#### KAPITALVERWALTUNGSGESELLSCHAFT:



## Stiftungsfonds ESG Global

JAHRESBERICHT

ZUM 31. DEZEMBER 2022

VERWAHRSTELLE:



BERATUNG UND VERTRIEB:



#### Tätigkeitsbericht

für den Berichtszeitraum vom 1. Januar 2022 bis 31. Dezember 2022

#### Anlageziele und Anlagepolitik zur Erreichung der Anlageziele

Der Fonds investiert unter Berücksichtigung des Nachhaltigkeitsgedanken weltweit in Anleihen von Staaten und Unternehmen, Aktien und zur Beimischung und Risikoregulierung bspw. in Immobilien (in Form von REITs oder Aktien von Immobilienunternehmen) und Edelmetalle (in Form von Zertifikaten, Aktien oder Fonds). Grundlage der angewandten Nachhaltigkeitskriterien, welche von führenden Anbietern von Nachhaltigkeitsanalysen und Ratings im Bereich Umwelt, Soziales und Unternehmensführung (ESG) analysiert werden, ist der Leitfaden für ethisch-nachhaltige Geldanlagen in der evangelischen Kirche ("EKD-Leitfaden"). Zusätzlich zu Ausschlusskriterien werden klassische Bewertungsmethoden wie bspw. FairValue- und Scoring-Analysemodelle angewandt, um eine ganzheitliche Investmententscheidung treffen zu können. Der "Balanced"-Ansatz aus insbesondere Anleihen und Aktien soll dabei die Erzielung einer stabilen Rendite bei begrenztem Risiko ermöglichen. Dieser Fonds bewirbt ökologische und/oder soziale Merkmale im Sinne des Artikel 8 der Offenlegungs-Verordnung (Verordnung (EU) 2019/2088).

#### Struktur des Portfolios und wesentliche Veränderungen im Berichtszeitraum

#### **Fondsstruktur**

|                                  | 31.12.2022    |                           | 31.12.2021    |                           |
|----------------------------------|---------------|---------------------------|---------------|---------------------------|
|                                  | Kurswert      | % Anteil<br>Fondsvermögen | Kurswert      | % Anteil<br>Fondsvermögen |
| Renten                           | 33.783.936,12 | 46,86                     | 19.401.050,50 | 23,23                     |
| Aktien                           | 30.507.931,08 | 42,31                     | 40.051.085,32 | 47,95                     |
| Fondsanteile                     | 1.745.080,73  | 2,42                      | 3.623.331,60  | 4,34                      |
| Zertifikate                      | 2.487.453,36  | 3,45                      | 3.135.801,50  | 3,75                      |
| Futures                          | 228.000,00    | 0,32                      | 31.200,00     | 0,04                      |
| Bankguthaben                     | 3.138.116,41  | 4,35                      | 17.230.614,50 | 20,63                     |
| Zins- und Dividendenansprüche    | 359.696,58    | 0,50                      | 146.996,18    | 0,18                      |
| Sonstige Ford./Verbindlichkeiten | -149.457,59   | -0,21                     | -86.836,98    | -0,10                     |
| Fondsvermögen                    | 72.100.756,69 | 100,00                    | 83.533.242,62 | 100,00                    |

#### Segment 1:

Das abgeschlossene Geschäftsjahr 2022 war für nahezu alle Segmente am Kapitalmarkt von einer negativen Wertentwicklung geprägt.

Aktien, Staats- und Unternehmensanleihen und diverse Rohstoffe verloren im Kurs. Eine erhöhte Volatilität, begründet in den überdurchschnittlich hohen Inflationsraten, folglich steigenden Leitzinsen, und dem Angriffskrieg auf die Ukraine, sorgten für größere Kursausschläge über das gesamte Jahr hinweg und belasteten die Wertentwicklung des Portfolios

Der USD konnte gegenüber den EUR in Summe an Wert gewinnen. Dies trug positiv zur Portfolioentwicklung bei.

Die Investitionsquote wurde zum Jahresende hin signifikant ausgebaut. Dies ist auf das positive Nominalzinsumfeld zurückzuführen, welches attraktive Möglichkeiten schaffte, in Rentenpapiere mit Investment Grade Rating und kurzer bis mittlerer Laufzeit zu investieren und freie Liquidität verzinslich anzulegen.

Das Segment der Aktieninvestments wurde in Reaktion auf die Marktvolatilität sehr aktiv gemanagt, sowohl in der Titelauswahl aus auch der Segmentallokation. Am Jahresende lag die Aktienquote niedriger als noch zum Jahresanfang. Einen positiven Wertbeitrag konnte der taktische Einsatz von Absicherungen des Aktienanteils beisteuern.

Das Segment 1 war zu jederzeit in liquide Wertpapiere investiert.

#### Segment 2:

Das abgeschlossene Geschäftsjahr 2022 war durch hohe und weiter ansteigende Inflation geprägt. Zahlreiche Zentralbanken reagierten darauf mit Leitzinserhöhungen. Die von einem sehr niedrigen Niveau ansteigenden Zinsen führten zu Verwerfungen an den internationalen Kapitalmärkten, insbesondere zu sinkenden Anleihen- und Aktienkursen. Das klassische Konzept gemischter Portfolien, in denen sich Aktien- und Anleihenkurse gegenläufig entwickeln und dadurch gegenseitig stabilisieren sollen, ging im Jahr 2022 nicht auf.

Das Segment 2 des Stiftungsfonds ESG Global reagierte auf diese Entwicklungen unter anderem mit einer deutlichen Reduzierung der Aktienquote. Das maximal mögliche Aktienexposure von 60 Prozent wurde zwischenzeitlich auf 40 Prozent reduziert, um die Kursverluste zu begrenzen. Gleichzeitig wurde die Branchenstruktur innerhalb des Aktienbestands angepasst, mit dem Ziel das Segment weniger konjunktursensitiv aufzustellen. Insbesondere wurde der Bestand an Aktien aus dem Technologiesektor deutlich verringert und dafür Aktien aus den Bereichen Kommunikation, Energie und Rohstoffe zugekauft.

Die Investitionsquote des Rentenbestands hat sich über das Geschäftsjahr verändert. Es wurde überwiegend in Unternehmensanleihen investiert. Die effektive Duration lag zum Jahresbeginn noch bei knapp 5 Prozent, bis zum Ende des Geschäftsjahres wurde sie auf 2,32 Prozent zurückgenommen. Damit konnten die Wertverluste im Rentenportfolio zwar nicht vermieden, aber zumindest reduziert werden. Die Wertverluste basieren dabei auf einer Erhöhung des Zinsniveaus und der Risikoprämien (Spreads). Es gab keine Ausfälle von Anleihen. Mit einem unveränderten Durchschnittsrating von BBB+ liegt das Rentenportfolio weiterhin deutlich im Investment Grade Bereich.

Die getroffenen Maßnahmen konnten die Kursverluste im Aktien- und Rentenbestand des Segments 2 nicht verhindern. Sie führten jedoch dazu, dass in diesem schwierigen Geschäftsjahr die Wertentwicklung des Segments mehr als drei Prozentpunkte über dem Vergleichsmaßstab (Benchmark) lag. Damit konnten Anleger ein über dem Marktniveau liegendes Ergebnis erzielen.

#### Wesentliche Risiken

#### Allgemeine Marktpreisrisiken

Die Kurs- oder Marktwertentwicklung von Finanzprodukten hängt insbesondere von der Entwicklung der Kapitalmärkte ab, die wiederum von der allgemeinen Lage der Weltwirtschaft sowie den wirtschaftlichen und politischen Rahmenbedingungen in den jeweiligen Ländern beeinflusst wird. Auf die allgemeine Kursentwicklung, insbesondere an einer Börse, können auch irrationale Faktoren wie Stimmungen, Meinungen und Gerüchte einwirken.

Für die Kurs- oder Marktwertentwicklung stellten die Entwicklungen aufgrund von COVID 19 im abgelaufenen Geschäftsjahr einen besonderen Aspekt der Unsicherheit dar.

Die Ukraine-Krise und die dadurch ausgelösten Marktturbulenzen und Sanktionen der Industrienationen gegenüber Russland haben eine Vielzahl an unterschiedlichen Auswirkungen auf die Finanzmärkte im Allgemeinen und auf Fonds (Sondervermögen) im Speziellen. Die Bewegungen an den Börsen werden sich entsprechend auch im Fondsvermögen (Wert des Sondervermögens) widerspiegeln.

Zusätzlich belasten Unsicherheiten über den weiteren Verlauf des Konflikts sowie die wirtschaftlichen Folgen der diversen Sanktionen die Märkte.

#### Zinsänderungsrisiken

Mit der Investition in festverzinsliche Wertpapiere ist die Möglichkeit verbunden, dass sich das Marktzinsniveau, das im Zeitpunkt der Begebung eines Wertpapiers besteht, ändern kann. Steigen die Marktzinsen gegenüber den Zinsen zum Zeitpunkt der Emission, so fallen in der Regel die Kurse der festverzinslichen Wertpapiere. Fällt dagegen der Marktzins, so steigt der Kurs festverzinslicher Wertpapiere. Diese Kursentwicklung führt dazu, dass die aktuelle Rendite der festverzinslichen Wertpapiere in etwa dem aktuellen Marktzins entspricht. Diese Kursentwicklungen fallen jedoch je nach Laufzeit der festverzinslichen Wertpapiere unterschiedlich aus. Festverzinsliche Wertpapiere mit kürzeren Laufzeiten haben geringere Zinsänderungs-/Kursrisiken als festverzinsliche Wertpapiere mit längeren Laufzeiten.

#### Adressenausfallrisiken / Emittentenrisiken

Durch den Ausfall eines Ausstellers oder Kontrahenten können Verluste für das Sondervermögen entstehen. Das Ausstellerrisiko beschreibt die Auswirkung der besonderen Entwicklungen des jeweiligen Ausstellers, die neben den allgemeinen Tendenzen der Kapitalmärkte auf den Kurs eines Wertpapiers einwirken. Auch bei sorgfältiger Auswahl der Wertpapiere kann nicht ausgeschlossen werden, dass Verluste durch Vermögensverfall von Ausstellern eintreten. Das Kontrahentenrisiko beinhaltet das Risiko der Partei eines gegenseitigen Vertrages, mit der eigenen Forderung teilweise oder vollständig auszufallen. Dies gilt für alle Verträge, die für Rechnung eines Sondervermögens geschlossen werden.

#### <u>Bonitätsrisiken</u>

Bei Anleihen kann es zu einer Ratingveränderung des Schuldners kommen. Je nachdem, ob die Bonität steigt oder fällt, kann es zu Kursveränderungen des Wertpapiers kommen.

#### Aktienrisiken

Mit dem Erwerb von Aktien können besondere Marktrisiken und Unternehmensrisiken verbunden sein. Der Wert von Aktien spiegelt nicht immer den tatsächlichen Wert des Unternehmens wider. Es kann daher zu großen und schnellen Schwankungen dieser Werte kommen, wenn sich Marktgegebenheiten und Einschätzungen von Marktteilnehmern hinsichtlich des Wertes dieser Anlagen ändern. Hinzu kommt, dass die Rechte aus Aktien stets nachrangig gegenüber den Ansprüchen sämtlicher Gläubiger des Emittenten befriedigt werden. Daher unterliegen Aktien im Allgemeinen größeren Wertschwankungen als z.B. festverzinsliche Wertpapiere.

#### Risiken im Zusammenhang mit Zielfonds

Die Risiken der Investmentanteile, die für das Sondervermögen erworben werden, stehen in engem Zusammenhang mit den Risiken der in diesen Sondervermögen enthaltenen Vermögensgegenstände. Zielfonds mit Rentenfokus weisen teilweise deutliche Zinsänderungsrisiken und Adressenausfallrisiken auf, während Zielfonds mit Aktienfokus stärkeren Marktschwankungen ausgesetzt sind. Eine breite Streuung des Sondervermögens kann jedoch zur Verringerung von Klumpenrisiken beitragen. Die laufende Überwachung der einzelnen Zielfonds hat zusätzlich zum Ziel, die genannten Einzelrisiken systematisch zu begrenzen.

#### Risiken im Zusammenhang mit Derivategeschäften

Die Gesellschaft darf für Rechnung des Sondervermögens sowohl zu Absicherungszwecken als auch zu Investitionszwecken Geschäfte mit Derivaten tätigen. Die Absicherungsgeschäfte dienen dazu, das Gesamtrisiko des Sondervermögens zu verringern, können jedoch ggf. auch die Renditechancen schmälern. Kauf und Verkauf von Optionen sowie der Abschluss von Terminkontrakten oder Swaps sind mit folgenden Risiken verbunden:

- Kursänderungen des Basiswertes können den Wert eines Optionsrechts oder Terminkontraktes bis hin zur Wertlosigkeit vermindern. Durch Wertänderungen des einem Swap zugrunde liegenden Vermögenswertes kann das Sondervermögen ebenfalls Verluste erleiden.
- Der gegebenenfalls erforderliche Abschluss eines Gegengeschäfts (Glattstellung) ist mit Kosten verbunden.
- Durch die Hebelwirkung von Optionen kann der Wert des Sondervermögens stärker beeinflusst werden, als dies beim unmittelbaren Erwerb der Basiswerte der Fall ist.
- Der Kauf von Optionen birgt das Risiko, dass die Option nicht ausgeübt wird, weil sich die Preise der Basiswerte nicht wie erwartet entwickeln, so dass die vom Sondervermögen gezahlte Optionsprämie verfällt. Beim Verkauf von Optionen besteht die Gefahr, dass das Sondervermögen zur Abnahme / Lieferung von Vermögenswerten zu einem abweichenden Preis als dem aktuellen Marktpreis verpflichtet ist.
- Auch bei Terminkontrakten besteht das Risiko, dass das Sondervermögen infolge unerwarteter Entwicklungen der Marktpreise bei Fälligkeit Verluste erleidet.

#### Währungsrisiken

Sofern Vermögenswerte eines Sondervermögens in anderen Währungen als der jeweiligen Fondswährung angelegt sind, erhält es die Erträge, Rückzahlungen und Erlöse aus solchen Anlagen in der jeweiligen Währung. Fällt der Wert dieser Währung gegenüber der Fondswährung, so reduziert sich der Wert des Sondervermögens.

#### **Fondsergebnis**

Die wesentlichen Quellen des negativen Veräußerungsergebnisses während des Berichtszeitraums waren realisierte Verluste aus ausländischen Aktien.

Im Berichtszeitraum vom 1. Januar 2022 bis 31. Dezember 2022 lag die Wertentwicklung des Sondervermögens bei -14,60%1.

<sup>1</sup>Eigene Berechnung nach der BVI-Methode (ohne Berücksichtigung von Ausgabeaufschlägen). Historische Wertentwicklungen lassen keine Rückschlüsse auf eine ähnliche Entwicklung in der Zukunft zu. Diese ist nicht prognostizierbar.

#### Vermögensübersicht zum 31.12.2022

| Anlag | Aktien Australien Bermuda Bundesrep. Deutschland Canada Frankreich Großbritannien Irland Japan Niederlande Norwegen Österreich Schweden Schweiz USA  Anleihen <1 Jahr >= 1 Jahr bis < 3 Jahre >= 3 Jahre bis < 5 Jahre >= 5 Jahre bis < 10 Jahre >= 10 Jahre  Zertifikate EUR  Wandelanleihen EUR | Tageswert<br>in EUR | % Anteil am<br>Fondsvermögen |
|-------|---|---------------------|------------------------------|
| I. V  | /ermögensgegenstände  | 72.251.649,25       | 100,21                       |
| 1     | . Aktien  | 30.346.362,34       | 42,09                        |
|       | Australien  | 243.807,21          | 0,34                         |
|       | Bermuda   | 177.017,15          | 0,25                         |
|       | Bundesrep. Deutschland  | 888.614,36          | 1,23                         |
|       | Canada  | 1.102.876,08        | 1,53                         |
|       | Frankreich  | 2.327.612,14        | 3,23                         |
|       | Großbritannien  | 868.541,18          | 1,20                         |
|       | Irland  | 1.068.592,58        | 1,48                         |
|       | Japan   | 1.445.372,84        | 2,00                         |
|       | Niederlande   | 2.078.480,25        | 2,88                         |
|       | Norwegen  | 93.845,01           | 0,13                         |
|       | Österreich  | 329.441,70          | 0,46                         |
|       | Schweden  | 1.162.992,88        | 1,61                         |
|       | Schweiz   | 1.717.224,51        | 2,38                         |
|       | USA   | 16.841.944,45       | 23,36                        |
| 2     | . Anleihen  | 33.546.654,12       | 46,53                        |
|       | < 1 Jahr  | 14.536.017,00       | 20,16                        |
|       | >= 1 Jahr bis < 3 Jahre   | 7.893.922,00        | 10,95                        |
|       | >= 3 Jahre bis < 5 Jahre  | 4.597.609,62        | 6,38                         |
|       | >= 5 Jahre bis < 10 Jahre   | 4.948.439,50        | 6,86                         |
|       | >= 10 Jahre   | 1.570.666,00        | 2,18                         |
| 3     | . Zertifikate   | 2.487.453,36        | 3,45                         |
|       | EUR   | 2.487.453,36        | 3,45                         |
| 4     | . Wandelanleihen  | 237.282,00          | 0,33                         |
|       | EUR   | 237.282,00          | 0,33                         |
| 5     | . Sonstige Beteiligungswertpapiere  | 161.568,74          | 0,22                         |
|       |   | 161.568,74          | 0,22                         |

#### Vermögensübersicht zum 31.12.2022

| Anlageschwerpunkte               | Tageswert<br>in EUR        | % Anteil am<br>Fondsvermögen |
|----------------------------------|----------------------------|------------------------------|
| 6. Investmentanteile EUR         | 1.745.080,73<br>915.860,00 | 2,42<br>1,27                 |
| USD                              | 829.220,73                 | 1,15                         |
| 7. Derivate                      | 228.000,00                 | 0,32                         |
| 8. Bankguthaben                  | 3.138.116,41               | 4,35                         |
| 9. Sonstige Vermögensgegenstände | 361.131,55                 | 0,50                         |
| II. Verbindlichkeiten            | -150.892,56                | -0,21                        |
| III. Fondsvermögen               | 72.100.756,69              | 100,00                       |

#### Vermögensaufstellung zum 31.12.2022

| Gattungsbezeichnung   | ISIN         | Markt | Stück bzw.<br>Anteile bzw.<br>Whg. in 1.000 | Bestand<br>31.12.2022 | Zugänge | Verkäufe /<br>Abgänge<br>tszeitraum |     | Kurs      | Kurswert<br>in EUR | %<br>des Fonds-<br>vermögens |
|---|--------------|-------|---|-----------------------|---------|-------------------------------------|-----|-----------|--------------------|------------------------------|
| Bestandspositionen  |              |       |   |                       |         |                                     | EUR |           | 68.524.401,29      | 95,04                        |
| Börsengehandelte Wertpapiere                                |              |       |   |                       |         |                                     | EUR |           | 60.042.667,44      | 83,28                        |
| Aktien  |              |       |   |                       |         |                                     | EUR |           | 30.346.362,34      | 42,09                        |
| Fortescue Metals Group Ltd. Registered Shares o.N.          | AU000000FMG4 |       | STK   | 18.701                | 18.701  |                                     | AUD | 20,510    | 243.807,21         | 0,34                         |
| Loblaw Companies Ltd. Registered Shares o.N.                | CA5394811015 |       | STK   | 3.550                 | 0       |                                     | CAD | 119,720   | 293.979,39         | 0,41                         |
| Manulife Financial Corp. Registered Shares o.N.             | CA56501R1064 |       | STK   | 12.305                | 12.305  |                                     | CAD | 24,150    | 205.551,46         | 0,29                         |
| Open Text Corp. Registered Shares o.N.                      | CA6837151068 |       | STK   | 13.160                | 0       |                                     | CAD | 40,120    | 365.206,61         | 0,51                         |
| Rogers Communications Inc. Reg. Shares Class B CD 1,62478   | CA7751092007 |       | STK   | 3.000                 | 0       |                                     | CAD | 63,370    | 131.500,31         | 0,18                         |
| TELUS Corp. Registered Shares o.N.                          | CA87971M1032 |       | STK   | 5.900                 | 0       |                                     | CAD | 26,130    | 106.638,31         | 0,15                         |
| Cie Financière Richemont AG Namens-Aktien SF 1              | CH0210483332 |       | STK   | 4.357                 | 4.357   | 0                                   | CHF | 119,900   | 529.231,38         | 0,73                         |
| Nestlé S.A. Namens-Aktien SF -,10                           | CH0038863350 |       | STK   | 9.243                 | 9.243   | 0                                   | CHF | 107,140   | 1.003.236,77       | 1,39                         |
| UBS Group AG Namens-Aktien SF -,10                          | CH0244767585 |       | STK   | 10.600                | 0       | 0                                   | CHF | 17,205    | 184.756,36         | 0,26                         |
| Akzo Nobel N.V. Aandelen aan toonder EO0,5                  | NL0013267909 |       | STK   | 2.000                 | 0       | 0                                   | EUR | 62,560    | 125.120,00         | 0,17                         |
| ASM International N.V. Bearer Shares EO 0,04                | NL0000334118 |       | STK   | 818                   | 0       | 0                                   | EUR | 235,650   | 192.761,70         | 0,27                         |
| ASML Holding N.V. Aandelen op naam EO -,09                  | NL0010273215 |       | STK   | 393                   | 0       | 0                                   | EUR | 503,800   | 197.993,40         | 0,27                         |
| AXA S.A. Actions Port. EO 2,29                              | FR0000120628 |       | STK   | 11.500                | 0       | 0                                   | EUR | 26,055    | 299.632,50         | 0,42                         |
| BNP Paribas S.A. Actions Port. EO 2                         | FR0000131104 |       | STK   | 10.446                | 10.446  | 12.500                              | EUR | 53,250    | 556.249,50         | 0,77                         |
| Covestro AG Inhaber-Aktien o.N.                             | DE0006062144 |       | STK   | 14.644                | 14.644  | 0                                   | EUR | 36,550    | 535.238,20         | 0,74                         |
| CRH PLC Registered Shares EO -,32                           | IE0001827041 |       | STK   | 4.900                 | 0       | 0                                   | EUR | 37,010    | 181.349,00         | 0,25                         |
| ING Groep N.V. Aandelen op naam EO -,01                     | NL0011821202 |       | STK   | 60.458                | 35.458  | 25.000                              | EUR | 11,388    | 688.495,70         | 0,95                         |
| Porsche Automobil Holding SE Inhaber-Vorzugsaktien o.St.o.N | DE000PAH0038 |       | STK   | 3.034                 | 3.034   | 0                                   | EUR | 51,240    | 155.462,16         | 0,22                         |
| Raiffeisen Bank Intl AG Inhaber-Aktien o.N.                 | AT0000606306 |       | STK   | 21.462                | 21.462  | 0                                   | EUR | 15,350    | 329.441,70         | 0,46                         |
| Soitec S.A. Actions au Porteur EO 2                         | FR0013227113 |       | STK   | 1.561                 | 0       | 1.504                               | EUR | 152,850   | 238.598,85         | 0,33                         |
| TotalEnergies SE Actions au Porteur EO 2,50                 | FR0000120271 |       | STK   | 11.117                | 11.117  | 0                                   | EUR | 58,650    | 652.012,05         | 0,90                         |
| Unilever PLC Registered Shares LS -,031111                  | GB00B10RZP78 |       | STK   | 4.062                 | 4.062   | 0                                   | EUR | 46,870    | 190.385,94         | 0,26                         |
| Universal Music Group N.V. Aandelen op naam EO1             | NL0015000IY2 |       | STK   | 29.907                | 29.907  | 0                                   | EUR | 22,510    | 673.206,57         | 0,93                         |
| Volkswagen AG Vorzugsaktien o.St. o.N.                      | DE0007664039 |       | STK   | 1.700                 | 0       |                                     | EUR | 116,420   | 197.914,00         | 0,27                         |
| Worldline S.A. Actions Port. EO -,68                        | FR0011981968 |       | STK   | 15.908                | 15.908  |                                     | EUR | 36,530    | 581.119,24         | 0,81                         |
| BT Group PLC Registered Shares LS 0,05                      | GB0030913577 |       | STK   | 220.375               | 220.375 |                                     | GBP | 1,121     | 278.388,04         | 0,39                         |
| Haleon PLC Reg.Shares LS 0,01                               | GB00BMX86B70 |       | STK   | 55.982                | 55.982  |                                     | GBP | 3,274     | 206.603,24         | 0,29                         |
| Sainsbury PLC, J. Registered Shs LS -,28571428              | GB00B019KW72 |       | STK   | 78.703                | 78.703  | _                                   | GBP | 2,177     | 193.163,96         | 0,27                         |
| Bridgestone Corp. Registered Shares o.N.                    | JP3830800003 |       | STK   | 5.600                 | 0       | 0                                   |     | 4.691,000 | 186.597,06         | 0,26                         |
| Fuji Corp. Registered Shares o.N.                           | JP3809200003 |       | STK   | 14.400                | 0       | _                                   | JPY | 1.930,000 | 197.410,90         | 0,27                         |

Jahresbericht Seite 8

#### Vermögensaufstellung zum 31.12.2022

|   |         | Stück bzw.    |            |            |            |     |            |            |            |
|---|---------|---------------|------------|------------|------------|-----|------------|------------|------------|
| Gattungsbezeichnung ISIN                                | Markt   | Anteile bzw.  | Bestand    | Käufe /    | Verkäufe / |     | Kurs       | Kurswert   | %          |
|   |         | Whg. in 1.000 | 31.12.2022 | Zugänge    | Abgänge    |     |            | in EUR     | des Fonds- |
|   |         |               |            | im Bericht | szeitraum  |     |            |            | vermögens  |
| KDDI Corp. Registered Shares o.N. JP3496                | 6400007 | STK           | 5.000      | 0          | 0          | JPY | 3.982,000  | 141.423,83 | 0,20       |
|   | 1400001 | STK           | 6.200      | 0          |            | JPY | 6.588,000  | 290.132,65 | 0,40       |
| · · · · · · · · · · · · · · · · · · ·                   | 2600005 | STK           | 1.100      | 0          | _          | JPY | 55.580,000 | 434.272,73 | 0,60       |
| , ,   | 2000009 | STK           | 18.500     | 0          |            | JPY | 1.488,000  | 195.535,67 | 0,27       |
|   | 3054108 | STK           | 5.900      | 0          |            | NOK | 167,200    | 93.845,01  | 0,13       |
|   | 7486889 | STK           | 64.000     | 64.000     |            | SEK | 123,100    | 708.693,15 | 0,98       |
| •   | 5658117 | STK           | 15.324     | 04.000     |            | SEK | 167,650    | 231.097,85 | 0,32       |
| ·   | 9922164 | STK           | 9.079      | 0          | 4.921      | -   | 273,300    | 223.201,88 | 0,31       |
| ·   | 87Y1091 | STK           | 5.100      | 2.600      |            | USD | 161,610    | 772.384,03 | 1,07       |
| ,   | BNMY34  | STK           | 1.816      | 936        |            | USD | 266,840    | 454.110,62 | 0,63       |
| •   | 2551016 | STK           | 440        | 0          |            | USD | 210,900    | 86.960,92  | 0,12       |
|   | 0021014 | STK           | 1.452      | 4.152      | 2.700      |     | 135,600    | 184.510,54 | 0,26       |
|   | 79K3059 | STK           | 5.783      | 7.600      | 2.092      |     | 88,230     | 478.150,21 | 0,66       |
|   | 8161092 | STK           | 1.700      | 0          |            | USD | 147,750    | 235.380,94 | 0,33       |
|   | 1621009 | STK           | 880        | 0          |            | USD | 262,640    | 216.590,01 | 0,30       |
|   | P1HW54  | STK           | 687        | 1.852      | 1.165      |     | 300,140    | 193.230,42 | 0,27       |
| · · · · · · · · · · · · · · · · · · ·                   | 4131064 | STK           | 1.800      | 1.800      |            | USD | 121,350    | 204.694,97 | 0,28       |
|   | 5161014 | STK           | 2.474      | 2.474      |            | USD | 80,210     | 185.961,52 | 0,26       |
|   | 47X1019 | STK           | 294        | 694        |            | USD | 708,630    | 195.236,83 | 0,27       |
|   | 57L1089 | STK           | 110        | 0          |            | USD | 2.015,280  | 207.741,36 | 0,29       |
|   | 1371077 | STK           | 11.900     | 11.900     |            | USD | 46,270     | 515.990,07 | 0,72       |
|   | 1231015 | STK           | 987        | 987        |            | USD | 239,560    | 221.577,85 | 0,31       |
|   | 6561059 | STK           | 325        | 325        | 0          | USD | 1.387,490  | 422.579,19 | 0,59       |
|   | 9674242 | STK           | 3.758      | 2.258      | 0          | USD | 45,230     | 159.286,23 | 0,22       |
|   | 4221039 | STK           | 4.374      | 0          | 0          | USD | 47,110     | 193.102,00 | 0,27       |
|   | 4461023 | STK           | 2.850      | 0          | 7.889      | USD | 57,190     | 152.742,48 | 0,21       |
|   | 1621039 | STK           | 4.000      | 0          | 0          | USD | 78,790     | 295.342,52 | 0,41       |
|   | 1151041 | STK           | 2.988      | 2.988      | 0          | USD | 95,310     | 266.878,72 | 0,37       |
| Darden Restaurants Inc. Registered Shares o.N. US237    | 1941053 | STK           | 1.650      | 0          | 0          | USD | 138,330    | 213.892,32 | 0,30       |
|   | 1991054 | STK           | 632        | 632        | 0          | USD | 428,760    | 253.937,14 | 0,35       |
| Dentsply Sirona Inc. Registered Shares DL -,01 US249    | 06P1093 | STK           | 2.900      | 0          | 0          | USD | 31,840     | 86.529,85  | 0,12       |
| Digital Turbine Inc. Registered Shares DL -,0001 US254  | 00W1027 | STK           | 14.642     | 7.800      | 0          | USD | 15,240     | 209.112,62 | 0,29       |
| Edwards Lifesciences Corp. Registered Shares DL 1 US281 | 76E1082 | STK           | 1.600      | 0          | 0          | USD | 74,610     | 111.869,55 | 0,16       |
| · ·   | 5121099 | STK           | 4.920      | 2.766      |            | USD | 122,180    | 563.326,40 | 0,78       |
|   | 4571083 | STK           | 1.350      | 0          | 0          | USD | 365,840    | 462.828,23 | 0,64       |
|   | 6161024 | STK           | 1.628      | 1.628      | 0          | USD | 143,510    | 218.943,19 | 0,30       |

Jahresbericht Seite 9

| Vermogensauistending zum 51.12.2022                       |              |       | Stück bzw.    |            |           |            |         |            |            |
|---|--------------|-------|---------------|------------|-----------|------------|---------|------------|------------|
| Gattungsbezeichnung                                       | ISIN         | Markt | Anteile bzw.  | Bestand    | Käufe /   | Verkäufe / | Kurs    | Kurswert   | %          |
|   |              |       | Whg. in 1.000 | 31.12.2022 |           | Abgänge    |         | in EUR     | des Fonds- |
|   |              |       |               |            | im Berich | tszeitraum |         |            | vermögens  |
| Goldman Sachs Group Inc., The Registered Shares DL -,01   | US38141G1040 |       | STK           | 929        | 929       | 0 USD      | 343,380 | 298.941,07 | 0,41       |
| Ingersoll-Rand Inc. Registered Shares DL -,01             | US45687V1061 |       | STK           | 5.239      | 5.239     | 4.000 USD  | 52,250  | 256.524,93 | 0,36       |
| Intel Corp. Registered Shares DL -,001                    | US4581401001 |       | STK           | 6.345      | 3.771     | 0 USD      | 26,430  | 157.153,36 | 0,22       |
| Intuit Inc. Registered Shares DL -,01                     | US4612021034 |       | STK           | 650        | 600       | 600 USD    | 389,220 | 237.084,62 | 0,33       |
| Invesco Ltd. Registered Shares DL -,10                    | BMG491BT1088 |       | STK           | 10.500     | 10.500    | 0 USD      | 17,990  | 177.017,15 | 0,25       |
| Johnson & Johnson Registered Shares DL 1                  | US4781601046 |       | STK           | 2.372      | 2.372     | 0 USD      | 176,650 | 392.665,92 | 0,54       |
| Johnson Controls Internat. PLC Registered Shares DL -,01  | IE00BY7QL619 |       | STK           | 4.000      | 0         | 0 USD      | 64,000  | 239.902,54 | 0,33       |
| Kellogg Co. Registered Shares DL -,25                     | US4878361082 |       | STK           | 1.920      | 0         | 0 USD      | 71,240  | 128.179,93 | 0,18       |
| KLA Corp. Registered Shares DL 0,001                      | US4824801009 |       | STK           | 730        | 0         | 2.400 USD  | 377,030 | 257.925,12 | 0,36       |
| Lyondellbasell Industries NV Registered Shares A EO -,04  | NL0009434992 |       | STK           | 2.582      | 2.582     | 0 USD      | 83,030  | 200.902,88 | 0,28       |
| Mastercard Inc. Registered Shares A DL -,0001             | US57636Q1040 |       | STK           | 755        | 0         | 1.120 USD  | 347,730 | 246.027,69 | 0,34       |
| Micron Technology Inc. Registered Shares DL -,10          | US5951121038 |       | STK           | 11.984     | 5.100     | 0 USD      | 49,980  | 561.297,27 | 0,78       |
| Microsoft Corp. Registered Shares DL-,00000625            | US5949181045 |       | STK           | 3.364      | 1.544     | 1.100 USD  | 239,820 | 756.025,19 | 1,05       |
| Morgan Stanley Registered Shares DL -,01                  | US6174464486 |       | STK           | 2.060      | 0         | 0 USD      | 85,020  | 164.128,20 | 0,23       |
| NVIDIA Corp. Registered Shares DL-,001                    | US67066G1040 |       | STK           | 1.750      | 2.497     | 1.347 USD  | 146,140 | 239.663,57 | 0,33       |
| PayPal Holdings Inc. Reg. Shares DL -,0001                | US70450Y1038 |       | STK           | 4.316      | 3.086     | 0 USD      | 71,220  | 288.056,90 | 0,40       |
| PepsiCo Inc. Registered Shares DL -,0166                  | US7134481081 |       | STK           | 1.033      | 1.033     | 0 USD      | 180,660 | 174.886,87 | 0,24       |
| Procter & Gamble Co., The Registered Shares o.N.          | US7427181091 |       | STK           | 1.537      | 0         | 963 USD    | 151,560 | 218.299,80 | 0,30       |
| QUALCOMM Inc. Registered Shares DL -,0001                 | US7475251036 |       | STK           | 5.346      | 5.346     | 0 USD      | 109,940 | 550.781,78 | 0,76       |
| Regeneron Pharmaceuticals Inc. Registered Shares DL -,001 | US75886F1075 |       | STK           | 421        | 421       | 0 USD      | 721,490 | 284.647,45 | 0,39       |
| Rockwell Automation Inc. Registered Shares DL 1           | US7739031091 |       | STK           | 900        | 0         | 1.032 USD  | 257,570 | 217.236,44 | 0,30       |
| Skyworks Solutions Inc. Registered Shares DL -,25         | US83088M1027 |       | STK           | 1.770      | 0         | 0 USD      | 91,130  | 151.157,44 | 0,21       |
| Synchrony Financial Registered Shares DL -,001            | US87165B1035 |       | STK           | 7.605      | 7.605     | 0 USD      | 32,860  | 234.186,39 | 0,32       |
| Teradyne Inc. Registered Shares DL -,125                  | US8807701029 |       | STK           | 2.802      | 2.000     | 4.021 USD  | 87,350  | 229.364,35 | 0,32       |
| Texas Instruments Inc. Registered Shares DL 1             | US8825081040 |       | STK           | 2.869      | 0         | 1.831 USD  | 165,220 | 444.209,71 | 0,62       |
| Trinet Group Inc. Registered Shares DL -,0001             | US8962881079 |       | STK           | 3.075      | 3.075     | 0 USD      | 67,800  | 195.375,32 | 0,27       |
| Ulta Beauty Inc. Registered Shares DL -,01                | US90384S3031 |       | STK           | 1.180      | 1.613     | 1.163 USD  | 469,070 | 518.697,97 | 0,72       |
| UnitedHealth Group Inc. Registered Shares DL -,01         | US91324P1021 |       | STK           | 887        | 887       | 0 USD      | 530,180 | 440.698,77 | 0,61       |
| VISA Inc. Reg. Shares Class A DL -,0001                   | US92826C8394 |       | STK           | 1.238      | 700       | 2.062 USD  | 207,760 | 241.033,53 | 0,33       |
| Walt Disney Co., The Registered Shares DL -,01            | US2546871060 |       | STK           | 6.034      | 779       | 0 USD      | 86,880  | 491.269,72 | 0,68       |
| Warner Bros. Discovery Inc. Reg. Shares Series A DL-,01   | US9344231041 |       | STK           | 8.538      | 8.538     | 0 USD      | 9,480   | 75.850,66  | 0,11       |
| Waste Management Inc. Registered Shares DL -,01           | US94106L1098 |       | STK           | 2.909      | 1.259     | 0 USD      | 156,880 | 427.667,44 | 0,59       |
| Waters Corp. Registered Shares DL -,01                    | US9418481035 |       | STK           | 720        | 0         | 0 USD      | 342,580 | 231.147,60 | 0,32       |
| Western Union Co. Registered Shares DL -,01               | US9598021098 |       | STK           | 6.700      | 0         | 0 USD      | 13,770  | 86.457,69  | 0,12       |
| Whirlpool Corp. Registered Shares DL 1                    | US9633201069 |       | STK           | 1.563      | 1.563     | 0 USD      | 141,460 | 207.198,93 | 0,29       |

| Gattungsbezeichnung  | ISIN                         | Markt | Stück bzw.<br>Anteile bzw.<br>Whg. in 1.000 | Bestand<br>31.12.2022 | Zugänge    | Verkäufe /<br>Abgänge<br>itszeitraum |            | Kurs              | Kurswert<br>in EUR       | %<br>des Fonds-<br>vermögens |
|--|------------------------------|-------|---|-----------------------|------------|--------------------------------------|------------|-------------------|--------------------------|------------------------------|
| Zoetis Inc. Registered Shares Cl.A DL -,01 Zoom Video Communications Inc. Registered Shs Cl.A DL -,001 | US98978V1035<br>US98980L1017 |       | STK<br>STK                                  | 1.445<br>1.955        | 0<br>1.955 |                                      | USD<br>USD | 146,550<br>67,740 | 198.448,83<br>124.104,30 | 0,28<br>0,17                 |
| Verzinsliche Wertpapiere   |                              |       |   |                       |            |                                      | EUR        |                   | 27.047.283,00            | 37,51                        |
| 0,6250 % adidas AG Anleihe v.2020(2020/2035)   | XS2224621420                 |       | EUR   | 500                   | 0          | 0                                    | %          | 69,423            | 347.115,00               | 0,48                         |
| 4,7500 % Allianz SE FLR-Med.Ter.Nts.v.13(23/unb.)  | DE000A1YCQ29                 |       | EUR   | 1.000                 | 1.000      | 0                                    | %          | 99,443            | 994.430,00               | 1,38                         |
| 1,9500 % AT & T Inc. EO-Notes 2019(19/23)  | XS1998902479                 |       | EUR   | 600                   | 600        | 0                                    | %          | 99,340            | 596.040,00               | 0,83                         |
| 5,0000 % AT&S Austria Techn.&Systemt.AG EO-FLR Notes 2022(22/Und.)                                     | XS2432941693                 |       | EUR   | 1.000                 | 1.000      | 0                                    | %          | 86,835            | 868.350,00               | 1,20                         |
| 0,2500 % Australia & N. Z. Bkg Grp Ltd. EO-MedTerm Cov. Bds 2022(25)                                   | XS2456253082                 |       | EUR   | 500                   | 500        | 0                                    | %          | 93,234            | 466.170,00               | 0,65                         |
| 0,6250 % Aviva PLC EO-MedTerm Nts 2016(23)   | XS1509003361                 |       | EUR   | 1.000                 | 1.000      | 0                                    | %          | 97,893            | 978.930,00               | 1,36                         |
| 3,2700 % AXA S.A. EO-FLR MedT. Nts 03(13/Und.)   | XS0179060974                 |       | EUR   | 400                   | 0          | 0                                    | %          | 81,444            | 325.776,00               | 0,45                         |
| 2,5770 % Banco Bilbao Vizcaya Argent. EO-FLR Non-Pref. MTN 2018(23)                                    | XS1788584321                 |       | EUR   | 500                   | 0          | 0                                    | %          | 100,065           | 500.325,00               | 0,69                         |
| 0,1000 % Banco Santander S.A. EO-FLR Preferred MTN 22(24/25)   | XS2436160779                 |       | EUR   | 700                   | 700        | 0                                    | %          | 96,357            | 674.499,00               | 0,94                         |
| 1,4010 % Becton, Dickinson & Co. EO-Notes 2018(18/23)  | XS1822506272                 |       | EUR   | 1.200                 | 1.200      | 0                                    | %          | 99,665            | 1.195.980,00             | 1,66                         |
| 0,7500 % Bque Fédérative du Cr. Mutuel EO-Medium-Term Notes 2018(25)                                   | XS1750122225                 |       | EUR   | 500                   | 500        | 0                                    | %          | 93,202            | 466.010,00               | 0,65                         |
| 0,6250 % Bque Fédérative du Cr. Mutuel EO-Non-Preferred MTN 2021(28)                                   | FR0014003SA0                 |       | EUR   | 500                   | 0          | 0                                    | %          | 81,612            | 408.060,00               | 0,57                         |
| 2,1250 % C.N.d.Reas.Mut.Agrico.Group.SA EO-Notes 2019(29)  | FR0013447125                 |       | EUR   | 100                   | 0          | 0                                    | %          | 84,055            | 84.055,00                | 0,12                         |
| 0,7500 % C.N.d.Reas.Mut.Agrico.Group.SA EO-Notes 2021(28/28)   | FR0014004EF7                 |       | EUR   | 400                   | 0          | 0                                    | %          | 80,927            | 323.708,00               | 0,45                         |
| 0,8000 % Capital One Financial Corp. EO-Notes 2019(24)   | XS2009011771                 |       | EUR   | 250                   | 250        | 0                                    | %          | 95,124            | 237.810,00               | 0,33                         |
| 1,1250 % Celanese US Holdings LLC EO-Notes 2016(16/23)   | XS1492691008                 |       | EUR   | 1.200                 | 1.200      | 0                                    | %          | 98,261            | 1.179.132,00             | 1,64                         |
| 0,5000 % Ceská Sporitelna AS EO-FLR Non-Pref.MTN 21(27/28)   | AT0000A2STV4                 |       | EUR   | 500                   | 0          | 0                                    | %          | 80,949            | 404.745,00               | 0,56                         |
| 6,6930 % Ceská Sporitelna AS EO-FLR Non-Pref.MTN 22(24/25)   | XS2555412001                 |       | EUR   | 300                   | 300        | 0                                    | %          | 102,560           | 307.680,00               | 0,43                         |
| 4,7500 % CNP Assurances S.A. EO-FLR Notes 2018(28/Und.)  | FR0013336534                 |       | EUR   | 600                   | 600        | 0                                    | %          | 92,560            | 555.360,00               | 0,77                         |
| 0,2500 % Commerzbank AG MTN-IHS S.939 v.19(24)   | DE000CZ45VB7                 |       | EUR   | 500                   | 0          | 0                                    | %          | 93,840            | 469.200,00               | 0,65                         |
| 1,6250 % Compagnie de Saint-Gobain S.A. EO-Medium-Term Notes 22(22/25)                                 | XS2517103250                 |       | EUR   | 500                   | 500        | 0                                    | %          | 95,161            | 475.805,00               | 0,66                         |
| 0,2500 % Credit Suisse AG EO-Medium-Term Notes 2021(26)  | XS2345982362                 |       | EUR   | 500                   | 0          | 0                                    | %          | 85,013            | 425.065,00               | 0,59                         |
| 1,3750 % Deutsche Bank AG FLR-MTN v.20(25/26)  | DE000DL19VP0                 |       | EUR   | 400                   | 400        | 0                                    | %          | 91,187            | 364.748,00               | 0,51                         |
| 1,7500 % Deutsche Bank AG FLR-MTN v.20(29/30)  | DE000DL19VS4                 |       | EUR   | 700                   | 0          | 0                                    | %          | 78,486            | 549.402,00               | 0,76                         |
| 4,3750 % Deutsche Pfandbriefbank AG MTN R.35416 v.22(26)   | DE000A30WFV1                 |       | EUR   | 500                   | 500        | 0                                    | %          | 96,256            | 481.280,00               | 0,67                         |
| 0,1250 % E.ON SE Medium Term Notes v.22(25/26)   | XS2433244089                 |       | EUR   | 700                   | 700        | 0                                    | %          | 90,510            | 633.570,00               | 0,88                         |
| 4,0000 % Fresenius SE & Co. KGaA EO-Notes 2014(14/24) Reg.S  | XS1026109204                 |       | EUR   | 600                   | 600        | 0                                    | %          | 100,423           | 602.538,00               | 0,84                         |
| 3,0000 % Glo.Wr.Real Estate Invest.Ltd. EO-Medium-Term Nts 2018(18/25)                                 | XS1799975922                 |       | EUR   | 300                   | 0          | 0                                    |            | 87,630            | 262.890,00               | 0,36                         |
| 3,0620 % Goldman Sachs Group Inc., The EO-FLR MedT. Nts 2021(25/26)                                    | XS2322254165                 |       | EUR   | 300                   | 300        | 0                                    |            | 99,250            | 297.750,00               | 0,41                         |
| 0,1250 % Goldman Sachs Group Inc., The EO-Medium-Term Nts 2019(24)                                     | XS2043678841                 |       | EUR   | 500                   | 500        | 0                                    |            | 94,946            | 474.730,00               | 0,66                         |
| 0,6250 % Grenke Finance PLC EO-MedTerm Nts 2022(25) Tr.2   | XS2560495207                 |       | EUR   | 300                   | 300        | 0                                    | %          | 89,049            | 267.147,00               | 0,37                         |

| Gattungsbezeichnung   | ISIN                         | Markt | Stück bzw.<br>Anteile bzw.<br>Whg. in 1.000 | Bestand<br>31.12.2022 | Zugänge    | Verkäufe /<br>Abgänge<br>itszeitraum |        | Kurs    | Kurswert<br>in EUR | %<br>des Fonds-<br>vermögens |
|---|------------------------------|-------|---|-----------------------|------------|--------------------------------------|--------|---------|--------------------|------------------------------|
| 2 OFOO N. Caralla Financa PLC FO Madisura Tarra Natas 2000/05)      | VC0455400040                 |       | EUD   | 400                   | 0          | 0                                    | 0/     | 05.000  | 200 000 00         | 0.50                         |
| 3,9500 % Grenke Finance PLC EO-Medium-Term Notes 2020(25)           | XS2155486942                 |       | EUR   | 400                   | 0          | 0                                    | %<br>% | 95,202  | 380.808,00         | 0,53                         |
| 4,1250 % Grenke Finance PLC EO-Medium-Term Notes 2022(24)           | XS2469031749<br>XS0856556807 |       | EUR<br>EUR                                  | 500<br>400            | 500<br>400 | 0                                    |        | 96,956  | 484.780,00         | 0,67                         |
| 5,0000 % Hannover Finance (Lux.) S.A. EO-FLR Notes 2012(23/43)      | DE000HCB0BQ0                 |       | EUR   |                       | 300        | 0                                    | %<br>% | 100,322 | 401.288,00         | 0,56                         |
| 6,2500 % HCOB 6 1/4 11/18/24  |                              |       |   | 300                   |            | 0                                    |        | 101,322 | 303.966,00         | 0,42                         |
| 1,0000 % HELLA GmbH & Co. KGaA EO-Notes 2017(17/24)                 | XS1611167856                 |       | EUR   | 200                   | 200        | 0                                    | %      | 96,429  | 192.858,00         | 0,27                         |
| 0,6250 % Infineon Technologies AG Medium Term Notes v.22(22/25)     | XS2443921056                 |       | EUR   | 700                   | 700        | 0                                    | %      | 94,003  | 658.021,00         | 0,91                         |
| 0,3750 % Medtronic Global Holdings SCA EO-Notes 2019(19/23)         | XS1960678099                 |       | EUR   | 1.100                 | 1.100      | 0                                    | %      | 99,718  | 1.096.898,00       | 1,52                         |
| 0,2500 % Mercedes-Benz Int.Fin. B.V. EO-Medium-Term Notes 2019(23)  | DE000A2R9ZT1                 |       | EUR<br>EUR                                  | 500                   | 500        | 0                                    | %      | 97,710  | 488.550,00         | 0,68                         |
| 0,7500 % Nestlé Finance Intl Ltd. EO-Medium-Term Nts.2015(15/23)    | XS1319652902                 |       | _   | 1.200                 | 1.200      | 0                                    | %      | 99,515  | 1.194.180,00       | 1,66                         |
| 0,5000 % Orange S.A. EO-Medium-Term Nts 2019(19/32)                 | FR0013444684                 |       | EUR   | 200                   | 0          | 0                                    | %      | 72,731  | 145.462,00         | 0,20                         |
| 1,8410 % Power Finance Corp. Ltd. EO-Medium-Term Notes 2021(28)     | XS2384373341                 |       | EUR   | 400                   | 0          | 0                                    | %      | 79,504  | 318.016,00         | 0,44                         |
| 2,0310 % Prosus N.V. EO-MedT.Nts 2020(20/32)Reg.S                   | XS2211183756                 |       | EUR   | 200                   | 0          | 0                                    | %      | 71,125  | 142.250,00         | 0,20                         |
| 2,2500 % Quadient S.A. EO-Obl. 2020(20/25)                          | FR0013478849                 |       | EUR   | 500                   | 0          | 0                                    | %      | 92,568  | 462.840,00         | 0,64                         |
| 1,1250 % SAP SE Med.Term Nts. v.2014(22/23)                         | DE000A13SL26                 |       | EUR   | 1.500                 | 1.500      | 0                                    | %      | 99,833  | 1.497.495,00       | 2,08                         |
| 1,0000 % Société Générale S.A. EO-FLR MedT. Nts 2020(25/30)         | FR0014000OZ2                 |       | EUR   | 300                   | 0          | 0                                    | %      | 87,730  | 263.190,00         | 0,37                         |
| 3,3750 % Stellantis N.V. EO-MedTerm Notes 2020(20/23)               | XS2178832379                 |       | EUR   | 1.200                 | 1.200      | 0                                    | %      | 100,190 | 1.202.280,00       | 1,67                         |
| 0,2500 % Telenor ASA EO-Medium-Term Nts 2019(19/27)                 | XS2056396919                 |       | EUR   | 300                   | 0          | 0                                    | %      | 84,921  | 254.763,00         | 0,35                         |
| 0,2500 % Toyota Motor Credit Corp. EO-Medium-Term Notes 2020(26)    | XS2102948994                 |       | EUR   | 300                   | 0          | 0                                    | %      | 89,643  | 268.929,00         | 0,37                         |
| 0,8000 % UniCredit S.p.A. EO-FLR Preferred MTN 21(28/29)            | XS2360310044                 |       | EUR   | 500                   | 0          | 0                                    | %      | 80,493  | 402.465,00         | 0,56                         |
| 0,8750 % Verizon Communications Inc. EO-Notes 2019(19/32)           | XS2052320954                 |       | EUR   | 500                   | 0          | 0                                    | %      | 75,274  | 376.370,00         | 0,52                         |
| 4,2500 % Volkswagen Intl Finance N.V. EO-Medium-Term Notes 2022(28) | XS2554488978                 |       | EUR   | 300                   | 300        | 0                                    | %      | 97,858  | 293.574,00         | 0,41                         |
| Zertifikate   |                              |       |   |                       |            |                                      | EUR    |         | 2.487.453,36       | 3,45                         |
| Deut. Börse Commodities GmbH Xetra-Gold IHS 2007(09/Und)            | DE000A0S9GB0                 |       | STK   | 25.000                | 10.000     | 46.300                               | EUR    | 54,795  | 1.369.875,00       | 1,90                         |
| WisdomTree Multi Ass.Iss.PLC LevDAX 3xLev.ETP Secs12(12/62)         | IE00B878KX55                 |       | STK   | 7.288                 | 7.288      | 0                                    | EUR    | 153,345 | 1.117.578,36       | 1,55                         |
| Sonstige Beteiligungswertpapiere                                    |                              |       |   |                       |            |                                      | EUR    |         | 161.568,74         | 0,22                         |
| Roche Holding AG Inhaber-Genussscheine o.N.                         | CH0012032048                 |       | STK   | 549                   | 549        | 0                                    | CHF    | 290,500 | 161.568,74         | 0,22                         |

| Gattungsbezeichnung   | ISIN           | Markt   | Stück bzw.<br>Anteile bzw.<br>Whg. in 1.000 | Bestand<br>31.12.2022 | Zugänge | Verkäufe /<br>Abgänge<br>tszeitraum |     | Kurs    | Kurswert<br>in EUR | %<br>des Fonds-<br>vermögens |
|---|----------------|---------|---|-----------------------|---------|-------------------------------------|-----|---------|--------------------|------------------------------|
| An organisierten Märkten zugelassene oder in diese e                | einbezogene We | ertpapi | ere   |                       |         |                                     | EUR |         | 6.736.653,12       | 9,34                         |
| Verzinsliche Wertpapiere  |                |         |   |                       |         |                                     | EUR |         | 6.499.371,12       | 9,01                         |
| 0,6250 % ABB Finance B.V. EO-Medium-T. Notes 2016(16/23)            | XS1402941790   |         | EUR   | 1.100                 | 1.100   | 0                                   | %   | 99,333  | 1.092.663,00       | 1,52                         |
| 3,2480 % Abertis Infraestruct. Fin. BV EO-FLR Notes 2020(25/Und.)   | XS2256949749   |         | EUR   | 500                   | 0       | 0                                   | %   | 84,925  | 424.625,00         | 0,59                         |
| 5,6250 % AEGON N.V. EO-FLR Notes 2019(29/Und.)                      | XS1886478806   |         | EUR   | 200                   | 0       | 0                                   | %   | 93,096  | 186.192,00         | 0,26                         |
| 2,6250 % Allianz SE FLR-Sub.Ter.Nts.v.20(30/unb.)                   | DE000A289FK7   |         | EUR   | 400                   | 400     | 0                                   | %   | 73,931  | 295.724,00         | 0,41                         |
| 0,7500 % Autoliv Inc. EO-Notes 2018(18/23)                          | XS1713462585   |         | EUR   | 1.200                 | 1.200   | 0                                   | %   | 99,554  | 1.194.648,00       | 1,66                         |
| 1,1250 % Berkshire Hathaway Inc. EO-Notes 2015(15/27)               | XS1200679071   |         | EUR   | 200                   | 200     | 0                                   | %   | 89,946  | 179.892,00         | 0,25                         |
| 4,0000 % Booking Holdings Inc. EO-Notes 2022(22/26)                 | XS2555218291   |         | EUR   | 300                   | 300     | 0                                   | %   | 100,848 | 302.544,00         | 0,42                         |
| 2,7500 % Fairfax Finl Holdings Ltd. EO-Notes 2018(18/28) Reg.S      | XS1794675931   |         | EUR   | 200                   | 200     | 0                                   | %   | 87,443  | 174.886,00         | 0,24                         |
| 3,8750 % Grifols Escrow Issuer S.A. EO-Notes 2021(21/28) Reg.S      | XS2393001891   |         | EUR   | 250                   | 0       | 0                                   | %   | 84,469  | 211.172,50         | 0,29                         |
| 1,6250 % Grifols S.A. EO-Notes 2019(19/25) Reg.S                    | XS2076836555   |         | EUR   | 300                   | 300     | 0                                   | %   | 95,035  | 285.105,00         | 0,40                         |
| 3,5000 % Intrum AB EO-MedT. Nts 19(19/26) Reg.S                     | XS2034925375   |         | EUR   | 400                   | 0       | 0                                   | %   | 84,313  | 337.252,00         | 0,47                         |
| 3,0000 % Intrum AB EO-MedT. Nts 19(19/27) Reg.S                     | XS2052216111   |         | EUR   | 100                   | 0       | 0                                   | %   | 80,186  | 80.186,00          | 0,11                         |
| 5,7500 % Lenzing AG EO-FLR Notes 2020(20/Und.)                      | XS2250987356   |         | EUR   | 500                   | 0       | 0                                   | %   | 84,213  | 421.065,00         | 0,58                         |
| 2,0030 % Thermo Fisher Scient.(Fin.I)BV EO-FLR Notes 2021(23)       | XS2407911705   |         | EUR   | 1.000                 | 1.000   | 0                                   | %   | 99,869  | 998.690,00         | 1,39                         |
| 4,0000 % Vossloh AG SubFLR-Nts.v.21(26/unb.)                        | DE000A3H2VA6   |         | EUR   | 100                   | 100     | 0                                   | %   | 93,722  | 93.722,00          | 0,13                         |
| 2,1250 % Wüstenrot& Württembergische AG FLR-NachrAnl. v.21(31/41)   | XS2378468420   |         | EUR   | 300                   | 300     | 0                                   | %   | 70,482  | 211.446,00         | 0,29                         |
| 7,3750 % Unifin Finan. S.A.B. de C.V. DL-Notes 2018(18/26) Reg.S    | USP94461AE36   |         | USD   | 300                   | 300     | 0                                   | %   | 3,400   | 9.558,62           | 0,01                         |
| Wandelanleihen  |                |         |   |                       |         |                                     | EUR |         | 237.282,00         | 0,33                         |
| 6,3980 % Mitsub. UFJ Invest.Ser.Bk.Dep. EO-FLR Exch. Notes 2009(50) | XS0413650218   |         | EUR   | 600                   | 0       | 0                                   | %   | 39,547  | 237.282,00         | 0,33                         |
| Investmentanteile   |                |         |   |                       |         |                                     | EUR |         | 1.745.080,73       | 2,42                         |
| KVG - eigene Investmentanteile                                      |                |         |   |                       |         |                                     | EUR |         | 915.860,00         | 1,27                         |
| EB-Sustainable Em.Mkts Corp.Bd Inhaber-Anteile AK I                 | DE000A2JF7T2   |         | ANT   | 11.500                | 0       | 0                                   | EUR | 79,640  | 915.860,00         | 1,27                         |

| Gattungsbezeichnung  | ISIN         | Markt      | Stück bzw.<br>Anteile bzw.<br>Whg. in 1.000 | Bestand<br>31.12.2022  | Käufe /<br>Zugänge<br>im Berich | Verkäufe /<br>Abgänge<br>utszeitraum | Kurs   | Kurswert<br>in EUR     | %<br>des Fonds-<br>vermögens |
|--|--------------|------------|---|------------------------|---------------------------------|--------------------------------------|--------|------------------------|------------------------------|
| Gruppenfremde Investmentanteile  |              |            |   |                        |                                 | EUR                                  |        | 829.220,73             | 1,15                         |
| iShs Core MSCI EM IMI U.ETF Registered Shares o.N.                           | IE00BKM4GZ66 |            | ANT   | 30.896                 | 30.896                          | 0 USD                                | 28,640 | 829.220,73             | 1,15                         |
| Summe Wertpapiervermögen 2)  |              |            |   |                        |                                 | EUR                                  |        | 68.524.401,29          | 95,04                        |
| Derivate   |              |            |   |                        |                                 | EUR                                  |        | 228.000,00             | 0,32                         |
| (Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte P | ositionen.)  |            |   |                        |                                 |                                      |        |                        |                              |
| Aktienindex-Derivate Forderungen/Verbindlichkeiten                           |              |            |   |                        |                                 | EUR                                  |        | 196.450,00             | 0,27                         |
| Aktienindex-Terminkontrakte  |              |            |   |                        |                                 | EUR                                  |        | 196.450,00             | 0,27                         |
| FUTURE EURO STOXX 50 PR.EUR 03.23 EUREX                                      |              | 185        | EUR   | Anzahl -150            |                                 |                                      |        | 196.450,00             | 0,27                         |
| <b>Zins-Derivate</b> Forderungen/Verbindlichkeiten                           |              |            |   |                        |                                 | EUR                                  |        | 31.550,00              | 0,04                         |
| Zinsterminkontrakte  |              |            |   |                        |                                 | EUR                                  |        | 31.550,00              | 0,04                         |
| FUTURE EURO-BOBL 03.23 EUREX<br>FUTURE EURO-BUND 03.23 EUREX                 |              | 185<br>185 | EUR<br>EUR                                  | -1.000.000<br>-500.000 |                                 |                                      |        | 14.300,00<br>17.250,00 | 0,02<br>0,02                 |

| Gattungsbezeichnung                             | ISIN             | Markt     | Stück bzw.<br>Anteile bzw.<br>Whg. in 1.000 | Bestand<br>31.12.2022 | Käufe / Verkäufe /<br>Zugänge Abgänge<br>im Berichtszeitraum |     | Kurs    | Kurswert<br>in EUR | %<br>des Fonds-<br>vermögens |
|---|------------------|-----------|---|-----------------------|--|-----|---------|--------------------|------------------------------|
| Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrui | mente und Geldma | arktfonds | i   |                       |  | EUR |         | 3.138.116,41       | 4,35                         |
| Bankguthaben                                    |                  |           |   |                       |  | EUR |         | 3.138.116,41       | 4,35                         |
| EUR - Guthaben bei:                             |                  |           |   |                       |  |     |         |                    |                              |
| Evangelische Bank eG                            |                  |           | EUR   | 3.120.752,75          |  | %   | 100,000 | 3.120.752,75       | 4,33                         |
| Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen bei:     |                  |           |   |                       |  |     |         |                    |                              |
| Evangelische Bank eG                            |                  |           | DKK   | 6.961,68              |  | %   | 100,000 | 936,18             | 0,00                         |
| Evangelische Bank eG                            |                  |           | SEK   | 6.511,15              |  | %   | 100,000 | 585,70             | 0,00                         |
| Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen bei:         |                  |           |   |                       |  |     |         |                    |                              |
| Evangelische Bank eG                            |                  |           | AUD   | 82,69                 |  | %   | 100,000 | 52,56              | 0,00                         |
| Evangelische Bank eG                            |                  |           | CAD   | 11.566,55             |  | %   | 100,000 | 8.000,66           | 0,01                         |
| Evangelische Bank eG                            |                  |           | CHF   | 620,57                |  | %   | 100,000 | 628,68             | 0,00                         |
| Evangelische Bank eG                            |                  |           | GBP   | 2.740,47              |  | %   | 100,000 | 3.089,59           | 0,00                         |
| Evangelische Bank eG                            |                  |           | JPY   | 7.853,00              |  | %   | 100,000 | 55,78              | 0,00                         |
| Evangelische Bank eG                            |                  |           | USD   | 4.283,88              |  | %   | 100,000 | 4.014,51           | 0,01                         |
| Sonstige Vermögensgegenstände                   |                  |           |   |                       |  | EUR |         | 361.131,55         | 0,50                         |
| Zinsansprüche                                   |                  |           | EUR   | 292.043,40            |  |     |         | 292.043,40         | 0,41                         |
| Dividendenansprüche                             |                  |           | EUR   | 49.162,93             |  |     |         | 49.162,93          | 0,07                         |
| Quellensteueransprüche                          |                  |           | EUR   | 19.925,22             |  |     |         | 19.925,22          | 0,03                         |

#### Vermögensaufstellung zum 31.12.2022

| Gattungsbezeichnung   | ISIN | Stück bz<br>Markt Anteile bz<br>Whg. in 1. | w. Bestand  |                          | ırs Kurswert<br>in EUR  | %<br>des Fonds-<br>vermögens |
|---|------|--|---|--------------------------|---|------------------------------|
| Sonstige Verbindlichkeiten  |      |  |   | EUR                      | -150.892,56   | -0,21                        |
| Zinsverbindlichkeiten Verwaltungsvergütung Verwahrstellenvergütung Prüfungskosten Veröffentlichungskosten |      | EUR<br>EUR<br>EUR<br>EUR<br>EUR            | -1.434,97<br>-136.476,01<br>-3.581,58<br>-8.900,00<br>-500,00 |                          | -1.434,97<br>-136.476,01<br>-3.581,58<br>-8.900,00<br>-500,00 | -0,19<br>0,00<br>-0,01       |
| Fondsvermögen   |      |  |   | EUR                      | 72.100.756,69   | 100,00 1)                    |
| Stiftungsfonds ESG Global AK S  |      |  |   |                          |   |                              |
| Anteilwert Ausgabepreis Rücknahmepreis Anzahl Anteile   |      |  |   | EUR<br>EUR<br>EUR<br>STK | 114,73<br>114,73<br>114,73<br>628.455                         |                              |

#### Fußnoten:

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

<sup>2)</sup> Die Wertpapiere und Schuldscheindarlehen des Sondervermögens sind teilweise durch Geschäfte mit Finanzinstrumenten abgesichert.

#### Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

Die Vermögensgegenstände des Sondervermögens sind auf Grundlage der zuletzt festgestellten Kurse/Marktsätze bewertet.

#### Devisenkurse (in Mengennotiz)

| , , |       | per 30.12.2022 |               |
|-----|-------|----------------|---------------|
| AUD | (AUD) | 1,5732000      | = 1 EUR (EUR) |
| CAD | (CAD) | 1,4457000      | = 1 EUR (EUR) |
| CHF | (CHF) | 0,9871000      | = 1 EUR (EUR) |
| DKK | (DKK) | 7,4363000      | = 1 EUR (EUR) |
| GBP | (GBP) | 0,8870000      | = 1 EUR (EUR) |
| JPY | (JPY) | 140,7825000    | = 1 EUR (EUR) |
| NOK | (NOK) | 10,5118000     | = 1 EUR (EUR) |
| SEK | (SEK) | 11,1168000     | = 1 EUR (EUR) |
| USD | (USD) | 1,0671000      | = 1 EUR (EUR) |

#### Marktschlüssel

#### b) Terminbörsen

185 Eurex Deutschland

| Gattungsbezeichnung                                      | ISIN         | Stück bzw. Anteile<br>Whg. in 1.000 | Käufe<br>bzw.<br>Zugänge | Verkäufe<br>bzw.<br>Abgänge | Volumen<br>in 1.000 |
|--|--------------|-------------------------------------|--------------------------|-----------------------------|---------------------|
| Börsengehandelte Wertpapiere                             |              |                                     |                          |                             |                     |
| Aktien   |              |                                     |                          |                             |                     |
| ACCOR S.A. Actions Port. EO 3                            | FR0000120404 | STK                                 | 0                        | 13.000                      |                     |
| Activision Blizzard Inc. Registered Shares DL-,000001    | US00507V1098 | STK                                 | 0                        | 11.465                      |                     |
| adidas AG Namens-Aktien o.N.                             | DE000A1EWWW0 | STK                                 | 0                        | 944                         |                     |
| Adobe Inc. Registered Shares o.N.                        | US00724F1012 | STK                                 | 0                        | 1.014                       |                     |
| Advanced Micro Devices Inc. Registered Shares DL -,01    | US0079031078 | STK                                 | 2.600                    | 2.600                       |                     |
| AIA Group Ltd Registerd Shares o.N.                      | HK0000069689 | STK                                 | 0                        | 20.600                      |                     |
| Allianz SE vink.Namens-Aktien o.N.                       | DE0008404005 | STK                                 | 0                        | 2.000                       |                     |
| Amazon.com Inc. Registered Shares DL -,01                | US0231351067 | STK                                 | 2.000                    | 2.100                       |                     |
| Apple Inc. Registered Shares o.N.                        | US0378331005 | STK                                 | 0                        | 6.030                       |                     |
| Applied Materials Inc. Registered Shares o.N.            | US0382221051 | STK                                 | 3.370                    | 3.370                       |                     |
| Assa-Abloy AB Namn-Aktier B SK -,33                      | SE0007100581 | STK                                 | 0                        | 10.700                      |                     |
| Bank of America Corp. Registered Shares DL 0,01          | US0605051046 | STK                                 | 5.300                    | 12.800                      |                     |
| Barclays PLC Registered Shares LS 0,25                   | GB0031348658 | STK                                 | 123.310                  | 123.310                     |                     |
| Bayerische Motoren Werke AG Stammaktien EO 1             | DE0005190003 | STK                                 | 2.952                    | 2.952                       |                     |
| BE Semiconductor Inds N.V. Aandelen op Naam EO-,01       | NL0012866412 | STK                                 | 0                        | 4.000                       |                     |
| Block Inc. Registered Shs Class A                        | US8522341036 | STK                                 | 0                        | 1.900                       |                     |
| Canadian Pacific Railway Ltd. Registered Shares o.N.     | CA13645T1003 | STK                                 | 3.140                    | 3.140                       |                     |
| Capital One Financial Corp. Registered Shares DL -,01    | US14040H1059 | STK                                 | 0                        | 2.200                       |                     |
| Check Point Software Techs Ltd Registered Shares IS -,01 | IL0010824113 | STK                                 | 0                        | 2.819                       |                     |
| Cigna Corp. Registered Shares DL 1                       | US1255231003 | STK                                 | 0                        | 1.600                       |                     |
| Clorox Co., The Registered Shares DL 1                   | US1890541097 | STK                                 | 0                        | 1.000                       |                     |
| Coca-Cola Co., The Registered Shares DL -,25             | US1912161007 | STK                                 | 0                        | 2.400                       |                     |
| Corbion N.V. Aandelen op naam EO-,25                     | NL0010583399 | STK                                 | 0                        | 5.163                       |                     |
| Credit Suisse Group AG Namens-Aktien SF -,04             | CH0012138530 | STK                                 | 0                        | 13.500                      |                     |
| Daimler Truck Holding AG Namens-Aktien o.N.              | DE000DTR0CK8 | STK                                 | 8.975                    | 8.975                       |                     |
| Danone S.A. Actions Port. EO-,25                         | FR0000120644 | STK                                 | 0                        | 14.000                      |                     |
| Deutsche Börse AG Namens-Aktien o.N.                     | DE0005810055 | STK                                 | 0                        | 1.500                       |                     |
| Dominos Pizza Inc. Registered Shares DL -,01             | US25754A2015 | STK                                 | 731                      | 731                         |                     |
| Etsy Inc. Registered Shares DL -,001                     | US29786A1060 | STK                                 | 1.764                    | 1.764                       |                     |
| Everest Reinsurance Group Ltd. Registered Shares DL -,01 | BMG3223R1088 | STK                                 | 1.200                    | 1.200                       |                     |
| Fanuc Corp. Registered Shares o.N.                       | JP3802400006 | STK                                 | 0                        | 2.200                       |                     |

| Gattungsbezeichnung                                      | ISIN         | Stück bzw. Anteile<br>Whg. in 1.000 | Käufe<br>bzw.<br>Zugänge | Verkäufe<br>bzw.<br>Abgänge | Volumen<br>in 1.000 |
|--|--------------|-------------------------------------|--------------------------|-----------------------------|---------------------|
| Fedex Corp. Registered Shares DL -,10                    | US31428X1063 | STK                                 | 1.338                    | 1.338                       |                     |
| Fiserv Inc. Registered Shares DL -,01                    | US3377381088 | STK                                 | 6.100                    | 6.100                       |                     |
| Fresenius SE & Co. KGaA Inhaber-Aktien o.N.              | DE0005785604 | STK                                 | 8.036                    | 8.036                       |                     |
| GN Store Nord AS Navne-Aktier DK 1                       | DK0010272632 | STK                                 | 0                        | 4.600                       |                     |
| H & M Hennes & Mauritz AB Namn-Aktier B SK 0,125         | SE0000106270 | STK                                 | 0                        | 8.700                       |                     |
| Illumina Inc. Registered Shares DL -,01                  | US4523271090 | STK                                 | 0                        | 800                         |                     |
| IPG Photonics Corp. Registered Shares DL -,0001          | US44980X1090 | STK                                 | 0                        | 1.674                       |                     |
| JPMorgan Chase & Co. Registered Shares DL 1              | US46625H1005 | STK                                 | 0                        | 2.100                       |                     |
| Koninklijke DSM N.V. Aandelen op naam EO 1,50            | NL0000009827 | STK                                 | 0                        | 1.300                       |                     |
| Lam Research Corp. Registered Shares DL -,001            | US5128071082 | STK                                 | 574                      | 574                         |                     |
| Lumentum Holdings Inc. Registered Shares DL -,001        | US55024U1097 | STK                                 | 2.291                    | 6.091                       |                     |
| Marvell Technology Inc. Registered Shares DL -,002       | US5738741041 | STK                                 | 0                        | 4.100                       |                     |
| Masimo Corp. Registered Shares DL -,001                  | US5747951003 | STK                                 | 2.228                    | 3.533                       |                     |
| Medtronic PLC Registered Shares DL -,0001                | IE00BTN1Y115 | STK                                 | 0                        | 850                         |                     |
| Moody's Corp. Registered Shares DL-,01                   | US6153691059 | STK                                 | 1.000                    | 1.922                       |                     |
| Newmont Corp. Registered Shares DL 1,60                  | US6516391066 | STK                                 | 0                        | 5.900                       |                     |
| Novartis AG Namens-Aktien SF 0,50                        | CH0012005267 | STK                                 | 2.600                    | 2.600                       |                     |
| NXP Semiconductors NV Aandelen aan toonder EO -,20       | NL0009538784 | STK                                 | 0                        | 1.570                       |                     |
| OMV AG Inhaber-Aktien o.N.                               | AT0000743059 | STK                                 | 5.811                    | 5.811                       |                     |
| Orsted A/S Indehaver Aktier DK 10                        | DK0060094928 | STK                                 | 0                        | 2.000                       |                     |
| Pfizer Inc. Registered Shares DL -,05                    | US7170811035 | STK                                 | 3.990                    | 3.990                       |                     |
| Proto Labs Inc. Registered Shares DL -,001               | US7437131094 | STK                                 | 0                        | 4.670                       |                     |
| Rio Tinto PLC Registered Shares LS -,10                  | GB0007188757 | STK                                 | 3.030                    | 7.030                       |                     |
| S&P Global Inc. Registered Shares DL 1                   | US78409V1044 | STK                                 | 653                      | 2.299                       |                     |
| Smith & Nephew PLC Registered Shares DL -,20             | GB0009223206 | STK                                 | 0                        | 12.800                      |                     |
| Société Générale S.A. Actions Port. EO 1,25              | FR0000130809 | STK                                 | 10.330                   | 10.330                      |                     |
| Take-Two Interactive Softw.Inc Registered Shares DL -,01 | US8740541094 | STK                                 | 0                        | 3.936                       |                     |
| Teladoc Health Inc. Registered Shares DL-,001            | US87918A1051 | STK                                 | 0                        | 2.100                       |                     |
| Tokyo Electron Ltd. Registered Shares o.N.               | JP3571400005 | STK                                 | 0                        | 530                         |                     |
| Tokyo Seimitsu Co. Ltd. Registered Shares o.N.           | JP3580200008 | STK                                 | 0                        | 6.100                       |                     |
| Trane Technologies PLC Registered Shares DL 1            | IE00BK9ZQ967 | STK                                 | 1.675                    | 3.095                       |                     |
| Trend Micro Inc. Registered Shares o.N.                  | JP3637300009 | STK                                 | 0                        | 9.440                       |                     |
| VMware Inc. Regist. Shares Class A DL -,01               | US9285634021 | STK                                 | 1.234                    | 5.034                       |                     |
| West Fraser Timber Co. Ltd. Registered Shares o.N.       | CA9528451052 | STK                                 | 2.992                    | 2.992                       |                     |

| Gattungsbezeichnung  | ISIN  | Stück bzw. Anteile<br>Whg. in 1.000     | Käufe<br>bzw.<br>Zugänge  | Verkäufe<br>bzw.<br>Abgänge  | Volumen<br>in 1.000 |
|--|---|---|---|--|---------------------|
| Xylem Inc. Registered Shares DL -,01 Zebra Technologies Corp. Registered Shares Cl.A DL -,01   | US98419M1009<br>US9892071054  | STK<br>STK                              | 0<br>0  | 2.190<br>700   |                     |
| Verzinsliche Wertpapiere   |   |   |   |  |                     |
| 0,5000 % Banco Santander S.A. EO-Non-Preferred MTN 2020(27) 0,5770 % Barclays PLC EO-FLR MedT. Nts 2021(28/29) 0,2500 % BASF SE MTN v.2020(2020/2027) 4,2500 % BayWa AG SubFLR-Nts.v.17(22/unb.) 0,5000 % BNP Paribas S.A. EO-FLR-Non-Pref.MTN2021(29/30) 1,5000 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.2013 (2023) 0,2840 % Deutsche Bank AG FLR-MTN v.17(22) 0,2500 % Essity AB EO-MedTerm Nts 2021(21/31) 4,8750 % Eurofins Scientific S.E. EO-FLR Notes 2015(23/Und.) 1,5000 % Grenke Finance PLC EO-Medium-Term Notes 2018(23) 0,6250 % Grenke Finance PLC EO-Medium-Term Notes 2019(25) 2,3750 % Iliad S.A. EO-Obl. 2020(20/26) 0,3750 % Kreditanst.f.Wiederaufbau Anl.v.2016 (2023) 0,3750 % Kreditanst.f.Wiederaufbau Anl.v.2016 (2023) 0,3750 % Landesbank Baden-Württemberg MTN Serie 826 v.21(28) 0,6250 % LANXESS AG Medium-Term Nts 2021(21/29) 0,0500 % Raiffeisen Bank Intl AG EO-Medium-Term Bonds 2021(27) 0,8750 % Société Générale S.A. EO-Non-Preferred MTN 2019(29) 2,7080 % TotalEnergies SE EO-FLR MedT. Nts 16(23/Und.) 2,1250 % TotalEnergies SE EO-FLR MedT. Nts 21(21/Und.) 1,6250 % Veolia Environnement S.A. EO-FLR Notes 2019(26/Und.) 2,7500 % VGP N.V. EO-Bonds 2019(23) 0,2500 % VOLKSW. FINANCIAL SERVICES AG Med.Term Notes v.22(25) | XS2113889351 XS2373642102 DE000A289DC9 XS1695284114 FR0014001JT3 DE0001102317 DE000DL19TQ2 XS2297177664 XS1224953882 XS1910851242 XS2078696866 FR0013518420 DE000A168Y22 DE000LB2V833 XS2415386726 XS2381599898 FR0013448859 XS1501167164 XS2290960876 FR0013445335 BE0002677582 XS2438615606 | EUR | 0<br>0<br>0<br>400<br>0<br>1.200<br>0<br>0<br>300<br>0<br>700<br>0<br>200<br>0<br>400<br>400<br>400<br>0<br>300 | 400<br>500<br>500<br>400<br>500<br>1.200<br>400<br>500<br>200<br>300<br>300<br>500<br>700<br>700<br>200<br>700<br>300<br>400<br>400<br>400<br>200<br>300 |                     |
| Zertifikate  | A324300 13000   | EUK                                     | 200   | 200  |                     |
| WisdomTree Multi Ass.Iss.PLC ETP 05.12.62 S&P 500 3x Daily   | IE00B8K7KM88  | STK                                     | 35.730.066  | 35.730.066   |                     |

| Gattungsbezeichnung  | ISIN   | Stück bzw. Anteile<br>Whg. in 1.000    | Käufe<br>bzw.<br>Zugänge       | Verkäufe<br>bzw.<br>Abgänge                 | Volumen in 1.000 |
|--|--|--|--------------------------------|---|------------------|
| An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezoge   | ne Wertpapiere   |  |                                |   |                  |
| Verzinsliche Wertpapiere   |  |  |                                |   |                  |
| 2,2500 % ADLER Group S.A. EO-Notes 2021(21/29) 0,2500 % ASML Holding N.V. EO-Notes 2020(20/30) 3,6250 % Heimstaden Bostad AB EO-FLR Notes 2021(21/Und.) 0,6250 % Kerry Group Financial Services EO-Notes 2019(19/29) 0,8750 % Mondelez Intl Hldgs Nether. BV EO-Notes 2019(19/31) Reg.S 1,5000 % VGP N.V. EO-Bonds 2021(21/29) | XS2283225477<br>XS2010032378<br>XS2397251807<br>XS2042667944<br>XS2056374353<br>BE6327721237 | EUR<br>EUR<br>EUR<br>EUR<br>EUR<br>EUR | 0<br>0<br>400<br>0<br>0<br>400 | 300<br>500<br>400<br>300<br>300<br>400      |                  |
| Nichtnotierte Wertpapiere *)   |  |  |                                |   |                  |
| Aktien   |  |  |                                |   |                  |
| Atlas Copco AB Namn-Aktier A SK-,052125<br>Atlas Copco AB Reg.Red.Sh.A (fria) SK-,052125<br>Citrix Systems Inc. Registered Shares DL -,001<br>Discovery Inc. Reg. Shares Series C DL-,01<br>IHS Markit Ltd. Registered Shares DL -,01  | SE0011166610<br>SE0017486863<br>US1773761002<br>US25470F3029<br>BMG475671050                 | STK<br>STK<br>STK<br>STK<br>STK        | 16.000<br>16.000<br>0<br>0     | 16.000<br>16.000<br>2.044<br>8.538<br>2.300 |                  |
| Verzinsliche Wertpapiere   |  |  |                                |   |                  |
| 4,7500 % AT&S Austria Techn.&Systemt.AG EO-FLR Notes 2017(22/Und.) 2,8750 % Eurofins Scientific S.E. EO-FLR Notes 2019(22/Und.)  | XS1721410725<br>XS2051471105   | EUR<br>EUR                             | 0<br>0                         | 300<br>200                                  |                  |
| Wandelanleihen   |  |  |                                |   |                  |
| 4,0000 % Consus Real Estate AG Wandelschuldv.v.17(22) 1,3750 % Corestate Capital Holding S.A EO-Wandelanl. 2017(23) 3,3750 % Quadient S.A. EO-FLR Conv. Nts 2015(22/Und.)  | DE000A2G9H97<br>DE000A19SPK4<br>FR0012799229   | EUR<br>EUR<br>STK                      | 0<br>0<br>0                    | 200<br>700<br>4.000                         |                  |

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<br>Whg. in 1.000 | Käufe<br>bzw.<br>Zugänge | Verkäufe<br>bzw.<br>Abgänge | Volumen in 1.000 |
|---|------------------------------------|-------------------------------------|--------------------------|-----------------------------|------------------|
| Investmentanteile   |                                    |                                     |                          |                             |                  |
| Gruppenfremde Investmentanteile   |                                    |                                     |                          |                             |                  |
| InvescoMI S&P500 ESG ETF Registered Shares USD Acc.o.N. Lyx.EURO STXX50 D.(2x)L.U.ETF Actions au Porteur Acc o.N. | IE00BKS7L097<br>FR0010468983       | ANT<br>ANT                          | 0<br>54.738              | 44.976<br>54.738            |                  |
| <b>Derivate</b> (In Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Opt                          | ionsgeschäfte, bei Optionsscheiner | n Angabe der Käufe und Verkä        | ufe)                     |                             |                  |
| Terminkontrakte   |                                    |                                     |                          |                             |                  |
| Aktienindex-Terminkontrakte   |                                    |                                     |                          |                             |                  |
| Verkaufte Kontrakte:<br>(Basiswert(e): ESTX 50 PR.EUR)  |                                    | EUR                                 |                          |                             | 16.482,12        |
| Zinsterminkontrakte   |                                    |                                     |                          |                             |                  |
| Verkaufte Kontrakte:<br>(Basiswert(e): EURO-BOBL, EURO-BUND, EURO-SCHATZ)   |                                    | EUR                                 |                          |                             | 9.884,83         |
| Währungsterminkontrakte   |                                    |                                     |                          |                             |                  |
| Gekaufte Kontrakte: (Basiswert(e): CROSS RATE EO/DL, CROSS RATE EO/LS)  |                                    | EUR                                 |                          |                             | 32.895,32        |

Die Gesellschaft sorgt dafür, dass eine unangemessene Beeinträchtigung von Anlegerinteressen durch Transaktionskosten vermieden wird, indem unter Berücksichtigung der Anlageziele dieses Sondervermögens ein Schwellenwert für die Transaktionskosten bezogen auf das durchschnittliche Fondsvolumen sowie für eine Portfolioumschlagsrate festgelegt wurde. Die Gesellschaft überwacht die Einhaltung der Schwellenwerte und ergreift im Falle des Überschreitens weitere Maßnahmen.

<sup>\*)</sup> Bei den nichtnotierten Wertpapieren können technisch bedingt auch endfällige Wertpapiere ausgewiesen werden.

# Ertrags- und Aufwandsrechnung (inkl. Ertragsausgleich) für den Zeitraum vom 01.01.2022 bis 31.12.2022

|   |          |             |     | insgesamt     | je Anteil |
|---|----------|-------------|-----|---------------|-----------|
| I. Erträge  |          |             |     |               |           |
| 1. Dividenden inländischer Aussteller (vor Körperschaft-/Kapitalertra | gsteuer) |             | EUR | 75.006,40     | 0,12      |
| 2. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer)            |          |             | EUR | 625.845,05    | 1,00      |
| 3. Zinsen aus inländischen Wertpapieren                               |          |             | EUR | 74.773,80     | 0,12      |
| 4. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer)          |          |             | EUR | 662.261,90    | 1,05      |
| 5. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland *)                         |          |             | EUR | -1,68         | 0,00      |
| 6. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Ausland (vor Quellensteuer)       |          |             | EUR | 0,00          | 0,00      |
| 7. Erträge aus Investmentanteilen                                     |          |             | EUR | 46.000,00     | 0,07      |
| 8. Erträge aus Wertpapier- Darlehen- und -Pensionsgeschäften          |          |             | EUR | 0,00          | 0,00      |
| 9. Abzug inländischer Körperschaft-/Kapitalertragsteuer               |          |             | EUR | -11.250,96    | -0,02     |
| 10. Abzug ausländischer Quellensteuer                                 |          |             | EUR | -107.530,80   | -0,17     |
| 11. Sonstige Erträge  |          |             | EUR | 0,00          | 0,00      |
| Summe der Erträge   |          |             | EUR | 1.365.103,71  | 2,17      |
| II. Aufwendungen  |          |             |     |               |           |
| Zinsen aus Kreditaufnahmen  |          |             | EUR | -4.182,96     | -0,01     |
| Verwaltungsvergütung  |          |             | EUR | -279.046,41   | -0,45     |
| - Verwaltungsvergütung  | EUR      | -279.046,41 |     |               |           |
| - Beratungsvergütung  | EUR      | 0,00        |     |               |           |
| - Asset Management Gebühr   | EUR      | 0,00        |     |               |           |
| 3. Verwahrstellenvergütung  |          |             | EUR | -94.905,96    | -0,15     |
| Prüfungs- und Veröffentlichungskosten                                 |          |             | EUR | -9.312,21     | -0,01     |
| 5. Sonstige Aufwendungen  |          |             | EUR | -15.034,96    | -0,02     |
| - Depotgebühren   | EUR      | 0,00        |     |               |           |
| - Ausgleich ordentlicher Aufwand                                      | EUR      | -4.719,11   |     |               |           |
| - Sonstige Kosten   | EUR      | -10.315,85  |     |               |           |
| - davon Aufwendungen aus negativen Habenzinsen                        | EUR      | -10.186,45  |     |               |           |
| Summe der Aufwendungen  |          |             | EUR | -402.482,50   | -0,64     |
| III. Ordentlicher Nettoertrag   |          |             | EUR | 962.621,21    | 1,53      |
| IV. Veräußerungsgeschäfte   |          |             |     | ,             | •         |
| Realisierte Gewinne   |          |             | EUR | 5.428.297,85  | 8,64      |
| 2. Realisierte Verluste   |          |             | EUR | -6.105.901,14 | -9,72     |
| Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften                                   |          |             | EUR | -677.603,29   | -1,08     |

| ٧.   | Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres        | EUR | 285.017,92     | 0,45   |
|------|--|-----|----------------|--------|
| 1.   | Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne  | EUR | -6.245.117,88  | -9,94  |
| 2.   | Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste | EUR | -6.165.832,03  | -9,81  |
|      |  |     |                |        |
| VI.  | Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres  | EUR | -12.410.949,91 | -19,75 |
| VII. | . Ergebnis des Geschäftsjahres                   | EUR | -12.125.931,99 | -19,30 |

<sup>\*)</sup> Der negative Betrag der Zinsen aus Liquiditätsanlagen resultiert aus dem die Zinszahlung übersteigenden Vorrechnungsbetrag.

| Entwicklung des Sondervermögens                                |      |               |     | 2022           |
|--|------|---------------|-----|----------------|
| I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjal         | hres |               | EUR | 83.533.242,62  |
| 1. Ausschüttung für das Vorjahr/Steuerabschlag für das Vorjahr |      |               | EUR | -2.101.464,00  |
| 2. Zwischenausschüttungen                                      |      |               | EUR | 0,00           |
| 3. Mittelzufluss/-abfluss (netto)                              |      |               | EUR | 2.822.311,31   |
| a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen                   | EUR  | 2.822.311,31  |     |                |
| b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen                  | EUR  | 0,00          |     |                |
| 4. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich                          |      |               | EUR | -27.401,25     |
| 5. Ergebnis des Geschäftsjahres                                |      |               | EUR | -12.125.931,99 |
| davon nicht realisierte Gewinne                                | EUR  | -6.245.117,88 |     |                |
| davon nicht realisierte Verluste                               | EUR  | -6.165.832,03 |     |                |
| II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahr         | res  |               | EUR | 72.100.756.69  |

#### Verwendung der Erträge des Sondervermögens Berechnung der Ausschüttung insgesamt und je Anteil

|      |   |     | insgesamt     | je Anteil |
|------|---|-----|---------------|-----------|
| I.   | Für die Ausschüttung verfügbar            | EUR | 18.777.481,58 | 29,88     |
| 1.   | Vortrag aus Vorjahr                       | EUR | 13.003.977,55 | 20,70     |
| 2.   | Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres | EUR | 285.017,92    | 0,45      |
| 3.   | Zuführung aus dem Sondervermögen *)       | EUR | 5.488.486,12  | 8,73      |
| II.  | Nicht für die Ausschüttung verwendet      | EUR | 16.615.596,38 | 26,44     |
| 1.   | Der Wiederanlage zugeführt                | EUR | 5.800.482,88  | 9,23      |
| 2.   | Vortrag auf neue Rechnung                 | EUR | 10.815.113,50 | 17,21     |
| III. | Gesamtausschüttung                        | EUR | 2.161.885,20  | 3,44      |
| 1.   | Zwischenausschüttung                      | EUR | 0,00          | 0,00      |
|      | •   |     |               |           |
|      |   |     |               |           |
|      |   |     |               |           |
|      |   |     |               |           |
| 2.   | Endausschüttung                           | EUR | 2.161.885,20  | 3,44      |

<sup>\*)</sup> Die Zuführung aus dem Sondervermögen resultiert aus der Berücksichtigung von realisierten Verlusten und beruht auf der Annahme einer nach den Anlagebedingungen maximalen Ausschüttung.

#### Vergleichende Übersicht über die letzten drei Geschäftsjahre

| Geschäftsjahr | Umlaufende Anteile am<br>Ende des Geschäftsjahres |         | Fondsvermögen am<br>Ende des Geschäftsjahre | s             | Anteilwert am<br>Ende des Geschäftsja | hres   |
|---------------|---|---------|---|---------------|---------------------------------------|--------|
| 2019          | Stück   | 434.763 | EUR   | 49.180.970,91 | EUR                                   | 113,12 |
| 2020          | Stück   | 515.659 | EUR   | 62.898.194,49 | EUR                                   | 121,98 |
| 2021          | Stück   | 605.548 | EUR   | 83.533.242,62 | EUR                                   | 137,95 |
| 2022          | Stück   | 628.455 | EUR   | 72.100.756,69 | EUR                                   | 114,73 |

#### Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

#### Angaben nach der Derivateverordnung

das durch Derivate erzielte zugrundeliegende Exposure EUR 7.499.650,00

#### die Vertragspartner der Derivate-Geschäfte

Bank of America Securities Europe SA (Broker) FR

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %) Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %) 95,04

0.32

Bei der Ermittlung der Auslastung der Marktrisikoobergrenze für diesen Fonds wendet die Gesellschaft seit 19.08.2019 den qualifizierten Ansatz im Sinne der Derivate-Verordnung anhand eines Vergleichsvermögens an. Die Value-at-Risk-Kennzahlen wurden auf Basis der Methode der historischen Simulation mit den Parametern 99 % Konfidenzniveau und 1 Tag Haltedauer unter Verwendung eines effektiven, historischen Beobachtungszeitraums von einem Jahr berechnet. Unter dem Marktrisiko versteht man das Risiko, das sich aus der ungünstigen Entwicklung von Marktpreisen für das Sondervermögen ergibt.

#### Potenzieller Risikobetrag für das Marktrisiko gem. § 37 Abs. 4 DerivateV

kleinster potenzieller Risikobetrag
größter potenzieller Risikobetrag
durchschnittlicher potenzieller Risikobetrag
1,13 %
durchschnittlicher potenzieller Risikobetrag
1,60 %

Im Geschäftsjahr erreichte durchschnittliche Hebelwirkung durch Derivategeschäfte: 0,98

#### Zusammensetzung des Vergleichsvermögens zum Berichtsstichtag

Bloomberg Euro Aggregate Corporate Total Return (EUR) (Bloomberg: LECPTREU INDEX)

MSCI World Net Return (EUR) (Bloomberg: MSDEWIN INDEX)

NASDAQ 100 Price Return (USD) (Bloomberg: NDX INDEX)

14,39 %

#### Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

#### **Sonstige Angaben**

Stiftungsfonds ESG Global AK S

Anteilwert EUR 114,73
Ausgabepreis EUR 114,73
Rücknahmepreis EUR 114,73
Anzahl Anteile STK 628.455

#### Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände

#### **Bewertung**

Die nachfolgend dargestellten Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände decken eventuelle aus der Covid-19 Pandemie resultierenden Marktauswirkungen ab. Darüber hinausgehende Bewertungsanpassungen waren nicht erforderlich.

Für Devisen, Aktien, Anleihen und Derivate, die zum Handel an einer Börse oder an einem anderen organisierten Markt zugelassen oder in diesen einbezogen sind, wird der letzte verfügbare handelbare Kurs gemäß § 27 KARBV zugrunde gelegt.

Für Investmentanteile werden die aktuellen Werte, für Bankguthaben und Verbindlichkeiten der Nennwert bzw. Rückzahlungsbetrag gemäß § 29 KARBV zugrunde gelegt.

Für Vermögensgegenstände, die weder zum Handel an einer Börse noch an einem anderen organisierten Markt zugelassen oder in den regulierten Markt oder Freiverkehr einer Börse einbezogen sind oder für die kein handelbarer Kurs verfügbar ist, werden gemäß § 28 KARBV i.V.m. § 168 Absatz 3 KAGB die Verkehrswerte zugrunde gelegt, die sich bei sorgfältiger Einschätzung nach geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten ergeben.

Unter dem Verkehrswert ist der Betrag zu verstehen, zu dem der jeweilige Vermögensgegenstand in einem Geschäft zwischen sachverständigen, vertragswilligen und unabhängigen Geschäftspartnern ausgetauscht werden könnte.

#### Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

#### Angaben zur Transparenz sowie zur Gesamtkostenquote

#### Stiftungsfonds ESG Global AK S

Gesamtkostenquote

Die Gesamtkostenquote (ohne Transaktionskosten) für das abgelaufene Geschäftsjahr beträgt

0,51 %

Die Gesamtkostenquote drückt sämtliche vom Sondervermögen im Jahresverlauf getragenen Kosten und Zahlungen (ohne Transaktionskosten) im Verhältnis zum durchschnittlichen Nettoinventarwert des Sondervermögens aus.

An die Verwaltungsgesellschaft oder Dritte gezahlte Pauschalvergütungen

**EUR** 

0.00

#### Hinweis gem. § 101 Abs. 2 Nr. 3 KAGB (Kostentransparenz)

Die Gesellschaft erhält aus dem Sondervermögen die ihr zustehende Verwaltungsvergütung. Ein wesentlicher Teil der Verwaltungsvergütung wird für Vergütungen an Vermittler von Anteilen des Sondervermögens verwendet. Der Gesellschaft fließen keine Rückvergütungen von den an die Verwahrstelle und an Dritte aus dem Sondervermögen geleisteten Vergütungen und Aufwendungserstattungen zu. Sie hat im Zusammenhang mit Handelsgeschäften für das Sondervermögen keine geldwerten Vorteile von Handelspartnern erhalten.

Ausgabeauf- und Rücknahmeabschläge, die dem Sondervermögen für den Erwerb und die Rücknahme von Investmentanteilen berechnet wurden

EUR

0,00

#### Verwaltungsvergütungssätze für im Sondervermögen gehaltene Investmentanteile

| Investmentanteile | Identifikation | Verwaltungsvergütungssatz |
|-------------------|----------------|---------------------------|
|                   |                | p.a. in %                 |
|                   |                |                           |

#### KVG - eigene Investmentanteile

EB-Sustainable Em. Mkts Corp. Bd Inhaber-Anteile AK I DE000A2JF7T2 0,600

#### **Gruppenfremde Investmentanteile**

iShs Core MSCI EM IMI U.ETF Registered Shares o.N. IE00BKM4GZ66 0.180

#### Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Während des Berichtszeitraumes gehaltene Bestände in Investmentanteilen, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen:

#### **Gruppenfremde Investmentanteile**

| InvescoMI S&P500 ESG ETF Registered Shares USD Acc.o.N.   | IE00BKS7L097 | 0,090 |
|---|--------------|-------|
| Lyx.EURO STXX50 D.(2x)L.U.ETF Actions au Porteur Acc o.N. | FR0010468983 | 0,400 |

#### Wesentliche sonstige Erträge und sonstige Aufwendungen

Stiftungsfonds ESG Global AK S

| Wesentliche sonstige Erträge:   | EUR               | 0,00                       |
|---|-------------------|----------------------------|
| Wesentliche sonstige Aufwendungen: - davon Aufwendungen aus negativen Habenzinsen | <b>EUR</b><br>EUR | <b>10.315,85</b> 10.186,45 |

#### Transaktionskosten (Summe der Nebenkosten des Erwerbs (Anschaffungsnebenkosten) und der Kosten der Veräußerung der Vermögensgegenstände)

Transaktionskosten EUR 93.200,24

Die Transaktionskosten berücksichtigen sämtliche Kosten, die im Geschäftsjahr für Rechnung des Fonds separat ausgewiesen bzw. abgerechnet wurden und in direktem Zusammenhang mit einem Kauf oder Verkauf von Vermögensgegenständen stehen.

#### Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

#### Angaben zur Mitarbeitervergütung

| Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr der KVG gezahlten Mitarbeitervergütung davon feste Vergütung davon variable Vergütung | <b>in Mio. EUR</b><br>in Mio. EUR<br>in Mio. EUR | <b>72,9</b><br>64,8<br>8,1 |
|---|--|----------------------------|
| Zahl der Mitarbeiter der KVG<br>Höhe des gezahlten Carried Interest   | in EUR   | 902<br>0                   |
| Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr der KVG gezahlten Vergütung an Risktaker davon Geschäftsleiter davon andere Risktaker | <b>in Mio. EUR</b><br>in Mio. EUR<br>in Mio. FUR | <b>5,7</b><br>4,6<br>1.1   |

#### Vergütungssystem der Kapitalverwaltungsgesellschaft

Die Universal-Investment-Gesellschaft mbH unterliegt den für Kapitalverwaltungsgesellschaften geltenden aufsichtsrechtlichen Vorgaben im Hinblick auf die Gestaltung ihres Vergütungssystems. Die detaillierte Ausgestaltung hat die Gesellschaft in einer Vergütungsrichtlinie geregelt, deren Ziel es ist, eine nachhaltige Vergütungssystematik unter Berücksichtigung von Sustainable Corporate Governance und unter Vermeidung von Fehlanreizen zur Eingehung übermäßiger Risiken (einschließlich einschlägiger Nachhaltigkeitsrisiken) sicherzustellen.

Das Vergütungssystem der Kapitalverwaltungsgesellschaft wird mindestens einmal jährlich durch den Vergütungsausschuss der Universal-Investment auf seine Angemessenheit und die Einhaltung aller rechtlichen sowie interner und externer regulatorischer Vorgaben überprüft. Es umfasst fixe und variable Vergütungselemente. Durch die Festlegung von Bandbreiten für die Gesamtzielvergütung ist gewährleistet, dass keine signifikante Abhängigkeit von der variablen Vergütung sowie ein angemessenes Verhältnis von variabler zu fixer Vergütung besteht. Für die Geschäftsführung der Kapitalverwaltungsgesellschaft und Mitarbeiter, deren Tätigkeiten einen wesentlichen Einfluss auf das Gesamtrisikoprofil der Kapitalverwaltungsgesellschaft und der von ihr verwalteten Investmentvermögen haben (Risk Taker) gelten besondere Regelungen. Risikorelevante Mitarbeiter, deren variable Vergütung für das jeweilige Geschäftsjahr einen Schwellenwert von 50 TEUR nicht überschreitet, erhalten die variable Vergütung vollständig in Form einer Barleistung ausgezahlt. Wird für risikorelevante Mitarbeiter dieser Schwellenwert überschritten, wird zwingend ein Anteil von 40 % der variablen Vergütung über einen Zeitraum von drei Jahren aufgeschoben. Der aufgeschobene Anteil der Vergütung ist während dieses Zeitraums risikoabhängig, d.h. er kann im Fall von negativen Erfolgsbeiträgen des Mitarbeiters oder der Kapitalverwaltungsgesellschaft insgesamt gekürzt werden. Jeweils am Ende jedes Jahres der Wartezeit wird der aufgeschobene Vergütungsanteil anteilig unverfallbar und zum jeweiligen Zahlungstermin ausgezahlt.

Soweit das Portfolio-Management ausgelagert ist, werden keine Mitarbeitervergütungen direkt aus dem Fonds gezahlt.

#### Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

#### Angaben gemäß § 101 Abs. 2 Nr. 5 KAGB

#### Wesentliche mittel- bis langfristigen Risiken

Die Angaben der wesentlichen mittel- bis langfristigen Risiken erfolgt innerhalb des Tätigkeitsberichts.

#### Zusammensetzung des Portfolios, die Portfolioumsätze und die Portfolioumsatzkosten

Die Angaben zu der Zusammensetzung des Portfolios erfolgen innerhalb der Vermögensaufstellung.

Die Angaben zu den Portfolioumsätzen erfolgen innerhalb der Vermögensaufstellung und innerhalb der Aufstellung der während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte.

Die Angabe zu den Transaktionskosten erfolgt im Anhang.

#### Berücksichtigung der mittel- bis langfristigen Entwicklung der Gesellschaft bei der Anlageentscheidung

Die Auswahl von Einzeltiteln richtet sich nach der Anlagestrategie. Die vertraglichen Grundlagen für die Anlageentscheidung finden sich in den vereinbarten Anlagebedingungen und ggf. Anlagerichtlinien. Eine Berücksichtigung der mittel- bis langfristigen Entwicklung der Portfoliogesellschaften erfolgt, wenn diese in den Vertragsbedingungen vorgeschrieben ist.

#### Einsatz von Stimmrechtsberatern

Zum Einsatz von Stimmrechtsberatern verweisen wir auf den neuen Mitwirkungsbericht auf der Homepage https://www.universal-investment.com/de/permanent-seiten/compliance/mitwirkungspolitik.

#### Handhabung der Wertpapierleihe und zum Umgang mit Interessenkonflikten im Rahmen der Mitwirkung in den Gesellschaften, insbesondere durch Ausübung von Aktionärsrechten

Zur grundsätzlichen Handhabung der Wertpapierleihe und zum Umgang mit Interessenkonflikten im Rahmen der Mitwirkung der Gesellschaft, insbesondere durch die Ausübung von Aktionärsrechten, verweisen wir auf unsere aktuelle Mitwirkungspolitik auf der Homepage https://www.universal-investment.com/de/permanent-seiten/compliance/mitwirkungspolitik.

#### Angaben zu nichtfinanziellen Leistungsindikatoren

Artikel 8 Offenlegungs-Verordnung (Finanzprodukte, die ökologische und/oder soziale Merkmale bewerben)

Die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (Principal Adverse Impacts PAI) werden im Investitionsprozess auf Gesellschaftsebene berücksichtigt. Eine Berücksichtigung der PAI auf Ebene des Fonds ist verbindlich und erfolgt insoweit.

Weitere Informationen über die ökologischen und/oder sozialen Merkmale und zu der Berücksichtigung von den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren sind im "Anhang 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" enthalten.

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.

#### ANHANG

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. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Name des Produkts: Stiftungsfonds ESG Global

Unternehmenskennung (LEI-Code): 52990033ZX89OHC1PE58

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

| Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?   |  |  |
|---|--|--|
| ● ● □ Ja  | ● ○ ⊠ Nein   |  |
| ☐ 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 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 nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt:%  | Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt.   |  |



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

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

Dieser Fonds bewarb ökologische und soziale Merkmale im Sinne von Artikel 8 der Offenlegungsverordnung.

Die Gesellschaft richtet ihre Anlagen an dem Leitfaden für ethisch-nachhaltige Geldanlagen in der evangelischen Kirche aus. Hierdurch werden auch soziale und ökologische Aspekte, wie bspw. menschenwürdige, faire Arbeitsbedingungen in Unternehmen oder die Verringerung der Nutzung von fossilen Energieträgern, berücksichtigt.

Das Hauptziel dieses Fonds besteht in der Berücksichtigung von ökologischen und sozialen Merkmalen im Investmentprozess. Allerdings verpflichtet sich dieser Fonds derzeit nicht, einen Mindestanteil seines Gesamtvermögens in ökologisch, nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß Artikel 3 der EU-Taxonomie-Verordnung (2020/852) zu investieren. Dies betrifft ebenfalls Angaben zu Investitionen in Wirtschaftstätigkeiten, die gemäß Artikel 16 bzw. 10 Absatz 2 der EU-Taxonomie-Verordnung (2020/852) als Ermöglichende- bzw. Übergangstätigkeiten eingestuft werden.

Der Fonds wandte tätigkeitsbezogene Ausschlüsse an. Unternehmen mit den folgenden Aktivitäten sind ganz oder teilweise ausgeschlossen:

- Pornografie/Erwachsenenunterhaltung (Produktion, Downstream) > 10,0 % Umsatzerlöse
- Tabak (Produktion) > 5,00 % Umsatzerlöse
- Glücksspiel (Produktion) > 10,0 % Umsatzerlöse
- GMO (Genetically Modified Organism Gentechnisch veränderte Organismen) (Produktion) > 10,0 % Umsatzerlöse
- Atomwaffen (Upstream, Produktion, Downstream) > 0 % Umsatzerlöse
- konventionelle Waffen (Produktion, Downstream) > 10,0 % Umsatzerlöse
- unkonventionelle Waffen (Upstream, Produktion, Downstream) > 0 % Umsatzerlöse
- Kohle (Produktion, Downstream) > 30,0 % Umsatzerlöse
- andere fossile Brennstoffe (Produktion) > 10,0 % Umsatzerlöse
- Alkohol, hochprozentig (Produktion) > 10% Einnahmen.

Der Fonds wandte normbasiertes Screening in Bezug auf UN Global Compact, OECD-Leitsätze, ILO (International Labour Organization) an.

Es wurden Verstöße gegen die UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte bei den Ausschlusskriterien berücksichtigt.

Der Fonds wandte folgende Ausschlüsse für Staaten an:

- Staaten mit schwerwiegenden Verstößen gegen die demokratischen Rechte und die Menschenrechte werden auf Grundlage der Bewertung von Freedom House ausgeschlossen.
- Staaten, die der Korruption ausgesetzt sind,
- Staaten, die in bewaffnete Konflikte (Krieg) verwickelt sind,

Es wurden ESG-Daten bei den Ausschlusskriterien und der Bewertung von Wertpapieren berücksichtigt. Die ESG-Ratings analysieren die Chancen und Risiken eines Emittenten, die

sich aufgrund dessen Nachhaltigkeit ergeben. Die ESG-Ratings berücksichtigen alle Nachhaltigkeitsdimensionen, die sich wieder aus verschiedenen Nachhaltigkeitsthemen und indikatoren zusammensetzen. Die verschiedenen Indikatoren werden in Abhängigkeit zu ihrer Materialität gewichtet. Die ESG-Ratings sind von AAA bis CCC (alphabetisch) bzw. 10 bis 0 (numerisch) skaliert. Die Datenpunkte werden von MSCI zur Verfügung gestellt.

#### Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Alle Nachhaltigkeitsindikatoren des Fonds, die zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale des Fonds dienen, wurden im Bezugszeitraum eingehalten. Die Einhaltung der ökologischen und/oder sozialen Kriterien für die Selektion der Vermögensgegenstände wurde vor sowie nach Erwerb geprüft.

Darüber hinaus berücksichtigte der Fonds verbindlich folgende Nachhaltigkeitsfaktoren in seiner Strategie und legt die nachteiligen Auswirkungen zu diesen offen:

- CO2-Fußabdruck 24.6420
   (Messgröße: CO2-Fußabdruck Scope 1 und 2, Berechnung siehe Anhang I der Offenlegungsverordnung)
- Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe t\u00e4tig sind 3,91% (Messgr\u00f6\u00dfe: Anteil der Investitionen in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe t\u00e4tig sind)
- Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen 0,43%
  - (Messgröße: Anteil der Investitionen in Unternehmen, die an Verstößen gegen die UNGC-Grundsätze oder gegen die OECD Leitsätze für multinationale Unternehmen beteiligt waren)
- Fehlende Prozesse und Compliance- Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen 37,67%
  - (Messgröße: Anteil der Investitionen in Unternehmen, die keine Richtlinien zur Überwachung der Einhaltung der UNGC Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen oder keine Verfahren zur Bearbeitung von Beschwerden wegen Verstößen gegen die UNGC-Grundsätze und OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen eingerichtet haben)
- Engagement in kontroverse Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) 0,00%
   (Messgröße: Anteil der Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird, die an der
- THG-Emissionsintensität 0,00%
   (Messgröße: THG-Emissionsintensität der Länder, in die investiert wird)

Herstellung oder am Verkauf von umstrittenen Waffen beteiligt sind)

 Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen 0 (Messgröße: Anzahl der Länder, in die investiert wird, die nach Maßgabe internationaler Verträge und Übereinkommen, der Grundsätze der Vereinten Nationen oder, falls anwendbar, nationaler Rechtsvorschriften gegen soziale Bestimmungen verstoßen)  Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen 0,00% (Messgröße: Prozentualer Anteil der Länder, in die investiert wird, die nach Maßgabe internationaler Verträge und Übereinkommen, der Grundsätze der Vereinten Nationen oder, falls anwendbar, nationaler Rechtsvorschriften gegen soziale Bestimmungen verstoßen)

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz "Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen" festgelegt, nach dem taxonomiekonforme 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 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.

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



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

Die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen Nachhaltigkeitsfaktoren im Sinne des Art. 7 der Offenlegungsverordnung werden berücksichtigt. Die Berücksichtigung der PAI-Kategorien erfolgt insbesondere über die Berücksichtigung von Ausschlusskriterien. So werden Unternehmen ausgeschlossen, Nachhaltigkeitsrisiken haben, in kontroverse Geschäftsaktivitäten (bspw. Verstöße gegen UN Global Compact) involviert oder in kontroversen Geschäftsfeldern (bspw. kontroverse Waffen) aktiv sind. Zusätzlich werden Ausschlusskriterien für Staaten, bspw. "Freedom House Index", berücksichtigt. Es wird insbesondere auf Daten von MSCI ESG Research bzw. ISS ESG zurückgegriffen.



#### Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 01.01.2022 – 31.12.2022

| Größte Investitionen   | Sektor                 | In % der<br>Vermögenswerte | Land        |
|--|------------------------|----------------------------|-------------|
| Deut. Börse Commodities GmbH Xetra-Gold IHS 2007(09/Und)           | Financials             | 1,91                       | Deutschland |
| EB-Sustainable Em.Mkts Corp.Bd Inhaber-Anteile AK I                | n.a.                   | 1,33                       | Deutschland |
| Microsoft Corp. Registered Shares DL-,00000625                     | Information Technology | 1,03                       | USA         |
| 5,0000 % AT&S Austria Techn.&Systemt.AG EO-FLR Notes 2022(22/Und.) | Corporates             | 0,92                       | Österreich  |
| Alphabet Inc. Reg. Shs Cl. A DL-,001                               | Communication Services | 0,84                       | USA         |
| Nestlé S.A. Namens-Aktien SF -,10                                  | Consumer Staples       | 0,82                       | Schweiz     |
| InvescoMI S&P500 ESG ETF Registered Shares USD Acc.o.N.            | n.a.                   | 0,78                       | Irland      |
| Texas Instruments Inc. Registered Shares DL 1                      | Information Technology | 0,76                       | USA         |
| Booking Holdings Inc. Registered Shares DL-,008                    | Consumer Discretionary | 0,75                       | USA         |
| QUALCOMM Inc. Registered Shares DL -,0001                          | Information Technology | 0,69                       | USA         |
| WisdomTree Multi Ass.lss.PLC ETP 05.12.62 S&P 500 3x Daily         | Financials             | 0,60                       | Irland      |
| 1,1250 % SAP SE Med.Term Nts. v.2014(22/23)                        | Technology             | 0,52                       | Deutschland |
| Micron Technology Inc. Registered Shares DL -,10                   | Information Technology | 0,49                       | USA         |
| 0,1000 % Banco Santander S.A. EO-FLR Preferred MTN 22(24/25)       | Financials banking     | 0,48                       | Spanien     |
| 0,6250 % Infineon Technologies AG Medium Term Notes v.22(22/25)    | Corporates             | 0,47                       | Deutschland |



#### Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Mit nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen sind alle Investitionen gemeint, die zur Erreichung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale im Rahmen der Anlagestrategie beitragen.

Dieser Fonds war zum Geschäftsjahresende am 31.12.2022 zu 98,79% nachhaltigkeitsbezogen in Bezug auf die Anlagen laut Nachhaltigkeitsstrategie des Fonds investiert. Der Prozentsatz weist den Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investments am Wertpapiervermögen aus.

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

#### Wie sah die Vermögensallokation aus?

Der Fonds war zu 47,25% in Renten, zu 42,31% in Aktien, zu 2,42% in Fondsanteilen und zu 3,45% in Zertifikaten investiert. Den Rest bildeten Derivate und liquide Mittel.



**#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

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

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

Die Renteninvestitionen wurden hauptsächlich in den Sektoren Corporates (56,89%), Financial non-banking (21,03%) und Financials banking (20,71%) getätigt.

Die Aktieninvestitionen wurden im Wesentlichen in den Sektoren Information Technology (25,79%), Financials (13,46%), Health Care (12,99%) und Industrials (11,09%) getätigt.

Eine Zuordnung der Fondsanteile in MSCI-Sektoren ist nicht darstellbar.

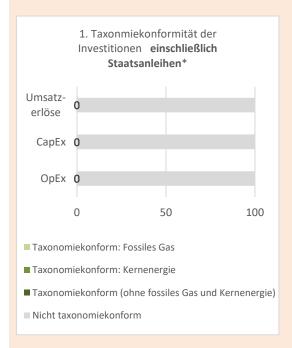
Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?

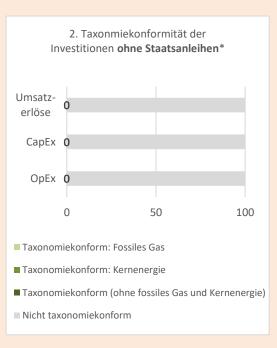
|           | Ja:               |                  |
|-----------|-------------------|------------------|
|           | ☐ In fossiles Gas | ☐ In Kernenergie |
| $\bowtie$ | Nein              |                  |

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

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität 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 \*

<sup>&</sup>lt;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. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.



# Welche Investitionen fielen unter "Andere Investitionen", welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Bargeld und Derivate fielen unter "Andere Investitionen" und dienten der Liquiditäts- und Risikosteuerung.

Für weitere Investitionen, die nicht unter die Nachhaltigkeitsstrategie des Fonds fallen, gibt es keine bindenden Kriterien zur Berücksichtigung eines ökologischen und/oder sozialen Mindestschutzes. Dies ist entweder durch die Natur der Vermögensgegenstände bedingt, bei denen zum Zeitpunkt der Erstellung dieses Berichts keine gesetzlichen Anforderungen oder marktüblichen Verfahren existieren, wie man bei solchen Vermögensgegenständen einen ökologischen und/oder sozialen Mindestschutz umsetzen kann oder es werden gezielt Investitionen von der Nachhaltigkeitsstrategie ausgenommen, die dann ebenfalls nicht der Prüfung eines ökologischen und/oder sozialen Mindestschutzes unterliegen.



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

Die Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale des Fonds während des Bezugszeitraums wurde maßgeblich durch die Einhaltung der zuvor beschriebenen quantitativen Nachhaltigkeitsindikatoren sowie der verbindlichen Elemente der Anlagestrategie gewährleistet. Die Überwachung der Einhaltung der Kriterien erfolgt vor Erwerb der Vermögenswerte durch das Portfoliomanagement und nach Erwerb durch weitere, entsprechende, tägliche Prüfung durch das Investment Controlling der Kapitalverwaltungsgesellschaft sowie fortlaufend durch den Portfolio Manager.

Die Mitwirkungspolitik (Engagement) der Kapitalverwaltungsgesellschaft wurde in Form der Stimmrechtsausübung wahrgenommen. Um die Interessen der Anleger in den verwalteten Fonds zu wahren und der damit verbundenen Verantwortung gerecht zu werden, übte die Kapitalverwaltungsgesellschaft die Aktionärs- und Gläubigerrechte aus den gehaltenen Aktienbeständen der verwalteten Fonds im Sinne der Anleger aus. Entscheidungskriterium für die Ausübung oder Nichtausübung von Stimmrechten war für die Kapitalverwaltungsgesellschaft die Interessen der Anleger und die Integrität des Marktes sowie der Nutzen für das betreffende Investmentvermögen und seine Anleger.

Die Kapitalverwaltungsgesellschaft legte ihrem Abstimmungsverhalten für das Inland die als ESG-konform geltenden ""Analyserichtlinien für Gesellschafterversammlungen"" des BVI zugrunde, die als Branchenstandard die Grundlage für einen verantwortungsvollen Umgang mit Anlegern, Kapital und Rechten bilden.

Bei Abstimmungen im Ausland zog die Kapitalverwaltungsgesellschaft die jeweils länderspezifischen Guidelines von Glass Lewis heran, die die lokalen Rahmenbedingungen berücksichtigen. Zusätzlich kamen die Glass Lewis Guidelines "Environmental, Social & Governance ("ESG") Initiatives" auf die spezifischen Länderguidelines zum Einsatz und gelangten vorrangig zur Anwendung. Die Anwendung dieser Guidelines gewährleistet, dass länderspezifisch und auf den Kriterien einer transparenten und nachhaltigen Corporate Governance-Politik sowie weiteren Kriterien aus den Bereichen Umwelt und Soziales, die auf einen langfristigen Erfolg der von Investmentvermögen gehaltenen Unternehmen (sog. Portfoliogesellschaften) abzielen, abgestimmt wurde.

Diese genutzten Abstimmungsstandards orientieren sich an den Interessen der von der Kapitalverwaltungsgesellschaft verwalteten Fonds und wurden daher grundsätzlich für alle Fonds angewandt, es sei denn, es ist im Interesse der Anleger, der Marktintegrität oder des Nutzens für den jeweiligen Investmentfonds erforderlich, von diesen Stimmrechtsrichtlinien für einzelne Fonds abzuweichen.

Die Kapitalverwaltungsgesellschaft veröffentlicht die Grundsätze ihre Mitwirkungspolitik sowie einen jährlichen Mitwirkungsbericht auf ihrer Internetseite.

Der Asset Manager, falls das Portfoliomanagement ausgelagert ist, oder ggf. ein beauftragter Anlageberater können als Teil ihrer unternehmensbezogenen Engagement-Tätigkeiten weitere Maßnahmen zur Erfüllung ökologischer und/oder sozialer Merkmale ergriffen haben. Dieses Engagement erfolgt jedoch nicht im Namen des Fonds.

Frankfurt am Main, den 2. Januar 2023

Universal-Investment-Gesellschaft mbH Die Geschäftsführung

#### VERMERK DES UNABHÄNGIGEN ABSCHLUSSPRÜFERS

An die Universal-Investment-Gesellschaft mbH, Frankfurt am Main

Prüfungsurteil

Wir haben den Jahresbericht des Sondervermögens Stiftungsfonds ESG Global - bestehend aus dem Tätigkeitsbericht für das Geschäftsjahr vom 1. Januar 2022 bis zum 31. Dezember 2022, der Vermögensübersicht und der Vermögensaufstellung zum 31. Dezember 2022, der Ertrags- und Aufwandsrechnung, der Verwendungsrechnung, der Entwicklungsrechnung für das Geschäftsjahr vom 1. Januar 2022 bis zum 31. Dezember 2022 sowie der vergleichenden Übersicht über die letzten drei Geschäftsjahre, der Aufstellung der während des Berichtszeitraumes abgeschlossenen Geschäfte, soweit diese nicht mehr Gegenstand der Vermögensaufstellung sind, und dem Anhang - geprüft.

Nach unserer Beurteilung aufgrund der bei der Prüfung gewonnenen Erkenntnisse entspricht der beigefügte Jahresbericht in allen wesentlichen Belangen den Vorschriften des deutschen Kapitalanlagegesetzbuchs (KAGB) und den einschlägigen europäischen Verordnungen und ermöglicht es unter Beachtung dieser Vorschriften, sich ein umfassendes Bild der tatsächlichen Verhältnisse und Entwicklungen des Sondervermögens zu verschaffen.

Grundlage für das Prüfungsurteil

Wir haben unsere Prüfung des Jahresberichts in Übereinstimmung mit § 102 KAGB unter Beachtung der vom Institut der Wirtschaftsprüfer (IDW) festgestellten deutschen Grundsätze ordnungsmäßiger Abschlussprüfung durchgeführt. Unsere Verantwortung nach diesen Vorschriften und Grundsätzen ist im Abschnitt "Verantwortung des Abschlussprüfers für die Prüfung des Jahresberichts" unseres Vermerks weitergehend beschrieben. Wir sind von der Universal-Investment-Gesellschaft mbH unabhängig in Übereinstimmung mit den deutschen handelsrechtlichen und berufsrechtlichen Vorschriften und haben unsere sonstigen deutschen Berufspflichten in Übereinstimmung mit diesen Anforderungen erfüllt. Wir sind der Auffassung, dass die von uns erlangten Prüfungsnachweise ausreichend und geeignet sind, um als Grundlage für unser Prüfungsurteil zum Jahresbericht zu dienen.

Verantwortung der gesetzlichen Vertreter für den Jahresbericht

Die gesetzlichen Vertreter der Universal-Investment-Gesellschaft mbH sind verantwortlich für die Aufstellung des Jahresberichts, der den Vorschriften des deutschen KAGB und den einschlägigen europäischen Verordnungen in allen wesentlichen Belangen entspricht und dafür, dass der Jahresbericht es unter Beachtung dieser Vorschriften ermöglicht, sich ein umfassendes Bild der tatsächlichen Verhältnisse und Entwicklungen des Sondervermögens zu verschaffen. Ferner sind die gesetzlichen Vertreter verantwortlich für die internen Kontrollen, die sie in Übereinstimmung mit diesen Vorschriften als notwendig bestimmt haben, um die Aufstellung eines Jahresberichts zu ermöglichen, der frei von wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen (d.h. Manipulationen der Rechnungslegung und Vermögensschädigungen) oder Irrtümern ist.

Bei der Aufstellung des Jahresberichts sind die gesetzlichen Vertreter dafür verantwortlich, Ereignisse, Entscheidungen und Faktoren, welche die weitere Entwicklung des Sondervermögens wesentlich beeinflussen können, in die Berichterstattung einzubeziehen. Das bedeutet u.a., dass die gesetzlichen Vertreter bei der Aufstellung des Jahresberichts die Fortführung des Sondervermögens durch die Universal-Investment-Gesellschaft mbH zu beurteilen haben und die Verantwortung haben, Sachverhalte im Zusammenhang mit der Fortführung des Sondervermögens, sofern einschlägig, anzugeben.

Verantwortung des Abschlussprüfers für die Prüfung des Jahresberichts

Unsere Zielsetzung ist, hinreichende Sicherheit darüber zu erlangen, ob der Jahresbericht als Ganzes frei von wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern ist, sowie einen Vermerk zu erteilen, der unser Prüfungsurteil zum Jahresbericht beinhaltet.

Hinreichende Sicherheit ist ein hohes Maß an Sicherheit, aber keine Garantie dafür, dass eine in Übereinstimmung mit § 102 KAGB unter Beachtung der vom Institut der Wirtschaftsprüfer (IDW) festgestellten deutschen Grundsätze ordnungsmäßiger Abschlussprüfung durchgeführte Prüfung eine wesentliche falsche Darstellung stets aufdeckt. Falsche Darstellungen können aus dolosen Handlungen oder Irrtümern resultieren und werden als wesentlich angesehen, wenn vernünftigerweise erwartet werden könnte, dass sie einzeln oder insgesamt die auf der Grundlage dieses Jahresberichts getroffenen wirtschaftlichen Entscheidungen von Adressaten beeinflussen.

Während der Prüfung üben wir pflichtgemäßes Ermessen aus und bewahren eine kritische Grundhaltung. Darüber hinaus

- identifizieren und beurteilen wir die Risiken wesentlicher falscher Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern im Jahresbericht, planen und führen Prüfungshandlungen als Reaktion auf diese Risiken durch sowie erlangen Prüfungsnachweise, die ausreichend und geeignet sind, um als Grundlage für unser Prüfungsurteil zu dienen. Das Risiko, dass aus dolosen Handlungen resultierende wesentliche falsche Darstellungen nicht aufgedeckt werden, ist höher als das Risiko, dass aus Irrtümern resultierende wesentliche falsche Darstellungen nicht aufgedeckt werden, da dolose Handlungen kollusives Zusammenwirken, Fälschungen, beabsichtigte Unvollständigkeiten, irreführende Darstellungen bzw. das Außerkraftsetzen interner Kontrollen beinhalten können.
- gewinnen wir ein Verständnis von dem für die Prüfung des Jahresberichts relevanten internen Kontrollsystem, um Prüfungshandlungen zu planen, die unter den gegebenen Umständen angemessen sind, jedoch nicht mit dem Ziel, ein Prüfungsurteil zur Wirksamkeit dieses Systems der Universal-Investment-Gesellschaft mbH abzugeben.
- beurteilen wir die Angemessenheit der von den gesetzlichen Vertretern der Universal-Investment-Gesellschaft mbH bei der Aufstellung des Jahresberichts angewandten Rechnungslegungsmethoden sowie die Vertretbarkeit der von den gesetzlichen Vertretern dargestellten geschätzten Werte und damit zusammenhängenden Angaben.
- ziehen wir Schlussfolgerungen auf der Grundlage erlangter Prüfungsnachweise, ob eine wesentliche Unsicherheit im Zusammenhang mit Ereignissen oder Gegebenheiten besteht, die bedeutsame Zweifel an der Fortführung des Sondervermögens durch die Universal-Investment-Gesellschaft mbH aufwerfen können. Falls wir zu dem Schluss kommen, dass eine wesentliche Unsicherheit besteht, sind wir verpflichtet, im Vermerk auf die dazugehörigen Angaben im Jahresbericht aufmerksam zu machen oder, falls diese Angaben unangemessen sind, unser Prüfungsurteil zu modifizieren. Wir ziehen unsere Schlussfolgerungen auf der Grundlage der bis zum Datum unseres Vermerks erlangten Prüfungsnachweise. Zukünftige Ereignisse oder Gegebenheiten können jedoch dazu führen, dass das Sondervermögen durch die Universal-Investment-Gesellschaft mbH nicht fortgeführt wird.
- beurteilen wir Darstellung, Aufbau und Inhalt des Jahresberichts insgesamt, einschließlich der Angaben sowie ob der Jahresbericht die zugrunde liegenden Geschäftsvorfälle und Ereignisse so darstellt, dass der Jahresbericht es unter Beachtung der Vorschriften des deutschen KAGB und der einschlägigen europäischen Verordnungen ermöglicht, sich ein umfassendes Bild der tatsächlichen Verhältnisse und Entwicklungen des Sondervermögens zu verschaffen.

Wir erörtern mit den für die Überwachung Verantwortlichen u.a. den geplanten Umfang und die Zeitplanung der Prüfung sowie bedeutsame Prüfungsfeststellungen, einschließlich etwaiger bedeutsamer Mängel im internen Kontrollsystem, die wir während unserer Prüfung feststellen.

Frankfurt am Main, den 18. April 2023

KPMG AG Wirtschaftsprüfungsgesellschaft

Schobel Wirtschaftsprüfer

Neuf Wirtschaftsprüfer

#### Kurzübersicht über die Partner

#### 1. Kapitalverwaltungsgesellschaft

Universal-Investment-Gesellschaft mbH

#### Hausanschrift:

Theodor-Heuss-Allee 70 60486 Frankfurt am Main

#### Postanschrift:

Postfach 17 05 48 60079 Frankfurt am Main

Telefon: 069 / 710 43-0 Telefax: 069 / 710 43-700 www.universal-investment.com

Gründung: 1968

Rechtsform: Gesellschaft mit beschränkter Haftung Gezeichnetes und eingezahltes Kapital: EUR 10.400.000,– Eigenmittel: EUR 70.241.950,24 (Stand: September 2021)

#### Geschäftsführer:

Frank Eggloff, München Mathias Heiß, Langen Katja Müller, Bad Homburg Markus Neubauer, Frankfurt am Main Michael Reinhard, Bad Vilbel Axel Vespermann, Dreieich

#### Aufsichtsrat:

Prof. Dr. Harald Wiedmann (Vorsitzender), Berlin Dr. Axel Eckhardt, Frankfurt am Main Ellen Engelhardt Daniel Fischer, Frankfurt am Main Daniel F. Just, München Janet Zirlewagen

#### 2. Verwahrstelle

Evangelische Bank eG

#### Hausanschrift:

Ständeplatz 19 34117 Kassel

Telefon 0800 520 604 10 Telefax 0800 520 604 19 www.eb.de

Rechtsform: Genossenschaft

Haftendes Eigenkapital: Mio. € 329 (Stand: 31.12.2021)

#### 3. Beratungsgesellschaft

ProVidens Vermögensmanagement GmbH

#### Postanschrift:

Savignystraße 22 60325 Frankfurt am Main

Telefon (069) 1539261-0 Telefax (069) 1539261-33 www.providens.de

#### 4. Beratungsgesellschaft und Vertrieb

EB-Sustainable Investment Management GmbH

Ständeplatz 19 34117 Kassel

Telefon (0561) 450603 3799 Telefax (0561) 450603 3798 www.eb-sim.de

WKN / ISIN: DK0LJZ / DE000DK0LJZ7