

Cleome Index

R.C.S. Luxemburg B-72234



SICAV luxemburgischen Rechts

Geprüfter Jahresbericht zum 31. Dezember 2021

Cleome Index

SICAV luxemburgischen Rechts

Geprüfter Jahresbericht für das Geschäftsjahr
vom 1. Januar 2021 bis zum 31. Dezember 2021

Cleome Index

Inhalt

Verwaltung der SICAV	4
Angaben zur SICAV	5
Bericht des Verwaltungsrats	6
Prüfungsbericht	11
Nettovermögensaufstellung zum 31. Dezember 2021	14
Statistiken	21
Anlageportfolio zum 31. Dezember 2021	23
Cleome Index EMU Equities	23
Cleome Index Euro Corporate Bonds	29
Cleome Index Euro Government Bonds	46
Cleome Index Euro Long Term Bonds	50
Cleome Index Euro Short Term Bonds	53
Cleome Index Europe Equities	56
Cleome Index USA Equities	65
Cleome Index World Equities (siehe Anhangangabe 1)	75
Anhang zum Abschluss - Aufstellung der derivativen Instrumente	88
Sonstige Erläuterungen zum Jahresabschluss	89
Zusätzliche ungeprüfte Angaben	98

Cleome Index

Verwaltung der SICAV

Vorsitzender

Tanguy DE VILLENFAGNE
Member of the Group Strategic Committee, Candriam Belgium

Mitglieder

Isabelle CABIE
Global Head of Corporate Responsible Development,
Candriam Belgium

Thierry BLONDEAU (seit 20. April 2021)
Independent Director

Catherine DELANGHE
Independent Director

Vincent HAMELINK
Member of the Group Strategic Committee, Candriam Belgium

Jean-Yves MALDAGUE (bis 19. April 2021)
Managing Director, Candriam Luxembourg

Myriam VANNESTE
Global Head of Product Management, Candriam Belgium

Jan VERGOTE
Head of Investment Strategy, Belfius Banque S.A

Gesellschaftssitz

5, Allée Scheffer
L-2520 Luxembourg

Depotbank und Hauptzahlstelle

CACEIS Bank, Luxembourg Branch
5, Allée Scheffer
L-2520 Luxembourg

Verwaltungsgesellschaft

Candriam Luxembourg
SERENITY - Bloc B
19-21, Route d'Arlon
L-8009 Strassen

Die Aufgaben der **Verwaltungsstelle**, der **Domizilstelle** und der **Transferstelle** (einschließlich der **Registerführungstätigkeit**) wurden übertragen auf:

CACEIS Bank, Luxembourg Branch
5, Allée Scheffer
L-2520 Luxembourg

Die Durchführung der **Portfolioverwaltungsaktivitäten** wurde für einige Teilfonds delegiert an:

Candriam Belgium
58, Avenue des Arts
B-1000 Brüssel

Die Durchführung der **Portfolioverwaltungsaktivitäten** wurde für einige andere Teilfonds delegiert an:

Candriam France
40, rue Washington
F-75408 Paris Cedex 08

Die Durchführung der **Wertpapierleihgeschäfte** wurde delegiert an:

Candriam France
40, rue Washington
F-75408 Paris Cedex 08

Für alle Teilfonds wurde die Durchführung der **Wertpapierleihgeschäfte** weiter delegiert an:

CACEIS Bank, Luxembourg Branch
5, Allée Scheffer
L-2520 Luxembourg

„Réviseur d'entreprises agréé“

PricewaterhouseCoopers, Société coopérative
2, Rue Gerhard Mercator
L-2182 Luxembourg

„Réviseur d'entreprises agréé“ der Verwaltungsgesellschaft

PricewaterhouseCoopers, Société coopérative
2, Rue Gerhard Mercator
L-2182 Luxembourg

Cleome Index

Angaben zur SICAV

Die SICAV veröffentlicht einen ausführlichen Jahresbericht über ihre Aktivitäten und das verwaltete Vermögen. Der Bericht enthält eine konsolidierte Aufstellung des Nettovermögens und eine konsolidierte Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens, dargestellt in Euro, den Wertpapierbestand jedes Teilfonds und den Bericht des Abschlussprüfers. Dieser Bericht ist am Sitz der SICAV und am Sitz der Banken, die in den Ländern, in denen die SICAV vertrieben wird, Finanzdienstleistungen erbringen, erhältlich.

Darüber hinaus wird alle sechs Monate ein Bericht veröffentlicht, der insbesondere die Zusammensetzung des Portfolios, die Anzahl der im Umlauf befindlichen Anteile und die Anzahl der ausgegebenen oder zurückgekauften Anteile seit dem Tag des jeweils vorigen Berichts enthält.

Die Anteile sind nur als Namensanteile erhältlich.

Die Jahreshauptversammlung der Anteilhaber der SICAV findet jedes Jahr am Gesellschaftssitz der SICAV oder an einem in der Einberufung der Versammlung angegebenen anderen Ort in Luxemburg statt. Sie findet innerhalb von 6 Monaten nach Ende des Geschäftsjahres statt.

Die Einberufung aller Hauptversammlungen wird mindestens acht Tage vor der Hauptversammlung an alle eingetragenen Anteilhaber per Post an ihre im Anteilhaberregister genannte Adresse verschickt. Diese Einberufungsschreiben enthalten den Ort und die Uhrzeit der Hauptversammlung sowie die Teilnahmebedingungen, die Tagesordnung und die Erfordernisse des luxemburgischen Rechts in Bezug auf Beschlussfähigkeit und erforderliche Mehrheiten.

Darüber hinaus wird in der „Recueil électronique des sociétés et associations“ („RESA“) des Großherzogtums Luxemburg sowie in einer Luxemburger Zeitung, dem „Luxemburger Wort“, sowie in der Presse der Länder, in denen die SICAV vermarktet wird, eine Mitteilung veröffentlicht, sofern die Gesetzgebung dies erfordert.

Das Geschäftsjahr der SICAV endet am 31. Dezember jedes Jahres.

Der Nettoinventarwert je Anteil jeder Anteilsklasse jedes Teilfonds sowie der Ausgabe-, Rücknahme- und Umtauschpreis jeder Anteilsklasse jedes Teilfonds sind am Sitz der SICAV und bei den Banken, die mit der Erbringung von Finanzdiensten in den Ländern, in denen die SICAV vertrieben wird, beauftragt sind, erhältlich.

Der Prospekt, die wesentlichen Anlegerinformationen, die Satzung der SICAV und die Finanzberichte sind für die Öffentlichkeit kostenlos am Gesellschaftssitz der SICAV verfügbar.

Bericht des Verwaltungsrats

Wirtschaftlicher und finanzieller Hintergrund

In den Vereinigten Staaten haben sich die Wachstumsaussichten für 2021 nach der Ankündigung der Wirksamkeit von Impfstoffen Ende 2020, dem Sieg des Duos Biden-Harris und der demokratischen Mehrheit in beiden Kammern weiter verbessert. Die ISM-Indikatoren sowohl für das verarbeitende als auch für das nicht-verarbeitende Gewerbe sind deutlich gestiegen. Das BIP wuchs im Vergleich zum vierten Quartal 2020 um 1,5 % gegenüber dem Vorjahresquartal. Präsident Biden drängte den Kongress zur Verabschiedung seines 1,9 Billionen US-Dollar schweren amerikanischen Rettungsplans, der Ende März verabschiedet wurde. Das Wachstum der Wirtschaftstätigkeit in Verbindung mit der daraus resultierenden fiskalischen Unterstützung gab dem Zinssatz für zehnjährige Anleihen starken Auftrieb. Er lag zum Quartalsende bei 1,75 % und damit 83 Basispunkte höher als Ende Dezember 2020. Der Aktienmarkt verzeichnete im gleichen Zeitraum einen Anstieg von 5,8 %. Die ISM-Indikatoren für das verarbeitende und das nicht-verarbeitende Gewerbe blieben im gesamten zweiten Quartal 2021 über 60. Die Arbeitslosenquote sank Monat für Monat und lag im Juni bei 5,9 %. Die Investitionen der privaten Haushalte in Wohnimmobilien waren im zweiten Quartal 2021 um 15,8 % höher als im vierten Quartal 2019, während die Hauspreise im Jahresvergleich um 17,4 % stiegen. Der Preis für ein Barrel der Sorte Brent stieg zwischen Anfang April und Ende Juni von 59 USD auf 75 USD, was auf das beschleunigte Wachstum in den USA (+1,6 % gegenüber dem Vorjahresquartal) und weltweit sowie auf die strenge Produktionskontrolle seitens der OPEC+ zurückzuführen ist. Durch eine Kombination aus steigenden Energie- und Rohstoffpreisen und einem „günstigen“ Basiseffekt erreichte die Inflation im Mai 5 % und die Kerninflation 3,8 %, was dazu führte, dass sich der zehnjährige Zinssatz bis Mitte Mai um 1,7 % herum bewegte. Die Spannungen an den Anleihemärkten haben sich nach den „schwächeren“ Daten zur Schaffung von Arbeitsplätzen (269.000) Anfang Mai entspannt. Der Zinssatz für 10-jährige Staatsanleihen fiel im Laufe des Quartals um 30 Basispunkte auf 1,44 %. Der Aktienmarkt legte dank des wiederbelebten Wachstums gegenüber Ende März um 8,2 % zu. Im dritten Quartal führte die Begrenzung der Impfquote in Verbindung mit der Ausbreitung der Delta-Variante zu einem starken Anstieg der durchschnittlichen Zahl der täglichen Fälle, was eine Verlangsamung der Aktivität befürchten ließ. Der zehnjährige Zinssatz fiel vorübergehend unter 1,2 %. Das wirtschaftliche Umfeld blieb jedoch lebhaft: Im dritten Quartal überstieg die Zahl der neu geschaffenen Arbeitsplätze die 1,6-Millionen-Marke, und die ISM-Indikatoren blieben im Durchschnitt über 60. Die OPEC+-Länder haben sich darauf geeinigt, die Ölproduktion bis Ende Dezember 2021 sehr schrittweise zu erhöhen. Die Transportkosten (im Seeverkehr und in anderen Bereichen) stiegen drastisch an. An der Westküste kam es zu Engpässen bei der Hafentladung und beim Gütertransport, da es an Lkw-Fahrern mangelte. Die Energiepreise stiegen, wobei der WTI-Preis Ende September auf 75 USD pro Barrel anstieg. Diese unterschiedlichen Entwicklungen führten dazu, dass die Inflation über 5 % und die Kerninflation über 4 % blieb. Erst die Ankündigung der US-Notenbank vom 22. September, die Ankäufe von Anleihen in den kommenden Monaten zu verlangsamen, führte dazu, dass der Zinssatz für zehnjährige Anleihen zum Quartalsende auf 1,53 % stieg, was einem Anstieg von 8 Basispunkten gegenüber dem zweiten Quartal entspricht. Der Aktienmarkt beendete das Quartal mit einem Plus von 0,2 % auf 4308. Nach einer Phase leichter Turbulenzen im dritten Quartal (BIP-Wachstum von nur 0,6 % im Vergleich zum Vorjahresquartal) haben die Märkte im vierten Quartal wieder Tritt gefasst. Während der ISM-Index für das verarbeitende Gewerbe stark blieb, beschleunigt sich der Dienstleistungsindex deutlich. Letzterer erreichte im November den höchsten Stand seit Einführung der Erhebung im Jahr 1997. Die Arbeitslosenquote ist erneut auf 4,2 % gesunken. Die anhaltend starke Nachfrage nach Gütern und die Normalisierung der Nachfrage nach Dienstleistungen sowie verschiedene Engpässe üben Druck auf die Preise aus. Inflation und Kerninflation lagen im November bei 6,8 % bzw. 5 %. Der Anstieg der Immobilienpreise liegt im Jahresvergleich bei über 15 %. Auf ihrer Sitzung am 15. Dezember veröffentlichte die US-Notenbank ihre neuen makroökonomischen Prognosen für 2022, in denen Wachstum und Inflation nach oben und die Arbeitslosenquote nach unten korrigiert werden. Diese verschiedenen Änderungen veranlassten die Bank, eine Beschleunigung ihres Tapering-Programms anzukündigen. Infolgedessen treiben das anhaltende Wachstum und die positiven Aussichten für 2022 den Aktienmarkt nach oben. Mit 4766 Punkten lag der S&P 500 Ende 2021 um 26,9 % höher als Ende Dezember 2020. Der Zinssatz für 10-jährige Staatsanleihen stieg im Jahresverlauf um 59 Basispunkte und lag bei 1,5 %.

Bericht des Verwaltungsrats

In der Eurozone hat der weltweite Aufschwung im verarbeitenden Gewerbe im ersten Quartal 2021 die Industrietätigkeit in Europa gestärkt, was zu einem Anstieg des Einkaufsmanagerindex (PMI) für das verarbeitende Gewerbe (deutlich über 50) führte. Der Einkaufsmanagerindex für das Dienstleistungsgewerbe blieb jedoch glanzlos, da sich die Lage im Gesundheitswesen aufgrund des schleppenden Beginns der Impfkampagne im ersten Quartal nur geringfügig verbesserte. Dies hatte zur Folge, dass ganze Bereiche des Dienstleistungssektors zum Stillstand gekommen sind. Insgesamt schrumpfte das BIP 0,2 % gegenüber dem Vorquartal, nachdem es im vierten Quartal 2020 um 0,4 % gesunken war. Dennoch stieg der deutsche 10-Jahres-Zinssatz Ende März, auch aufgrund einer ähnlichen Zinsentwicklung wie in den Vereinigten Staaten, gegenüber Ende 2020 um 24 Basispunkte auf -0,33 %. Der Aktienmarkt legte im Vergleich zum Jahresende 2020 um 8,7 % zu. Im zweiten Quartal 2021 stiegen die Exporte und Exportaufträge stark an, ebenso wie die Indikatoren für die Investitionsabsichten der Unternehmen. Die Arbeitslosenquote ging im Juni leicht auf 7,8 % zurück, verglichen mit mehr als 8 % Mitte 2020. Der Einkaufsmanagerindex für das verarbeitende Gewerbe der Eurozone blieb über 60. Die Mobilitätsindikatoren zogen ab April deutlich an. Der Dienstleistungssektor löste sich im Laufe des Quartals allmählich aus seiner Blockade, und der Einkaufsmanagerindex für diesen Sektor stieg von 50,5 im April auf 58,3 im Juni. Die Rücknahme der Lockdown-Maßnahmen führte zu einem Anstieg des BIP um 2,2 % gegenüber dem Vorjahresquartal. Der deutsche 10-Jahres-Zinssatz stieg um 8 Basispunkte auf -0,25 % und der Aktienmarkt legte um 4,6 % zu. Die Industrieproduktion und die Fähigkeit der Unternehmen, ihre Lagerbestände wieder aufzufüllen, waren jedoch mehrere Monate lang durch Engpässe (bei Halbleitern), Lieferunterbrechungen (infolge des Wiederauftretens der Delta-Variante in Asien) und die u. a. in China angewandte „Null-COVID-19“-Politik beeinträchtigt worden. Infolgedessen sank die deutsche 10-Jahres-Rendite im Vergleich zu Ende Juni um 18 Basispunkte. Andererseits kündigte die EZB angesichts der Normalisierung der Mobilität und der Aufrechterhaltung des Vertrauens der Unternehmen und Haushalte auf hohem Niveau Anfang September eine leichte Verringerung des Tempos der Ankäufe von Vermögenswerten im Rahmen des PEPP (Pandemic Emergency Purchase Programme) an. Ab Ende August trieben die Verknappung und der beträchtliche Anstieg der Energiepreise (einschließlich Gas und Strom) die Inflation in der Eurozone auf über 3 %, was trotz der weiterhin robusten Wirtschaftstätigkeit (Einkaufsmanagerindizes über 50) den Anstieg des Aktienmarktes bremste und die langfristigen Zinsen nach oben trieb. Schließlich legte der Aktienmarkt im Laufe des Quartals um 0,2 % zu, während der 10-jährige Zinssatz um 5 Basispunkte auf -0,19 % stieg. Dank der Verbesserung der Beschäftigungslage und der Normalisierung der Tätigkeit im Dienstleistungssektor wuchs das BIP trotz Engpässen in den Lieferketten um 2,2 % gegenüber dem Vorjahresquartal. Andererseits sind in der Eurozone zunehmend Ausrüstungsengpässe und in letzter Zeit auch Arbeitskräftemangel zu verzeichnen, die die Produktion belasten. Aufgrund seiner Industriestruktur ist Deutschland am stärksten von diesem Phänomen betroffen. Bis jetzt sind die Einkaufsmanagerindizes sowohl im verarbeitenden Gewerbe als auch im Dienstleistungssektor jedoch positiv geblieben. Das Verbrauchervertrauen bleibt hoch. Der Arbeitsmarkt normalisiert sich. Ende November veranlasste das Auftreten einer neuen Variante (Omikron) die Regierungen, neue Maßnahmen zu ergreifen, die entweder auf Mobilität oder auf Impfung abzielen. Trotz dieser neuen Unsicherheit gab die Europäische Zentralbank am 16. Dezember bekannt, dass sie die Nettokäufe von Vermögenswerten im Rahmen des Pandemie-Notkaufprogramms (PEPP) nicht über den 31. März 2022 hinaus verlängern wird. Sie beschloss außerdem, ihre Ankäufe im Rahmen des Programms zum Ankauf von Vermögenswerten (Asset Purchase Programme, APP) zu ändern. Außerdem hat sie entschieden, den Zeitpunkt - zumindest bis Ende 2024 - zu verschieben, ab dem sie die Wiederanlage der Fälligkeiten fällig werdender Anleihen einstellen könnte. Eine Änderung des Leitzinses steht in der Eurozone jedoch nicht zur Debatte, trotz einer Inflation von 4,9 % im November. Anders sieht der Trend in den Vereinigten Staaten aus. Die Kerninflation liegt bei nur 2,6 %. Das Lohnwachstum in den Ländern der Eurozone ist wesentlich moderater als in den Vereinigten Staaten. Insgesamt beendete der deutsche 10-Jahres-Zinssatz das Jahr bei -0,18 %, 40 Punkte höher als Ende 2020. Im Gegensatz zu 2020 verzeichnete der Aktienmarkt einen Anstieg von 20,1 %.

Bericht des Verwaltungsrats

Cleome Bonds

Marktumfeld

Das Jahr 2021 war durch eine höhere Volatilität an den Finanzmärkten gekennzeichnet. Die Coronavirus-Pandemie wirkte sich weiterhin auf die Märkte aus, da in der ersten Jahreshälfte Fortschritte bei den Impfstoffprogrammen und Wiedereröffnungen zu verzeichnen waren. In der zweiten Jahreshälfte jedoch führte die Omikron-Variante des Covid-Virus zu Schließungen und Ausgangssperren auf der ganzen Welt. Dennoch waren die makroökonomischen Aussichten in den Industrieländern im Laufe des Jahres überwiegend positiv, auch wenn die Konjunkturabschwächung in China (die in der zweiten Jahreshälfte stärker ausgeprägt war) einige negative Auswirkungen hatte. Ein äußerst wichtiges Element, das sich durch das gesamte Jahr zog, war die Inflation, die sich auf einem hohen Niveau bewegte. Einen wesentlichen Beitrag zu diesem Phänomen leisteten die hohen Rohstoffpreise, die durch den Anstieg des Ölpreises von 50 USD/Barrel auf 75 USD/Barrel gekennzeichnet waren, was sich auf die Kosten der Waren auswirkte. Darüber hinaus sah sich die Welt weiterhin mit einer Versorgungskrise konfrontiert, die auf die zahlreichen Probleme in der Versorgungskette zurückzuführen war, die überall auf der Welt zu beobachten waren.

Die Reaktion auf diese Krise war sowohl an der fiskalischen als auch an der geldpolitischen Front außerordentlich heftig und erreichte in der ersten Hälfte des Jahres 2022 weiterhin Rekordwerte. Der fiskalische Unterstützungsplan von Biden wurde Anfang des Jahres eingeführt, und das „Next-Gen“-Programm der EZB wurde während des gesamten Jahres 2022 fortgesetzt. Darüber hinaus war die Unterstützung durch die Zentralbanken im ersten Halbjahr allgegenwärtig, da sowohl die FED als auch die EZB ihre Programme zur quantitativen Lockerung aufrechterhielten, während sie die Zinsen niedrig hielten. In der zweiten Jahreshälfte kam es jedoch zu einer deutlichen Wende in der Geldpolitik. Sowohl die Fed als auch die EZB wählten eine kämpferische Rhetorik, die auf eine geringere Unterstützung hindeutete, und kündigten schließlich die Drosselung ihrer Anleihekaufprogramme an. Die Fed wies darauf hin, dass eine Anhebung der Zinssätze im Jahr 2022 erfolgen könnte, da die höhere Inflation nicht mehr als vorübergehend angesehen wurde. Auch die Bank of England und mehrere Zentralbanken der Schwellenländer kündigten Zinserhöhungen an. China schien hier eine Ausnahme zu bilden, da die Peoples Bank of China angesichts der Wachstumsverlangsamung an ihrer abwartenden Haltung festhielt. Darüber hinaus hatte das Land auch mit den Turbulenzen im Immobiliensektor zu kämpfen, wobei Emittenten wie Evergrande unter den strengeren Vorschriften und schwachen Bilanzen litten. Diese Turbulenzen wirkten sich sowohl auf die Kredit- als auch auf die EM-Schuldenmärkte aus.

Das politische Risiko hat zwar 2021 etwas nachgelassen (insbesondere in den USA), war aber keineswegs verschwunden. In Italien und Deutschland kam es zu einem Regierungswechsel, der jedoch von den Märkten relativ gut aufgenommen wurde. Handelskriege waren ebenfalls präsent, da die De-Globalisierung weiterhin einen Schatten auf die Volkswirtschaften warf und die Folgen des Brexit weiterhin Anlass zur Sorge gaben. Die geringere geldpolitische Unterstützung führte auch dazu, dass die Streuung wieder zunahm. In einem Umfeld, in dem der Einfluss der Zentralbanken abnahm, rückte das idiosynkratische Risiko in den Vordergrund, während die Fundamentaldaten an Bedeutung gewannen.

Staatsanleihen

Die Renditen für Staatsanleihen der Industrieländer erlebten ein unbeständiges Jahr, das mit einem starken Anstieg im ersten Quartal begann, der auf die rasch voranschreitenden Impfprogramme und die potenzielle Wiederbelebung der Volkswirtschaften zurückzuführen war. Der durch den starken Anstieg der Rohstoffpreise bedingte Inflationsanstieg trug ebenfalls zu diesem Aufwärtstrend bei. Die 10-jährigen US-Zinsen stiegen kräftig auf über 1,7 %, während die deutschen Zinsen ebenfalls auf -0,30 anstiegen. Während die Zinssätze in der Kern-Eurozone im 2. Quartal weiter stiegen, verlor die US-Wirtschaft etwas an Schwung, und die Impfprogramme erreichten ein gewisses Plateau, so dass die Zinssätze auf 1,2 % sanken. Die zweite Jahreshälfte war durch einen Anstieg der Zinssätze gekennzeichnet, der sich im vierten Quartal beschleunigte. Die kämpferische Rhetorik der Fed und der EZB sowie der zunehmende Inflationsdruck zogen den erwarteten Zinsanstieg in der Tat vor. Im vierten Quartal führten die Ankündigung des Tapering-Programms der DM-Zentralbanken und die Anhebung der Zinssätze einiger EM-Zentralbanken zu einem sprunghaften Anstieg der Zinssätze, was auch die Volatilität erhöhte. Die Kernzinsen beendeten das Jahr mit einer negativen Performance über 2021. Die Staatsanleihen der Peripherieländer folgten einem ähnlichen Trend, wengleich die Bewegungen vielleicht etwas weniger stark ausfielen, da die Suche nach Rendite die Anleger weiterhin in diese Anlageklasse trieb. Länder wie Australien und Kanada (rohstoffabhängiger Dollar-Block) verzeichneten eine ähnliche Performance wie die US-Zinsen, während Neuseeland, wo die Zentralbank schon früher eine Zinserhöhung durchführte, einen stetigen Anstieg seiner 10-jährigen Renditen verzeichnete.

Corporate Investment Grade

2021 war ein volatiles Jahr für den Euro Corporate Investment Grade-Markt. Das Jahr war geprägt von der Allgegenwart des Coronavirus in verschiedenen Varianten, das Länder auf der ganzen Welt dazu zwang, regelmäßig Maßnahmen zu ergreifen, die zu zusätzlichen Störungen führten, die sich in der zweiten Jahreshälfte deutlich verschärften. Die Unterstützung durch die Zentralbanken war das ganze Jahr über präsent, wengleich die Rhetorik recht uneinheitlich war, wobei sich im vierten Quartal zunehmend kämpferische Töne durchsetzten, was die Volatilität noch verstärkte. Das Hauptthema im Jahr 2021 war eindeutig die Inflation, die durch den Anstieg der Rohstoffpreise und Einschränkungen in der Lieferkette bedingt war und die Märkte sowie die Geldpolitik vor Herausforderungen stellte. Die Fundamentaldaten der Emittenten mit Investment-Grade-Rating blieben das ganze Jahr über gut, da die Unternehmen weiterhin von einem äußerst akkommodierenden monetären Umfeld profitierten, auch wenn in der zweiten Jahreshälfte das idiosynkratische Risiko an Bedeutung gewann und damit die Streuung unter den Emittenten förderte.

Insgesamt verzeichnete der ICE BofA-Merrill Lynch Euro Corporate Index in der ersten Jahreshälfte 2021 eine leicht negative Performance, die durch den starken Anstieg der Kernzinsen im ersten Quartal geprägt war, der sich auf die Performance des IG-Marktes auswirkte. In den Monaten Juni bis Juli 2021 erholten sich die IG-Märkte stark, da die Zentralbanken ihre akkommodierende Haltung beibehielten und die Fundamentaldaten der Emittenten stark blieben (wie die Anzahl der Rising Stars in den ersten beiden Quartalen zeigt). Im weiteren Verlauf des Jahres sorgte die aggressive Rhetorik der Zentralbanken in Verbindung mit dem Auftauchen der Omikron-Variante von Covid für erhebliche Turbulenzen. Der ICE BofA-Merrill Lynch Euro Corporate Index verzeichnete im Jahresverlauf eine Rendite von -1 %, wobei die Anleger nach wie vor in Scharen in diese Anlageklasse strömten, die von dem Streben nach Rendite sowie von dem bis 2021 geltenden EZB-Backstop profitierte.

Bericht des Verwaltungsrats

Cleome Equities

Für die Finanzmärkte erwies sich das erste Halbjahr 2021 als recht ereignisreich. Das erste Quartal des Jahres war dominiert von steigenden Anleiheerträgen und einer wertorientierten Erholung am Aktienmarkt. Das Jahr begann optimistisch, als der Wahlsieg der Demokraten in den USA Anfang Januar das Konjunkturprogramm-Narrativ wiederbelebte. Die Aktienmärkte reagierten hoffnungsvoll auf die Aussicht auf weitere Finanzanreize und die Anleihemärkte erlebten einen heftigen Ausverkauf bei den 10-jährigen. Die beiden Schlüsselantriebskräfte für diese Performance waren der Sieg der Demokraten in Georgia Anfang des Jahres, der den Weg für weitere massive US-Finanzanreize ebnete, sowie der Erfolg der Impfkampagne in den USA und Großbritannien.

Insgesamt war es kein gutes Quartal für Regierungsanleihen/Festverzinsliche Papiere und ein gutes Quartal für die meisten Aktienmärkte. Die von Covid am meisten profitierenden Aktien blieben seit November 2020 hinter den Erwartungen zurück, während die Covid-Verlierer aufholten. Ebenso verlangsamten Virusmutationen wie die brasilianische und die südafrikanische Variante die Rückkehr zur Normalität.

Im Verlauf des 2. Quartals erholten sich die Aktienmärkte, als die Impfkampagnen in den meisten Industrieländern, insbesondere in Europa, Fahrt aufnahmen. Die Regierungen der meisten Industrieländer lockerten die mit Covid zusammenhängenden Mobilitätseinschränkungen weiter, und die Aktivitäten nahmen zu. Die Wirtschaftsdaten der vergangenen drei Monate waren insgesamt sehr stark, insbesondere in den USA, wo eine annualisierte Wachstumsrate von 6,4 % im 1. Quartal verzeichnet wurde.

Dennoch hat die neuerliche Öffnung der Wirtschaft und die darauf folgende schnelle Rückkehr der Aktivitäten in einigen Ländern zu einem Anstieg der Inflation geführt. Während die US-Notenbank diesen Inflationsanstieg als vorübergehend ansah, ist sie nun etwas zurückhaltender und räumt ein, dass ein Tapering diskutiert wird.

Die Aktien der Industrieländer blieben im dritten Quartal weitgehend unverändert, nachdem ein moderater Rückgang im September die vorherigen Gewinne des Quartals zunichte gemacht hatte. Aktien hielten sich im Laufe des Quartals trotz einiger Bedenken über einen Höhepunkt des Wirtschaftswachstums, Versorgungsausfälle und steigende Inflation. Die Europäische Zentralbank (EZB) hat eine Verringerung des Tempos ihrer Ankäufe von Vermögenswerten angekündigt, aber im Gegensatz zur US-Notenbank betont, dass dies nicht der Beginn eines Prozesses der Rückführung der Ankäufe auf Null ist.

Im Kampf gegen das Virus deuten die Daten weiterhin darauf hin, dass alle Impfstoffe einen deutlichen Schutz gegen die Notwendigkeit eines Krankenhausaufenthalts bieten und insgesamt verkräfteten die Aktienmärkte verhältnismäßig gut die in vielen Ländern während dieses Quartals auftretende Covid-Hospitalisierungswelle. Inzwischen gibt es ermutigende Signale, dass die Anzahl der hospitalisierten Personen in den meisten Schlüsseländern den Höchststand überschritten hat.

Im 4. Quartal haben sich die Aktien der Industrieländer weiter erholt und boten Anlegern das dritte Kalenderjahr in Folge eine gute positive Rendite. Der starke Ertragszuwachs trieb die Aktien höher. Die Performance von festverzinslichen Wertpapieren war im Laufe des Quartals flach, da die Märkte die steigende Inflation und die weniger lockere Politik der Zentralbanken verdauen mussten. Das Auftreten der hochinfektiösen Omicron-Variante führte zu einem Anstieg der Volatilität der Aktienmärkte Ende November, aber die Märkte erholten sich rasch, als Daten aus Südafrika und Großbritannien ein geringeres Risiko schwerer Erkrankungen andeuteten.

Der saisonbedingte rasche Anstieg bei den Infektionen und die neue Omicron-Variante begannen, sich auf das globale Wachstum auszuwirken. Der jüngste Rückgang bei den Flash-Service-PMI-Werten in den USA, der Eurozone und Großbritannien ist ein klarer Hinweis darauf, dass der Dienstleistungssektor einen Teil seines positiven Schwungs verloren hat. Die Stimmung in der verarbeitenden Industrie ist jedoch trotz der Versorgungsengpässe und der steigenden Eingangspreise relativ stabil.

In Bezug auf die Inflation gaben drei der vier Zentralbanken der wichtigsten Industrieländer im Dezember an, dass sie sich mehr Sorgen um die Inflation im Jahr 2022 machen als um die wirtschaftliche Störung, die durch die Omicron-Variante verursacht werden könnte.

Europa

Europäische Aktien hatten einen schwachen Start in das Jahr 2021 aufgrund der Bedrohungen durch neue und virulentere Varianten des Coronavirus, Knappheit der Impfstoffe und der ansteigenden Zahlen neuer Krankheitsfälle. Die Impfungen begannen in Frankreich, Deutschland, Italien, Spanien und Großbritannien sehr langsam, insbesondere in Frankreich. Es konnten jedoch in der letzten Januarwoche positive Ergebnisse der Impfungen in Großbritannien beobachtet werden.

Europäische Aktien folgten eng der US-Performance im 2. Quartal und wurden durch die Wiedereröffnung regionaler Volkswirtschaften sowie die starke globale Güternachfrage gestützt. Die Ausbreitung der Delta-Variante könnte die vollständige Öffnung der Wirtschaft verlangsamen, aber die steigende Zahl der Krankheitsfälle hat in Großbritannien nicht zu wesentlich höheren Hospitalisierungsraten geführt. Das deutet darauf hin, dass die Impfungen gut gegen diese Variante helfen, und die britischen Aktien konnten immer noch 5,6 % im Verlauf des Quartals erzielen.

Im 3. Quartal änderte die EZB erwartungsgemäß ihre Forward Guidance, um die neue geldpolitische Strategie zu berücksichtigen, verzichtete aber auf weitere Änderungen (z. B. bei den Anleihenankäufen). Auf dem Papier ist die neue Forward Guidance gemäßiger als die vorige. Die Europäische Zentralbank (EZB) kündigte eine Verringerung ihrer Anleihenankäufe an, betonte aber im Gegensatz zur US-Notenbank, dass dies nicht der Beginn eines Taperings der Käufe gegen Null sei.

Weitere wichtige Nachrichten aus der Eurozone im Verlauf des 3. Quartals waren das Ergebnis der Wahlen in Deutschland, wobei das Ergebnis jedoch nicht bedeutet, dass das endgültige Ergebnis jetzt nicht mehr zu einem Impulsgeber für deutsche oder europäische Aktien wird. In Großbritannien hat die Bank of England (BoE) einen Kurswechsel vollzogen und angedeutet, dass sie die Zinsen noch vor Ende des Jahres anheben könnte.

Bericht des Verwaltungsrats

Cleome Equities (Fortsetzung)

Im 4. Quartal führten die unzuverlässige Versorgung mit russischem Gas, sinkende Investitionen in Wärmeenergie und Wartungsarbeiten an Nuklearanlagen zu einem scharfen Anstieg der Gas- und Strompreise auf dem Kontinent, bevor sie gegen Ende des Quartals wieder sanken. Höhere Energiepreise trugen zu einem Anstieg der Inflation in der Region bei.

An der politischen Front wurde der Vorsitzende der Deutschen Sozialdemokratischen Partei (SPD) der neue deutsche Bundeskanzler. Die SPD, die Grünen und die FDP haben einen Koalitionsvertrag mit ehrgeizigen Klimazielen unterzeichnet, wie z. B. den Ausstieg aus der Kohle aus dem deutschen Energiemix bis 2030, weit vor dem ursprünglichen Zeitplan. Die Bank of England erhöhte die Zinsen um 0,15 % auf 0,25 %, trotz der raschen Ausbreitung von Omicron. Die Europäische Zentralbank (EZB) bestätigte, dass das PEPP (Pandemic Emergency Purchase Programme) im März enden werde. Die Anleihenankäufe sollen auf rund 40 Mrd. Euro pro Monat im 2. Quartal 2022, 30 Mrd. Euro pro Monat im 3. Quartal 2022 und dann 20 Mrd. Euro pro Monat reduziert werden, bis kurz vorher die erste Zinserhöhung erfolgen soll.

USA

Das 1. Quartal 2021 brachte viele Ereignisse mit sich. In der letzten Januarwoche kam es zu einem Short Squeeze, der von Privatanlegern ausgelöst wurde, die sich in einige der am meisten geshorteten Aktien stürzten. Dies führte zu dem größten Kursrückgang an der Wall Street seit Oktober. Außerdem wurden Sorgen über eine Blase und Bedenken wegen der Bewertungen weiter Vorschub geleistet. Der Wahlsieg der Demokraten in den zwei Senatswahlen in Georgia bescherte der Partei die Kontrolle im Kongress und sorgte für einen mit 1,9 Billionen Dollar bezifferten „American Rescue Plan“, der das US-amerikanische Wachstum 2021 vorantrieb.

Die Konjunkturumfragedaten konsolidierten sich im März und sahen insgesamt positiv aus, einschließlich der ISM-Umfrage für das verarbeitende Gewerbe, die den höchsten Stand seit den 1980er Jahren erreichte. Auch die Konsumentenstimmung stieg im März schlagartig, lag jedoch deutlich unter den Werten der Trends vor dem Virus.

Im 2. Quartal notierten die US-Indizes höher als im 1. Quartal. Zurückzuführen war dies auf die Erholung von Wachstumsaktien, das starke Wachstum der Unternehmensergebnisse im 1. Quartal und die Aussichten auf weitere staatliche Konjunkturmaßnahmen, denn Joe Biden gelang eine überparteiliche Vereinbarung, durch die die Infrastrukturausgaben um 600 Mrd. US-Dollar gesteigert werden sollen.

Durch den guten Verlauf der Impfkampagne im 2. Quartal sowie einer weitgehenden Kontrolle der Covid-19-Erkrankungen begannen die Verbraucher in den USA, die verlorene Zeit aufzuholen, während die Wirtschaft sich erneut öffnete. Die größte Frage für die Märkte in der zweiten Jahreshälfte bestand darin, in welchem Ausmaß der Anstieg der Inflation „vorübergehend“ sein würde, wie es die Fed vorbeugend ausdrückte.

Im August wurde die Jackson Hole-Rede des Vorsitzenden der US-Notenbank (Fed), Jerome Powell, am Markt wohlwollend aufgenommen. Die Fed ist zufrieden mit dem bei der Inflation erzielten Fortschritt, wobei sie weiter von einer lediglich vorübergehenden Inflation ausgeht, und erwartet, dass der Arbeitsmarkt bald die Messlatte für ein Tapering erreicht. Powell betonte außerdem, dass der Zeitplan für ein Tapering von dem für Zinserhöhungen unabhängig ist.

Die US-Notenbank (die Fed) kündigte an, dass sie im November mit einer Verlangsamung ihrer Ankäufe von Vermögenswerten beginnen wird, und dass die Käufe etwa Mitte nächsten Jahres beendet sein werden. Die Fed veröffentlichte auch ihre Prognosen für die Zinssätze für die kommenden Jahren, wobei die zentrale Erwartung jetzt darin besteht, dass die US-Zinssätze bis Ende 2024 auf 1,75 % ansteigen. Das Tempo der Zinserhöhungen war schneller, als der Markt eingepreist hatte, was in den Tagen nach der Fed-Sitzung im September zu einem Anstieg der Renditen von Staatsanleihen führte und den Renditerückgang vom Anfang des Quartals umkehrte.

Im November sprang der US-Verbraucherpreisindex (CPI) auf 6,8 % im Vergleich zum Vorjahr, dem höchsten Ergebnis in 39 Jahren, und die Arbeitslosenquote fiel auf 4,2 %. Dieser hartnäckige Inflationsdruck und der sich rasch verengende Arbeitsmarkt veranlassten die US-Notenbank zu einer restriktiveren Haltung. Während das Federal Open Market Committee (FOMC) sich dafür aussprach, den derzeitigen Zielsatz für die Bundesmittel bei 0,00 % - 0,25 % zu belassen, verkündete es Pläne, das Tapering der Anleihenankäufe von 15 Milliarden Dollar auf 30 Milliarden Dollar monatlich ab Januar zu beschleunigen. Das deutet darauf hin, dass das FOMC das Tapering bis März 2022 abschließen wird, was den Weg für weitere Zinserhöhungen im kommenden Jahr freimacht, wobei das Median der Mitglieder nun drei Erhöhungen für 2022 prognostiziert.

In politischer Hinsicht wurde Jay Powell für weitere vier Jahre als Vorsitzender der US-Notenbank bestätigt. Mehrere Mitglieder der Fed haben sich dafür ausgesprochen, die Geschwindigkeit des Tapering zu erhöhen, aber die Unsicherheiten rund um Omicron könnten dies nun kurzfristig weniger wahrscheinlich werden lassen.

Das ambitionierte Ausgabengesetz Build Back Better (1,7 Billionen Dollar) erhielt im vergangenen Dezember im Senat keine Mehrheit. Die grundlegenden Daten des privaten Sektors erscheinen jedoch solide genug, um den USA im kommenden Jahr ein Wachstum zu bescheren. Die starke Performance von Finanzanlagen und Immobilien hat das Verhältnis von Verbindlichkeiten zu Vermögenswerten der privaten Haushalte in den USA auf den niedrigsten Stand seit 1973 gedrückt. Dies wird gemeinsam mit den weiterhin erhöhten Spareinlagen den Verbrauchern erhebliche Schlagkraft verleihen.

Der Verwaltungsrat

Luxemburg, 29. März 2022



Prüfungsbericht

An die Anteilhaber des
Cleome Index

Unser Testat

Nach unserer Auffassung vermittelt der beigefügte Jahresabschluss ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild der Vermögens- und Finanzlage von Cleome Index und jedem seiner Teilfonds (der „Fonds“) zum 31. Dezember 2021 sowie seines Betriebsergebnisses und der Veränderungen des Nettovermögens für das an diesem Datum abgelaufene Geschäftsjahr in Übereinstimmung mit den in Luxemburg geltenden gesetzlichen und aufsichtsrechtlichen Bestimmungen hinsichtlich der Erstellung und Darstellung von Jahresabschlüssen.

Was wir geprüft haben

Der Jahresabschluss des Fonds umfasst:

- die Aufstellung des Nettovermögens zum 31. Dezember 2021;
- die Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2021;
- die Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das an diesem Datum abgeschlossene Geschäftsjahr; und
- die Erläuterungen zum Jahresabschluss, die einen Überblick über die wichtigsten Rechnungslegungsgrundsätze enthalten.

Grundlage für unser Testat

Wir führten unsere Prüfung gemäß dem Gesetz vom 23. Juli 2016 über den Beruf des Wirtschaftsprüfers (Gesetz vom 23. Juli 2016) und den international anerkannten Prüfungsgrundsätzen (International Standards on Auditing, ISAs) durch, die für Luxemburg von der „Commission de Surveillance du Secteur Financier“ (CSSF) übernommen wurden. Unsere Verantwortlichkeiten gemäß dem Gesetz vom 23. Juli 2016 und den für Luxemburg von der CSSF übernommenen ISAs sind im Abschnitt „Verantwortlichkeiten des ‚Réviseur d’Entreprises agréé‘ für die Prüfung des Jahresabschlusses“ unseres Berichts genauer beschrieben.

Wir betrachten die von uns ermittelte Prüfungsnachweise als hinreichende und angemessene Grundlage für die Erteilung unseres Testats.

Wir sind entsprechend dem Internationalen Verhaltenskodex für Berufsangehörige des International Ethics Standards Board for Accountants, einschließlich der von ihm herausgegebenen internationalen Standards zur Unabhängigkeit (International Independence Standards), (IESBA-Kodex), wie er für Luxemburg von der CSSF übernommen wurde, und den berufsethischen Anforderungen, die für unsere Prüfung des Jahresabschlusses relevant sind, vom Fonds unabhängig. Wir haben unsere sonstigen berufsständischen Verantwortlichkeiten gemäß diesen ethischen Anforderungen erfüllt.

*PricewaterhouseCoopers, Société coopérative, 2 rue Gerhard Mercator, B.P. 1443, L-1014 Luxembourg
T: +352 494848 1, F: +352 494848 2900, www.pwc.lu*

*Cabinet de révision agréé. Expert-comptable (autorisation gouvernementale n°10028256)
R.C.S. Luxembourg B 65 477 - TVA LU25482518*

Zusätzliche Informationen

Der Verwaltungsrat der SICAV ist für die sonstigen Informationen verantwortlich. Die sonstigen Informationen beinhalten die Informationen, welche im Jahresbericht enthalten sind, jedoch nicht den Jahresabschluss und unseren Prüfungsvermerk zu diesem Jahresabschluss.

Unser Prüfungsurteil zum Jahresabschluss umfasst nicht die sonstigen Informationen und wir haben keine dahingehende Beurteilung vorgenommen.

Unsere Verantwortung im Rahmen unserer Prüfung des Jahresabschlusses besteht darin, die oben genannten sonstigen Informationen kritisch zu lesen und etwaige wesentliche Unstimmigkeiten zwischen den sonstigen Informationen und dem Jahresabschluss oder unseren bei der Prüfung gewonnenen Erkenntnissen oder wesentliche falsche Angaben zu berücksichtigen. Wenn wir aufgrund unserer Tätigkeit feststellen, dass die sonstigen Informationen wesentliche falsche Angaben enthalten, sind wir verpflichtet, diesen Sachverhalt zu berichten. Im Hinblick darauf haben wir nichts zu berichten.

Verantwortlichkeit des Verwaltungsrates die Fonds für den Jahresabschlusses

Der Verwaltungsrat der SICAV ist verantwortlich für die Erstellung und angemessene Darstellung dieses Jahresabschlusses in Übereinstimmung mit den in Luxemburg geltenden gesetzlichen und aufsichtsrechtlichen Bestimmungen hinsichtlich der Erstellung und Darstellung von Jahresabschlüssen sowie für interne Kontrollen, die der Verwaltungsrat des Fonds als notwendig erachtet für die Erstellung von Abschlüssen, die frei sind von wesentlichen unzutreffenden Angaben, unabhängig davon, ob diese auf Betrug oder Irrtum zurückzuführen sind.

Bei der Erstellung des Jahresabschlusses hat der Verwaltungsrat des Fonds die Fähigkeit des Fonds und jedes seiner Teilfonds zur Fortführung des Geschäftsbetriebs zu beurteilen, gegebenenfalls Sachverhalte im Zusammenhang mit der Unternehmensfortführung offenzulegen und von der Annahme der Unternehmensfortführung als Grundlage der Rechnungslegung auszugehen, sofern der Verwaltungsrat des Fonds nicht die Liquidation des Fonds, die Schließung eines Teilfonds oder die Einstellung des Geschäftsbetriebs beabsichtigt oder keine realistische Alternative hierzu hat.

Verantwortlichkeiten des „Réviseur d’Entreprises agréé“ für die Prüfung des Jahresabschlusses

Ziel unserer Prüfung ist es, mit hinreichender Sicherheit festzustellen, ob der Jahresabschluss insgesamt frei von wesentlichen unzutreffenden Angaben ist, unabhängig davon, ob diese auf Irrtum oder Betrug zurückzuführen sind, und einen Prüfungsbericht zu erstellen, der unser Testat enthält. Hinreichende Sicherheit ist ein hohes Maß an Sicherheit, aber keine Garantie, dass ggf. vorliegende wesentliche unzutreffende Angaben in einer gemäß dem Gesetz vom 23. Juli 2016 und den für Luxemburg von der CSSF übernommenen ISAs durchgeführten Prüfung immer erkannt werden. Unzutreffende Angaben können auf Betrug oder Irrtum zurückzuführen sein und gelten als wesentlich, wenn von ihnen einzeln oder zusammen bei angemessener Betrachtung eine Beeinflussung der wirtschaftlichen Entscheidungen erwartet werden könnte, die Adressaten dieses Jahresabschlusses auf dessen Basis treffen.

Als Teil einer Prüfung gemäß dem Gesetz vom 23. Juli 2016 und den für Luxemburg von der CSSF übernommenen ISAs üben wir pflichtgemäßes Ermessen aus und behalten während der gesamten Prüfung eine kritische Grundhaltung bei.



Des Weiteren:

- ermitteln und beurteilen wir die Risiken von wesentlichen unzutreffenden Angaben im Jahresabschluss aufgrund von Betrug oder Irrtum, konzipieren und wenden wir Prüfungsverfahren an, die diesen Risiken angemessen sind, und erlangen Prüfungsnachweise, die ausreichend und geeignet sind, um als Grundlage für unser Testat zu dienen. Das Risiko, eine auf Betrug zurückzuführende wesentliche unzutreffende Angabe nicht festzustellen, ist höher als bei einer auf Irrtum zurückgehenden wesentlichen unzutreffenden Angabe, da bei Betrug geheime Absprachen, Fälschungen, vorsätzliche Auslassungen, falsche Angaben oder die Außerkraftsetzung des internen Kontrollsystems im Spiel sein können;
- erlangen wir ein Verständnis des internen Kontrollsystems, das für die Prüfung relevant ist, um Prüfungsverfahren zu konzipieren, die unter den gegebenen Umständen angemessen sind, jedoch nicht zu dem Zweck, eine Meinung zur Wirksamkeit des internen Kontrollsystems des Fonds zu äußern;
- beurteilen wir die Angemessenheit der vom Verwaltungsrat des Fonds angewendeten Rechnungslegungsgrundsätze und vorgenommenen Schätzungen sowie zugehöriger Angaben;
- beurteilen wir die Angemessenheit der vom Verwaltungsrat des Fonds herangezogenen Annahme der Unternehmensfortführung als Grundlage der Rechnungslegung und beantworten die Frage, ob angesichts der erlangten Prüfungsnachweise eine erhebliche Unsicherheit im Zusammenhang mit Ereignissen oder Umständen besteht, die erheblichen Zweifel an der Fähigkeit des Fonds oder eines seiner Teilfonds zur Fortführung des Geschäftsbetriebs aufkommen lassen könnten. Wenn wir zu dem Schluss kommen, dass eine erhebliche Unsicherheit besteht, sind wir verpflichtet, in unserem Prüfungsbericht auf die betreffenden Angaben im Jahresabschluss aufmerksam zu machen oder, falls diese Angaben unangemessen sind, unser Testat zu ändern. Unsere Schlussfolgerungen beruhen auf den Prüfungsnachweisen, die wir bis zum Datum unseres Prüfungsberichts erlangt haben. Allerdings können zukünftige Ereignisse oder Umstände dazu führen, dass der Fonds oder einer seiner Teilfonds seine Geschäftstätigkeit nicht fortführt;
- beurteilen wir die Gesamtdarstellung, die Struktur und den Inhalt des Jahresabschlusses, einschließlich der darin enthaltenen Angaben, und ob der Jahresabschluss die zugrunde liegenden Vorgänge und Ereignisse in einer den tatsächlichen Verhältnissen entsprechenden Weise darstellt.

Wir teilen den für die Unternehmensführung zuständigen Personen unter anderem den geplanten Umfang und Zeitpunkt der Prüfung und wesentliche Prüfungsergebnisse mit, darunter auch etwaige wesentliche Unzulänglichkeiten im internen Kontrollsystem, die wir während unserer Prüfung feststellen.

PricewaterhouseCoopers, Société coopérative
Vertreten durch

Luxemburg, 1. April 2022

Sébastien Sadzot

Nur die englische Fassung des vorliegenden Jahresabschlusses wurde vom Wirtschaftsprüfer geprüft. Folglich bezieht sich das Prüfungstestat ausschließlich auf die englische Fassung des Abschlusses; bei den anderen Fassungen handelt es sich um gewissenhafte Übersetzungen, die vom Verwaltungsrat in Auftrag gegeben wurden. Im Falle von Abweichungen zwischen der englischen Fassung und der Übersetzung ist allein der englische Text maßgeblich.

Cleome Index

Nettovermögensaufstellung zum 31. Dezember 2021

		Cleome Index EMU Equities	Cleome Index Euro Corporate Bonds	Cleome Index Euro Government Bonds
		EUR	EUR	EUR
Aktiva				
Anlageportfolio zum Marktwert	2a	225,730,708	235,225,953	165,645,480
Guthaben bei Banken und Brokern	10	295,883	2,219,346	838,647
Forderungen aus Zeichnungen		5,872	61,861	1,274
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		3,057	1,886,849	1,476,692
Nicht realisierter Nettowertzuwachs bei Futures	2e	0	124,370	0
Sonstige Vermögenswerte		836,477	0	0
Aktiva insgesamt		226,871,997	239,518,379	167,962,093
Passiva				
Verbindlichkeiten aus Anteilsrücknahmen		0	13,648	0
Zu zahlende Verwaltungsgebühren	3	20,971	10,385	8,310
Verbindlichkeiten aus Vertriebsgebühren	4	0	19,676	0
Zu zahlende Betriebs- und Verwaltungskosten	5	18,903	14,794	9,258
Passiva insgesamt		39,874	58,503	17,568
Nettovermögen insgesamt		226,832,123	239,459,876	167,944,525

Cleome Index

Nettovermögensaufstellung zum 31. Dezember 2021

		Cleome Index Euro Long Term Bonds	Cleome Index Euro Short Term Bonds	Cleome Index Europe Equities
		EUR	EUR	EUR
Aktiva				
Anlageportfolio zum Marktwert	2a	13,811,355	103,424,247	903,750,433
Guthaben bei Banken und Brokern	10	161,421	1,190,902	201,272
Forderungen aus Zeichnungen		0	0	92,206
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		163,530	1,168,043	513,878
Nicht realisierter Nettowertzuwachs bei Futures	2e	0	0	0
Sonstige Vermögenswerte		0	0	1,203,733
Aktiva insgesamt		14,136,306	105,783,192	905,761,522
Passiva				
Verbindlichkeiten aus Anteilsrücknahmen		2,478	1,168	55,316
Zu zahlende Verwaltungsgebühren	3	3,703	8,610	62,796
Verbindlichkeiten aus Vertriebsgebühren	4	30,773	7,040	70,083
Zu zahlende Betriebs- und Verwaltungskosten	5	1,408	5,096	78,363
Passiva insgesamt		38,362	21,914	266,558
Nettovermögen insgesamt		14,097,944	105,761,278	905,494,964

Cleome Index

Nettovermögensaufstellung zum 31. Dezember 2021

		Cleome Index USA Equities	Cleome Index World Equities (siehe Anhangangabe 1)	Kombiniert
		EUR	EUR	EUR
Aktiva				
Anlageportfolio zum Marktwert	2a	1,530,819,424	169,429,790	3,347,837,390
Guthaben bei Banken und Brokern	10	531,096	108,458	5,547,025
Forderungen aus Zeichnungen		474,388	15,534	651,135
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		651,370	99,974	5,963,393
Nicht realisierter Nettowertzuwachs bei Futures	2e	0	0	124,370
Sonstige Vermögenswerte		20,841	148,481	2,209,532
Aktiva insgesamt		1,532,497,119	169,802,237	3,362,332,845
Passiva				
Verbindlichkeiten aus Anteilsrücknahmen		174,614	0	247,224
Zu zahlende Verwaltungsgebühren	3	71,799	15,071	201,645
Verbindlichkeiten aus Vertriebsgebühren	4	55,468	0	183,040
Zu zahlende Betriebs- und Verwaltungskosten	5	129,349	14,309	271,480
Passiva insgesamt		431,230	29,380	903,389
Nettovermögen insgesamt		1,532,065,889	169,772,857	3,361,429,456

Cleome Index

Aufstellung der Veränderung des Nettovermögens für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

		Cleome Index EMU Equities	Cleome Index Euro Corporate Bonds	Cleome Index Euro Government Bonds
		EUR	EUR	EUR
Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres		210,426,900	220,873,302	188,413,552
Erträge				
Dividenden, netto		4,780,778	315	0
Zinsen auf Anleihen und Geldmarktinstrumente, netto		0	3,293,924	3,164,194
Zinsen aus Wertpapierleihgeschäften	7	29,660	4,910	29,512
Bankzinsen		6,803	218	169
Sonstige Erträge		71	960	0
Erträge insgesamt		4,817,312	3,300,327	3,193,875
Aufwendungen				
Verwaltungsgebühren	3	248,374	124,040	107,746
Betriebs- und Verwaltungskosten	5	213,851	155,991	115,559
Vertriebsgebühren	4	0	84,169	0
Depotbankgebühren	5	9,828	10,184	8,151
Transaktionskosten	2g	42,529	1,105	467
Bankzinsen		2,779	7,040	7,019
Sonstige Aufwendungen		186	241	1,950
Aufwendungen insgesamt		517,547	382,770	240,892
Nettoertrag / (-verlust) aus Kapitalanlagen		4,299,765	2,917,557	2,952,983
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus dem Verkauf von Kapitalanlagen	2b	6,439,284	(450,085)	(711,458)
Realisierter Nettogewinn / (-verlust) aus Devisentermingeschäften	2f	0	0	0
Realisierter Nettogewinn / (-verlust) aus Termingeschäften	2e	0	66,830	(68,850)
Realisierter Nettogewinn / (-verlust) aus Wechselkursen		(46,967)	3,540	0
Realisierter Nettogewinn / (-verlust)		10,692,082	2,537,842	2,172,675
Veränderung der nicht realisierten Nettowertsteigerung / -minderung der Kapitalanlagen	2a	33,959,623	(5,887,492)	(8,860,198)
Veränderung der nicht realisierten Nettowertsteigerung / -minderung bei Devisentermingeschäften	2f	0	0	0
Veränderung der nicht realisierten Nettowertsteigerung/-minderung bei Futures	2e	0	150,120	(4,690)
Nettozunahme/(-abnahme) des Nettovermögens aufgrund der Geschäftstätigkeiten		44,651,705	(3,199,530)	(6,692,213)
Entwicklung des Kapitals				
Zeichnung von Anteilen		28,012,161	56,017,583	63,200,317
Rücknahme von Anteilen		(56,173,851)	(33,874,815)	(76,795,828)
Ausgeschüttete Dividenden		(84,792)	(356,664)	(181,303)
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		226,832,123	239,459,876	167,944,525

Cleome Index

Aufstellung der Veränderung des Nettovermögens für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

		Cleome Index Euro Long Term Bonds	Cleome Index Euro Short Term Bonds	Cleome Index Europe Equities
		EUR	EUR	EUR
Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres		18,588,771	112,097,487	739,791,091
Erträge				
Dividenden, netto		0	0	20,226,504
Zinsen auf Anleihen und Geldmarktinstrumente, netto		334,767	2,288,270	0
Zinsen aus Wertpapierleihgeschäften	7	1,013	18,764	98,841
Bankzinsen		16	78	12,882
Sonstige Erträge		0	0	16,645
Erträge insgesamt		335,796	2,307,112	20,354,872
Aufwendungen				
Verwaltungsgebühren	3	47,591	107,670	749,352
Betriebs- und Verwaltungskosten	5	17,391	59,064	820,880
Vertriebsgebühren	4	133,617	30,181	276,527
Depotbankgebühren	5	698	4,964	36,169
Transaktionskosten	2g	41	359	337,489
Bankzinsen		923	5,388	15,543
Sonstige Aufwendungen		21	494	451
Aufwendungen insgesamt		200,282	208,120	2,236,411
Nettoertrag / (-verlust) aus Kapitalanlagen		135,514	2,098,992	18,118,461
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus dem Verkauf von Kapitalanlagen	2b	389,227	(2,003,062)	30,902,058
Realisierter Nettogewinn / (-verlust) aus Devisentermingeschäften	2f	0	0	(6,991)
Realisierter Nettogewinn / (-verlust) aus Termingeschäften	2e	0	(4,023)	0
Realisierter Nettogewinn / (-verlust) aus Wechselkursen		0	0	44,013
Realisierter Nettogewinn / (-verlust)		524,741	91,907	49,057,541
Veränderung der nicht realisierten Nettowertsteigerung / -minderung der Kapitalanlagen	2a	(1,987,406)	(1,077,056)	134,504,424
Veränderung der nicht realisierten Nettowertsteigerung / -minderung bei Devisentermingeschäften	2f	0	0	488
Veränderung der nicht realisierten Nettowertsteigerung/-minderung bei Futures	2e	0	2,660	0
Nettozunahme/(-abnahme) des Nettovermögens aufgrund der Geschäftstätigkeiten		(1,462,665)	(982,489)	183,562,453
Entwicklung des Kapitals				
Zeichnung von Anteilen		50,400	5,463,626	244,658,680
Rücknahme von Anteilen		(3,078,562)	(10,817,346)	(258,755,721)
Ausgeschüttete Dividenden		0	0	(3,761,539)
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		14,097,944	105,761,278	905,494,964

Die Erläuterungen im Anhang sind fester Bestandteil des Abschlusses.

Cleome Index

Aufstellung der Veränderung des Nettovermögens für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

	Cleome Index Global Equities (siehe Anhangangabe 1)	Cleome Index USA Equities	Cleome Index World Equities (siehe Anhangangabe 1)
	EUR	EUR	EUR
Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres	7,295,062	1,236,156,022	127,182,017
Erträge			
Dividenden, netto	160,514	13,409,031	2,010,394
Zinsen auf Anleihen und Geldmarktinstrumente, netto	0	0	0
Zinsen aus Wertpapierleihgeschäften	7 447	72,316	9,012
Bankzinsen	0	323	7,867
Sonstige Erträge	182	96	38
Erträge insgesamt	161,143	13,481,766	2,027,311
Aufwendungen			
Verwaltungsgebühren	3 23,932	735,923	126,970
Betriebs- und Verwaltungskosten	5 8,609	1,355,211	135,695
Vertriebsgebühren	4 0	207,581	0
Depotbankgebühren	5 298	61,954	6,216
Transaktionskosten	2g 2,552	107,448	15,122
Bankzinsen	194	15,773	1,239
Sonstige Aufwendungen	75	688	89
Aufwendungen insgesamt	35,660	2,484,578	285,331
Nettoertrag / (-verlust) aus Kapitalanlagen	125,483	10,997,188	1,741,980
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus dem Verkauf von Kapitalanlagen	2b 3,219,759	127,084,869	4,928,151
Realisierter Nettogewinn / (-verlust) aus Devisentermingeschäften	2f (68)	165,817	7,895
Realisierter Nettogewinn / (-verlust) aus Termingeschäften	2e 0	0	0
Realisierter Nettogewinn / (-verlust) aus Wechselkursen	48,601	(6,295,351)	(374,649)
Realisierter Nettogewinn / (-verlust)	3,393,775	131,952,523	6,303,377
Veränderung der nicht realisierten Nettowertsteigerung / -minderung der Kapitalanlagen	2a (1,633,717)	304,266,287	31,333,412
Veränderung der nicht realisierten Nettowertsteigerung / -minderung bei Devisentermingeschäften	2f 0	(2,252)	(481)
Veränderung der nicht realisierten Nettowertsteigerung/-minderung bei Futures	2e 0	0	0
Nettozunahme/(-abnahme) des Nettovermögens aufgrund der Geschäftstätigkeiten	1,760,058	436,216,558	37,636,308
Entwicklung des Kapitals			
Zeichnung von Anteilen	629,669	327,183,990	25,836,112
Rücknahme von Anteilen	(9,620,746)	(466,960,014)	(20,876,021)
Ausgeschüttete Dividenden	(64,043)	(530,667)	(5,559)
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres	0	1,532,065,889	169,772,857

Cleome Index

Aufstellung der Veränderung des Nettovermögens für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

	Kombiniert
	EUR
Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres	2,860,824,204
Erträge	
Dividenden, netto	40,587,536
Zinsen auf Anleihen und Geldmarktinstrumente, netto	9,081,155
Zinsen aus Wertpapierleihgeschäften	7 264,475
Bankzinsen	28,356
Sonstige Erträge	17,992
Erträge insgesamt	49,979,514
Aufwendungen	
Verwaltungsgebühren	3 2,271,598
Betriebs- und Verwaltungskosten	5 2,882,251
Vertriebsgebühren	4 732,075
Depotbankgebühren	5 138,462
Transaktionskosten	2g 507,112
Bankzinsen	55,898
Sonstige Aufwendungen	4,195
Aufwendungen insgesamt	6,591,591
Nettoertrag / (-verlust) aus Kapitalanlagen	43,387,923
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus dem Verkauf von Kapitalanlagen	2b 169,798,743
Realisierter Nettogewinn / (-verlust) aus Devisentermingeschäften	2f 166,653
Realisierter Nettogewinn / (-verlust) aus Termingeschäften	2e (6,043)
Realisierter Nettogewinn / (-verlust) aus Wechselkursen	(6,620,813)
Realisierter Nettogewinn / (-verlust)	206,726,463
Veränderung der nicht realisierten Nettowertsteigerung / -minderung der Kapitalanlagen	2a 484,617,877
Veränderung der nicht realisierten Nettowertsteigerung / -minderung bei Devisentermingeschäften	2f (2,245)
Veränderung der nicht realisierten Nettowertsteigerung/-minderung bei Futures	2e 148,090
Nettozunahme/(-abnahme) des Nettovermögens aufgrund der Geschäftstätigkeiten	691,490,185
Entwicklung des Kapitals	
Zeichnung von Anteilen	751,052,538
Rücknahme von Anteilen	(936,952,904)
Ausgeschüttete Dividenden	(4,984,567)
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres	3,361,429,456

Cleome Index

Statistiken

Cleome Index EMU Equities

Name	ISIN	Anteilsart	Währung	Anzahl der in Umlauf befindlichen Anteile	Nettoinventarwert je Anteil zum 31.12. 2021	Nettoinventarwert je Anteil zum 31.12. 2020	Nettoinventarwert je Anteil zum 31.12. 2019
Nettovermögen insgesamt			EUR		226,832,123	210,426,900	223,833,727
C	LU1292953335	Thesaurierung	EUR	1,003.00	236.03	194.28	193.07
C	LU1365257788	Ausschüttung	EUR	310.00	213.33	178.35	182.07
I	LU1292953418	Thesaurierung	EUR	34,676.00	2,476.94	2,018.81	1,986.45
R	LU1292953509	Thesaurierung	EUR	205,027.15	209.39	170.97	168.54
R	LU1718421743	Ausschüttung	EUR	30,379.02	189.22	156.92	158.86
Z	LU1292953764	Thesaurierung	EUR	36,858.00	2,494.97	2,031.06	1,996.10

Cleome Index Euro Corporate Bonds

Name	ISIN	Anteilsart	Währung	Anzahl der in Umlauf befindlichen Anteile	Nettoinventarwert je Anteil zum 31.12. 2021	Nettoinventarwert je Anteil zum 31.12. 2020	Nettoinventarwert je Anteil zum 31.12. 2019
Nettovermögen insgesamt			EUR		239,459,876	220,873,302	56,861,468
C	LU1542321093	Thesaurierung	EUR	5,869.47	162.77	165.16	159.95
C	LU1542321176	Ausschüttung	EUR	681.78	117.58	-	-
I	LU1542321259	Thesaurierung	EUR	113,685.14	159.37	161.66	157.11
R2	LU1542321416	Thesaurierung	EUR	18,591.92	150.18	152.38	-
R2	LU1622416649	Ausschüttung	EUR	332,150.15	154.23	157.61	155.66
Y	LU1542321689	Thesaurierung	EUR	204,305.54	44.04	45.14	44.32
Z	LU1542321762	Thesaurierung	EUR	960,729.68	163.72	165.82	160.91

Cleome Index Euro Government Bonds

Name	ISIN	Anteilsart	Währung	Anzahl der in Umlauf befindlichen Anteile	Nettoinventarwert je Anteil zum 31.12. 2021	Nettoinventarwert je Anteil zum 31.12. 2020	Nettoinventarwert je Anteil zum 31.12. 2019
Nettovermögen insgesamt			EUR		167,944,525	188,413,552	77,124,244
C	LU1542321929	Thesaurierung	EUR	9.43	167.65	173.73	165.12
I	LU1542322224	Thesaurierung	EUR	29,737.25	1,654.73	1,716.89	1,634.81
R2	LU1542322653	Thesaurierung	EUR	17,288.97	163.56	169.79	161.75
R2	LU1622416722	Ausschüttung	EUR	123,159.36	159.17	166.16	159.89
S	LU1933089531	Thesaurierung	EUR	18,985.32	1,480.19	1,534.73	-
Z	LU1542322810	Thesaurierung	EUR	40,962.07	1,665.04	1,725.52	1,641.01

Cleome Index Euro Long Term Bonds

Name	ISIN	Anteilsart	Währung	Anzahl der in Umlauf befindlichen Anteile	Nettoinventarwert je Anteil zum 31.12. 2021	Nettoinventarwert je Anteil zum 31.12. 2020	Nettoinventarwert je Anteil zum 31.12. 2019
Nettovermögen insgesamt			EUR		14,097,944	18,588,771	19,330,326
C	LU1542323032	Thesaurierung	EUR	1.00	187.27	201.77	181.46
I	LU1542323206	Thesaurierung	EUR	3.00	2,074.94	2,238.92	2,014.90
Y	LU1542323891	Thesaurierung	EUR	189,519.39	74.33	81.08	73.74
Z	LU1542324196	Thesaurierung	EUR	2.00	2,104.90	2,268.98	2,039.87

Cleome Index Euro Short Term Bonds

Name	ISIN	Anteilsart	Währung	Anzahl der in Umlauf befindlichen Anteile	Nettoinventarwert je Anteil zum 31.12. 2021	Nettoinventarwert je Anteil zum 31.12. 2020	Nettoinventarwert je Anteil zum 31.12. 2019
Nettovermögen insgesamt			EUR		105,761,278	112,097,487	92,878,736
C	LU1542324352	Thesaurierung	EUR	1.00	150.92	151.95	151.74
I	LU1542324519	Thesaurierung	EUR	14,397.55	1,102.41	1,112.10	1,113.15
V	LU1542324865	Thesaurierung	EUR	77,092.00	1,105.51	1,114.78	1,115.37
Y	LU1542324949	Thesaurierung	EUR	143,030.24	32.58	33.14	33.45
Z	LU1542325086	Thesaurierung	EUR	2.00	1,212.92	1,221.78	1,221.20

Cleome Index

Statistiken

Cleome Index Europe Equities

Name	ISIN	Anteilsart	Währung	Anzahl der in Umlauf befindlichen Anteile	Nettoinventarwert je Anteil zum 31.12. 2021	Nettoinventarwert je Anteil zum 31.12. 2020	Nettoinventarwert je Anteil zum 31.12. 2019
Nettovermögen insgesamt			EUR		905,494,964	739,791,091	834,415,447
C	LU0461106337	Thesaurierung	EUR	89,178.40	243.50	195.88	201.97
I	LU0461106683	Thesaurierung	EUR	30,593.54	2,560.18	2,039.31	2,082.05
R	LU1006087669	Thesaurierung	EUR	545,619.82	169.44	135.21	138.29
R	LU1718421826	Ausschüttung	EUR	10,579.64	191.76	155.99	165.01
V2	LU0438017591	Thesaurierung	EUR	54,694.78	2,577.97	2,052.04	2,093.59
Y	LU0102768701	Thesaurierung	EUR	501,383.57	54.19	43.70	45.18
Z	LU0479710047	Thesaurierung	EUR	148,172.00	2,318.98	1,844.97	1,881.40
Z	LU1379319319	Ausschüttung	EUR	90,717.00	2,195.82	1,780.78	1,879.41

Cleome Index Global Equities (siehe Anhangangabe 1)

Name	ISIN	Anteilsart	Währung	Anzahl der in Umlauf befindlichen Anteile	Nettoinventarwert je Anteil zum 31.12. 2021	Nettoinventarwert je Anteil zum 31.12. 2020	Nettoinventarwert je Anteil zum 31.12. 2019
Nettovermögen insgesamt			EUR		-	7,295,062	65,636,197
C	LU0547832997	Ausschüttung	EUR	-	-	154.87	158.70
I	LU0644254632	Thesaurierung	EUR	-	-	1,975.90	1,949.38
R	LU1718421586	Thesaurierung	EUR	-	-	176.61	174.60
R	LU1718421669	Ausschüttung	EUR	-	-	167.90	170.53
Z	LU0644254475	Thesaurierung	EUR	-	-	2,208.85	2,176.64

Cleome Index USA Equities

Name	ISIN	Anteilsart	Währung	Anzahl der in Umlauf befindlichen Anteile	Nettoinventarwert je Anteil zum 31.12. 2021	Nettoinventarwert je Anteil zum 31.12. 2020	Nettoinventarwert je Anteil zum 31.12. 2019
Nettovermögen insgesamt			EUR		1,532,065,889	1,236,156,022	1,508,966,806
C	LU0461105529	Thesaurierung	EUR	3,594.76	541.82	401.23	365.37
C - USD - Unhedged	LU1006087313	Thesaurierung	USD	5,800.35	375.75	299.38	250.10
C - USD - Unhedged	LU1365257515	Ausschüttung	USD	293.00	332.27	267.79	226.48
I	LU2197357747	Thesaurierung	EUR	1.00	1,812.73	1,561.87	-
I - USD - Unhedged	LU0461105875	Thesaurierung	USD	38,756.89	4,406.36	3,476.35	2,875.55
R	LU1006087586	Thesaurierung	EUR	592,663.15	278.05	204.25	184.50
R	LU1718422394	Ausschüttung	EUR	1,130.00	293.82	218.38	199.56
R - USD - Unhedged	LU1718422477	Thesaurierung	USD	47,874.64	289.83	229.07	189.83
R - USD - Unhedged	LU1718422550	Ausschüttung	USD	15,706.89	265.00	211.85	177.69
V	LU2197358042	Thesaurierung	EUR	18,708.47	1,838.98	1,515.35	-
V - USD - Unhedged	LU0438016601	Thesaurierung	USD	3,396.85	2,628.89	2,073.20	1,713.83
Y	LU0102768370	Thesaurierung	EUR	252,088.23	86.05	63.88	58.33
Z	LU0479709973	Thesaurierung	EUR	21,872.51	6,042.81	4,425.64	3,985.56
Z	LU1379320085	Ausschüttung	EUR	14,814.00	2,854.17	2,114.94	1,926.89
Z - USD - Unhedged	LU0644256330	Thesaurierung	USD	288,738.07	3,775.29	2,974.90	2,457.81

Cleome Index World Equities (siehe Anhangangabe 1)

Name	ISIN	Anteilsart	Währung	Anzahl der in Umlauf befindlichen Anteile	Nettoinventarwert je Anteil zum 31.12. 2021	Nettoinventarwert je Anteil zum 31.12. 2020	Nettoinventarwert je Anteil zum 31.12. 2019
Nettovermögen insgesamt			EUR		169,772,857	127,182,017	121,928,226
C	LU1365257945	Ausschüttung	EUR	6,266.00	277.05	217.14	209.49
I	LU1292954903	Thesaurierung	EUR	30,191.28	3,207.61	2,452.18	2,298.14
R	LU1292955033	Thesaurierung	EUR	67,674.64	218.43	167.29	-
R	LU1718422634	Ausschüttung	EUR	5,031.33	208.95	-	-
Z	LU1292955207	Thesaurierung	EUR	17,132.87	3,231.31	2,467.34	2,309.57

Cleome Index

Cleome Index EMU Equities

Anlageportfolio zum 31. Dezember 2021

Bezeichnung	Anzahl	Währung	Marktwert (in EUR)	% des NV
Übertragbare Wertpapiere, die zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden				
Aktien				
Österreich				
ERSTE GROUP BANK AG	11,250	EUR	465,188	0.21
OMV AG	7,972	EUR	398,201	0.18
VERBUND AG	4,490	EUR	444,061	0.20
VOESTALPINE AG	6,823	EUR	218,336	0.10
			1,525,786	0.67
Belgien				
AGEAS NOM	7,978	EUR	363,398	0.16
ANHEUSER-BUSCH INBEV	34,837	EUR	1,852,283	0.82
ELIA SYSTEM OPERATOR SA	1,316	EUR	152,261	0.07
GROUPE BRUXELLES LAMBERT GBL	4,309	EUR	422,971	0.19
KBC GROUPE SA	11,790	EUR	889,673	0.39
PROXIMUS SA	8,079	EUR	138,474	0.06
SOLVAY	3,219	EUR	328,982	0.15
UCB	7,266	EUR	729,143	0.32
UMICORE SA	10,331	EUR	369,333	0.16
			5,246,518	2.31
Finnland				
ELISA CORPORATION -A-	5,117	EUR	276,932	0.12
FORTUM CORP	20,044	EUR	540,988	0.24
KESKO CORP	11,981	EUR	351,523	0.15
KONE -B-	15,796	EUR	995,780	0.44
NESTE	19,141	EUR	829,954	0.37
NOKIA OYJ	249,474	EUR	1,390,568	0.61
ORION CORPORATION (NEW) -B-	7,239	EUR	264,368	0.12
SAMPO OYJ -A-	20,680	EUR	911,161	0.40
STORA ENSO -R-	30,263	EUR	488,445	0.22
UPM KYMMENE CORP	25,257	EUR	845,099	0.37
WARTSILA CORPORATION -B-	25,115	EUR	310,421	0.14
			7,205,239	3.18
Frankreich				
ACCOR SA	11,838	EUR	336,791	0.15
AEROPORTS DE PARIS-ADP-	1,860	EUR	210,738	0.09
AIR LIQUIDE SA	21,325	EUR	3,269,549	1.44
ALSTOM SA	15,662	EUR	488,968	0.22
AMUNDI SA	3,669	EUR	266,186	0.12
ARKEMA SA	3,068	EUR	379,972	0.17
AXA SA	94,528	EUR	2,475,216	1.09
BIOMERIEUX SA	1,934	EUR	241,557	0.11
BNP PARIBAS SA	53,403	EUR	3,245,300	1.43
BOUYGUES SA	12,941	EUR	407,512	0.18
BUREAU VERITAS SA	12,492	EUR	364,517	0.16
CAPGEMINI SE	7,491	EUR	1,614,310	0.71
CARREFOUR SA	29,481	EUR	474,792	0.21
CIE DE SAINT-GOBAIN	26,708	EUR	1,652,424	0.73
CNP ASSURANCES	9,450	EUR	205,538	0.09
COVIVIO SA	3,601	EUR	259,992	0.11
CREDIT AGRICOLE SA	57,875	EUR	726,331	0.32
DANONE SA	29,602	EUR	1,615,973	0.71
DASSAULT AVIA. --- SHS	3,920	EUR	372,400	0.16
DASSAULT SYST.	29,307	EUR	1,533,049	0.68
EDENRED SA	11,715	EUR	475,278	0.21
EDF SA	28,173	EUR	291,027	0.13
EIFFAGE	6,143	EUR	555,696	0.24
ENGIE SA	91,112	EUR	1,185,732	0.52
ESSILORLUXOTTICA SA	12,984	EUR	2,431,124	1.07

Die Erläuterungen im Anhang sind fester Bestandteil des Abschlusses.

Etwasige Abweichungen bei den Prozentsätzen des Nettovermögens sind auf Rundungen zurückzuführen.

Cleome Index

Cleome Index EMU Equities

Anlageportfolio zum 31. Dezember 2021

Bezeichnung	Anzahl	Währung	Marktwert (in EUR)	% des NV
EURAZEO	1,773	EUR	136,166	0.06
FAURECIA	6,353	EUR	265,746	0.12
GECINA	1,792	EUR	220,237	0.10
GETLINK ACT	21,336	EUR	310,652	0.14
HERMES INTERNATIONAL SA	1,465	EUR	2,250,240	0.99
IPSEN	2,252	EUR	181,286	0.08
KERING	3,455	EUR	2,442,340	1.08
KLEPIERRE SA	12,737	EUR	265,566	0.12
LEGRAND SA	16,468	EUR	1,694,557	0.75
L'OREAL SA	11,460	EUR	4,778,247	2.11
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	12,651	EUR	9,197,277	4.05
MICHELIN SA REG SHS	7,445	EUR	1,073,197	0.47
ORANGE	89,055	EUR	838,275	0.37
ORPEA SA	3,188	EUR	280,863	0.12
PERNOD RICARD SA	9,546	EUR	2,018,979	0.89
PUBLICIS GROUPE	10,949	EUR	648,181	0.29
REMY COINTREAU	776	EUR	166,064	0.07
RENAULT SA	14,050	EUR	429,157	0.19
SANOFI	54,335	EUR	4,812,994	2.12
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,507	EUR	726,977	0.32
SCHNEIDER ELECTRIC SE	27,674	EUR	4,772,658	2.10
SEB SA	741	EUR	101,443	0.04
SOCIETE GENERALE SA	41,819	EUR	1,263,143	0.56
SODEXO SA	4,962	EUR	382,372	0.17
SUEZ ACT.	13,238	EUR	262,245	0.12
TELEPERFORMANCE SE	2,709	EUR	1,061,928	0.47
TOTALENERGIESSE	116,744	EUR	5,210,285	2.30
UBISOFT ENTERTAINMENT	5,223	EUR	224,955	0.10
UNIBAIL RODAMCO	6,783	EUR	417,968	0.18
VALEO SA	12,985	EUR	345,141	0.15
VEOLIA ENVIRONNEMENT SA	27,011	EUR	871,375	0.38
VINCI SA	27,543	EUR	2,559,020	1.13
VIVENDI SA	33,366	EUR	396,722	0.17
WENDEL SA	959	EUR	101,079	0.04
WORLDLINE SA	10,974	EUR	537,836	0.24
			76,325,143	33.65
Deutschland				
ADIDAS AG NAMEN AKT	8,704	EUR	2,203,853	0.97
ALLIANZ SE REG SHS	19,430	EUR	4,034,640	1.78
BASF SE REG SHS	44,123	EUR	2,725,919	1.20
BECHTLE	4,065	EUR	255,851	0.11
BEIERSDORF AG	4,472	EUR	404,179	0.18
BMW AG	18,771	EUR	1,661,046	0.73
BRENNTAG - NAMEN AKT	10,406	EUR	828,109	0.37
CARL ZEISS MEDITEC AG	1,823	EUR	336,982	0.15
COMMERZBK	48,588	EUR	325,005	0.14
CONTINENTAL AG	5,925	EUR	551,677	0.24
COVESTRO AG	9,296	EUR	503,843	0.22
DAIMLER AG NAMEN-AKT	40,009	EUR	2,704,208	1.19
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	20,004	EUR	645,929	0.28
DELIVERY HERO	7,517	EUR	736,666	0.32
DEUTSCHE BANK AG NAMEN-AKT	101,294	EUR	1,116,057	0.49
DEUTSCHE BOERSE AG REG SHS	9,311	EUR	1,369,648	0.60
DEUTSCHE LUFTHANSA AG REG SHS	19,192	EUR	118,607	0.05
DEUTSCHE POST AG REG SHS	46,629	EUR	2,636,404	1.16
DEUTSCHE TELEKOM AG REG SHS	156,720	EUR	2,554,536	1.13
E.ON SE	115,644	EUR	1,409,932	0.62
EVONIK INDUSTRIES	10,305	EUR	293,383	0.13

Die Erläuterungen im Anhang sind fester Bestandteil des Abschlusses.

Etwasige Abweichungen bei den Prozentsätzen des Nettovermögens sind auf Rundungen zurückzuführen.

Cleome Index

Cleome Index EMU Equities

Anlageportfolio zum 31. Dezember 2021

Bezeichnung	Anzahl	Währung	Marktwert (in EUR)	% des NV
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	10,521	EUR	601,170	0.27
FRESENIUS SE	20,456	EUR	724,142	0.32
GEA GROUP AG	6,863	EUR	330,042	0.15
HANNOVER RUECK SE	3,285	EUR	549,088	0.24
HELLOFRESH SE	7,923	EUR	535,119	0.24
HENKEL AG & CO KGAA	4,168	EUR	286,342	0.13
HENKEL AG & CO KGAA	9,142	EUR	650,362	0.29
INFINEON TECHNOLOGIES REG SHS	60,273	EUR	2,456,727	1.08
KION GROUP AG	4,799	EUR	463,008	0.20
KNORR-BREMSE - BEARER SHS	3,717	EUR	323,007	0.14
LANXESS AG	5,920	EUR	322,640	0.14
LEG IMMOBILIEN - NAMEN AKT	2,864	EUR	351,413	0.15
MERCK KGAA	6,087	EUR	1,381,749	0.61
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	3,605	EUR	646,737	0.29
MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS AG REG SHS	7,033	EUR	1,832,096	0.81
NEMETSCHKE	2,771	EUR	312,569	0.14
PUMA AG	4,574	EUR	491,705	0.22
RATIONAL NAMEN	285	EUR	256,614	0.11
SAP AG	47,559	EUR	5,940,119	2.62
SARTORIUS VORZ.OHNE STIMMRECHT.	1,218	EUR	724,954	0.32
SCOUT24	3,906	EUR	239,907	0.11
SIEMENS AG REG	37,159	EUR	5,673,436	2.50
SIEMENS ENERGY - REGISTERED SHS	23,826	EUR	535,847	0.24
SIEMENS HEALTHINEERS	13,183	EUR	867,705	0.38
SYMRISE AG	6,100	EUR	794,830	0.35
UNITED INTERNET AG REG SHS	5,683	EUR	198,564	0.09
VOLKSWAGEN AG	1,140	EUR	294,576	0.13
VOLKSWAGEN AG VORZ.AKT	9,928	EUR	1,762,021	0.78
VONOVIA SE	25,999	EUR	1,260,952	0.56
ZALANDO SE	10,547	EUR	750,314	0.33
			58,974,229	26.00
Irland				
CRH PLC	34,558	EUR	1,607,638	0.71
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	9,384	EUR	1,304,376	0.58
KERRY GROUP -A-	6,805	EUR	770,666	0.34
KINGSPAN GROUP	8,373	EUR	879,165	0.39
SMURFIT KAPPA PLC	11,904	EUR	576,630	0.25
			5,138,475	2.27
Italien				
AMPLIFON SPA	5,784	EUR	274,451	0.12
ASSICURAZIONI GENERALI SPA	46,818	EUR	872,219	0.38
DIASORIN	996	EUR	166,780	0.07
ENEL SPA	377,278	EUR	2,658,301	1.17
ENI SPA	101,356	EUR	1,238,570	0.55
FINECOBANK	23,315	EUR	359,867	0.16
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE SPA	14,840	EUR	158,491	0.07
INTESA SANPAOLO	702,492	EUR	1,597,467	0.70
MEDIOBANCA	20,784	EUR	210,126	0.09
NEXI SPA	21,873	EUR	306,003	0.13
POSTE ITALIANE SPA	12,872	EUR	148,543	0.07
PRYSMIAN SPA	16,954	EUR	561,347	0.25
RECORDATI SPA	6,286	EUR	355,159	0.16
SNAM SPA	114,982	EUR	609,405	0.27
TELECOM ITALIA	472,756	EUR	205,271	0.09
TERNA SPA	77,276	EUR	549,741	0.24
UNICREDIT SPA REGS	100,584	EUR	1,362,310	0.60
			11,634,051	5.13
Luxemburg				
ARCELORMITTAL SA	11,045	EUR	310,862	0.14

Die Erläuterungen im Anhang sind fester Bestandteil des Abschlusses.

Etwasige Abweichungen bei den Prozentsätzen des Nettovermögens sind auf Rundungen zurückzuführen.

Cleome Index

Cleome Index EMU Equities

Anlageportfolio zum 31. Dezember 2021

AROUNDTOWN SA	58,743	EUR	312,513	0.14
CNH INDUSTRIAL NV	54,035	EUR	922,377	0.41
EUROFINS SCIENTIFIC SE	6,810	EUR	740,928	0.33
LA FRANCAISE DES JEUX SA	3,069	EUR	119,507	0.05
MONCLER SPA	9,106	EUR	582,966	0.26
TENARIS SA - REG.SHS	29,990	EUR	276,208	0.12
			3,265,361	1.44
Niederlande				
ABN AMRO GROUP DEP RECEIPT	20,451	EUR	264,145	0.12
ADYEN --- PARTS SOCIALES	923	EUR	2,133,514	0.94
AEGON NV	102,552	EUR	450,511	0.20
AKZO NOBEL NV	9,477	EUR	914,530	0.40
ARGENX SE	2,279	EUR	718,569	0.32
ASM INTERNATIONAL NV	2,053	EUR	798,001	0.35
ASML HOLDING NV	18,768	EUR	13,263,346	5.85
DAVIDE CAMPARI-MILANO N.V.	11,158	EUR	143,436	0.06
DSM KONINKLIJKE	8,201	EUR	1,623,798	0.72
EXOR REG	6,208	EUR	490,184	0.22
FERRARI NV	5,501	EUR	1,251,478	0.55
HEINEKEN HOLDING	6,508	EUR	528,124	0.23
HEINEKEN NV	12,514	EUR	1,237,134	0.55
ING GROUP NV	186,018	EUR	2,277,232	1.00
JUST EAT TAKEAWAY.COM N.V	10,110	EUR	490,032	0.22
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	48,916	EUR	1,474,084	0.65
KONINKLIJKE KPN NV	165,097	EUR	450,715	0.20
NN GROUP NV	10,949	EUR	521,282	0.23
PROSUS NV	42,480	EUR	3,123,554	1.38
QIAGEN REGD EUR	12,029	EUR	589,301	0.26
RANDSTAD BR	8,398	EUR	504,216	0.22
ROYAL PHILIPS NV	43,800	EUR	1,435,107	0.63
STELLANTIS N.V.-BEARER & REGISTERED SHS	97,317	EUR	1,623,742	0.72
STMICROELECTRONICS NV	31,108	EUR	1,349,154	0.59
WOLTERS KLUWER NV	11,767	EUR	1,219,061	0.54
			38,874,250	17.14
Portugal				
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA - REG.SHS	137,351	EUR	663,680	0.29
GALP ENERGIA SA REG SHS -B-	24,115	EUR	205,460	0.09
JERONIMO MARTINS SGPS SA	6,134	EUR	123,293	0.05
			992,433	0.44
Spanien				
ACS	11,550	EUR	272,234	0.12
AENA SME SA	3,818	EUR	529,938	0.23
AMADEUS IT GROUP SA -A-	20,519	EUR	1,223,753	0.54
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA	308,695	EUR	1,620,649	0.71
BANCO SANTANDER SA REG SHS	800,250	EUR	2,353,135	1.04
CAIXABANK SA	194,388	EUR	469,253	0.21
CELLNEX TELECOM SA	22,441	EUR	1,148,530	0.51
EDP RENOVAVEIS SA	19,081	EUR	417,874	0.18
ENAGAS	11,914	EUR	243,046	0.11
FERROVIAL SA	23,005	EUR	634,018	0.28
GAMESA CORPORACION TECNOLOGICA SA	14,420	EUR	303,829	0.13
GRIFOLS SA -A-	19,434	EUR	327,949	0.14
IBERDROLA SA	268,591	EUR	2,796,032	1.23
INDITEX SHARE FROM SPLIT	50,526	EUR	1,441,507	0.64
NATURGY ENERGY GROUP SA	10,314	EUR	295,290	0.13
RED ELECTRICA	21,505	EUR	409,133	0.18
REPSOL SA	57,498	EUR	600,049	0.26
TELEFONICA SA	246,796	EUR	950,658	0.42
			16,036,877	7.07
Großbritannien				
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS	10,439	EUR	512,346	0.23
			512,346	0.23

Die Erläuterungen im Anhang sind fester Bestandteil des Abschlusses.

Etwasige Abweichungen bei den Prozentsätzen des Nettovermögens sind auf Rundungen zurückzuführen.

Cleome Index

Cleome Index EMU Equities

Anlageportfolio zum 31. Dezember 2021

Aktien insgesamt	225,730,708	99.51
Gesamtsumme übertragbarer Wertpapiere, die zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	225,730,708	99.51
Anlageportfolio insgesamt	225,730,708	99.51
Anschaffungskosten	173,538,373	

Cleome Index

Cleome Index EMU Equities

Geografische und wirtschaftliche Zusammensetzung des Wertpapierbestandes zum 31. Dezember 2021

Geografische Zusammensetzung (in % des Nettovermögens)

Frankreich	33.65
Deutschland	26.00
Niederlande	17.14
Spanien	7.07
Italien	5.13
Finnland	3.18
Belgien	2.31
Irland	2.27
Luxemburg	1.44
Österreich	0.67
Portugal	0.44
Großbritannien	0.23
	99.51

Wirtschaftliche Zusammensetzung (in % des Nettovermögens)

Banken und andere Finanzinstitute	11.23
Pharmazeutika	8.83
Elektronik und Halbleiter	8.76
Textilien und Bekleidung	6.82
Internet und Internet-Dienste	6.60
Versorger	5.80
Elektrotechnik	5.68
Versicherung	5.29
Chemikalien	5.28
Kraftfahrzeuge	4.84
Kommunikation	4.04
Erdöl	3.98
Baumaterialien	3.50
Einzelhandel und Warenhäuser	2.78
Tabak und alkoholische Getränke	2.62
Maschinen- und Apparatebau	2.03
Transport	1.96
Lebensmittel und alkoholfreie Getränke	1.51
Immobilien	1.36
Grafik und Verlage	1.00
Papier und Forsterzeugnisse	0.84
Sonstige Dienstleistungen	0.81
Hotels und Restaurants	0.78
Biotechnologie	0.72
Reifen und Kautschuk	0.72
Sonstige Konsumgüter	0.46
Luft- und Raumfahrt	0.45
Kohlebergbau und Stahlindustrie & Chemie	0.36
Umweltdienste und Recycling	0.18
NE-Metalle	0.16
Gesundheitswesen	0.12
	99.51

Etwaige Abweichungen bei den Prozentsätzen des Nettovermögens sind auf Rundungen zurückzuführen.

Cleome Index

Cleome Index Euro Corporate Bonds

Anlageportfolio zum 31. Dezember 2021

Bezeichnung	Anzahl	Währung	Marktwert (in EUR)	% des NV
Übertragbare Wertpapiere, die zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden				
Anleihen				
Australien				
AUSNET SERVICES HOLDI 1.50 15-27 26/02A	300,000	EUR	316,492	0.13
BHP BILLITON FINANCE 3.25 12-27 24/09A	400,000	EUR	464,528	0.19
MACQUARIE GROUP LTD 0.35 20-28 03/12A	200,000	EUR	197,604	0.08
SCENTRE MGMT LTD 2.25 14-24 16/07A	300,000	EUR	315,435	0.13
WESTPAC BANKING 1.125 17-27 05/09A	100,000	EUR	104,866	0.04
WESTPAC BANKING 1.45 18-28 17/07A	500,000	EUR	534,945	0.22
			1,933,870	0.81
Österreich				
ERSTE GROUP BANK AG 0.05 20-25 16/09A	200,000	EUR	199,115	0.08
ERSTE GROUP BANK AG 0.875 20 27 13/05A	300,000	EUR	308,514	0.13
OMV AG 1.875 18-28 04/12A	300,000	EUR	329,901	0.14
			837,530	0.35
Belgien				
ANHEUSER BUSCH INBEV 2.70 04-26 31/03A	600,000	EUR	666,369	0.28
ANHEUSER-BUSCH INBEV 1.50 15-30 18/04A	500,000	EUR	532,620	0.22
ANHEUSER-BUSCH INBEV 1.6500 19-31 28/03A	800,000	EUR	862,492	0.36
ANHEUSER-BUSCH INBEV 2.00 16-28 17/03A	900,000	EUR	987,556	0.41
BELFIUS BANQUE SA 0.00 19-26 28/08U	500,000	EUR	493,838	0.21
BELFIUS BANQUE SA/NV 0.01 20-25 15/10A	300,000	EUR	298,401	0.12
BPOST BANK NV 1.25 18-26 11/07A	100,000	EUR	104,870	0.04
ELIA SYSTEM OP SA/NV 3.25 13-28 04/04A	100,000	EUR	118,136	0.05
ELIA SYSTEM OPERATOR 1.375 19-26 14/01A	100,000	EUR	104,792	0.04
ELIA TRANSMISSION BE 0.875 20-30 28/04A	200,000	EUR	204,307	0.09
KBC GROUPE SA 0.6250 19-25 10/04A	200,000	EUR	203,391	0.08
SOLVAY SA 0.500 19-29 06/09A	300,000	EUR	296,494	0.12
SOLVAY SA 2.75 15-27 02/12A	200,000	EUR	225,440	0.09
			5,098,706	2.13
Kanada				
CANADA 0.375 19-24 03/05A	347,000	EUR	350,238	0.15
			350,238	0.15
Kaimaninseln				
CHE HUTCHISON FINANCE 2.00 16-28 06/04A	200,000	EUR	217,338	0.09
			217,338	0.09
Dänemark				
AP MOLLER MAERSK 1.75 18-26 16/03A	200,000	EUR	211,990	0.09
DANSKE BANK A/S 0.625 20-25 12/05A	200,000	EUR	202,884	0.08
NYKREDIT REALKREDIT 0.1250 19-24 10/07A	519,000	EUR	519,688	0.22
NYKREDIT REALKREDIT 0.875 21-31 28/04A	300,000	EUR	297,362	0.12
			1,231,924	0.51
Finnland				
BALDER FINLAND OYJ 1.375 21-30 24/05A	300,000	EUR	294,123	0.12
OP CORPORATE BANK 0.625 19-29 12/11U	300,000	EUR	299,457	0.13
			593,580	0.25
Frankreich				
AEROPORTS DE PARIS 1.0 17-27 13/12A	400,000	EUR	414,256	0.17
AEROPORTS DE PARIS 1.125 19-34 18/06A	100,000	EUR	100,632	0.04
AEROPORTS DE PARIS A 1 20-29 02/07A	600,000	EUR	616,953	0.26
APRR SA 0.125 20-29 18/09A	300,000	EUR	295,557	0.12
APRR SA 1.25 20-27 14/04A	300,000	EUR	315,720	0.13
APRR SA 1.625 17-32 13/01A	100,000	EUR	110,025	0.05
ARKEMA SA 0.75 19-29 03/12A	200,000	EUR	205,284	0.09
ARKEMA SA 1.50 17-27 20/04A	500,000	EUR	531,488	0.22
AUCHAN HOLDING SA 2.625 19-24 30/01A	500,000	EUR	522,578	0.22
AUCHAN HOLDING SA 3.25 20-27 23/07A	600,000	EUR	674,724	0.28
AUTOROUTES DU SUD 1.375 18-30 22/01A	100,000	EUR	107,653	0.04

Die Erläuterungen im Anhang sind fester Bestandteil des Abschlusses.

Etwas Abweichungen bei den Prozentsätzen des Nettovermögens sind auf Rundungen zurückzuführen.

Cleome Index

Cleome Index Euro Corporate Bonds

Anlageportfolio zum 31. Dezember 2021

Bezeichnung	Anzahl	Wahrung	Marktwert (in EUR)	% des NV
AUTOROUTES DU SUD FRA 1.125 17-26 20/04A	300,000	EUR	313,242	0.13
AXA SA 1.125 16-28 15/05A	100,000	EUR	106,352	0.04
BANQUE FEDERATIVE DU 0.1 20-27 08/10A	200,000	EUR	196,743	0.08
BANQUE FEDERATIVE DU 1.25 20-30 03/06A	500,000	EUR	519,460	0.22
BFCM 0.25 21-28 19/01A	200,000	EUR	195,374	0.08
BFCM 1.75 19-29 15/03A	100,000	EUR	107,586	0.04
BFCM 1.875 19-29 18/06A	600,000	EUR	634,287	0.26
BNP PARIBAS 0.375 20-27 14/10A	200,000	EUR	198,717	0.08
BNP PARIBAS 1.00 17-24 29/11A	100,000	EUR	102,030	0.04
BNP PARIBAS 1.125 20-29 17/04A	600,000	EUR	613,287	0.26
BNP PARIBAS FL.R 19-27 23/01A	700,000	EUR	746,704	0.31
BOUYGUES 1.125 20-28 14/04A	100,000	EUR	104,554	0.04
BPCE 0.5 20-27 15/09A	200,000	EUR	199,387	0.08
BPCE 0.625 19-24 26/09A	200,000	EUR	203,430	0.08
BPCE 0.875 18-24 31/01A	200,000	EUR	203,880	0.09
BPCE 1.0 19-25 01/04A	400,000	EUR	410,856	0.17
BPCE 1.00 16-28 05/10A	500,000	EUR	518,618	0.22
BPCE 2.875 16-26 22/04A	100,000	EUR	109,815	0.05
BPCE S.A. 0.625 20-25 28/04A	400,000	EUR	406,594	0.17
CAPGEMINI SE 0.625 20-25 23/06A	200,000	EUR	203,656	0.09
CAPGEMINI SE 1.125 20-30 23/06A	100,000	EUR	103,944	0.04
CAPGEMINI SE 1.625 20-26 15/04A	100,000	EUR	105,965	0.04
CAPGEMINI SE 2.375 20-32 15/04A	200,000	EUR	229,460	0.10
CARREFOUR SA 1.7500 18-26 04/05A	200,000	EUR	211,730	0.09
CARREFOUR SA 2.625 20-27 01/04A	200,000	EUR	223,800	0.09
CIE GENERALE DES ETA 0 20-28 02/11A	300,000	EUR	293,280	0.12
CIE GENERALE DES ETA 0,25 20-32 02/11A	300,000	EUR	287,988	0.12
COFIROUTE SA 1 20-31 19/05A	300,000	EUR	313,572	0.13
COVIVIO SA 1.625 20-30 23/06A	200,000	EUR	211,589	0.09
CREDIT AGRICOLE 0.125 20-27 09/12A	300,000	EUR	293,476	0.12
CREDIT AGRICOLE 0.375 19-25 21/10A	400,000	EUR	403,312	0.17
CREDIT AGRICOLE 0.375 21-28 20/04A	200,000	EUR	197,160	0.08
CREDIT AGRICOLE 2.70 15-25 14/04Q	100,000	EUR	106,818	0.04
CREDIT AGRICOLE SA 4.1 12-24 17/04Q	150,000	EUR	163,940	0.07
CREDIT MUTUEL ARKEA 0.01 20-26 28/10A	300,000	EUR	296,714	0.12
CREDIT MUTUEL ARKEA 0.875 21-33 11/03A	100,000	EUR	99,724	0.04
CREDIT MUTUEL ARKEA 1.125 19-29 23/05A	100,000	EUR	104,356	0.04
CREDIT MUTUEL ARKEA 3.25 16-26 01/06A	100,000	EUR	111,053	0.05
CREDIT MUTUEL ARKEA 3.375 19-31 11/03A	100,000	EUR	117,974	0.05
CTE CO TRANSP ELEC 2.125 17-32 29/07A	200,000	EUR	224,295	0.09
DASSAULT SYSTEM 0.1250 19-26 16/09A	300,000	EUR	299,832	0.13
EDENRED SA 1.375 15-25 10/03A	200,000	EUR	207,458	0.09
EDENRED SA 1.875 17-27 30/03A	100,000	EUR	107,910	0.05
EDENRED SA 1.875 18-26 06/03A	300,000	EUR	319,654	0.13
EDF 1.00 16-26 13/10A	500,000	EUR	517,975	0.22
EDF 4.00 10-25 12/11A	100,000	EUR	114,838	0.05
EDF SA 2.00 18-30 02/10A	500,000	EUR	553,982	0.23
EDF SA 4.50 10-40 12/11A	300,000	EUR	447,969	0.19
ENGIE 1.00 15-26 13/03A	200,000	EUR	206,985	0.09
ENGIE SA 0.375 19-27 21/06A	300,000	EUR	301,102	0.13
ENGIE SA 0.5 19-30 24/10A	300,000	EUR	297,250	0.12
ENGIE SA 1.25 19-41 24/10A	200,000	EUR	201,201	0.08
ENGIE SA 1.375 17-29 28/02A	100,000	EUR	106,276	0.04
ENGIE SA 1.50 15-35 13/03A	100,000	EUR	106,664	0.04
ENGIE SA 1.50 20-49 31/12A	300,000	EUR	299,488	0.13
ENGIE SA 1.875 18-33 19/09A	300,000	EUR	332,415	0.14
ESSILORLUXOTTICA 0.375 19-27 27/11A	300,000	EUR	304,893	0.13
ESSILORLUXOTTICA 0.375 20-26 05/01A	400,000	EUR	405,258	0.17

Die Erlauerungen im Anhang sind fester Bestandteil des Abschlusses.

Etwache Abweichungen bei den Prozentsatzen des Nettovermogens sind auf Rundungen zururckzufuhren.

Cleome Index

Cleome Index Euro Corporate Bonds

Anlageportfolio zum 31. Dezember 2021

Bezeichnung	Anzahl	Wahrung	Marktwert (in EUR)	% des NV
ESSILORLUXOTTICA 0.75 19-31 27/11A	500,000	EUR	512,988	0.21
FONC DES REGIONS 1.875 16-26 20/05A	100,000	EUR	107,198	0.04
GECINA 1.00 16-29 30/01A	100,000	EUR	104,069	0.04
GECINA 1.625 18-30 14/03A	100,000	EUR	108,856	0.05
GECINA 1.625 19-34 29/05A	100,000	EUR	109,085	0.05
GIE PSA TRESORIE 6.00 03-33 19/09A	100,000	EUR	145,345	0.06
GROUPAMA SA 3.375 18-28 24/09A	100,000	EUR	111,835	0.05
GROUPAMA SA 6.00 17-27 23/01A	200,000	EUR	246,334	0.10
ICADE SA 0.625 21-31 18/01A	200,000	EUR	191,910	0.08
ICADE SA 1.50 17-27 13/09A	100,000	EUR	105,320	0.04
ICADE SANTE SAS 1.375 20-30 17/09A	100,000	EUR	102,793	0.04
JC DECAUX SA 2 20-24 24/04A	200,000	EUR	209,309	0.09
KERING SA 0.75 20-28 13/05A	100,000	EUR	103,324	0.04
KLEPIERRE (EX-COMPAG 0.875 20-31 17/11A	500,000	EUR	498,420	0.21
KLEPIERRE 1.25 16-31 29/09A	100,000	EUR	102,793	0.04
KLEPIERRE 1.875 16-26 19/02A	100,000	EUR	106,183	0.04
LA BANQUE POSTALE 2.00 18-28 13/07A	100,000	EUR	108,946	0.05
LA POSTE 0.625 20-26 21/04A	500,000	EUR	512,102	0.21
LA POSTE 1.375 20-32 21/04A	300,000	EUR	320,223	0.13
LEGRAND SA 0.6250 19-28 24/06A	100,000	EUR	102,416	0.04
LEGRAND SA 0.75 20-30 20/05A	200,000	EUR	206,799	0.09
LEGRAND SA 1.875 17-32 06/07A	200,000	EUR	226,168	0.09
LVMH MOET HENNESSY 0.125 20-28 11/02A	200,000	EUR	199,362	0.08
MMS USA INVESTMENTS 1.7500 19-31 13/06A	100,000	EUR	107,172	0.04
ORANGE SA 0.00 19-26 04/09U	400,000	EUR	396,452	0.17
ORANGE SA 0.125 20-29 16/09A	200,000	EUR	196,533	0.08
ORANGE SA 0.5 19-32 04/09A	200,000	EUR	195,584	0.08
ORANGE SA 1.00 18-25 12/09A	200,000	EUR	206,375	0.09
ORANGE SA 1.25 20-27 07/04A	200,000	EUR	210,228	0.09
ORANGE SA 1.375 18-28 20/03A	400,000	EUR	424,860	0.18
ORANGE SA 1.625 20-32 07/04A	100,000	EUR	109,168	0.05
ORANGE SA 8.125 03-33 28/01A	100,000	EUR	175,848	0.07
PERNOD RICARD SA 0.50 19-27 24/10A	100,000	EUR	101,226	0.04
PERNOD RICARD SA 0.875 19-31 24/10A	200,000	EUR	205,032	0.09
PERNOD RICARD SA 1.125 20-25 06/04A	500,000	EUR	517,032	0.22
PEUGEOT SA 2 18-25 20/03A	200,000	EUR	210,351	0.09
RCI BANQUE SA 0.2500 19-23 08/03A	474,000	EUR	475,379	0.20
RCI BANQUE SA 1.625 18-26 24/05A	200,000	EUR	207,633	0.09
RENAULT SA 2 19-24 11/07A	600,000	EUR	624,897	0.26
RTE EDF TRANSPORT 1.125 19-49 09/09A	200,000	EUR	194,151	0.08
RTE RESEAU DE T 0.6250 20-32 08/07A	400,000	EUR	395,856	0.17
SANEF SA 1.875 15-26 16/03A	100,000	EUR	105,639	0.04
SANOFI 1.375 18-30 21/03A	100,000	EUR	108,277	0.05
SANOFI SA 1.25 19-34 21/03A	300,000	EUR	324,093	0.14
SANOFI SA 1.5 20-30 30/03A	200,000	EUR	218,301	0.09
SCHNEIDER ELECT 1.5000 19-28 15/01A	100,000	EUR	107,334	0.04
SCHNEIDER ELECTRIC S 0,25 20-29 11/03A	300,000	EUR	299,577	0.13
SCHNEIDER ELECTRIC SE 1.375 18-27 21/06A	200,000	EUR	212,509	0.09
SOCIETE DES AUTOROUTE 1.375 19-31 21/02A	100,000	EUR	107,470	0.04
SOCIETE GENERALE 0.8750 19-26 01/07A	100,000	EUR	101,882	0.04
SOCIETE GENERALE 1.125 18-25 23/01A	300,000	EUR	309,122	0.13
SOCIETE GENERALE 1.25 19-24 15/02A	300,000	EUR	308,127	0.13
SOCIETE GENERALE 2.125 18-28 27/09A	100,000	EUR	108,742	0.05
SOCIETE GENERALE SA 0.125 21-28 18/02A	400,000	EUR	391,844	0.16
SOCIETE GENERALE SA 0.75 20-27 23/01A	200,000	EUR	201,576	0.08
SOCIETE GENERALE SA 1.25 20-30 12/06A	400,000	EUR	409,612	0.17
SODEXHO 2.50 14-26 24/06A	300,000	EUR	330,748	0.14
SODEXO 0.75 20-25 27/04A	625,000	EUR	638,741	0.27

Die Erlauterungen im Anhang sind fester Bestandteil des Abschlusses.

Etwaige Abweichungen bei den Prozentsatzen des Nettovermogens sind auf Rundungen zuruckzufuhren.

Cleome Index

Cleome Index Euro Corporate Bonds

Anlageportfolio zum 31. Dezember 2021

Bezeichnung	Anzahl	Wahrung	Marktwert (in EUR)	% des NV
SODEXO 1 20-29 27/04A	100,000	EUR	104,335	0.04
STE AUTOROUTES PARIS 1.875 16-31 06/01A	200,000	EUR	224,265	0.09
STE AUTOPARRHI 1.5 18-30 25/01A	300,000	EUR	325,947	0.14
STELLANTIS 2.00 17-24 23/03A	200,000	EUR	208,292	0.09
STELLANTIS 2.75 20-26 15/05A	200,000	EUR	218,638	0.09
SUEZ 0.5 19-31 14/10A	300,000	EUR	295,354	0.12
SUEZ 1.25 16-28 19/05A	100,000	EUR	105,469	0.04
SUEZ ENVIRONNEMENT 1.75 15-25 10/09A	100,000	EUR	105,729	0.04
UNIBAIL RODAMCO 1.75 19-49 01/07A	100,000	EUR	94,322	0.04
UNIBAIL-RODAMCO-WEST 0.625 20-27 04/12A	100,000	EUR	100,554	0.04
UNIBAIL-RODAMCO-WEST 1.375 20-31 04/12A	200,000	EUR	205,250	0.09
UNIBAIL-RODAMCO-WEST 1.375 21-33 25/05A	200,000	EUR	199,931	0.08
UNIBAIL-RODAMCO-WEST 2.125 20-25 09/04A	900,000	EUR	951,466	0.40
VEOLIA ENVIRONNEMENT 0.664 20-31 15/01A	300,000	EUR	301,598	0.13
VEOLIA ENVIRONNEMENT 0.8 20-32 15/06A	200,000	EUR	201,206	0.08
VEOLIA ENVIRONNEMENT 1.59 15-28 10/01A	200,000	EUR	215,107	0.09
VEOLIA ENVIRONNEMENT 1.94 18-30 07/01A	200,000	EUR	222,077	0.09
VEOLIA ENVIRONNEMENT 4.625 12-27 30/03A	200,000	EUR	245,836	0.10
VINCI SA 1,625 19-29 18/01A	200,000	EUR	217,046	0.09
VINCI SA 1,7500 18-30 26/09A	400,000	EUR	444,286	0.19
VIVENDI SA 0.6250 19-25 11/06A	300,000	EUR	304,272	0.13
VIVENDI SA 1.1250 19-28 11/12A	100,000	EUR	103,752	0.04
WENDEL 2.50 15-27 09/02A	200,000	EUR	221,212	0.09
WPP FINANCE SA EMTN 2.25 14-26 22/09A	300,000	EUR	329,102	0.14
			38,944,937	16.26
Deutschland				
ADIDAS AG 0.6250 20-35 10/09A	200,000	EUR	196,903	0.08
ALLIANZ FIN II 1.375 16-31 21/04A	700,000	EUR	762,573	0.32
BASF SE 0.875 16-31 06/10A	300,000	EUR	312,948	0.13
BERTELSMANN SE CO. 1.5 20-30 15/05A	300,000	EUR	319,756	0.13
COMMERZBANK AG 0.625 19-24 28/08A	367,000	EUR	372,255	0.16
COMMERZBANK AG 0.875 20-27 22/01A	100,000	EUR	100,706	0.04
COMMERZBANK AG 1.1250 19-26 22/06A	600,000	EUR	614,475	0.26
COMMERZBANK AG 4.00 16-26 23/03A	200,000	EUR	221,233	0.09
DAIMLER 2.0 19-31 27/02A	100,000	EUR	113,292	0.05
DAIMLER AG 0.75 19-30 08/02A	200,000	EUR	205,464	0.09
DAIMLER AG 0.75 20-30 10/09A	100,000	EUR	102,968	0.04
DAIMLER AG 1.125 19-31 06/11A	400,000	EUR	419,928	0.18
DAIMLER AG 1.375 16-28 11/05A	300,000	EUR	322,329	0.13
DAIMLER AG 1.50 16-26 09/03A	600,000	EUR	636,654	0.27
DAIMLER AG 2 20-26 22/05A	242,000	EUR	263,308	0.11
DAIMLER AG 2.375 20-30 22/05A	100,000	EUR	115,690	0.05
DEUTSCHE BAHN FINANC 0.625 20-50 08/12A	200,000	EUR	173,259	0.07
DEUTSCHE BAHN FINANC 0.625 21-36 15/04A	550,000	EUR	529,534	0.22
DEUTSCHE BANK AG 1.125 15-25 17/03A	500,000	EUR	512,845	0.21
DEUTSCHE BANK AG 1.375 21-32 17/02A	200,000	EUR	199,858	0.08
DEUTSCHE BANK AG 1.625 20-27 20/01A	400,000	EUR	417,052	0.17
DEUTSCHE POST AG 1 20-32 20/05A	300,000	EUR	317,350	0.13
DEUTSCHE TELEKOM AG 0.50 19-27 05/07A	520,000	EUR	529,563	0.22
DEUTSCHE TELEKOM AG 0.875 19-26 25/03A	200,000	EUR	206,343	0.09
DEUTSCHE TELEKOM AG 1.75 19-31 25/03A	100,000	EUR	111,221	0.05
DEUTSCHE TELEKOM AG 1.75 19-49 09/12A	100,000	EUR	103,556	0.04
EVONIK FINANCE BV 0.375 16-24 07/09A	200,000	EUR	201,947	0.08
EVONIK FINANCE BV 0.75 16-28 07/09A	157,000	EUR	160,160	0.07
FRESENIUS MEDICAL CARE 1.50 18-25 11/07A	261,000	EUR	272,507	0.11
FRESENIUS SE CO. KG 1.625 20-27 08/04A	201,000	EUR	213,628	0.09
HOCHTIEF AG 0.5 19-27 03/09A	200,000	EUR	200,952	0.08
INFINEON TECHNO 1.1250 20-26 24/06A	400,000	EUR	414,444	0.17

Die Erluterungen im Anhang sind fester Bestandteil des Abschlusses.

Etwaige Abweichungen bei den Prozentsatzen des Nettovermogens sind auf Rundungen zuruckzufuhren.

Cleome Index

Cleome Index Euro Corporate Bonds

Anlageportfolio zum 31. Dezember 2021

Bezeichnung	Anzahl	Wahrung	Marktwert (in EUR)	% des NV
LANDESBANK BADEN-WUE 0.25 21-28 21/07A	300,000	EUR	294,735	0.12
LBK BAD.WUERT 2.875 16-26 28/09A	200,000	EUR	215,743	0.09
MERCK FINANCIAL SERVI 0.375 19-27 05/07A	200,000	EUR	202,577	0.08
MUNICH REINSURANCE C 1.25 20-41 23/09A	200,000	EUR	197,439	0.08
SANTANDER CONS BK 0.2500 19-24 15/10A	400,000	EUR	402,236	0.17
SAP EMTN 1.625 18-31 10/03A	300,000	EUR	330,308	0.14
SAP SE 0.125 20-26 18/05A	100,000	EUR	100,412	0.04
TALANX AG 2.50 14-26 23/07A	100,000	EUR	111,278	0.05
VOLKSWAGEN LEASING 1.50 19-26 19/06A	100,000	EUR	104,826	0.04
VOLKSWAGEN LEASING G 0,25 21-26 12/01A	300,000	EUR	298,716	0.12
VOLKSWAGEN LEASING G 0,5 21-29 12/01A	743,000	EUR	730,012	0.30
VONOVIA FINANCE BV 1.125 17-25 08/09A	400,000	EUR	412,748	0.17
VONOVIA FINANCE BV 1.5 18-26 22/03A	200,000	EUR	209,770	0.09
VONOVIA FINANCE BV 1.50 16-26 10/06A	300,000	EUR	315,024	0.13
VONOVIA FINANCE BV 2.25 20-30 07/04A	100,000	EUR	111,082	0.05
VONOVIA SE 1 21-33 16/06A	400,000	EUR	392,546	0.16
			14,074,153	5.88
Irland				
AIB GROUP PLC 2.25 18-25 03/07A	100,000	EUR	106,884	0.04
BANK OF IRELAND GRP 1.375 18-23 29/08A	200,000	EUR	204,597	0.09
FCA BANK S.P.A. - IR 0.125 20-23 16/11A	196,000	EUR	196,348	0.08
FCA BANK SPA 0.00 21-24 16/04A	143,000	EUR	142,678	0.06
FRESENIUS FIN IRL 1.50 17-24 30/01A	500,000	EUR	513,910	0.21
			1,164,417	0.49
Italien				
ACEA SPA 0.00 21-25 28/09A	177,000	EUR	176,248	0.07
ACEA SPA 0.25 21-30 28/07A	159,000	EUR	152,923	0.06
ASSICURAZ GENERALI 4.125 14-26 04/05A	300,000	EUR	344,030	0.14
ENEL SPA 1.375 21-99 31/12A	300,000	EUR	293,680	0.12
ENI SPA 1.0000 19-34 11/10A	100,000	EUR	103,377	0.04
INTESA SANPAOLO 0.75 19-24 04/12A	275,000	EUR	279,711	0.12
INTESA SANPAOLO 1.75 19-29 04/07A	218,000	EUR	230,871	0.10
POSTE ITALIANE SPA 0.0 20-24 10/12A	428,000	EUR	427,142	0.18
POSTE ITALIANE SPA 0.50 20-28 10/12A	129,000	EUR	128,104	0.05
SNAM S.P.A. 0.625 21-31 30/06A	400,000	EUR	395,438	0.17
TERNA S.P.A. 0.75 20-32 24/07A	200,000	EUR	199,316	0.08
TERNA SPA 1.00 16-28 11/10U	100,000	EUR	103,262	0.04
			2,834,102	1.18
Japan				
MITSUBISHI UFJ FIN 0.848 19-29 19/07A	400,000	EUR	407,226	0.17
MIZUHO FINANCIAL GR 0.523 19-24 10/06A	295,000	EUR	299,042	0.12
MIZUHO FINANCIAL GRP 0.118 19-24 06/09A	300,000	EUR	300,832	0.13
MIZUHO FINANCIAL GRP 0.214 20-25 07/10A	208,000	EUR	207,901	0.09
MIZUHO FINANCIAL GRP 0.843 21-33 12/04A	300,000	EUR	296,660	0.12
NISSAN MOTOR CO 1.94 20-23 15/09A	300,000	EUR	309,276	0.13
NISSAN MOTOR CO 3.2010 20-28 17/09A	200,000	EUR	222,977	0.09
			2,043,914	0.85
Luxemburg				
3M CO 1.50 16-31 02/06A	100,000	EUR	107,951	0.05
ABBOTT IRL FINANCING 0.375 19-27 19/11A	146,000	EUR	147,130	0.06
ABBVIE INC 0.75 19-27 18/11A	200,000	EUR	203,444	0.08
ABERTIS INFRASTRUCT 0.625 19-25 15/07A	500,000	EUR	506,615	0.21
ABERTIS INFRASTRUCT 1.625 19-29 15/07A	100,000	EUR	103,499	0.04
ABERTIS INFRASTRUCT 3.0000 19-31 27/03A	200,000	EUR	229,718	0.10
ACEA SPA 0.5 20-29 06/02A	200,000	EUR	197,726	0.08
ACEA SPA 1 16-26 24/10A	200,000	EUR	206,269	0.09
ACEA SPA 1.50 18-27 08/06	100,000	EUR	105,567	0.04
ACEA SPA 1.7500 19-28 23/05A	102,000	EUR	109,966	0.05
AIR PRODUCTS CHEMIC 0.8 20-32 05/05A	500,000	EUR	504,462	0.21

Die Erluterungen im Anhang sind fester Bestandteil des Abschlusses.

Etwaige Abweichungen bei den Prozentsatzen des Nettovermogens sind auf Rundungen zuruckzufuhren.

Cleome Index

Cleome Index Euro Corporate Bonds

Anlageportfolio zum 31. Dezember 2021

Bezeichnung	Anzahl	Wahrung	Marktwert (in EUR)	% des NV
AMERICA MOVIL 0.75 19-27 26/06A	151,000	EUR	152,963	0.06
AMPHENOL TECHNOLOGIE 0.75 20-26 04/05A	200,000	EUR	204,277	0.09
AQUARIUS INVESTMENTS 4.25 13-42 02/10A	761,000	EUR	814,631	0.34
AROUNDTOWN SA 0.625 19-25 09/07A	300,000	EUR	303,471	0.13
AROUNDTOWN SA 1.00 17-25 07/01A	100,000	EUR	102,082	0.04
AROUNDTOWN SA 1.50 19-26 28/05A	200,000	EUR	208,958	0.09
AROUNDTOWN SA 1.625 18-28 31/01A	200,000	EUR	207,571	0.09
ASML HOLDING NV 0.625 20-29 07/05A	459,000	EUR	469,144	0.20
ASTRAZENECA PLC 1.25 16-28 12/05A	200,000	EUR	212,616	0.09
AT&T INC 0.8000 19-30 04/03A	100,000	EUR	99,784	0.04
AT&T INC 1.6 20-28 27/05A	388,000	EUR	410,673	0.17
AT&T INC 2.60 14-29 17/12A	300,000	EUR	340,976	0.14
AT&T INC 3.375 14-34 15/03A	200,000	EUR	244,717	0.10
AT&T INC 3.55 12-32 17/12A	200,000	EUR	246,564	0.10
AVIVA PLC 3.375 15-45 04/12A	100,000	EUR	109,642	0.05
BANCO BILBAO VI 0.3750 19-26 15/11A	200,000	EUR	200,100	0.08
BANCO BILBAO VIZCAYA 0.75 20-25 04/06A	200,000	EUR	203,898	0.09
BANCO BILBAO VIZCAYA 1.00 19-26 21/06A	100,000	EUR	102,542	0.04
BANCO SANTANDER SA 0.30 19-26 04/10A	300,000	EUR	300,236	0.13
BANCO SANTANDER SA 1.125 18-25 17/01A	400,000	EUR	411,480	0.17
BANCO SANTANDER SA 1.125 20-27 23/06A	400,000	EUR	411,574	0.17
BANCO SANTANDER SA 1.375 20-26 05/05A	300,000	EUR	311,769	0.13
BANK OF AMERICA CORP 1.375 15-25 26/03A	200,000	EUR	208,405	0.09
BANQUE FED CRED 1.25 17-27 26/05A	400,000	EUR	418,800	0.17
BAXTER INTERNATIONAL 1.30 19-29 15/05A	200,000	EUR	208,682	0.09
BAXTER INTL 1.30 17-25 30/05A	200,000	EUR	207,196	0.09
BECTON DICKINSON 1.208 19-26 04/06A	799,000	EUR	827,285	0.35
BECTON DICKINSON EUR 1.213 21-36 12/02A	100,000	EUR	97,842	0.04
BERKSHIRE HATHAWAY 1.125 15-27 16/03A	100,000	EUR	104,652	0.04
BERKSHIRE HATHAWAY 1.625 15-35 16/03A	100,000	EUR	107,936	0.05
BERKSHIRE HATHAWAY I 0.5 21-41 15/01A	200,000	EUR	175,864	0.07
BFCM 1.25 15-25 14/01A	200,000	EUR	207,276	0.09
BFCM 1.875 16-26 04/11A	100,000	EUR	105,408	0.04
BFCM 2.5 18-28 25/05A	200,000	EUR	218,930	0.09
BG ENERGY CAP REGS 2.25 14-29 21/11A	250,000	EUR	278,214	0.12
BHP BILLITON FINANCE 1.50 15-30 29/04A	300,000	EUR	317,559	0.13
BMW FINANCE 1.00 15-25 21/01A	400,000	EUR	412,960	0.17
BMW FINANCE NV 1.5000 19-29 06/02A	292,000	EUR	318,461	0.13
BNP PARIBAS 1.50 16-28 25/05A	300,000	EUR	322,497	0.13
BNP PARIBAS 2.875 16-26 01/10A	350,000	EUR	386,330	0.16
BNP PARIBAS SA 1.00 17-24 27/06A	400,000	EUR	409,920	0.17
BNP PARIBAS SA 1.125 18-26 11/06A	200,000	EUR	207,329	0.09
BOSTON SCIENTIF CORP 0.6250 19-27 01/12A	532,000	EUR	531,612	0.22
BP CAPITAL MARKETS 1.00 14-26 25/09A	100,000	EUR	109,404	0.05
BP CAPITAL MARKETS 1.573 15-27 16/02A	100,000	EUR	106,134	0.04
BP CAPITAL MARKETS 1.637 17-29 26/06A	700,000	EUR	746,263	0.31
BRISTOL-MYERS SQUIBB 1.75 15-35 15/05A	100,000	EUR	111,327	0.05
BRITISH TELECOM 1.75 16-26 10/03A	500,000	EUR	521,742	0.22
CAIXABANK SA 0.625 19-24 01/10A	300,000	EUR	303,657	0.13
CHUBB INA HOLDING INC 0.875 19-29 15/12A	400,000	EUR	407,134	0.17
CHUBB INA HOLDINGS 0.875 19-27 15/06A	200,000	EUR	204,761	0.09
CIE DE SAINT GOBAIN 1.125 18-26 23/03A	300,000	EUR	313,098	0.13
CIE DE SAINT GOBAIN 1.875 19-31 15/03A	300,000	EUR	332,445	0.14
CITIGROUP 1.75 15-25 28/01A	100,000	EUR	105,052	0.04
CITIGROUP EMTN 2.375 14-24 22/05A	400,000	EUR	423,108	0.18
CITIGROUP INC 1.50 16-28 26/10A	200,000	EUR	212,200	0.09
CK HUTCHISON FINANCE 0.7500 19-26 17/04A	500,000	EUR	506,105	0.21
CK HUTCHISON FINANCE 0.875 16-24 03/10A	300,000	EUR	306,300	0.13

Die Erluterungen im Anhang sind fester Bestandteil des Abschlusses.

Etwaige Abweichungen bei den Prozentsatzen des Nettovermogens sind auf Rundungen zuruckzufuhren.

Cleome Index

Cleome Index Euro Corporate Bonds

Anlageportfolio zum 31. Dezember 2021

Bezeichnung	Anzahl	Wahrung	Marktwert (in EUR)	% des NV
CNH INDUSTRIAL 1.875 18-26 19/01A	200,000	EUR	210,388	0.09
COCA COLA 1.625 15-35 09/09A	300,000	EUR	327,346	0.14
COCA-COLA CO 0.75 19-26 22/09A	249,000	EUR	257,599	0.11
COCA-COLA CO 1.875 14-26 22/09A	100,000	EUR	108,979	0.05
COCA-COLA EUROPEAN 1.125 19-29 12/04A	628,000	EUR	648,821	0.27
COCA-COLA EUROPEAN 1.75 16-28 26/05A	100,000	EUR	107,611	0.04
COCA-COLA EUROPEAN 1.875 15-30 18/03A	400,000	EUR	436,036	0.18
CREDIT AGRICOLE 1.75 19-29 05/03A	300,000	EUR	322,964	0.13
CREDIT AGRICOLE 2.625 15-27 17/03A	600,000	EUR	656,664	0.27
CREDIT AGRICOLE EMTN 3.125 14-26 05/02A	100,000	EUR	112,698	0.05
CREDIT AGRICOLE LDN 1.875 16-26 20/12A	300,000	EUR	322,610	0.13
CRH FUNDING B.V. 1.625 20-30 05/05A	111,000	EUR	119,084	0.05
DEUT TELEKOM INT FIN 3.25 13-28 17/01A	200,000	EUR	238,115	0.10
DEUT TELEKOM INT FIN 7.50 03-33 24/01A	200,000	EUR	340,555	0.14
DEUTSCHE BAHN FIN 1.00 18-27 17/12A	400,000	EUR	420,660	0.18
DEUTSCHE BAHN FIN 1.625 18-33 16/08A	300,000	EUR	333,530	0.14
DEUTSCHE BAHN FINANC 0.75 20-35 16/01A	200,000	EUR	199,106	0.08
DEUTSCHE POST AG 1.625 18-28 05/12A	245,000	EUR	267,108	0.11
DEUTSCHE TELEKOM 0.625 17-24 13/12A	200,000	EUR	203,829	0.09
DH EUROPE FIN 0.20 19-26 18/03A	200,000	EUR	199,967	0.08
DH EUROPE FIN 0.45 19-28 18/03A	275,000	EUR	275,305	0.11
DH EUROPE FIN 0.75 19-31 18/09A	850,000	EUR	847,641	0.35
DIAGEO FINANCE PLC 2.375 14-26 20/05A	400,000	EUR	438,282	0.18
DIGITAL EURO FINCO 2.5 19-26 16/01A	312,000	EUR	337,189	0.14
DOW CHEMICAL CO 1.125 20-32 25/02A	100,000	EUR	100,085	0.04
DS SMITH PLC 0.8750 19-26 12/09A	500,000	EUR	507,562	0.21
DSM KONINKLIJKE 0.75 16-26 28/09A	300,000	EUR	309,441	0.13
E.ON SE 0.8750 20-31 20/08A	700,000	EUR	723,264	0.30
EDP FINANCE 1.50 17-27 22/11A	500,000	EUR	532,578	0.22
ELI LILLY & CO 2.125 15-30 03/06A	300,000	EUR	341,984	0.14
ENAGAS FIN REGS 1.25 15-25 06/02A	300,000	EUR	311,234	0.13
ENEL FIN INTL 0.375 19-27 17/06A	320,000	EUR	319,118	0.13
ENEL FIN INTL 1.125 18-26 16/09A	201,000	EUR	208,531	0.09
ENEL SOCIETA -EMTN- 5.625 07-27 21/06A	400,000	EUR	510,734	0.21
ENI SPA 3.625 14-29 29/01A	400,000	EUR	484,398	0.20
ERSTE GROUP BAN 0.8750 19-26 22/05A	200,000	EUR	205,730	0.09
EURONEXT NV 1 18-25 18/04A	100,000	EUR	102,772	0.04
EXXON MOBIL CORP 0.835 20-32 26/06A	300,000	EUR	293,952	0.12
FID NATL INFO SERV 1.10 17-24 15/07A	200,000	EUR	204,688	0.09
FIDELITY NATIONAL INF 0.625 19-25 03/12A	300,000	EUR	303,822	0.13
FORTUM CORP 1.625 19-26 27/02A	200,000	EUR	210,804	0.09
FRESENIUS FIN IRL 3.00 17-32 30/01A	100,000	EUR	117,586	0.05
FRESENIUS MEDICAL CA 1 20-26 29/05A	343,000	EUR	353,942	0.15
FRESENIUS MEDICAL CARE 1.25 19-29 29/11A	100,000	EUR	103,820	0.04
FRESENIUS SE CO. KG 0.75 20-28 15/01A	448,000	EUR	452,798	0.19
GENERAL ELECTRIC CO 4.125 05-35 19/09A	450,000	EUR	614,360	0.26
GENERAL MOTORS FIN 2.20 19-24 01/04A	218,000	EUR	228,336	0.10
GENERAL MOTORS FINAN 1.694 18-25 26/03A	200,000	EUR	208,357	0.09
GIVAUDAN FINANCE EUR 1 20-27 22/04A	243,000	EUR	253,043	0.11
GLAXOSMITHKLINE 1.375 17-29 12/09A	100,000	EUR	107,755	0.04
GRAND CITY PROPERTIES 1.375 17-26 03/08A	100,000	EUR	104,188	0.04
GRAND CITY PROPERTIES 1.50 -49 31/12A	300,000	EUR	291,706	0.12
HEIDELBERGCEMENT 1.125 19-27 01/12A	200,000	EUR	207,328	0.09
HEIDELBERGCEMENT 1.5 17-27 14/06A	300,000	EUR	317,187	0.13
HEIDELBERGCEMENT 2.25 16-24 03/06A	200,000	EUR	209,970	0.09
HEIDELBERGCEMENT FIN 1.75 18-28 24/04A	100,000	EUR	106,650	0.04
HEINEKEN 1.50 17-29 03/10A	200,000	EUR	214,295	0.09
HEINEKEN NV 1.75 18-31 17/03A	800,000	EUR	874,956	0.37

Die Erluterungen im Anhang sind fester Bestandteil des Abschlusses.

Etwaige Abweichungen bei den Prozentsatzen des Nettovermogens sind auf Rundungen zuruckzufuhren.

Cleome Index

Cleome Index Euro Corporate Bonds

Anlageportfolio zum 31. Dezember 2021

Bezeichnung	Anzahl	Wahrung	Marktwert (in EUR)	% des NV
HEINEKEN NV 2.875 12-25 04/08A	240,000	EUR	264,796	0.11
HLDG INFRA TRANSPORT 2.25 14-25 24/03A	500,000	EUR	532,572	0.22
HSBC HOLDINGS PLC 2.50 16-27 15/03A	500,000	EUR	552,172	0.23
IBERDROLA FINANZAS 1.621 17-29 29/11A	100,000	EUR	110,396	0.05
IBERDROLA INTL BV 1.125 16-26 21/04A	100,000	EUR	104,758	0.04
IBM CORP 1.25 19-27 29/01A	300,000	EUR	314,805	0.13
IBM CORP 1.5 17-29 23/05A	100,000	EUR	107,044	0.04
IBM CORP 1.75 16-28 07/03A	100,000	EUR	108,468	0.05
ILLINOIS TOOL WORKS 2.125 15-30 22/05A	200,000	EUR	224,899	0.09
INFORMA PLC 1.5000 18-23 05/07A	200,000	EUR	204,160	0.09
ING GROEP NV 2.5000 18-30 15/11A	200,000	EUR	232,584	0.10
ING GROUP NV 1.125 18-25 14/02A	300,000	EUR	309,352	0.13
ING GROUP NV 2.125 19-26 10/01A	200,000	EUR	214,903	0.09
INNOGY FINANCE BV 5.75 03-33 14/02A	100,000	EUR	151,326	0.06
INTESA SANPAOLO 1.00 19-26 19/11A	100,000	EUR	101,818	0.04
INTESA SANPAOLO SPA 1.75 18-28 20/03A	300,000	EUR	316,372	0.13
INVESTOR AB 1.5000 18-30 12/09A	200,000	EUR	216,548	0.09
IREN SPA 1.50 17-27 24/10A	300,000	EUR	316,005	0.13
ITALGAS SPA 1.0 19-31 11/12A	100,000	EUR	101,168	0.04
ITALGAS SPA 1.625 17-29 18/01A	100,000	EUR	106,838	0.04
JOHN DEERE CASH MANA 2.2 20-32 02/04A	300,000	EUR	347,432	0.15
JOHNSON A JOHNSON 1.65 16-35 20/05A	300,000	EUR	334,329	0.14
JOHNSON CONTROLS INTL 1.375 16-25 25/02A	200,000	EUR	206,576	0.09
JPMORGAN CHASE & C 1.50 16-26 29/10A	200,000	EUR	211,799	0.09
JPMORGAN CHASE & CO 1.50 15-25 27/01A	600,000	EUR	627,234	0.26
JPMORGAN CHASE & CO 3.00 14-26 19/02A	300,000	EUR	335,530	0.14
KERRY GROUP FIN SERV 0.625 19-29 20/09A	300,000	EUR	300,490	0.13
KON AHOLD DELHAIZE 0.25 19-25 26/06A	103,000	EUR	103,728	0.04
KONINKIJKKE 1.125 18-26 19/03A	113,000	EUR	117,278	0.05
LINDE FINANCE BV 0.55 20-32 19/05A	800,000	EUR	801,600	0.33
LLOYDS BANKING GROUP 1.50 17-27 12/09A	100,000	EUR	106,669	0.04
LONDON STOCK EX 1.7500 18-27 06/12A	100,000	EUR	107,470	0.04
LSE GROUP 1.75 17-29 19/09A	200,000	EUR	217,521	0.09
MAGNA INTL 1.500 17-27 25/09A	100,000	EUR	106,491	0.04
MANPOWERGROUP INC 1.75 18-26 22/06A	200,000	EUR	212,774	0.09
MC DONALD S 1.875 15-27 26/05A	700,000	EUR	759,066	0.32
MEDIOBANCA 0.875 19-26 15/01A	467,000	EUR	472,504	0.20
MEDIOBANCA 1.00 20-27 08/09A	194,000	EUR	197,499	0.08
MEDTRONIC GLOBAL HLDG 1.50 19-39 02/07A	200,000	EUR	206,261	0.09
MEDTRONIC GLOBAL HOLD 0.25 19-25 02/07A	200,000	EUR	201,493	0.08
MEDTRONIC GLOBAL HOLD 0.375 20-28 15/10A	200,000	EUR	200,066	0.08
MEDTRONIC GLOBAL HOLD 1.00 19-31 02/07A	450,000	EUR	465,034	0.19
MEDTRONIC GLOBAL HOLD 1.125 19-27 07/03A	500,000	EUR	521,948	0.22
MEDTRONIC GLOBAL HOLD 1.625 19-31 07/03A	500,000	EUR	543,612	0.23
MERCK & CO INC 1.875 14-26 15/10A	100,000	EUR	108,044	0.05
MERCK FIN SERVI 0.1250 20-25 16/07A	300,000	EUR	301,570	0.13
MERLIN PROPERTIES SO 2.375 20-27 13/07A	100,000	EUR	107,848	0.05
MICROSOFT 2.625 13-33 02/05A	300,000	EUR	370,178	0.15
MIZUHO FINA 1.5980 18-28 10/04A	200,000	EUR	214,431	0.09
MOLNLYCKE HLDG 1.875 17-25 28/02A	200,000	EUR	210,160	0.09
MONDELEZ INTERNATIONAL 1.625 15-27 08/03	200,000	EUR	213,009	0.09
MORGAN STANLEY 1.375 16-26 27/10	100,000	EUR	104,972	0.04
MORGAN STANLEY 1.75 15-25 30/01A	300,000	EUR	315,154	0.13
MYLAN INC 2.125 18/25 23/05A	400,000	EUR	423,700	0.18
MYLAN NV 2.25 16-24 22/11A	200,000	EUR	211,446	0.09
MYLAN NV 3.125 16-28 22/11	500,000	EUR	569,322	0.24
NASDAQ INC 1.7500 19-29 28/03A	400,000	EUR	428,058	0.18
NATIONAL AUSTRA 1.1250 19-31 20/05A	100,000	EUR	104,958	0.04

Die Erlauterungen im Anhang sind fester Bestandteil des Abschlusses.

Etwige Abweichungen bei den Prozentsatzen des Nettovermogens sind auf Rundungen zururckzufuhren.

Cleome Index

Cleome Index Euro Corporate Bonds

Anlageportfolio zum 31. Dezember 2021

Bezeichnung	Anzahl	Wahrung	Marktwert (in EUR)	% des NV
NATIONAL AUSTRALIA 1.3750 18-28 30/08A	100,000	EUR	106,356	0.04
NATURGY FINANCE B.V. 1.25 20-26 15/04A	100,000	EUR	104,318	0.04
NATURGY FINANCE BV 1.375 17-27 19/01A	500,000	EUR	527,668	0.22
NESTLE FINANCE INTL 1.25 17-29 02/11A	400,000	EUR	428,826	0.18
NESTLE FINANCE INTL 1.75 17-37 02/11A	300,000	EUR	341,996	0.14
NN GROUP NV 4.375 14-XX 13/06A	100,000	EUR	108,860	0.05
NOVARTIS FINANCE 1.375 18-30 14/08A	200,000	EUR	215,858	0.09
NOVARTIS FINANCE 1.70 18-38 14/08A	100,000	EUR	113,038	0.05
OMV AG 0.75 20-30 16/06A	270,000	EUR	274,753	0.11
OP CORPORATE BA 1.0000 18-25 22/05A	100,000	EUR	103,303	0.04
ORACLE CORP 3.125 13-25 10/07A	320,000	EUR	352,963	0.15
PEPSICO INC 0.5 20-28 06/05A	617,000	EUR	624,028	0.26
PPG INDUSTRIES 1.40 15-27 13/03A	200,000	EUR	211,210	0.09
PROCTER & GAMBLE 1.25 17-29 25/10A	200,000	EUR	213,023	0.09
PROLOGIS 3.00 14-26 02/06A	100,000	EUR	112,014	0.05
PROLOGIS EURO FINANCE 0.25 19-27 10/09A	200,000	EUR	198,415	0.08
PROLOGIS EURO FINANCE 0.375 20-28 06/02A	174,000	EUR	173,407	0.07
PROLOGIS EURO FINANCE 1.875 18-29 05/01A	400,000	EUR	432,666	0.18
PSA BANQUE FRAN 0.6250 19-24 21/06A	206,000	EUR	208,626	0.09
PVH CORP 3.625 16-24 15/07S	200,000	EUR	215,691	0.09
RED ELECT FIN 1.00 16-26 21/04A	200,000	EUR	208,307	0.09
RED ELECTRICA FINANC 0.375 20-28 24/01A	100,000	EUR	101,318	0.04
RELAX CAPITAL INC 1.30 15-25 12/05A	300,000	EUR	311,592	0.13
RELX FINANCE BV 1.375 16-26 12/05A	350,000	EUR	367,453	0.15
REPSOL INTL FINANCE 0.25 19-27 02/08A	300,000	EUR	299,001	0.12
REPSOL INTL FINANCE 2.6250 20-30 15/04A	200,000	EUR	232,063	0.10
RICHEMONT INTERNATIO 0.75 20-28 26/05A	454,000	EUR	464,369	0.19
RICHEMONT INTERNATIO 1.125 20-32 26/05A	500,000	EUR	521,278	0.22
RICHEMONT INTERNATION 2.0 18-38 26/03A	200,000	EUR	226,296	0.09
ROYAL PHILIPS NV 0.50 19-26 22/05A	292,000	EUR	297,117	0.12
SAMPO PLC 2.25 18-30 27/09A	500,000	EUR	570,150	0.24
SANTANDER CONS BK 0.125 19-24 11/09A	200,000	EUR	200,262	0.08
SANTANDER CONS FIN 0.375 19-24 27/06A	300,000	EUR	302,458	0.13
SANTANDER CONSUMER F 0,375 20-25 17/01A	400,000	EUR	402,460	0.17
SAP SE 0.375 20-29 18/05A	500,000	EUR	503,712	0.21
SBAB BANK AB 0.5 20-25 13/05A	200,000	EUR	203,463	0.08
SCHLUMBERGER FINANCE 1.375 20-26 06/05A	650,000	EUR	682,903	0.29
SHELL INT FIN 0.75 16-28 15/08A	300,000	EUR	306,392	0.13
SHELL INTL FINANCE 1.625 14-27 10/01A	300,000	EUR	321,076	0.13
SIEMENS FIN NV 1.3750 18-30 06/09A	600,000	EUR	652,320	0.27
SIEMENS FINANCIERING 0.375 20-26 05/06A	200,000	EUR	203,181	0.08
SIMON INTL FINANCE 1.25 16-25 13/05A	400,000	EUR	412,456	0.17
SKANDINAVISKA ENSKIL 0.625 19-29 12/11A	400,000	EUR	402,274	0.17
SNAM SPA 0.00 19-24 12/05A	200,000	EUR	200,226	0.08
SNAM SPA 0.875 16-26 25/10A	300,000	EUR	308,360	0.13
SNAM SPA 1.2500 19-25 28/08A	106,000	EUR	110,042	0.05
SOCIETE GENERALE 1.375 17-28 13/01A	100,000	EUR	103,918	0.04
SOCIETE GENERALE 2.625 15-25 27/02A	400,000	EUR	427,970	0.18
STATOIL ASA 1.625 15-35 17/02A	200,000	EUR	215,061	0.09
STEDIN HOLDING NV 0.50 19-29 14/11A	400,000	EUR	403,266	0.17
STRYKER CORP 0.75 19-29 01/03A	232,000	EUR	233,687	0.10
STRYKER CORP 2.125 18-27 30/11A	100,000	EUR	109,176	0.05
STRYKER CORP 2.6250 18-30 30/11A	100,000	EUR	115,160	0.05
SUEZ 1.625 18-30 17/09A	100,000	EUR	108,845	0.05
SUMITOMO MITSUI FIN 0.934 17-24 11/10A	200,000	EUR	205,107	0.09
SUMITOMO MITSUI FIN 1.546 16-26 15/06A	100,000	EUR	105,470	0.04
SUMITOMO MITSUI FINAN 0.632 19-29 23/10A	300,000	EUR	298,680	0.12
SUMITOMO MITSUI FINL 0.465 19-24 30/05A	220,000	EUR	222,781	0.09

Die Erluterungen im Anhang sind fester Bestandteil des Abschlusses.

Etwaige Abweichungen bei den Prozentsatzen des Nettovermogens sind auf Rundungen zuruckzufuhren.

Cleome Index

Cleome Index Euro Corporate Bonds

Anlageportfolio zum 31. Dezember 2021

Bezeichnung	Anzahl	Wahrung	Marktwert (in EUR)	% des NV
TAKEDA PHARMACEUTICAL 0.75 20-27 09/07A	1,077,000	EUR	1,097,651	0.46
TAKEDA PHARMACEUTICAL 2.25 18-26 21/11A	496,000	EUR	541,136	0.23
TAKEDA PHARMACEUTICAL 3.00 18-30 21/11A	200,000	EUR	237,454	0.10
TELEFONICA EMISIONES 1.788 19-29 12/03A	200,000	EUR	217,998	0.09
TELEFONICA EMISIONES 1.807 20-32 21/05A	200,000	EUR	217,407	0.09
TELEFONICA EMISIONES 1.93 16-31 17/10A	100,000	EUR	111,172	0.05
TELEFONICA EMISIONES 2.318 17-28 17/10A	100,000	EUR	112,457	0.05
TELEFONICA EMISIONES 2.932 14-29 17/10A	300,000	EUR	354,442	0.15
TELENOR ASA 0.25 20-28 14/02A	147,000	EUR	145,736	0.06
TELENOR ASA 0.2500 19-27 25/09A	254,000	EUR	252,430	0.11
TELENOR ASA 1.75 19-34 31/05A	200,000	EUR	219,962	0.09
TELIASONERA EMTN 3.875 10-25 01/10A	200,000	EUR	227,883	0.10
TELSTRA CORP LTD 1.125 16-26 14/04A	300,000	EUR	311,162	0.13
TELSTRA CORPORATION 1 20-30 23/04A	278,000	EUR	285,662	0.12
TENNET HOLDING 2.0 18-34 05/06A	300,000	EUR	339,982	0.14
TENNET HOLDING BV 1.375 18-28 05/06A	402,000	EUR	428,759	0.18
TENNET HOLDING REGS 1.75 15-27 04/06A	100,000	EUR	108,238	0.05
TERNA SPA 1.0000 19-26 10/04A	350,000	EUR	361,538	0.15
TERNA SPA 1.375 17-27 26/07A	200,000	EUR	210,461	0.09
THERMO FISHER SCIEN 1.95 17-29 24/07A	100,000	EUR	110,072	0.05
THERMO FISHER SCIEN 2.00 14-25 15/04A	400,000	EUR	423,256	0.18
THERMO FISHER SCIENT 0.50 19-28 01/03A	100,000	EUR	100,382	0.04
THERMO FISHER SCIENT 0.75 16-24 12/09A	400,000	EUR	407,964	0.17
THERMO FISHER SCIENT 1.40 17-26 23/01A	112,000	EUR	117,275	0.05
THERMO FISHER SCIENT 1.75 20-27 02/04A	400,000	EUR	429,750	0.18
TORONTO DOMINION BANK 0.375 19-24 25/04A	200,000	EUR	201,940	0.08
TOTALENERGIES 2.125 14-29 18/09A	200,000	EUR	223,855	0.09
TOTALENERGIES CAP 1.491 18-30 04/09A	200,000	EUR	215,106	0.09
TOTALENERGIES CAPITA 0.952 20-31 18/05A	400,000	EUR	411,610	0.17
TOTALENERGIES CAPITA 1.994 20-32 08/04A	400,000	EUR	448,956	0.19
TRANSURBAN FINANCE 1.45 19-29 16/05A	400,000	EUR	417,214	0.17
UNIBAIL RODAMCO 1.00 15-25 14/03A	200,000	EUR	205,149	0.09
UNIBAIL RODAMCO 1.375 16-26 09/03A	200,000	EUR	208,680	0.09
UNIBAIL-RODAMCO 1.375 15-30 15/04A	200,000	EUR	208,705	0.09
UNICREDIT SPA 2.125 16-26 24/10A	400,000	EUR	429,198	0.18
UNILEVER 1.625 18-33 12/02A	700,000	EUR	775,386	0.32
UNILEVER NV 1.125 16-28 29/04A	200,000	EUR	210,615	0.09
VERIZON COMMUNICATION 1.50 19-39 19/09A	300,000	EUR	299,588	0.13
VERIZON COMMUNICATION 1.875 17-29 26/10A	800,000	EUR	875,920	0.37
VF CORP 0.25 20-28 25/02A	200,000	EUR	196,205	0.08
VODAFONE GROUP 0.90 19-26 24/11A	100,000	EUR	103,422	0.04
VODAFONE GROUP 1.50 17-27 24/07A	100,000	EUR	106,496	0.04
VODAFONE GROUP 2.20 16-26 25/08A	100,000	EUR	109,154	0.05
VODAFONE GROUP 2.875 17-37 20/11A	100,000	EUR	118,122	0.05
VODAFONE GROUP PLC 1.125 17-25 20/11A	100,000	EUR	103,778	0.04
VODAFONE GROUP PLC 1.60 16-31 29/07A	470,000	EUR	498,966	0.21
VODAFONE GROUP PLC 1.875 14-25 11/09A	100,000	EUR	106,296	0.04
VOLKSWAGEN FIN 1.5 19-24 01/10A	100,000	EUR	103,740	0.04
VOLKSWAGEN FIN 2.2500 19-27 01/10A	500,000	EUR	545,562	0.23
VOLKSWAGEN FINANCIAL 3 20-25 06/04A	400,000	EUR	435,438	0.18
VOLKSWAGEN FINANCIAL 3.375 20-28 06/04A	400,000	EUR	465,474	0.19
VOLKSWAGEN INTL FIN NV 3.25 18-30 18/11A	300,000	EUR	359,732	0.15
VW INTL FINANCE 1.625 15-30 16/01A	500,000	EUR	537,772	0.22
WELLS FARGO 1.5 17-27 24/05A	100,000	EUR	104,351	0.04
WELLS FARGO CO 1.625 15-25 02/06A	100,000	EUR	104,764	0.04
WHIRLPOOL FINANCE 1.25 16-26 15/06A	400,000	EUR	415,252	0.17
WINTERSHALL DEA 1.8230 19-31 25/09A	300,000	EUR	308,860	0.13
WINTERSHALL DEA FINA 1.3320 19-28 25/09A	200,000	EUR	204,297	0.09

Die Erlauterungen im Anhang sind fester Bestandteil des Abschlusses.

Etwaige Abweichungen bei den Prozentsatzen des Nettovermogens sind auf Rundungen zuruckzufuhren.

Cleome Index

Cleome Index Euro Corporate Bonds

Anlageportfolio zum 31. Dezember 2021

Bezeichnung	Anzahl	Wahrung	Marktwert (in EUR)	% des NV
WOLTERS KLUWER 1.50 17-27 22/03A	200,000	EUR	211,512	0.09
ZURICH FINANCE 1.6250 19-39 17/06A	300,000	EUR	324,453	0.14
			87,813,668	36.67
Niederlande				
ABN AMRO BANK 0.5 19-26 15/04A	302,000	EUR	307,137	0.13
ABN AMRO BANK NV 1 21-33 02/06A	400,000	EUR	402,594	0.17
ALLIANZ FINANCE II 1.5 19-30 15/01A	300,000	EUR	326,374	0.14
ASML HOLDING NV 1.375 16-26 07/07S	100,000	EUR	105,832	0.04
BMW FINANCE NV 0.2 21-33 11/01A	286,000	EUR	273,811	0.11
BMW FINANCE NV 0.75 19-26 13/07A	200,000	EUR	206,002	0.09
COOP RABOBANK 1.25 16-26 23/03A	200,000	EUR	209,847	0.09
CRH FINANCE 1.375 16-28 18/10A	400,000	EUR	422,428	0.18
DAIMLER INTL FIN 1.375 19-26 26/06A	400,000	EUR	424,280	0.18
DEUT TELEKOM INT FIN 1.50 16-28 03/04A	300,000	EUR	322,029	0.13
DIAGEO CAPITAL BV 0.125 20-28 28/09A	300,000	EUR	295,924	0.12
DIGITAL DUTCH FINCO 1 20-32 23/09A	325,000	EUR	316,022	0.13
DIGITAL DUTCH FINCO 1,25 20-31 26/06A	100,000	EUR	100,758	0.04
EDP FINANCE 1.625 18-26 26/01A	217,000	EUR	229,984	0.10
ENEL FIN INTL 1.125 19-34 17/10A	200,000	EUR	201,593	0.08
EURONEXT NV 0.125 21-26 17/05A	200,000	EUR	199,189	0.08
EURONEXT NV 1.5 21-41 17/05A	100,000	EUR	99,001	0.04
IBERDROLA 0.375 16-25 15/09A	300,000	EUR	304,312	0.13
IBERDROLA INTL BV 1.45 21-99 31/12A	300,000	EUR	300,790	0.13
IBERDROLA INTL BV 1.874 20-99 31/12A	500,000	EUR	510,230	0.21
ING GROEP NV FL.R 20-29 18/02A	300,000	EUR	292,312	0.12
KONINKLIJKE KPN NV 0.875 20-32 14/09A	300,000	EUR	295,012	0.12
RABOBANK 1.125 19-31 07/05A	300,000	EUR	315,711	0.13
SCHLUMBERGER FINANCE 0.25 19-27 15/10A	546,000	EUR	543,076	0.23
SHELL INTL FINANCE BV 0.875 19-39 08/11A	200,000	EUR	183,754	0.08
SIEMENS FINANCIERING 0.25 20-29 20/02A	200,000	EUR	200,373	0.08
SIEMENS FINANCIERING 1.25 19-31 28/02A	300,000	EUR	325,101	0.14
STELLANTIS N.V. 1.25 21-33 18/06A	400,000	EUR	390,564	0.16
TENNET HOLDING B.V 0.125 20-32 30/11A	305,000	EUR	286,880	0.12
THERMO FISHER SCIENTI 1.125 21-33 18/10A	500,000	EUR	508,592	0.21
VOLKSWAGEN INTL FIN 0.8750 20-28 22/09A	400,000	EUR	411,720	0.17
VOLKSWAGEN INTL FIN 1.25 20-32 23/09A	400,000	EUR	416,460	0.17
VONOVIA FINANCE B.V. 1 21-41 28/01A	100,000	EUR	88,806	0.04
VONOVIA FINANCE BV 1.125 19-34 14/09A	200,000	EUR	194,854	0.08
VONOVIA FINANCE BV 1.625 20-24 07/04A	500,000	EUR	516,565	0.22
VONOVIA FINANCE BV 2.125 18-30 22/03A	100,000	EUR	110,061	0.05
			10,637,978	4.44
Norwegen				
STATOIL ASA 1.625 16-36 09/11A	200,000	EUR	214,698	0.09
			214,698	0.09
Portugal				
ENERGIAS DE PORTUGAL 1.625 20-27 15/04A	100,000	EUR	106,273	0.04
			106,273	0.04
Spanien				
ABERTIS INFRASTRUCT 1.00 16-27 27/02A	200,000	EUR	203,475	0.08
ABERTIS INFRASTRUCT 1.125 19-28 26/03A	200,000	EUR	202,721	0.08
AMADEUS IT GROUP 0.875 18-23 18/09A	300,000	EUR	304,184	0.13
BANCO BILBAO VIZCAYA 0.5 20-27 14/01A	200,000	EUR	198,898	0.08
BANCO BILBAO VIZCAYA 3.50 17-27 10/02A	200,000	EUR	225,334	0.09
BANCO SANTANDER SA 0.25 19-24 19/06A	300,000	EUR	302,373	0.13
BANCO SANTANDER SA 0.5 21-27 24/03A	100,000	EUR	99,816	0.04
BANCO SANTANDER SA 2.125 18-28 08/02A	400,000	EUR	423,276	0.18
BANCO SANTANDER SA 2.50 15-25 18/03A	300,000	EUR	319,209	0.13
BANKIA SA 0.75 19-26 09/07A	200,000	EUR	203,457	0.08
BANKINTER SA 0.8750 19-26 08/07A	300,000	EUR	304,630	0.13

Die Erluterungen im Anhang sind fester Bestandteil des Abschlusses.

Etwaige Abweichungen bei den Prozentsatzen des Nettovermogens sind auf Rundungen zuruckzufuhren.

Cleome Index

Cleome Index Euro Corporate Bonds

Anlageportfolio zum 31. Dezember 2021

Bezeichnung	Anzahl	Währung	Marktwert (in EUR)	% des NV
CAIXABANK SA 1.125 19-26 27/03A	200,000	EUR	206,643	0.09
CAIXABANK SA 1.75 18-23 24/10A	200,000	EUR	206,222	0.09
CRITERIA CAIXA SA 1.5 17-23 10/05A	800,000	EUR	816,888	0.34
IBERDROLA FIN 1.25 18-26 28/10A	200,000	EUR	210,963	0.09
MERLIN PROPERTIES SO 1.375 21-30 01/06A	300,000	EUR	296,282	0.12
SANTANDER CONS FIN 0.00 19-22 06/05A	200,000	EUR	201,519	0.08
SANTANDER CONSUMER F 0 21-26 23/02A	100,000	EUR	98,600	0.04
TELEFONICA EMISIONES 1.864 20-40 13/07A	200,000	EUR	218,104	0.09
			5,042,594	2.11
Schweden				
FASTIGHETS AB BALDER 1.125 19-27 29/01A	200,000	EUR	202,233	0.08
SVENSKA HANDELSBANKEN 0.05 19-26 03/09A	200,000	EUR	198,399	0.08
TELIA COMPANY AB 2.125 19-34 20/02A	400,000	EUR	449,194	0.19
			849,826	0.35
Schweiz				
CREDIT SUISSE GROUP 0.625 21-33 18/01A	250,000	EUR	233,300	0.10
UBS AG 1.50 16-24 30/11A	600,000	EUR	618,159	0.26
UBS GROUP SA 0.25 20-28 05/11A	600,000	EUR	590,073	0.25
			1,441,532	0.60
Großbritannien				
ANZ NEW ZEALAND 1.125 18-25 20/03A	100,000	EUR	103,101	0.04
BARCLAYS PLC 0.577 21-29 09/08A	400,000	EUR	391,014	0.16
BARCLAYS PLC 1.375 18-26 24/01A	300,000	EUR	309,862	0.13
BP CAPITAL MARKETS 1.231 19-31 08/05A	300,000	EUR	310,830	0.13
BP CAPITAL MARKETS 3.25 20-XX 22/06A	300,000	EUR	318,414	0.13
BP CAPITAL MARKETS P 2.822 20-32 07/04A	250,000	EUR	295,944	0.12
CREDIT SUISSE 0.45 20-25 19/05A	255,000	EUR	257,298	0.11
CREDIT SUISSE AG L 1.50 16-26 10/04A	300,000	EUR	314,379	0.13
DS SMITH PLC 1.375 17-24 26/07A	400,000	EUR	411,660	0.17
NATIONAL GRID ELECTR 0.823 20-32 07/07A	300,000	EUR	299,109	0.12
NATWEST MARKETS PLC 2.75 20-25 02/04A	300,000	EUR	325,221	0.14
STANDARD CHARTERED 1.2 21-31 23/03A	600,000	EUR	599,130	0.25
UBS AG LONDON BRANCH 0.5 21-31 31/03A	400,000	EUR	394,024	0.16
VODAFONE GROUP 3.1 18-79 03/01A	300,000	EUR	310,012	0.13
			4,639,998	1.94
Vereinigte Staaten von Amerika				
ABBVIE INC 2.125 16-28 17/11A	100,000	EUR	110,138	0.05
AMERICAN HONDA FINAN 0.3 21-28 09/07A	300,000	EUR	297,080	0.12
AMERICAN INTL GRP 1.875 17-27 21/06A	200,000	EUR	212,640	0.09
AMERICAN TOWER 0.5 20-28 10/09A	397,000	EUR	390,332	0.16
AMERICAN TOWER CORP 0,875 21-29 21/05A	100,000	EUR	99,029	0.04
AMERICAN TOWER CORP 1 20-32 10/09A	200,000	EUR	194,550	0.08
AMGEN INC 2.00 16-26 25/02A	200,000	EUR	214,441	0.09
ARCHER DANIELS MIDLAND 1% 18-25 12/09A	100,000	EUR	103,133	0.04
AT&T INC 1.80 18-26 05/09A	100,000	EUR	106,291	0.04
AT&T INC 2.45 15-35 15/03S	300,000	EUR	332,412	0.14
BANK OF AMERICA CORP 1.102 21-32 24/05A	400,000	EUR	403,970	0.17
BERKSHIRE HATHAWAY 2.15 16-28 15/03A	400,000	EUR	441,982	0.18
CHUBB INA HOLDINGS 1.55 18-28 15/03A	100,000	EUR	106,040	0.04
COCA-COLA CO 0.5 21-33 09/03A	200,000	EUR	193,558	0.08
COCA-COLA CO 0.8 20-40 18/09A	300,000	EUR	283,304	0.12
COLGATE-PALMOLIVE CO 0.875 19-29 12/11S	100,000	EUR	99,484	0.04
COMCAST CORP 0.25 20-27 20/05A	386,000	EUR	383,589	0.16
COMCAST CORP 0.7500 20-32 20/02A	500,000	EUR	499,158	0.21
DANAHER CORP 2.5 20-30 30/03A	400,000	EUR	458,740	0.19
DIGITAL EURO FINCO 1.125 19-28 09/10A	151,000	EUR	153,332	0.06
DOW CHEMICAL CO 0.5 20-27 25/02A	200,000	EUR	199,448	0.08
ELI LILLY & CO 0.625 19-31 01/11A	620,000	EUR	627,669	0.26
ELI LILLY 1.625 15-26 02/06A	200,000	EUR	213,056	0.09

Die Erläuterungen im Anhang sind fester Bestandteil des Abschlusses.

Etwaige Abweichungen bei den Prozentsätzen des Nettovermögens sind auf Rundungen zurückzuführen.

Cleome Index

Cleome Index Euro Corporate Bonds

Anlageportfolio zum 31. Dezember 2021

Bezeichnung	Anzahl	Währung	Marktwert (in EUR)	% des NV
EQUINIX INC 0,2500 21-27 15/03A	330,000	EUR	324,336	0.14
EQUINIX INC 1 21-33 10/03A	200,000	EUR	192,503	0.08
EURO MEDIUM TERM NOTE 0.875 19-25 31/01A	393,000	EUR	403,676	0.17
FEDEX CORP 0.95 21-33 04/05A	200,000	EUR	192,990	0.08
FEDEX CORP 1.30 19-31 05/08A	100,000	EUR	103,198	0.04
FIDELITY NATIONAL INF 1.5 19-27 21/05A	200,000	EUR	209,278	0.09
FIDELITY NATL INFORM 2 19-30 21/05A	150,000	EUR	163,041	0.07
FISERV INC 1.125 19-27 01/07A	200,000	EUR	206,899	0.09
FISERV INC 1.625 19-30 01/07A	200,000	EUR	211,876	0.09
ILLINOIS TOOL WORKS 3.00 14-34 19/05A	100,000	EUR	124,608	0.05
INTERNATIONAL BUSINE 0.3 20-28 11/02A	772,000	EUR	769,047	0.32
JOHNSON CONTROLS INT 0.375 20-27 15/09A	355,000	EUR	351,963	0.15
JPMORGAN CHASE 2.875 13-28 24/05A	850,000	EUR	984,551	0.41
MCDONALD'S CORP 0.9 19-26 15/06A	200,000	EUR	205,665	0.09
MCKESSON CORP 1.50 17-25 17/11A	200,000	EUR	209,911	0.09
MERCK & CO 2.50 14-34 15/10A	200,000	EUR	241,771	0.10
MONDELEZ INTERNATION 0.75 21-33 17/03A	400,000	EUR	385,952	0.16
MOODY'S CORP 0.95 19-30 25/02A	280,000	EUR	286,224	0.12
MORGAN STANLEY 0.497 21-31 08/02A	400,000	EUR	387,568	0.16
PEPSICO INC 0.75 21-33 14/10A	300,000	EUR	299,013	0.12
PEPSICO INC 1.125 19-31 18/03A	100,000	EUR	104,764	0.04
PROCTER & GAMBLE 1.875 18-38 30/10A	100,000	EUR	114,954	0.05
PROLOGIS EURO FINANCE 0.625 19-31 10/09A	100,000	EUR	96,996	0.04
PROLOGIS INTERNATION 1.625 20-32 17/06A	200,000	EUR	209,405	0.09
STRYKER CORP 1.00 19-31 03/12A	100,000	EUR	101,270	0.04
SUMITOMO MITSUI FINL 1.143 17-27 14/06A	100,000	EUR	105,070	0.04
THERMO FISHER SCIENT 0.875 19-31 01/10A	1,100,000	EUR	1,111,786	0.46
TOYOTA MOTOR CREDIT 0.125 21-27 06/05A	300,000	EUR	295,856	0.12
TOYOTA MOTOR CREDIT 0.25 20-26 16/01A	200,000	EUR	200,367	0.08
UNITED PARCEL 1.00 16-28 28/11A	100,000	EUR	104,490	0.04
VERIZON COMM 3.25 14-26 17/02A	200,000	EUR	225,390	0.09
VERIZON COMMUNICATION 0.875 19-27 08/04A	151,000	EUR	155,126	0.06
VERIZON COMMUNICATION 1.375 16-28 02/11A	100,000	EUR	105,994	0.04
VERIZON COMMUNICATION 2.625 14-31 01/12A	200,000	EUR	233,884	0.10
WELLS FARGO 0.50 19-24 26/04A	400,000	EUR	404,350	0.17
WELLS FARGO 1.375 16-26 26/10A	482,000	EUR	501,678	0.21
WELLS FARGO CO 0.625 20-30 14/02A	300,000	EUR	293,631	0.12
ZIMMER BIOMET 1.164 19-27 15/11A	100,000	EUR	102,118	0.04
			16,844,575	7.03
Anleihen gesamt			196,915,851	82.23
Variabel verzinsliche Anleihen				
Österreich				
ERSTE GROUP BANK AG FL.R 20-31 08/09	400,000	EUR	411,514	0.17
OMV AG FL.R 20-49 31/12A	100,000	EUR	103,932	0.04
VIENNA INS GRP AGW FL.R 13-43 09/10A	200,000	EUR	218,174	0.09
VIENNA INSURANCE GRP FL.R 15-XX 02/03A	100,000	EUR	111,540	0.05
			845,160	0.35
Belgien				
AGEAS NV FL.R 19-49 02/07A	100,000	EUR	111,150	0.05
KBC GROUP NV FL.R 19-29 03/12A	400,000	EUR	398,440	0.17
KBC GROUPE SA FL.R 17-29 18/09A	400,000	EUR	412,080	0.17
			921,670	0.38
Dänemark				
ORSTED FL.R 19-XX 09/12A	100,000	EUR	102,498	0.04
			102,498	0.04
Frankreich				
AXA SA FL.R 18-49 28/05A	500,000	EUR	561,368	0.23
BNP PARIBAS FL.R 19-25 15/07A	400,000	EUR	404,260	0.17

Die Erläuterungen im Anhang sind fester Bestandteil des Abschlusses.

Etwaige Abweichungen bei den Prozentsätzen des Nettovermögens sind auf Rundungen zurückzuführen.

Cleome Index

Cleome Index Euro Corporate Bonds

Anlageportfolio zum 31. Dezember 2021

Bezeichnung	Anzahl	Wahrung	Marktwert (in EUR)	% des NV
BNP PARIBAS FL.R 19-26 04/12A	200,000	EUR	201,850	0.08
BNP PARIBAS FL.R 4.032 14-XX 25	200,000	EUR	224,060	0.09
CNP ASSURANCES FL.R 14-45 05/06A	400,000	EUR	449,830	0.19
CNP ASSURANCES FL.R 14-XX 18/11A	200,000	EUR	219,793	0.09
CNP ASSURANCES FL.R 15-47 10/06A	500,000	EUR	594,082	0.25
CREDIT AGRICOLE FL.R 15-XX 13/01A	300,000	EUR	329,560	0.14
CREDIT AGRICOLE FL.R 16-48 27/09A	100,000	EUR	120,474	0.05
CREDIT AGRICOLE FL.R 20-26 22/04A	1,000,000	EUR	1,025,380	0.43
CREDIT MUTUEL ARKEA FL.R 17-29 25/10A	100,000	EUR	103,272	0.04
CREDIT MUTUEL ARKEA FL.R 20-29 11/06A	200,000	EUR	207,099	0.09
DANONE SA FL.R 17-XX 23/06A	200,000	EUR	203,489	0.08
DANONE SA FL.R 21-XX XX/XXA	500,000	EUR	500,642	0.21
ENGIE SA FL.R 19-XX 08/07A	100,000	EUR	102,227	0.04
GROUPAMA SA FL.R 14-XX 28/05A	100,000	EUR	113,342	0.05
LA BANQUE POSTALE FL.R 20-26 17/06A	300,000	EUR	302,062	0.13
LA BANQUE POSTALE FL.R 21-32 02/02A	400,000	EUR	387,388	0.16
LA MONDIALE FL.R 14-XX 17/12A	500,000	EUR	577,752	0.24
SCOR FL.R 15-XX 05/06A	100,000	EUR	112,201	0.05
SCOR SE SUB FL.R 16-48 27/05A	100,000	EUR	115,960	0.05
SOCIETE GENERALE FL.R 18-28 23/02A	300,000	EUR	303,918	0.13
SOCIETE GENERALE SA FL.R 20-30 24/11A	400,000	EUR	399,914	0.17
SOGECAP SA FL.R 14-49 29/12A	200,000	EUR	223,163	0.09
SUEZ FL.R 17-XX 19/04A	300,000	EUR	312,898	0.13
SUEZ FL.R 19-XX XX/XXA	300,000	EUR	301,917	0.13
TOTAL SE FL.R 20-XX 04/09A	300,000	EUR	296,040	0.12
UNIBAIL RODAMCO FL.R 18-XX 25/10A	300,000	EUR	297,429	0.12
			8,991,370	3.75
Deutschland				
ALLIANZ SE FL.R 13-XX 24/10A	300,000	EUR	323,914	0.14
ALLIANZ SE FL.R 20-50 22/05A	600,000	EUR	630,903	0.26
COMMERZBANK AG FL.R 20-26 24/03A	100,000	EUR	101,536	0.04
DEUTSCHE BANK AG 1.0 20-25 19/11A	500,000	EUR	508,925	0.21
DEUTSCHE BANK AG 1.75 20-30 19/11A	100,000	EUR	104,078	0.04
DEUTSCHE BOERSE AG 1.25 20-47 16/06A	100,000	EUR	102,212	0.04
MUNICH RE FL.R 18-49 26/05A	200,000	EUR	226,510	0.09
TALANX AG FL.R 17-47 05/12A	100,000	EUR	105,590	0.04
			2,103,668	0.88
Italien				
ASSICURAZ GENERALI FL.R 15-47 27/10A	200,000	EUR	243,326	0.10
ASSICURAZ GENERALI FL.R 16-48 08/06A	300,000	EUR	359,862	0.15
ENEL SPA 2.25 20-XX XX/XXA	402,000	EUR	415,698	0.17
ENI SPA FL.R 20-49 31/12A	577,000	EUR	598,880	0.25
ENI SPA FL.R 21-99 31/12A	283,000	EUR	282,118	0.12
UNICREDIT SPA FL.R 20-27 22/07A	500,000	EUR	528,020	0.22
			2,427,904	1.01
Luxemburg				
ACHMEA BV FL.R 15-49 31/12A	100,000	EUR	108,976	0.05
AEGON NV FL.R 14-44 25/04A	100,000	EUR	107,622	0.04
ASR NEDERLAND NV FL.R 15-45 29/09A	100,000	EUR	116,023	0.05
AXA SA FL.R 14-XX 07/11A	100,000	EUR	109,606	0.05
AXA SA FL.R 16-47 06/07A	300,000	EUR	336,300	0.14
BANCO BILBAO VIZCAYA FL.R 19-29 22/02A	400,000	EUR	415,818	0.17
BANCO DE SABADELL SA FL.R 19-25 07/11A	100,000	EUR	100,381	0.04
BNP PARIBAS FL.R 14-27 14/10A	500,000	EUR	510,138	0.21
CITIGROUP INC FL.R 19-27 08/10A	400,000	EUR	400,224	0.17
COMMONW BK AUSTRALIA FL.R 17-29 03/10A	100,000	EUR	103,904	0.04
COOPERATIEVE RABOBAN FL.R 20-28 05/05A	900,000	EUR	921,555	0.38
DANSKE BANK A/S FL.R 19-30 12/02A	400,000	EUR	405,876	0.17
ENEL SPA FL.R 18-78 24/05A	200,000	EUR	206,846	0.09

Die Erlauterungen im Anhang sind fester Bestandteil des Abschlusses.

Etwlige Abweichungen bei den Prozentsatzen des Nettovermogens sind auf Rundungen zuruckzufuhren.

Cleome Index

Cleome Index Euro Corporate Bonds

Anlageportfolio zum 31. Dezember 2021

Bezeichnung	Anzahl	Währung	Marktwert (in EUR)	% des NV
HANNOVER RUECK SE FL.R 14-XX 26/06A	900,000	EUR	989,060	0.41
HSBC HOLDINGS PLC 1.5 18-24 04/12A	500,000	EUR	514,620	0.21
IBERDROLA INTL BV FL.R 17-99 22/02A	400,000	EUR	408,738	0.17
ING GROUP NV FL.R 17-29 15/02A	100,000	EUR	104,352	0.04
ING GROUP NV FL.R 19-25 03/09A	400,000	EUR	399,886	0.17
ING GROUP NV FL.R 19-30 13/11A	300,000	EUR	301,437	0.13
ING GROUP NV FL.R 20-31 26/05A	100,000	EUR	104,762	0.04
JPMORGAN CHASE & CO FL.R 19-27 11/03A	224,000	EUR	230,682	0.10
JPMORGAN CHASE & CO FL.R 19-32 04/11A	100,000	EUR	101,182	0.04
LLOYDS BANKING GROUP FL.R 18-28 07/09A	800,000	EUR	821,940	0.34
MERCK KGAA FL.R 19-79 25/06A	100,000	EUR	102,828	0.04
MERCK KGAA FL.R 20-80 09/09A	700,000	EUR	717,178	0.30
MORGAN STANLEY FL.R 17-26 23/10A	200,000	EUR	207,617	0.09
MORGAN STANLEY FL.R 19-24 26/07A	376,000	EUR	380,407	0.16
NATIONWIDE BUILDING FL.R 17-29 25/07A	400,000	EUR	414,924	0.17
NATWEST GROUP PLC FL.R 18-25 04/03A	200,000	EUR	207,987	0.09
NN GROUP NV FL.R 14-44 08/04A	200,000	EUR	218,275	0.09
NN GROUP NV FL.R 14-XX 15/07A	200,000	EUR	226,059	0.09
NN GROUP NV FL.R 17-48 13/01A	100,000	EUR	117,059	0.05
OMV AG FL.R 18-XX 19/06A	200,000	EUR	209,343	0.09
ORANGE FL.R 14-XX 07/02A	400,000	EUR	440,210	0.18
ORANGE SA FL.R 14-XX 01/10A	700,000	EUR	823,228	0.34
ORSTED FL.R 13-XX 26/06A	360,000	EUR	391,401	0.16
SKANDINAVISKA ENSKIL FL.R 16-28 31/10A	200,000	EUR	204,298	0.09
SOCIETE GENERALE SA 0.5 21-29 12/01A	200,000	EUR	195,849	0.08
STANDARD CHARTERED FL.R 20-28 16/01A	200,000	EUR	202,028	0.08
SVENSKA HANDELSBANKEN FL.R 18-29 05/03A	1,000,000	EUR	1,029,365	0.43
TELIA COMPANY AB FL.R 17-78 04/04A	200,000	EUR	206,542	0.09
TOTALENE FL.R 19-XX 04/04A	761,000	EUR	776,513	0.32
TOTALENERGIESSE	650,000	EUR	681,587	0.28
UNICREDIT SPA FL.R 19-29 23/09A	200,000	EUR	201,816	0.08
VOLKSWAGEN INTL FIN FL.R 17-XX 14/12A	700,000	EUR	715,281	0.30
VOLKSWAGEN INTL FIN FL.R 8-XX 27/06A	300,000	EUR	341,084	0.14
WELLS FARGO CO FL.R 20-30 04/05A	100,000	EUR	105,854	0.04
			16,936,661	7.07
Niederlande				
ELM BV FL.R 15-XX 01/09A	400,000	EUR	424,822	0.18
IBERDROLA INTL BV FL.R -49 31/12A	200,000	EUR	215,036	0.09
ING GROEP NV FL.R 21-32 16/11A	400,000	EUR	396,982	0.17
TENNET HOLDING BV FL.R 17-49 12/04A	113,000	EUR	118,354	0.05
			1,155,194	0.48
Spanien				
BANCO DE SABADELL SA FL.R 20-27 11/09A	100,000	EUR	101,839	0.04
CAIXABANK S.A. FL.R 20-26 10/07A	300,000	EUR	304,918	0.13
CAIXABANK S.A. FL.R 20-26 18/11A	100,000	EUR	99,581	0.04
CAIXABANK SA FL.R 17-28 14/07A	600,000	EUR	620,100	0.26
CAIXABANK SA FL.R 18-30 17/04A	100,000	EUR	103,928	0.04
			1,230,366	0.51
Schweiz				
CREDIT SUISSE FL.R 17-25 17/07A	259,000	EUR	264,847	0.11
CREDIT SUISSE FL.R 20-26 02/04A	154,000	EUR	167,629	0.07
CREDIT SUISSE GROUP FL.R 19-27 24/06A	200,000	EUR	202,703	0.08
			635,179	0.27
Großbritannien				
AVIVA PLC FL.R 14-44 03/07A	100,000	EUR	108,214	0.05
BARCLAYS PLC FL.R 19-25 09/06A	174,000	EUR	176,498	0.07
HSBC HOLDINGS PLC 0.309 20-26 13/11A	199,000	EUR	198,672	0.08
HSBC HOLDINGS PLC FL.R 20-31 13/11A	200,000	EUR	198,340	0.08
NATIONWIDE BUILDING FL.R 18-26 08/03A	500,000	EUR	519,692	0.22

Die Erläuterungen im Anhang sind fester Bestandteil des Abschlusses.

Etwaige Abweichungen bei den Prozentsätzen des Nettovermögens sind auf Rundungen zurückzuführen.

Cleome Index

Cleome Index Euro Corporate Bonds

Anlageportfolio zum 31. Dezember 2021

Bezeichnung	Anzahl	Währung	Marktwert (in EUR)	% des NV
NATWEST GROUP PLC FL.R 18-26 02/03A	200,000	EUR	208,548	0.09
NATWEST GROUP PLC FL.R 21-30 26/02A	300,000	EUR	296,392	0.12
			1,706,356	0.71
Vereinigte Staaten von Amerika				
BANK OF AMERICA CORP FL.R 20-31 26/10A	600,000	EUR	585,402	0.24
CITIGROUP INC FL.R 20-26 06/05A	489,000	EUR	505,545	0.21
MORGAN STANLEY FL.R 20-29 26/10A	166,000	EUR	163,129	0.07
			1,254,076	0.52
Variabel verzinsliche Anleihen insgesamt			38,310,102	16.00
Gesamtsumme übertragbarer Wertpapiere, die zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden			235,225,953	98.23
Anlageportfolio insgesamt			235,225,953	98.23
Anschaffungskosten			237,000,651	

Die Erläuterungen im Anhang sind fester Bestandteil des Abschlusses.
Etwaige Abweichungen bei den Prozentsätzen des Nettovermögens sind auf Rundungen zurückzuführen.

Cleome Index

Cleome Index Euro Corporate Bonds

Geografische und wirtschaftliche Zusammensetzung des Wertpapierbestandes zum 31. Dezember 2021

Geografische Zusammensetzung (in % des Nettovermögens)

Luxemburg	43.74
Frankreich	20.02
Vereinigte Staaten von Amerika	7.56
Deutschland	6.76
Niederlande	4.92
Großbritannien	2.65
Spanien	2.62
Belgien	2.51
Italien	2.20
Schweiz	0.87
Japan	0.85
Australien	0.81
Österreich	0.70
Dänemark	0.56
Irland	0.49
Schweden	0.35
Finnland	0.25
Kanada	0.15
Kaimaninseln	0.09
Norwegen	0.09
Portugal	0.04
	98.23

Wirtschaftliche Zusammensetzung (in % des Nettovermögens)

Banken und andere Finanzinstitute	47.06
Pharmazeutika	5.89
Kommunikation	5.66
Versorger	5.64
Versicherung	4.90
Immobilien	4.75
Erdöl	2.81
Transport	2.59
Tabak und alkoholische Getränke	2.18
Lebensmittel und alkoholfreie Getränke	2.00
Internet und Internet-Dienste	1.76
Kraftfahrzeuge	1.76
Elektronik und Halbleiter	1.67
Elektrotechnik	1.63
Chemikalien	1.41
Grafik und Verlage	0.93
Einzelhandel und Warenhäuser	0.77
Baumaterialien	0.76
Büroausstattung und Computer	0.71
Nicht klassifizierbare Institutionen	0.68
Hotels und Restaurants	0.40
Sonstige Konsumgüter	0.40
Sonstige Dienstleistungen	0.40
Verpackungsindustrie	0.38
Maschinen- und Apparatebau	0.34
Textilien und Bekleidung	0.34
Reifen und Kautschuk	0.24
Gesundheitswesen	0.09
Nicht klassifizierbare Institutionen	0.07
	98.23

Etwaige Abweichungen bei den Prozentsätzen des Nettovermögens sind auf Rundungen zurückzuführen.

Cleome Index

Cleome Index Euro Government Bonds

Anlageportfolio zum 31. Dezember 2021

Bezeichnung	Anzahl	Währung	Marktwert (in EUR)	% des NV
Übertragbare Wertpapiere, die zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden				
Anleihen				
Österreich				
AUSTRIA 0.00 16-23 15/07U	1,000,000	EUR	1,010,535	0.60
AUSTRIA 0.5 19-29 20/02A	750,000	EUR	783,709	0.47
AUSTRIA 1.20 15-25 20/10A	500,000	EUR	532,882	0.32
AUSTRIA 1.50 16-47 20/02A	1,000,000	EUR	1,217,800	0.73
AUSTRIA 2.10 17-17 20/09A	150,000	EUR	230,022	0.14
AUSTRIA 2.40 13-34 23/05A	900,000	EUR	1,141,924	0.68
AUSTRIA 4.85 09-26 15/03A	500,000	EUR	613,682	0.37
AUSTRIA 6.25 97-27 15/07A	750,000	EUR	1,028,212	0.61
			6,558,766	3.91
Belgien				
BELGIUM 0.0000 20-27 22/10A	700,000	EUR	711,403	0.42
BELGIUM 0.1000 20-30 22/06A	1,400,000	EUR	1,410,430	0.84
BELGIUM 0.20 16-23 22/10A	760,000	EUR	771,339	0.46
BELGIUM 0.80 15-25 22/06A	850,000	EUR	888,768	0.53
BELGIUM 0.80 17-27 22/06A	800,000	EUR	849,292	0.51
BELGIUM 1.00 16-26 22/06A	300,000	EUR	318,915	0.19
BELGIUM 1.60 16-47 22/06A	475,000	EUR	554,287	0.33
BELGIUM 1.90 15-38 22/06A	320,000	EUR	388,925	0.23
BELGIUM 2.25 17-57 22/06A	200,000	EUR	275,579	0.16
BELGIUM 2.60 14-24 22/06A	700,000	EUR	756,010	0.45
BELGIUM 3.75 13-45 22/06A	500,000	EUR	819,352	0.49
BELGIUM 4.25 10-41 28/03A	550,000	EUR	906,232	0.54
BELGIUM 5.00 04-35 28/03A	850,000	EUR	1,363,787	0.81
			10,014,319	5.96
Finnland				
FINLAND 0.000 20-30 15/09A	500,000	EUR	499,972	0.30
FINLAND 0.125 20-36 15/04A	400,000	EUR	388,722	0.23
FINLAND 0.50 16-26 15/04A	150,000	EUR	156,100	0.09
FINLAND 0.50 17-27 15/09A	300,000	EUR	313,676	0.19
FINLAND 0.875 15-25 15/09A	500,000	EUR	525,592	0.31
FINLAND 1.625 12-22 15/09A	1,000,000	EUR	1,017,265	0.61
FINLAND 2.625 12-42 04/07A	300,000	EUR	434,568	0.26
			3,335,895	1.99
Frankreich				
FRANCE 0.0 18-24 25/03A	3,000,000	EUR	3,039,105	1.81
FRANCE 0.00 17-23 25/03A	3,000,000	EUR	3,024,645	1.80
FRANCE 0.00 19-25 25/03A	600,000	EUR	609,363	0.36
FRANCE 0.00 21-31 25/11A	1,450,000	EUR	1,422,399	0.85
FRANCE 0.0000 19-29 25/11A	3,000,000	EUR	3,003,075	1.79
FRANCE 0.25 15-26 25/11A	1,600,000	EUR	1,644,880	0.98
FRANCE 0.5 18-29 25/05A	700,000	EUR	729,813	0.43
FRANCE 0.50 15-25 25/05A	1,000,000	EUR	1,032,785	0.61
FRANCE 0.50 15-26 25/05A	2,000,000	EUR	2,076,010	1.24
FRANCE 0.50 20-40 25/05A	1,300,000	EUR	1,270,633	0.76
FRANCE 0.75 17-28 25/05A	1,500,000	EUR	1,589,895	0.95
FRANCE 0.75 17-28 25/11A	1,500,000	EUR	1,591,875	0.95
FRANCE 1.00 15-25 25/11A	1,700,000	EUR	1,793,806	1.07
FRANCE 1.00 16-27 25/05A	1,600,000	EUR	1,712,080	1.02
FRANCE 1.25 16-36 25/05A	1,650,000	EUR	1,829,536	1.09
FRANCE 1.25 18-34 25/05A	1,000,000	EUR	1,106,870	0.66
FRANCE 1.50 15-31 25/05A	1,500,000	EUR	1,692,622	1.01
FRANCE 1.50 18-50 25/05A	1,300,000	EUR	1,507,422	0.90
FRANCE 1.75 13-24 25/11A	1,400,000	EUR	1,492,813	0.89
FRANCE 1.75 17-39 25/06A	1,050,000	EUR	1,268,526	0.76
FRANCE 2.25 11-22 25/10A	700,000	EUR	716,674	0.43

Die Erläuterungen im Anhang sind fester Bestandteil des Abschlusses.

Etwaige Abweichungen bei den Prozentsätzen des Nettovermögens sind auf Rundungen zurückzuführen.

Cleome Index

Cleome Index Euro Government Bonds

Anlageportfolio zum 31. Dezember 2021

Bezeichnung	Anzahl	Währung	Marktwert (in EUR)	% des NV
FRANCE 2.50 13-30 25/05A	600,000	EUR	726,057	0.43
FRANCE 3.25 12-45 25/05A	2,450,000	EUR	3,781,195	2.25
FRANCE 4.00 09-60 25/04A	680,000	EUR	1,342,694	0.80
FRANCE 4.75 04-35 25/04A	1,200,000	EUR	1,887,234	1.12
			41,892,007	24.94
Deutschland				
ALLEMAGNE 0.25 17-27 15/02A	1,650,000	EUR	1,710,225	1.02
BUNDESREPUB. DE 0.0000 19-29 15/08A	1,600,000	EUR	1,640,040	0.98
GERMANY 0.00 16-26 15/08U	2,100,000	EUR	2,148,752	1.28
GERMANY 0.00 20-30 15/02A	3,150,000	EUR	3,226,608	1.92
GERMANY 0.00 20-35 15/05A	400,000	EUR	400,898	0.24
GERMANY 0.00 21-50 15/08A	400,000	EUR	385,434	0.23
GERMANY 1.00 15-25 15/08A	1,900,000	EUR	2,008,328	1.20
GERMANY 1.25 17-48 15/08A	350,000	EUR	451,505	0.27
GERMANY 1.50 13-23 15/05U	1,200,000	EUR	1,236,210	0.74
GERMANY 1.50 14-24 15/05A	2,100,000	EUR	2,209,106	1.32
GERMANY 1.75 14-24 15/02A	2,500,000	EUR	2,630,250	1.57
GERMANY 2.50 12-44 04/07A	1,900,000	EUR	2,959,858	1.76
GERMANY 2.50 14-46 15/08A	500,000	EUR	797,268	0.47
GERMANY 4.00 05-37 04/01A	1,050,000	EUR	1,702,370	1.01
GERMANY 4.25 07-39 04/07A	350,000	EUR	616,032	0.37
GERMANY 4.75 08-40 04/07A	475,000	EUR	899,700	0.54
GERMANY 4.75 98-28 04/07A	2,000,000	EUR	2,689,770	1.60
			27,712,354	16.50
Irland				
IRELAND 0.90 18-28 15/05A	100,000	EUR	106,245	0.06
IRELAND 1.10 19-29 16/01A	100,000	EUR	107,715	0.06
IRELAND 1.50 19-50 15/05A	200,000	EUR	230,460	0.14
IRELAND 1.70 17-37 15/05A	350,000	EUR	407,855	0.24
IRELAND 2.00 15-45 18/02A	200,000	EUR	254,870	0.15
IRELAND 2.40 14-30 15/05A	820,000	EUR	978,260	0.58
IRELAND 3.40 14-24 18/03A	350,000	EUR	380,415	0.23
IRELAND 3.90 13-23 20/03A	300,000	EUR	315,900	0.19
IRELAND 5.40 09-25 13/03A	800,000	EUR	948,360	0.56
			3,730,080	2.22
Italien				
BUONI POLIENNAL 0.8500 19-27 15/01S	700,000	EUR	714,035	0.43
ITALY 0.6 21-31 01/08S	1,500,000	EUR	1,428,825	0.85
ITALY 1.50 15-25 01/06S	1,700,000	EUR	1,777,358	1.06
ITALY 1.75 19-24 01/07S	1,000,000	EUR	1,043,325	0.62
ITALY 1.8500 20-25 01/07S	1,050,000	EUR	1,110,622	0.66
ITALY 2.05 17-27 01/08S	500,000	EUR	541,510	0.32
ITALY 2.20 17-27 01/06S	700,000	EUR	763,788	0.45
ITALY 2.50 14-24 01/12S	1,650,000	EUR	1,766,333	1.05
ITALY 3.45 17-48 01/03S	1,600,000	EUR	2,101,112	1.25
ITALY 3.50 14-30 01/03S	2,800,000	EUR	3,378,620	2.01
ITALY 3.75 14-24 01/09S	1,300,000	EUR	1,428,830	0.85
ITALY 4.00 05-37 01/02S	1,800,000	EUR	2,399,751	1.43
ITALY 4.50 13-24 01/03S	1,600,000	EUR	1,758,096	1.05
ITALY 4.75 13-28 01/09S	1,500,000	EUR	1,896,675	1.13
ITALY 4.75 13-44 01/09S	1,380,000	EUR	2,138,731	1.27
ITALY 5.00 03-34 01/08S	600,000	EUR	853,113	0.51
ITALY 5.00 07-39 01/08S	550,000	EUR	833,734	0.50
ITALY 5.00 09-25 01/03S	1,210,000	EUR	1,396,546	0.83
ITALY 5.00 09-40 01/09S	1,800,000	EUR	2,765,871	1.65
ITALY 5.25 98-29 01/11S	1,000,000	EUR	1,338,825	0.80
ITALY 5.75 02-33 01/02S	200,000	EUR	294,383	0.18
ITALY 7.25 96-26 01/11S	900,000	EUR	1,196,577	0.71
ITALY BTP 6.50 97-27 01/11S	1,000,000	EUR	1,339,770	0.80

Die Erläuterungen im Anhang sind fester Bestandteil des Abschlusses.

Etwasige Abweichungen bei den Prozentsätzen des Nettovermögens sind auf Rundungen zurückzuführen.

Cleome Index

Cleome Index Euro Government Bonds

Anlageportfolio zum 31. Dezember 2021

Bezeichnung	Anzahl	Währung	Marktwert (in EUR)	% des NV
REPUBLIQUE ITALIENNE 0.00 21-26 01/08S	1,100,000	EUR	1,079,414	0.64
			35,345,844	21.05
Niederlande				
NETHERLANDS 0.00 17-24 15/01U	650,000	EUR	658,645	0.39
NETHERLANDS 0.00 20-30 15/07A	200,000	EUR	201,971	0.12
NETHERLANDS 0.25 15-25 15/07A	500,000	EUR	513,720	0.31
NETHERLANDS 0.25 19-29 14/02A	1,200,000	EUR	1,240,632	0.74
NETHERLANDS 0.50 16-26 15/07A	700,000	EUR	730,576	0.44
NETHERLANDS 0.50 19-40 15/01A	200,000	EUR	212,750	0.13
NETHERLANDS 0.75 17-27 15/07A	650,000	EUR	690,872	0.41
NETHERLANDS 1.75 13-23 15/07A	1,350,000	EUR	1,401,671	0.83
NETHERLANDS 2.50 12-33 15/01A	1,150,000	EUR	1,465,957	0.87
NETHERLANDS 3.75 10-42 15/01A	1,200,000	EUR	2,048,376	1.22
			9,165,170	5.46
Portugal				
PORTUGAL 1.95 19-29 15/06A	725,000	EUR	821,686	0.49
PORTUGAL 2.125 18-28 17/10A	550,000	EUR	626,884	0.37
PORTUGAL 2.20 15-22 17/10A	200,000	EUR	204,638	0.12
PORTUGAL 2.875 15-25 15/10A	500,000	EUR	561,768	0.33
PORTUGAL 4.10 06-37 15/04A	400,000	EUR	591,888	0.35
PORTUGAL 4.10 15-45 15/02A	150,000	EUR	242,912	0.14
PORTUGAL 4.125 17-27 14/04A	100,000	EUR	122,693	0.07
PORTUGAL 5.65 13-24 15/02A	550,000	EUR	623,263	0.37
			3,795,732	2.26
Spanien				
SPAIN 0.35 18-23 30/07A	950,000	EUR	964,236	0.57
SPAIN 0.80 20-27 30/07A	500,000	EUR	521,572	0.31
SPAIN 1.40 18-28 30/07A	600,000	EUR	650,790	0.39
SPAIN 1.45 17-27 31/10A	950,000	EUR	1,027,895	0.61
SPAIN 1.45 19-29 29/01A	1,000,000	EUR	1,089,090	0.65
SPAIN 1.50 17-27 30/04A	500,000	EUR	541,760	0.32
SPAIN 1.85 19-35 05/03A	600,000	EUR	677,286	0.40
SPAIN 1.95 15-30 30/07A	1,550,000	EUR	1,756,863	1.05
SPAIN 2.15 15-25 31/10A	2,300,000	EUR	2,513,440	1.50
SPAIN 2.35 17-33 30/07A	600,000	EUR	712,554	0.42
SPAIN 2.90 16-46 31/10A	1,200,000	EUR	1,620,552	0.96
SPAIN 3.45 16-66 30/07A	600,000	EUR	904,092	0.54
SPAIN 3.80 14-24 30/04A	1,900,000	EUR	2,092,404	1.25
SPAIN 4.20 05-37 31/01A	2,000,000	EUR	2,940,150	1.75
SPAIN 4.40 13-23 31/10A	1,150,000	EUR	1,254,719	0.75
SPAIN 4.70 09-41 30/07A	370,000	EUR	607,460	0.36
SPAIN 5.15 13-28 31/10A	800,000	EUR	1,072,952	0.64
SPAIN 5.15 13-44 31/10A	110,000	EUR	198,156	0.12
SPAIN 5.90 11-26 30/07A	1,200,000	EUR	1,533,762	0.91
SPAIN 6.00 98-29 31/01A	1,000,000	EUR	1,415,580	0.84
			24,095,313	14.35
Anleihen insgesamt			165,645,480	98.63
Gesamtsumme übertragbarer Wertpapiere, die zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden			165,645,480	98.63
Anlageportfolio insgesamt			165,645,480	98.63
Anschaffungskosten			169,544,076	

Die Erläuterungen im Anhang sind fester Bestandteil des Abschlusses.
Etwaige Abweichungen bei den Prozentsätzen des Nettovermögens sind auf Rundungen zurückzuführen.

Cleome Index

Cleome Index Euro Government Bonds

Geografische und wirtschaftliche Zusammensetzung des Wertpapierbestandes zum 31. Dezember 2021

Geografische Zusammensetzung (in % des Nettovermögens)

Frankreich	24.94
Italien	21.05
Deutschland	16.50
Spanien	14.35
Belgien	5.96
Niederlande	5.46
Österreich	3.91
Portugal	2.26
Irland	2.22
Finnland	1.99
	98.63

Wirtschaftliche Zusammensetzung (in % des Nettovermögens)

Anleihen von Staaten, Provinzen und Gemeinden	98.63
	98.63

Cleome Index

Cleome Index Euro Long Term Bonds

Anlageportfolio zum 31. Dezember 2021

Bezeichnung	Anzahl	Währung	Marktwert (in EUR)	% des NV
Übertragbare Wertpapiere, die zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden				
Anleihen				
Österreich				
AUSTRIA 0.00 20-40 20/10A	80,000	EUR	73,084	0.52
AUSTRIA 2.40 13-34 23/05A	40,000	EUR	50,752	0.36
AUSTRIA 3.80 12-62 26/01A	185,000	EUR	379,209	2.69
AUSTRIA 4.15 06-37 15/03A	60,000	EUR	94,535	0.67
REPUBLIC OF AUS 0.2500 21-36 20/10A	20,000	EUR	19,532	0.14
			617,112	4.38
Belgien				
BELGIUM 0.4000 20-40 22/06A	120,000	EUR	114,154	0.81
BELGIUM 1.60 16-47 22/06A	150,000	EUR	175,038	1.24
BELGIUM 2.15 16-66 22/06A	85,000	EUR	118,154	0.84
BELGIUM 3.75 13-45 22/06A	70,000	EUR	114,709	0.81
BELGIUM 4.25 10-41 28/03A	140,000	EUR	230,677	1.64
BELGIUM 5.00 04-35 28/03A	210,000	EUR	336,936	2.39
			1,089,668	7.73
Finnland				
FINLAND 0.125 20-36 15/04A	80,000	EUR	77,744	0.55
FINLAND 1.375 17-47 15/04A	80,000	EUR	98,592	0.70
			176,336	1.25
Frankreich				
FRANCE 1.25 18-34 25/05A	495,000	EUR	547,901	3.89
FRANCE 1.50 18-50 25/05A	320,000	EUR	371,058	2.63
FRANCE 1.75 15-66 25/05A	130,000	EUR	163,138	1.16
FRANCE 1.75 17-39 25/06A	550,000	EUR	664,466	4.71
FRANCE 2.00 17-48 25/05A	130,000	EUR	167,148	1.19
FRANCE 3.25 12-45 25/05A	230,000	EUR	354,969	2.52
FRANCE 4.00 04-55 25/04A	110,000	EUR	206,940	1.47
FRANCE 4.00 09-60 25/04A	100,000	EUR	197,455	1.40
FRANCE 4.50 09-41 25/04A	275,000	EUR	470,400	3.34
FRANCE 5.75 00-32 25/10A	260,000	EUR	415,353	2.95
FRANCE ZCP 290420	135,000	EUR	129,055	0.92
			3,687,883	26.16
Deutschland				
GERMANY 0.00 19-50 15/08U	130,000	EUR	123,894	0.88
GERMANY 0.00 20-35 15/05A	20,000	EUR	20,045	0.14
GERMANY 0.00 21-52 15/08A	60,000	EUR	56,588	0.40
GERMANY 1.25 17-48 15/08A	190,000	EUR	245,103	1.74
GERMANY 2.50 12-44 04/07A	250,000	EUR	389,455	2.76
GERMANY 2.50 14-46 15/08A	220,000	EUR	350,798	2.49
GERMANY 4.00 05-37 04/01A	270,000	EUR	437,752	3.11
GERMANY 4.25 07-39 04/07A	160,000	EUR	281,614	2.00
GERMANY 4.75 03-34 04/07A	200,000	EUR	325,362	2.31
			2,230,611	15.82
Irland				
IRELAND 1.30 18-33 15/05A	20,000	EUR	22,071	0.16
IRELAND 1.50 19-50 15/05A	50,000	EUR	57,615	0.41
IRELAND 1.70 17-37 15/05A	100,000	EUR	116,530	0.83
IRELAND 2.00 15-45 18/02A	50,000	EUR	63,718	0.45
			259,934	1.84
Italien				
BUONI POLIENNAL 3.8500 18-49 01/09S	170,000	EUR	238,638	1.69
ITALY 1.80 20-41 01/03S	160,000	EUR	161,610	1.15
ITALY 2.80 16-67 01/03S	215,000	EUR	242,782	1.72
ITALY 3.25 14-46 01/09S	220,000	EUR	278,734	1.98
ITALY 3.45 17-48 01/03S	130,000	EUR	170,715	1.21
ITALY 4.00 05-37 01/02S	405,000	EUR	539,944	3.83

Die Erläuterungen im Anhang sind fester Bestandteil des Abschlusses.

Etwasige Abweichungen bei den Prozentsätzen des Nettovermögens sind auf Rundungen zurückzuführen.

Cleome Index

Cleome Index Euro Long Term Bonds

Anlageportfolio zum 31. Dezember 2021

Bezeichnung	Anzahl	Wahrung	Marktwert (in EUR)	% des NV
ITALY 4.75 13-44 01/09S	20,000	EUR	30,996	0.22
ITALY 5.00 03-34 01/08S	270,000	EUR	383,901	2.72
ITALY 5.00 07-39 01/08S	370,000	EUR	560,876	3.98
ITALY 5.00 09-40 01/09S	170,000	EUR	261,221	1.85
			2,869,417	20.35
Niederlande				
NETHERLANDS 0.00 20-52 15/01A	185,000	EUR	168,465	1.19
NETHERLANDS 0.50 19-40 15/01A	20,000	EUR	21,275	0.15
NETHERLANDS 2.50 12-33 15/01A	170,000	EUR	216,707	1.54
NETHERLANDS 2.75 14-47 15/01A	105,000	EUR	170,452	1.21
NETHERLANDS 4.00 05-37 15/01A	140,000	EUR	221,402	1.57
			798,301	5.66
Portugal				
PORTUGAL 1.00 21-52 12/04A	15,000	EUR	13,638	0.10
PORTUGAL 2.25 18-34 18/04A	25,000	EUR	29,719	0.21
PORTUGAL 4.10 06-37 15/04A	100,000	EUR	147,972	1.05
PORTUGAL 4.10 15-45 15/02A	25,000	EUR	40,485	0.29
			231,814	1.64
Spanien				
SPAIN 1.85 19-35 05/03A	135,000	EUR	152,389	1.08
SPAIN 2.70 18-48 31/10A	105,000	EUR	137,792	0.98
SPAIN 2.90 16-46 31/10A	150,000	EUR	202,569	1.44
SPAIN 3.45 16-66 30/07A	180,000	EUR	271,228	1.92
SPAIN 4.20 05-37 31/01A	160,000	EUR	235,212	1.67
SPAIN 4.70 09-41 30/07A	170,000	EUR	279,103	1.98
SPAIN 4.90 07-40 30/07A	290,000	EUR	481,915	3.42
SPAIN 5.15 13-44 31/10A	50,000	EUR	90,071	0.64
			1,850,279	13.12
Anleihen insgesamt			13,811,355	97.97
Gesamtsumme ubertragbarer Wertpapiere, die zur amtlichen Notierung an einer Borse zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden			13,811,355	97.97
Anlageportfolio insgesamt			13,811,355	97.97
Anschaffungskosten			13,337,574	

Die Erlauterungen im Anhang sind fester Bestandteil des Abschlusses.
Etwaige Abweichungen bei den Prozentsatzen des Nettovermogens sind auf Rundungen zuruckzufuhren.

Cleome Index

Cleome Index Euro Long Term Bonds

Geografische und wirtschaftliche Zusammensetzung des Wertpapierbestandes zum 31. Dezember 2021

Geografische Zusammensetzung (in % des Nettovermögens)

Frankreich	26.16
Italien	20.35
Deutschland	15.82
Spanien	13.12
Belgien	7.73
Niederlande	5.66
Österreich	4.38
Irland	1.84
Portugal	1.64
Finnland	1.25
	97.97

Wirtschaftliche Zusammensetzung (in % des Nettovermögens)

Anleihen von Staaten, Provinzen und Gemeinden	97.57
Nicht klassifizierbare Institutionen	0.40
	97.97

Cleome Index

Cleome Index Euro Short Term Bonds

Anlageportfolio zum 31. Dezember 2021

Bezeichnung	Anzahl	Währung	Marktwert (in EUR)	% des NV
Übertragbare Wertpapiere, die zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden				
Anleihen				
Österreich				
AUSTRIA 0.00 16-23 15/07U	700,000	EUR	707,374	0.67
AUSTRIA 0.00 20-23 20/04A	900,000	EUR	907,808	0.86
AUSTRIA 1.65 14-24 21/10A	1,000,000	EUR	1,063,940	1.01
AUSTRIA 1.75 13-23 20/10A	400,000	EUR	417,700	0.39
AUSTRIA 3.40 12-22 22/11A	1,000,000	EUR	1,035,970	0.98
REPUBLIC OF AUS 0.0000 19-24 15/07A	500,000	EUR	507,618	0.48
			4,640,410	4.39
Belgien				
BELGIUM 0.20 16-23 22/10A	1,700,000	EUR	1,725,364	1.63
BELGIUM 0.50 17-24 22/10A	700,000	EUR	721,466	0.68
BELGIUM 2.25 13-23 22/06A	1,900,000	EUR	1,981,643	1.87
BELGIUM 4.25 12-22 28/09A	900,000	EUR	933,160	0.88
			5,361,633	5.07
Finnland				
FINLAND 0.00 16-23 15/09U	1,300,000	EUR	1,313,247	1.24
FINLAND 1.50 13-23 15/04A	500,000	EUR	514,150	0.49
			1,827,397	1.73
Frankreich				
FRANCE 0.0 18-24 25/03A	2,000,000	EUR	2,026,070	1.92
FRANCE 0.00 17-23 25/03A	3,500,000	EUR	3,528,753	3.34
FRANCE 0.00 21-24 25/02A	2,700,000	EUR	2,733,156	2.58
FRANCE 1.75 12-23 25/05A	3,000,000	EUR	3,100,545	2.93
FRANCE 1.75 13-24 25/11A	1,500,000	EUR	1,599,442	1.51
FRANCE 2.25 13-24 25/05A	3,500,000	EUR	3,739,855	3.54
FRANCE 20-23 25/02U	2,800,000	EUR	2,822,386	2.67
FRANCE 4.25 06-23 25/10A	2,000,000	EUR	2,178,720	2.06
FRANCE 8.50 92-23 25/04A	1,400,000	EUR	1,569,092	1.48
			23,298,019	22.03
Deutschland				
GERMANY 0.00 17-22 07/10U	1,000,000	EUR	1,005,215	0.95
GERMANY 0.00 19-24 18/10A	1,500,000	EUR	1,527,735	1.44
GERMANY 0.00 19-24 25/01A	1,500,000	EUR	1,523,400	1.44
GERMANY 0.00 20-22 16/09A	2,000,000	EUR	2,010,170	1.90
GERMANY 1.50 13-23 15/02A	3,700,000	EUR	3,793,332	3.59
GERMANY 1.50 13-23 15/05U	4,500,000	EUR	4,635,787	4.38
GERMANY 1.75 14-24 15/02A	2,500,000	EUR	2,630,250	2.49
			17,125,889	16.19
Irland				
IRELAND 3.90 13-23 20/03A	1,400,000	EUR	1,474,200	1.39
			1,474,200	1.39
Italien				
ITALY 0.00 20-24 15/01S	4,900,000	EUR	4,909,236	4.64
ITALY 1.75 19-24 01/07S	2,600,000	EUR	2,712,645	2.56
ITALY 2.50 14-24 01/12S	1,500,000	EUR	1,605,758	1.52
ITALY 3.75 14-24 01/09S	2,000,000	EUR	2,198,200	2.08
ITALY 4.75 08-23 01/08S	3,000,000	EUR	3,240,345	3.06
ITALY 9.00 93-23 01/11S	4,000,000	EUR	4,673,260	4.42
ITALY BTP 0.95 16-23 15/03S	2,000,000	EUR	2,032,650	1.92
ITALY BTP 1.45 15-22 15/09S	2,000,000	EUR	2,026,990	1.92
			23,399,084	22.12
Luxemburg				
BUNDSOBLIGATION 0.0 18-23 13/10A	4,700,000	EUR	4,759,972	4.50
			4,759,972	4.50
Niederlande				
NETHERLANDS 0.00 17-24 15/01U	700,000	EUR	709,310	0.67
NETHERLANDS 3.75 06-23 15/01A	3,000,000	EUR	3,139,830	2.97

Die Erläuterungen im Anhang sind fester Bestandteil des Abschlusses.

Etwasige Abweichungen bei den Prozentsätzen des Nettovermögens sind auf Rundungen zurückzuführen.

Cleome Index

Cleome Index Euro Short Term Bonds

Anlageportfolio zum 31. Dezember 2021

Bezeichnung	Anzahl	Währung	Marktwert (in EUR)	% des NV
NETHERLANDS 7.50 93-23 15/01A	3,500,000	EUR	3,798,620	3.59
			7,647,760	7.23
Portugal				
PORTUGAL 5.65 13-24 15/02A	1,200,000	EUR	1,359,846	1.29
			1,359,846	1.29
Spanien				
SPAIN 0.00 20-23 30/04A	1,350,000	EUR	1,361,185	1.29
SPAIN 0.00 21-24 31/05A	1,500,000	EUR	1,515,435	1.43
SPAIN 0.25 19-24 30/07A	700,000	EUR	713,307	0.67
SPAIN 0.35 18-23 30/07A	1,500,000	EUR	1,522,478	1.44
SPAIN 2.75 14-24 31/10A	1,000,000	EUR	1,092,330	1.03
SPAIN 3.80 14-24 30/04A	1,500,000	EUR	1,651,897	1.56
SPAIN 4.40 13-23 31/10A	2,500,000	EUR	2,727,650	2.58
SPAIN 4.80 08-24 31/01A	1,750,000	EUR	1,945,755	1.84
			12,530,037	11.85
Anleihen insgesamt			103,424,247	97.79
Gesamtsumme übertragbarer Wertpapiere, die zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden			103,424,247	97.79
Anlageportfolio insgesamt			103,424,247	97.79
Anschaffungskosten			105,747,019	

Die Erläuterungen im Anhang sind fester Bestandteil des Abschlusses.
Etwaige Abweichungen bei den Prozentsätzen des Nettovermögens sind auf Rundungen zurückzuführen.

Cleome Index

Cleome Index Euro Short Term Bonds

Geografische und wirtschaftliche Zusammensetzung des Wertpapierbestandes zum 31. Dezember 2021

Geografische Zusammensetzung (in % des Nettovermögens)

Italien	22.12
Frankreich	22.03
Deutschland	16.19
Spanien	11.85
Niederlande	7.23
Belgien	5.07
Luxemburg	4.50
Österreich	4.39
Finnland	1.73
Irland	1.39
Portugal	1.29
	97.79

Wirtschaftliche Zusammensetzung (in % des Nettovermögens)

Anleihen von Staaten, Provinzen und Gemeinden	97.79
	97.79

Cleome Index

Cleome Index Europe Equities

Anlageportfolio zum 31. Dezember 2021

Bezeichnung	Anzahl	Währung	Marktwert (in EUR)	% des NV
Übertragbare Wertpapiere, die zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden				
Aktien				
Österreich				
ERSTE GROUP BANK AG	29,370	EUR	1,214,450	0.13
OMV AG	14,493	EUR	723,925	0.08
RAIFFEISEN BANK	12,795	EUR	331,135	0.04
VERBUND AG	6,599	EUR	652,641	0.07
VOESTALPINE AG	8,792	EUR	281,344	0.03
			3,203,495	0.35
Belgien				
AGEAS NOM	18,474	EUR	841,491	0.09
ANHEUSER-BUSCH INBEV	80,336	EUR	4,271,465	0.47
ELIA SYSTEM OPERATOR SA	2,332	EUR	269,812	0.03
GROUPE BRUXELLES LAMBERT GBL	8,417	EUR	826,213	0.09
KBC GROUPE SA	20,294	EUR	1,531,385	0.17
PROXIMUS SA	19,225	EUR	329,516	0.04
SOFINA SA	1,064	EUR	459,648	0.05
SOLVAY	5,557	EUR	567,925	0.06
UCB	13,583	EUR	1,363,054	0.15
UMICORE SA	19,242	EUR	687,902	0.08
			11,148,411	1.23
Dänemark				
A.P. MOELLER-MAERSK -A-	351	DKK	1,027,856	0.11
A.P. MOELLER-MAERSK A/S -B-	495	DKK	1,560,685	0.17
AMBU AS - BEARER -B-	16,006	DKK	372,303	0.04
CARLSBERG AS -B-	11,304	DKK	1,716,665	0.19
CHRISTIAN HANSEN	10,710	DKK	742,166	0.08
COLOPLAST -B-	10,152	DKK	1,571,065	0.17
DANSKE BANK	64,700	DKK	982,557	0.11
DEMANT A/S	8,523	DKK	384,003	0.04
DSV A/S	17,817	DKK	3,659,173	0.40
GENMAB AS	6,224	DKK	2,200,860	0.24
GN GREAT NORDIC	10,381	DKK	574,070	0.06
NOVO NORDISK	153,197	DKK	15,139,265	1.67
NOVOZYMES -B-	18,199	DKK	1,314,470	0.15
PANDORA	8,676	DKK	951,168	0.11
ROCKWOOL INT SHS -B-	1,007	DKK	387,224	0.04
TRYG A/S	20,487	DKK	444,855	0.05
VESTAS WIND SYSTEMS - BEARER AND/OR SHS	97,964	DKK	2,634,291	0.29
			35,662,676	3.94
Finnland				
ELISA CORPORATION -A-	8,043	EUR	435,287	0.05
FORTUM CORP	35,933	EUR	969,832	0.11
KESKO CORP	29,527	EUR	866,322	0.10
KONE -B-	33,985	EUR	2,142,414	0.24
NESTE	36,964	EUR	1,602,759	0.18
NOKIA OYJ	490,116	EUR	2,731,907	0.30
NORDEA BANK	268,695	SEK	2,883,722	0.32
ORION CORPORATION (NEW) -B-	10,927	EUR	399,054	0.04
SAMPO OYJ -A-	40,474	EUR	1,783,284	0.20
STORA ENSO -R-	68,323	EUR	1,102,733	0.12
UPM KYMMENE CORP	53,853	EUR	1,801,921	0.20
WARTSILA CORPORATION -B-	45,686	EUR	564,679	0.06
			17,283,914	1.91
Frankreich				
ACCOR SA	18,839	EUR	535,970	0.06
AEROPORTS DE PARIS-ADP-	2,919	EUR	330,723	0.04
AIR LIQUIDE SA	43,733	EUR	6,705,144	0.74

Die Erläuterungen im Anhang sind fester Bestandteil des Abschlusses.

Etwaige Abweichungen bei den Prozentsätzen des Nettovermögens sind auf Rundungen zurückzuführen.

Cleome Index

Cleome Index Europe Equities

Anlageportfolio zum 31. Dezember 2021

Bezeichnung	Anzahl	Währung	Marktwert (in EUR)	% des NV
ALSTOM SA	31,719	EUR	990,267	0.11
AMUNDI SA	6,375	EUR	462,506	0.05
ARKEMA SA	6,467	EUR	800,938	0.09
AXA SA	189,854	EUR	4,971,327	0.55
BIOMERIEUX SA	3,347	EUR	418,040	0.05
BNP PARIBAS SA	109,870	EUR	6,676,800	0.74
BOLLORE INVESTISSEMENT	123,646	EUR	608,338	0.07
BOUYGUES SA	26,206	EUR	825,227	0.09
BUREAU VERITAS SA	25,205	EUR	735,482	0.08
CAPGEMINI SE	14,707	EUR	3,169,358	0.35
CARREFOUR SA	84,321	EUR	1,357,990	0.15
CIE DE SAINT-GOBAIN	53,728	EUR	3,324,151	0.37
CNP ASSURANCES	15,719	EUR	341,888	0.04
COVIVIO SA	6,986	EUR	504,389	0.06
CREDIT AGRICOLE SA	130,711	EUR	1,640,423	0.18
DANONE SA	69,168	EUR	3,775,881	0.42
DASSAULT AVIA. --- SHS	6,614	EUR	628,330	0.07
DASSAULT SYST.	57,281	EUR	2,996,369	0.33
EDENRED SA	22,702	EUR	921,020	0.10
EDF SA	56,831	EUR	587,064	0.06
EIFFAGE	12,175	EUR	1,101,350	0.12
ENGIE SA	161,491	EUR	2,101,644	0.23
ESSILORLUXOTTICA SA	25,896	EUR	4,848,767	0.54
FAURECIA	13,333	EUR	557,719	0.06
GECINA	4,806	EUR	590,657	0.07
GETLINK ACT	44,584	EUR	649,143	0.07
HERMES INTERNATIONAL SA	2,647	EUR	4,065,792	0.45
IPSEN	4,840	EUR	389,620	0.04
KERING	6,997	EUR	4,946,179	0.55
KLEPIERRE SA	25,770	EUR	537,304	0.06
LEGRAND SA	29,983	EUR	3,085,251	0.34
L'OREAL SA	23,337	EUR	9,730,362	1.07
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	25,394	EUR	18,461,438	2.04
MICHELIN SA REG SHS	14,851	EUR	2,140,772	0.24
ORANGE	224,565	EUR	2,113,830	0.23
ORPEA SA	6,378	EUR	561,902	0.06
PERNOD RICARD SA	21,165	EUR	4,476,398	0.49
PUBLICIS GROUPE	23,730	EUR	1,404,816	0.16
REMY COINTREAU	2,634	EUR	563,676	0.06
RENAULT SA	25,249	EUR	771,231	0.09
SANOFI	112,715	EUR	9,984,295	1.10
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	2,661	EUR	1,283,666	0.14
SCHNEIDER ELECTRIC SE	54,092	EUR	9,328,706	1.03
SEB SA	2,460	EUR	336,774	0.04
SOCIETE GENERALE SA	80,034	EUR	2,417,427	0.27
SODEXO SA	9,125	EUR	703,172	0.08
SUEZ ACT.	27,213	EUR	539,090	0.06
TELEPERFORMANCE SE	5,628	EUR	2,206,176	0.24
TOTALENERGIESSE	233,700	EUR	10,430,031	1.15
UBISOFT ENTERTAINMENT	10,091	EUR	434,619	0.05
UNIBAIL RODAMCO	13,726	EUR	845,796	0.09
VALEO SA	25,067	EUR	666,281	0.07
VEOLIA ENVIRONNEMENT SA	51,796	EUR	1,670,939	0.18
VINCI SA	54,506	EUR	5,064,152	0.56
VIVENDI SA	58,050	EUR	690,214	0.08
WENDEL SA	1,641	EUR	172,961	0.02
WORLDDLINE SA	21,982	EUR	1,076,358	0.12
			154,256,133	17.04

Die Erläuterungen im Anhang sind fester Bestandteil des Abschlusses.

Etwasige Abweichungen bei den Prozentsätzen des Nettovermögens sind auf Rundungen zurückzuführen.

Cleome Index

Cleome Index Europe Equities

Anlageportfolio zum 31. Dezember 2021

Bezeichnung	Anzahl	Währung	Marktwert (in EUR)	% des NV
Deutschland				
ADIDAS AG NAMEN AKT	17,889	EUR	4,529,495	0.50
ALLIANZ SE REG SHS	39,776	EUR	8,259,486	0.91
BASF SE REG SHS	95,278	EUR	5,886,275	0.65
BECHTLE	6,453	EUR	406,152	0.04
BEIERSDORF AG	9,176	EUR	829,327	0.09
BMW AG	34,994	EUR	3,096,619	0.34
BMW VORZUG - STIMMRECHTSLOS	10,665	EUR	781,744	0.09
BRENNTAG - NAMEN AKT	20,591	EUR	1,638,632	0.18
CARL ZEISS MEDITEC AG	3,480	EUR	643,278	0.07
COMMERZBK	73,636	EUR	492,551	0.05
CONTINENTAL AG	10,661	EUR	992,646	0.11
COVESTRO AG	19,116	EUR	1,036,087	0.11
DAIMLER AG NAMEN-AKT	79,894	EUR	5,400,035	0.60
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	40,712	EUR	1,314,590	0.15
DELIVERY HERO	14,654	EUR	1,436,092	0.16
DEUTSCHE BANK AG NAMEN-AKT	202,465	EUR	2,230,759	0.25
DEUTSCHE BOERSE AG REG SHS	16,113	EUR	2,370,222	0.26
DEUTSCHE LUFTHANSA AG REG SHS	14,757	EUR	91,198	0.01
DEUTSCHE POST AG REG SHS	96,619	EUR	5,462,838	0.60
DEUTSCHE TELEKOM AG REG SHS	338,511	EUR	5,517,729	0.61
E.ON SE	237,684	EUR	2,897,843	0.32
EVONIK INDUSTRIES	25,484	EUR	725,529	0.08
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	24,346	EUR	1,391,130	0.15
FRESENIUS SE	44,994	EUR	1,592,788	0.18
FUCHS PETROLUB	8,863	EUR	353,811	0.04
GEA GROUP AG	13,792	EUR	663,257	0.07
HANNOVER RUECK SE	5,082	EUR	849,456	0.09
HELLOFRESH SE	15,717	EUR	1,061,526	0.12
HENKEL AG & CO KGAA	9,970	EUR	684,939	0.08
HENKEL AG & CO KGAA	19,132	EUR	1,361,050	0.15
INFINEON TECHNOLOGIES REG SHS	119,006	EUR	4,850,685	0.54
KION GROUP AG	7,321	EUR	706,330	0.08
KNORR-BREMSE - BEARER SHS	7,225	EUR	627,852	0.07
LANXESS AG	9,512	EUR	518,404	0.06
LEG IMMOBILIEN - NAMEN AKT	6,197	EUR	760,372	0.08
MERCK KGAA	11,588	EUR	2,630,476	0.29
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	6,256	EUR	1,122,326	0.12
MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS AG REG SHS	13,393	EUR	3,488,876	0.39
NEMETSCHKE	4,143	EUR	467,330	0.05
PUMA AG	8,046	EUR	864,945	0.10
RATIONAL NAMEN	495	EUR	445,698	0.05
SAP AG	96,076	EUR	11,999,892	1.33
SARTORIUS VORZ.OHNE STIMMRECHT.	2,330	EUR	1,386,816	0.15
SCOUT24	6,803	EUR	417,840	0.05
SIEMENS AG REG	74,236	EUR	11,334,352	1.25
SIEMENS ENERGY - REGISTERED SHS	43,936	EUR	988,121	0.11
SIEMENS HEALTHINEERS	25,225	EUR	1,660,310	0.18
SYMRISE AG	11,712	EUR	1,526,074	0.17
TELEFONICA NAMEN AKT	99,423	EUR	242,692	0.03
UNITED INTERNET AG REG SHS	5,873	EUR	205,203	0.02
VOLKSWAGEN AG	2,736	EUR	706,982	0.08
VOLKSWAGEN AG VORZ.AKT	19,424	EUR	3,447,372	0.38
VONOVIA SE	70,377	EUR	3,413,284	0.38
ZALANDO SE	19,611	EUR	1,395,127	0.15
			119,204,443	13.16
Irland				
CRH PLC	72,468	EUR	3,371,211	0.37
DCC PLC	13,917	GBP	1,002,833	0.11

Die Erläuterungen im Anhang sind fester Bestandteil des Abschlusses.

Etwaige Abweichungen bei den Prozentsätzen des Nettovermögens sind auf Rundungen zurückzuführen.

Cleome Index

Cleome Index Europe Equities

Anlageportfolio zum 31. Dezember 2021

Bezeichnung	Anzahl	Währung	Marktwert (in EUR)	% des NV
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	15,434	EUR	2,145,326	0.24
KERRY GROUP -A-	15,928	EUR	1,803,846	0.20
KINGSPAN GROUP	14,657	EUR	1,538,985	0.17
SMURFIT KAPPA PLC	24,620	EUR	1,192,593	0.13
			11,054,794	1.22
Isle of Man				
ENTAIN PLC	56,850	GBP	1,139,573	0.13
			1,139,573	0.13
Italien				
AMPLIFON SPA	10,004	EUR	474,690	0.05
ASSICURAZIONI GENERALI SPA	94,545	EUR	1,761,373	0.19
DIASORIN	1,958	EUR	327,867	0.04
ENEL SPA	781,315	EUR	5,505,145	0.61
ENI SPA	196,942	EUR	2,406,631	0.27
FINECOBANK	24,453	EUR	377,432	0.04
INTESA SANPAOLO	1,547,007	EUR	3,517,894	0.39
MEDIOBANCA	49,069	EUR	496,088	0.05
NEXI SPA	37,843	EUR	529,424	0.06
POSTE ITALIANE SPA	43,133	EUR	497,755	0.05
PRYSMIAN SPA	33,161	EUR	1,097,961	0.12
RECORDATI SPA	12,201	EUR	689,356	0.08
SNAM SPA	257,362	EUR	1,364,019	0.15
TELECOM ITALIA	1,070,549	EUR	464,832	0.05
TERNA SPA	151,641	EUR	1,078,774	0.12
UNICREDIT SPA REGS	199,915	EUR	2,707,649	0.30
			23,296,890	2.57
Jersey				
FERGUSON NEWCO PLC	23,144	GBP	3,612,460	0.40
WPP PLC	124,575	GBP	1,661,049	0.18
			5,273,509	0.58
Luxemburg				
ARCELORMITTAL SA	13,852	EUR	389,865	0.04
AROUNDTOWN SA	137,887	EUR	733,559	0.08
CNH INDUSTRIAL NV	109,379	EUR	1,867,100	0.21
EUROFINS SCIENTIFIC SE	12,518	EUR	1,361,958	0.15
LA FRANCAISE DES JEUX SA	7,847	EUR	305,562	0.03
MONCLER SPA	17,283	EUR	1,106,458	0.12
ORSTED	17,534	DKK	1,968,968	0.22
TENARIS SA - REG.SHS	52,694	EUR	485,312	0.05
			8,218,782	0.91
Niederlande				
ABN AMRO GROUP DEP RECEIPT	33,928	EUR	438,214	0.05
ADYEN --- PARTS SOCIALES	1,791	EUR	4,139,896	0.46
AEGON NV	203,059	EUR	892,038	0.10
AKZO NOBEL NV	18,324	EUR	1,768,266	0.20
ARGENX SE	4,249	EUR	1,339,710	0.15
ASM INTERNATIONAL NV	4,059	EUR	1,577,733	0.17
ASML HOLDING NV	37,729	EUR	26,663,084	2.94
DAVIDE CAMPARI-MILANO N.V.	60,268	EUR	774,745	0.09
DSM KONINKLIJKE	15,322	EUR	3,033,756	0.34
EURONEXT NV	5,301	EUR	483,716	0.05
EXOR REG	12,841	EUR	1,013,925	0.11
FERRARI NV	10,109	EUR	2,299,798	0.25
HEINEKEN HOLDING	15,649	EUR	1,269,916	0.14
HEINEKEN NV	26,666	EUR	2,636,201	0.29
IMCD	4,976	EUR	968,827	0.11
ING GROUP NV	346,408	EUR	4,240,727	0.47
JUST EAT TAKEAWAY.COM N.V	16,619	EUR	805,523	0.09
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	103,221	EUR	3,110,565	0.34

Die Erläuterungen im Anhang sind fester Bestandteil des Abschlusses.

Etwasige Abweichungen bei den Prozentsätzen des Nettovermögens sind auf Rundungen zurückzuführen.

Cleome Index

Cleome Index Europe Equities

Anlageportfolio zum 31. Dezember 2021

Bezeichnung	Anzahl	Währung	Marktwert (in EUR)	% des NV
KONINKLIJKE KPN NV	285,516	EUR	779,459	0.09
NN GROUP NV	26,134	EUR	1,244,240	0.14
PROSUS NV	86,536	EUR	6,362,992	0.70
QIAGEN REGD EUR	20,109	EUR	985,140	0.11
RANDSTAD BR	12,447	EUR	747,318	0.08
ROYAL PHILIPS NV	86,381	EUR	2,830,273	0.31
STELLANTIS N.V.-BEARER & REGISTERED SHS	199,618	EUR	3,330,826	0.37
STMICROELECTRONICS NV	63,364	EUR	2,748,097	0.30
UNIVERSAL MUSIC GROUP N.V.	57,641	EUR	1,428,344	0.16
WOLTERS KLUWER NV	20,438	EUR	2,117,377	0.23
			80,030,706	8.84
Norwegen				
ADEVINTA ASA - REGISTERED SHS	28,922	NOK	338,303	0.04
AKER BP SHS	8,707	NOK	235,818	0.03
DNB BK ASA	81,020	NOK	1,632,010	0.18
EQUINOR ASA	88,645	NOK	2,085,266	0.23
MOWI ASA	47,659	NOK	991,851	0.11
NORSK HYDRO ASA	143,570	NOK	995,297	0.11
ORKLA ASA	105,607	NOK	930,524	0.10
SCHIBSTED -B-	15,892	NOK	470,667	0.05
TELENOR ASA	63,690	NOK	880,265	0.10
YARA INTERNATIONAL ASA	11,219	NOK	497,844	0.05
			9,057,845	1.00
Portugal				
BANCO ESPIRIT SANTO	548,704	EUR	0	0.00
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA - REG.SHS	268,908	EUR	1,299,363	0.14
GALP ENERGIA SA REG SHS -B-	39,410	EUR	335,773	0.04
JERONIMO MARTINS SGPS SA	26,790	EUR	538,479	0.06
			2,173,615	0.24
Spanien				
ACS	28,625	EUR	674,691	0.07
AENA SME SA	7,883	EUR	1,094,160	0.12
AMADEUS IT GROUP SA -A-	40,683	EUR	2,426,334	0.27
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA	620,116	EUR	3,255,609	0.36
BANCO SANTANDER SA REG SHS	1,664,972	EUR	4,895,850	0.54
CAIXABANK SA	435,844	EUR	1,052,127	0.12
CELLNEX TELECOM SA	42,498	EUR	2,175,048	0.24
EDP RENOVAVEIS SA	27,053	EUR	592,461	0.07
ENAGAS	33,192	EUR	677,117	0.07
FERROVIAL SA	42,177	EUR	1,162,398	0.13
GAMESA CORPORACION TECNOLOGICA SA	26,300	EUR	554,141	0.06
GRIFOLS SA -A-	37,309	EUR	629,589	0.07
IBERDROLA SA	560,830	EUR	5,838,240	0.64
INDITEX SHARE FROM SPLIT	100,810	EUR	2,876,109	0.32
NATURGY ENERGY GROUP SA	14,732	EUR	421,777	0.05
RED ELECTRICA	43,614	EUR	829,756	0.09
REPSOL SA	108,601	EUR	1,133,360	0.13
TELEFONICA SA	537,339	EUR	2,069,830	0.23
			32,358,597	3.57
Schweden				
ALFA LAVAL	29,036	SEK	1,027,653	0.11
ASSA ABLOY -B- NEW I	108,689	SEK	2,915,686	0.32
ATLAS COPCO AB - REGS -A-	55,930	SEK	3,399,475	0.38
ATLAS COPCO AB - REGS -B-	41,983	SEK	2,170,100	0.24
BOLIDEN AB	39,741	SEK	1,350,947	0.15
ELECTROLUX AB	20,588	SEK	438,915	0.05
EMBRACER GRP --- REGISTERED SHS	41,753	SEK	391,374	0.04
EPIROC --- REGISTERED SHS -A-	86,313	SEK	1,921,420	0.21
EQT AB	25,161	SEK	1,204,776	0.13

Die Erläuterungen im Anhang sind fester Bestandteil des Abschlusses.

Etwasige Abweichungen bei den Prozentsätzen des Nettovermögens sind auf Rundungen zurückzuführen.

Cleome Index

Cleome Index Europe Equities

Anlageportfolio zum 31. Dezember 2021

Bezeichnung	Anzahl	Währung	Marktwert (in EUR)	% des NV
ESSITY AB REGISTERED -B-	52,266	SEK	1,499,551	0.17
EVOLUTION AB	16,100	SEK	2,011,249	0.22
FASTIGHETS AB BALDER -B-	7,697	SEK	487,267	0.05
GETINGE -B-	18,875	SEK	724,312	0.08
HENNES AND MAURITZ AB	74,232	SEK	1,283,919	0.14
HEXAGON --- REGISTERED SHS -B-	175,952	SEK	2,454,886	0.27
HUSQVARNA -B-	39,642	SEK	557,706	0.06
INDUSTRIVAERDEN AB -A- FREE	6,189	SEK	173,359	0.02
INDUSTRIVAERDEN -C- FREE	26,409	SEK	728,710	0.08
INVESTOR --- REGISTERED SHS -B-	225,444	SEK	4,986,876	0.55
KINNEVIK AB	21,931	SEK	687,474	0.08
LATOUR INVESTMENT REGISTERED B	19,549	SEK	700,050	0.08
LIFCO AB	25,203	SEK	662,631	0.07
LUNDBERGFOERETAGEN -B- FREE	4,610	SEK	227,455	0.03
LUNDIN ENERGY AB	18,743	SEK	590,725	0.07
NIBE INDUSTRIER	135,675	SEK	1,802,016	0.20
SAGAX -B-	11,383	SEK	337,200	0.04
SANDVIK AB	110,555	SEK	2,712,334	0.30
SECURITAS -B- FREE	35,585	SEK	430,815	0.05
SINCH	47,569	SEK	531,779	0.06
SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN -A-	129,860	SEK	1,587,304	0.18
SKANSKA -B- FREE	34,997	SEK	796,066	0.09
SKF AB -B-	38,985	SEK	812,188	0.09
SVENSKA CELLULOSA SCA AB-SHS-B-	64,071	SEK	1,000,332	0.11
SVENSKA HANDELSBANKEN AB-A-	123,121	SEK	1,170,223	0.13
SWEDBANK -A-	75,056	SEK	1,327,476	0.15
TELE2 AB	35,560	SEK	445,882	0.05
TELEFON ERICSSON	274,314	SEK	2,658,682	0.29
TELIA COMPANY AB	200,597	SEK	689,796	0.08
VOLVO AB -B-	163,367	SEK	3,326,524	0.37
			52,225,133	5.77
Schweiz				
ABB LTD REG SHS	169,595	CHF	5,712,364	0.63
ADECCO REG.SHS	19,272	CHF	866,742	0.10
ALCON - REGISTERED SHS	44,200	CHF	3,444,200	0.38
BACHEM HLDG -B- NAM.AKT	480	CHF	331,689	0.04
BALOISE HOLDING REG.SHS	3,724	CHF	535,876	0.06
BARRY CALLEBAUT - NAMEN-AKT	427	CHF	913,219	0.10
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT & SP PARTIZIPSCH	99	CHF	1,206,746	0.13
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT & SP REGS	10	CHF	1,179,366	0.13
CIE FINANCIERE RICHEMONT NAMEN AKT	46,917	CHF	6,201,113	0.68
CLARIANT NAMEN AKT	22,962	CHF	421,057	0.05
COCA COLA HBC NAMEN	36,035	GBP	1,096,587	0.12
CREDIT SUISSE GROUP AG REG SHS	272,940	CHF	2,337,040	0.26
EMS-CHEM HOLDINGS-NAMEN ACT.	681	CHF	671,043	0.07
GEBERIT AG	4,093	CHF	2,943,689	0.33
GIVAUDAN SA REG.SHS	813	CHF	3,759,973	0.42
JULIUS BAER GROUP NAMEN AKT	20,698	CHF	1,222,124	0.13
KUEHNE + NAGEL INTERNATIONAL AG	5,055	CHF	1,436,271	0.16
LOGITECH NAMEN AKT	15,941	CHF	1,182,786	0.13
LONZA GROUP (CHF)	6,801	CHF	4,998,930	0.55
NESTLE SA REG SHS	260,080	CHF	31,988,221	3.53
NOVARTIS AG REG SHS	196,927	CHF	15,257,733	1.69
PARTNERS GROUP HLDG NAMEN AKT	1,878	CHF	2,741,374	0.30
ROCHE HOLDING LTD	67,177	CHF	24,578,295	2.71
SCHINDLER HOLDING NAMEN AKT	1,843	CHF	434,714	0.05
SCHINDLER HOLDING SA	3,896	CHF	923,098	0.10
SGS SA REG SHS	514	CHF	1,511,517	0.17

Die Erläuterungen im Anhang sind fester Bestandteil des Abschlusses.

Etwas Abweichungen bei den Prozentsätzen des Nettovermögens sind auf Rundungen zurückzuführen.

Cleome Index

Cleome Index Europe Equities

Anlageportfolio zum 31. Dezember 2021

Bezeichnung	Anzahl	Wahrung	Marktwert (in EUR)	% des NV
SIKA - REGISTERED SHS	12,982	CHF	4,763,554	0.53
SONOVA HOLDING NAM-AKT	4,683	CHF	1,617,119	0.18
STRAUMANN HOLDING REG	866	CHF	1,618,918	0.18
SWISS LIFE HOLDING N-NAMEN REGISTERED	2,356	CHF	1,271,055	0.14
SWISS PRIME SITE AG-NAMEN AKT	5,033	CHF	435,466	0.05
SWISS RE REGS	28,538	CHF	2,485,972	0.27
SWISSCOM SHS NOM	1,950	CHF	968,460	0.11
TEMENOS AG NAM.AKT	5,816	CHF	707,530	0.08
THE SWATCH GROUP	3,989	CHF	1,074,102	0.12
UBS GROUP SA	346,303	CHF	5,487,907	0.61
VAT GROUP SA	2,136	CHF	936,735	0.10
VIFOR PHARMA - REGISTERED	4,986	CHF	780,754	0.09
ZURICH INSURANCE GROUP NAMEN AKT	13,338	CHF	5,154,210	0.57
			145,197,549	16.04
Grobritannien				
3I GROUP PLC	102,150	GBP	1,762,927	0.19
ABRDN PLC	286,078	GBP	820,822	0.09
ADMIRAL GROUP PLC	17,194	GBP	646,516	0.07
ANGLO AMERICAN PLC	150,533	GBP	5,407,426	0.60
ANTOFAGASTA PLC	59,608	GBP	950,278	0.10
ASHTREAD GROUP	47,306	GBP	3,347,931	0.37
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	43,347	GBP	1,036,693	0.11
ASTRAZENECA PLC	143,886	GBP	14,871,876	1.64
AUTO TRADER GROUP PLC	80,386	GBP	708,500	0.08
AVEVA GROUP	10,553	GBP	427,852	0.05
AVIVA PLC	442,137	GBP	2,161,184	0.24
BARCLAYS PLC	1,642,694	GBP	3,658,692	0.40
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	111,409	GBP	992,543	0.11
BHP GROUP-REGISTERED SHS	244,803	GBP	6,413,104	0.71
BP PLC	1,939,647	GBP	7,635,223	0.84
BRITISH LAND CO PLC REIT	106,814	GBP	675,539	0.07
BT GROUP PLC	867,067	GBP	1,750,967	0.19
BUNZL PLC	40,898	GBP	1,405,321	0.16
BURBERRY GROUP PLC	39,684	GBP	859,048	0.09
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS	22,332	EUR	1,096,055	0.12
COMPASS GROUP	167,733	GBP	3,298,323	0.36
CRODA INTL - REGISTERED SHS	11,783	GBP	1,420,247	0.16
DIAGEO PLC	226,326	GBP	10,879,606	1.20
EXPERIAN GROUP	85,657	GBP	3,705,410	0.41
GLAXOSMITHKLINE PLC	495,969	GBP	9,490,517	1.05
HALMA PLC	33,200	GBP	1,265,364	0.14
HARGREAVES LANS - REGISTERED SHS	31,649	GBP	510,772	0.06
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	19,142	GBP	505,909	0.06
HSBC HOLDINGS PLC	1,899,226	GBP	10,148,734	1.12
INFORMA PLC	155,644	GBP	957,667	0.11
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	16,239	GBP	924,710	0.10
INTERTEK GROUP PLC	15,814	GBP	1,060,419	0.12
J SAINSBURY PLC	283,944	GBP	932,727	0.10
JD SPORTS FASHION PLC	240,225	GBP	623,166	0.07
JOHNSON MATTHEY	26,268	GBP	640,118	0.07
KINGFISHER PLC	219,437	GBP	884,177	0.10
LAND SEC R.E.I.T	81,482	GBP	753,485	0.08
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	627,505	GBP	2,223,472	0.25
LLOYDS BANKING GROUP PLC	6,790,543	GBP	3,865,983	0.43
LSE GROUP	30,231	GBP	2,495,246	0.28
M AND G REGISTERED SHS	328,769	GBP	781,198	0.09
MELROSE INDUSTRIES PLC-ORDSHR 0.5	665,259	GBP	1,266,971	0.14
MONDI PLC	50,734	GBP	1,103,386	0.12

Die Erluterungen im Anhang sind fester Bestandteil des Abschlusses.

Etwaige Abweichungen bei den Prozentsatzen des Nettovermogens sind auf Rundungen zuruckzufuhren.

Cleome Index

Cleome Index Europe Equities

Anlageportfolio zum 31. Dezember 2021

Bezeichnung	Anzahl	Wahrung	Marktwert (in EUR)	% des NV
NATIONAL GRID PLC	358,000	GBP	4,518,919	0.50
NATWEST GROUP PLC - REGISTERED SHS	579,495	GBP	1,557,790	0.17
NEXT PLC	13,206	GBP	1,281,907	0.14
NMC HEALTH PLC	14,075	GBP	0	0.00
OCADO GROUP PLC	49,504	GBP	989,372	0.11
PEARSON PLC	76,491	GBP	558,650	0.06
PERSIMMON PLC	34,182	GBP	1,162,742	0.13
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC - REG SHS	84,567	GBP	657,922	0.07
PRUDENTIAL PLC	242,892	GBP	3,687,064	0.41
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	65,709	GBP	4,963,393	0.55
RELX PLC	177,228	GBP	5,070,291	0.56
RENTOKIL INITIAL PLC	163,951	GBP	1,140,393	0.13
RIO TINTO PLC	128,272	GBP	7,473,876	0.83
ROYAL DUTCH SHELL PLC	366,998	EUR	7,086,731	0.78
ROYAL DUTCH SHELL PLC -B-	348,178	GBP	6,728,013	0.74
SAGE GROUP	90,672	GBP	920,759	0.10
SCHRODERS	10,927	GBP	463,317	0.05
SEGRO (REIT)	89,968	GBP	1,539,293	0.17
SEVERN TRENT PLC	26,737	GBP	938,470	0.10
SMITH AND NEPHEW PLC	90,433	GBP	1,393,224	0.15
SPIRAX-SARCO ENGIN	6,751	GBP	1,290,538	0.14
SSE PLC	104,906	GBP	2,060,386	0.23
ST JAME'S PLACE CAPITAL	46,382	GBP	930,015	0.10
STANDARD CHARTERED PLC	270,437	GBP	1,444,306	0.16
TAYLOR WIMPEY PLC	482,377	GBP	1,008,304	0.11
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	11,912	GBP	677,463	0.07
UNILEVER	129,950	EUR	6,114,797	0.68
UNILEVER	114,630	GBP	5,386,764	0.59
UNITED UTILITIES GROUP PLC	72,918	GBP	945,780	0.10
VODAFONE GROUP PLC	2,852,956	GBP	3,814,588	0.42
WHITBREAD	22,236	GBP	793,197	0.09
Aktien insgesamt			192,964,368	21.31
Gesamtsumme ubertragbarer Wertpapiere, die zur amtlichen Notierung an einer Borse zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden			903,750,433	99.81
Sonstige ubertragbare Wertpapiere				
Rechte				
Grobritannien				
ROYAL DUTCH SHELL RECHTE	329,549	USD	0	0.00
			0	0.00
Rechte insgesamt			0	0.00
Sonstige ubertragbare Wertpapiere, insgesamt			0	0.00
Anlageportfolio insgesamt			903,750,433	99.81
Anschaffungskosten			680,433,290	

Die Erlauterungen im Anhang sind fester Bestandteil des Abschlusses.
Etwaige Abweichungen bei den Prozentsatzen des Nettovermogens sind auf Rundungen zuruckzufuhren.

Cleome Index

Cleome Index Europe Equities

Geografische und wirtschaftliche Zusammensetzung des Wertpapierbestandes zum 31. Dezember 2021

Geografische Zusammensetzung (in % des Nettovermögens)

Großbritannien	21.31
Frankreich	17.04
Schweiz	16.04
Deutschland	13.16
Niederlande	8.84
Schweden	5.77
Dänemark	3.94
Spanien	3.57
Italien	2.57
Finnland	1.91
Belgien	1.23
Irland	1.22
Norwegen	1.00
Luxemburg	0.91
Jersey	0.58
Österreich	0.35
Portugal	0.24
Isle of Man	0.13
	99.81

Wirtschaftliche Zusammensetzung (in % des Nettovermögens)

Pharmazeutika	14.26
Banken und andere Finanzinstitute	13.72
Lebensmittel und alkoholfreie Getränke	6.36
Versicherung	4.91
Erdöl	4.67
Chemikalien	4.59
Elektronik und Halbleiter	4.53
Versorger	4.46
Maschinen- und Apparatebau	3.97
Internet und Internet-Dienste	3.68
Textilien und Bekleidung	3.57
Kommunikation	3.44
Elektrotechnik	3.41
Baumaterialien	3.03
Tabak und alkoholische Getränke	2.94
Kraftfahrzeuge	2.84
Einzelhandel und Warenhäuser	2.17
Transport	1.89
NE-Metalle	1.60
Grafik und Verlage	1.43
Immobilien	1.27
Kohlebergbau und Stahlindustrie & Chemie	0.99
Sonstige Dienstleistungen	0.99
Sonstige Konsumgüter	0.96
Hotels und Restaurants	0.88
Papier und Forsterzeugnisse	0.84
Biotechnologie	0.65
Gesundheitswesen	0.60
Reifen und Kautschuk	0.35
Luft- und Raumfahrt	0.19
Landwirtschaft und Fischerei	0.16
Büroausstattung und Computer	0.13
Uhrenindustrie, Schmuck	0.12
Umweltdienste und Recycling	0.07
Edelmetalle und Edelsteine	0.07
Nicht klassifizierbare Institutionen	0.06
	99.81

Etwaige Abweichungen bei den Prozentsätzen des Nettovermögens sind auf Rundungen zurückzuführen.

Cleome Index

Cleome Index USA Equities

Anlageportfolio zum 31. Dezember 2021

Bezeichnung	Anzahl	Wahrung	Marktwert (in EUR)	% des NV
Übertragbare Wertpapiere, die zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden				
Aktien				
Bermuda				
ARCH CAPITAL GROUP LTD	15,491	USD	605,500	0.04
BUNGE LTD	8,005	USD	657,182	0.04
IHS MARKIT LTD	20,018	USD	2,339,775	0.15
			3,602,457	0.24
Kanada				
WASTE CONNECTIONS INC	8,277	USD	991,828	0.06
			991,828	0.06
Irland				
ACCENTURE - SHS CLASS A	26,729	USD	9,743,675	0.64
ALLEGION PLC WI	8,664	USD	1,009,022	0.07
AON - REGISTERED SHS (USD)	9,880	USD	2,611,267	0.17
EATON CORPORATION PUBLIC LIMITED COMPANY	23,724	USD	3,605,330	0.24
HORIZON THERAPEUTICS PLC	9,229	USD	874,531	0.06
JOHNSON CONTROLS INTL	43,898	USD	3,138,715	0.20
LINDE PLC	21,679	USD	6,604,165	0.43
MEDTRONIC HLD	59,584	USD	5,420,300	0.35
PENTAIR PLC	14,052	USD	902,407	0.06
TRANE TECH - REGISTERED SHS	13,781	USD	2,448,272	0.16
WILLIS TOWERS WATSON PLC	5,991	USD	1,251,145	0.08
			37,608,829	2.45
Jersey				
APTIV PLC	12,405	USD	1,799,336	0.12
NOVOCURE --- REGISTERED SHS	5,751	USD	379,691	0.02
			2,179,027	0.14
Liberia				
ROYAL CARIBBEAN CRUISES	11,408	USD	771,434	0.05
			771,434	0.05
Luxemburg				
LYFT INC	15,624	USD	587,068	0.04
PINTEREST REGISTERED SHS -A-	28,499	USD	910,956	0.06
ZENDESK INC	6,562	USD	601,786	0.04
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS INC	10,428	USD	1,686,435	0.11
			3,786,245	0.25
Niederlande				
LYONDELLBASELL -A-	11,662	USD	945,820	0.06
NXP SEMICONDUCTORS	10,605	USD	2,124,171	0.14
			3,069,991	0.20
Niederländische Antillen				
SCHLUMBERGER LTD	75,652	USD	1,992,418	0.13
			1,992,418	0.13
Panama				
CARNIVAL CORP	43,885	USD	776,439	0.05
			776,439	0.05
Schweiz				
CHUBB - NAMEN AKT	19,817	USD	3,368,646	0.22
GARMIN	6,921	USD	828,731	0.05
TE CONNECTIVITY LTD REG SHS	14,599	USD	2,071,230	0.14
			6,268,607	0.41
Großbritannien				
LIBERTY GLOBAL -C-	29,241	USD	722,283	0.05
SENSATA TECH(S) -REGISTERED SHS	7,913	USD	429,259	0.03
			1,151,542	0.08
Vereinigte Staaten von Amerika				
10X GENOMICS - REGS- A	4,334	USD	567,704	0.04
3M CO	30,574	USD	4,775,642	0.31
ABBOTT LABORATORIES	73,903	USD	9,146,244	0.60

Die Erluterungen im Anhang sind fester Bestandteil des Abschlusses.

Etwasige Abweichungen bei den Prozentsatzen des Nettovermogens sind auf Rundungen zuruckzufuhren.

Cleome Index

Cleome Index USA Equities

Anlageportfolio zum 31. Dezember 2021

Bezeichnung	Anzahl	Wahrung	Marktwert (in EUR)	% des NV
ABBVIE INC	72,508	USD	8,633,119	0.56
ACTIVISION BLIZZARD	35,939	USD	2,102,552	0.14
ADOBE INC	19,932	USD	9,939,008	0.65
ADVANCED MICRO DEVICES INC	50,457	USD	6,384,772	0.42
AFLAC INC	32,340	USD	1,660,511	0.11
AGILENT TECHNOLOGIES	15,923	USD	2,235,409	0.15
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	8,459	USD	2,263,221	0.15
AIRBNB INC	11,091	USD	1,623,761	0.11
AKAMAI TECHNOLOGIES	8,142	USD	837,970	0.05
ALBEMARLE - REGISTERED SHS	5,875	USD	1,207,702	0.08
ALEXANDRIA REAL ESTATE	5,329	USD	1,044,806	0.07
ALIGN TECHNOLOGY INC	3,069	USD	1,773,554	0.12
ALLSTATE CORP	15,258	USD	1,578,529	0.10
ALLY FINANCIAL INC	23,616	USD	988,707	0.06
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	5,707	USD	851,032	0.06
ALPHABET INC -A-	12,317	USD	31,377,807	2.05
ALPHABET INC -C-	11,578	USD	29,460,064	1.92
AMAZON.COM INC	18,419	USD	54,005,635	3.53
AMERICAN WATER WORKS CO INC	14,933	USD	2,479,992	0.16
AMERICAN EXPRESS	29,749	USD	4,279,754	0.28
AMERICAN INTL	44,272	USD	2,213,600	0.14
AMERICAN TOWER CORP	19,403	USD	4,990,659	0.33
AMERIPRISE FINANCIAL INC	5,439	USD	1,442,779	0.09
AMERISOURCEBERGEN CORP	6,786	USD	792,993	0.05
AMETEK INC	14,515	USD	1,876,790	0.12
AMGEN INC	24,123	USD	4,772,205	0.31
AMPHENOL -A-	20,458	USD	1,573,388	0.10
ANALOG DEVICES INC	20,467	USD	3,163,458	0.21
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	99,643	USD	685,199	0.04
ANSYS INC	3,791	USD	1,337,184	0.09
ANTHEM INC	10,644	USD	4,338,656	0.28
APPLE INC	669,052	USD	104,470,246	6.82
APPLIED MATERIALS INC	37,400	USD	5,175,223	0.34
AQUA AMERICA --- REGISTERED SHS	31,521	USD	1,488,184	0.10
ARCHER-DANIELS MIDLAND CO	19,131	USD	1,137,060	0.07
ARISTA NETWORKS INC	10,810	USD	1,366,459	0.09
ARTHUR J.GALLAGHER AN CO	8,949	USD	1,335,189	0.09
AT&T INC	329,179	USD	7,120,826	0.46
ATMOS ENERGY CORP	16,993	USD	1,565,562	0.10
AUTODESK INC	9,264	USD	2,290,665	0.15
AUTOMATIC DATA PROCESSING INC	17,812	USD	3,862,190	0.25
AUTOZONE INC	857	USD	1,579,851	0.10
AVALONBAY COMMUN	6,627	USD	1,471,961	0.10
AVANTOR - REGISTERED SHS	28,440	USD	1,053,871	0.07
BAKER HUGHES RG-A REGISTERED SHS -A-	45,696	USD	966,801	0.06
BALL CORP	18,110	USD	1,533,107	0.10
BANK OF AMERICA CORP	317,448	USD	12,419,330	0.81
BANK OF NY MELLON	41,234	USD	2,105,936	0.14
BAXTER INTERNATIONAL INC	22,122	USD	1,669,849	0.11
BECTON DICKINSON	12,894	USD	2,851,375	0.19
BERKSHIRE HATHAWAY -B-	53,896	USD	14,170,686	0.92
BEST BUY CO INC	11,560	USD	1,032,796	0.07
BIO RAD LABORATORIES -A-	1,142	USD	758,759	0.05
BIOGEN IDEC INC	6,691	USD	1,411,629	0.09
BIO-TECHNE CORP	2,367	USD	1,076,806	0.07
BLACKROCK INC	6,825	USD	5,494,809	0.36
BLACKSTONE INC - REGISTERED SHS	31,126	USD	3,541,499	0.23
BLOCK INC -A-	17,145	USD	2,435,006	0.16

Die Erlauterungen im Anhang sind fester Bestandteil des Abschlusses.

Etwaige Abweichungen bei den Prozentsatzen des Nettovermogens sind auf Rundungen zuruckzufuhren.

Cleome Index

Cleome Index USA Equities

Anlageportfolio zum 31. Dezember 2021

Bezeichnung	Anzahl	Wahrung	Marktwert (in EUR)	% des NV
BOOKING HOLDINGS INC	1,690	USD	3,565,511	0.23
BOSTON PROPERTIES INC	8,542	USD	865,167	0.06
BOSTON SCIENTIF CORP	59,666	USD	2,228,818	0.15
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	107,845	USD	5,912,888	0.39
BROADCOM INC - REGISTERED SHS	16,816	USD	9,839,549	0.64
BROADRIDGE FINANCIAL SOL -W/I	5,204	USD	836,612	0.05
BROWN-FORMAN CORP -B- NON VOTING	19,256	USD	1,233,725	0.08
BTH & BDY WRKS --- REGISTERED SHS	12,280	USD	753,624	0.05
BURLINGTON STORES INC	3,614	USD	926,413	0.06
CADENCE DESIGN SYSTEMS INC	12,392	USD	2,030,645	0.13
CAESARS ENTERTAINMENT - REGISTERED SHS	9,876	USD	812,260	0.05
CAMPBELL SOUP CO	18,130	USD	692,868	0.05
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	20,706	USD	2,641,781	0.17
CARDINAL HEALTH	15,165	USD	686,639	0.04
CARMAX INC	7,593	USD	869,536	0.06
CARRIER GLOBAL CORP-WI	43,502	USD	2,074,876	0.14
CATALENT	9,626	USD	1,083,729	0.07
CATERPILLAR - REGISTERED	26,523	USD	4,821,812	0.31
CBOE HOLDINGS INC	6,053	USD	694,083	0.05
CBRE GROUP	14,153	USD	1,350,459	0.09
CDW	6,545	USD	1,178,583	0.08
CENTENE CORP	25,647	USD	1,858,348	0.12
CENTERPOINT ENERGY	51,151	USD	1,255,386	0.08
CERIDIAN --- REGISTERED SHS	6,087	USD	559,135	0.04
CERNER CORP	15,036	USD	1,227,922	0.08
CHARLES RIVER LABORATORIES INTERNATIONAL	2,980	USD	987,341	0.06
CHARLES SCHWAB CORP/THE	64,265	USD	4,752,626	0.31
CHARTER COMM -A-	6,105	USD	3,500,068	0.23
CHENIERE ENERGY INC	16,293	USD	1,453,074	0.09
CHIPOTLE MEXICAN GRILL -A-	985	USD	1,514,269	0.10
CHURCH AND DWIGHT CO	12,939	USD	1,166,239	0.08
CIGNA CORPORATION - REGISTERED SHS	15,088	USD	3,046,656	0.20
CINCINNATI FINANCIAL CORP	7,113	USD	712,614	0.05
CINTAS	4,840	USD	1,886,161	0.12
CISCO SYSTEMS INC	186,027	USD	10,366,278	0.68
CITIGROUP INC	88,018	USD	4,674,118	0.31
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	24,495	USD	1,017,753	0.07
CITRIX SYSTEMS	8,059	USD	670,331	0.04
CLOROX CO	8,961	USD	1,373,936	0.09
CME GROUP -A-	16,712	USD	3,357,390	0.22
COCA-COLA CO	184,426	USD	9,602,412	0.63
COGNEX CORP	9,505	USD	649,937	0.04
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS -A-	20,797	USD	1,622,502	0.11
COLGATE-PALMOLIVE CO	37,553	USD	2,818,126	0.18
COMCAST CORP	199,851	USD	8,844,971	0.58
CONAGRA BRANDS INC	43,959	USD	1,320,084	0.09
CONOCOPHILLIPS CO	57,951	USD	3,678,248	0.24
CONSOLIDATED EDISON INC	34,782	USD	2,609,568	0.17
CONSTELLATION BRANDS INC -A-	7,497	USD	1,654,522	0.11
COPART INC	10,752	USD	1,433,537	0.09
CORNING INC	40,665	USD	1,331,303	0.09
CORTEVA - REGISTERED SHS	35,497	USD	1,475,816	0.10
COSTAR GROUP INC	19,623	USD	1,363,705	0.09
COSTCO WHOLESALE CORP	21,264	USD	10,615,171	0.69
COUPA SOFTWARE INC REG SHS	4,569	USD	635,007	0.04
CROWN CASTLE REIT	18,857	USD	3,461,317	0.23
CSX CORP	103,875	USD	3,434,488	0.22
CUMMINS - REGISTERED	9,825	USD	1,884,651	0.12

Die Erlauerungen im Anhang sind fester Bestandteil des Abschlusses.

Etwaige Abweichungen bei den Prozentsatzen des Nettovermogens sind auf Rundungen zuruckzufuhren.

Cleome Index

Cleome Index USA Equities

Anlageportfolio zum 31. Dezember 2021

Bezeichnung	Anzahl	Währung	Marktwert (in EUR)	% des NV
CVS HEALTH	56,668	USD	5,140,583	0.34
DANAHER CORP	28,406	USD	8,218,306	0.54
DARDEN RESTAURANTS INC	6,037	USD	799,695	0.05
DATADOG INC	9,051	USD	1,417,581	0.09
DEERE AND CO	13,943	USD	4,204,111	0.27
DELL TECHNOLOGIES-REGISTERED SHS C W/I	12,696	USD	627,097	0.04
DEVON ENERGY CORP	36,826	USD	1,426,473	0.09
DEXCOM INC	4,115	USD	1,942,973	0.13
DIAMONDBACK ENERGY	8,285	USD	785,734	0.05
DIGITAL REALTY TRUST INC	12,727	USD	1,979,445	0.13
DISCOVER FINANCIAL SERVICES - SHS WI	15,854	USD	1,611,052	0.11
DISCOVERY C	30,220	USD	608,546	0.04
DOCUSIGN INC	8,507	USD	1,139,378	0.07
DOLLAR GENERAL	10,318	USD	2,139,724	0.14
DOLLAR TREE INC	10,379	USD	1,282,498	0.08
DOMINION RESOURCES - REGSITERED	46,912	USD	3,240,773	0.21
DOMINO PIZZA INC	1,459	USD	724,022	0.05
DOVER CORP	11,152	USD	1,780,868	0.12
DOW - REGISTERED SHS	21,674	USD	1,081,032	0.07
DOWDUPONT - REGISTERED SHS WI	26,679	USD	1,895,119	0.12
DR HORTON	16,015	USD	1,527,283	0.10
EBAY INC	31,626	USD	1,849,392	0.12
ECOLAB INC	13,078	USD	2,697,826	0.18
EDISON INTERNATIONAL	32,621	USD	1,957,776	0.13
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	26,599	USD	3,030,162	0.20
ELANCO ANIMAL HEALTH	22,491	USD	561,286	0.04
ELECTRONIC ARTS - REGISTERED	12,798	USD	1,484,397	0.10
ELI LILLY & CO	34,557	USD	8,393,717	0.55
EMERSON ELECTRIC CO	39,222	USD	3,206,533	0.21
ENPHASE ENERGY --- REGISTERED SHS	5,400	USD	868,692	0.06
ENTERGY CORP	3,163	USD	313,324	0.02
EOG RESOURCES INC	26,570	USD	2,075,460	0.14
EPAM SYSTEMS	2,601	USD	1,528,877	0.10
EQTY RESIDENTIAL PPTYS TR SHS BEN.INT.	18,244	USD	1,451,884	0.09
EQUIFAX INC	6,063	USD	1,561,015	0.10
EQUINIX INC	3,962	USD	2,946,903	0.19
ESSEX PROPERTY TRUST	3,103	USD	961,106	0.06
ESTEE LAUDER COMPANIES INC -A-	10,697	USD	3,482,263	0.23
ETSY	5,769	USD	1,110,680	0.07
EVERSOURCE ENERGY	30,772	USD	2,461,868	0.16
EXACT SCIENCES CORP	9,177	USD	628,074	0.04
EXELON CORP	56,544	USD	2,871,950	0.19
EXPEDIA GROUP INC	7,530	USD	1,196,642	0.08
EXPEDITORS INTERNATIONAL OF WASHINGTON	9,802	USD	1,157,501	0.08
EXTRA SPACE STORAGE INC	5,827	USD	1,161,762	0.08
EXXON MOBIL CORP	197,744	USD	10,640,130	0.69
FAIR ISAAC CORP	2,064	USD	787,104	0.05
FASTENAL CO	36,277	USD	2,043,532	0.13
FEDEX CORP	11,089	USD	2,522,036	0.16
FIDELITY NATIONAL INFO SERVICES INC	29,958	USD	2,875,410	0.19
FIDL NAT FINANCL-A FNF GROUP WI	11,448	USD	525,287	0.03
FIFTH THIRD BANCORP	34,990	USD	1,339,971	0.09
FIRST REPUBLIC BANK	7,138	USD	1,296,226	0.08
FISERV INC	26,532	USD	2,421,523	0.16
FLEETCOR TECHNOLOGIES	4,304	USD	847,175	0.06
FMC CORP	9,967	USD	963,132	0.06
FORD MOTOR	170,477	USD	3,113,619	0.20
FORTINET	6,730	USD	2,126,945	0.14

Die Erläuterungen im Anhang sind fester Bestandteil des Abschlusses.

Etwache Abweichungen bei den Prozentsätzen des Nettovermögens sind auf Rundungen zurückzuführen.

Cleome Index

Cleome Index USA Equities

Anlageportfolio zum 31. Dezember 2021

Bezeichnung	Anzahl	Währung	Marktwert (in EUR)	% des NV
FORTIVE CORP	19,188	USD	1,287,243	0.08
FOX CORP -B-	28,435	USD	856,901	0.06
FRANKLIN RESOURCES INC	20,584	USD	606,189	0.04
GARTNER INC	3,464	USD	1,018,365	0.07
GENERAL ELECTRI	51,538	USD	4,281,388	0.28
GENERAL MILLS INC	40,216	USD	2,382,830	0.16
GENERAL MOTORS CO	59,689	USD	3,077,353	0.20
GENUINE PARTS CO	7,567	USD	932,900	0.06
GILEAD SCIENCES INC	56,147	USD	3,584,975	0.23
GLOBAL PAYMENTS INC	14,665	USD	1,743,242	0.11
GODADDY -A-	10,210	USD	761,889	0.05
HALLIBURTON	42,534	USD	855,393	0.06
HCA INC	10,855	USD	2,452,398	0.16
HCP - REGISTERED SHS	28,014	USD	889,048	0.06
HEICO -A-	8,115	USD	917,112	0.06
HERSHEY	8,884	USD	1,511,421	0.10
HESS CORP	14,012	USD	912,160	0.06
HILTON WORLDWIDE HLDGS INC REG SHS	11,710	USD	1,606,264	0.10
HOLOGIC INC	11,050	USD	743,922	0.05
HOME DEPOT INC	43,942	USD	16,036,202	1.05
HORMEL FOODS CORP	31,445	USD	1,349,657	0.09
HOST HOTELS & RESORTS - SHS	43,507	USD	665,307	0.04
HOWMET AEROSPC - REGISTERED SHS	24,980	USD	699,185	0.05
HP ENTERPRISE CO	79,210	USD	1,098,436	0.07
HP INC	58,551	USD	1,939,515	0.13
HUBSPOT INC	2,010	USD	1,165,047	0.08
HUMANA INC	5,504	USD	2,245,063	0.15
HUNTINGTON BANCSHARES INC	73,112	USD	991,371	0.06
IAC/INTERACTIVE	5,495	USD	631,596	0.04
IBM CORP	39,040	USD	4,588,539	0.30
IDEX CORP	6,468	USD	1,344,106	0.09
IDEXX LABS CORP	3,884	USD	2,248,908	0.15
ILLINOIS TOOL WORKS	17,856	USD	3,875,185	0.25
ILLUMINA INC	6,770	USD	2,264,842	0.15
INCYTE CORP	12,168	USD	785,377	0.05
INGERSOLL RAND INC	25,570	USD	1,391,150	0.09
INSULET	2,980	USD	697,229	0.05
INTEL CORP	166,350	USD	7,533,437	0.49
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	24,285	USD	2,920,735	0.19
INTERNATIONAL PAPER CO	15,340	USD	633,726	0.04
INTL FLAVORS & FRAG	14,273	USD	1,890,809	0.12
INTUIT	11,720	USD	6,629,035	0.43
INTUITIVE SURGICAL	14,616	USD	4,617,947	0.30
INVITATION HOMS REGISTERED	22,868	USD	911,744	0.06
IQVIA HOLDINGS INC	9,494	USD	2,355,467	0.15
IRON MOUNTAIN INC REIT	14,653	USD	674,280	0.04
J.M. SMUCKER CO SHS	9,148	USD	1,092,579	0.07
JOHNSON & JOHNSON	113,841	USD	17,125,202	1.12
JPMORGAN CHASE CO	124,323	USD	17,311,420	1.13
KELLOGG CO	22,930	USD	1,298,937	0.08
KEURIG DR PEPPR --- REGISTERED SHS	47,805	USD	1,549,501	0.10
KEYCORP	48,219	USD	980,747	0.06
KEYSIGHT TECHNOLOGIES	7,603	USD	1,380,668	0.09
KIMBERLY-CLARK CORP	16,735	USD	2,103,206	0.14
KINDER MORGAN INC	174,374	USD	2,431,913	0.16
KKR & CO -REGISTERED SHS	23,369	USD	1,530,945	0.10
KLA CORPORATION	6,066	USD	2,294,273	0.15
KROGER CO	56,583	USD	2,251,976	0.15

Die Erläuterungen im Anhang sind fester Bestandteil des Abschlusses.

Etwaige Abweichungen bei den Prozentsätzen des Nettovermögens sind auf Rundungen zurückzuführen.

Cleome Index

Cleome Index USA Equities

Anlageportfolio zum 31. Dezember 2021

Bezeichnung	Anzahl	Wahrung	Marktwert (in EUR)	% des NV
LABORATORY CORP OF AMERICA HOLDINGS	4,897	USD	1,353,048	0.09
LAM RESEARCH CORP	6,052	USD	3,827,203	0.25
LAS VEGAS SANDS CORP	22,146	USD	733,007	0.05
LENNAR CORP -A-	12,038	USD	1,229,629	0.08
LIBERTY BROADBAND CORP -C-	8,816	USD	1,248,907	0.08
LINCOLN NATIONAL CORP	10,920	USD	655,469	0.04
LIVE NATION ENT	10,179	USD	1,071,337	0.07
LOWE'S CO INC	29,153	USD	6,626,334	0.43
LULULEMON ATHLETICA INC SHS WHEN ISSUED	5,202	USD	1,790,646	0.12
LUMEN TECH - REGISTERED SHS	60,666	USD	669,503	0.04
M&T BANK CORPORATION	6,903	USD	932,257	0.06
MARATHON PETROLEUM	29,915	USD	1,683,311	0.11
MARKETAXESS HOLDING INC	2,642	USD	955,483	0.06
MARRIOTT INTERNATIONAL -A-	11,953	USD	1,736,822	0.11
MARSH MCLENNAN COS	21,480	USD	3,283,199	0.21
MARTIN MARIETTA	2,963	USD	1,147,785	0.07
MARVELL TECH --- REGISTERED SHS	33,741	USD	2,595,850	0.17
MASCO CORP	16,419	USD	1,013,843	0.07
MASTERCARD INC -A-	36,714	USD	11,600,488	0.76
MATCH GROUP INC	12,938	USD	1,504,617	0.10
MCCORMICK & CO INC NON VOTING	16,688	USD	1,417,717	0.09
MCDONALD'S CORP	29,668	USD	6,993,581	0.46
MCKESSON CORP	6,220	USD	1,359,572	0.09
MERCADOLIBRE	1,962	USD	2,326,381	0.15
MERCK & CO INC	113,737	USD	7,665,146	0.50
META PLATFOR -A-	97,412	USD	28,811,578	1.88
METLIFE INC	45,114	USD	2,479,048	0.16
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL	1,155	USD	1,723,776	0.11
MGM RESORTS INTL	19,316	USD	762,313	0.05
MICROCHIP TECHNOLOGY	23,266	USD	1,781,162	0.12
MICRON TECHNOLOGY INC	46,002	USD	3,768,103	0.25
MICROSOFT CORP	288,725	USD	85,388,667	5.57
MID-AMER APARTMENT COMMUNITIES INC	5,221	USD	1,053,382	0.07
MODERNA INC	14,806	USD	3,306,743	0.22
MOLINA HEALTHCARE	2,662	USD	744,573	0.05
MOLSON COORS - REGISTERED SHS -B-	14,134	USD	576,074	0.04
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	73,974	USD	4,313,415	0.28
MONGODB INC	2,955	USD	1,375,509	0.09
MONOLITHIC POWER	1,811	USD	785,632	0.05
MONSTER BEVERAGE CORP	20,730	USD	1,750,712	0.11
MOODY S CORP	7,706	USD	2,646,684	0.17
MORGAN STANLEY	63,392	USD	5,471,824	0.36
MOSAIC	17,105	USD	590,974	0.04
MOTOROLA SOLUTIONS INC	7,728	USD	1,846,375	0.12
MSCI INC -A-	3,747	USD	2,018,774	0.13
NETAPP	12,017	USD	972,075	0.06
NETFLIX INC	18,281	USD	9,684,493	0.63
NEWMONT CORPORATION	42,245	USD	2,303,935	0.15
NEXTERA ENERGY	91,171	USD	7,484,809	0.49
NIKE INC	52,859	USD	7,747,107	0.51
NORFOLK SOUTHERN	11,723	USD	3,068,989	0.20
NORTHERN TRUST CORP	12,485	USD	1,313,165	0.09
NORTONLIFELOCK INC	28,385	USD	648,472	0.04
NOVAVAX - REGISTERED SHS	3,429	USD	431,399	0.03
NUCOR CORP	17,243	USD	1,730,820	0.11
NVIDIA CORP	101,661	USD	26,292,224	1.72
NVR INC	153	USD	794,985	0.05
O REILLY AUTO	2,751	USD	1,708,441	0.11

Die Erluterungen im Anhang sind fester Bestandteil des Abschlusses.

Etwache Abweichungen bei den Prozentsatzen des Nettovermogens sind auf Rundungen zururckzufuhren.

Cleome Index

Cleome Index USA Equities

Anlageportfolio zum 31. Dezember 2021

Bezeichnung	Anzahl	Wahrung	Marktwert (in EUR)	% des NV
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	44,463	USD	1,133,470	0.07
OKTA -A-	6,679	USD	1,316,595	0.09
OLD DOMINION FREIGHT LINES INC	5,188	USD	1,634,959	0.11
OMNICOM GROUP INC	15,521	USD	1,000,021	0.07
ON SEMICONDUCTOR CORP	16,686	USD	996,582	0.07
ONEOK INC (NEW)	32,109	USD	1,659,097	0.11
ORACLE CORP	71,040	USD	5,447,941	0.36
OTIS WORLDWIDE CORPORATION	23,328	USD	1,786,114	0.12
PACCAR INC	21,328	USD	1,655,302	0.11
PACKAGING CORP OF AMERICA	4,999	USD	598,500	0.04
PALO ALTO NETWORKS	4,218	USD	2,065,084	0.13
PARKER-HANNIFIN CORP	7,572	USD	2,118,189	0.14
PAYCHEX INC	14,198	USD	1,704,209	0.11
PAYCOM SOFTWARE INC	2,267	USD	827,678	0.05
PAYPAL HOLDINGS	47,220	USD	7,830,415	0.51
PELOTON INTERAC - REGISTERED SHS -A-	19,194	USD	603,568	0.04
PEPSICO INC	62,590	USD	9,560,771	0.62
PERKINELMER	6,143	USD	1,086,099	0.07
PHILLIPS 66	17,977	USD	1,145,457	0.07
PIONER NATURAL RESOURCES COMPANY	10,431	USD	1,668,300	0.11
PLUG POWER INC	25,893	USD	642,771	0.04
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP INC	19,796	USD	3,490,586	0.23
PPG INDUSTRIES INC	12,401	USD	1,880,433	0.12
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP INC	16,970	USD	1,079,353	0.07
PROCTER & GAMBLE CO	103,267	USD	14,854,393	0.97
PROGRESSIVE CORP	30,350	USD	2,739,560	0.18
PROLOGIS	31,334	USD	4,638,931	0.30
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	24,908	USD	2,370,772	0.15
PTC INC	6,170	USD	657,312	0.04
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GROUP INC	32,330	USD	1,897,099	0.12
PUBLIC STORAGE INC	7,777	USD	2,561,513	0.17
PULTEGROUP	12,649	USD	635,787	0.04
QORVO INC	3,298	USD	453,548	0.03
QUALCOMM INC	45,707	USD	7,350,017	0.48
QUEST DIAGNOSTICS	6,555	USD	997,257	0.07
REALTY INCOME CORP	27,079	USD	1,704,701	0.11
REGENERON PHARMACEUTICALS INC	4,401	USD	2,444,002	0.16
REGIONS FINANCIAL CORP	43,291	USD	829,884	0.05
RESMED	6,143	USD	1,407,078	0.09
RINGCENTRAL INC	5,572	USD	917,969	0.06
ROCKWELL AUTOMATION	6,768	USD	2,076,167	0.14
ROKU	6,112	USD	1,226,485	0.08
ROPER TECHNOLOGIES	5,324	USD	2,302,728	0.15
ROSS STORES INC	17,835	USD	1,792,283	0.12
S&P GLOBAL INC	10,763	USD	4,466,569	0.29
SALESFORCE.COM INC	40,441	USD	9,037,347	0.59
SBA COMMUNICATIONS - A	4,990	USD	1,707,008	0.11
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	10,816	USD	1,074,562	0.07
SEAGEN INC	6,475	USD	880,263	0.06
SEMPRA ENERGY	24,812	USD	2,886,151	0.19
SERVICENOW INC	8,527	USD	4,867,183	0.32
SHERWIN WILLIAMS CO	12,616	USD	3,906,833	0.26
SIMON PROPERTY GROUP - REGISTERED	15,428	USD	2,167,544	0.14
SKYWORKS SOLUTIONS INC	6,743	USD	919,899	0.06
SNAP INC-A-	43,418	USD	1,795,593	0.12
SNAP ON INC	5,227	USD	989,968	0.06
SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	2,275	USD	561,288	0.04
SPLUNK INC	7,933	USD	807,252	0.05

Die Erluterungen im Anhang sind fester Bestandteil des Abschlusses.

Etwaige Abweichungen bei den Prozentsatzen des Nettovermogens sind auf Rundungen zuruckzufuhren.

Cleome Index

Cleome Index USA Equities

Anlageportfolio zum 31. Dezember 2021

Bezeichnung	Anzahl	Währung	Marktwert (in EUR)	% des NV
STANLEY BLACK & DECKER INC	10,862	USD	1,801,610	0.12
STARBUCKS CORP	47,757	USD	4,912,185	0.32
STATE STREET CORP	20,175	USD	1,649,908	0.11
STEEL DYNAMICS	19,682	USD	1,074,272	0.07
STRYKER CORP	14,515	USD	3,413,297	0.22
SUN COMMUNITIES	5,203	USD	960,670	0.06
SUNRUN INC	14,423	USD	435,024	0.03
SVB FINANCIAL GROUP	2,611	USD	1,557,232	0.10
SYNCHRONY FINANCIAL	30,887	USD	1,259,979	0.08
SYNOPSIS	6,682	USD	2,165,245	0.14
SYSCO CORP	31,759	USD	2,193,695	0.14
T MOBILE USA INC	28,815	USD	2,938,765	0.19
T ROWE PRICE GROUP INC	11,081	USD	1,916,081	0.13
TAKE TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC	6,305	USD	985,336	0.06
TARGET CORP	21,106	USD	4,295,438	0.28
TELADOC HEALTH	10,653	USD	860,146	0.06
TELEDYNE TECHNOLOGIES	1,695	USD	651,186	0.04
TELEFLEX INC	2,539	USD	733,390	0.05
TERADYNE INC	6,098	USD	876,896	0.06
TESLA MOTORS INC	34,219	USD	31,799,116	2.08
TEXAS INSTRUMENTS INC	38,088	USD	6,312,386	0.41
THE HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP	16,755	USD	1,017,205	0.07
THE KRAFT HEINZ	46,582	USD	1,470,536	0.10
THE WESTERN UNION COMPANY	47,920	USD	751,752	0.05
THERMO FISHER SCIENT SHS	16,961	USD	9,951,686	0.65
TJX COS INC	53,016	USD	3,539,373	0.23
TRACTOR SUPPLY CO	5,518	USD	1,157,751	0.08
TRANSUNION	10,685	USD	1,114,164	0.07
TRAVELERS COS INC/THE	11,753	USD	1,616,709	0.11
TRIMBLE	12,925	USD	990,970	0.06
TRUIST FINANCIAL CORP	60,513	USD	3,115,579	0.20
TWILIO INC	7,691	USD	1,780,995	0.12
TWITTER INC	35,958	USD	1,366,606	0.09
TYLER TECHNOLOGIES INC	1,653	USD	781,948	0.05
UGI CORP	31,377	USD	1,266,724	0.08
ULTA BEAUTY RG REGISTERED	2,333	USD	845,928	0.06
UNION PACIFIC CORP	28,068	USD	6,218,054	0.41
UNITED PARCEL SERVICE INC	31,009	USD	5,844,591	0.38
UNITED RENTALS INC	3,717	USD	1,086,108	0.07
UNITEDHEALTH GROUP INC	39,193	USD	17,305,991	1.13
US BANCORP	65,358	USD	3,228,244	0.21
VALERO ENERGY CORP	22,806	USD	1,506,295	0.10
VEEVA SYSTEMS -A-	6,162	USD	1,384,337	0.09
VENTAS INC	25,994	USD	1,168,496	0.08
VERISIGN INC	4,476	USD	999,031	0.07
VERISK ANALYTICS	8,074	USD	1,623,959	0.11
VERIZON COMMUNICATIONS INC	190,456	USD	8,702,158	0.57
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	11,164	USD	2,155,834	0.14
VF REGISTERED	16,370	USD	1,054,002	0.07
VIACOMCBS INC	31,960	USD	848,182	0.06
VIATRIS INC - REGISTERED SHS	75,400	USD	897,082	0.06
VISA INC -A-	70,641	USD	13,461,670	0.88
VMWARE INC -A-	11,403	USD	1,161,959	0.08
VORNADO REALTY TRUST SHS OF BENEF.INT	16,622	USD	611,851	0.04
VULCAN MATERIALS CO	7,337	USD	1,339,267	0.09
W.P. CAREY	10,631	USD	767,036	0.05
WABTEC CORP	11,350	USD	919,318	0.06
WALGREENS BOOTS	49,546	USD	2,272,528	0.15

Die Erläuterungen im Anhang sind fester Bestandteil des Abschlusses.

Etwasige Abweichungen bei den Prozentsätzen des Nettovermögens sind auf Rundungen zurückzuführen.

Cleome Index

Cleome Index USA Equities

Anlageportfolio zum 31. Dezember 2021

Bezeichnung	Anzahl	Währung	Marktwert (in EUR)	% des NV
WALT DISNEY CO	75,827	USD	10,327,861	0.67
WASTE MANAGEMENT	16,766	USD	2,460,645	0.16
WATERS	3,707	USD	1,214,587	0.08
WAYFAIR INC	4,085	USD	682,402	0.04
WELLS FARGO AND CO	175,286	USD	7,395,552	0.48
WELLTOWER INC	23,908	USD	1,803,191	0.12
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES INC	4,364	USD	1,799,824	0.12
WESTERN DIGITAL CORP	14,174	USD	812,774	0.05
WESTROCK	12,222	USD	476,757	0.03
WEYERHAEUSER CO	35,212	USD	1,275,088	0.08
WHIRLPOOL CORP	3,181	USD	656,396	0.04
WILLIAMS COS INC	81,376	USD	1,863,376	0.12
WORKDAY INC -A-	8,094	USD	1,944,354	0.13
WW GRAINGER INC	2,924	USD	1,332,513	0.09
WYNN RESORTS LTD	6,445	USD	481,958	0.03
XILINX INC	10,843	USD	2,021,668	0.13
XYLEM INC	12,823	USD	1,352,211	0.09
YUM BRANDS INC	10,055	USD	1,227,785	0.08
ZEBRA TECHNOLOGIES -A-	2,291	USD	1,199,088	0.08
ZILLOW GROUP -C-	13,271	USD	745,123	0.05
ZIMMER BIOMET HLDGS SHS	10,621	USD	1,186,504	0.08
ZOETIS INC -A-	22,079	USD	4,737,899	0.31
ZSCALER INC	4,102	USD	1,159,071	0.08
			1,468,620,607	95.86
Aktien insgesamt			1,530,819,424	99.92
Gesamtsumme übertragbarer Wertpapiere, die zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden			1,530,819,424	99.92
Anlageportfolio insgesamt			1,530,819,424	99.92
Anschaffungskosten			874,588,543	

Die Erläuterungen im Anhang sind fester Bestandteil des Abschlusses.
Etwaige Abweichungen bei den Prozentsätzen des Nettovermögens sind auf Rundungen zurückzuführen.

Cleome Index

Cleome Index USA Equities

Geografische und wirtschaftliche Zusammensetzung des Wertpapierbestandes zum 31. Dezember 2021

Geografische Zusammensetzung (in % des Nettovermögens)

Vereinigte Staaten von Amerika	95.86
Irland	2.45
Schweiz	0.41
Luxemburg	0.25
Bermuda	0.24
Niederlande	0.20
Jersey	0.14
Niederländische Antillen	0.13
Großbritannien	0.08
Kanada	0.06
Liberia	0.05
Panama	0.05
	99.92

Wirtschaftliche Zusammensetzung (in % des Nettovermögens)

Internet und Internet-Dienste	19.05
Banken und andere Finanzinstitute	11.54
Büroausstattung und Computer	8.90
Pharmazeutika	8.14
Einzelhandel und Warenhäuser	7.52
Elektronik und Halbleiter	6.20
Maschinen- und Apparatebau	3.36
Kraftfahrzeuge	2.75
Immobilien	2.72
Lebensmittel und alkoholfreie Getränke	2.71
Kommunikation	2.62
Versorger	2.61
Sonstige Dienstleistungen	2.42
Erdöl	2.18
Sonstige Konsumgüter	2.17
Gesundheitswesen	2.03
Versicherung	1.80
Grafik und Verlage	1.78
Transport	1.60
Hotels und Restaurants	1.48
Biotechnologie	1.46
Elektrotechnik	1.17
Chemikalien	0.95
Textilien und Bekleidung	0.81
Baumaterialien	0.60
Umweltdienste und Recycling	0.23
Tabak und alkoholische Getränke	0.23
Papier und Forsterzeugnisse	0.21
Kohlebergbau und Stahlindustrie & Chemie	0.18
Edelmetalle und Edelsteine	0.15
Verpackungsindustrie	0.14
Landwirtschaft und Fischerei	0.10
Luft- und Raumfahrt	0.06
NE-Metalle	0.05
	99.92

Etwaige Abweichungen bei den Prozentsätzen des Nettovermögens sind auf Rundungen zurückzuführen.

Cleome Index

Cleome Index World Equities (siehe Anhangangabe 1)

Anlageportfolio zum 31. Dezember 2021

Bezeichnung	Anzahl	Währung	Marktwert (in EUR)	% des NV
Übertragbare Wertpapiere, die zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden				
Aktien				
Australien				
AFTERPAY TOUCH - REGISTERED SHS	1,367	AUD	72,547	0.04
ANZ BANKING GROUP LTD	8,391	AUD	147,579	0.09
BHP GROUP LTD	15,195	AUD	403,153	0.24
BLUESCOPE STEEL	9,679	AUD	129,330	0.08
BRAMBLES	25,974	AUD	176,520	0.10
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	3,399	AUD	219,480	0.13
CSL LTD	1,707	AUD	317,271	0.19
GOODMAN GROUP - STAPLED SECURITY	12,646	AUD	214,250	0.13
MACQUARIE GROUP	1,591	AUD	208,926	0.12
NAT. AUSTRALIA BANK	10,635	AUD	196,090	0.12
RIO TINTO	2,334	AUD	149,383	0.09
SCENTRE GRP - STAPLED SECURITY	64,727	AUD	130,766	0.08
SUNCORP GROUP	14,225	AUD	100,675	0.06
TRANSURBAN GROUP	18,243	AUD	161,185	0.09
WESFARMERS	6,621	AUD	251,015	0.15
WESTPAC BANKING CORP	11,891	AUD	162,307	0.10
WOOLWORTHS GRP - REGISTERED	10,203	AUD	247,940	0.15
			3,288,417	1.94
Belgien				
ANHEUSER-BUSCH INBEV	3,310	EUR	175,993	0.10
UCB	1,960	EUR	196,686	0.12
			372,679	0.22
Bermuda				
IHS MARKIT LTD	2,781	USD	325,053	0.19
			325,053	0.19
Kanada				
AGNICO EAGLE MINES LTD	3,951	CAD	184,802	0.11
BANK OF MONTREAL	2,742	CAD	259,960	0.15
BANK OF NOVA SCOTIA	4,371	CAD	272,484	0.16
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC -A-	4,595	CAD	244,352	0.14
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	2,277	CAD	233,723	0.14
CANADIAN NATIONAL RAILWAY	2,521	CAD	272,686	0.16
CANADIAN NATURAL RESOURCES	4,603	CAD	171,271	0.10
CANADIAN PACIFIC RAILWAY	3,760	CAD	238,138	0.14
ENBRIDGE INC	8,818	CAD	303,305	0.18
FAIRFAX FINANCIAL HOLDINGS SUB.VTG	260	CAD	112,623	0.07
FRANCO-NEVADA CORP	1,440	CAD	175,366	0.10
KINROSS GOLD CORP	27,495	CAD	140,490	0.08
MAGNA INTL SHS -A- SUB.VTG	2,168	CAD	154,469	0.09
MANULIFE FINANCIAL REGISTERED	10,436	CAD	175,156	0.10
NATIONAL BK CANADA	3,280	CAD	220,204	0.13
POWER CORP DU CANADA SUB.	6,333	CAD	184,281	0.11
ROYAL BANK OF CANADA	3,736	CAD	349,153	0.21
SHOPIFY -A- SUBORD VOTING	435	CAD	527,417	0.31
SUN LIFE FINANCIAL INC	3,982	CAD	195,178	0.11
SUNCOR ENERGY INC	6,703	CAD	147,685	0.09
TC ENERGY - REGISTERED SHS	4,544	CAD	186,094	0.11
TECK RESOURCES LTD -B-	7,004	CAD	177,623	0.10
TORONTO DOMINION BANK	6,102	CAD	411,954	0.24
			5,338,414	3.14
Kaimaninseln				
CK HUTCHISON	10,500	HKD	59,571	0.04
			59,571	0.04
Dänemark				
DANSKE BANK	7,676	DKK	116,570	0.07

Die Erläuterungen im Anhang sind fester Bestandteil des Abschlusses.

Etwache Abweichungen bei den Prozentsätzen des Nettovermögens sind auf Rundungen zurückzuführen.

Cleome Index

Cleome Index World Equities (siehe Anhangangabe 1)

Anlageportfolio zum 31. Dezember 2021

DSV A/S	1,216	DKK	249,736	0.15
GENMAB AS	272	DKK	96,182	0.06
NOVO NORDISK	6,280	DKK	620,603	0.37
NOVOZYMES -B-	1,742	DKK	125,820	0.07
VESTAS WIND SYSTEMS - BEARER AND/OR SHS	6,228	DKK	167,473	0.10
			1,376,384	0.81
Finnland				
KONE -B-	2,822	EUR	177,899	0.10
NOKIA OYJ	34,423	EUR	191,874	0.11
NORDEA BANK	14,581	SEK	156,488	0.09
			526,261	0.31
Frankreich				
ACCOR SA	5,790	EUR	164,726	0.10
AIR LIQUIDE SA	1,787	EUR	273,983	0.16
AXA SA	5,820	EUR	152,397	0.09
BNP PARIBAS SA	3,393	EUR	206,193	0.12
CAPGEMINI SE	1,523	EUR	328,206	0.19
CARREFOUR SA	8,511	EUR	137,070	0.08
CIE DE SAINT-GOBAIN	3,068	EUR	189,817	0.11
DANONE SA	3,262	EUR	178,073	0.10
ENGIE SA	7,530	EUR	97,995	0.06
ESSILORLUXOTTICA SA	1,303	EUR	243,974	0.14
KERING	304	EUR	214,898	0.13
LEGRAND SA	2,630	EUR	270,627	0.16
L'OREAL SA	964	EUR	401,940	0.24
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	915	EUR	665,205	0.39
ORANGE	7,686	EUR	72,348	0.04
PERNOD RICARD SA	1,331	EUR	281,506	0.17
SANOFI	3,663	EUR	324,469	0.19
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	234	EUR	112,882	0.07
SCHNEIDER ELECTRIC SE	2,352	EUR	405,626	0.24
SOCIETE GENERALE SA	4,549	EUR	137,403	0.08
TOTALENERGIESSE	8,583	EUR	383,059	0.23
VINCI SA	2,361	EUR	219,361	0.13
VIVENDI SA	9,722	EUR	115,595	0.07
			5,577,353	3.29
Deutschland				
ADIDAS AG NAMEN AKT	709	EUR	179,519	0.11
ALLIANZ SE REG SHS	993	EUR	206,196	0.12
BASF SE REG SHS	3,964	EUR	244,896	0.14
BMW AG	1,498	EUR	132,558	0.08
CONTINENTAL AG	934	EUR	86,965	0.05
DAIMLER AG NAMEN-AKT	2,928	EUR	197,904	0.12
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	1,464	EUR	47,273	0.03
DEUTSCHE BANK AG NAMEN-AKT	11,329	EUR	124,823	0.07
DEUTSCHE POST AG REG SHS	5,358	EUR	302,941	0.18
DEUTSCHE TELEKOM AG REG SHS	12,726	EUR	207,434	0.12
E.ON SE	18,854	EUR	229,868	0.14
FRESENIUS SE	2,712	EUR	96,005	0.06
HENKEL AG & CO KGAA	1,400	EUR	99,596	0.06
INFINEON TECHNOLOGIES REG SHS	8,269	EUR	337,044	0.20
MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS AG REG SHS	558	EUR	145,359	0.09
SAP AG	3,866	EUR	482,863	0.28
SIEMENS AG REG	2,505	EUR	382,463	0.23
SIEMENS ENERGY - REGISTERED SHS	4,058	EUR	91,264	0.05
VOLKSWAGEN AG	505	EUR	130,492	0.08
Bezeichnung				
	Anzahl	Währung	Marktwert (in EUR)	% des NV
VOLKSWAGEN AG VORZ.AKT	104	EUR	18,458	0.01
VONOVIA SE	1,493	EUR	72,410	0.04

Die Erläuterungen im Anhang sind fester Bestandteil des Abschlusses.
Etwaige Abweichungen bei den Prozentsätzen des Nettovermögens sind auf Rundungen zurückzuführen.

Cleome Index

Cleome Index World Equities (siehe Anhangangabe 1)

Anlageportfolio zum 31. Dezember 2021

			3,816,331	2.25
Hongkong				
AIA GROUP LTD	40,800	HKD	361,707	0.21
HANG SENG BANK LTD	4,600	HKD	74,038	0.04
HONG KONG CHINA GAS	141,623	HKD	193,922	0.11
HONG KONG EXCHANGES AND CLEARING LTD	4,500	HKD	231,143	0.14
SUN HUNG KAI PROPERTIES LTD	11,000	HKD	117,370	0.07
THE LINK REIT UNITS	20,500	HKD	158,734	0.09
			1,136,914	0.67
Irland				
ACCENTURE - SHS CLASS A	2,435	USD	887,644	0.52
AON - REGISTERED SHS (USD)	804	USD	212,496	0.13
CRH PLC	3,652	EUR	169,891	0.10
EATON CORPORATION PUBLIC LIMITED COMPANY	2,270	USD	344,971	0.20
JOHNSON CONTROLS INTL	5,281	USD	377,592	0.22
KERRY GROUP -A-	1,406	EUR	159,230	0.09
LINDE PLC	1,621	USD	493,812	0.29
MEDTRONIC HLD	4,325	USD	393,441	0.23
TRANE TECH - REGISTERED SHS	1,305	USD	231,841	0.14
			3,270,918	1.93
Israel				
WIX.COM LTD	568	USD	78,812	0.05
			78,812	0.05
Italien				
ASSICURAZIONI GENERALI SPA	965	EUR	17,978	0.01
ENEL SPA	29,039	EUR	204,609	0.12
ENI SPA	14,518	EUR	177,410	0.10
INTESA SANPAOLO	53,975	EUR	122,739	0.07
SNAM SPA	61,478	EUR	325,833	0.19
UNICREDIT SPA REGS	13,252	EUR	179,485	0.11
			1,028,054	0.61
Japan				
ASTELLAS PHARMA	10,800	JPY	154,263	0.09
BRIDGESTONE CORP	3,800	JPY	143,609	0.08
CANON INC	6,300	JPY	134,752	0.08
CENTRAL JAPAN RAILWAY CO	700	JPY	82,025	0.05
CHUGAI PHARMACEUTICAL	3,900	JPY	111,234	0.07
DAI-ICHI LIFE HOLDINGS INC	6,400	JPY	113,652	0.07
DAIICHI SANKYO CO LTD	7,600	JPY	169,754	0.10
DAIKIN INDUSTRIES LTD	1,100	JPY	219,153	0.13
DAIWA SECURITIES GROUP INC	26,800	JPY	132,758	0.08
DENSO CORP	2,800	JPY	203,744	0.12
EAST JAPAN RAILWAY CO	2,400	JPY	129,627	0.08
ENEOS HOLDINGS INC	29,700	JPY	97,591	0.06
FANUC CORP SHS	900	JPY	167,555	0.10
FAST RETAILING CO LTD	300	JPY	149,617	0.09
FUJIFILM HOLDINGS CORP	3,000	JPY	195,320	0.12
HITACHI LTD	4,900	JPY	233,112	0.14
HONDA MOTOR CO LTD	4,719	JPY	116,395	0.07
HOYA CORP	1,700	JPY	222,116	0.13
ITOCHU CORP	6,100	JPY	163,872	0.10
KAO CORP	3,100	JPY	142,484	0.08
KDDI CORP	7,300	JPY	187,414	0.11
KEYENCE CORP	900	JPY	496,754	0.29
KIRIN HOLDINGS CO LTD	7,100	JPY	100,140	0.06
KOMATSU LTD	6,000	JPY	123,410	0.07
KUBOTA CORP	8,300	JPY	161,843	0.10
Bezeichnung	Anzahl	Währung	Marktwert (in EUR)	% des NV
KYOCERA CORP	2,900	JPY	159,157	0.09
MARUBENI CORP	13,800	JPY	117,973	0.07

Die Erläuterungen im Anhang sind fester Bestandteil des Abschlusses.

Etwaige Abweichungen bei den Prozentsätzen des Nettovermögens sind auf Rundungen zurückzuführen.

Cleome Index

Cleome Index World Equities (siehe Anhangangabe 1)

Anlageportfolio zum 31. Dezember 2021

MITSUBISHI CORP	5,900	JPY	164,537	0.10
MITSUBISHI ELECTRIC CORP	10,500	JPY	116,944	0.07
MITSUBISHI ESTATE	8,900	JPY	108,366	0.06
MITSUBISHI HEAVY INDUSTRIES LTD	4,500	JPY	91,372	0.05
MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC	15,361	JPY	73,301	0.04
MITSUI AND CO LTD	6,400	JPY	133,103	0.08
MITSUI FUDOSAN CO LTD	7,400	JPY	128,754	0.08
MS&AD INSURANCE GROUP HOLDING	4,800	JPY	130,085	0.08
MURATA MANUFACTURING CO LTD	2,800	JPY	195,791	0.12
NIDEC CORP	1,800	JPY	185,836	0.11
NINTENDO CO LTD	400	JPY	163,874	0.10
NIPPON TELEGRAPH AND TELEPHONE CORP	6,200	JPY	149,136	0.09
NISSAN CHEMICAL CORP	2,900	JPY	147,930	0.09
NOMURA HOLDINGS INC	16,400	JPY	62,830	0.04
ONO PHARMACEUTICAL CO LTD	7,000	JPY	152,664	0.09
ORIX CORP	11,200	JPY	200,772	0.12
OTSUKA HOLDINGS	4,600	JPY	146,444	0.09
PANASONIC CORP	15,700	JPY	151,660	0.09
RECRUIT HOLDINGS CO LTD	6,300	JPY	335,412	0.20
SECOM CO LTD	2,000	JPY	121,966	0.07
SEKISUI HOUSE LTD	12,700	JPY	239,445	0.14
SHIN-ETSU CHEM. CO LTD	1,500	JPY	228,171	0.13
SHISEIDO	1,900	JPY	93,060	0.05
SMC CORP	300	JPY	177,749	0.10
SOFTBANK GROUP	4,200	JPY	174,281	0.10
SO-NET M3	2,100	JPY	92,897	0.05
SONY CORP	4,700	JPY	519,513	0.31
SUMITOMO CORP	6,600	JPY	85,704	0.05
SUMITOMO ELECTRIC INDUSTRIES LTD	8,900	JPY	101,910	0.06
SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GROUP INC	2,100	JPY	63,230	0.04
TAKEDA PHARMACEUTICAL	5,500	JPY	131,752	0.08
TOKIO MARINE HOLDINGS INC	3,500	JPY	170,838	0.10
TOKYO GAS CO LTD	5,400	JPY	85,028	0.05
TOKYU CORP	9,200	JPY	107,347	0.06
TOSHIBA CORP	2,700	JPY	97,523	0.06
TOYOTA MOTOR CORP	33,900	JPY	545,049	0.32
WEST JAPAN RAILWAY COMPANY	2,000	JPY	73,461	0.04
YASKAWA ELECTRIC CORP	3,800	JPY	163,660	0.10
			10,540,719	6.21
Jersey				
APTIV PLC	1,611	USD	233,674	0.14
FERGUSON NEWCO PLC	761	GBP	118,782	0.07
WPP PLC	17,213	GBP	229,514	0.14
			581,970	0.34
Luxemburg				
ARCELORMITTAL SA	726	EUR	20,433	0.01
ORSTED	1,477	DKK	165,859	0.10
PINTEREST REGISTERED SHS -A-	3,085	USD	98,610	0.06
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS INC	932	USD	150,725	0.09
			435,627	0.26
Niederlande				
ADYEN --- PARTS SOCIALES	105	EUR	242,708	0.14
AKZO NOBEL NV	2,142	EUR	206,703	0.12
ASML HOLDING NV	1,526	EUR	1,078,424	0.64
HEINEKEN NV	475	EUR	46,958	0.03
ING GROUP NV	16,187	EUR	198,161	0.12
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	9,053	EUR	272,812	0.16
Bezeichnung	Anzahl	Währung	Marktwert (in EUR)	% des NV
LYONDELLBASELL -A-	1,605	USD	130,170	0.08

Die Erläuterungen im Anhang sind fester Bestandteil des Abschlusses.

Etwasige Abweichungen bei den Prozentsätzen des Nettovermögens sind auf Rundungen zurückzuführen.

Cleome Index

Cleome Index World Equities (siehe Anhangangabe 1)

Anlageportfolio zum 31. Dezember 2021

NXP SEMICONDUCTORS	1,313	USD	262,993	0.15
PROSUS NV	2,660	EUR	195,590	0.12
QIAGEN REGD EUR	3,421	EUR	167,595	0.10
ROYAL PHILIPS NV	4,033	EUR	132,141	0.08
UNIVERSAL MUSIC GROUP N.V.	5,212	EUR	129,153	0.08
			3,063,408	1.80
Niederländische Antillen				
SCHLUMBERGER LTD	6,367	USD	167,685	0.10
			167,685	0.10
Norwegen				
DNB BK ASA	5,973	NOK	120,316	0.07
EQUINOR ASA	9,096	NOK	213,972	0.13
			334,288	0.20
Panama				
CARNIVAL CORP	5,299	USD	93,753	0.06
			93,753	0.06
Singapur				
KEPPEL CORPORATION LTD	46,100	SGD	153,957	0.09
SINGAPORE TELECOM - SH BOARD LOT 1000	119,300	SGD	180,534	0.11
			334,491	0.20
Spanien				
AMADEUS IT GROUP SA -A-	2,974	EUR	177,369	0.10
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA	28,507	EUR	149,662	0.09
BANCO SANTANDER SA REG SHS	51,323	EUR	150,915	0.09
CELLNEX TELECOM SA	2,276	EUR	116,486	0.07
IBERDROLA SA	23,901	EUR	248,809	0.15
INDITEX SHARE FROM SPLIT	5,527	EUR	157,685	0.09
REPSOL SA	11,589	EUR	120,943	0.07
TELEFONICA SA	30,504	EUR	117,501	0.07
			1,239,370	0.73
Schweden				
ASSA ABLOY -B- NEW I	6,721	SEK	180,297	0.11
ATLAS COPCO AB - REGS -A-	4,684	SEK	284,698	0.17
EPIROC --- REGISTERED SHS -A-	9,549	SEK	212,571	0.13
EVOLUTION AB	1,133	SEK	141,537	0.08
HENNES AND MAURITZ AB	6,781	SEK	117,284	0.07
INVESTOR --- REGISTERED SHS -B-	7,773	SEK	171,941	0.10
SINCH	6,054	SEK	67,678	0.04
SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN -A-	10,564	SEK	129,126	0.08
SWEDBANK -A-	5,264	SEK	93,102	0.05
TELEFON ERICSSON	15,854	SEK	153,659	0.09
			1,551,893	0.91
Schweiz				
ABB LTD REG SHS	8,844	CHF	297,887	0.18
ADECCO REG.SHS	2,677	CHF	120,396	0.07
ALCON - REGISTERED SHS	2,552	CHF	198,860	0.12
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT & SP REGS	3	CHF	353,810	0.21
CHUBB - NAMEN AKT	1,370	USD	232,883	0.14
CIE FINANCIERE RICHEMONT NAMEN AKT	2,233	CHF	295,140	0.17
CREDIT SUISSE GROUP AG REG SHS	11,124	CHF	95,249	0.06
GEBERIT AG	459	CHF	330,113	0.19
GIVAUDAN SA REG.SHS	67	CHF	309,862	0.18
LONZA GROUP (CHF)	396	CHF	291,071	0.17
NESTLE SA REG SHS	8,278	CHF	1,018,142	0.60
NOVARTIS AG REG SHS	6,471	CHF	501,367	0.30
ROCHE HOLDING LTD	2,264	CHF	828,338	0.49
TE CONNECTIVITY LTD REG SHS	2,365	USD	335,534	0.20
THE SWATCH GROUP	575	CHF	154,828	0.09
Bezeichnung	Anzahl	Währung	Marktwert (in EUR)	% des NV
UBS GROUP SA	12,086	CHF	191,528	0.11

Die Erläuterungen im Anhang sind fester Bestandteil des Abschlusses.

Etwaige Abweichungen bei den Prozentsätzen des Nettovermögens sind auf Rundungen zurückzuführen.

Cleome Index

Cleome Index World Equities (siehe Anhangangabe 1)

Anlageportfolio zum 31. Dezember 2021

ZURICH INSURANCE GROUP NAMEN AKT	314	CHF	121,339	0.07
			5,676,347	3.34
Großbritannien				
ABRDN PLC	34,333	GBP	98,509	0.06
ASTRAZENECA PLC	4,824	GBP	498,603	0.29
AVIVA PLC	23,286	GBP	113,823	0.07
BARCLAYS PLC	74,828	GBP	166,661	0.10
BHP GROUP-REGISTERED SHS	12,109	GBP	317,219	0.19
BP PLC	65,745	GBP	258,799	0.15
BRITISH LAND CO PLC REIT	28,392	GBP	179,564	0.11
BT GROUP PLC	60,523	GBP	122,221	0.07
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS	225	USD	11,066	0.01
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS	2,955	EUR	145,031	0.09
COMPASS GROUP	9,838	GBP	193,456	0.11
DIAGEO PLC	8,452	GBP	406,292	0.24
EXPERIAN GROUP	5,055	GBP	218,673	0.13
GLAXOSMITHKLINE PLC	17,842	GBP	341,412	0.20
HSBC HOLDINGS PLC	52,480	GBP	280,433	0.17
LAND SEC R.E.I.T	16,266	GBP	150,416	0.09
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	32,116	GBP	113,798	0.07
LIBERTY GLOBAL -C-	5,421	USD	133,904	0.08
LLOYDS BANKING GROUP PLC	262,186	GBP	149,267	0.09
M AND G REGISTERED SHS	28,890	GBP	68,646	0.04
NATIONAL GRID PLC	17,963	GBP	226,741	0.13
NEXT PLC	1,724	GBP	167,349	0.10
OCADO GROUP PLC	4,463	GBP	89,196	0.05
PRUDENTIAL PLC	8,178	GBP	124,141	0.07
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	2,591	GBP	195,714	0.12
RELX PLC	9,675	GBP	276,791	0.16
RIO TINTO PLC	4,485	GBP	261,322	0.15
ROYAL DUTCH SHELL PLC	12,694	EUR	245,121	0.14
ROYAL DUTCH SHELL PLC -B-	9,839	GBP	190,124	0.11
SEVERN TRENT PLC	8,254	GBP	289,716	0.17
SMITH AND NEPHEW PLC	7,572	GBP	116,655	0.07
STANDARD CHARTERED PLC	18,591	GBP	99,288	0.06
UNILEVER	4,503	EUR	211,889	0.12
UNILEVER	2,268	GBP	106,579	0.06
VODAFONE GROUP PLC	91,709	GBP	122,621	0.07
WHITBREAD	4,627	GBP	165,053	0.10
			6,856,093	4.04
Vereinigte Staaten von Amerika				
3M CO	1,834	USD	286,470	0.17
ABBOTT LABORATORIES	5,759	USD	712,734	0.42
ABBVIE INC	5,779	USD	688,073	0.41
ACTIVISION BLIZZARD	3,205	USD	187,503	0.11
ADOBE INC	1,625	USD	810,299	0.48
ADVANCED MICRO DEVICES INC	4,410	USD	558,036	0.33
AFLAC INC	3,214	USD	165,024	0.10
AGILENT TECHNOLOGIES	2,465	USD	346,058	0.20
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	746	USD	199,594	0.12
ALIGN TECHNOLOGY INC	302	USD	174,524	0.10
ALLSTATE CORP	1,248	USD	129,113	0.08
ALPHABET INC -A-	805	USD	2,050,754	1.21
ALPHABET INC -C-	1,061	USD	2,699,700	1.59
AMAZON.COM INC	1,388	USD	4,069,701	2.40
AMERICAN WATER WORKS CO INC	2,054	USD	341,117	0.20
AMERICAN EXPRESS	2,564	USD	368,862	0.22
Bezeichnung	Anzahl	Währung	Marktwert (in EUR)	% des NV
AMERICAN INTL	3,653	USD	182,650	0.11

Die Erläuterungen im Anhang sind fester Bestandteil des Abschlusses.

Etwaige Abweichungen bei den Prozentsätzen des Nettovermögens sind auf Rundungen zurückzuführen.

Cleome Index

Cleome Index World Equities (siehe Anhangangabe 1)

Anlageportfolio zum 31. Dezember 2021

AMERICAN TOWER CORP	1,703	USD	438,030	0.26
AMERIPRISE FINANCIAL INC	911	USD	241,657	0.14
AMERISOURCEBERGEN CORP	1,926	USD	225,067	0.13
AMETEK INC	1,892	USD	244,636	0.14
AMGEN INC	1,796	USD	355,299	0.21
AMPHENOL -A-	4,036	USD	310,401	0.18
ANALOG DEVICES INC	2,328	USD	359,825	0.21
ANTHEM INC	873	USD	355,848	0.21
APPLE INC	51,345	USD	8,017,351	4.72
APPLIED MATERIALS INC	3,945	USD	545,889	0.32
ARCHER-DANIELS MIDLAND CO	3,157	USD	187,638	0.11
AT&T INC	21,384	USD	462,580	0.27
ATMOS ENERGY CORP	1,994	USD	183,707	0.11
AUTODESK INC	1,104	USD	272,981	0.16
AUTOMATIC DATA PROCESSING INC	1,762	USD	382,056	0.23
AUTOZONE INC	119	USD	219,372	0.13
BALL CORP	2,412	USD	204,189	0.12
BANK OF AMERICA CORP	23,574	USD	922,272	0.54
BANK OF NY MELLON	4,231	USD	216,089	0.13
BAXTER INTERNATIONAL INC	1,809	USD	136,550	0.08
BECTON DICKINSON	974	USD	215,390	0.13
BERKSHIRE HATHAWAY -B-	3,324	USD	873,968	0.51
BIOGEN IDEC INC	562	USD	118,568	0.07
BLACKROCK INC	562	USD	452,466	0.27
BLACKSTONE INC - REGISTERED SHS	2,937	USD	334,170	0.20
BLOCK INC -A-	1,449	USD	205,793	0.12
BOOKING HOLDINGS INC	159	USD	335,453	0.20
BOSTON PROPERTIES INC	1,821	USD	184,438	0.11
BOSTON SCIENTIF CORP	5,297	USD	197,869	0.12
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	6,630	USD	363,507	0.21
BROADCOM INC - REGISTERED SHS	1,337	USD	782,319	0.46
BROWN-FORMAN CORP -B- NON VOTING	2,079	USD	133,201	0.08
CAESARS ENTERTAINMENT - REGISTERED SHS	1,286	USD	105,768	0.06
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	1,729	USD	220,595	0.13
CARDINAL HEALTH	2,669	USD	120,847	0.07
CARRIER GLOBAL CORP-WI	4,855	USD	231,565	0.14
CATERPILLAR - REGISTERED	1,985	USD	360,868	0.21
CENTENE CORP	2,378	USD	172,307	0.10
CERNER CORP	2,236	USD	182,604	0.11
CHARLES SCHWAB CORP/THE	5,598	USD	413,992	0.24
CHARTER COMM -A-	496	USD	284,363	0.17
CHIPOTLE MEXICAN GRILL -A-	142	USD	218,301	0.13
CHURCH AND DWIGHT CO	2,739	USD	246,876	0.15
CIGNA CORPORATION - REGISTERED SHS	1,181	USD	238,474	0.14
CISCO SYSTEMS INC	14,580	USD	812,464	0.48
CITIGROUP INC	5,987	USD	317,934	0.19
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	4,103	USD	170,477	0.10
CITRIX SYSTEMS	1,006	USD	83,677	0.05
CLOROX CO	1,134	USD	173,869	0.10
CME GROUP -A-	1,272	USD	255,541	0.15
COCA-COLA CO	11,838	USD	616,363	0.36
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS -A-	2,484	USD	193,792	0.11
COLGATE-PALMOLIVE CO	2,099	USD	157,517	0.09
COMCAST CORP	14,120	USD	624,921	0.37
CONAGRA BRANDS INC	4,875	USD	146,396	0.09
CONOCOPHILLIPS CO	5,402	USD	342,874	0.20
CONSOLIDATED EDISON INC	3,546	USD	266,044	0.16

Bezeichnung	Anzahl	Wahrung	Marktwert (in EUR)	% des NV
CONSTELLATION BRANDS INC -A-	779	USD	171,918	0.10

Die Erlauerungen im Anhang sind fester Bestandteil des Abschlusses.
Etwaige Abweichungen bei den Prozentsatzen des Nettovermogens sind auf Rundungen zuruckzufuhren.

Cleome Index

Cleome Index World Equities (siehe Anhangangabe 1)

Anlageportfolio zum 31. Dezember 2021

CORNING INC	4,496	USD	147,191	0.09
COSTCO WHOLESALE CORP	1,657	USD	827,189	0.49
COUPA SOFTWARE INC REG SHS	570	USD	79,220	0.05
CROWN CASTLE REIT	1,736	USD	318,653	0.19
CSX CORP	9,101	USD	300,912	0.18
CUMMINS - REGISTERED	778	USD	149,238	0.09
CVS HEALTH	4,724	USD	428,533	0.25
DANAHER CORP	2,310	USD	668,320	0.39
DATADOG INC	1,020	USD	159,754	0.09
DEERE AND CO	1,186	USD	357,604	0.21
DEXCOM INC	413	USD	195,006	0.11
DISCOVER FINANCIAL SERVICES - SHS WI	1,383	USD	140,538	0.08
DOCUSIGN INC	1,028	USD	137,684	0.08
DOLLAR GENERAL	1,052	USD	218,161	0.13
DOLLAR TREE INC	957	USD	118,253	0.07
DOMINION RESOURCES - REGSITERED	3,539	USD	244,481	0.14
DOVER CORP	1,666	USD	266,044	0.16
DOW - REGISTERED SHS	2,998	USD	149,531	0.09
DOWDUPONT - REGISTERED SHS WI	2,544	USD	180,711	0.11
EBAY INC	3,074	USD	179,758	0.11
ECOLAB INC	1,393	USD	287,358	0.17
EDISON INTERNATIONAL	3,232	USD	193,971	0.11
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	2,913	USD	331,849	0.20
ELECTRONIC ARTS - REGISTERED	1,641	USD	190,334	0.11
ELI LILLY & CO	2,752	USD	668,447	0.39
EMERSON ELECTRIC CO	3,018	USD	246,732	0.15
ENPHASE ENERGY --- REGISTERED SHS	619	USD	99,578	0.06
ENTERGY CORP	999	USD	98,960	0.06
EOG RESOURCES INC	3,100	USD	242,150	0.14
EQTY RESIDENTIAL PPTYS TR SHS BEN.INT.	3,056	USD	243,201	0.14
EQUIFAX INC	719	USD	185,118	0.11
EQUINIX INC	384	USD	285,616	0.17
ESSEX PROPERTY TRUST	679	USD	210,310	0.12
ESTEE LAUDER COMPANIES INC -A-	934	USD	304,051	0.18
ETSY	584	USD	112,435	0.07
EXXON MOBIL CORP	13,622	USD	732,967	0.43
FASTENAL CO	3,480	USD	196,033	0.12
FEDEX CORP	829	USD	188,544	0.11
FIDELITY NATIONAL INFO SERVICES INC	2,490	USD	238,994	0.14
FIFTH THIRD BANCORP	5,565	USD	213,116	0.13
FIRST REPUBLIC BANK	1,068	USD	193,944	0.11
FISERV INC	2,313	USD	211,103	0.12
FORD MOTOR	16,229	USD	296,409	0.17
FORTINET	1,020	USD	322,360	0.19
FORTIVE CORP	2,015	USD	135,178	0.08
FOX CORP -A-	3,406	USD	110,518	0.07
FRANKLIN RESOURCES INC	3,310	USD	97,478	0.06
GENERAL ELECTRI	4,148	USD	344,585	0.20
GENERAL MILLS INC	4,273	USD	253,179	0.15
GENERAL MOTORS CO	4,575	USD	235,871	0.14
GENUINE PARTS CO	1,596	USD	196,763	0.12
GILEAD SCIENCES INC	4,846	USD	309,416	0.18
HALLIBURTON	6,764	USD	136,029	0.08
HCA INC	1,075	USD	242,868	0.14
HENRY SCHEIN INC	1,599	USD	109,014	0.06
HESS CORP	2,253	USD	146,667	0.09
HOME DEPOT INC	3,294	USD	1,202,113	0.71
HP ENTERPRISE CO	12,220	USD	169,460	0.10
Bezeichnung	Anzahl	Währung	Marktwert (in EUR)	% des NV
HP INC	6,481	USD	214,685	0.13

Die Erläuterungen im Anhang sind fester Bestandteil des Abschlusses.

Etwasige Abweichungen bei den Prozentsätzen des Nettovermögens sind auf Rundungen zurückzuführen.

Cleome Index

Cleome Index World Equities (siehe Anhangangabe 1)

Anlageportfolio zum 31. Dezember 2021

HUBSPOT INC	283	USD	164,034	0.10
HUMANA INC	449	USD	183,146	0.11
HUNTINGTON BANCSHARES INC	9,721	USD	131,813	0.08
IAC/INTERACTIVE	1,129	USD	129,767	0.08
IBM CORP	3,060	USD	359,655	0.21
IDEXX LABS CORP	442	USD	255,926	0.15
ILLINOIS TOOL WORKS	1,176	USD	255,221	0.15
ILLUMINA INC	539	USD	180,318	0.11
INCYTE CORP	2,042	USD	131,800	0.08
INGERSOLL RAND INC	3,608	USD	196,295	0.12
INTEL CORP	12,922	USD	585,194	0.34
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	1,885	USD	226,707	0.13
INTERNATIONAL PAPER CO	3,027	USD	125,051	0.07
INTL FLAVORS & FRAG	1,387	USD	183,742	0.11
INTUIT	1,130	USD	639,148	0.38
INTUITIVE SURGICAL	1,408	USD	444,860	0.26
IQVIA HOLDINGS INC	1,306	USD	324,019	0.19
J.M. SMUCKER CO SHS	1,605	USD	191,691	0.11
JOHNSON & JOHNSON	7,764	USD	1,167,945	0.69
JPMORGAN CHASE CO	8,843	USD	1,231,348	0.73
KELLOGG CO	2,995	USD	169,660	0.10
KEYCORP	9,132	USD	185,740	0.11
KIMBERLY-CLARK CORP	1,104	USD	138,748	0.08
KINDER MORGAN INC	15,268	USD	212,936	0.13
KROGER CO	5,975	USD	237,802	0.14
LABORATORY CORP OF AMERICA HOLDINGS	656	USD	181,254	0.11
LAM RESEARCH CORP	566	USD	357,931	0.21
LINCOLN NATIONAL CORP	1,966	USD	118,008	0.07
LOEWS CORP	2,338	USD	118,750	0.07
LOWE'S CO INC	2,378	USD	540,508	0.32
LULULEMON ATHLETICA INC SHS WHEN ISSUED	552	USD	190,011	0.11
LUMEN TECH - REGISTERED SHS	7,900	USD	87,183	0.05
M&T BANK CORPORATION	1,153	USD	155,714	0.09
MARATHON PETROLEUM	2,746	USD	154,517	0.09
MARKETAXESS HOLDING INC	315	USD	113,920	0.07
MARRIOTT INTERNATIONAL -A-	1,425	USD	207,059	0.12
MARSH MCLENNAN COS	1,762	USD	269,320	0.16
MASTERCARD INC -A-	2,854	USD	901,776	0.53
MATCH GROUP INC	1,170	USD	136,064	0.08
MCCORMICK & CO INC NON VOTING	2,168	USD	184,181	0.11
MCDONALD'S CORP	2,438	USD	574,705	0.34
MCKESSON CORP	1,138	USD	248,745	0.15
MERCADOLIBRE	168	USD	199,201	0.12
MERCK & CO INC	8,721	USD	587,740	0.35
META PLATFOR -A-	7,586	USD	2,243,714	1.32
METLIFE INC	3,759	USD	206,560	0.12
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL	171	USD	255,208	0.15
MICRON TECHNOLOGY INC	4,073	USD	333,626	0.20
MICROSOFT CORP	22,417	USD	6,629,692	3.91
MODERNA INC	1,278	USD	285,426	0.17
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	5,672	USD	330,734	0.19
MONSTER BEVERAGE CORP	2,535	USD	214,088	0.13
MOODY S CORP	750	USD	257,593	0.15
MORGAN STANLEY	4,889	USD	422,005	0.25
NETFLIX INC	1,424	USD	754,374	0.44
NEWMONT CORPORATION	2,059	USD	112,293	0.07
NEXTERA ENERGY	6,750	USD	554,151	0.33
NIKE INC	4,106	USD	601,782	0.35
Bezeichnung	Anzahl	Währung	Marktwert (in EUR)	% des NV
NORFOLK SOUTHERN	1,000	USD	261,792	0.15

Die Erläuterungen im Anhang sind fester Bestandteil des Abschlusses.

Etwasige Abweichungen bei den Prozentsätzen des Nettovermögens sind auf Rundungen zurückzuführen.

Cleome Index

Cleome Index World Equities (siehe Anhangangabe 1)

Anlageportfolio zum 31. Dezember 2021

NORTHERN TRUST CORP	1,327	USD	139,573	0.08
NUCOR CORP	2,002	USD	200,957	0.12
NVIDIA CORP	8,081	USD	2,089,960	1.23
O REILLY AUTO	368	USD	228,537	0.13
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	4,059	USD	103,474	0.06
OKTA -A-	805	USD	158,685	0.09
OMNICOM GROUP INC	2,799	USD	180,340	0.11
ORACLE CORP	6,671	USD	511,588	0.30
OTIS WORLDWIDE CORPORATION	2,187	USD	167,448	0.10
PACCAR INC	1,199	USD	93,056	0.05
PARKER-HANNIFIN CORP	741	USD	207,287	0.12
PAYCHEX INC	2,451	USD	294,198	0.17
PAYCOM SOFTWARE INC	363	USD	132,531	0.08
PAYPAL HOLDINGS	3,732	USD	618,871	0.36
PELOTON INTERAC - REGISTERED SHS -A-	2,540	USD	79,872	0.05
PEPSICO INC	4,073	USD	622,160	0.37
PIONER NATURAL RESOURCES COMPANY	1,427	USD	228,230	0.13
PLUG POWER INC	2,482	USD	61,613	0.04
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP INC	1,758	USD	309,984	0.18
PPG INDUSTRIES INC	1,236	USD	187,422	0.11
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP INC	2,499	USD	158,945	0.09
PROCTER & GAMBLE CO	6,763	USD	972,821	0.57
PROGRESSIVE CORP	1,968	USD	177,643	0.10
PROLOGIS	3,236	USD	479,083	0.28
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	1,986	USD	189,030	0.11
PUBLIC STORAGE INC	1,041	USD	342,875	0.20
QUALCOMM INC	3,690	USD	593,379	0.35
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	2,193	USD	193,613	0.11
REGENERON PHARMACEUTICALS INC	455	USD	252,675	0.15
REGIONS FINANCIAL CORP	8,935	USD	171,283	0.10
RINGCENTRAL INC	698	USD	114,993	0.07
ROCKWELL AUTOMATION	757	USD	232,219	0.14
ROKU	622	USD	124,816	0.07
ROPER TECHNOLOGIES	435	USD	188,146	0.11
ROSS STORES INC	1,531	USD	153,854	0.09
S&P GLOBAL INC	872	USD	361,874	0.21
SALESFORCE.COM INC	3,173	USD	709,070	0.42
SBA COMMUNICATIONS - A	691	USD	236,381	0.14
SEA -A- ADR REPR1 SHS	827	USD	162,687	0.10
SEMPRA ENERGY	1,779	USD	206,935	0.12
SERVICENOW INC	836	USD	477,186	0.28
SHERWIN WILLIAMS CO	1,317	USD	407,839	0.24
SIMON PROPERTY GROUP - REGISTERED	1,735	USD	243,757	0.14
SNAP INC-A-	3,934	USD	162,694	0.10
SNAP ON INC	769	USD	145,645	0.09
SPLUNK INC	950	USD	96,671	0.06
STANLEY BLACK & DECKER INC	899	USD	149,111	0.09
STARBUCKS CORP	4,703	USD	483,741	0.28
STATE STREET CORP	2,085	USD	170,511	0.10
STRYKER CORP	1,234	USD	290,183	0.17
SYSCO CORP	2,866	USD	197,964	0.12
T MOBILE USA INC	1,984	USD	202,343	0.12
T ROWE PRICE GROUP INC	1,252	USD	216,491	0.13
TARGET CORP	1,861	USD	378,746	0.22
TESLA MOTORS INC	2,638	USD	2,451,447	1.44
TEXAS INSTRUMENTS INC	3,210	USD	531,999	0.31
THE HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP	2,179	USD	132,288	0.08
THE KRAFT HEINZ	4,222	USD	133,283	0.08
Bezeichnung	Anzahl	Währung	Marktwert (in EUR)	% des NV
THE WESTERN UNION COMPANY	8,287	USD	130,004	0.08

Die Erläuterungen im Anhang sind fester Bestandteil des Abschlusses.

Etwasige Abweichungen bei den Prozentsätzen des Nettovermögens sind auf Rundungen zurückzuführen.

Cleome Index

Cleome Index World Equities (siehe Anhangangabe 1)

Anlageportfolio zum 31. Dezember 2021

THERMO FISHER SCIENT SHS	1,364	USD	800,312	0.47
TJX COS INC	4,272	USD	285,201	0.17
TRAVELERS COS INC/THE	979	USD	134,668	0.08
TRUIST FINANCIAL CORP	4,798	USD	247,030	0.15
TWILIO INC	797	USD	184,560	0.11
TWITTER INC	3,104	USD	117,969	0.07
UNION PACIFIC CORP	2,025	USD	448,609	0.26
UNITED PARCEL SERVICE INC	2,193	USD	413,338	0.24
UNITEDHEALTH GROUP INC	2,888	USD	1,275,220	0.75
US BANCORP	5,420	USD	267,711	0.16
VALERO ENERGY CORP	1,959	USD	129,388	0.08
VEEVA SYSTEMS -A-	686	USD	154,115	0.09
VERIZON COMMUNICATIONS INC	10,516	USD	480,488	0.28
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	1,040	USD	200,830	0.12
VF REGISTERED	1,881	USD	121,110	0.07
VIACOMCBS INC	2,881	USD	76,458	0.05
VISA INC -A-	5,404	USD	1,029,811	0.61
VORNADO REALTY TRUST SHS OF BENEF.INT	3,047	USD	112,159	0.07
WABTEC CORP	2,010	USD	162,804	0.10
WALGREENS BOOTS	3,492	USD	160,168	0.09
WALT DISNEY CO	5,618	USD	765,188	0.45
WASTE MANAGEMENT	2,193	USD	321,853	0.19
WATERS	543	USD	177,912	0.10
WAYFAIR INC	488	USD	81,521	0.05
WELLS FARGO AND CO	13,767	USD	580,848	0.34
WELLTOWER INC	2,716	USD	204,846	0.12
WESTERN DIGITAL CORP	1,620	USD	92,895	0.05
WEYERHAEUSER CO	5,051	USD	182,906	0.11
WILLIAMS COS INC	7,514	USD	172,058	0.10
WORKDAY INC -A-	786	USD	188,814	0.11
WW GRAINGER INC	336	USD	153,121	0.09
WYNN RESORTS LTD	1,475	USD	110,301	0.06
XILINX INC	1,506	USD	280,792	0.17
YUM BRANDS INC	1,591	USD	194,272	0.11
ZILLOW GRP -A-	1,407	USD	76,982	0.05
ZOETIS INC -A-	2,084	USD	447,202	0.26
			112,358,985	66.18
Aktien insgesamt			169,429,790	99.80
Gesamtsumme übertragbarer Wertpapiere, die zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden			169,429,790	99.80
Sonstige übertragbare Wertpapiere				
Rechte				
Großbritannien				
ROYAL DUTCH SHELL RECHTE	11,226	USD	0	0.00
			0	0.00
Rechte insgesamt			0	0.00
Sonstige übertragbare Wertpapiere insgesamt			0	0.00
Anlageportfolio insgesamt			169,429,790	99.80
Anschaffungskosten			110,570,760	

Die Erläuterungen im Anhang sind fester Bestandteil des Abschlusses.
Etwaige Abweichungen bei den Prozentsätzen des Nettovermögens sind auf Rundungen zurückzuführen.

Cleome Index

Cleome Index World Equities (siehe Anhangangabe 1)

Geografische und wirtschaftliche Zusammensetzung des Wertpapierbestandes zum 31. Dezember 2021

Geografische Zusammensetzung (in % des Nettovermögens)

Vereinigte Staaten von Amerika	66.18
Japan	6.21
Großbritannien	4.04
Schweiz	3.34
Frankreich	3.29
Kanada	3.14
Deutschland	2.25
Australien	1.94
Irland	1.93
Niederlande	1.80
Schweden	0.91
Dänemark	0.81
Spanien	0.73
Hongkong	0.67
Italien	0.61
Jersey	0.34
Finnland	0.31
Luxemburg	0.26
Belgien	0.22
Norwegen	0.20
Singapur	0.20
Bermuda	0.19
Niederländische Antillen	0.10
Panama	0.06
Israel	0.05
Kaimaninseln	0.04
	99.80

Wirtschaftliche Zusammensetzung (in % des Nettovermögens)

Internet und Internet-Dienste	14.56
Banken und andere Finanzinstitute	14.33
Pharmazeutika	8.77
Elektronik und Halbleiter	6.93
Büroausstattung und Computer	6.21
Einzelhandel und Warenhäuser	6.04
Maschinen- und Apparatebau	3.54
Lebensmittel und alkoholfreie Getränke	3.08
Kraftfahrzeuge	2.92
Versorger	2.89
Erdöl	2.76
Kommunikation	2.58
Immobilien	2.44
Versicherung	2.38
Sonstige Dienstleistungen	1.98
Elektrotechnik	1.92
Grafik und Verlage	1.86
Transport	1.81
Sonstige Konsumgüter	1.76
Chemikalien	1.75
Gesundheitswesen	1.61
Hotels und Restaurants	1.42
Biotechnologie	1.39
Textilien und Bekleidung	1.04
Baumaterialien	0.99
Kohlebergbau und Stahlindustrie & Chemie	0.84
Tabak und alkoholische Getränke	0.72
NE-Metalle	0.32
Verpackungsindustrie	0.22
Umweltdienste und Recycling	0.19

Etwaige Abweichungen bei den Prozentsätzen des Nettovermögens sind auf Rundungen zurückzuführen.

Cleome Index

Cleome Index World Equities (siehe Anhangangabe 1)

Geografische und wirtschaftliche Zusammensetzung des Wertpapierbestandes zum 31. Dezember 2021

Wirtschaftliche Zusammensetzung (in % des Nettovermögens)

Edelmetalle und Edelsteine	0.17
Papier und Forsterzeugnisse	0.16
Reifen und Kautschuk	0.14
Uhrenindustrie, Schmuck	0.09
	99.80

Cleome Index

Anhang zum Abschluss - Aufstellung der derivativen Instrumente

Futures

Zum 31. Dezember 2021 waren die folgenden Terminkontrakte ausstehend:

Cleome Index Euro Corporate Bonds

Anzahl (Kauf/(Verkauf))	Bezeichnung	Währung	Verpflichtung (in EUR) (in absolutem Wert)	Gegenpartei	Nicht realisiert (in EUR)
Futures auf Anleihen					
(54)	EURO-BUND FUTURE Mar22	EUR	5,508,972	J.P. Morgan AG	124,370
					<u>124,370</u>

Siehe Anhangangabe 10 über Barmittel bei Brokern im Zusammenhang mit Futures.

Cleome Index

Sonstige Erläuterungen zum Jahresabschluss

Anhangangabe 1 – Allgemeines

Cleome Index (nachfolgend „SICAV“) wurde am 28. Oktober 1999 als Investmentgesellschaft mit variablem Kapital (SICAV) gemäß den Bestimmungen von Teil I des luxemburgischen Gesetzes vom 17. Dezember 2010 über Organismen für gemeinsame Anlagen in seiner jeweils gültigen Fassung und des Gesetzes vom 10. August 1915 über Handelsgesellschaften in seiner jeweils gültigen Fassung auf unbestimmte Dauer gegründet. Ihr Mindestkapital beträgt 1.250.000 EUR.

Die Satzung der SICAV wurde am 8. Dezember 1999 im „Mémorial, Recueil des Sociétés et Associations“ veröffentlicht. Sie wurde mehrfach geändert, das letzte Mal insbesondere am 6. April 2020. Die entsprechenden Änderungen wurden in „Recueil Electronique des Sociétés et Associations“ („RESA“) veröffentlicht. Die SICAV ist im Handels- und Gesellschaftsregister Luxemburg unter der Nummer B-72234 eingetragen.

Die SICAV besitzt mehrere Teilfonds, die jeweils einer eigenen Anlagepolitik unterliegen.

Zurzeit stehen den Anlegern folgende Teilfonds zur Verfügung:

<u>Teilfonds</u>	<u>Referenzwährung</u>
Cleome Index EMU Equities	EUR
Cleome Index Euro Corporate Bonds	EUR
Cleome Index Euro Government Bonds	EUR
Cleome Index Euro Long Term Bonds	EUR
Cleome Index Euro Short Term Bonds	EUR
Cleome Index Europe Equities	EUR
Cleome Index USA Equities	EUR
Cleome Index World Equities	EUR

Unterjährig hat der Verwaltungsrat die Verschmelzung durch Aufnahme der folgenden Teilfonds beschlossen:

- Candriam Bonds Euro Corporate ex-Financials, aufgenommen von dem Teilfonds Cleome Index Euro Corporate Bonds mit Wirkung zum 28. Juni 2021
- Cleome Index Global Equities, aufgenommen von dem Teilfonds Cleome Index World Equities mit Wirkung zum 24. November 2021

Die ausgegebenen Anteilsklassen sind die folgenden:

- Die **Anteilsklasse C** steht sowohl natürlichen als auch juristischen Personen offen.
- Die **Anteilsklasse I** ist ausschließlich institutionellen Anlegern vorbehalten.
- Die **Anteilsklasse R** ist Finanzintermediären vorbehalten (einschließlich Vertriebsstellen und Plattformen), die:
 - verschiedene Vereinbarungen mit ihren Kunden bezüglich der Bereitstellung von Wertpapierdienstleistungen in Verbindung mit dem Teilfonds geschlossen haben, und
 - die aufgrund der geltenden Rechts- und Verwaltungsvorschriften oder aufgrund von Vereinbarungen mit ihren Kunden von der Verwaltungsgesellschaft in Verbindung mit der Bereitstellung der oben genannten Wertpapierdienstleistungen keine Abgaben, Gebühren oder sonstige finanzielle Vergünstigungen annehmen oder einbehalten dürfen.
- Die **Anteilsklasse R2** ist folgenden Anlegern vorbehalten:
 - Vertriebsstellen und/oder Finanzintermediären, die von der Verwaltungsgesellschaft zugelassen wurden, wobei die Verwaltungsgesellschaft für Anlagen in dieser Anteilsklasse von keinem Unternehmen der Gruppe Candriam eine Vergütung erhält, wenn die Anlagen in den Anteilen letztlich im Rahmen eines Mandats erfolgen.
 - OGA, die von der Verwaltungsgesellschaft zugelassen wurden.
- Die **Anteilsklasse S** ist ausschließlich institutionellen Anlegern vorbehalten, die von der Verwaltungsgesellschaft speziell zugelassen wurden. Ihr Mindestbetrag bei Erstzeichnung beläuft sich auf 50.000.000 EUR (bzw. den entsprechenden Gegenwert auf Beschluss des Verwaltungsrats) bzw. den Gegenwert in Fremdwährungen bei auf Fremdwährungen lautenden Anteilsklassen. Dieser Mindestbetrag kann vom Verwaltungsrat der SICAV geändert werden, sofern eine Gleichbehandlung der Anteilinhaber am Bewertungstag gewährleistet ist.
- Die **Anteilsklasse V** ist ausschließlich institutionellen Anlegern vorbehalten, die einen in den Fact Sheets angegebenen Mindestbetrag zeichnen.
- Die **Anteilsklasse V2** ist eine Anteilsklasse ohne Performancegebühren und institutionellen/professionellen Anlegern, Vertriebsstellen und/oder Finanzintermediären vorbehalten, die von der Verwaltungsgesellschaft zugelassen wurden. Ihr Mindestbetrag bei Erstzeichnung beläuft sich auf EUR 30.000.000 oder den Gegenwert in Fremdwährungen bei auf Fremdwährungen lautenden Anteilsklassen (dieser Mindestbetrag kann vom Verwaltungsrat geändert werden, sofern eine Gleichbehandlung aller Anteilinhaber an einem bestimmten Bewertungstag gewährleistet ist).
- Die **Anteilsklasse Y** ist ausschließlich institutionellen Anlegern vorbehalten, die von der Verwaltungsgesellschaft speziell zugelassen wurden.
- Die **Anteilsklasse Z** ist folgenden Anlegern vorbehalten:
 - institutionellen/professionellen Anlegern, die von der Verwaltungsgesellschaft zugelassen wurden. Die Portfolioverwaltung in dieser Anteilsklasse wird unmittelbar über den mit dem Anleger geschlossenen Vertrag vergütet. Daher fallen auf die Vermögenswerte dieser Anteilsklasse keine Portfolioverwaltungsgebühren an.
 - OGA, die von der Verwaltungsgesellschaft genehmigt wurden und von einem Unternehmen der Candriam-Gruppe verwaltet werden.

Cleome Index

Sonstige Erläuterungen zum Jahresabschluss

Anhangangabe 1 – Allgemeines (Fortsetzung)

Darüber hinaus kann für die Anteilsklassen ein Verfahren zur Währungsabsicherung angewandt werden:

- Basiswährungsgesicherte Anteilsklassen:

Ziel dieser abgesicherten Anteilsklassen ist es, die Auswirkungen von Wechselkursschwankungen zwischen der Basiswährung des Teilfonds und der Währung, auf die die jeweilige abgesicherte Anteilsklasse lautet, zu verringern.

Mit dieser Art der Absicherung soll erreicht werden, dass sich die Performance der abgesicherten Anteilsklasse auf angemessener Grundlage (d. h. um die Zinsdifferenz zwischen den beiden Währungen bereinigt) mit der Performance einer Anteilsklasse, die auf die Basiswährung des Teilfonds lautet, vergleichen lässt. Diese Absicherungsart wird in der Bezeichnung der Anteilsklasse durch Hinzufügung des Suffixes H gekennzeichnet.

- Anteilsklassen mit Absicherung gegenüber den Währungen der Vermögenswerte

Ziel dieser abgesicherten Anteilsklassen ist es, die Auswirkungen von Wechselkursschwankungen zwischen den Währungen, auf die die Vermögenswerte des Teilfonds lauten, und der Währung, auf die die jeweilige abgesicherte Anteilsklasse lautet, zu verringern. Diese Absicherungsart wird in der Bezeichnung der Anteilsklasse durch Hinzufügung des Suffixes AH gekennzeichnet.

Die ausgegebenen Anteile werden im Abschnitt „Statistiken“ zu den einzelnen Teilfonds ausführlich beschrieben.

Anhangangabe 2 – Wesentliche Rechnungslegungsgrundsätze

Der Jahresabschluss der SICAV wurde in Übereinstimmung mit den luxemburgischen Vorschriften für Organismen für gemeinsame Anlagen erstellt. Aufgrund von Rundungsregeln können in einigen Summen oder Zwischensummen des Jahresabschlusses geringfügige Abweichungen auftreten. Die für den Jahresabschluss verwendeten Nettoinventarwerte beziehen sich auf den 31. Dezember 2021. Der Nettoinventarwert jedes Teilfonds wurde zum 3. Januar 2022 basierend auf den zuletzt bekannten Preisen zum Bewertungszeitpunkt berechnet.

a) Bewertung des Portfolios der einzelnen Teilfonds

Die Bewertung eines Wertpapiers, das zum Handel an einer amtlichen Notierung oder an einem anderen geregelten Markt mit ordnungsgemäßer Funktionsweise, der anerkannt und für das Publikum offen ist, zugelassen ist, erfolgt auf der Grundlage des letzten in Luxemburg am Bewertungstag bekannten Kurses oder, wenn diese Aktie an mehreren Märkten gehandelt wird, auf der Grundlage des letzten bekannten Kurses an dem Hauptmarkt, an dem sie gehandelt wird. Ist der letzte bekannte Preis nicht repräsentativ, erfolgt die Bewertung auf der Grundlage des wahrscheinlichen Veräußerungswerts, der vom Verwaltungsrat nach bestem Wissen und Gewissen geschätzt wird. Wertpapiere, die weder an einer Börse noch an einem anderen geregelten Markt, der anerkannt und für das Publikum offen ist, notiert sind oder gehandelt werden, werden auf der Grundlage des wahrscheinlichen Veräußerungswerts bewertet, der mit der gebotenen Vorsicht und in gutem Glauben geschätzt wird. Alle anderen Vermögenswerte werden von den Geschäftsführern auf der Grundlage des wahrscheinlichen Veräußerungswerts bewertet, der nach Treu und Glauben und nach allgemein anerkannten Grundsätzen und Verfahren geschätzt werden muss.

b) Realisierte Nettogewinn oder Verluste aus Wertpapierverkäufen

Die realisierten Gewinne oder Verluste aus Wertpapierverkäufen in jedem Teilfonds werden auf der Grundlage der durchschnittlichen Kosten der verkauften Wertpapiere berechnet.

c) Umrechnung von Fremdwährungen

Die in einer anderen Währung als der Referenzwährung der einzelnen Teilfonds ausgedrückten Werte werden zu dem am Abschlussdatum geltenden Wechselkurs in diese Währung umgerechnet.

Erträge und Aufwendungen, die auf eine andere Währung als die Referenzwährung des jeweiligen Teilfonds lauten, werden zu den am Transaktionsdatum geltenden Wechselkursen in die jeweilige Währung umgerechnet.

Die Erwerbskosten von Wertpapieren der einzelnen Teilfonds, die auf eine andere Währung als die Referenzwährung des Teilfonds lauten, werden zu den am Tag des Erwerbs geltenden Wechselkursen in diese Währung umgerechnet.

Zum 31. Dezember 2021 verwendete Wechselkurse:

1 EUR =	1.564150	AUD	1 EUR =	0.839600	GBP	1 EUR =	10.028150	NOK	1 EUR =	1.533100	SGD
1 EUR =	1.436500	CAD	1 EUR =	8.865950	HKD	1 EUR =	1.661000	NZD	1 EUR =	1.137200	USD
1 EUR =	1.036150	CHF	1 EUR =	130.954250	JPY	1 EUR =	10.296000	SEK	1 EUR =	18.149750	ZAR
1 EUR =	7.437600	DKK									

d) Kombinierte Jahresabschlüsse der SICAV

Die kombinierte Aufstellung des Nettovermögens der SICAV und die kombinierte Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens, die in EUR ausgewiesen sind, entsprechen der Summe aus der Aufstellung des Nettovermögens und der Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens jedes Teilfonds.

e) Bewertung von Optionen und Futures

Die Bewertung von Optionen und Futures, die an einer amtlichen Notierung oder einem sonstigen geregelten Markt zugelassen sind, erfolgt auf der Grundlage des letzten bekannten Kurses oder, wenn die Option an mehreren Märkten gehandelt wird, auf der Grundlage des letzten bekannten Kurses an dem Markt, an dem der Vertrag von der SICAV abgeschlossen wurde.

Sonstige Erläuterungen zum Jahresabschluss

Anhangangabe 2 – Wesentliche Rechnungslegungsgrundsätze (Fortsetzung)

Optionen und Futures, die nicht an einer Börse oder einem sonstigen geregelten Markt gehandelt werden, werden zu ihrem wahrscheinlichen Marktwert bewertet, der konservativ und in gutem Glauben geschätzt wird. Der Marktwert der Optionen ist in der Aufstellung des Nettovermögens unter der Rubrik „Optionen (Long-Position) / (Short-Position) zum Marktwert“ enthalten.

Die realisierten Gewinne / (Verluste) und die Veränderung der nicht realisierten Wertsteigerungen / Abschreibungen auf Optionen werden in der Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens unter den Überschriften „Realisierter Nettogewinn / (-verlust) aus Optionen“ und „Veränderung der nicht realisierten Nettowertsteigerung / -abschreibung aus Optionen“ ausgewiesen.

Der nicht realisierte Wertzuwachs / (Wertverlust) von Terminkontrakten wird in der Nettovermögensaufstellung unter „Nicht realisierter Wertzuwachs / (Wertverlust) von Terminkontrakten (netto)“ ausgewiesen. Veränderungen am Marktwert von offenen Futures werden als nicht realisierte Gewinne/Verluste in der Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens unter „Veränderung bei nicht realisierten Gewinnen/Verlusten aus Futures“ erfasst. Realisierte Gewinne oder Verluste, die der Differenz zwischen dem Wert des Kontrakts zum Zeitpunkt seiner Eröffnung und dem Wert zum Zeitpunkt seiner Schließung entsprechen, werden bei der Schließung oder dem Verfall von Futures-Kontrakten in der Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens unter „Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Futures“ ausgewiesen.

Einzelheiten zu ausstehenden Optionen und Finanzterminkontrakten finden Sie ggf. im Abschnitt „Erläuterungen zum Jahresabschluss – Planung für derivative Instrumente“.

f) Bewertung von Devisenterminkontrakten

Die Devisenterminkontrakte werden auf der Grundlage der am Abschlussdatum geltenden Devisenterminkurse bewertet, die für den verbleibenden Zeitraum bis zum Verfallsdatum gelten. Der nicht realisierte Wertzuwachs / (Wertverlust) aus Devisenterminkontrakten wird in der Nettovermögensaufstellung unter „Nicht realisierter Wertzuwachs / (Wertverlust) aus Devisenterminkontrakten“ ausgewiesen.

Die daraus resultierenden realisierten Gewinne / (Verluste) und die Veränderung der nicht realisierten Wertsteigerung / Wertminderung sind in der Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens unter „Realisierter Nettogewinn / (-verlust) aus Devisenterminkontrakten“ bzw. „Veränderung der nicht realisierten Nettowertsteigerung / -minderung aus Devisenterminkontrakten“ enthalten.

Einzelheiten zu Devisenterminkontrakten finden Sie ggf. im Abschnitt „Anhang zum Abschluss - Aufstellung der derivativen Instrumente“.

g) Transaktionskosten

In dem am 31. Dezember 2021 endenden Geschäftsjahr fielen für die SICAV beim Kauf und Verkauf von Wertpapieren, Geldmarktinstrumenten, sonstigen zulässigen Anlagen und Derivaten Transaktionskosten und Maklergebühren an. Diese Kosten werden in der Übersicht über die Entwicklung des Nettovermögens unter der Überschrift „Transaktionskosten“ ausgewiesen.

h) Erträge

Zinserträge laufen gemäß den Bedingungen der zugrunde liegenden Anlage auf. Erträge werden nach Abzug einer etwaigen Quellensteuer erfasst. Dividenden werden auf EX-Datumsbasis ausgewiesen.

i) In Anlageportfolios verwendete Abkürzungen

A: Jährliche
FL.R: Variabel verzinsliche Anleihen
Q: Vierteljährlich
S: Halbjährlich
XX: Anleihen ohne festgelegte Laufzeit
ZCP oder U: Null-Coupon

Anhangangabe 3 – Verwaltungsgebühren

Candriam Luxembourg (nachfolgend als „Verwaltungsgesellschaft“ bezeichnet), eine Kommanditgesellschaft auf Aktien („société en commandite par actions“) luxemburgischen Rechts, wurde am 10. Juli 1991 in Luxemburg gegründet und nach Maßgabe eines zwischen der SICAV und Candriam Luxembourg geschlossenen Vertrags zur Verwaltungsgesellschaft der SICAV bestimmt.

Die Verwaltungsgesellschaft mit Sitz in SERENITY - Bloc B, 19-21, Route d'Arlon, L-8009 Strassen, ist eine Tochtergesellschaft der Candriam Group, einer Gesellschaft der New York Life Insurance Company Group.

Sie ist als Verwaltungsgesellschaft gemäß Kapitel 15 des Gesetzes vom 17. Dezember 2010 über OGAW zugelassen und ist berechtigt, die Tätigkeiten der gemeinsamen Portfolioverwaltung, der Verwaltung von Anlageportfolios und der Erbringung von Anlageberatungsdienstleistungen auszuüben.

Die Verwaltungsgesellschaft ist mit weitreichenden Befugnissen ausgestattet, um im Rahmen dieses Zwecks gemäß ihrer Satzung alle Handlungen im Zusammenhang mit dem Management und der Verwaltung der SICAV auszuführen. Sie ist für die Abläufe im Zusammenhang mit dem Portfoliomanagement, die Verwaltung (Verwaltungsstelle, Transferstelle (einschließlich der Registerführung)) und die Vermarktung (Vertrieb) zuständig.

Gemäß dem Gesetz vom 17. Dezember 2010 ist die Verwaltungsgesellschaft befugt, ihre Aufgaben, Befugnisse und Pflichten oder einen Teil davon an eine Person oder Gesellschaft zu übertragen, die sie für geeignet hält. Die Verwaltungsgesellschaft trägt jedoch die volle Verantwortung für die Handlungen, die von diesem (diesen) Vertreter(n) vorgenommen werden.

Cleome Index

Sonstige Erläuterungen zum Jahresabschluss

Anhangangabe 3 – Verwaltungsgebühren (Fortsetzung)

Im Wege eines auf unbefristete Dauer geschlossenen Delegationsvertrags hat die Verwaltungsgesellschaft unter eigener Aufsicht und Verantwortung sowie auf eigene Kosten die Portfolioverwaltung für die Teilfonds der SICAV mit Ausnahme des Teilfonds Cleome Index Euro Corporate Bonds auf ihre belgische Tochtergesellschaft Candriam Belgium mit Sitz in der Avenue des Arts 58 in B-1000 Brüssel übertragen. Diese Vereinbarung kann von jeder Partei unter Einhaltung einer Kündigungsfrist von 90 Tagen gekündigt werden.

Im Wege eines auf unbefristete Dauer geschlossenen Delegationsvertrags hat die Verwaltungsgesellschaft unter eigener Aufsicht und Verantwortung sowie auf eigene Kosten die Portfolioverwaltung für den Teilfonds Cleome Index Euro Corporate Bonds auf ihre französische Tochtergesellschaft Candriam France mit Sitz in der 40, rue Washington, F-75408 Paris Cedex 08, übertragen. Diese Vereinbarung kann von jeder Partei unter Einhaltung einer Kündigungsfrist von 90 Tagen gekündigt werden.

Die Verwaltungsgesellschaft erhält als Entgelt für ihre Dienstleistungen eine Verwaltungsgebühr, die als jährlicher Prozentsatz des durchschnittlichen Nettoinventarwerts ausgedrückt wird.

Diese Gebühren sind von der SICAV am Ende eines jeden Monats zu zahlen.

Zum 31. Dezember 2021 gelten die folgenden Gebührensätze:

Teilfonds	Anteilsklasse	Anteilsart	ISIN	Verwaltungsgebühr
Cleome Index EMU Equities	C	Thesaurierung	LU1292953335	1.00%
	C	Ausschüttung	LU1365257788	1.00%
	I	Thesaurierung	LU1292953418	0.12%
	R	Thesaurierung	LU1292953509	0.30%
	R	Ausschüttung	LU1718421743	0.30%
Cleome Index Euro Corporate Bonds	Z	Thesaurierung	LU1292953764	0.00%
	C	Thesaurierung	LU1542321093	0.25%
	C	Ausschüttung	LU1542321176	0.25%
	I	Thesaurierung	LU1542321259	0.15%
	R2	Thesaurierung	LU1542321416	0.12%
Cleome Index Euro Government Bonds	R2	Ausschüttung	LU1622416649	0.12%
	Z	Thesaurierung	LU1542321762	0.00%
	Y	Thesaurierung	LU1542321689	0.30%
	C	Thesaurierung	LU1542321929	0.20%
	I	Thesaurierung	LU1542322224	0.12%
Cleome Index Euro Long Term Bonds	R2	Thesaurierung	LU1542322653	0.10%
	R2	Ausschüttung	LU1622416722	0.10%
	S	Thesaurierung	LU1933089531	0.05%
	Z	Thesaurierung	LU1542322810	0.00%
	C	Thesaurierung	LU1542323032	0.20%
Cleome Index Euro Short Term Bonds	I	Thesaurierung	LU1542323206	0.12%
	Z	Thesaurierung	LU1542324196	0.00%
	Y	Thesaurierung	LU1542323891	0.30%
	C	Thesaurierung	LU1542324352	0.20%
Cleome Index Europe Equities	I	Thesaurierung	LU1542324519	0.12%
	V	Thesaurierung	LU1542324865	0.08%
	Z	Thesaurierung	LU1542325086	0.00%
	Y	Thesaurierung	LU1542324949	0.30%
	C	Thesaurierung	LU0461106337	1.00%
	I	Thesaurierung	LU0461106683	0.12%
Cleome Index Global Equities (siehe Anhangangabe 1)	R	Thesaurierung	LU1006087669	0.30%
	R	Ausschüttung	LU1718421826	0.30%
	V2	Thesaurierung	LU0438017591	0.05%
	Z	Thesaurierung	LU0479710047	0.00%
	Z	Ausschüttung	LU1379319319	0.00%
	Y	Thesaurierung	LU0102768701	0.30%
	C	Ausschüttung	LU0547832997	1.10%
Cleome Index USA Equities	I	Thesaurierung	LU0644254632	0.12%
	R	Thesaurierung	LU1718421586	0.30%
	R	Ausschüttung	LU1718421669	0.30%
	Z	Thesaurierung	LU0644254475	0.00%
	C	Thesaurierung	LU0461105529	1.00%
	C - USD - UnH	Thesaurierung	LU1006087313	1.00%
	C - USD - UnH	Ausschüttung	LU1365257515	1.00%
	I	Thesaurierung	LU2197357747	0.12%
	I - USD - UnH	Thesaurierung	LU0461105875	0.12%
	R	Thesaurierung	LU1006087586	0.30%
	R	Ausschüttung	LU1718422394	0.30%
	V	Thesaurierung	LU2197358042	0.08%
	Z	Thesaurierung	LU0479709973	0.00%
	Z	Ausschüttung	LU1379320085	0.00%
	Y	Thesaurierung	LU0102768370	0.30%
R - USD - UnH	Thesaurierung	LU1718422477	0.30%	
R - USD - UnH	Ausschüttung	LU1718422550	0.30%	
V - USD - UnH	Thesaurierung	LU0438016601	0.08%	
Z - USD - UnH	Thesaurierung	LU0644256330	0.00%	

Cleome Index

Sonstige Erläuterungen zum Jahresabschluss

Anhangangabe 3 – Verwaltungsgebühren (Fortsetzung)

Teilfonds	Anteilsklasse	Anteilsart	ISIN	Verwaltungsgebühr
Cleome Index World Equities	C	Ausschüttung	LU1365257945	1.00%
	I	Thesaurierung	LU1292954903	0.12%
	R	Thesaurierung	LU1292955033	0.30%
	R	Ausschüttung	LU1718422634	0.30%
	Z	Thesaurierung	LU1292955207	0.00%

Anhangangabe 4 – Verwaltungsgebühren

Die folgenden Teilfonds zahlen lediglich für die Anteilsklassen Y eine Vertriebsgebühr an die Verwaltungsgesellschaft. Diese Gebühr ist vierteljährlich zu zahlen und wird anhand des durchschnittlichen Nettovermögens der betreffenden Anteilsklasse im Verhältnis zum Volumen der vertriebenen Anteile berechnet.

Teilfonds	Anteilsklasse	Anteilsart	ISIN	Jahressatz
Cleome Index USA Equities	Y	Thesaurierung	LU0102768370	1.04%
Cleome Index Europe Equities	Y	Thesaurierung	LU0102768701	1.04%
Cleome Index Euro Short Term Bonds	Y	Thesaurierung	LU1542324949	0.58%
Cleome Index Euro Long Term Bonds	Y	Thesaurierung	LU1542323891	0.84%
Cleome Index Euro Corporate Bonds	Y	Thesaurierung	LU1542321689	0.84%

Anhangangabe 5 – Betriebs- und Verwaltungskosten

Die SICAV trägt die laufenden Betriebs- und Verwaltungskosten, die zur Deckung aller Gemeinkosten und variablen Kosten, der Gebühren, Entgelte und sonstigen Aufwendungen, wie nachstehend definiert („Betriebs- und Verwaltungskosten“), anfallen.

Die Betriebs- und Verwaltungskosten umfassen unter anderem die folgenden Ausgaben:

a) die direkt von der SICAV getätigten Ausgaben, darunter unter anderem die Gebühren und Kosten der Depotbank, die Gebühren und Auslagen der zugelassenen unabhängigen Wirtschaftsprüfer, die Kosten für die Absicherung von Anteilsklassen, einschließlich der von der Verwaltungsgesellschaft in Rechnung gestellten Kosten, die an die Verwaltungsratsmitglieder gezahlten Gebühren und die angemessenen Ausgaben und Aufwendungen, die den Verwaltungsratsmitgliedern entstanden sind oder für sie getätigt wurden;

b) eine an die Verwaltungsgesellschaft zu zahlende „Servicegebühr“, die den nach Abzug der vorstehend unter (a) aufgeführten Ausgaben verbleibenden Teil der Betriebs- und Verwaltungskosten abdeckt, das heißt unter anderem die folgenden Kosten und Gebühren: die Gebühren und Kosten der Domizilstelle, der Verwaltungsstelle sowie der Übertragungs- und Registerführungsstelle; die Kosten für die Registrierung und Aufrechterhaltung der Registrierung in allen relevanten Rechtsgebieten (z. B. die von den betreffenden Aufsichtsbehörden erhobenen Gebühren, die Kosten für Übersetzungen und die Vergütungen der Vertreter im Ausland und der lokalen Zahlstellen); die Kosten für die Börsennotierung und deren Aufrechterhaltung; die Kosten für die Veröffentlichung der Anteilspreise; die Kosten für Porto und Telekommunikation; die Kosten für die Erstellung, den Druck, die Übersetzung und die Verteilung der Prospekte, der Dokumente mit den wesentlichen Anlegerinformationen, der Mitteilungen an die Anteilinhaber, der Finanzberichte oder aller sonstigen Dokumente für die Anteilinhaber; die Honorare und Kosten für rechtliche Belange; die Gebühren und Kosten für Zugriffe auf kostenpflichtige Informationen oder Daten (Abonnements, Lizenzgebühren und jegliche anderen Kosten); die Kosten für die Verwendung eingetragener Marken durch die SICAV sowie die Kosten und Gebühren, die der Verwaltungsgesellschaft und/oder den von ihr beauftragten Stellen und/oder jeder anderen von der SICAV selbst beauftragten Stelle und/oder unabhängigen Sachverständigen zustehen.

Die Betriebs- und Verwaltungskosten werden als jährlicher Prozentsatz des durchschnittlichen Nettoinventarwerts der einzelnen Anteilsklassen ausgedrückt und sind monatlich zu zahlen.

Sollten am Ende eines bestimmten Zeitraums die tatsächlichen Gebühren und Aufwendungen höher sein als der für eine Anteilsklasse festgelegte Prozentsatz der Betriebs- und Verwaltungskosten, so würde die Verwaltungsgesellschaft die Differenz selbst bezahlen. Sollten hingegen die tatsächlichen Gebühren und Aufwendungen unter dem für eine Anteilsklasse festgelegten Prozentsatz der Betriebs- und Verwaltungskosten liegen, würde die Verwaltungsgesellschaft die Differenz einbehalten.

Die Verwaltungsgesellschaft ist berechtigt, die SICAV anzuweisen, alle oder einen Teil der oben aufgeführten Kosten direkt aus ihrem Vermögen zu begleichen.

In einem solchen Fall würde sich der Betrag der Betriebs- und Verwaltungskosten entsprechend verringern.

Die zum 31. Dezember 2021 geltenden Höchstsätze lauten wie folgt:

Teilfonds	Anteilsklasse	Anteilsart	ISIN	Höchstsatz
Cleome Index EMU Equities	C	Thesaurierung	LU1292953335	0.40%
	C	Ausschüttung	LU1365257788	0.40%
	I	Thesaurierung	LU1292953418	0.30%
	R	Thesaurierung	LU1292953509	0.40%
	R	Ausschüttung	LU1718421743	0.40%
	Z	Thesaurierung	LU1292953764	0.30%
Cleome Index Euro Corporate Bonds	C	Thesaurierung	LU1542321093	0.33%
	C	Ausschüttung	LU1542321176	0.33%
	I	Thesaurierung	LU1542321259	0.25%
	R2	Thesaurierung	LU1542321416	0.33%

Cleome Index

Sonstige Erläuterungen zum Jahresabschluss

Anhangangabe 5 – Betriebs- und Verwaltungskosten (Fortsetzung)

Teilfonds	Anteilsklasse	Anteilsart	ISIN	Höchstsatz	
Cleome Index Euro Government Bonds	R2	Ausschüttung	LU1622416649	0.33%	
	Z	Thesaurierung	LU1542321762	0.25%	
	Y	Thesaurierung	LU1542321689	0.25%	
	C	Thesaurierung	LU1542321929	0.33%	
	I	Thesaurierung	LU1542322224	0.25%	
	R2	Thesaurierung	LU1542322653	0.33%	
Cleome Index Euro Long Term Bonds	R2	Ausschüttung	LU1622416722	0.33%	
	S	Thesaurierung	LU1933089531	0.25%	
	Z	Thesaurierung	LU1542322810	0.25%	
	C	Thesaurierung	LU1542323032	0.33%	
	I	Thesaurierung	LU1542323206	0.25%	
	Z	Thesaurierung	LU1542324196	0.25%	
Cleome Index Euro Short Term Bonds	Y	Thesaurierung	LU1542323891	0.25%	
	C	Thesaurierung	LU1542324352	0.33%	
	I	Thesaurierung	LU1542324519	0.25%	
	V	Thesaurierung	LU1542324865	0.25%	
	Z	Thesaurierung	LU1542325086	0.25%	
	Y	Thesaurierung	LU1542324949	0.25%	
Cleome Index Europe Equities	C	Thesaurierung	LU0461106337	0.40%	
	I	Thesaurierung	LU0461106683	0.30%	
	R	Thesaurierung	LU1006087669	0.40%	
	R	Ausschüttung	LU1718421826	0.40%	
	V2	Thesaurierung	LU0438017591	0.30%	
	Z	Thesaurierung	LU0479710047	0.30%	
	Z	Ausschüttung	LU1379319319	0.30%	
	Y	Thesaurierung	LU0102768701	0.40%	
	C	Ausschüttung	LU0547832997	0.40%	
	I	Thesaurierung	LU0644254632	0.33%	
	R	Thesaurierung	LU1718421586	0.40%	
	R	Ausschüttung	LU1718421669	0.40%	
Cleome Index USA Equities	Z	Thesaurierung	LU0644254475	0.33%	
	C	Thesaurierung	LU0461105529	0.40%	
	C - USD - UnH	Thesaurierung	LU1006087313	0.40%	
	C - USD - UnH	Ausschüttung	LU1365257515	0.40%	
	I	Thesaurierung	LU2197357747	0.25%	
	I - USD - UnH	Thesaurierung	LU0461105875	0.23%	
	R	Thesaurierung	LU1006087586	0.40%	
	R	Ausschüttung	LU1718422394	0.40%	
	V	Thesaurierung	LU2197358042	0.25%	
	Z	Thesaurierung	LU0479709973	0.23%	
	Z	Ausschüttung	LU1379320085	0.23%	
	Y	Thesaurierung	LU0102768370	0.40%	
	R - USD - UnH	Thesaurierung	LU1718422477	0.40%	
	R - USD - UnH	Ausschüttung	LU1718422550	0.40%	
	V - USD - UnH	Thesaurierung	LU0438016601	0.23%	
	Z - USD - UnH	Thesaurierung	LU0644256330	0.23%	
	Cleome Index World Equities	C	Ausschüttung	LU1365257945	0.40%
		I	Thesaurierung	LU1292954903	0.30%
R		Thesaurierung	LU1292955033	0.40%	
R		Ausschüttung	LU1718422634	0.40%	
Z		Thesaurierung	LU1292955207	0.30%	

Anhangangabe 6 – Zeichnungssteuer

Die SICAV unterliegt in Luxemburg einer jährlichen Steuer, die sich auf 0,05 % des Nettovermögens beläuft. Für die den institutionellen Anlegern vorbehaltenen Anteilsklassen gilt ein ermäßigter Satz von 0,01 %. Die gelisteten indexgebundenen Teilfonds sind von der Abonnementsteuer befreit. Diese Steuer ist vierteljährlich zahlbar und wird anhand des Nettovermögens der SICAV zum Ende des Quartals, auf das sich die Steuer bezieht, berechnet.

Auf das Vermögen, das die SICAV in Anteilen anderer OGAW hält, die in Luxemburg bereits der Zeichnungssteuer unterliegen, wird keine Zeichnungssteuer fällig.

Die belgische Regierung hat ein Gesetz erlassen, wonach der Nettoinventarwert der in Belgien registrierten ausländischen Anlagefonds einmal pro Jahr besteuert wird. Diese jährliche Steuer wird auf die Nettobeträge berechnet, die von belgischen Finanzintermediären als in Belgien investiert gelten. In Ermangelung einer ausreichenden Erklärung in Bezug auf diese Zahlen ist die Steuerbehörde berechtigt, die Steuer auf das gesamte Vermögen dieser Teilfonds zu berechnen. Das belgische Gesetz vom 17. Juni 2013 über steuerliche und finanzielle Bestimmungen sowie Bestimmungen bezüglich der nachhaltigen Entwicklung setzt den jährlichen Steuersatz für Organismen für gemeinsame Anlagen mit Wirkung zum 1. Januar 2014 auf 0,0925 % fest.

Die SICAV hat vorsorglich bei der belgischen Steuerbehörde und beim Gericht erster Instanz in Brüssel eine Klage auf Rückerstattung der Steuer eingereicht. Zum jetzigen Zeitpunkt ist es nicht möglich, dem Ausgang des Rechtsstreits oder einer eventuellen Erstattung zugunsten der SICAV vorzugreifen. In einem ähnlichen Fall legte der belgische Staat beim Kassationsgerichtshof Berufung gegen die zugunsten des Klägers ergangenen Urteile des Berufungsgerichts ein. Die Verwaltungsgesellschaft wurde gerade darüber informiert, dass der Kassationsgerichtshof am 25. März 2022 gegen den Kläger entschieden hat, was einen positiven Ausgang des Rechtsstreits zugunsten der SICAV eher hypothetisch erscheinen lässt.

Cleome Index

Sonstige Erläuterungen zum Jahresabschluss

Anhangangabe 7 – Wertpapierleihgeschäfte

Mit einem Delegationsvertrag vom 18. Februar 2014 hat die Verwaltungsgesellschaft die Durchführung der Wertpapierleihgeschäfte unter ihrer Aufsicht und Verantwortung an Candriam France, eine vereinfachte Aktiengesellschaft mit Sitz in 40, rue Washington, F-75408 Paris Cedex 08, übertragen. Dieser Vertrag kann von jeder Partei unter Einhaltung einer Frist von 90 Tagen schriftlich gekündigt werden. Zum 31. Dezember 2021 setzten sich die verliehenen Wertpapiere wie folgt zusammen:

Teilfonds	Währung	Marktwert von verliehenen Wertpapieren	Sicherheiten in Form von Wertpapieren
Cleome Index EMU Equities	EUR	47,538,117	54,798,578
Cleome Index Euro Corporate Bonds	EUR	5,187,067	5,329,955
Cleome Index Euro Government Bonds	EUR	72,455,136	76,193,047
Cleome Index Euro Long Term Bonds	EUR	3,902,052	4,013,412
Cleome Index Euro Short Term Bonds	EUR	35,469,397	37,022,579
Cleome Index Europe Equities	EUR	122,958,426	138,950,140
Cleome Index USA Equities	EUR	74,392,137	79,896,672
Cleome Index World Equities	EUR	9,859,853	10,828,456

Folgende Arten von Finanzgarantien sind zulässig:

- Barsicherheiten, die auf die Referenzwährung des jeweiligen Teilfonds lauten;
- Schuldtitel guter Bonität (mit einem von einer Ratingagentur vergebenen Rating von mindestens BBB-/Baa3 oder ähnlich), die von einem Emittenten des öffentlichen Sektors eines OECD-Landes aufgelegt wurden (Staaten, supranationale Organisationen usw.) und deren Emissionsvolumen mindestens EUR 250 Millionen beträgt;
- Schuldtitel guter Bonität (mit einem von einer Ratingagentur vergebenen Rating von mindestens BBB-/Baa3 oder ähnlich), die von einem Emittenten des Privatsektors eines OECD-Landes aufgelegt wurden und deren Emissionsvolumen mindestens EUR 250 Millionen beträgt;
- Aktien, die an einem geregelten Markt in einem Mitgliedsstaat der Europäischen Union oder einer Wertpapierbörse eines Mitgliedstaates der OECD notiert sind oder gehandelt werden, unter der Voraussetzung, dass diese in einem wichtigen Index enthalten sind;
- Anteile bzw. Aktien von Organismen für gemeinsame Anlagen mit hinreichender Liquidität, die in Geldmarktinstrumenten, in Anleihen guter Bonität oder in Aktien anlegen, die die vorstehend aufgeführten Bedingungen erfüllen.

Die Gegenparteien im Zusammenhang mit den offenen Wertpapierleihpositionen sind BNP Paribas Securities Services SCA, BNP Paribas, Natixis SA, Banco Santander, Goldman Sachs Bank Europe SE, Scotiabank, Société Générale SA, Crédit Agricole Corporate and Investment Bank, UniCredit AG und Morgan Stanley.

Die folgenden Ertragsposten wurden im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 verbucht:

Teilfonds	Währung	Bruttogesamtbetrag der Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	Direkte/indirekte Kosten und Gebühren, die vom Bruttobetrag der Erträge aus Wertpapierleihgeschäften abgezogen wurden	Gesamtnettobetrag der Erträge aus Wertpapierleihgeschäften
Cleome Index EMU Equities	EUR	49,433	19,773	29,660
Cleome Index Euro Corporate Bonds	EUR	8,183	3,273	4,910
Cleome Index Euro Government Bonds	EUR	49,187	19,675	29,512
Cleome Index Euro Long Term Bonds	EUR	1,688	675	1,013
Cleome Index Euro Short Term Bonds	EUR	31,273	12,509	18,764
Cleome Index Europe Equities	EUR	164,735	65,894	98,841
Cleome Index Global Equities	EUR	745	298	447
Cleome Index USA Equities	EUR	120,527	48,211	72,316
Cleome Index World Equities	EUR	15,020	6,008	9,012

Der Ertrag, nach Abzug von Kosten, Gebühren und Kommissionen für die Verwaltungsstelle werden von der SICAV entgegengenommen.

Die direkten und indirekten Kosten und Gebühren, die Candriam France und Candriam Luxembourg erhalten haben, belaufen sich für alle Teilfonds auf 19 % bzw. 1 %.

Die von der CACEIS Bank, Luxembourg Branch erhaltenen Provisionen belaufen sich auf 20 % der Bruttoerträge.

Candriam France und Candriam Luxembourg sind verbundene Parteien der SICAV.

Anhangangabe 8 – Dividenden

Die SICAV hat in dem am 31. Dezember 2021 endenden Jahr die folgenden Dividenden ausgeschüttet:

Teilfonds	Anteilsklasse	Währung	Dividende	Ex-Tag
Cleome Index EMU Equities	C	EUR	3.09	28/04/2021
Cleome Index EMU Equities	R	EUR	2.71	28/04/2021
Cleome Index Euro Corporate Bonds	R2	EUR	1.10	28/04/2021
Cleome Index Euro Government Bonds	R2	EUR	0.90	28/04/2021
Cleome Index Europe Equities	R	EUR	3.30	28/04/2021

Cleome Index

Sonstige Erläuterungen zum Jahresabschluss

Anhangangabe 8 – Dividenden (Fortsetzung)

Teilfonds	Anteilsklasse	Währung	Dividende	Ex-Tag
Cleome Index Europe Equities	Z	EUR	37.67	28/04/2021
Cleome Index USA Equities	C - USD - ungesichert	USD	3.40	28/04/2021
Cleome Index USA Equities	R - USD - ungesichert	USD	2.68	28/04/2021
Cleome Index USA Equities	R	EUR	2.87	28/04/2021
Cleome Index USA Equities	Z	EUR	27.78	28/04/2021
Cleome Index World Equities	C	EUR	3.61	28/04/2021
Cleome Index Global Equities (siehe Anhangangabe 1)	C	EUR	3.07	28/04/2021
Cleome Index Global Equities (siehe Anhangangabe 1)	R	EUR	3.32	28/04/2021

Anhangangabe 9 - Swing Pricing

Für alle Teilfonds der SICAV wurde die folgende Maßnahme vorgesehen:

An Bewertungstagen, an denen die Differenz zwischen Zeichnungen und Rücknahmen eines Teilfonds (d. h. die Nettotransaktionen) einen vom Verwaltungsrat vorher festgelegten prozentualen Grenzwert (Partial Swing Pricing) überschreitet, behält sich der Verwaltungsrat das Recht vor:

- bei Aktienteilfonds den Nettoinventarwert (NIW) zu bestimmen, indem ein pauschaler Prozentsatz der den Marktpraktiken beim Kauf oder Verkauf von Wertpapieren entsprechenden Gebühren und Kosten zu den Vermögenswerten hinzuaddiert (bei Nettozeichnungen) bzw. abgezogen wird (bei Nettorücknahmen) für Cleome Index EMU Equities, Cleome Index Europe Equities, Cleome Index Global Equities, Cleome Index USA Equities und Cleome Index World Equities.
- bei Rentenfonds den Wert der Wertpapiere des Teilfonds auf der Grundlage der Kauf- oder Verkaufspreise oder durch die Festlegung von Spreads zu bewerten, die den betreffenden Markt widerspiegeln (im Falle von Nettozeichnungen bzw. -rücknahmen), für Cleome Index Euro Corporate Bonds, Cleome Index Euro Government Bonds, Cleome Index Euro Long Term Bonds und Cleome Index Euro Short Term Bonds.

Unterjährig wurde das Swing Pricing auf die Nettoinventarwerte der nachfolgenden Teilfonds angewandt: Cleome Index EMU Equities, Cleome Index Euro Corporate Bonds, Cleome Index Euro Government Bonds, Cleome Index Euro Long Term Bonds, Cleome Index Euro Short Term Bonds, Cleome Index Europe Equities, Cleome Index Global Equities, Cleome Index USA Equities und Cleome Index World Equities.

Zum 31. Dezember 2021 wurde kein Swing angewendet.

Der Swing-Faktor ist der Betrag, um den der Nettoinventarwert schwankt, wenn der Swing-Pricing-Prozess ausgelöst wird, nachdem die Nettozeichnungen oder -rücknahmen die Swing-Schwelle überschritten haben. Folgende Faktoren sind bei der Bestimmung des Swing-Faktors unter anderem zu berücksichtigen:

Für die Equity-Methode:

- Vom Teilfonds gezahlte Netto-Maklerprovisionen
- Steuern (z. B. Stempelsteuer und Umsatzsteuer)

Für die Fixed-Income-Methode:

- Swing Pricing-Politik
- verbunden mit Geld-Brief-Spanne

Teilfonds	Maximaler Swing-Faktor Mittelzufluss (in %)	Maximaler Swing-Faktor Mittelabfluss (in %)
Cleome Index EMU Equities	0.15	0.02
Cleome Index Europe Equities	0.20	0.02
Cleome Index USA Equities	0.02	0.04
Cleome Index World Equities	0.06	0.04
Cleome Index Global Equities (siehe Anhangangabe 1)	0.14	0.04

Anhangangabe 10 Guthaben bei Banken und Brokern

Die Guthaben bei Kreditinstituten und Brokern in der Vermögensaufstellung umfassen die Kassenkonten und die Guthaben bei Brokern für zukünftige Verträge.

Der in der Vermögensaufstellung zum 31. Dezember 2021 enthaltene Teil der Barmittel bei Brokern in Barmittel bei Banken und Brokern stellt sich wie folgt dar:

Teilfonds	Währung	Barmittel bei Brokern
Cleome Index Euro Corporate Bonds	EUR	12.440

Anhangangabe 11 - Änderungen in der Portfoliozusammensetzung

Eine Liste der Transaktionen (Verkäufe und Käufe) in den Anlageportfolios ist kostenlos am Gesellschaftssitz der SICAV erhältlich.

Sonstige Erläuterungen zum Jahresabschluss

Anhangangabe 12 – Ereignisse nach dem Bilanzstichtag

Es gibt keine Ereignisse nach dem Bilanzstichtag.

Zusätzliche ungeprüfte Angaben

Globale Risikoexposition

Wie im CSSF-Rundschreiben 11/512 vorgeschrieben, muss der Verwaltungsrat der Gesellschaft das Risikomanagementverfahren der Gesellschaft festlegen und dabei entweder den Commitment-Ansatz oder den VaR-Ansatz verwenden.

Der Verwaltungsrat der Gesellschaft hat sich für die Anwendung des Commitment-Ansatzes als Verfahren zur Bestimmung des Gesamtrisikos für alle Teilfonds der Gesellschaft entschieden.

Mitwirkungs- und Abstimmungspolitik, Nutzung von Stimmrechten

Candriam übt Stimmrechte für die betrachteten Fonds aus.

Für alle Fragen zur Mitwirkung verweist Candriam auf die Mitwirkungspolitik und die zugehörigen Berichte, die auf der Candriam-Website einzusehen sind unter:

www.candriam.com/en/professional/market-insights/sri-publications/.

Stimmrechtsvertretung

Seit dem 1. Januar 2004 hat Candriam Luxembourg beschlossen, die mit den Anteilen, die sie im Namen ihrer Kunden verwaltet, verbundenen Stimmrechte aktiv auszuüben, und zwar in Übereinstimmung mit ihrer Mitwirkungspolitik. Diese Entscheidung belegt die Entschlossenheit von Candriam Luxembourg, seine Verantwortung im Hinblick auf die Corporate Governance zu übernehmen und seine Stimmrechte für die Unternehmen, in die es investiert, umfassend auszuüben. Die Einzelheiten zum Stimmrecht sind einzusehen auf der Website unter www.candriam.com/en/professional/market-insights/sri-publications/.

Für die vorliegende SICAV hat Candriam Stimmrechte für die folgenden Teilfonds ausgeübt:

- Cleome Index EMU Equities
- Cleome Index Europe Equities
- Cleome Index USA Equities
- Cleome Index World Equities.

Wie bereits angekündigt, finden Sie die Einzelheiten zum Stimmrecht auf der Website unter www.candriam.com/en/professional/market-insights/sri-publications/. Alle Hauptversammlungen, an denen die Verwaltungsgesellschaft teilgenommen hat oder bei denen sie vertreten war, sind im Detail aufgeführt, ebenso wie die verabschiedeten Beschlüsse, die effektiven Stimmen und die dazugehörigen Begründungen, wenn Stimmen gegen die Verwaltungsgesellschaft registriert wurden.

Candriam Luxembourg hat eine Stimmrechtsrichtlinie basierend auf vier Prinzipien der Corporate Governance formuliert. Abstimmungsentscheidungen werden basierend auf diesen Prinzipien getroffen:

1. Schutz aller Anlegerrechte gemäß der Regel „Ein Anteil – eine Stimme – eine Dividende“.
2. Garantiert gleichberechtigte Behandlung aller Anteilinhaber auch von ausländischen und Minderheitsaktionären.
3. Kommunikation von genauen und transparenten Finanzinformationen.
4. Rechenschaftspflicht und Unabhängigkeit des Verwaltungsrats und der externen Abschlussprüfer.

Im Rahmen seiner Abstimmungsentscheidung überzeugt sich Candriam Luxembourg, dass es alle für die zu treffende Entscheidung erforderlichen Informationen erhalten hat.

Die Analysten für Umwelt, Soziales und Governance (ESG) sowie Finanzen von Candriam Luxembourg untersuchen die den Aktionären vorgelegten Entschlüsse und berücksichtigen auch die Abstimmungsempfehlungen externer Unternehmensberater. Candriam Luxembourg behält sich jedoch im Hinblick auf seine Abstimmungen eine absolute Unabhängigkeit vor.

Diese Stimmrechtsrichtlinien sind einzusehen auf der Candriam Website (*) insbesondere zu folgenden Einzelheiten:

- Definition des Abstimmungsumfangs
- Identifizierung und Behebung von Interessenskonflikten
- Die Rolle von bevollmächtigten Beratern

Darüber hinaus wurde bei Candriam Luxembourg ein Ausschuss für die Stimmrechtsvertretung eingerichtet. Seine Aufgabe ist es, die Stimmrechtsrichtlinien zu bewerten und gegebenenfalls Änderungen vorzunehmen.

Der Ausschuss für die Stimmrechtsvertretung besteht aus internen Vertretern aus Management, Operations, Risk und den Teams von ESG-Research & Stewardship von Candriam. Vertreter der Rechtsabteilung können auf Anfrage den Versammlungen beiwohnen.

Bei Fonds mit Wertpapierleihgeschäften werden mindestens 20 % jeder Position systematisch zur Abstimmung reserviert (außer solchen, die in Märkten mit Aktiensperren gehandelt werden, bei denen der reservierte Teil kleiner sein kann).

Weitere Informationen über die Art, wie die Verwaltungsgesellschaft mit Wertpapierleihgeschäften während des Abstimmungszeitraums verfährt, finden Sie in der Candriam-Abstimmungspolitik unter <https://www.candriam.com/en/professional/market-insights/sri-publications/>.

(*) www.candriam.com/en/professional/market-insights/sri-publications/

Cleome Index

Zusätzliche ungeprüfte Angaben

Europäische Richtlinie über Aktionärsrechte (SRD II) (1)

Gemäß den in der europäischen Richtlinie „Rechte der Aktionäre“ festgelegten Transparenzregeln und in Bezug auf die jährliche Offenlegung gegenüber institutionellen Anlegern können Sie zusätzliche Informationen über die von Candriam umgesetzte Anlagestrategie und den Beitrag dieser Strategie zur mittel- bis langfristigen Performance des Fonds erhalten.

Sie können Ihre Anfrage an die folgende Adresse senden: <https://www.candriam.fr/contact/>.

Unsere Mitwirkungspolitik ist auf der Website von Candriam unter der folgenden Adresse verfügbar: <https://www.candriam.fr/>

- (1) Richtlinie (EU) 2017/828 des Europäischen Parlaments und des Rates zur Änderung der Richtlinie 2007/36/EG im Hinblick auf die Förderung der langfristigen Mitwirkung der Aktionäre.
- (2)

Teilfonds	Portfolio- umschlagsrate (in %)
Cleome Index EMU Equities	-5.08
Cleome Index Euro Corporate Bonds	22.53
Cleome Index Euro Government Bonds	9.68
Cleome Index Euro Long Term Bonds	68.04
Cleome Index Euro Short Term Bonds	170.49
Cleome Index Europe Equities	-20.5
Cleome Index Global Equities	102.91
Cleome Index USA Equities	-16.67
Cleome Index World Equities	-0.46

Informationen über die Vergütungspolitik:

Die Europäische Richtlinie 2014/91/EU zur Änderung der Richtlinie 2009/65/EG über Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren, die auf die SICAV anwendbar ist, trat am 18. März 2016 in Kraft. Sie wird durch das Luxemburger Gesetz vom 10. Mai 2016 zur Umsetzung der Richtlinie 2014/91/EU in nationales Recht umgesetzt. Aufgrund dieser neuen Vorschriften ist die SICAV verpflichtet, im Jahresbericht Informationen über die Vergütung der identifizierten Mitarbeiter im Sinne des Gesetzes zu veröffentlichen.

Candriam Luxemburg verfügt über eine doppelte Zulassung, zum einen als Verwaltungsgesellschaft gemäß Abschnitt 15 des Gesetzes vom 17. Dezember 2010 über Organismen für gemeinsame Anlagen und zum anderen als Verwalter von alternativen Investmentfonds gemäß dem Gesetz vom 12. Juli 2013 über Verwalter alternativer Investmentfonds. Luxemburg nach diesen beiden Gesetzen obliegen, sind relativ ähnlich, und Candriam Luxemburg ist der Ansicht, dass seine Mitarbeiter für Aufgaben im Zusammenhang mit der Verwaltung von OGAW und alternativen Investmentfonds in gleicher Weise entlohnt werden.

Während des am 31. Dezember 2021 abgeschlossenen Geschäftsjahres zahlte Candriam Luxemburg die folgenden Beträge an seine Mitarbeiter:

- Gesamtbruttobetrag der gezahlten festen Vergütungen (ohne Zahlungen oder Leistungen, die als Teil einer allgemeinen und nicht diskretionären Politik angesehen werden können und keinen Anreizeffekt auf das Risikomanagement haben): 14.364.579 EUR
- Gesamtbruttobetrag der gezahlten variablen Vergütungen: 4.998.163 EUR
- Anzahl der Begünstigten: 132.

Gesamtbetrag der Vergütungen, aufgeschlüsselt nach der Geschäftsleitung und den Mitarbeitern des Anlageverwalters, deren Tätigkeit sich wesentlich auf das Risikoprofil des Fonds auswirkt. Candriam Luxemburgs Systeme lassen eine solche Identifizierung für jeden verwalteten Fonds nicht zu. Die Zahlen unten zeigen auch die Gesamtsumme der Vergütungen bei Candriam Luxemburg.

- Gesamtbetrag der Vergütungen für die Geschäftsleitung: 3.840.050 EUR
- Gesamtbetrag der Vergütungen für die Mitarbeiter von Candriam Luxembourg, deren Tätigkeit sich wesentlich auf das Risikoprofil der Fonds auswirkt, deren Verwaltungsgesellschaft sie ist (mit Ausnahme der Geschäftsleitung): 1.816.006 EUR

Die Vergütungspolitik wurde zuletzt vom Vergütungsausschuss von Candriam Luxemburg am 29. Januar 2021 überprüft und vom Verwaltungsrat von Candriam Luxemburg angenommen.

Vergütungen, die Candriam Belgium als Untieranlageverwalter in dem am 31. Dezember 2021 abgeschlossenen Geschäftsjahr an seine Mitarbeiter gezahlt hat:

- Gesamtbruttobetrag der gezahlten festen Vergütungen (ohne Zahlungen oder Leistungen, die als Teil einer allgemeinen und nicht diskretionären Politik angesehen werden können und keinen Anreizeffekt auf das Risikomanagement haben): 24.608.259 EUR
- Gesamtbruttobetrag der gezahlten variablen Vergütungen: 9.271.300 EUR
- Anzahl der Begünstigten: 277.

Gesamtbetrag der Vergütungen, aufgeschlüsselt nach der Geschäftsleitung und den Mitarbeitern des Untieranlageverwalters, deren Tätigkeit sich wesentlich auf das Risikoprofil des Fonds auswirkt. Die Systeme des Untieranlageverwalters lassen eine solche Identifizierung für jeden verwalteten Fonds nicht zu. Die nachstehenden Zahlen zeigen auch den Gesamtbetrag der Vergütungen auf der Ebene des Untieranlageverwalters.

- Gesamtbetrag der Vergütungen für die Geschäftsleitung: EUR: 5,517,342.
- Gesamtbetrag der Vergütungen der Mitglieder des Personals des Untieranlageverwalters, deren Tätigkeiten sich wesentlich auf das Risikoprofil der Fonds auswirken, deren Untieranlageverwalter er ist (mit Ausnahme der Geschäftsleitung): 5.467.138 EUR

Cleome Index

Zusätzliche ungeprüfte Angaben

Informationen über die Vergütungspolitik: (Fortsetzung)

Vergütungen, die Candriam France als ein oder mehrere Untereinlageverwalter in dem am 31. Dezember 2021 abgeschlossenen Geschäftsjahr an seine Mitarbeiter gezahlt hat:

- Gesamtbruttobetrag der gezahlten festen Vergütungen (ohne Zahlungen oder Leistungen, die als Teil einer allgemeinen und nicht diskretionären Politik angesehen werden können und keinen Anreizeffekt auf das Risikomanagement haben): 16.018.538 EUR
- Gesamtbruttobetrag der gezahlten variablen Vergütungen: 8.444.050 EUR
- Anzahl der Begünstigten: 182.

Gesamtbetrag der Vergütungen, aufgeschlüsselt nach der Geschäftsleitung und den Mitarbeitern des Untereinlageverwalters, deren Tätigkeit sich wesentlich auf das Risikoprofil des Fonds auswirkt. Die Systeme des Untereinlageverwalters lassen eine solche Identifizierung für jeden verwalteten Fonds nicht zu. Die nachstehenden Zahlen zeigen auch den Gesamtbetrag der Vergütungen auf der Ebene des Untereinlageverwalters.

- Gesamtbetrag der Vergütungen für die Geschäftsleitung: 3.491.605 EUR
- Gesamtbetrag der Vergütungen der Mitglieder des Personals des Untereinlageverwalters, deren Tätigkeiten sich wesentlich auf das Risikoprofil der Fonds auswirken, deren Untereinlageverwalter er ist (mit Ausnahme der Geschäftsleitung): 2.680.293 EUR

Verordnung über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften und der Weiterverwendung sowie zur Änderung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012

a) Globale Daten

Im Zusammenhang mit Wertpapierleihgeschäften und Total Return Swaps stellte sich der gesamte Marktwert der entlehnten Wertpapiere zum 31. Dezember 2021 wie folgt dar:

Teilfonds	Währung	Marktwert (in absoluten Werten)	% der gesamten ausleihbaren Vermögenswerte	% des gesamten Nettoinventarwerts
Cleome Index EMU Equities	EUR	47,538,117	21.06	20.96
Cleome Index Euro Corporate Bonds	EUR	5,157,949	2.19	2.15
Cleome Index Euro Government Bonds	EUR	71,936,699	43.43	42.83
Cleome Index Euro Long Term Bonds	EUR	3,857,499	27.93	27.36
Cleome Index Euro Short Term Bonds	EUR	35,172,484	34.01	33.26
Cleome Index Europe Equities	EUR	122,958,426	13.61	13.58
Cleome Index USA Equities	EUR	74,392,137	4.86	4.86
Cleome Index World Equities (siehe Anhangangabe 1)	EUR	9,859,853	5.82	5.81

b) Konzentrationsdaten

Die 10 größten Gegenparteien bei allen Wertpapierleihgeschäften zum 31. Dezember 2021 sind wie folgt:

Cleome Index EMU Equities

Gegenpartei	Bruttovolumen von offenen Geschäften
NATIXIS	27,490,529
SOCIETE GENERALE EQUITIES	14,044,072
CACIB	4,893,138
BP2S	1,031,200
UNICREDIT AG	79,179

Cleome Index Euro Corporate Bonds

Gegenpartei	Bruttovolumen von offenen Geschäften
SOCIETE GENERALE FI	3,391,906
GOLDMAN SACHS BANK EUROPE SE EQ	1,251,839
BNP SA	410,390
BP2S	103,814

Cleome Index Euro Government Bonds

Gegenpartei	Bruttovolumen von offenen Geschäften
BNP SA	25,412,437
SOCIETE GENERALE EQUITIES	20,909,370
BANCO SANTANDER	12,523,570
SOCIETE GENERALE FI	5,077,155
BP2STERM	4,994,971
BP2S	1,966,375
CACIB	1,052,821

Cleome Index

Zusätzliche ungeprüfte Angaben

Verordnung über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften und der Weiterverwendung sowie zur Änderung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 (Fortsetzung)

Cleome Index Euro Long Term Bonds

Gegenpartei	Bruttovolumen von offenen Geschäften
BNP SA	1,525,984
SOCIETE GENERALE EQUITIES	1,049,413
BP2STERM	691,470
BP2S	590,632

Cleome Index Euro Short Term Bonds

Gegenpartei	Bruttovolumen von offenen Geschäften
BNP SA	11,142,058
SOCIETE GENERALE EQUITIES	8,523,272
BANCO SANTANDER	7,285,889
BP2STERM	6,249,095
SOCIETE GENERALE FI	1,858,309
CACIB	113,861

Cleome Index Europe Equities

Gegenpartei	Bruttovolumen von offenen Geschäften
NATIXIS	77,710,645
SOCIETE GENERALE EQUITIES	27,591,789
CACIB	9,740,841
BP2S	6,532,639
MORGAN STANLEY EUROPE SE	874,211
BANK OF NOVA SCOTIA	348,734
UNICREDIT AG	159,567

Cleome Index USA Equities

Gegenpartei	Bruttovolumen von offenen Geschäften
BP2S	58,461,411
NATIXIS	13,411,541
BANK OF NOVA SCOTIA	2,519,185

Cleome Index World Equities (siehe Anhangangabe 1)

Gegenpartei	Bruttovolumen von offenen Geschäften
BP2S	4,791,837
NATIXIS	3,408,481
SOCIETE GENERALE EQUITIES	1,061,091
CACIB	327,103
BANK OF NOVA SCOTIA	175,447
MORGAN STANLEY EUROPE SE	83,799
UNICREDIT AG	12,094

Die zehn größten Aussteller von Sicherheiten, die bei Wertpapierleihgeschäften empfangen wurden, waren zum 31. Dezember 2021:

Cleome Index EMU Equities

Gegenpartei	Bruttovolumen von offenen Geschäften
SANOFI	3,850,395
L'OREAL SA	3,822,598
SCHNEIDER ELECTRIC SE	3,659,429
AIR LIQUIDE SA	2,615,639
PROSUS NV	2,498,844
DAIMLER AG NAMEN-AKT	2,144,293
DEUTSCHE TELEKOM AG REG SHS	1,975,153
AXA SA	1,963,220
INFINEON TECHNOLOGIES REG SHS	1,944,252
PERNOD RICARD SA	1,615,014

Cleome Index

Zusätzliche ungeprüfte Angaben

Verordnung über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften und der Weiterverwendung sowie zur Änderung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 (Fortsetzung)

Cleome Index Euro Corporate Bonds

Gegenpartei	Bruttovolumen von offenen Geschäften
HEINEKEN NV 1.75 18-31 17/03A	866,206
VOLKSWAGEN LEASING G 0,5 21-29 12/01A	687,764
DEUTSCHE TELEKOM AG 0.50 19-27 05/07A	523,452
TAKEDA PHARMACEUTICAL 0.75 20-27 09/07A	496,338
ESSILORLUXOTTICA 0.75 19-31 27/11A	410,390
DANONE SA FL.R 21-XX XX/XXA	400,514
DH EUROPE FIN 0.75 19-31 18/09A	338,059
ENI SPA FL.R 21-99 31/12A	279,128
WHIRLPOOL FINANCE 1.25 06-16 15/06A	207,626
ING GROUP NV FL.R 19-30 13/11A	200,958

Cleome Index Euro Government Bonds

Gegenpartei	Bruttovolumen von offenen Geschäften
FRANCE 3.25 12-45 25/05A	3,743,383
GERMANY 0.00 20-30 15/02A	3,185,635
FRANCE 0.0 18-24 25/03A	3,000,988
FRANCE 0.0000 19-29 25/11A	2,973,044
SPAIN 4.20 05-37 31/01A	2,904,868
GERMANY 2.50 12-44 04/07A	2,847,695
GERMANY 1.75 14-24 15/02A	2,597,635
SPAIN 2.15 15-25 31/10A	2,488,306
ITALY 4.75 13-44 01/09S	2,117,034
SPAIN 3.80 14-24 30/04A	2,071,479

Cleome Index Euro Long Term Bonds

Gegenpartei	Bruttovolumen von offenen Geschäften
ITALY 5.00 07-39 01/08S	524,494
FRANCE 1.75 17-39 25/06A	495,329
FRANCE 4.50 09-41 25/04A	461,847
GERMANY 2.50 12-44 04/07A	370,138
FRANCE 3.25 12-45 25/05A	351,420
GERMANY 4.75 03-34 04/07A	322,108
GERMANY 1.25 17-48 15/08A	229,623
BUONI POLIENNAL 3.8500 18-49 01/09S	216,178
SPAIN 4.20 05-37 31/01A	214,631
SPAIN 2.90 16-46 31/10A	200,543

Cleome Index Euro Short Term Bonds

Gegenpartei	Bruttovolumen von offenen Geschäften
BUNDSOBLIGATION 0.0 18-23 13/10A	4,699,206
FRANCE 0.00 17-23 25/03A	3,493,465
ITALY 4.75 08-23 01/08S	3,200,381
FRANCE 1.75 12-23 25/05A	3,069,540
FRANCE 20-23 25/02U	2,794,162
FRANCE 0.00 21-24 25/02A	2,692,665
ITALY 9.00 93-23 01/11S	2,687,125
GERMANY 1.75 14-24 15/02A	2,525,040
FRANCE 0.0 18-24 25/03A	1,983,145
SPAIN 4.80 08-24 31/01A	1,667,790

Cleome Index

Zusätzliche ungeprüfte Angaben

Verordnung über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften und der Weiterverwendung sowie zur Änderung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 (Fortsetzung)

Cleome Index Europe Equities

Gegenpartei	Bruttovolumen von offenen Geschäften
SANOFI	7,970,960
L'OREAL SA	7,784,040
SCHNEIDER ELECTRIC SE	6,898,400
ALLIANZ SE REG SHS	6,607,423
AIR LIQUIDE SA	5,364,054
PROSUS NV	5,090,335
ABB LTD REG SHS	4,569,891
DEUTSCHE TELEKOM AG REG SHS	4,414,170
DAIMLER AG NAMEN-AKT	4,308,187
AXA SA	3,928,981

Cleome Index USA Equities

Gegenpartei	Bruttovolumen von offenen Geschäften
ADVANCED MICRO DEVICES INC	5,107,741
IBM CORP	3,648,147
S&P GLOBAL INC	3,532,005
SHERWIN WILLIAMS CO	3,002,898
VISA INC -A-	2,802,823
FORD MOTOR	2,490,884
NORFOLK SOUTHERN	2,455,087
EVERSOURCE ENERGY	1,969,447
FISERV INC	1,937,164
BLOCK INC -A-	1,846,742

Cleome Index World Equities (siehe Anhangangabe 1)

Gegenpartei	Bruttovolumen von offenen Geschäften
VISA INC -A-	744,536
ADVANCED MICRO DEVICES INC	422,766
L'OREAL SA	321,468
SHERWIN WILLIAMS CO	293,570
SCHNEIDER ELECTRIC SE	291,285
S&P GLOBAL INC	261,446
SANOFI	259,539
IBM CORP	253,992
FORD MOTOR	237,124
PERNOD RICARD SA	225,036

c) Verwahrung der erhaltenen Sicherheiten

Jeder Teilfonds hat die CACEIS Bank, Filiale Luxemburg, als Verwahrstelle für erhaltene Sicherheiten.
Es gibt keine Wiederverwendung von Sicherheiten im Zusammenhang mit Wertpapierleihgeschäften.

Teilfonds	Währung	Barmittel	Anleihen	Eigenkapital	Gesamtbetrag an Sicherheiten
Cleome Index EMU Equities	EUR	0	4,343,869	50,454,709	54,798,578
Cleome Index Euro Corporate Bonds	EUR	1	5,227,549	102,405	5,329,955
Cleome Index Euro Government Bonds	EUR	2	36,516,508	39,676,537	76,193,047
Cleome Index Euro Long Term Bonds	EUR	3	2,257,686	1,755,723	4,013,412
Cleome Index Euro Short Term Bonds	EUR	4	16,404,905	20,617,670	37,022,579
Cleome Index Europe Equities	EUR	5	4,727,992	134,222,143	138,950,140
Cleome Index USA Equities	EUR	6	8,484,175	71,412,491	79,896,672
Cleome Index World Equities (siehe Anhangangabe 1)	EUR	7	2,076,010	8,752,439	10,828,456

Cleome Index

Zusätzliche ungeprüfte Angaben

Verordnung über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften und der Weiterverwendung sowie zur Änderung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 (Fortsetzung)

d) Aggregierte Transaktionsdaten

Die Laufzeiten der Sicherheiten für Wertpapierfinanzierungsgeschäfte sind wie folgt gestaffelt

Teilfonds	Währung	1 Monat bis 3 Monate	3 Monate bis 1 Jahr	Mehr als 1 Jahr	offene Fälligkeit	Gesamtbetrag an Sicherheiten
Cleome Index EMU Equities	EUR	4,343,869	54,798,579	50,454,709	0	109,597,157
Cleome Index Euro Corporate Bonds	EUR	418,957	418,957	0	0	837,914
Cleome Index Euro Corporate Bonds	EUR	4,557,064	4,910,997	102,405	251,527	9,821,993
Cleome Index Euro Government Bonds	EUR	24,129,217	24,129,217	0	0	48,258,434
Cleome Index Euro Government Bonds	EUR	12,188,976	52,063,828	39,676,537	198,315	104,127,656
Cleome Index Euro Long Term Bonds	EUR	1,575,877	1,575,877	0	0	3,151,754
Cleome Index Euro Long Term Bonds	EUR	681,809	2,437,531	1,755,723	0	4,875,063
Cleome Index Euro Short Term Bonds	EUR	11,487,322	11,487,322	0	0	22,974,644
Cleome Index Euro Short Term Bonds	EUR	4,917,583	25,535,253	20,617,670	0	51,070,506
Cleome Index Europe Equities	EUR	4,075,417	138,950,136	134,222,143	652,575	277,900,271
Cleome Index USA Equities	EUR	7,041,729	79,896,666	71,412,491	1,442,446	159,793,332
Cleome Index World Equities (siehe Anhangangabe 1)	EUR	1,594,629	10,828,449	8,752,439	481,380	21,656,897

Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (SFDR)

Cleome Index Euro Corporate Bonds

Cleome Index Euro Corporate Bonds ist gemäß Artikel 8 der SFDR eingestuft. Der Fonds zielt darauf ab, ökologische und soziale Merkmale zu fördern, hat aber kein nachhaltiges Anlageziel.

Bei den Anlageentscheidungen des Fonds werden ökologische, soziale und Governance-Kriterien (ESG) berücksichtigt. Diese Kriterien sind in den für den Fonds definierten Verwaltungsrahmen integriert und können bei Anlageentscheidungen und der Positionsgröße eine Rolle spielen.

Um diese ESG-Kriterien zu berücksichtigen und Nachhaltigkeitsrisiken zu mindern, ist der Fonds bestrebt, Emittenten auszuschließen, die in erheblichem Maße und wiederholt gegen eines der Prinzipien des Global Compact der Vereinten Nationen verstoßen haben oder in erheblichem Maße bestimmten kontroversen Aktivitäten ausgesetzt sind. Diese Ausschlüsse haben beispielsweise dazu geführt, dass der Fonds keine Investitionen in Unternehmen wie Philip Morris International, das in der Tabakproduktion tätig ist, oder Lafarge, das in der Thermalkohleproduktion aktiv ist, tätigt.

Um die Förderung ökologischer und sozialer Merkmale umzusetzen, stehen Governance und Klimawandel zusammen mit sozialem Bewusstsein im Mittelpunkt unseres ESG-Integrationsansatzes, der bei allen Investitionen des Fonds angewendet wird. Im vergangenen Jahr hat der Teilfonds Positionen in Emittenten mit einem positiven ESG-Profil, basierend auf der unabhängigen ESG-Bewertung von Candriam, eröffnet bzw. ausgebaut. Als Ausdruck dafür, dass die Herausforderungen des Klimawandels berücksichtigt wurden, wird der Kohlenstoff-Fußabdruck von Unternehmen gemessen. Ende 2021 lag der durchschnittliche CO₂-Fußabdruck des Fonds bei 82 Tonnen CO₂-Äquivalent je Million investierte Euro im Vergleich zu 104 CO₂-Äquivalent je Million investierte Euro bei seiner Benchmark.

Cleome Index Euro Government Bonds

Cleome Index Euro Government Bonds ist gemäß Artikel 8 der SFDR eingestuft. Der Fonds zielt darauf ab, ökologische und soziale Merkmale zu fördern, hat aber kein nachhaltiges Anlageziel.

Bei den Anlageentscheidungen des Fonds werden ökologische, soziale und Governance-Kriterien (ESG) berücksichtigt. Diese Kriterien sind in den für den Fonds definierten Verwaltungsrahmen integriert und können bei Anlageentscheidungen und der Positionsgröße eine Rolle spielen.

Um diese ESG-Kriterien zu berücksichtigen und Nachhaltigkeitsrisiken zu mindern, ist der Fonds bestrebt, Emittenten auszuschließen, die in erheblichem Maße und wiederholt gegen eines der Prinzipien des Global Compact der Vereinten Nationen verstoßen haben oder in erheblichem Maße bestimmten kontroversen Aktivitäten ausgesetzt sind. Diese Ausschlüsse haben beispielsweise dazu geführt, dass der Fonds keine Investitionen in Unternehmen wie Philip Morris International, das in der Tabakproduktion tätig ist, oder Lafarge, das in der Thermalkohleproduktion aktiv ist, tätigt.

Um die Förderung ökologischer und sozialer Merkmale umzusetzen, stehen Governance und Klimawandel zusammen mit sozialem Bewusstsein im Mittelpunkt unseres ESG-Integrationsansatzes, der bei allen Investitionen des Fonds angewendet wird. Im vergangenen Jahr hat der Teilfonds Positionen in Emittenten mit einem positiven ESG-Profil, basierend auf der unabhängigen ESG-Bewertung von Candriam, eröffnet bzw. ausgebaut. Um der Tatsache Ausdruck zu verleihen, dass mit den ESG-Bereichen (Umwelt, Soziales und Unternehmensführung) in Zusammenhang stehende Herausforderungen berücksichtigt wurden, wird der ESG-Score gemessen. Ende 2021 lag der ESG-Score des Fonds bei 73,85 im Vergleich zu 73,47 für die Benchmark.

Zusätzliche ungeprüfte Angaben

Cleome Index Euro Long Term Bonds

Cleome Index Euro Long Term Bonds ist gemäß Artikel 8 der SFDR eingestuft. Der Fonds zielt darauf ab, ökologische und soziale Merkmale zu fördern, hat aber kein nachhaltiges Anlageziel.

Bei den Anlageentscheidungen des Fonds werden ökologische, soziale und Governance-Kriterien (ESG) berücksichtigt. Diese Kriterien sind in den für den Fonds definierten Verwaltungsrahmen integriert und können bei Anlageentscheidungen und der Positionsgröße eine Rolle spielen.

Um diese ESG-Kriterien zu berücksichtigen und Nachhaltigkeitsrisiken zu mindern, ist der Fonds bestrebt, Emittenten auszuschließen, die in erheblichem Maße und wiederholt gegen eines der Prinzipien des Global Compact der Vereinten Nationen verstoßen haben oder in erheblichem Maße bestimmten kontroversen Aktivitäten ausgesetzt sind. Diese Ausschlüsse haben beispielsweise dazu geführt, dass der Fonds keine Investitionen in Unternehmen wie Philip Morris International, das in der Tabakproduktion tätig ist, oder Lafarge, das in der Thermalkohleproduktion aktiv ist, tätigt.

Um die Förderung ökologischer und sozialer Merkmale umzusetzen, stehen Governance und Klimawandel zusammen mit sozialem Bewusstsein im Mittelpunkt unseres ESG-Integrationsansatzes, der bei allen Investitionen des Fonds angewendet wird. Im vergangenen Jahr hat der Teilfonds Positionen in Emittenten mit einem positiven ESG-Profil, basierend auf der unabhängigen ESG-Bewertung von Candriam, eröffnet bzw. ausgebaut. Um der Tatsache Ausdruck zu verleihen, dass mit den ESG-Bereichen (Umwelt, Soziales und Unternehmensführung) in Zusammenhang stehende Herausforderungen berücksichtigt wurden, wird der ESG-Score gemessen. Ende 2021 lag der ESG-Score des Fonds bei 74,25 im Vergleich zu 73,94 für die Benchmark.

Cleome Index Euro Short Term Bonds

Cleome Index Euro Short Term Bonds ist gemäß Artikel 8 der SFDR eingestuft. Der Fonds zielt darauf ab, ökologische und soziale Merkmale zu fördern, hat aber kein nachhaltiges Anlageziel.

Bei den Anlageentscheidungen des Fonds werden ökologische, soziale und Governance-Kriterien (ESG) berücksichtigt. Diese Kriterien sind in den für den Fonds definierten Verwaltungsrahmen integriert und können bei Anlageentscheidungen und der Positionsgröße eine Rolle spielen.

Um diese ESG-Kriterien zu berücksichtigen und Nachhaltigkeitsrisiken zu mindern, ist der Fonds bestrebt, Emittenten auszuschließen, die in erheblichem Maße und wiederholt gegen eines der Prinzipien des Global Compact der Vereinten Nationen verstoßen haben oder in erheblichem Maße bestimmten kontroversen Aktivitäten ausgesetzt sind. Diese Ausschlüsse haben beispielsweise dazu geführt, dass der Fonds keine Investitionen in Unternehmen wie Philip Morris International, das in der Tabakproduktion tätig ist, oder Lafarge, das in der Thermalkohleproduktion aktiv ist, tätigt.

Um die Förderung ökologischer und sozialer Merkmale umzusetzen, stehen Governance und Klimawandel zusammen mit sozialem Bewusstsein im Mittelpunkt unseres ESG-Integrationsansatzes, der bei allen Investitionen des Fonds angewendet wird. Im vergangenen Jahr hat der Teilfonds Positionen in Emittenten mit einem positiven ESG-Profil, basierend auf der unabhängigen ESG-Bewertung von Candriam, eröffnet bzw. ausgebaut. Um der Tatsache Ausdruck zu verleihen, dass mit den ESG-Bereichen (Umwelt, Soziales und Unternehmensführung) in Zusammenhang stehende Herausforderungen berücksichtigt wurden, wird der ESG-Score gemessen. Ende 2021 lag der ESG-Score des Fonds bei 73,87 im Vergleich zu 72,75 für die Benchmark.

Cleome Index EMU Equities:

Cleome Index EMU Equities ist gemäß Artikel 8 der SFDR eingestuft. Der Fonds zielt darauf ab, ökologische und soziale Merkmale zu fördern, hat aber kein nachhaltiges Anlageziel.

Bei den Anlageentscheidungen des Fonds werden ökologische, soziale und Governance-Kriterien (ESG) berücksichtigt. Diese Kriterien sind in den für den Fonds definierten Verwaltungsrahmen integriert und können bei Anlageentscheidungen und der Positionsgröße eine Rolle spielen.

Um diese ESG-Kriterien zu berücksichtigen und Nachhaltigkeitsrisiken zu mindern, ist der Fonds bestrebt, Emittenten auszuschließen, die in erheblichem Maße und wiederholt gegen eines der Prinzipien des Global Compact der Vereinten Nationen verstoßen haben oder in erheblichem Maße bestimmten kontroversen Aktivitäten ausgesetzt sind. Durch diese Ausschlüsse konnte der Fonds beispielsweise Anlagen in Unternehmen wie RWE, das stark in der Produktion von Kraftwerkskohle engagiert ist, oder Bayer, das in der umstrittenen Produktion von gentechnisch modifizierten Nutzpflanzen aktiv ist, vermeiden.

Um die Förderung ökologischer und sozialer Merkmale umzusetzen, stehen Governance und Klimawandel zusammen mit sozialem Bewusstsein im Mittelpunkt unseres ESG-Integrationsansatzes, der bei allen Investitionen des Fonds angewendet wird. Im vergangenen Jahr hat der Teilfonds Positionen in Emittenten mit einem positiven ESG-Profil, basierend auf der unabhängigen ESG-Bewertung von Candriam, eröffnet bzw. ausgebaut. So wurde beispielsweise EDP Renovaeis 2021 neu in das Portfolio aufgenommen. EDP Renovaeis ist weltweit führend im Bereich der erneuerbaren Energien und der viertgrößte Windenergieerzeuger der Welt, der sich zu weiteren sozialen Fortschritten bei Nachhaltigkeit und Integration verpflichtet hat.

Als Ausdruck dafür, dass die Herausforderungen des Klimawandels berücksichtigt wurden, wird der Kohlenstoff-Fußabdruck von Unternehmen gemessen. Im Jahr 2021 lag der durchschnittliche CO₂-Fußabdruck des Fonds bei 88 Tonnen CO₂-Äquivalent je Million investierte Euro im Vergleich zu 126 CO₂-Äquivalent je Million investierte Euro bei seiner Benchmark. Deswegen erreichte der Teilfonds einen um durchschnittlich 31 % niedrigeren CO₂-Fußabdruck als die Benchmark.

Zusätzliche ungeprüfte Angaben

Cleome Index Europe Equities:

Cleome Index Europe Equities ist gemäß Artikel 8 der SFDR eingestuft. Der Fonds zielt darauf ab, ökologische und soziale Merkmale zu fördern, hat aber kein nachhaltiges Anlageziel.

Bei den Anlageentscheidungen des Fonds werden ökologische, soziale und Governance-Kriterien (ESG) berücksichtigt. Diese Kriterien sind in den für den Fonds definierten Verwaltungsrahmen integriert und können bei Anlageentscheidungen und der Positionsgröße eine Rolle spielen.

Um diese ESG-Kriterien zu berücksichtigen und Nachhaltigkeitsrisiken zu mindern, ist der Fonds bestrebt, Emittenten auszuschließen, die in erheblichem Maße und wiederholt gegen eines der Prinzipien des Global Compact der Vereinten Nationen verstoßen haben oder in erheblichem Maße bestimmten kontroversen Aktivitäten ausgesetzt sind. Durch diese Ausschlüsse konnte der Fonds beispielsweise Anlagen in Unternehmen wie RWE, das stark in der Produktion von Kraftwerkskohle engagiert ist, oder Bayer, das in der umstrittenen Produktion von gentechnisch modifizierten Nutzpflanzen aktiv ist, vermeiden.

Um die Förderung ökologischer und sozialer Merkmale umzusetzen, stehen Governance und Klimawandel zusammen mit sozialem Bewusstsein im Mittelpunkt unseres ESG-Integrationsansatzes, der bei allen Investitionen des Fonds angewendet wird. Im vergangenen Jahr hat der Teilfonds Positionen in Emittenten mit einem positiven ESG-Profil, basierend auf der unabhängigen ESG-Bewertung von Candriam, eröffnet bzw. ausgebaut. So wurde beispielsweise EDP Renovaeis 2021 neu in das Portfolio aufgenommen. EDP Renovaeis ist weltweit führend im Bereich der erneuerbaren Energien und der viertgrößte Windenergieerzeuger der Welt, der sich zu weiteren sozialen Fortschritten bei Nachhaltigkeit und Integration verpflichtet hat.

Als Ausdruck dafür, dass die Herausforderungen des Klimawandels berücksichtigt wurden, wird der Kohlenstoff-Fußabdruck von Unternehmen gemessen. Im Jahr 2021 lag der durchschnittliche CO₂-Fußabdruck des Fonds bei 72 Tonnen CO₂-Äquivalent je Million investierte Euro im Vergleich zu 103 CO₂-Äquivalent je Million investierte Euro bei seiner Benchmark. Dementsprechend erreichte der Teilfonds einen um durchschnittlich 32 % niedrigeren CO₂-Fußabdruck als die Benchmark.

Cleome Index USA Equities:

Cleome Index USA Equities ist gemäß Artikel 8 der SFDR eingestuft. Der Fonds zielt darauf ab, ökologische und soziale Merkmale zu fördern, hat aber kein nachhaltiges Anlageziel.

Bei den Anlageentscheidungen des Fonds werden ökologische, soziale und Governance-Kriterien (ESG) berücksichtigt. Diese Kriterien sind in den für den Fonds definierten Verwaltungsrahmen integriert und können bei Anlageentscheidungen und der Positionsgröße eine Rolle spielen.

Um diese ESG-Kriterien zu berücksichtigen und Nachhaltigkeitsrisiken zu mindern, ist der Fonds bestrebt, Emittenten auszuschließen, die in erheblichem Maße und wiederholt gegen eines der Prinzipien des Global Compact der Vereinten Nationen verstoßen haben oder in erheblichem Maße bestimmten kontroversen Aktivitäten ausgesetzt sind. Durch diese Ausschlüsse konnte der Fonds beispielsweise Anlagen in Unternehmen wie RWE, das stark in der Produktion von Kraftwerkskohle engagiert ist, oder Bayer, das in der umstrittenen Produktion von gentechnisch modifizierten Nutzpflanzen aktiv ist, vermeiden.

Um die Förderung ökologischer und sozialer Merkmale umzusetzen, stehen Governance und Klimawandel zusammen mit sozialem Bewusstsein im Mittelpunkt unseres ESG-Integrationsansatzes, der bei allen Investitionen des Fonds angewendet wird. Im vergangenen Jahr hat der Teilfonds Positionen in Emittenten mit einem positiven ESG-Profil, basierend auf der unabhängigen ESG-Bewertung von Candriam, eröffnet bzw. ausgebaut. So wurde beispielsweise Sunrun Inc 2021 neu in das Portfolio aufgenommen. Sunrun Inc ist ein amerikanischer Anbieter von Solarenergieleistungen. Das Unternehmen will mit seiner Technologie eine Dekarbonisierung des Energiesystems herbeiführen. Seit 2007 hat Sunrun mehr als 11 Milliarden Kilowattstunden saubere Energie erzeugt und 8,1 Millionen Tonnen CO₂ vor dem Eintritt in die Atmosphäre verhindert.

Als Ausdruck dafür, dass die Herausforderungen des Klimawandels berücksichtigt wurden, wird der Kohlenstoff-Fußabdruck von Unternehmen gemessen. Im Jahr 2021 lag der durchschnittliche CO₂-Fußabdruck des Fonds bei 28 Tonnen CO₂-Äquivalent je Million investierte Euro im Vergleich zu 41 CO₂-Äquivalent je Million investierte Euro bei seiner Benchmark. Deswegen erreichte der Teilfonds einen um durchschnittlich 32 % niedrigeren CO₂-Fußabdruck als die Benchmark.

Cleome Index World Equities:

Cleome Index World Equities ist gemäß Artikel 8 der SFDR eingestuft. Der Fonds zielt darauf ab, ökologische und soziale Merkmale zu fördern, hat aber kein nachhaltiges Anlageziel.

Bei den Anlageentscheidungen des Fonds werden ökologische, soziale und Governance-Kriterien (ESG) berücksichtigt. Diese Kriterien sind in den für den Fonds definierten Verwaltungsrahmen integriert und können bei Anlageentscheidungen und der Positionsgröße eine Rolle spielen.

Um diese ESG-Kriterien zu berücksichtigen und Nachhaltigkeitsrisiken zu mindern, ist der Fonds bestrebt, Emittenten auszuschließen, die in erheblichem Maße und wiederholt gegen eines der Prinzipien des Global Compact der Vereinten Nationen verstoßen haben oder in erheblichem Maße bestimmten kontroversen Aktivitäten ausgesetzt sind. Durch diese Ausschlüsse konnte der Fonds beispielsweise Anlagen in Unternehmen wie RWE, das stark in der Produktion von Kraftwerkskohle engagiert ist, oder Bayer, das in der umstrittenen Produktion von gentechnisch modifizierten Nutzpflanzen aktiv ist, vermeiden.

Um die Förderung ökologischer und sozialer Merkmale umzusetzen, stehen Governance und Klimawandel zusammen mit sozialem Bewusstsein im Mittelpunkt unseres ESG-Integrationsansatzes, der bei allen Investitionen des Fonds angewendet wird. Im vergangenen Jahr hat der Teilfonds Positionen in Emittenten mit einem positiven ESG-Profil, basierend auf der unabhängigen ESG-Bewertung von Candriam, eröffnet bzw. ausgebaut. So wurde beispielsweise Severn Trent PLC 2021 neu in das Portfolio aufgenommen. Severn Trent PLC bietet eine Reihe von Dienstleistungen für die Wasserreinigung, die Abwasserbehandlung, die Entsorgung und das Recycling an. Mehr als 4,6 Millionen Haushalte und Unternehmen in Großbritannien beziehen Wasser- und Abwasserdienstleistungen von dem Unternehmen.

Zusätzliche ungeprüfte Angaben

Als Ausdruck dafür, dass die Herausforderungen des Klimawandels berücksichtigt wurden, wird der Kohlenstoff-Fußabdruck von Unternehmen gemessen. Im Jahr 2021 lag der durchschnittliche CO₂-Fußabdruck des Fonds bei 38 Tonnen CO₂-Äquivalent je Million investierte Euro im Vergleich zu 58 CO₂-Äquivalent je Million investierte Euro bei seiner Benchmark. Deswegen erreichte der Teilfonds einen um durchschnittlich 35 % niedrigeren CO₂-Fußabdruck als die Benchmark.

Taxonomie

Die Europäische Taxonomie für umweltfreundliche Tätigkeiten (die „Taxonomie“) - Verordnung (EU) 2020/852 ist Teil der allgemeinen Bemühungen der EU, die Ziele des Green Deal für Europa zu erreichen und Europa in die Lage zu versetzen, bis 2050 klimaneutral zu werden. Die Verordnung enthält sechs Umweltziele:

- Abschwächung des Klimawandels;
- Anpassung an den Klimawandel;
- Nachhaltige Nutzung und Schutz der Wasser- und Meeresressourcen;
- Übergang zu einer Kreislaufwirtschaft;
- Vermeidung und Kontrolle der Umweltverschmutzung;
- Schutz und Wiederherstellung von Biodiversität und Ökosystemen.

Sowohl bei den direkt verwalteten Anlagen als auch bei den von Candriam verwalteten zugrunde liegenden Fonds stehen die Umweltaspekte dieser sechs Umweltziele im Mittelpunkt der ESG-Analyse der Emittenten. Für Teilfonds mit einem nachhaltigen Anlageziel sowie für Teilfonds, die neben anderen Merkmalen auch ökologische und/oder soziale Merkmale fördern, erfordert diese Arbeit der Bewertung des Beitrags der Emittenten zu den wichtigsten Umweltzielen, insbesondere zum Kampf gegen den Klimawandel, eine sektorale Bewertung auf der Grundlage einer Reihe heterogener Daten, komplexer Realitäten mit vielfältigen Interdependenzen. Die ESG-Analysten von Candriam haben auch das Inkrafttreten der von der EU festgelegten Kriterien vorweggenommen und ihren eigenen Analyserahmen entwickelt. Dieser Rahmen ermöglicht eine systematische Bewertung des Beitrags der Aktivitäten eines Unternehmens zu verschiedenen von Candriam definierten Umweltzielen, die mit der Taxonomie im Einklang stehen.

Nach Veröffentlichung der technischen Kriterien für die 2 Umweltziele im Zusammenhang mit dem Klimawandel der Taxonomie durch die auf europäischer Ebene eingerichtete Expertengruppe verpflichtete sich Candriam, diese Kriterien in seine Analyse einzubeziehen, Candriam verpflichtete sich, diese Kriterien in seinen bereits bestehenden Analyserahmen einzubeziehen. Die Durchführung einer solchen Analyse über den gesamten Kreis der betroffenen Emittenten hängt in hohem Maße von der tatsächlichen Veröffentlichung bestimmter Daten durch diese wichtigen Emittenten ab, die es ermöglichen, ihren Beitrag im Detail zu bewerten.

Gegenwärtig stellen nur wenige Unternehmen weltweit die Mindestdaten zur Verfügung, die erforderlich sind, um den Grad ihrer Übereinstimmung mit der Taxonomie genau zu bewerten. Das Fehlen von Daten zur genauen Bewertung der Einhaltung der Kriterien der Taxonomie bedeutet, dass es noch nicht möglich ist, einen Mindestprozentsatz für die Anpassung dieser Kompartimente an die europäische Taxonomie festzulegen.

Cleome Index

Zusätzliche ungeprüfte Angaben

Informationen für Anleger in der Bundesrepublik Deutschland

Für die folgenden Teilfonds ist keine Anzeige nach § 310 Kapitalanlagegesetzbuch erstattet worden und Anteile dieser Teilfonds dürfen in der Bundesrepublik Deutschland nicht vertrieben werden:

- Cleome Index EMU Equities
- Cleome Index Euro Government Bonds
- Cleome Index Euro Long Term Bonds
- Cleome Index Euro Short Term Bonds
- Cleome Index World Equities

Einrichtungen gemäß Art. 92 Abs. 1 der Richtlinie 2009/65/EG in der Fassung der Richtlinie (EU) 2019/1160

Marcard, Stein & Co AG, Ballindamm 36, D-20095 Hamburg:

- Bei dieser Einrichtung können Anträge auf die Zeichnung, die Rücknahme und den Umtausch von Anteilen eingereicht werden.
- Sämtliche für einen Anteilinhaber bestimmte Zahlungen, einschließlich der Rücknahmeerlöse und etwaiger Ausschüttungen, können auf seinen Wunsch hin über diese Einrichtung geleitet werden.
- Der Verkaufsprospekt, die wesentlichen Anlegerinformationen, die Satzung der SICAV, die letzten veröffentlichten Jahres- und Halbjahresberichte – auf Anfrage jeweils in Papierform – sowie sonstige Angaben und Unterlagen sind bei dieser Einrichtung kostenlos verfügbar.
- Der Nettoinventarwert pro Anteil, die Ausgabe-, Rücknahme-, und Umtauschpreise sind bei dieser Einrichtung kostenlos verfügbar.
- Diese Einrichtung fungiert als Kontaktstelle für die Kommunikation mit der Bundesanstalt für Finanzdienstleistungsaufsicht.

Die Website www.candriam.com:

- Der Verkaufsprospekt, die wesentlichen Anlegerinformationen, die Satzung der SICAV, die letzten veröffentlichten Jahres- und Halbjahresberichte sowie sonstige Angaben und Unterlagen werden auf dieser Website veröffentlicht und sind dort kostenlos verfügbar.
- Der Nettoinventarwert pro Anteil sowie die Ausgabe-, Rücknahme-, und Umtauschpreise werden auf dieser Website veröffentlicht und sind dort kostenlos verfügbar.

Der Gesellschaftssitz der SICAV:

- Der Verkaufsprospekt, die wesentlichen Anlegerinformationen, die Satzung der SICAV, die letzten veröffentlichten Jahres- und Halbjahresberichte – auf Anfrage jeweils in Papierform – sowie sonstige Angaben und Unterlagen sind am Gesellschaftssitz der SICAV kostenlos verfügbar.
- Der Nettoinventarwert pro Anteil sowie die Ausgabe-, Rücknahme-, und Umtauschpreise sind am Gesellschaftssitz der SICAV kostenlos verfügbar.

Etwaige Mitteilungen an die Anteilinhaber in Deutschland werden unter www.candriam.com veröffentlicht und an die Anteilinhaber an ihre im Anteilinhaberregister eingetragene Anschrift übersandt. In den folgenden Fällen wird eine Mitteilung per dauerhaftem Datenträger veröffentlicht: Die Aussetzung der Rücknahme der Anteile des Fonds; die Kündigung der Verwaltung des Fonds oder dessen Abwicklung; bei Änderungen von Anlagebedingungen, die mit den bisherigen Anlagegrundsätzen nicht vereinbar sind oder bei anlegerbenachteiligenden Änderungen von wesentlichen Anlegerrechten oder bei anlegerbenachteiligenden Änderungen, die die Vergütungen und Aufwendungserstattungen betreffen, die aus dem Investmentvermögen entnommen werden können (einschließlich der Hintergründe der Änderungen sowie der Rechte der Anleger); die Verschmelzung des Fonds oder eines Teilfonds sowie die Umwandlung des Fonds oder eines Teilfonds in einen Feederfonds.