

**Halbjahresbericht  
zum 30. Juni 2022**

# **FutureFolio 55**

Verwaltungsgesellschaft



R.C.S. Luxembourg B 82 112

## Inhaltsverzeichnis

<b>Vermögensübersicht .....</b>	<b>1</b>
<b>Vermögensaufstellung.....</b>	<b>2</b>
<b>Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte .....</b>	<b>5</b>
<b>Anhang zum Halbjahresbericht.....</b>	<b>7</b>

## FutureFolio 55

Vermögensübersicht zum 30. Juni 2022

	Tageswert in EUR	% Anteil am Fondsvermögen
<b>I. Vermögensgegenstände</b>	<b>17.195.011,46</b>	<b>100,16</b>
1. Investmentanteile	14.132.083,28	82,32
Euro	14.132.083,28	82,32
2. Bankguthaben	3.062.928,18	17,84
<b>II. Verbindlichkeiten</b>	<b>-26.848,28</b>	<b>-0,16</b>
<b>III. Fondsvermögen</b>	<b>17.168.163,18</b>	<b>100,00</b>

## FutureFolio 55

### FutureFolio 55

#### Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2022

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2022	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
<b>Bestandspositionen</b>							<b>EUR</b>	<b>14.132.083,28</b>	<b>82,32</b>
<b>Investmentanteile</b>							<b>EUR</b>	<b>14.132.083,28</b>	<b>82,32</b>
<b>Gruppenfremde Investmentanteile</b>									
AIS-AM.IDX MSCI EUR.SRI PAB Act. Nom. DR A EUR Acc. oN	LU1861137484		ANT	5.068	360		EUR 63,3950	321.285,86	1,87
AIS-AM.WORLD SRI PAB Act.Nom. UCITS ETF DR (C)o.N.	LU1861134382		ANT	10.461	3.781		EUR 72,8540	762.125,69	4,44
AIS-Amundi MSCI EM SRI PAB Act. Nom. ETF DR USD Dis. oN	LU2059756754		ANT	615	615		EUR 47,7100	29.341,65	0,17
AXA World Fds-Gbl Fac.-Sus.Eq. Namens-Anteile ZI Cap.EUR o.N.	LU0943665348		ANT	2.586	202		EUR 265,3500	686.195,10	4,00
B.PE-JPM ESG EMU-Staat.IG 3-5Y Act. Nom. UCITS ETF EUR Acc.oN	LU2244387457		ANT	70.321	10.684		EUR 9,3379	656.650,47	3,82
BNP PARIBAS EASY-E.GI.E.B.Eco. Act. au Port. UE EUR Acc. oN	LU2194447293		ANT	18.185	18.185		EUR 13,6020	247.352,37	1,44
BNPPE-MSCI Wrlld SRI S-Ser.5%C. Nam.-Ant.UCITS ETF CAP EUR o.N	LU1615092217		ANT	44.118	44.118		EUR 15,7280	693.887,90	4,04
DPAM L-Bds.Govmt.Sustaina.Hed. Actions au Port.F Inst.Cap.oN	LU0336683767		ANT	381			EUR 1.458,4600	555.673,26	3,24
DWS Inv.-ESG Float.Rate Notes Act. au Port. IC EUR Acc. oN	LU1965927848		ANT	6.519	6.519		EUR 98,7500	643.751,25	3,75
DWS Invest-DWS Invest ESG WFW Act. au Port. XC EUR Acc. oN	LU2420982428		ANT	2.800	2.800		EUR 88,2800	247.184,00	1,44
Fran.LibertyQ Gl.Eq.SRI UC.ETF Registered Shares USD Acc.o.N.	IE00BF2B0N83		ANT	16.242	6.130		EUR 30,1100	489.046,62	2,85
Franklin Liberty EO GR.BD ETF Reg. Shares EUR Acc. o.N.	IE00BHZRR253		ANT	13.580			EUR 22,4530	304.911,74	1,78
Franklin Liberty EO Sh.Mat.ETF Reg. Shs EUR Dis. oN	IE00BFWWDY69		ANT	11.940	11.940		EUR 25,0540	299.144,76	1,74
iShs V-MSCI W.H.C.S.ESG U.ETF Reg. Shs USD Dis. oN	IE00BJ5JNZ06		ANT	43.442	43.442		EUR 6,2730	272.511,67	1,59
iShs VI-iSh.Edg.MSCI Wld M.V.E Reg. Shares USD (Acc) o.N.	IE00BKVL7778		ANT	126.042	4.703		EUR 5,5210	695.877,88	4,05
iShsII-EO C.Bd 0-3yr ESG U.ETF Registered Shares o.N.	IE00BYZTVV78		ANT	79.931			EUR 4,8424	387.057,87	2,25
iShsIV-MSCI Wld.SRI UCITS ETF Registered Shs EUR Acc. o.N.	IE00BYX2JD69		ANT	77.410	6.158		EUR 8,3020	642.657,82	3,74
LBBW Renten Short Term Nachha. Inhaber-Anteile I	DE000A2QDRK7		ANT	4.003			EUR 96,7700	387.370,31	2,26
MUL-Lyx.G.Gr.Bd 1-10Y(DR)U.ETF Namens-Anteile Acc.EUR o.N.	LU1981859819		ANT	18.089			EUR 17,6915	320.021,54	1,86
MUL-Lyxor N.Zero2050S&P W.Cl. Nam.-Ant. USD Acc.oN	LU2198882362		ANT	11.815	3.677	20.200	EUR 20,0250	236.595,38	1,38
nx-25 Indexfonds Inhaber-Ant.Klasse I	DE000A3CWRH1		ANT	2.788	2.788		EUR 79,6200	221.980,56	1,29
OSSIAM L.-O.EO G.Bds 3-5y C.R. Inh.-Ant. UCITS ETF 1C EUR o.N	LU2069380306		ANT	1.723	518		EUR 192,7950	332.185,79	1,94
Pictet - Smart City Namens-Anteile I dy EUR o.N.	LU0503634064		ANT	1.317	1.317		EUR 172,3800	227.024,46	1,32
Pictet - Timber Namens-Anteile I EUR o.N.	LU0340558823		ANT	1.043	1.043		EUR 226,7600	236.510,68	1,38
Riz.UCITS IC.-Sus.Fut.Food ETF Reg. Shs A USD Acc. oN	IE00BLRPQH31		ANT	57.538	5.796		EUR 4,0655	233.920,74	1,36
Robeco Cap.Gr.F-Sust Water Eq. Act. Nom. I EUR Acc. oN	LU2146192377		ANT	507	96		EUR 510,0700	258.605,49	1,51
Robeco Cap.Grow.Fd-Sm.Ener.Eq. Act. Nom. I EUR Acc. oN	LU2145462722		ANT	4.878	545		EUR 52,0500	253.899,90	1,48
U.(I.)E-S&P Div.Aris.ESG U.ETF Reg.Shs A Dis. USD o.N.	IE00BMP3HG27		ANT	5.312	5.312		EUR 9,0870	48.270,14	0,28
UBS(L)FS-JPM Gl.Gov.ESG Liq.Bd Act. Nom. H A EUR Acc. oN	LU1974694553		ANT	25.000			EUR 10,6780	266.950,00	1,56
UBS(L)FS-Sust.Dev.Bank Bds UE Act. Nom. A USD Dis. oN	LU1852212965		ANT	33.961	7.750		EUR 10,2010	346.436,16	2,02
Unilnstit.EO Cov.Bds4-6yrs Sus Inhaber-Anteile	DE0009757633		ANT	4.570			EUR 107,5400	491.457,80	2,86
VanEck Sust.World EQ.UC.ETF Aandelen oop naam o.N.	NL0010408704		ANT	25.376	1.835		EUR 25,6300	650.386,88	3,79
WI Global Challenges Index-Fds Inhaber-Anteile 1	DE000A0LGNP3		ANT	2.103	313		EUR 235,3600	494.962,08	2,88
Xtr.(IE)-MSCI World ESG Registered Shares 1C o.N.	IE00BZ02LR44		ANT	27.446	4.933		EUR 26,8800	737.748,48	4,30
Xtrackers II ESG EUR Corp.Bond Inhaber-Anteile 1D o.N.	LU0484968812		ANT	3.326			EUR 136,2300	453.100,98	2,64
<b>Summe Wertpapiervermögen</b>							<b>EUR</b>	<b>14.132.083,28</b>	<b>82,32</b>
<b>Bankguthaben / Bankverbindlichkeiten</b>							<b>EUR</b>	<b>3.062.928,18</b>	<b>17,84</b>
<b>Kassenbestände</b>							<b>EUR</b>	<b>3.062.928,18</b>	<b>17,84</b>
Verwahrstelle									
			EUR	3.060.950,14				3.060.950,14	17,83
			USD	2.067,84				1.978,04	0,01

## FutureFolio 55

### FutureFolio 55

Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2022

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2022	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>							EUR	<b>-26.848,28</b>	<b>-0,16</b>
Verwaltungsvergütung			EUR	-14.400,58				-14.400,58	-0,08
Verwahrstellenvergütung			EUR	-3.804,23				-3.804,23	-0,02
Prüfungskosten			EUR	-4.368,50				-4.368,50	-0,03
Sonstige Kosten			EUR	-4.274,97				-4.274,97	-0,03
<b>Fondsvermögen</b>							<b>EUR</b>	<b>17.168.163,18</b>	<b>100,00</b> <sup>1)</sup>
<b>FutureFolio 55 U</b>									
Anzahl Anteile							STK	71.585	
Anteilwert							EUR	108,88	
<b>FutureFolio 55 P</b>									
Anzahl Anteile							STK	87.694	
Anteilwert							EUR	106,89	

**Fußnoten:**

1) Durch Rundung der Prozent-Anteile bei der Berechnung können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.

Sofern das Sondervermögen im Berichtszeitraum andere Investmentanteile (Zielfonds) hielt, können weitere Kosten, Gebühren und Vergütungen auf Ebene der Zielfonds angefallen sein.

**FutureFolio 55**

**Wertpapierkurse bzw. Marktsätze**

Devisenkurse (in Mengennotiz)  
US-Dollar

(USD)

per 30.06.2022  
1,0454000

= 1 Euro (EUR)

## FutureFolio 55

### FutureFolio 55

Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen:  
 - Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schuldscheindarlehen (Marktzuordnung zum Berichtsstichtag):

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile Whg. in 1.000	Käufe bzw. Zugänge	Verkäufe bzw. Abgänge
<b>Investmentanteile</b>				
<b>Gruppenfremde Investmentanteile</b>				
BNP P.Easy-ECPI Circ.Econ.Ldrs Namens-Ant.UCITS ETF CAP o.N.	LU1953136527	ANT		15.364
Ca.Su.-Equ.Circular Economy Act. Nom. I EUR Acc. oN	LU2109441332	ANT	205	205
JSS II-JSS Sus.Equ.-Future H. Act. Nom. C EUR Acc. oN	LU2041625810	ANT		2.104
LBBW Gesund Leben Inhaber-Anteile I	DE000A2QDRQ4	ANT	2.657	2.657
Lupus alpha Sust.Convertib.Bds Inhaber-Anteile C	DE000A2DTNQ7	ANT		2.784
MULux-Lyx.EOGovtGr.Bd(DR)ETF Act. Nom. EUR Acc. oN	LU2356220926	ANT		42.902
Nordea 1-Emerging Stars Equity Actions Nom. BI-EUR o.N.	LU0602539271	ANT	525	3.461
RIZE-Env.Impact Opps ETF Reg. Shs ETF USD Acc. oN	IE00BLRPRR04	ANT	6.582	67.192
UBS(IrI)ETF-Glo. Gender Equal. Reg.Shs A Acc. EUR Hgd. o.N.	IE00BDR5H073	ANT		13.940
UBS(IrI)ETF-MSCI Wld Soc.Resp. Reg. Shs A Hedged EUR Acc. oN	IE00BK72HM96	ANT	11.253	64.827
UBS(L)FS-BB EO Inf.L.10+ U.ETF Namens-Ant. EUR A Dis. o.N.	LU1645381689	ANT		15.063

## FutureFolio 55

### FutureFolio 55

#### Anteilklassen im Überblick

<b>Merkmal</b>	<b>Anteilklasse P</b>	<b>Anteilklasse U</b>
Wertpapierkennnummer	A2N67J	A2N67H
ISIN-Code	DE000A2N67J9	DE000A2N67H3
Anteilklassenwährung	Euro	Euro
Erstausgabepreis	100,- EUR	100,- EUR
Erstausgabedatum	15. Februar 2019	15. Februar 2019
Ertragsverwendung	ausschüttend	ausschüttend
Ausgabeaufschlag	keiner	bis zu 3,00%
Rücknahmeabschlag	keiner	keiner
Mindestanlagesumme	keine	keine
Verwaltungsvergütung	bis zu 1,25% p.a. (aktuell: bis zu 1,25% p.a.)	bis zu 1,25% p.a. (aktuell: bis zu 0,70% p.a.)



## Anhang zum Halbjahresbericht zum 30. Juni 2022

### Erläuterung 1 – Wesentliche Rechnungslegungsgrundsätze

#### a) Allgemeine Regeln für die Vermögensbewertung

Vermögensgegenstände, die zum Handel an einer Börse zugelassen sind oder an einem anderen organisierten Markt zugelassen oder in diesen einbezogen sind sowie Bezugsrechte für den Fonds werden zum letzten verfügbaren handelbaren Kurs, der eine verlässliche Bewertung gewährleistet, bewertet, sofern im Abschnitt „Besondere Regeln für die Bewertung einzelner Vermögensgegenstände“ des Verkaufsprospekts nicht anders angegeben.

Vermögensgegenstände, die weder zum Handel an Börsen zugelassen sind noch in einem anderen organisierten Markt zugelassen oder in diesen einbezogen sind oder für die kein handelbarer Kurs verfügbar ist, werden zu dem aktuellen Verkehrswert bewertet, der bei sorgfältiger Einschätzung nach geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten angemessen ist, sofern im Abschnitt „Besondere Regeln für die Bewertung einzelner Vermögensgegenstände“ des Verkaufsprospekts nicht anders angegeben.

Für die Bewertung von Schuldverschreibungen, die nicht zum Handel an einer Börse zugelassen oder an einem anderen organisierten Markt zugelassen oder in diesen einbezogen sind (z. B. nicht notierte Anleihen, Commercial Papers und Einlagenzertifikate), und für die Bewertung von Schuldscheindarlehen werden die für vergleichbare Schuldverschreibungen und Schuldscheindarlehen vereinbarten Preise und gegebenenfalls die Kurswerte von Anleihen vergleichbarer Emittenten mit entsprechender Laufzeit und Verzinsung herangezogen, erforderlichenfalls mit einem Abschlag zum Ausgleich der geringeren Veräußerbarkeit.

Die zu dem Fonds gehörenden Optionsrechte und Verbindlichkeiten aus einem Dritten eingeräumten Optionsrechten, die zum Handel an einer Börse zugelassen oder an einem anderen organisierten Markt zugelassen oder in diesen einbezogen sind, werden zu dem jeweils letzten verfügbaren handelbaren Kurs, der eine verlässliche Bewertung gewährleistet, bewertet.

Das gleiche gilt für Forderungen und Verbindlichkeiten aus für Rechnung des Fonds verkauften Terminkontrakten. Die zu Lasten des Fonds geleisteten Einschüsse werden unter Einbeziehung der am Börsentag festgestellten Bewertungsgewinne und Bewertungsverluste zum Wert des Fonds hinzugerechnet.

Bankguthaben werden grundsätzlich zu ihrem Nennwert zuzüglich zugeflossener Zinsen bewertet.

Festgelder werden zum Verkehrswert bewertet, sofern das Festgeld jederzeit kündbar ist und die Rückzahlung bei der Kündigung nicht zum Nennwert zuzüglich Zinsen erfolgt.

Anteile an Investmentvermögen werden grundsätzlich mit ihrem letzten festgestellten Rücknahmepreis angesetzt oder zum letzten verfügbaren handelbaren Kurs, der eine verlässliche Bewertung gewährleistet. Stehen diese Werte nicht zur Verfügung, werden Anteile an Investmentvermögen zu dem aktuellen Verkehrswert bewertet, der bei sorgfältiger Einschätzung nach geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten angemessen ist.

Für Rückerstattungsansprüche aus Darlehensgeschäften ist der jeweilige Kurswert der als Darlehen übertragenen Vermögensgegenstände maßgebend.

#### b) Realisierte Nettogewinne/-verluste aus Wertpapierverkäufen

Die aus dem Verkauf und der Veräußerung von Wertpapieren realisierten Gewinne und Verluste werden auf der Grundlage der Methode der Durchschnittskosten der verkauften Wertpapiere berechnet.

c) Umrechnung von Fremdwährungen

Auf ausländische Währung lautende Vermögensgegenstände werden unter Zugrundelegung des Bloomberg Fixing Kurses der Währung von 17.00 Uhr des Vortages in Euro umgerechnet.

d) Einstandswerte der Wertpapiere im Bestand

Für Wertpapiere, die auf andere Währungen als die Währung des Fonds lauten, wird der Einstandswert auf der Grundlage der am Kauftag gültigen Wechselkurse errechnet.

e) Bewertung der Devisentermingeschäfte

Nicht realisierte Gewinne oder Verluste, welche sich zum Berichtsdatum aus der Bewertung von offenen Devisentermingeschäften ergeben, werden zum Berichtsdatum aufgrund der Terminkurse für die restliche Laufzeit bestimmt und sind in der Vermögensaufstellung ausgewiesen.

f) Bewertung von Terminkontrakten

Die Terminkontrakte werden zum letzten verfügbaren Kurs bewertet. Die nicht realisierten Werterhöhungen oder -minderungen werden in der Vermögensaufstellung eingetragen.

g) Dividendenerträge

Dividenden werden am Ex-Datum gebucht. Dividendenerträge werden vor Abzug von Quellensteuer ausgewiesen.

h) Bewertung der Verbindlichkeiten

Die zum Berichtsstichtag bestehenden Verbindlichkeiten werden mit ihrem Rückzahlungsbetrag angesetzt.

i) Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne und Verluste

Die Ermittlung der Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne und Verluste erfolgt dadurch, dass in jedem Geschäftsjahr die in den Anteilpreis einfließenden Wertansätze der Vermögensgegenstände mit den jeweiligen historischen Anschaffungskosten verglichen werden, die Höhe der positiven Differenzen in die Summe der nicht realisierten Gewinne einfließt, die Höhe der negativen Differenzen in die Summe der nicht realisierten Verluste einfließt und aus dem Vergleich der Summenpositionen zum Ende des Geschäftsjahres mit den Summenpositionen zum Anfang des Geschäftsjahres die Nettoveränderungen ermittelt werden.

j) Zusätzliche Informationen zum Bericht

Dieser Bericht wurde auf Basis des Nettoinventarwertes zum 30. Juni 2022 mit den letzten verfügbaren Kursen zum 30. Juni 2022 und unter Berücksichtigung aller Ereignisse, die sich auf die Rechnungslegung zum Berichtsstichtag am 30. Juni 2022 beziehen, erstellt.

## **Erläuterung 2 – Gebühren und Aufwendungen**

Angaben zu Gebühren und Aufwendungen können dem aktuellen Verkaufsprospekt sowie den wesentlichen Anlegerinformationen („Key Investor Information Document“) entnommen werden.

### **Erläuterung 3 – Verwaltungsvergütung**

Die Gesellschaft erhält für die Verwaltung des OGAW-Sondervermögens eine jährliche Vergütung in Höhe von bis zu 1,25% des Durchschnittswertes des OGAW-Sondervermögens. Der Durchschnittswert des OGAW-Sondervermögens wird börsentäglich errechnet. Die Vergütung wird monatlich anteilig erhoben.

Die Gesellschaft erhält für die Anbahnung, Vorbereitung und Durchführung von Wertpapierdarlehensgeschäften und Wertpapierpensionsgeschäften für Rechnung des OGAW-Sondervermögens eine marktübliche Vergütung in Höhe von maximal einem Drittel der Bruttoerträge aus diesen Geschäften. Die im Zusammenhang mit der Vorbereitung und Durchführung von solchen Geschäften entstandenen Kosten einschließlich der an Dritte zu zahlenden Vergütungen trägt die Gesellschaft.

Diese Vergütungen verstehen sich zuzüglich einer etwaigen Mehrwertsteuer.

### **Erläuterung 4 – Verwahrstellenvergütung**

Die Verwahrstelle erhält für ihre Tätigkeit eine jährliche Vergütung von bis zu 0,08% des Durchschnittswertes des OGAW-Sondervermögens, der börsentäglich errechnet wird. Die Vergütung wird monatlich anteilig erhoben.

Diese Vergütung versteht sich zuzüglich einer etwaigen Mehrwertsteuer.

### **Erläuterung 5 – Ertragsverwendung**

Bei ausschüttenden Anteilklassen schüttet die Gesellschaft grundsätzlich die während des Geschäftsjahres für Rechnung des Fonds angefallenen und nicht zur Kostendeckung verwendeten Zinsen, Dividenden und Erträge aus Investmentanteilen und Optionsprämien, sowie Entgelte aus Darlehens- und Pensionsgeschäften innerhalb von vier Monaten nach Schluss des Geschäftsjahres – unter Berücksichtigung des zugehörigen Ertragsausgleichs – an die Anleger aus. Realisierte Veräußerungsgewinne und sonstige Erträge – unter Berücksichtigung des zugehörigen Ertragsausgleichs – können ebenfalls zur Ausschüttung herangezogen werden. Zwischenausschüttungen sind daneben jederzeit möglich. Bei der Gutschrift von Ausschüttungen können zusätzliche Kosten entstehen. Bei thesaurierenden Anteilklassen werden die auf diese Anteilklassen entfallenden Erträge nicht ausgeschüttet, sondern im Fonds wiederangelegt (Thesaurierung).

Nach Maßgabe der Gesellschaft werden die Erträge der Anteilklassen P und U grundsätzlich ausgeschüttet.

### **Erläuterung 6 – Angaben zur Transparenz und zur Gesamtkostenquote gemäß §16 KARBV**

#### *Umlaufende Anteile und Anteilwert*

	Anzahl Anteile	Anteilwert
FutureFolio 55 P	87.694	106,89 EUR
FutureFolio 55 U	71.585	108,88 EUR

*Kosten aus Investmentanteilen*

Sofern der Fonds in Anteile eines anderen Investmentfonds (Zielfonds) investiert, können für die erworbenen Zielfondsanteile zusätzliche Verwaltungsgebühren anfallen.

Im Berichtszeitraum war das Sondervermögen in folgende Investmentfonds (Zielfonds) investiert, deren maximale jährliche Verwaltungsvergütungssätze aus der nachfolgenden Aufstellung ersichtlich sind.

Gehaltene Investmentanteile	Verwaltungs- vergütungssatz	Angefallener Ausgabeaufschlag	Angefallener Rücknahmeabschlag
AIS-AM.IDX MSCI EUR.SRI PAB Act. Nom. DR A EUR Acc. oN	0,18%	0,00 EUR	0,00 EUR
AIS-AM.WORLD SRI PAB Act.Nom. UCITS ETF DR (C)o.N.	0,18%	0,00 EUR	0,00 EUR
AIS-Amundi MSCI EM SRI PAB Act. Nom. ETF DR USD Dis. oN	0,25%	0,00 EUR	0,00 EUR
AXA World Fds-Gbl Fac.-Sus.Eq. Namens-Anteile ZI Cap.EUR o.N.	0,19%	0,00 EUR	0,00 EUR
B.PE-JPM ESG EMU-Staat.IG 3-5Y Act. Nom. UCITS ETF EUR Acc.oN	0,15%	0,00 EUR	0,00 EUR
BNP PARIBAS EASY-E.GI.E.B.Eco. Act. au Port. UE EUR Acc. oN	0,30%	0,00 EUR	0,00 EUR
BNPPE-MSCI Wrlid SRI S-Ser.5%C. Nam.-Ant.UCITS ETF CAP EUR o.N	0,25%	0,00 EUR	0,00 EUR
DPAM L-Bds.Govmt.Sustaina.Hed. Actions au Port.F Inst.Cap.oN	0,20%	0,00 EUR	0,00 EUR
DWS Inv.-ESG Float.Rate Notes Act. au Port. IC EUR Acc. oN	0,09%	0,00 EUR	0,00 EUR
DWS Invest-DWS Invest ESG WFW Act. au Port. XC EUR Acc. oN	0,35%	0,00 EUR	0,00 EUR
Fran.LibertyQ GI.Eq.SRI UC.ETF Registered Shares USD Acc.o.N.	0,40%	0,00 EUR	0,00 EUR
Franklin Liberty EO GR.BD ETF Reg. Shares EUR Acc. o.N.	0,30%	0,00 EUR	0,00 EUR
Franklin Liberty EO Sh.Mat.ETF Reg. Shs EUR Dis. oN	0,05%	0,00 EUR	0,00 EUR
iShs V-MSCI W.H.C.S.ESG U.ETF Reg. Shs USD Dis. oN	0,25%	0,00 EUR	0,00 EUR
iShs VI-iSh.Edg.MSCI Wld M.V.E Reg. Shares USD (Acc) o.N.	0,30%	0,00 EUR	0,00 EUR
iShsII-EO C.Bd 0-3yr ESG U.ETF Registered Shares o.N.	0,15%	0,00 EUR	0,00 EUR
iShsIV-MSCI Wld.SRI UCITS ETF Registered Shs EUR Acc. o.N.	0,20%	0,00 EUR	0,00 EUR
LBBW Renten Short Term Nachha. Inhaber-Anteile I	0,06%	0,00 EUR	0,00 EUR
MUL-Lyx.G.Gr.Bd 1-10Y(DR)U.ETF Namens-Anteile Acc.EUR o.N.	0,25%	0,00 EUR	0,00 EUR
MUL-Lyxor N.Zero2050S&P W.Cl. Nam.-Ant. USD Acc.oN	0,20%	0,00 EUR	0,00 EUR
nx-25 Indexfonds Inhaber-Ant.Klasse I	0,47%	0,00 EUR	0,00 EUR
OSSIAM L.-O.EO G.Bds 3-5y C.R. Inh.-Ant. UCITS ETF 1C EUR o.N	0,17%	0,00 EUR	0,00 EUR
Pictet - Smart City Namens-Anteile I dy EUR o.N.	0,80%	0,00 EUR	0,00 EUR
Pictet - Timber Namens-Anteile I EUR o.N.	0,80%	0,00 EUR	0,00 EUR
Riz.UCITS IC.-Sus.Fut.Food ETF Reg. Shs A USD Acc. oN	0,45%	0,00 EUR	0,00 EUR
Robeco Cap.Gr.F-Sust Water Eq. Act. Nom. I EUR Acc. oN	0,80%	0,00 EUR	0,00 EUR
Robeco Cap.Grow.Fd-Sm.Ener.Eq. Act. Nom. I EUR Acc. oN	0,80%	0,00 EUR	0,00 EUR
U.(I.)E-S&P Div.Aris.ESG U.ETF Reg.Shs A Dis. USD o.N.	0,30%	0,00 EUR	0,00 EUR
UBS(L)FS-JPM GI.Gov.ESG Liq.Bd Act. Nom. H A EUR Acc. oN	0,15%	0,00 EUR	0,00 EUR
UBS(L)FS-Sust.Dev.Bank Bds UE Act. Nom. A USD Dis. oN	0,18%	0,00 EUR	0,00 EUR
Unilnstit.EO Cov.Bds4-6yrs Sus Inhaber-Anteile	0,30%	0,00 EUR	0,00 EUR
VanEck Sust.World EQ.UC.ETF Aandelen oop naam o.N.	0,20%	0,00 EUR	0,00 EUR
WI Global Challenges Index-Fds Inhaber-Anteile 1	0,33%	0,00 EUR	0,00 EUR
Xtr.(IE)-MSCI World ESG Registered Shares 1C o.N.	0,20%	0,00 EUR	0,00 EUR
Xtrackers II ESG EUR Corp.Bond Inhaber-Anteile 1D o.N.	0,16%	0,00 EUR	0,00 EUR
BNP P.Easy-ECPI Circ.Econ.Ldrs Namens-Ant.UCITS ETF CAP o.N.	0,18%	0,00 EUR	0,00 EUR
Ca.Su.-Equ.Circular Economy Act. Nom. I EUR Acc. oN	0,80%	0,00 EUR	0,00 EUR
JSS II-JSS Sus.Equ.-Future H. Act. Nom. C EUR Acc. oN	1,00%	0,00 EUR	0,00 EUR
LBBW Gesund Leben Inhaber-Anteile I	0,60%	0,00 EUR	0,00 EUR
Lupus alpha Sust.Convertib.Bds Inhaber-Anteile C	0,75%	0,00 EUR	0,00 EUR
MULux-Lyx.EOGovtGr.Bd(DR)ETF Act. Nom. EUR Acc. oN	0,20%	0,00 EUR	0,00 EUR
Nordea 1-Emerging Stars Equity Actions Nom. BI-EUR o.N.	0,75%	0,00 EUR	0,00 EUR
RIZE-Env.Impact Opps ETF Reg. Shs ETF USD Acc. oN	0,55%	0,00 EUR	0,00 EUR
UBS(Irl)ETF-Glo. Gender Equal. Reg.Shs A Acc. EUR Hgd. o.N.	0,30%	0,00 EUR	0,00 EUR
UBS(Irl)ETF-MSCI Wld Soc.Resp. Reg. Shs A Hedged EUR Acc. oN	0,27%	0,00 EUR	0,00 EUR
UBS(L)FS-BB EO Inf.L.10+ U.ETF Namens-Ant. EUR A Dis. o.N.	0,20%	0,00 EUR	0,00 EUR

## Erläuterung 7 – Angaben zur Mitarbeitervergütung der EU-Verwaltungsgesellschaft

Die Verwaltungsgesellschaft verfügt über ein Vergütungssystem, das sowohl die regulatorischen Anforderungen erfüllt, als auch das verantwortungsvolle und risikobewusste Verhalten der Mitarbeiter fördert. Das System ist so gestaltet, dass es mit einem soliden und wirksamen Risikomanagement vereinbar ist und nicht zur Übernahme von Risiken ermutigt. Das Vergütungssystem wird mindestens einmal jährlich durch einen Vergütungsausschuss auf seine Angemessenheit und die Einhaltung aller rechtlichen und regulatorischen Vorgaben überprüft.

Ziel der Gesellschaft ist es, mit einer markt- und leistungsgerechten Vergütung die Interessen des Unternehmens, der Gesellschafter und der Mitarbeiter gleichermaßen zu berücksichtigen und die nachhaltige und positive Entwicklung der Gesellschaft zu unterstützen. Die Vergütung der Mitarbeiter setzt sich aus einem angemessenen Jahresfestgehalt sowie einer möglichen variablen leistungs- und ergebnisorientierten Vergütung zusammen. Der Pool der variablen Vergütung wird durch den Aufsichtsrat unter Berücksichtigung der finanziellen Lage der Gesellschaft festgelegt, er kann nach pflichtgemäßem Ermessen auch reduziert oder gestrichen werden. Bei der Bemessung der variablen Vergütung werden u. a. die individuelle Leistung und das Risikobewusstsein berücksichtigt. Die Bemessung und Verteilung der Vergütung an die Mitarbeiter erfolgt durch den Vorstand. Die Vergütung der Vorstände und Risk Taker mit Kontrollfunktionen in leitender Funktion werden durch den Aufsichtsrat festgelegt. Für die Vorstände und Mitarbeiter, deren Tätigkeiten einen wesentlichen Einfluss auf das Gesamtrisikoprofil der Gesellschaft und der von ihr verwalteten Investmentvermögen haben, gelten darüber hinaus besondere Regelungen.

Gesamtsumme der im abgelaufenen Geschäftsjahr 2021 (Zeitraum vom 1. Januar 2021 bis zum 31. Dezember 2021) der Axxion S.A. gezahlten Mitarbeitervergütung:

davon feste Vergütung:	TEUR	3.796
davon variable Vergütung:	TEUR	450
Gesamtsumme:	TEUR	4.246

Durchschnittliche Zahl der Mitarbeiter der Verwaltungsgesellschaft: 50 (inkl. Vorstände)

Summe der im abgelaufenen Geschäftsjahr 2021 der Axxion S.A. gezahlten Vergütungen an bestimmte Mitarbeitergruppen anteilig auf Basis der Fondsvermögen zum Geschäftsjahresende für das Sondervermögen FutureFolio 55:

Vorstand:	EUR	1.339
weitere Risk Taker:	EUR	1.135
Mitarbeiter mit Kontrollfunktionen:	EUR	539
Mitarbeiter in gleicher Einkommensstufe wie Vorstand und Risk Taker:		n.a.
Gesamtsumme:	EUR	3.013

### *Überprüfung der Angemessenheit des Vergütungssystems*

Die Überprüfung des Vergütungssystems für das Geschäftsjahr 2021 fand im Rahmen der jährlichen Sitzung des Vergütungsausschusses statt. Dabei konnte zusammenfassend festgestellt werden, dass die Grundsätze der Vergütungsrichtlinie und aufsichtsrechtlichen Vorgaben an Vergütungssysteme eingehalten wurden. Zudem konnten keine Unregelmäßigkeiten festgestellt werden.

Die Vergütungsrichtlinie der Gesellschaft wurde im Jahr 2021 aktualisiert, weitere Einzelheiten der aktuellen Vergütungsrichtlinie können kostenlos auf der Internetseite der Verwaltungsgesellschaft [www.axxion.lu](http://www.axxion.lu) unter der Rubrik Anlegerinformationen abgerufen werden.

### **Erläuterung 8 – Angaben zu den Wertpapierfinanzierungsgeschäften gemäß der Verordnung (EU) 2015/2365**

Zum Berichtszeitpunkt und während der Berichtsperiode hat das Sondervermögen keine Wertpapierfinanzierungsgeschäfte entsprechend der Verordnung (EU) 2015/2365 des europäischen Parlaments und des Rates vom 25. November 2015 über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften und der Weiterverwendung sowie zur Änderung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 abgeschlossen.

### **Erläuterung 9 – Pflichtangaben gemäß EU-Offenlegungsverordnung und EU-Taxonomie-Verordnung**

*Angaben gemäß Verordnung (EU) 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor*

Dieser Fonds ist ein Finanzprodukt, mit dem ökologische und soziale Merkmale beworben werden, und qualifiziert gemäß Artikel 8 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor.

*Angabe gemäß Verordnung (EU) 2020/852 über die Einrichtung eines Rahmens zur Erleichterung nachhaltiger Investitionen („Taxonomie-Verordnung“)*

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

Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

### **Erläuterung 10 – Weitere Informationen**

*Änderung in den Gesellschaftsgremien der Verwaltungsgesellschaft Axxion S.A.*

Mit Wirkung zum 1. Januar 2022 ist der bisherige Vorstandsvorsitzende Herr Thomas Amend aus dem Vorstand der Verwaltungsgesellschaft Axxion S.A. ausgeschieden und in den Aufsichtsrat der Axxion S.A. gewechselt. Der Vorstand der Axxion S.A. setzt sich seither zusammen aus Herrn Stefan Schneider (Vorsitzender des Vorstands), Herrn Pierre Girardet und Herrn Armin Clemens, der zum 1. Januar 2022 in den Vorstand aufgerückt ist. Dem Aufsichtsrat der Gesellschaft gehören neben Herrn Thomas Amend auch weiterhin die bisherigen Aufsichtsratsmitglieder Herr Dr. Burkhard Wittek, Herr Martin Stürner und Frau Constanze Hintze an.

*Mögliche Auswirkungen der COVID-19-Pandemie*

Angesichts der Entwicklungen in Bezug auf COVID-19 sind die Mitglieder des Vorstands der Verwaltungsgesellschaft davon überzeugt, dass die Pläne zur Aufrechterhaltung des Geschäftsbetriebs die laufenden operationellen Risiken berücksichtigen. Der Vorstand hat dafür gesorgt, dass alle erforderlichen Maßnahmen getroffen werden, um sicherzustellen, dass die Aktivitäten der Gesellschaft nicht gestört werden. Auf Basis der aktuellen Entwicklungen in Bezug auf COVID-19 geht die Gesellschaft davon aus, dass die Unternehmensfortführung sowohl finanziell als auch personell sichergestellt ist.

## FutureFolio 55

Eine fortlaufende Überwachung der Wertentwicklung, sowie der Risiken – insbesondere in Bezug auf die Markt- sowie Liquiditätsrisiken – erfolgt durch das Risikomanagement der Verwaltungsgesellschaft.

Die aktuellen Entwicklungen und damit einhergehenden volatilen Märkte können sich entsprechend der Investitionen auf das Sondervermögen FutureFolio 55 auswirken.

Auswirkungen der Ereignisse sind derzeit nicht prognostizierbar.

Auf Basis der aktuellen Entwicklungen in Bezug auf COVID-19 geht die Gesellschaft davon aus, dass die Fortführung des FutureFolio 55 sichergestellt ist.

### *Mögliche Auswirkungen des Ukraine-Konfliktes*

Die jüngsten Entwicklungen hinsichtlich des Konfliktes im Osten Europas führten auf den globalen Finanzmärkten teilweise zu signifikanten Abschlagen und starken Schwankungen. Mittelfristig werden die Rahmenbedingungen der globalen Wirtschaft und damit verbunden die Entwicklung an den Finanzmärkten von erhöhter Unsicherheit geprägt sein. Damit einher geht eine steigende Volatilität an den Finanzplätzen. Insofern unterliegt auch die zukünftige Wertentwicklung des Fonds erhöhten Schwankungsrisiken.

Grevenmacher, im Juli 2022

Der Vorstand der Axxion S.