
0,950% Macquarie Group Ltd. EO-Medium-Term Notes 2021(31)	XS2343850033	EUR	300,00	%	83,8200	251.460,00	0,37
1,000% BMW Finance N.V. EO-Medium-Term Notes 2018(25)	XS1873143645	EUR	500,00	%	97,1600	485.800,00	0,71
1,000% British Telecommunications PLC EO-Med.-Term Notes 2017(17/24)	XS1720922175	EUR	300,00	%	98,9000	296.700,00	0,43
1,000% ENI S.p.A. EO-Medium-Term Nts 2019(34)	XS2065946837	EUR	500,00	%	76,1000	380.500,00	0,55
1,000% IMERYS S.A. EO-Med.-Term Notes 2021(21/31)	FR0014003GX7	EUR	300,00	%	80,3000	240.900,00	0,35
1,000% LANXESS AG Medium-Term Nts 2016(16/26)	XS1501367921	EUR	300,00	%	93,5450	280.635,00	0,41
1,000% Mercedes-Benz Int.Fin. B.V. EO-Medium-Term Notes 2018(25)	DE000A190NE4	EUR	400,00	%	96,7440	386.976,00	0,56
1,000% Sagax EURO MTN NL B.V. EO-Med.-Term Notes 2021(21/29)	XS2342227837	EUR	300,00	%	86,4700	259.410,00	0,38
1,000% Siemens Finan.maatschappij NV EO-Medium-Term Notes 2018(27)	XS1874128033	EUR	500,00	%	94,6700	473.350,00	0,69
1,000% VINCI S.A. EO-Med.-Term Notes 2018(18/25)	FR0013367620	EUR	300,00	%	96,9000	290.700,00	0,42
1,125% Amcor UK Finance PLC EO-Notes 2020(20/27)	XS2193669657	EUR	200,00	%	93,0200	186.040,00	0,27
1,125% Hannover Rück SE FLR-Sub.Anl.v.2019(2029/2039) FTF	XS2063350925	EUR	200,00	%	85,9500	171.900,00	0,25
1,250% Adecco Intl Fin. Serv. B.V. EO-Medium-T.Notes 2019(19/29)	XS1995662027	EUR	400,00	%	89,6100	358.440,00	0,52
1,250% Bertelsmann SE & Co. KGaA MTN v.2018(25/2025)	XS1888229249	EUR	300,00	%	96,9700	290.910,00	0,42
1,250% Goldman Sachs Group Inc., The EO-Medium-Term Nts 2016(24/25)	XS1509006380	EUR	500,00	%	98,0130	490.065,00	0,71
1,250% HOCHTIEF AG MTN v.2019(2031/2031)	DE000A2YN2V0	EUR	500,00	%	82,4000	412.000,00	0,60
1,250% Slowenien, Republik EO-Bonds 2017(27)	SI0002103685	EUR	300,00	%	95,5800	286.740,00	0,42
1,250% Snam S.p.A. EO-Med.-T. Nts 2022(22/34)	XS2433226854	EUR	300,00	%	78,8800	236.640,00	0,34
1,300% Baxter International Inc. EO-Notes 2019(19/29)	XS1998215559	EUR	500,00	%	89,8200	449.100,00	0,65
1,350% Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Non-Preferred MTN 2021(31)	XS2304664597	EUR	250,00	%	84,0800	210.200,00	0,31
1,375% Alfa Laval Treasury Intl. AB EO-Medium-Term Nts 2022(22/29)	XS2444286145	EUR	300,00	%	91,4300	274.290,00	0,40
1,375% CRH Finance DAC EO-Med.-Term Notes 2016(16/28)	XS1505896735	EUR	400,00	%	91,7100	366.840,00	0,53
1,375% DSV Finance B.V. EO-Medium-Term Nts 2022(22/30)	XS2458285355	EUR	400,00	%	88,7800	355.120,00	0,52
1,375% Morgan Stanley EO-Med.-T. Nts 2016(26) Ser.G	XS1511787589	EUR	500,00	%	95,7600	478.800,00	0,70
1,375% Raiffeisen Bank Intl AG EO-FLR Med.-T. Nts 2021(28/33) FTF	XS2353473692	EUR	300,00	%	83,5100	250.530,00	0,36

Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

## Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund ESG

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg in 1.000	Bestand	Kurs zum 28.06.2024	Kurswert in EUR	in % des Netto- Teilfonds- vermögens	
1,500% BNP Paribas S.A. EO-Non-Preferred MTN 2017(28)	XS1722801708	EUR	400,00	%	92,0800	368.320,00	0,54
1,500% Fresenius Medical Care KGaA MTN v.2018(2025/2025)	XS1854532949	EUR	500,00	%	97,8600	489.300,00	0,71
1,500% Israel EO-Medium-Term Notes 2019(29)	XS1936100483	EUR	500,00	%	89,1380	445.690,00	0,65
1,500% ISS Global A/S EO-Medium-Term Nts 2017(17/27)	XS1673102734	EUR	300,00	%	93,4200	280.260,00	0,41
1,500% McKesson Corp. EO-Notes 2017(17/25)	XS1567174286	EUR	300,00	%	97,1500	291.450,00	0,42
1,500% Schneider Electric SE EO-Med.-Term Notes 2019(19/28)	FR0013396876	EUR	500,00	%	94,4800	472.400,00	0,69
1,500% Valéo S.E. EO-Med.-Term Nts 2018(18/25)	FR0013342334	EUR	500,00	%	97,1800	485.900,00	0,71
1,625% Abertis Infraestructuras S.A. EO-Medium-Term Nts 2019(19/29)	XS2025480596	EUR	400,00	%	90,8000	363.200,00	0,53
1,625% Givaudan Finance Europe B.V. EO-Notes 2020(20/32)	XS2126170161	EUR	200,00	%	87,6900	175.380,00	0,26
1,625% Lonza Finance International NV EO-Notes 2020(20/27)	BE6321076711	EUR	200,00	%	95,1100	190.220,00	0,28
1,625% UniCredit S.p.A. EO-Preferred Med.-T.Nts 22(32)	XS2433141947	EUR	300,00	%	85,6500	256.950,00	0,37
1,715% Telefonica Emisiones S.A.U. EO-Medium-Term Nts 2017(17/28)	XS1681521081	EUR	300,00	%	94,4500	283.350,00	0,41
1,750% A.P.Møller-Mærsk A/S EO-Medium-Term Nts 2018(18/26)	XS1789699607	EUR	200,00	%	96,9000	193.800,00	0,28
1,750% Frankreich EO-OAT 2014(24)	FR0011962398	EUR	2.500,00	%	99,2890	2.482.225,00	3,61
1,750% Holcim Finance (Luxembg) S.A. EO-Medium-T. Notes 2017(17/29)	XS1672151492	EUR	300,00	%	91,2700	273.810,00	0,40
1,750% Unilever Fin. Netherlands B.V. EO-Medium-Term Nts 2020(20/30)	XS2147133578	EUR	500,00	%	92,5300	462.650,00	0,67
1,875% Compagnie de Saint-Gobain S.A. EO-Medium-Term Notes 2018(28)	XS1881593971	EUR	500,00	%	93,8700	469.350,00	0,68
1,875% Heathrow Funding Ltd. EO-FLR Med.-T. Nts 19(34.36) A FTF	XS1960589155	EUR	200,00	%	82,6600	165.320,00	0,24
1,940% Veolia Environnement S.A. EO-Med.-Term Nts 2018(18/30)	FR0013385473	EUR	300,00	%	91,9700	275.910,00	0,40
2,000% Emerson Electric Co. EO-Notes 2019(19/29)	XS1916073254	EUR	500,00	%	93,4000	467.000,00	0,68
2,000% Klépierre S.A. EO-Med.-Term Notes 2020(20/29)	FR0013512233	EUR	200,00	%	92,5300	185.060,00	0,27
2,000% Schlumberger Finance B.V. EO-Notes 2020(20/32)	XS2166755509	EUR	200,00	%	89,5700	179.140,00	0,26
2,000% SES S.A. EO-Med.-Term Nts 2020(20/28)	XS2196317742	EUR	300,00	%	92,4100	277.230,00	0,40
2,121% Allianz SE FLR-Sub.MTN.v.2020(2030/2050) FTF	DE000A254TM8	EUR	200,00	%	88,9400	177.880,00	0,26
2,124% Rumänien EO-Med.-Term Nts 2019(31)Reg.S	XS2027596530	EUR	300,00	%	80,2200	240.660,00	0,35
2,125% BNP Paribas S.A. EO-FLR Med.-T. Nts 2019(26/27) FTF	FR0013398070	EUR	400,00	%	97,3600	389.440,00	0,57
2,125% Royal Bank of Canada EO-Medium-Term Notes 2022(29)	XS2472603740	EUR	400,00	%	94,0000	376.000,00	0,55
2,125% Société Générale S.A. EO-Non-Preferred MTN 2018(28)	FR0013368602	EUR	500,00	%	93,0800	465.400,00	0,68
2,250% AIB Group PLC EO-FLR Med.-T.Nts 2022(26/28) FTF	XS2464405229	EUR	200,00	%	95,9400	191.880,00	0,28
2,250% Evonik Industries AG Medium Term Notes v.22(22/27)	XS2485162163	EUR	200,00	%	96,1800	192.360,00	0,28
2,375% De Volksbank N.V. EO-FLR Non-Pref.MTN 22(26/27) FTF	XS2475502832	EUR	300,00	%	97,1600	291.480,00	0,42
2,375% Thermo Fisher Scientific Inc. EO-Notes 2020(20/32)	XS2010032451	EUR	200,00	%	92,7900	185.580,00	0,27
2,500% Unibail-Rodamco-Westfield SE EO-Medium-Term Notes 2014(26)	XS1074055770	EUR	300,00	%	97,9900	293.970,00	0,43
2,500% Vodafone Group PLC EO-Medium-Term Notes 2019(39)	XS2002019060	EUR	200,00	%	84,2400	168.480,00	0,25
2,500% Wendel SE EO-Bonds 2015(15/27)	FR0012516417	EUR	300,00	%	96,9700	290.910,00	0,42
2,625% Bque Fédérative du Cr. Mutuel EO-Non-Preferred MTN 2022(29)	FR001400A3G4	EUR	300,00	%	94,0550	282.165,00	0,41
2,750% Aéroports de Paris S.A. EO-Obl. 2020(20/30)	FR0013505633	EUR	200,00	%	95,7600	191.520,00	0,28
2,800% Bundesrep.Deutschland Bundesschatzanw. v.23(25)	DE000BU22015	EUR	1.500,00	%	99,6120	1.494.180,00	2,17
2,824% Bank of America Corp. EO-FLR Med.-T. Nts 2022(22/33) FTF	XS2462323853	EUR	300,00	%	93,2710	279.813,00	0,41
3,000% ACCOR S.A. EO-Bonds 2019(19/26)	FR0013399029	EUR	300,00	%	96,9500	290.850,00	0,42
3,000% KBC Groep N.V. EO-Medium Term Notes 2022(30)	BE0002875566	EUR	400,00	%	95,9700	383.880,00	0,56
3,125% Volvo Treasury AB EO-Med.-T.Notes 2024(24/29)	XS2760217880	EUR	200,00	%	98,8620	197.724,00	0,29
3,129% Toronto-Dominion Bank, The EO-Medium-Term Notes 2022(32)	XS2511309903	EUR	600,00	%	95,3900	572.340,00	0,83
3,245% National Grid PLC EO-Medium Term Nts 2022(22/34)	XS2486461523	EUR	300,00	%	93,9000	281.700,00	0,41
3,500% Deutsche Lufthansa AG MTN v.2021(2029/2029)	XS2363235107	EUR	200,00	%	98,1200	196.240,00	0,29
3,500% Frankreich EO-OAT 2010(26)	FR0010916924	EUR	1.200,00	%	100,6100	1.207.320,00	1,76
3,519% Becton, Dickinson & Co. EO-Notes 2024(24/31)	XS2763026395	EUR	200,00	%	98,9800	197.960,00	0,29
3,733% Mitsubishi HC Capital UK PLC EO-Med.-T. Nts 2024(27/27)	XS2758931880	EUR	200,00	%	99,7800	199.560,00	0,29
3,750% Santander Consumer Finance SA EO-Preferred MTN 2024(29)	XS2747776487	EUR	200,00	%	100,3140	200.628,00	0,29
3,875% Danske Bank AS EO-FLR Non-Pref. MTN 24(31/32) FTF	XS2741808898	EUR	200,00	%	99,2700	198.540,00	0,29
3,875% Generali S.p.A. EO-Medium-Term Notes 2019(29)	XS1941841311	EUR	400,00	%	99,4800	397.920,00	0,58
3,875% Kon. KPN N.V. EO-Medium-Term Nts 2024(24/36)	XS2764455619	EUR	200,00	%	98,7400	197.480,00	0,29
3,875% Prologis Euro Finance LLC EO-Notes 2023(23/30)	XS2580271596	EUR	200,00	%	100,5100	201.020,00	0,29
3,875% Terna Rete Elettrica Nazio.SpA EO-Medium-Term Nts 2023(23/33)	XS2655852726	EUR	300,00	%	100,4100	301.230,00	0,44
3,900% General Motors Financial Co. EO-Medium-Term Nts 2024(24/28)	XS2747270630	EUR	200,00	%	100,2300	200.460,00	0,29
4,000% Intl Business Machines Corp. EO-Notes 2023(23/43)	XS2583742668	EUR	300,00	%	99,1900	297.570,00	0,43
4,125% CaixaBank S.A. EO-FLR Non-Pref. MTN 24(31/32) FTF	XS2764459363	EUR	200,00	%	100,3700	200.740,00	0,29
4,125% Vestas Wind Systems A/S EO-Medium-Term Nts 2023(23/31)	XS2725957042	EUR	300,00	%	101,4000	304.200,00	0,44
4,250% AXA S.A. EO-FLR M.-T.Nts 2022(32/43) FTF	XS2487052487	EUR	200,00	%	97,3000	194.600,00	0,28

Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

## Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund ESG

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg in 1.000	Bestand	Kurs zum 28.06.2024	Kurswert in EUR	in % des Netto- Teilfonds- vermögens	
4,250% Crédit Mutuel Arkéa EO-Non-Preferred MTN 2022(32)	FR001400E946	EUR	300,00	%	102,8600	308.580,00	0,45
4,275% National Grid PLC EO-Medium Term Nts 2023(23/35)	XS2576067081	EUR	300,00	%	101,3000	303.900,00	0,44
4,375% Thames Water Utilities Fin.PLC EO-Med.-Term Nts 2023(23/31)	XS2576550672	EUR	300,00	%	85,6600	256.980,00	0,37
4,500% ABN AMRO Bank N.V. EO-Non-Preferred MTN 2022(34)	XS2557084733	EUR	300,00	%	105,5100	316.530,00	0,46
4,500% BPCE S.A. EO-Non-Preferred MTN 2023(33)	FR001400F083	EUR	300,00	%	103,5100	310.530,00	0,45
4,500% Carrier Global Corp. EO-Notes 2024(24/32)	XS2751689048	EUR	300,00	%	104,4590	313.377,00	0,46
4,500% DNB Bank ASA EO-FLR Med.-Term Nts 23(27/28) FTF	XS2652069480	EUR	300,00	%	102,4600	307.380,00	0,45
4,500% DS Smith PLC EO-Medium-Term Nts 2023(23/30)	XS2654098222	EUR	300,00	%	103,4000	310.200,00	0,45
4,500% RCI Banque S.A. EO-Medium-Term Nts 2023(27/27)	FR001400H2O3	EUR	400,00	%	101,6370	406.548,00	0,59
4,750% Ayvens S.A. EO-Medium-Term Notes 2022(25)	FR001400D7M0	EUR	200,00	%	100,9700	201.940,00	0,29
4,750% BNP Paribas S.A. EO-FLR Non-Pref. MTN 23(31/32) FTF	FR001400LZ16	EUR	100,00	%	104,5100	104.510,00	0,15
4,750% UBS Group AG EO-FLR Med.-T. Nts 2023(31/32) FTF	CH1255915014	EUR	400,00	%	104,4490	417.796,00	0,61
4,875% RCI Banque S.A. EO-Medium-Term Nts 2023(29/29)	FR001400KY69	EUR	300,00	%	103,6400	310.920,00	0,45
5,000% Fresenius SE & Co. KGaA MTN v.2022(2022/2029)	XS2559501429	EUR	200,00	%	105,5400	211.080,00	0,31
5,000% Suez S.A. EO-Medium-Term Nts 2022(22/32)	FR001400DQ92	EUR	400,00	%	106,2500	425.000,00	0,62
5,125% Generali S.p.A. EO-Medium-Term Notes 2009(24)	XS0452314536	EUR	200,00	%	100,1600	200.320,00	0,29
5,125% Südzucker Intl Finance B.V. EO-Sustain.Lkd Nts 2022(22/27)	XS2550868801	EUR	400,00	%	103,9900	415.960,00	0,61
5,230% Raiffeisen Schweiz Genossensch EO-Anl. 2022(27)	CH1224575899	EUR	400,00	%	104,1600	416.640,00	0,61
5,250% CNP Assurances S.A. EO-FLR Med.-T.Nts 2023(33/53) FTF	FR001400F620	EUR	200,00	%	102,2900	204.580,00	0,30
5,250% ING Groep N.V. EO-FLR Med.-T. Nts 2022(32/33) FTF	XS2554745708	EUR	400,00	%	109,4700	437.880,00	0,64
5,262% Barclays PLC EO-FLR Med.-T. Nts 2022(33/34) FTF	XS2560422581	EUR	300,00	%	106,9100	320.730,00	0,47
5,375% Bouygues S.A. EO-Bonds 2022(22/42)	FR001400DNF5	EUR	300,00	%	112,9800	338.940,00	0,49
5,625% Deutsche Bank AG Sub.FLR-MTN v20(26/31) FTF	DE000DL19VB0	EUR	200,00	%	101,1200	202.240,00	0,29
1,750% Sodexo S.A. LS-Notes 2019(19/28)	XS2017471983	GBP	200,00	%	88,5600	208.904,88	0,30
2,250% Fiserv Inc. LS-Notes 2019(19/25)	XS1843433712	GBP	200,00	%	96,9100	228.601,76	0,33
6,625% Lloyds Banking Group PLC LS-FLR Med.-T. Nts 2023(28/33) FTF	XS2591847970	GBP	300,00	%	101,2300	358.188,36	0,52
2,650% Oracle Corp. DL-Notes 2016(16/26)	US68389XBM65	USD	500,00	%	94,7470	442.020,06	0,64
3,306% Banco Santander S.A. DL-Preferred Notes 2019(29)	US05971KAC36	USD	200,00	%	91,4940	170.737,58	0,25
4,500% Willis North America Inc. DL-Notes 2018(18/28)	US970648AG61	USD	200,00	%	97,2100	181.404,25	0,26

### Organisierter Markt

#### Verzinsliche Wertpapiere

0,500% PepsiCo Inc. EO-Notes 2020(20/28)	XS2168625544	EUR	200,00	%	90,4200	180.840,00	0,26
0,625% Mölnlycke Holding AB EO-Medium-Term Nts 2020(20/31)	XS2270406452	EUR	200,00	%	80,8500	161.700,00	0,24
0,697% Eaton Capital Unlimited Co. EO-Notes 2019(19/25)	XS1996269061	EUR	300,00	%	97,4000	292.200,00	0,43
0,766% Westpac Banking Corp. EO-FLR Med.-T. Nts 2021(26/31) FTF	XS2342206591	EUR	300,00	%	93,4100	280.230,00	0,41
0,797% Mizuho Financial Group Inc. EO-Medium-Term Notes 2020(30)	XS2098350965	EUR	500,00	%	85,4700	427.350,00	0,62
1,125% Australia & N. Z. Bkg Grp Ltd. EO-FLR Med.-Term Nts 19(24/29) FTF	XS2082818951	EUR	500,00	%	98,6300	493.150,00	0,72
1,250% Kellanova Co. EO-Notes 2015(15/25)	XS1199356954	EUR	300,00	%	98,2600	294.780,00	0,43
1,250% Whirlpool Fin. Luxembourg Sarl EO-Notes 2016(16/26)	XS1514149159	EUR	400,00	%	94,9900	379.960,00	0,55
2,000% Autostrade per L'Italia S.p.A. EO-Notes 2021(21/30)	XS2278566299	EUR	200,00	%	89,4700	178.940,00	0,26
2,125% Nexi S.p.A. EO-Notes 2021(21/29)	XS2332590475	EUR	200,00	%	90,2900	180.580,00	0,26
2,125% Walgreens Boots Alliance Inc. EO-Notes 2014(14/26)	XS1138360166	EUR	300,00	%	94,1800	282.540,00	0,41
2,250% IQVIA Inc. EO-Notes 2019(19/28) Reg.S	XS2036798150	EUR	200,00	%	93,0000	186.000,00	0,27
2,500% FIL Ltd. EO-Bonds 2016(26)	XS1511793124	EUR	400,00	%	95,5900	382.360,00	0,56
2,750% Helvetia Europe EO-FLR Notes 2020(31/41) FTF	XS2197076651	EUR	300,00	%	87,8400	263.520,00	0,38
3,375% Levi Strauss & Co. EO-Notes 2017(17/27) Reg.S	XS1571994554	EUR	200,00	%	97,5170	195.034,00	0,28
3,625% Chorus Ltd. EO-Med.-Term Notes 2022(22/29)	XS2521013909	EUR	200,00	%	99,2300	198.460,00	0,29
3,750% Elia Transm. Belgium N.V. EO-Medium-Term Nts 2024(24/36)	BE6349118800	EUR	200,00	%	98,5200	197.040,00	0,29
3,750% EXOR N.V. EO-Notes 2024(24/33)	XS2764405432	EUR	200,00	%	98,5000	197.000,00	0,29
4,125% McDonald's Corp. EO-Medium-Term Nts 2023(23/35)	XS2726263911	EUR	300,00	%	101,5700	304.710,00	0,44
4,250% Volvo Car AB EO-Med.-Term Nts 2022(22/28)	XS2486825669	EUR	200,00	%	99,7400	199.480,00	0,29
4,375% Rentokil Initial Finance B.V. EO-Medium-Term Nts 2022(22/30)	XS2494946820	EUR	400,00	%	103,7900	415.160,00	0,60
4,500% Dell Bank International DAC EO-Medium-Term Nts 2022(22/27)	XS2545259876	EUR	400,00	%	102,2800	409.120,00	0,60
4,500% JDE Peet's N.V. EO-Med.-Term Notes 2023(23/34)	XS2728560959	EUR	200,00	%	102,1600	204.320,00	0,30
4,750% CTP N.V. EO-Medium-Term Nts 2024(24/30)	XS2759989234	EUR	200,00	%	101,3200	202.640,00	0,29
5,250% Rexel S.A. EO-Notes 2023(23/30)	XS2655993033	EUR	200,00	%	102,2200	204.440,00	0,30
3,750% WPP Finance 2017 LS-Medium-Term Nts 2020(20/32)	XS2176605132	GBP	200,00	%	87,9900	207.560,30	0,30
2,650% HP Inc. DL-Notes 2022(22/31)	US40434LJ44	USD	200,00	%	85,2790	159.139,72	0,23

Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.



## Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund ESG

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg in 1.000	Bestand		Kurs zum 28.06.2024	Kurswert in EUR	in % des Netto- Teilfonds- vermögens
2,950% Marvell Technology Inc. DL-Notes 2021(21/31)	US573874AJ32	USD	200,00	%	86,5280	161.470,49	0,23
3,125% Ball Corp. DL-Notes 2021(31/31)	US058498AX40	USD	200,00	%	84,8806	158.396,31	0,23
3,375% Weyerhaeuser Co. DL-Notes 2022(22/33)	US962166CA07	USD	200,00	%	85,8460	160.197,81	0,23
3,500% Zurich Finance (Ireland) DAC DL-FLR Med.-T. Nts 2021(32/52) FTF	XS2416978190	USD	200,00	%	82,7200	154.364,36	0,22
3,850% Thomson Reuters Corp. DL-Notes 2014(14/24)	US884903BT19	USD	300,00	%	99,4820	278.466,06	0,41
3,900% Zoetis Inc. DL-Notes 2018(18/28)	US98978VAN38	USD	500,00	%	95,5050	445.556,33	0,65
4,000% Service Corp. International DL-Notes 2021(21/31)	US817565CG79	USD	200,00	%	89,1280	166.322,37	0,24
4,185% Micron Technology Inc. DL-Notes 2019(19/27)	US595112BP79	USD	200,00	%	97,3570	181.678,56	0,26
4,300% Kellanova Co. DL-Notes 2018(18/28)	US487836BW75	USD	400,00	%	97,4550	363.722,88	0,53
4,350% Valero Energy Corp. DL-Notes 2018(18/28)	US91913YAV20	USD	700,00	%	96,8130	632.321,90	0,92
4,375% Apache Corp. DL-Notes 2018(18/28)	US037411BE40	USD	500,00	%	94,7167	441.878,66	0,64
4,375% Marsh & McLennan Cos. Inc. DL-Notes 2019(19/29)	US571748BG65	USD	500,00	%	97,8300	456.403,08	0,66
4,625% Yum! Brands, Inc. DL-Notes 2021(21/32)	US988498AP63	USD	200,00	%	91,7700	171.252,62	0,25
6,500% Petróleos Mexicanos (PEMEX) DL-Notes 2018(18/29) Reg.S	USP78625DV20	USD	300,00	%	90,2440	252.607,42	0,37
7,125% Brasilien DL-Bonds 2006(37)	US105756BK57	USD	300,00	%	104,1900	291.644,51	0,42
9,625% Seagate HDD Cayman DL-Notes 2023(23/32)	US81180WBM29	USD	153,00	%	114,0380	162.797,42	0,24
<b>Wertpapier-Investmentanteile</b>							
Plenum CAT Bond Fund Inhaber-Anteile P EUR o.N.	LI0290349617	ANT	15.000,00	EUR	112,4800	1.687.200,00	2,46
<b>Summe Wertpapiervermögen</b>				<b>EUR</b>		<b>61.111.822,69</b>	<b>88,93</b>
<b>Derivate</b>							
<b>Rentenindex-Terminkontrakte</b>							
Bobl Future 06.09.24		STK	-110	EUR	116,4400	-77.000,00	-0,11
Euro Bund Future 06.09.24		STK	-115	EUR	131,6200	-82.800,00	-0,12
10 Year T-Note Future 19.09.24		STK	-25	USD	109,9844	-20.410,54	-0,03
5 Year T-Note Future 30.09.24		STK	-10	USD	106,5781	-6.196,06	-0,01
<b>Devisenterminkontrakte Verkauf</b>							
<b>offen (Kontrahent Verwahrstelle)</b>							
Devisenterminkontrakt Verkauf EUR / CHF 15.08.24		EUR	-50.530.000	EUR		597.695,84	0,87
Devisenterminkontrakt Verkauf GBP / EUR 22.07.24		GBP	-800.000	EUR		-10.982,72	-0,02
Devisenterminkontrakt Verkauf USD / EUR 22.07.24		USD	-6.000.000	EUR		6.759,12	0,01
<b>Summe Derivate</b>				<b>EUR</b>		<b>407.065,64</b>	<b>0,59</b>
<b>Bankguthaben</b>							
<b>Bankkonten</b>							
Bankkonto CACEIS Investor Services Bank S.A.		CHF	691.173,02	EUR		717.691,73	1,04
Bankkonto CACEIS Investor Services Bank S.A.		EUR	2.311.056,16	EUR		2.311.056,16	3,36
Bankkonto CACEIS Investor Services Bank S.A.		GBP	77.857,19	EUR		91.828,97	0,13
Bankkonto CACEIS Investor Services Bank S.A.		USD	222.067,11	EUR		207.200,48	0,30
Bankkonto UBS Ltd London		EUR	1.805.452,17	EUR		1.805.452,17	2,63
Bankkonto UBS Ltd London		USD	825.014,84	EUR		769.782,92	1,12
Forderungen aus Variation Margin		EUR	159.800,00	EUR		159.800,00	0,23
Forderungen aus Variation Margin		USD	28.515,62	EUR		26.606,59	0,04
Initial Margin UBS Ltd London		EUR	537.044,10	EUR		537.044,10	0,78
Initial Margin UBS Ltd London		USD	63.000,00	EUR		58.782,37	0,09
<b>Summe Bankguthaben</b>				<b>EUR</b>		<b>6.685.245,49</b>	<b>9,73</b>
<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>							
Wertpapierzinsen		EUR	602.647,97	EUR		602.647,97	0,88
Wertpapierzinsen		GBP	7.006,31	EUR		8.263,61	0,01
Wertpapierzinsen		USD	66.542,45	EUR		62.087,66	0,09
<b>Summe Sonstige Vermögensgegenstände</b>				<b>EUR</b>		<b>672.999,24</b>	<b>0,98</b>

Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

# Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund ESG

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg in 1.000	Bestand	Kurs zum 28.06.2024	Kurswert in EUR	in % des Netto- Teilfonds- vermögens
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>						
Sonstige Verbindlichkeiten		CHF	-115.439,34	EUR	-119.868,49	-0,17
Sonstige Verbindlichkeiten		EUR	-38.599,84	EUR	-38.599,84	-0,06
<b>Summe Sonstige Verbindlichkeiten 1)</b>				<b>EUR</b>	<b>-158.468,33</b>	<b>-0,23</b>
<b>Netto-Teilfondsvermögen</b>				<b>EUR</b>	<b>68.718.664,73</b>	<b>100,00<sup>*)</sup></b>

\*) Durch Rundungen bei der Berechnung können geringe Differenzen entstanden sein.

1) In den 'Sonstigen Verbindlichkeiten' sind Fondsmanagervergütung, Risikomanagementgebühr, Taxe d'abonnement, Verbindlichkeiten MwSt., Verwahrstellenvergütung, Verwaltungsvergütung und Zentralverwaltungsstellenvergütung enthalten.

Nettoinventarwert pro Aktie des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund ESG A	EUR	12,06
Nettoinventarwert pro Aktie des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund ESG C	CHF	9,80
Nettoinventarwert pro Aktie des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund ESG B	EUR	10,46
Nettoinventarwert pro Aktie des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund ESG D	CHF	9,72
Nettoinventarwert pro Aktie des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund ESG X	CHF	8,61
Umlaufende Aktien des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund ESG A	STK	776.982,449
Umlaufende Aktien des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund ESG C	STK	4.982.405,703
Umlaufende Aktien des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund ESG B	STK	762.328,875
Umlaufende Aktien des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund ESG D	STK	53.805,205
Umlaufende Aktien des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund ESG X	STK	15.000,000
Anteil der Wertpapiere am Netto-Teilfondsvermögen	%	88,93
Anteil der Derivate am Netto-Teilfondsvermögen	%	0,59

## Verpflichtungen aus Derivaten

Devisentermingeschäfte Verkäufe	Währung	Nominal	Währung	Nominal	offene Positionen in EUR
Devisenterminkontrakt Verkauf GBP / EUR 22.07.24	GBP	-800.000,00	EUR	931.768,89	942.751,61
Devisenterminkontrakt Verkauf EUR / CHF 15.08.24	EUR	-50.530.000,00	CHF	49.079.637,41	50.365.013,69
Devisenterminkontrakt Verkauf USD / EUR 22.07.24	USD	-6.000.000,00	EUR	5.599.593,77	5.592.834,65
<b>Summe Devisentermingeschäfte Verkäufe</b>					<b>56.900.599,95</b>

Futures Verkauf	Währung	Kontrakte	Kontraktgröße	Kurs Underlying	Dev. Kurs	Verpflichtungen aus Derivaten in EUR
10 Year T-Note Future 19.09.24	USD	-25,00	100.000,00	109,9844	0,933053	2.565.532,42
5 Year T-Note Future 30.09.24	USD	-10,00	100.000,00	106,5781	0,933053	994.430,84
Bobl Future 06.09.24	EUR	-110,00	100.000,00	116,4400	1,000000	12.808.400,00
Euro Bund Future 06.09.24	EUR	-115,00	100.000,00	131,6200	1,000000	15.136.300,00
<b>Summe Futures Verkauf</b>						<b>31.504.663,26</b>

## Devisenkurse (in Mengennotiz)

			per	28.06.2024
Britisches Pfund	GBP	0,847850	=1	EUR
Schweizer Franken	CHF	0,963050	=1	EUR
US-Dollar	USD	1,071750	=1	EUR

Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

## Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund ESG

### Ertrags- und Aufwandsrechnung des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund ESG im Zeitraum vom 1. Juli 2023 bis 30. Juni 2024

	EUR
<b>Erträge</b>	
Zinserträge aus Wertpapieren	1.583.065,97
Zinsen aus Geldanlagen	173.454,00
Sonstige Erträge	22,11
Ordentlicher Ertragsausgleich	-99.203,75
<b>Erträge insgesamt</b>	<b>1.657.338,33</b>
<b>Aufwendungen</b>	
Fondsmanagervergütung	-558.507,78
Verwaltungsvergütung	-41.558,90
Zentralverwaltungsstellenvergütung	-19.820,42
Verwahrstellenvergütung	-39.051,93
Prüfungskosten	-11.407,32
Taxe d'abonnement	-35.797,59
Veröffentlichungskosten	-8.634,87
Register- und Transferstellenvergütung	-650,00
Regulatorische Kosten	-3.874,52
Zinsaufwendungen	-24.666,54
Sonstige Aufwendungen	-58.247,19
Ordentlicher Aufwandsausgleich	49.249,58
<b>Aufwendungen insgesamt</b>	<b>-752.967,48</b>
<b>Ordentlicher Nettoertrag</b>	<b>904.370,85</b>
<b>Veräußerungsgeschäfte</b>	
Realisierte Gewinne	2.939.227,93
Ertragsausgleich auf realisierte Gewinne	-353.769,88
Realisierte Verluste	-4.037.340,74
Aufwandsausgleich auf realisierte Verluste	238.535,88
<b>Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften</b>	<b>-1.213.346,81</b>
<b>Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>	<b>-308.975,96</b>
<b>Veränderung der nicht realisierten Gewinne und Verluste</b>	
Veränderung der nicht realisierten Gewinne	3.491.848,88
Veränderung der nicht realisierten Verluste	-209.995,17
<b>Nettoveränderung des nicht realisierten Ergebnisses des Geschäftsjahres</b>	<b>3.281.853,71</b>
<b>Ergebnis des Geschäftsjahres inkl. Ertrags-/Aufwandsausgleich</b>	<b>2.972.877,75</b>

### Vermögensentwicklung des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund ESG

	EUR
<b>Netto-Teilfondsvermögen zum Beginn des Geschäftsjahres</b>	<b>73.604.574,90</b>
Mittelzuflüsse	8.597.330,47
Mittelabflüsse	-16.621.306,56
Mittelzufluss/ -abfluss netto	-8.023.976,09
Ertrags- und Aufwandsausgleich	165.188,17
Ergebnis des Geschäftsjahres inkl. Ertrags-/Aufwandsausgleich	2.972.877,75
<b>Netto-Teilfondsvermögen zum Ende des Geschäftsjahres</b>	<b>68.718.664,73</b>

Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

# Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund ESG

## Entwicklung des Teilfonds im Jahresvergleich Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund ESG A

Stichtag	Umlaufende Aktien	Währung	Netto-Teilfondsvermögen	Nettoinventarwert pro Aktie
30.06.2024	776.982,449	EUR	9.369.525,35	12,06
30.06.2023	250.722,104	EUR	2.871.649,28	11,45
30.06.2022	217.070,900	EUR	2.435.787,62	11,22

## Entwicklung des Teilfonds im Jahresvergleich Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund ESG C

Stichtag	Umlaufende Aktien	Währung	Netto-Teilfondsvermögen	Nettoinventarwert pro Aktie
30.06.2024	4.982.405,703	CHF	48.825.173,98	9,80
30.06.2023	6.410.852,547	CHF	61.059.049,34	9,52
30.06.2022	6.044.696,093	CHF	57.129.501,56	9,45

## Entwicklung des Teilfonds im Jahresvergleich Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund ESG B

Stichtag	Umlaufende Aktien	Währung	Netto-Teilfondsvermögen	Nettoinventarwert pro Aktie
30.06.2024	762.328,875	EUR	7.973.390,50	10,46
30.06.2023	761.325,382	EUR	7.530.913,06	9,89
30.06.2022	746.889,372	EUR	7.202.581,67	9,64

## Entwicklung des Teilfonds im Jahresvergleich Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund ESG D

Stichtag	Umlaufende Aktien	Währung	Netto-Teilfondsvermögen	Nettoinventarwert pro Aktie
30.06.2024	53.805,205	CHF	523.160,41	9,72
30.06.2023	53.805,205	CHF	506.026,16	9,40
30.06.2022	33.760,205	CHF	313.300,52	9,28

## Entwicklung des Teilfonds im Jahresvergleich Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund ESG X

Stichtag	Umlaufende Aktien	Währung	Netto-Teilfondsvermögen	Nettoinventarwert pro Aktie
30.06.2024	15.000,000	CHF	129.080,57	8,61
30.06.2023	15.000,000	CHF	123.248,86	8,22
30.06.2022	15.000,000	CHF	122.736,54	8,18

Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

## Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund Plus ESG

### Zusammensetzung des Netto-Fondsvermögens des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund Plus ESG per 30. Juni 2024

Position	Betrag in EUR
Wertpapiervermögen	85.852.743,86
(Wertpapiereinstandskosten EUR 88.212.568,33)	
Derivate	606.382,03
Bankguthaben	10.757.390,09
Sonstige Vermögensgegenstände	1.027.586,20
<b>Summe Aktiva</b>	<b>98.244.102,18</b>
Bankverbindlichkeiten	-222.948,42
Sonstige Verbindlichkeiten	-316.158,65
<b>Summe Passiva</b>	<b>-539.107,07</b>
<b>Netto-Teilfondsvermögen</b>	<b>97.704.995,11</b>

### Währungs-Übersicht des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund Plus ESG

Währung	Kurswert in Mio. EUR	in % des Netto- Teilfondsvermögens
EUR	77,35	79,17
USD	14,99	15,34
CHF	2,99	3,06
GBP	2,37	2,43
<b>Summe</b>	<b>97,70</b>	<b>100,00</b>

### Wertpapierkategorie-Übersicht des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund Plus ESG

Wertpapierkategorie	Kurswert in Mio. EUR	in % des Netto- Teilfondsvermögens
Verzinsliche Wertpapiere	78,85	80,70
Wertpapier-Investmentanteile	7,00	7,17
<b>Summe</b>	<b>85,85</b>	<b>87,87</b>

### Länder-Übersicht des Wertpapiervermögens des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund Plus ESG

Länder	Kurswert in Mio. EUR	in % des Netto- Teilfondsvermögens
Frankreich	16,51	16,89
USA	15,89	16,27
Niederlande	8,85	9,06
Luxemburg	7,29	7,46
Bundesrepublik Deutschland	5,83	5,97
Großbritannien	4,46	4,56
Italien	3,90	3,99
Spanien	2,74	2,81
Irland	2,55	2,61
Sonstige Länder	17,83	18,25
<b>Summe</b>	<b>85,85</b>	<b>87,87</b>

Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

# Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund Plus ESG

## Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2024 des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund Plus ESG

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg in 1.000	Bestand	Kurs zum 28.06.2024	Kurswert in EUR	in % des Netto- Teilfonds- vermögens
<b>Amtlich gehandelte Wertpapiere / Regulierter Markt</b>						
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>						
0,250% Bank of Nova Scotia, The EO-Medium-Term Notes 2021(28)	XS2381362966	EUR	200,00 %	86,7900	173.580,00	0,18
0,250% LeasePlan Corporation N.V. EO-Medium-Term Notes 2021(26)	XS2305244241	EUR	300,00 %	94,5500	283.650,00	0,29
0,250% Siemens Finan.maatschappij NV EO-Medium-Term Notes 2020(29)	XS2118276026	EUR	300,00 %	87,8400	263.520,00	0,27
0,250% SKF AB EO-Notes 2021(21/31)	XS2297204815	EUR	300,00 %	79,7800	239.340,00	0,24
0,250% V.F. Corp. EO-Notes 2020(20/28)	XS2123970167	EUR	300,00 %	84,2200	252.660,00	0,26
0,375% Münchener Hypothekenbank MTN-IHS Serie 1927 v.21(29)	DE000MHB64E1	EUR	300,00 %	84,6000	253.800,00	0,26
0,375% Woolworths Group Ltd. EO-Medium-Term Nts 2021(21/28)	XS2384274440	EUR	200,00 %	86,7200	173.440,00	0,18
0,500% Alstom S.A. EO-Notes 2021(21/30)	FR0014004R72	EUR	300,00 %	82,3700	247.110,00	0,25
0,500% Banco Bilbao Vizcaya Argent. EO-Non-Preferred MTN 2020(27)	XS2101349723	EUR	500,00 %	92,5800	462.900,00	0,47
0,500% Italgas S.P.A. EO-Medium-Term Notes 2021(33)	XS2299002423	EUR	300,00 %	74,5600	223.680,00	0,23
0,500% Nationale-Nederlanden Bank NV EO-Medium-Term Notes 2021(28)	XS2388449758	EUR	300,00 %	88,2600	264.780,00	0,27
0,500% REN Finance B.V. EO-Medium-Term Nts 2021(21/29)	XS2332186001	EUR	300,00 %	87,1000	261.300,00	0,27
0,571% Danone S.A. EO-Med.-Term Notes 2020(20/27)	FR0013495181	EUR	300,00 %	93,4600	280.380,00	0,29
0,625% Banco de Sabadell S.A. EO-FLR Preferred MTN 19(24/25) FTF	XS2076079594	EUR	500,00 %	98,8700	494.350,00	0,51
0,625% Celanese US Holdings LLC EO-Notes 2021(21/28)	XS2385114298	EUR	400,00 %	86,6500	346.600,00	0,35
0,625% Nordea Bank Abp EO-Medium-Term Nts 2021(26/31) FTF	XS2343459074	EUR	300,00 %	93,5100	280.530,00	0,29
0,750% Aareal Bank AG MTN-IHS v.22(28)	DE000AAR0322	EUR	200,00 %	87,1700	174.340,00	0,18
0,750% Kering S.A. EO-Med.-Term Notes 2020(20/28)	FR0013512407	EUR	300,00 %	90,6100	271.830,00	0,28
0,750% Sodexo S.A. EO-Notes 2016(16/27)	XS1505132602	EUR	500,00 %	93,8200	469.100,00	0,48
0,750% Tele2 AB EO-Medium-Term Nts 2021(30/31)	XS2314267449	EUR	400,00 %	85,4100	341.640,00	0,35
0,875% Cie Génle Étis Michelin ScpA EO-Obl. 2018(18/25)	FR0013357845	EUR	500,00 %	96,9400	484.700,00	0,50
0,875% Coöperatieve Rabobank U.A. EO-FLR Non-Pref.MTN 20(27/28) FTF	XS2168285000	EUR	300,00 %	92,7900	278.370,00	0,28
0,875% Kojamo Oyj EO-Medium-Term Notes 21(21/29)	XS2345877497	EUR	400,00 %	84,8900	339.560,00	0,35
0,875% Metso Oyj EO-Medium-Term Nts.2020(20/28)	XS2264692737	EUR	300,00 %	89,9100	269.730,00	0,28
0,875% Nykredit Realkredit A/S EO-FLR Med.-T. Nts 2021(26/31) FTF	DK0030487996	EUR	400,00 %	93,5800	374.320,00	0,38
0,875% PPG Industries Inc. EO-Notes 2016(16/25)	XS1405769487	EUR	500,00 %	96,3100	481.550,00	0,49
0,875% Verizon Communications Inc. EO-Notes 2016(16/25)	XS1405766897	EUR	200,00 %	98,0100	196.020,00	0,20
0,875% Vivendi SE EO-Med.-Term Notes 2017(17/24)	FR0013282571	EUR	300,00 %	99,3730	298.119,00	0,31
0,900% Standard Chartered PLC EO-FLR Med.-T. Nts 2019(26/27) FTF	XS2021467753	EUR	500,00 %	94,5300	472.650,00	0,48
0,950% Macquarie Group Ltd. EO-Medium-Term Notes 2021(31)	XS2343850033	EUR	400,00 %	83,8200	335.280,00	0,34
1,000% BMW Finance N.V. EO-Medium-Term Notes 2018(25)	XS1873143645	EUR	500,00 %	97,1600	485.800,00	0,50
1,000% BorgWarner Inc. EO-Bonds 2021(21/31)	XS2343846940	EUR	300,00 %	82,0700	246.210,00	0,25
1,000% ENI S.p.A. EO-Medium-Term Nts 2019(34)	XS2065946837	EUR	500,00 %	76,1000	380.500,00	0,39
1,000% IMERYS S.A. EO-Med.-Term Notes 2021(21/31)	FR0014003GX7	EUR	400,00 %	80,3000	321.200,00	0,33
1,000% LANXESS AG Medium-Term Nts 2016(16/26)	XS1501367921	EUR	300,00 %	93,5450	280.635,00	0,29
1,000% Sagax EURO MTN NL B.V. EO-Med.-Term Notes 2021(21/29)	XS2342227837	EUR	400,00 %	86,4700	345.880,00	0,35
1,000% Siemens Finan.maatschappij NV EO-Medium-Term Notes 2018(27)	XS1874128033	EUR	500,00 %	94,6700	473.350,00	0,48
1,000% VINCI S.A. EO-Med.-Term Notes 2018(18/25)	FR0013367620	EUR	300,00 %	96,9000	290.700,00	0,30
1,125% Amcor UK Finance PLC EO-Notes 2020(20/27)	XS2193669657	EUR	200,00 %	93,0200	186.040,00	0,19
1,125% Commerzbank AG MTN-Anl. v.19(26) S.932	DE000CZ40N46	EUR	400,00 %	95,1700	380.680,00	0,39
1,125% Hannover Rück SE FLR-Sub.Anl.v.2019(2029/2039) FTF	XS2063350925	EUR	300,00 %	85,9500	257.850,00	0,26
1,125% Kroatien, Republik EO-Notes 2019(29)	XS1843434876	EUR	400,00 %	90,3100	361.240,00	0,37
1,250% Adecco Intl Fin. Serv. B.V. EO-Medium-T.Notes 2019(19/29)	XS1995662027	EUR	400,00 %	89,6100	358.440,00	0,37
1,250% APA Infrastructure Ltd. EO-Medium-Term Nts 2021(21/33)	XS2315784806	EUR	200,00 %	79,7000	159.400,00	0,16
1,250% Bertelsmann SE & Co. KGaA MTN v.2018(25/2025)	XS1888229249	EUR	300,00 %	96,9700	290.910,00	0,30
1,250% HOCHTIEF AG MTN v.2019(2031/2031)	DE000A2YN2V0	EUR	500,00 %	82,4000	412.000,00	0,42
1,250% Slowenien, Republik EO-Bonds 2017(27)	SI0002103685	EUR	300,00 %	95,5800	286.740,00	0,29
1,250% Snam S.p.A. EO-Med.-T. Nts 2022(22/34)	XS2433226854	EUR	300,00 %	78,8800	236.640,00	0,24
1,250% Thames Water Utilities Fin.PLC EO-Med.-Term Nts 2022(22/32)	XS2438026366	EUR	300,00 %	71,5600	214.680,00	0,22
1,300% Baxter International Inc. EO-Notes 2019(19/29)	XS1998215559	EUR	500,00 %	89,8200	449.100,00	0,46
1,350% Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Non-Preferred MTN 2021(31)	XS2304664597	EUR	300,00 %	84,0800	252.240,00	0,26
1,375% Alfa Laval Treasury Intl. AB EO-Medium-Term Nts 2022(22/29)	XS2444286145	EUR	300,00 %	91,4300	274.290,00	0,28
1,375% CRH Finance DAC EO-Med.-Term Notes 2016(16/28)	XS1505896735	EUR	400,00 %	91,7100	366.840,00	0,38

Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

## Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund Plus ESG

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg in 1.000	Bestand	Kurs zum 28.06.2024	Kurswert in EUR	in % des Netto- Teilfonds- vermögens	
1,375% Morgan Stanley EO-Med.-T. Nts 2016(26) Ser.G	XS1511787589	EUR	500,00	%	95,7600	478.800,00	0,49
1,375% Raiffeisen Bank Intl AG EO-FLR Med.-T. Nts 2021(28/33) FTF	XS2353473692	EUR	400,00	%	83,5100	334.040,00	0,34
1,450% Italien, Republik EO-B.T.P. 2020(36)	IT0005402117	EUR	1.800,00	%	75,5100	1.359.180,00	1,39
1,450% Transurban Finance Co. Pty Ltd EO-Medium-Term Nts 2019(19/29)	XS1997077364	EUR	300,00	%	90,2200	270.660,00	0,28
1,500% BNP Paribas S.A. EO-Non-Preferred MTN 2017(28)	XS1722801708	EUR	400,00	%	92,0800	368.320,00	0,38
1,500% Fresenius Medical Care KGaA MTN v.2018(2025/2025)	XS1854532949	EUR	500,00	%	97,8600	489.300,00	0,50
1,500% Israel EO-Medium-Term Notes 2019(29)	XS1936100483	EUR	500,00	%	89,1380	445.690,00	0,46
1,500% ISS Global A/S EO-Medium-Term Nts 2017(17/27)	XS1673102734	EUR	300,00	%	93,4200	280.260,00	0,29
1,500% McKesson Corp. EO-Notes 2017(17/25)	XS1567174286	EUR	300,00	%	97,1500	291.450,00	0,30
1,500% Schneider Electric SE EO-Med.-Term Notes 2019(19/28)	FR0013396876	EUR	500,00	%	94,4800	472.400,00	0,48
1,500% Valéo S.E. EO-Med.-Term Nts 2018(18/25)	FR0013342334	EUR	500,00	%	97,1800	485.900,00	0,50
1,625% Abertis Infraestructuras S.A. EO-Medium-Term Nts 2019(19/29)	XS2025480596	EUR	400,00	%	90,8000	363.200,00	0,37
1,625% Givaudan Finance Europe B.V. EO-Notes 2020(20/32)	XS2126170161	EUR	200,00	%	87,6900	175.380,00	0,18
1,625% Lonza Finance International NV EO-Notes 2020(20/27)	BE6321076711	EUR	200,00	%	95,1100	190.220,00	0,19
1,715% Telefonica Emisiones S.A.U. EO-Medium-Term Nts 2017(17/28)	XS1681521081	EUR	300,00	%	94,4500	283.350,00	0,29
1,750% Aeroporti di Roma S.p.A. EO-Medium-Term Nts 2021(31/31)	XS2337326727	EUR	100,00	%	86,4000	86.400,00	0,09
1,750% Holcim Finance (Luxembg) S.A. EO-Medium-T. Notes 2017(17/29)	XS1672151492	EUR	400,00	%	91,2700	365.080,00	0,37
1,776% Bank of America Corp. EO-FLR Med.-T. Nts 2017(17/27) FTF	XS1602547264	EUR	300,00	%	96,8000	290.400,00	0,30
1,875% Compagnie de Saint-Gobain S.A. EO-Medium-Term Notes 2018(28)	XS1881593971	EUR	500,00	%	93,8700	469.350,00	0,48
1,875% Heathrow Funding Ltd. EO-FLR Med.-T. Nts 19(34.36) A FTF	XS1960589155	EUR	300,00	%	82,6600	247.980,00	0,25
1,940% Veolia Environnement S.A. EO-Med.-Term Nts 2018(18/30)	FR0013385473	EUR	300,00	%	91,9700	275.910,00	0,28
2,000% Emerson Electric Co. EO-Notes 2019(19/29)	XS1916073254	EUR	500,00	%	93,4000	467.000,00	0,48
2,000% Klépierre S.A. EO-Med.-Term Notes 2020(20/29)	FR0013512233	EUR	300,00	%	92,5300	277.590,00	0,28
2,000% SES S.A. EO-Med.-Term Nts 2020(20/28)	XS2196317742	EUR	400,00	%	92,4100	369.640,00	0,38
2,121% Allianz SE FLR-Sub.MTN.v.2020(2030/2050) FTF	DE000A254TM8	EUR	200,00	%	88,9400	177.880,00	0,18
2,124% Rumänien EO-Med.-Term Nts 2019(31)Reg.S	XS2027596530	EUR	300,00	%	80,2200	240.660,00	0,25
2,125% BNP Paribas S.A. EO-FLR Med.-T. Nts 2019(26/27) FTF	FR0013398070	EUR	400,00	%	97,3600	389.440,00	0,40
2,125% British Telecommunications PLC EO-Med.-Term Notes 2018(18/28)	XS1886403200	EUR	400,00	%	94,6600	378.640,00	0,39
2,125% Société Générale S.A. EO-Non-Preferred MTN 2018(28)	FR0013368602	EUR	500,00	%	93,0800	465.400,00	0,48
2,250% AIB Group PLC EO-FLR Med.-T.Nts 2022(26/28) FTF	XS2464405229	EUR	200,00	%	95,9400	191.880,00	0,20
2,250% Eutelsat S.A. EO-Bonds 2019(19/27)	FR0013422623	EUR	400,00	%	87,5500	350.200,00	0,36
2,250% UPM Kymmene Corp. EO-Medium-Term Nts 2022(22/29)	XS2478685931	EUR	300,00	%	94,8300	284.490,00	0,29
2,375% De Volksbank N.V. EO-FLR Non-Pref.MTN 22(26/27) FTF	XS2475502832	EUR	300,00	%	97,1600	291.480,00	0,30
2,500% Dufry One B.V. EO-Notes 2017(17/24)	XS1699848914	EUR	200,00	%	99,3100	198.620,00	0,20
2,500% Frankreich EO-OAT 2023(26)	FR001400FYQ4	EUR	4.000,00	%	98,7000	3.948.000,00	4,04
2,500% Wendel SE EO-Bonds 2015(15/27)	FR0012516417	EUR	200,00	%	96,9700	193.940,00	0,20
2,625% Carrefour S.A. EO-Medium-Term Nts 2020(20/27)	FR0013505260	EUR	200,00	%	97,1100	194.220,00	0,20
2,625% Unibail-Rodamco-Westfield SE EO-Medium-Term Nts 2020(20/30)	FR0013506821	EUR	300,00	%	96,3600	289.080,00	0,30
2,750% Aéroports de Paris S.A. EO-Obl. 2020(20/30)	FR0013505633	EUR	200,00	%	95,7600	191.520,00	0,20
2,750% Kroatien, Republik EO-Notes 2017(30)	XS1713475306	EUR	500,00	%	97,3300	486.650,00	0,50
2,800% Bundesrep.Deutschland Bundesschatzanw. v.23(25)	DE000BU22015	EUR	1.500,00	%	99,6120	1.494.180,00	1,53
2,875% Cellnex Telecom S.A. EO-Med.-Term Notes 2017(17/25)	XS1551726810	EUR	300,00	%	99,2300	297.690,00	0,30
3,000% ACCOR S.A. EO-Bonds 2019(19/26)	FR0013399029	EUR	300,00	%	96,9500	290.850,00	0,30
3,000% KBC Groep N.V. EO-Medium Term Notes 2022(30)	BE0002875566	EUR	400,00	%	95,9700	383.880,00	0,39
3,125% OI European Group B.V. EO-Notes 2016(16/24) Reg.S	XS1405765907	EUR	300,00	%	99,3800	298.140,00	0,31
3,125% Volvo Treasury AB EO-Med.-T.Notes 2024(24/29)	XS2760217880	EUR	200,00	%	98,8620	197.724,00	0,20
3,129% Toronto-Dominion Bank, The EO-Medium-Term Notes 2022(32)	XS2511309903	EUR	300,00	%	95,3900	286.170,00	0,29
3,200% Procter & Gamble Co., The EO-Bonds 2024(24/34)	XS2810309224	EUR	500,00	%	98,6500	493.250,00	0,50
3,250% Deutsche Bank AG FLR-MTN v.22(27/28) FTF	DE000DL19WU8	EUR	200,00	%	98,2400	196.480,00	0,20
3,375% Indonesien, Republik EO-Med.-T. Nts 2015(25) Reg.S	XS1268430201	EUR	400,00	%	99,1700	396.680,00	0,41
3,375% Polen, Republik EO-Medium-Term Notes 2012(24)	XS0841073793	EUR	250,00	%	99,8000	249.500,00	0,26
3,375% Schaeffler AG MTN v.2020(2020/2028)	DE000A3H2TA0	EUR	200,00	%	96,7450	193.490,00	0,20
3,500% Deutsche Lufthansa AG MTN v.2021(2029/2029)	XS2363235107	EUR	300,00	%	98,1200	294.360,00	0,30
3,500% Frankreich EO-OAT 2010(26)	FR0010916924	EUR	1.000,00	%	100,6100	1.006.100,00	1,03
3,564% Roche Finance Europe B.V. EO-Med.-Term Notes 2024(24/44)	XS2813211617	EUR	500,00	%	97,6800	488.400,00	0,50
3,625% NatWest Markets PLC EO-Med.-Term Nts 2024(29)	XS2745115837	EUR	200,00	%	99,9150	199.830,00	0,20
3,733% Mitsubishi HC Capital UK PLC EO-Med.-T. Nts 2024(27/27)	XS2758931880	EUR	200,00	%	99,7800	199.560,00	0,20
3,750% BASF SE MTN v.2022(2022/2032)	XS2491542457	EUR	300,00	%	100,9000	302.700,00	0,31
3,750% Sandvik AB EO-Med.-Term Nts 2022(22/29)	XS2538368221	EUR	400,00	%	101,2600	405.040,00	0,41

Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

# Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund Plus ESG

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg in 1.000	Bestand	Kurs zum 28.06.2024	Kurswert in EUR	in % des Netto- Teilfonds- vermögens	
3,750% Santander Consumer Finance SA EO-Preferred MTN 2024(29)	XS2747776487	EUR	200,00	%	100,3140	200.628,00	0,21
3,850% General Mills Inc. EO-Notes 2024(24/34)	XS2809271047	EUR	400,00	%	99,8900	399.560,00	0,41
3,875% Crédit Agricole S.A. EO-Pref. Med.-T.Nts 23(31)	FR001400HCR4	EUR	300,00	%	101,2400	303.720,00	0,31
3,875% Danske Bank AS EO-FLR Non-Pref. MTN 24(31/32) FTF	XS2741808898	EUR	200,00	%	99,2700	198.540,00	0,20
3,875% Generali S.p.A. EO-Medium-Term Notes 2019(29)	XS1941841311	EUR	400,00	%	99,4800	397.920,00	0,41
3,875% Kon. KPN N.V. EO-Medium-Term Nts 2024(24/36)	XS2764455619	EUR	300,00	%	98,7400	296.220,00	0,30
3,875% Lonza Finance International NV EO-Medium-Term Nts 2024(24/36)	BE6351290216	EUR	200,00	%	98,6000	197.200,00	0,20
3,875% Prologis Euro Finance LLC EO-Notes 2023(23/30)	XS2580271596	EUR	200,00	%	100,5100	201.020,00	0,21
3,875% RCI Banque S.A. EO-Medium-Term Nts 2024(28/29)	FR001400N3F1	EUR	200,00	%	99,3450	198.690,00	0,20
3,875% Terna Rete Elettrica Nazio.SpA EO-Medium-Term Nts 2023(23/33)	XS2655852726	EUR	300,00	%	100,4100	301.230,00	0,31
3,900% General Motors Financial Co. EO-Medium-Term Nts 2024(24/28)	XS2747270630	EUR	200,00	%	100,2300	200.460,00	0,21
4,000% Akzo Nobel N.V. EO-Med.-Term Notes 2023(23/33)	XS2625136531	EUR	300,00	%	101,4600	304.380,00	0,31
4,125% Booking Holdings Inc. EO-Notes 2023(23/33)	XS2621007660	EUR	300,00	%	103,1000	309.300,00	0,32
4,125% Caixabank S.A. EO-FLR Non-Pref. MTN 24(31/32) FTF	XS2764459363	EUR	300,00	%	100,3700	301.110,00	0,31
4,250% AXA S.A. EO-FLR M.-T.Nts 2022(32/43) FTF	XS2487052487	EUR	300,00	%	97,3000	291.900,00	0,30
4,250% Cadent Finance PLC EO-Med.-Term Nts 2023(23/29)	XS2641164491	EUR	200,00	%	102,1000	204.200,00	0,21
4,250% Crédit Mutuel Arkéa EO-Non-Preferred MTN 2022(32)	FR001400E946	EUR	200,00	%	102,8600	205.720,00	0,21
4,250% John.Cont.Intl/Tyco F.+Sec.F. EO-Notes 2023(23/35)	XS2626007939	EUR	400,00	%	101,9100	407.640,00	0,42
4,275% National Grid PLC EO-Medium Term Nts 2023(23/35)	XS2576067081	EUR	300,00	%	101,3000	303.900,00	0,31
4,500% ABN AMRO Bank N.V. EO-Non-Preferred MTN 2022(34)	XS2557084733	EUR	300,00	%	105,5100	316.530,00	0,32
4,500% BPCE S.A. EO-Non-Preferred MTN 2023(33)	FR001400F083	EUR	200,00	%	103,5100	207.020,00	0,21
4,500% DNB Bank ASA EO-FLR Med.-Term Nts 23(27/28) FTF	XS2652069480	EUR	300,00	%	102,4600	307.380,00	0,31
4,500% DS Smith PLC EO-Medium-Term Nts 2023(23/30)	XS2654098222	EUR	300,00	%	103,4000	310.200,00	0,32
4,500% RCI Banque S.A. EO-Medium-Term Nts 2023(27/27)	FR001400H2O3	EUR	400,00	%	101,6370	406.548,00	0,42
4,506% Barclays PLC EO-FLR-Med.-T. Nts 2024(24/33) FTF	XS2739054489	EUR	200,00	%	101,7700	203.540,00	0,21
4,750% Ayvens S.A. EO-Medium-Term Notes 2022(25)	FR001400D7M0	EUR	200,00	%	100,9700	201.940,00	0,21
4,750% Covestro AG EO-MTN v.2022(2022/2028)	XS2554997937	EUR	300,00	%	104,9800	314.940,00	0,32
4,750% Eurofins Scientific S.E. EO-Bonds 2023(23/30)	XS2676883114	EUR	300,00	%	100,1300	300.390,00	0,31
4,750% UBS Group AG EO-FLR Med.-T. Nts 2023(31/32) FTF	CH1255915014	EUR	400,00	%	104,4490	417.796,00	0,43
4,875% RCI Banque S.A. EO-Medium-Term Nts 2023(29/29)	FR001400KY69	EUR	300,00	%	103,6400	310.920,00	0,32
5,000% Fresenius SE & Co. KGaA MTN v.2022(2022/2029)	XS2559501429	EUR	300,00	%	105,5400	316.620,00	0,32
5,000% Suez S.A. EO-Medium-Term Nts 2022(22/32)	FR001400DQ92	EUR	400,00	%	106,2500	425.000,00	0,43
5,125% Generali S.p.A. EO-Medium-Term Notes 2009(24)	XS0452314536	EUR	200,00	%	100,1600	200.320,00	0,21
5,125% Südzucker Intl Finance B.V. EO-Sustain.Lkd Nts 2022(22/27)	XS2550868801	EUR	400,00	%	103,9900	415.960,00	0,43
5,200% Hera S.p.A. EO-Medium-Term Notes 2013(28)	XS0880764435	EUR	100,00	%	104,9500	104.950,00	0,11
5,230% Raiffeisen Schweiz Genossensch EO-Anl. 2022(27)	CH1224575899	EUR	400,00	%	104,1600	416.640,00	0,43
5,250% CNP Assurances S.A. EO-FLR Med.-T.Nts 2023(33/53) FTF	FR001400F620	EUR	200,00	%	102,2900	204.580,00	0,21
5,250% ING Groep N.V. EO-FLR Med.-T. Nts 2022(32/33) FTF	XS2554745708	EUR	300,00	%	109,4700	328.410,00	0,34
5,262% Barclays PLC EO-FLR Med.-T. Nts 2022(33/34) FTF	XS2560422581	EUR	300,00	%	106,9100	320.730,00	0,33
5,375% Bouygues S.A. EO-Bonds 2022(22/42)	FR001400DNF5	EUR	300,00	%	112,9800	338.940,00	0,35
5,500% Jyske Bank A/S EO-Non-Preferred. MTN 2022(26/27)	XS2555918270	EUR	300,00	%	103,6700	311.010,00	0,32
6,625% Permanent TSB Group Hldgs PLC EO-FLR Med.-Term Nts 23(28/29) FTF	XS2641927574	EUR	200,00	%	107,6900	215.380,00	0,22
1,750% Sodexo S.A. LS-Notes 2019(19/28)	XS2017471983	GBP	300,00	%	88,5600	313.357,32	0,32
2,250% Fiserv Inc. LS-Notes 2019(19/25)	XS1843433712	GBP	300,00	%	96,9100	342.902,64	0,35
3,375% GlaxoSmithKline Cap. PLC LS-Medium-Term Notes 2012(27)	XS0866588527	GBP	200,00	%	96,3900	227.375,13	0,23
3,625% Severn Trent Utilities Finance LS-Medium-Term Notes 2013(26)	XS0875301912	GBP	300,00	%	97,5300	345.096,42	0,35
6,625% Lloyds Banking Group PLC LS-FLR Med.-T. Nts 2023(28/33) FTF	XS2591847970	GBP	300,00	%	101,2300	358.188,36	0,37
2,000% Moody's Corp. DL-Notes 2021(21/31)	US615369AW51	USD	100,00	%	81,4580	76.004,67	0,08
2,650% Oracle Corp. DL-Notes 2016(16/26)	US68389XBM65	USD	500,00	%	94,7470	442.020,06	0,45
3,306% Banco Santander S.A. DL-Preferred Notes 2019(29)	US05971KAC36	USD	400,00	%	91,4940	341.475,16	0,35
4,125% Alcoa Nederland Holding B.V. DL-Notes 2021(21/29) Reg.S	USN02175AE23	USD	200,00	%	92,6420	172.879,87	0,18
4,500% Willis North America Inc. DL-Notes 2018(18/28)	US970648AG61	USD	200,00	%	97,2100	181.404,25	0,19
4,600% Intercontinental Exchange Inc. DL-Notes 2022(22/33)	US45866FAW41	USD	100,00	%	95,5510	89.154,19	0,09
4,700% Fidelity Natl Inform.Svcs Inc. DL-Notes 2022(22/27)	US31620MBW55	USD	100,00	%	98,2300	91.653,84	0,09
5,125% DCP Midstream Operating L.P. DL-Notes 2019(19/29)	US23311VAH06	USD	300,00	%	99,5220	278.578,03	0,29
<b>Organisierter Markt</b>							
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>							
0,000% BNP Paribas S.A. EO-Pref.Zero Exch.Bonds 22(25)	FR0014008OH3	EUR	300,00	%	121,3780	364.134,00	0,37

Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.



## Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund Plus ESG

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg in 1.000	Bestand	Kurs zum 28.06.2024	Kurswert in EUR	in % des Netto- Teilfonds- vermögens	
0,250% ASML Holding N.V. EO-Notes 2020(20/30)	XS2010032378	EUR	200,00	%	85,0000	170.000,00	0,17
0,500% Brenntag Finance B.V. EO-Medium-Term Nts 2021(21/29)	XS2394063437	EUR	200,00	%	85,0600	170.120,00	0,17
0,500% PepsiCo Inc. EO-Notes 2020(20/28)	XS2168625544	EUR	300,00	%	90,4200	271.260,00	0,28
0,500% Whirlpool EMEA Finance S.à r.l. EO-Notes 2020(20/28)	XS2115092954	EUR	300,00	%	89,6800	269.040,00	0,28
0,625% Mölnlycke Holding AB EO-Medium-Term Nts 2020(20/31)	XS2270406452	EUR	300,00	%	80,8500	242.550,00	0,25
0,697% Eaton Capital Unlimited Co. EO-Notes 2019(19/25)	XS1996269061	EUR	300,00	%	97,4000	292.200,00	0,30
0,750% Aedifica S.A. EO-Notes 2021(21/31)	BE6330288687	EUR	100,00	%	78,6300	78.630,00	0,08
0,766% Westpac Banking Corp. EO-FLR Med.-T. Nts 2021(26/31) FTF	XS2342206591	EUR	300,00	%	93,4100	280.230,00	0,29
0,797% Mizuho Financial Group Inc. EO-Medium-Term Notes 2020(30)	XS2098350965	EUR	500,00	%	85,4700	427.350,00	0,44
0,800% AGCO International Holdings BV EO-Notes 2021(21/28)	XS2393232071	EUR	200,00	%	87,7200	175.440,00	0,18
0,875% Nasdaq Inc. EO-Notes 2020(20/30)	XS2010032881	EUR	200,00	%	86,6800	173.360,00	0,18
0,950% Fedex Corp. EO-Notes 2021(21/33)	XS2337253319	EUR	300,00	%	79,0100	237.030,00	0,24
1,000% Equinix Inc. EO-Notes 2021(21/33)	XS2304340693	EUR	300,00	%	79,2900	237.870,00	0,24
1,125% Australia & N. Z. Bkg Grp Ltd. EO-FLR Med.-Term Nts 19(24/29) FTF	XS2082818951	EUR	500,00	%	98,6300	493.150,00	0,50
1,500% Aptiv PLC EO-Notes 2015(15/25)	XS1197775692	EUR	300,00	%	98,3200	294.960,00	0,30
1,500% CCEP Finance (Ireland) DAC EO-Notes 2021(21/41)	XS2337061837	EUR	300,00	%	71,6680	215.004,00	0,22
2,000% Autostrade per L'Italia S.p.A. EO-Notes 2021(21/30)	XS2278566299	EUR	300,00	%	89,4700	268.410,00	0,27
2,000% Volvo Car AB EO-Med.-Term Nts 2017(17/25) 1	XS1724626699	EUR	300,00	%	98,4800	295.440,00	0,30
2,125% Informa PLC EO-Medium-Term Nts 2020(20/25)	XS2240507801	EUR	400,00	%	97,9300	391.720,00	0,40
2,125% Nexi S.p.A. EO-Notes 2021(21/29)	XS2332590475	EUR	100,00	%	90,2900	90.290,00	0,09
2,250% IQVIA Inc. EO-Notes 2019(19/28) Reg.S	XS2036798150	EUR	300,00	%	93,0000	279.000,00	0,29
2,250% WMG Acquisition Corp. EO-Notes 2021(21/31) Reg.S	XS2367081523	EUR	200,00	%	86,9000	173.800,00	0,18
2,500% FIL Ltd. EO-Bonds 2016(26)	XS1511793124	EUR	400,00	%	95,5900	382.360,00	0,39
2,534% Swiss Re Finance (Lux) S.A. EO-FLR Notes 2019(30/50) FTF	XS1963116964	EUR	300,00	%	92,1800	276.540,00	0,28
2,625% Wendel SE EO-Exchangeable Bonds 2023(26)	FR001400GVB0	EUR	200,00	%	98,9090	197.818,00	0,20
2,750% Helvetia Europe EO-FLR Notes 2020(31/41) FTF	XS2197076651	EUR	400,00	%	87,8400	351.360,00	0,36
2,750% Smurfit Kappa Acquis. Unl. Co. EO-Notes 2015(15/25) Reg.S	XS1117298759	EUR	300,00	%	99,2400	297.720,00	0,30
3,125% Cemex S.A.B. de C.V. EO-Notes 2019(19/26) Reg.S	XS1964617879	EUR	200,00	%	98,2200	196.440,00	0,20
3,250% Svenska Handelsbanken AB EO-FLR Med.-Term Nts 22(28/33) FTF	XS2486857431	EUR	300,00	%	96,2800	288.840,00	0,30
3,375% Levi Strauss & Co. EO-Notes 2017(17/27) Reg.S	XS1571994554	EUR	400,00	%	97,5170	390.068,00	0,40
3,375% Ziggo Bond Co. B.V. EO-Notes 2020(20/30) Reg.S	XS2116386132	EUR	200,00	%	83,9900	167.980,00	0,17
3,553% Becton Dickinson Euro Fin.Sarl EO-Notes 2023(23/29)	XS2585932275	EUR	200,00	%	99,8900	199.780,00	0,20
3,556% Mitsubishi UFJ Finl Grp Inc. EO-Medium-Term Nts 2022(32)	XS2489982293	EUR	300,00	%	100,7700	302.310,00	0,31
3,625% ASR Nederland N.V. EO-Bonds 2023(23/28)	XS2694995163	EUR	200,00	%	99,9500	199.900,00	0,20
3,625% Chorus Ltd. EO-Med.-Term Notes 2022(22/29)	XS2521013909	EUR	200,00	%	99,2300	198.460,00	0,20
3,750% Elia Transm. Belgium N.V. EO-Medium-Term Nts 2024(24/36)	BE6349118800	EUR	200,00	%	98,5200	197.040,00	0,20
3,750% EXOR N.V. EO-Notes 2024(24/33)	XS2764405432	EUR	300,00	%	98,5000	295.500,00	0,30
3,875% Daimler Truck Intl Finance EO-Med.-Term Notes 2023(23/29)	XS2623221228	EUR	400,00	%	101,7200	406.880,00	0,42
4,250% Solvay S.A. EO-Notes 2024(24/31)	BE6350792089	EUR	400,00	%	100,0600	400.240,00	0,41
4,375% Rentokil Initial Finance B.V. EO-Medium-Term Nts 2022(22/30)	XS2494946820	EUR	400,00	%	103,7900	415.160,00	0,42
4,500% Dell Bank International DAC EO-Medium-Term Nts 2022(22/27)	XS2545259876	EUR	400,00	%	102,2800	409.120,00	0,42
4,750% CTP N.V. EO-Medium-Term Nts 2024(24/30)	XS2759989234	EUR	200,00	%	101,3200	202.640,00	0,21
5,250% Rexel S.A. EO-Notes 2023(23/30)	XS2655993033	EUR	200,00	%	102,2200	204.440,00	0,21
7,250% Stena International S.A. EO-Notes 2023(23/28) Reg.S	XS2010025836	EUR	200,00	%	104,8400	209.680,00	0,21
1,875% Wales & West Utilities Fin.PLC LS-Med.-Term Notes 2020(20/41)	XS2124190369	GBP	200,00	%	59,1300	139.482,22	0,14
1,750% Rockwell Automation Inc. DL-Notes 2021(21/31)	US773903AL39	USD	100,00	%	80,5100	75.120,13	0,08
2,400% Autodesk Inc. DL-Notes 2021(21/31)	US052769AH94	USD	100,00	%	82,9910	77.435,04	0,08
2,500% Tyco Electronics Group S.A. DL-Notes 2022(22/32)	US902133AY31	USD	100,00	%	84,8100	79.132,26	0,08
2,600% eBay Inc. DL-Notes 2021(21/31)	US278642AY97	USD	400,00	%	84,9660	317.111,27	0,32
2,600% Williams Companies Inc., The DL-Notes 2021(21/31)	US969457BY52	USD	200,00	%	85,0360	158.686,26	0,16
2,650% HP Inc. DL-Notes 2022(22/31)	US40434LAJ44	USD	400,00	%	85,2790	318.279,45	0,33
2,950% Marvell Technology Inc. DL-Notes 2021(21/31)	US573874AJ32	USD	100,00	%	86,5280	80.735,25	0,08
3,125% Ball Corp. DL-Notes 2021(31/31)	US058498AX40	USD	400,00	%	84,8806	316.792,61	0,32
3,250% Hologic Inc. DL-Notes 2020(20/29) Reg.S	USU38284AF94	USD	100,00	%	89,8000	83.788,20	0,09
3,375% Centene Corp. DL-Notes 2020(20/30)	US15135BAV36	USD	200,00	%	88,7360	165.590,86	0,17
3,375% Weyerhaeuser Co. DL-Notes 2022(22/33)	US962166CA07	USD	200,00	%	85,8460	160.197,81	0,16
3,500% Alb.Cos LLC/Safe.Inc/N.A.I./A. DL-Notes 2020(20/29) REGS	USU0125LAH34	USD	400,00	%	89,1250	332.633,54	0,34
3,500% Zurich Finance (Ireland) DAC DL-FLR Med.-T. Nts 2021(32/52) FTF	XS2416978190	USD	200,00	%	82,7200	154.364,36	0,16
3,625% Gartner Inc. DL-Notes 2021(21/29) Reg.S	USU33791AD36	USD	100,00	%	91,5590	85.429,44	0,09

Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

## Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund Plus ESG

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg in 1.000	Bestand		Kurs zum 28.06.2024	Kurswert in EUR	in % des Netto- Teilfonds- vermögens
3,800% American Tower Corp. DL-Notes 2019(19/29)	US03027XAW02	USD	500,00	%	93,0880	434.280,38	0,44
3,850% Thomson Reuters Corp. DL-Notes 2014(14/24)	US884903BT19	USD	300,00	%	99,4820	278.466,06	0,29
3,900% Zoetis Inc. DL-Notes 2018(18/28)	US98978VAN38	USD	500,00	%	95,5050	445.556,33	0,46
4,000% Sensata Technologies B.V. DL-Notes 2021(21/29) Reg.S	USN78840AM28	USD	200,00	%	91,8690	171.437,37	0,18
4,000% Service Corp. International DL-Notes 2021(21/31)	US817565CG79	USD	100,00	%	89,1280	83.161,18	0,09
4,125% HCA Inc. DL-Notes 2019(19/29)	US404119BX69	USD	300,00	%	95,0490	266.057,38	0,27
4,185% Micron Technology Inc. DL-Notes 2019(19/27)	US595112BP79	USD	200,00	%	97,3570	181.678,56	0,19
4,250% AbbVie Inc. DL-Notes 2018(18/28)	US00287YBF51	USD	500,00	%	97,7190	455.885,23	0,47
4,300% Kellanova Co. DL-Notes 2018(18/28)	US487836BW75	USD	400,00	%	97,4550	363.722,88	0,37
4,300% Western Midstream Operating LP DL-Notes 2020(20/30)	US958667AC17	USD	300,00	%	93,0995	260.600,36	0,27
4,350% Valero Energy Corp. DL-Notes 2018(18/28)	US91913YAV20	USD	700,00	%	96,8130	632.321,90	0,65
4,375% Apache Corp. DL-Notes 2018(18/28)	US037411BE40	USD	500,00	%	94,7167	441.878,66	0,45
4,375% Marsh & McLennan Cos. Inc. DL-Notes 2019(19/29)	US571748BG65	USD	500,00	%	97,8300	456.403,08	0,47
4,500% Brasilien DL-Bonds 2019(19/29)	US105756CA66	USD	300,00	%	94,0100	263.149,06	0,27
4,500% Kaiser Aluminum Corp. DL-Notes 2021(21/31) Reg.S	USU24442AE29	USD	100,00	%	88,5980	82.666,67	0,08
4,625% Yum! Brands, Inc. DL-Notes 2021(21/32)	US988498AP63	USD	400,00	%	91,7700	342.505,25	0,35
5,250% United Rentals N. America Inc. DL-Notes 2019(19/30)	US911365BL76	USD	300,00	%	96,4430	269.959,41	0,28
5,750% Hilton Domestic Operating Co. DL-Notes 2020(20/28) Reg.S	USU4328RAE46	USD	200,00	%	98,5000	183.811,52	0,19
6,125% Macy's Retail Holdings LLC DL-Notes 2022(22/32) Reg.S	USU5562LAJ80	USD	100,00	%	95,1250	88.756,71	0,09
6,250% Icahn Enterpr.L.P./Fin. Corp. DL-Notes 2019(19/26) Reg.S	USU44927AS74	USD	300,00	%	99,1650	277.578,73	0,28
6,500% Petróleos Mexicanos (PEMEX) DL-Notes 2018(18/29) Reg.S	USP78625DV20	USD	300,00	%	90,2440	252.607,42	0,26
9,625% Seagate HDD Cayman DL-Notes 2023(23/32)	US81180WBM29	USD	306,00	%	114,0380	325.594,85	0,33
<b>Neuemission Handel</b>							
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>							
4,000% VEON Holdings B.V. DL-Bonds 2024(24/25) Reg.S	XS2824765098	USD	200,00	%	94,3550	176.076,51	0,18
<b>Sonstige Märkte</b>							
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>							
3,750% Mattel Inc. DL-Notes 2021(21/29) Reg.S	USU57619AG08	USD	100,00	%	92,2010	86.028,46	0,09
<b>Wertpapier-Investmentanteile</b>							
Swisscanto(LU)Bd-Res.COCO Namens-Ant. DTH CHF o.N.	LU0599119616	ANT	18.000,00	CHF	185,4300	3.465.801,36	3,55
FISCH Convert.Gbl Sustainable Namens-Anteile BE o.N.	LU1130246231	ANT	10.000,00	EUR	106,0600	1.060.600,00	1,09
Plenum CAT Bond Fund Inhaber-Anteile P EUR o.N.	LI0290349617	ANT	22.000,00	EUR	112,4800	2.474.560,00	2,53
<b>Sonstige Wertpapiere</b>							
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>							
4,750% OHL Operaciones S.A Techn.Codes EO-Nts 2014(18/22)	XS2339732385	EUR	100,00	%	0,0000	0,00	0,00
5,150% Gaz Capital S.A. DL-M.T.LPN 19(26)GAZPROM Reg.S	XS1951084471	USD	500,00	%	73,4290	342.565,90	0,35
<b>Summe Wertpapiervermögen</b>					<b>EUR</b>	<b>85.852.743,86</b>	<b>87,87</b>
<b>Derivate</b>							
<b>Rentenindex-Terminkontrakte</b>							
Bobl Future 06.09.24		STK	-95	EUR	116,4400	-66.500,00	-0,07
Euro Bund Future 06.09.24		STK	-147	EUR	131,6200	-105.840,00	-0,11
10 Year T-Note Future 19.09.24		STK	-90	USD	109,9844	-73.477,95	-0,08
5 Year T-Note Future 30.09.24		STK	-25	USD	106,5781	-15.490,14	-0,02
<b>Devisenterminkontrakte Verkauf</b>							
<b>offen (Kontrahent Verwahrstelle)</b>							
Devisenterminkontrakt Verkauf EUR / CHF 15.08.24		EUR	-74.000.000	EUR		875.311,54	0,90
Devisenterminkontrakt Verkauf EUR / USD 15.08.24		EUR	-680.000	EUR		5.190,61	0,01
Devisenterminkontrakt Verkauf GBP / EUR 22.07.24		GBP	-2.000.000	EUR		-27.456,79	-0,03
Devisenterminkontrakt Verkauf USD / EUR 22.07.24		USD	-13.000.000	EUR		14.644,76	0,01
<b>Summe Derivate</b>					<b>EUR</b>	<b>606.382,03</b>	<b>0,62</b>

Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

# Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund Plus ESG

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg in 1.000	Bestand	Kurs zum 28.06.2024	Kurswert in EUR	in % des Netto- Teilfonds- vermögens
<b>Bankguthaben</b>						
<b>Bankkonten</b>						
Bankkonto CACEIS Investor Services Bank S.A.		EUR	3.606.250,25	EUR	3.606.250,25	3,69
Bankkonto CACEIS Investor Services Bank S.A.		GBP	544.432,45	EUR	642.132,98	0,66
Bankkonto CACEIS Investor Services Bank S.A.		USD	2.075.613,66	EUR	1.936.658,42	1,98
Bankkonto UBS Ltd London		EUR	2.022.723,44	EUR	2.022.723,44	2,07
Bankkonto UBS Ltd London		GBP	8.714,79	EUR	10.278,69	0,01
Bankkonto UBS Ltd London		USD	1.591.569,50	EUR	1.485.019,36	1,52
Forderungen aus Variation Margin		EUR	172.340,00	EUR	172.340,00	0,18
Forderungen aus Variation Margin		USD	95.351,56	EUR	88.968,10	0,09
Initial Margin UBS Ltd London		EUR	594.745,00	EUR	594.745,00	0,61
Initial Margin UBS Ltd London		USD	212.500,00	EUR	198.273,85	0,20
<b>Summe Bankguthaben</b>				<b>EUR</b>	<b>10.757.390,09</b>	<b>11,01</b>
<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>						
Forderungen Verwahrstelle <sup>1)</sup>		EUR	73.714,15	EUR	73.714,15	0,08
Wertpapierzinsen		EUR	814.146,01	EUR	814.146,01	0,83
Wertpapierzinsen		GBP	17.286,00	EUR	20.388,04	0,02
Wertpapierzinsen		USD	127.900,51	EUR	119.338,00	0,12
<b>Summe Sonstige Vermögensgegenstände</b>				<b>EUR</b>	<b>1.027.586,20</b>	<b>1,05</b>
<b>Bankverbindlichkeiten</b>						
Bankverbindlichkeiten CACEIS Investor Services Bank S.A.		CHF	-214.710,48	EUR	-222.948,42	-0,23
<b>Summe Bankverbindlichkeiten</b>				<b>EUR</b>	<b>-222.948,42</b>	<b>-0,23</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>						
Sonstige Verbindlichkeiten		CHF	-239.248,14	EUR	-248.427,54	-0,25
Sonstige Verbindlichkeiten		EUR	-65.172,17	EUR	-65.172,17	-0,07
Sonstige Verbindlichkeiten		USD	-2.742,55	EUR	-2.558,94	0,00
<b>Summe Sonstige Verbindlichkeiten <sup>2)</sup></b>				<b>EUR</b>	<b>-316.158,65</b>	<b>-0,32</b>
<b>Netto-Teilfondsvermögen</b>				<b>EUR</b>	<b>97.704.995,11</b>	<b>100,00<sup>*)</sup></b>

\*) Durch Rundungen bei der Berechnung können geringe Differenzen entstanden sein.

1) Für weitere Angaben verweisen wir auf das Kapitel "Wertpapiere mit Bewertungsbesonderheiten" im Anhang dieses Berichts.

2) In den 'Sonstigen Verbindlichkeiten' sind Fondsmanagervergütung, performanceabhängige Fondsmanagervergütung, Risikomanagementgebühr, Transaktionskosten, Taxe d'abonnement, Verbindlichkeiten MwSt., Verwahrstellenvergütung, Verwaltungsvergütung und Zentralverwaltungsstellenvergütung enthalten.

Nettoinventarwert pro Aktie des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund Plus ESG A	EUR	11,21
Nettoinventarwert pro Aktie des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund Plus ESG C	CHF	10,20
Nettoinventarwert pro Aktie des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund Plus ESG B	EUR	11,46
Nettoinventarwert pro Aktie des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund Plus ESG D	CHF	10,59
Nettoinventarwert pro Aktie des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund Plus ESG X	CHF	9,01
Nettoinventarwert pro Aktie des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund Plus ESG E	USD	12,05
Umlaufende Aktien des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund Plus ESG A	STK	1.115.423,866
Umlaufende Aktien des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund Plus ESG C	STK	5.214.429,699
Umlaufende Aktien des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund Plus ESG B	STK	835.615,173
Umlaufende Aktien des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund Plus ESG D	STK	1.770.791,437
Umlaufende Aktien des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund Plus ESG X	STK	14.977,530
Umlaufende Aktien des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund Plus ESG E	STK	67.593,000
Anteil der Wertpapiere am Netto-Teilfondsvermögen	%	87,87
Anteil der Derivate am Netto-Teilfondsvermögen	%	0,62

Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

# Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund Plus ESG

## Verpflichtungen aus Derivaten

Devisentermingeschäfte Verkäufe	Währung	Nominal	Währung	Nominal	offene Positionen in EUR
Devisenterminkontrakt Verkauf GBP / EUR 22.07.24	GBP	-2.000.000,00	EUR	2.329.422,23	2.356.879,02
Devisenterminkontrakt Verkauf EUR / CHF 15.08.24	EUR	-74.000.000,00	CHF	71.875.978,00	73.758.381,42
Devisenterminkontrakt Verkauf EUR / USD 15.08.24	EUR	-680.000,00	USD	735.902,12	681.445,38
Devisenterminkontrakt Verkauf USD / EUR 22.07.24	USD	-13.000.000,00	EUR	12.132.453,16	12.117.808,40
<b>Summe Devisentermingeschäfte Verkäufe</b>					<b>88.914.514,22</b>

Futures Verkauf	Währung	Kontrakte	Kontraktgröße	Kurs Underlying	Dev. Kurs	Verpflichtungen aus Derivaten in EUR
10 Year T-Note Future 19.09.24	USD	-90,00	100.000,00	109,9844	0,933053	9.235.916,72
5 Year T-Note Future 30.09.24	USD	-25,00	100.000,00	106,5781	0,933053	2.486.077,09
Bobl Future 06.09.24	EUR	-95,00	100.000,00	116,4400	1,000000	11.061.800,00
Euro Bund Future 06.09.24	EUR	-147,00	100.000,00	131,6200	1,000000	19.348.140,00
<b>Summe Futures Verkauf</b>						<b>42.131.933,81</b>

## Devisenkurse (in Mengennotiz)

			per	28.06.2024
Britisches Pfund	GBP	0,847850	=1	EUR
Schweizer Franken	CHF	0,963050	=1	EUR
US-Dollar	USD	1,071750	=1	EUR

Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

## Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund Plus ESG

### Ertrags- und Aufwandsrechnung des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund Plus ESG im Zeitraum vom 1. Juli 2023 bis 30. Juni 2024

	EUR
<b>Erträge</b>	
Zinserträge aus Wertpapieren	2.198.982,21
Zinsen aus Geldanlagen	331.817,32
Ordentlicher Ertragsausgleich	-2.702,33
<b>Erträge insgesamt</b>	<b>2.528.097,20</b>
<b>Aufwendungen</b>	
Fondsmanagervergütung	-748.243,29
Performanceabhängige Fondsmanagervergütung	-96.162,39
Verwaltungsvergütung	-52.028,35
Zentralverwaltungsstellenvergütung	-26.549,46
Verwahrstellenvergütung	-50.522,61
Prüfungskosten	-11.407,32
Taxe d'abonnement	-46.121,68
Veröffentlichungskosten	-8.634,87
Register- und Transferstellenvergütung	-650,02
Regulatorische Kosten	-3.922,56
Zinsaufwendungen	-23.222,04
Sonstige Aufwendungen	-69.709,47
Ordentlicher Aufwandsausgleich	-2.458,29
<b>Aufwendungen insgesamt</b>	<b>-1.139.632,35</b>
<b>Ordentlicher Nettoertrag</b>	<b>1.388.464,85</b>
<b>Veräußerungsgeschäfte</b>	
Realisierte Gewinne	4.415.803,04
Ertragsausgleich auf realisierte Gewinne	-289.575,32
Realisierte Verluste	-6.347.872,52
Aufwandsausgleich auf realisierte Verluste	184.578,47
<b>Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften</b>	<b>-2.037.066,33</b>
<b>Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>	<b>-648.601,48</b>
<b>Veränderung der nicht realisierten Gewinne und Verluste</b>	
Veränderung der nicht realisierten Gewinne	5.495.602,70
Veränderung der nicht realisierten Verluste	-282.512,83
<b>Nettoveränderung des nicht realisierten Ergebnisses des Geschäftsjahres</b>	<b>5.213.089,87</b>
<b>Ergebnis des Geschäftsjahres inkl. Ertrags-/Aufwandsausgleich</b>	<b>4.564.488,39</b>

### Vermögensentwicklung des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund Plus ESG

	EUR
<b>Netto-Teilfondsvermögen zum Beginn des Geschäftsjahres</b>	<b>95.050.557,82</b>
Mittelzuflüsse	13.464.439,07
Mittelabflüsse	-15.484.647,64
Mittelzufluss/ -abfluss netto	-2.020.208,57
Ertrags- und Aufwandsausgleich	110.157,47
Ergebnis des Geschäftsjahres inkl. Ertrags-/Aufwandsausgleich	4.564.488,39
<b>Netto-Teilfondsvermögen zum Ende des Geschäftsjahres</b>	<b>97.704.995,11</b>

Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

## Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund Plus ESG

### Entwicklung des Teilfonds im Jahresvergleich

#### Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund Plus ESG A

Stichtag	Umlaufende Aktien	Währung	Netto-Teilfondsvermögen	Nettoinventarwert pro Aktie
30.06.2024	1.115.423,866	EUR	12.499.733,66	11,21
30.06.2023	144.634,258	EUR	1.534.561,90	10,61
30.06.2022	124.276,218	EUR	1.275.768,70	10,27

### Entwicklung des Teilfonds im Jahresvergleich

#### Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund Plus ESG C

Stichtag	Umlaufende Aktien	Währung	Netto-Teilfondsvermögen	Nettoinventarwert pro Aktie
30.06.2024	5.214.429,699	CHF	53.207.273,90	10,20
30.06.2023	6.426.071,162	CHF	63.454.745,10	9,87
30.06.2022	6.840.540,225	CHF	66.194.386,83	9,68

### Entwicklung des Teilfonds im Jahresvergleich

#### Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund Plus ESG B

Stichtag	Umlaufende Aktien	Währung	Netto-Teilfondsvermögen	Nettoinventarwert pro Aktie
30.06.2024	835.615,173	EUR	9.577.764,05	11,46
30.06.2023	852.449,021	EUR	9.189.825,70	10,78
30.06.2022	906.299,483	EUR	9.404.823,34	10,38

### Entwicklung des Teilfonds im Jahresvergleich

#### Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund Plus ESG D

Stichtag	Umlaufende Aktien	Währung	Netto-Teilfondsvermögen	Nettoinventarwert pro Aktie
30.06.2024	1.770.791,437	CHF	18.758.978,80	10,59
30.06.2023	1.770.791,439	CHF	18.064.283,33	10,20
30.06.2022	1.875.048,439	CHF	18.640.991,84	9,94

### Entwicklung des Teilfonds im Jahresvergleich

#### Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund Plus ESG X

Stichtag	Umlaufende Aktien	Währung	Netto-Teilfondsvermögen	Nettoinventarwert pro Aktie
30.06.2024	14.977,530	CHF	134.906,39	9,01
30.06.2023	14.977,530	CHF	127.997,53	8,55
30.06.2022	14.977,530	CHF	125.753,84	8,40

### Entwicklung des Teilfonds im Jahresvergleich

#### Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund Plus ESG E

Stichtag	Umlaufende Aktien	Währung	Netto-Teilfondsvermögen	Nettoinventarwert pro Aktie
30.06.2024	67.593,000	USD	814.512,51	12,05
30.06.2023	65.653,000	USD	737.206,02	11,23
30.06.2022	67.110,000	USD	712.246,48	10,61

Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

# Zusammenfassung des Swiss Rock (Lux) Sicav

## Zusammensetzung des Netto-Fondsvermögens

	EUR
Wertpapiervermögen	415.313.673,99
Derivate	873.994,05
Bankguthaben	22.869.620,46
Sonstige Vermögensgegenstände	2.258.549,09
Bankverbindlichkeiten	-668.677,97
Sonstige Verbindlichkeiten	-2.080.746,77
<b>Netto-Fondsvermögen</b>	<b>438.566.412,85</b>

## Vermögensentwicklung des Fonds

		EUR
<b>Netto-Fondsvermögen zum Beginn des Geschäftsjahres</b>		<b>408.039.976,74</b>
Mittelzuflüsse	43.516.558,25	
Mittelabflüsse	-62.423.253,16	
Mittelzufluss/ -abfluss netto		-18.906.694,91
Ertrags- und Aufwandsausgleich		127.024,90
Ergebnis des Geschäftsjahres inkl. Ertrags-/Aufwandsausgleich		49.306.106,12
<b>Netto-Fondsvermögen zum Ende des Geschäftsjahres</b>		<b>438.566.412,85</b>

## Ertrags- und Aufwandsrechnung des Fonds

	EUR
<b>Erträge</b>	
Zinserträge aus Wertpapieren	3.782.048,18
Zinsen aus Geldanlagen	659.774,55
Dividendenerträge	6.135.314,09
Erträge aus Bestandsprovisionen	15.172,40
Erträge aus REITs	27.655,56
Sonstige Erträge	1.511,49
Ordentlicher Ertragsausgleich	-200.922,71
<b>Erträge insgesamt</b>	<b>10.420.553,56</b>
<b>Aufwendungen</b>	
Fondsmanagervergütung	-3.327.068,07
Performanceabhängige Fondsmanagervergütung	-1.026.179,96
Verwaltungsvergütung	-226.353,62
Zentralverwaltungsstellenvergütung	-114.780,58
Verwahrstellenvergütung	-376.678,14
Prüfungskosten	-57.036,58
Taxe d'abonnement	-206.639,47
Veröffentlichungskosten	-43.174,37
Register- und Transferstellenvergütung	-3.250,01
Regulatorische Kosten	-19.502,53
Zinsaufwendungen	-70.487,23
Sonstige Aufwendungen	-275.925,67
Ordentlicher Aufwandsausgleich	180.858,97
<b>Aufwendungen insgesamt</b>	<b>-5.566.217,26</b>
<b>Ordentlicher Nettoertrag</b>	<b>4.854.336,30</b>
<b>Veräußerungsgeschäfte</b>	
Realisierte Gewinne	39.866.227,18
Ertragsausgleich auf realisierte Gewinne	-925.125,04
Realisierte Verluste	-40.248.738,47
Aufwandsausgleich auf realisierte Verluste	818.163,88
<b>Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften</b>	<b>-489.472,45</b>
<b>Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>	<b>4.364.863,85</b>
<b>Veränderung der nicht realisierten Gewinne und Verluste</b>	
Veränderung der nicht realisierten Gewinne	47.021.518,36
Veränderung der nicht realisierten Verluste	-2.080.276,09
<b>Nettoveränderung des nicht realisierten Ergebnisses des Geschäftsjahres</b>	<b>44.941.242,27</b>
<b>Ergebnis des Geschäftsjahres inkl. Ertrags-/Aufwandsausgleich</b>	<b>49.306.106,12</b>

Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

## Anhang zum Jahresabschluss

### Allgemein

Der Fonds Swiss Rock (Lux) Sicav (die „Gesellschaft“) ist eine nach Luxemburger Recht errichtete Investmentgesellschaft mit variablem Kapital (Société d'investissement à capital variable), welche am 16. Januar 2008 auf unbestimmte Dauer errichtet wurde. Die Gesellschaft ist im Handels- und Gesellschaftsregister in Luxemburg unter der Nummer B 135.671 eingetragen.

Die Gesellschaft unterliegt den Bedingungen gemäß Teil I des Luxemburger Gesetzes vom 17. Dezember 2010 über Organismen für gemeinsame Anlagen.

Der vorliegende Bericht wurde gemäß den in Luxemburg geltenden Vorschriften unter der Annahme des Prinzips der Unternehmensfortführung erstellt.

### Bewertungs- und Bilanzierungsgrundsätze

1. Der Nettoinventarwert der Aktien sämtlicher Teilfonds wird in der Währung des jeweiligen Teilfonds bestimmt. Die Berechnung erfolgt durch Teilung des Wertes des jeweiligen Teilfondsvermögens abzüglich Verbindlichkeiten dieses Teilfonds („Netto-Teilfondsvermögen“) durch die Zahl der am Bewertungstag im Umlauf befindlichen Aktien an diesem Teilfonds. Der Nettoinventarwert pro Aktie eines jeden Teilfonds kann auf eine nächst höhere oder niedrigere Währungseinheit auf- oder abgerundet werden entsprechend dem Beschluss des Verwaltungsrates. Der Nettoinventarwert pro Aktie sämtlicher Teilfonds wird an jedem Tag, der in Luxemburg Bankarbeitstag - mit Ausnahme des 24. Dezembers - ist, („Bewertungstag“) bestimmt, sofern in Kapitel VI des Verkaufsprospektes bei den jeweiligen Teilfonds nichts anderes bestimmt ist, und basiert auf dem Wert der zugrunde liegenden Investitionen gemäß Kapitel V des Verkaufsprospektes.
2. Die in jedem Teilfondsvermögen befindlichen Vermögenswerte werden nach folgenden Grundsätzen bewertet:
  - a) Die im jeweiligen Teilfonds enthaltenen offenen Zielfondsanteile werden zum letzten festgestellten und erhältlichen Rücknahmepreis bewertet.
  - b) Der Wert von Kassenbeständen oder Bankguthaben, sonstigen ausstehenden Forderungen, vorausbezahlten Auslagen, Bardividenden und erklärten oder aufgelaufenen und noch nicht erhaltenen Zinsen entspricht dem jeweiligen Nennbetrag, es sei denn, dass dieser wahrscheinlich nicht voll bezahlt oder erhalten werden kann, in welchem Falle der Wert unter Einschluss eines angemessenen Abschlages ermittelt wird, um den tatsächlichen Wert zu erhalten. Verbindlichkeiten werden zum Rückzahlungsbetrag bewertet.
  - c) Der Wert von Vermögenswerten, welche an einer Börse notiert oder gehandelt werden, wird auf der Grundlage des letzten verfügbaren Kurses an der Börse, welche normalerweise der Hauptmarkt dieses Wertpapiers ist, ermittelt. Wenn ein Wertpapier oder sonstiger Vermögenswert an mehreren Börsen notiert ist, ist der letzte Verkaufskurs an jener Börse bzw. an jenem geregelten Markt maßgebend, welcher der Hauptmarkt für diesen Vermögenswert ist.
  - d) Der Wert von Vermögenswerten, welche an einem anderen geregelten Markt (entsprechend der Definition in Artikel 18 der Satzung) gehandelt werden, wird auf der Grundlage des letzten verfügbaren Preises ermittelt.
  - e) Sofern ein Vermögenswert nicht an einer Börse oder auf einem anderen geregelten Markt notiert oder gehandelt wird oder sofern für Vermögenswerte, welche an einer Börse oder auf einem anderen Markt wie vorerwähnt notiert oder gehandelt werden, die Kurse entsprechend den Regelungen in (a), (b) oder (c) den tatsächlichen Marktwert der entsprechenden Vermögenswerte nicht angemessen widerspiegeln, wird der Wert solcher Vermögenswerte auf der Grundlage des vernünftigerweise vorhersehbaren Verkaufspreises nach einer vorsichtigen Einschätzung ermittelt oder im Falle eines Fonds bei der Rücknahme oder Veräußerung wahrscheinlich erzielt würde. Der Verwaltungsrat der SICAV wendet in diesem Fall angemessene und in der Praxis anerkannte Bewertungsmodelle und -grundsätze an.



## Anhang zum Jahresabschluss

- f) Der Liquidationswert von Forwards oder Optionen, die nicht an Börsen oder anderen organisierten Märkten gehandelt werden, entspricht dem jeweiligen Nettoliquidationswert, wie er gemäß den Richtlinien des Verwaltungsrates auf einer konsistent für alle verschiedenen Arten von Verträgen angewandten Grundlage festgestellt wird. Der Liquidationswert von Futures oder Optionen, welche an Börsen oder anderen organisierten Märkten gehandelt werden, wird auf der Grundlage der letzten verfügbaren Abwicklungspreise solcher Verträge an den Börsen oder organisierten Märkten, auf welchen diese Futures, Forwards oder Optionen von der Gesellschaft gehandelt werden, berechnet. Sofern ein Future, ein Forward oder eine Option an einem Tag, für welchen der Nettovermögenswert bestimmt wird, nicht liquidiert werden kann, wird die Bewertungsgrundlage für einen solchen Vertrag vom Verwaltungsrat in angemessener und vernünftiger Weise bestimmt.
- g) Der Wert von Geldmarktinstrumenten, die nicht an einer Börse notiert oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden und eine Restlaufzeit von weniger als 397 Tagen und mehr als 90 Tagen aufweisen, entspricht dem jeweiligen Nennwert zuzüglich hierauf aufgelaufener Zinsen. Geldmarktinstrumente mit einer Restlaufzeit von höchstens 90 Tagen werden auf der Grundlage der Amortisierungskosten, wodurch dem ungefähren Marktwert entsprochen wird, ermittelt.
- h) Swaps werden zu ihrem, unter Bezug auf die anwendbare Zinsentwicklung, bestimmten Marktwert bewertet.
- i) Sämtliche sonstigen Wertpapiere oder sonstigen Vermögenswerte werden zu ihrem angemessenen Marktwert bewertet, wie dieser nach Treu und Glauben und entsprechend dem vom Verwaltungsrat der SICAV auszustellenden Verfahren zu bestimmen ist.

Der Wert aller Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, welche nicht in der Währung des jeweiligen Teilfonds ausgedrückt ist, wird in diese Währung zu den zuletzt verfügbaren Devisenkursen umgerechnet. Wenn solche Kurse nicht verfügbar sind, wird der Wechselkurs nach Treu und Glauben und nach dem vom Verwaltungsrat der SICAV aufgestellten Verfahren bestimmt.

Der Verwaltungsrat der SICAV kann nach eigenem Ermessen andere Bewertungsmethoden zulassen, wenn er dieses im Interesse einer angemessenen Bewertung eines Vermögenswertes der Gesellschaft für angebracht hält.

Der Verwaltungsrat der SICAV kann bei umfangreichen Rücknahmeanträgen ferner beschließen, die Aktien erst nach Verkauf genügender Vermögenswerte und nach Eingang der entsprechenden Mittel zurückzunehmen, dies unter Berücksichtigung der Interessen aller Aktionäre. Nicht ausgeführte Rücknahmeanträge werden im Falle einer Aussetzung der Nettoinventarwertermittlung am nächstfolgenden Bewertungstag vorrangig berücksichtigt.

Die vorgenannten Methoden zur Ermittlung des Nettoinventarwertes sind in entsprechender Art und Weise auf die Berechnung des Nettoinventarwertes der jeweiligen Aktienklassen anwendbar.

- 3. Für jeden Teilfonds wird eine Ertrags- und Aufwandsausgleichsberechnung durchgeführt. Diese wird für jede Aktienklasse separat durchgeführt und im realisierten Ergebnis des Geschäftsjahres verrechnet. Der Ertrags- und Aufwandsausgleich beinhaltet das angefallene Nettoergebnis, welches die Aktionäre bei Erwerb mitbezahlen und bei Verkauf vergütet bekommen.

## Anhang zum Jahresabschluss

### Wertpapiere mit Bewertungsbesonderheiten

Der Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Emerging Equity / Aktien Schwellenländer ESG war zum Ende des Geschäftsjahres in nicht materiellem Umfang wie folgt in Wertpapiere mit Bewertungsbesonderheiten investiert:

ISIN	Wertpapier	in % des Teilfondsvermögens
KYG2113A1004	China Forestry Hldgs Co. i.L. Reg. Shares Reg S DL -,001	0,00

Die Aktie KYG2113A1004 China Forestry Hldgs Co. i.L. Reg. Shares Reg S DL -,001 wurde bereits vor dem Delisting in 2017 als nicht mehr werthaltig eingeschätzt. In Abwesenheit aktueller bewertungsrelevanter Informationen erfolgt die Bewertung auf Basis einer Entscheidung des Verwaltungsrates der SICAV weiterhin zu Null. Der entsprechende Ansatz wird durch das Valuation Committee regelmäßig kritisch überprüft und gegebenenfalls angepasst.

Die Bewertung des Wertpapiers erschien dem Verwaltungsrat der SICAV nach Treu und Glauben zum 30. Juni 2024 als der wahrscheinlichste Veräußerungswert. Aufgrund eingeschränkter Liquidität kann jedoch grundsätzlich nicht ausgeschlossen werden, dass Wertpapiertransaktionen zu einem vom Bewertungskurs abweichenden Kurs stattfinden können.

Der Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund Plus ESG war zum Ende des Geschäftsjahres in nicht materiellem Umfang wie folgt in Wertpapiere mit Bewertungsbesonderheiten investiert:

ISIN	Wertpapier	in % des Teilfondsvermögens
XS2339732385	OHL Operaciones S.A Techn.Codes EO-Nts 2014(18/22)	0,00

Der Bond stammt aus einem – im Rahmen des Restrukturierungsprozesses der OHL Operaciones S.A. – vorgenommenen 1:1 Umtauschs aus der ursprünglich emittierten Gattung (XS1043961439). Da es sich lediglich um eine technische ISIN ohne Notierung handelt, wurde im Valuation Committee der Fundrock-LRI beschlossen die Bewertung auf die XS2356570239 abzustellen (Option 1 der Umtauschofferte unter der XS2339732385). Weiterhin wurde beschlossen, die minimale Denominierung von 75.000 in den Bewertungsansatz mit einzubeziehen.

Im Januar 2023 erfolgte die wertlose Ausbuchung der Position durch die Verwahrstelle, da die Weisung zum Umtausch aufgrund fehlender Informationen zum beneficiary owner nicht ausgeführt und somit von der Verwahrstelle als nicht fristgerecht eingereicht eingestuft wurde. Im Valuation Committee der Fundrock-LRI wurde daraufhin beschlossen, die Position als Erinnerungsposten zu Null zu bewerten und im Gegenzug eine Forderung in Höhe von EUR 73.714,15 gegenüber der Verwahrstelle einzubuchen. Der entsprechende Ansatz wird durch das Valuation Committee regelmäßig kritisch überprüft und gegebenenfalls angepasst.

Die Verwaltungsgesellschaft des Fonds befindet sich zurzeit in Klärung des Sachverhalts und Austausch bzgl. einer Erstattung durch die Verwahrstelle. Der Verwaltungsrat der SICAV beurteilt die Forderung gegenüber der Verwahrstelle zum 30. Juni 2024 als werthaltig.

## Anhang zum Jahresabschluss

### Hinweis zur Bewertung von Wertpapieren welche vom Russland / Ukraine - Konflikt betroffen sind

Der Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Emerging Equity / Aktien Schwellenländer ESG war zum Ende des Geschäftsjahres wie folgt in Wertpapiere investiert, welche vom Russland / Ukraine Konflikt betroffen sind:

ISIN	Wertpapier	in % des Teilfondsvermögens
US55953Q2021	Magnit PJSC Reg.Shs(Sp.GDRsREGS)1/5/RL-,01	0,00
US69343P1057	LUKOIL PJSC Reg. Shs (Sp. ADRs)/1 RL-,025	0,00
US67011E2046	Novolipetskiy Metallurg. Komb. Reg.Shs(Sp.GDRs RegS)/10 RL 1	0,00
RU0009046452	Novolipetskiy Metallurg. Komb. Registered Shares RL 1	0,00
RU0009029524	Surgutneftegas PJSC Registered Pfd Shares RL 1	0,00
RU0009033591	Tatneft PJSC Registered Shares RL 1	0,01
JE00B6T5S470	Solidcore Resources PLC Registered Shares DL-,03	0,02
RU0009024277	LUKOIL PJSC Registered Shares RL -,025	0,00
RU0009029540	Sberbank of Russia PJSC Namensaktien RL 3	0,00
RU000A0J2Q06	Rosneft Oil Company Registered Shares RL -,01	0,00
RU000A0JP7J7	PIK-specialized Homebuil. PJSC Registered Shares RL 62,50	0,00
RU0007661625	Gazprom PJSC Registered Shares RL 5	0,00
US98387E2054	X 5 Retail Group N.V. Reg.Sh(spon.GDRs Reg S)1/4/EO1	0,01
RU000A0JPNM1	Inter RAO UES PJSC Registered Shares RL 2,809767	0,00
RU000A0JNAA8	Polyus PJSC Registered Shares RL 1	0,00

Aufgrund des Russland / Ukraine - Konflikts und der damit erlassenen wirtschaftlichen Sanktionen und Gegenanktionen, kam es zu erheblichen Unsicherheiten und Schwankungen an den internationalen Finanzmärkten.

Infolgedessen kam es sowohl bei Aktien als auch bei Anleihen zu deutlichen Kursverlusten. Da zu einem Großteil der russischen Bestände keine aktuellen Marktpreise vorhanden sind, hat das Valuation Committee der Fundrock-LRI beschlossen, die am Markt beobachtbaren, bzw. zuletzt verfügbaren Quotes mit einem Abschlag zu bewerten. Die Höhe richtet sich dabei in einem ersten Schritt nach beobachtbaren Indikatoren, die durch im Rahmen des Pricing Committee als verlässlich definiert wurden (Indices, ETF's). Nach Aussetzung der Indices / ETFs wurden die Kurse per Beschluss des Pricing Committees zu dem letzten Preis fixiert.

Der entsprechende Ansatz wird durch das Valuation Committee regelmäßig kritisch überprüft und gegebenenfalls angepasst.

Der Verwaltungsrat der SICAV ist der Auffassung, dass dies die angemessenen Werte widerspiegelt; aufgrund eingeschränkter Liquidität kann jedoch grundsätzlich nicht ausgeschlossen werden, dass Wertpapiertransaktionen zu einem vom Bewertungskurs abweichenden Kurs stattfinden können.

JE00B6T5S470: Die Solidcore Resources PLC (bis 17.06.2024 Polymetal International plc) hat am 24. Juni 2024 einen Antrag auf Einstellung der Notierung an der Moskauer Börse eingereicht. Im Zuge dessen wurde den anspruchsberechtigten Aktionären das Recht eingeräumt, die an der Moskauer Börse gelisteten Aktien umzutauschen in Aktien, die an der Astana International Exchange (AIX) gelistet sind. Trotz der Tatsache, dass an der AIX hohe Volumina gehandelt werden, konnte gemäß des Portfoliomanagements (Fundrock-LRI) kein unmittelbarer Verkauf der Anteile erfolgen, weshalb (Liquiditätsrisiko) das Valuation Committee der Fundrock-LRI in seiner Sitzung am 28. Juni 2024 beschlossen hat, zur Bewertung einen Discount von 10% auf die festgestellten Schlusskurse anzuwenden.

Der entsprechende Ansatz wird durch das Valuation Committee regelmäßig kritisch überprüft und gegebenenfalls angepasst.

Der Verwaltungsrat der SICAV ist der Auffassung, dass dies die angemessenen Werte widerspiegelt; aufgrund eingeschränkter Liquidität kann jedoch grundsätzlich nicht ausgeschlossen werden, dass Wertpapiertransaktionen zu einem vom Bewertungskurs abweichenden Kurs stattfinden können.

## Anhang zum Jahresabschluss

Der Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund Plus ESG war zum Ende des Geschäftsjahres wie folgt in Wertpapiere investiert, welche vom Russland / Ukraine Konflikt betroffen sind:

<b>ISIN</b>	<b>Wertpapier</b>	<b>in % des Teilfondsvermögens</b>
XS1951084471	Gaz Capital S.A. DL-M.T.LPN 19(26)GAZPROM Reg.S	0,35

Aufgrund des Russland / Ukraine - Konflikts und der damit erlassenen wirtschaftlichen Sanktionen und Gegenanktionen, kam es zu erheblichen Unsicherheiten und Schwankungen an den internationalen Finanzmärkten. Infolgedessen kam es sowohl bei Aktien als auch bei Anleihen zu deutlichen Kursverlusten. Rentenseitig am stärksten betroffen sind ukrainische und russische Anleihen deren Kurse mit hohen Abschlägen notieren. Im Valuation Committee der Fundrock-LRI wurde daraufhin die Entscheidung getroffen, bei weiterhin beobachtbaren Preisen den aktuellen Marktkurs, bzw. eine Bewertung zu Modelkursen wie BVAL (Bloomberg Valuation Service) oder EPS (Refinitiv Evaluated Pricing Service) anzusetzen. Der entsprechende Ansatz wird durch das Valuation Committee regelmäßig kritisch überprüft. Zum 30. Juni 2024 erfolgte die Bewertung auf Basis von Mark-to-Modelkursen (BVAL). Der entsprechende Ansatz wird durch das Valuation Committee regelmäßig kritisch überprüft und gegebenenfalls angepasst.

Der Verwaltungsrat der SICAV ist der Auffassung, dass dies die angemessenen Werte widerspiegelt; aufgrund eingeschränkter Liquidität kann jedoch grundsätzlich nicht ausgeschlossen werden, dass Wertpapiertransaktionen zu einem vom Bewertungskurs abweichenden Kurs stattfinden können.

### **Hinweis zum Ausweis von Dividendenerträgen**

Die in der Ertrags- und Aufwandsrechnung gezeigten Dividendenerträge werden inkl. Quellensteuer ausgewiesen.

### **Kosten**

Angaben zu Verwaltungsvergütung, Anlageberater- / Investment- bzw. Fondsmanagervergütung, Verwahrstellenvergütung sowie einer etwaigen Performance-Fee und Register- und Transferstellenvergütung können dem aktuellen Verkaufsprospekt / Emissionsdokument entnommen werden.

## Anhang zum Jahresabschluss

### Höhe der für das Geschäftsjahr angefallenen Performance-Fees

Im abgelaufenen Geschäftsjahr ist für die / den nachfolgend aufgeführte(n) Teilfonds des Fonds eine erfolgsabhängige Vergütung (Performance-Fee) gemäß den Regelungen des im Geschäftsjahr gültigen Verkaufsprospektes / Emissionsdokumentes angefallen. Sofern eine Performance-Fee angefallen ist, erfolgt der Ausweis ohne einen eventuell zugehörigen Ertrags- und Aufwandsausgleich. Bei den in der nachfolgenden Tabelle gezeigten Werten handelt es sich um die im Geschäftsjahr im jeweiligen Teilfonds abgegrenzten Beträge.

#### Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Global Equity / Aktien Welt ESG

Die Höhe der Beträge ist abhängig von der Wertentwicklung des Teilfonds im Vergleich zur Wertentwicklung des Referenzindex ("Benchmark"). Eine Auszahlung erfolgt erst nach Ende des Geschäftsjahres des Teilfonds und einzig im Falle einer positiven relativen Wertentwicklung im Vergleich zum Referenzindex.

Teilfonds	Aktien- klasse	Referenz-Benchmark
Global Equity / Aktien Welt ESG	A	MSCI World ESG Universal Price Index in EUR
Global Equity / Aktien Welt ESG	C	MSCI World 100% Hedged to CHF Price Index
Global Equity / Aktien Welt ESG	B	-
Global Equity / Aktien Welt ESG	X	-

#### Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - European Equity / Aktien Europa ESG

Die Höhe der Beträge ist abhängig von der Wertentwicklung des Teilfonds im Vergleich zur Wertentwicklung des Referenzindex ("Benchmark"). Eine Auszahlung erfolgt erst nach Ende des Geschäftsjahres des Teilfonds und einzig im Falle einer positiven relativen Wertentwicklung im Vergleich zum Referenzindex.

Teilfonds	Aktien- klasse	Referenz-Benchmark
European Equity / Aktien Europa ESG	A	MSCI Europe ESG Universal Price EUR Index
European Equity / Aktien Europa ESG	B	-
European Equity / Aktien Europa ESG	X	-

#### Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Emerging Equity / Aktien Schwellenländer ESG

Die Höhe der Beträge ist abhängig von der Wertentwicklung des Teilfonds im Vergleich zur Wertentwicklung des Referenzindex ("Benchmark"). Eine Auszahlung erfolgt erst nach Ende des Geschäftsjahres des Teilfonds und einzig im Falle einer positiven relativen Wertentwicklung im Vergleich zum Referenzindex.

Teilfonds	Aktien- klasse	Referenz-Benchmark
Emerg. Equ. / Aktien Schwellenländer ESG	A	MSCI EM ESG Universal Price Return Index in EUR
Emerg. Equ. / Aktien Schwellenländer ESG	B	-
Emerg. Equ. / Aktien Schwellenländer ESG	X	-
Emerg. Equ. / Aktien Schwellenländer ESG	E	-
Emerg. Equ. / Aktien Schwellenländer ESG	C	-

## Anhang zum Jahresabschluss

### Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund ESG

Für den Teilfonds wird keine Performance-Fee berechnet.

### Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund Plus ESG

Die Höhe der Beträge ist abhängig von der Wertentwicklung des Teilfonds im Vergleich zur Wertentwicklung des Referenzindex ("Benchmark"). Eine Auszahlung erfolgt erst nach Ende des Geschäftsjahres des Teilfonds und einzig im Falle einer positiven relativen Wertentwicklung im Vergleich zum Referenzindex.

Teilfonds	Aktien- klasse	Referenz-Benchmark
Absolute Return Bond Fund Plus ESG	A	€STR (Euro Short-Term Rate – Volume Weighted Trimmed Mean Rate, Zinsmethode ACT/360)
Absolute Return Bond Fund Plus ESG	C	SARON (Swiss Average Rate Overnight, Zinsmethode ACT/360)
Absolute Return Bond Fund Plus ESG	B	-
Absolute Return Bond Fund Plus ESG	D	SARON (Swiss Average Rate Overnight, Zinsmethode ACT/360)
Absolute Return Bond Fund Plus ESG	X	-
Absolute Return Bond Fund Plus ESG	E	SOFR (United States Secured Overnight Financing Rate, Zinsmethode ACT/360)

## Anhang zum Jahresabschluss

Teilfonds	Aktien- klasse	Wahrung	Hohe der berechneten Performance Fees in Wahrung der jeweiligen Aktienklasse	In % des Ø Aktien- klassen- vermogens
Absolute Return Bond Fund ESG	A	EUR	-	-
Absolute Return Bond Fund ESG	C	CHF	-	-
Absolute Return Bond Fund ESG	B	EUR	-	-
Absolute Return Bond Fund ESG	D	CHF	-	-
Absolute Return Bond Fund ESG	X	CHF	-	-
Absolute Return Bond Fund Plus ESG	A	EUR	11.239,44	0,31 %
Absolute Return Bond Fund Plus ESG	C	CHF	51.446,90	0,08 %
Absolute Return Bond Fund Plus ESG	B	EUR	-	-
Absolute Return Bond Fund Plus ESG	D	CHF	28.472,11	0,15 %
Absolute Return Bond Fund Plus ESG	X	CHF	-	-
Absolute Return Bond Fund Plus ESG	E	USD	804,47	0,11 %
Emerg. Equ. / Aktien Schwellenlander ESG	A	EUR	374.935,29	1,13 %
Emerg. Equ. / Aktien Schwellenlander ESG	B	EUR	-	-
Emerg. Equ. / Aktien Schwellenlander ESG	X	CHF	-	-
Emerg. Equ. / Aktien Schwellenlander ESG	E	USD	-	-
Emerg. Equ. / Aktien Schwellenlander ESG	C	CHF	-	-
European Equity / Aktien Europa ESG	A	EUR	218.904,99	1,02 %
European Equity / Aktien Europa ESG	B	EUR	-	-
European Equity / Aktien Europa ESG	X	EUR	-	-
Global Equity / Aktien Welt ESG	A	EUR	92.897,35	0,47 %
Global Equity / Aktien Welt ESG	C	CHF	233.367,40	0,59 %
Global Equity / Aktien Welt ESG	B	EUR	-	-
Global Equity / Aktien Welt ESG	X	CHF	-	-

### Transaktionskosten

Die Transaktionskosten beruckichtigen samtliche Kosten, die im Geschaftsjahr separat ausgewiesen bzw. abgerechnet wurden und in direktem Zusammenhang mit einem Kauf oder Verkauf von Vermogensgegenstanden stehen.

Fur das Geschaftsjahr waren die Transaktionskosten wie folgt:

Teilfonds	Transaktionskosten	
Absolute Return Bond Fund ESG	EUR	10.858,29
Absolute Return Bond Fund Plus ESG	EUR	15.431,02
Emerg. Equ. / Aktien Schwellenlander ESG	EUR	231.533,43
European Equity / Aktien Europa ESG	EUR	33.079,43
Global Equity / Aktien Welt ESG	EUR	36.805,04

## Anhang zum Jahresabschluss

### Sicherheiten

Im Rahmen der Besicherung von Derivategeschäften erhielt der Fonds zum Geschäftsjahresende folgende Sicherheiten:

#### (Teil-) Fonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Global Equity / Aktien Welt ESG

##### Cash-Collateral

Kontrahent	Besichertes Geschäft	Währung	Bestand
CACEIS Investor Services Bank S.A.	Devisentermingeschäft	EUR	550.000,00

#### (Teil-) Fonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Emerging Equity / Aktien Schwellenländer ESG

##### Cash-Collateral

Kontrahent	Besichertes Geschäft	Währung	Bestand
CACEIS Investor Services Bank S.A.	Devisentermingeschäft	EUR	200.000,00

#### (Teil-) Fonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund ESG

##### Cash-Collateral

Kontrahent	Besichertes Geschäft	Währung	Bestand
CACEIS Investor Services Bank S.A.	Devisentermingeschäft	EUR	750.000,00

#### (Teil-) Fonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund Plus ESG

##### Cash-Collateral

Kontrahent	Besichertes Geschäft	Währung	Bestand
CACEIS Investor Services Bank S.A.	Devisentermingeschäft	EUR	1.250.000,00

### Aufstellung über die Entwicklung des Wertpapierbestandes

Auf Anfrage ist am eingetragenen Sitz der Gesellschaft, bzw. der Verwaltungsgesellschaft sowie bei der Zahl- und Informationsstelle eine kostenfreie Aufstellung mit detaillierten Angaben über sämtliche während des Geschäftsjahres getätigten Käufe und Verkäufe erhältlich.

### Angaben zu Artikel 8 der Verordnung (EU) 2019/2088 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 27. November 2019 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (ungeprüft)

Die Angaben sind im Anhang zum Jahresbericht im ungeprüften Teil enthalten.



## **Anhang zum Jahresabschluss**

### **Wichtige Ereignisse während des Geschäftsjahres**

Mit Wirkung zum 3. Juli 2023 fand eine Übernahme der RBC Investor Services Bank, welche für den Fonds als Verwahrstelle, Register- und Transferstelle sowie als Zahlstelle agiert, durch die CACEIS Investor Services Bank S.A. statt.

Mit Wirkung zum 1. September 2023 haben die Aktionäre Herrn Karen Armenakyan als neues Mitglied des Aufsichtsrats der Verwaltungsgesellschaft LRI Invest S.A. bestellt.

Mit Wirkung zum 30. September 2023 ist Utz Schüller von seinem Posten im Managing Board der LRI Invest S.A. ausgeschieden.

Mit Wirkung zum 30. November 2023 ist Herr Lobsang Gangshontsang als Mitglied des Verwaltungsrates ausgeschieden.

Mit Wirkung zum 1. Dezember 2023 ist Herr Markus Herbert Rellstab als Mitglied des Verwaltungsrates ernannt worden.

### **Wichtige Ereignisse nach Ende des Geschäftsjahres**

Aus Gründen des Anlegerschutzes und im Einklang mit Artikel 6 des Verkaufsprospektes sowie Artikel 12 der Satzung des Fonds ist entschieden worden, die Berechnung des Anteilwertes für den Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav – Emerging Equity / Aktien Schwellenländer für die Kurstage 25. Juli 2024 und 6. September 2024 einzustellen. Die Wiederaufnahme der Berechnung erfolgte ab den Kurstagen 26. Juli 2024 sowie am 9. September 2024.

Hintergrund der Aussetzung war die Tatsache, dass das Teilfondsvermögen in verschiedene Vermögenswerte investiert ist, für die keine ordnungsgemäße sowie belastbare Bewertung (bedingt durch externe und nicht von der Verwaltungsgesellschaft LRI Invest S.A. sowie dem Verwaltungsrat beeinflussbaren Faktoren) sichergestellt werden konnte.

Diese gegenständlichen Vermögenswerte sind an den Börsen von Taiwan („TWSE“) beziehungsweise Hong Kong („SEHK“) gelistet, welche beide aufgrund eines Taifuns geschlossen waren.

Die Verwaltungsgesellschaft hat eine entsprechende Mitteilung an die Aktionäre publiziert.



## Prüfungsvermerk

An die Aktionäre des  
**Swiss Rock (Lux) Sicav**

---

### Unser Prüfungsurteil

Nach unserer Beurteilung vermittelt der beigefügte Abschluss in Übereinstimmung mit den in Luxemburg geltenden gesetzlichen Bestimmungen und Verordnungen betreffend die Aufstellung und Darstellung des Abschlusses ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild der Vermögens- und Finanzlage des Swiss Rock (Lux) Sicav (der „Fonds“) und seiner jeweiligen Teilfonds zum 30. Juni 2024 sowie der Ertragslage und der Entwicklung des Fondsvermögens für das an diesem Datum endende Geschäftsjahr.

#### *Was wir geprüft haben*

Der Abschluss des Fonds besteht aus:

- der Zusammensetzung des Netto-Fondsvermögens des Fonds und der Zusammensetzung des Netto-Fondsvermögens der Teilfonds zum 30. Juni 2024;
- der Vermögensaufstellung der Teilfonds zum 30. Juni 2024;
- der Ertrags- und Aufwandsrechnung des Fonds und der Ertrags- und Aufwandsrechnung der Teilfonds für das an diesem Datum endende Geschäftsjahr;
- der Vermögensentwicklung des Fonds und der Vermögensentwicklung der Teilfonds für das an diesem Datum endende Geschäftsjahr; und
- dem Anhang, einschließlich einer Zusammenfassung bedeutsamer Rechnungslegungsmethoden.

---

### Grundlage für das Prüfungsurteil

Wir führten unsere Abschlussprüfung in Übereinstimmung mit dem Gesetz vom 23. Juli 2016 über die Prüfungstätigkeit (Gesetz vom 23. Juli 2016) und nach den für Luxemburg von der „Commission de Surveillance du Secteur Financier“ (CSSF) angenommenen internationalen Prüfungsstandards (ISAs) durch. Unsere Verantwortung gemäß dem Gesetz vom 23. Juli 2016 und den für Luxemburg von der CSSF angenommenen ISAs wird im Abschnitt „Verantwortung des „Réviseur d’entreprises agréé“ für die Abschlussprüfung“ weitergehend beschrieben.

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

Wir sind unabhängig von dem Fonds in Übereinstimmung mit dem „International Code of Ethics for Professional Accountants, including International Independence Standards“, herausgegeben vom „International Ethics Standards Board for Accountants“ (IESBA Code) und für Luxemburg von der CSSF angenommen, sowie den beruflichen Verhaltensanforderungen, die wir im Rahmen der Abschlussprüfung einzuhalten haben und haben alle sonstigen Berufspflichten in Übereinstimmung mit diesen Verhaltensanforderungen erfüllt.

---

### **Sonstige Informationen**

Der Verwaltungsrat des Fonds ist verantwortlich für die sonstigen Informationen. Die sonstigen Informationen beinhalten die Informationen, welche im Jahresbericht enthalten sind, jedoch beinhalten sie nicht den Abschluss und unseren Prüfungsvermerk zu diesem Abschluss.

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

Im Zusammenhang mit der Prüfung des Abschlusses besteht unsere Verantwortung darin, die sonstigen Informationen zu lesen und dabei zu beurteilen, ob eine wesentliche Unstimmigkeit zwischen diesen und dem Abschluss oder mit den bei der Abschlussprüfung gewonnenen Erkenntnissen besteht oder auch ansonsten die sonstigen Informationen wesentlich falsch dargestellt erscheinen. Sollten wir auf Basis der von uns durchgeführten Arbeiten schlussfolgern, dass sonstige Informationen wesentliche falsche Darstellungen enthalten, sind wir verpflichtet, diesen Sachverhalt zu berichten. Wir haben diesbezüglich nichts zu berichten.

---

### **Verantwortung des Verwaltungsrats des Fonds für den Abschluss**

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

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

---

### **Verantwortung des „Réviseur d'entreprises agréé“ für die Abschlussprüfung**

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

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

- identifizieren und beurteilen wir das Risiko von wesentlichen falschen Darstellungen im Abschluss aus Unrichtigkeiten oder Verstößen, planen und führen Prüfungshandlungen durch als Antwort auf diese Risiken und erlangen Prüfungsnachweise, die ausreichend und angemessen sind, um als Grundlage für unser Prüfungsurteil zu dienen. Das Risiko, dass wesentliche falsche Darstellungen nicht aufgedeckt werden, ist bei Verstößen höher als bei Unrichtigkeiten, da Verstöße betrügerisches Zusammenwirken, Fälschungen, beabsichtigte Unvollständigkeiten, irreführende Angaben bzw. das Außerkraftsetzen interner Kontrollen beinhalten können;
- gewinnen wir ein Verständnis von dem für die Abschlussprüfung relevanten internen Kontrollsystem, um Prüfungshandlungen zu planen, die unter den gegebenen Umständen angemessen sind, jedoch nicht mit dem Ziel, ein Prüfungsurteil zur Wirksamkeit des internen Kontrollsystems des Fonds abzugeben;
- beurteilen wir die Angemessenheit der von dem Verwaltungsrat des Fonds angewandten Bilanzierungsmethoden, der rechnungslegungsrelevanten Schätzungen und den entsprechenden Anhangsangaben;
- schlussfolgern wir über die Angemessenheit der Anwendung des Rechnungslegungsgrundsatzes der Fortführung der Tätigkeit durch den Verwaltungsrat des Fonds sowie auf der Grundlage der erlangten Prüfungsnachweise, ob eine wesentliche Unsicherheit im Zusammenhang mit Ereignissen oder Gegebenheiten besteht, die bedeutsame Zweifel an der Fähigkeit des Fonds oder eines seiner Teilfonds zur Fortführung der Tätigkeit aufwerfen könnten. Sollten wir schlussfolgern, dass eine wesentliche Unsicherheit besteht, sind wir verpflichtet, im Prüfungsvermerk auf die dazugehörigen Anhangsangaben zum Abschluss hinzuweisen oder, falls die Angaben unangemessen sind, das Prüfungsurteil zu modifizieren. Diese Schlussfolgerungen basieren auf der Grundlage der bis zum Datum des Prüfungsvermerks erlangten Prüfungsnachweise. Zukünftige Ereignisse oder Gegebenheiten können jedoch dazu führen, dass der Fonds oder einer seiner Teilfonds seine Tätigkeit nicht mehr fortführen kann;
- beurteilen wir die Gesamtdarstellung, den Aufbau und den Inhalt des Abschlusses einschließlich der Anhangsangaben, und beurteilen, ob dieser die zugrundeliegenden Geschäftsvorfälle und Ereignisse sachgerecht darstellt.

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

PricewaterhouseCoopers, Société coopérative  
Vertreten durch

Luxemburg, 17. September 2024

Carsten Brengel

## Zusätzliche Informationen zum Jahresbericht (ungeprüft)

### Wertpapier-Kennnummern / ISINs

Teilfonds	Aktien-klasse	Wertpapier-Kennnummer	ISIN
Absolute Return Bond Fund ESG	A	A0M97P	LU0337168347
Absolute Return Bond Fund ESG	C	A1C1PH	LU0524233250
Absolute Return Bond Fund ESG	B	A110RQ	LU1048648569
Absolute Return Bond Fund ESG	D	A110RR	LU1048648726
Absolute Return Bond Fund ESG	X	A110RS	LU1048648999
Absolute Return Bond Fund Plus ESG	A	A1C86W	LU0558816855
Absolute Return Bond Fund Plus ESG	C	A1C86X	LU0558817150
Absolute Return Bond Fund Plus ESG	B	A1J7RV	LU0851164367
Absolute Return Bond Fund Plus ESG	D	A1J7RW	LU0851164870
Absolute Return Bond Fund Plus ESG	X	A110RT	LU1048649021
Absolute Return Bond Fund Plus ESG	E	A118TE	LU1090786119
Emerg. Equ. / Aktien Schwellenländer ESG	A	A0M97N	LU0337168263
Emerg. Equ. / Aktien Schwellenländer ESG	B	A110RN	LU1048648213
Emerg. Equ. / Aktien Schwellenländer ESG	X	A110RP	LU1048648304
Emerg. Equ. / Aktien Schwellenländer ESG	E	A2DP0G	LU1611484822
Emerg. Equ. / Aktien Schwellenländer ESG	C	A3DJWC	LU2468302406
European Equity / Aktien Europa ESG	A	A0M93F	LU0337167885
European Equity / Aktien Europa ESG	B	A110RL	LU1048648056
European Equity / Aktien Europa ESG	X	A110RM	LU1048648130
Global Equity / Aktien Welt ESG	A	A0M97M	LU0337150725
Global Equity / Aktien Welt ESG	C	A110RJ	LU1048647835
Global Equity / Aktien Welt ESG	B	A110RH	LU1048647751
Global Equity / Aktien Welt ESG	X	A110RK	LU1048647918

### Ertragsverwendung

Der Verwaltungsrat der SICAV beabsichtigt, die Erträge der Teilfonds zu thesaurieren.

### Steuern

Die Einkünfte des Fonds werden im Großherzogtum Luxemburg nicht mit Einkommen- oder Körperschaftsteuern belastet. Sie können jedoch etwaigen Quellensteuern oder anderen Steuern in Ländern unterliegen, in denen das Fondsvermögen investiert ist. Weder die Verwaltungsgesellschaft noch die Verwahrstelle werden Bescheinigungen über solche Steuern für einzelne oder alle Aktionäre einholen.

Anleger können hinsichtlich der Zins- und Kapitalerträge einer individuellen Besteuerung unterliegen. Interessenten sollten sich über Gesetze und Verordnungen, die auf den Kauf, den Besitz und die Rücknahme von Aktien Anwendung finden, informieren und sich gegebenenfalls beraten lassen.

Detaillierte Informationen bezüglich der Besteuerung von Fondsvermögen in Luxemburg können dem aktuellen Verkaufsprospekt entnommen werden.

### Aktienpreise

Sofern im Sonderreglement des Verkaufsprospektes nicht anders geregelt, wird der Nettovermögenswert sowie die Ausgabe- und Rücknahmepreise pro Aktie an jedem Bankarbeitstag, mit Ausnahme des 24. und 31. Dezember eines jeden Jahres, in Luxemburg am Sitz der Verwaltungsgesellschaft bekannt gegeben, ggfs. in hinreichend verbreiteten Tages- und Wirtschaftszeitungen veröffentlicht und können bei allen im Verkaufsprospekt genannten Zahlstellen erfragt werden. Zudem finden Sie die Nettoinventarwerte pro Aktie und weitere Fondsinformationen auf der Internetseite der LRI Invest S.A. ([www.lri-group.lu](http://www.lri-group.lu)).

## Zusätzliche Informationen zum Jahresbericht (ungeprüft)

### Anwendbares Recht, Gerichtsstand und Vertragssprache

1. Das Allgemeine Verwaltungsreglement unterliegt luxemburgischem Recht. Insbesondere gelten in Ergänzung zu den Regelungen des Allgemeinen Verwaltungsreglements die Vorschriften des Gesetzes vom 17. Dezember 2010 sowie die Richtlinie 2007/16/EG. Gleiches gilt für die Rechtsbeziehungen zwischen den Aktionären, der Verwaltungsgesellschaft und der Verwahrstelle.
2. Jeder Rechtsstreit zwischen Aktionären, der Verwaltungsgesellschaft und der Verwahrstelle unterliegt der Gerichtsbarkeit des zuständigen Gerichts im Gerichtsbezirk Luxemburg im Großherzogtum Luxemburg. Die Verwaltungsgesellschaft und die Verwahrstelle sind berechtigt, sich selbst und einen Fonds der Gerichtsbarkeit und dem Recht eines jeden Landes zu unterwerfen, in welchem Aktien eines Fonds öffentlich vertrieben werden, soweit es sich um Ansprüche der Anleger handelt, die in dem betreffenden Land ansässig sind, und im Hinblick auf Angelegenheiten, die sich auf den jeweiligen Fonds beziehen.
3. Der deutsche Wortlaut des Allgemeinen Verwaltungsreglements ist maßgeblich, falls im jeweiligen Sonderreglement nicht ausdrücklich eine anderweitige Bestimmung getroffen wurde.

### Kostenquote (Ongoing Charges)

Die Kostenquote drückt die Summe der Kosten und Gebühren (mit Ausnahme etwaig angefallener Performance-Fees und angefallener Transaktionskosten) inkl. Kosten der Zielfonds abzüglich etwaiger Einnahmen aus Bestandsprovisionen, sofern der Gesamtanteil der Zielfonds größer gleich 20% des Netto- (Teil-) Fondsvermögens ist, als Prozentsatz des durchschnittlichen (Teil-) Fondsvermögens innerhalb eines Geschäftsjahres aus.

Teilfonds	Aktien- klasse	Ongoing Charges per 30.06.2024	Performance-Fee per 30.06.2024
Absolute Return Bond Fund ESG	A	1,14 %	-
Absolute Return Bond Fund ESG	C	1,14 %	-
Absolute Return Bond Fund ESG	B	0,64 %	-
Absolute Return Bond Fund ESG	D	0,64 %	-
Absolute Return Bond Fund ESG	X	0,25 %	-
Absolute Return Bond Fund Plus ESG	A	1,24 %	0,31 %
Absolute Return Bond Fund Plus ESG	C	1,21 %	0,08 %
Absolute Return Bond Fund Plus ESG	B	0,71 %	-
Absolute Return Bond Fund Plus ESG	D	0,66 %	0,15 %
Absolute Return Bond Fund Plus ESG	X	0,23 %	-
Absolute Return Bond Fund Plus ESG	E	1,20 %	0,11 %
Emerg. Equ. / Aktien Schwellenländer ESG	A	1,51 %	1,13 %
Emerg. Equ. / Aktien Schwellenländer ESG	B	1,11 %	-
Emerg. Equ. / Aktien Schwellenländer ESG	X	0,32 %	-
Emerg. Equ. / Aktien Schwellenländer ESG	E	1,11 %	-
Emerg. Equ. / Aktien Schwellenländer ESG	C	0,78 %	-
European Equity / Aktien Europa ESG	A	1,28 %	1,02 %
European Equity / Aktien Europa ESG	B	0,88 %	-
European Equity / Aktien Europa ESG	X	0,29 %	-
Global Equity / Aktien Welt ESG	A	1,32 %	0,47 %
Global Equity / Aktien Welt ESG	C	1,61 %	0,59 %
Global Equity / Aktien Welt ESG	B	0,86 %	-
Global Equity / Aktien Welt ESG	X	0,22 %	-

## Zusätzliche Informationen zum Jahresbericht (ungeprüft)

### Portfolio Turnover Rate

Die Portfolio Turnover Rate beziffert den Transaktionsumfang auf Ebene des jeweiligen Teilfondsportfolios.

Eine Portfolio Turnover Rate, die nahe an Null liegt, zeigt, dass Transaktionen getätigt wurden, um die Mittelzu- bzw. -abflüsse aus Zeichnungen bzw. Rücknahmen zu investieren bzw. zu deinvestieren. Eine negative Portfolio Turnover Rate indiziert, dass die Summe der Zeichnungen und Rücknahmen höher war als die Wertpapiertransaktionen im jeweiligen Teilfondsportfolio. Eine positive Portfolio Turnover Rate zeigt, dass die Wertpapiertransaktionen höher waren als die Aktientransaktionen.

Die Portfolio Turnover Rate wird jährlich ermittelt.

<b>Teilfonds</b>	<b>Portfolio Turnover Rate per 30.06.2024</b>
Absolute Return Bond Fund ESG	14,78 %
Absolute Return Bond Fund Plus ESG	9,91 %
Emerg. Equ. / Aktien Schwellenländer ESG	101,94 %
European Equity / Aktien Europa ESG	39,51 %
Global Equity / Aktien Welt ESG	44,00 %

### Hebelwirkung

Im Rahmen der Ermittlung der Hebelwirkung wird der Ansatz gemäß Punkt 3 der Box 24 der ESMA-Empfehlung 10-788 herangezogen, in welchem die Summe der Nominalwerte der derivativen Positionen bzw. deren Basiswertäquivalente als Berechnungsgrundlage verwendet werden. Dabei ist zu berücksichtigen, dass sich zukünftig sowohl die Gewichtung der einzelnen Derivatepositionen als auch die Ausprägungen der Risikofaktoren für jedes derivative Instrument durch neue Marktgegebenheiten im Zeitverlauf ändern können und es somit zu Abweichungen der erwarteten Hebelwirkung gemäß Verkaufsprospekt kommen kann. Der Anleger muss insofern damit rechnen, dass sich auch die erwartete Hebelwirkung ändern kann. Darüber hinaus sei darauf hingewiesen, dass derivative Finanzinstrumente auch teilweise oder vollständig zur Absicherung von Risiken eingesetzt werden können.

<b>Teilfonds</b>	<b>Durchschnittliche Hebelwirkung</b>
Absolute Return Bond Fund ESG	134,90 %
Absolute Return Bond Fund Plus ESG	144,54 %
Emerg. Equ. / Aktien Schwellenländer ESG	79,51 %
European Equity / Aktien Europa ESG	1,15 %
Global Equity / Aktien Welt ESG	76,93 %

## Zusätzliche Informationen zum Jahresbericht (ungeprüft)

### Marktrisiko (Value at Risk; kurz: VaR)

Unter dem Marktrisiko versteht man das Verlustrisiko, das aus Schwankungen beim Marktwert von Positionen im Portfolio resultiert, die auf Veränderungen bei Marktvariablen, wie Zinssätzen, Wechselkursen oder Aktienpreisen zurückzuführen sind.

#### Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Global Equity / Aktien Welt ESG

Bei der Ermittlung des Marktrisikopotentials wendet die Gesellschaft den relativen VaR-Ansatz im Sinne des Rundschreibens CSSF 11/512 an. Dabei entspricht das relative Limit dem zweifachen Marktrisiko (VaR) eines Referenzportfolios. Das Referenzportfolio besteht aus dem MSCI World ESG Universal Price Index in EUR.

Minimale Auslastung des VaR-Limits	42,92 %
Maximale Auslastung des VaR-Limits	53,60 %
Durchschnittliche Auslastung des VaR-Limits	50,68 %

#### Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - European Equity / Aktien Europa ESG

Bei der Ermittlung des Marktrisikopotentials wendet die Gesellschaft den relativen VaR-Ansatz im Sinne des Rundschreibens CSSF 11/512 an. Dabei entspricht das relative Limit dem zweifachen Marktrisiko (VaR) eines Referenzportfolios. Das Referenzportfolio besteht aus dem MSCI Europe ESG Universal Price Index in EUR.

Minimale Auslastung des VaR-Limits	47,17 %
Maximale Auslastung des VaR-Limits	56,93 %
Durchschnittliche Auslastung des VaR-Limits	50,09 %

#### Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Emerging Equity / Aktien Schwellenländer ESG

Bei der Ermittlung des Marktrisikopotentials wendet die Gesellschaft den relativen VaR-Ansatz im Sinne des Rundschreibens CSSF 11/512 an. Dabei entspricht das relative Limit dem zweifachen Marktrisiko (VaR) eines Referenzportfolios. Das Referenzportfolio besteht aus dem MSCI Emerging Markets ESG Universal Price Index in EUR.

Minimale Auslastung des VaR-Limits	30,63 %
Maximale Auslastung des VaR-Limits	38,05 %
Durchschnittliche Auslastung des VaR-Limits	34,12 %

#### Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund ESG

Bei der Ermittlung des Marktrisikopotentials wendet die Gesellschaft den absoluten VaR-Ansatz im Sinne des Rundschreibens CSSF 11/512 an. Das absolute VaR-Limit beträgt 20%.

Minimale Auslastung des VaR-Limits	14,95 %
Maximale Auslastung des VaR-Limits	21,80 %
Durchschnittliche Auslastung des VaR-Limits	19,68 %

#### Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund Plus ESG

Bei der Ermittlung des Marktrisikopotentials wendet die Gesellschaft den absoluten VaR-Ansatz im Sinne des Rundschreibens CSSF 11/512 an. Das absolute VaR-Limit beträgt 20%.

Minimale Auslastung des VaR-Limits	17,15 %
Maximale Auslastung des VaR-Limits	22,60 %
Durchschnittliche Auslastung des VaR-Limits	20,56 %

Die Risikokennzahlen wurden für den Berichtszeitraum auf Basis des Verfahrens der Historischen Simulation mit den Parametern 99% Konfidenzniveau, 20 Tage Haltedauer unter Verwendung eines effektiven, historischen Beobachtungszeitraumes von zwei Jahren berechnet.

### Meldepflichtige Wertpapierfinanzierungsgeschäfte

Der Fonds tätigte während des Geschäftsjahres keine Transaktionen in meldepflichtige Finanzierungsinstrumente gemäß der Verordnung (EU) 2015/2365 (SFT-Verordnung).



## Zusätzliche Informationen zum Jahresbericht (ungeprüft)

### ESG-Methodologie der Artikel-8-Teilfonds

Folgende Teilfonds des Fonds Swiss Rock (Lux) Sicav unterliegen Artikel 8 der Verordnung (EU) 2019/2088 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 27. November 2019 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor:

- Global Equity / Aktien Welt ESG
- European Equity / Aktien Europa ESG
- Emerging Equity / Aktien Schwellenländer ESG
- Absolute Return Bond Fund ESG
- Absolute Return Bond Fund Plus ESG

Neben der klassischen finanziellen Analyse integriert der aktive Auswahlprozess der Teilfonds ökologische und soziale Merkmale sowie Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung („ESG“-Merkmale) in die Investitionsentscheidungen.

Basierend auf dem im Verkaufsprospekt dargestellten umfangreichen ESG-Regelwerk werden Finanzinstrumente und/oder Emittenten gemäß nachvollziehbarer ESG Merkmale bewertet und entsprechend klassifiziert. Die Implementierung des ESG-Regelwerks im Investmentprozess der Teilfonds basiert u.a. auf der Verwendung von Daten der Nachhaltigkeitsspezialisten MSCI ESG Research LLC und ESG Screen 17 GmbH.

### Verwaltungsgebühren der KAG-fremden Zielfonds

Auf Anfrage ist am eingetragenen Sitz der Verwaltungsgesellschaft eine kostenfreie Aufstellung über die Verwaltungsgebühren der im Geschäftsjahr im Bestand gehaltenen Zielfonds, welche nicht von der Verwaltungsgesellschaft verwaltet wurden, erhältlich.

### Angaben zur Vergütung des delegierten Portfoliomanagers

Der Verwaltungsrat der SICAV hat das Portfoliomanagement an die Swiss Rock Asset Management AG, Zürich ausgelagert.

Angaben zum Gesamtbetrag der Vergütungen, unterteilt in fixe und variable Vergütung und die Anzahl der Begünstigten der variablen Vergütung:

Gesamtbetrag der Vergütung	EUR	5.089.489,91
Gesamtbetrag der fixen Vergütung	EUR	4.331.173,67
Gesamtbetrag der variablen Vergütung	EUR	758.316,24
Anzahl der Mitarbeiter		21

Angaben zur Vergütung gemäß Auskunft des delegierten Portfoliomanagers: Swiss Rock Asset Management AG für das Geschäftsjahr 2023.

## Zusätzliche Informationen zum Jahresbericht (ungeprüft)

### Angaben zur Vergütungspolitik der Verwaltungsgesellschaft

#### Vergütungsgrundsätze

Die LRI Invest S.A. ("Fundrock LRI") hat im Einklang mit geltenden gesetzlichen und aufsichtsrechtlichen Vorgaben Grundsätze für ihr Vergütungssystem definiert, die mit einem soliden und wirksamen Risikomanagementsystem vereinbar und diesem förderlich sind. Dieses Vergütungssystem orientiert sich an der nachhaltigen und unternehmerischen Geschäftspolitik des Unternehmens und soll daher keine Anreize zur Übernahme von Risiken geben, die unvereinbar mit den Risikoprofilen und Vertragsbedingungen der von der Fundrock LRI verwalteten Investmentfonds sind. Das Vergütungssystem soll stets im Einklang mit Geschäftsstrategie, Zielen, Werten und Interessen der Fundrock LRI und der von ihr verwalteten Fonds und der Anleger dieser Fonds stehen und umfasst auch Maßnahmen zur Vermeidung von Interessenkonflikten.

Die Vergütung der Mitarbeiter der Fundrock LRI kann fixe und variable Elemente sowie monetäre und nicht-monetäre Nebenleistungen enthalten. Die Bemessung der Komponenten erfolgt unter Beachtung der Risiko-grundsätze, Marktüblichkeit und Angemessenheit. Des Weiteren wird bei der Festlegung der einzelnen Bestandteile gewährleistet, dass keine signifikante Abhängigkeit von der variablen Vergütung besteht sowie ein angemessenes Verhältnis von variabler zu fixer Vergütung besteht. Die variable Vergütung stellt somit nur eine Ergänzung zur fixen Vergütung dar und setzt keine Anreize zur Eingehung unangemessener Risiken. Ziel ist eine flexible Vergütungspolitik, die auch einen Verzicht auf die Zahlung der variablen Komponente vorsehen kann.

Das Vergütungssystem wird mindestens einmal jährlich überprüft und bei Bedarf angepasst, um die Angemessenheit und Einhaltung der rechtlichen Vorgaben zu gewährleisten.

#### Angaben zur Mitarbeitervergütung

Die Angaben zur Mitarbeitervergütung der LRI Invest S.A. erfolgen für das Geschäftsjahr 1. Januar 2023 bis 31. Dezember 2023.

<b>Anzahl Mitarbeiter (MA) (inkl. Geschäftsleiter): 117</b>	<b>Stand: 31.12.2023</b>		
<b>Geschäftsjahr: 01.01.2023 – 31.12.2023</b>	<b>EUR</b>	<b>EUR</b>	<b>EUR</b>
<b>Vergütung</b>	<b>Fix</b>	<b>Variabel</b>	<b>Gesamt *)</b>
Gesamtsumme der gezahlten Mitarbeitervergütung im abgelaufenen Geschäftsjahr	15.117.538,61	1.323.727,94	16.441.266,55
davon Vergütungen an Führungskräfte, MA mit Kontrollfunktionen und andere Risikoträger			4.008.180,16
davon MA mit Kontrollfunktionen			1.966.845,01
davon MA mit gleicher Einkommensstufe			-

\*) Von den Investmentvermögen wurden keine direkten Zahlungen an Mitarbeiter geleistet.

## Zusatzinformationen für Anleger in der Schweiz (ungeprüft)

### Vertreter in der Schweiz

Vertreter in der Schweiz ist die Swiss Rock Asset Management AG, Rigistraße 60, CH-8006 Zürich.

### Zahlstelle in der Schweiz

Zahlstelle in der Schweiz ist die CACEIS Investor Services Bank S.A., Esch-sur-Alzette, Zweigniederlassung Zürich, Bleicherweg 7, CH-8027 Zürich.

### Bezugsort für maßgebliche Dokumente

Der Prospekt einschließlich Verwaltungsreglement, die Basisinformationsblätter sowie der Halbjahres- und Jahresbericht können kostenlos beim Vertreter in der Schweiz bezogen werden. Auf Anfrage ist beim Vertreter in der Schweiz eine kostenfreie Aufstellung mit detaillierten Angaben über sämtliche während des Geschäftsjahres getätigten Käufe und Verkäufe erhältlich.

### Total Expense Ratio

Die Gesamtkostenquote (TER) drückt die Summe der Kosten und Gebühren (mit Ausnahme der angefallenen Transaktionskosten) als Prozentsatz des durchschnittlichen Nettofondsvermögens innerhalb der letzten 12 Monate zum Geschäftsjahresende aus. Die Darstellung erfolgt sowohl inklusive als auch exklusive einer etwaig angefallenen Performance-Fees (PF).

Teilfonds	Aktien- klasse	Total Expense Ratio (exkl. PF)	Total Expense Ratio (inkl. PF)
Absolute Return Bond Fund ESG	A	1,14 %	1,14 %
Absolute Return Bond Fund ESG	C	1,14 %	1,14 %
Absolute Return Bond Fund ESG	B	0,64 %	0,64 %
Absolute Return Bond Fund ESG	D	0,64 %	0,64 %
Absolute Return Bond Fund ESG	X	0,25 %	0,25 %
Absolute Return Bond Fund Plus ESG	A	1,24 %	1,55 %
Absolute Return Bond Fund Plus ESG	C	1,21 %	1,29 %
Absolute Return Bond Fund Plus ESG	B	0,71 %	0,71 %
Absolute Return Bond Fund Plus ESG	D	0,66 %	0,81 %
Absolute Return Bond Fund Plus ESG	X	0,23 %	0,23 %
Absolute Return Bond Fund Plus ESG	E	1,20 %	1,31 %
Emerg. Equ. / Aktien Schwellenländer ESG	A	1,51 %	2,64 %
Emerg. Equ. / Aktien Schwellenländer ESG	B	1,11 %	1,11 %
Emerg. Equ. / Aktien Schwellenländer ESG	X	0,32 %	0,32 %
Emerg. Equ. / Aktien Schwellenländer ESG	E	1,11 %	1,11 %
Emerg. Equ. / Aktien Schwellenländer ESG	C	0,78 %	0,78 %
European Equity / Aktien Europa ESG	A	1,28 %	2,30 %
European Equity / Aktien Europa ESG	B	0,88 %	0,88 %
European Equity / Aktien Europa ESG	X	0,29 %	0,29 %
Global Equity / Aktien Welt ESG	A	1,32 %	1,79 %
Global Equity / Aktien Welt ESG	C	1,61 %	2,20 %
Global Equity / Aktien Welt ESG	B	0,86 %	0,86 %
Global Equity / Aktien Welt ESG	X	0,22 %	0,22 %

Die Berechnung und Offenlegung der Total Expense Ratio entspricht der AMAS-Richtlinie vom 16. Mai 2008 (Stand 5. August 2021).

Die Kennziffer (TER) erfasst entsprechend internationaler Gepflogenheiten die auf Ebene des Sondervermögens angefallenen Kosten (ohne Transaktionskosten).

Eine synthetische TER wird in diesem Bericht nicht ausgewiesen, da der Anteil der Zielfonds zum Berichtsstichtag kleiner 10% des Nettofondsvermögens war.

## Zusatzinformationen für Anleger in der Schweiz (ungeprüft)

### Bemerkung zur TER inklusive Performancegebühr

Wie im Prospekt festgehalten ist, erhält der Fondsmanager neben der fixen Fondsmanagementvergütung eine leistungsabhängige Vergütung (Performance-Fee). Diese wird ausbezahlt, sofern im jeweiligen Fiskaljahr die realisierte Performance des Teilfonds über die Performance der kostenbereinigten Benchmarks (Hürde) hinausgeht. In dieser Situation fährt der Endanleger mit aktiven Anlagestrategien im Vergleich zu passiven Anlagestrategien besser.

#### Für die Teilfonds

- Swiss Rock (Lux) Sicav - Global Equity / Aktien Welt ESG
- Swiss Rock (Lux) Sicav - European Equity / Aktien Europa ESG
- Swiss Rock (Lux) Sicav - Emerging Equity / Aktien Schwellenländer ESG

erhält der Fondsmanager 20% der über die Benchmark hinausgehenden zusätzlich erwirtschafteten Performance, 80% dieses zusätzlichen Ertrages geht an die Endkunden bzw. verbleibt im Teilfonds. Für den Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund Plus ESG erhält der Fondsmanager 10% der über die Benchmark hinausgehenden zusätzlich erwirtschafteten Performance, 90% dieses zusätzlichen Ertrages geht an die Endkunden bzw. verbleibt im Teilfonds. Aus gesetzlichen Gründen wird der an den Fondsmanager ausbezahlte Performance Betrag in der Kennziffer „TER inklusive Performancegebühr“ der TER hinzugeschlagen. Faktisch ist es allerdings so, dass eine derart definierte Performancegebühr die Endkunden immer besser stellt, als eine Situation, in der die Performancegebühr nicht zur Anwendung kommt. Darüber hinaus leistet die so definierte Performancegebühr positive Beiträge zur Reduktion der in der normalen TER ausgewiesenen Kosten. Das kann sogar soweit gehen, dass die Überperformance sämtliche Kosten mehr als deckt und dem Endanleger für die Teilnahme an den Märkten überhaupt keine Kosten mehr entstehen.

### Performance-Kennzahlen (Stand: 30.06.2024)

Teilfonds	Aktien- klasse	2024	2023	2022
Absolute Return Bond Fund ESG	A	5,33 %	2,05 %	-5,24 %
Absolute Return Bond Fund ESG	C	2,94 %	0,74 %	-5,31 %
Absolute Return Bond Fund ESG	B	5,76 %	2,59 %	-4,74 %
Absolute Return Bond Fund ESG	D	3,40 %	1,29 %	-4,62 %
Absolute Return Bond Fund ESG	X	4,74 %	0,49 %	-12,70 %
Absolute Return Bond Fund Plus ESG	A	5,66 %	3,31 %	-5,08 %
Absolute Return Bond Fund Plus ESG	C	3,34 %	1,96 %	-5,84 %
Absolute Return Bond Fund Plus ESG	B	6,31 %	3,85 %	-5,21 %
Absolute Return Bond Fund Plus ESG	D	3,82 %	2,62 %	-5,42 %
Absolute Return Bond Fund Plus ESG	X	5,38 %	1,79 %	-13,04 %
Absolute Return Bond Fund Plus ESG	E	7,30 %	5,84 %	-4,41 %
Emerg. Equ. / Aktien Schwellenländer ESG	A	14,65 %	-2,47 %	-12,22 %
Emerg. Equ. / Aktien Schwellenländer ESG	B	16,09 %	-1,43 %	-10,74 %
Emerg. Equ. / Aktien Schwellenländer ESG	X	15,46 %	-3,13 %	-17,87 %
Emerg. Equ. / Aktien Schwellenländer ESG	E	14,05 %	2,91 %	-21,39 %
Emerg. Equ. / Aktien Schwellenländer ESG	C	13,23 %	0,50 % <sup>1)</sup>	-
European Equity / Aktien Europa ESG	A	16,51 %	15,36 %	-7,84 %
European Equity / Aktien Europa ESG	B	17,98 %	16,13 %	-7,46 %
European Equity / Aktien Europa ESG	X	18,63 %	16,83 %	-6,92 %
Global Equity / Aktien Welt ESG	A	23,46 %	10,25 %	-3,65 %
Global Equity / Aktien Welt ESG	C	17,87 %	9,81 %	-13,54 %
Global Equity / Aktien Welt ESG	B	24,46 %	10,77 %	-3,18 %
Global Equity / Aktien Welt ESG	X	23,58 %	8,72 %	-11,06 %

<sup>1)</sup> Für den Zeitraum seit Erstausgabe am 8. Februar 2023 (Datum der ersten Anteilwertberechnung).

## Zusatzinformationen für Anleger in der Schweiz (ungeprüft)

Benchmark	Aktien- klasse	2024	2023	2022
Absolute Return Bond Fund Plus ESG	A	3,80 %	-0,02 %	-0,57 %
Absolute Return Bond Fund Plus ESG	C	1,62 %	-0,24 %	-0,72 %
Absolute Return Bond Fund Plus ESG	B	3,80 %	-0,02 %	-0,57 %
Absolute Return Bond Fund Plus ESG	D	1,62 %	-0,24 %	-0,72 %
Absolute Return Bond Fund Plus ESG	E	5,28 %	1,61 %	0,27 %
Emerg. Equ. / Aktien Schwellenländer ESG	A	11,85 %	-15,06 %	-14,80 %
Emerg. Equ. / Aktien Schwellenländer ESG	B	11,85 %	-15,06 %	-14,80 %
Emerg. Equ. / Aktien Schwellenländer ESG	X	10,36 %	-19,06 %	-22,21 %
Emerg. Equ. / Aktien Schwellenländer ESG	E	10,62 %	-20,29 %	-24,89 %
European Equity / Aktien Europa ESG	A	14,86 %	-10,81 %	-7,53 %
European Equity / Aktien Europa ESG	B	14,86 %	-10,81 %	-7,53 %
European Equity / Aktien Europa ESG	X	14,86 %	-10,81 %	-7,53 %
Global Equity / Aktien Welt ESG	A	22,85 %	-13,29 %	-3,15 %
Global Equity / Aktien Welt ESG	C	16,70 %	-18,07 %	-12,51 %

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

Als Benchmarks für die Messung der Überschussperformances der einzelnen Teilfonds gelten folgende kostenbereinigte Indices-performances:

Swiss Rock (Lux) Sicav - Emerging Equity / Aktien Schwellenländer ESG der Aktienklasse A:

- "MSCI EM ESG Universal Price Return Index in EUR"

Swiss Rock (Lux) Sicav - European Equity / Aktien Europa ESG der Aktienklasse A:

- "MSCI Europe ESG Universal Price EUR Index"

Swiss Rock (Lux) Sicav - Global Equity / Aktien Welt ESG der Aktienklasse A:

- "MSCI World ESG Universal Price Index in EUR"

Swiss Rock (Lux) Sicav - Global Equity / Aktien Welt ESG der Aktienklasse C:

- "MSCI World 100% Hedged to CHF Price Index"

Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund ESG:

- Der Fondsmanager des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund ESG erhält keine leistungsabhängige Vergütung (Performance-Fee).

Als Benchmark für die Messung der Überschussperformance für den Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund Plus ESG gilt folgender Referenzzinssatz im Interbankengeschäft:

Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund Plus ESG Aktienklasse A:

- "€STR (Euro Short-Term Rate – Volume Weighted Trimmed Mean Rate, Zinsmethode ACT/360)"

Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund Plus ESG Aktienklasse C und D:

- "SARON (Swiss Average Rate Overnight, Zinsmethode ACT/360)"

Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund Plus ESG Aktienklasse E:

- "SOFR (United States Secured Overnight Financing Rate, Zinsmethode ACT/360)"

## Zusatzinformationen für Anleger in der Schweiz (ungeprüft)

Für die Messung der Benchmark wurden folgende Bloomberg-Seiten zu Grunde gelegt:

- Swiss Rock (Lux) Sicav - Global Equity / Aktien Welt ESG - A: MXWOESU Index
- Swiss Rock (Lux) Sicav - Global Equity / Aktien Welt ESG - C: MBWOHCHF Index
- Swiss Rock (Lux) Sicav - European Equity / Aktien Europa ESG: PE712647 Index
- Swiss Rock (Lux) Sicav - Emerging Equity / Aktien Schwellenländer ESG: MXEFESU Index
- Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund Plus ESG - A : ESTRON Index
- Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund Plus ESG - C und D: SRFXON3 Index
- Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund Plus ESG - E: SOFRRATE Index

**Angaben zu Artikel 8 der Verordnung (EU) 2019/2088 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 27. November 2019 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (ungeprüft)**

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

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

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

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

Name des Produkts: **Swiss Rock (Lux) Sicav – Global Equity / Aktien Welt ESG**  
 Unternehmenskennung (LEI-Code): **5299009QJZEZH1ERO81**

**Ökologische und/oder soziale Merkmale**

**Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?**

<input checked="" type="checkbox"/> <input checked="" type="checkbox"/> <input type="checkbox"/> <b>Ja</b>	<input checked="" type="checkbox"/> <input type="checkbox"/> <input checked="" type="checkbox"/> <b>Nein</b>
<input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel</b> getätigt: __% <ul style="list-style-type: none"> <li><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> </ul> <input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel</b> getätigt: __%	<input type="checkbox"/> Es wurden <b>damit ökologische/soziale Merkmale beworben</b> und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es __% an nachhaltigen Investitionen <ul style="list-style-type: none"> <li><input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel</li> </ul> <input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber <b>keine nachhaltigen Investitionen getätigt.</b>



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

Es gab keine aktiven Verletzungen gegen die vom Finanzprodukt beworbenen positiven ökologischen und/oder sozialen Merkmale im Bezugszeitraum. Es wurde kein Index als Referenzwert für die Erreichung der mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale bestimmt.



**Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Die definierten Nachhaltigkeitsindikatoren wurden im Berichtszeitraum laufend im Pre- und Post-Trade Verfahren überwacht und geprüft. Etwaige, durch Datenveränderungen des vom Fondsmanager benutzten Anbieters für Nachhaltigkeits-Research aufgetretene Verstöße gegen die Ausschlusskriterien wurden geprüft und entsprechend gehandelt. Es gab keine aktiven Verstöße gegen die definierten Ausschlusskriterien.

## Angaben zu Artikel 8 der Verordnung (EU) 2019/2088 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 27. November 2019 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (ungeprüft)

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

Es sind keine signifikanten Ereignisse / Veränderungen im Vergleich der beiden Zeiträume zu verzeichnen.

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

Für den Teilfonds werden keine nachhaltigen Investitionen getätigt.

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

Für den Teilfonds werden keine nachhaltigen Investitionen getätigt.

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

### Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die Portfolioverwaltung berücksichtigt für das Teilfondsvermögen im Rahmen ihrer Investitionsentscheidungen sogenannte wesentliche nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren („PAI“).

Nachhaltigkeitsfaktoren bezeichnen in diesem Zusammenhang Umwelt-, Sozial- und Arbeitnehmerbelange, die Achtung der Menschenrechte und die Bekämpfung von Korruption und Bestechung. Die Berücksichtigung der PAI erfolgt im Rahmen der Investitionsentscheidungen für das Sondervermögen durch verbindliche Ausschlusskriterien. Im weiteren Verlauf dieses Dokuments, wird dargestellt, wie durch die jeweiligen Ausschlusskriterien negative Einflüsse auf die aufgeführten Nachhaltigkeitsfaktoren jeweils vermieden bzw. verringert werden sollen.

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

Nicht anwendbar, da für den Teilfonds keine nachhaltigen Investitionen getätigt werden.

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

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

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



## Angaben zu Artikel 8 der Verordnung (EU) 2019/2088 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 27. November 2019 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (ungeprüft)



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

Der Fondsmanager hat die folgenden Nachhaltigkeitsthemen als die wichtigsten negativen Nachhaltigkeitsauswirkungen-Indikatoren («Principal Adverse (Sustainability) Impacts/PAIs») identifiziert, auf die er sich konzentriert:

1. Klima- und umweltbezogene Indikatoren basierend auf den folgenden negativen Nachhaltigkeitsindikatoren:
  - Treibhausgasemissionen
  - Energieleistung
  - Carbon Footprint
2. Soziales und Mitarbeiter, Achtung der Menschenrechte, Korruptions- und Bestechungsbekämpfung, basierend auf den folgenden negativen Nachhaltigkeitsindikatoren:
  - Soziales und Arbeitnehmerfragen
  - Violation of UN Global Compact Principles
  - Exposition zu kontroversen Waffen

Die Priorisierung der PAIs (und der von den PAIs abgeleiteten Leistungsindikatoren «KPIs») sowie die damit verbundenen Kennzahlen können für verschiedene Anlageklassen variieren und es kann im Laufe der Zeit zu einer Neu-Priorisierung kommen. Dies hängt unter anderem damit zusammen, dass sowohl die Datenverfügbarkeit als auch die Datenqualität der PAIs je nach Anlageklasse variieren und sich im Laufe der Zeit weiterentwickeln werden.



### Was waren die wichtigsten Investitionen in dieses Finanzprodukt?

Dargestellt sind die größten 15 Investitionen zum Ende des Bezugszeitraums (30. Juni 2024).

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: Top-15 per 30.06.2024

Grösste Investitionen	In % des NAV	Sektor	Land
NVIDIA Corp. Registered Shares DL-,001	7,28	Semiconductors & Semiconductor	UNITED STATES
Microsoft Corp. Registered Shares DL-,00000625	5,88	Software	UNITED STATES
Apple Inc. Registered Shares o.N.	2,92	Technology Hardware, Storage &	UNITED STATES
Amazon.com Inc. Registered Shares DL -,01	2,14	Broadline Retail	UNITED STATES
Alphabet Inc. Reg. Shs Cl. A DL-,001	1,50	Interactive Media & Services	UNITED STATES
Eli Lilly and Company Registered Shares o.N.	1,33	Pharmaceuticals	UNITED STATES
Broadcom Inc. Registered Shares DL -,001	1,18	Semiconductors & Semiconductor	UNITED STATES
Novo-Nordisk AS Navne-Aktier B DK 0,1	1,04	Pharmaceuticals	DENMARK
Exxon Mobil Corp. Registered Shares o.N.	0,97	Oil, Gas & Consumable Fuels	UNITED STATES
Alphabet Inc. Reg. Shs Cap.Stk Cl. C DL-,001	0,95	Interactive Media & Services	UNITED STATES
ASML Holding N.V. Aandelen op naam EO -,09	0,89	Semiconductors & Semiconductor	NETHERLANDS
Home Depot Inc., The Registered Shares DL -,05	0,79	Specialty Retail	UNITED STATES
Costco Wholesale Corp. Registered Shares DL -,005	0,78	Consumer Staples Distribution	UNITED STATES
Merck & Co. Inc. Registered Shares DL-,01	0,77	Pharmaceuticals	UNITED STATES
Meta Platforms Inc. Reg.Shares Cl.A DL-,000006	0,74	Interactive Media & Services	UNITED STATES

# Angaben zu Artikel 8 der Verordnung (EU) 2019/2088 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 27. November 2019 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (ungeprüft)

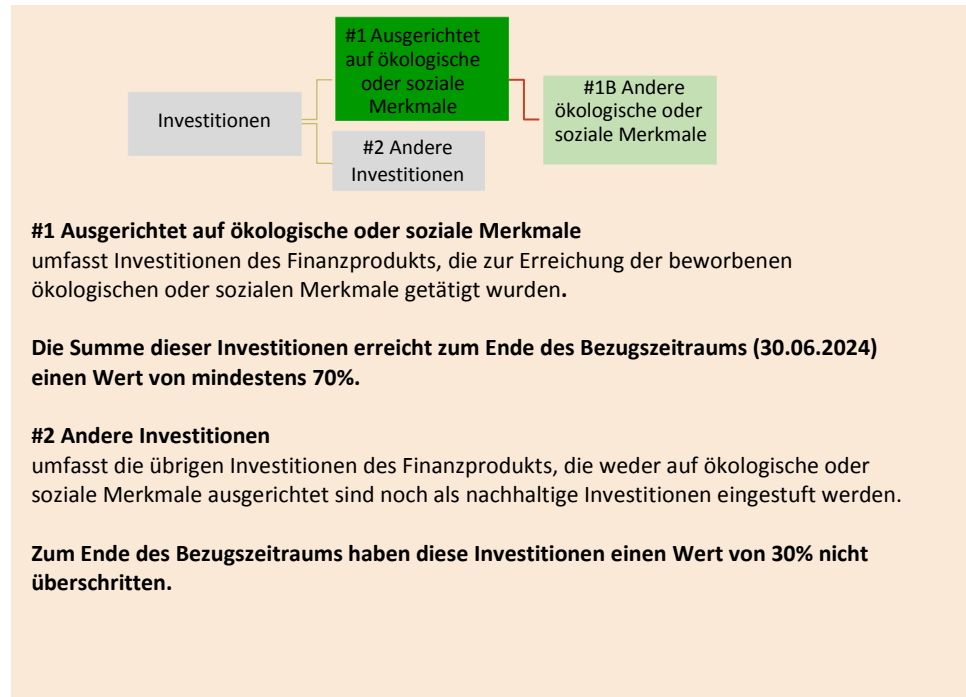


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Für den Teilfonds werden keine nachhaltigen Investitionen getätigt.

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

## Wie sah die Vermögensallokation aus?



**Angaben zu Artikel 8 der Verordnung (EU) 2019/2088 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 27. November 2019 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (ungeprüft)**

***In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?***

Dargestellt sind die Wirtschaftssektoren, die zusammen mehr als 90% der Investitionen zum Ende des Bezugszeitraums (30.06.2024) ausmachen.

Sektor	In % der Vermögenswerte
Semiconductors & Semiconductor	13.11
Software	11.41
Banks	6.00
Pharmaceuticals	5.29
Oil, Gas & Consumable Fuels	4.86
Interactive Media & Services	3.61
Technology Hardware, Storage &	3.38
Insurance	2.98
Specialty Retail	2.40
Broadline Retail	2.37
Health Care Providers & Servic	2.36
Consumer Staples Distribution	2.19
Financial Services	1.98
Health Care Equipment & Suppli	1.84
Consumer Finance	1.77
Chemicals	1.74
Building Products	1.69
Electrical Equipment	1.60
IT Services	1.54
Machinery	1.51
Electric Utilities	1.43
Beverages	1.41
Biotechnology	1.37
Capital Markets	1.29
Hotels, Restaurants & Leisure	1.22
Household Durables	1.07
Aerospace & Defense	1.04
Commercial Services & Supplies	1.00
Industrial Conglomerates	0.99
Ground Transportation	0.98
Communications Equipment	0.94
Textiles, Apparel & Luxury Goo	0.89
Multi-Utilities	0.87
Professional Services	0.83
Food Products	0.78
Metals & Mining	0.77

## Angaben zu Artikel 8 der Verordnung (EU) 2019/2088 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 27. November 2019 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (ungeprüft)

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln



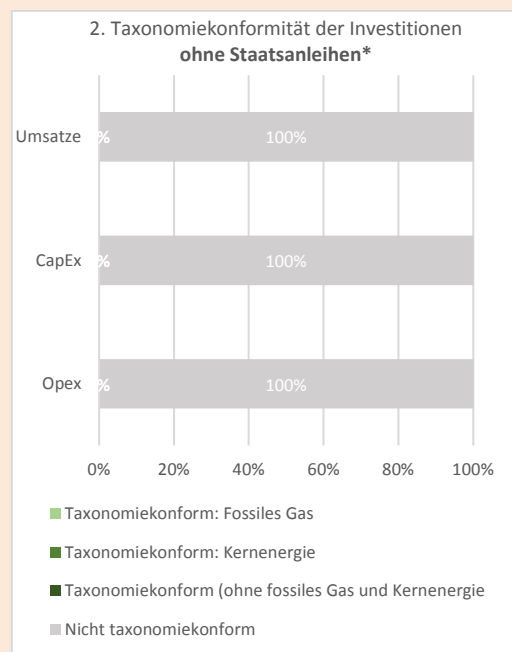
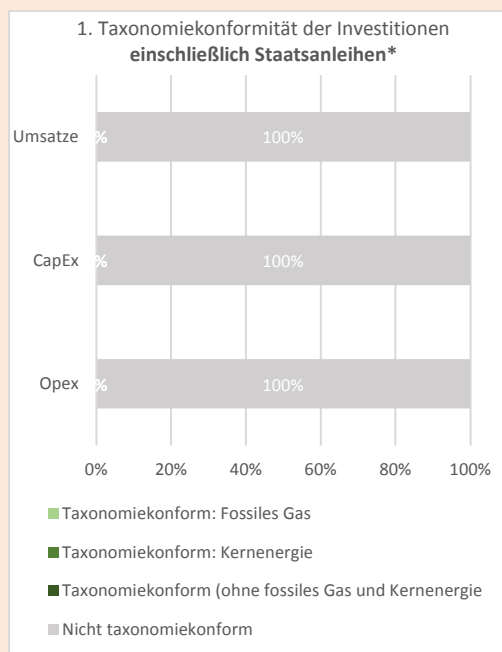
### Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Für den Teilfonds werden keine nachhaltigen Investitionen getätigt.

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

- Ja:
- In fossiles Gas     In Kernenergie
- Nein

*In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Mindestprozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie konform sind. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.*



\* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Mit Blick auf die EU Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für fossiles Gas die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für Kernenergie beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

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


**Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.


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

Der Fonds trägt nicht zu einem oder mehreren Umweltzielen gem. Art 9 der Verordnung (EU) 2020/852 („Taxonomieverordnung“) bei. Die dem Fonds zugrundeliegenden Investitionen sind nicht, d.h. zu 0 %, auf Wirtschaftstätigkeiten ausgerichtet, die gem. Art. 3 Verordnung (EU) 2020/852 („Taxonomieverordnung“) als ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten eingestuft sind.


<sup>1</sup> Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 1011/1214 der Kommission festgelegt.

## Angaben zu Artikel 8 der Verordnung (EU) 2019/2088 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 27. November 2019 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (ungeprüft)

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

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


Nicht anwendbar.

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

Ein Mindestanteil nachhaltiger Investitionen mit Umweltziel wurde nicht festgelegt.

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

Der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen lag bei mindestens 70%.

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

#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden. Unter „#2 Andere Investitionen“ fallen Barmittel, welche als zusätzliche Liquidität gehalten werden und Derivate welche der Absicherung dienen. Liquiditäts- und Derivatepositionen werden im Rahmen des ESG-Regelwerks nicht betrachtet und unterliegen somit keinem ökologischen oder sozialen Mindestschutz.



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

Die Einhaltung der Anlagegrundsätze mithilfe des Portfolio-Screenings, Analyse der Einzeltitel, sowie Analyse der Datenveränderungen im Nachhaltigkeits-Research wurde laufend vorgenommen und überwacht

Im Bezugszeitraum mussten keine Titel aufgrund von aktiven Verletzungen gegen die definierten Ausschlusskriterien verkauft oder getauscht werden.




- Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?**

Es wurde kein Index als Referenzwert für die Erreichung der mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale bestimmt.

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

-  **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**


Nicht anwendbar.

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

Nicht anwendbar.

-  **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**

Nicht anwendbar.

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

Nicht anwendbar.

**Angaben zu Artikel 8 der Verordnung (EU) 2019/2088 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 27. November 2019 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (ungeprüft)**

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

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

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

Name des Produkts: **Swiss Rock (Lux) Sicav – European Equity/Aktien Europa ESG**

Unternehmenskennung (LEI-Code): **5299005E6NOTUI38ZE05**

**Ökologische und/oder soziale Merkmale**

**Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?**

**Ja**

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: \_\_%

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: \_\_%

**Nein**

Es wurden **damit ökologische/soziale Merkmale beworben** und

obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es \_\_% an nachhaltigen Investitionen

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt.**



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

Es gab keine aktiven Verletzungen gegen die vom Finanzprodukt beworbenen positiven ökologischen und/oder sozialen Merkmale im Bezugszeitraum. Es wurde kein Index als Referenzwert für die Erreichung der mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale bestimmt.



**Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Die definierten Nachhaltigkeitsindikatoren wurden im Berichtszeitraum laufend im Pre- und Post-Trade Verfahren überwacht und geprüft. Etwaige, durch Datenveränderungen des vom Fondsmanager benutzten Anbieters für Nachhaltigkeits-Research aufgetretene Verstöße gegen die Ausschlusskriterien wurden geprüft und entsprechend gehandelt. Es gab keine aktiven Verstöße gegen die definierten Ausschlusskriterien.

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

## Angaben zu Artikel 8 der Verordnung (EU) 2019/2088 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 27. November 2019 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (ungeprüft)

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

Es sind keine signifikanten Ereignisse / Veränderungen im Vergleich der beiden Zeiträume zu verzeichnen.

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

Für den Teilfonds werden keine nachhaltigen Investitionen getätigt.

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

Für den Teilfonds werden keine nachhaltigen Investitionen getätigt.

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

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

Die Portfolioverwaltung berücksichtigt für das Teilfondsvermögen im Rahmen ihrer Investitionsentscheidungen sogenannte wesentliche nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren („PAI“).

Nachhaltigkeitsfaktoren bezeichnen in diesem Zusammenhang Umwelt-, Sozial- und Arbeitnehmerbelange, die Achtung der Menschenrechte und die Bekämpfung von Korruption und Bestechung. Die Berücksichtigung der PAI erfolgt im Rahmen der Investitionsentscheidungen für das Sondervermögen durch verbindliche Ausschlusskriterien. Im weiteren Verlauf dieses Dokuments, wird dargestellt, wie durch die jeweiligen Ausschlusskriterien negative Einflüsse auf die aufgeführten Nachhaltigkeitsfaktoren jeweils vermieden bzw. verringert werden sollen.

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

Nicht anwendbar, da für den Teilfonds keine nachhaltigen Investitionen getätigt werden.

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

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

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

## Angaben zu Artikel 8 der Verordnung (EU) 2019/2088 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 27. November 2019 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (ungeprüft)



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

Der Fondsmanager hat die folgenden Nachhaltigkeitsthemen als die wichtigsten negativen Nachhaltigkeitsauswirkungen-Indikatoren («Principal Adverse (Sustainability) Impacts/PAIs») identifiziert, auf die er sich konzentriert:

1. Klima- und umweltbezogene Indikatoren basierend auf den folgenden negativen Nachhaltigkeitsindikatoren:
  - Treibhausgasemissionen
  - Energieleistung
  - Carbon Footprint
2. Soziales und Mitarbeiter, Achtung der Menschenrechte, Korruptions- und Bestechungsbekämpfung, basierend auf den folgenden negativen Nachhaltigkeitsindikatoren:
  - Soziales und Arbeitnehmerfragen
  - Violation of UN Global Compact Principles
  - Exposition zu kontroversen Waffen

Die Priorisierung der PAIs (und der von den PAIs abgeleiteten Leistungsindikatoren «KPIs») sowie die damit verbundenen Kennzahlen können für verschiedene Anlageklassen variieren und es kann im Laufe der Zeit zu einer Neu-Priorisierung kommen. Dies hängt unter anderem damit zusammen, dass sowohl die Datenverfügbarkeit als auch die Datenqualität der PAIs je nach Anlageklasse variieren und sich im Laufe der Zeit weiterentwickeln werden.



### Was waren die wichtigsten Investitionen in dieses Finanzprodukt?

Dargestellt sind die grössten 15 Investitionen zum Ende des Bezugszeitraums (30. Juni 2024).

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der grösste Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: Top-15 per 30.06.2024

Grösste Investitionen	In % des NAV	Sektor	Land
Novo-Nordisk AS Navne-Aktier B DK 0,1	5,51	Pharmaceuticals	DENMARK
ASML Holding N.V. Aandelen op naam EO -,09	4,76	Semiconductors & Semiconductor	NETHERLANDS
Novartis AG Namens-Aktien SF 0,49	2,77	Pharmaceuticals	SWITZERLAND
SAP SE Inhaber-Aktien o.N.	2,50	Software	GERMANY
LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE Actions Port. (C.R.) EO 0,3	2,10	Textiles, Apparel & Luxury Goo	FRANCE
Shell PLC Reg. Shares Class EO -,07	2,08	Oil, Gas & Consumable Fuels	BRITAIN
AstraZeneca PLC Registered Shares DL -,25	1,95	Pharmaceuticals	BRITAIN
Siemens AG Namens-Aktien o.N.	1,69	Industrial Conglomerates	GERMANY
TotalEnergies SE Actions au Porteur EO 2,50	1,62	Oil, Gas & Consumable Fuels	FRANCE
HSBC Holdings PLC Registered Shares DL -,50	1,57	Banks	BRITAIN
Schneider Electric SE Actions Port. EO 4	1,53	Electrical Equipment	FRANCE
Allianz SE vink.Namens-Aktien o.N.	1,25	Insurance	GERMANY
Iberdrola S.A. Acciones Port. EO -,75	1,22	Electric Utilities	SPAIN
Roche Holding AG Inhaber-Genußscheine o.N.	1,19	Pharmaceuticals	SWITZERLAND
ABB Ltd. Namens-Aktien SF 0,12	1,18	Electrical Equipment	SWITZERLAND



# Angaben zu Artikel 8 der Verordnung (EU) 2019/2088 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 27. November 2019 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (ungeprüft)

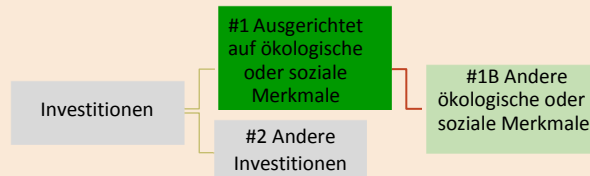


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Für den Teilfonds werden keine nachhaltigen Investitionen getätigt.

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

## Wie sah die Vermögensallokation aus?



### #1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale

umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

**Die Summe dieser Investitionen erreicht zum Ende des Bezugszeitraums (30.06.2024) einen Wert von mindestens 70%.**

### #2 Andere Investitionen

umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

**Zum Ende des Bezugszeitraums haben diese Investitionen einen Wert von 30% nicht überschritten.**

## In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Dargestellt sind die Wirtschaftssektoren, die zusammen mehr als 90% der Investitionen zum Ende des Bezugszeitraums (30.06.2024) ausmachen.

Sektor	In % der Vermögenswerte
Pharmaceuticals	12.79
Banks	9.06
Insurance	5.69
Oil, Gas & Consumable Fuels	5.49
Semiconductors & Semiconductor	5.45
Machinery	4.02
Textiles, Apparel & Luxury Goods	3.72
Capital Markets	3.42
Electrical Equipment	3.38
Software	2.92
Electric Utilities	2.52
Construction Materials	2.44
Aerospace & Defense	2.42
Beverages	2.34
Food Products	2.06
Industrial Conglomerates	1.93
Chemicals	1.86
Personal Care Products	1.82
Consumer Staples Distribution	1.79
Professional Services	1.78
Building Products	1.71
Hotels, Restaurants & Leisure	1.58
Media	1.37
Specialty Retail	1.33
Automobiles	1.32
Multi-Utilities	1.28
Construction & Engineering	1.20
Diversified Telecommunication	0.97
IT Services	0.86
Automobile Components	0.85
Trading Companies & Distributors	0.72

# Angaben zu Artikel 8 der Verordnung (EU) 2019/2088 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 27. November 2019 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (ungeprüft)

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

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

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

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



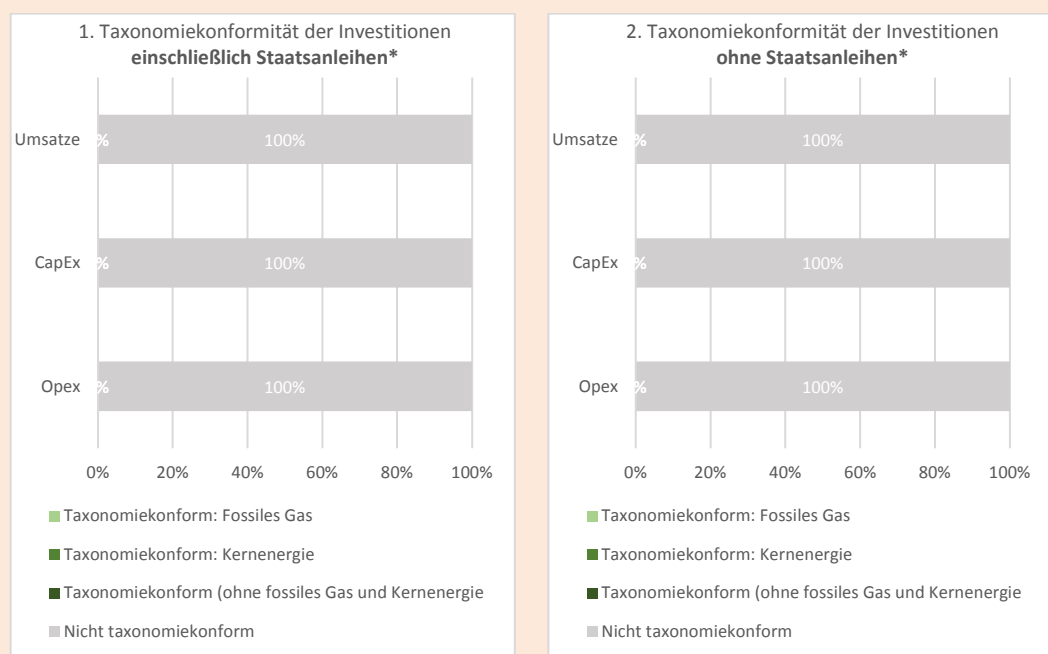
## Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Für den Teilfonds werden keine nachhaltigen Investitionen getätigt.

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

- Ja:
- In fossiles Gas
  - In Kernenergie
- Nein

*In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Mindestprozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie konform sind. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.*




\* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.


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

Der Fonds trägt nicht zu einem oder mehreren Umweltzielen gem. Art 9 der Verordnung (EU) 2020/852 („Taxonomieverordnung“) bei. Die dem Fonds zugrundeliegenden Investitionen sind nicht, d.h. zu 0 %, auf Wirtschaftstätigkeiten ausgerichtet, die gem. Art. 3 Verordnung (EU) 2020/852 („Taxonomieverordnung“) als ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten eingestuft sind.


<sup>1</sup> Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 1011/1214 der Kommission festgelegt.

## Angaben zu Artikel 8 der Verordnung (EU) 2019/2088 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 27. November 2019 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (ungeprüft)


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

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


Nicht anwendbar.

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

Ein Mindestanteil nachhaltiger Investitionen mit Umweltziel wurde nicht festgelegt.

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

Der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen lag bei mindestens 70%.

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

#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden. Unter „#2 Andere Investitionen“ fallen Barmittel, welche als zusätzliche Liquidität gehalten werden und Derivate welche der Absicherung dienen. Liquiditäts- und Derivatepositionen werden im Rahmen des ESG-Regelwerks nicht betrachtet und unterliegen somit keinem ökologischen oder sozialen Mindestschutz.



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

Die Einhaltung der Anlagegrundsätze mithilfe des Portfolio-Screenings, Analyse der Einzeltitel, sowie Analyse der Datenveränderungen im Nachhaltigkeits-Research wurde laufend vorgenommen und überwacht

Im Bezugszeitraum mussten keine Titel aufgrund von aktiven Verletzungen gegen die definierten Ausschlusskriterien verkauft oder getauscht werden.




- Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?**

Es wurde kein Index als Referenzwert für die Erreichung der mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale bestimmt.

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

-  **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

Nicht anwendbar.

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

Nicht anwendbar.

-  **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**

Nicht anwendbar.

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

Nicht anwendbar.

**Angaben zu Artikel 8 der Verordnung (EU) 2019/2088 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 27. November 2019 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (ungeprüft)**

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

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

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

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

Name des Produkts: **Swiss Rock (Lux) Sicav – Emerging Equity / Aktien Schwellenländer ESG**  
 Unternehmenskennung (LEI-Code): **5299003EALIDWIU58Z35**

**Ökologische und/oder soziale Merkmale**

**Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?**

**Ja**

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: \_\_%

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: \_\_%

**Nein**

Es wurden **damit ökologische/soziale Merkmale beworben** und

obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es \_\_% an nachhaltigen Investitionen

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt.**



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

Es gab keine aktiven Verletzungen gegen die vom Finanzprodukt beworbenen positiven ökologischen und/oder sozialen Merkmale im Bezugszeitraum. Es wurde kein Index als Referenzwert für die Erreichung der mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale bestimmt.



**Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Die definierten Nachhaltigkeitsindikatoren wurden im Berichtszeitraum laufend im Pre- und Post-Trade Verfahren überwacht und geprüft. Etwaige, durch Datenveränderungen des vom Fondsmanager benutzten Anbieters für Nachhaltigkeits-Research aufgetretene Verstöße gegen die Ausschlusskriterien wurden geprüft und entsprechend gehandelt. Es gab keine aktiven Verstöße gegen die definierten Ausschlusskriterien.

## Angaben zu Artikel 8 der Verordnung (EU) 2019/2088 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 27. November 2019 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (ungeprüft)

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

Es sind keine signifikanten Ereignisse / Veränderungen im Vergleich der beiden Zeiträume zu verzeichnen.

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

Für den Teilfonds werden keine nachhaltigen Investitionen getätigt.

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

Für den Teilfonds werden keine nachhaltigen Investitionen getätigt.

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

#### Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die Portfolioverwaltung berücksichtigt für das Teilfondsvermögen im Rahmen ihrer Investitionsentscheidungen sogenannte wesentliche nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren („PAI“).

Nachhaltigkeitsfaktoren bezeichnen in diesem Zusammenhang Umwelt-, Sozial- und Arbeitnehmerbelange, die Achtung der Menschenrechte und die Bekämpfung von Korruption und Bestechung. Die Berücksichtigung der PAI erfolgt im Rahmen der Investitionsentscheidungen für das Sondervermögen durch verbindliche Ausschlusskriterien. Im weiteren Verlauf dieses Dokuments, wird dargestellt, wie durch die jeweiligen Ausschlusskriterien negative Einflüsse auf die aufgeführten Nachhaltigkeitsfaktoren jeweils vermieden bzw. verringert werden sollen.

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

Nicht anwendbar, da für den Teilfonds keine nachhaltigen Investitionen getätigt werden.

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

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

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

## Angaben zu Artikel 8 der Verordnung (EU) 2019/2088 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 27. November 2019 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (ungeprüft)



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

Der Fondsmanager hat die folgenden Nachhaltigkeitsthemen als die wichtigsten negativen Nachhaltigkeitsauswirkungen-Indikatoren («Principal Adverse (Sustainability) Impacts/PAIs») identifiziert, auf die er sich konzentriert:

1. Klima- und umweltbezogene Indikatoren basierend auf den folgenden negativen Nachhaltigkeitsindikatoren:
  - Treibhausgasemissionen
  - Energieleistung
  - Carbon Footprint
2. Soziales und Mitarbeiter, Achtung der Menschenrechte, Korruptions- und Bestechungsbekämpfung, basierend auf den folgenden negativen Nachhaltigkeitsindikatoren:
  - Soziales und Arbeitnehmerfragen
  - Violation of UN Global Compact Principles
  - Exposition zu kontroversen Waffen

Die Priorisierung der PAIs (und der von den PAIs abgeleiteten Leistungsindikatoren «KPIs») sowie die damit verbundenen Kennzahlen können für verschiedene Anlageklassen variieren und es kann im Laufe der Zeit zu einer Neu-Priorisierung kommen. Dies hängt unter anderem damit zusammen, dass sowohl die Datenverfügbarkeit als auch die Datenqualität der PAIs je nach Anlageklasse variieren und sich im Laufe der Zeit weiterentwickeln werden.



### Was waren die wichtigsten Investitionen in dieses Finanzprodukt?

Dargestellt sind die größten 15 Investitionen zum Ende des Bezugszeitraums (30. Juni 2024):

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: Top-15 per 30.06.2024

Grösste Investitionen	In % des NAV	Sektor	Land
UTI Gold.PLC-UTI Ind.Dyn.Eq.Fd Reg. Shares EUR Class o.N.	9,59	Equity Fund	IRELAND
Taiwan Semiconduct.Manufact.Co Reg.Shs (Spons.ADRs)/5 TA 10	3,63	Semiconductors & Semiconductor	TAIWAN
Samsung Electronics Co. Ltd. Registered Shares SW 100	3,45	Technology Hardware, Storage &	SOUTH KOREA
Tencent Holdings Ltd. Reg. Shares HD -,00002	3,12	Interactive Media & Services	CHINA
Taiwan Semiconduct.Manufact.Co Registered Shares TA 10	2,99	Semiconductors & Semiconductor	TAIWAN
Reliance Industries Ltd. Reg.Eqy Shs(GDRs 144A)/2 IR 10	1,90	Oil, Gas & Consumable Fuels	INDIA
SK Hynix Inc. Registered Shares SW 5000	1,55	Semiconductors & Semiconductor	SOUTH KOREA
ICICI Bank Ltd. Reg.Shs (Spons.ADRs)/2 IR 10	1,51	Banks	INDIA
Hon Hai Precision Ind. Co.Ltd. Registered Shares TA 10	1,39	Electronic Equipment, Instrume	TAIWAN
China Construction Bank Corp. Registered Shares H YC 1	1,36	Banks	CHINA
Industr. & Commerc.Bk of China Registered Shares H YC 1	1,28	Banks	CHINA
Dr Reddy's Laboratories Ltd. Reg. Shares (Sp.ADRs)/1 IR 5	1,13	Pharmaceuticals	INDIA
Alibaba Group Holding Ltd. Registered Shares o.N.	1,08	Broadline Retail	CHINA
KB Financial Group Inc. Registered Shares SW 5000	1,06	Banks	SOUTH KOREA
CTBC Financial Holding Co.Ltd. Registered Shares TA 10	0,99	Banks	TAIWAN

# Angaben zu Artikel 8 der Verordnung (EU) 2019/2088 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 27. November 2019 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (ungeprüft)

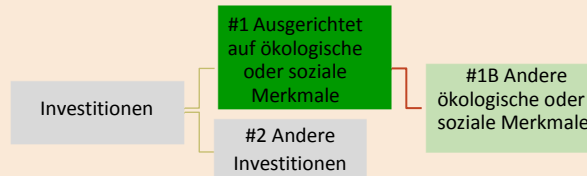


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Für den Teilfonds werden keine nachhaltigen Investitionen getätigt.

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

## Wie sah die Vermögensallokation aus?



### #1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale

umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

**Die Summe dieser Investitionen erreicht zum Ende des Bezugszeitraums (30.06.2024) einen Wert von mindestens 70%.**

### #2 Andere Investitionen

umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

**Zum Ende des Bezugszeitraums haben diese Investitionen einen Wert von 30% nicht überschritten.**

## In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Dargestellt sind die Wirtschaftssektoren, die zusammen mehr als 90% der Investitionen zum Ende des Bezugszeitraums (30.06.2024) ausmachen.

Sektor	In % der Vermögenswerte
Banks	21.23
Semiconductors & Semiconductor	9.70
Equity Fund	9.59
Technology Hardware, Storage &	6.39
Oil, Gas & Consumable Fuels	5.20
Interactive Media & Services	3.24
Broadline Retail	3.20
Electronic Equipment, Instrume	2.80
Insurance	2.73
Pharmaceuticals	2.48
Food Products	2.31
Metals & Mining	2.08
Wireless Telecommunication Ser	1.84
Automobiles	1.72
Machinery	1.62
Industrial Conglomerates	1.52
Beverages	1.46
Specialty Retail	1.35
Diversified Telecommunication	1.25
IT Services	1.24
Construction & Engineering	1.12
Real Estate Management & Devel	1.06
Automobile Components	1.05
Marine Transportation	1.04
Electric Utilities	0.99
Textiles, Apparel & Luxury Goo	0.98
Consumer Staples Distribution	0.92

# Angaben zu Artikel 8 der Verordnung (EU) 2019/2088 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 27. November 2019 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (ungeprüft)

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

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

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

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



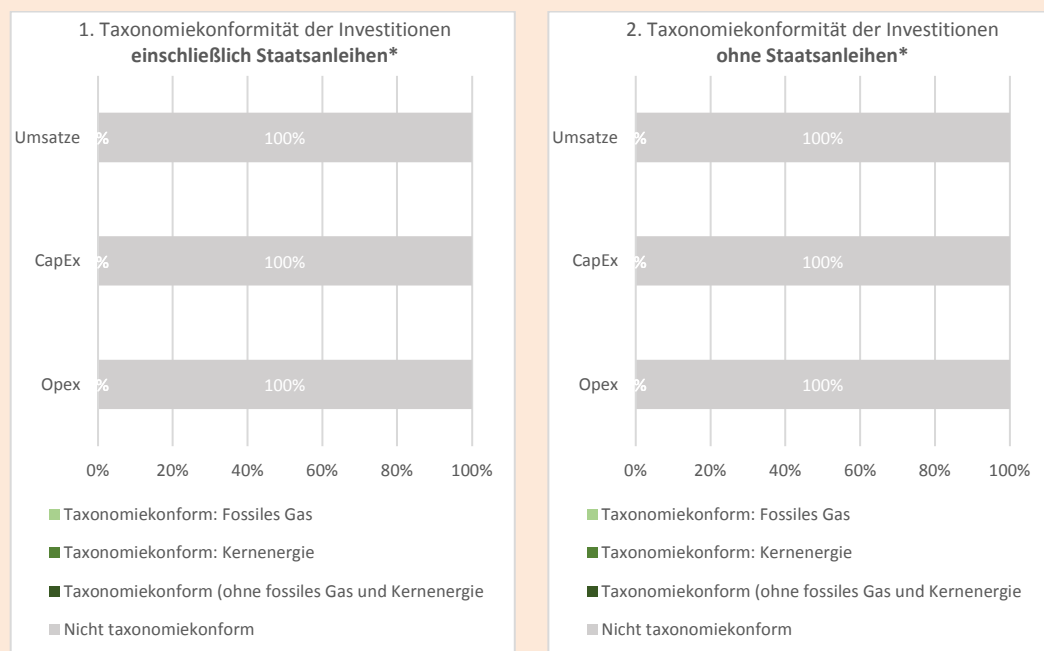
## Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Für den Teilfonds werden keine nachhaltigen Investitionen getätigt.

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

- Ja:
- In fossiles Gas     In Kernenergie
- Nein

*In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Mindestprozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie konform sind. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.*



\* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.


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


Der Fonds trägt nicht zu einem oder mehreren Umweltzielen gem. Art 9 der Verordnung (EU) 2020/852 („Taxonomieverordnung“) bei. Die dem Fonds zugrundeliegenden Investitionen sind nicht, d.h. zu 0 %, auf Wirtschaftstätigkeiten ausgerichtet, die gem. Art. 3 Verordnung (EU) 2020/852 („Taxonomieverordnung“) als ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten eingestuft sind.

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 1011/1214 der Kommission festgelegt.




## Angaben zu Artikel 8 der Verordnung (EU) 2019/2088 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 27. November 2019 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (ungeprüft)

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

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


Nicht anwendbar.

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

Ein Mindestanteil nachhaltiger Investitionen mit Umweltziel wurde nicht festgelegt.

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

Der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen lag bei mindestens 70%.

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

#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden. Unter „#2 Andere Investitionen“ fallen Barmittel, welche als zusätzliche Liquidität gehalten werden und Derivate welche der Absicherung dienen. Liquiditäts- und Derivatepositionen werden im Rahmen des ESG-Regelwerks nicht betrachtet und unterliegen somit keinem ökologischen oder sozialen Mindestschutz.



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

Die Einhaltung der Anlagegrundsätze mithilfe des Portfolio-Screenings, Analyse der Einzeltitel, sowie Analyse der Datenveränderungen im Nachhaltigkeits-Research wurde laufend vorgenommen und überwacht

Im Bezugszeitraum mussten keine Titel aufgrund von aktiven Verletzungen gegen die definierten Ausschlusskriterien verkauft oder getauscht werden.




- Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?**

Es wurde kein Index als Referenzwert für die Erreichung der mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale bestimmt.

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

-  **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**


Nicht anwendbar.

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

Nicht anwendbar.

-  **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**

Nicht anwendbar.

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

Nicht anwendbar.

**Angaben zu Artikel 8 der Verordnung (EU) 2019/2088 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 27. November 2019 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (ungeprüft)**

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

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

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

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

Name des Produkts: **Swiss Rock (Lux) Sicav – Absolute Return Bond Fund ESG**

Unternehmenskennung (LEI-Code): **529900UG6MKO0GTWU739**

**Ökologische und/oder soziale Merkmale**

**Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?**

**Ja**

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: \_\_%

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: \_\_%

**Nein**

Es wurden **damit ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es \_\_% an nachhaltigen Investitionen

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.



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

Es gab keine aktiven Verletzungen gegen die vom Finanzprodukt beworbenen positiven ökologischen und/oder sozialen Merkmale im Bezugszeitraum. Es wurde kein Index als Referenzwert für die Erreichung der mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale bestimmt.



**Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Die definierten Nachhaltigkeitsindikatoren wurden im Berichtszeitraum laufend im Pre- und Post-Trade Verfahren überwacht und geprüft. Etwaige, durch Datenveränderungen des vom Fondsmanager benutzten Anbieters für Nachhaltigkeits-Research aufgetretene Verstöße gegen die Ausschlusskriterien wurden geprüft und entsprechend gehandelt. Es gab keine aktiven Verstöße gegen die definierten Ausschlusskriterien.

## Angaben zu Artikel 8 der Verordnung (EU) 2019/2088 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 27. November 2019 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (ungeprüft)

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

Es sind keine signifikanten Ereignisse / Veränderungen im Vergleich der beiden Zeiträume zu verzeichnen.

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

Für den Teilfonds werden keine nachhaltigen Investitionen getätigt.

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

Für den Teilfonds werden keine nachhaltigen Investitionen getätigt.

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

### Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die Portfolioverwaltung berücksichtigt für das Teilfondsvermögen im Rahmen ihrer Investitionsentscheidungen sogenannte wesentliche nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren („PAI“).

Nachhaltigkeitsfaktoren bezeichnen in diesem Zusammenhang Umwelt-, Sozial- und Arbeitnehmerbelange, die Achtung der Menschenrechte und die Bekämpfung von Korruption und Bestechung. Die Berücksichtigung der PAI erfolgt im Rahmen der Investitionsentscheidungen für das Sondervermögen durch verbindliche Ausschlusskriterien. Im weiteren Verlauf dieses Dokuments, wird dargestellt, wie durch die jeweiligen Ausschlusskriterien negative Einflüsse auf die aufgeführten Nachhaltigkeitsfaktoren jeweils vermieden bzw. verringert werden sollen.

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

Nicht anwendbar, da für den Teilfonds keine nachhaltigen Investitionen getätigt werden.

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

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

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

## Angaben zu Artikel 8 der Verordnung (EU) 2019/2088 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 27. November 2019 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (ungeprüft)



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

Der Fondsmanager hat die folgenden Nachhaltigkeitsthemen als die wichtigsten negativen Nachhaltigkeitsauswirkungen-Indikatoren («Principal Adverse (Sustainability) Impacts/PAIs») identifiziert, auf die er sich konzentriert:

1. Klima- und umweltbezogene Indikatoren basierend auf den folgenden negativen Nachhaltigkeitsindikatoren:
  - Treibhausgasemissionen
  - Energieleistung
  - Carbon Footprint
2. Soziales und Mitarbeiter, Achtung der Menschenrechte, Korruptions- und Bestechungsbekämpfung, basierend auf den folgenden negativen Nachhaltigkeitsindikatoren:
  - Soziales und Arbeitnehmerfragen
  - Violation of UN Global Compact Principles
  - Exposition zu kontroversen Waffen

Die Priorisierung der PAIs (und der von den PAIs abgeleiteten Leistungsindikatoren «KPIs») sowie die damit verbundenen Kennzahlen können für verschiedene Anlageklassen variieren und es kann im Laufe der Zeit zu einer Neu-Priorisierung kommen. Dies hängt unter anderem damit zusammen, dass sowohl die Datenverfügbarkeit als auch die Datenqualität der PAIs je nach Anlageklasse variieren und sich im Laufe der Zeit weiterentwickeln werden.



### Was waren die wichtigsten Investitionen in dieses Finanzprodukt?

Dargestellt sind die größten 15 Investitionen zum Ende des Bezugszeitraums (30. Juni 2024):

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: Top-15 per 30.06.2024

Grösste Investitionen	In % des NAV	Sektor	Land
Frankreich EO-OAT 2014(24)	3,61	Sovereign	FRANCE
Plenum CAT Bond Fund Inhaber-Anteile P EUR o.N.	2,46	Debt Fund	LIECHTENSTEIN
Bundesrep.Deutschland Bundesschatzanw. v.23(25)	2,17	Sovereign	GERMANY
Kreditanst.f.Wiederaufbau Anl.v.2017 (2027)	2,05	Banks	GERMANY
Frankreich EO-OAT 2010(26)	1,76	Sovereign	FRANCE
Merck & Co. Inc. EO-Notes 2016(16/24)	1,01	Pharmaceuticals	UNITED STATES
Valero Energy Corp. DL-Notes 2018(18/28)	0,92	Oil, Gas & Consumable Fuels	UNITED STATES
Toronto-Dominion Bank, The EO-Medium-Term Notes 2022(32)	0,83	Banks	CANADA
Banco de Sabadell S.A. EO-FLR Preferred MTN 19(24/25)	0,72	Banks	SPAIN
Australia & N. Z. Bkg Grp Ltd. EO-FLR Med.-Term Nts 19(24/29)	0,72	Banks	AUSTRALIA
Goldman Sachs Group Inc., The EO-Medium-Term Nts 2016(24/25)	0,71	Capital Markets	UNITED STATES
Fresenius Medical Care KGaA MTN v.2018(2025/2025)	0,71	Health Care Providers & Servic	GERMANY
Valéo S.E. EO-Med.-Term Nts 2018(18/25)	0,71	Automobile Components	FRANCE
BMW Finance N.V. EO-Medium-Term Notes 2018(25)	0,71	Auto Manufacturers	NETHERLANDS
Cie Génle Étis Michelin SCpA EO-Obl. 2018(18/25)	0,71	Automobile Components	FRANCE

# Angaben zu Artikel 8 der Verordnung (EU) 2019/2088 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 27. November 2019 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (ungeprüft)

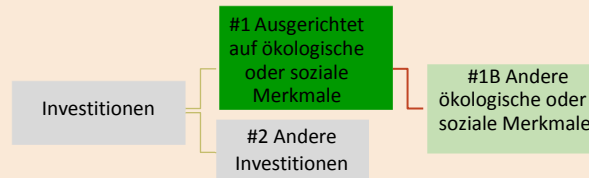


Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Für den Teilfonds werden keine nachhaltigen Investitionen getätigt.

## Wie sah die Vermögensallokation aus?



### #1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale

umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

**Die Summe dieser Investitionen erreicht zum Ende des Bezugszeitraums (30.06.2024) einen Wert von mindestens 90%.**

### #2 Andere Investitionen

umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

**Zum Ende des Bezugszeitraums haben diese Investitionen einen Wert von 10% nicht überschritten.**

**Angaben zu Artikel 8 der Verordnung (EU) 2019/2088 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 27. November 2019 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (ungeprüft)**

**In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Dargestellt sind die Wirtschaftssektoren, die zusammen mehr als 90% der Investitionen zum Ende des Bezugszeitraums (30.06.2024) ausmachen.

Sektor	In % der Vermögenswerte
Banks	19.09
Sovereign	10.62
Insurance	3.50
Auto Manufacturers	2.73
Capital Markets	2.68
Debt Fund	2.46
Oil, Gas & Consumable Fuels	2.12
Miscellaneous Manufactur	1.90
Diversified Telecommunication	1.83
Electrical Equipment	1.81
Commercial Services	1.79
Pharmaceuticals	1.66
Chemicals	1.64
Financial Services	1.56
Construction & Engineering	1.52
Building Materials	1.49
Health Care Providers & Servic	1.44
Hotels, Restaurants & Leisure	1.42
Automobile Components	1.41
Media	1.26
Food Products	1.26
Multi-Utilities	1.25
Building Products	1.14
Machinery	0.99
Agriculture	0.98
Diversified Finan Serv	0.97
Health Care Equipment & Suppli	0.94
Telecommunications	0.84
Transportation Infrastructure	0.81
Textiles, Apparel & Luxury Goo	0.79
Retail REITs	0.70
Containers & Packaging	0.68
Food	0.67
Gas Utilities	0.67
Real Estate Management & Devel	0.67
Consumer Staples Distribution	0.66
Oil&Gas	0.66
Software	0.64
Water	0.62
Wireless Telecommunication Ser	0.62
Computers	0.60
Packaging&Containers	0.57
Healthcare-Services	0.55
Transportation	0.52
Semiconductors & Semiconductor	0.50
Electric Utilities	0.44
IT Services	0.43
Professional Services	0.41
Real Estate	0.38
Construction Materials	0.35
Trading Companies & Distributo	0.30
Ground Transportation	0.29
REITS	0.29
Automobiles	0.29
Passenger Airlines	0.29
Marine Transportation	0.28
Life Sciences Tools & Services	0.27
Beverages	0.26
Oil&Gas Services	0.26
Diversified Consumer Services	0.24
Engineering&Construction	0.24
Healthcare-Products	0.24
Specialized REITs	0.23
Technology Hardware, Storage &	0.23

# Angaben zu Artikel 8 der Verordnung (EU) 2019/2088 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 27. November 2019 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (ungeprüft)

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln



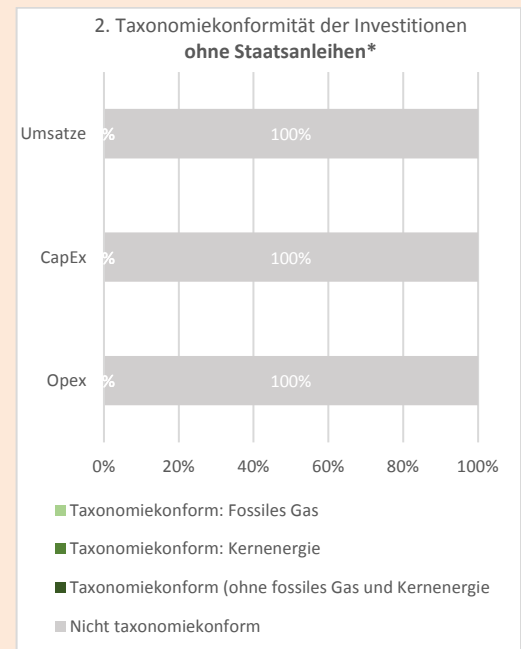
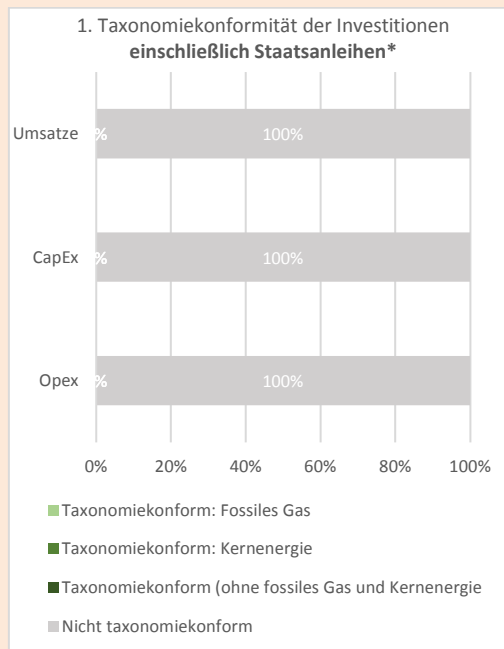
## Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Für den Teilfonds werden keine nachhaltigen Investitionen getätigt.

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

- Ja:
- In fossiles Gas     In Kernenergie
- Nein

*In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Mindestprozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie konform sind. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.*



\* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

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

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


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

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

Der Fonds trägt nicht zu einem oder mehreren Umweltzielen gem. Art 9 der Verordnung (EU) 2020/852 („Taxonomieverordnung“) bei. Die dem Fonds zugrundeliegenden Investitionen sind nicht, d.h. zu 0 %, auf Wirtschaftstätigkeiten ausgerichtet, die gem. Art. 3 Verordnung (EU) 2020/852 („Taxonomieverordnung“) als ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten eingestuft sind.

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 1011/1214 der Kommission festgelegt.

## Angaben zu Artikel 8 der Verordnung (EU) 2019/2088 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 27. November 2019 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (ungeprüft)

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

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

Nicht anwendbar.

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

Ein Mindestanteil nachhaltiger Investitionen mit Umweltziel wurde nicht festgelegt.

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

Der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen lag bei mindestens 90%.

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

#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden. Unter „#2 Andere Investitionen“ fallen Barmittel, welche als zusätzliche Liquidität gehalten werden und Derivate welche der Absicherung dienen. Liquiditäts- und Derivatepositionen werden im Rahmen des ESG-Regelwerks nicht betrachtet und unterliegen somit keinem ökologischen oder sozialen Mindestschutz.



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

Die Einhaltung der Anlagegrundsätze mithilfe des Portfolio-Screenings, Analyse der Einzeltitel, sowie Analyse der Datenveränderungen im Nachhaltigkeits-Research wurde laufend vorgenommen und überwacht

Im Bezugszeitraum mussten keine Titel aufgrund von aktiven Verletzungen gegen die definierten Ausschlusskriterien verkauft oder getauscht werden.



- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?**

Es wurde kein Index als Referenzwert für die Erreichung der mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale bestimmt.

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

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

Nicht anwendbar.

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

Nicht anwendbar.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**

Nicht anwendbar.

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

Nicht anwendbar.



**Angaben zu Artikel 8 der Verordnung (EU) 2019/2088 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 27. November 2019 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (ungeprüft)**

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

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

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

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

Name des Produkts: **Swiss Rock (Lux) Sicav – Absolute Return Bond Fund Plus ESG**

Unternehmenskennung (LEI-Code): **529900GEG9D6E7AFJJ30**

**Ökologische und/oder soziale Merkmale**

**Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?**

**Ja**

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: \_\_%

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: \_\_%

**Nein**

Es wurden **damit ökologische/soziale Merkmale beworben** und

obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es \_\_% an nachhaltigen Investitionen

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.



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

Es gab keine aktiven Verletzungen gegen die vom Finanzprodukt beworbenen positiven ökologischen und/oder sozialen Merkmale im Bezugszeitraum. Es wurde kein Index als Referenzwert für die Erreichung der mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale bestimmt.

**Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Die definierten Nachhaltigkeitsindikatoren wurden im Berichtszeitraum laufend im Pre- und Post-Trade Verfahren überwacht und geprüft. Etwaige, durch Datenveränderungen des vom Fondsmanager benutzten Anbieters für Nachhaltigkeits-Research aufgetretene Verstöße gegen die Ausschlusskriterien wurden geprüft und entsprechend gehandelt. Es gab keine aktiven Verstöße gegen die definierten Ausschlusskriterien.

## Angaben zu Artikel 8 der Verordnung (EU) 2019/2088 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 27. November 2019 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (ungeprüft)

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

Es sind keine signifikanten Ereignisse / Veränderungen im Vergleich der beiden Zeiträume zu verzeichnen.

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

Für den Teilfonds werden keine nachhaltigen Investitionen getätigt.

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

Für den Teilfonds werden keine nachhaltigen Investitionen getätigt.

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

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

Die Portfolioverwaltung berücksichtigt für das Teilfondsvermögen im Rahmen ihrer Investitionsentscheidungen sogenannte wesentliche nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren („PAI“).

Nachhaltigkeitsfaktoren bezeichnen in diesem Zusammenhang Umwelt-, Sozial- und Arbeitnehmerbelange, die Achtung der Menschenrechte und die Bekämpfung von Korruption und Bestechung. Die Berücksichtigung der PAI erfolgt im Rahmen der Investitionsentscheidungen für das Sondervermögen durch verbindliche Ausschlusskriterien. Im weiteren Verlauf dieses Dokuments, wird dargestellt, wie durch die jeweiligen Ausschlusskriterien negative Einflüsse auf die aufgeführten Nachhaltigkeitsfaktoren jeweils vermieden bzw. verringert werden sollen.

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

Nicht anwendbar, da für den Teilfonds keine nachhaltigen Investitionen getätigt werden.

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

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

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

## Angaben zu Artikel 8 der Verordnung (EU) 2019/2088 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 27. November 2019 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (ungeprüft)



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

Der Fondsmanager hat die folgenden Nachhaltigkeitsthemen als die wichtigsten negativen Nachhaltigkeitsauswirkungen-Indikatoren («Principal Adverse (Sustainability) Impacts/PAIs») identifiziert, auf die er sich konzentriert:

1. Klima- und umweltbezogene Indikatoren basierend auf den folgenden negativen Nachhaltigkeitsindikatoren:
  - Treibhausgasemissionen
  - Energieleistung
  - Carbon Footprint
2. Soziales und Mitarbeiter, Achtung der Menschenrechte, Korruptions- und Bestechungsbekämpfung, basierend auf den folgenden negativen Nachhaltigkeitsindikatoren:
  - Soziales und Arbeitnehmerfragen
  - Violation of UN Global Compact Principles
  - Exposition zu kontroversen Waffen

Die Priorisierung der PAIs (und der von den PAIs abgeleiteten Leistungsindikatoren «KPIs») sowie die damit verbundenen Kennzahlen können für verschiedene Anlageklassen variieren und es kann im Laufe der Zeit zu einer Neu-Priorisierung kommen. Dies hängt unter anderem damit zusammen, dass sowohl die Datenverfügbarkeit als auch die Datenqualität der PAIs je nach Anlageklasse variieren und sich im Laufe der Zeit weiterentwickeln werden.



### Was waren die wichtigsten Investitionen in dieses Finanzprodukt?

Dargestellt sind die größten 15 Investitionen zum Ende des Bezugszeitraums (30. Juni 2024):

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: Top-15 per 30.06.2024

Grösste Investitionen	↓↑	In % des NAV	Sektor	Land
Frankreich EO-OAT 2023(26)		4,04	Sovereign	FRANCE
Swisscanto(LU)Bd-Res.COCO Namens-Ant. DTH CHF o.N.		3,55	Debt Fund	LUXEMBOURG
Plenum CAT Bond Fund Inhaber-Anteile P EUR o.N.		2,53	Debt Fund	LIECHTENSTEIN
Bundesrep.Deutschland Bundesschatzanw. v.23(25)		1,53	Sovereign	GERMANY
Italien, Republik EO-B.T.P. 2020(36)		1,39	Sovereign	ITALY
FISCH Convert.Gbl Sustainable Namens-Anteile BE o.N.		1,09	Asset Allocation Fund	LUXEMBOURG
Frankreich EO-OAT 2010(26)		1,03	Sovereign	FRANCE
Valero Energy Corp. DL-Notes 2018(18/28)		0,65	Oil, Gas & Consumable Fuels	UNITED STATES
Banco de Sabadell S.A. EO-FLR Preferred MTN 19(24/25)		0,51	Banks	SPAIN
Procter & Gamble Co., The EO-Bonds 2024(24/34)		0,50	Household Products	UNITED STATES
Australia & N. Z. Bkg Grp Ltd. EO-FLR Med.-Term Nts 19(24/29)		0,50	Banks	AUSTRALIA
Fresenius Medical Care KGaA MTN v.2018(2025/2025)		0,50	Health Care Providers & Serv	GERMANY
Roche Finance Europe B.V. EO-Med.-Term Notes 2024(24/44)		0,50	Chemicals	NETHERLANDS
Kroatien, Republik EO-Notes 2017(30)		0,50	Sovereign	CROATIA
Valéo S.E. EO-Med.-Term Nts 2018(18/25)		0,50	Automobile Components	FRANCE

# Angaben zu Artikel 8 der Verordnung (EU) 2019/2088 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 27. November 2019 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (ungeprüft)

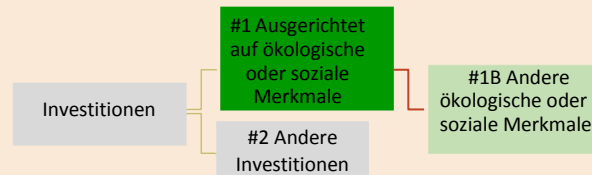


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Für den Teilfonds werden keine nachhaltigen Investitionen getätigt.

## Wie sah die Vermögensallokation aus?

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



### #1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale

umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

**Die Summe dieser Investitionen erreicht zum Ende des Bezugszeitraums (30.06.2024) einen Wert von mindestens 90%.**

### #2 Andere Investitionen

umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

**Zum Ende des Bezugszeitraums haben diese Investitionen einen Wert von 10% nicht überschritten.**

**Angaben zu Artikel 8 der Verordnung (EU) 2019/2088 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 27. November 2019 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (ungeprüft)**

***In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?***

Dargestellt sind die Wirtschaftssektoren, die zusammen mehr als 90% der Investitionen zum Ende des Bezugszeitraums (30.06.2024) ausmachen.

Sektor	In % der Vermögenswerte
Banks	15.35
Sovereign	10.79
Debt Fund	6.08
Chemicals	3.54
Insurance	3.40
Auto Manufacturers	1.94
Oil, Gas & Consumable Fuels	1.92
Commercial Services	1.91
Capital Markets	1.81
Hotels, Restaurants & Leisure	1.77
Automobile Components	1.75
Media	1.55
Financial Services	1.42
Miscellaneous Manufactur	1.33
Health Care Providers & Servic	1.29
Machinery	1.19
Asset Allocation Fund	1.09
Food Products	1.07
Construction & Engineering	1.07
Electrical Equipment	1.04
Telecommunications	1.04
Diversified Telecommunication	1.01
Water	1.01
Textiles, Apparel & Luxury Goo	0.94
Building Products	0.90
Specialized REITs	0.85
Agriculture	0.84
Packaging&Containers	0.80
Healthcare-Services	0.75
Building Materials	0.75
Multi-Utilities	0.70
Pharmaceuticals	0.69
Diversified Finan Serv	0.68
Containers & Packaging	0.64
Oil&Gas	0.61
Retail REITs	0.58
Transportation Infrastructure	0.57
Real Estate Management & Devel	0.55
Health Care Equipment & Suppli	0.55
Softw are	0.53
Construction Materials	0.53
Household Products	0.50
Beverages	0.50
Gas Utilities	0.47
Biotechnology	0.47
Semiconductors & Semiconductor	0.44
Computers	0.42
Consumer Staples Distribution	0.38
Real Estate	0.35
Wireless Telecommunication Ser	0.35
Engineering&Construction	0.34
Food	0.34
Technology Hardw are, Storage &	0.33
Broadline Retail	0.32
Electric Utilities	0.31
Life Sciences Tools & Services	0.31
Gas	0.31
Automobiles	0.30
Passenger Airlines	0.30
Retail	0.29
Paper & Forest Products	0.29
Pipelines	0.29
Professional Services	0.29
Investment Companies	0.28
Home Furnishings	0.28
Electric	0.27
Electronics	0.26
Healthcare-Products	0.25
Air Freight & Logistics	0.24
Trading Companies & Distributo	0.21
Ground Transportation	0.21
REITs	0.21
Lodging	0.19
Machinery-Diversified	0.18
Mining	0.18
Leisure Products	0.09
IT Services	0.09
Diversified Consumer Services	0.09
Metals & Mining	0.08
Health Care REITs	0.08

## Angaben zu Artikel 8 der Verordnung (EU) 2019/2088 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 27. November 2019 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (ungeprüft)

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

Mit Blick auf die EU Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für fossiles Gas die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für Kernenergie beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

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

**Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



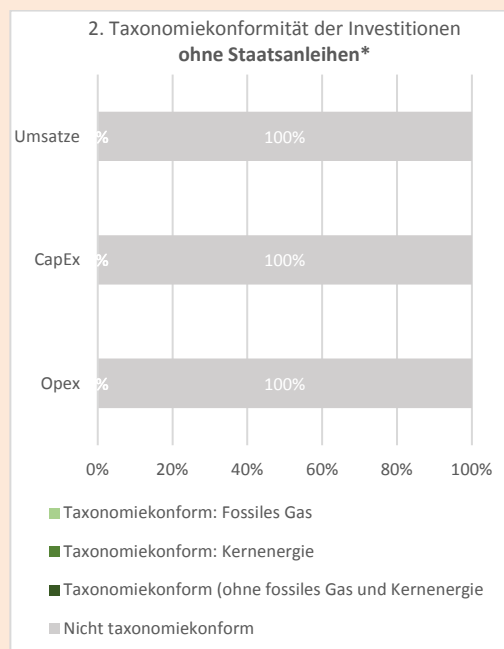
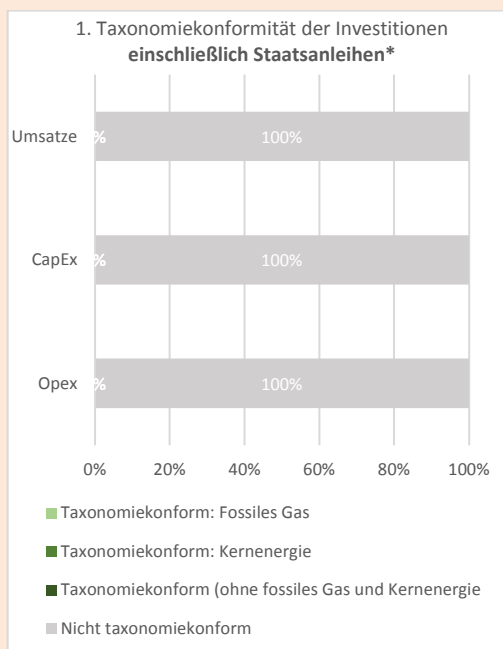
### Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Für den Teilfonds werden keine nachhaltigen Investitionen getätigt.

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

- Ja:
- In fossiles Gas     In Kernenergie
- Nein

*In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Mindestprozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie konform sind. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.*




\* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

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

Der Fonds trägt nicht zu einem oder mehreren Umweltzielen gem. Art 9 der Verordnung (EU) 2020/852 („Taxonomieverordnung“) bei. Die dem Fonds zugrundeliegenden Investitionen sind nicht, d.h. zu 0 %, auf Wirtschaftstätigkeiten ausgerichtet, die gem. Art. 3 Verordnung (EU) 2020/852 („Taxonomieverordnung“) als ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten eingestuft sind.

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 1011/1214 der Kommission festgelegt.

**Angaben zu Artikel 8 der Verordnung (EU) 2019/2088 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 27. November 2019 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (ungeprüft)**

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

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

Nicht anwendbar.



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

Ein Mindestanteil nachhaltiger Investitionen mit Umweltziel wurde nicht festgelegt.



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

Der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen lag bei mindestens 90%.



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

#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden. Unter „#2 Andere Investitionen“ fallen Barmittel, welche als zusätzliche Liquidität gehalten werden und Derivate welche der Absicherung dienen. Liquiditäts- und Derivatepositionen werden im Rahmen des ESG-Regelwerks nicht betrachtet und unterliegen somit keinem ökologischen oder sozialen Mindestschutz.



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

Die Einhaltung der Anlagegrundsätze mithilfe des Portfolio-Screenings, Analyse der Einzeltitel, sowie Analyse der Datenveränderungen im Nachhaltigkeits-Research wurde laufend vorgenommen und überwacht

Im Bezugszeitraum mussten keine Titel aufgrund von aktiven Verletzungen gegen die definierten Ausschlusskriterien verkauft oder getauscht werden.



- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?**

Es wurde kein Index als Referenzwert für die Erreichung der mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale bestimmt.

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

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

Nicht anwendbar.

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

Nicht anwendbar.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**

Nicht anwendbar.

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

Nicht anwendbar.