



# Jahresbericht inklusive geprüftem Jahresabschluss

zum 30. Juni 2023

## Swiss Rock (Lux) Sicav

-Anlagefonds nach Luxemburger Recht-

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

**Handelsregister-Nr. B 135.671**

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

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

# Inhaltsverzeichnis

	Seite
Informationen an die Aktionäre	4
Management und Verwaltung	5
Bericht über den Geschäftsverlauf	7
<b>Teilfonds Global Equity / Aktien Welt ESG</b>	<b>13</b>
Zusammensetzung des Netto-Fondsvermögens des Teilfonds	13
Währungs-Übersicht des Teilfonds	13
Wertpapierkategorie-Übersicht des Teilfonds	13
Länder-Übersicht des Wertpapiervermögens des Teilfonds	13
Vermögensaufstellung des Teilfonds	14
Ertrags- und Aufwandsrechnung des Teilfonds	24
Vermögensentwicklung des Teilfonds	24
Entwicklung des Teilfonds im Jahresvergleich	25
<b>Teilfonds European Equity / Aktien Europa ESG</b>	<b>26</b>
Zusammensetzung des Netto-Fondsvermögens des Teilfonds	26
Währungs-Übersicht des Teilfonds	26
Wertpapierkategorie-Übersicht des Teilfonds	26
Länder-Übersicht des Wertpapiervermögens des Teilfonds	26
Vermögensaufstellung des Teilfonds	27
Ertrags- und Aufwandsrechnung des Teilfonds	32
Vermögensentwicklung des Teilfonds	32
Entwicklung des Teilfonds im Jahresvergleich	33

## Inhaltsverzeichnis

<b>Teilfonds Emerging Equity / Aktien Schwellenländer ESG</b>	<b>34</b>
Zusammensetzung des Netto-Fondsvermögens des Teilfonds	34
Währungs-Übersicht des Teilfonds	34
Wertpapierkategorie-Übersicht des Teilfonds	34
Länder-Übersicht des Wertpapiervermögens des Teilfonds	34
Vermögensaufstellung des Teilfonds	35
Ertrags- und Aufwandsrechnung des Teilfonds	44
Vermögensentwicklung des Teilfonds	44
Entwicklung des Teilfonds im Jahresvergleich	45
<b>Teilfonds Absolute Return Bond Fund ESG</b>	<b>46</b>
Zusammensetzung des Netto-Fondsvermögens des Teilfonds	46
Währungs-Übersicht des Teilfonds	46
Wertpapierkategorie-Übersicht des Teilfonds	46
Länder-Übersicht des Wertpapiervermögens des Teilfonds	46
Vermögensaufstellung des Teilfonds	47
Ertrags- und Aufwandsrechnung des Teilfonds	52
Vermögensentwicklung des Teilfonds	52
Entwicklung des Teilfonds im Jahresvergleich	53

## Inhaltsverzeichnis

<b>Teilfonds Absolute Return Bond Fund Plus ESG</b>	<b>54</b>
Zusammensetzung des Netto-Fondsvermögens des Teilfonds	54
Währungs-Übersicht des Teilfonds	54
Wertpapierkategorie-Übersicht des Teilfonds	54
Länder-Übersicht des Wertpapiervermögens des Teilfonds	54
Vermögensaufstellung des Teilfonds	55
Ertrags- und Aufwandsrechnung des Teilfonds	62
Vermögensentwicklung des Teilfonds	62
Entwicklung des Teilfonds im Jahresvergleich	63
Zusammenfassung des Swiss Rock (Lux) Sicav	64
Anhang zum Jahresabschluss	65
Prüfungsvermerk	74
Zusätzliche Informationen zum Jahresbericht (ungeprüft)	77
Zusatzinformationen für Anleger in der Schweiz (ungeprüft)	83
Angaben zu Artikel 8 der Verordnung (EU) 2019/2088 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 27. November 2019 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (ungeprüft)	87

## Informationen an die Aktionäre

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

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

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

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

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

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

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

## Management und Verwaltung

### Gesellschaftssitz

9A, rue Gabriel Lippmann  
L-5365 Munsbach

### Verwaltungsrat der Gesellschaft

#### Vorsitzender

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

#### Mitglieder

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

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

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

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

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

### Zahl- und Informationsstelle in der Bundesrepublik Deutschland

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

### Zahlstelle in der Schweiz

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

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

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

### Verwaltungsgesellschaft, Promoter

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

### Managing Board der Verwaltungsgesellschaft

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

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

seit dem 1. November 2022:  
Marc-Oliver Scharwath  
Mitglied des Managing Board  
LRI Invest S.A., Munsbach/Luxemburg

### Aufsichtsrat der Verwaltungsgesellschaft

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

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

seit dem 1. Juli 2022:  
Thomas Rosenfeld (Mitglied des Aufsichtsrats)  
Generalbevollmächtigter  
Fürstlich Castell'sche Bank  
Würzbank/Deutschland

### Zentralverwaltungsstelle

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

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

## Management und Verwaltung

### **Abschlussprüfer**

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

## Bericht über den Geschäftsverlauf

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

Der Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav – Global Equity / Aktien Welt ESG erzielte in der Berichtsperiode eine Rendite von 10.25% (in EUR) für die Anteilklasse A.

Die Berichtsperiode wurde geprägt vom Ukraine Krieg und dem Kampf der Zentralbanken in den entwickelten Ländern gegen die Inflation. Die steigenden Zinsen haben vor allem die Wachstumstitel sinken lassen, da die Bewertungen seit der Covid Krise auch deutlich gestiegen sind. Zu Beginn des Jahres 22 hat das Kurs-Gewinn-Verhältnis (KGV) für den MSCI Welt Wachstum Index rund 31 betragen, im Vergleich zu 14 für den MSCI Welt Substanzwerte. Per Ende 2022 ist das KGV der Wachstumstitel auf 21 gesunken, dasjenige der Substanzwerte auf 12. Selbst Ende 2022 sind die Wachstumstitel immer noch eher teuer bewertet, während die Substanzwerte sehr billig erscheinen.

Während im ersten Halbjahr 2022 der britische Aktienmarkt deutlich besser rentierte als die restlichen Europäischen Länder (wegen dem hohen Anteil an Energie- und Rohstoffwerten), so hat sich dieses Verhalten im zweiten Halbjahr nicht mehr wiederholt. Der US Markt startete gut ins zweite Halbjahr 2022, getrieben von zyklischen Konsumgütern, verlor dann deutlich an Dynamik aufgrund der gestiegenen Rezessionserwartung.

Trotz einer gewissen Erleichterung im vierten Quartal wird das Jahr 2022 vor allem als ein Jahr in Erinnerung bleiben, in dem die Märkte die unangenehmen Folgen höherer Inflation und Zinsen einpreisten, die die Weltwirtschaft im Jahr 2023 treffen dürften. Positiv zu vermerken ist, dass eine Rezession nun weithin erwartet wird und die Märkte bereits einen Rückgang der Inflation und einen Höchststand der Zinsen vorwegnehmen.

2023 startete auch fulminant, vor allem für die Europäischen Finanzwerte. Höhere Zinsen bedeuten höhere Margen und damit auch höhere Gewinne. Bis Mitte März avancierten die Finanztitel rund 14%, während der breite Europäische Markt knapp 10% erreichte. Aufgrund der raschen Zinserhöhungen in den USA, erlitten einige Banken grosse Verluste auf ihren festverzinslichen Anlagen. Da gleichzeitig Kunden Geld von den Konten abzogen um Anlagen mit attraktiven Zinsen zu tätigen, kamen einige Regionalbanken in Liquiditätsnöte und mussten herbe Verluste auf ihren Anlagen realisieren. Drei Regionalbanken mussten aufgelöst, resp. in grössere Banken integriert werden. Die Schockwellen erfassten den ganzen Sektor und die Outperformance der Finanzwerte wandelte sich bis Ende März in eine deutliche Minderperformance.

Gleichzeitig begann die Inflation wieder zu sinken, sodass die US FED eine Reduktion der Zinserhöhungsrates einlegen konnte. Der Risikoappetit der Investoren kehrte zurück und liess zyklische Titel aus dem IT-Sektor und zyklischem Konsum erneut steigen.

Über die Berichtsperiode gehörten Automobilwerte, Luxusgüterfirmen und Technologiewerte zu den Gewinnern, während die defensiveren Pharmawerte oder Getränke- und Lebensmittelproduzenten zu den Schlusslichtern gehörten.

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

## **Bericht über den Geschäftsverlauf**

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

Der Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav – European Equity / Aktien Europe ESG erzielte in der Berichtsperiode eine Rendite von 15.36% (in EUR) für die Anteilklasse A.

Die Berichtsperiode wurde geprägt vom Ukraine Krieg und dem Kampf der Zentralbanken in den entwickelten Ländern gegen die Inflation. Die steigenden Zinsen haben vor allem die Wachstumstitel sinken lassen, da die Bewertungen seit der Covid Krise auch deutlich gestiegen sind. Zu Beginn des Jahres 22 hat das Kurs-Gewinn-Verhältnis (KGV) für den MSCI Welt Wachstum Index rund 31 betragen, im Vergleich zu 14 für den MSCI Welt Substanzwerte. Per Ende 2022 ist das KGV der Wachstumstitel auf 21 gesunken, dasjenige der Substanzwerte auf 12. Selbst Ende 2022 sind die Wachstumstitel immer noch eher teuer bewertet, während die Substanzwerte sehr billig erscheinen.

Während im ersten Halbjahr 2022 der Britische Aktienmarkt deutlich besser rentierte als die restlichen Europäischen Länder (wegen dem hohen Anteil an Energie- und Rohstoffwerten), so hat sich dieses Verhalten im zweiten Halbjahr nicht mehr wiederholt.

Trotz einer gewissen Erleichterung im vierten Quartal wird das Jahr 2022 vor allem als ein Jahr in Erinnerung bleiben, in dem die Märkte die unangenehmen Folgen höherer Inflation und Zinsen einpreisten, die die Weltwirtschaft im Jahr 2023 treffen dürften. Positiv zu vermerken ist, dass eine Rezession nun weithin erwartet wird und die Märkte bereits einen Rückgang der Inflation und einen Höchststand der Zinsen vorwegnehmen.

2023 startete auch fulminant, vor allem für die Europäischen Finanzwerte. Höhere Zinsen bedeuten höhere Margen und damit auch höhere Gewinne. Bis Mitte März avancierten die Finanztitel rund 14%, während der breite Markt knapp 10% erreichte. Aufgrund der raschen Zinserhöhungen in den USA, erlitten einige Banken grosse Verluste auf ihren festverzinslichen Anlagen. Da gleichzeitig Kunden Geld von den Konten abzogen um Anlagen mit attraktiven Zinsen zu tätigen, kamen einige Regionalbanken in Liquiditätsnöte und mussten herbe Verluste auf ihren Anlagen realisieren. Drei Regionalbanken mussten aufgelöst, resp. in grössere Banken integriert werden. Die Schockwellen erfassten den ganzen Sektor und die Outperformance der Finanzwerte wandelte sich bis Ende März in eine deutliche Minderperformance.

Gleichzeitig begann die Inflation wieder zu sinken, sodass die US FED eine Reduktion der Zinserhöhungsrates einlegen konnte. Der Risikoappetit der Investoren kehrte zurück und liess zyklische Titel aus dem IT-Sektor und zyklischem Konsum erneut steigen.

Über die Berichtsperiode gehörten Automobilwerte, Luxusgüterfirmen und Technologiewerte zu den Gewinnern, während die defensiveren Pharmawerte oder Getränke- und Lebensmittelproduzenten zu den Schlusslichtern gehörten.

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

## Bericht über den Geschäftsverlauf

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

Der Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav – Emerging Equity / Aktien Schwellenländer ESG erzielte in der Berichtsperiode eine Rendite von -1.43% (in EUR) für die Anteilklasse B.

Die Performance der Schwellenländermärkte (-3.00% in EUR, MSCI EM Universal ESG Net) liegt in der Berichtsperiode deutlich tiefer als jene der Industrienationen (13.77% in EUR, MSCI World Universal ESG Net).

Das Berichtsjahr war geprägt von der restriktiven Geldpolitik der Notenbanken zur Inflationsbekämpfung. Die US-Notenbank erhöhte die Zinsen im Juni 2022 erstmals seit mehreren Jahrzehnten um 75 Basispunkte und erhöhte sie bei jeder Sitzung weiter, bis im Juni 2023 erstmals eine Pause eingelegt wurde.

In diesem Umfeld sah sich die chinesische Wirtschaft mit einer Reihe von Gegenwindfaktoren konfrontiert: darunter die Null-Covid Politik des Landes, wetterbedingte Störungen und die anhaltende Schwäche des Immobilienmarktes. Während die meisten Wirtschaftsdaten zu Beginn des Berichtszeitraums noch schwach waren, verbesserten sie sich im Laufe des Jahres dank politischer Massnahmen zur Stützung der Anlageinvestitionen und der Industrieproduktion.

Lateinamerika entwickelte sich im Gegensatz zu den Industrieländern und den meisten asiatischen Märkten im Jahr 2022 positiv, der «MSCI Latin America» Index legte im Jahresverlauf um 9,56% in USD zu. Die gestiegenen Rohstoff- und Energiepreise trugen wesentlich zu dieser positiven Nachfrage bei. So lag der brasilianische Aktienmarkt per Jahresende 14.64% im Plus (MSCI Brazil in USD) und Chile sogar 23.28%. In Asien lagen 2022 nur Thailand und Indonesien im Plus, Indien verzeichnete in Lokalwährung das siebte positive Jahr in Folge.

Es gab auch Überraschungen. Das Wachstum in China und Europa überraschte positiv. Der durch den Krieg zwischen Russland und der Ukraine ausgelöste Energieschock sollte Europa während des nordischen Winters in eine Rezession stürzen, aber das Wachstum blieb positiv. Der ungewöhnlich warme Winter hat die Wirtschaftsdaten in den USA und Europa beflügelt. Die Verbraucher in beiden Regionen profitierten von sinkenden Energiepreisen, neuen Arbeitsplätzen und steigenden Einkommen. China erholte sich nach der Lockerung der COVID-19-Beschränkungen zunehmend.

In der ersten Jahreshälfte 2023 sind die Engpässe in den Lieferketten weitgehend beseitigt und die Energiepreise gesunken. China weist einige makroökonomische und finanzielle Besonderheiten auf, die sich in den derzeitigen Turbulenzen als Stärken erweisen. Das exzentrische Festhalten an einer Nullzinspolitik hat dazu geführt, dass sich der chinesische Konjunkturzyklus vom Rest der Welt abgekoppelt hat. Das Land ist daher ein natürlicher "Wachstumshedge". China könnte die einzige grosse Volkswirtschaft sein, die 2023 schneller wächst als im vergangenen Jahr. Das bedeutet, dass sich die Wachstumslücke zwischen China und Amerika auf fünf Prozentpunkte vergrössern könnte.

In unserem ökonomischen Basisszenario für 2023 gehen wir von einer Verlangsamung der Weltwirtschaft aus. Dies würde sich typischerweise negativ auf die Aktien der Schwellenländer im Vergleich zu den Industrieländern auswirken, aber es gibt Gründe, warum sich diese Beziehung diesmal umkehren könnte.

Der erste ist die Bewertung. Aktien aus Schwellenländern werden bereits mit einem Abschlag von fast 30 Prozent gegenüber den 12-Monats-Gewinnprognosen der Industrieländer gehandelt, und viele Währungen sind gegenüber dem US-Dollar günstig. Der zweite Grund ist die Geldpolitik. Nachdem mehrere Zentralbanken der Schwellenländer ihre Zinserhöhungszyklen 2021 vorgezogen haben, eröffnet die Abkühlung der Inflation in diesem Jahr nun das Potenzial für Zinssenkungen, die das Wirtschaftswachstum unterstützen. Wir glauben, dass diese Kombination von Faktoren darauf hindeutet, dass das Umfeld für Schwellenländeraktien günstig ist.

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

## Bericht über den Geschäftsverlauf

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

Die Aktienklasse A (EUR) des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav Absolute Return Bond Fund ESG erzielte in der Berichtsperiode eine Rendite von 2,05%, die Rendite der Aktienklasse C (CHF) betrug 0,74%. Die Entwicklung der risikolosen Zinsen in Europa waren im Berichtszeitraum stark von der Inflation geprägt. Aufgrund gestiegener Rohstoffpreise, Engpässen in Lieferketten und steigender Nachfrage stiegen die Verbraucherpreise in vielen Ländern stark an. Dies führte zu einer erhöhten Diskussion über die Geldpolitik und die potenziellen Auswirkungen auf die wirtschaftliche Erholung. Die Teuerung näherte sich zweistelligen Wachstumsraten, wodurch das Inflationsziel der Zentralbanken von 2% massiv überschritten wurde. So erhöhte die US-Notenbank Fed die Leitzinsen 2022 in sieben Schritten auf ein Zielband von 4.25% bis 4.50%, nach drei weiteren Anhebungen in diesem Jahr liegt es nun bei 5 bis 5.25%. Die EZB (Europäische Zentralbank) reagierte im Juli 2022 und erhöhte die Zinsen um 50 Basispunkte, die erste Zinserhöhung seit über 10 Jahren. Im Berichtszeitraum folgten sieben weitere Zinsschritte und das massgebende EZB Hauptrefinanzierungsinstrument („ECB Main Refinancing Operation“) erhöhte sich auf 4.0%, eine Zinserhöhung um 400 Basispunkte in weniger als einem Jahr. Entsprechend notieren Bonds über alle Laufzeiten wieder mit positiven Renditen, die Phase der Negativzinsen scheint überwunden. Aufgrund der stark gestiegenen Zinsen geht der Markt von einer deutlichen Abkühlung der Weltwirtschaft aus und antizipiert, dass die Zentralbanken die Zinsen bald wieder senken werden. Das Ergebnis dieser Markteinschätzung sind inverse Zinskurven, sprich die langfristigen Zinsen sind tiefer als die Kurzfristigen. In den USA besteht dieses Phänomen bereits seit rund 12 Monaten und seit November 2022 weisen auch deutsche Staatsanleihen eine inverse Struktur auf. Dabei sind in der Berichtsperiode die 2-jährigen Zinsen für deutsche Staatsanleihen um 255 Basispunkte auf 3.2% und die 10-jährigen Renditen stiegen um 106 Basispunkten auf 2.4%. In der Vergangenheit waren inverse Zinskurven meist ein Signal für eine aufkommende Rezession. Die aktuellen Wirtschaftsdaten, insbesondere auch ein solider Arbeitsmarkt, weisen noch auf keine Abkühlung hin. Dies widerspiegeln auch die tieferen Kreditrisikoprämien für Investment Grade Anleihen, nachdem sich diese im Spätsommer 2022 etwas ausgeweitet hatten. Noch haben sich Befürchtungen stark ansteigender Firmenkonkurse nicht materialisiert, jedoch zahlen Firmen mit einer tiefen Bonität aktuell signifikant mehr, um auslaufende Bonds zu refinanzieren, was sich früher oder später in tieferen Unternehmensgewinnen niederschlagen wird. Die positive Performance über die Berichtsperiode erklärt sich weitestgehend durch die Reduktion der Kreditrisikoprämien in 2022. Wir investierten vor allem in Neuemissionen solider Firmen und untergewichtigen High Yield. Die aktuellen Kreditrisikoprämien überkompensieren das durchschnittliche Konkursrisiko für Anleihen bester Qualität und entsprechend favorisierten wir eine Strategie, welche selektiv in attraktiv bewertete Neuemissionen investierte. Der Einfluss der risikolosen Zinsen auf die Performance war gering aufgrund der tiefen Zinsduration im Fond.

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

## Bericht über den Geschäftsverlauf

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

Die Aktienklasse A (EUR) des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav Absolute Return Bond Fund Plus ESG erzielte in der Berichtsperiode eine Rendite von 3,31%, die Rendite der Aktienklasse C (CHF) betrug 1,96%. Die Entwicklung der risikolosen Zinsen in Europa waren im Berichtszeitraum stark von der Inflation geprägt. Aufgrund gestiegener Rohstoffpreise, Engpässen in Lieferketten und steigender Nachfrage stiegen die Verbraucherpreise in vielen Ländern stark an. Dies führte zu einer erhöhten Diskussion über die Geldpolitik und die potenziellen Auswirkungen auf die wirtschaftliche Erholung. Die Teuerung näherte sich zweistelligen Wachstumsraten, wodurch das Inflationsziel der Zentralbanken von 2% massiv überschritten wurde. So erhöhte die US-Notenbank Fed die Leitzinsen 2022 in sieben Schritten auf ein Zielband von 4.25% bis 4.50%, nach drei weiteren Anhebungen in diesem Jahr liegt es nun bei 5 bis 5.25%. Die EZB (Europäische Zentralbank) reagierte im Juli 2022 und erhöhte die Zinsen um 50 Basispunkte, die erste Zinserhöhung seit über 10 Jahren. Im Berichtszeitraum folgten sieben weitere Zinsschritte und das massgebende EZB Hauptrefinanzierungsinstrument („ECB Main Refinancing Operation“) erhöhte sich auf 4.0%, eine Zinserhöhung um 400 Basispunkte in weniger als einem Jahr. Entsprechend notieren Bonds über alle Laufzeiten wieder mit positiven Renditen, die Phase der Negativzinsen scheint überwunden. Aufgrund der stark gestiegenen Zinsen geht der Markt von einer deutlichen Abkühlung der Weltwirtschaft aus und antizipiert, dass die Zentralbanken die Zinsen bald wieder senken werden. Das Ergebnis dieser Markteinschätzung sind inverse Zinskurven, sprich die langfristigen Zinsen sind tiefer als die Kurzfristigen. In den USA besteht dieses Phänomen bereits seit rund 12 Monaten und seit November 2022 weisen auch deutsche Staatsanleihen eine inverse Struktur auf. Dabei sind in der Berichtsperiode die 2-jährigen Zinsen für deutsche Staatsanleihen um 255 Basispunkte auf 3.2% und die 10-jährigen Renditen stiegen um 106 Basispunkten auf 2.4%. In der Vergangenheit waren inverse Zinskurven meist ein Signal für eine aufkommende Rezession. Die aktuellen Wirtschaftsdaten, insbesondere auch ein solider Arbeitsmarkt, weisen noch auf keine Abkühlung hin. Dies widerspiegeln auch die tieferen Kreditrisikoprämien für Investment Grade Anleihen, nachdem sich diese im Spätsommer 2022 etwas ausgeweitet hatten. Noch haben sich Befürchtungen stark ansteigender Firmenkurse nicht materialisiert, jedoch zahlen Firmen mit einer tiefen Bonität aktuell signifikant mehr, um auslaufende Bonds zu refinanzieren, was sich früher oder später in tieferen Unternehmensgewinnen niederschlagen wird. Die positive Performance über die Berichtsperiode erklärt sich weitestgehend durch die Reduktion der Kreditrisikoprämien in 2022. Wir investierten vor allem in Neuemissionen solider Firmen und untergewichteten High Yield. Die aktuellen Kreditrisikoprämien überkompensieren das durchschnittliche Konkursrisiko für Anleihen bester Qualität und entsprechend favorisierten wir eine Strategie, welche selektiv in attraktiv bewertete Neuemissionen investierte. Der Einfluss der risikolosen Zinsen auf die Performance war gering aufgrund der tiefen Zinsduration im Fond.

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

# Bericht über den Geschäftsverlauf

## Übersicht der Wertentwicklung aller Anteilklassen

Anteilklasse	Performance	Anteilklasse	Performance
Global Equity / Aktien Welt ESG A	10,25%	Absolute Return Bond Fund ESG A	2,05%
Global Equity / Aktien Welt ESG B	10,77%	Absolute Return Bond Fund ESG B	2,59%
Global Equity / Aktien Welt ESG C	9,81%	Absolute Return Bond Fund ESG C	0,74%
Global Equity / Aktien Welt ESG X	8,72%	Absolute Return Bond Fund ESG D	1,29%
European Equity / Aktien Europa ESG A	15,36%	Absolute Return Bond Fund ESG X	0,49%
European Equity / Aktien Europa ESG B	16,13%	Absolute Return Bond Fund Plus ESG A	3,31%
European Equity / Aktien Europa ESG X	16,83%	Absolute Return Bond Fund Plus ESG B	3,85%
Emerg. Equ. / Aktien Schwellenländer ESG A	-2,47%	Absolute Return Bond Fund Plus ESG C	1,96%
Emerg. Equ. / Aktien Schwellenländer ESG B	-1,43%	Absolute Return Bond Fund Plus ESG D	2,62%
Emerg. Equ. / Aktien Schwellenländer ESG C	0,20%	Absolute Return Bond Fund Plus ESG E	5,84%
Emerg. Equ. / Aktien Schwellenländer ESG E	2,91%	Absolute Return Bond Fund Plus ESG X	1,79%
Emerg. Equ. / Aktien Schwellenländer ESG X	-3,13%		

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

### Hinweis zum Russland / Ukraine Konflikt

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

Munsbach, im Oktober 2023

Der Verwaltungsrat

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

### Zusammensetzung des Netto-Fondsvermögens des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Global Equity / Aktien Welt ESG per 30. Juni 2023

Position	Betrag in EUR
Wertpapiervermögen (Wertpapiereinstandskosten EUR 62.629.052,08)	85.540.221,90
Derivate	479.997,43
Bankguthaben	1.182.880,06
Sonstige Vermögensgegenstände	128.157,26
<b>Summe Aktiva</b>	<b>87.331.256,65</b>
Bankverbindlichkeiten	-19.092,93
Sonstige Verbindlichkeiten	-267.262,25
<b>Summe Passiva</b>	<b>-286.355,18</b>
<b>Netto-Teilfondsvermögen</b>	<b>87.044.901,47</b>

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

Währung	Kurswert in Mio. EUR	in % des Netto- Teilfondsvermögens
USD	58,64	67,39
EUR	9,26	10,65
JPY	5,29	6,07
CAD	3,68	4,23
GBP	3,35	3,84
CHF	2,57	2,95
AUD	1,80	2,07
DKK	1,00	1,14
SEK	0,78	0,89
Sonstige Währungen	0,67	0,77
<b>Summe</b>	<b>87,04</b>	<b>100,00</b>

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

Wertpapierkategorie	Kurswert in Mio. EUR	in % des Netto- Teilfondsvermögens
Aktien	84,47	97,04
REITS	0,82	0,94
Genussscheine	0,25	0,29
<b>Summe</b>	<b>85,54</b>	<b>98,27</b>

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

Länder	Kurswert in Mio. EUR	in % des Netto- Teilfondsvermögens
USA	56,47	64,89
Japan	5,15	5,92
Kanada	3,67	4,21
Großbritannien	3,17	3,64
Frankreich	3,05	3,51
Schweiz	2,74	3,14
Bundesrepublik Deutschland	1,90	2,19
Niederlande	1,83	2,10
Australien	1,77	2,03
Sonstige Länder	5,79	6,64
<b>Summe</b>	<b>85,54</b>	<b>98,27</b>

Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

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

## Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2023 des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Global Equity / Aktien Welt ESG

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg in 1.000	Bestand	Kurs zum 30.06.2023	Kurswert in EUR	in % des Netto- vermögens
<b>Amtlich gehandelte Wertpapiere / Regulierter Markt</b>						
<b>Aktien</b>						
Aristocrat Leisure Ltd. Registered Shares o.N.	AU000000ALL7	STK	4.500,00 AUD	38,6600	106.143,99	0,12
AUB Group Ltd. Registered Shares o.N.	AU000000AUB9	STK	2.097,00 AUD	29,4000	37.615,50	0,04
Brambles Ltd. Registered Shares o.N.	AU000000BXB1	STK	7.600,00 AUD	14,4100	66.818,79	0,08
Challenger Ltd. Registered Shares o.N.	AU000000CGF5	STK	6.000,00 AUD	6,4800	23.721,78	0,03
Coles Group Ltd. Registered Shares o.N.	AU00000030678	STK	6.900,00 AUD	18,4200	77.546,06	0,09
CSL Ltd. Registered Shares o.N.	AU000000CSL8	STK	850,00 AUD	277,3800	143.851,74	0,17
Fortescue Metals Group Ltd. Registered Shares o.N.	AU000000FMG4	STK	10.000,00 AUD	22,1800	135.326,42	0,16
Harvey Norman Holdings Ltd. Registered Shares o.N.	AU000000HVN7	STK	10.000,00 AUD	3,4800	21.232,46	0,02
Incitec Pivot Ltd. Registered Shares o.N.	AU000000IPL1	STK	11.090,00 AUD	2,7400	18.539,72	0,02
Metcash Ltd. Registered Shares o.N.	AU000000MTS0	STK	7.548,00 AUD	3,7600	17.315,73	0,02
Origin Energy Ltd. Registered Shares o.N.	AU000000ORG5	STK	9.000,00 AUD	8,4100	46.180,60	0,05
Perpetual Ltd. Registered Shares o.N.	AU000000PPT9	STK	1.428,00 AUD	25,8800	22.548,29	0,03
Platinum Asset Management Ltd. Registered Shares o.N.	AU000000PTM6	STK	25.000,00 AUD	1,7400	26.540,57	0,03
Premier Investments Ltd. Registered Shares o.N.	AU000000PMV2	STK	1.100,00 AUD	20,2600	13.597,32	0,02
QBE Insurance Group Ltd. Registered Shares o.N.	AU000000QBE9	STK	11.525,00 AUD	15,6700	110.187,16	0,13
Reece Ltd. Registered Shares o.N.	AU000000REH4	STK	3.400,00 AUD	18,5700	38.522,27	0,04
Rio Tinto Ltd. Registered Shares o.N.	AU000000RIO1	STK	900,00 AUD	114,6900	62.978,04	0,07
Santos Ltd. Registered Shares o.N.	AU000000STO6	STK	15.500,00 AUD	7,5200	71.116,53	0,08
Sims Metal Management Ltd. Reg. Shares o.N.	AU000000SGM7	STK	2.800,00 AUD	15,7500	26.906,65	0,03
Sonic Healthcare Ltd. Registered Shares o.N.	AU000000SHL7	STK	2.700,00 AUD	35,5700	58.596,10	0,07
South32 Ltd. Registered Shares o.N.	AU000000S320	STK	23.374,00 AUD	3,7600	53.621,87	0,06
Steadfast Group Ltd Registered Shares o.N.	AU000000SDF8	STK	14.862,00 AUD	6,0000	54.406,35	0,06
Suncorp Group Ltd. Registered Shares o.N.	AU000000SUN6	STK	6.300,00 AUD	13,4900	51.852,96	0,06
Super Retail Group Ltd. Registered Shares o.N.	AU000000SUL0	STK	3.670,00 AUD	11,4300	25.593,72	0,03
Telstra Group Ltd. Registered Shares o.N.	AU000000TLS2	STK	30.000,00 AUD	4,3000	78.706,53	0,09
Wesfarmers Ltd. Registered Shares o.N.	AU000000WES1	STK	3.000,00 AUD	49,3400	90.311,17	0,10
WiseTech Global Ltd. Registered Shares o.N.	AU000000WTC3	STK	900,00 AUD	79,8100	43.824,89	0,05
Woodside Energy Group Ltd. Registered Shares o.N.	AU0000224040	STK	5.992,00 AUD	34,4400	125.908,77	0,14
Woolworths Group Ltd. Registered Shares o.N.	AU000000WOW2	STK	2.764,00 AUD	39,7300	67.000,44	0,08
Alimentation Couche-Tard Inc. Registered Shares o.N.	CA01626P1484	STK	5.000,00 CAD	67,9300	235.263,56	0,27
B2Gold Corp. Registered Shares o.N.	CA11777Q2099	STK	42.200,00 CAD	4,7200	137.967,72	0,16
BRP Inc. Reg.Subordinate Voting Shs o.N	CA05577W2004	STK	2.000,00 CAD	111,9900	155.143,04	0,18
Canadian Imperial Bk of Comm. Registered Shares o.N.	CA1360691010	STK	4.000,00 CAD	56,5600	156.708,46	0,18
Canadian National Railway Co. Registered Shares o.N.	CA1363751027	STK	1.500,00 CAD	160,4200	166.675,90	0,19
Canadian Paci.Kansas City Ltd. Registered Shares o.N.	CA13646K1084	STK	3.000,00 CAD	107,0000	222.345,36	0,26
Constellation Software Inc. Registered Shares o.N.	CA21037X1006	STK	100,00 CAD	2.744,7600	190.119,83	0,22
Enbridge Inc. Registered Shares o.N.	CA29250N1050	STK	5.000,00 CAD	49,2400	170.534,04	0,20
IA Financial Corporation Inc. Registered Shares o.N.	CA45075E1043	STK	3.000,00 CAD	90,2500	187.538,96	0,22
Lumine Group Inc. Registered Shs (Sub.Vtg.)o.N.	CA55027C1068	STK	300,00 CAD	18,1700	3.775,72	0,00
Manulife Financial Corp. Registered Shares o.N.	CA56501R1064	STK	19.800,00 CAD	25,0400	343.417,61	0,39
Nutrien Ltd Registered Shares o.N.	CA67077M1086	STK	2.400,00 CAD	78,2100	130.015,93	0,15
Parkland Corp. Registered Shares o.N.	CA70137W1086	STK	6.000,00 CAD	33,0000	137.147,61	0,16
Pembina Pipeline Corp. Registered Shares o.N.	CA7063271034	STK	6.000,00 CAD	41,6500	173.096,90	0,20
Rogers Communications Inc. Reg. Shares Class B CD 1,62478	CA7751092007	STK	4.100,00 CAD	60,4400	171.645,08	0,20
Royal Bank of Canada Registered Shares o.N.	CA7800871021	STK	2.109,00 CAD	126,5200	184.824,19	0,21
Suncor Energy Inc. Registered Shares o.N.	CA8672241079	STK	6.000,00 CAD	38,8600	161.501,70	0,19
Toronto-Dominion Bank, The Registered Shares o.N.	CA8911605092	STK	6.235,00 CAD	82,1100	354.613,74	0,41
West Fraser Timber Co. Ltd. Registered Shares o.N.	CA9528451052	STK	1.700,00 CAD	113,8100	134.014,68	0,15
Weston Ltd., George Registered Shares o.N.	CA9611485090	STK	1.200,00 CAD	156,6200	130.182,17	0,15
WSP Global Inc. Registered Shares o.N.	CA92938W2022	STK	1.000,00 CAD	175,0200	121.230,17	0,14
ABB Ltd. Namens-Aktien SF 0,12	CH0012221716	STK	4.326,00 CHF	35,1800	155.923,04	0,18

Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

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

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg in 1.000	Bestand	Kurs zum 30.06.2023	Kurswert in EUR	in % des Netto- Teilfonds- vermögens	
Cie Financière Richemont AG Namens-Aktien SF 1	CH0210483332	STK	1.150,00	CHF	151,6500	178.676,81	0,21
DKSH Holding AG Nam.-Aktien SF -,10	CH0126673539	STK	500,00	CHF	66,5500	34.091,49	0,04
Givaudan SA Namens-Aktien SF 10	CH0010645932	STK	16,00	CHF	2.965,0000	48.604,07	0,06
Holcim Ltd. Namens-Aktien SF 2	CH0012214059	STK	1.980,00	CHF	60,2000	122.120,79	0,14
Julius Baer Gruppe AG Namens-Aktien SF -,02	CH0102484968	STK	1.300,00	CHF	56,3400	75.039,19	0,09
Kühne + Nagel Internat. AG Namens-Aktien SF 1	CH0025238863	STK	253,00	CHF	264,7000	68.612,37	0,08
Nestlé S.A. Namens-Aktien SF -,10	CH0038863350	STK	6.182,00	CHF	107,6000	681.505,25	0,78
Novartis AG Namens-Aktien SF 0,50	CH0012005267	STK	5.052,00	CHF	90,0000	465.836,79	0,54
Partners Group Holding AG Namens-Aktien SF -,01	CH0024608827	STK	70,00	CHF	841,6000	60.357,56	0,07
SFS Group AG Nam.-Aktien SF -,10	CH0239229302	STK	250,00	CHF	117,8000	30.172,63	0,03
Swiss Re AG Namens-Aktien SF -,10	CH0126881561	STK	932,00	CHF	90,0400	85.976,42	0,10
Swisscom AG Namens-Aktien SF 1	CH0008742519	STK	290,00	CHF	557,8000	165.731,26	0,19
Zurich Insurance Group AG Nam.-Aktien SF 0,10	CH0011075394	STK	642,00	CHF	424,9000	279.479,33	0,32
A.P.Møller-Mærsk A/S Navne-Aktier B DK 1000	DK0010244508	STK	40,00	DKK	11.975,0000	64.330,27	0,07
Carlsberg AS Navne-Aktier B DK 20	DK0010181759	STK	489,00	DKK	1.090,5000	71.616,72	0,08
Danske Bank AS Navne-Aktier DK 10	DK0010274414	STK	2.085,00	DKK	166,0000	46.482,99	0,05
Demant AS Navne Aktier A DK 0,2	DK0060738599	STK	1.300,00	DKK	288,5000	50.369,66	0,06
DSV A/S Indehaver Bonus-Aktier DK 1	DK0060079531	STK	623,00	DKK	1.433,0000	119.898,60	0,14
Novo-Nordisk AS Navne-Aktier B DK -,20	DK0060534915	STK	3.920,00	DKK	1.099,4000	578.790,89	0,66
Novozymes A/S Navne-Aktier B DK 2	DK0060336014	STK	789,00	DKK	317,9000	33.685,84	0,04
NTG Nordic Transport Group AS Navne-Aktier DK 20	DK0061141215	STK	541,00	DKK	431,5000	31.351,47	0,04
ACCOR S.A. Actions Port. EO 3	FR0000120404	STK	1.500,00	EUR	34,0200	51.030,00	0,06
ACS, Act.de Constr.y Serv. SA Acciones Port. EO -,50	ES0167050915	STK	1.298,00	EUR	32,1700	41.756,66	0,05
Aena SME S.A. Acciones Port. EO 10	ES0105046009	STK	350,00	EUR	148,0000	51.800,00	0,06
Ahold Delhaize N.V., Konkinkl. Aandelen aan toonder EO -,01	NL0011794037	STK	6.025,00	EUR	31,2600	188.341,50	0,22
Air Liquide-SA Ét.Expl.P.G.Cl. Actions Port. EO 5,50	FR0000120073	STK	1.201,00	EUR	164,2000	197.204,20	0,23
Airbus SE Aandelen op naam EO 1	NL0000235190	STK	957,00	EUR	132,3600	126.668,52	0,15
Allianz SE vink.Namens-Aktien o.N.	DE0008404005	STK	1.253,00	EUR	213,2000	267.139,60	0,31
Andritz AG Inhaber-Aktien o.N.	AT0000730007	STK	1.275,00	EUR	51,0500	65.088,75	0,07
Anheuser-Busch InBev S.A./N.V. Actions au Port. o.N.	BE0974293251	STK	2.121,00	EUR	51,8300	109.931,43	0,13
Aperam S.A. Actions Nom. o.N.	LU0569974404	STK	2.258,00	EUR	28,5800	64.533,64	0,07
ASM International N.V. Bearer Shares EO 0,04	NL0000334118	STK	250,00	EUR	388,3500	97.087,50	0,11
ASML Holding N.V. Aandelen op naam EO -,09	NL0010273215	STK	914,00	EUR	663,0000	605.982,00	0,70
Assicurazioni Generali S.p.A. Azioni nom. o.N.	IT0000062072	STK	4.434,00	EUR	18,6200	82.561,08	0,09
AXA S.A. Actions Port. EO 2,29	FR0000120628	STK	3.272,00	EUR	27,0250	88.425,80	0,10
Banco Bilbao Vizcaya Argent. Acciones Nom. EO 0,49	ES0113211835	STK	19.431,00	EUR	7,0320	136.638,79	0,16
Banco Santander S.A. Acciones Nom. EO 0,50	ES0113900J37	STK	30.000,00	EUR	3,3850	101.550,00	0,12
BE Semiconductor Inds N.V. Aandelen op Naam EO-,01	NL0012866412	STK	500,00	EUR	99,3000	65.950,00	0,06
BNP Paribas S.A. Actions Port. EO 2	FR0000131104	STK	2.907,00	EUR	57,7200	167.792,04	0,19
Bouygues S.A. Actions Port. EO 1	FR0000120503	STK	1.874,00	EUR	30,7600	57.644,24	0,07
Brunello Cucinelli S.P.A. Azioni nom. o. N.	IT0004764699	STK	593,00	EUR	80,6000	47.795,80	0,05
Bureau Veritas SA Actions au Porteur EO -,12	FR0006174348	STK	4.259,00	EUR	25,1200	106.986,08	0,12
BUZZI S.p.A. Azioni nom. o.N.	IT0001347308	STK	1.902,00	EUR	22,9400	43.631,88	0,05
Capgemini SE Actions Port. EO 8	FR0000125338	STK	425,00	EUR	173,5500	73.758,75	0,08
Cie Génle ÉtS Michelin SCpA Actions Nom. EO -,50	FR001400AJ45	STK	2.356,00	EUR	27,0600	63.753,36	0,07
Compagnie de Saint-Gobain S.A. Actions au Porteur (C.R.) EO 4	FR0000125007	STK	1.422,00	EUR	55,7300	79.248,06	0,09
Danone S.A. Actions Port. EO-,25	FR0000120644	STK	1.432,00	EUR	56,1400	80.392,48	0,09
Dassault Systemes SE Actions Port. EO 0,10	FR0014003TT8	STK	2.580,00	EUR	40,6250	104.812,50	0,12
Deutsche Börse AG Namens-Aktien o.N.	DE0005810055	STK	750,00	EUR	169,1000	126.825,00	0,15
Deutsche Post AG Namens-Aktien o.N.	DE0005552004	STK	2.900,00	EUR	44,7300	129.717,00	0,15
Deutsche Telekom AG Namens-Aktien o.N.	DE0005557508	STK	4.136,00	EUR	19,9760	82.620,74	0,09
DWS Group GmbH & Co. KGaA Inhaber-Aktien o.N.	DE000DWS1007	STK	1.100,00	EUR	28,0400	30.844,00	0,04
E.ON SE Namens-Aktien o.N.	DE000ENAG999	STK	7.000,00	EUR	11,6800	81.760,00	0,09
Edenred SE Actions Port. EO 2	FR0010908533	STK	1.381,00	EUR	61,3400	84.710,54	0,10
Eiffage S.A. Actions Port. EO 4	FR0000130452	STK	538,00	EUR	95,5800	51.422,04	0,06
Endesa S.A. Acciones Port. EO 1,20	ES0130670112	STK	2.272,00	EUR	19,6500	44.644,80	0,05
Engie S.A. Actions Port. EO 1	FR0010208488	STK	5.000,00	EUR	15,2280	76.140,00	0,09
ENI S.p.A. Azioni nom. o.N.	IT0003132476	STK	6.451,00	EUR	13,1820	85.037,08	0,10

Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

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

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg in 1.000	Bestand	Kurs zum 30.06.2023	Kurswert in EUR	in % des Netto- Teilfonds- vermögens
Euronext N.V. Aandelen an toonder WI EO 1,60	NL0006294274	STK	531,00	EUR 62,3000	33.081,30	0,04
Ferrari N.V. Aandelen op naam EO -,01	NL0011585146	STK	201,00	EUR 299,5000	60.199,50	0,07
Ferrovial SE Registered Shares EO-,01	NL0015001FS8	STK	2.000,00	EUR 28,9700	57.940,00	0,07
Finecobank Banca Fineco S.p.A. Azioni nom. EO -,33	IT0000072170	STK	3.700,00	EUR 12,3150	45.565,50	0,05
Henkel AG & Co. KGaA Inhaber-Vorzugsaktien o.St.o.N	DE0006048432	STK	849,00	EUR 73,2600	62.197,74	0,07
Hermes International S.C.A. Actions au Porteur o.N.	FR0000052292	STK	83,00	EUR 1.990,0000	165.170,00	0,19
HUGO BOSS AG Namens-Aktien o.N.	DE000A1PHFF7	STK	684,00	EUR 71,5400	48.933,36	0,06
Iberdrola S.A. Acciones Port. EO -,75	ES0144580Y14	STK	16.213,00	EUR 11,9500	193.745,35	0,22
Indra Sistemas S.A. Acciones Port. EO 0,20	ES0118594417	STK	3.144,00	EUR 11,5800	36.407,52	0,04
Industria de Diseño Textil SA Acciones Port. EO 0,03	ES0148396007	STK	4.049,00	EUR 35,4600	143.577,54	0,16
Infineon Technologies AG Namens-Aktien o.N.	DE0006231004	STK	3.913,00	EUR 37,7850	147.852,71	0,17
ING Groep N.V. Aandelen op naam EO -,01	NL0011821202	STK	6.000,00	EUR 12,3380	74.028,00	0,09
Jerónimo Martins, SGPS, S.A. Acções Nominativas EO 1	PTJMT0AE0001	STK	1.966,00	EUR 25,2400	49.621,84	0,06
Kering S.A. Actions Port. EO 4	FR0000121485	STK	181,00	EUR 505,6000	91.513,60	0,11
Kingspan Group PLC Registered Shares EO -,13	IE0004927939	STK	720,00	EUR 60,9000	43.848,00	0,05
Konecranes Oyj Registered Shares o.N.	FI0009005870	STK	764,00	EUR 36,8500	28.153,40	0,03
LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE Actions Port. (C.R.) EO 0,3	FR0000121014	STK	417,00	EUR 863,0000	359.871,00	0,41
Mercedes-Benz Group AG Namens-Aktien o.N.	DE0007100000	STK	1.403,00	EUR 73,6700	103.359,01	0,12
Merck KGaA Inhaber-Aktien o.N.	DE0006599905	STK	310,00	EUR 151,5500	46.980,50	0,05
Moncler S.p.A. Azioni nom. o.N.	IT0004965148	STK	600,00	EUR 63,3400	38.004,00	0,04
Münchener Rückvers.-Ges. AG vink.Namens-Aktien o.N.	DE0008430026	STK	538,00	EUR 343,6000	184.856,80	0,21
N.V. Bekaert S.A. Parts Sociales au Port. o.N.	BE0974258874	STK	1.332,00	EUR 41,5000	55.278,00	0,06
Naturgy Energy Group S.A. Acciones Port. EO 1	ES0116870314	STK	1.435,00	EUR 27,2600	39.118,10	0,04
Oréal S.A., L' Actions Port. EO 0,2	FR0000120321	STK	563,00	EUR 427,1000	240.457,30	0,28
Pernod Ricard S.A. Actions Port. (C.R.) o.N.	FR0000120693	STK	600,00	EUR 202,4000	121.440,00	0,14
Publicis Groupe S.A. Actions Port. EO 0,40	FR0000130577	STK	739,00	EUR 73,5000	54.316,50	0,06
Red Electrica Corporacion S.A. Acciones Port. EO -,50	ES0173093024	STK	3.904,00	EUR 15,3850	60.063,04	0,07
Rheinmetall AG Inhaber-Aktien o.N.	DE0007030009	STK	270,00	EUR 250,8000	67.716,00	0,08
Sanofi S.A. Actions Port. EO 2	FR0000120578	STK	1.858,00	EUR 98,2000	182.455,60	0,21
SAP SE Inhaber-Aktien o.N.	DE0007164600	STK	2.166,00	EUR 125,1400	271.053,24	0,31
Schaeffler AG Inhaber-Vorzugsakt.o.St. o.N.	DE000SHA0159	STK	10.479,00	EUR 5,6450	59.153,96	0,07
Schneider Electric SE Actions Port. EO 4	FR0000121972	STK	1.300,00	EUR 166,4600	216.398,00	0,25
Siemens AG Namens-Aktien o.N.	DE0007236101	STK	1.034,00	EUR 152,5400	157.726,36	0,18
Sodexo S.A. Actions Port. EO 4	FR0000121220	STK	470,00	EUR 100,8500	47.399,50	0,05
Solvay S.A. Actions au Porteur A o.N.	BE0003470755	STK	448,00	EUR 102,3000	45.830,40	0,05
Stellantis N.V. Aandelen op naam EO -,01	NL00150001Q9	STK	10.116,00	EUR 16,0800	162.665,28	0,19
STMicroelectronics N.V. Aandelen aan toonder EO 1,04	NL0000226223	STK	2.055,00	EUR 45,5650	93.636,08	0,11
Telefónica S.A. Acciones Port. EO 1	ES0178430E18	STK	8.000,00	EUR 3,7160	29.728,00	0,03
TotalEnergies SE Actions au Porteur EO 2,50	FR0000120271	STK	4.013,00	EUR 52,5500	210.883,15	0,24
UniCredit S.p.A. Azioni nom. o.N.	IT0005239360	STK	3.639,00	EUR 21,2650	77.383,34	0,09
UPM Kymmene Corp. Registered Shares o.N.	FI0009005987	STK	2.322,00	EUR 27,2700	63.320,94	0,07
Veolia Environnement S.A. Actions au Porteur EO 5	FR0000124141	STK	1.816,00	EUR 28,9500	52.573,20	0,06
Vitesco Technologies Group AG Namens-Aktien o.N.	DE000VTSC017	STK	116,00	EUR 75,4500	8.752,20	0,01
Wacker Chemie AG Inhaber-Aktien o.N.	DE000WCH8881	STK	207,00	EUR 125,7500	26.030,25	0,03
Wolters Kluwer N.V. Aandelen op naam EO -,12	NL0000395903	STK	1.180,00	EUR 116,3000	137.234,00	0,16
Anglo American PLC Registered Shares DL -,54945	GB00B1XZS820	STK	1.500,00	GBP 22,3300	39.031,64	0,04
Ashtead Group PLC Registered Shares LS -,10	GB0000536739	STK	1.174,00	GBP 54,4400	74.477,14	0,09
Associated British Foods PLC Registered Shares LS -,0568	GB0006731235	STK	2.500,00	GBP 19,9100	58.002,68	0,07
AstraZeneca PLC Registered Shares DL -,25	GB0009895292	STK	3.066,00	GBP 112,7600	402.869,15	0,46
BAE Systems PLC Registered Shares LS -,025	GB0002634946	STK	8.500,00	GBP 9,2700	91.819,61	0,11
Balfour Beatty PLC Registered Shares LS -,50	GB0000961622	STK	15.000,00	GBP 3,4080	59.570,01	0,07
Beazley PLC Registered Shares LS -,05	GB00BYQ0JC66	STK	9.000,00	GBP 5,8900	61.772,42	0,07
BP PLC Registered Shares DL -,25	GB0007980591	STK	27.560,00	GBP 4,5835	147.201,84	0,17
British American Tobacco PLC Registered Shares LS -,25	GB0002875804	STK	3.075,00	GBP 26,0800	93.452,19	0,11
Bunzl PLC Registered Shares LS -,3214857	GB00B0744B38	STK	3.000,00	GBP 29,9900	104.841,81	0,12
Burberry Group PLC Registered Shares LS -,0005	GB0031743007	STK	1.691,00	GBP 21,2000	41.774,98	0,05
Centrica PLC Reg. Shares LS -,061728395	GB00B033F229	STK	50.000,00	GBP 1,2395	72.219,31	0,08
Compass Group PLC Registered Shares LS -,1105	GB00BD6K4575	STK	3.937,00	GBP 22,0200	101.022,83	0,12

Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

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

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg in 1.000	Bestand	Kurs zum 30.06.2023	Kurswert in EUR	in % des Netto- Teilfonds- vermögens
CRH PLC Registered Shares EO -,32	IE0001827041	STK	1.500,00	GBP 43,4600	75.965,74	0,09
Grafton Group PLC Registered Shares EO -,05	IE00B00MZ448	STK	4.706,00	GBP 7,8170	42.867,57	0,05
GSK PLC Registered Shares LS-,3125	GB00BN7SWP63	STK	11.972,00	GBP 13,8880	193.750,67	0,22
Haleon PLC Reg.Shares LS 0,01	GB00BMX86B70	STK	14.965,00	GBP 3,2225	56.196,13	0,06
HSBC Holdings PLC Registered Shares DL -,50	GB0005405286	STK	47.183,00	GBP 6,2170	341.824,52	0,39
IG Group Holdings PLC Registered Shares LS 0,00005	GB00B06QFB75	STK	6.458,00	GBP 6,7700	50.947,57	0,06
Imperial Brands PLC Registered Shares LS -,10	GB0004544929	STK	1.900,00	GBP 17,3850	38.491,52	0,04
Investec PLC Registered Shares LS -,0002	GB00B17BBQ50	STK	9.434,00	GBP 4,4080	48.458,98	0,06
Man Group PLC Reg. SharesDL-,0342857142	JE00BJ1DLW90	STK	20.260,00	GBP 2,1850	51.585,50	0,06
National Grid PLC Reg. Shares LS -,12431289	GB00BDR05C01	STK	6.315,00	GBP 10,4050	76.568,87	0,09
NatWest Group PLC Registered Shares LS 1,0769	GB00BM8PJY71	STK	30.167,00	GBP 2,4080	84.649,70	0,10
NEXT PLC Registered Shares LS 0,10	GB0032089863	STK	750,00	GBP 69,0000	60.304,14	0,07
Rio Tinto PLC Registered Shares LS -,10	GB0007188757	STK	1.682,00	GBP 49,8550	97.717,31	0,11
Serco Group PLC Registered Shares LS -,02	GB0007973794	STK	17.925,00	GBP 1,5570	32.522,55	0,04
Shell PLC Reg. Shares Class EO -,07	GB00BP6MXD84	STK	7.500,00	GBP 23,4250	204.728,19	0,24
Tate & Lyle PLC Reg. Shares LS -,291666667	GB00BP92CJ43	STK	9.573,00	GBP 7,2600	80.988,15	0,09
Tesco PLC Registered Shs LS-,0633333	GB00BLGZ9862	STK	37.834,00	GBP 2,4840	109.514,25	0,13
Unilever PLC Registered Shares LS -,031111	GB00B10RZP78	STK	6.216,00	GBP 40,9750	296.801,96	0,34
Vodafone Group PLC Registered Shares DL 0,2095238	GB00BH4HKS39	STK	53.277,00	GBP 0,7397	45.923,20	0,05
AIA Group Ltd Registerd Shares o.N.	HK0000069689	STK	34.000,00	HKD 79,1000	314.560,74	0,36
ASMPT Ltd. Registered Shares New HD-,10	KYG0535Q1331	STK	3.500,00	HKD 77,1500	31.582,98	0,04
Budweiser Brew. Co. Apac Ltd. Registered Shares DL-,00001	KYG1674K1013	STK	8.400,00	HKD 20,2000	19.846,31	0,02
PCCW Ltd. Reg. Cons. Shares o.N.	HK0008011667	STK	43.000,00	HKD 4,0600	20.419,43	0,02
Sino Land Co. Ltd. Registered Shares o.N.	HK0083000502	STK	56.000,00	HKD 9,6300	63.075,90	0,07
SITC International Hldg.Co.Ltd Registered Shs REG S HD -,10	KYG8187G1055	STK	16.000,00	HKD 14,3000	26.761,17	0,03
Sun Hung Kai Properties Ltd. Registered Shares o.N.	HK0016000132	STK	5.500,00	HKD 98,7000	63.493,46	0,07
Advantest Corp. Registered Shares o.N.	JP3122400009	STK	1.400,00	JPY 19.150,0000	170.019,60	0,20
AMADA Co. Ltd. Registered Shares o.N.	JP3122800000	STK	8.300,00	JPY 1.413,0000	74.374,22	0,09
Asahi Kasei Corp. Registered Shares o.N.	JP3111200006	STK	8.700,00	JPY 972,0000	53.627,52	0,06
Astellas Pharma Inc. Registered Shares o.N.	JP3942400007	STK	7.200,00	JPY 2.149,0000	98.123,06	0,11
Bridgestone Corp. Registered Shares o.N.	JP3830800003	STK	2.500,00	JPY 5.892,0000	93.412,49	0,11
Canon Inc. Registered Shares o.N.	JP3242800005	STK	3.000,00	JPY 3.790,0000	72.104,55	0,08
Capcom Co. Ltd. Registered Shares o.N.	JP3218900003	STK	2.600,00	JPY 5.695,0000	93.900,79	0,11
Chugai Pharmaceutical Co. Ltd. Registered Shares o.N.	JP3519400000	STK	3.000,00	JPY 4.086,0000	77.735,93	0,09
Daiichi Sankyo Co. Ltd. Registered Shares o.N.	JP3475350009	STK	4.500,00	JPY 4.550,0000	129.845,26	0,15
Daito Trust Constr. Co. Ltd. Registered Shares o.N.	JP3486800000	STK	900,00	JPY 14.585,0000	83.243,65	0,10
Daiwa House Industry Co. Ltd. Registered Shares o.N.	JP3505000004	STK	2.400,00	JPY 3.792,0000	57.714,08	0,07
Daiwa Securities Group Inc. Registered Shares o.N.	JP3502200003	STK	28.800,00	JPY 740,3000	135.208,01	0,16
DMG Mori Co. Ltd. Registered Shares o.N.	JP3924800000	STK	4.100,00	JPY 2.488,0000	64.689,89	0,07
Haseko Corp. Registered Shares o.N.	JP3768600003	STK	5.100,00	JPY 1.773,0000	57.343,09	0,07
Hazama Ando Corp. Registered Shares o.N.	JP3767810009	STK	9.500,00	JPY 1.075,0000	64.764,09	0,07
Hoya Corp. Registered Shares o.N.	JP3837800006	STK	800,00	JPY 17.075,0000	86.626,92	0,10
Hulic Co. Ltd. Registered Shares o.N.	JP3360800001	STK	11.100,00	JPY 1.231,0000	86.652,92	0,10
Internet Initiative Japan Inc. Registered Shares o.N.	JP3152820001	STK	2.000,00	JPY 2.700,5000	34.251,24	0,04
Isuzu Motors Ltd. Registered Shares o.N.	JP3137200006	STK	4.500,00	JPY 1.740,0000	49.655,11	0,06
Japan Exchange Group Inc. Registered Shares o.N.	JP3183200009	STK	4.000,00	JPY 2.508,0000	63.619,42	0,07
Japan Tobacco Inc. Registered Shares o.N.	JP3726800000	STK	6.300,00	JPY 3.153,0000	125.969,88	0,14
Kajima Corp. Registered Shares o.N.	JP3210200006	STK	6.000,00	JPY 2.170,0000	82.568,27	0,09
Keyence Corp. Registered Shares o.N.	JP3236200006	STK	400,00	JPY 67.850,0000	172.112,35	0,20
Komatsu Ltd. Registered Shares o.N.	JP3304200003	STK	5.500,00	JPY 3.881,0000	135.365,66	0,16
Marubeni Corp. Registered Shares o.N.	JP3877600001	STK	9.000,00	JPY 2.440,0000	139.262,61	0,16
Meitec Corp. Registered Shares o.N.	JP3919200000	STK	3.300,00	JPY 2.474,0000	51.774,49	0,06
Mitsubishi Corp. Registered Shares o.N.	JP3898400001	STK	3.200,00	JPY 6.930,0000	140.632,40	0,16
Mitsubishi Electric Corp. Registered Shares o.N.	JP3902400005	STK	9.000,00	JPY 2.027,0000	115.690,70	0,13
Mitsubishi HC Capital Inc. Registered Shares o.N.	JP3499800005	STK	20.700,00	JPY 854,5000	112.172,03	0,13
Mitsubishi UFJ Finl Grp Inc. Registered Shares o.N.	JP3902900004	STK	38.000,00	JPY 1.065,0000	256.646,52	0,29
Mitsui & Co. Ltd. Registered Shares o.N.	JP3893600001	STK	3.200,00	JPY 5.411,0000	109.806,92	0,13
Mizuho Financial Group Inc. Registered Shares o.N.	JP3885780001	STK	7.650,00	JPY 2.199,0000	106.681,43	0,12

Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

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

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg in 1.000	Bestand	Kurs zum 30.06.2023	Kurswert in EUR	in % des Netto- Teilfonds- vermögens
Nintendo Co. Ltd. Registered Shares o.N.	JP3756600007	STK	2.000,00	JPY 6.542,0000	82.974,13	0,10
Nippon Tel. and Tel. Corp. Registered Shares o.N.	JP3735400008	STK	75.000,00	JPY 170,5000	81.093,83	0,09
Otsuka Corp. Registered Shares o.N.	JP3188200004	STK	2.700,00	JPY 5.587,0000	95.663,14	0,11
Panasonic Holdings Corp. Registered Shares o.N.	JP3866800000	STK	9.900,00	JPY 1.753,5000	110.088,80	0,13
Recruit Holdings Co. Ltd. Registered Shares o.N.	JP3970300004	STK	2.600,00	JPY 4.563,0000	75.236,05	0,09
Seiko Epson Corp. Registered Shares o.N.	JP3414750004	STK	4.000,00	JPY 2.239,0000	56.795,81	0,07
Sekisui House Ltd. Registered Shares o.N.	JP3420600003	STK	6.400,00	JPY 2.905,5000	117.924,23	0,14
Shin-Etsu Chemical Co. Ltd. Registered Shares o.N.	JP3371200001	STK	4.000,00	JPY 4.768,0000	120.947,92	0,14
SoftBank Corp. Registered Shares o.N.	JP3732000009	STK	16.600,00	JPY 1.540,0000	162.117,91	0,19
Sony Group Corp. Registered Shares o.N.	JP3435000009	STK	2.200,00	JPY 12.965,0000	180.882,85	0,21
Sumitomo Chemical Co. Ltd. Registered Shares o.N.	JP3401400001	STK	20.000,00	JPY 436,5000	55.362,59	0,06
Sumitomo Corp. Registered Shares o.N.	JP3404600003	STK	3.600,00	JPY 3.041,0000	69.425,83	0,08
Tokyo Electron Ltd. Registered Shares o.N.	JP3571400005	STK	1.500,00	JPY 20.560,0000	195.576,45	0,22
Topcon Corp. Registered Shares o.N.	JP3630400004	STK	2.000,00	JPY 2.108,0000	26.736,39	0,03
Toyota Motor Corp. Registered Shares o.N.	JP3633400001	STK	18.500,00	JPY 2.308,5000	270.834,38	0,31
Yamada Holdings Co. Ltd. Registered Shares o.N.	JP3939000000	STK	20.000,00	JPY 424,4000	53.827,91	0,06
Yamaha Motor Co. Ltd. Registered Shares o.N.	JP3942800008	STK	4.200,00	JPY 4.122,0000	109.789,16	0,13
Yamaichi Electronics Co. Ltd. Registered Shares o.N.	JP3934200001	STK	6.000,00	JPY 2.366,0000	90.026,05	0,10
Equinor ASA Navne-Aksjer NK 2,50	NO0010096985	STK	4.913,00	NOK 312,1000	131.184,27	0,15
Addtech AB Namn-Aktier B SK -,1875	SE0014781795	STK	2.996,00	SEK 234,8000	59.695,00	0,07
Assa-Abloy AB Namn-Aktier B SK -,33	SE0007100581	STK	2.400,00	SEK 259,0000	52.748,37	0,06
Atlas Copco AB Namn-Aktier A SK-,052125	SE0017486889	STK	12.092,00	SEK 155,4000	159.458,33	0,18
Beijer Ref AB Namn-Aktier B O.N.	SE0015949748	STK	2.601,00	SEK 137,6000	30.370,84	0,03
Epiroc AB Namn-Aktier A o.N.	SE0015658109	STK	3.329,00	SEK 203,9000	57.600,87	0,07
Evolution AB (publ) Namn-Aktier SK-,003	SE0012673267	STK	452,00	SEK 1.365,8000	52.387,01	0,06
Indutrade AB Aktier SK 1	SE0001515552	STK	1.800,00	SEK 242,9000	37.102,06	0,04
Lagercrantz Group AB Namn-Aktier Ser.B o.N.	SE0014990966	STK	3.625,00	SEK 139,0000	42.758,34	0,05
Lifco AB Namn-Aktier B o.N.	SE0015949201	STK	3.199,00	SEK 234,3000	63.604,02	0,07
NIBE Industrier AB Namn-Aktier B o.N.	SE0015988019	STK	5.586,00	SEK 102,4000	48.539,91	0,06
Saab AB Namn-Aktier B SK 25	SE0000112385	STK	1.200,00	SEK 583,2000	59.387,74	0,07
Skandinaviska Enskilda Banken Namn-Aktier A (fria) SK 10	SE0000148884	STK	6.852,00	SEK 119,1500	69.280,25	0,08
Swedbank AB Namn-Aktier A o.N.	SE0000242455	STK	2.800,00	SEK 181,8500	43.208,52	0,05
Abbott Laboratories Registered Shares o.N.	US0028241000	STK	2.000,00	USD 109,0200	199.853,35	0,23
AbbVie Inc. Registered Shares DL -,01	US00287Y1091	STK	1.900,00	USD 134,7300	234.635,20	0,27
Accenture PLC Reg.Shares Class A DL-,0000225	IE00B4BNMY34	STK	1.100,00	USD 308,5800	311.125,57	0,36
Advanced Micro Devices Inc. Registered Shares DL -,01	US0079031078	STK	3.100,00	USD 113,9100	323.667,28	0,37
AFLAC Inc. Registered Shares DL -,10	US0010551028	STK	5.100,00	USD 69,8000	326.287,81	0,37
Agilent Technologies Inc. Registered Shares DL -,01	US00846U1016	STK	1.700,00	USD 120,2500	187.373,97	0,22
Airbnb Inc. Registered Shares DL -,01	US0090661010	STK	2.400,00	USD 128,1600	281.928,51	0,32
Align Technology Inc. Registered Shares DL -,0001	US0162551016	STK	1.000,00	USD 353,6400	324.142,99	0,37
Ally Financial Inc. Registered Shares DL -,10	US02005N1000	STK	10.000,00	USD 27,0100	247.571,04	0,28
Alphabet Inc. Reg. Shs Cap.Stk Cl. C DL-,001	US02079K1079	STK	4.940,00	USD 120,9700	547.746,84	0,63
Alphabet Inc. Reg. Shs Cl. A DL-,001	US02079K3059	STK	9.000,00	USD 119,7000	987.442,71	1,13
Altria Group Inc. Registered Shares DL -,333	US02209S1033	STK	6.700,00	USD 45,3000	278.194,32	0,32
Amazon.com Inc. Registered Shares DL -,01	US0231351067	STK	7.500,00	USD 130,3600	896.150,32	1,03
Amdocs Ltd. Registered Shares LS -,01	GB0022569080	STK	5.378,00	USD 98,8500	487.273,42	0,56
American Electric Power Co.Inc Registered Shares DL 6,50	US0255371017	STK	1.900,00	USD 84,2000	146.636,11	0,17
American Express Co. Registered Shares DL -,20	US0258161092	STK	2.500,00	USD 174,2000	399.175,07	0,46
AmerisourceBergen Corp. Registered Shares DL -,01	US03073E1055	STK	1.500,00	USD 192,4300	264.569,20	0,30
AMETEK Inc. Registered Shares DL -,01	US0311001004	STK	1.100,00	USD 161,8800	163.215,40	0,19
Amgen Inc. Registered Shares DL -,0001	US0311621009	STK	1.660,00	USD 222,0200	337.812,28	0,39
Apple Inc. Registered Shares o.N.	US0378331005	STK	25.500,00	USD 193,9700	4.533.670,94	5,21
Applied Materials Inc. Registered Shares o.N.	US0382221051	STK	2.800,00	USD 144,5400	370.955,09	0,43
AT & T Inc. Registered Shares DL 1	US00206R1023	STK	19.904,00	USD 15,9500	290.988,82	0,33
Automatic Data Processing Inc. Registered Shares DL -,10	US0530151036	STK	600,00	USD 219,7900	120.874,43	0,14
AutoZone Inc. Registered Shares DL -,01	US0533321024	STK	130,00	USD 2.493,3600	297.100,64	0,34
Axon Enterprise Inc. Registered Shares DL -,00001	US05464C1018	STK	700,00	USD 195,1200	125.191,57	0,14
Bank of America Corp. Registered Shares DL 0,01	US0605051046	STK	12.700,00	USD 28,6900	333.971,59	0,38

Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

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

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg in 1.000	Bestand	Kurs zum 30.06.2023	Kurswert in EUR	in % des Netto- Teilfonds- vermögens
Becton, Dickinson & Co. Registered Shares DL 1	US0758871091	STK	900,00	USD 264,0100	217.790,10	0,25
Berkshire Hathaway Inc. Reg. Shares B New DL -,00333	US0846707026	STK	2.217,00	USD 341,0000	692.939,51	0,80
Best Buy Co. Inc. Registered Shares DL -,10	US0865161014	STK	3.000,00	USD 81,9500	225.343,72	0,26
Bristol-Myers Squibb Co. Registered Shares DL -,10	US1101221083	STK	4.200,00	USD 63,9500	246.186,98	0,28
Broadcom Inc. Registered Shares DL -,001	US11135F1012	STK	1.000,00	USD 867,4300	795.077,91	0,91
Cadence Design Systems Inc. Registered Shares DL 0,01	US1273871087	STK	2.000,00	USD 234,5200	429.917,51	0,49
Capital One Financial Corp. Registered Shares DL -,01	US14040H1059	STK	2.600,00	USD 109,3700	260.643,45	0,30
Caterpillar Inc. Registered Shares DL 1	US1491231015	STK	1.400,00	USD 246,0500	315.737,86	0,36
CBRE Group Inc. Reg. Shares Class A DL -,01	US12504L1098	STK	3.400,00	USD 80,7100	251.525,21	0,29
CDW Corp. Registered Shares DL -,01	US12514G1085	STK	900,00	USD 183,5000	151.374,89	0,17
Chevron Corp. Registered Shares DL-,75	US1667641005	STK	3.500,00	USD 157,3500	504.789,18	0,58
Chubb Ltd. Registered Shares SF 24,15	CH0044328745	STK	200,00	USD 192,5600	35.299,73	0,04
Cigna Group, The Registered Shares DL 1	US1255231003	STK	1.000,00	USD 280,6000	257.195,23	0,30
Cintas Corp. Registered Shares o.N.	US1729081059	STK	300,00	USD 497,0800	136.685,61	0,16
Cisco Systems Inc. Registered Shares DL-,001	US17275R1023	STK	10.000,00	USD 51,7400	474.243,81	0,54
Citigroup Inc. Registered Shares DL -,01	US1729674242	STK	6.700,00	USD 46,0400	282.738,77	0,32
Citizens Financial Group Inc. Registered Shares DL -,01	US1746101054	STK	7.800,00	USD 26,0800	186.456,46	0,21
CME Group Inc. Registered Shares DL-,01	US12572Q1058	STK	1.100,00	USD 185,2900	186.818,52	0,21
Coca-Cola Co., The Registered Shares DL -,25	US1912161007	STK	8.311,00	USD 60,2200	458.742,82	0,53
Comcast Corp. Reg. Shares Class A DL -,01	US20030N1019	STK	9.800,00	USD 41,5500	373.226,40	0,43
Consolidated Edison Inc. Registered Shares DL -,01	US2091151041	STK	2.100,00	USD 90,4000	174.005,50	0,20
Corteva Inc. Registered Shares DL -,01	US22052L1044	STK	3.000,00	USD 57,3000	157.561,87	0,18
Costco Wholesale Corp. Registered Shares DL -,005	US22160K1051	STK	1.100,00	USD 538,3800	542.821,26	0,62
Crocs Inc. Registered Shares DL-,001	US2270461096	STK	1.700,00	USD 112,4400	175.204,40	0,20
CVS Health Corp. Registered Shares DL-,01	US1266501006	STK	4.100,00	USD 69,1300	259.791,93	0,30
D.R. Horton Inc. Registered Shares DL -,01	US23331A1097	STK	3.000,00	USD 121,6900	334.619,62	0,38
Dentsply Sirona Inc. Registered Shares DL -,01	US24906P1093	STK	3.200,00	USD 40,0200	117.382,22	0,13
Dick's Sporting Goods Inc. Registered Shares DL -,01	US2533931026	STK	1.600,00	USD 132,1900	193.862,51	0,22
Discover Financial Services Registered Shares DL -,01	US2547091080	STK	2.000,00	USD 116,8500	214.207,15	0,25
Dollar General Corp. (New) Registered Shares DL -,875	US2566771059	STK	700,00	USD 169,7800	108.933,09	0,13
Dollar Tree Inc. Registered Shares DL -,01	US2567461080	STK	900,00	USD 143,5000	118.377,64	0,14
Dow Inc. Reg. Shares DL -,01	US2605571031	STK	3.000,00	USD 53,2600	146.452,80	0,17
Dynatrace Inc. Registered Shares DL-,001	US2681501092	STK	3.600,00	USD 51,4700	169.836,85	0,20
Edwards Lifesciences Corp. Registered Shares DL 1	US28176E1082	STK	2.500,00	USD 94,3300	216.154,90	0,25
Elevance Health Inc. Registered Shares DL -,01	US0367521038	STK	600,00	USD 444,2900	244.339,14	0,28
Eli Lilly and Company Registered Shares o.N.	US5324571083	STK	1.900,00	USD 468,9800	816.738,77	0,94
Emerson Electric Co. Registered Shares DL -,50	US2910111044	STK	3.158,00	USD 90,3900	261.642,18	0,30
EOG Resources Inc. Registered Shares DL -,01	US26875P1012	STK	1.700,00	USD 114,4400	178.320,81	0,20
Exxon Mobil Corp. Registered Shares o.N.	US30231G1022	STK	6.900,00	USD 107,2500	678.299,73	0,78
FactSet Research Systems Inc. Registered Shares DL -,01	US3030751057	STK	400,00	USD 400,6500	146.892,76	0,17
Fastenal Co. Registered Shares DL -,01	US3119001044	STK	4.000,00	USD 58,9900	216.278,64	0,25
Fedex Corp. Registered Shares DL -,10	US31428X1063	STK	600,00	USD 247,9000	136.333,64	0,16
Fifth Third Bancorp Registered Shares o.N.	US3167731005	STK	6.000,00	USD 26,2100	144.142,99	0,17
First Horizon Corp. Registered Shares DL -,625	US3205171057	STK	6.000,00	USD 11,2700	61.979,84	0,07
Fortinet Inc. Registered Shares DL -,001	US34959E1091	STK	2.700,00	USD 75,5900	187.069,66	0,21
Fox Corp. Registered Shares A DL -,01	US35137L1052	STK	5.300,00	USD 34,0000	165.169,57	0,19
Gartner Inc. Reg. Shares DL -,0005	US3666511072	STK	600,00	USD 350,3100	192.654,45	0,22
General Electric Co. Registered Shares DL -,06	US3696043013	STK	1.300,00	USD 109,8500	130.893,68	0,15
Gilead Sciences Inc. Registered Shares DL -,001	US3755581036	STK	3.600,00	USD 77,0700	254.309,81	0,29
Graphic Packaging Holding Co. Registered Shares DL -,01	US3886891015	STK	5.200,00	USD 24,0300	114.533,46	0,13
Hologic Inc. Registered Shares DL -,01	US4364401012	STK	2.300,00	USD 80,9700	170.697,53	0,20
Home Depot Inc., The Registered Shares DL -,05	US4370761029	STK	3.200,00	USD 310,6400	911.134,74	1,05
Honeywell International Inc. Registered Shares DL 1	US4385161066	STK	2.000,00	USD 207,5000	380.384,97	0,44
Horizon Therapeutics PLC Registered Shares DL -,01	IE00BQPQVQ261	STK	600,00	USD 102,8500	56.562,79	0,06
HP Inc. Registered Shares DL -,01	US40434L1052	STK	9.800,00	USD 30,7100	275.855,18	0,32
HubSpot Inc. Registered Shares DL -,001	US4435731009	STK	700,00	USD 532,0900	341.395,97	0,39
Huntington Bancshares Inc. Registered Shares DL-,01	US4461501045	STK	16.900,00	USD 10,7800	166.986,25	0,19
Interpublic Group of Comp.Inc. Registered Shares DL -,10	US4606901001	STK	6.000,00	USD 38,5800	212.172,32	0,24

Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

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

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg in 1.000	Bestand	Kurs zum 30.06.2023	Kurswert in EUR	in % des Netto- Teilfonds- vermögens
Intl Business Machines Corp. Registered Shares DL -,20	US4592001014	STK	2.800,00	USD 133,8100	343.417,05	0,39
Intuit Inc. Registered Shares DL -,01	US4612021034	STK	1.200,00	USD 458,1900	503.967,00	0,58
Intuitive Surgical Inc. Registered Shares DL -,001	US46120E6023	STK	800,00	USD 341,9400	250.735,11	0,29
Johnson & Johnson Registered Shares DL 1	US4781601046	STK	4.156,00	USD 165,5200	630.523,48	0,72
Johnson Controls Internat. PLC Registered Shares DL -,01	IE00BY7QL619	STK	700,00	USD 68,1400	43.719,52	0,05
JPMorgan Chase & Co. Registered Shares DL 1	US46625H1005	STK	1.188,00	USD 145,4400	158.370,96	0,18
Keysight Technologies Inc. Registered Shares DL -,01	US49338L1035	STK	1.000,00	USD 167,4500	153.483,04	0,18
KLA Corp. Registered Shares DL 0,001	US4824801009	STK	500,00	USD 485,0200	222.282,31	0,26
Kroger Co., The Registered Shares DL 1	US5010441013	STK	4.300,00	USD 47,0000	185.242,90	0,21
Las Vegas Sands Corp. Registered Shares DL -,001	US5178341070	STK	2.200,00	USD 58,0000	116.956,92	0,13
Lattice Semiconductor Corp. Registered Shares DL -,01	US5184151042	STK	2.700,00	USD 96,0700	237.753,44	0,27
Lennox International Inc. Registered Shares DL -,01	US5261071071	STK	600,00	USD 326,0700	179.323,56	0,21
Lincoln Electric Holdings Inc. Registered Shares o.N.	US5339001068	STK	1.000,00	USD 198,6300	182.062,33	0,21
Linde plc Registered Shares EO -,001	IE000S9YS762	STK	430,00	USD 381,0800	150.196,52	0,17
Lowe's Companies Inc. Registered Shares DL -,50	US5486611073	STK	2.600,00	USD 225,7000	537.873,51	0,62
Lululemon Athletica Inc. Registered Shares o.N.	US5500211090	STK	600,00	USD 378,5000	208.157,65	0,24
Lyondellbasell Industries NV Registered Shares A EO -,04	NL0009434992	STK	600,00	USD 91,8300	50.502,29	0,06
Marathon Petroleum Corp. Registered Shares DL -,01	US56585A1025	STK	3.100,00	USD 116,6000	331.310,72	0,38
Marsh & McLennan Cos. Inc. Registered Shares DL 1	US5717481023	STK	1.426,00	USD 188,0800	245.831,42	0,28
Mastercard Inc. Registered Shares A DL -,0001	US57636Q1040	STK	1.000,00	USD 393,3000	360.494,96	0,41
McDonald's Corp. Registered Shares DL-,01	US5801351017	STK	1.600,00	USD 298,4100	437.631,53	0,50
McKesson Corp. Registered Shares DL -,01	US58155Q1031	STK	800,00	USD 427,3100	313.334,56	0,36
Medtronic PLC Registered Shares DL -,0001	IE00BTN1Y115	STK	1.600,00	USD 88,1000	129.202,57	0,15
Merck & Co. Inc. Registered Shares DL-,01	US58933Y1055	STK	5.300,00	USD 115,3900	560.556,37	0,64
MetLife Inc. Registered Shares DL -,01	US59156R1086	STK	4.600,00	USD 56,5300	238.348,30	0,27
Microsoft Corp. Registered Shares DL-,00000625	US5949181045	STK	17.934,00	USD 340,5400	5.597.840,84	6,43
Mondelez International Inc. Registered Shares Class A o.N.	US6092071058	STK	2.500,00	USD 72,9400	167.140,24	0,19
Monolithic Power Systems Inc. Registered Shares DL -,001	US6098391054	STK	500,00	USD 540,2300	247.584,78	0,28
Morgan Stanley Registered Shares DL -,01	US6174464486	STK	3.800,00	USD 85,4000	297.451,88	0,34
Nextera Energy Inc. Registered Shares DL -,01	US65339F1012	STK	6.300,00	USD 74,2000	428.469,29	0,49
NIKE Inc. Registered Shares Class B o.N.	US6541061031	STK	3.000,00	USD 110,3700	303.492,21	0,35
Nucor Corp. Registered Shares DL -,40	US6703461052	STK	1.100,00	USD 163,9800	165.332,72	0,19
NVIDIA Corp. Registered Shares DL-,001	US67066G1040	STK	6.500,00	USD 423,0200	2.520.284,14	2,90
NXP Semiconductors NV Aandelen aan toonder EO -,20	NL0009538784	STK	500,00	USD 204,6800	93.803,85	0,11
ON Semiconductor Corp. Registered Shares DL -,01	US6821891057	STK	2.900,00	USD 94,5800	251.404,22	0,29
Oracle Corp. Registered Shares DL -,01	US68389X1054	STK	3.700,00	USD 119,0900	403.879,93	0,46
Palo Alto Networks Inc. Registered Shares DL -,0001	US6974351057	STK	1.500,00	USD 255,5100	351.296,98	0,40
Paychex Inc. Registered Shares DL -,01	US7043261079	STK	2.900,00	USD 111,8700	297.362,97	0,34
PepsiCo Inc. Registered Shares DL -,0166	US7134481081	STK	2.765,00	USD 185,2200	469.416,41	0,54
Pfizer Inc. Registered Shares DL -,05	US7170811035	STK	10.389,00	USD 36,6800	349.283,70	0,40
Pinterest Inc. Registered Shares DL-,00001	US72352L1061	STK	7.200,00	USD 27,3400	180.428,96	0,21
Pioneer Natural Resources Co. Registered Shares DL -,01	US7237871071	STK	800,00	USD 207,1800	151.919,34	0,17
Procter & Gamble Co., The Registered Shares o.N.	US7427181091	STK	2.689,00	USD 151,7400	373.995,29	0,43
Public Service Ent. Group Inc. Registered Shares o.N.	US7445731067	STK	2.100,00	USD 62,6100	120.514,21	0,14
Pulte Group Inc. Registered Shares DL -,01	US7458671010	STK	4.000,00	USD 77,6800	284.802,93	0,33
QUALCOMM Inc. Registered Shares DL -,0001	US7475251036	STK	3.500,00	USD 119,0400	381.888,18	0,44
Raytheon Technologies Corp. Registered Shares DL -,01	US75513E1010	STK	2.200,00	USD 97,9600	197.536,21	0,23
Regeneron Pharmaceuticals Inc. Registered Shares DL -,001	US75886F1075	STK	200,00	USD 718,5400	131.721,36	0,15
Regions Financial Corp. Registered Shares DL -,01	US7591EP1005	STK	9.100,00	USD 17,8200	148.636,11	0,17
Republic Services Inc. Registered Shares DL -,01	US7607591002	STK	1.400,00	USD 153,1700	196.551,79	0,23
Roper Technologies Inc. Registered Shares DL -,01	US7766961061	STK	400,00	USD 480,8000	176.278,64	0,20
S&P Global Inc. Registered Shares DL 1	US78409V1044	STK	1.000,00	USD 400,8900	367.451,88	0,42
Seagate Technolog.Holdings PLC Registered Shares DL -,00001	IE00BKVD2N49	STK	596,00	USD 61,8700	33.798,83	0,04
Sempra Registered Shares o.N.	US8168511090	STK	1.200,00	USD 145,5900	160.135,66	0,18
Sherwin-Williams Co. Registered Shares DL 1	US8243481061	STK	600,00	USD 265,5200	146.023,83	0,17
Smartsheet Inc. Reg. Sh. Class A DL-,0001	US83200N1037	STK	3.400,00	USD 38,2600	119.233,73	0,14
Southern Co., The Registered Shares DL 5	US8425871071	STK	1.900,00	USD 70,2500	122.341,89	0,14
Stryker Corp. Registered Shares DL -,10	US8636671013	STK	800,00	USD 305,0900	223.714,02	0,26

Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

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

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg in 1.000	Bestand	Kurs zum 30.06.2023	Kurswert in EUR	in % des Netto- Teilfonds- vermögens	
Synchrony Financial Registered Shares DL -,001	US87165B1035	STK	7.500,00	USD	33,9200	233.180,57	0,27
Synopsys Inc. Registered Shares DL -,01	US8716071076	STK	800,00	USD	435,4100	319.274,06	0,37
T-Mobile US Inc. Registered Shares DL-,00001	US8725901040	STK	2.600,00	USD	138,9000	331.017,42	0,38
Texas Instruments Inc. Registered Shares DL 1	US8825081040	STK	2.098,00	USD	180,0200	346.179,62	0,40
Thermo Fisher Scientific Inc. Registered Shares DL 1	US8835561023	STK	869,00	USD	521,7500	415.582,72	0,48
TJX Companies Inc. Registered Shares DL 1	US8725401090	STK	3.700,00	USD	84,7900	287.555,45	0,33
Tractor Supply Co. Registered Shares DL -,008	US8923561067	STK	800,00	USD	221,1000	162.126,49	0,19
Trane Technologies PLC Registered Shares DL 1	IE00BK9ZQ967	STK	800,00	USD	191,2600	140.245,65	0,16
U.S. Bancorp Registered Shares DL -,01	US9029733048	STK	6.300,00	USD	33,0400	190.790,10	0,22
Ulta Beauty Inc. Registered Shares DL -,01	US90384S3031	STK	450,00	USD	470,5950	194.104,26	0,22
Union Pacific Corp. Registered Shares DL 2,50	US9078181081	STK	1.100,00	USD	204,6200	206.307,97	0,24
United Parcel Service Inc. Reg. Shares Class B DL -,01	US9113121068	STK	1.500,00	USD	179,2500	246.448,21	0,28
UnitedHealth Group Inc. Registered Shares DL -,01	US91324P1021	STK	1.000,00	USD	480,6400	440.549,95	0,51
Vertex Pharmaceuticals Inc. Registered Shares DL -,01	US92532F1003	STK	600,00	USD	351,9100	193.534,37	0,22
VISA Inc. Reg. Shares Class A DL -,0001	US92826C8394	STK	2.000,00	USD	237,4800	435.343,72	0,50
Walgreens Boots Alliance Inc. Reg. Shares DL -,01	US9314271084	STK	4.300,00	USD	28,4900	112.288,73	0,13
Warner Bros. Discovery Inc. Reg. Shares Series A DL-,01	US9344231041	STK	10.215,00	USD	12,5400	117.411,64	0,13
Waste Management Inc. Registered Shares DL -,01	US94106L1098	STK	1.600,00	USD	173,4200	254.328,14	0,29
West Pharmaceutic.Services Inc Registered Shares DL -,25	US9553061055	STK	800,00	USD	382,4700	280.454,63	0,32
Whirlpool Corp. Registered Shares DL 1	US9633201069	STK	1.300,00	USD	148,7900	177.293,31	0,20
Williams Cos.Inc., The Registered Shares DL 1	US9694571004	STK	10.100,00	USD	32,6300	302.074,24	0,35
Workday Inc. Registered Shares A DL -,001	US98138H1014	STK	1.700,00	USD	225,8900	351.982,58	0,40
Xcel Energy Inc. Registered Shares DL 2,50	US98389B1008	STK	2.400,00	USD	62,1700	136.762,60	0,16
Zoetis Inc. Registered Shares Cl.A DL -,01	US98978V1035	STK	1.800,00	USD	172,2100	284.122,82	0,33
<b>Genussscheine</b>							
Roche Holding AG Inhaber-Genussscheine o.N.	CH0012032048	STK	890,00	CHF	273,5000	249.387,84	0,29
<b>REITs</b>							
Stockland Reg. Stapled Secs o.N.	AU000000SGP0	STK	19.923,00	AUD	4,0300	48.987,00	0,06
Unibail-Rodamco-Westfield SE Stapled Shares EO-,05	FR0013326246	STK	542,00	EUR	48,1500	26.097,30	0,03
ProLogis Inc. Registered Shares DL -,01	US74340W1036	STK	2.300,00	USD	122,6300	258.523,37	0,30
Regency Centers Corp. Registered Shares DL -,01	US7588491032	STK	2.200,00	USD	61,7700	124.559,12	0,14
SBA Communications Corp. Reg. Shares Class A DL -,01	US78410G1040	STK	600,00	USD	231,7600	127.457,38	0,15
Vici Properties Inc. Registered Shares DL -,01	US9256521090	STK	8.000,00	USD	31,4300	230.467,46	0,26
<b>Summe Wertpapiervermögen</b>				<b>EUR</b>		<b>85.540.221,90</b>	<b>98,27</b>
<b>Derivate</b>							
<b>Aktienindex-Terminkontrakte</b>							
S&P 500 E-Mini Index Future 15.09.23		STK	5	USD	4.488,2500	16.406,97	0,02
<b>Devisenterminkontrakte Kauf</b>							
<b>offen (Kontrahent Verwahrstelle)</b>							
Devisenterminkontrakt Kauf AUD / CHF 14.07.23		AUD	1.689	EUR		-32,32	0,00
Devisenterminkontrakt Kauf CAD / CHF 14.07.23		CAD	5.788	EUR		-23,97	0,00
Devisenterminkontrakt Kauf EUR / CAD 05.07.23		EUR	1.067	EUR		1,91	0,00
Devisenterminkontrakt Kauf EUR / CHF 14.07.23		EUR	460.350	EUR		-166,71	0,00
Devisenterminkontrakt Kauf EUR / USD 03.07.23		EUR	577	EUR		-0,23	0,00
Devisenterminkontrakt Kauf EUR / USD 05.07.23		EUR	332	EUR		-1,63	0,00
Devisenterminkontrakt Kauf GBP / CHF 14.07.23		GBP	3.206	EUR		-11,53	0,00
Devisenterminkontrakt Kauf JPY / CHF 14.07.23		JPY	887.257	EUR		-151,61	0,00
Devisenterminkontrakt Kauf SEK / CHF 14.07.23		SEK	4.230.911	EUR		-3.533,75	0,00
Devisenterminkontrakt Kauf USD / CHF 14.07.23		USD	70.496	EUR		-383,21	0,00
<b>Devisenterminkontrakte Verkauf</b>							
<b>offen (Kontrahent Verwahrstelle)</b>							
Devisenterminkontrakt Verkauf AUD / CHF 14.07.23		AUD	-1.205.292	EUR		21.252,80	0,02
Devisenterminkontrakt Verkauf CAD / CHF 14.07.23		CAD	-2.108.089	EUR		6.194,25	0,01
Devisenterminkontrakt Verkauf DKK / CHF 14.07.23		DKK	-2.868.064	EUR		-126,44	0,00
Devisenterminkontrakt Verkauf EUR / CHF 14.07.23		EUR	-4.268.624	EUR		1.809,43	0,00
Devisenterminkontrakt Verkauf GBP / CHF 14.07.23		GBP	-1.209.665	EUR		-2.110,91	0,00

Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

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

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg in 1.000	Bestand	Kurs zum 30.06.2023	Kurswert in EUR	in % des Netto- Teilfonds- vermögens
Devisenterminkontrakt Verkauf JPY / CHF 14.07.23		JPY	-322.060,867	EUR	107.700,48	0,12
Devisenterminkontrakt Verkauf SEK / CHF 14.07.23		SEK	-4.230,911	EUR	5.149,28	0,01
Devisenterminkontrakt Verkauf USD / CHF 14.07.23		USD	-25.211,006	EUR	328.024,62	0,38
<b>Summe Derivate</b>				<b>EUR</b>	<b>479.997,43</b>	<b>0,55</b>
<b>Bankguthaben</b>						
<b>Bankkonten</b>						
Bankkonto RBC Investor Services Bank S.A.		CAD	0,01	EUR	0,01	0,00
Bankkonto RBC Investor Services Bank S.A.		CHF	14,66	EUR	15,02	0,00
Bankkonto RBC Investor Services Bank S.A.		EUR	888.626,29	EUR	888.626,29	1,02
Bankkonto RBC Investor Services Bank S.A.		GBP	410,21	EUR	478,02	0,00
Bankkonto RBC Investor Services Bank S.A.		JPY	1.379.935,00	EUR	8.751,06	0,01
Bankkonto RBC Investor Services Bank S.A.		SEK	-0,05	EUR	0,00	0,00
Bankkonto RBC Investor Services Bank S.A.		USD	4.490,05	EUR	4.115,54	0,00
Bankkonto UBS Ltd London		EUR	42.773,36	EUR	42.773,36	0,05
Bankkonto UBS Ltd London		JPY	1.375.333,00	EUR	8.721,88	0,01
Bankkonto UBS Ltd London		USD	250.274,18	EUR	229.398,88	0,26
<b>Summe Bankguthaben</b>				<b>EUR</b>	<b>1.182.880,06</b>	<b>1,36</b>
<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>						
Dividendenforderungen		AUD	18.717,43	EUR	11.420,02	0,01
Dividendenforderungen		CAD	10.729,95	EUR	7.432,25	0,01
Dividendenforderungen		EUR	5.389,92	EUR	5.389,92	0,01
Dividendenforderungen		GBP	10.414,63	EUR	12.136,15	0,01
Dividendenforderungen		JPY	1.553.546,00	EUR	9.852,05	0,01
Dividendenforderungen		USD	33.382,22	EUR	30.597,81	0,04
Initial Margin UBS Ltd London		USD	56.000,00	EUR	51.329,06	0,06
<b>Summe Sonstige Vermögensgegenstände</b>				<b>EUR</b>	<b>128.157,26</b>	<b>0,15</b>
<b>Bankverbindlichkeiten</b>						
Bankverbindlichkeiten UBS Ltd London		GBP	-2.304,96	EUR	-2.685,96	0,00
Verbindlichkeiten aus Variation Margin		USD	-17.900,00	EUR	-16.406,97	-0,02
<b>Summe Bankverbindlichkeiten</b>				<b>EUR</b>	<b>-19.092,93</b>	<b>-0,02</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>						
Sonstige Verbindlichkeiten		CHF	-130.057,66	EUR	-133.248,96	-0,15
Sonstige Verbindlichkeiten		EUR	-134.013,29	EUR	-134.013,29	-0,15
<b>Summe Sonstige Verbindlichkeiten <sup>1)</sup></b>				<b>EUR</b>	<b>-267.262,25</b>	<b>-0,31</b>
<b>Netto-Teilfondsvermögen</b>				<b>EUR</b>	<b>87.044.901,47</b>	<b>100,00<sup>*)</sup></b>

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

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

Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

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

Nettoinventarwert pro Aktie des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Global Equity / Aktien Welt ESG A	EUR	28,82
Nettoinventarwert pro Aktie des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Global Equity / Aktien Welt ESG C	CHF	14,66
Nettoinventarwert pro Aktie des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Global Equity / Aktien Welt ESG B	EUR	21,91
Nettoinventarwert pro Aktie des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Global Equity / Aktien Welt ESG X	CHF	18,45
Umlaufende Aktien des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Global Equity / Aktien Welt ESG A	STK	711.340,820
Umlaufende Aktien des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Global Equity / Aktien Welt ESG C	STK	2.572.544,000
Umlaufende Aktien des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Global Equity / Aktien Welt ESG B	STK	1.151.272,922
Umlaufende Aktien des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Global Equity / Aktien Welt ESG X	STK	142.191,809
Anteil der Wertpapiere am Netto-Teilfondsvermögen	%	98,27
Anteil der Derivate am Netto-Teilfondsvermögen	%	0,55

### Verpflichtungen aus Derivaten

Devisentermingeschäfte Käufe	Währung	Nominal	Währung	Nominal	offene Positionen in EUR
Devisenterminkontrakt Kauf CAD / CHF 14.07.23	CAD	5.787,58	CHF	-3.932,41	4.004,94
Devisenterminkontrakt Kauf AUD / CHF 14.07.23	AUD	1.689,22	CHF	-1.036,67	1.029,79
Devisenterminkontrakt Kauf GBP / CHF 14.07.23	GBP	3.205,56	CHF	-3.653,35	3.731,48
Devisenterminkontrakt Kauf EUR / CAD 05.07.23	EUR	1.066,74	CAD	-1.537,50	1.066,88
Devisenterminkontrakt Kauf EUR / CHF 14.07.23	EUR	460.350,36	CHF	-449.223,90	460.080,10
Devisenterminkontrakt Kauf EUR / USD 03.07.23	EUR	577,11	USD	-630,00	577,22
Devisenterminkontrakt Kauf EUR / USD 05.07.23	EUR	331,93	USD	-364,00	332,01
Devisenterminkontrakt Kauf JPY / CHF 14.07.23	JPY	887.257,00	CHF	-5.642,97	5.629,82
Devisenterminkontrakt Kauf SEK / CHF 14.07.23	SEK	4.230.911,44	CHF	-353.659,09	358.803,32
Devisenterminkontrakt Kauf USD / CHF 14.07.23	USD	70.496,28	CHF	-63.371,23	64.543,01
<b>Summe Devisentermingeschäfte Käufe</b>					<b>899.798,57</b>

Devisentermingeschäfte Verkäufe	Währung	Nominal	Währung	Nominal	offene Positionen in EUR
Devisenterminkontrakt Verkauf DKK / CHF 14.07.23	DKK	-2.868.063,79	CHF	375.661,88	385.006,19
Devisenterminkontrakt Verkauf CAD / CHF 14.07.23	CAD	-2.108.088,82	CHF	1.429.878,70	1.458.770,35
Devisenterminkontrakt Verkauf AUD / CHF 14.07.23	AUD	-1.205.291,86	CHF	737.921,86	734.775,95
Devisenterminkontrakt Verkauf GBP / CHF 14.07.23	GBP	-1.209.664,56	CHF	1.372.340,25	1.408.125,20
Devisenterminkontrakt Verkauf EUR / CHF 14.07.23	EUR	-4.268.624,27	CHF	4.165.710,90	4.266.118,33
Devisenterminkontrakt Verkauf JPY / CHF 14.07.23	JPY	-322.060.867,00	CHF	2.099.718,08	2.043.539,80
Devisenterminkontrakt Verkauf SEK / CHF 14.07.23	SEK	-4.230.911,44	CHF	355.235,93	358.803,32
Devisenterminkontrakt Verkauf USD / CHF 14.07.23	USD	-25.211.005,85	CHF	22.849.339,67	23.081.984,77
<b>Summe Devisentermingeschäfte Verkäufe</b>					<b>33.737.123,91</b>

Futures Kauf	Währung	Kontrakte	Kontraktgröße	Kurs Underlying	Dev. Kurs	Verpflichtungen aus Derivaten in EUR
S&P 500 E-Mini Index Future 15.09.23	USD	5,00	50,00	4.488,2500	0,916590	1.028.471,59
<b>Summe Futures Kauf</b>						<b>1.028.471,59</b>

### Devisenkurse (in Mengennotiz)

				per	30.06.2023
Australischer Dollar	AUD	1,639000	=1		EUR
Britisches Pfund	GBP	0,858150	=1		EUR
Dänische Kronen	DKK	7,445950	=1		EUR
Hongkong Dollar	HKD	8,549700	=1		EUR
Japanischer Yen	JPY	157,687700	=1		EUR
Kanadischer Dollar	CAD	1,443700	=1		EUR
Norwegische Kronen	NOK	11,688500	=1		EUR
Schwedische Kronen	SEK	11,784250	=1		EUR
Schweizer Franken	CHF	0,976050	=1		EUR
US-Dollar	USD	1,091000	=1		EUR

Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

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

### Ertrags- und Aufwandsrechnung des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Global Equity / Aktien Welt ESG im Zeitraum vom 1. Juli 2022 bis 30. Juni 2023

	EUR
<b>Erträge</b>	
Zinsen aus Geldanlagen	25.475,15
Dividendenerträge	1.552.427,52
Erträge aus REITs	26.703,94
Sonstige Erträge	2,37
Ordentlicher Ertragsausgleich	-14.000,84
<b>Erträge insgesamt</b>	<b>1.590.608,14</b>
<b>Aufwendungen</b>	
Fondsmanagervergütung	-835.825,58
Performanceabhängige Fondsmanagervergütung	-11.752,20
Verwaltungsvergütung	-44.398,51
Zentralverwaltungsstellenvergütung	-22.735,38
Verwahrstellenvergütung	-52.436,48
Prüfungskosten	-13.360,25
Taxe d'abonnement	-40.049,06
Veröffentlichungskosten	-8.624,22
Register- und Transferstellenvergütung	-650,01
Regulatorische Kosten	-7.992,10
Zinsaufwendungen	-3.652,66
Sonstige Aufwendungen	-49.926,22
Ordentlicher Aufwandsausgleich	15.887,97
<b>Aufwendungen insgesamt</b>	<b>-1.075.514,70</b>
<b>Ordentlicher Nettoertrag</b>	<b>515.093,44</b>
<b>Veräußerungsgeschäfte</b>	
Realisierte Gewinne	11.445.356,23
Ertragsausgleich auf realisierte Gewinne	-228.051,44
Realisierte Verluste	-9.195.712,22
Aufwandsausgleich auf realisierte Verluste	220.731,55
<b>Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften</b>	<b>2.242.324,12</b>
<b>Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>	<b>2.757.417,56</b>
<b>Veränderung der nicht realisierten Gewinne und Verluste</b>	
Veränderung der nicht realisierten Gewinne	6.874.244,71
Veränderung der nicht realisierten Verluste	-694.510,46
<b>Nettoveränderung des nicht realisierten Ergebnisses des Geschäftsjahres</b>	<b>6.179.734,25</b>
<b>Ergebnis des Geschäftsjahres inkl. Ertrags-/Aufwandsausgleich</b>	<b>8.937.151,81</b>

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

	EUR
<b>Netto-Teilfondsvermögen zum Beginn des Geschäftsjahres</b>	<b>78.299.474,36</b>
Mittelzuflüsse	5.701.924,18
Mittelabflüsse	-5.899.081,64
Mittelzufluss/ -abfluss netto	-197.157,46
Ertrags- und Aufwandsausgleich	5.432,76
Ergebnis des Geschäftsjahres inkl. Ertrags-/Aufwandsausgleich	8.937.151,81
<b>Netto-Teilfondsvermögen zum Ende des Geschäftsjahres</b>	<b>87.044.901,47</b>

Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

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

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

Stichtag	Umlaufende Aktien	Wahrung	Netto-Teilfondsvermogen	Nettoinventarwert pro Aktie
30.06.2023	711.340,820	EUR	20.500.159,40	28,82
30.06.2022	721.304,815	EUR	18.858.031,28	26,14
30.06.2021	744.525,057	EUR	20.196.049,12	27,13

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

Stichtag	Umlaufende Aktien	Wahrung	Netto-Teilfondsvermogen	Nettoinventarwert pro Aktie
30.06.2023	2.572.544,000	CHF	37.708.629,93	14,66
30.06.2022	2.632.451,000	CHF	35.135.123,79	13,35
30.06.2021	2.981.330,000	CHF	46.039.728,20	15,44

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

Stichtag	Umlaufende Aktien	Wahrung	Netto-Teilfondsvermogen	Nettoinventarwert pro Aktie
30.06.2023	1.151.272,922	EUR	25.223.467,17	21,91
30.06.2022	1.108.654,390	EUR	21.927.619,95	19,78
30.06.2021	1.102.904,352	EUR	22.535.271,23	20,43

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

Stichtag	Umlaufende Aktien	Wahrung	Netto-Teilfondsvermogen	Nettoinventarwert pro Aktie
30.06.2023	142.191,809	CHF	2.623.000,44	18,45
30.06.2022	142.171,809	CHF	2.412.461,78	16,97
30.06.2021	152.755,809	CHF	2.913.966,02	19,08

Der beigelegte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

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

### Zusammensetzung des Netto-Fondsvermögens des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - European Equity / Aktien Europa ESG per 30. Juni 2023

Position	Betrag in EUR
Wertpapiervermögen	38.667.776,91
(Wertpapiereinstandskosten EUR 30.375.732,20)	
Derivate	1.800,00
Bankguthaben	622.322,89
Sonstige Vermögensgegenstände	59.889,33
<b>Summe Aktiva</b>	<b>39.351.789,13</b>
Bankverbindlichkeiten	-1.810,98
Sonstige Verbindlichkeiten	-168.213,87
<b>Summe Passiva</b>	<b>-170.024,85</b>
<b>Netto-Teilfondsvermögen</b>	<b>39.181.764,28</b>

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

Währung	Kurswert in Mio. EUR	in % des Netto- Teilfondsvermögens
EUR	20,88	53,28
GBP	7,49	19,11
CHF	6,24	15,93
DKK	2,07	5,28
SEK	1,98	5,05
NOK	0,43	1,11
USD	0,09	0,24
<b>Summe</b>	<b>39,18</b>	<b>100,00</b>

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

Wertpapierkategorie	Kurswert in Mio. EUR	in % des Netto- Teilfondsvermögens
Aktien	37,87	96,64
Genussscheine	0,77	1,97
REITS	0,03	0,08
<b>Summe</b>	<b>38,67</b>	<b>98,69</b>

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

Länder	Kurswert in Mio. EUR	in % des Netto- Teilfondsvermögens
Frankreich	7,19	18,31
Großbritannien	7,14	18,22
Schweiz	6,24	15,93
Bundesrepublik Deutschland	4,40	11,24
Niederlande	3,98	10,17
Dänemark	2,07	5,28
Schweden	1,98	5,05
Spanien	1,93	4,92
Italien	1,59	4,07
Sonstige Länder	2,15	5,50
<b>Summe</b>	<b>38,67</b>	<b>98,69</b>

Der beigegefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

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

## Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2023 des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - European Equity / Aktien Europa ESG

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg in 1.000	Bestand	Kurs zum 30.06.2023	Kurswert in EUR	in % des Netto- vermögens
<b>Amtlich gehandelte Wertpapiere / Regulierter Markt</b>						
<b>Aktien</b>						
ABB Ltd. Namens-Aktien SF 0,12	CH0012221716	STK	11.000,00	CHF 35,1800	396.475,59	1,01
Barry Callebaut AG Namensaktien SF 0,02	CH0009002962	STK	40,00	CHF 1.727,0000	70.775,06	0,18
Cie Financière Richemont AG Namens-Aktien SF 1	CH0210483332	STK	3.346,00	CHF 151,6500	519.871,83	1,33
Holcim Ltd. Namens-Aktien SF 2	CH0012214059	STK	4.333,00	CHF 60,2000	267.247,17	0,68
Julius Baer Gruppe AG Namens-Aktien SF -,02	CH0102484968	STK	3.437,00	CHF 56,3400	198.392,07	0,51
Lonza Group AG Namens-Aktien SF 1	CH0013841017	STK	400,00	CHF 533,4000	218.595,36	0,56
Nestlé S.A. Namens-Aktien SF -,10	CH0038863350	STK	13.859,00	CHF 107,6000	1.527.819,68	3,90
Novartis AG Namens-Aktien SF 0,50	CH0012005267	STK	10.864,00	CHF 90,0000	1.001.751,96	2,56
Swiss Life Holding AG Namens-Aktien SF 0,10	CH0014852781	STK	268,00	CHF 523,0000	143.603,30	0,37
Swiss Re AG Namens-Aktien SF -,10	CH0126881561	STK	1.448,00	CHF 90,0400	133.577,09	0,34
Swisscom AG Namens-Aktien SF 1	CH0008742519	STK	239,00	CHF 557,8000	136.585,42	0,35
UBS Group AG Namens-Aktien SF -,10	CH0244767585	STK	20.769,00	CHF 18,0950	385.036,68	0,98
Zehnder Group AG Namens-Aktien SF-,05	CH0276534614	STK	1.100,00	CHF 72,4000	81.594,18	0,21
Zurich Insurance Group AG Nam.-Aktien SF 0,10	CH0011075394	STK	899,00	CHF 424,9000	391.358,13	1,00
A.P.Møller-Mærsk A/S Navne-Aktier B DK 1000	DK0010244508	STK	82,00	DKK 11.975,0000	131.877,06	0,34
Carlsberg AS Navne-Aktier B DK 20	DK0010181759	STK	519,00	DKK 1.090,5000	76.010,38	0,19
Dampskibsselskabet Norden A/S Navne Aktier DK 1	DK0060083210	STK	1.650,00	DKK 340,4000	75.431,61	0,19
Demant AS Navne Aktier A DK 0,2	DK0060738599	STK	2.500,00	DKK 288,5000	96.864,74	0,25
DSV A/S Indehaver Bonus-Aktier DK 1	DK0060079531	STK	834,00	DKK 1.433,0000	160.506,32	0,41
Jyske Bank A/S Navne-Aktier DK 10	DK0010307958	STK	2.000,00	DKK 518,4000	139.243,48	0,36
Novo-Nordisk AS Navne-Aktier B DK -,20	DK0060534915	STK	9.406,00	DKK 1.099,4000	1.388.802,83	3,54
Ahold Delhaize N.V., Konkinkl. Aandelen aan toonder EO -,01	NL0011794037	STK	8.565,00	EUR 31,2600	267.741,90	0,68
Air France-KLM S.A. Actions Port. EO 1	FR0000031122	STK	35.000,00	EUR 1,7230	60.305,00	0,15
Air Liquide-SA Ét. Expl. P.G. Cl. Actions Port. EO 5,50	FR0000120073	STK	2.300,00	EUR 164,2000	377.660,00	0,96
Airbus SE Aandelen op naam EO 1	NL0000235190	STK	2.314,00	EUR 132,3600	306.281,04	0,78
Allianz SE vink.Namens-Aktien o.N.	DE0008404005	STK	2.406,00	EUR 213,2000	512.959,20	1,31
Andritz AG Inhaber-Aktien o.N.	AT0000730007	STK	2.400,00	EUR 51,0500	122.520,00	0,31
Anheuser-Busch InBev S.A./N.V. Actions au Port. o.N.	BE0974293251	STK	5.150,00	EUR 51,8300	266.924,50	0,68
Aperam S.A. Actions Nom. o.N.	LU0569974404	STK	2.135,00	EUR 28,5800	61.018,30	0,16
ASM International N.V. Bearer Shares EO 0,04	NL0000334118	STK	476,00	EUR 388,3500	184.854,60	0,47
ASML Holding N.V. Aandelen op naam EO -,09	NL0010273215	STK	2.233,00	EUR 663,0000	1.480.479,00	3,78
Assicurazioni Generali S.p.A. Azioni nom. o.N.	IT0000062072	STK	10.750,00	EUR 18,6200	200.165,00	0,51
Atresmedia Corp.d.Medio.d.Com. Acciones Nom. EO -,75	ES0109427734	STK	20.000,00	EUR 3,4920	69.840,00	0,18
AXA S.A. Actions Port. EO 2,29	FR0000120628	STK	5.259,00	EUR 27,0250	142.124,48	0,36
Azimut Holding S.p.A. Azioni nom. EUR o.N.	IT0003261697	STK	3.500,00	EUR 19,7550	69.142,50	0,18
Banco Bilbao Vizcaya Argent. Acciones Nom. EO 0,49	ES0113211835	STK	35.000,00	EUR 7,0320	246.120,00	0,63
Banco Santander S.A. Acciones Nom. EO 0,50	ES0113900J37	STK	52.915,00	EUR 3,3850	179.117,28	0,46
BNP Paribas S.A. Actions Port. EO 2	FR0000131104	STK	6.055,00	EUR 57,7200	349.494,60	0,89
Bolloré SE Actions Port. EO 0,16	FR0000039299	STK	13.486,00	EUR 5,7100	77.005,06	0,20
Bouygues S.A. Actions Port. EO 1	FR0000120503	STK	3.680,00	EUR 30,7600	113.196,80	0,29
Brembo S.p.A. Azioni nom. o.N.	IT0005252728	STK	4.400,00	EUR 13,5800	59.752,00	0,15
Brenntag SE Namens-Aktien o.N.	DE000A1DAHH0	STK	2.000,00	EUR 71,4000	142.800,00	0,36
Brunello Cucinelli S.P.A. Azioni nom. o. N.	IT0004764699	STK	1.377,00	EUR 80,6000	110.986,20	0,28
Bureau Veritas SA Actions au Porteur EO -,12	FR0006174348	STK	5.859,00	EUR 25,1200	147.178,08	0,38
BUZZI S.p.A. Azioni nom. o.N.	IT0001347308	STK	5.310,00	EUR 22,9400	121.811,40	0,31
Capgemini SE Actions Port. EO 8	FR0000125338	STK	800,00	EUR 173,5500	138.840,00	0,35
Carrefour S.A. Actions Port. EO 2,5	FR0000120172	STK	7.000,00	EUR 17,3550	121.485,00	0,31
Cia. d. Dis.Integ.Logista Hdgs Acciones Port. EO -,20	ES0105027009	STK	2.000,00	EUR 24,6800	49.360,00	0,13
Cie Génle ÉtS Michelin SCpA Actions Nom. EO -,50	FR001400AJ45	STK	7.160,00	EUR 27,0600	193.749,60	0,49
Commerzbank AG Inhaber-Aktien o.N.	DE000CBK1001	STK	6.724,00	EUR 10,1500	68.248,60	0,17
Compagnie de Saint-Gobain S.A. Actions au Porteur (C.R.) EO 4	FR0000125007	STK	4.458,00	EUR 55,7300	248.444,34	0,63

Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

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

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg in 1.000	Bestand	Kurs zum 30.06.2023	Kurswert in EUR	in % des Netto- Teilfonds- vermögens
CRH PLC Registered Shares EO -,32	IE0001827041	STK	5.218,00	EUR 50,5000	263.509,00	0,67
Danone S.A. Actions Port. EO-,25	FR0000120644	STK	5.013,00	EUR 56,1400	281.429,82	0,72
Deutsche Börse AG Namens-Aktien o.N.	DE0005810055	STK	1.844,00	EUR 169,1000	311.820,40	0,80
Deutsche Post AG Namens-Aktien o.N.	DE0005552004	STK	7.171,00	EUR 44,7300	320.758,83	0,82
Deutsche Telekom AG Namens-Aktien o.N.	DE0005557508	STK	6.944,00	EUR 19,9760	138.713,34	0,35
E.ON SE Namens-Aktien o.N.	DE000ENAG999	STK	17.000,00	EUR 11,6800	198.560,00	0,51
Edenred SE Actions Port. EO 2	FR0010908533	STK	2.871,00	EUR 61,3400	176.107,14	0,45
Eiffage S.A. Actions Port. EO 4	FR0000130452	STK	939,00	EUR 95,5800	89.749,62	0,23
Endesa S.A. Acciones Port. EO 1,20	ES0130670112	STK	6.403,00	EUR 19,6500	125.818,95	0,32
ENEL S.p.A. Azioni nom. EO 1	IT0003128367	STK	51.466,00	EUR 6,1680	317.442,29	0,81
ENI S.p.A. Azioni nom. o.N.	IT0003132476	STK	9.176,00	EUR 13,1820	120.958,03	0,31
Esprinet S.p.A. Azioni nom. EO -,15	IT0003850929	STK	5.363,00	EUR 5,5600	29.818,28	0,08
EssilorLuxottica S.A. Actions Port. EO 0,18	FR0000121667	STK	400,00	EUR 172,6000	69.040,00	0,18
Ferrari N.V. Aandelen op naam EO -,01	NL0011585146	STK	323,00	EUR 299,5000	96.738,50	0,25
Finecobank Banca Fineco S.p.A. Azioni nom. EO -,33	IT0000072170	STK	6.553,00	EUR 12,3150	80.700,20	0,21
GFT Technologies SE Inhaber-Aktien o.N.	DE0005800601	STK	1.330,00	EUR 25,8000	34.314,00	0,09
Heidelberg Materials AG Inhaber-Aktien o.N.	DE0006047004	STK	2.580,00	EUR 75,2000	194.016,00	0,50
Heineken Holding N.V. Aandelen aan toonder EO 1,60	NL0000008977	STK	1.443,00	EUR 79,6500	114.934,95	0,29
Heineken N.V. Aandelen aan toonder EO 1,60	NL0000009165	STK	1.568,00	EUR 94,1800	147.674,24	0,38
Henkel AG & Co. KGaA Inhaber-Vorzugsaktien o.St.o.N	DE0006048432	STK	1.575,00	EUR 73,2600	115.384,50	0,29
Hermes International S.C.A. Actions au Porteur o.N.	FR0000052292	STK	183,00	EUR 1.990,0000	364.170,00	0,93
Iberdrola S.A. Acciones Port. EO -,75	ES0144580Y14	STK	44.935,00	EUR 11,9500	536.973,25	1,37
Indra Sistemas S.A. Acciones Port. EO 0,20	ES0118594417	STK	8.168,00	EUR 11,5800	94.585,44	0,24
Industria de Diseño Textil SA Acciones Port. EO 0,03	ES0148396007	STK	9.738,00	EUR 35,4600	345.309,48	0,88
Infineon Technologies AG Namens-Aktien o.N.	DE0006231004	STK	10.749,00	EUR 37,7850	406.150,97	1,04
ING Groep N.V. Aandelen op naam EO -,01	NL0011821202	STK	10.000,00	EUR 12,3380	123.380,00	0,31
Interpump Group S.p.A. Azioni nom. EO 0,52	IT0001078911	STK	2.400,00	EUR 50,8800	122.112,00	0,31
Intesa Sanpaolo S.p.A. Azioni nom. o.N.	IT0000072618	STK	102.829,00	EUR 2,4000	246.789,60	0,63
Ipsen S.A. Actions au Porteur EO 1	FR0010259150	STK	900,00	EUR 110,2000	99.180,00	0,25
IPSOS S.A. Actions Port. EO -,25	FR0000073298	STK	2.000,00	EUR 50,9500	101.900,00	0,26
Jerónimo Martins, SGPS, S.A. Açções Nominativas EO 1	PTJMT0AE0001	STK	3.679,00	EUR 25,2400	92.857,96	0,24
Jungheinrich AG Inhaber-Vorzugsakt.o.St.o.N.	DE0006219934	STK	1.800,00	EUR 33,5400	60.372,00	0,15
KBC Groep N.V. Parts Sociales Port. o.N.	BE0003565737	STK	1.756,00	EUR 63,9200	112.243,52	0,29
Kering S.A. Actions Port. EO 4	FR0000121485	STK	301,00	EUR 505,6000	152.185,60	0,39
KRONES AG Inhaber-Aktien o.N.	DE0006335003	STK	500,00	EUR 111,1000	55.550,00	0,14
LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE Actions Port. (C.R.) EO 0,3	FR0000121014	STK	1.448,00	EUR 863,0000	1.249.624,00	3,19
Melexis N.V. Actions au Port. o.N.	BE0165385973	STK	873,00	EUR 89,9000	78.482,70	0,20
Mercedes-Benz Group AG Namens-Aktien o.N.	DE0007100000	STK	3.672,00	EUR 73,6700	270.516,24	0,69
Münchener Rückvers.-Ges. AG vink.Namens-Aktien o.N.	DE0008430026	STK	1.119,00	EUR 343,6000	384.488,40	0,98
N.V. Bekaert S.A. Parts Sociales au Port. o.N.	BE0974258874	STK	2.610,00	EUR 41,5000	108.315,00	0,28
Nokia Oyj Registered Shares EO 0,06	FI0009000681	STK	45.243,00	EUR 3,8355	173.529,53	0,44
Orange S.A. Actions Port. EO 4	FR0000133308	STK	14.000,00	EUR 10,7020	149.828,00	0,38
Oréal S.A., L' Actions Port. EO 0,2	FR0000120321	STK	1.377,00	EUR 427,1000	588.116,70	1,50
Pernod Ricard S.A. Actions Port. (C.R.) o.N.	FR0000120693	STK	692,00	EUR 202,4000	140.060,80	0,36
PostNL N.V. Aandelen aan toonder EO -,08	NL0009739416	STK	46.305,00	EUR 1,5955	73.879,63	0,19
Prosus N.V. Registered Shares EO -,05	NL0013654783	STK	4.334,00	EUR 67,1100	290.854,74	0,74
Publicis Groupe S.A. Actions Port. EO 0,40	FR0000130577	STK	2.336,00	EUR 73,5000	171.696,00	0,44
Randstad N.V. Aandelen aan toonder EO 0,10	NL0000379121	STK	2.770,00	EUR 48,3100	133.818,70	0,34
Red Electrica Corporacion S.A. Acciones Port. EO -,50	ES0173093024	STK	9.608,00	EUR 15,3850	147.819,08	0,38
Repsol S.A. Acciones Port. EO 1	ES0173516115	STK	10.000,00	EUR 13,3300	133.300,00	0,34
Rexel S.A. Actions au Porteur EO 5	FR0010451203	STK	5.000,00	EUR 22,6100	113.050,00	0,29
Rheinmetall AG Inhaber-Aktien o.N.	DE0007030009	STK	451,00	EUR 250,8000	113.110,80	0,29
RWE AG Inhaber-Aktien o.N.	DE0007037129	STK	4.072,00	EUR 39,8700	162.350,64	0,41
Sampo OYJ Registered Shares Cl.A o.N.	FI0009003305	STK	3.932,00	EUR 41,1200	161.683,84	0,41
Sanofi S.A. Actions Port. EO 2	FR0000120578	STK	4.020,00	EUR 98,2000	394.764,00	1,01
SAP SE Inhaber-Aktien o.N.	DE0007164600	STK	3.773,00	EUR 125,1400	472.153,22	1,21
Schaeffler AG Inhaber-Vorzugsakt.o.St. o.N.	DE000SHA0159	STK	17.000,00	EUR 5,6450	95.965,00	0,24
Schneider Electric SE Actions Port. EO 4	FR0000121972	STK	1.984,00	EUR 166,4600	330.256,64	0,84

Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

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

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg in 1.000	Bestand	Kurs zum 30.06.2023	Kurswert in EUR	in % des Netto- Teilfonds- vermögens	
Siemens AG Namens-Aktien o.N.	DE0007236101	STK	2.269,00	EUR	152,5400	346.113,26	0,88
Stellantis N.V. Aandelen op naam EO -,01	NL00150001Q9	STK	13.875,00	EUR	16,0800	223.110,00	0,57
STMicrollectronics N.V. Aandelen aan toonder EO 1,04	NL0000226223	STK	5.141,00	EUR	45,5650	234.249,67	0,60
Television Fse 1 S.A. (TF1) Actions Port. EO 0,2	FR0000054900	STK	9.000,00	EUR	6,2950	56.655,00	0,14
TotalEnergies SE Actions au Porteur EO 2,50	FR0000120271	STK	8.313,00	EUR	52,5500	436.848,15	1,11
UniCredit S.p.A. Azioni nom. o.N.	IT0005239360	STK	5.345,00	EUR	21,2650	113.661,43	0,29
Universal Music Group N.V. Aandelen op naam EO1	NL00150001Y2	STK	6.847,00	EUR	20,3500	139.336,45	0,36
UPM Kymmene Corp. Registered Shares o.N.	FI0009005987	STK	4.900,00	EUR	27,2700	133.623,00	0,34
VINCI S.A. Actions Port. EO 2,50	FR0000125486	STK	2.013,00	EUR	106,3800	214.142,94	0,55
Wolters Kluwer N.V. Aandelen op naam EO -,12	NL0000395903	STK	1.435,00	EUR	116,3000	166.890,50	0,43
Anglo American PLC Registered Shares DL -,54945	GB00B1XZS820	STK	2.895,00	GBP	22,3300	75.331,06	0,19
Associated British Foods PLC Registered Shares LS -,0568	GB0006731235	STK	4.933,00	GBP	19,9100	114.450,89	0,29
AstraZeneca PLC Registered Shares DL -,25	GB0009895292	STK	6.257,00	GBP	112,7600	822.163,16	2,10
BAE Systems PLC Registered Shares LS -,025	GB0002634946	STK	23.463,00	GBP	9,2700	253.454,54	0,65
Balfour Beatty PLC Registered Shares LS -,50	GB0000961622	STK	16.422,00	GBP	3,4080	65.217,24	0,17
Barclays PLC Registered Shares LS 0,25	GB0031348658	STK	81.601,00	GBP	1,5338	145.848,18	0,37
Beazley PLC Registered Shares LS -,05	GB00BYQJQC66	STK	12.106,00	GBP	5,8900	83.090,77	0,21
BP PLC Registered Shares DL -,25	GB0007980591	STK	59.844,00	GBP	4,5835	319.635,23	0,82
Britvic PLC Registered Shares LS -,20	GB00B0N8QD54	STK	7.000,00	GBP	8,5600	69.824,62	0,18
Bunzl PLC Registered Shares LS -,3214857	GB00B0744B38	STK	4.513,00	GBP	29,9900	157.717,03	0,40
Burberry Group PLC Registered Shares LS-,0005	GB0031743007	STK	5.889,00	GBP	21,2000	145.483,66	0,37
Centrica PLC Reg. Shares LS -,061728395	GB00B033F229	STK	57.076,00	GBP	1,2395	82.439,79	0,21
Compass Group PLC Registered Shares LS -,1105	GB00BD6K4575	STK	9.091,00	GBP	22,0200	233.273,69	0,60
Diageo PLC Reg. Shares LS -,28935185	GB0002374006	STK	4.446,00	GBP	33,7900	175.063,03	0,45
EnQuest PLC Registered Shares LS -,05	GB00B635TG28	STK	60.000,00	GBP	0,1491	10.424,75	0,03
Ferguson PLC Reg. Shares LS 0,1	JE00BJVNSS43	STK	492,00	GBP	124,1000	71.149,80	0,18
Forterra PLC Registered Shares LS -,01	GB00BYW3C20	STK	15.000,00	GBP	1,6160	28.246,81	0,07
Grafton Group PLC Registered Shares EO -,05	IE00B00MZ448	STK	8.000,00	GBP	7,8170	72.873,04	0,19
GSK PLC Registered Shares LS-,3125	GB00BN7SWP63	STK	22.100,00	GBP	13,8880	357.658,68	0,91
HSBC Holdings PLC Registered Shares DL -,50	GB0005405286	STK	99.088,00	GBP	6,2170	717.858,30	1,83
IG Group Holdings PLC Registered Shares LS 0,00005	GB00B06QFB75	STK	8.080,00	GBP	6,7700	63.743,63	0,16
Inchcape PLC Registered Shares LS -,10	GB00B61TVQ02	STK	9.893,00	GBP	7,7750	89.632,44	0,23
Informa PLC Registered Shares LS -,001	GB00BMJ6DW54	STK	9.000,00	GBP	7,2600	76.140,53	0,19
JD Sports Fashion PLC Registered Shares LS -,0005	GB00BM8Q5M07	STK	58.515,00	GBP	1,4600	99.553,57	0,25
Lloyds Banking Group PLC Registered Shares LS -,10	GB0008706128	STK	335.357,00	GBP	0,4359	170.345,65	0,43
Marks & Spencer Group PLC Registered Shares LS -,01	GB0031274896	STK	38.976,00	GBP	1,9270	87.521,71	0,22
National Grid PLC Reg. Shares LS -,12431289	GB00BDR05C01	STK	7.058,00	GBP	10,4050	85.577,68	0,22
NatWest Group PLC Registered Shares LS 1,0769	GB00BM8PJY71	STK	62.194,00	GBP	2,4080	174.518,62	0,45
NEXT PLC Registered Shares LS 0,10	GB0032089863	STK	1.600,00	GBP	69,0000	128.648,84	0,33
Prudential PLC Registered Shares LS -,05	GB0007099541	STK	8.000,00	GBP	11,0850	103.338,58	0,26
Reckitt Benckiser Group Registered Shares LS -,10	GB00B24CGK77	STK	1.434,00	GBP	59,1200	98.791,68	0,25
Relx PLC Registered Shares LS -,144397	GB00B2B0DG97	STK	5.000,00	GBP	26,2100	152.712,23	0,39
Rio Tinto PLC Registered Shares LS -,10	GB0007188757	STK	2.331,00	GBP	49,8550	135.421,55	0,35
Rolls Royce Holdings PLC Registered Shares LS 0,20	GB00B63H8491	STK	46.000,00	GBP	1,5105	80.968,36	0,21
Sainsbury PLC, J. Registered Shs LS -,28571428	GB00B019KW72	STK	27.816,00	GBP	2,6900	87.193,43	0,22
Serco Group PLC Registered Shares LS -,02	GB0007973794	STK	45.000,00	GBP	1,5570	81.646,57	0,21
Shell PLC Reg. Shares Class EO -,07	GB00BP6MXD84	STK	27.244,00	GBP	23,4250	743.681,99	1,90
Smiths Group PLC Registered Shares LS -,375	GB00B1WY2338	STK	3.573,00	GBP	16,4400	68.449,71	0,17
Standard Chartered PLC Registered Shares DL -,50	GB0004082847	STK	11.146,00	GBP	6,8300	88.710,81	0,23
Tesco PLC Registered Shs LS-,0633333	GB00BLGZ9862	STK	63.570,00	GBP	2,4840	184.009,65	0,47
Unilever PLC Registered Shares LS -,031111	GB00B10RZP78	STK	8.373,00	GBP	40,9750	399.794,53	1,02
Whitbread PLC Reg. Shares LS -,76797385	GB00B1KJJ408	STK	2.016,00	GBP	33,8600	79.545,25	0,20
Equinor ASA Navne-Aksjer NK 2,50	NO0010096985	STK	9.000,00	NOK	312,1000	240.313,13	0,61
Gjensidige Forsikring ASA Navne-Aksjer NK 2	NO0010582521	STK	5.000,00	NOK	171,8000	73.491,04	0,19
SpareBank 1 Nord-Norge Navne-Aksjer NK 18	NO0006000801	STK	7.043,00	NOK	97,1000	58.508,39	0,15
Yara International ASA Navne-Aksjer NK 1,70	NO0010208051	STK	1.877,00	NOK	379,0000	60.861,79	0,16
Addtech AB Namn-Aktier B SK -,1875	SE0014781795	STK	5.000,00	SEK	234,8000	99.624,50	0,25
Alleima AB Namn-Aktier o.N.	SE0017615644	STK	1.400,00	SEK	49,0600	5.828,46	0,01

Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

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

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg in 1.000	Bestand		Kurs zum 30.06.2023	Kurswert in EUR	in % des Netto- Teilfonds- vermögens
Atlas Copco AB Namn-Aktier A SK-,052125	SE0017486889	STK	24.316,00	SEK	155,4000	320.657,35	0,82
Beijer Alma AB Namn-Aktier B SK 2,083	SE0011090547	STK	3.182,00	SEK	225,5000	60.889,83	0,16
Beijer Ref AB Namn-Aktier B O.N.	SE0015949748	STK	4.000,00	SEK	137,6000	46.706,41	0,12
Betsson AB Namn-Aktier Ser.B o.N.	SE0019892167	STK	16.023,00	SEK	114,8000	156.093,12	0,40
Bilia AB Namn-Aktier A (fria) SK 2,50	SE0009921588	STK	10.000,00	SEK	112,4000	95.381,55	0,24
BioGaia AB Namn-Aktier B o.N.	SE0017769995	STK	5.940,00	SEK	116,0000	58.471,26	0,15
Boliden AB Namn-Aktier o.N.	SE0020050417	STK	2.000,00	SEK	311,5500	52.875,66	0,13
Evolution AB (publ) Namn-Aktier SK-,003	SE0012673267	STK	1.120,00	SEK	1.365,8000	129.808,52	0,33
Fortnox AB Namn-Aktier o.N.	SE0017161243	STK	16.035,00	SEK	63,6800	86.650,30	0,22
Indutrade AB Aktier SK 1	SE0001515552	STK	6.000,00	SEK	242,9000	123.673,55	0,32
Lagercrantz Group AB Namn-Aktier Ser.B o.N.	SE0014990966	STK	8.000,00	SEK	139,0000	94.363,24	0,24
Lifco AB Namn-Aktier B o.N.	SE0015949201	STK	5.000,00	SEK	234,3000	99.412,35	0,25
NIBE Industrier AB Namn-Aktier B o.N.	SE0015988019	STK	10.362,00	SEK	102,4000	90.041,27	0,23
Saab AB Namn-Aktier B SK 25	SE0000112385	STK	2.898,00	SEK	583,2000	143.421,40	0,37
Skandinaviska Enskilda Banken Namn-Aktier A (fria) SK 10	SE0000148884	STK	14.325,00	SEK	119,1500	144.839,40	0,37
Volvo (publ), AB Namn-Aktier B (fria) o.N.	SE0000115446	STK	8.997,00	SEK	223,0000	170.255,30	0,43
<b>Genussscheine</b>							
Chocoladef. Lindt & Sprüngli Inhaber-Part.sch. SF 10	CH0010570767	STK	11,00	CHF	11.240,0000	126.673,84	0,32
Roche Holding AG Inhaber-Genußscheine o.N.	CH0012032048	STK	2.296,00	CHF	273,5000	643.364,58	1,64
<b>REITs</b>							
Unibail-Rodamco-Westfield SE Stapled Shares EO-,05	FR0013326246	STK	620,00	EUR	48,1500	29.853,00	0,08
<b>Summe Wertpapiervermögen</b>				<b>EUR</b>		<b>38.667.776,91</b>	<b>98,69</b>
<b>Derivate</b>							
<b>Aktienindex-Terminkontrakte</b>							
Euro STOXX 50 Future 15.09.23		STK	8	EUR	4.427,0000	1.800,00	0,00
<b>Summe Derivate</b>				<b>EUR</b>		<b>1.800,00</b>	<b>0,00</b>
<b>Bankguthaben</b>							
<b>Bankkonten</b>							
Bankkonto RBC Investor Services Bank S.A.		DKK	0,97	EUR		0,13	0,00
Bankkonto RBC Investor Services Bank S.A.		EUR	109.643,32	EUR		109.643,32	0,28
Bankkonto RBC Investor Services Bank S.A.		GBP	45,01	EUR		52,45	0,00
Bankkonto RBC Investor Services Bank S.A.		NOK	39,38	EUR		3,37	0,00
Bankkonto RBC Investor Services Bank S.A.		SEK	3.161,69	EUR		268,30	0,00
Bankkonto RBC Investor Services Bank S.A.		USD	0,51	EUR		0,47	0,00
Bankkonto UBS Ltd London		EUR	237.016,14	EUR		237.016,14	0,60
Bankkonto UBS Ltd London		GBP	155.107,99	EUR		180.746,94	0,46
Bankkonto UBS Ltd London		USD	103.199,62	EUR		94.591,77	0,24
<b>Summe Bankguthaben</b>				<b>EUR</b>		<b>622.322,89</b>	<b>1,59</b>
<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>							
Dividendenforderungen		EUR	6.177,34	EUR		6.177,34	0,02
Dividendenforderungen		GBP	22.574,20	EUR		26.305,67	0,07
Dividendenforderungen		USD	369,00	EUR		338,22	0,00
Initial Margin UBS Ltd London		EUR	27.068,10	EUR		27.068,10	0,07
<b>Summe Sonstige Vermögensgegenstände</b>				<b>EUR</b>		<b>59.889,33</b>	<b>0,15</b>
<b>Bankverbindlichkeiten</b>							
Bankverbindlichkeiten RBC Investor Services Bank S.A.		CHF	-10,72	EUR		-10,98	0,00
Verbindlichkeiten aus Variation Margin		EUR	-1.800,00	EUR		-1.800,00	0,00
<b>Summe Bankverbindlichkeiten</b>				<b>EUR</b>		<b>-1.810,98</b>	<b>0,00</b>

Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

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

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg in 1.000	Bestand	Kurs zum 30.06.2023	Kurswert in EUR	in % des Netto- Teilfonds- vermögens
Sonstige Verbindlichkeiten <sup>1)</sup>				EUR	-168.213,87	-0,43
<b>Netto-Teilfondsvermögen</b>				EUR	<b>39.181.764,28</b>	<b>100,00<sup>*)</sup></b>

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

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

Nettoinventarwert pro Aktie des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - European Equity / Aktien Europa ESG A	EUR	20,35
Nettoinventarwert pro Aktie des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - European Equity / Aktien Europa ESG B	EUR	16,85
Nettoinventarwert pro Aktie des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - European Equity / Aktien Europa ESG X	EUR	17,77
Umlaufende Aktien des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - European Equity / Aktien Europa ESG A	STK	1.015.738,588
Umlaufende Aktien des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - European Equity / Aktien Europa ESG B	STK	1.007.845,495
Umlaufende Aktien des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - European Equity / Aktien Europa ESG X	STK	85.983,253
Anteil der Wertpapiere am Netto-Teilfondsvermögen	%	98,69
Anteil der Derivate am Netto-Teilfondsvermögen	%	0,00

### Verpflichtungen aus Derivaten

Futures Kauf	Währung	Kontrakte	Kontraktgröße	Kurs Underlying	Dev. Kurs	Verpflichtungen aus Derivaten in EUR
EUR STOXX 50 Future 15.09.23	EUR	8,00	10,00	4.427,0000	1,000000	354.160,00
<b>Summe Futures Kauf</b>						<b>354.160,00</b>

### Devisenkurse (in Mengennotiz)

			per	30.06.2023
Britisches Pfund	GBP	0,858150	=1	EUR
Dänische Kronen	DKK	7,445950	=1	EUR
Norwegische Kronen	NOK	11,688500	=1	EUR
Schwedische Kronen	SEK	11,784250	=1	EUR
Schweizer Franken	CHF	0,976050	=1	EUR
US-Dollar	USD	1,091000	=1	EUR

Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

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

### Ertrags- und Aufwandsrechnung des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - European Equity / Aktien Europa ESG im Zeitraum vom 1. Juli 2022 bis 30. Juni 2023

	EUR
<b>Erträge</b>	
Zinsen aus Geldanlagen	18.057,56
Dividenderträge	1.206.200,98
Sonstige Erträge	168,89
Ordentlicher Ertragsausgleich	-27.918,00
<b>Erträge insgesamt</b>	<b>1.196.509,43</b>
<b>Aufwendungen</b>	
Fondsmanagervergütung	-277.345,41
Performanceabhängige Fondsmanagervergütung	-67.586,86
Verwaltungsvergütung	-19.167,52
Zentralverwaltungsstellenvergütung	-10.351,84
Verwahrstellenvergütung	-33.809,34
Prüfungskosten	-13.360,25
Taxe d'abonnement	-18.125,56
Veröffentlichungskosten	-8.624,22
Register- und Transferstellenvergütung	-650,00
Regulatorische Kosten	-6.336,95
Zinsaufwendungen	-1.878,04
Sonstige Aufwendungen	-28.374,48
Ordentlicher Aufwandsausgleich	16.333,19
<b>Aufwendungen insgesamt</b>	<b>-469.277,28</b>
<b>Ordentlicher Nettoertrag</b>	<b>727.232,15</b>
<b>Veräußerungsgeschäfte</b>	
Realisierte Gewinne	1.860.863,65
Ertragsausgleich auf realisierte Gewinne	-51.179,49
Realisierte Verluste	-1.709.507,72
Aufwandsausgleich auf realisierte Verluste	50.038,21
<b>Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften</b>	<b>150.214,65</b>
<b>Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>	<b>877.446,80</b>
<b>Veränderung der nicht realisierten Gewinne und Verluste</b>	
Veränderung der nicht realisierten Gewinne	4.785.984,59
Veränderung der nicht realisierten Verluste	-143.938,63
<b>Nettoveränderung des nicht realisierten Ergebnisses des Geschäftsjahres</b>	<b>4.642.045,96</b>
<b>Ergebnis des Geschäftsjahres inkl. Ertrags-/Aufwandsausgleich</b>	<b>5.519.492,76</b>

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

	EUR
<b>Netto-Teilfondsvermögen zum Beginn des Geschäftsjahres</b>	<b>34.851.454,68</b>
Mittelzuflüsse	1.488.567,83
Mittelabflüsse	-2.690.477,08
Mittelzufluss/ -abfluss netto	-1.201.909,25
Ertrags- und Aufwandsausgleich	12.726,09
Ergebnis des Geschäftsjahres inkl. Ertrags-/Aufwandsausgleich	5.519.492,76
<b>Netto-Teilfondsvermögen zum Ende des Geschäftsjahres</b>	<b>39.181.764,28</b>

Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

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

## Entwicklung des Teilfonds im Jahresvergleich

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

Stichtag	Umlaufende Aktien	Währung	Netto-Teilfondsvermögen	Nettoinventarwert pro Aktie
30.06.2023	1.015.738,588	EUR	20.673.386,84	20,35
30.06.2022	1.095.524,069	EUR	19.328.477,31	17,64
30.06.2021	1.168.504,679	EUR	22.366.608,42	19,14

## Entwicklung des Teilfonds im Jahresvergleich

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

Stichtag	Umlaufende Aktien	Währung	Netto-Teilfondsvermögen	Nettoinventarwert pro Aktie
30.06.2023	1.007.845,495	EUR	16.980.869,23	16,85
30.06.2022	980.015,211	EUR	14.215.559,79	14,51
30.06.2021	958.658,549	EUR	15.030.419,80	15,68

## Entwicklung des Teilfonds im Jahresvergleich

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

Stichtag	Umlaufende Aktien	Währung	Netto-Teilfondsvermögen	Nettoinventarwert pro Aktie
30.06.2023	85.983,253	EUR	1.527.508,21	17,77
30.06.2022	85.983,253	EUR	1.307.417,58	15,21
30.06.2021	92.111,253	EUR	1.504.767,95	16,34

Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

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

### Zusammensetzung des Netto-Fondsvermögens des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Emerging Equity / Aktien Schwellenländer ESG per 30. Juni 2023

Position	Betrag in EUR
Wertpapiervermögen	110.498.632,39
(Wertpapiereinstandskosten EUR 105.865.299,05)	
Derivate	783.607,87
Bankguthaben	1.788.039,32
Sonstige Vermögensgegenstände	609.431,37
<b>Summe Aktiva</b>	<b>113.679.710,95</b>
Bankverbindlichkeiten	-0,03
Sonstige Verbindlichkeiten	-521.532,65
<b>Summe Passiva</b>	<b>-521.532,68</b>
<b>Netto-Teilfondsvermögen</b>	<b>113.158.178,27</b>

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

Währung	Kurswert in Mio. EUR	in % des Netto- Teilfondsvermögens
HKD	20,66	18,25
TWD	14,13	12,48
KRW	13,57	11,98
USD	13,41	11,84
EUR	12,03	10,73
CNY	8,13	7,17
ZAR	5,24	4,62
BRL	4,93	4,36
MXN	4,05	3,58
Sonstige Währungen	17,01	14,99
<b>Summe</b>	<b>113,16</b>	<b>100,00</b>

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

Wertpapierkategorie	Kurswert in Mio. EUR	in % des Netto- Teilfondsvermögens
Aktien	99,65	87,96
Wertpapier-Investmentanteile	10,10	8,92
Andere Wertpapiere	0,75	0,66
<b>Summe</b>	<b>110,50</b>	<b>97,54</b>

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

Länder	Kurswert in Mio. EUR	in % des Netto- Teilfondsvermögens
China	16,83	14,85
Taiwan	16,29	14,37
Südkorea	13,31	11,75
Kaimaninseln	10,61	9,37
Irland	10,10	8,92
Indien	6,76	5,97
Brasilien	4,82	4,25
Republik Südafrika	4,64	4,10
Mexiko	4,05	3,58
Sonstige Länder	23,09	20,38
<b>Summe</b>	<b>110,50</b>	<b>97,54</b>

Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

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

## Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2023 des Teilfonds

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

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg in 1.000	Bestand	Kurs zum 30.06.2023	Kurswert in EUR	in % des Netto- vermögens
<b>Amtlich gehandelte Wertpapiere / Regulierter Markt</b>						
<b>Aktien</b>						
Abu Dhabi Islamic Bank Inhaber-Aktien VE 10	AEA000801018	STK	122.737,00	AED 10,6400	325.885,68	0,29
Emirates NBD PJSC Inhaber-Aktien VE 1	AEE000801010	STK	200.000,00	AED 14,8500	741.147,41	0,65
Banco do Brasil S.A. Registered Shares o.N.	BRBBASACNOR3	STK	41.700,00	BRL 49,4000	391.407,94	0,35
Cia En. de Minas Gerais-CEMIG Reg. Preferred Shares RB 5	BRCMIGACNPR3	STK	103.999,00	BRL 12,8600	254.118,78	0,22
Cielo S.A. Registered Shares o.N.	BRCIELACNOR3	STK	274.400,00	BRL 4,5900	239.311,42	0,21
CPFL Energia SA Registered Shares o.N.	BRCPFACNOR0	STK	21.600,00	BRL 34,3900	141.140,79	0,12
EDP - Energias do Brasil SA Registered Shares o.N.	BRENBRACNOR2	STK	50.000,00	BRL 23,6200	224.396,73	0,20
Gerdau S.A. Reg. Preferred Shares o.N.	BRGGBRACNPR8	STK	33.495,00	BRL 25,0700	159.551,52	0,14
Grupo Mateus S.A. Registered Shares o.N.	BRGMATACNOR7	STK	168.800,00	BRL 7,9200	254.017,86	0,22
Itau Unibanco Holding S.A. Reg. Preferred Shares o.N.	BRITUBACNPR1	STK	100.000,00	BRL 28,4200	539.996,20	0,48
Metalúrgica Gerdau S.A. Reg. Preferred Shares o.N.	BRGOAUACNPR8	STK	50.000,00	BRL 11,8200	112.293,37	0,10
Petroleo Brasileiro S.A. Reg. Preferred Shares o.N.	BRPETRACNPR6	STK	100.000,00	BRL 29,5300	561.086,83	0,50
Petroleo Brasileiro S.A. Registered Shares o.N.	BRPETRACNOR9	STK	80.000,00	BRL 33,1000	503.135,09	0,44
Raia Drogasil S.A. Registered Shares o.N.	BRRADLACNOR0	STK	79.352,00	BRL 29,6000	446.289,04	0,39
SLC Agricola S.A. Registered Shares o.N.	BRSLCEACNOR2	STK	42.300,00	BRL 38,2200	307.183,36	0,27
Ultrapar Participações S.A. Reg. Shares o.N.	BRUGPAACNOR8	STK	50.000,00	BRL 18,8900	179.460,38	0,16
Anhui Gujing Distillery Co.Ltd Registered Shares A YC 1	CNE000000MD5	STK	1.200,00	CNY 247,3800	37.457,70	0,03
Apeloa Pharmaceutical Co. Ltd. Registered Shares A YC 1	CNE000000Q45	STK	60.700,00	CNY 17,7400	135.874,37	0,12
Beijing Kingsoft Office Softwa Registered Shares Cl.A YC1	CNE100003PM2	STK	6.450,00	CNY 472,0100	384.154,71	0,34
Beijing United Information Tec Registered Shares A YC 1	CNE100003M28	STK	31.421,00	CNY 36,9300	146.418,03	0,13
By-health Co. Ltd. Registered Shares A YC 1	CNE100000Y84	STK	31.200,00	CNY 23,9800	94.405,88	0,08
China Nat.Softw. & Serv.Co.Ltd Registered Shares A YC 1	CNE000001BB0	STK	36.530,00	CNY 46,8800	216.088,93	0,19
China National Chem. Eng. Co. Registered Shares A YC 1	CNE100000KC0	STK	120.300,00	CNY 8,2800	125.687,25	0,11
China National Medicine Registered Shares A YC 1	CNE000001D56	STK	21.500,00	CNY 38,8500	105.396,15	0,09
Chongqing Zhif.Biol.Pr.Co.Ltd. Registered Shares A YC 1	CNE100000V20	STK	44.100,00	CNY 44,2000	245.955,26	0,22
CN Res.Sanju Med.&Phar.Co.Ltd Registered Shares A YC 1	CNE0000011K8	STK	32.300,00	CNY 60,6600	247.229,44	0,22
Daan Gene Co. Ltd. Registered Shares A YC 1	CNE000001KP1	STK	113.820,00	CNY 9,9700	143.188,78	0,13
Dashenlin Pharmaceutical Group Registered Shares A YC 1	CNE100002RG2	STK	42.360,00	CNY 28,0100	149.714,65	0,13
ENN Natural Gas Co. Ltd. Registered Shares A YC 1	CNE000000DG7	STK	47.100,00	CNY 18,9800	112.800,85	0,10
Foxconn Industrial Internet Registered Shares A YC1	CNE1000031P3	STK	24.900,00	CNY 25,2000	79.176,29	0,07
Fujian Sunner Developm.Co.Ltd. Registered Shares A YC 1	CNE100000G78	STK	32.300,00	CNY 19,1500	78.048,86	0,07
G-Bits Netw.Tec.(Xiamen)Co.Ltd Registered Shares A YC 1	CNE100002GK7	STK	6.700,00	CNY 491,1100	415.191,86	0,37
Guangdong Hec Tech.Hold.Co.Ltd Registered Shares A YC 1	CNE000000BL1	STK	130.600,00	CNY 7,2100	118.815,66	0,10
Guangzhou Shiyuan EI.Tech.Co. Registered Shares o.N.	CNE100002K47	STK	59.200,00	CNY 66,8400	499.290,61	0,44
Henan Shuanghui In.&De.Co.Ltd. Registered Shares A YC 1	CNE000000XM3	STK	135.100,00	CNY 24,4900	417.483,56	0,37
Hengdian Group DMEGC Magnetics Registered Shares A YC 1	CNE000001N70	STK	101.600,00	CNY 18,2100	233.452,70	0,21
Humanwell Healthcare (Grp) Co. Registered Shares A YC 1	CNE000000QW6	STK	11.400,00	CNY 26,9400	38.752,32	0,03
Hundsun Technologies Inc. Registered Shares A YC 1	CNE000001GD5	STK	53.500,00	CNY 44,2900	298.988,66	0,26
Inspur Electro.Info.Ind.Co.Ltd Registered Shares A YC 1	CNE0000012M2	STK	34.500,00	CNY 48,5000	211.132,98	0,19
Joincare Pharmaceut.Ind. Group Registered Shares A YC 1	CNE000001816	STK	63.500,00	CNY 12,7100	101.839,09	0,09
Lepu Medical Techn.Beij.Co.Ltd Registered Shares A YC 1	CNE100000H44	STK	128.100,00	CNY 22,6100	365.464,28	0,32
NAURA Technology Group Co.Ltd. Registered Shares A YC 1	CNE100000ML7	STK	3.500,00	CNY 317,6500	140.285,30	0,12
Ningbo Ronb.New Energ.Tech.Co. Registered Shares A YC 1	CNE100003MS6	STK	9.421,00	CNY 54,0200	64.216,53	0,06
Shandong Buchang Pharm.Co.Ltd. Registered Shares A YC 1	CNE100002FV6	STK	12.100,00	CNY 20,5900	31.436,70	0,03
Shenzhen Kedali Industry Co. Registered Shares A YC1	CNE100002JW6	STK	21.500,00	CNY 132,2500	358.780,96	0,32
Shenzhen Mindray Bio-Med.Elec. Registered Shares A YC1	CNE100003G67	STK	1.700,00	CNY 299,8000	64.309,60	0,06
Shenzhen New Ind.Biomed.Eng.Co Registered Shares Cl.A YC 1	CNE100003T39	STK	22.300,00	CNY 59,0000	166.016,83	0,15
Shenzhen SC New Energy Technol Registered Shares A YC 1	CNE100003G91	STK	8.600,00	CNY 112,3500	121.917,70	0,11
Shijiazhuang Yil.Pharm.Co.Ltd. Registered Shares A YC 1	CNE1000015S0	STK	90.200,00	CNY 25,6900	292.392,27	0,26
Sungrow Power Supply Co. Ltd. Registered Shares A YC 1	CNE1000018M7	STK	19.700,00	CNY 116,6300	289.915,71	0,26
TCL Zhonghuan Renew.Ener.Tech. Registered Shares A YC 1	CNE1000000B8	STK	19.000,00	CNY 33,2000	79.595,21	0,07

Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

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

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg in 1.000	Bestand	Kurs zum 30.06.2023	Kurswert in EUR	in % des Netto- Teilfonds- vermögens	
Unisplendour Corp. Ltd. Registered Shares A YC 1	CNE0000010T1	STK	128.300,00	CNY	31,8500	515.621,88	0,46
Wuhu Sanqi Inter.Ent.N.T.Gr.Co Registered Shares A YC 1	CNE1000010N2	STK	128.400,00	CNY	34,8800	565.114,89	0,50
WUS Printed Circuit[Kushan]Co. Registered Shares A YC 1	CNE100000SP5	STK	99.900,00	CNY	20,9400	263.959,57	0,23
Yifeng Pharmacy Chain Co. Ltd. Registered Shares A YC 1	CNE100001TS5	STK	35.420,00	CNY	37,0000	165.365,74	0,15
CEZ AS Inhaber-Aktien KC 100	CZ0005112300	STK	15.252,00	CZK	900,0000	577.763,75	0,51
Alpha Services and Holdings SA Namens-Aktien EO -,29	GRS015003007	STK	43.086,00	EUR	1,5000	64.629,00	0,06
Jumbo S.A. Namens-Aktien EO 0,88	GRS282183003	STK	18.584,00	EUR	25,2000	468.316,80	0,41
Mytilineos S.A. Namens-Aktien EO 0,97	GRS393503008	STK	2.780,00	EUR	32,3400	89.905,20	0,08
Piraeus Financial Holdings SA Namens-Aktien EO 0,93	GRS014003032	STK	76.113,00	EUR	3,0060	228.795,68	0,20
3SBio Inc. Registered Shares DL -,00001	KYG8875G1029	STK	174.000,00	HKD	7,8700	160.167,02	0,14
Agricult. Bk of China, The Registered Shares H YC 1	CNE100000Q43	STK	789.000,00	HKD	3,0800	284.234,53	0,25
Alibaba Group Holding Ltd. Registered Shares o.N.	KYG017191142	STK	211.700,00	HKD	81,2000	2.010.601,54	1,78
Alibaba Health Inform.Tech.Ltd Registered Shares HD -,01	BMG0171K1018	STK	778.000,00	HKD	4,7100	428.597,49	0,38
Aluminum Corp. of China Ltd. Registered Shares H YC 1	CNE1000001T8	STK	180.000,00	HKD	3,3700	70.949,86	0,06
Bank of China Ltd. Registered Shares H YC 1	CNE1000001Z5	STK	871.000,00	HKD	3,1400	319.887,25	0,28
Bank of Communications Co.Ltd. Registered Shares H YC 1	CNE100000205	STK	415.000,00	HKD	5,1900	251.921,12	0,22
Bosideng Intl Hldgs Ltd. Registered Shares DL-,00001	KYG126521064	STK	352.000,00	HKD	3,3000	135.864,42	0,12
C&D Intl Invst Grp Ltd. Registered Shares HD-,1	KYG3165D1097	STK	161.000,00	HKD	17,7600	334.439,80	0,30
China CITIC Bank Corp. Ltd. Registered Shares H YC 1	CNE1000001Q4	STK	110.000,00	HKD	3,6800	47.346,69	0,04
China Cmncnts Srvc Corp.Ltd. Registered Shares H YC 1	CNE1000002G3	STK	228.000,00	HKD	3,8600	102.936,95	0,09
China Construction Bank Corp. Registered Shares H YC 1	CNE1000002H1	STK	2.443.000,00	HKD	5,0700	1.448.706,97	1,28
China Everbright Bank Co. Ltd. Registered Shares H YC 1	CNE100001QW3	STK	133.000,00	HKD	2,2500	35.001,23	0,03
China Life Insurance Co. Ltd. Registered Shares H YC 1	CNE1000002L3	STK	480.000,00	HKD	13,0600	733.218,71	0,65
China Medical System Holdings Reg. Consolid. Shares DL-,005	KYG211081248	STK	156.000,00	HKD	12,7600	232.822,20	0,21
China Minsheng Banking Corp. Registered Shares H YC 1	CNE100000HF9	STK	150.000,00	HKD	2,9000	50.878,98	0,04
China Overseas Ppty Hldgs Ltd. Registered Shares HD-,001	KYG2118M1096	STK	270.000,00	HKD	7,8900	249.166,64	0,22
China Pacific Insurance(Grp)Co Registered Shares H YC 1	CNE1000009Q7	STK	232.600,00	HKD	20,2500	550.914,07	0,49
China Petroleum & Chemi. Corp. Registered Shares H YC 1	CNE1000002Q2	STK	240.000,00	HKD	4,5900	128.846,63	0,11
China Railway Group Ltd. Registered Shares H YC 1	CNE1000007Z2	STK	490.000,00	HKD	5,1700	296.302,79	0,26
China Resources Land Ltd. Registered Shares HD -,10	KYG2108Y1052	STK	48.000,00	HKD	33,2000	186.392,51	0,16
China Resources Power Hldgs Co Registered Shares o.N.	HK0836012952	STK	48.000,00	HKD	17,7000	99.371,91	0,09
China Southern Airlines Co.Ltd Registered Shares H YC 1	CNE1000002T6	STK	630.000,00	HKD	4,4200	325.695,64	0,29
China Tradition.C.Med.Hldg.Co. Registered Shares o.N.	HK0000056256	STK	250.000,00	HKD	3,6500	106.728,89	0,09
CITIC Ltd. Registered Shares o.N.	HK0267001375	STK	53.000,00	HKD	9,3500	57.961,10	0,05
CMOC Group Ltd. Registered Shares H YC -,20	CNE100000114	STK	570.000,00	HKD	4,1000	273.342,92	0,24
COSCO SHIPPING Holdings Co.Ltd Registered Shares H YC 1	CNE1000002J7	STK	403.600,00	HKD	7,0600	333.276,72	0,29
Dongyue Group Ltd. Registered Shares o.N.	KYG2816P1072	STK	125.000,00	HKD	5,8600	85.675,52	0,08
Grand Pharmaceutical Group Ltd Reg.Ajusted Shares HD -,01	BMG210A71016	STK	58.000,00	HKD	4,4200	29.984,68	0,03
Health & Happiness (H&H) Int. Registered Shares HD -,01	KYG4387E1070	STK	45.000,00	HKD	10,0800	53.054,49	0,05
Industr. & Commerc.Bk of China Registered Shares H YC 1	CNE1000003G1	STK	902.000,00	HKD	4,1800	440.993,25	0,39
Kerry Properties Ltd. Registered Shares HD 1	BMG524401079	STK	100.000,00	HKD	16,2400	189.948,19	0,17
Kingboard Holdings Ltd. Registered Shares HD -,10	KYG525621408	STK	103.500,00	HKD	21,3500	258.456,44	0,23
Kingboard Laminates Hldgs Ltd. Registered Shares HD -,10	KYG5257K1076	STK	215.500,00	HKD	7,3700	185.765,00	0,16
Kunlun Energy Co. Ltd. Registered Shares HD -,01	BMG5320C1082	STK	286.000,00	HKD	6,1600	206.061,03	0,18
Lenovo Group Ltd. Registered Shares o.N.	HK0992009065	STK	366.000,00	HKD	8,1700	349.745,61	0,31
Meituan Registered Shs Cl.B o.N.	KYG596691041	STK	12.070,00	HKD	122,3000	172.656,47	0,15
New China Life Insurance Co. Registered Shares H YC 1	CNE100001922	STK	61.800,00	HKD	20,6500	149.264,89	0,13
New Oriental Educat.&Techn.Grp Registered Shares DL -,0,001	KYG6470A1168	STK	16.300,00	HKD	30,7500	58.624,86	0,05
NongFu Spring Co. Ltd. Registered Shares H YC 1	CNE100004272	STK	48.200,00	HKD	43,2500	243.827,27	0,22
Orient Overseas (Intl.) Ltd. Registered Shares New DL -,10	BMG677491539	STK	12.000,00	HKD	105,1000	147.513,95	0,13
Pacific Basin Shipping Ltd. Registered Shares DL -,01	BMG684371393	STK	179.000,00	HKD	2,3800	49.828,65	0,04
People's Ins.Co.(Gr.) o.Ch.Ltd Registered Shares H YC 1	CNE100001MK7	STK	391.000,00	HKD	2,8400	129.880,58	0,11
PICC Property & Casualty Co. Registered Shares H YC 1	CNE100000593	STK	70.000,00	HKD	8,7100	71.312,44	0,06
Postal Savings Bank of China Registered Shares H YC 1	CNE1000029W3	STK	341.000,00	HKD	4,8200	192.243,00	0,17
Sany Heavy Equipment Intl Co. Registered Shs REG S o.N.	KYG781631059	STK	100.000,00	HKD	10,2600	120.004,21	0,11
Shandong Weigao Grp Med. Pol. Registered Shares H YC -,10	CNE100000171	STK	197.200,00	HKD	10,2400	236.187,00	0,21
Shanghai Pharmaceuticals Hdgs Registered Shares H YC 1	CNE1000012B3	STK	296.800,00	HKD	15,5200	538.771,65	0,48
Sinopharm Group Co. Ltd. Registered Shares H YC 1	CNE100000FN7	STK	18.000,00	HKD	24,5000	51.580,76	0,05

Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

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

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg in 1.000	Bestand	Kurs zum 30.06.2023	Kurswert in EUR	in % des Netto- Teilfonds- vermögens
Sun Hung Kai Properties Ltd. Registered Shares o.N.	HK0016000132	STK	42.500,00	HKD 98,7000	490.631,25	0,43
Tencent Holdings Ltd. Reg. Shares HD -,00002	KYG875721634	STK	88.700,00	HKD 331,6000	3.440.228,31	3,04
Theme International Hldgs Ltd. Registered Shares HD-,0025	BMG8800F1876	STK	930.000,00	HKD 0,8800	95.722,66	0,08
Tianneng Power Intern. Ltd. Registered Shares HD -,1	KYG8655K1094	STK	86.000,00	HKD 8,0900	81.375,95	0,07
Tingyi (Cayman Isl.)Hldg Corp. Registered Shares DL -,005	KYG8878S1030	STK	354.000,00	HKD 12,1800	504.312,43	0,45
Uni-President China HLDGS Ltd. Registered Shares o.N.	KYG9222R1065	STK	138.000,00	HKD 6,6000	106.530,05	0,09
Vinda International Hldgs Ltd. Registered Shares HD -,10	KYG9361V1086	STK	45.000,00	HKD 19,5000	102.635,18	0,09
Vitasoy Intl Holdings Ltd. Registered Shares o.N.	HK0345001611	STK	104.000,00	HKD 9,7600	118.722,29	0,10
VTech Holdings Ltd. Reg.Shs (BL 100) DL -,05	BMG9400S1329	STK	31.400,00	HKD 51,4000	188.773,88	0,17
Weichai Power Co. Ltd. Registered Shares H YC 1	CNE1000004L9	STK	359.000,00	HKD 11,4800	482.042,64	0,43
Yadea Group Holdings Ltd. Registered Shares DL -,0001	KYG9830F1063	STK	230.000,00	HKD 17,8200	479.385,24	0,42
Yankuang Energy Group Co. Ltd. Registered Shares H YC 1	CNE1000004Q8	STK	74.000,00	HKD 22,4500	194.310,91	0,17
Yue Yuen Indust.(Hldgs) Ltd. Registered Shares HD -,25	BMG988031446	STK	150.000,00	HKD 10,2400	179.655,43	0,16
ZTE Corp. Registered Shares H YC 1	CNE1000004Y2	STK	197.200,00	HKD 31,4000	724.245,30	0,64
OTP Bank Nyrt. Namens-Aktien UF 100	HU0000061726	STK	22.574,00	HUF 12.130,0000	734.108,90	0,65
Richter Gedeon Vegye.Gyár Nyrt Namens-Aktien UF 100	HU0000123096	STK	10.461,00	HUF 8.420,0000	236.143,75	0,21
Adaro Energy Indonesia Tbk, PT Registered Shares RP 100	ID1000111305	STK	1.000.000,00	IDR 2.230,0000	136.334,59	0,12
Astra International TBK, PT Registered Shares RP 50	ID1000122807	STK	1.204.800,00	IDR 6.775,0000	499.028,61	0,44
Bank Central Asia TBK, PT Registered Shares RP 12,50	ID1000109507	STK	1.366.700,00	IDR 9.150,0000	764.531,66	0,68
Ciputra Development, PT Registered Shares RP 250	ID1000115306	STK	2.377.700,00	IDR 1.060,0000	154.086,33	0,14
Indofood Sukses Makmur Tbk, PT Registered Shares RP 100	ID1000057003	STK	101.900,00	IDR 7.350,0000	45.789,16	0,04
Mitra Adiperkasa Tbk, PT Registered Shares RP 500	ID1000099807	STK	588.800,00	IDR 1.690,0000	60.835,31	0,05
PT Bank Mandiri (Persero) TBK Registered Shares RP 125	ID1000095003	STK	2.330.200,00	IDR 5.200,0000	740.794,46	0,65
PT Bank Negara Indonesia Registered Shares RP 7500	ID1000096605	STK	911.000,00	IDR 9.150,0000	509.613,19	0,45
PT Bank Tabung.Neg.(Pers.)Tbk Registered Shares RP 500	ID1000113707	STK	922.100,00	IDR 1.320,0000	74.413,74	0,07
PT Bumi Serpong Damai Tbk Registered Shares RP 100	ID1000110802	STK	2.532.000,00	IDR 1.095,0000	169.503,63	0,15
PT Indosat TBK Registered Shares RP 100	ID1000097405	STK	70.700,00	IDR 8.625,0000	37.280,33	0,03
PT Perusahaan Gas Negara Tbk Registered Shares RP 100	ID1000111602	STK	452.800,00	IDR 1.305,0000	36.125,85	0,03
Sumber Alfaria Trijaya Tbk PT Registered Shares RP 10	ID1000128705	STK	754.000,00	IDR 2.580,0000	118.930,22	0,11
BGF Retail Co. Ltd. Registered Shares SW 1000	KR7282330000	STK	2.019,00	KRW 174.900,0000	245.641,26	0,22
DB Insurance Co. Ltd. Registered Shares SW 500	KR7005830005	STK	5.829,00	KRW 74.600,0000	302.487,94	0,27
Doosan Bobcat Inc. Registered Shares SW 500	KR7241560002	STK	5.000,00	KRW 58.700,0000	204.165,94	0,18
Hana Financial Group Inc. Registered Shares SW 5000	KR7086790003	STK	15.045,00	KRW 39.200,0000	410.254,58	0,36
Hankook Tire&Technology Co.Ltd Registered Shares SW 500	KR7161390000	STK	3.423,00	KRW 34.400,0000	81.910,68	0,07
Hanmi Pharmaceutical Co. Ltd. Registered Shares SW 2500	KR7128940004	STK	93,00	KRW 308.500,0000	19.957,83	0,02
HD Hyundai Co. Ltd. Registered Shares SW 1000	KR7267250009	STK	1.722,00	KRW 59.900,0000	171.752,19	0,06
HMM Co. Ltd. Registered Shares SW 5000	KR7011200003	STK	13.457,00	KRW 18.850,0000	776.455,33	0,16
Hotel Shilla Ltd. Registered Shares SW 5000	KR7008770000	STK	5.817,00	KRW 73.400,0000	297.009,48	0,26
Hyundai Glovis Co. Ltd. Registered Shares SW 500	KR7086280005	STK	2.386,00	KRW 197.700,0000	328.134,80	0,29
HYUNDAI MOBIS Registered Shares SW 5000	KR7012330007	STK	1.779,00	KRW 232.500,0000	287.722,67	0,25
Hyundai Motor Co. Ltd. Reg.Pfd Shares II Em.99 SW5000	KR7005382007	STK	7.736,00	KRW 109.700,0000	590.334,65	0,52
Hyundai Motor Co. Ltd. Registered Pfd Shares SW 5000	KR7005381009	STK	7.055,00	KRW 108.800,0000	533.950,62	0,47
Hyundai Motor Co. Ltd. Registered Shares SW 5000	KR7005380001	STK	798,00	KRW 206.500,0000	114.629,96	0,10
Hyundai Steel Co. Registered Shares SW 5000	KR7004020004	STK	6.381,00	KRW 33.750,0000	149.808,93	0,13
Industrial Bank of Korea Registered Shares SW 5000	KR7024110009	STK	20.000,00	KRW 10.340,0000	143.855,25	0,13
KB Financial Group Inc. Registered Shares SW 5000	KR7105560007	STK	25.252,00	KRW 47.750,0000	838.772,80	0,74
Kia Corp. Registered Shares SW 5000	KR7000270009	STK	11.140,00	KRW 88.500,0000	685.809,73	0,61
Korean Air Lines Co. Ltd. Registered Shares SW 5000	KR7003490000	STK	5.686,00	KRW 24.350,0000	96.312,13	0,09
LG Electronics Inc. (new) Registered Shares SW 5000	KR7066570003	STK	7.394,00	KRW 126.700,0000	651.675,28	0,58
LG Uplus Corp. Registered Shares SW 5000	KR7032640005	STK	23.429,00	KRW 10.730,0000	174.875,37	0,15
LX International Corp. Registered Shares SW 5000	KR7001120005	STK	5.136,00	KRW 36.050,0000	128.796,92	0,11
Orion Corp. of Republic of Kor Registered Shares KRW 5000	KR7271560005	STK	2.500,00	KRW 120.000,0000	208.687,50	0,18
POSCO Holdings Inc. Registered Shares SW 5000	KR7005490008	STK	2.015,00	KRW 388.000,0000	543.853,54	0,48
Posco International Corp. Registered Shares SW 5000	KR7047050000	STK	9.313,00	KRW 39.850,0000	258.162,47	0,23
Samsung Electro-Mechan.Co.Ltd. Registered Shares SW 5000	KR7009150004	STK	1.134,00	KRW 144.500,0000	113.987,20	0,10
Samsung Electronics Co. Ltd. Reg Pref. Shares SW 100	KR7005931001	STK	5.246,00	KRW 59.500,0000	217.130,30	0,19
Samsung Electronics Co. Ltd. Registered Shares SW 100	KR7005930003	STK	59.039,00	KRW 72.200,0000	2.965.182,13	2,62
Samsung Engineering Co. Ltd. Registered Shares SW 5000	KR7028050003	STK	27.035,00	KRW 28.300,0000	532.216,08	0,47

Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

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

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg in 1.000	Bestand	Kurs zum 30.06.2023	Kurswert in EUR	in % des Netto- Teilfonds- vermögens
Samsung Fire&Marine Ins.Co.Ltd Registered Shares SW 500	KR7000810002	STK	1.876,00	KRW 230.000,0000	300.148,28	0,27
Samsung Life Insurance Co. Ltd Registered Shares SW 5000	KR7032830002	STK	5.000,00	KRW 67.300,0000	234.077,81	0,21
Samsung Securities Co. Ltd. Registered Shares SW 5000	KR7016360000	STK	10.000,00	KRW 36.000,0000	250.425,00	0,22
Shinhan Financial Group Co.Ltd Registered Shares SW 5000	KR7055550008	STK	27.765,00	KRW 34.000,0000	656.676,96	0,58
SK Telecom Co. Ltd. Registered Shares SW 100	KR7017670001	STK	5.199,00	KRW 46.600,0000	168.531,43	0,15
Woori Financial Group Inc. Registered Shares SW 5000	KR7316140003	STK	40.000,00	KRW 11.790,0000	328.056,75	0,29
Alfa S.A.B. de C.V. Registered Shares Class A o.N.	MXP000511016	STK	223.200,00	MXN 10,6500	127.040,49	0,11
América Móvil S.A.B. de C.V. Registered Shares B o.N.	MX01AM050019	STK	850.000,00	MXN 18,6000	844.948,48	0,75
Cemex S.A.B. de C.V. Ct.Ptg.O.nom.(2SHS A+1SHS B)oN	MXP225611567	STK	380.300,00	MXN 12,1000	245.929,18	0,22
Controladora AXTEL S.A.B. de C Registered Shares MN -,05	MX01CT0D0002	STK	223.200,00	MXN 0,2220	2.648,17	0,00
Gruma S.A.B. de C.V. Registered Shares Class B o.N.	MXP4948K1056	STK	23.945,00	MXN 274,7800	351.640,04	0,31
Grupo Bimbo S.A.B. de C.V. Registered Shares Class A o.N.	MXP495211262	STK	40.300,00	MXN 91,6500	197.394,88	0,17
Grupo Financ.Banorte SAB de CV Registered Shares Class O o.N.	MXP370711014	STK	105.000,00	MXN 141,2100	792.415,77	0,70
Kimberly-Clark d.Mex.SAB de CV Registered Shares Class A o.N.	MXP606941179	STK	60.000,00	MXN 38,0700	122.076,62	0,11
Orbia Advance Corp. SAB de CV Registered Shares o.N.	MX01OR010004	STK	146.500,00	MXN 36,8800	288.753,26	0,26
Wal-Mart de Mexico SAB de CV Registered Shares Class V o.N.	MX01WA000038	STK	112.200,00	MXN 67,7200	406.076,79	0,36
Fraser & Neave Holdings Berhad Registered Shares MR 1	MYL368900006	STK	23.800,00	MYR 25,2200	117.873,61	0,10
Gamuda Berhad Registered Shares MR 1	MYL539800002	STK	335.100,00	MYR 4,4000	289.548,72	0,26
KPJ Healthcare Berhad Registered Shares MR o.N.	MYL587800003	STK	600.000,00	MYR 1,1200	131.966,54	0,12
Petronas Dagangan Berhad Registered Shares MR 1	MYL568100001	STK	135.900,00	MYR 22,2000	592.470,84	0,52
QL Resources Bhd Registered Shares MR -,25	MYL708400006	STK	200.000,00	MYR 5,3600	210.518,05	0,19
Tenaga Nasional Berhad Registered Shares MR 1	MYL534700009	STK	189.100,00	MYR 9,0500	336.073,80	0,30
TIME dotCom Bhd Registered Shares MR 0,5	MYL503100009	STK	190.000,00	MYR 5,2000	194.022,23	0,17
Yinson Holdings Berhad Registered Shares MR 0,5	MYL729300003	STK	300.000,00	MYR 2,5600	150.818,90	0,13
Aboitiz Equity Ventures Inc. Registered Shares PP 1	PHY0001Z1040	STK	334.800,00	PHP 54,4000	302.429,48	0,27
BDO Unibank Inc. Registered Shares PP 10	PHY077751022	STK	187.836,00	PHP 137,7000	429.489,50	0,38
Bk of the Philippine Islands Registered Shares PP 10	PHY0967S1694	STK	170.756,00	PHP 108,8000	308.492,53	0,27
Intl Container Term. Svcs Inc. Registered Shares PP 1	PHY411571011	STK	11.680,00	PHP 203,8000	39.526,36	0,03
Metropolitan Bank & Trust Co. Registered Shares PP 20	PHY6028G1361	STK	269.900,00	PHP 55,7000	249.630,62	0,22
LPP S.A. Inhaber-Aktien ZY 2	PLLPP0000011	STK	50,00	PLN 14.010,0000	158.031,88	0,14
Polski Koncern Naftowy Orlen Inhaber-Aktien ZY 1,25	PLPKN0000018	STK	47.418,00	PLN 64,4100	689.022,00	0,61
Powszechny Zaklad Ubezpieczen Namens-Aktien ZY 0,10	PLPZU0000011	STK	53.729,00	PLN 39,4100	477.696,16	0,42
Santander Bank Polska S.A. Inhaber-Aktien ZY 10	PLBZ00000044	STK	1.300,00	PLN 389,0000	114.085,25	0,10
Dr. Sulaiman Al Habib Medical Registered Shares RS 10	SA1510P1UMH1	STK	2.500,00	SAR 286,2000	174.853,37	0,15
Elm Co. Registered Shares RS 10	SA15GG53GHH3	STK	2.000,00	SAR 582,0000	284.457,48	0,25
Etiihad Etisalat Co. Registered Shares RS 10	SA000A0DM9P2	STK	52.000,00	SAR 47,9000	608.699,90	0,54
Mobile Telecommunications Co. Registered Shares RS 10	SA121053DR18	STK	145.000,00	SAR 14,1600	501.759,53	0,44
Saudi Arabian Oil Co. Registered Shares RS 10	SA14TG012N13	STK	59.219,00	SAR 32,2500	466.718,66	0,41
Saudi Awwal Bank Registered Shares RS 50	SA0007879089	STK	20.000,00	SAR 38,1500	186.461,39	0,16
Saudi Investment Bank Registered Shares RS 50	SA0007879063	STK	50.000,00	SAR 17,0600	208.455,52	0,18
Savola Group Registered Shares RS 10	SA0007879162	STK	80.000,00	SAR 41,6500	814.271,75	0,72
Bangkok Dusit Med.Ser.PCL Reg. Shares (NVDRs) BA 1	TH0264010R10	STK	688.500,00	THB 27,7500	493.929,25	0,44
Berli Jucker PCL (BJC) Reg. Shares (NVDRs) BA 1	TH0002010R14	STK	235.000,00	THB 34,7500	211.115,68	0,19
Central Retail Corp. PCL Reg. Shares (NVDR) BA1	TH9597010R14	STK	515.900,00	THB 39,0000	520.149,22	0,46
Delta Electronics (Thai.)PCL Reg. Shares(NVDRs)BA 0,1	TH0528010R18	STK	155.000,00	THB 91,7500	367.650,86	0,32
Krung Thai Bank PCL Reg. Shares (NVDRs) BA 5,15	TH0150010R11	STK	876.600,00	THB 19,4000	439.643,86	0,39
Thai Oil PCL Reg. Shares (NVDRs) BA 10	TH0796010R11	STK	198.800,00	THB 44,2500	227.419,38	0,20
BIM Birlesik Magazalar A.S. Inhaber-Aktien TN 1	TREBIMM00018	STK	23.389,00	TRY 170,5000	140.207,03	0,12
Koc Holding A.S. Namens-Aktien TN 1	TRAKCHOL91Q8	STK	71.955,00	TRY 103,7000	262.345,42	0,23
Accton Technology Corp. Registered Shares TA 10	TW0002345006	STK	15.000,00	TWD 349,0000	154.067,33	0,14
ASE Technology Holding Co. Ltd Registered Shares TA 10	TW0003711008	STK	137.000,00	TWD 110,5000	445.529,77	0,39
Asia Vital Components Co. Ltd. Registered Shares TA 10	TW0003017000	STK	20.000,00	TWD 271,0000	159.511,93	0,14
Chunghwa Telecom Co. Ltd. Registered Shares TA 10	TW0002412004	STK	128.000,00	TWD 116,5000	438.863,82	0,39
Far Eastone Telecom. Co. Ltd. Registered Shares TA 10	TW0004904008	STK	126.000,00	TWD 78,6000	291.465,38	0,26
First Finl Holding Co. Ltd Registered Shares TA 10	TW0002892007	STK	250.000,00	TWD 27,6500	203.436,57	0,18
Giga-Byte Technology Co. Ltd. Registered Shares TA 10	TW0002376001	STK	74.000,00	TWD 243,5000	530.303,59	0,47
Global Unichip Corp. Registered Shares TA 10	TW0003443008	STK	1.000,00	TWD 1.605,0000	47.235,54	0,04
Gold Circuit Electronics Ltd. Registered Shares TA 10	TW0002368008	STK	112.300,00	TWD 146,0000	482.532,41	0,43

Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

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

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg in 1.000	Bestand	Kurs zum 30.06.2023	Kurswert in EUR	in % des Netto- Teilfonds- vermögens	
Intl Games Sys Co. Ltd. Registered Shares TA 10	TW0003293007	STK	28.000,00	TWD	618,0000	509.260,96	0,45
Inventec Corp. Registered Shares TA 10	TW0002356003	STK	70.000,00	TWD	43,2000	88.997,06	0,08
Lite-On Technology Corp. Registered Shares TA 10	TW0002301009	STK	151.000,00	TWD	103,5000	459.950,59	0,41
OTES Co. Ltd. Registered Shares TA 10	TW0003530006	STK	16.000,00	TWD	860,0000	404.960,17	0,36
Makalot Industrial Co.Ltd. Registered Shares TA 10	TW0001477008	STK	76.000,00	TWD	302,0000	675.482,99	0,60
Micro-Star Internation.Co.Ltd. Registered Shares TA 10	TW0002377009	STK	114.000,00	TWD	176,5000	592.165,96	0,52
MiTAC Holdings Corp. Registered Shares TA 10	TW0003706008	STK	233.000,00	TWD	34,9500	239.660,79	0,21
Novatek Microelectronics Corp. Registered Shares TA 10	TW0003034005	STK	46.000,00	TWD	426,5000	577.391,98	0,51
Pegatron Corp. Registered Shares TA 10	TW0004938006	STK	70.000,00	TWD	74,8000	154.096,76	0,14
POYA International Co. Ltd. Registered Shares TA 10	TW0005904007	STK	15.000,00	TWD	592,0000	261.340,58	0,23
Qisda Corp. Registered Shares TA 10	TW0002352002	STK	240.000,00	TWD	45,9000	324.203,58	0,29
Quanta Computer Inc. Registered Shares TA 10	TW0002382009	STK	63.000,00	TWD	152,0000	281.824,03	0,25
Simplo Technology Co. Ltd. Registered Shares TA 10	TW0006121007	STK	20.000,00	TWD	328,5000	193.356,71	0,17
Sinbon Electronics Co. Ltd. Registered Shares TA 10	TW0003023008	STK	40.000,00	TWD	369,5000	434.979,02	0,38
Synnex Technology Intl Corp. Registered Shares TA 10	TW0002347002	STK	293.000,00	TWD	58,0000	500.137,59	0,44
Ta Chen Stainless Pipe Registered Shares TA 10	TW0002027000	STK	172.700,00	TWD	47,4000	240.915,40	0,21
Taishin Financial Hldgs Co.Ltd Registered Shares TA 10	TW0002887007	STK	1.055.000,00	TWD	18,9000	586.824,37	0,52
Taiwan Mobile Co. Ltd. Registered Shares TA 10	TW0003045001	STK	74.000,00	TWD	95,6000	208.201,33	0,18
Taiwan Semiconduct.Manufact.Co Registered Shares TA 10	TW0002330008	STK	158.000,00	TWD	576,0000	2.678.387,75	2,37
Topco Scientific Co. Ltd. Registered Shares TA 10	TW0005434005	STK	52.000,00	TWD	182,5000	279.293,03	0,25
Tung Ho Steel Enterprise Corp. Registered Shares TA 10	TW0002006004	STK	21.000,00	TWD	59,5000	36.773,09	0,03
Union Bank of Taiwan Registered Shares TA 10	TW0002838000	STK	113.417,00	TWD	16,4500	54.908,29	0,05
United Integrated Ser.Co.Ltd. Registered Shares TA 10	TW0002404001	STK	44.000,00	TWD	218,0000	282.294,91	0,25
United Microelectronics Corp. Registered Shares TA 10	TW0002303005	STK	270.000,00	TWD	48,5000	385.389,06	0,34
Wiwynn Corp. Registered Shares TWD 10	TW0006669005	STK	15.000,00	TWD	1.420,0000	626.864,22	0,55
Alibaba Group Holding Ltd. Reg.Shs (sp.ADRs)/8 DL-,000025	US01609W1027	STK	6.500,00	USD	83,3500	496.585,70	0,44
Axis Bank Ltd. Reg. Shs (GDRs Reg.S)/5 IR 10	US05462W1099	STK	10.383,00	USD	59,7000	568.162,33	0,50
Banco de Chile Reg. Shs (Sp.ADRs)/200 o.N.	US0595201064	STK	15.000,00	USD	20,9600	288.175,99	0,25
Bancolumbia S.A. Reg.Prf.Shs(Sp.ADRs)/4 KP 500	US05968L1026	STK	17.100,00	USD	26,6800	418.174,15	0,37
Cía Cervecerías Unidas S.A. Acc. Nom.(Spons. ADRs)/2 CP 17	US2044291043	STK	36.342,00	USD	16,2300	540.633,05	0,48
Dr Reddy's Laboratories Ltd. Reg. Shares (Sp.ADRs)/1 IR 5	US2561352038	STK	35.636,00	USD	63,1100	2.061.400,51	1,82
Enel Chile S.A. Reg. Shs (Sp.ADRs)/50 o.N.	US29278D1054	STK	80.000,00	USD	3,3300	244.179,65	0,22
ICICI Bank Ltd. Reg.Shs (Spons.ADRs)/2 IR 10	US45104G1040	STK	60.000,00	USD	23,0800	1.269.294,23	1,12
Infosys Ltd. Reg. Shs (Spons.ADRs)/1 IR 5	US4567881085	STK	49.881,00	USD	16,0700	734.727,47	0,65
Taiwan Semiconduct.Manufact.Co Reg.Shs (Spons.ADRs)/5 TA 10	US8740391003	STK	26.537,00	USD	100,9200	2.454.733,31	2,17
Tencent Music Entertainment Gr Reg.Shares (Sp. ADRs) o.N.	US88034P1093	STK	64.300,00	USD	7,3800	434.953,25	0,38
Trip.com Group Ltd. Reg.Shares (Sp.ADRs) 1 o.N.	US89677Q1076	STK	15.900,00	USD	35,0000	510.082,49	0,45
Vipshop Holdings Ltd. Reg.Shares (Sp.ADRs)/2 o.N.	US92763W1036	STK	14.000,00	USD	16,5000	211.732,36	0,19
Yum China Hldgs Inc. Registered Shares DL-,01	US98850P1093	STK	14.500,00	USD	56,5000	750.916,59	0,66
African Rainbow Minerals Ltd. Registered Shares RC -,05	ZAE000054045	STK	6.816,00	ZAR	199,0100	65.814,13	0,06
Bid Corp. Ltd. Registered Shares o.N.	ZAE000216537	STK	20.028,00	ZAR	413,2900	401.612,40	0,35
Bidvest Group Ltd. Registered Shares New RC -,05	ZAE000117321	STK	27.000,00	ZAR	261,6300	342.740,90	0,30
Gold Fields Ltd. Registered Shares RC -,50	ZAE000018123	STK	60.000,00	ZAR	261,6400	761.675,57	0,67
Impala Platinum Holdings Ltd. Registered Shares o.N.	ZAE000083648	STK	46.862,00	ZAR	125,3200	284.941,59	0,25
Kumba Iron Ore Ltd. Registered Shares RC 0,01	ZAE000085346	STK	15.525,00	ZAR	442,5400	333.348,71	0,29
Motus Holdings Ltd. Registered Shares o.N.	ZAE000261913	STK	54.796,00	ZAR	100,1800	266.344,98	0,24
MTN Group Ltd. Registered Shares RC -,0001	ZAE000042164	STK	43.149,00	ZAR	138,1500	289.225,28	0,26
Nedbank Group Ltd. Registered Shares RC 1	ZAE000004875	STK	4.443,00	ZAR	228,5800	49.275,29	0,04
Northam Platinum Holdings Ltd Registered Shares o.N.	ZAE000298253	STK	30.000,00	ZAR	125,4800	182.646,10	0,16
Sasol Ltd. Registered Shares o.N.	ZAE000006896	STK	10.000,00	ZAR	233,2600	113.176,15	0,10
Standard Bank Group Ltd. Registered Shares RC-,10	ZAE000109815	STK	78.947,00	ZAR	177,5500	680.097,13	0,60
Tiger Brands Ltd. Registered Shares RC -,10	ZAE000071080	STK	26.811,00	ZAR	167,2300	217.541,36	0,19
Truworths International Ltd. Registered Shares RC-,00015	ZAE000028296	STK	110.822,00	ZAR	56,6000	304.338,61	0,27
Woolworths Holdings Ltd. Reg. Shares New RC o.N.	ZAE000063863	STK	100.468,00	ZAR	71,3500	347.805,44	0,31
<b>Andere Wertpapiere</b>							
Banco BTG Pactual S.A. Units (BDC) (1 Shs +2 Pfd A)	BRBPACUNT006	STK	13.000,00	BRL	31,4500	77.683,83	0,07
Coca-Cola FEMSA S.A.B. de C.V. Registered Units o.N.	MX01KO000002	STK	15.095,00	MXN	143,0800	115.427,80	0,10
Fomento Econom.Mexica.SAB D.CV Reg.Uts(1Share B + 4 Shs D)oN	MXP320321310	STK	55.000,00	MXN	189,5300	557.107,51	0,49

Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

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

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg in 1.000	Bestand		Kurs zum 30.06.2023	Kurswert in EUR	in % des Netto- Teilfonds- vermögens
<b>Organisierter Markt</b>							
<b>Aktien</b>							
Neoenergia S.A. Registered Shares o.N.	BRNEOEACNOR3	STK	106.200,00	BRL	21,2300	428.391,79	0,38
Mahindra & Mahindra Ltd. Reg. Shs (GDRs Reg.S)/1 IR 10	USY541641194	STK	13.655,00	USD	17,7000	221.533,91	0,20
Reliance Industries Ltd. Reg.Eqy Shs(GDRs144A)/2 IR 10	US7594701077	STK	18.500,00	USD	62,3000	1.056.416,13	0,93
State Bank of India Reg.Shs(GDRs Reg.S)/10IR 10	US8565522039	STK	12.195,00	USD	70,1000	783.565,08	0,69
Tata Steel Ltd. Reg. Shs (GDRs Reg S)/1 IR 1	US87656Y4061	STK	5.500,00	USD	13,3500	67.300,64	0,06
NEPI Rockcastle N.V. Aand.op naam EO -,01	NL0015000RT3	STK	100.000,00	ZAR	110,4700	535.992,84	0,47
<b>Wertpapier-Investmentanteile</b>							
UTI Gold.PLC-UTI Ind.Dyn.Eq.Fd Reg. Shares EUR Class o.N.	IE00BYPC7T68	ANT	476.668,66	EUR	21,1944	10.102.706,25	8,93
<b>Sonstige Wertpapiere</b>							
<b>Aktien</b>							
China Forestry Hldgs Co. i.L. Reg. Shares Reg S DL -,001	KYG2113A1004	STK	400.000,00	HKD	0,0000	0,00	0,00
Gazprom PJSC Registered Shares RL 5	RU0007661625	STK	22.330,00	RUB	12,9831	2.969,06	0,00
Inter RAO UES PJSC Registered Shares RL 2,809767	RU000A0JPNM1	STK	2.383.300,00	RUB	0,0605	1.476,92	0,00
LUKOIL PJSC Registered Shares RL -,025	RU0009024277	STK	1.900,00	RUB	38,3773	746,76	0,00
Novolipetskiy Metallurg. Komb. Registered Shares RL 1	RU0009046452	STK	65.110,00	RUB	1,1911	794,24	0,00
PIK-specialized Homebuil. PJSC Registered Shares RL 62,50	RU000A0JP7J7	STK	11.914,00	RUB	10,6583	1.300,46	0,00
Polymetal International PLC Registered Shares o.N.	JE00B6T5S470	STK	10.000,00	RUB	180,2000	18.454,69	0,02
Polyus PJSC Registered Shares RL 1	RU000A0JNAA8	STK	883,00	RUB	291,5744	2.636,71	0,00
Rosneft Oil Company Registered Shares RL -,01	RU000A0J2Q06	STK	14.460,00	RUB	6,5393	968,40	0,00
Sberbank of Russia PJSC Namensaktien RL 3	RU0009029540	STK	176.390,00	RUB	0,7623	1.377,11	0,00
Surgutneftegas PJSC Registered Pfd Shares RL 1	RU0009029524	STK	192.400,00	RUB	0,6730	1.326,16	0,00
Tatneft PJSC Registered Shares RL 1	RU0009033591	STK	50.000,00	RUB	15,4216	7.896,78	0,01
X 5 Retail Group N.V. Reg.Sh(spon.GDRs Reg S)1/4/EO1	US98387E2054	STK	9.329,00	RUB	124,2572	11.871,58	0,01
LUKOIL PJSC Reg. Shs (Sp. ADRs)/1 RL-,025	US69343P1057	STK	2.361,00	USD	0,3770	815,76	0,00
Magnit PJSC Reg.Shs(Sp.GDRsREGS)1/5/RL-,01	US55953Q2021	STK	13.143,00	USD	0,0065	78,21	0,00
Novolipetskiy Metallurg. Komb. Reg.Shs(Sp.GDRs RegS)/10 RL 1	US67011E2046	STK	5.456,00	USD	0,1655	827,89	0,00
<b>Summe Wertpapiervermögen</b>				<b>EUR</b>		<b>110.498.632,39</b>	<b>97,65</b>
<b>Derivate</b>							
<b>Aktienindex-Terminkontrakte</b>							
MSCI Emerging Markets Index Future 15.09.23		STK	33	USD	997,9000	-31.773,61	-0,03
<b>Devisenterminkontrakte Kauf</b>							
<b>offen (Kontrahent Verwahrstelle)</b>							
Devisenterminkontrakt Kauf BRL / CHF 14.07.23		BRL	945.037	EUR		-1.758,82	0,00
Devisenterminkontrakt Kauf CHF / EUR 03.07.23		CHF	642	EUR		1,11	0,00
Devisenterminkontrakt Kauf CNH / CHF 14.07.23		CNH	4.870.569	EUR		-7.450,03	-0,01
Devisenterminkontrakt Kauf CZK / CHF 14.07.23		CZK	950.560	EUR		10,44	0,00
Devisenterminkontrakt Kauf EUR / CHF 14.07.23		EUR	1.282.414	EUR		-3.635,29	0,00
Devisenterminkontrakt Kauf MYR / CHF 14.07.23		MYR	1.254.772	EUR		-1.044,99	0,00
Devisenterminkontrakt Kauf TRY / CHF 14.07.23		TRY	868.586	EUR		-1.484,56	0,00
Devisenterminkontrakt Kauf TWD / CHF 14.07.23		TWD	12.584.834	EUR		-2.355,48	0,00
Devisenterminkontrakt Kauf USD / CHF 14.07.23		USD	241.923	EUR		-854,75	0,00
Devisenterminkontrakt Kauf ZAR / CHF 14.07.23		ZAR	2.750.546	EUR		-3.103,65	0,00
<b>Devisenterminkontrakte Verkauf</b>							
<b>offen (Kontrahent Verwahrstelle)</b>							
Devisenterminkontrakt Verkauf BRL / CHF 14.07.23		BRL	-10.651.771	EUR		-1.248,40	0,00
Devisenterminkontrakt Verkauf CHF / EUR 04.07.23		CHF	-20.157	EUR		-29,95	0,00
Devisenterminkontrakt Verkauf CHF / EUR 05.07.23		CHF	-22.136	EUR		-17,28	0,00
Devisenterminkontrakt Verkauf CLP / CHF 14.07.23		CLP	-353.709.449	EUR		675,77	0,00
Devisenterminkontrakt Verkauf CNH / CHF 14.07.23		CNH	-29.568.044	EUR		118.585,45	0,10
Devisenterminkontrakt Verkauf CZK / CHF 14.07.23		CZK	-6.027.727	EUR		528,76	0,00

Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

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

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg in 1.000	Bestand	Kurs zum 30.06.2023	Kurswert in EUR	in % des Netto- Teilfonds- vermögens
Devisenterminkontrakt Verkauf EUR / CHF 14.07.23		EUR	-2.164.804	EUR	5.589,86	0,00
Devisenterminkontrakt Verkauf HKD / CHF 14.07.23		HKD	-70.958.597	EUR	123.565,67	0,11
Devisenterminkontrakt Verkauf HUF / CHF 14.07.23		HUF	-135.102.882	EUR	299,89	0,00
Devisenterminkontrakt Verkauf IDR / CHF 14.07.23		IDR	-21.609.456.342	EUR	29.420,42	0,03
Devisenterminkontrakt Verkauf INR / CHF 14.07.23		INR	-557.573.910	EUR	57.758,53	0,05
Devisenterminkontrakt Verkauf KRW / CHF 14.07.23		KRW	-7.487.649.813	EUR	201.418,94	0,18
Devisenterminkontrakt Verkauf MXN / CHF 14.07.23		MXN	-28.563.108	EUR	-53,09	0,00
Devisenterminkontrakt Verkauf MYR / CHF 14.07.23		MYR	-5.122.271	EUR	24.604,87	0,02
Devisenterminkontrakt Verkauf PHP / CHF 14.07.23		PHP	-30.832.530	EUR	-804,31	0,00
Devisenterminkontrakt Verkauf PLN / CHF 14.07.23		PLN	-2.510.768	EUR	-2.349,42	0,00
Devisenterminkontrakt Verkauf TRY / CHF 14.07.23		TRY	-5.262.023	EUR	13.937,97	0,01
Devisenterminkontrakt Verkauf TWD / CHF 14.07.23		TWD	-220.568.221	EUR	171.201,82	0,15
Devisenterminkontrakt Verkauf USD / CHF 14.07.23		USD	-2.787.612	EUR	31.965,91	0,03
Devisenterminkontrakt Verkauf ZAR / CHF 14.07.23		ZAR	-42.554.625	EUR	62.006,09	0,05
<b>Summe Derivate</b>				<b>EUR</b>	<b>783.607,87</b>	<b>0,69</b>
<b>Bankguthaben</b>						
<b>Bankkonten</b>						
Bankkonto RBC Investor Services Bank S.A.		BRL	26.234,40	EUR	4.984,69	0,00
Bankkonto RBC Investor Services Bank S.A.		CHF	19.544,85	EUR	20.024,44	0,02
Bankkonto RBC Investor Services Bank S.A.		CNY	39.306,81	EUR	4.959,79	0,00
Bankkonto RBC Investor Services Bank S.A.		EUR	1.511.058,01	EUR	1.511.058,01	1,34
Bankkonto RBC Investor Services Bank S.A.		IDR	51.096.829,13	EUR	3.123,89	0,00
Bankkonto RBC Investor Services Bank S.A.		KRW	4.104,00	EUR	2,85	0,00
Bankkonto RBC Investor Services Bank S.A.		MYR	3.760,20	EUR	738,42	0,00
Bankkonto RBC Investor Services Bank S.A.		PHP	121.526,23	EUR	2.017,95	0,00
Bankkonto RBC Investor Services Bank S.A.		SAR	43.553,01	EUR	10.643,45	0,01
Bankkonto RBC Investor Services Bank S.A.		TRY	0,01	EUR	0,00	0,00
Bankkonto RBC Investor Services Bank S.A.		TWD	24.465,00	EUR	720,01	0,00
Bankkonto RBC Investor Services Bank S.A.		USD	21.658,35	EUR	19.851,83	0,02
Bankkonto RBC Investor Services Bank S.A.		ZAR	0,04	EUR	0,00	0,00
Bankkonto UBS Ltd London		USD	194.351,17	EUR	178.140,39	0,16
Forderungen aus Variation Margin		USD	34.665,00	EUR	31.773,60	0,03
<b>Summe Bankguthaben</b>				<b>EUR</b>	<b>1.788.039,32</b>	<b>1,58</b>
<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>						
Dividendenforderungen		BRL	595.433,07	EUR	113.135,69	0,10
Dividendenforderungen		CZK	1.437.501,00	EUR	60.504,70	0,05
Dividendenforderungen		EUR	3.274,86	EUR	3.274,86	0,00
Dividendenforderungen		HKD	1.239.224,81	EUR	144.943,64	0,13
Dividendenforderungen		KRW	80.609.961,90	EUR	56.074,31	0,05
Dividendenforderungen		MYR	3.900,00	EUR	765,88	0,00
Dividendenforderungen		TWD	4.659.241,43	EUR	137.122,63	0,12
Dividendenforderungen		USD	54.721,14	EUR	50.156,86	0,04
Initial Margin UBS Ltd London		USD	47.407,00	EUR	43.452,80	0,04
<b>Summe Sonstige Vermögensgegenstände</b>				<b>EUR</b>	<b>609.431,37</b>	<b>0,54</b>
<b>Bankverbindlichkeiten</b>						
Bankverbindlichkeiten RBC Investor Services Bank S.A.		HKD	-0,02	EUR	0,00	0,00
Bankverbindlichkeiten RBC Investor Services Bank S.A.		THB	-1,34	EUR	-0,03	0,00
<b>Summe Bankverbindlichkeiten</b>				<b>EUR</b>	<b>-0,03</b>	<b>0,00</b>

Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

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

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg in 1.000	Bestand	Kurs zum 30.06.2023	Kurswert in EUR	in % des Netto- Teilfonds- vermögens
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>						
Sonstige Verbindlichkeiten		CHF	-53.360,72	EUR	-54.670,06	-0,05
Sonstige Verbindlichkeiten		EUR	-444.435,93	EUR	-444.435,93	-0,39
Sonstige Verbindlichkeiten		USD	-24.467,49	EUR	-22.426,66	-0,02
<b>Summe Sonstige Verbindlichkeiten 1)</b>				<b>EUR</b>	<b>-521.532,65</b>	<b>-0,46</b>
<b>Netto-Teilfondsvermögen</b>				<b>EUR</b>	<b>113.158.178,27</b>	<b>100,00<sup>*)</sup></b>

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

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

Nettoinventarwert pro Aktie des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Emerging Equity / Aktien Schwellenländer ESG A	EUR	16,25
Nettoinventarwert pro Aktie des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Emerging Equity / Aktien Schwellenländer ESG B	EUR	15,16
Nettoinventarwert pro Aktie des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Emerging Equity / Aktien Schwellenländer ESG X	CHF	13,00
Nettoinventarwert pro Aktie des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Emerging Equity / Aktien Schwellenländer ESG E	USD	12,03
Nettoinventarwert pro Aktie des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Emerging Equity / Aktien Schwellenländer ESG C	CHF	10,05
Umlaufende Aktien des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Emerging Equity / Aktien Schwellenländer ESG A	STK	2.146.678,369
Umlaufende Aktien des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Emerging Equity / Aktien Schwellenländer ESG B	STK	1.187.182,175
Umlaufende Aktien des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Emerging Equity / Aktien Schwellenländer ESG X	STK	161.960,575
Umlaufende Aktien des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Emerging Equity / Aktien Schwellenländer ESG E	STK	1.022.884,937
Umlaufende Aktien des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Emerging Equity / Aktien Schwellenländer ESG C	STK	4.550.262,700
Anteil der Wertpapiere am Netto-Teilfondsvermögen	%	97,65
Anteil der Derivate am Netto-Teilfondsvermögen	%	0,69

## Verpflichtungen aus Derivaten

Devisentermingeschäfte Käufe	Währung	Nominal	Währung	Nominal	offene Positionen in EUR
Devisenterminkontrakt Kauf CZK / CHF 14.07.23	CZK	950.560,06	CHF	-39.034,49	40.002,75
Devisenterminkontrakt Kauf CHF / EUR 03.07.23	CHF	642,14	EUR	-656,93	658,04
Devisenterminkontrakt Kauf BRL / CHF 14.07.23	BRL	945.036,62	CHF	-176.380,13	178.949,27
Devisenterminkontrakt Kauf CNH / CHF 14.07.23	CNH	4.870.568,95	CHF	-606.229,17	613.654,59
Devisenterminkontrakt Kauf EUR / CHF 14.07.23	EUR	1.282.414,06	CHF	-1.254.513,65	1.281.661,21
Devisenterminkontrakt Kauf MYR / CHF 14.07.23	MYR	1.254.771,71	CHF	-241.434,99	246.314,25
Devisenterminkontrakt Kauf TWD / CHF 14.07.23	TWD	12.584.833,76	CHF	-363.843,61	370.416,01
Devisenterminkontrakt Kauf ZAR / CHF 14.07.23	ZAR	2.750.545,62	CHF	-132.998,40	133.158,22
Devisenterminkontrakt Kauf TRY / CHF 14.07.23	TRY	868.585,75	CHF	-31.139,56	30.419,09
Devisenterminkontrakt Kauf USD / CHF 14.07.23	USD	241.922,87	CHF	-217.022,47	221.492,95
<b>Summe Devisentermingeschäfte Käufe</b>					<b>3.116.726,38</b>

Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

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

Devisentermingeschäfte Verkäufe	Währung	Nominal	Währung	Nominal	offene Positionen in EUR
Devisenterminkontrakt Verkauf CZK / CHF 14.07.23	CZK	-6.027.727,24	CHF	248.107,71	253.666,94
Devisenterminkontrakt Verkauf CHF / EUR 05.07.23	CHF	-22.135,71	EUR	22.667,40	22.684,68
Devisenterminkontrakt Verkauf CHF / EUR 04.07.23	CHF	-20.156,50	EUR	20.626,02	20.655,97
Devisenterminkontrakt Verkauf BRL / CHF 14.07.23	BRL	-10.651.771,01	CHF	1.967.461,75	2.016.987,09
Devisenterminkontrakt Verkauf CNH / CHF 14.07.23	CNH	-29.568.044,49	CHF	3.751.871,66	3.725.348,43
Devisenterminkontrakt Verkauf CLP / CHF 14.07.23	CLP	-353.709.448,55	CHF	394.650,09	403.658,12
Devisenterminkontrakt Verkauf EUR / CHF 14.07.23	EUR	-2.164.803,76	CHF	2.117.172,26	2.163.532,89
Devisenterminkontrakt Verkauf HKD / CHF 14.07.23	HKD	-70.958.597,07	CHF	8.213.527,01	8.291.502,21
Devisenterminkontrakt Verkauf INR / CHF 14.07.23	INR	-557.573.910,15	CHF	6.126.684,42	6.219.260,50
Devisenterminkontrakt Verkauf IDR / CHF 14.07.23	IDR	-21.609.456.342,38	CHF	1.316.609,69	1.319.495,81
Devisenterminkontrakt Verkauf MYR / CHF 14.07.23	MYR	-5.122.271,03	CHF	1.005.445,84	1.005.512,27
Devisenterminkontrakt Verkauf MXN / CHF 14.07.23	MXN	-28.563.108,40	CHF	1.484.970,98	1.521.461,80
Devisenterminkontrakt Verkauf TWD / CHF 14.07.23	TWD	-220.568.221,41	CHF	6.503.715,79	6.492.100,05
Devisenterminkontrakt Verkauf PHP / CHF 14.07.23	PHP	-30.832.530,34	CHF	498.220,58	511.250,07
Devisenterminkontrakt Verkauf ZAR / CHF 14.07.23	ZAR	-42.554.625,45	CHF	2.071.316,80	2.060.136,01
Devisenterminkontrakt Verkauf KRW / CHF 14.07.23	KRW	-7.487.649.813,03	CHF	5.277.121,73	5.205.191,10
Devisenterminkontrakt Verkauf TRY / CHF 14.07.23	TRY	-5.262.022,86	CHF	193.473,98	184.283,41
Devisenterminkontrakt Verkauf HUF / CHF 14.07.23	HUF	-135.102.882,07	CHF	353.674,29	362.052,75
Devisenterminkontrakt Verkauf USD / CHF 14.07.23	USD	-2.787.611,69	CHF	2.522.278,30	2.552.203,23
Devisenterminkontrakt Verkauf PLN / CHF 14.07.23	PLN	-2.510.767,99	CHF	549.624,80	565.460,73
<b>Summe Devisentermingeschäfte Verkäufe</b>					<b>44.896.444,06</b>

Futures Kauf	Währung	Kontrakte	Kontraktgröße	Kurs Underlying	Dev. Kurs	Verpflichtungen aus Derivaten in EUR
MSCI Emerging Markets Index Future 15.09.23	USD	33,00	50,00	997,9000	0,916590	1.509.197,98
<b>Summe Futures Kauf</b>						<b>1.509.197,98</b>

### Devisenkurse (in Mengennotiz)

			per	30.06.2023
Brasilianischer Real	BRL	5,263000	=1	EUR
Hongkong Dollar	HKD	8,549700	=1	EUR
Indonesische Rupiah	IDR	16.356,817750	=1	EUR
Malaysische Ringgit	MYR	5,092200	=1	EUR
Mexikanischer Peso	MXN	18,711200	=1	EUR
Philippinische Pesos	PHP	60,222700	=1	EUR
Polnischer Zloty	PLN	4,432650	=1	EUR
Russischer Rubel	RUB	97,644550	=1	EUR
Saudi-Riyal	SAR	4,092000	=1	EUR
Schweizer Franken	CHF	0,976050	=1	EUR
Südafrikanischer Rand	ZAR	20,610350	=1	EUR
Südkoreanischer Won	KRW	1.437,556150	=1	EUR
Taiwan Dollar	TWD	33,978650	=1	EUR
Thailändische Baht	THB	38,681400	=1	EUR
Tschechische Kronen	CZK	23,758500	=1	EUR
Türkische Lira	TRY	28,442400	=1	EUR
US-Dollar	USD	1,091000	=1	EUR
Ungarischer Forint	HUF	373,000000	=1	EUR
VAE-Dirham	AED	4,007300	=1	EUR
Yuan Renminbi	CNY	7,925100	=1	EUR

Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

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

## Ertrags- und Aufwandsrechnung des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Emerging Equity / Aktien Schwellenländer ESG im Zeitraum vom 1. Juli 2022 bis 30. Juni 2023

	EUR
<b>Erträge</b>	
Zinsen aus Geldanlagen	46.878,66
Dividendenerträge	2.767.656,67
Erträge aus Bestandsprovisionen	11.650,19
Sonstige Erträge	5.186,94
Ordentlicher Ertragsausgleich	174.189,04
<b>Erträge insgesamt</b>	<b>3.005.561,50</b>
<b>Aufwendungen</b>	
Fondsmanagervergütung	-643.555,01
Performanceabhängige Fondsmanagervergütung	-257.887,17
Verwaltungsvergütung	-41.805,15
Zentralverwaltungsstellenvergütung	-21.579,53
Verwahrstellenvergütung	-133.587,39
Prüfungskosten	-13.360,25
Taxe d'abonnement	-41.157,29
Veröffentlichungskosten	-8.624,23
Register- und Transferstellenvergütung	-649,99
Regulatorische Kosten	-7.395,11
Zinsaufwendungen	-26.800,70
Sonstige Aufwendungen	-43.777,55
Ordentlicher Aufwandsausgleich	-63.030,14
<b>Aufwendungen insgesamt</b>	<b>-1.303.209,51</b>
<b>Ordentlicher Nettoertrag</b>	<b>1.702.351,99</b>
<b>Veräußerungsgeschäfte</b>	
Realisierte Gewinne	6.400.858,26
Ertragsausgleich auf realisierte Gewinne	363.804,03
Realisierte Verluste	-10.327.778,93
Aufwandsausgleich auf realisierte Verluste	-496.933,97
<b>Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften</b>	<b>-4.060.050,61</b>
<b>Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>	<b>-2.357.698,62</b>
<b>Veränderung der nicht realisierten Gewinne und Verluste</b>	
Veränderung der nicht realisierten Gewinne	1.946.711,98
Veränderung der nicht realisierten Verluste	-40.577,42
<b>Nettoveränderung des nicht realisierten Ergebnisses des Geschäftsjahres</b>	<b>1.906.134,56</b>
<b>Ergebnis des Geschäftsjahres inkl. Ertrags-/Aufwandsausgleich</b>	<b>-451.564,06</b>

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

	EUR
<b>Netto-Teilfondsvermögen zum Beginn des Geschäftsjahres</b>	<b>58.861.878,51</b>
Mittelzuflüsse	59.146.981,83
Mittelabflüsse	-4.421.089,05
Mittelzufluss/ -abfluss netto	54.725.892,78
Ertrags- und Aufwandsausgleich	21.971,04
Ergebnis des Geschäftsjahres inkl. Ertrags-/Aufwandsausgleich	-451.564,06
<b>Netto-Teilfondsvermögen zum Ende des Geschäftsjahres</b>	<b>113.158.178,27</b>

Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

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

### Entwicklung des Teilfonds im Jahresvergleich

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

Stichtag	Umlaufende Aktien	Währung	Netto-Teilfondsvermögen	Nettoinventarwert pro Aktie
30.06.2023	2.146.678,369	EUR	34.880.069,16	16,25
30.06.2022	2.120.399,904	EUR	35.336.327,24	16,66
30.06.2021	2.043.084,610	EUR	38.770.212,92	18,98

### Entwicklung des Teilfonds im Jahresvergleich

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

Stichtag	Umlaufende Aktien	Währung	Netto-Teilfondsvermögen	Nettoinventarwert pro Aktie
30.06.2023	1.187.182,175	EUR	17.991.993,82	15,16
30.06.2022	1.177.058,711	EUR	18.098.353,63	15,38
30.06.2021	1.212.460,079	EUR	20.896.149,60	17,23

### Entwicklung des Teilfonds im Jahresvergleich

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

Stichtag	Umlaufende Aktien	Währung	Netto-Teilfondsvermögen	Nettoinventarwert pro Aktie
30.06.2023	161.960,575	CHF	2.105.296,57	13,00
30.06.2022	168.909,575	CHF	2.266.240,01	13,42
30.06.2021	188.901,575	CHF	3.086.636,12	16,34

### Entwicklung des Teilfonds im Jahresvergleich

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

Stichtag	Umlaufende Aktien	Währung	Netto-Teilfondsvermögen	Nettoinventarwert pro Aktie
30.06.2023	1.022.884,937	USD	12.303.670,35	12,03
30.06.2022	282.791,087	USD	3.306.753,55	11,69
30.06.2021	249.181,360	USD	3.705.007,16	14,87

### Entwicklung des Teilfonds im Jahresvergleich

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

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

1) Datum der ersten Anteilwertberechnung für die Anteilklasse.

Der beigelegte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

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

### Zusammensetzung des Netto-Fondsvermögens des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund ESG per 30. Juni 2023

Position	Betrag in EUR
Wertpapiervermögen (Wertpapiereinstandskosten EUR 73.301.427,07)	69.131.399,61
Derivate	-381.037,88
Bankguthaben	3.750.761,07
Sonstige Vermögensgegenstände	1.474.992,61
<b>Summe Aktiva</b>	<b>73.976.115,41</b>
Bankverbindlichkeiten	-187.329,12
Sonstige Verbindlichkeiten	-184.211,39
<b>Summe Passiva</b>	<b>-371.540,51</b>
<b>Netto-Teilfondsvermögen</b>	<b>73.604.574,90</b>

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

Währung	Kurswert in Mio. EUR	in % des Netto- Teilfondsvermögens
EUR	65,57	89,08
USD	6,70	9,11
GBP	0,95	1,29
CHF	0,38	0,52
<b>Summe</b>	<b>73,60</b>	<b>100,00</b>

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

Wertpapierkategorie	Kurswert in Mio. EUR	in % des Netto- Teilfondsvermögens
Verzinsliche Wertpapiere	67,56	91,78
Wertpapier-Investmentanteile	1,57	2,14
<b>Summe</b>	<b>69,13</b>	<b>93,92</b>

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

Länder	Kurswert in Mio. EUR	in % des Netto- Teilfondsvermögens
Frankreich	16,03	21,76
USA	11,07	15,04
Bundesrepublik Deutschland	10,21	13,87
Niederlande	6,80	9,24
Großbritannien	4,35	5,90
Italien	4,26	5,79
Spanien	1,70	2,31
Liechtenstein	1,57	2,14
Irland	1,37	1,86
Sonstige Länder	11,77	16,01
<b>Summe</b>	<b>69,13</b>	<b>93,92</b>

Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

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

## Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2023 des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund ESG

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg in 1.000	Bestand	Kurs zum 30.06.2023	Kurswert in EUR	in % des Netto- vermögens
<b>Amtlich gehandelte Wertpapiere / Regulierter Markt</b>						
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>						
0,000% Niederlande EO-Anl. 2020(27)	NL0015031501	EUR	400,00 %	90,3500	361.400,00	0,49
0,250% LeasePlan Corporation N.V. EO-Medium-Term Notes 2021(26)	XS2305244241	EUR	300,00 %	89,5600	268.680,00	0,37
0,250% Siemens Finan.maatschappij NV EO-Medium-Term Notes 2020(29)	XS2118276026	EUR	300,00 %	84,1200	252.360,00	0,34
0,250% SKF AB EO-Notes 2021(21/31)	XS2297204815	EUR	200,00 %	74,9200	149.840,00	0,20
0,250% V.F. Corp. EO-Notes 2020(20/28)	XS2123970167	EUR	200,00 %	83,0600	166.120,00	0,23
0,375% Münchener Hypothekbank MTN-IHS Serie 1927 v.21(29)	DE000MHB64E1	EUR	300,00 %	80,2100	240.630,00	0,33
0,375% Woolworths Group Ltd. EO-Medium-Term Nts 2021(21/28)	XS2384274440	EUR	200,00 %	82,5700	165.140,00	0,22
0,500% Alstom S.A. EO-Notes 2021(21/30)	FR0014004R72	EUR	300,00 %	80,0100	240.030,00	0,33
0,500% Banco Bilbao Vizcaya Argent. EO-Non-Preferred MTN 2020(27)	XS2101349723	EUR	500,00 %	87,7800	438.900,00	0,60
0,500% Italgas S.P.A. EO-Medium-Term Notes 2021(33)	XS2299002423	EUR	300,00 %	70,7100	212.130,00	0,29
0,500% Merck & Co. Inc. EO-Notes 2016(16/24)	XS1513055555	EUR	700,00 %	95,6120	669.284,00	0,91
0,500% Niederlande EO-Anl. 2016(26)	NL0011819040	EUR	500,00 %	92,8890	464.445,00	0,63
0,500% Publicis Groupe S.A. EO-Obl. 2016(16/23)	FR0013217346	EUR	200,00 %	98,8100	197.620,00	0,27
0,500% Solvay S.A. EO-Notes 2019(19/29)	BE6315847804	EUR	500,00 %	84,4400	422.200,00	0,57
0,625% Aviva PLC EO-Med.-Term Nts 2016(23)	XS1509003361	EUR	500,00 %	98,8800	494.400,00	0,67
0,625% Banco de Sabadell S.A. EO-FLR Preferred MTN 19(24/25) FTF	XS2076079594	EUR	500,00 %	94,4400	472.200,00	0,64
0,625% Kreditanst.f.Wiederaufbau Anl.v.2017 (2027)	DE000A2DAR65	EUR	1.500,00 %	91,1500	1.367.250,00	1,86
0,625% Nordea Bank Abp EO-Medium-Term Nts 2021(26/31) FTF	XS2343459074	EUR	300,00 %	87,2500	261.750,00	0,36
0,750% Aareal Bank AG MTN-IHS v.22(28)	DE000AAR0322	EUR	200,00 %	76,8500	153.700,00	0,21
0,750% Citigroup Inc. EO-Medium-Term Nts 2016(16/23)	XS1457608013	EUR	500,00 %	99,0120	495.060,00	0,67
0,750% Dover Corp. EO-Notes 2019(19/27)	XS2010038730	EUR	300,00 %	87,1100	261.330,00	0,36
0,750% Kering S.A. EO-Med.-Term Notes 2020(20/28)	FR0013512407	EUR	200,00 %	88,8600	177.720,00	0,24
0,750% Tele2 AB EO-Medium-Term Nts 2021(30/31)	XS2314267449	EUR	300,00 %	78,1300	234.390,00	0,32
0,830% BP Capital Markets PLC EO-Med.-Term Nts 2016(24/24)	XS1492671158	EUR	200,00 %	96,3800	192.760,00	0,26
0,875% Cie Génle Étis Michelin SCpA EO-Obl. 2018(18/25)	FR0013357845	EUR	500,00 %	93,8650	469.325,00	0,64
0,875% Coöperatieve Rabobank U.A. EO-FLR Non-Pref.MTN 20(27/28) FTF	XS2168285000	EUR	200,00 %	87,6900	175.380,00	0,24
0,875% Kojamo Oyj EO-Medium-Term Notes 21(21/29)	XS2345877497	EUR	300,00 %	70,5700	211.710,00	0,29
0,875% Nykredit Realkredit A/S EO-FLR Med.-T. Nts 2021(26/31) FTF	DK0030487996	EUR	200,00 %	86,0300	172.060,00	0,23
0,875% Orange S.A. EO-Med.-Term Notes 2016(16/27)	FR0013217114	EUR	500,00 %	90,7600	453.800,00	0,62
0,875% PPG Industries Inc. EO-Notes 2016(16/25)	XS1405769487	EUR	500,00 %	93,0090	465.045,00	0,63
0,875% Verizon Communications Inc. EO-Notes 2016(16/25)	XS1405766897	EUR	400,00 %	94,7100	378.840,00	0,51
0,875% Vivendi SE EO-Med.-Term Notes 2017(17/24)	FR0013282571	EUR	300,00 %	95,8200	287.460,00	0,39
0,950% Macquarie Group Ltd. EO-Medium-Term Notes 2021(31)	XS2343850033	EUR	300,00 %	77,3300	231.990,00	0,32
1,000% BMW Finance N.V. EO-Medium-Term Notes 2018(25)	XS1873143645	EUR	500,00 %	94,7450	473.725,00	0,64
1,000% British Telecommunications PLC EO-Med.-Term Notes 2017(17/24)	XS1720922175	EUR	300,00 %	95,8300	287.490,00	0,39
1,000% ENI S.p.A. EO-Medium-Term Nts 2019(34)	XS2065946837	EUR	500,00 %	72,9300	364.650,00	0,50
1,000% IMERY S.A. EO-Med.-Term Notes 2021(21/31)	FR0014003GX7	EUR	300,00 %	75,4900	226.470,00	0,31
1,000% LANXESS AG Medium-Term Nts 2016(16/26)	XS1501367921	EUR	300,00 %	90,7350	272.205,00	0,37
1,000% Mercedes-Benz Int.Fin. B.V. EO-Medium-Term Notes 2018(25)	DE000A190NE4	EUR	400,00 %	94,2200	376.880,00	0,51
1,000% Sagax EURO MTN NL B.V. EO-Med.-Term Notes 2021(21/29)	XS2342227837	EUR	300,00 %	70,9200	212.760,00	0,29
1,000% Siemens Finan.maatschappij NV EO-Medium-Term Notes 2018(27)	XS1874128033	EUR	500,00 %	93,4900	467.450,00	0,64
1,000% VINCI S.A. EO-Med.-Term Notes 2018(18/25)	FR0013367620	EUR	300,00 %	94,6100	283.830,00	0,39
1,125% Amcor UK Finance PLC EO-Notes 2020(20/27)	XS2193669657	EUR	200,00 %	88,3500	176.700,00	0,24
1,125% easyJet PLC EO-Med.-Term Notes 2016(16/23)	XS1505884723	EUR	400,00 %	99,1130	396.452,00	0,54
1,125% Hannover Rück SE FLR-Sub.Anl.v.2019(2029/2039) FTF	XS2063350925	EUR	200,00 %	78,4100	156.820,00	0,21
1,250% Adecco Intl Fin. Serv. B.V. EO-Medium-T.Notes 2019(19/29)	XS1995662027	EUR	400,00 %	85,2200	340.880,00	0,46
1,250% Bertelsmann SE & Co. KGaA MTN v.2018(25/2025)	XS1888229249	EUR	300,00 %	94,5520	283.656,00	0,39
1,250% Goldman Sachs Group Inc., The EO-Medium-Term Nts 2016(24/25)	XS1509006380	EUR	500,00 %	94,8300	474.150,00	0,64
1,250% HOCHTIEF AG MTN v.2019(2031/2031)	DE000A2YN2V0	EUR	500,00 %	76,7100	383.550,00	0,52
1,250% Slowenien, Republik EO-Bonds 2017(27)	SI0002103685	EUR	300,00 %	92,6900	278.070,00	0,38
1,250% Snam S.p.A. EO-Med.-T. Nts 2022(22/34)	XS2433226854	EUR	300,00 %	74,6100	223.830,00	0,30

Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

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

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg in 1.000	Bestand	Kurs zum 30.06.2023	Kurswert in EUR	in % des Netto- Teilfonds- vermögens	
1,300% Baxter International Inc. EO-Notes 2019(19/29)	XS1998215559	EUR	500,00	%	85,8100	429.050,00	0,58
1,350% Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Non-Preferred MTN 2021(31)	XS2304664597	EUR	250,00	%	75,4400	188.600,00	0,26
1,375% Alfa Laval Treasury Intl. AB EO-Medium-Term Nts 2022(22/29)	XS2444286145	EUR	300,00	%	85,8900	257.670,00	0,35
1,375% CRH Finance DAC EO-Med.-Term Notes 2016(16/28)	XS1505896735	EUR	400,00	%	88,4530	353.812,00	0,48
1,375% DSV Finance B.V. EO-Medium-Term Nts 2022(22/30)	XS2458285355	EUR	400,00	%	86,3700	345.480,00	0,47
1,375% Morgan Stanley EO-Med.-T. Nts 2016(26) Ser.G	XS1511787589	EUR	500,00	%	91,4600	457.300,00	0,62
1,375% Raiffeisen Bank Intl AG EO-FLR Med.-T. Nts 2021(28/33) FTF	XS2353473692	EUR	300,00	%	73,6550	220.965,00	0,30
1,375% Tesco Corp. Treas. Serv. PLC EO-Medium-Term Notes 18(23/23)	XS1896851224	EUR	500,00	%	99,2400	496.200,00	0,67
1,500% BNP Paribas S.A. EO-Non-Preferred MTN 2017(28)	XS1722801708	EUR	400,00	%	87,8700	351.480,00	0,48
1,500% Fresenius Medical Care KGaA MTN v.2018(2025/2025)	XS1854532949	EUR	500,00	%	94,8200	474.100,00	0,64
1,500% Israel EO-Medium-Term Notes 2019(29)	XS1936100483	EUR	500,00	%	88,7400	443.700,00	0,60
1,500% ISS Global A/S EO-Medium-Term Nts 2017(17/27)	XS1673102734	EUR	300,00	%	90,1100	270.330,00	0,37
1,500% McKesson Corp. EO-Notes 2017(17/25)	XS1567174286	EUR	300,00	%	94,3300	282.990,00	0,38
1,500% Schneider Electric SE EO-Med.-Term Notes 2019(19/28)	FR0013396876	EUR	500,00	%	91,6500	458.250,00	0,62
1,500% Valéo S.E. EO-Med.-Term Nts 2018(18/25)	FR0013342334	EUR	500,00	%	94,6200	473.100,00	0,64
1,500% Vonovia Finance B.V. EO-Medium-Term Nts 2018(18/26)	DE000A19X8A4	EUR	500,00	%	90,5900	452.950,00	0,62
1,625% Abertis Infraestructuras S.A. EO-Medium-Term Nts 2019(19/29)	XS2025480596	EUR	400,00	%	86,4100	345.640,00	0,47
1,625% Givaudan Finance Europe B.V. EO-Notes 2020(20/32)	XS2126170161	EUR	200,00	%	83,6400	167.280,00	0,23
1,625% Lonza Finance International NV EO-Notes 2020(20/27)	BE6321076711	EUR	200,00	%	92,4100	184.820,00	0,25
1,625% Telecom Italia S.p.A. EO-Med.-Term Notes 2021(21/29)	XS2288109676	EUR	200,00	%	76,3600	152.720,00	0,21
1,625% UniCredit S.p.A. EO-Preferred Med.-T.Nts 22(32)	XS2433141947	EUR	300,00	%	79,1090	237.327,00	0,32
1,715% Telefonica Emisiones S.A.U. EO-Medium-Term Nts 2017(17/28)	XS1681521081	EUR	300,00	%	92,1900	276.570,00	0,38
1,750% A.P.Møller-Mærsk A/S EO-Medium-Term Nts 2018(18/26)	XS1789699607	EUR	200,00	%	94,3200	188.640,00	0,26
1,750% Holcim Finance (Luxembg) S.A. EO-Medium-T. Notes 2017(17/29)	XS1672151492	EUR	300,00	%	87,8600	263.580,00	0,36
1,750% Italien, Republik EO-B.T.P. 2019(24)	IT0005367492	EUR	2.000,00	%	98,0020	1.960.040,00	2,66
1,750% Unilever Fin. Netherlands B.V. EO-Medium-Term Nts 2020(20/30)	XS2147133578	EUR	500,00	%	89,8100	449.050,00	0,61
1,875% Compagnie de Saint-Gobain S.A. EO-Medium-Term Notes 2018(28)	XS1881593971	EUR	500,00	%	91,0700	455.350,00	0,62
1,875% Heathrow Funding Ltd. EO-FLR Med.-T. Nts 19(34.36) A FTF	XS1960589155	EUR	200,00	%	79,1900	158.380,00	0,22
1,875% Telefonaktiebolaget L.M.Erics. EO-Med.-Term Nts 17(17/24)	XS1571293684	EUR	200,00	%	98,2720	196.544,00	0,27
1,940% Veolia Environnement S.A. EO-Med.-Term Nts 2018(18/30)	FR0013385473	EUR	300,00	%	89,6200	268.860,00	0,37
1,950% Warner Media LLC EO-Notes 2015(15/23) Reg.S	XS1266734349	EUR	300,00	%	99,3700	298.110,00	0,41
2,000% Emerson Electric Co. EO-Notes 2019(19/29)	XS1916073254	EUR	500,00	%	91,2820	456.410,00	0,62
2,000% Klépierre S.A. EO-Med.-Term Notes 2020(20/29)	FR0013512233	EUR	200,00	%	88,5040	177.008,00	0,24
2,000% NatWest Group PLC EO-FLR Med.-T.Nts 2018(24/25) FTF	XS1875275205	EUR	500,00	%	98,1200	490.600,00	0,67
2,000% Schlumberger Finance B.V. EO-Notes 2020(20/32)	XS2166755509	EUR	200,00	%	86,6900	173.380,00	0,24
2,000% SES S.A. EO-Med.-Term Nts 2020(20/28)	XS2196317742	EUR	300,00	%	86,8500	260.550,00	0,35
2,000% Wienerberger AG EO-SchuldF. 2018(24)	AT0000A20F93	EUR	500,00	%	98,1190	490.595,00	0,67
2,121% Allianz SE FLR-Sub.MTN.v.2020(2030/2050) FTF	DE000A254TM8	EUR	200,00	%	81,7900	163.580,00	0,22
2,124% Rumänien EO-Med.-Term Nts 2019(31)Reg.S	XS2027596530	EUR	300,00	%	75,9900	227.970,00	0,31
2,125% BNP Paribas S.A. EO-FLR Med.-T. Nts 2019(26/27) FTF	FR0013398070	EUR	400,00	%	93,8700	375.480,00	0,51
2,125% Royal Bank of Canada EO-Medium-Term Notes 2022(29)	XS2472603740	EUR	400,00	%	89,8050	359.220,00	0,49
2,125% Société Générale S.A. EO-Non-Preferred MTN 2018(28)	FR0013368602	EUR	500,00	%	88,7600	443.800,00	0,60
2,250% AIB Group PLC EO-FLR Med.-T.Nts 2022(26/28) FTF	XS2464405229	EUR	200,00	%	90,8100	181.620,00	0,25
2,250% Evonik Industries AG Medium Term Notes v.22(22/27)	XS2485162163	EUR	200,00	%	93,2700	186.540,00	0,25
2,375% Brambles Finance Ltd. EO-Bonds 2014(14/24)	XS1028952312	EUR	200,00	%	98,2700	196.540,00	0,27
2,375% De Volksbank N.V. EO-FLR Non-Pref.MTN 22(26/27) FTF	XS2475502832	EUR	300,00	%	93,0830	279.249,00	0,38
2,375% Thermo Fisher Scientific Inc. EO-Notes 2020(20/32)	XS2010032451	EUR	200,00	%	89,9300	179.860,00	0,24
2,500% Unibail-Rodamco-Westfield SE EO-Medium-Term Notes 2014(26)	XS1074055770	EUR	300,00	%	94,2300	282.690,00	0,38
2,500% Vodafone Group PLC EO-Medium-Term Notes 2019(39)	XS2002019060	EUR	200,00	%	79,7900	159.580,00	0,22
2,500% Wendel SE EO-Bonds 2015(15/27)	FR0012516417	EUR	300,00	%	93,8900	281.670,00	0,38
2,625% Bque Fédérative du Cr. Mutuel EO-Non-Preferred MTN 2022(29)	FR001400A3G4	EUR	300,00	%	90,1270	270.381,00	0,37
2,750% Aéroports de Paris S.A. EO-Obl. 2020(20/30)	FR0013505633	EUR	200,00	%	93,5600	187.120,00	0,25
2,800% Bundesrep.Deutschland Bundesschatzanw. v.23(25)	DE000BU22015	EUR	6.000,00	%	99,2710	5.956.260,00	8,09
2,824% Bank of America Corp. EO-FLR Med.-T. Nts 2022(22/33) FTF	XS2462323853	EUR	300,00	%	88,9940	266.982,00	0,36
3,000% ACCOR S.A. EO-Bonds 2019(19/26)	FR0013399029	EUR	300,00	%	96,4470	289.341,00	0,39
3,000% KBC Groep N.V. EO-Medium Term Notes 2022(30)	BE0002875566	EUR	400,00	%	92,8400	371.360,00	0,50
3,129% Toronto-Dominion Bank, The EO-Medium-Term Notes 2022(32)	XS2511309903	EUR	600,00	%	92,7080	556.248,00	0,76
3,245% National Grid PLC EO-Medium Term Nts 2022(22/34)	XS2486461523	EUR	300,00	%	90,2300	270.690,00	0,37

Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

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

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg in 1.000	Bestand	Kurs zum 30.06.2023	Kurswert in EUR	in % des Netto- Teilfonds- vermögens
3,500% Deutsche Lufthansa AG MTN v.2021(2029/2029)	XS2363235107	EUR	200,00 %	91,2500	182.500,00	0,25
3,500% Frankreich EO-OAT 2010(26)	FR0010916924	EUR	500,00 %	101,0600	505.300,00	0,69
3,875% Assicurazioni Generali S.p.A. EO-Medium-Term Notes 2019(29)	XS1941841311	EUR	400,00 %	95,7000	382.800,00	0,52
3,875% Prologis Euro Finance LLC EO-Notes 2023(23/30)	XS2580271596	EUR	200,00 %	96,9200	193.840,00	0,26
4,000% Intl Business Machines Corp. EO-Notes 2023(23/43)	XS2583742668	EUR	300,00 %	97,3800	292.140,00	0,40
4,250% AXA S.A. EO-FLR M.-T.Nts 2022(32/43) FTF	XS2487052487	EUR	200,00 %	91,6900	183.380,00	0,25
4,250% Crédit Mutuel Arkéa EO-Non-Preferred MTN 2022(32)	FR001400E946	EUR	300,00 %	100,0300	300.090,00	0,41
4,275% National Grid PLC EO-Medium Term Nts 2023(23/35)	XS2576067081	EUR	300,00 %	98,6200	295.860,00	0,40
4,375% Thames Water Utilities Fin.PLC EO-Med.-Term Nts 2023(23/31)	XS2576550672	EUR	300,00 %	88,2660	264.798,00	0,36
4,500% ABN AMRO Bank N.V. EO-Non-Preferred MTN 2022(34)	XS2557084733	EUR	300,00 %	100,6900	302.070,00	0,41
4,500% BPCE S.A. EO-Non-Preferred MTN 2023(33)	FR001400F083	EUR	300,00 %	100,2000	300.600,00	0,41
4,500% RCI Banque S.A. EO-Medium-Term Nts 2023(27/27)	FR001400H2O3	EUR	400,00 %	98,5760	394.304,00	0,54
4,750% ALD S.A. EO-Medium-Term Notes 2022(25)	FR001400D7M0	EUR	200,00 %	100,7600	201.520,00	0,27
4,750% UBS Group AG EO-FLR Med.-T. Nts 2023(31/32) FTF	CH1255915014	EUR	400,00 %	99,5100	398.040,00	0,54
5,000% Fresenius SE & Co. KGaA MTN v.2022(2022/2029)	XS2559501429	EUR	200,00 %	100,9600	201.920,00	0,27
5,000% Suez S.A. EO-Medium-Term Nts 2022(22/32)	FR001400DQ92	EUR	400,00 %	106,0400	424.160,00	0,58
5,125% Assicurazioni Generali S.p.A. EO-Medium-Term Notes 2009(24)	XS0452314536	EUR	200,00 %	101,5800	203.160,00	0,28
5,125% Südzucker Intl Finance B.V. EO-Notes 2022(22/27)	XS2550868801	EUR	400,00 %	102,7940	411.176,00	0,56
5,230% Raiffeisen Schweiz Genossensch EO-Anl. 2022(27)	CH1224575899	EUR	400,00 %	102,9200	411.680,00	0,56
5,250% CNP Assurances S.A. EO-FLR Med.-T.Nts 2023(33/53) FTF	FR001400F620	EUR	200,00 %	95,7400	191.480,00	0,26
5,250% ING Groep N.V. EO-FLR Med.-T. Nts 2022(32/33) FTF	XS2554745708	EUR	400,00 %	105,3500	421.400,00	0,57
5,262% Barclays PLC EO-FLR Med.-T. Nts 2022(33/34) FTF	XS2560422581	EUR	300,00 %	99,9380	299.814,00	0,41
5,375% Bouygues S.A. EO-Bonds 2022(22/42)	FR001400DNF5	EUR	300,00 %	109,6200	328.860,00	0,45
5,625% Deutsche Bank AG Sub.FLR-MTN v20(26/31) FTF	DE000DL19VB0	EUR	200,00 %	94,8100	189.620,00	0,26
1,750% Sodexo S.A. LS-Notes 2019(19/28)	XS2017471983	GBP	200,00 %	81,5000	189.943,48	0,26
6,625% Lloyds Banking Group PLC LS-FLR Med.-T. Nts 2023(28/33) FTF	XS2591847970	GBP	300,00 %	94,6600	330.921,17	0,45
2,650% Oracle Corp. DL-Notes 2016(16/26)	US68389XBM65	USD	500,00 %	92,8740	425.637,03	0,58
3,306% Banco Santander S.A. DL-Preferred Notes 2019(29)	US05971KAC36	USD	200,00 %	89,1390	163.407,88	0,22
4,500% Willis North America Inc. DL-Notes 2018(18/28)	US970648AG61	USD	200,00 %	95,3510	174.795,60	0,24

### Organisierter Markt

#### Verzinsliche Wertpapiere

0,500% PepsiCo Inc. EO-Notes 2020(20/28)	XS2168625544	EUR	200,00 %	86,7800	173.560,00	0,24
0,625% Mölnlycke Holding AB EO-Medium-Term Nts 2020(20/31)	XS2270406452	EUR	200,00 %	77,0200	154.040,00	0,21
0,697% Eaton Capital Unlimited Co. EO-Notes 2019(19/25)	XS1996269061	EUR	300,00 %	93,8640	281.592,00	0,38
0,766% Westpac Banking Corp. EO-FLR Med.-T. Nts 2021(26/31) FTF	XS2342206591	EUR	300,00 %	86,5900	259.770,00	0,35
0,797% Mizuho Financial Group Inc. EO-Medium-Term Notes 2020(30)	XS2098350965	EUR	500,00 %	80,1200	400.600,00	0,54
1,125% Australia & N. Z. Bkg Grp Ltd. EO-FLR Med.-Term Nts 19(24/29) FTF	XS2082818951	EUR	500,00 %	93,6900	468.450,00	0,64
1,125% Mexiko EO-Medium-Term Nts 2020(20/30)	XS2104886341	EUR	500,00 %	82,3200	411.600,00	0,56
1,250% Kellogg Co. EO-Notes 2015(15/25)	XS1199356954	EUR	300,00 %	95,5700	286.710,00	0,39
1,250% Whirlpool Fin. Luxembourg Sarl EO-Notes 2016(16/26)	XS1514149159	EUR	400,00 %	91,2500	365.000,00	0,50
2,000% Autostrade per L'Italia S.p.A. EO-Notes 2021(21/30)	XS2278566299	EUR	200,00 %	83,9600	167.920,00	0,23
2,125% Nexi S.p.A. EO-Nts 2021(21/29) Reg.S	XS2332590475	EUR	200,00 %	83,2500	166.500,00	0,23
2,125% Walgreens Boots Alliance Inc. EO-Notes 2014(14/26)	XS1138360166	EUR	300,00 %	92,5900	277.770,00	0,38
2,250% IQVIA Inc. EO-Notes 2019(19/28) Reg.S	XS2036798150	EUR	200,00 %	88,0150	176.030,00	0,24
2,375% Barry Callebaut Services N.V. EO-Notes 2016(24)	BE6286963051	EUR	200,00 %	98,3960	196.792,00	0,27
2,500% FIL Ltd. EO-Bonds 2016(26)	XS1511793124	EUR	400,00 %	91,8400	367.360,00	0,50
2,750% Helvetia Europe EO-FLR Notes 2020(31/41) FTF	XS2197076651	EUR	300,00 %	79,4800	238.440,00	0,32
3,375% Levi Strauss & Co. EO-Notes 2017(17/27) Reg.S	XS1571994554	EUR	200,00 %	95,0600	190.120,00	0,26
3,625% Chorus Ltd. EO-Med.-Term Notes 2022(22/29)	XS2521013909	EUR	200,00 %	97,3400	194.680,00	0,26
4,250% Volvo Car AB EO-Med.-Term Nts 2022(22/28)	XS2486825669	EUR	200,00 %	95,7500	191.500,00	0,26
4,375% Rentokil Initial Finance B.V. EO-Medium-Term Nts 2022(22/30)	XS2494946820	EUR	400,00 %	101,2300	404.920,00	0,55
4,500% Dell Bank International DAC EO-Medium-Term Nts 2022(22/27)	XS2545259876	EUR	400,00 %	100,8200	403.280,00	0,55
2,250% Fiserv Inc. LS-Notes 2019(19/25)	XS1843433712	GBP	200,00 %	91,7000	213.715,55	0,29
3,750% WPP Finance 2017 LS-Medium-Term Nts 2020(20/32)	XS2176605132	GBP	200,00 %	81,2300	189.314,22	0,26
2,650% HP Inc. DL-Notes 2022(22/31)	US40434LAJ44	USD	200,00 %	80,5800	147.717,69	0,20
2,950% Marvell Technology Inc. DL-Notes 2021(21/31)	US573874AJ32	USD	200,00 %	83,8600	153.730,52	0,21

Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

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

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg in 1.000	Bestand		Kurs zum 30.06.2023	Kurswert in EUR	in % des Netto- Teilfonds- vermögens
3,125% Ball Corp. DL-Notes 2021(31/31)	US058498AX40	USD	200,00	%	82,3670	150.993,58	0,21
3,375% Weyerhaeuser Co. DL-Notes 2022(22/33)	US962166CA07	USD	200,00	%	86,4200	158.423,46	0,22
3,500% Zurich Finance (Ireland) DAC DL-FLR Med.-T. Nts 2021(32/52) FTF	XS2416978190	USD	200,00	%	79,1900	145.169,57	0,20
3,850% Thomson Reuters Corp. DL-Notes 2014(14/24)	US884903BT19	USD	300,00	%	96,9940	266.711,27	0,36
3,900% Zoetis Inc. DL-Notes 2018(18/28)	US98978VAN38	USD	500,00	%	96,3330	441.489,46	0,60
4,000% Service Corp. International DL-Notes 2021(21/31)	US817565CG79	USD	200,00	%	85,6030	156.925,76	0,21
4,185% Micron Technology Inc. DL-Notes 2019(19/27)	US595112BP79	USD	200,00	%	95,8120	175.640,70	0,24
4,300% Kellogg Co. DL-Notes 2018(18/28)	US487836BW75	USD	400,00	%	96,8510	355.090,74	0,48
4,350% Valero Energy Corp. DL-Notes 2018(18/28)	US91913YAV20	USD	700,00	%	95,7950	614.633,36	0,84
4,375% Apache Corp. DL-Notes 2018(18/28)	US037411BE40	USD	500,00	%	91,2500	418.194,32	0,57
4,375% Marsh & McLennan Cos. Inc. DL-Notes 2019(19/29)	US571748BG65	USD	500,00	%	97,1280	445.132,91	0,60
4,625% Yum! Brands, Inc. DL-Notes 2021(21/32)	US988498AP63	USD	200,00	%	91,1175	167.034,83	0,23
6,500% Petróleos Mexicanos (PEMEX) DL-Notes 2018(18/29) Reg.S	USP78625DV20	USD	300,00	%	82,7860	227.642,53	0,31
7,125% Brasilien DL-Bonds 2006(37)	US105756BK57	USD	300,00	%	106,4100	292.603,12	0,40
9,625% Seagate HDD Cayman DL-Notes 2022(22/32) 144A	US81180WBG50	USD	153,00	%	109,0400	152.915,86	0,21
<b>Sonstige Märkte</b>							
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>							
0,000% Frankreich EO-Treasury Bills 2022(23)	FR0127317032	EUR	6.000,00	%	99,4040	5.964.240,00	8,10
2,500% Cppgemini SE EO-Notes 2015(15/23)	FR0012821940	EUR	400,00	%	100,0000	400.000,00	0,54
<b>Wertpapier-Investmentanteile</b>							
Plenum CAT Bond Fund Inhaber-Anteile P EUR o.N.	LI0290349617	ANT	15.000,00	EUR	104,9400	1.574.100,00	2,14
<b>Summe Wertpapiervermögen</b>				<b>EUR</b>		<b>69.131.399,61</b>	<b>93,92</b>
<b>Derivate</b>							
<b>Rentenindex-Terminkontrakte</b>							
Bobl Future 07.09.23		STK	-110	EUR	115,7100	46.200,00	0,06
Euro Bund Future 07.09.23		STK	-115	EUR	133,7400	-142.600,00	-0,19
10 Year T-Note Future 20.09.23		STK	-25	USD	112,2656	28.285,40	0,04
5 Year T-Note Future 29.09.23		STK	-10	USD	107,0938	12.531,51	0,02
<b>Devisenterminkontrakte Verkauf</b>							
<b>offen (Kontrahent Verwahrstelle)</b>							
Devisenterminkontrakt Verkauf EUR / CHF 15.08.23		EUR	-61.500.000	EUR		-246.440,43	-0,33
Devisenterminkontrakt Verkauf GBP / EUR 20.07.23		GBP	-800.000	EUR		-27.809,09	-0,04
Devisenterminkontrakt Verkauf USD / EUR 20.07.23		USD	-6.000.000	EUR		-51.205,27	-0,07
<b>Summe Derivate</b>				<b>EUR</b>		<b>-381.037,88</b>	<b>-0,52</b>
<b>Bankguthaben</b>							
<b>Bankkonten</b>							
Bankkonto (Collateral) RBC Investor Services Bank S.A.		EUR	550.000,00	EUR		550.000,00	0,75
Bankkonto RBC Investor Services Bank S.A.		CHF	509.522,98	EUR		522.025,49	0,71
Bankkonto RBC Investor Services Bank S.A.		GBP	40.292,09	EUR		46.952,27	0,06
Bankkonto RBC Investor Services Bank S.A.		USD	862.537,96	EUR		790.593,91	1,07
Bankkonto UBS Ltd London		EUR	1.091.188,56	EUR		1.091.188,56	1,48
Bankkonto UBS Ltd London		USD	662.674,32	EUR		607.400,84	0,83
Forderungen aus Variation Margin		EUR	142.600,00	EUR		142.600,00	0,19
<b>Summe Bankguthaben</b>				<b>EUR</b>		<b>3.750.761,07</b>	<b>5,10</b>
<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>							
Initial Margin UBS Ltd London		EUR	812.514,50	EUR		812.514,50	1,10
Initial Margin UBS Ltd London		USD	66.500,00	EUR		60.953,25	0,08
Wertpapierzinsen		EUR	532.371,24	EUR		532.371,24	0,72
Wertpapierzinsen		GBP	7.003,76	EUR		8.161,46	0,01
Wertpapierzinsen		USD	66.542,45	EUR		60.992,16	0,08
<b>Summe Sonstige Vermögensgegenstände</b>				<b>EUR</b>		<b>1.474.992,61</b>	<b>2,00</b>

Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

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

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg in 1.000	Bestand	Kurs zum 30.06.2023	Kurswert in EUR	in % des Netto- Teilfonds- vermögens
<b>Bankverbindlichkeiten</b>						
Bankverbindlichkeiten RBC Investor Services Bank S.A.		EUR	-100.312,21	EUR	-100.312,21	-0,14
Verbindlichkeiten aus Variation Margin		EUR	-46.200,00	EUR	-46.200,00	-0,06
Verbindlichkeiten aus Variation Margin		USD	-44.531,25	EUR	-40.816,91	-0,06
<b>Summe Bankverbindlichkeiten</b>				<b>EUR</b>	<b>-187.329,12</b>	<b>-0,25</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>						
Sonstige Verbindlichkeiten		CHF	-138.868,58	EUR	-142.276,10	-0,19
Sonstige Verbindlichkeiten		EUR	-41.935,29	EUR	-41.935,29	-0,06
<b>Summe Sonstige Verbindlichkeiten 1)</b>				<b>EUR</b>	<b>-184.211,39</b>	<b>-0,25</b>
<b>Netto-Teilfondsvermögen</b>				<b>EUR</b>	<b>73.604.574,90</b>	<b>100,00<sup>*)</sup></b>

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

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

Nettoinventarwert pro Aktie des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund ESG A	EUR	11,45
Nettoinventarwert pro Aktie des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund ESG C	CHF	9,52
Nettoinventarwert pro Aktie des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund ESG B	EUR	9,89
Nettoinventarwert pro Aktie des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund ESG D	CHF	9,40
Nettoinventarwert pro Aktie des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund ESG X	CHF	8,22
Umlaufende Aktien des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund ESG A	STK	250.722,104
Umlaufende Aktien des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund ESG C	STK	6.410.852,547
Umlaufende Aktien des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund ESG B	STK	761.325,382
Umlaufende Aktien des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund ESG D	STK	53.805,205
Umlaufende Aktien des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund ESG X	STK	15.000,000
Anteil der Wertpapiere am Netto-Teilfondsvermögen	%	93,92
Anteil der Derivate am Netto-Teilfondsvermögen	%	-0,52

## Verpflichtungen aus Derivaten

Devisentermingeschäfte Verkäufe	Währung	Nominal	Währung	Nominal	offene Positionen in EUR
Devisenterminkontrakt Verkauf GBP / EUR 20.07.23	GBP	-800.000,00	EUR	903.730,15	931.539,24
Devisenterminkontrakt Verkauf EUR / CHF 15.08.23	EUR	-61.500.000,00	CHF	59.645.590,50	61.355.595,19
Devisenterminkontrakt Verkauf USD / EUR 20.07.23	USD	-6.000.000,00	EUR	5.443.559,36	5.494.764,63
<b>Summe Devisentermingeschäfte Verkäufe</b>					<b>67.781.899,06</b>

Futures Verkauf	Währung	Kontrakte	Kontraktgröße	Kurs Underlying	Dev. Kurs	Verpflichtungen aus Derivaten in EUR
10 Year T-Note Future 20.09.23	USD	-25,00	100.000,00	112,2656	0,916590	2.572.539,53
5 Year T-Note Future 29.09.23	USD	-10,00	100.000,00	107,0938	0,916590	981.610,91
Bobl Future 07.09.23	EUR	-110,00	100.000,00	115,7100	1,000000	12.728.100,00
EUR Bund Future 07.09.23	EUR	-115,00	100.000,00	133,7400	1,000000	15.380.100,00
<b>Summe Futures Verkauf</b>						<b>31.662.350,44</b>

Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

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

## Devisenkurse (in Mengennotiz)

			per	30.06.2023
Britisches Pfund	GBP	0,858150	=1	EUR
Schweizer Franken	CHF	0,976050	=1	EUR
US-Dollar	USD	1,091000	=1	EUR

## Ertrags- und Aufwandsrechnung des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund ESG im Zeitraum vom 1. Juli 2022 bis 30. Juni 2023

	EUR
<b>Erträge</b>	
Zinserträge aus Wertpapieren	1.117.730,27
Zinsen aus Geldanlagen	86.313,20
Sonstige Erträge	23,25
Ordentlicher Ertragsausgleich	11.981,86
<b>Erträge insgesamt</b>	<b>1.216.048,58</b>
<b>Aufwendungen</b>	
Fondsmanagervergütung	-560.077,34
Verwaltungsvergütung	-41.648,98
Zentralverwaltungsstellenvergütung	-19.807,62
Verwahrstellenvergütung	-38.743,51
Prüfungskosten	-13.360,25
Taxe d'abonnement	-36.486,68
Veröffentlichungskosten	-8.624,22
Register- und Transferstellenvergütung	-650,00
Regulatorische Kosten	-7.437,52
Zinsaufwendungen	-25.958,88
Sonstige Aufwendungen	-64.121,05
Ordentlicher Aufwandsausgleich	-8.716,10
<b>Aufwendungen insgesamt</b>	<b>-825.632,15</b>
<b>Ordentlicher Nettoertrag</b>	<b>390.416,43</b>
<b>Veräußerungsgeschäfte</b>	
Realisierte Gewinne	8.486.458,22
Ertragsausgleich auf realisierte Gewinne	352.501,24
Realisierte Verluste	-3.927.399,27
Aufwandsausgleich auf realisierte Verluste	-103.097,21
<b>Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften</b>	<b>4.808.462,98</b>
<b>Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>	<b>5.198.879,41</b>
<b>Veränderung der nicht realisierten Gewinne und Verluste</b>	
Veränderung der nicht realisierten Gewinne	111.068,98
Veränderung der nicht realisierten Verluste	-2.935.153,24
<b>Nettoveränderung des nicht realisierten Ergebnisses des Geschäftsjahres</b>	<b>-2.824.084,26</b>
<b>Ergebnis des Geschäftsjahres inkl. Ertrags-/Aufwandsausgleich</b>	<b>2.374.795,15</b>

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

	EUR
<b>Netto-Teilfondsvermögen zum Beginn des Geschäftsjahres</b>	<b>67.152.145,51</b>
Mittelzuflüsse	9.389.219,69
Mittelabflüsse	-5.058.915,66
Mittelzufluss/-abfluss netto	4.330.304,03
Ertrags- und Aufwandsausgleich	-252.669,79
Ergebnis des Geschäftsjahres inkl. Ertrags-/Aufwandsausgleich	2.374.795,15
<b>Netto-Teilfondsvermögen zum Ende des Geschäftsjahres</b>	<b>73.604.574,90</b>

Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

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

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

Stichtag	Umlaufende Aktien	Währung	Netto-Teilfondsvermögen	Nettoinventarwert pro Aktie
30.06.2023	250.722,104	EUR	2.871.649,28	11,45
30.06.2022	217.070,900	EUR	2.435.787,62	11,22
30.06.2021	201.851,966	EUR	2.389.103,15	11,84

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

Stichtag	Umlaufende Aktien	Währung	Netto-Teilfondsvermögen	Nettoinventarwert pro Aktie
30.06.2023	6.410.852,547	CHF	61.059.049,34	9,52
30.06.2022	6.044.696,093	CHF	57.129.501,56	9,45
30.06.2021	6.247.140,797	CHF	62.370.007,54	9,98

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

Stichtag	Umlaufende Aktien	Währung	Netto-Teilfondsvermögen	Nettoinventarwert pro Aktie
30.06.2023	761.325,382	EUR	7.530.913,06	9,89
30.06.2022	746.889,372	EUR	7.202.581,67	9,64
30.06.2021	774.540,460	EUR	7.838.009,66	10,12

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

Stichtag	Umlaufende Aktien	Währung	Netto-Teilfondsvermögen	Nettoinventarwert pro Aktie
30.06.2023	53.805,205	CHF	506.026,16	9,40
30.06.2022	33.760,205	CHF	313.300,52	9,28
30.06.2021	289.470,205	CHF	2.817.979,88	9,73

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

Stichtag	Umlaufende Aktien	Währung	Netto-Teilfondsvermögen	Nettoinventarwert pro Aktie
30.06.2023	15.000,000	CHF	123.248,86	8,22
30.06.2022	15.000,000	CHF	122.736,54	8,18
30.06.2021	15.000,000	CHF	140.556,89	9,37

Der beigelegte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

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

### Zusammensetzung des Netto-Fondsvermögens des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund Plus ESG per 30. Juni 2023

Position	Betrag in EUR
Wertpapiervermögen	87.962.050,12
(Wertpapiereinstandskosten EUR 94.342.572,02)	
Derivate	-545.774,45
Bankguthaben	6.012.902,11
Sonstige Vermögensgegenstände	2.027.005,29
<b>Summe Aktiva</b>	<b>95.456.183,07</b>
Bankverbindlichkeiten	-173.056,22
Sonstige Verbindlichkeiten	-232.569,03
<b>Summe Passiva</b>	<b>-405.625,25</b>
<b>Netto-Teilfondsvermögen</b>	<b>95.050.557,82</b>

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

Währung	Kurswert in Mio. EUR	in % des Netto- Teilfondsvermögens
EUR	72,29	76,06
USD	16,45	17,30
CHF	3,77	3,97
GBP	2,54	2,67
<b>Summe</b>	<b>95,05</b>	<b>100,00</b>

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

Wertpapierkategorie	Kurswert in Mio. EUR	in % des Netto- Teilfondsvermögens
Verzinsliche Wertpapiere	81,58	85,83
Wertpapier-Investmentanteile	6,38	6,71
<b>Summe</b>	<b>87,96</b>	<b>92,54</b>

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

Länder	Kurswert in Mio. EUR	in % des Netto- Teilfondsvermögens
USA	14,45	15,20
Frankreich	12,76	13,42
Niederlande	9,30	9,78
Bundesrepublik Deutschland	8,60	9,05
Großbritannien	7,27	7,64
Luxemburg	6,03	6,35
Italien	5,72	6,02
Liechtenstein	2,31	2,43
Schweden	2,28	2,40
Sonstige Länder	19,24	20,25
<b>Summe</b>	<b>87,96</b>	<b>92,54</b>

Der beigegefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

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

## Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2023 des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund Plus ESG

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg in 1.000	Bestand	Kurs zum 30.06.2023	Kurswert in EUR	in % des Netto- Teilfonds- vermögens
<b>Amtlich gehandelte Wertpapiere / Regulierter Markt</b>						
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>						
0,250% Bank of Nova Scotia, The EO-Medium-Term Notes 2021(28)	XS2381362966	EUR	200,00 %	81,5960	163.192,00	0,17
0,250% LeasePlan Corporation N.V. EO-Medium-Term Notes 2021(26)	XS2305244241	EUR	300,00 %	89,5600	268.680,00	0,28
0,250% Siemens Finan.maatschappij NV EO-Medium-Term Notes 2020(29)	XS2118276026	EUR	300,00 %	84,1200	252.360,00	0,27
0,250% SKF AB EO-Notes 2021(21/31)	XS2297204815	EUR	300,00 %	74,9200	224.760,00	0,24
0,250% V.F. Corp. EO-Notes 2020(20/28)	XS2123970167	EUR	300,00 %	83,0600	249.180,00	0,26
0,375% Münchener Hypothekbank MTN-IHS Serie 1927 v.21(29)	DE000MHB64E1	EUR	300,00 %	80,2100	240.630,00	0,25
0,375% Woolworths Group Ltd. EO-Medium-Term Nts 2021(21/28)	XS2384274440	EUR	200,00 %	82,5700	165.140,00	0,17
0,500% Alstom S.A. EO-Notes 2021(21/30)	FR0014004R72	EUR	300,00 %	80,0100	240.030,00	0,25
0,500% Banco Bilbao Vizcaya Argent. EO-Non-Preferred MTN 2020(27)	XS2101349723	EUR	500,00 %	87,7800	438.900,00	0,46
0,500% Italgas S.P.A. EO-Medium-Term Notes 2021(33)	XS2299002423	EUR	300,00 %	70,7100	212.130,00	0,22
0,500% Nationale-Nederlanden Bank NV EO-Medium-Term Notes 2021(28)	XS2388449758	EUR	300,00 %	82,7100	248.130,00	0,26
0,500% Publicis Groupe S.A. EO-Obl. 2016(16/23)	FR0013217346	EUR	500,00 %	98,8100	494.050,00	0,52
0,500% REN Finance B.V. EO-Medium-Term Nts 2021(21/29)	XS2332186001	EUR	300,00 %	83,2400	249.720,00	0,26
0,500% Solvay S.A. EO-Notes 2019(19/29)	BE6315847804	EUR	500,00 %	84,4400	422.200,00	0,44
0,500% Vodafone Group PLC EO-Med.-Term Notes 2016(24)	XS1499604905	EUR	500,00 %	98,0100	490.050,00	0,52
0,571% Danone S.A. EO-Med.-Term Notes 2020(20/27)	FR0013495181	EUR	300,00 %	89,9600	269.880,00	0,28
0,625% Aviva PLC EO-Med.-Term Nts 2016(23)	XS1509003361	EUR	500,00 %	98,8800	494.400,00	0,52
0,625% Banco de Sabadell S.A. EO-FLR Preferred MTN 19(24/25) FTF	XS2076079594	EUR	500,00 %	94,4400	472.200,00	0,50
0,625% Celanese US Holdings LLC EO-Notes 2021(21/28)	XS2385114298	EUR	400,00 %	77,5000	310.000,00	0,33
0,625% Nordea Bank Abp EO-Medium-Term Nts 2021(26/31) FTF	XS2343459074	EUR	300,00 %	87,2500	261.750,00	0,28
0,750% Aareal Bank AG MTN-IHS v.22(28)	DE000AAR0322	EUR	200,00 %	76,8500	153.700,00	0,16
0,750% Citigroup Inc. EO-Medium-Term Nts 2016(16/23)	XS1457608013	EUR	500,00 %	99,0120	495.060,00	0,52
0,750% Kering S.A. EO-Med.-Term Notes 2020(20/28)	FR0013512407	EUR	300,00 %	88,8600	266.580,00	0,28
0,750% Sodexo S.A. EO-Notes 2016(16/27)	XS1505132602	EUR	500,00 %	90,1500	450.750,00	0,47
0,750% Tele2 AB EO-Medium-Term Nts 2021(30/31)	XS2314267449	EUR	400,00 %	78,1300	312.520,00	0,33
0,830% BP Capital Markets PLC EO-Med.-Term Nts 2016(24/24)	XS1492671158	EUR	400,00 %	96,3800	385.520,00	0,41
0,875% Cie Génle Étis Michelin SCpA EO-Obl. 2018(18/25)	FR0013357845	EUR	500,00 %	93,8650	469.325,00	0,49
0,875% Coöperatieve Rabobank U.A. EO-FLR Non-Pref.MTN 20(27/28) FTF	XS2168285000	EUR	300,00 %	87,6900	263.070,00	0,28
0,875% Kojamo Oyj EO-Medium-Term Notes 21(21/29)	XS2345877497	EUR	400,00 %	70,5700	282.280,00	0,30
0,875% Metso Oyj EO-Medium-Term Nts.2020(20/28)	XS2264692737	EUR	300,00 %	85,5800	256.740,00	0,27
0,875% Nykredit Realkredit A/S EO-FLR Med.-T. Nts 2021(26/31) FTF	DK0030487996	EUR	400,00 %	86,0300	344.120,00	0,36
0,875% PPG Industries Inc. EO-Notes 2016(16/25)	XS1405769487	EUR	500,00 %	93,0090	465.045,00	0,49
0,875% Verizon Communications Inc. EO-Notes 2016(16/25)	XS1405766897	EUR	200,00 %	94,7100	189.420,00	0,20
0,875% Vivendi SE EO-Med.-Term Notes 2017(17/24)	FR0013282571	EUR	300,00 %	95,8200	287.460,00	0,30
0,900% Standard Chartered PLC EO-FLR Med.-T. Nts 2019(26/27) FTF	XS2021467753	EUR	500,00 %	88,9600	444.800,00	0,47
0,950% Macquarie Group Ltd. EO-Medium-Term Notes 2021(31)	XS2343850033	EUR	400,00 %	77,3300	309.320,00	0,33
1,000% BMW Finance N.V. EO-Medium-Term Notes 2018(25)	XS1873143645	EUR	500,00 %	94,7450	473.725,00	0,50
1,000% BorgWarner Inc. EO-Bonds 2021(21/31)	XS2343846940	EUR	300,00 %	77,6300	232.890,00	0,25
1,000% British Telecommunications PLC EO-Med.-Term Notes 2017(17/24)	XS1720922175	EUR	300,00 %	95,8300	287.490,00	0,30
1,000% ENI S.p.A. EO-Medium-Term Nts 2019(34)	XS2065946837	EUR	500,00 %	72,9300	364.650,00	0,38
1,000% IMERYS S.A. EO-Med.-Term Notes 2021(21/31)	FR0014003GX7	EUR	400,00 %	75,4900	301.960,00	0,32
1,000% LANXESS AG Medium-Term Nts 2016(16/26)	XS1501367921	EUR	300,00 %	90,7350	272.205,00	0,29
1,000% Mercedes-Benz Int.Fin. B.V. EO-Medium-Term Notes 2018(25)	DE000A190NE4	EUR	400,00 %	94,2200	376.880,00	0,40
1,000% Sagax EURO MTN NL B.V. EO-Med.-Term Notes 2021(21/29)	XS2342227837	EUR	400,00 %	70,9200	283.680,00	0,30
1,000% Siemens Finan.maatschappij NV EO-Medium-Term Notes 2018(27)	XS1874128033	EUR	500,00 %	93,4900	467.450,00	0,49
1,000% VINCI S.A. EO-Med.-Term Notes 2018(18/25)	FR0013367820	EUR	300,00 %	94,6100	283.830,00	0,30
1,125% Amcor UK Finance PLC EO-Notes 2020(20/27)	XS2193669657	EUR	200,00 %	88,3500	176.700,00	0,19
1,125% Commerzbank AG MTN-Anl. v.19(26) S.932	DE000CZ40N46	EUR	400,00 %	90,5880	362.352,00	0,38
1,125% easyJet PLC EO-Med.-Term Notes 2016(16/23)	XS1505884723	EUR	400,00 %	99,1130	396.452,00	0,42
1,125% Hannover Rück SE FLR-Sub.Anl.v.2019(2029/2039) FTF	XS2063350925	EUR	300,00 %	78,4100	235.230,00	0,25
1,125% Kroatien, Republik EO-Notes 2019(29)	XS1843434876	EUR	400,00 %	87,3000	349.200,00	0,37

Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

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

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg in 1.000	Bestand	Kurs zum 30.06.2023	Kurswert in EUR	in % des Netto- Teilfonds- vermögens	
1,250% Adecco Intl Fin. Serv. B.V. EO-Medium-T.Notes 2019(19/29)	XS1995662027	EUR	400,00	%	85,2200	340.880,00	0,36
1,250% APA Infrastructure Ltd. EO-Medium-Term Nts 2021(21/33)	XS2315784806	EUR	200,00	%	74,0200	148.040,00	0,16
1,250% Bertelsmann SE & Co. KGaA MTN v.2018(25/2025)	XS1888229249	EUR	300,00	%	94,5520	283.656,00	0,30
1,250% HOCHTIEF AG MTN v.2019(2031/2031)	DE000A2YN2V0	EUR	500,00	%	76,7100	383.550,00	0,40
1,250% Slowenien, Republik EO-Bonds 2017(27)	SI0002103685	EUR	300,00	%	92,6900	278.070,00	0,29
1,250% Snam S.p.A. EO-Med.-T. Nts 2022(22/34)	XS2433226854	EUR	300,00	%	74,6100	223.830,00	0,24
1,250% Thames Water Utilities Fin.PLC EO-Med.-Term Nts 2022(22/32)	XS2438026366	EUR	300,00	%	71,5960	214.788,00	0,23
1,300% Baxter International Inc. EO-Notes 2019(19/29)	XS1998215559	EUR	500,00	%	85,8100	429.050,00	0,45
1,350% Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Non-Preferred MTN 2021(31)	XS2304664597	EUR	300,00	%	75,4400	226.320,00	0,24
1,375% Alfa Laval Treasury Intl. AB EO-Medium-Term Nts 2022(22/29)	XS2444286145	EUR	300,00	%	85,8900	257.670,00	0,27
1,375% CRH Finance DAC EO-Med.-Term Notes 2016(16/28)	XS1505896735	EUR	400,00	%	88,4530	353.812,00	0,37
1,375% DSV Finance B.V. EO-Medium-Term Nts 2022(22/30)	XS2458285355	EUR	400,00	%	86,3700	345.480,00	0,36
1,375% Morgan Stanley EO-Med.-T. Nts 2016(26) Ser.G	XS1511787589	EUR	500,00	%	91,4600	457.300,00	0,48
1,375% Raiffeisen Bank Intl AG EO-FLR Med.-T. Nts 2021(28/33) FTF	XS2353473692	EUR	400,00	%	73,6550	294.620,00	0,31
1,375% Tesco Corp. Treas. Serv. PLC EO-Medium-Term Notes 18(23/23)	XS1896851224	EUR	500,00	%	99,2400	496.200,00	0,52
1,450% Italien, Republik EO-B.T.P. 2020(36)	IT0005402117	EUR	1.800,00	%	74,0200	1.332.360,00	1,40
1,450% Transurban Finance Co. Pty Ltd EO-Medium-Term Nts 2019(19/29)	XS1997077364	EUR	300,00	%	86,9000	260.700,00	0,27
1,500% BNP Paribas S.A. EO-Non-Preferred MTN 2017(28)	XS1722801708	EUR	400,00	%	87,8700	351.480,00	0,37
1,500% Fresenius Medical Care KGaA MTN v.2018(2025/2025)	XS1854532949	EUR	500,00	%	94,8200	474.100,00	0,50
1,500% Israel EO-Medium-Term Notes 2019(29)	XS1936100483	EUR	500,00	%	88,7400	443.700,00	0,47
1,500% ISS Global A/S EO-Medium-Term Nts 2017(17/27)	XS1673102734	EUR	300,00	%	90,1100	270.330,00	0,28
1,500% McKesson Corp. EO-Notes 2017(17/25)	XS1567174286	EUR	300,00	%	94,3300	282.990,00	0,30
1,500% Schneider Electric SE EO-Med.-Term Notes 2019(19/28)	FR0013396876	EUR	500,00	%	91,6500	458.250,00	0,48
1,500% Valéo S.E. EO-Med.-Term Nts 2018(18/25)	FR0013342334	EUR	500,00	%	94,6200	473.100,00	0,50
1,500% Vonovia Finance B.V. EO-Medium-Term Nts 2018(18/26)	DE000A19X8A4	EUR	500,00	%	90,5900	452.950,00	0,48
1,625% Abertis Infraestructuras S.A. EO-Medium-Term Nts 2019(19/29)	XS2025480596	EUR	400,00	%	86,4100	345.640,00	0,36
1,625% Givaudan Finance Europe B.V. EO-Notes 2020(20/32)	XS2126170161	EUR	200,00	%	83,6400	167.280,00	0,18
1,625% Lonza Finance International NV EO-Notes 2020(20/27)	BE6321076711	EUR	200,00	%	92,4100	184.820,00	0,19
1,715% Telefonica Emisiones S.A.U. EO-Medium-Term Nts 2017(17/28)	XS1681521081	EUR	300,00	%	92,1900	276.570,00	0,29
1,750% Aeroporti di Roma S.p.a. EO-Medium-Term Nts 2021(31/31)	XS2337326727	EUR	100,00	%	80,9000	80.900,00	0,09
1,750% Holcim Finance (Luxembg) S.A. EO-Medium-T. Notes 2017(17/29)	XS1672151492	EUR	400,00	%	87,8600	351.440,00	0,37
1,750% Italien, Republik EO-B.T.P. 2019(24)	IT0005367492	EUR	2.000,00	%	98,0020	1.960.040,00	2,06
1,776% Bank of America Corp. EO-FLR Med.-T. Nts 2017(17/27) FTF	XS1602547264	EUR	300,00	%	92,3500	277.050,00	0,29
1,875% Compagnie de Saint-Gobain S.A. EO-Medium-Term Notes 2018(28)	XS1881593971	EUR	500,00	%	91,0700	455.350,00	0,48
1,875% Heathrow Funding Ltd. EO-FLR Med.-T. Nts 19(34.36) A FTF	XS1960589155	EUR	300,00	%	79,1900	237.570,00	0,25
1,875% Telefonaktiebolaget L.M.Erics. EO-Med.-Term Nts 17(17/24)	XS1571293684	EUR	300,00	%	98,2720	294.816,00	0,31
1,940% Veolia Environnement S.A. EO-Med.-Term Nts 2018(18/30)	FR0013385473	EUR	300,00	%	89,6200	268.860,00	0,28
2,000% Emerson Electric Co. EO-Notes 2019(19/29)	XS1916073254	EUR	500,00	%	91,2820	456.410,00	0,48
2,000% Goldman Sachs Group Inc., The EO-Medium-Term Notes 2015(23)	XS1265805090	EUR	400,00	%	99,8700	399.480,00	0,42
2,000% Klépierre S.A. EO-Med.-Term Notes 2020(20/29)	FR0013512233	EUR	300,00	%	88,5040	265.512,00	0,28
2,000% NatWest Group PLC EO-FLR Med.-T.Nts 2018(24/25) FTF	XS1875275205	EUR	500,00	%	98,1200	490.600,00	0,52
2,000% Schlumberger Finance B.V. EO-Notes 2020(20/32)	XS2166755509	EUR	300,00	%	86,6900	260.070,00	0,27
2,000% SES S.A. EO-Med.-Term Nts 2020(20/28)	XS2196317742	EUR	400,00	%	86,8500	347.400,00	0,37
2,000% Wienerberger AG EO-Schuldv. 2018(24)	AT0000A20F93	EUR	500,00	%	98,1190	490.595,00	0,52
2,121% Allianz SE FLR-Sub.MTN.v.2020(2030/2050) FTF	DE000A254TM8	EUR	200,00	%	81,7900	163.580,00	0,17
2,124% Rumänien EO-Med.-Term Nts 2019(31)Reg.S	XS2027596530	EUR	300,00	%	75,9900	227.970,00	0,24
2,125% BNP Paribas S.A. EO-FLR Med.-T. Nts 2019(26/27) FTF	FR0013398070	EUR	400,00	%	93,8700	375.480,00	0,40
2,125% British Telecommunications PLC EO-Med.-Term Notes 2018(18/28)	XS1886403200	EUR	400,00	%	92,2200	368.880,00	0,39
2,125% Société Générale S.A. EO-Non-Preferred MTN 2018(28)	FR0013368602	EUR	500,00	%	88,7600	443.800,00	0,47
2,250% AIB Group PLC EO-FLR Med.-T.Nts 2022(26/28) FTF	XS2464405229	EUR	200,00	%	90,8100	181.620,00	0,19
2,250% Eutelsat S.A. EO-Bonds 2019(19/27)	FR0013422623	EUR	400,00	%	82,4200	329.680,00	0,35
2,250% UPM Kymmene Corp. EO-Medium-Term Nts 2022(22/29)	XS2478685931	EUR	300,00	%	90,8700	272.610,00	0,29
2,375% Brambles Finance Ltd. EO-Bonds 2014(14/24)	XS1028952312	EUR	200,00	%	98,2700	196.540,00	0,21
2,375% De Volksbank N.V. EO-FLR Non-Pref.MTN 22(26/27) FTF	XS2475502832	EUR	300,00	%	93,0830	279.249,00	0,29
2,500% Dufry One B.V. EO-Notes 2017(17/24)	XS1699848914	EUR	200,00	%	97,7500	195.500,00	0,21
2,500% thyssenkrupp AG Medium Term Notes v.15(25)	DE000A14J587	EUR	400,00	%	97,1880	388.752,00	0,41
2,500% Wendel SE EO-Bonds 2015(15/27)	FR0012516417	EUR	200,00	%	93,8900	187.780,00	0,20
2,500% Wolters Kluwer N.V. EO-Notes 2014(15/24)	XS1067329570	EUR	300,00	%	98,7500	296.250,00	0,31

Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

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

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg in 1.000	Bestand	Kurs zum 30.06.2023	Kurswert in EUR	in % des Netto- Teilfonds- vermögens
2,625% Carrefour S.A. EO-Medium-Term Nts 2020(20/27)	FR0013505260	EUR	200,00 %	95,2600	190.520,00	0,20
2,625% Unibail-Rodamco-Westfield SE EO-Medium-Term Nts 2020(20/30)	FR0013506821	EUR	300,00 %	87,1500	261.450,00	0,28
2,750% Aéroports de Paris S.A. EO-Obl. 2020(20/30)	FR0013505633	EUR	200,00 %	93,5600	187.120,00	0,20
2,750% Kroatien, Republik EO-Notes 2017(30)	XS17113475306	EUR	500,00 %	95,3500	476.750,00	0,50
2,800% Bundesrep.Deutschland Bundesschatzanw. v.23(25)	DE000BU22015	EUR	3.500,00 %	99,2710	3.474.485,00	3,66
2,875% Cellnex Telecom S.A. EO-Med.-Term Notes 2017(17/25)	XS1551726810	EUR	300,00 %	97,0300	291.090,00	0,31
2,950% Autoroutes du Sud de la France EO-Med.-Term Notes 2014(14/24)	FR0011694033	EUR	300,00 %	99,5400	298.620,00	0,31
3,000% ACCOR S.A. EO-Bonds 2019(19/26)	FR0013399029	EUR	300,00 %	96,4470	289.341,00	0,30
3,000% KBC Groep N.V. EO-Medium Term Notes 2022(30)	BE0002875566	EUR	400,00 %	92,8400	371.360,00	0,39
3,125% OI European Group B.V. EO-Notes 2016(16/24) Reg.S	XS1405765907	EUR	300,00 %	98,3000	294.900,00	0,31
3,125% Orange S.A. EO-Med.-Term Notes 2013(13/24)	FR0011560077	EUR	400,00 %	99,5460	398.184,00	0,42
3,129% Toronto-Dominion Bank, The EO-Medium-Term Notes 2022(32)	XS2511309903	EUR	300,00 %	92,7080	278.124,00	0,29
3,250% Deutsche Bank AG FLR-MTN v.22(27/28) FTF	DE000DL19WU8	EUR	200,00 %	92,1600	184.320,00	0,19
3,375% Indonesien, Republik EO-Med.-T. Nts 2015(25) Reg.S	XS1268430201	EUR	400,00 %	98,5300	394.120,00	0,41
3,375% Polen, Republik EO-Medium-Term Notes 2012(24)	XS0841073793	EUR	250,00 %	100,3720	250.930,00	0,26
3,500% Deutsche Lufthansa AG MTN v.2021(2029/2029)	XS2363235107	EUR	300,00 %	91,2500	273.750,00	0,29
3,500% Frankreich EO-OAT 2010(26)	FR0010916924	EUR	1.000,00 %	101,0600	1.010.600,00	1,06
3,750% BASF SE MTN v.2022(2022/2032)	XS2491542457	EUR	300,00 %	99,1400	297.420,00	0,31
3,750% Sandvik AB EO-Med.-Term Nts 2022(22/29)	XS2538368221	EUR	400,00 %	98,9200	395.680,00	0,42
3,875% Assicurazioni Generali S.p.a. EO-Medium-Term Notes 2019(29)	XS1941841311	EUR	400,00 %	95,7000	382.800,00	0,40
3,875% Prologis Euro Finance LLC EO-Notes 2023(23/30)	XS2580271596	EUR	200,00 %	96,9200	193.840,00	0,20
4,250% AXA S.A. EO-FLR M.-T.Nts 2022(32/43) FTF	XS2487052487	EUR	300,00 %	91,6900	275.070,00	0,29
4,250% Crédit Mutuel Arkéa EO-Non-Preferred MTN 2022(32)	FR001400E946	EUR	200,00 %	100,0300	200.060,00	0,21
4,250% Johnson Controls Internat. PLC EO-Notes 2023(23/35)	XS2626007939	EUR	400,00 %	100,3420	401.368,00	0,42
4,275% National Grid PLC EO-Medium Term Nts 2023(23/35)	XS2576067081	EUR	300,00 %	98,6200	295.860,00	0,31
4,500% ABN AMRO Bank N.V. EO-Non-Preferred MTN 2022(34)	XS2557084733	EUR	300,00 %	100,6900	302.070,00	0,32
4,500% Bilfinger SE Anleihe v.2019(2024/2024)	DE000A2YNQW7	EUR	400,00 %	99,5040	398.016,00	0,42
4,500% BPCE S.A. EO-Non-Preferred MTN 2023(33)	FR001400F083	EUR	200,00 %	100,2000	200.400,00	0,21
4,500% RCI Banque S.A. EO-Medium-Term Nts 2023(27/27)	FR001400H2O3	EUR	400,00 %	98,5760	394.304,00	0,41
4,750% ALD S.A. EO-Medium-Term Notes 2022(25)	FR001400D7M0	EUR	200,00 %	100,7600	201.520,00	0,21
4,750% Covestro AG EO-MTN v.2022(2022/2028)	XS2554997937	EUR	300,00 %	101,9600	305.880,00	0,32
4,750% UBS Group AG EO-FLR Med.-T. Nts 2023(31/32) FTF	CH1255915014	EUR	400,00 %	99,5100	398.040,00	0,42
4,875% UniCredit S.p.a. EO-FLR Med.-T. Nts 19(24/29) FTF	XS1953271225	EUR	300,00 %	99,2600	297.780,00	0,31
5,000% Fresenius SE & Co. KGaA MTN v.2022(2022/2029)	XS2559501429	EUR	300,00 %	100,9600	302.880,00	0,32
5,000% Suez S.A. EO-Medium-Term Nts 2022(22/32)	FR001400D092	EUR	400,00 %	106,0400	424.160,00	0,45
5,125% Assicurazioni Generali S.p.a. EO-Medium-Term Notes 2009(24)	XS0452314536	EUR	200,00 %	101,5800	203.160,00	0,21
5,125% Südzucker Intl Finance B.V. EO-Notes 2022(22/27)	XS2550868801	EUR	400,00 %	102,7940	411.176,00	0,43
5,200% Hera S.p.A. EO-Medium-Term Notes 2013(28)	XS0880764435	EUR	100,00 %	104,4200	104.420,00	0,11
5,230% Raiffeisen Schweiz Genossensch EO-Anl. 2022(27)	CH1224575899	EUR	400,00 %	102,9200	411.680,00	0,43
5,250% CNP Assurances S.A. EO-FLR Med.-T.Nts 2023(33/53) FTF	FR001400F620	EUR	200,00 %	95,7400	191.480,00	0,20
5,250% ING Groep N.V. EO-FLR Med.-T. Nts 2022(32/33) FTF	XS2554745708	EUR	300,00 %	105,3500	316.050,00	0,33
5,262% Barclays PLC EO-FLR Med.-T. Nts 2022(33/34) FTF	XS2560422581	EUR	300,00 %	99,9380	299.814,00	0,32
5,375% Bouygues S.A. EO-Bonds 2022(22/42)	FR001400DNF5	EUR	300,00 %	109,6200	328.860,00	0,35
5,500% Jyske Bank A/S EO-Non-Prefer. MTN 2022(26/27)	XS2555918270	EUR	300,00 %	100,8100	302.430,00	0,32
1,250% Deutsche Telekom Intl Fin.B.V. LS-Medium-Term Notes 2016(23)	XS1501155748	GBP	500,00 %	98,8600	576.006,53	0,61
1,750% Sodexo S.A. LS-Notes 2019(19/28)	XS2017471983	GBP	300,00 %	81,5000	284.915,22	0,30
3,375% GlaxoSmithKline Cap. PLC LS-Medium-Term Notes 2012(27)	XS0866588527	GBP	200,00 %	91,6400	213.575,72	0,22
3,625% Severn Trent Utilities Finance LS-Medium-Term Notes 2013(26)	XS0875301912	GBP	300,00 %	93,0500	325.292,78	0,34
6,000% Marks & Spencer PLC LS-Medium-Term Notes 2012(25)	XS0863523030	GBP	300,00 %	97,0200	339.171,47	0,36
6,625% Lloyds Banking Group PLC LS-FLR Med.-T. Nts 2023(28/33) FTF	XS2591847970	GBP	300,00 %	94,6600	330.921,17	0,35
2,000% Moody's Corp. DL-Notes 2021(21/31)	US615369AW51	USD	100,00 %	80,5700	73.849,68	0,08
2,650% Oracle Corp. DL-Notes 2016(16/26)	US68389XBM65	USD	500,00 %	92,8740	425.637,03	0,45
2,880% Tencent Holdings Ltd. DL-Med.-T. Nts 21(21/31) Reg.S	US88032XBA19	USD	400,00 %	84,7000	310.540,79	0,33
3,306% Banco Santander S.A. DL-Preferred Notes 2019(29)	US05971KAC36	USD	400,00 %	89,1390	326.815,77	0,34
4,125% Alcoa Nederland Holding B.V. DL-Notes 2021(21/29) Reg.S	USN02175AE23	USD	200,00 %	89,1250	163.382,22	0,17
4,500% Willis North America Inc. DL-Notes 2018(18/28)	US970648AG61	USD	200,00 %	95,3510	174.795,60	0,18
4,600% Intercontinental Exchange Inc. DL-Notes 2022(22/33)	US45866FAW41	USD	100,00 %	96,4020	88.361,14	0,09
4,700% Fidelity Natl Inform.Svcs Inc. DL-Notes 2022(22/27)	US31620MBW55	USD	100,00 %	97,5260	89.391,38	0,09

Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

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

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg in 1.000	Bestand	Kurs zum 30.06.2023	Kurswert in EUR	in % des Netto- Teilfonds- vermögens
5,125% DCP Midstream Operating L.P. DL-Notes 2019(19/29)	US23311VAH06	USD	300,00 %	98,2600	270.192,48	0,28
5,375% Indonesien, Republik DL-Med.-Term Nts 2013(23)Reg.S	USY20721BH19	USD	300,00 %	99,7800	274.372,14	0,29
7,625% Türkei, Republik DL-Notes 2019(29)	US900123CT57	USD	300,00 %	94,1500	258.890,93	0,27
<b>Organisierter Markt</b>						
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>						
0,000% BNP Paribas S.A. EO-Pref.Zero Exch.Bonds 22(25)	FR0014008OH3	EUR	300,00 %	116,4580	349.374,00	0,37
0,250% ASML Holding N.V. EO-Notes 2020(20/30)	XS2010032378	EUR	200,00 %	81,4800	162.960,00	0,17
0,500% Brenntag Finance B.V. EO-Medium-Term Nts 2021(21/29)	XS2394063437	EUR	200,00 %	79,9400	159.880,00	0,17
0,500% PepsiCo Inc. EO-Notes 2020(20/28)	XS2168625544	EUR	300,00 %	86,7800	260.340,00	0,27
0,500% Whirlpool EMEA Finance S.à r.l. EO-Notes 2020(20/28)	XS2115092954	EUR	300,00 %	85,4900	256.470,00	0,27
0,625% Mölnlycke Holding AB EO-Medium-Term Nts 2020(20/31)	XS2270406452	EUR	300,00 %	77,0200	231.060,00	0,24
0,697% Eaton Capital Unlimited Co. EO-Notes 2019(19/25)	XS1996269061	EUR	300,00 %	93,8640	281.592,00	0,30
0,750% Aedifica S.A. EO-Notes 2021(21/31)	BE6330288687	EUR	100,00 %	70,0400	70.040,00	0,07
0,766% Westpac Banking Corp. EO-FLR Med.-T. Nts 2021(26/31) FTF	XS2342206591	EUR	300,00 %	86,5900	259.770,00	0,27
0,797% Mizuho Financial Group Inc. EO-Medium-Term Notes 2020(30)	XS2098350965	EUR	500,00 %	80,1200	400.600,00	0,42
0,800% AGCO International Holdings BV EO-Notes 2021(21/28)	XS2393232071	EUR	200,00 %	83,2990	166.598,00	0,18
0,875% Nasdaq Inc. EO-Notes 2020(20/30)	XS2010032881	EUR	200,00 %	80,7900	161.580,00	0,17
1,125% Australia & N. Z. Bkg Grp Ltd. EO-FLR Med.-Term Nts 19(24/29) FTF	XS2082818951	EUR	500,00 %	93,6900	468.450,00	0,49
1,125% Mexiko EO-Medium-Term Nts 2020(20/30)	XS2104886341	EUR	500,00 %	82,3200	411.600,00	0,43
1,500% Aptiv PLC EO-Notes 2015(15/25)	XS1197775692	EUR	300,00 %	95,3380	286.014,00	0,30
1,500% CCEP Finance (Ireland) DAC EO-Notes 2021(21/41)	XS2337061837	EUR	300,00 %	68,4560	205.368,00	0,22
2,000% Autostrade per L'Italia S.p.A. EO-Notes 2021(21/30)	XS2278566299	EUR	300,00 %	83,9600	251.880,00	0,26
2,000% Volvo Car AB EO-Med.-Term Nts 2017(17/25) 1	XS1724626699	EUR	300,00 %	95,4800	286.440,00	0,30
2,125% Informa PLC EO-Medium-Term Nts 2020(20/25)	XS2240507801	EUR	400,00 %	95,2650	381.060,00	0,40
2,125% Nexi S.p.A. EO-Nts 2021(21/29) Reg.S	XS2332590475	EUR	100,00 %	83,2500	83.250,00	0,09
2,250% IQVIA Inc. EO-Notes 2019(19/28) Reg.S	XS2036798150	EUR	300,00 %	88,0150	264.045,00	0,28
2,375% Barry Callebaut Services N.V. EO-Notes 2016(24)	BE6286963051	EUR	200,00 %	98,3960	196.792,00	0,21
2,500% FIL Ltd. EO-Bonds 2016(26)	XS1511793124	EUR	400,00 %	91,8400	367.360,00	0,39
2,534% Swiss Re Finance (Lux) S.A. EO-FLR Notes 2019(30/50) FTF	XS1963116964	EUR	300,00 %	83,6700	251.010,00	0,26
2,625% Wendel SE EO-Exchangeable Bonds 2023(26)	FR001400GVB0	EUR	200,00 %	98,0000	196.000,00	0,21
2,750% Helvetia Europe EO-FLR Notes 2020(31/41) FTF	XS2197076651	EUR	400,00 %	79,4800	317.920,00	0,33
2,750% Smurfit Kappa Acquis. Unl. Co. EO-Notes 2015(15/25) Reg.S	XS1117298759	EUR	300,00 %	97,7600	293.280,00	0,31
3,000% WPP Finance 2013 EO-Medium Term Nts 2013(13/23)	XS0995643003	EUR	400,00 %	99,5200	398.080,00	0,42
3,125% Cemex S.A.B. de C.V. EO-Notes 2019(19/26) Reg.S	XS1964617879	EUR	200,00 %	95,9700	191.940,00	0,20
3,250% Svenska Handelsbanken AB EO-FLR Med.-Term Nts 22(28/33) FTF	XS2486857431	EUR	300,00 %	91,2500	273.750,00	0,29
3,375% Levi Strauss & Co. EO-Notes 2017(17/27) Reg.S	XS1571994554	EUR	400,00 %	95,0600	380.240,00	0,40
3,375% Ziggo Bond Co. B.V. EO-Notes 2020(20/30) Reg.S	XS2116386132	EUR	200,00 %	73,2700	146.540,00	0,15
3,556% Mitsubishi UFJ Finl Grp Inc. EO-Medium-Term Nts 2022(32)	XS2489982293	EUR	300,00 %	95,7400	287.220,00	0,30
3,625% Chorus Ltd. EO-Med.-Term Notes 2022(22/29)	XS2521013909	EUR	200,00 %	97,3400	194.680,00	0,20
3,875% Daimler Truck Intl Finance EO-Med.-Term Notes 2023(23/29)	XS2623221228	EUR	400,00 %	98,9490	395.796,00	0,42
4,000% Robert Bosch GmbH MTN v.2023(2023/2035)	XS2629470845	EUR	400,00 %	101,4300	405.720,00	0,43
4,375% Rentokil Initial Finance B.V. EO-Medium-Term Nts 2022(22/30)	XS2494946820	EUR	400,00 %	101,2300	404.920,00	0,43
4,500% Dell Bank International DAC EO-Medium-Term Nts 2022(22/27)	XS2545259876	EUR	400,00 %	100,8200	403.280,00	0,42
1,875% Wales & West Utilities Fin.PLC LS-Med.-Term Notes 2020(20/41)	XS2124190369	GBP	200,00 %	57,2700	133.473,17	0,14
2,250% Fiserv Inc. LS-Notes 2019(19/25)	XS1843433712	GBP	300,00 %	91,7000	320.573,33	0,34
1,750% Rockwell Automation Inc. DL-Notes 2021(21/31)	US773903AL39	USD	100,00 %	80,1600	73.473,88	0,08
2,400% Autodesk Inc. DL-Notes 2021(21/31)	US052769AH94	USD	100,00 %	82,7700	75.866,18	0,08
2,500% Tyco Electronics Group S.A. DL-Notes 2022(22/32)	US902133AY31	USD	100,00 %	84,2920	77.261,23	0,08
2,600% eBay Inc. DL-Notes 2021(21/31)	US278642AY97	USD	400,00 %	83,6590	306.724,11	0,32
2,600% Williams Companies Inc., The DL-Notes 2021(21/31)	US969457BY52	USD	200,00 %	82,5850	151.393,22	0,16
2,650% HP Inc. DL-Notes 2022(22/31)	US40434LAJ44	USD	400,00 %	80,5800	295.435,38	0,31
2,950% Marvell Technology Inc. DL-Notes 2021(21/31)	US573874AJ32	USD	100,00 %	83,8600	76.865,26	0,08
3,000% Philippinen DL-Bonds 2018(28)	US718286CC97	USD	500,00 %	92,8400	425.481,21	0,45
3,125% Ball Corp. DL-Notes 2021(31/31)	US058498AX40	USD	400,00 %	82,3670	301.987,17	0,32
3,250% Hologic Inc. DL-Notes 2020(20/29) Reg.S	USU38284AF94	USD	100,00 %	87,2600	79.981,67	0,08
3,375% Centene Corp. DL-Notes 2020(20/30)	US15135BAV36	USD	200,00 %	86,1110	157.857,01	0,17

Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

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

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg in 1.000	Bestand	Kurs zum 30.06.2023	Kurswert in EUR	in % des Netto- Teilfonds- vermögens	
3,375% Weyerhaeuser Co. DL-Notes 2022(22/33)	US962166CA07	USD	200,00	%	86,4200	158.423,46	0,17
3,500% Alb.Cos LLC/Safe.Inc/N.A.I./A. DL-Notes 2020(20/29) REGS	USU0125LAH34	USD	400,00	%	86,9710	318.867,09	0,34
3,500% Zurich Finance (Ireland) DAC DL-FLR Med.-T. Nts 2021(32/52) FTF	XS2416978190	USD	200,00	%	79,1900	145.169,57	0,15
3,625% Gartner Inc. DL-Notes 2021(21/29) Reg.S	USU33791AD36	USD	100,00	%	88,1850	80.829,51	0,09
3,800% American Tower Corp. DL-Notes 2019(19/29)	US03027XAW02	USD	500,00	%	91,8640	421.008,25	0,44
3,850% Thomson Reuters Corp. DL-Notes 2014(14/24)	US884903BT19	USD	300,00	%	96,9940	266.711,27	0,28
3,875% Ally Financial Inc. DL-Notes 2019(19/24)	US02005NBH26	USD	300,00	%	97,7590	268.814,85	0,28
3,900% Zoetis Inc. DL-Notes 2018(18/28)	US98978VAN38	USD	500,00	%	96,3330	441.489,46	0,46
4,000% Sensata Technologies B.V. DL-Notes 2021(21/29) Reg.S	USN78840AM28	USD	200,00	%	89,0110	163.173,24	0,17
4,000% Service Corp. International DL-Notes 2021(21/31)	US817565CG79	USD	100,00	%	85,6030	78.462,88	0,08
4,125% HCA Inc. DL-Notes 2019(19/29)	US404119BX69	USD	300,00	%	92,4880	254.320,81	0,27
4,185% Micron Technology Inc. DL-Notes 2019(19/27)	US595112BP79	USD	200,00	%	95,8120	175.640,70	0,18
4,250% AbbVie Inc. DL-Notes 2018(18/28)	US00287YBF51	USD	500,00	%	97,0970	444.990,83	0,47
4,250% Sinopec Grp Ov.Dev.(2018) Ltd. DL-Notes 2018(18/28) Reg.S	USG82016AC32	USD	400,00	%	97,2300	356.480,29	0,38
4,300% Kellogg Co. DL-Notes 2018(18/28)	US487836BW75	USD	400,00	%	96,8510	355.090,74	0,37
4,300% Western Midstream Operating LP DL-Notes 2020(20/30)	US958667AC17	USD	300,00	%	89,8350	247.025,66	0,26
4,350% Valero Energy Corp. DL-Notes 2018(18/28)	US91913YAV20	USD	700,00	%	95,7950	614.633,36	0,65
4,375% Apache Corp. DL-Notes 2018(18/28)	US037411BE40	USD	500,00	%	91,2500	418.194,32	0,44
4,375% Marsh & McLennan Cos. Inc. DL-Notes 2019(19/29)	US571748BG65	USD	500,00	%	97,1280	445.132,91	0,47
4,500% Brasilien DL-Bonds 2019(19/29)	US105756CA66	USD	300,00	%	94,4500	259.715,86	0,27
4,500% Kaiser Aluminum Corp. DL-Notes 2021(21/31) Reg.S	USU24442AE29	USD	100,00	%	79,8850	73.221,81	0,08
4,625% Yum! Brands, Inc. DL-Notes 2021(21/32)	US988498AP63	USD	400,00	%	91,1175	334.069,66	0,35
4,750% Banco do Brasil S.A. DL-Med.-Term Nts 2019(24)Reg.S	USP1R027AA25	USD	300,00	%	98,6200	271.182,40	0,29
4,750% VMED O2 UK Financing I PLC DL-Notes 2021(21/31) Reg.S	USG9444PAD45	USD	400,00	%	82,5900	302.804,77	0,32
5,250% United Rentals N. America Inc. DL-Notes 2019(19/30)	US911365BL76	USD	300,00	%	95,8270	263.502,29	0,28
5,750% Hilton Domestic Operating Co. DL-Notes 2020(20/28) Reg.S	USU4328RAE46	USD	200,00	%	97,7500	179.193,40	0,19
6,125% Macy's Retail Holdings LLC DL-Notes 2022(22/32) Reg.S	USU5562LAJ80	USD	100,00	%	87,5870	80.281,39	0,08
6,250% Icahn Enterpr.L.P./Fin. Corp. DL-Notes 2019(19/26) Reg.S	USU44927AS74	USD	300,00	%	91,1090	250.528,87	0,26
6,500% Petróleos Mexicanos (PEMEX) DL-Notes 2018(18/29) Reg.S	USP78625DV20	USD	300,00	%	82,7860	227.642,53	0,24
9,625% Seagate HDD Cayman DL-Notes 2022(22/32) 144A	US81180WBG50	USD	306,00	%	109,0400	305.831,71	0,32
<b>Sonstige Märkte</b>							
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>							
2,500% Capgemini SE EO-Notes 2015(15/23)	FR0012821940	EUR	400,00	%	100,0000	400.000,00	0,42
3,750% Mattel Inc. DL-Notes 2021(21/29) Reg.S	USU57619AG08	USD	100,00	%	88,0000	80.659,95	0,08
<b>Wertpapier-Investmentanteile</b>							
Swisscanto(LU)Bd-Res.COCO Namens-Ant. DTH CHF o.N.	LU0599119616	ANT	18.000,00	CHF	164,0700	3.025.726,14	3,18
FISCH Convert.Gbl Sustainable Namens-Anteile BE o.N.	LU1130246231	ANT	10.000,00	EUR	104,2500	1.042.500,00	1,10
Plenum CAT Bond Fund Inhaber-Anteile P EUR o.N.	LI0290349617	ANT	22.000,00	EUR	104,9400	2.308.680,00	2,43
<b>Sonstige Wertpapiere</b>							
<b>Aktien</b>							
4,750% OHL Operaciones S.A Techn.Codes EO-Nts 2014(18/22)	XS2339732385	EUR	100,00	%	0,0000	0,00	0,00
4,000% VEON Holdings B.V. DL-Bonds 2019(19/25) Reg.S	XS2058691663	USD	200,00	%	84,9580	155.743,35	0,16
4,950% VEON Holdings B.V. DL-Bonds 2017(17/24) Reg.S	XS1625994618	USD	300,00	%	93,5130	257.139,32	0,27
5,150% Gaz Capital S.A. DL-M.T.LPN 19(26)GAZPROM Reg.S	XS1951084471	USD	500,00	%	79,1620	362.795,60	0,38
<b>Summe Wertpapiervermögen</b>				<b>EUR</b>		<b>87.962.050,12</b>	<b>92,54</b>
<b>Derivate</b>							
<b>Rentenindex-Terminkontrakte</b>							
Bobl Future 07.09.23		STK	-95	EUR	115,7100	39.900,00	0,04
Euro Bund Future 07.09.23		STK	-147	EUR	133,7400	-182.280,00	-0,19
10 Year T-Note Future 20.09.23		STK	-90	USD	112,2656	101.827,45	0,11
5 Year T-Note Future 29.09.23		STK	-25	USD	107,0938	31.328,77	0,03

Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

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

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg in 1.000	Bestand	Kurs zum 30.06.2023	Kurswert in EUR	in % des Netto- Teilfonds- vermögens
<b>Devisenterminkontrakte Kauf</b>						
<b>offen (Kontrahent Verwahrstelle)</b>						
Devisenterminkontrakt Kauf EUR / USD 15.08.23		EUR	35.000	EUR	491,70	0,00
<b>Devisenterminkontrakte Verkauf</b>						
<b>offen (Kontrahent Verwahrstelle)</b>						
Devisenterminkontrakt Verkauf EUR / CHF 15.08.23		EUR	-81.000.000	EUR	-324.580,09	-0,34
Devisenterminkontrakt Verkauf EUR / USD 15.08.23		EUR	-700.000	EUR	3.245,28	0,00
Devisenterminkontrakt Verkauf GBP / EUR 20.07.23		GBP	-2.400.000	EUR	-83.427,27	-0,09
Devisenterminkontrakt Verkauf USD / EUR 20.07.23		USD	-15.500.000	EUR	-132.280,29	-0,14
<b>Summe Derivate</b>				<b>EUR</b>	<b>-545.774,45</b>	<b>-0,57</b>
<b>Bankguthaben</b>						
<b>Bankkonten</b>						
Bankkonto (Collateral) RBC Investor Services Bank S.A.		EUR	800.000,00	EUR	800.000,00	0,84
Bankkonto RBC Investor Services Bank S.A.		CHF	908.506,58	EUR	930.799,22	0,98
Bankkonto RBC Investor Services Bank S.A.		EUR	144.400,62	EUR	144.400,62	0,15
Bankkonto RBC Investor Services Bank S.A.		GBP	53.907,87	EUR	62.818,70	0,07
Bankkonto RBC Investor Services Bank S.A.		USD	1.840.009,20	EUR	1.686.534,56	1,77
Bankkonto UBS Ltd London		EUR	1.193.200,91	EUR	1.193.200,91	1,26
Bankkonto UBS Ltd London		GBP	8.350,05	EUR	9.730,29	0,01
Bankkonto UBS Ltd London		USD	1.094.423,35	EUR	1.003.137,81	1,06
Forderungen aus Variation Margin		EUR	182.280,00	EUR	182.280,00	0,19
<b>Summe Bankguthaben</b>				<b>EUR</b>	<b>6.012.902,11</b>	<b>6,33</b>
<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>						
Initial Margin UBS Ltd London		EUR	920.937,20	EUR	920.937,20	0,97
Initial Margin UBS Ltd London		USD	224.000,00	EUR	205.316,22	0,22
Sonstige Forderungen		EUR	73.714,15	EUR	73.714,15	0,08
Wertpapierzinsen		EUR	650.515,81	EUR	650.515,81	0,68
Wertpapierzinsen		GBP	22.783,42	EUR	26.549,47	0,03
Wertpapierzinsen		USD	163.619,97	EUR	149.972,44	0,16
<b>Summe Sonstige Vermögensgegenstände</b>				<b>EUR</b>	<b>2.027.005,29</b>	<b>2,13</b>
<b>Bankverbindlichkeiten</b>						
Verbindlichkeiten aus Variation Margin		EUR	-39.900,00	EUR	-39.900,00	-0,04
Verbindlichkeiten aus Variation Margin		USD	-145.273,44	EUR	-133.156,22	-0,14
<b>Summe Bankverbindlichkeiten</b>				<b>EUR</b>	<b>-173.056,22</b>	<b>-0,18</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>						
Sonstige Verbindlichkeiten		CHF	-179.854,50	EUR	-184.267,72	-0,19
Sonstige Verbindlichkeiten		EUR	-46.624,92	EUR	-46.624,92	-0,05
Sonstige Verbindlichkeiten		USD	-1.828,94	EUR	-1.676,39	0,00
<b>Summe Sonstige Verbindlichkeiten 1)</b>				<b>EUR</b>	<b>-232.569,03</b>	<b>-0,24</b>
<b>Netto-Teilfondsvermögen</b>				<b>EUR</b>	<b>95.050.557,82</b>	<b>100,00<sup>*)</sup></b>

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

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

Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

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

Nettoinventarwert pro Aktie des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund Plus ESG A	EUR	10,61
Nettoinventarwert pro Aktie des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund Plus ESG C	CHF	9,87
Nettoinventarwert pro Aktie des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund Plus ESG B	EUR	10,78
Nettoinventarwert pro Aktie des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund Plus ESG D	CHF	10,20
Nettoinventarwert pro Aktie des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund Plus ESG X	CHF	8,55
Nettoinventarwert pro Aktie des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund Plus ESG E	USD	11,23
Umlaufende Aktien des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund Plus ESG A	STK	144.634,258
Umlaufende Aktien des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund Plus ESG C	STK	6.426.071,162
Umlaufende Aktien des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund Plus ESG B	STK	852.449,021
Umlaufende Aktien des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund Plus ESG D	STK	1.770.791,439
Umlaufende Aktien des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund Plus ESG X	STK	14.977,530
Umlaufende Aktien des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund Plus ESG E	STK	65.653,000
Anteil der Wertpapiere am Netto-Teilfondsvermögen	%	92,54
Anteil der Derivate am Netto-Teilfondsvermögen	%	-0,57

### Verpflichtungen aus Derivaten

Devisentermingeschäfte Käufe	Währung	Nominal	Währung	Nominal	offene Positionen in EUR
Devisenterminkontrakt Kauf EUR / USD 15.08.23	EUR	35.000,00	USD	-37.731,23	35.075,77
<b>Summe Devisentermingeschäfte Käufe</b>					<b>35.075,77</b>

Devisentermingeschäfte Verkäufe	Währung	Nominal	Währung	Nominal	offene Positionen in EUR
Devisenterminkontrakt Verkauf GBP / EUR 20.07.23	GBP	-2.400.000,00	EUR	2.711.190,44	2.794.617,71
Devisenterminkontrakt Verkauf EUR / CHF 15.08.23	EUR	-81.000.000,00	CHF	78.557.607,00	80.809.808,30
Devisenterminkontrakt Verkauf EUR / USD 15.08.23	EUR	-700.000,00	USD	768.894,00	701.515,49
Devisenterminkontrakt Verkauf USD / EUR 20.07.23	USD	-15.500.000,00	EUR	14.062.528,35	14.194.808,64
<b>Summe Devisentermingeschäfte Verkäufe</b>					<b>98.500.750,14</b>

Futures Verkauf	Währung	Kontrakte	Kontraktgröße	Kurs Underlying	Dev. Kurs	Verpflichtungen aus Derivaten in EUR
10 Year T-Note Future 20.09.23	USD	-90,00	100.000,00	112,2656	0,916590	9.261.142,30
5 Year T-Note Future 29.09.23	USD	-25,00	100.000,00	107,0938	0,916590	2.454.027,27
Bobl Future 07.09.23	EUR	-95,00	100.000,00	115,7100	1,000000	10.992.450,00
EUR Bund Future 07.09.23	EUR	-147,00	100.000,00	133,7400	1,000000	19.659.780,00
<b>Summe Futures Verkauf</b>						<b>42.367.399,57</b>

### Devisenkurse (in Mengennotiz)

			per	30.06.2023
Britisches Pfund	GBP	0,858150	=1	EUR
Schweizer Franken	CHF	0,976050	=1	EUR
US-Dollar	USD	1,091000	=1	EUR

Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

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

### Ertrags- und Aufwandsrechnung des Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund Plus ESG im Zeitraum vom 1. Juli 2022 bis 30. Juni 2023

	EUR
<b>Erträge</b>	
Zinserträge aus Wertpapieren	1.878.447,89
Zinsen aus Geldanlagen	134.457,97
Sonstige Erträge	98,28
Ordentlicher Ertragsausgleich	-39.813,00
<b>Erträge insgesamt</b>	<b>1.973.191,14</b>
<b>Aufwendungen</b>	
Fondsmanagervergütung	-743.445,29
Verwaltungsvergütung	-51.679,29
Zentralverwaltungsstellenvergütung	-26.314,38
Verwahrstellenvergütung	-50.099,44
Prüfungskosten	-13.360,26
Taxe d'abonnement	-46.019,73
Veröffentlichungskosten	-8.624,20
Register- und Transferstellenvergütung	-649,99
Regulatorische Kosten	-8.364,80
Zinsaufwendungen	-31.404,25
Sonstige Aufwendungen	-75.193,43
Ordentlicher Aufwandsausgleich	23.242,67
<b>Aufwendungen insgesamt</b>	<b>-1.031.912,39</b>
<b>Ordentlicher Nettoertrag</b>	<b>941.278,75</b>
<b>Veräußerungsgeschäfte</b>	
Realisierte Gewinne	12.982.348,68
Ertragsausgleich auf realisierte Gewinne	-425.591,18
Realisierte Verluste	-5.646.112,21
Aufwandsausgleich auf realisierte Verluste	144.538,24
<b>Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften</b>	<b>7.055.183,53</b>
<b>Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>	<b>7.996.462,28</b>
<b>Veränderung der nicht realisierten Gewinne und Verluste</b>	
Veränderung der nicht realisierten Gewinne	322.228,78
Veränderung der nicht realisierten Verluste	-4.254.480,81
<b>Nettoveränderung des nicht realisierten Ergebnisses des Geschäftsjahres</b>	<b>-3.932.252,03</b>
<b>Ergebnis des Geschäftsjahres inkl. Ertrags-/Aufwandsausgleich</b>	<b>4.064.210,25</b>

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

	EUR
<b>Netto-Teilfondsvermögen zum Beginn des Geschäftsjahres</b>	<b>96.246.610,49</b>
Mittelzuflüsse	2.314.675,62
Mittelabflüsse	-7.872.561,81
Mittelzufluss/ -abfluss netto	-5.557.886,19
Ertrags- und Aufwandsausgleich	297.623,27
Ergebnis des Geschäftsjahres inkl. Ertrags-/Aufwandsausgleich	4.064.210,25
<b>Netto-Teilfondsvermögen zum Ende des Geschäftsjahres</b>	<b>95.050.557,82</b>

Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

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

### Entwicklung des Teilfonds im Jahresvergleich

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

Stichtag	Umlaufende Aktien	Währung	Netto-Teilfondsvermögen	Nettoinventarwert pro Aktie
30.06.2023	144.634,258	EUR	1.534.561,90	10,61
30.06.2022	124.276,218	EUR	1.275.768,70	10,27
30.06.2021	95.616,218	EUR	1.034.932,95	10,82

### Entwicklung des Teilfonds im Jahresvergleich

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

Stichtag	Umlaufende Aktien	Währung	Netto-Teilfondsvermögen	Nettoinventarwert pro Aktie
30.06.2023	6.426.071,162	CHF	63.454.745,10	9,87
30.06.2022	6.840.540,225	CHF	66.194.386,83	9,68
30.06.2021	7.116.240,323	CHF	73.127.039,91	10,28

### Entwicklung des Teilfonds im Jahresvergleich

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

Stichtag	Umlaufende Aktien	Währung	Netto-Teilfondsvermögen	Nettoinventarwert pro Aktie
30.06.2023	852.449,021	EUR	9.189.825,70	10,78
30.06.2022	906.299,483	EUR	9.404.823,34	10,38
30.06.2021	830.024,518	EUR	9.091.354,25	10,95

### Entwicklung des Teilfonds im Jahresvergleich

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

Stichtag	Umlaufende Aktien	Währung	Netto-Teilfondsvermögen	Nettoinventarwert pro Aktie
30.06.2023	1.770.791,439	CHF	18.064.283,33	10,20
30.06.2022	1.875.048,439	CHF	18.640.991,84	9,94
30.06.2021	2.002.710,439	CHF	21.039.350,44	10,51

### Entwicklung des Teilfonds im Jahresvergleich

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

Stichtag	Umlaufende Aktien	Währung	Netto-Teilfondsvermögen	Nettoinventarwert pro Aktie
30.06.2023	14.977,530	CHF	127.997,53	8,55
30.06.2022	14.977,530	CHF	125.753,84	8,40
30.06.2021	14.977,530	CHF	144.687,38	9,66

### Entwicklung des Teilfonds im Jahresvergleich

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

Stichtag	Umlaufende Aktien	Währung	Netto-Teilfondsvermögen	Nettoinventarwert pro Aktie
30.06.2023	65.653,000	USD	737.206,02	11,23
30.06.2022	67.110,000	USD	712.246,48	10,61
30.06.2021	85.707,000	USD	951.318,09	11,10

Der beigegefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

# Zusammenfassung des Swiss Rock (Lux) Sicav

## Zusammensetzung des Netto-Fondsvermögens

	EUR
Wertpapiervermögen	391.800.080,93
Derivate	338.592,97
Bankguthaben	13.356.905,45
Sonstige Vermögensgegenstände	4.299.475,86
Bankverbindlichkeiten	-381.289,28
Sonstige Verbindlichkeiten	-1.373.789,19
<b>Netto-Fondsvermögen</b>	<b>408.039.976,74</b>

## Vermögensentwicklung des Fonds

		EUR
<b>Netto-Fondsvermögen zum Beginn des Geschäftsjahres</b>		<b>335.411.563,55</b>
Mittelzuflüsse	78.041.369,15	
Mittelabflüsse	-25.942.125,24	
Mittelzufluss/ -abfluss netto		52.099.243,91
Ertrags- und Aufwandsausgleich		85.083,37
Ergebnis des Geschäftsjahres inkl. Ertrags-/Aufwandsausgleich		20.444.085,91
<b>Netto-Fondsvermögen zum Ende des Geschäftsjahres</b>		<b>408.039.976,74</b>

## Ertrags- und Aufwandsrechnung des Fonds

	EUR
<b>Erträge</b>	
Zinserträge aus Wertpapieren	2.996.178,16
Zinsen aus Geldanlagen	311.182,54
Dividendenerträge	5.526.285,17
Erträge aus Bestandsprovisionen	11.650,19
Erträge aus REITs	26.703,94
Sonstige Erträge	5.479,73
Ordentlicher Ertragsausgleich	104.439,06
<b>Erträge insgesamt</b>	<b>8.981.918,79</b>
<b>Aufwendungen</b>	
Fondsmanagervergütung	-3.060.248,63
Performanceabhängige Fondsmanagervergütung	-337.226,23
Verwaltungsvergütung	-198.699,45
Zentralverwaltungsstellenvergütung	-100.788,75
Verwahrstellenvergütung	-308.676,16
Prüfungskosten	-66.801,26
Taxe d'abonnement	-181.838,32
Veröffentlichungskosten	-43.121,09
Register- und Transferstellenvergütung	-3.249,99
Regulatorische Kosten	-37.526,48
Zinsaufwendungen	-89.694,53
Sonstige Aufwendungen	-261.392,73
Ordentlicher Aufwandsausgleich	-16.282,41
<b>Aufwendungen insgesamt</b>	<b>-4.705.546,03</b>
<b>Ordentlicher Nettoertrag</b>	<b>4.276.372,76</b>
<b>Veräußerungsgeschäfte</b>	
Realisierte Gewinne	41.175.885,04
Ertragsausgleich auf realisierte Gewinne	11.483,16
Realisierte Verluste	-30.806.510,35
Aufwandsausgleich auf realisierte Verluste	-184.723,18
<b>Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften</b>	<b>10.196.134,67</b>
<b>Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>	<b>14.472.507,43</b>
<b>Veränderung der nicht realisierten Gewinne und Verluste</b>	
Veränderung der nicht realisierten Gewinne	14.040.239,04
Veränderung der nicht realisierten Verluste	-8.068.660,56
<b>Nettoveränderung des nicht realisierten Ergebnisses des Geschäftsjahres</b>	<b>5.971.578,48</b>
<b>Ergebnis des Geschäftsjahres inkl. Ertrags-/Aufwandsausgleich</b>	<b>20.444.085,91</b>

Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

## Anhang zum Jahresabschluss

### Allgemein

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

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

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

### Bewertungs- und Bilanzierungsgrundsätze

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

## Anhang zum Jahresabschluss

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

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

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

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

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

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

### Korrektur des Teilfondsvermögen zum Geschäftsjahresende

Im Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Emerging Equity / Aktien Schwellenländer ESG kam es für das abgelaufenen Geschäftsjahr nachträglich zu einer Korrektur der Performance Fee. Der für den Jahresabschluss berechnete Nettoinventarwert des Teilfonds zum 30. Juni 2023 ist unter Berücksichtigung dieser Korrektur um EUR -132.737,95 (-0,12%) niedriger als der ursprüngliche zu diesem Datum berechnete Nettoinventarwert.

## Anhang zum Jahresabschluss

### Wertpapiere mit Bewertungsbesonderheiten

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

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

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

Die Bewertung des Wertpapiers erschien dem Verwaltungsrat der SICAV nach Treu und Glauben zum 30. Juni 2023 als der wahrscheinlichste Veräußerungswert. Aufgrund eingeschränkter Liquidität kann jedoch grundsätzlich nicht ausgeschlossen werden, dass Wertpapiertransaktionen zu einem vom Bewertungskurs abweichenden Kurs stattfinden können.

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

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

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

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

Die Verwaltungsgesellschaft des Fonds befindet sich zurzeit in Klärung des Sachverhalts und Austausch bzgl. einer Erstattung durch die Verwahrstelle. Der Verwaltungsrat des Fonds beurteilt die Forderung gegenüber der Verwahrstelle zum 30. Juni 2023 als werthaltig.

## Anhang zum Jahresabschluss

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

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

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

Aufgrund des Russland / Ukraine - Konflikts und der damit erlassenen wirtschaftlichen Sanktionen und Gegensanktionen, kam es zu erheblichen Unsicherheiten und Schwankungen an den internationalen Finanzmärkten. Infolgedessen kam es sowohl bei Aktien als auch bei Anleihen zu deutlichen Kursverlusten. Da zu einem Großteil der russischen Bestände keine aktuellen Marktpreise vorhanden sind, hat das Pricing Committee der Fundrock-LRI beschlossen, die am Markt beobachtbaren, bzw. zuletzt verfügbaren Quotes mit einem Abschlag zu bewerten. Die Höhe richtet sich dabei nach beobachtbaren Indikatoren, die durch im Rahmen des Pricing Committees als verlässlich definiert wurden. Hierauf basierend wurde für Aktien bislang ein durchschnittlicher Abschlag von bis zu 99 % angesetzt. Der entsprechende Ansatz wird durch das Pricing Committee regelmäßig kritisch überprüft und gegebenenfalls angepasst.

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

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

ISIN	Wertpapier	in % des Teilfondsvermögens
XS1951084471	Gaz Capital S.A. DL-M.T.LPN 19(26)GAZPROM Reg.S	0,38
XS1625994618	VEON Holdings B.V. DL-Bonds 2017(17/24) Reg.S	0,27
XS2058691663	VEON Holdings B.V. DL-Bonds 2019(19/25) Reg.S	0,16

Aufgrund des Russland / Ukraine - Konflikts und der damit erlassenen wirtschaftlichen Sanktionen und Gegen sanktionen, kam es zu erheblichen Unsicherheiten und Schwankungen an den internationalen Finanzmärkten. Infolgedessen kam es sowohl bei Aktien als auch bei Anleihen zu deutlichen Kursverlusten. Rentenseitig am stärksten betroffen sind ukrainische und russische Anleihen deren Kurse mit hohen Abschlägen notieren. Im Pricing Committee der Fundrock-LRI wurde daraufhin die Entscheidung getroffen, bei weiterhin beobachtbaren Preisen den aktuellen Marktkurs, bzw. eine Bewertung zu Modelkursen wie BVAL (Bloomberg Valuation Service) oder EPS (Refinitiv Evaluated Pricing Service) anzusetzen. Der entsprechende Ansatz wird durch das Pricing Committee regelmäßig kritisch überprüft. Zum 30. Juni 2023 erfolgte die Bewertung auf Basis von Mark-to-Model-Kursen (BVAL). Der entsprechende Ansatz wird durch das Pricing Committee regelmäßig kritisch überprüft und gegebenenfalls angepasst.

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

## Anhang zum Jahresabschluss

### Hinweis zum Ausweis von Dividendenerträgen

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

### Kosten

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

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

Im abgelaufenen Geschäftsjahr ist für die / den nachfolgend aufgeführte(n) Teilfonds des Fonds eine erfolgsabhängige Vergütung (Performance-Fee) gemäß den Regelungen des im Geschäftsjahr gültigen Verkaufsprospektes / Emissionsdokumentes angefallen. Sofern eine Performance-Fee angefallen ist, erfolgt der Ausweis ohne einen eventuell zugehörigen Ertrags- und Aufwandsausgleich. Bei den in der nachfolgenden Tabelle gezeigten Werten handelt es sich um die im Geschäftsjahr im jeweiligen Teilfonds abgegrenzten Beträge ab dem 14. Februar 2023. Für den Zeitraum vom 1. Juli 2022 (Beginn des Geschäftsjahres) bis zum 13. Februar 2022 war die Berechnung der Performance-Fee ausgesetzt.

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

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

<b>Teilfonds</b>	<b>Aktien- klasse</b>	<b>Referenz-Benchmark</b>
Global Equity / Aktien Welt ESG	A	MSCI WORLD ESG Universal PR in EUR
Global Equity / Aktien Welt ESG	C	MSCI World CHF Hedged PR
Global Equity / Aktien Welt ESG	B	-
Global Equity / Aktien Welt ESG	X	-

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

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

<b>Teilfonds</b>	<b>Aktien- klasse</b>	<b>Referenz-Benchmark</b>
European Equity / Aktien Europa ESG	A	MSCI Europe ESG Universal PR EUR Index
European Equity / Aktien Europa ESG	B	-
European Equity / Aktien Europa ESG	X	-

## Anhang zum Jahresabschluss

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

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

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

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

Für den Teilfonds wird keine Performance-Fee berechnet.

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

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

Im Geschäftsjahr ist keine Performance-Fee für den Teilfonds angefallen.

Teilfonds	Aktien- klasse	Referenz-Benchmark
Absolute Return Bond Fund Plus ESG	A	euroSTR Euro Short- Term Rate
Absolute Return Bond Fund Plus ESG	C	Swiss Average Rate Overnight (SARON)
Absolute Return Bond Fund Plus ESG	B	-
Absolute Return Bond Fund Plus ESG	D	Swiss Average Rate Overnight (SARON)
Absolute Return Bond Fund Plus ESG	X	-
Absolute Return Bond Fund Plus ESG	E	US Secured Overnight Financing Rate (SOFR)

## Anhang zum Jahresabschluss

Teilfonds	Aktien- klasse	Wahrung	Hohe der berechneten Performance Fees in Wahrung der jeweiligen Aktienklasse	In % des Ø Aktien- klassen- vermogens
Absolute Return Bond Fund ESG	A	EUR	-	-
Absolute Return Bond Fund ESG	C	CHF	-	-
Absolute Return Bond Fund ESG	B	EUR	-	-
Absolute Return Bond Fund ESG	D	CHF	-	-
Absolute Return Bond Fund ESG	X	CHF	-	-
Absolute Return Bond Fund Plus ESG	A	EUR	0,00	0,00 %
Absolute Return Bond Fund Plus ESG	C	CHF	0,00	0,00 %
Absolute Return Bond Fund Plus ESG	B	EUR	-	-
Absolute Return Bond Fund Plus ESG	D	CHF	0,00	0,00 %
Absolute Return Bond Fund Plus ESG	X	CHF	-	-
Absolute Return Bond Fund Plus ESG	E	USD	0,00	0,00 %
Emerg. Equ. / Aktien Schwellenlander ESG	A	EUR	257.887,17	0,74 %
Emerg. Equ. / Aktien Schwellenlander ESG	B	EUR	-	-
Emerg. Equ. / Aktien Schwellenlander ESG	X	CHF	-	-
Emerg. Equ. / Aktien Schwellenlander ESG	E	USD	-	-
Emerg. Equ. / Aktien Schwellenlander ESG	C	CHF	-	-
European Equity / Aktien Europa ESG	A	EUR	67.586,86	0,33 %
European Equity / Aktien Europa ESG	B	EUR	-	-
European Equity / Aktien Europa ESG	X	EUR	-	-
Global Equity / Aktien Welt ESG	A	EUR	10.826,10	0,06 %
Global Equity / Aktien Welt ESG	C	CHF	773,97	0,00 %
Global Equity / Aktien Welt ESG	B	EUR	-	-
Global Equity / Aktien Welt ESG	X	CHF	-	-

### Transaktionskosten

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

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

Teilfonds	Transaktionskosten	
Absolute Return Bond Fund ESG	EUR	16.445,06
Absolute Return Bond Fund Plus ESG	EUR	21.175,32
Emerg. Equ. / Aktien Schwellenlander ESG	EUR	197.222,29
European Equity / Aktien Europa ESG	EUR	41.314,94
Global Equity / Aktien Welt ESG	EUR	33.416,60

## Anhang zum Jahresabschluss

### Sicherheiten

Im Rahmen der Besicherung von Derivategeschäften wurden zum Geschäftsjahresende folgende Sicherheiten gestellt:

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

##### Cash-Collateral

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

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

##### Cash-Collateral

Kontrahent	Besichertes Geschäft	Währung	Bestand
RBC Investor Services Bank S.A.	Devisentermingeschäft	EUR	800.000,00

Darüber hinaus erhielt der Fonds zum Geschäftsjahresende im Rahmen der Besicherung von Derivategeschäften folgende Sicherheiten:

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

##### Cash-Collateral

Kontrahent	Besichertes Geschäft	Währung	Bestand
RBC Investor Services Bank S.A.	Devisentermingeschäft	EUR	450.000,00

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

##### Cash-Collateral

Kontrahent	Besichertes Geschäft	Währung	Bestand
RBC Investor Services Bank S.A.	Devisentermingeschäft	EUR	340.000,00

### Aufstellung über die Entwicklung des Wertpapierbestandes

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

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

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

## Anhang zum Jahresabschluss

### Wichtige Ereignisse während des Geschäftsjahres

Mit Wirkung zum 1. Juli 2022 haben die Aktionäre Herrn Thomas Rosenfeld als neues Mitglied des Aufsichtsrats der Verwaltungsgesellschaft LRI Invest S.A. bestellt.

Mit Wirkung zum 1. November 2022 wurde Herr Marc-Oliver Scharwath durch den Aufsichtsrat der LRI Invest S.A. als neues Mitglied des Managing Boards der Verwaltungsgesellschaft ernannt.

Die Performance-Fee Berechnung für alle Teilfonds war vom 1. Juli 2022 bis einschließlich 13. Februar 2023 ausgesetzt. Mit Wirkung zum 14. Februar 2023 wurde die Berechnung wieder eingesetzt. Mit der Wiedereinsetzung änderten sich die Referenzbenchmarks für die einzelnen Teilfonds wie folgt:

Teilfonds	Aktien- klasse	Benchmark (alt)	Benchmark (neu)
Global Equity / Aktien Welt ESG	A	MSCI Europe Net TR EUR Index net of withholding tax reinvested – 0,5% p.a.	MSCI World ESG Universal Price Index in EUR
Global Equity / Aktien Welt ESG	C	MSCI World 100% Hedged to CHF Net TR Index net of withholding tax reinvested – 0,5% p.a.	MSCI World 100% Hedged CHF Price Index
European Equity / Aktien Europa ESG	A	MSCI Europe Net TR EUR Index net of withholding tax reinvested – 0,5% p.a.	MSCI Europe ESG Universal Price EUR Index
Emerg. Equ. / Aktien Schwellenländer ESG	A	MSCI Europe Net TR EUR Index net of withholding tax reinvested – 1,0% p.a.	MSCI EM ESG Universal Price Return Index in EUR
Absolute Return Bond Fund Plus ESG	A	Compounded euro short-term rate average rate 3 months tenor	euroSTR Euro Short- Term Rate
Absolute Return Bond Fund Plus ESG	C	SARON 3 months Compound rate	Swiss Average Rate Overnight (SARON)
Absolute Return Bond Fund Plus ESG	D	SARON 3 months Compound rate	Swiss Average Rate Overnight (SARON)
Absolute Return Bond Fund Plus ESG	E	SOFR (United States Secured Overnight Financing) 90-DAY Average	US Secured Overnight Financing Rate (SOFR)

### Wichtige Ereignisse nach Ende des Geschäftsjahres

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

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

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



## Prüfungsvermerk

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

---

### Unser Prüfungsurteil

Nach unserer Beurteilung vermittelt der beigefügte Abschluss in Übereinstimmung mit den in Luxemburg geltenden gesetzlichen Bestimmungen und Verordnungen betreffend die Aufstellung und Darstellung des Abschlusses ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild der Vermögens- und Finanzlage des Swiss Rock (Lux) Sicav (der „Fonds“) und seiner jeweiligen Teilfonds zum 30. Juni 2023 sowie der Ertragslage und der Entwicklung des Fondsvermögens für das an diesem Datum endende Geschäftsjahr.

#### *Was wir geprüft haben*

Der Abschluss des Fonds besteht aus:

- der Zusammensetzung des Netto-Fondsvermögens des Fonds und der Zusammensetzung des Netto-Fondsvermögens der Teilfonds zum 30. Juni 2023;
- der Vermögensaufstellung der Teilfonds zum 30. Juni 2023;
- der Ertrags- und Aufwandsrechnung des Fonds und der Ertrags- und Aufwandsrechnung der Teilfonds für das an diesem Datum endende Geschäftsjahr;
- der Vermögensentwicklung des Fonds und der Vermögensentwicklung der Teilfonds für das an diesem Datum endende Geschäftsjahr; und
- dem Anhang, einschließlich einer Zusammenfassung bedeutsamer Rechnungslegungsmethoden.

---

### Grundlage für das Prüfungsurteil

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

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

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

---

### **Sonstige Informationen**

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

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

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

---

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

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

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

---

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

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

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

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

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

PricewaterhouseCoopers, Société coopérative  
Vertreten durch

Luxemburg, 23. Oktober 2023

Carsten Brengel

## Zusätzliche Informationen zum Jahresbericht (ungeprüft)

### Wertpapier-Kennnummern / ISINs

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

### Ertragsverwendung

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

### Steuern

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

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

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

### Aktienpreise

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

## Zusätzliche Informationen zum Jahresbericht (ungeprüft)

### Anwendbares Recht, Gerichtsstand und Vertragssprache

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

### Kostenquote (Ongoing Charges)

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

Teilfonds	Aktien- klasse	Ongoing Charges per 30.06.2023	Performance-Fee per 30.06.2023
Absolute Return Bond Fund ESG	A	1,15 %	-
Absolute Return Bond Fund ESG	C	1,15 %	-
Absolute Return Bond Fund ESG	B	0,65 %	-
Absolute Return Bond Fund ESG	D	0,65 %	-
Absolute Return Bond Fund ESG	X	0,26 %	-
Absolute Return Bond Fund Plus ESG	A	1,23 %	0,00 %
Absolute Return Bond Fund Plus ESG	C	1,23 %	0,00 %
Absolute Return Bond Fund Plus ESG	B	0,72 %	-
Absolute Return Bond Fund Plus ESG	D	0,67 %	0,00 %
Absolute Return Bond Fund Plus ESG	X	0,24 %	-
Absolute Return Bond Fund Plus ESG	E	1,21 %	0,00 %
Emerg. Equ. / Aktien Schwellenländer ESG	A	1,54 %	0,74 %
Emerg. Equ. / Aktien Schwellenländer ESG	B	1,14 %	-
Emerg. Equ. / Aktien Schwellenländer ESG	X	0,35 %	-
Emerg. Equ. / Aktien Schwellenländer ESG	E	1,14 %	-
Emerg. Equ. / Aktien Schwellenländer ESG	C	0,78 %	-
European Equity / Aktien Europa ESG	A	1,31 %	0,33 %
European Equity / Aktien Europa ESG	B	0,91 %	-
European Equity / Aktien Europa ESG	X	0,32 %	-
Global Equity / Aktien Welt ESG	A	1,33 %	0,06 %
Global Equity / Aktien Welt ESG	C	1,63 %	0,00 %
Global Equity / Aktien Welt ESG	B	0,88 %	-
Global Equity / Aktien Welt ESG	X	0,24 %	-

## Zusätzliche Informationen zum Jahresbericht (ungeprüft)

### Portfolio Turnover Rate

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

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

Die Portfolio Turnover Rate wird jährlich ermittelt.

<b>Teilfonds</b>	<b>Portfolio Turnover Rate per 30.06.2023</b>
Absolute Return Bond Fund ESG	46,45 %
Absolute Return Bond Fund Plus ESG	45,47 %
Emerg. Equ. / Aktien Schwellenländer ESG	66,63 %
European Equity / Aktien Europa ESG	64,49 %
Global Equity / Aktien Welt ESG	45,05 %

### Hebelwirkung

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

<b>Teilfonds</b>	<b>Durchschnittliche Hebelwirkung</b>
Absolute Return Bond Fund ESG	135,60 %
Absolute Return Bond Fund Plus ESG	151,45 %
Emerg. Equ. / Aktien Schwellenländer ESG	28,71 %
European Equity / Aktien Europa ESG	3,55 %
Global Equity / Aktien Welt ESG	75,89 %

## Zusätzliche Informationen zum Jahresbericht (ungeprüft)

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

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

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

Bei der Ermittlung des Marktrisikopotentials wendet die Gesellschaft den relativen VaR-Ansatz im Sinne des Rundschreibens CSSF 11/512 an. Dabei entspricht das relative Limit dem zweifachen Marktrisiko (VaR) eines Referenzportfolios. Das Referenzportfolio besteht aus einem weltweiten Aktienindex (Large und Mid Caps).

Minimale Auslastung des VaR-Limits	44,72 %
Maximale Auslastung des VaR-Limits	49,87 %
Durchschnittliche Auslastung des VaR-Limits	47,06 %

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

Bei der Ermittlung des Marktrisikopotentials wendet die Gesellschaft den relativen VaR-Ansatz im Sinne des Rundschreibens CSSF 11/512 an. Dabei entspricht das relative Limit dem zweifachen Marktrisiko (VaR) eines Referenzportfolios. Das Referenzportfolio besteht aus einem europäischen Aktienindex (Large und Mid Caps).

Minimale Auslastung des VaR-Limits	44,44 %
Maximale Auslastung des VaR-Limits	49,64 %
Durchschnittliche Auslastung des VaR-Limits	47,73 %

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

Bei der Ermittlung des Marktrisikopotentials wendet die Gesellschaft den relativen VaR-Ansatz im Sinne des Rundschreibens CSSF 11/512 an. Dabei entspricht das relative Limit dem zweifachen Marktrisiko (VaR) eines Referenzportfolios. Das Referenzportfolio besteht aus einem Aktienindex bzgl. Schwellenländern (Large und Mid Caps).

Minimale Auslastung des VaR-Limits	28,40 %
Maximale Auslastung des VaR-Limits	56,46 %
Durchschnittliche Auslastung des VaR-Limits	31,20 %

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

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

Minimale Auslastung des VaR-Limits	16,45 %
Maximale Auslastung des VaR-Limits	21,95 %
Durchschnittliche Auslastung des VaR-Limits	20,01 %

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

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

Minimale Auslastung des VaR-Limits	16,90 %
Maximale Auslastung des VaR-Limits	24,00 %
Durchschnittliche Auslastung des VaR-Limits	20,83 %

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

### Meldepflichtige Wertpapierfinanzierungsgeschäfte

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

## Zusätzliche Informationen zum Jahresbericht (ungeprüft)

### ESG Methodologie der Artikel 8 Teilfonds

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

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

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

Basierend auf dem im Verkaufsprospekt dargestellten umfangreichen ESG-Regelwerk werden Finanzinstrumente und/oder Emittenten gemäß nachvollziehbarer ESG Merkmale bewertet und entsprechend klassifiziert. Die Teilfonds werden nur in Finanzinstrumente und/oder Emittenten investieren, welche basierend auf diesem Regelwerk als ESG-konform angesehen werden. Die Implementierung des ESG-Regelwerks im Investmentprozess der Teilfonds basiert u.a. auf der Verwendung von Daten der Nachhaltigkeitspezialisten MSCI ESG Research LLC und ESG Screen 17 GmbH.

### Verwaltungsgebühren der KAG-fremden Zielfonds

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

### Angaben zur Vergütung des delegierten Portfoliomanagers

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

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

Gesamtbetrag der Vergütung	EUR	4.809.379,80
Gesamtbetrag der fixen Vergütung	EUR	4.026.551,52
Gesamtbetrag der variablen Vergütung	EUR	782.828,28
Anzahl der Mitarbeiter		21

Angaben zur Vergütung gemäß Auskunft des delegierten Portfoliomanagers: Swiss Rock Asset Management AG für das Geschäftsjahr 2022.

## Zusätzliche Informationen zum Jahresbericht (ungeprüft)

### Angaben zur Vergütungspolitik der Verwaltungsgesellschaft

#### Vergütungsgrundsätze

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

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

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

#### Angaben zur Mitarbeitervergütung

Die Angaben zur Mitarbeitervergütung der LRI Invest S.A. erfolgen für das Geschäftsjahr 1. Januar 2022 bis 31. Dezember 2022.

<b>Anzahl Mitarbeiter (MA) (inkl. Geschäftsleiter): 130</b>		<b>Stand:</b>	<b>31.12.2022</b>
<b>Geschäftsjahr: 01.01.2022 – 31.12.2022</b>	<b>EUR</b>	<b>EUR</b>	<b>EUR</b>
<b>Vergütung</b>	<b>Fix</b>	<b>Variabel</b>	<b>Gesamt *)</b>
Gesamtsumme der gezahlten Mitarbeitervergütung im abgelaufenen Geschäftsjahr	11.661.775,22	1.260.912,87	12.922.688,09
davon Vergütungen an Führungskräfte, MA mit Kontrollfunktionen und andere Risikoträger			3.590.145,46
davon MA mit Kontrollfunktionen			1.919.185,34
davon MA mit gleicher Einkommensstufe			-

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

## Zusatzinformationen für Anleger in der Schweiz (ungeprüft)

### Vertreter in der Schweiz

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

### Zahlstelle in der Schweiz

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

### Bezugsort für maßgebliche Dokumente

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

### Total Expense Ratio

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

Teilfonds	Aktien- klasse	Total Expense Ratio (exkl. PF)	Total Expense Ratio (inkl. PF)
Absolute Return Bond Fund ESG	A	1,15 %	1,15 %
Absolute Return Bond Fund ESG	C	1,15 %	1,15 %
Absolute Return Bond Fund ESG	B	0,65 %	0,65 %
Absolute Return Bond Fund ESG	D	0,65 %	0,65 %
Absolute Return Bond Fund ESG	X	0,26 %	0,26 %
Absolute Return Bond Fund Plus ESG	A	1,23 %	1,23 %
Absolute Return Bond Fund Plus ESG	C	1,23 %	1,23 %
Absolute Return Bond Fund Plus ESG	B	0,72 %	0,72 %
Absolute Return Bond Fund Plus ESG	D	0,67 %	0,67 %
Absolute Return Bond Fund Plus ESG	X	0,24 %	0,24 %
Absolute Return Bond Fund Plus ESG	E	1,21 %	1,21 %
Emerg. Equ. / Aktien Schwellenländer ESG	A	1,54 %	2,28 %
Emerg. Equ. / Aktien Schwellenländer ESG	B	1,14 %	1,14 %
Emerg. Equ. / Aktien Schwellenländer ESG	X	0,35 %	0,35 %
Emerg. Equ. / Aktien Schwellenländer ESG	E	1,14 %	1,14 %
Emerg. Equ. / Aktien Schwellenländer ESG	C <sup>1)</sup>	0,78 %	0,78 %
European Equity / Aktien Europa ESG	A	1,31 %	1,64 %
European Equity / Aktien Europa ESG	B	0,91 %	0,91 %
European Equity / Aktien Europa ESG	X	0,32 %	0,32 %
Global Equity / Aktien Welt ESG	A	1,33 %	1,39 %
Global Equity / Aktien Welt ESG	C	0,88 %	0,88 %
Global Equity / Aktien Welt ESG	B	1,63 %	1,63 %
Global Equity / Aktien Welt ESG	X	0,24 %	0,24 %

<sup>1)</sup> Für den Zeitraum ab 8. Februar 2023 (Erstausgabe) bis zum 30. Juni 2023.

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

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

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

## Zusatzinformationen für Anleger in der Schweiz (ungeprüft)

### Bemerkung zur TER inklusive Performancegebühr

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

#### Für die Teilfonds

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

erhält der Fondsmanager 20% der über die Benchmark hinausgehenden zusätzlich erwirtschafteten Performance, 80% dieses zusätzlichen Ertrages geht an die Endkunden bzw. verbleibt im Teilfonds. Für den Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund Plus ESG erhält der Fondsmanager 10% der über die Benchmark hinausgehenden zusätzlich erwirtschafteten Performance, 90% dieses zusätzlichen Ertrages geht an die Endkunden bzw. verbleibt im Teilfonds. Aus gesetzlichen Gründen wird der an den Fondsmanager ausbezahlte Performance Betrag in der Kennziffer „TER inklusive Performancegebühr“ der TER hinzugeschlagen. Faktisch ist es allerdings so, dass eine derart definierte Performancegebühr die Endkunden immer besser stellt, als eine Situation, in der die Performancegebühr nicht zur Anwendung kommt. Die Überperformance erhöht die Gewinne um das Vierfache (im Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund Plus ESG um das 4,5-fache) dessen, was der Fondsmanager aus der Performancegebühr erhält bzw. verkleinert die Verluste um das Vierfache (im Teilfonds Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund Plus ESG um das 4,5-fache) der Performancegebühr. Darüber hinaus leistet die so definierte Performancegebühr positive Beiträge zur Reduktion der in der normalen TER ausgewiesenen Kosten. Das kann sogar soweit gehen, dass die Überperformance sämtliche Kosten mehr als deckt und dem Endanleger für die Teilnahme an den Märkten überhaupt keine Kosten mehr entstehen.

### Performance-Kennzahlen (Stand: 30.06.2023)

Teilfonds	Aktien- klasse	2023	2022	2021
Absolute Return Bond Fund ESG	A	2,05 %	-5,24 %	2,87 %
Absolute Return Bond Fund ESG	C	0,74 %	-5,31 %	2,36 %
Absolute Return Bond Fund ESG	B	2,59 %	-4,74 %	3,16 %
Absolute Return Bond Fund ESG	D	1,29 %	-4,62 %	2,96 %
Absolute Return Bond Fund ESG	X	0,49 %	-12,70 %	6,72 %
Absolute Return Bond Fund Plus ESG	A	3,31 %	-5,08 %	2,37 %
Absolute Return Bond Fund Plus ESG	C	1,96 %	-5,84 %	2,90 %
Absolute Return Bond Fund Plus ESG	B	3,85 %	-5,21 %	3,89 %
Absolute Return Bond Fund Plus ESG	D	2,62 %	-5,42 %	3,34 %
Absolute Return Bond Fund Plus ESG	X	1,79 %	-13,04 %	7,57 %
Absolute Return Bond Fund Plus ESG	E	5,84 %	-4,41 %	4,23 %
Emerg. Equ. / Aktien Schwellenländer ESG	A	-2,47 %	-12,22 %	36,06 %
Emerg. Equ. / Aktien Schwellenländer ESG	B	-1,43 %	-10,74 %	37,29 %
Emerg. Equ. / Aktien Schwellenländer ESG	X	-3,13 %	-17,87 %	42,46 %
Emerg. Equ. / Aktien Schwellenländer ESG	E	2,91 %	-21,39 %	45,07 %
Emerg. Equ. / Aktien Schwellenländer ESG	C	0,50 % <sup>1)</sup>	-	-
European Equity / Aktien Europa ESG	A	15,36 %	-7,84 %	27,26 %
European Equity / Aktien Europa ESG	B	16,13 %	-7,46 %	27,79 %
European Equity / Aktien Europa ESG	X	16,83 %	-6,92 %	28,56 %
Global Equity / Aktien Welt ESG	A	10,25 %	-3,65 %	29,07 %
Global Equity / Aktien Welt ESG	C	9,81 %	-13,54 %	29,21 %
Global Equity / Aktien Welt ESG	B	10,77 %	-3,18 %	29,47 %
Global Equity / Aktien Welt ESG	X	8,72 %	-11,06 %	34,27 %

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

## Zusatzinformationen für Anleger in der Schweiz (ungeprüft)

Benchmark	Aktien- klasse	2023	2022	2021
Absolute Return Bond Fund Plus ESG	A	-0,02 %	-0,57 %	-0,53 %
Absolute Return Bond Fund Plus ESG	C	-0,24 %	-0,72 %	-0,75 %
Absolute Return Bond Fund Plus ESG	B	-0,02 %	-0,57 %	-0,53 %
Absolute Return Bond Fund Plus ESG	D	-0,24 %	-0,72 %	-0,75 %
Absolute Return Bond Fund Plus ESG	E	1,61 %	0,27 %	0,21 %
Emerg. Equ. / Aktien Schwellenländer ESG	A	-15,06 %	-14,80 %	33,45 %
Emerg. Equ. / Aktien Schwellenländer ESG	B	-15,06 %	-14,80 %	33,45 %
Emerg. Equ. / Aktien Schwellenländer ESG	X	-19,06 %	-22,21 %	37,46 %
Emerg. Equ. / Aktien Schwellenländer ESG	E	-20,29 %	-24,89 %	40,90 %
European Equity / Aktien Europa ESG	A	-10,81 %	-7,53 %	27,94 %
European Equity / Aktien Europa ESG	B	-10,81 %	-7,53 %	27,94 %
European Equity / Aktien Europa ESG	X	-10,81 %	-7,53 %	27,94 %
Global Equity / Aktien Welt ESG	A	-13,29 %	-3,15 %	31,69 %
Global Equity / Aktien Welt ESG	C	-18,07 %	-12,51 %	34,83 %

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

### Hinweis zur Änderung der Benchmarks:

Die Performance-Fee Berechnung für alle Teilfonds war vom 1. Juli 2022 bis einschließlich 13. Februar 2023 ausgesetzt. Mit Wirkung zum 14. Februar 2023 wurde die Berechnung wieder eingesetzt. Mit der Wiedereinsetzung änderten sich die Referenzbenchmarks für die einzelnen Teilfonds.

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

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

- "MSCI Emerging Net TR EUR Index net of withholding tax reinvested" - 1,0% p.a. (bis zum 13. Februar 2023)
- "MSCI EM ESG Universal Price Return Index in EUR" (seit dem 14. Februar 2023)

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

- "MSCI Europe Net TR EUR Index net of withholding tax reinvested" - 0,5% p.a. (bis zum 13. Februar 2023)
- "MSCI Europe ESG Universal Price EUR Index" (seit dem 14. Februar 2023)

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

- "MSCI World Net TR EUR Index net of withholding tax reinvested" - 0,5% p.a. (bis zum 13. Februar 2023)
- "MSCI World ESG Universal Price Index in EUR" (seit dem 14. Februar 2023)

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

- "MSCI World 100% Hedged to CHF Net TR Index net of withholding tax reinvested" - 0,5% p.a. (bis zum 13. Februar 2023)
- "MSCI World 100% Hedged to CHF Price Index" (seit dem 14. Februar 2023)

## Zusatzinformationen für Anleger in der Schweiz (ungeprüft)

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

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

Bis zum 13. Februar 2023:

(die Performance-Fee Berechnung war im Zeitraum vom 1. Juli 2022 bis 14. Februar 2023 ausgesetzt)

- Aktienklassen A: Compounded euro short-term rate average rate, 3 months tenor
- Aktienklassen C und D: SARON 3 months Compound rate
- Aktienklassen E: SOFR (United States Secured Overnight Financing) 90-DAY Average

Seit dem 14. Februar 2023 :

(erneutes einsetzen der Performance-Fee Berechnung mit den neuen Indizes)

- Aktienklassen A: euroSTR Euro Short Term Rate
- Aktienklassen C und D: Swiss Average Rate Overnight (SARON)
- Aktienklassen E: United States Secured Overnight Financing Rate (SOFR)

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

- Swiss Rock (Lux) Sicav - Global Equity / Aktien Welt ESG - A: MXWOESU Index
- Swiss Rock (Lux) Sicav - Global Equity / Aktien Welt ESG - C: MBWOHCHF Index
- Swiss Rock (Lux) Sicav - European Equity / Aktien Europa ESG: PE712647 Index
- Swiss Rock (Lux) Sicav - Emerging Equity / Aktien Schwellenländer ESG: MXEFESU Index
- Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund Plus ESG - A : ESTRON Index
- Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund Plus ESG - C und D: SRFON3 Index
- Swiss Rock (Lux) Sicav - Absolute Return Bond Fund Plus ESG - E: SOFRRATE Index

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

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

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

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

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

Unternehmenskennung (LEI-Code): **5299009QJZEZH1ERO81**

### Ökologische und/oder soziale Merkmale

**Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?** *[Bitte gegebenenfalls ankreuzen und ausfüllen; der Prozentsatz entspricht der Mindestverpflichtung zu nachhaltigen Investitionen]*

**Ja**

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

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

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

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

**Nein**

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

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

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

mit einem sozialen Ziel

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



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

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

### Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

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

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

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

Nicht anwendbar.

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

Für den Teilfonds werden keine nachhaltigen Investitionen getätigt.

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

Für den Teilfonds werden keine nachhaltigen Investitionen getätigt.

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

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

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

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

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

*In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem 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 Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.**

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

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



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

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

1. Klima- und umweltbezogene Indikatoren basierend auf den folgenden negativen Nachhaltigkeitsindikatoren:

- Treibhausgasemissionen
- Energieleistung
- Carbon Footprint

2. Soziales und Mitarbeiter, Achtung der Menschenrechte, Korruptions- und Bestechungsbekämpfung, basierend auf den folgenden negativen Nachhaltigkeitsindikatoren:

- Soziales und Arbeitnehmerfragen
- Violation of UN Global Compact Principles
- Exposition zu kontroversen Waffen

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



**Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?**

Dargestellt sind die grössten 10 Investitionen zum Ende des Bezugszeitraums (30.06.2023).

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: Top-10 per 30.06.2023

<b>Größte Investitionen</b>	<b>In % der Vermögenswerte</b>	<b>Sektor</b>	<b>Land</b>
Microsoft Corp. Registered Shares DL-,00000625	6,43 %	Software	United States
Apple Inc. Registered Shares o.N.	5,21 %	Computers	United States
NVIDIA Corp. Registered Shares DL-,001	2,90 %	Semiconductors	United States
Alphabet Inc. Reg. Shs Cl. A DL-,001	1,13 %	Internet	United States
Home Depot Inc., The Registered Shares DL -,05	1,05 %	Retail	United States
Amazon.com Inc. Registered Shares DL -,01	1,03 %	Internet	United States
Eli Lilly and Company Registered Shares o.N.	0,94 %	Pharmaceuticals	United States
Broadcom Inc. Registered Shares DL -,001	0,91 %	Semiconductors	United States
Berkshire Hathaway Inc. Reg.Shares B New DL -,00333	0,80 %	Insurance	United States
Nestlé S.A. Namens-Aktien SF -,10	0,78 %	Food	Switzerland

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



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

Für den Teilfonds werden keine nachhaltigen Investitionen getätigt.

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

*[Fügen Sie diesen Hinweis für Finanzprodukte im Sinne des Artikels 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852]*

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

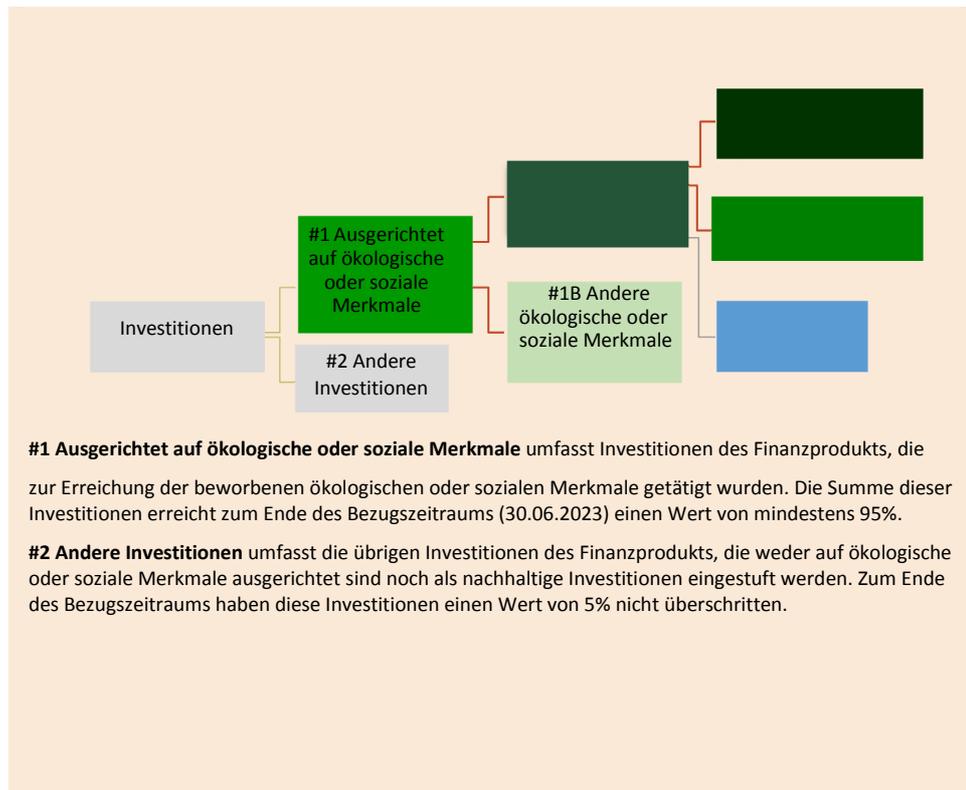
- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

- **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



**Wie sah die Vermögensallokation aus?**



**#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden. Die Summe dieser Investitionen erreicht zum Ende des Bezugszeitraums (30.06.2023) einen Wert von mindestens 95%.

**#2 Andere Investitionen** umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden. Zum Ende des Bezugszeitraums haben diese Investitionen einen Wert von 5% nicht überschritten.

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



*In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?*

Dargestellt sind die Wirtschaftssektoren, die zusammen mehr als 90% der Investitionen zum Ende des Bezugszeitraums (30.06.2023) ausmachen.

<b>Sektor</b>	<b>In % der Vermögenswerte</b>
Software	10.86
Semiconductors	8.31
Pharmaceuticals	7.9
Computers	7.45
Retail	6.27
Banks	4.91
Insurance	4.28
Internet	3.9
Oil&Gas	3.61
Diversified Finan Serv	3.57
Healthcare-Products	2.85
Telecommunications	2.23
Electric	2.14
Food	2.12
Transportation	1.64
Biotechnology	1.47
Beverages	1.44
Commercial Services	1.42
Chemicals	1.41
Electronics	1.33
Apparel	1.31
Cosmetics/Personal Care	1.11
Media	1.09
Building Materials	1.05
Home Builders	1
Distribution/Wholesale	0.97
REITS	0.95
Healthcare-Services	0.86
Electrical Compo&Equip	0.8
Engineering&Construction	0.75
Pipelines	0.75
Auto Manufacturers	0.75

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



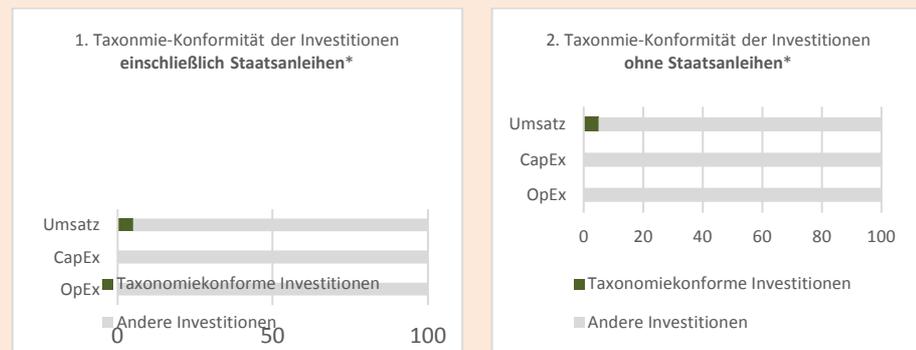
**Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?**

Für den Teilfonds werden keine nachhaltigen Investitionen getätigt.

**Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonmiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?**

- Ja
- In fossiles Gas
- In Kernenergie
- Nein

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



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

*[Fügen Sie diesen Hinweis nur für die Finanzprodukte im Sinne des Artikels 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 ein.]*

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

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

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

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

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

Nicht anwendbar.

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

[Fügen Sie den Hinweis für die Finanzprodukte im Sinne des Artikels 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 ein, mit denen in ökologische Wirtschaftstätigkeiten sind.]



sind nachhaltige Investitionen

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



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

Ein Mindestanteil nachhaltiger Investitionen mit Umweltziel wurde nicht festgelegt.



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

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



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

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



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

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

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

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



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

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

*[Fügen Sie diesen Hinweis bei Finanzprodukten ein, bei denen ein Index als Referenzwert für die Erreichung der mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wurde.]*

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

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

Nicht anwendbar.

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

Nicht anwendbar.

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

Nicht anwendbar.

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

Nicht anwendbar.

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

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

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

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

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

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

### Ökologische und/oder soziale Merkmale

**Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?** *[Bitte gegebenenfalls ankreuzen und ausfüllen; der Prozentsatz entspricht der Mindestverpflichtung zu nachhaltigen Investitionen]*

**Ja**

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

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

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

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

**Nein**

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

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

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

mit einem sozialen Ziel

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



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

Es gab keine aktiven Verletzungen gegen die vom Finanzprodukt beworbenen positiven ökologischen und/oder sozialen Merkmale im Bezugszeitraum.

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



**Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

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

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

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

Nicht anwendbar.

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

Für den Teilfonds werden keine nachhaltigen Investitionen getätigt.

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

Für den Teilfonds werden keine nachhaltigen Investitionen getätigt.

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

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

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

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

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

*In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem 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 Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.**

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

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



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

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

1. Klima- und umweltbezogene Indikatoren basierend auf den folgenden negativen Nachhaltigkeitsindikatoren:

- Treibhausgasemissionen
- Energieleistung
- Carbon Footprint

2. Soziales und Mitarbeiter, Achtung der Menschenrechte, Korruptions- und Bestechungsbekämpfung, basierend auf den folgenden negativen Nachhaltigkeitsindikatoren:

- Soziales und Arbeitnehmerfragen
- Violation of UN Global Compact Principles
- Exposition zu kontroversen Waffen

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



### Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Dargestellt sind die grössten 10 Investitionen zum Ende des Bezugszeitraums (30.06.2023).

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: Top-10 per 30.06.2023

<b>Grösste Investitionen</b>	<b>In % der Vermögenswerte</b>	<b>Sektor</b>	<b>Land</b>
Nestlé S.A. Namens-Aktien SF -,10	3,90 %	Food	Switzerland
ASML Holding N.V. Aandelen op naam EO -,09	3,78 %	Semiconductors	Netherlands
Novo-Nordisk AS Navne-Aktier B DK -,20	3,54 %	Pharmaceuticals	Denmark
LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE Actions Port. (C.R.) EO 0,3	3,19 %	Appareal	France
Novartis AG Namens-Aktien SF 0,50	2,56 %	Pharmaceuticals	Switzerland
AstraZeneca PLC Registered Shares DL -,25	2,10 %	Pharmaceuticals	UK
Shell PLC Reg. Shares Class EO -,07	1,90 %	Oil & Gas	UK
HSBC Holdings PLC Registered Shares DL -,50	1,83 %	Banks	UK
Roche Holding AG Inhaber-Genußscheine o.N.	1,64 %	Pharmaceuticals	Switzerland
Oréal S.A., L' Actions Port. EO 0,2	1,50 %	Cosmetics/ Personal Care	France

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

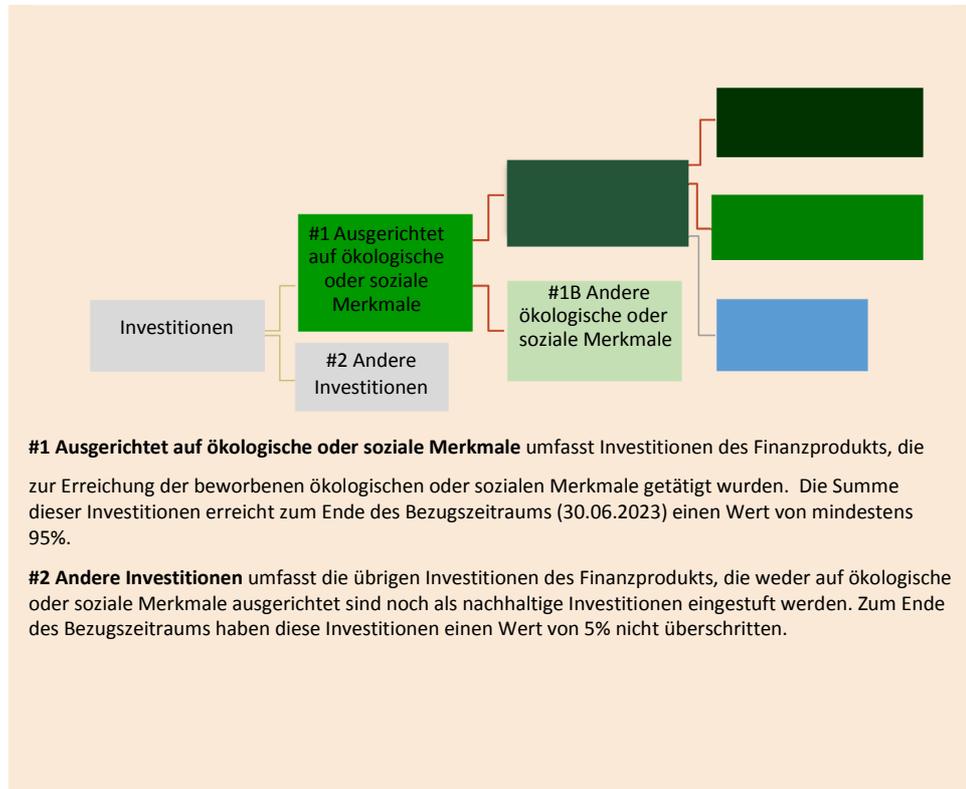


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Für den Teilfonds werden keine nachhaltigen Investitionen getätigt.

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

## Wie sah die Vermögensallokation aus?



**#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden. Die Summe dieser Investitionen erreicht zum Ende des Bezugszeitraums (30.06.2023) einen Wert von mindestens 95%.

**#2 Andere Investitionen** umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden. Zum Ende des Bezugszeitraums haben diese Investitionen einen Wert von 5% nicht überschritten.

*[Fügen Sie diesen Hinweis für Finanzprodukte im Sinne des Artikels 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852]*

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

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



*In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?*

Dargestellt sind die Wirtschaftssektoren, die zusammen mehr als 90% der Investitionen zum Ende des Bezugszeitraums (30.06.2023) ausmachen.

<b>Sektor</b>	<b>In % der Vermögenswerte</b>
Pharmaceuticals	12.12
Banks	9.03
Food	7.25
Semiconductors	6.07
Insurance	5.94
Oil&Gas	5.1
Apparel	4.87
Electric	4.02
Retail	3.78
Building Materials	3.08
Beverages	2.53
Cosmetics/Personal Care	2.52
Aerospace/Defense	2.28
Transportation	2.08
Machinery-Diversified	2.06
Auto Manufacturers	1.94
Diversified Finan Serv	1.63
Commercial Services	1.55
Telecommunications	1.52
Software	1.51
Miscellaneous Manufactur	1.51
Chemicals	1.47
Distribution/Wholesale	1.43
Electronics	1.25
Engineering&Construction	1.23
Media	1.13
Electrical Compo&Equip	1.12

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



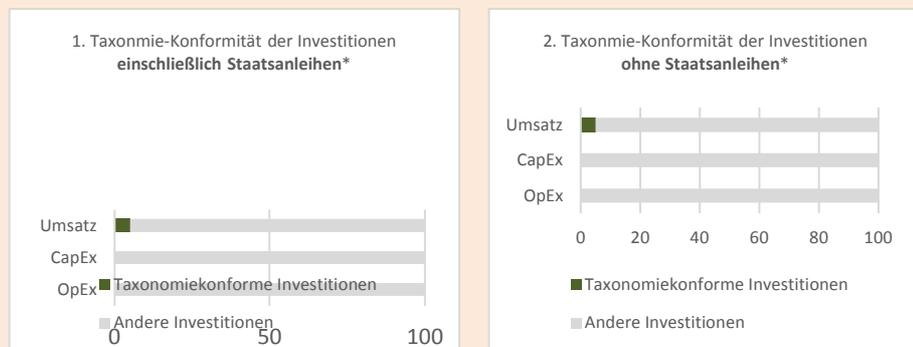
**Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?**

Für den Teilfonds werden keine nachhaltigen Investitionen getätigt.

**Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?**

- Ja  
 In fossiles Gas                       In Kernenergie  
 Nein

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



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

*[Fügen Sie diesen Hinweis nur für die Finanzprodukte im Sinne des Artikels 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 ein.]*

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

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

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

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

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

Nicht anwendbar.

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

[Fügen Sie den Hinweis für die Finanzprodukte im Sinne des Artikels 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 ein, mit denen in ökologische Wirtschaftstätigkeiten sind.]



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



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

Ein Mindestanteil nachhaltiger Investitionen mit Umweltziel wurde nicht festgelegt.



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

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



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

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



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

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

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

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



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

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

*[Fügen Sie diesen Hinweis bei Finanzprodukten ein, bei denen ein Index als Referenzwert für die Erreichung der mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wurde.]*

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

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

Nicht anwendbar.

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

Nicht anwendbar.

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

Nicht anwendbar.

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

Nicht anwendbar.

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

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

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

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

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

### Ökologische und/oder soziale Merkmale

**Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?** *[Bitte gegebenenfalls ankreuzen und ausfüllen; der Prozentsatz entspricht der Mindestverpflichtung zu nachhaltigen Investitionen]*

**Ja**

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

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

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

**Nein**

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

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

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



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

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



#### **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

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

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

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Nicht anwendbar.

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

Für den Teilfonds werden keine nachhaltigen Investitionen getätigt.

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

Für den Teilfonds werden keine nachhaltigen Investitionen getätigt.

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

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

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

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

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

*In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem 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 Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.**

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

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



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

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

1. Klima- und umweltbezogene Indikatoren basierend auf den folgenden negativen Nachhaltigkeitsindikatoren:

- Treibhausgasemissionen
- Energieleistung
- Carbon Footprint

2. Soziales und Mitarbeiter, Achtung der Menschenrechte, Korruptions- und Bestechungsbekämpfung, basierend auf den folgenden negativen Nachhaltigkeitsindikatoren:

- Soziales und Arbeitnehmerfragen
- Violation of UN Global Compact Principles
- Exposition zu kontroversen Waffen

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



### Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Dargestellt sind die grössten 10 Investitionen zum Ende des Bezugszeitraums (30.06.2023).

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: Top-10 per 30.06.2023

Größte Investitionen	In % der Vermögenswerte	Sektor	Land
UTI Gold.PLC-UTI Ind.Dyn.Eq.Fd Reg. Shares EUR Class o.N.	8,93 %	Equity Fund	Ireland
Tencent Holdings Ltd. Reg. Shares HD -,00002	3,04 %	Internet	China
Samsung Electronics Co. Ltd. Registered Shares SW 100	2,62 %	Semiconductors	South Korea
Taiwan Semiconduct.Manufact.Co Registered Shares TA 10	2,37 %	Semiconductors	Taiwan
Taiwan Semiconduct.Manufact.Co Reg.Shs (Spons.ADRs)/5 TA 10	2,17 %	Semiconductors	Taiwan
Dr Reddy's Laboratories Ltd. Reg. Shares (Sp.ADRs)/1 IR 5	1,82 %	Semiconductors	India
Alibaba Group Holding Ltd. Registered Shares o.N.	1,78 %	Internet	China
China Construction Bank Corp. Registered Shares H YC 1	1,28 %	Banks	China
ICICI Bank Ltd. Reg.Shs (Spons.ADRs)/2 IR 10	1,12 %	Banks	India
Reliance Industries Ltd. Reg.Eqy Shs(GDRs144A)/2 IR 10	0,93 %	Oil & Gas	India

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



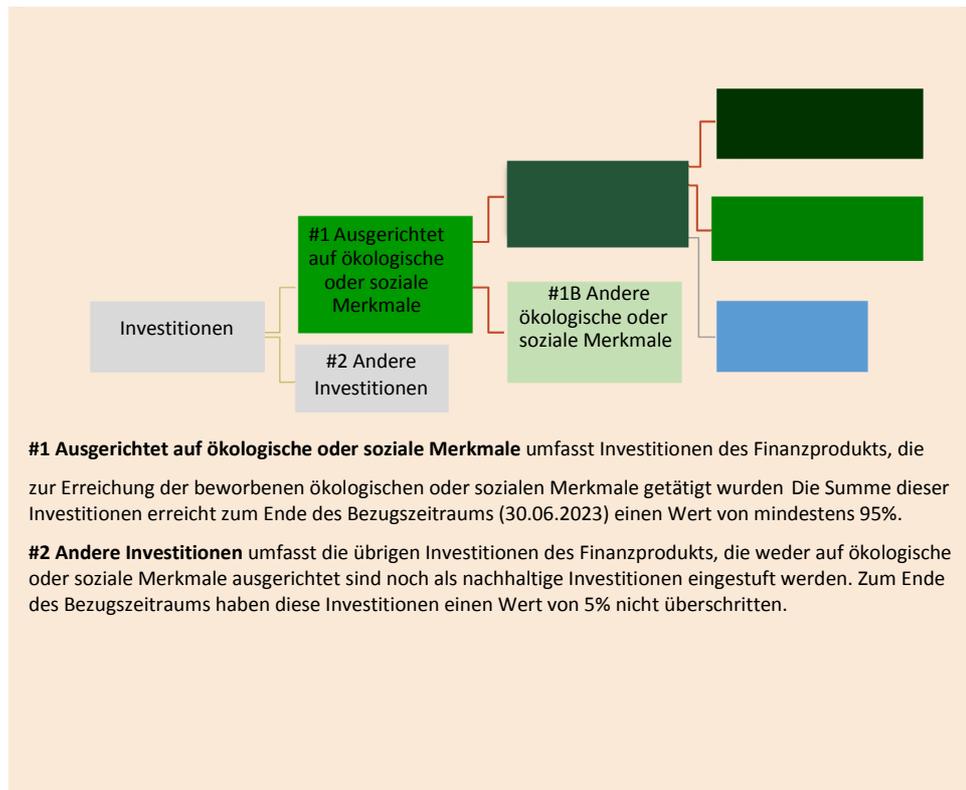
**Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?**

Für den Teilfonds werden keine nachhaltigen Investitionen getätigt.

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



**Wie sah die Vermögensallokation aus?**



*[Fügen Sie diesen Hinweis für Finanzprodukte im Sinne des Artikels 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852]*

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

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



*In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?*

Dargestellt sind die Wirtschaftssektoren, die zusammen mehr als 90% der Investitionen zum Ende des Bezugszeitraums (30.06.2023) ausmachen.

<b>Sektor</b>	<b>In % der Vermögenswerte</b>
Banks	14.95
Equity Fund	8.88
Semiconductors	8.71
Internet	6.53
Retail	4.88
Oil&Gas	4.6
Telecommunications	4.08
Electronics	3.95
Computers	3.84
Food	3.78
Pharmaceuticals	3.37
Insurance	2.58
Electric	2.2
Software	2.11
Real Estate	1.94
Auto Manufacturers	1.88
Diversified Finan Serv	1.73
Beverages	1.6
Mining	1.52
Iron/Steel	1.44
Engineering&Construction	1.43
Home Furnishings	1.14
Healthcare-Products	1.07
Transportation	1.04
Apparel	0.89

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



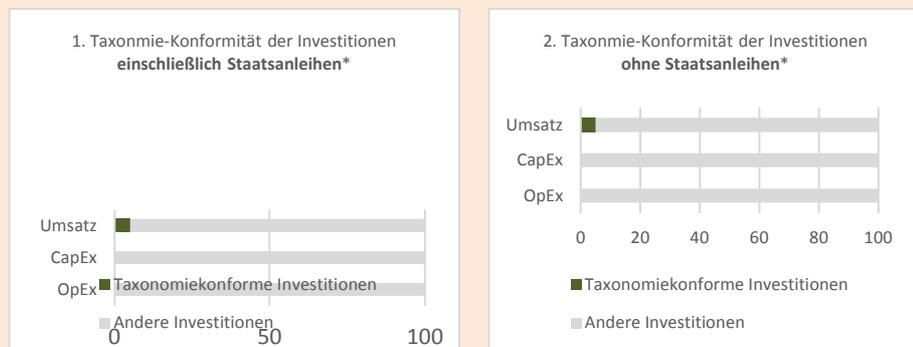
**Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?**

Für den Teilfonds werden keine nachhaltigen Investitionen getätigt.

**Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?**

- Ja
- In fossiles Gas
- In Kernenergie
- Nein

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



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

[Fügen Sie diesen Hinweis nur für die Finanzprodukte im Sinne des Artikels 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 ein.]

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

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

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

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

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

Nicht anwendbar.

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

[Fügen Sie den Hinweis für die Finanzprodukte im Sinne des Artikels 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 ein, mit denen in ökologische Wirtschaftstätigkeiten sind.]



sind nachhaltige Investitionen

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



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

Ein Mindestanteil nachhaltiger Investitionen mit Umweltziel wurde nicht festgelegt.



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

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



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

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



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

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

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

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



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

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

*[Fügen Sie diesen Hinweis bei Finanzprodukten ein, bei denen ein Index als Referenzwert für die Erreichung der mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wurde.]*

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

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

Nicht anwendbar.

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

Nicht anwendbar.

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

Nicht anwendbar.

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

Nicht anwendbar.

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

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

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

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

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

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

### Ökologische und/oder soziale Merkmale

**Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?** *[Bitte gegebenenfalls ankreuzen und ausfüllen; der Prozentsatz entspricht der Mindestverpflichtung zu nachhaltigen Investitionen]*

**Ja**

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

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

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

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

**Nein**

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

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

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

mit einem sozialen Ziel

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



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

Es gab keine aktiven Verletzungen gegen die vom Finanzprodukt beworbenen positiven ökologischen und/oder sozialen Merkmale im Bezugszeitraum.

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



**Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

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

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

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

Nicht anwendbar.

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

Für den Teilfonds werden keine nachhaltigen Investitionen getätigt.

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

Für den Teilfonds werden keine nachhaltigen Investitionen getätigt.

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

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

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

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

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

*In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem 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 Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.**

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

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



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

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

1. Klima- und umweltbezogene Indikatoren basierend auf den folgenden negativen Nachhaltigkeitsindikatoren:

- Treibhausgasemissionen
- Energieleistung
- Carbon Footprint

2. Soziales und Mitarbeiter, Achtung der Menschenrechte, Korruptions- und Bestechungsbekämpfung, basierend auf den folgenden negativen Nachhaltigkeitsindikatoren:

- Soziales und Arbeitnehmerfragen
- Violation of UN Global Compact Principles
- Exposition zu kontroversen Waffen

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



### Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Dargestellt sind die grössten 10 Investitionen zum Ende des Bezugszeitraums (30.06.2023).

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: Top-10 per 30.06.2023

<b>Größte Investitionen</b>	<b>In % der Vermögenswerte</b>	<b>Sektor</b>	<b>Land</b>
0,000% Frankreich EO-Treasury Bills 2022(23)	8,10 %	Sovereign	France
2,800% Bundesrep.Deutschland Bundesschatzanw. v.23(25)	8,09 %	Sovereign	Germany
1,750% Italien, Republik EO-B.T.P. 2019(24)	2,66 %	Sovereign	Italy
Plenum CAT Bond Fund Inhaber-Anteile P EUR o.N.	2,14 %	Debt Fund	Liechtenstein
0,625% Kreditanst.f.Wiederaufbau Anl.v.2017 (2027)	1,86 %	Banks	Germany
0,500% Merck & Co. Inc. EO-Notes 2016(16/24)	0,91 %	Pharmaceuticals	United States
4,350% Valero Energy Corp. DL-Notes 2018(18/28)	0,84 %	Oil & Gas	United States
3,129% Toronto-Dominion Bank, The EO-Medium-Term Notes 2022(32)	0,76 %	Banks	Canada
3,500% Frankreich EO-OAT 2010(26)	0,69 %	Sovereign	France
1,375% Tesco Corp. Treas. Serv. PLC EO-Medium-Term Notes 18(23/23)	0,67 %	Insurance	Britain

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



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

Für den Teilfonds werden keine nachhaltigen Investitionen getätigt.

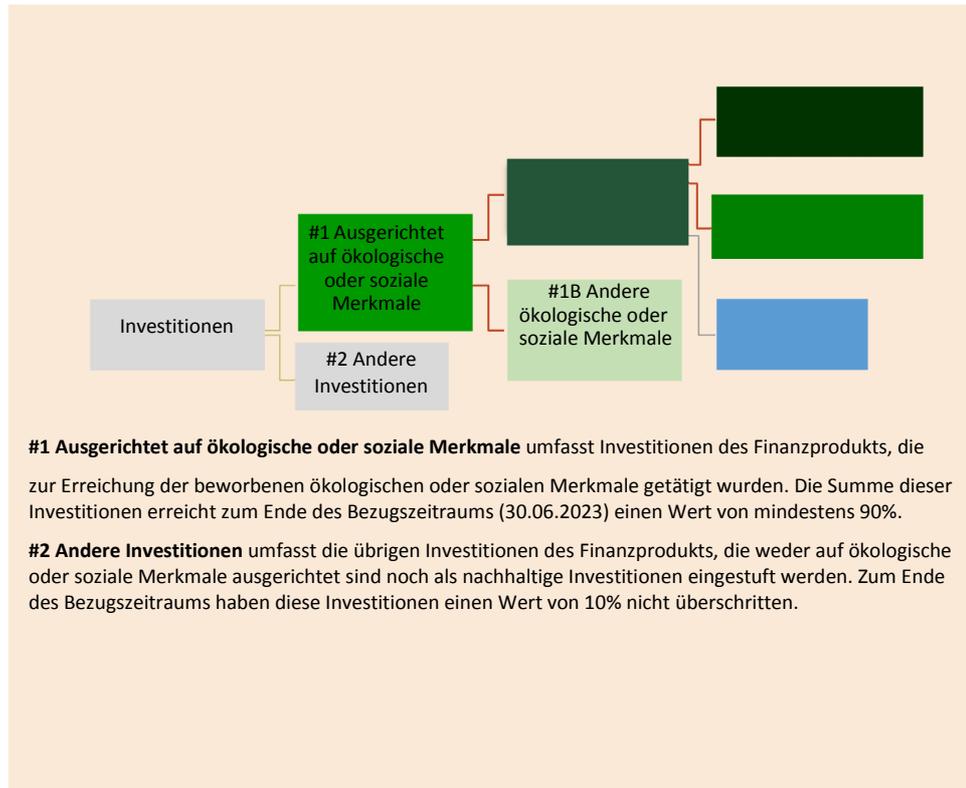
Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

**Wie sah die Vermögensallokation aus?**

*[Fügen Sie diesen Hinweis für Finanzprodukte im Sinne des Artikels 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852]*

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



**#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden. Die Summe dieser Investitionen erreicht zum Ende des Bezugszeitraums (30.06.2023) einen Wert von mindestens 90%.

**#2 Andere Investitionen** umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden. Zum Ende des Bezugszeitraums haben diese Investitionen einen Wert von 10% nicht überschritten.

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



*In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?*

Dargestellt sind die Wirtschaftssektoren, die zusammen mehr als 90% der Investitionen zum Ende des Bezugszeitraums (30.06.2023) ausmachen.

<b>Sektor</b>	<b>In % der Vermögenswerte</b>
Sovereign	22.94
Banks	18.55
Insurance	3.78
Telecommunications	3.55
Commercial Services	2.79
Oil&Gas	2.47
Building Materials	2.44
Debt Fund	2.15
Chemicals	2.05
Food	2.04
Miscellaneous Manufactur	2.03
Auto Manufacturers	1.94
Computers	1.9
Pharmaceuticals	1.89
Engineering&Construction	1.84
Media	1.55
Healthcare-Services	1.4
Water	1.31
Auto Parts&Equipment	1.28
Electrical Compo&Equip	1.24
Real Estate	1.19
REITS	1.09
Diversified Finan Serv	1.08
Healthcare-Products	1.03
Transportation	1
Software	0.87
Airlines	0.79
Electric	0.77
Apparel	0.73
Cosmetics/Personal Care	0.61
Retail	0.61
Gas	0.59
Agriculture	0.56

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



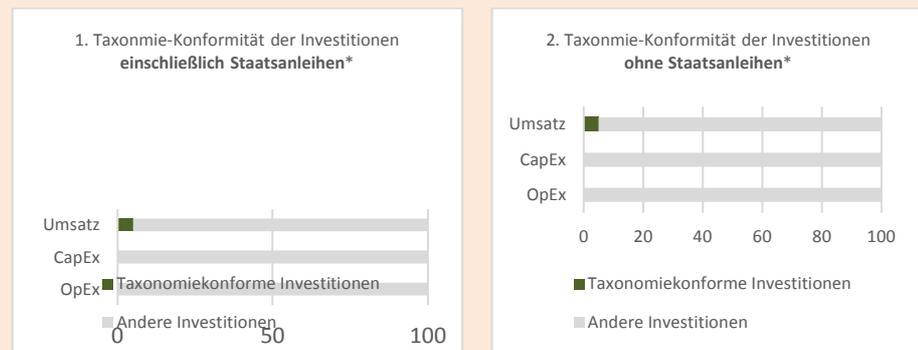
**Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?**

Für den Teilfonds werden keine nachhaltigen Investitionen getätigt.

**Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonmiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?**

- Ja  
 In fossiles Gas                       In Kernenergie  
 Nein

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



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

*[Fügen Sie diesen Hinweis nur für die Finanzprodukte im Sinne des Artikels 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 ein.]*

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

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

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

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

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

Nicht anwendbar.

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

[Fügen Sie den Hinweis für die Finanzprodukte im Sinne des Artikels 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 ein, mit denen in ökologische Wirtschaftstätigkeiten sind.]



sind nachhaltige Investitionen

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



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

Ein Mindestanteil nachhaltiger Investitionen mit Umweltziel wurde nicht festgelegt.



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

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



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

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



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

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

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

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



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

*[Fügen Sie diesen Hinweis bei Finanzprodukten ein, bei denen ein Index als Referenzwert für die Erreichung der mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wurde.]*

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

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

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

Nicht anwendbar.

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

Nicht anwendbar.

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

Nicht anwendbar.

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

Nicht anwendbar.

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

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

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

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

Name des Produkts: **Swiss Rock (Lux) Sicav – Absolute Return Bond Fund Plus ESG**  
 Unternehmenskennung (LEI-Code): **529900GEG9D6E7AFJJ30**

### Ökologische und/oder soziale Merkmale

**Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?** *[Bitte gegebenenfalls ankreuzen und ausfüllen; der Prozentsatz entspricht der Mindestverpflichtung zu nachhaltigen Investitionen]*

**Ja**

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

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

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

**Nein**

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

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

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



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

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



#### **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

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

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

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Nicht anwendbar.

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

Für den Teilfonds werden keine nachhaltigen Investitionen getätigt.

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

Für den Teilfonds werden keine nachhaltigen Investitionen getätigt.

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

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

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

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

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

*In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem 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 Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.**

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

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



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

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

1. Klima- und umweltbezogene Indikatoren basierend auf den folgenden negativen Nachhaltigkeitsindikatoren:

- Treibhausgasemissionen
- Energieleistung
- Carbon Footprint

2. Soziales und Mitarbeiter, Achtung der Menschenrechte, Korruptions- und Bestechungsbekämpfung, basierend auf den folgenden negativen Nachhaltigkeitsindikatoren:

- Soziales und Arbeitnehmerfragen
- Violation of UN Global Compact Principles
- Exposition zu kontroversen Waffen

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



### Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Dargestellt sind die grössten 10 Investitionen zum Ende des Bezugszeitraums (30.06.2023).

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die der größte Anteil der getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: Top-10 per 30.06.2023

Größte Investitionen	In % der Vermögenswerte	Sektor	Land
2,800% Bundesrep.Deutschland Bundesschatzanw. v.23(25)	3,66 %	Sovereign	Germany
Swisscanto(LU)Bd-Res.COCO Namens-Ant. DTH CHF o.N.	3,18 %	Debt Fund	Luxembourg
Plenum CAT Bond Fund Inhaber-Anteile P EUR o.N.	2,43 %	Debt Fund	Luxembourg
1,750% Italien, Republik EO-B.T.P. 2019(24)	2,06 %	Sovereign	Italy
1,450% Italien, Republik EO-B.T.P. 2020(36)	1,40 %	Sovereign	Italy
FISCH Convert.Gbl Sustainable Namens-Anteile BE o.N.	1,10 %	Asset Allocation Fund	Luxembourg
3,500% Frankreich EO-OAT 2010(26)	1,06 %	Sovereign	France
4,350% Valero Energy Corp. DL-Notes 2018(18/28)	0,65 %	Oil & Gas	United States
1,250% Deutsche Telekom Intl Fin.B.V. LS-Medium-Term Notes 2016(23)	0,61 %	Telecommunications	Netherlands
1,375% Tesco Corp. Treas. Serv. PLC EO-Medium-Term Notes 18(23/23)	0,52 %	Insurance	Britain

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

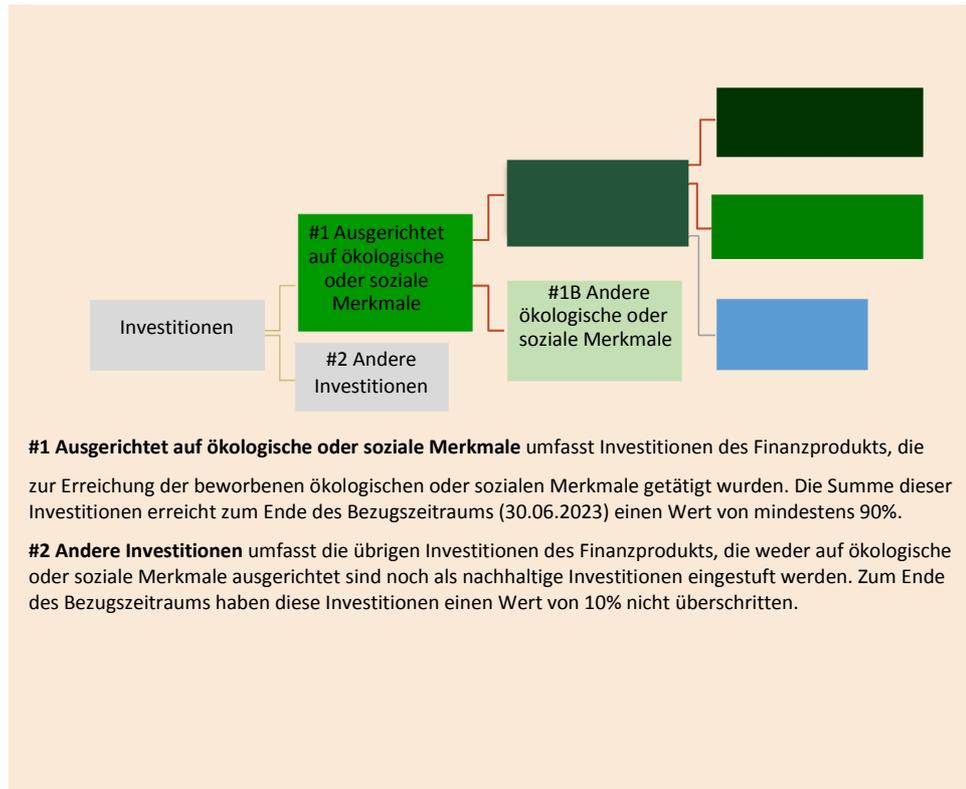


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Für den Teilfonds werden keine nachhaltigen Investitionen getätigt.

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

## Wie sah die Vermögensallokation aus?



**#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden. Die Summe dieser Investitionen erreicht zum Ende des Bezugszeitraums (30.06.2023) einen Wert von mindestens 90%.

**#2 Andere Investitionen** umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden. Zum Ende des Bezugszeitraums haben diese Investitionen einen Wert von 10% nicht überschritten.

*[Fügen Sie diesen Hinweis für Finanzprodukte im Sinne des Artikels 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852]*

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

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



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

Dargestellt sind die Wirtschaftssektoren, die zusammen mehr als 90% der Investitionen zum Ende des Bezugszeitraums (30.06.2023) ausmachen.

<b>Sektor</b>	<b>In % der Vermögenswerte</b>
Banks	15.08
Sovereign	12.44
Debt Fund	5.62
Telecommunications	5.04
Insurance	3.58
Commercial Services	3.09
Oil&Gas	2.9
Building Materials	2.68
Chemicals	2.53
Engineering&Construction	2.33
Food	2.08
Auto Manufacturers	2.03
Auto Parts&Equipment	1.97
Pharmaceuticals	1.91
Media	1.91
Healthcare-Services	1.73
Miscellaneous Manufactur	1.58
Computers	1.48
REITS	1.43
Diversified Finan Serv	1.37
Retail	1.35
Water	1.29
Packaging&Containers	1.13
Asset Allocation Fund	1.1
Real Estate	1.08
Software	0.96
Electrical Compo&Equip	0.96
Apparel	0.94
Advertising	0.94
Food Service	0.78
Healthcare-Products	0.77
Gas	0.76
Airlines	0.71
Pipelines	0.7
Machinery-Constr&Mining	0.69
Electric	0.68
Investment Companies	0.67
Internet	0.65
Transportation	0.57
Lodging	0.5

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



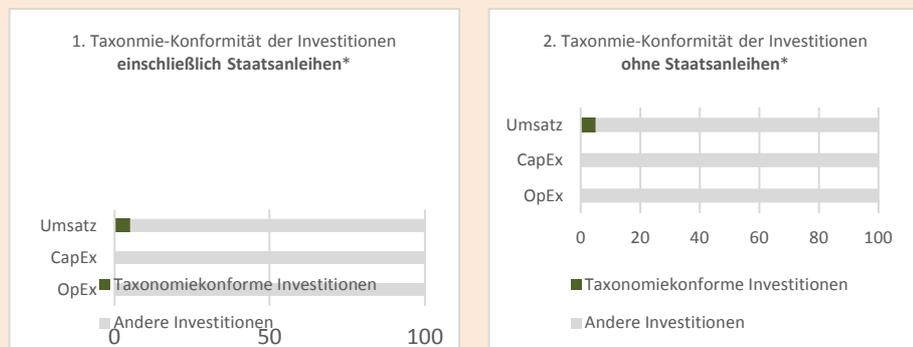
**Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?**

Für den Teilfonds werden keine nachhaltigen Investitionen getätigt.

**Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?**

- Ja
- In fossiles Gas
- In Kernenergie
- Nein

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



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

*[Fügen Sie diesen Hinweis nur für die Finanzprodukte im Sinne des Artikels 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 ein.]*

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

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

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

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

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

Nicht anwendbar.

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

[Fügen Sie den Hinweis für die Finanzprodukte im Sinne des Artikels 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 ein, mit denen in ökologische Wirtschaftstätigkeiten sind.]



sind nachhaltige Investitionen

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



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

Ein Mindestanteil nachhaltiger Investitionen mit Umweltziel wurde nicht festgelegt.



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

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



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

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



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

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

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

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



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

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

*[Fügen Sie diesen Hinweis bei Finanzprodukten ein, bei denen ein Index als Referenzwert für die Erreichung der mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wurde.]*

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

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

Nicht anwendbar.

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

Nicht anwendbar.

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

Nicht anwendbar.

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

Nicht anwendbar.