



Ungeprüfter Halbjahresbericht
Cleome Index

30. Juni 2024

01.01.2024 - 28.06.2024
SICAV luxemburgischen Rechts
R.C.S. Luxemburg Nr. B-72234



Cleome Index

SICAV luxemburgischen Rechts

Ungeprüfter Halbjahresbericht für die Periode
vom 1. Januar 2024 bis zum 30. Juni 2024



Inhalt

Verwaltung der SICAV	4
Angaben zur SICAV	5
Aufstellung des Nettovermögens zum 30. Juni 2024	6
Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens für die Periode zum 30. Juni 2024	9
Statistiken	12
Anlageportfolio zum 30. Juni 2024	14
Cleome Index EMU Equities	14
Cleome Index Euro Corporate Bonds	19
Cleome Index Euro Government Bonds	38
Cleome Index Euro Long Term Bonds	44
Cleome Index Euro Short Term Bonds	48
Cleome Index Europe Equities	51
Cleome Index USA Equities	59
Cleome Index World Equities	69
Anhang zum Abschluss – Aufstellung der derivativen Instrumente	82
Sonstige Erläuterungen zum Abschluss	84
Zusätzliche ungeprüfte Angaben	94



Verwaltung der SICAV

Vorsitzender

Tanguy DE VILLENFAGNE
Advisor to the Group Strategic Committee
Candriam

Mitglieder

Isabelle CABIE
Global Head of Corporate Sustainability
Candriam

Thierry BLONDEAU
Independent Director

Catherine DELANGHE
Independent Director

Aurore PELLE
Senior Internal Auditor
Candriam

Myriam VANNESTE
Global Head of Product Management
Candriam

Gesellschaftssitz

5, Allée Scheffer
L-2520 Luxemburg

Depotbank und Hauptzahlstelle

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

Verwaltungsgesellschaft

Candriam
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 Luxemburg

Die Durchführung der **Portfoliomanagementaktivitäten** erfolgt durch Candriam und/oder einer oder mehrerer ihrer Niederlassungen:

Candriam – Belgian Branch
58, Avenue des Arts
B-1000 Brüssel

Candriam Succursale française
40, rue Washington
F-75408 Paris Cedex 08

Candriam – UK Establishment
Aldersgate Street 200, London EC1A 4 HD

„Réviseur d'entreprises agréé“

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



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 Verkaufsprospekt, die Basisinformationsblätter für verpackte Anlageprodukte für Kleinanleger und Versicherungsanlageprodukte (PRIIP BiB), die Satzung der SICAV und die Finanzberichte werden am Sitz der SICAV kostenlos für die Öffentlichkeit bereitgehalten.



Aufstellung des Nettovermögens zum 30. Juni 2024

		Cleome Index EMU Equities	Cleome Index Euro Corporate Bonds	Cleome Index Euro Government Bonds
		EUR	EUR	EUR
Aktiva				
Anlageportfolio zum Marktwert	2a	271,720,459	458,084,264	263,101,875
Guthaben bei Banken und Brokern	10	250,730	19,724,533	360,517
Forderungen aus dem Verkauf von Wertpapieren		646,695	0	507,645
Forderungen aus Zeichnungen		184,295	797,125	338,504
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		147,244	4,736,852	2,603,392
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisentermingeschäften	2f	0	0	0
Nicht realisierter Nettogewinn aus Futures	2e	0	79,820	0
Sonstige Vermögenswerte		482,401	0	0
Aktiva insgesamt		273,431,824	483,422,594	266,911,933
Passiva				
Kontokorrentkredite		3,004	0	0
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		0	1,775,564	388,704
Verbindlichkeiten aus Anteilsrücknahmen		206,340	415,941	624,286
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	3	21,434	30,663	16,543
Verbindlichkeiten aus Vertriebsgebühren		0	38,466	0
Verbindlichkeiten aus Betriebs- und Verwaltungskosten	5	21,245	34,857	15,712
Sonstige Verbindlichkeiten		0	0	0
Passiva insgesamt		252,023	2,295,491	1,045,245
Nettovermögen insgesamt		273,179,801	481,127,103	265,866,688



Aufstellung des Nettovermögens zum 30. Juni 2024

		Cleome Index Euro Long Term Bonds	Cleome Index Euro Short Term Bonds	Cleome Index Europe Equities
		EUR	EUR	EUR
Aktiva				
Anlageportfolio zum Marktwert	2a	6,243,916	51,798,532	1,286,204,169
Guthaben bei Banken und Brokern	10	103,219	104,405	21,275,056
Forderungen aus dem Verkauf von Wertpapieren		0	1,874,299	0
Forderungen aus Zeichnungen		1,423	0	9,954,386
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		81,783	369,883	1,609,682
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisentermingeschäften	2f	0	0	0
Nicht realisierter Nettogewinn aus Futures	2e	0	0	0
Sonstige Vermögenswerte		0	0	269,235
Aktiva insgesamt		6,430,341	54,147,119	1,319,312,528
Passiva				
Kontokorrentkredite		0	0	325,545
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		6,150	1,944,162	32,109,179
Verbindlichkeiten aus Anteilsrücknahmen		37,014	13,217	27,347,931
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	3	1,488	3,934	66,710
Verbindlichkeiten aus Vertriebsgebühren		42,076	13,825	174,219
Verbindlichkeiten aus Betriebs- und Verwaltungskosten	5	566	2,293	101,417
Sonstige Verbindlichkeiten		0	0	2,943
Passiva insgesamt		87,294	1,977,431	60,127,944
Nettovermögen insgesamt		6,343,047	52,169,688	1,259,184,584



Aufstellung des Nettovermögens zum 30. Juni 2024

		Cleome Index USA Equities	Cleome Index World Equities	Kombiniert
		USD	EUR	EUR
Aktiva				
Anlageportfolio zum Marktwert	2a	2,574,325,786	151,503,995	4,890,640,682
Guthaben bei Banken und Brokern	10	0	133,986	41,952,446
Forderungen aus dem Verkauf von Wertpapieren		26,902,161	0	28,129,792
Forderungen aus Zeichnungen		18,070,132	0	28,136,131
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		1,041,834	165,860	10,686,783
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisentermingeschäften	2f	55,117	0	51,427
Nicht realisierter Nettogewinn aus Futures	2e	0	0	79,820
Sonstige Vermögenswerte		0	60,033	811,669
Aktiva insgesamt		2,620,395,030	151,863,874	5,000,488,750
Passiva				
Kontokorrentkredite		8,424,037	264	8,188,890
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		0	0	36,223,759
Verbindlichkeiten aus Anteilsrücknahmen		8,927,017	0	36,974,113
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	3	99,800	15,839	249,730
Verbindlichkeiten aus Vertriebsgebühren		54,970	0	319,876
Verbindlichkeiten aus Betriebs- und Verwaltungskosten	5	300,005	11,520	467,531
Sonstige Verbindlichkeiten		2,640	12	5,418
Passiva insgesamt		17,808,469	27,635	82,429,317
Nettovermögen insgesamt		2,602,586,561	151,836,239	4,918,059,433



Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens für die Periode zum 30. Juni 2024

		Cleome Index EMU Equities	Cleome Index Euro Corporate Bonds	Cleome Index Euro Government Bonds
		EUR	EUR	EUR
Nettovermögen zu Beginn der Periode		261,698,183	422,751,553	244,504,267
Erträge				
Dividenden, netto	2h	6,359,622	0	0
Zinsen auf Anleihen und Geldmarktinstrumente, netto		0	4,775,806	2,590,240
Zinsen aus Wertpapierleihgeschäften	7	6,272	17,763	17,897
Bankzinsen		7,778	227,102	13,782
Sonstige Erträge		45	96	15
Erträge insgesamt		6,373,717	5,020,767	2,621,934
Aufwendungen				
Bezahlte Dividenden, netto	2h	0	0	4,286
Verwaltungsgebühren	3	134,041	182,268	97,264
Betriebs- und Verwaltungskosten	5	127,440	201,918	86,940
Vertriebsgebühren	4	0	25,238	0
Depotbankgebühren	4	5,957	10,076	5,467
Transaktionskosten	2g	42,979	2,764	376
Bankzinsen		49	0	0
Sonstige Aufwendungen		3,045	0	0
Aufwendungen insgesamt		313,511	422,264	194,333
Nettoertrag/(-verlust) aus Wertpapieren		6,060,206	4,598,503	2,427,601
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus dem Verkauf von Wertpapieren	2b	3,738,476	(679,588)	(1,979,523)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Devisentermingeschäften	2f	0	0	0
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Futures	2e	0	(141,756)	0
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Devisen		44	825	3
Realisierter Nettogewinn/(-verlust)		9,798,726	3,777,984	448,081
Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus Wertpapieren	2a	13,743,607	(2,997,172)	(5,305,440)
Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus Devisentermingeschäften	2f	0	0	0
Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus Futures	2e	0	286,750	0
Nettozunahme/(-abnahme) des Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit		23,542,333	1,067,562	(4,857,359)
Entwicklung des Kapitals				
Zeichnung von Anteilen		20,598,708	102,638,062	45,038,795
Rücknahme von Anteilen		(32,561,626)	(33,866,197)	(16,267,196)
Ausgeschüttete Dividenden	8	(97,797)	(11,463,877)	(2,551,819)
Währungsumrechnung		0	0	0
Nettovermögen zum Ende der Periode		273,179,801	481,127,103	265,866,688



Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens für die Periode zum 30. Juni 2024

		Cleome Index Euro Long Term Bonds	Cleome Index Euro Short Term Bonds	Cleome Index Europe Equities
		EUR	EUR	EUR
Nettovermögen zu Beginn der Periode		7,120,650	55,133,249	1,505,415,573
Erträge				
Dividenden, netto	2h	0	0	31,598,802
Zinsen auf Anleihen und Geldmarktinstrumente, netto		98,928	469,237	0
Zinsen aus Wertpapierleihgeschäften	7	176	4,918	55,686
Bankzinsen		851	2,663	62,258
Sonstige Erträge		0	0	1,129
Erträge insgesamt		99,955	476,818	31,717,875
Aufwendungen				
Bezahlte Dividenden, netto	2h	19	0	0
Verwaltungsgebühren	3	9,968	26,142	424,454
Betriebs- und Verwaltungskosten	5	3,640	13,928	688,375
Vertriebsgebühren	4	27,752	8,906	117,302
Depotbankgebühren	4	149	1,174	31,717
Transaktionskosten	2g	0	0	602,709
Bankzinsen		0	0	16,784
Sonstige Aufwendungen		0	0	2,223
Aufwendungen insgesamt		41,528	50,150	1,883,564
Nettoertrag/(-verlust) aus Wertpapieren		58,427	426,668	29,834,311
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus dem Verkauf von Wertpapieren	2b	(376,862)	(467,987)	83,476,526
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Devisentermingeschäften	2f	0	0	0
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Futures	2e	0	0	0
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Devisen		0	(2)	2,984,730
Realisierter Nettogewinn/(-verlust)		(318,435)	(41,321)	116,295,567
Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus Wertpapieren	2a	(44,241)	218,009	10,377,654
Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus Devisentermingeschäften	2f	0	0	0
Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus Futures	2e	0	0	0
Nettozunahme/(-abnahme) des Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit		(362,676)	176,688	126,673,221
Entwicklung des Kapitals				
Zeichnung von Anteilen		21,523	1,708	383,266,775
Rücknahme von Anteilen		(436,450)	(3,141,957)	(749,458,726)
Ausgeschüttete Dividenden	8	0	0	(6,712,259)
Währungsumrechnung		0	0	0
Nettovermögen zum Ende der Periode		6,343,047	52,169,688	1,259,184,584



Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens für die Periode zum 30. Juni 2024

		Cleome Index USA Equities	Cleome Index World Equities	Kombiniert
		USD	EUR	EUR
Nettovermögen zu Beginn der Periode		1,908,743,531	128,550,136	4,353,090,625
Erträge				
Dividenden, netto	2h	11,328,397	1,273,387	49,801,811
Zinsen auf Anleihen und Geldmarktinstrumente, netto		0	0	7,934,211
Zinsen aus Wertpapierleihgeschäften	7	15,538	1,126	118,336
Bankzinsen		10,838	3,128	327,674
Sonstige Erträge		0	22	1,307
Erträge insgesamt		11,354,773	1,277,663	58,183,339
Aufwendungen				
Bezahlte Dividenden, netto	2h	0	0	4,305
Verwaltungsgebühren	3	552,824	96,551	1,486,502
Betriebs- und Verwaltungskosten	5	1,056,505	66,841	2,174,858
Vertriebsgebühren	4	110,309	0	282,122
Depotbankgebühren	4	48,748	3,097	103,121
Transaktionskosten	2g	170,633	8,068	816,106
Bankzinsen		96,294	2,572	109,252
Sonstige Aufwendungen		0	0	5,268
Aufwendungen insgesamt		2,035,313	177,129	4,981,534
Nettoertrag/(-verlust) aus Wertpapieren		9,319,460	1,100,534	53,201,805
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus dem Verkauf von Wertpapieren	2b	71,074,380	2,444,195	152,471,430
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Devisentermingeschäften	2f	(487,133)	(1,057)	(455,578)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Futures	2e	0	0	(141,756)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Devisen		(233,458)	(56,850)	2,710,921
Realisierter Nettogewinn/(-verlust)		79,673,249	3,486,822	207,786,822
Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus Wertpapieren	2a	223,506,395	16,254,810	240,790,633
Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus Devisentermingeschäften	2f	(421,797)	0	(393,559)
Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus Futures	2e	0	0	286,750
Nettozunahme/(-abnahme) des Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit		302,757,847	19,741,632	448,470,646
Entwicklung des Kapitals				
Zeichnung von Anteilen		796,466,568	13,184,541	1,307,895,965
Rücknahme von Anteilen		(404,798,403)	(9,603,216)	(1,223,033,901)
Ausgeschüttete Dividenden	8	(582,982)	(36,854)	(21,406,559)
Währungsumrechnung		0	0	53,042,660
Nettovermögen zum Ende der Periode		2,602,586,561	151,836,239	4,918,059,433



Statistiken

Cleome Index EMU Equities

Name	ISIN	Anteilsart	Währung	Anzahl der in Umlauf befindlichen Anteile	Nettoinventarwert je Anteil zum 30.06.2024	Nettoinventarwert je Anteil zum 31.12.2023	Nettoinventarwert je Anteil zum 31.12.2022
Nettovermögen insgesamt			EUR		273,179,801	261,698,183	180,810,724
C	LU1292953335	Thesaurierung	EUR	1,413.00	262.08	241.12	203.72
C	LU1365257788	Ausschüttung	EUR	98.00	222.61	209.49	180.59
I	LU1292953418	Thesaurierung	EUR	32,441.00	2,810.56	2,575.84	2,159.38
R	LU1292953509	Thesaurierung	EUR	209,114.15	236.45	216.90	182.16
R	LU1718421743	Ausschüttung	EUR	20,329.84	200.94	188.50	161.49
V	LU1292953681	Thesaurierung	EUR	10.00	145.83	-	-
Z	LU1292953764	Thesaurierung	EUR	45,121.00	2,838.55	2,599.96	2,176.98

Cleome Index Euro Corporate Bonds

Name	ISIN	Anteilsart	Währung	Anzahl der in Umlauf befindlichen Anteile	Nettoinventarwert je Anteil zum 30.06.2024	Nettoinventarwert je Anteil zum 31.12.2023	Nettoinventarwert je Anteil zum 31.12.2022
Nettovermögen insgesamt			EUR		481,127,103	422,751,553	232,512,812
C	LU1542321093	Thesaurierung	EUR	2,772.69	150.61	150.49	139.66
C	LU1542321176	Ausschüttung	EUR	755.92	102.91	107.50	100.49
I	LU1542321259	Thesaurierung	EUR	226,937.03	148.08	147.84	136.98
R2	LU1542321416	Thesaurierung	EUR	22,517.28	139.40	139.20	129.02
R2	LU1622416649	Ausschüttung	EUR	2,036,822.88	135.44	141.38	131.99
Y	LU1542321689	Thesaurierung	EUR	146,787.32	39.86	40.00	37.45
Z	LU1542321762	Thesaurierung	EUR	1,061,988.55	152.69	152.33	140.92

Cleome Index Euro Government Bonds

Name	ISIN	Anteilsart	Währung	Anzahl der in Umlauf befindlichen Anteile	Nettoinventarwert je Anteil zum 30.06.2024	Nettoinventarwert je Anteil zum 31.12.2023	Nettoinventarwert je Anteil zum 31.12.2022
Nettovermögen insgesamt			EUR		265,866,688	244,504,267	118,241,839
C	LU1542321929	Thesaurierung	EUR	17.54	143.12	146.08	136.84
I	LU1542322224	Thesaurierung	EUR	55,761.35	1,417.53	1,445.85	1,352.58
R2	LU1542322653	Thesaurierung	EUR	12,538.81	139.94	142.77	133.63
R2	LU1622416722	Ausschüttung	EUR	682,565.51	130.91	138.20	129.98
S	LU1933089531	Thesaurierung	EUR	49,870.32	1,270.23	1,295.16	1,210.76
Z	LU1542322810	Thesaurierung	EUR	22,624.07	1,430.63	1,458.36	1,362.64

Cleome Index Euro Long Term Bonds

Name	ISIN	Anteilsart	Währung	Anzahl der in Umlauf befindlichen Anteile	Nettoinventarwert je Anteil zum 30.06.2024	Nettoinventarwert je Anteil zum 31.12.2023	Nettoinventarwert je Anteil zum 31.12.2022
Nettovermögen insgesamt			EUR		6,343,047	7,120,650	7,547,273
C	LU1542323032	Thesaurierung	EUR	1.00	133.44	139.86	126.60
I	LU1542323206	Thesaurierung	EUR	3.00	1,471.84	1,544.23	1,399.96
Y	LU1542323891	Thesaurierung	EUR	123,417.02	51.33	54.15	49.62
Z	LU1542324196	Thesaurierung	EUR	2.00	1,498.58	1,571.13	1,422.14

Cleome Index Euro Short Term Bonds

Name	ISIN	Anteilsart	Währung	Anzahl der in Umlauf befindlichen Anteile	Nettoinventarwert je Anteil zum 30.06.2024	Nettoinventarwert je Anteil zum 31.12.2023	Nettoinventarwert je Anteil zum 31.12.2022
Nettovermögen insgesamt			EUR		52,169,688	55,133,249	100,619,204
C	LU1542324352	Thesaurierung	EUR	1.00	150.15	149.41	144.35
I	LU1542324519	Thesaurierung	EUR	6,918.51	1,091.00	1,087.03	1,052.23
V	LU1542324865	Thesaurierung	EUR	37,978.00	1,095.15	1,090.96	1,055.61
Y	LU1542324949	Thesaurierung	EUR	95,815.34	31.60	31.61	30.85
Z	LU1542325086	Thesaurierung	EUR	2.00	1,204.82	1,199.60	1,159.46

Cleome Index Europe Equities



Statistiken

Name	ISIN	Anteilsart	Währung	Anzahl der in Umlauf befindlichen Anteile	Nettoinventarwert je Anteil zum 30.06.2024	Nettoinventarwert je Anteil zum 31.12.2023	Nettoinventarwert je Anteil zum 31.12.2022
Nettovermögen insgesamt			EUR		1,259,184,584	1,505,415,573	934,751,146
C	LU0461106337	Thesaurierung	EUR	52,980.61	271.65	249.95	216.69
I	LU0461106683	Thesaurierung	EUR	30,909.73	2,917.90	2,674.41	2,300.43
R	LU1006087669	Thesaurierung	EUR	828,939.83	192.25	176.37	151.98
R	LU1718421826	Ausschüttung	EUR	8,746.50	201.97	190.14	167.87

Cleome Index Europe Equities (Fortsetzung)

Name	ISIN	Anteilsart	Währung	Anzahl der in Umlauf befindlichen Anteile	Nettoinventarwert je Anteil zum 30.06.2024	Nettoinventarwert je Anteil zum 31.12.2023	Nettoinventarwert je Anteil zum 31.12.2022
V2	LU0438017591	Thesaurierung	EUR	6,965.24	2,943.29	2,696.76	2,318.03
Y	LU0102768701	Thesaurierung	EUR	389,043.45	59.87	55.21	48.09
Z	LU0479710047	Thesaurierung	EUR	280,386.55	2,650.91	2,428.27	2,086.20
Z	LU1379319319	Ausschüttung	EUR	88,558.12	2,330.62	2,190.71	1,928.20

Cleome Index USA Equities

Name	ISIN	Anteilsart	Währung	Anzahl der in Umlauf befindlichen Anteile	Nettoinventarwert je Anteil zum 30.06.2024	Nettoinventarwert je Anteil zum 31.12.2023	Nettoinventarwert je Anteil zum 31.12.2022
Nettovermögen insgesamt			USD		2,602,586,561	1,908,743,531	1,495,356,039
C	LU1006087313	Thesaurierung	USD	1,947.96	424.53	372.38	297.07
C	LU1365257515	Ausschüttung	USD	84.00	363.02	321.92	259.58
C - EUR - Hedged	LU2403432581	Thesaurierung	EUR	245.67	179.19	158.55	129.25
C - EUR - Unhedged	LU0461105529	Thesaurierung	EUR	3,242.39	649.53	552.78	456.44
I	LU0461105875	Thesaurierung	USD	24,741.86	5,085.91	4,444.00	3,517.51
I - EUR - Hedged	LU2197357408	Thesaurierung	EUR	8,862.00	1,945.36	1,713.20	-
I - EUR - Unhedged	LU2197357747	Thesaurierung	EUR	3,778.00	2,219.59	1,881.69	1,541.59
R	LU1718422477	Thesaurierung	USD	45,461.34	333.03	291.25	230.95
R	LU1718422550	Ausschüttung	USD	5,899.99	294.56	260.41	208.69
R - EUR - Hedged	LU2403432748	Thesaurierung	EUR	10.00	194.10	171.29	-
R - EUR - Unhedged	LU1006087586	Thesaurierung	EUR	95,214.22	339.01	287.65	236.08
R - EUR - Unhedged	LU1718422394	Ausschüttung	EUR	2,053.00	347.20	297.83	246.95
V	LU0438016601	Thesaurierung	USD	126.00	3,037.35	2,653.47	2,099.43
V - EUR - Hedged	LU2403432821	Thesaurierung	EUR	10,822.05	2,023.81	1,783.32	1,445.59
V - EUR - Unhedged	LU2197358042	Thesaurierung	EUR	16,811.75	2,254.46	1,910.87	1,564.86
Y - EUR - Unhedged	LU0102768370	Thesaurierung	EUR	203,546.10	102.15	87.13	72.31
Z	LU0644256330	Thesaurierung	USD	398,509.68	4,370.58	3,816.70	3,017.36
Z - EUR - Unhedged	LU0479709973	Thesaurierung	EUR	21,628.98	7,422.86	6,289.11	5,146.20
Z - EUR - Unhedged	LU1379320085	Ausschüttung	EUR	22,605.00	3,398.33	2,910.65	2,406.19

Cleome Index World Equities

Name	ISIN	Anteilsart	Währung	Anzahl der in Umlauf befindlichen Anteile	Nettoinventarwert je Anteil zum 30.06.2024	Nettoinventarwert je Anteil zum 31.12.2023	Nettoinventarwert je Anteil zum 31.12.2022
Nettovermögen insgesamt			EUR		151,836,239	128,550,136	112,003,755
C	LU1292953848	Thesaurierung	EUR	10.00	155.04	-	-
C	LU1365257945	Ausschüttung	EUR	4,708.40	310.39	274.55	235.30
I	LU1292954903	Thesaurierung	EUR	31,043.70	3,843.79	3,335.07	2,791.91
R	LU1292955033	Thesaurierung	EUR	66,569.51	260.59	226.30	189.78
R	LU1718422634	Ausschüttung	EUR	4,302.54	241.78	213.20	181.54
Z	LU1292955207	Thesaurierung	EUR	3,259.87	3,883.78	3,367.78	2,815.92



Cleome Index EMU Equities

Anlageportfolio zum 30. Juni 2024

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				
Anteile				
Österreich				
ERSTE GROUP BANK AG	21,083	EUR	932,712	0.34
OMV AG	6,041	EUR	245,627	0.09
VERBUND AG	6,604	EUR	486,385	0.18
VOESTALPINE AG	11,404	EUR	287,609	0.11
			1,952,333	0.71
Belgien				
AGEAS NOM	12,142	EUR	518,221	0.19
ANHEUSER-BUSCH INBEV	41,845	EUR	2,264,651	0.83
ELIA SYSTEM OPERATOR SA	2,239	EUR	195,801	0.07
GROUPE BRUXELLES LAMBERT GBL	893	EUR	59,518	0.02
KBC GROUPE SA	13,815	EUR	910,409	0.33
SYENSQO SA	5,399	EUR	451,194	0.17
UCB	8,661	EUR	1,201,281	0.44
UMICORE SA	16,880	EUR	236,827	0.09
			5,837,902	2.14
Finnland				
ELISA CORPORATION -A-	9,972	EUR	427,200	0.16
FORTUM CORP	20,195	EUR	275,662	0.10
KESKO CORP	4,749	EUR	77,836	0.03
KONE OYJ -B-	20,919	EUR	964,157	0.35
NESTE	23,022	EUR	382,741	0.14
NOKIA OYJ	295,977	EUR	1,053,234	0.39
NORDEA BANK	167,777	USD	1,874,699	0.69
ORION CORPORATION (NEW) -B-	7,367	EUR	293,649	0.11
SAMPO	19,735	EUR	791,374	0.29
STORA ENSO -R-	39,870	EUR	508,541	0.19
UPM KYMMENE CORP	30,621	EUR	998,857	0.37
WARTSILA CORPORATION -B-	37,279	EUR	671,022	0.25
			8,318,972	3.05
Frankreich				
ACCOR SA	9,889	EUR	378,749	0.14
AEROPORTS DE PARIS-ADP-	1,248	EUR	141,773	0.05
AIR LIQUIDE SA	32,086	EUR	5,174,830	1.89
ALSTOM SA	28,668	EUR	450,088	0.16
AMUNDI SA	2,101	EUR	126,585	0.05
ARKEMA SA	3,203	EUR	259,923	0.10
AXA SA	96,903	EUR	2,962,325	1.08
BIOMERIEUX SA	4,775	EUR	423,781	0.16
BNP PARIBAS SA	56,358	EUR	3,354,992	1.23
BOUYGUES SA	16,240	EUR	486,713	0.18
BUREAU VERITAS SA	26,357	EUR	681,592	0.25
CAPGEMINI SE	8,630	EUR	1,602,591	0.59
CARREFOUR SA	31,700	EUR	418,440	0.15
CIE DE SAINT-GOBAIN	37,436	EUR	2,718,602	1.00
CIE GENERALE DES ETABLISSEMENTS MICHELIN	42,654	EUR	1,540,236	0.56
COVIVIO SA	5,732	EUR	254,386	0.09
CREDIT AGRICOLE SA	59,505	EUR	758,094	0.28
DANONE SA	41,157	EUR	2,349,242	0.86
DASSAULT SYST.	36,411	EUR	1,285,308	0.47
EDENRED SA	14,318	EUR	564,272	0.21
EIFFAGE	4,292	EUR	368,082	0.13
ENGIE SA	101,638	EUR	1,355,343	0.50
ESSILORLUXOTTICA SA	15,765	EUR	3,171,918	1.16

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

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



Cleome Index EMU Equities

Anlageportfolio zum 30. Juni 2024

Bezeichnung	Anzahl	Wahrung	Marktwert (in EUR)	% des NV
EURAZEO	6,029	EUR	448,256	0.16
GECINA	2,724	EUR	234,128	0.09
GETLINK ACT	31,082	EUR	480,217	0.18
HERMES INTERNATIONAL SA	1,812	EUR	3,877,680	1.42
IPSEN	2,664	EUR	305,028	0.11
KERING	4,008	EUR	1,356,708	0.50
KLEPIERRE SA	18,293	EUR	456,959	0.17
LA FRANCAISE DES JEUX SA	5,067	EUR	161,131	0.06
LEGRAND SA	27,057	EUR	2,506,560	0.92
L'OREAL SA	12,734	EUR	5,221,577	1.91
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	14,594	EUR	10,414,277	3.81
ORANGE	97,064	EUR	907,937	0.33
PERNOD RICARD SA	9,222	EUR	1,168,428	0.43
PUBLICIS GROUPE	15,654	EUR	1,555,695	0.57
REMY COINTREAU	939	EUR	73,148	0.03
RENAULT SA	13,710	EUR	655,887	0.24
SANOFI	63,584	EUR	5,718,744	2.09
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,625	EUR	249,113	0.09
SCHNEIDER ELECTRIC SE	36,412	EUR	8,167,211	2.99
SOCIETE GENERALE SA	42,764	EUR	937,387	0.34
SODEXO SA	7,059	EUR	592,956	0.22
TELEPERFORMANCE SE	2,986	EUR	293,643	0.11
TOTALENERGIES SE	117,718	EUR	7,337,363	2.69
UNIBAIL RODAMCO	9,451	EUR	694,838	0.25
VEOLIA ENVIRONNEMENT SA	32,276	EUR	901,146	0.33
VINCI SA	24,756	EUR	2,435,495	0.89
VIVENDI SA	51,191	EUR	499,419	0.18
			88,478,796	32.39
Deutschland				
ADIDAS AG - REG SHS	9,059	EUR	2,020,157	0.74
ALLIANZ SE PREFERENTIAL SHARE	19,595	EUR	5,084,903	1.86
BASF SE PREFERENTIAL SHARE	44,341	EUR	2,003,548	0.73
BECHTLE	3,948	EUR	173,475	0.06
BEIERSDORF AG	4,959	EUR	677,151	0.25
BMW AG	19,208	EUR	1,697,604	0.62
BRENNTAG - REG SHS	14,301	EUR	900,391	0.33
CARL ZEISS MEDITEC AG	3,228	EUR	211,918	0.08
COMMERZBK	65,300	EUR	926,281	0.34
CONTINENTAL AG	5,841	EUR	308,989	0.11
COVESTRO AG	11,221	EUR	614,911	0.23
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	30,892	EUR	1,148,256	0.42
DELIVERY HERO	11,122	EUR	246,352	0.09
DEUTSCHE BANK AG PREFERENTIAL SHARE	111,713	EUR	1,665,417	0.61
DEUTSCHE BOERSE AG - REG SHS	11,998	EUR	2,292,818	0.84
DEUTSCHE LUFTHANSA AG - REG SHS	19,644	EUR	112,167	0.04
DEUTSCHE POST AG - REG SHS	50,256	EUR	1,899,174	0.70
DEUTSCHE TELEKOM AG - REG SHS	175,650	EUR	4,124,261	1.51
E.ON SE	134,905	EUR	1,653,261	0.61
FRESENIUS MEDICAL CARE AG	12,918	EUR	461,948	0.17
FRESENIUS SE	24,129	EUR	672,717	0.25
GEA GROUP AG	17,285	EUR	672,387	0.25
HANNOVER RUECK SE	3,875	EUR	917,212	0.34
HENKEL AG & CO KGAA	5,818	EUR	427,332	0.16
HENKEL AG & CO KGAA PREFERENTIAL SHARE	9,143	EUR	760,880	0.28
INFINEON TECHNOLOGIES - REG SHS	73,264	EUR	2,513,322	0.92
KNORR-BREMSE - BEARER SHS	7,646	EUR	545,160	0.20
LEG IMMOBILIEN - REG SHS	5,690	EUR	433,919	0.16
MERCEDES-BENZ GROUP	43,604	EUR	2,815,510	1.03

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

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



Cleome Index EMU Equities

Anlageportfolio zum 30. Juni 2024

Bezeichnung	Anzahl	Wahrung	Marktwert (in EUR)	% des NV
MERCK KGAA	7,295	EUR	1,128,901	0.41
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	4,653	EUR	1,111,136	0.41
MUENCHENER RUECK - REG SHS	8,522	EUR	3,979,774	1.46
NEMETSCHEK	3,943	EUR	362,165	0.13
PUMA AG	6,781	EUR	290,701	0.11
RATIONAL NAMEN	463	EUR	359,983	0.13
SAP AG	56,432	EUR	10,694,990	3.92
SARTORIUS VORZ.OHNE STIMMRECHT.	1,484	EUR	324,996	0.12
SCOUT24	4,875	EUR	347,100	0.13
SIEMENS AG PREFERENTIAL SHARE	44,987	EUR	7,815,141	2.86
SIEMENS ENERGY - REG SHS	43,213	EUR	1,050,508	0.38
SIEMENS HEALTHINEERS	13,618	EUR	732,649	0.27
SYMRISE AG	8,795	EUR	1,005,269	0.37
VOLKSWAGEN AG	2,278	EUR	255,364	0.09
VOLKSWAGEN AG VORZ.AKT	11,283	EUR	1,189,228	0.44
VONOVIA SE	40,713	EUR	1,080,930	0.40
ZALANDO SE	13,953	EUR	305,431	0.11
			70,015,687	25.63
Irland				
BANK OF IRELAND - REGISTERED	69,295	EUR	676,874	0.25
KERRY GROUP -A-	9,853	EUR	745,379	0.27
KINGSPAN GROUP	13,323	EUR	1,059,179	0.39
SMURFIT KAPPA PLC	18,764	EUR	780,583	0.29
			3,262,015	1.19
Italien				
AMPLIFON SPA	6,327	EUR	210,309	0.08
ASSICURAZIONI GENERALI SPA	61,684	EUR	1,436,620	0.53
DIASORIN	803	EUR	74,727	0.03
ENEL SPA	436,932	EUR	2,837,436	1.04
ENI SPA	114,929	EUR	1,649,691	0.60
FINECOBANK	39,577	EUR	550,912	0.20
INTESA SANPAOLO	842,725	EUR	2,925,098	1.07
MONCLER SPA	10,189	EUR	581,384	0.21
NEXI SPA	38,753	EUR	220,660	0.08
PRYSMIAN SPA	29,284	EUR	1,693,201	0.62
RECORDATI SPA	5,562	EUR	270,869	0.10
SNAM SPA	77,908	EUR	321,838	0.12
TELECOM ITALIA	494,640	EUR	110,553	0.04
TERNA SPA	74,955	EUR	541,025	0.20
UNICREDIT SPA - REG SHS	85,401	EUR	2,955,302	1.08
			16,379,625	6.00
Luxemburg				
EUROFINS SCIENTIFIC SE	8,416	EUR	391,765	0.14
TENARIS - REG SHS	29,076	EUR	417,241	0.15
			809,006	0.30
Niederlande				
ABN AMRO GROUP DEP RECEIPT	24,445	EUR	375,231	0.14
ADYEN	1,134	EUR	1,262,369	0.46
AKZO NOBEL NV	12,075	EUR	685,619	0.25
ARGENX SE	3,364	EUR	1,374,531	0.50
ASM INTERNATIONAL NV	2,805	EUR	1,996,599	0.73
ASML HOLDING NV	21,475	EUR	20,706,194	7.58
ASR NEDERLAND NV	10,586	EUR	471,183	0.17
DAVIDE CAMPARI-MILANO N.V.	20,590	EUR	181,686	0.07
EXOR NV	6,457	EUR	630,849	0.23
FERRARI NV	6,421	EUR	2,444,475	0.89
FERROVIAL INTERNATIONAL SE	23,057	EUR	836,047	0.31
HEINEKEN HOLDING	4,082	EUR	300,639	0.11
HEINEKEN NV	13,775	EUR	1,243,883	0.46

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

Etwige Abweichungen bei den Prozentsatzen des Nettovermogens sind auf Rundungen zuruckzufuhren.



Cleome Index EMU Equities

Anlageportfolio zum 30. Juni 2024

Bezeichnung	Anzahl	Wahrung	Marktwert (in EUR)	% des NV
ING GROUP NV	178,602	EUR	2,850,845	1.04
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	53,716	EUR	1,482,024	0.54
KONINKLIJKE KPN NV	256,388	EUR	917,869	0.34
NN GROUP NV	20,265	EUR	880,514	0.32
PROSUS NV	75,461	EUR	2,509,833	0.92
QIAGEN NV - REG SHS	15,546	EUR	599,298	0.22
RANDSTAD BR	8,074	EUR	341,772	0.13
ROYAL PHILIPS NV	41,232	EUR	972,663	0.36
STELLANTIS NV-BEARER AND REGISTERED SHS	122,703	EUR	2,266,324	0.83
STMICROELECTRONICS NV	39,680	EUR	1,462,803	0.54
UNIVERSAL MUSIC GROUP N.V.	53,157	EUR	1,476,701	0.54
WOLTERS KLUWER NV	16,853	EUR	2,608,844	0.95
			50,878,795	18.62
Portugal				
EDP ENERGIAS DE PORTUGAL SA - REG SHS	219,827	EUR	769,175	0.28
GALP ENERGIA SA REG SHS -B-	26,888	EUR	530,232	0.19
JERONIMO MARTINS SGPS SA	16,824	EUR	307,038	0.11
			1,606,445	0.59
Spanien				
ACS	17,161	EUR	691,245	0.25
AENA SME SA	3,440	EUR	646,720	0.24
AMADEUS IT GROUP SA -A-	26,604	EUR	1,653,173	0.61
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA	320,865	EUR	3,000,729	1.10
BANCO SANTANDER SA - REG SHS	820,807	EUR	3,554,505	1.30
CAIXABANK SA	254,852	EUR	1,259,733	0.46
CELLNEX TELECOM SA	24,725	EUR	750,898	0.27
EDP RENOVAVEIS SA	37,009	EUR	482,968	0.18
GRIFOLS SA -A-	18,672	EUR	146,762	0.05
IBERDROLA SA	358,789	EUR	4,346,728	1.59
INDITEX SHARE FROM SPLIT	55,705	EUR	2,582,483	0.95
REDEIA CORPORACION SA	36,702	EUR	598,977	0.22
REPSOL SA	69,748	EUR	1,027,737	0.38
TELEFONICA SA	228,004	EUR	902,896	0.33
			21,645,554	7.92
Schweiz				
DSM FIRMENICH	10,859	EUR	1,146,710	0.42
			1,146,710	0.42
Grobritannien				
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS	11,322	EUR	774,425	0.28
			774,425	0.28
Vereinigte Staaten von Amerika				
AEGON - REGISTERED SHS	106,483	EUR	614,194	0.22
			614,194	0.22
Aktien gesamt			271,720,459	99.47
bertragbare Wertpapiere, die zur amtlichen Notierung an einer Brse zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden gesamt			271,720,459	99.47
Sonstige bertragbare Wertpapiere				
Rechte				
Italien				
DIR AMPLIFON	5,325	EUR	0	0.00
			0	0.00
Gesamtrechte			0	0.00
Sonstige bertragbare Wertpapiere, insgesamt			0	0.00
Anlageportfolio gesamt			271,720,459	99.47
Erwerbskosten			219,761,948	

Die Erluterungen im Anhang sind fester Bestandteil des Abschlusses.
Etwaige Abweichungen bei den Prozentsatzen des Nettovermgens sind auf Rundungen zurckzufhren.



Cleome Index EMU Equities

Geografische und wirtschaftliche Zusammensetzung des Wertpapierbestandes zum 30. Juni 2024

Geografische Zusammensetzung (in % des Nettovermögens)

Frankreich	32.39
Deutschland	25.63
Niederlande	18.62
Spanien	7.92
Italien	6.00
Finnland	3.05
Belgien	2.14
Irland	1.19
Österreich	0.71
Portugal	0.59
Schweiz	0.42
Luxemburg	0.30
Großbritannien	0.28
Vereinigte Staaten von Amerika	0.22
	99.47

Wirtschaftliche Zusammensetzung (in % des Nettovermögens)

Banken und andere Finanzinstitute	14.69
Elektronik und Halbleiter	10.74
Pharmazeutika	7.84
Elektrotechnik	7.06
Internet und Internet-Dienste	6.69
Textilien und Bekleidung	6.40
Versicherungen	6.27
Versorger	5.13
Kraftfahrzeuge	4.57
Erdöl	4.19
Chemikalien	3.90
Kommunikation	3.47
Baumaterialien	2.84
Einzelhandel und Warenhäuser	2.28
Tabak und alkoholische Getränke	1.92
Grafik und Verlage	1.71
Maschinen- und Apparatebau	1.55
Lebensmittel und alkoholfreie Getränke	1.42
Transport	1.20
Immobilien	1.15
Papier und Forsterzeugnisse	0.84
Biotechnologie	0.78
Reifen und Kautschuk	0.68
Sonstige Dienstleistungen	0.59
Sonstige Konsumgüter	0.43
Luft- und Raumfahrt	0.41
Kohlebergbau und Stahlindustrie & Chemie	0.26
Hotels und Restaurants	0.20
Umweltdienste und Recycling	0.18
NE-Metalle	0.09
	99.47

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



Cleome Index Euro Corporate Bonds

Anlageportfolio zum 30. Juni 2024

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	284,302	0.06
MACQUARIE GROUP LTD 0.35 20-28 03/12A	400,000	EUR	355,667	0.07
NATL AUSTRALIA BANK 1.125 19-31 20/05A	100,000	EUR	88,845	0.02
NATL AUSTRALIA BANK 1.375 18-28 30/08A	1,100,000	EUR	1,015,438	0.21
SCENTRE GROUP 1.75 18-28 11/04A	1,200,000	EUR	1,121,181	0.23
SCENTRE MGMT LTD 2.25 14-24 16/07A	300,000	EUR	299,744	0.06
TELSTRA CORP LTD 1.125 16-26 14/04A	300,000	EUR	288,068	0.06
TELSTRA CORPORATION 1 20-30 23/04A	278,000	EUR	243,229	0.05
TRANSURBAN FINANCE 4.225 23-33 26/04A	1,000,000	EUR	1,024,002	0.21
TRANSURBAN FINANCE 1.45 19-29 16/05A	400,000	EUR	360,874	0.08
WESTPAC BANKING 1.125 17-27 05/09A	100,000	EUR	93,465	0.02
WESTPAC BANKING 1.45 18-28 17/07A	500,000	EUR	465,766	0.10
WESTPAC BANKING CORP 0.766 21-31 13/05A	1,000,000	EUR	934,028	0.19
			6,574,609	1.37
Österreich				
ERSTE GROUP BAN 0.8750 19-26 22/05A	1,200,000	EUR	1,141,908	0.24
ERSTE GROUP BANK AG 0.05 20-25 16/09A	200,000	EUR	191,545	0.04
ERSTE GROUP BANK AG 0.875 20 27 13/05A	300,000	EUR	280,229	0.06
OMV AG 0.75 20-30 16/06A	770,000	EUR	664,161	0.14
OMV AG 1.875 18-28 04/12A	300,000	EUR	282,251	0.06
VIENNA INSURANCE GRO 1 21-36 26/03A	500,000	EUR	393,060	0.08
			2,953,154	0.61
Belgien				
ANHEUSER INBEV SANV 3.75 24-37 22/03A	2,000,000	EUR	1,991,483	0.41
ANHEUSER-BUSCH INBEV 1.50 15-30 18/04A	500,000	EUR	454,787	0.09
ANHEUSER-BUSCH INBEV 1.6500 19-31 28/03A	800,000	EUR	721,016	0.15
ANHEUSER-BUSCH INBEV 2.00 16-28 17/03A	645,000	EUR	619,260	0.13
ANHEUSER-BUSCH INBEV 2.875 20-32 02/04A	800,000	EUR	768,322	0.16
BELFIUS BANQUE SA 0.00 19-26 28/08U	500,000	EUR	463,432	0.10
BELFIUS BANQUE SA/NV 0.01 20-25 15/10A	1,800,000	EUR	1,717,552	0.36
BELFIUS SANV 3.75 24-29 22/01A	1,600,000	EUR	1,599,288	0.33
BPOST BANK NVÂ 1.25 18-26 11/07A	100,000	EUR	95,445	0.02
ELIA SYSTEM OP SA/NV 3.25 13-28 04/04A	300,000	EUR	296,972	0.06
ELIA SYSTEM OPERATOR 1.375 19-26 14/01A	100,000	EUR	96,767	0.02
ELIA TRANSMISSION BE 0.875 20-30 28/04A	200,000	EUR	171,703	0.04
FLUVIUS SYSTEM 0.2500 21-28 14/06A	1,300,000	EUR	1,150,512	0.24
KBC GROUPE SA 0.6250 19-25 10/04A	200,000	EUR	195,419	0.04
KBC GROUPE SA 3 22-30 25/08A	600,000	EUR	575,519	0.12
SOLVAY SA 2.75 15-27 02/12A15-27 02/12A	1,200,000	EUR	1,176,394	0.24
VGP SA 2.25 22-30 17/01A	100,000	EUR	86,101	0.02
			12,179,972	2.53
Kanada				
MAGNA INTL 1.500 17-27 25/09A	100,000	EUR	94,036	0.02
MAGNA INTL 4.375 23-32 17/03A	800,000	EUR	834,618	0.17
TORONTO DOMINION BANK 3.129 22-32 03/08A	400,000	EUR	381,117	0.08
TORONTO DOMINION BK 1.952 22-30 08/04A	300,000	EUR	272,245	0.06
TOTALENERGIES 2.125 14-29 18/09A	200,000	EUR	188,148	0.04
			1,770,164	0.37
Kaimaninseln				
CK HUTCHINSON E 0.7500 21-29 02/11A	500,000	EUR	427,734	0.09
CK HUTCHINSON FINANCE 0.875 16-24 03/10A	300,000	EUR	297,509	0.06
CK HUTCHINSON TCOM FIN 0.75 19-26 17/04A	500,000	EUR	473,983	0.10
CKE HUTCHINSON FINANCE 2.00 16-28 06/04A	200,000	EUR	188,820	0.04
CKH GRP TELECOM FIN 1.125 19-28 17/10A	800,000	EUR	719,897	0.15

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



Cleome Index Euro Corporate Bonds

Anlageportfolio zum 30. Juni 2024

Bezeichnung	Anzahl	Wahrung	Marktwert (in EUR)	% des NV
			2,107,943	0.44
Danemark				
A.P. MOELLER - MAERSK 4.125 24-36 05/03A	1,000,000	EUR	1,008,959	0.21
AP MOLLER MAERSK 1.75 18-26 16/03A	200,000	EUR	193,959	0.04
CARLSBERG BREWERIES A 4.25 23-33 05/10A	700,000	EUR	726,338	0.15
DANSKE BANK A/S 0.625 20-25 12/05A	200,000	EUR	194,722	0.04
DANSKE BANK A/S 4.0000 23-27 12/01A	1,000,000	EUR	1,004,544	0.21
NYKREDIT REALKREDIT 0.875 21-31 28/04A	900,000	EUR	843,242	0.18
NYKREDIT REALKREDIT 0.1250 19-24 10/07A	519,000	EUR	518,575	0.11
ORSTED 3.25 22-31 13/09A	600,000	EUR	584,336	0.12
			5,074,675	1.05
Finnland				
BALDER FINLAND OYJ 1.375 21-30 24/05A	400,000	EUR	318,455	0.07
FORTUM CORP 1.625 19-26 27/02A	1,500,000	EUR	1,448,885	0.30
NORDEA BANK ABP 0.50 21-28 02/11A	800,000	EUR	704,402	0.15
NORDEA BKP 3.625 24-34 15/03A	1,000,000	EUR	989,532	0.21
OP CORPORATE BA 1.0000 18-25 22/05A	100,000	EUR	97,702	0.02
OP CORPORATE BANK 0.625 19-29 12/11U	300,000	EUR	256,408	0.05
OP CORPORATE BANK PLC 0.375 21-28 08/12A	500,000	EUR	434,009	0.09
			4,249,393	0.88
Frankreich				
AEROPORTS DE PARIS 1.125 19-34 18/06A	100,000	EUR	78,899	0.02
AEROPORTS DE PARIS A 1 20-29 02/07A	600,000	EUR	538,414	0.11
AEROPORTS DE PARIS A 1.5 20-32 02/07A	1,300,000	EUR	1,114,091	0.23
AEROPORTS DE PARIS-ADP- 1 17-27 13/12A	400,000	EUR	371,009	0.08
AIR LIQUIDE FINANCE 0.375 21-33 20/09A	800,000	EUR	614,458	0.13
APRR SA 0.125 20-29 18/09A	300,000	EUR	259,285	0.05
APRR SA 1.25 20-27 14/04A	300,000	EUR	284,230	0.06
APRR SA 1.625 17-32 13/01A	100,000	EUR	87,688	0.02
ARKEMA SA 0.75 19-29 03/12A	200,000	EUR	172,570	0.04
ARKEMA SA 1.50 17-27 20/04A	500,000	EUR	474,318	0.10
ARVAL SERVICE LEASE 4.0 22-26 22/09A	1,500,000	EUR	1,504,909	0.31
AUTOROUTES DU SUD 1.375 18-30 22/01A	100,000	EUR	89,907	0.02
AUTOROUTES DU SUD FRA 1.125 17-26 20/04A	300,000	EUR	288,204	0.06
AXA 3.625 23-33 10/01A	500,000	EUR	506,972	0.11
AXA 3.75 22-30 12/10A	1,000,000	EUR	1,020,150	0.21
BANQUE FEDERATIVE DU 0.1 20-27 08/10A	2,200,000	EUR	1,968,340	0.41
BFCM 0.01 21-26 11/05A	800,000	EUR	749,040	0.16
BFCM 0.25 21-28 19/01A	200,000	EUR	173,460	0.04
BFCM 1.25 15-25 14/01A	1,200,000	EUR	1,184,505	0.25
BFCM 1.25 20-30 03/06A 1.25 20-30 03/06A	2,500,000	EUR	2,150,956	0.45
BFCM 1.75 19-29 15/03A	1,600,000	EUR	1,459,677	0.30
BFCM 1.875 16-26 04/11A	100,000	EUR	95,603	0.02
BFCM 2.5 18-28 25/05A	200,000	EUR	190,321	0.04
BFCM 3.625 22-32 14/09A	1,000,000	EUR	996,607	0.21
BFCM 4.524 22-25 13/07S	400,000	EUR	374,812	0.08
BFCM BANQUE FEDERATI 3.75 22-33 01/02A	1,300,000	EUR	1,298,805	0.27
BNP PARIBAS 1.00 17-24 29/11A	100,000	EUR	98,699	0.02
BNP PARIBAS 1.50 16-28 25/05A	300,000	EUR	278,615	0.06
BNP PARIBAS 1.625 16-26 23/03A	800,000	EUR	777,168	0.16
BNP PARIBAS 2.1 22-32 07/04A	1,000,000	EUR	881,128	0.18
BNP PARIBAS 4.125 23-33 24/05A	1,000,000	EUR	1,035,440	0.22
BNP PARIBAS FL.R 19-27 23/01A	3,700,000	EUR	3,601,786	0.75
BNP PARIBAS FL.R 20-29 17/04A	600,000	EUR	542,880	0.11
BNP PARIBAS SA 1.125 18-26 11/06A	200,000	EUR	190,625	0.04
BNP PARIBAS SA 2.875 16-26 01/10A	350,000	EUR	343,286	0.07
BNP PARIBAS SA FL.R 20-27 14/10A	200,000	EUR	185,047	0.04
BOUYGUES 1.125 20-28 14/04A	100,000	EUR	91,903	0.02
BOUYGUES 2.25 22-29 29/06A	800,000	EUR	756,168	0.16

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 Euro Corporate Bonds

Anlageportfolio zum 30. Juni 2024

Bezeichnung	Anzahl	Wahrung	Marktwert (in EUR)	% des NV
BOUYGUES 5.375 22-42 30/06A	600,000	EUR	677,098	0.14
BPCE 0.5 20-27 15/09A	700,000	EUR	650,043	0.14
BPCE 0.625 20-25 28/04A	400,000	EUR	390,144	0.08
BPCE 1.0 19-25 01/04A	1,400,000	EUR	1,371,433	0.29
BPCE 1.00 16-28 05/10A	500,000	EUR	451,048	0.09
BPCE 2.375 22-32 26/04A	2,300,000	EUR	2,090,248	0.43
BPCE 2.875 16-26 22/04A	100,000	EUR	98,055	0.02
BPCE SA 1.75 22-34 02/02A	500,000	EUR	446,591	0.09
CA 2.5 22-34 22/04A	1,200,000	EUR	1,075,228	0.22
CA 3.75 24-34 22/01A	1,000,000	EUR	998,952	0.21
CA 3.875 22-34 28/11A	700,000	EUR	709,158	0.15
CA ASSURANCES SA 1.5 21-31 06/10A 06/10A	500,000	EUR	408,844	0.08
CA ASSURANCES SA 2 20-30 17/07A	1,400,000	EUR	1,215,824	0.25
CAPGEMINI SE 0.625 20-25 23/06A	200,000	EUR	194,282	0.04
CAPGEMINI SE 1.125 20-30 23/06A	100,000	EUR	87,899	0.02
CAPGEMINI SE 1.625 20-26 15/04A	100,000	EUR	96,949	0.02
CAPGEMINI SE 2.375 20-32 15/04A	700,000	EUR	644,238	0.13
CARREFOUR SA 1.7500 18-26 04/05A	200,000	EUR	193,860	0.04
CARREFOUR SA 2.375 22-29 30/10A	500,000	EUR	470,020	0.10
CARREFOUR SA 2.625 20-27 01/04A	500,000	EUR	485,170	0.10
CIE DE SAINT GOBAIN 1.125 18-26 23/03A	300,000	EUR	288,196	0.06
CIE DE SAINT GOBAIN 1.875 19-31 15/03A	300,000	EUR	268,649	0.06
CIE DE SAINT-GOBAIN 2.625 22-32 10/08A	300,000	EUR	278,069	0.06
CNP ASSURANCES 1.25 22-29 27/01A	500,000	EUR	442,619	0.09
COFIROUTE SA 1 20-31 19/05A	300,000	EUR	253,916	0.05
COMPAGNIE DE SAINT G 3.625 24-34 08/04A	1,000,000	EUR	983,642	0.20
COVIVIO SA 1.625 20-30 23/06A	700,000	EUR	612,972	0.13
COVIVIO SA 1.875 16-26 20/05A	100,000	EUR	96,474	0.02
CREDIT AGRICOLE 0.125 20-27 09/12A	300,000	EUR	266,053	0.06
CREDIT AGRICOLE 0.375 19-25 21/10A	400,000	EUR	383,441	0.08
CREDIT AGRICOLE 0.375 21-28 20/04A	200,000	EUR	176,942	0.04
CREDIT AGRICOLE 1.75 19-29 05/03A	1,300,000	EUR	1,188,635	0.25
CREDIT AGRICOLE 2.70 15-25 14/04Q	100,000	EUR	98,988	0.02
CREDIT AGRICOLE LDN 3.125 14-26 05/02AA	100,000	EUR	99,570	0.02
CREDIT MUTUEL ARKEA 0.01 20-26 28/10A	300,000	EUR	283,587	0.06
CREDIT MUTUEL ARKEA 0.875 21-33 11/03A	100,000	EUR	77,956	0.02
CREDIT MUTUEL ARKEA 1.125 19-29 23/05A	100,000	EUR	89,152	0.02
CREDIT MUTUEL ARKEA 3.25 16-26 01/06A	100,000	EUR	98,951	0.02
CREDIT MUTUEL ARKEA 3.375 19-31 11/03A	100,000	EUR	93,930	0.02
CREDIT MUTUEL ARKEA 3.625 24-33 03/10A	1,000,000	EUR	985,751	0.20
CREDIT MUTUEL ARKEA 4.25 22-32 01/12A	500,000	EUR	515,728	0.11
CTE CO TRANSP ELEC 2.125 17-32 29/07A	900,000	EUR	797,236	0.17
DANONE 3.071 22-32 07/09A	900,000	EUR	874,264	0.18
DASSAULT SYSTEM 0.1250 19-26 16/09A	300,000	EUR	278,242	0.06
EDENRED SA 1.375 15-25 10/03A	200,000	EUR	196,710	0.04
EDENRED SA 1.875 17-27 30/03A	100,000	EUR	95,723	0.02
EDENRED SA 1.875 18-26 06/03A	300,000	EUR	291,373	0.06
EDF 1.00 16-26 13/10A	500,000	EUR	471,356	0.10
EDF 2.0019-49 09/12A	500,000	EUR	309,820	0.06
EDF ENERGY EMTN 4.625 10-30 26/04A	300,000	EUR	312,575	0.06
EDF SA 2.00 18-30 02/10A	500,000	EUR	452,551	0.09
EDF SA 4.50 10-40 12/11A	100,000	EUR	103,193	0.02
ELECTRICITE DE FRANCE 4.75 22-34 12/10A	800,000	EUR	840,571	0.17
ENGIE SA 0.375 19-27 21/06A	300,000	EUR	273,987	0.06
ENGIE SA 0.5 19-30 24/10A	300,000	EUR	248,447	0.05
ENGIE SA 1.00 15-26 13/03A	200,000	EUR	192,139	0.04
ENGIE SA 1.25 19-41 24/10A	200,000	EUR	127,514	0.03
ENGIE SA 1.375 17-29 28/02A	100,000	EUR	91,003	0.02

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

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



Cleome Index Euro Corporate Bonds

Anlageportfolio zum 30. Juni 2024

Bezeichnung	Anzahl	Wahrung	Marktwert (in EUR)	% des NV
ENGIE SA 1.50 15-35 13/03A	100,000	EUR	78,768	0.02
ENGIE SA 1.875 18-33 19/09A	300,000	EUR	256,116	0.05
ENGIE SA 3.625 23-30 11/01A	300,000	EUR	299,808	0.06
ENGIE SA FL.R 20-XX 30/11A	400,000	EUR	354,279	0.07
ENGIE SPA 4.25 23-43 11/01A	1,200,000	EUR	1,177,528	0.24
GECINA 1.00 16-29 30/01A	100,000	EUR	89,327	0.02
GECINA 1.375 17-28 26/01A	800,000	EUR	740,329	0.15
GECINA 1.625 18-30 14/03A	100,000	EUR	89,132	0.02
GECINA 1.625 19-34 29/05A	400,000	EUR	329,392	0.07
GIE PSA TRESORERIE 6 03-33 19/09A 19/09A	100,000	EUR	114,684	0.02
GROUPAMA SA 3.375 18-28 24/09A	100,000	EUR	97,647	0.02
GROUPAMA SA 6.00 17-27 23/01A	200,000	EUR	209,648	0.04
HLDG INFRA TRANSPORT 1.475 22-31 18/01A	1,300,000	EUR	1,112,082	0.23
HLDG INFRA TRANSPORT 2.25 14-25 24/03A	500,000	EUR	494,245	0.10
HOLDING D'INFRASTRUC 0.625 21-28 14/05A	500,000	EUR	438,700	0.09
HSBC CONTINENTAL EUR 1.3750 18-28 04/09A	1,000,000	EUR	921,551	0.19
ICADE SA 0.625 21-31 18/01A	200,000	EUR	158,523	0.03
ICADE SA 1.50 17-27 13/09A	100,000	EUR	93,221	0.02
ICADE SA 1.625 18-28 28/02A	200,000	EUR	183,369	0.04
JC DECAUX SE 5.0 3-29 11/01A	1,400,000	EUR	1,459,839	0.30
JCDECAUX SE 1.6250 22-30 07/02A	300,000	EUR	264,703	0.06
KERING SA 3.875 23-35 05/09A	1,500,000	EUR	1,504,806	0.31
KLEPIERRE (EX-COMPAG 0.875 20-31 17/11A	500,000	EUR	415,278	0.09
KLEPIERRE 1.25 16-31 29/09A	100,000	EUR	83,789	0.02
KLEPIERRE 1.375 17-27 16/02A	400,000	EUR	378,929	0.08
KLEPIERRE 1.875 16-26 19/02A	100,000	EUR	97,121	0.02
L OREAL S A 3.375 23-29 23/11A	2,000,000	EUR	2,020,786	0.42
LA BANQUE POSTALE 2.00 18-28 13/07A	100,000	EUR	93,391	0.02
LA POSTE 0.625 20-26 21/04A	500,000	EUR	467,962	0.10
LA POSTE 1.375 20-32 21/04A	800,000	EUR	680,888	0.14
LA POSTE 4.00 23-35 12/06A	1,000,000	EUR	1,024,795	0.21
LEGRAND SA 0.75 20-30 20/05A	200,000	EUR	171,821	0.04
LEGRAND SA 1.875 17-32 06/07A	200,000	EUR	180,110	0.04
LVMH MOET HENNE 3.5 23-33 07/09A	1,000,000	EUR	1,005,751	0.21
MMA USA HOLDINGS INC 1.75 19-31 13/06A6A	100,000	EUR	89,074	0.02
ORANGE SA 0.00 19-26 04/09U	400,000	EUR	371,467	0.08
ORANGE SA 0.125 20-29 16/09A	200,000	EUR	169,471	0.04
ORANGE SA 0.5 19-32 04/09A	200,000	EUR	157,893	0.03
ORANGE SA 1.00 18-25 12/09A	200,000	EUR	193,773	0.04
ORANGE SA 1.25 20-27 07/04A	200,000	EUR	188,204	0.04
ORANGE SA 1.375 18-28 20/03A	1,400,000	EUR	1,304,231	0.27
ORANGE SA 1.625 20-32 07/04A	100,000	EUR	87,729	0.02
ORANGE SA 8.125 03-33 28/01AA	400,000	EUR	533,436	0.11
PERNOD RICARD 3.75 22-32 02/11A	700,000	EUR	705,821	0.15
PERNOD RICARD S 3.3750 24-30 07/11A	2,000,000	EUR	1,974,083	0.41
PERNOD RICARD SA 0.50 19-27 24/10A	400,000	EUR	365,303	0.08
PERNOD RICARD SA 0.875 19-31 24/10A	200,000	EUR	165,816	0.03
PERNOD RICARD SA 1.125 20-25 06/04A	500,000	EUR	490,164	0.10
PEUGEOT SA 2 18-25 20/03A	200,000	EUR	197,462	0.04
PRAEMIA HEALTHCARE 0.875 19-29 04/11A	500,000	EUR	417,658	0.09
PRAEMIA HEALTHCARE 375 20-30 17/09A	100,000	EUR	83,893	0.02
RCI BANQUE SA 1.625 18-26 24/05A	200,000	EUR	192,388	0.04
RCI BANQUE SA 2.0 19-24 11/07A	600,000	EUR	599,671	0.12
RCI BANQUE SA 4.75 22-27 06/07A	1,000,000	EUR	1,027,481	0.21
RCI BANQUE SA 4.875 22-28 21/09A	300,000	EUR	310,315	0.06
RCI BANQUE SA 4.875 23-29 02/10A	1,300,000	EUR	1,347,468	0.28
RTE EDF TRANSPORT 1.125 19-49 09/09A	700,000	EUR	410,133	0.09
RTE RESEAU DE T 0.6250 20-32 08/07A	400,000	EUR	320,720	0.07

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 Euro Corporate Bonds

Anlageportfolio zum 30. Juni 2024

Bezeichnung	Anzahl	Wahrung	Marktwert (in EUR)	% des NV
SANEF SA 1.875 15-26 16/03A	100,000	EUR	97,238	0.02
SANOFI SA 1.375 18-30 21/03A	100,000	EUR	90,330	0.02
SANOFI SA 1.875 18-38 21/03A	1,000,000	EUR	824,940	0.17
SCHNEIDER ELECTRIC 1.5000 19-28 15/01A	100,000	EUR	94,484	0.02
SCHNEIDER ELECTRIC 3.5 22-32 09/11A	500,000	EUR	502,196	0.10
SCHNEIDER ELECTRIC SE 1.375 18-27 21/06A	200,000	EUR	190,188	0.04
SOCIETE DES AUTOROUTE 1.375 19-31 21/02A	100,000	EUR	87,522	0.02
SOCIETE GENERALE SA 0.125 21-28 18/02A	400,000	EUR	352,240	0.07
SOCIETE GENERALE SA 0.75 20-27 23/01A	200,000	EUR	185,014	0.04
SOCIETE GENERALE SA 0.875 19-26 01/07A	100,000	EUR	94,224	0.02
SOCIETE GENERALE SA 1.125 18-25 23/01A	300,000	EUR	295,438	0.06
SOCIETE GENERALE SA 1.25 20-30 12/06A	400,000	EUR	341,930	0.07
SOCIETE GENERALE SA 1.375 17-28 13/01A	100,000	EUR	92,339	0.02
SOCIETE GENERALE SA 2.125 18-28 27/09A	100,000	EUR	93,060	0.02
SOCIETE GENERALE SA 2.625 15-25 27/02A	400,000	EUR	395,761	0.08
SOCIETE GENERALE SA 4.25 22-32 16/11A	2,200,000	EUR	2,274,332	0.47
SODEXO 0.75 20-25 27/04A	625,000	EUR	609,396	0.13
SODEXO 2.50 14-26 24/06A	300,000	EUR	294,951	0.06
STE AUTORPARRHI 1.5 18-30 25/01A	300,000	EUR	270,166	0.06
STELLANTIS 2.75 20-26 15/05A	200,000	EUR	197,065	0.04
SUEZ 1.25 16-28 19/05A	100,000	EUR	92,028	0.02
SUEZ 1.625 18-30 17/09A	100,000	EUR	89,068	0.02
SUEZ 1.875 22-27 24/05A	1,000,000	EUR	949,391	0.20
SUEZ 5.0000 22-32 03/11A	300,000	EUR	318,414	0.07
SUEZ ENVIRONNEMENT 1.75 15-25 10/09A	100,000	EUR	97,812	0.02
TOTALENERGIES CAP 1.491 18-30 04/09A	200,000	EUR	179,035	0.04
TOTALENERGIES CAPIT 1.535 19-39 31/05A	500,000	EUR	379,829	0.08
TOTALENERGIES CAPITA 0.952 20-31 18/05A	400,000	EUR	339,451	0.07
TOTALENERGIES CAPITA 1.994 20-32 08/04A	1,400,000	EUR	1,268,132	0.26
UNIBAIL RODAMCO 1.00 15-25 14/03A	200,000	EUR	196,247	0.04
UNIBAIL-RODAMCO 1.375 15-30 15/04A	300,000	EUR	262,726	0.05
UNIBAIL-RODAMCO 1.375 16-26 09/03A	200,000	EUR	192,896	0.04
UNIBAIL-RODAMCO 1.8750 18-31 15/01A	1,700,000	EUR	1,500,081	0.31
UNIBAIL-RODAMCO-WEST 0.625 20-27 04/12A	100,000	EUR	91,844	0.02
UNIBAIL-RODAMCO-WEST 1.375 21-33 25/05A	1,300,000	EUR	1,039,368	0.22
UNIBAIL-RODAMCO-WEST 2.125 20-25 09/04A	900,000	EUR	888,484	0.18
VEOLIA ENVIRONNEMENT 0.8 20-32 15/06A	200,000	EUR	162,714	0.03
VEOLIA ENVIRONNEMENT 1.59 15-28 10/01A	200,000	EUR	187,800	0.04
VEOLIA ENVIRONNEMENT 1.94 18-30 07/01A	200,000	EUR	183,830	0.04
VEOLIA ENVIRONNEMENT 4.625 12-27 30/03A	200,000	EUR	206,282	0.04
VEOLIA ENVIRONNEMENT 6.125 03-33 25/11A	300,000	EUR	357,229	0.07
VINCI SA 1.625 19-29 18/01A	1,200,000	EUR	1,114,457	0.23
VINCI SA 1.7500 18-30 26/09A	400,000	EUR	363,269	0.08
VIVENDI SA 0.6250 19-25 11/06A	300,000	EUR	293,463	0.06
WENDEL SE 2.5 15-27 09/02A	200,000	EUR	193,988	0.04
WPP FINANCE 4.125 23-28 30/05A	1,000,000	EUR	1,014,405	0.21
WPP FINANCE SA 2.25 14-26 22/09A6 22/09A	300,000	EUR	291,542	0.06
			101,553,555	21.11
Deutschland				
ADIDAS AG 0.6250 20-35 10/09A	200,000	EUR	148,185	0.03
BASF 4.5 23-35 08/03A	800,000	EUR	844,564	0.18
BASF SE 0.875 16-31 06/10A	300,000	EUR	253,837	0.05
BASF SE 3.75 22-32 29/06A	300,000	EUR	301,884	0.06
COMMERZBANK AG 0.625 19-24 28/08A	367,000	EUR	365,147	0.08
COMMERZBANK AG 0.875 20-27 22/01A	2,800,000	EUR	2,605,010	0.54
COMMERZBANK AG 4.00 16-26 23/03A	200,000	EUR	199,869	0.04
DEUTSCHE BAHN FIN 0.75 20-35 16/07A/01A	200,000	EUR	151,648	0.03
DEUTSCHE BAHN FIN 1.625 18-33 16/08A	2,300,000	EUR	2,017,475	0.42

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 Euro Corporate Bonds

Anlageportfolio zum 30. Juni 2024

Bezeichnung	Anzahl	Wahrung	Marktwert (in EUR)	% des NV
DEUTSCHE BAHN FIN 3.875 22-42 13/10A	500,000	EUR	513,336	0.11
DEUTSCHE BAHN FINANC 0.625 20-50 08/12A	400,000	EUR	200,764	0.04
DEUTSCHE BAHN FINANC 0.625 21-36 15/04A	550,000	EUR	401,066	0.08
DEUTSCHE BANK AG 1.625 20-27 20/01A	400,000	EUR	378,649	0.08
DEUTSCHE BANK AG 4 22-27 29/11A	1,900,000	EUR	1,929,244	0.40
DEUTSCHE TELEKOM AG 1.75 19-49 09/12A	500,000	EUR	343,207	0.07
E.ON SE 0.35 19-30 28/02A	300,000	EUR	253,854	0.05
E.ON SE 0.8750 20-31 20/08A	1,500,000	EUR	1,254,966	0.26
EON SE 3.875 23-35 12/01A	1,500,000	EUR	1,500,015	0.31
FRES ME 3.875 22-27 20/09A	800,000	EUR	807,987	0.17
FRESENIUS MEDICAL CA 1 20-26 29/05A	343,000	EUR	327,336	0.07
FRESENIUS MEDICAL CARE 1.50 18-25 11/07A	261,000	EUR	255,204	0.05
FRESENIUS SE CO. KG 1.125 20-33 28/09A	350,000	EUR	283,912	0.06
FRESENIUS SE CO. KG 1.625 20-27 08/04A	201,000	EUR	190,233	0.04
HEIDELBERGCEMENT AG 3.75 23-32 31/05A	500,000	EUR	498,457	0.10
HOCHTIEF AG 0.5 19-27 03/09A	200,000	EUR	181,691	0.04
HOCHTIEF AG 0.625 21-29 26/04A	800,000	EUR	685,722	0.14
INFINEON TECHNO 1.1250 20-26 24/06A	400,000	EUR	382,184	0.08
INFINEON TECHNO 1.625 20-29 24/06A	300,000	EUR	275,889	0.06
INNOGY FINANCE BV 5.75 03-33 14/02A	300,000	EUR	344,107	0.07
LANDESBANK BADEN-WUER 2.2 19-29 09/05A	500,000	EUR	452,614	0.09
LBBW 0.25 21-28 21/07A0.25 21-28 21/07A	300,000	EUR	262,853	0.05
LEG IMMOBILIEN 0.3750 22-26 17/01A	400,000	EUR	379,167	0.08
LEG IMMOBILIEN SE 1.5 22-34 17/01A	500,000	EUR	392,056	0.08
MERCEDES-BENZ 1.125 19-31 06/11A	400,000	EUR	340,831	0.07
MERCEDES-BENZ GROUP 0.75 19-30 08/02A	200,000	EUR	173,963	0.04
MERCEDES-BENZ GROUP 0.75 20-30 10/09A	100,000	EUR	85,845	0.02
MERCEDES-BENZ GROUP 1.1250 19-34 08/08A	1,000,000	EUR	802,537	0.17
MERCEDES-BENZ GROUP 1.375 16-28 11/05A	300,000	EUR	280,803	0.06
MERCEDES-BENZ GROUP 1.50 17-29 03/07A	1,000,000	EUR	918,286	0.19
MERCEDES-BENZ GROUP 2.375 20-30 22/05A	100,000	EUR	94,735	0.02
MERCK FIN SERVI 0.1250 20-25 16/07A	300,000	EUR	289,572	0.06
MERCK FINANCIAL SERVI 0.375 19-27 05/07A	200,000	EUR	183,364	0.04
MUENCHENER RUECK FL.R 20-41 26/05A	800,000	EUR	668,859	0.14
SANTANDER CONS BK 0.2500 19-24 15/10A	400,000	EUR	395,984	0.08
TALANX AG 2.50 14-26 23/07A	100,000	EUR	98,417	0.02
VOLKSWAGEN FIN 1.5 19-24 01/10A	100,000	EUR	99,383	0.02
VOLKSWAGEN FIN 2.2500 19-27 01/10A	500,000	EUR	482,345	0.10
VOLKSWAGEN FINANCIAL 3 20-25 06/04A	400,000	EUR	397,929	0.08
VOLKSWAGEN LEASING G 0.25 21-26 12/01A	300,000	EUR	284,757	0.06
VOLKSWAGEN LEASING G 0.5 21-29 12/01A	743,000	EUR	644,247	0.13
VOLKSWAGEN LEASING GMB 1.50 19-26 19/06A	100,000	EUR	95,985	0.02
VONOVIA FINANCE BV 2.25 20-30 07/04A	600,000	EUR	546,558	0.11
VONOVIA SE 1 21-33 16/06A	400,000	EUR	304,068	0.06
VONOVIA SE 1.625 21-51 01/09A	100,000	EUR	56,088	0.01
VONOVIA SE 1.8750 22-28 28/06A	1,000,000	EUR	928,372	0.19
			27,555,060	5.73
Indonesien				
REPSOL INTL FINANCE 0.25 19-27 02/08A	300,000	EUR	272,141	0.06
			272,141	0.06
Irland				
AIB GROUP PLC 2.25 18-25 03/07A	100,000	EUR	98,591	0.02
CRH SMW FINANCE DAC 4.25 23-35 11/07A	800,000	EUR	816,389	0.17
ESB FINANCE LIMITED 2.125 18-33 05/11A	200,000	EUR	175,907	0.04
ESB FINANCE LIMITED 4.25 23-36 03/03A	500,000	EUR	517,039	0.11
FRESENIUS FINANCE IR 0.875 21-31 01/04A	1,000,000	EUR	817,122	0.17
JOHNSON CONTROLS INT 4.25 23-35 01/06A	600,000	EUR	611,524	0.13
JOHNSON CONTROLS INTL 1.375 16-25 25/02A	200,000	EUR	196,966	0.04
KERRY GROUP FIN SERV 0.625 19-29 20/09A	300,000	EUR	261,101	0.05

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 Euro Corporate Bonds

Anlageportfolio zum 30. Juni 2024

Bezeichnung	Anzahl	Wahrung	Marktwert (in EUR)	% des NV
LINDE PUBLIC LIMITED 3.2 24-31 14/02A	2,700,000	EUR	2,670,658	0.56
			6,165,297	1.28
Italien				
A2A EX AEM 2.5 22-26 15/06A	1,000,000	EUR	977,143	0.20
A2A SPA 4.5000 22-30 19/09A	300,000	EUR	310,682	0.06
ACEA SPA 0.00 21-25 28/09U	177,000	EUR	169,089	0.04
ACEA SPA 0.25 21-30 28/07A	159,000	EUR	129,481	0.03
ACEA SPA 1 16-26 24/10A	200,000	EUR	188,830	0.04
ACEA SPA 1.50 18-27 08/06	100,000	EUR	94,699	0.02
ACEA SPA 1.7500 19-28 23/05A	102,000	EUR	94,955	0.02
ASSICURAZ GENERALI 4.125 14-26 04/05A	300,000	EUR	301,763	0.06
ASSICURAZ GENERALI 5.272 23-33 12/09A	600,000	EUR	629,565	0.13
AUTOSTRAD E ITALIA 2 21-30 15/01A/01A	200,000	EUR	179,280	0.04
AUTOSTRAD E ITALIA SPA 2 20-28 08/03A	1,250,000	EUR	1,151,943	0.24
AUTOSTRAD E PER L ITA 5.125 23-33 14/06A	600,000	EUR	623,673	0.13
ENEL SOCIETA -EMTN- 5.625 07-27 21/06A	400,000	EUR	426,300	0.09
ENI S.P.A. 0.625 20-30 23/01A	500,000	EUR	427,652	0.09
ENI SPA 0.375 21-28 14/06A	1,000,000	EUR	886,904	0.18
ENI SPA 1.0000 19-34 11/10A	600,000	EUR	456,846	0.09
ENI SPA 1.125 16-28 19/09A	250,000	EUR	228,598	0.05
ENI SPA 3.625 14-29 29/01A	400,000	EUR	403,266	0.08
ERG SPA 0.875 21-31 15/09A	100,000	EUR	79,938	0.02
HERA SPA 4.25 23-33 20/04A	200,000	EUR	202,401	0.04
INTE 5.25 22-30 13/01A	500,000	EUR	535,891	0.11
INTESA SANPAOLO 0.75 19-24 04/12A	275,000	EUR	271,482	0.06
INTESA SANPAOLO 1.00 19-26 19/11A	100,000	EUR	93,965	0.02
INTESA SANPAOLO 1.75 19-29 04/07A	518,000	EUR	472,494	0.10
INTESA SANPAOLO SPA 1.75 18-28 20/03A	1,800,000	EUR	1,682,109	0.35
INTESA SANPAOLO SPA 5.625 23-33 08/03A	500,000	EUR	547,499	0.11
IREN SPA 1.50 17-27 24/10A	800,000	EUR	751,541	0.16
ITALGAS SPA 0.875 19-30 24/04A	500,000	EUR	426,481	0.09
ITALGAS SPA 1.0 19-31 11/12A	100,000	EUR	82,171	0.02
ITALGAS SPA 1.625 17-29 18/01A	300,000	EUR	275,501	0.06
MEDIOBANCA 0.875 19-26 15/01A	467,000	EUR	446,999	0.09
MEDIOBANCA 1 20-27 08/09A8/09A	194,000	EUR	178,510	0.04
POSTE ITALIANE SPA 0.0 20-24 10/12A	428,000	EUR	420,984	0.09
POSTE ITALIANE SPA 0.50 20-28 10/12A	129,000	EUR	112,837	0.02
SNAM SPA 0.625 21-31 30/06A	400,000	EUR	325,774	0.07
SNAM SPA 0.875 16-26 25/10A	300,000	EUR	282,152	0.06
SNAM SPA 1.25 22-34 20/06A	200,000	EUR	157,588	0.03
SNAM SPA 1.2500 19-25 28/08A	106,000	EUR	103,101	0.02
SNAM SPA 3.875 24-34 19/02A	1,000,000	EUR	986,327	0.21
TERNA SPA 0.75 20-32 24/07A	1,200,000	EUR	960,503	0.20
TERNA SPA 1.00 16-28 11/10U	100,000	EUR	90,411	0.02
TERNA SPA 1.0000 19-26 10/04A	350,000	EUR	335,322	0.07
TERNA SPA 1.375 17-27 26/07A	200,000	EUR	187,849	0.04
UNICREDIT FL.R 22-28 18/01A	3,000,000	EUR	2,797,937	0.58
UNICREDIT SPA 0.85 21-31 19/01A	1,500,000	EUR	1,241,755	0.26
UNICREDIT SPA 2.125 16-26 24/10A	400,000	EUR	387,813	0.08
			22,118,004	4.60
Japan				
mitsubishi UFJ FIN 0.848 19-29 19/07A	400,000	EUR	356,036	0.07
mitsubishi UFJ FINA 3.556 22-32 15/06A	400,000	EUR	403,379	0.08
MIZUHO FINA 1.5980 18-28 10/04A	200,000	EUR	186,905	0.04
MIZUHO FINANCIAL GRO 0.797 20-30 14/01A	2,000,000	EUR	1,708,925	0.36
MIZUHO FINANCIAL GRP 0.118 19-24 06/09A	300,000	EUR	297,991	0.06
MIZUHO FINANCIAL GRP 0.214 20-25 07/10A	208,000	EUR	199,757	0.04
NISSAN MOTOR CO 3.2010 20-28 17/09A	200,000	EUR	192,799	0.04
SUMITOMO MITSUI FIN 0.632 19-29 23/10A	300,000	EUR	257,672	0.05

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 Euro Corporate Bonds

Anlageportfolio zum 30. Juni 2024

Bezeichnung	Anzahl	Wahrung	Marktwert (in EUR)	% des NV
SUMITOMO MITSUI FIN 0.934 17-24 11/10A	200,000	EUR	198,414	0.04
SUMITOMO MITSUI FIN 1.546 16-26 15/06A	100,000	EUR	96,240	0.02
TAKEDA PHARMA 0.75 20-27 09/07A	2,077,000	EUR	1,917,877	0.40
TAKEDA PHARMA 2.25 18-26 21/11A	496,000	EUR	482,048	0.10
			6,298,043	1.31
Luxemburg				
AMERICAN MEDIC SYS EU 1.875 22-34 08/03A	1,000,000	EUR	849,519	0.18
AROWNTOWN SA 0.3750 21-27 15/04A	800,000	EUR	694,438	0.14
AROWNTOWN SA 1.45 19-28 09/07A	200,000	EUR	170,660	0.04
BECTON DICKINSON 1.208 19-26 04/06A	799,000	EUR	763,326	0.16
BECTON DICKINSON EUR 1.213 21-36 12/02A	700,000	EUR	526,368	0.11
BLACKSTONE PROPERTY 1.25 20-27 26/10A	150,000	EUR	137,652	0.03
BLACKSTONE PROPERTY P 3.625 22-29 29/10A	700,000	EUR	668,627	0.14
DH EUROPE FIN 0.20 19-26 18/03A	200,000	EUR	189,128	0.04
DH EUROPE FIN 0.45 19-28 18/03A	275,000	EUR	247,437	0.05
ENEL FINANCE INTL 1.125 18-26 16/09A	201,000	EUR	191,002	0.04
HEIDELBERG MATERIALS 1.75 18-28 24/04A	100,000	EUR	93,942	0.02
JOHN DEERE CASH MANA 1.85 20-28 02/04A	300,000	EUR	285,731	0.06
JOHN DEERE CASH MGT 2.2 20-32 02/04A4A	300,000	EUR	276,784	0.06
LOGICOR FINANCI 2.0000 22-34 17/01A	300,000	EUR	237,807	0.05
LOGICOR FINANCING 1.625 22-30 17/01A/01A	400,000	EUR	344,020	0.07
MEDTRONIC GLOBAL HLDG 0.375 20-28 15/10A	200,000	EUR	176,374	0.04
MEDTRONIC GLOBAL HLDG 1.375 20-40 15/10A	1,000,000	EUR	700,559	0.15
MEDTRONIC GLOBAL HLDG 1.50 19-39 02/07A	200,000	EUR	146,632	0.03
MEDTRONIC GLOBAL HLDG 2.25 19-39 07/03A	300,000	EUR	246,939	0.05
MEDTRONIC GLOBAL HOLD 0.25 19-25 02/07A	200,000	EUR	193,486	0.04
MEDTRONIC GLOBAL HOLD 1.00 19-31 02/07A	450,000	EUR	383,314	0.08
MEDTRONIC GLOBAL HOLD 1.125 19-27 07/03A	1,500,000	EUR	1,414,590	0.29
MEDTRONIC GLOBAL HOLD 1.625 19-31 07/03A	500,000	EUR	446,880	0.09
NESTLE FINANCE INTER 0.875 21-41 14/06A	800,000	EUR	539,053	0.11
NESTLE FINANCE INTER 3.375 22-34 15/11A	800,000	EUR	802,295	0.17
NESTLE FINANCE INTL 1.75 17-37 02/11A	300,000	EUR	245,206	0.05
NOVARTIS FINANCE 1.70 18-38 14/08A	100,000	EUR	82,322	0.02
RELAX CAPITAL INC 1.30 15-25 12/05A	300,000	EUR	293,860	0.06
REPSOL EUROPE FINANC 0.375 21-29 06/07A	1,300,000	EUR	1,118,794	0.23
RICHEMONT INTL 2.0 18-38 26/03A	1,160,000	EUR	966,326	0.20
SIMON INTERNATIONAL 1.125 21-33 19/03A	400,000	EUR	320,171	0.07
SIMON INTL FINANCE 1.25 16-25 13/05A	400,000	EUR	390,831	0.08
TRATON FINANCE LUXEM 1.25 21-33 24/03A	500,000	EUR	403,848	0.08
WHIRLPOOL FINANCE 1.25 06-16 15/06A	400,000	EUR	380,174	0.08
ZURICH FINANCE 1.6250 19-39 17/06A	300,000	EUR	233,791	0.05
			15,161,886	3.15
Niederlande				
ABN AMRO BANK 1.25 22-34 20/01A	200,000	EUR	160,796	0.03
ABN AMRO BANK 4.375 23-28 20/10A	1,000,000	EUR	1,026,035	0.21
ABN AMRO BANK NV 1 21-33 02/06A	400,000	EUR	323,990	0.07
ABN AMRO BANK NV 4.5 22-34 21/11A	500,000	EUR	526,023	0.11
AIRBUS SE 2.375 20-40 09/06A	450,000	EUR	370,296	0.08
AKZO NOBEL NV 2.0 22-32 28/03A	600,000	EUR	533,968	0.11
ASML HOLDING NV 0.625 20-29 07/05A	459,000	EUR	409,185	0.09
ASML HOLDING NV 1.375 16-26 07/07S	100,000	EUR	96,416	0.02
BMW FINANCE NV 0.2 21-33 11/01A	1,286,000	EUR	991,537	0.21
BMW FINANCE NV 1.5000 19-29 06/02A	1,292,000	EUR	1,197,629	0.25
CNH INDUSTRIAL 1.625 19-29 03/07A	500,000	EUR	452,959	0.09
CNH INDUSTRIAL 1.875 18-26 19/01A	200,000	EUR	194,587	0.04
COOPERATIEVE RABOBANK 0.625 21-33 25/02A	1,000,000	EUR	779,822	0.16
CRH FINANCE 1.375 16-28 18/10A	400,000	EUR	366,878	0.08
CRH FUNDING B.V. 1.625 20-30 05/05A	111,000	EUR	99,602	0.02
DEUT TELEKOM INT FIN 1.50 16-28 03/04A	300,000	EUR	282,410	0.06

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

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



Cleome Index Euro Corporate Bonds

Anlageportfolio zum 30. Juni 2024

Bezeichnung	Anzahl	Wahrung	Marktwert (in EUR)	% des NV
DEUTSCHE TEL INTL FIN 7.5 03-33 24/01A	200,000	EUR	257,712	0.05
DIAGEO CAPITAL BV 0.125 20-28 28/09A	300,000	EUR	263,437	0.05
DIAGEO CAPITAL BV 1.875 22-34 08/06A	500,000	EUR	433,460	0.09
DIGITAL DUTCH FINCO 1.5 20-30 17/01A	300,000	EUR	262,540	0.05
DIGITAL DUTCH FINCO 1 20-32 23/09A	325,000	EUR	260,296	0.05
DIGITAL DUTCH FINCO 1.25 20-31 26/06A	100,000	EUR	83,388	0.02
EASYJET FINCO BV 1.875 21-28 03/03A	500,000	EUR	467,614	0.10
EDP FINANCE BV 1.5 17-27 22/11A	500,000	EUR	469,267	0.10
EDP FINANCE BV 1.625 18-26 26/01A	217,000	EUR	210,751	0.04
ENEL FIN INTL 0.8750 21-34 28/09A	800,000	EUR	597,104	0.12
ENEL FINANCE IN 0.00 21-26 28/05U	1,000,000	EUR	940,360	0.20
ENEL FINANCE INTL 0.375 19-27 17/06A	520,000	EUR	475,218	0.10
ENEL FINANCE INTL 0.5 21-30 17/06A	300,000	EUR	254,292	0.05
ENEL FINANCE INTL 1.125 19-34 17/10A	700,000	EUR	537,063	0.11
EURONEXT NV 0.125 21-26 17/05A	700,000	EUR	658,021	0.14
EURONEXT NV 1 18-25 18/04A	100,000	EUR	97,823	0.02
EURONEXT NV 1.1250 19-29 12/06A	500,000	EUR	448,795	0.09
EURONEXT NV 1.5 21-41 17/05A	100,000	EUR	72,098	0.01
GIVAUDAN FINANCE EUR 1.625 20-32 22/04A	1,000,000	EUR	874,628	0.18
HEIMSTADEN BOSTAD TSY 0.25 21-24 13/10A	200,000	EUR	195,983	0.04
HEIMSTADEN BOSTAD TSY 1 21-28 13/04A	400,000	EUR	327,079	0.07
HEINEKEN 1.50 17-29 03/10A	700,000	EUR	637,863	0.13
HEINEKEN NV 1.25 20-33 07/05A	400,000	EUR	329,654	0.07
HEINEKEN NV 2.25 20-30 30/03A	800,000	EUR	749,810	0.16
HEINEKEN NV 2.875 12-25 04/08A	240,000	EUR	238,107	0.05
HEINEKEN NV 4.125 23-35 23/03A	500,000	EUR	516,719	0.11
IBERDROLA INTL BV FL.R 20-XX 28/04A	500,000	EUR	480,077	0.10
IBERDROLA INTL BV FL.R 21-XX 09/02A	300,000	EUR	279,576	0.06
ING GROEP NV FL.R 20-29 18/02A	300,000	EUR	264,172	0.05
ING GROUP NV 0.25 21-30 11/01A	500,000	EUR	426,327	0.09
ING GROUP NV 1.125 18-25 14/02A	600,000	EUR	590,309	0.12
ING GROUP NV 2.125 19-26 10/01A	1,000,000	EUR	978,447	0.20
ING GROUP NV 2.5 18-30 15/11A	200,000	EUR	187,405	0.04
JAB HOLDINGS B.V. 2.25 19-39 19/12A	500,000	EUR	375,723	0.08
JAB HOLDINGS B.V. 3.375 20-35 17/04A	200,000	EUR	185,985	0.04
JAB HOLDINGS BV 2 17-28 18/05A	500,000	EUR	471,446	0.10
KONINKLIJKE AHOLD 1.125 18-26 19/03A	113,000	EUR	108,664	0.02
KONINKLIJKE AHOLD 3.5 23-28 04/04A	300,000	EUR	301,963	0.06
KONINKLIJKE AHOLD DE 0.375 21-30 18/03A	500,000	EUR	423,581	0.09
KONINKLIJKE DSM NV 0.625 20-32 23/06A	800,000	EUR	642,814	0.13
KONINKLIJKE KPN NV 0.875 20-32 14/09A	300,000	EUR	240,582	0.05
KONINKLIJKE PHILIPS 2.125 22-29 05/11A	1,300,000	EUR	1,209,388	0.25
KPN NV 0.875 21-33 15/11A50 21-33 15/11A	1,000,000	EUR	778,319	0.16
LINDE FINANCE BV 0.55 20-32 19/05A	800,000	EUR	647,042	0.13
MONDELEZ INTERNATION 0.375 20-29 22/09A	1,000,000	EUR	854,129	0.18
MYLAN INC 2.125 18/25 23/05A	400,000	EUR	393,792	0.08
NATURGY FINANCE B.V. 1.25 20-26 15/04A	100,000	EUR	96,404	0.02
NATURGY FINANCE BV 1.375 17-27 19/01A	500,000	EUR	473,945	0.10
NN BANK NV NETH 0.5000 21-28 21/09A	1,000,000	EUR	882,122	0.18
PROSUS NV 2.031 20-32 03/08A	600,000	EUR	489,580	0.10
RABOBANK 1.125 19-31 07/05A	300,000	EUR	256,080	0.05
RABOBANK 1.25 16-27 23/03A 16-26 23/03A	200,000	EUR	193,063	0.04
RELX FINANCE BV 0.875 20-32 10/03A	500,000	EUR	413,077	0.09
RELX FINANCE BV 1.375 16-26 12/05A	350,000	EUR	337,403	0.07
RENTOKIL INITIAL FIN 3.875 22-27 27/06A	500,000	EUR	503,039	0.10
RENTOKIL INITIAL FIN 4.375 22-30 27/06AA	600,000	EUR	621,474	0.13
REPSOL INTL FINANCE 2.6250 20-30 15/04A	200,000	EUR	191,723	0.04
ROYAL PHILIPS NV 0.50 19-26 22/05A	292,000	EUR	276,634	0.06

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 Euro Corporate Bonds

Anlageportfolio zum 30. Juni 2024

Bezeichnung	Anzahl	Wahrung	Marktwert (in EUR)	% des NV
SCHLUMBERGER FINANCE 0.25 19-27 15/10A	546,000	EUR	494,652	0.10
SCHLUMBERGER FINANCE 1.375 20-26 06/05A	650,000	EUR	620,432	0.13
SHELL INT FIN 0.75 16-28 15/08A	300,000	EUR	270,667	0.06
SHELL INTL FINANCE 1.625 14-27 10/01A	300,000	EUR	288,260	0.06
SHELL INTL FINANCE 1.875 20-32 07/04A	500,000	EUR	445,244	0.09
SHELL INTL FINANCE BV 0.875 19-39 08/11A	200,000	EUR	133,647	0.03
SIEM FI 3.625 23-43 24/02A	1,300,000	EUR	1,271,820	0.26
SIEMENS FIN NV 0.375 20-26 05/06A	200,000	EUR	189,477	0.04
SIEMENS FIN NV 1.3750 18-30 06/09A	600,000	EUR	542,627	0.11
SIEMENS FINANCIERING 1.25 19-31 28/02A	300,000	EUR	268,300	0.06
STEDIN HOLDING NV 0.50 19-29 14/11A	400,000	EUR	342,531	0.07
STELLANTIS N.V. 1.25 21-33 18/06A	700,000	EUR	559,731	0.12
STELLANTIS NV 4.2500 23-31 16/06A	1,000,000	EUR	1,018,746	0.21
TELEFONICA EUROPE BV 5.875 03-33 14/02A	500,000	EUR	584,785	0.12
TENNET HOLDING BV 4.75 22-42 28/10A	200,000	EUR	218,191	0.05
UNILEVER 1.625 18-33 12/02A	700,000	EUR	613,613	0.13
UNILEVER FINANCE NET 3.5 23-35 23/02A	1,000,000	EUR	1,004,286	0.21
UNILEVER NV 1.125 16-28 29/04A	200,000	EUR	185,944	0.04
UPJOHN FINANCE 1.908 20-32 23/06A06A	500,000	EUR	419,142	0.09
VIATRIS INC 2.25 16-24 22/11A	200,000	EUR	198,632	0.04
VIATRIS INC 3.125 16-28 22/11	300,000	EUR	291,033	0.06
VOLKSWAGEN INTL FIN 0.875 20-28 22/09A	1,400,000	EUR	1,245,692	0.26
VOLKSWAGEN INTL FIN 1.25 20-32 23/09A	2,200,000	EUR	1,804,034	0.37
VONOVIA FINANCE B.V. 1 21-41 28/01A	300,000	EUR	178,494	0.04
VONOVIA FINANCE BV 1.625 19-39 07/10A	500,000	EUR	337,390	0.07
VONOVIA FINANCE BV 2.125 18-30 22/03A	100,000	EUR	90,327	0.02
VW INTL FINANCE 1.625 15-30 16/01A	500,000	EUR	447,791	0.09
WINTERSHALL DEA FIN 1.823 19-31 25/09A	300,000	EUR	252,553	0.05
WOLTERS KLUWER 1.50 17-27 22/03A	200,000	EUR	190,496	0.04
WOLTERS KLUWER N.V. 0.75 20-30 03/07A	500,000	EUR	429,224	0.09
			47,983,261	9.97
Norwegen				
SANTANDER CONS BK 0.125 19-24 11/09A	200,000	EUR	198,546	0.04
STATOIL ASA 1.625 15-35 17/02A	200,000	EUR	166,494	0.03
STATOIL ASA 1.625 16-36 09/11A	200,000	EUR	161,521	0.03
TELENOR AS 4.25 23-35 03/10A	500,000	EUR	527,056	0.11
TELENOR ASA 0.25 20-28 14/02A	147,000	EUR	131,519	0.03
TELENOR ASA 0.2500 19-27 25/09A	254,000	EUR	230,438	0.05
TELENOR ASA 1.75 19-34 31/05A	200,000	EUR	171,979	0.04
			1,587,553	0.33
Portugal				
ENERGIAS DE PORTUGAL 1.625 20-27 15/04A	100,000	EUR	95,247	0.02
			95,247	0.02
Spanien				
ABERTIS INFRASTRUCT 0.625 19-25 15/07A	500,000	EUR	484,445	0.10
ABERTIS INFRASTRUCT 1.00 16-27 27/02A	200,000	EUR	187,689	0.04
ABERTIS INFRASTRUCT 1.125 19-28 26/03A	200,000	EUR	182,311	0.04
ABERTIS INFRASTRUCT 1.625 19-29 15/07A	1,100,000	EUR	997,372	0.21
ABERTIS INFRASTRUCT 3.0000 19-31 27/03A	200,000	EUR	190,714	0.04
AMADEUS IT GROUP SA 1.875 20-28 24/09A	1,000,000	EUR	935,805	0.19
BANCO BILBAO VI 0.3750 19-26 15/11A	200,000	EUR	185,972	0.04
BANCO BILBAO VIZCAYA 0.5 20-27 14/01A	200,000	EUR	185,164	0.04
BANCO BILBAO VIZCAYA 0.75 20-25 04/06A	200,000	EUR	194,844	0.04
BANCO BILBAO VIZCAYA 1.00 19-26 21/06A	100,000	EUR	95,167	0.02
BANCO BILBAO VIZCAYA 3.50 17-27 10/02A	200,000	EUR	198,886	0.04
BANCO SANTANDER 3.875 23-28 16/01A	800,000	EUR	810,429	0.17
BANCO SANTANDER 4.25 23-30 12/06A	1,500,000	EUR	1,556,462	0.32
BANCO SANTANDER ALL 4.125 24-34 22/04A	1,000,000	EUR	1,002,750	0.21
BANCO SANTANDER SA 0.2 21-28 11/02A	1,200,000	EUR	1,066,275	0.22

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 Euro Corporate Bonds

Anlageportfolio zum 30. Juni 2024

Bezeichnung	Anzahl	Wahrung	Marktwert (in EUR)	% des NV
BANCO SANTANDER SA 0.30 19-26 04/10A	300,000	EUR	279,593	0.06
BANCO SANTANDER SA 0.5 21-27 24/03A	100,000	EUR	94,627	0.02
BANCO SANTANDER SA 1.125 18-25 17/01A	400,000	EUR	394,220	0.08
BANCO SANTANDER SA 1.125 20-27 23/06A	400,000	EUR	373,799	0.08
BANCO SANTANDER SA 1.375 20-26 05/05A	300,000	EUR	290,232	0.06
BANCO SANTANDER SA 2.125 18-28 08/02A	400,000	EUR	377,342	0.08
BANCO SANTANDER SA 2.50 15-25 18/03A	300,000	EUR	296,899	0.06
BANKINTER SA 0.8750 19-26 08/07A	300,000	EUR	283,944	0.06
BBVA 3.375 22-27 20/09A	2,000,000	EUR	1,998,457	0.42
BBVA 4.375 22-29 14/10A	800,000	EUR	833,095	0.17
CAIXABANK SA 0.625 19-24 01/10A	300,000	EUR	297,659	0.06
CAIXABANK SA 0.75 19-26 09/07A	200,000	EUR	188,874	0.04
CAIXABANK SA 0.75 21-28 26/05A	300,000	EUR	276,705	0.06
CAIXABANK SA 1.125 19-26 27/03A	200,000	EUR	191,933	0.04
CAIXABANK SA 3.75 22-29 07/09A	500,000	EUR	507,413	0.11
CAIXABANK SA 4.375 23-33 29/11A	1,000,000	EUR	1,042,500	0.22
CRITERIA CAIXA SAU 0.875 20-27 28/10A	300,000	EUR	273,012	0.06
EDP SERVICIOS FINANC 4.375 23-32 04/04A	1,000,000	EUR	1,036,309	0.22
ENAGAS FIN REGS 1.25 15-25 06/02A	1,300,000	EUR	1,281,038	0.27
IBERDROLA FINANZAS 1.25 18-26 28/10A	200,000	EUR	191,290	0.04
IBERDROLA FINANZAS 3.125 22-28 22/11A	1,000,000	EUR	993,331	0.21
IBERDROLA FINANZAS 3.375 22-32 22/11A	500,000	EUR	494,915	0.10
NATURGY FINANCE 0.7500 19-29 28/11A	200,000	EUR	173,635	0.04
SANTANDER CONS FIN 0 21-26 23/02A	100,000	EUR	94,391	0.02
SANTANDER CONS FIN 0.00 19-22 06/05A	200,000	EUR	186,115	0.04
SANTANDER CONSUMER F 0.375 20-25 17/01A	400,000	EUR	392,881	0.08
TELEFONICA EMISIONES 1.447 18-27 22/01A	500,000	EUR	475,337	0.10
TELEFONICA EMISIONES 1.788 19-29 12/03A	200,000	EUR	186,136	0.04
TELEFONICA EMISIONES 1.807 20-32 21/05A	200,000	EUR	174,778	0.04
TELEFONICA EMISIONES 1.864 20-40 13/07A	300,000	EUR	223,707	0.05
TELEFONICA EMISIONES 1.93 16-31 17/10A	100,000	EUR	89,313	0.02
TELEFONICA EMISIONES 2.318 17-28 17/10A	100,000	EUR	95,607	0.02
TELEFONICA EMISIONES 2.592 22-31 25/05A	1,000,000	EUR	941,827	0.20
TELEFONICA EMISIONES 2.932 14-29 17/10A	300,000	EUR	293,545	0.06
			23,598,744	4.90
Schweden				
INVESTOR AB 0.375 20-35 29/10A	500,000	EUR	355,097	0.07
INVESTOR AB 1.5000 18-30 12/09A	200,000	EUR	179,980	0.04
MOLNLYCKE HOLDING AB 0.875 19-29 05/09AA	800,000	EUR	690,613	0.14
NORDEA BANK ABP 0.5 20-27 14/05A	1,000,000	EUR	927,530	0.19
SBAB BANK AB 0.5 20-25 13/05A	200,000	EUR	194,398	0.04
SKANDINAVISKA ENSKIL 0.625 19-29 12/11A	1,400,000	EUR	1,207,435	0.25
SVENSKA HANDELSBANKEN 0.010 20-27 02/12A	1,000,000	EUR	892,310	0.19
SVENSKA HANDELSBANKEN 0.05 19-26 03/09A	200,000	EUR	185,553	0.04
TELIA COMPANY AB 2.125 19-34 20/02A	400,000	EUR	356,470	0.07
			4,989,386	1.04
Schweiz				
UBS GROUP SA 0.25 20-28 05/11A	600,000	EUR	535,802	0.11
UBS GROUP SA 0.625 21-33 24/02A	1,000,000	EUR	762,908	0.16
			1,298,710	0.27
Grobritannien				
ANZ NEW ZEALAND INTL 0.375 19-29 17/09A	500,000	EUR	429,868	0.09
ASTRAZENECA PLC 1.25 16-28 12/05A	200,000	EUR	185,652	0.04
ASTRAZENECA PLC 3.75 23-32 03/03A	500,000	EUR	512,179	0.11
AVIVA PLC 3.375 15-45 04/12A	100,000	EUR	98,664	0.02
BARCLAYS 4.918 23-30 08/08A	2,000,000	EUR	2,082,077	0.43
BARCLAYS PLC 0.577 21-29 09/08A	400,000	EUR	350,485	0.07
BARCLAYS PLC 1.375 18-26 24/01A	300,000	EUR	295,787	0.06
BP CAPITAL MARKETS 1.00 14-26 25/09A	100,000	EUR	97,518	0.02

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

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



Cleome Index Euro Corporate Bonds

Anlageportfolio zum 30. Juni 2024

Bezeichnung	Anzahl	Wahrung	Marktwert (in EUR)	% des NV
BP CAPITAL MARKETS 1.231 19-31 08/05A	300,000	EUR	256,407	0.05
BP CAPITAL MARKETS 1.573 15-27 16/02A	100,000	EUR	95,724	0.02
BP CAPITAL MARKETS 1.637 17-29 26/06A	700,000	EUR	641,739	0.13
BP CAPITAL MARKETS 2.822 20-32 07/04A	250,000	EUR	235,287	0.05
BP CAPITAL MARKETS FL.R 20-XX 22/06A	300,000	EUR	293,610	0.06
BP CAPITAL MARKETS FL.R 20-XX 22/06A	800,000	EUR	767,423	0.16
BRITISH TEL 3.375 22-32 30/08A	2,000,000	EUR	1,946,322	0.40
COCA-COLA EUROPACIFIC 1.125 19-29 12/04A	628,000	EUR	563,627	0.12
COCA-COLA EUROPEAN 1.75 16-28 26/05A	100,000	EUR	93,992	0.02
CREDIT AGRICOLE LDN 1.875 16-26 20/12A	300,000	EUR	287,953	0.06
DIAGEO FINANCE PLC 2.375 14-26 20/05A	400,000	EUR	392,683	0.08
DS SMITH PLC 0.8750 19-26 12/09A	500,000	EUR	470,824	0.10
DS SMITH PLC 08750 1 4.375 23-27 27/07A	500,000	EUR	510,221	0.11
DS SMITH PLC 1.375 17-24 26/07A	400,000	EUR	399,322	0.08
GLAXOSMITHKLINE 1.2500 18-26 21/05A	300,000	EUR	287,880	0.06
GLAXOSMITHKLINE 1.375 17-29 12/09A	600,000	EUR	543,705	0.11
HSBC HOLDINGS PLC 3.125 16-28 07/06A/06A	400,000	EUR	389,400	0.08
INFORMA PLC 1.2500 19-28 22/04A	200,000	EUR	183,166	0.04
LLOYDS BANKING GROUP 1.50 17-27 12/09A	100,000	EUR	93,847	0.02
LONDON STOCK EX 1.7500 18-27 06/12A	500,000	EUR	473,607	0.10
LSE GROUP 1.75 17-29 19/09A	200,000	EUR	183,770	0.04
NATIONAL GRID ELEC 0.823 20-32 07/07A	300,000	EUR	238,379	0.05
NATIONAL GRID PLC 0.75 21-33 01/09A1/09A	500,000	EUR	377,460	0.08
NATIONAL GRID PLC 2.949 22-30 30/03A	300,000	EUR	286,557	0.06
NATIONAL GRID PLC 3.245 22-34 30/03A	500,000	EUR	468,542	0.10
NATIONWIDE BUILDING 2.00 22-27 28/04A	1,000,000	EUR	959,457	0.20
STANDARD CHARTERED 0.9 19-27 02/07A	1,800,000	EUR	1,702,415	0.35
UBS AG LONDON 0.5 21-31 31/03A	400,000	EUR	325,659	0.07
VODAFONE GROUP 0.90 19-26 24/11A	100,000	EUR	94,396	0.02
VODAFONE GROUP 1.50 17-27 24/07A	100,000	EUR	94,665	0.02
VODAFONE GROUP 2.875 17-37 20/11A	100,000	EUR	89,380	0.02
VODAFONE GROUP PLC 1.125 17-25 20/11A	100,000	EUR	96,918	0.02
VODAFONE GROUP PLC 1.60 16-31 29/07A	1,170,000	EUR	1,026,956	0.21
VODAFONE GROUP PLC 1.875 14-25 11/09A	100,000	EUR	98,156	0.02
VODAFONE GROUP PLC 2.2 16-26 28/02A	400,000	EUR	391,214	0.08
			19,412,893	4.03
Vereinigte Staaten von Amerika				
3M CO 1.50 16-31 02/06A	1,100,000	EUR	952,688	0.20
ABBVIE INC 0.75 19-27 18/11A	200,000	EUR	184,034	0.04
ABBVIE INC 1.25 19-31 18/11A	1,000,000	EUR	862,251	0.18
ABBVIE INC 2.125 16-28 17/11A	100,000	EUR	94,966	0.02
AMERICAN HONDA FINAN 0.3 21-28 09/07A	300,000	EUR	265,431	0.06
AMERICAN INTL GRP 1.875 17-27 21/06A	200,000	EUR	190,317	0.04
AMERICAN TOWER 0.45 21-27 21/05A	400,000	EUR	369,444	0.08
AMERICAN TOWER 0.5 20-28 10/09A	400,000	EUR	356,943	0.07
AMERICAN TOWER 4.125 23-27 16/05A	300,000	EUR	302,915	0.06
AMERICAN TOWER CORP 0.875 21-29 21/05A	800,000	EUR	695,632	0.14
AMERICAN TOWER CORP 1 20-32 10/09A	400,000	EUR	322,673	0.07
AMERICAN TOWER CORP 1.25 21-33 21/05A	300,000	EUR	238,367	0.05
AMGEN INC 2.00 16-26 25/02A	200,000	EUR	194,789	0.04
APPLE INC 1.375 17-29 24/05A	2,000,000	EUR	1,853,277	0.39
ARCHER DANIELS MIDLAND 1% 18-25 12/09A	100,000	EUR	96,837	0.02
AT T INC 1.80 18-26 05/09A	100,000	EUR	96,510	0.02
AT T INC 2.45 15-35 15/03S	100,000	EUR	87,313	0.02
AT&T INC 0.8000 19-30 04/03A	100,000	EUR	85,872	0.02
AT&T INC 1.6 20-28 27/05A	2,388,000	EUR	2,226,240	0.46
AT&T INC 2.60 14-29 17/12A	1,100,000	EUR	1,045,946	0.22
AT&T INC 3.375 14-34 15/03A	400,000	EUR	384,090	0.08

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 Euro Corporate Bonds

Anlageportfolio zum 30. Juni 2024

Bezeichnung	Anzahl	Wahrung	Marktwert (in EUR)	% des NV
AT&T INC 3.55 12-32 17/12A	200,000	EUR	197,362	0.04
BANK OF AMERICA CORP 1.102 21-32 24/05A	400,000	EUR	335,638	0.07
BANK OF AMERICA CORP 1.375 15-25 26/03A	200,000	EUR	196,618	0.04
BANK OF AMERICA CORP FL.R 22-33 27/04A	600,000	EUR	558,932	0.12
BAXTER INTL INC 1.3 17-25 30/05A	200,000	EUR	195,802	0.04
BAXTER INTL INC 1.3 19-29 15/05A	200,000	EUR	179,810	0.04
BOOKING 4.125 23-33 12/05A	800,000	EUR	823,186	0.17
BOOKING HOLDING 4.7500 22-34 15/11A	500,000	EUR	538,051	0.11
BOSTON SCIENTIF CORP 0.6250 19-27 01/12A	832,000	EUR	757,199	0.16
BRISTOL-MYERS SQUIBB 1.75 15-35 15/05A	100,000	EUR	85,609	0.02
CHUBB INA HOLDINGS 0.875 19-27 15/06A	200,000	EUR	185,768	0.04
CHUBB INA HOLDINGS 0.875 19-29 15/12A	400,000	EUR	350,064	0.07
CHUBB INA HOLDINGS 1.55 18-28 15/03A	100,000	EUR	93,357	0.02
CITIGROUP INC 1.50 16-28 26/10A	200,000	EUR	184,312	0.04
CITIGROUP INC 1.75 15-25 28/01A	100,000	EUR	98,876	0.02
COCA COLA 1.625 15-35 09/09A	300,000	EUR	252,655	0.05
COCA-COLA CO 0.5 21-33 09/03A	1,200,000	EUR	948,649	0.20
COCA-COLA CO 0.8 20-40 18/09A	300,000	EUR	201,953	0.04
COCA-COLA CO 1.875 14-26 22/09A	100,000	EUR	97,075	0.02
COCA-COLA EUROPEAN 1.875 15-30 18/03A	400,000	EUR	366,220	0.08
COMCAST CORP 0.25 20-27 20/05A	386,000	EUR	353,527	0.07
COMCAST CORP 0.7500 20-32 20/02A	500,000	EUR	408,474	0.08
DANAHER CORP 2.5 20-30 30/03A	1,000,000	EUR	952,781	0.20
DIGITAL EURO FINCO 1.125 19-28 09/10A	751,000	EUR	677,873	0.14
DIGITAL EURO FINCO 2.5 19-26 16/01A	500,000	EUR	488,601	0.10
DOW CHEMICAL CO 0.5 20-27 25/02A	200,000	EUR	184,259	0.04
DOW CHEMICAL CO 1.125 20-32 25/02A	900,000	EUR	744,874	0.15
ELI LILLY & CO 1.625 15-26 02/06A	200,000	EUR	193,692	0.04
ELI LILLY & CO 2.125 15-30 03/06A	3,000,000	EUR	2,822,241	0.59
EQUINIX INC 0.2500 21-27 15/03A	730,000	EUR	668,151	0.14
EQUINIX INC 1 21-33 10/03A	400,000	EUR	318,405	0.07
EXXON MOBIL CORP 0.524 20-28 26/06A	1,000,000	EUR	900,398	0.19
EXXON MOBIL CORP 0.835 20-32 26/06A	300,000	EUR	244,558	0.05
FEDEX CORP 0.95 21-33 04/05A	200,000	EUR	157,857	0.03
FEDEX CORP 1.30 19-31 05/08A	100,000	EUR	85,947	0.02
FIDELITY NATIONAL INF 0.625 19-25 03/12A	300,000	EUR	287,435	0.06
FIDELITY NATIONAL INF 1.1 17-24 15/07A	100,000	EUR	99,887	0.02
FIDELITY NATIONAL INF 1.5 19-27 21/05A	1,200,000	EUR	1,132,699	0.24
FIDELITY NATIONAL INF 2 19-30 21/05A	150,000	EUR	136,517	0.03
FISERV INC 1.125 19-27 01/07A	200,000	EUR	186,948	0.04
FISERV INC 1.625 19-30 01/07A	200,000	EUR	177,395	0.04
GENERAL ELECTRIC CO 0.875 17-25 17/05A	500,000	EUR	487,687	0.10
GENERAL ELECTRIC CO 4.125 05-35 19/09A	250,000	EUR	254,923	0.05
GENERAL MOTORS 0.6500 21-28 07/09A	200,000	EUR	177,028	0.04
GENERAL MOTORS FINAN 1.694 18-25 26/03A	200,000	EUR	196,951	0.04
GENERAL MOTORS FINAN 4.3 23-29 15/02A	800,000	EUR	814,201	0.17
IBM CORP 0.875 19-25 31/01A	393,000	EUR	386,718	0.08
IBM CORP 1.25 19-27 29/01A	300,000	EUR	284,948	0.06
IBM CORP 1.5 17-29 23/05A	100,000	EUR	91,782	0.02
IBM CORP 1.75 16-28 07/03A	100,000	EUR	94,437	0.02
IBM CORP 1.75 19-31 31/01A	300,000	EUR	270,274	0.06
IBM INTL BUSINESS MA 3.375 23-27 06/02A	1,000,000	EUR	999,165	0.21
IBM INTL BUSINESS MA 4.0 23-43 06/02A	1,300,000	EUR	1,286,521	0.27
ILLINOIS TOOL WORKS 2.125 15-30 22/05A	200,000	EUR	186,544	0.04
ILLINOIS TOOL WORKS 3.00 14-34 19/05A	100,000	EUR	94,841	0.02
INTERNATIONAL BUSINE 0.3 20-28 11/02A	772,000	EUR	693,169	0.14
JOHNSON CONTROLS INT 0.375 20-27 15/09A	355,000	EUR	321,703	0.07
JPMORGAN CHASE & CO 1.5 16-26 29/10A	200,000	EUR	191,796	0.04

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 Euro Corporate Bonds

Anlageportfolio zum 30. Juni 2024

Bezeichnung	Anzahl	Wahrung	Marktwert (in EUR)	% des NV
MANPOWERGROUP INC 1.75 18-26 22/06A	600,000	EUR	580,889	0.12
MC DONALD S 2.375 22-29 31/05A	1,000,000	EUR	952,058	0.20
MCDONALD S CORP 0.9 19-26 15/06A	200,000	EUR	190,530	0.04
MCDONALD'S CORP 0.2500 21-28 04/10A	500,000	EUR	438,904	0.09
MCDONALD'S CORP 1.875 15-27 26/05A	700,000	EUR	672,359	0.14
MCKESSON CORP 1.50 17-25 17/11A	200,000	EUR	194,391	0.04
MERCK & CO 2.50 14-34 15/10A	200,000	EUR	184,892	0.04
MERCK & CO INC 1.875 14-26 15/10A	100,000	EUR	96,635	0.02
MICROSOFT 2.625 13-33 02/05A	1,000,000	EUR	971,292	0.20
MMS USA INVESTMENTS 1.25 19-28 13/06A	1,000,000	EUR	916,981	0.19
MONDELEZ INTERNATION 0.75 21-33 17/03A	400,000	EUR	315,954	0.07
MONDELEZ INTERNATIONAL 1.625 15-27 08/03	200,000	EUR	190,795	0.04
MOODY'S CORPORATION 0.95 19-30 25/02A	480,000	EUR	418,201	0.09
MOODY'S CORPORATION 1.75 15-27 09/03A	1,000,000	EUR	960,784	0.20
MORGAN STANLEY 0.497 21-31 08/02A	900,000	EUR	750,456	0.16
MORGAN STANLEY 1.375 16-26 27/10	100,000	EUR	95,806	0.02
MORGAN STANLEY 1.75 15-25 30/01A	300,000	EUR	296,619	0.06
NASDAQ INC 0.9 21-33 30/07A	300,000	EUR	234,964	0.05
NASDAQ INC 1.7500 19-29 28/03A	400,000	EUR	370,120	0.08
NETFLIX INC 3.6250 19-30 15/06S	1,500,000	EUR	1,498,078	0.31
PEPSICO INC 0.5 20-28 06/05A	617,000	EUR	557,004	0.12
PEPSICO INC 0.75 21-33 14/10A	800,000	EUR	636,716	0.13
PEPSICO INC 1.125 19-31 18/03A	100,000	EUR	87,284	0.02
PPG INDUSTRIES 1.40 15-27 13/03A	1,200,000	EUR	1,139,897	0.24
PROCTER & GAMBLE 1.875 18-38 30/10A	500,000	EUR	417,410	0.09
PROLOGIS 3.00 14-26 02/06A	100,000	EUR	99,000	0.02
PROLOGIS EURO FINANCE 0.25 19-27 10/09A	200,000	EUR	179,818	0.04
PROLOGIS EURO FINANCE 0.375 20-28 06/02A	174,000	EUR	154,989	0.03
PROLOGIS EURO FINANCE 0.625 19-31 10/09A	300,000	EUR	241,068	0.05
PROLOGIS EURO FINANCE 1.875 18-29 05/01A	400,000	EUR	369,984	0.08
PROLOGIS EURO FINANCE L 1.5 19-49 10/09A	700,000	EUR	399,443	0.08
PROLOGIS INTL FDG II 1.625 20-32 17/06A	700,000	EUR	586,538	0.12
STRYKER CORP 0.75 19-29 01/03A	232,000	EUR	205,006	0.04
STRYKER CORP 1.00 19-31 03/12A	100,000	EUR	83,337	0.02
STRYKER CORP 2.125 18-27 30/11A	100,000	EUR	95,730	0.02
STRYKER CORP 2.6250 18-30 30/11A	100,000	EUR	94,875	0.02
SUMITOMO MITSUI FINL 1.143 17-27 14/06A	100,000	EUR	94,208	0.02
THERMO FISHER SCIEN 1.95 17-29 24/07A	100,000	EUR	93,700	0.02
THERMO FISHER SCIENT 0.50 19-28 01/03A	100,000	EUR	90,362	0.02
THERMO FISHER SCIENT 0.75 16-24 12/09A	200,000	EUR	198,736	0.04
THERMO FISHER SCIENT 0.875 19-31 01/10A	1,100,000	EUR	922,577	0.19
THERMO FISHER SCIENT 1.40 17-26 23/01A	112,000	EUR	108,271	0.02
THERMO FISHER SCIENT 1.45 17-27 16/03A	1,000,000	EUR	951,055	0.20
THERMO FISHER SCIENT 1.75 20-27 02/04A	400,000	EUR	382,800	0.08
THERMO FISHER SCIENT 1.875 19-49 01/10A	800,000	EUR	540,386	0.11
THERMO FISHER SCIENT 2.00 14-25 15/04A	400,000	EUR	394,526	0.08
TOYOTA MOTOR CREDIT 0.125 21-27 06/05A	800,000	EUR	719,243	0.15
TOYOTA MOTOR CREDIT 0.25 20-26 16/01A	200,000	EUR	187,855	0.04
TOYOTA MOTOR CREDIT 3.85 23-30 24/07A	1,000,000	EUR	1,016,781	0.21
UNITED PARCEL 1.00 16-28 28/11A	100,000	EUR	90,802	0.02
VERIZON COMM 1.125 21-35 19/09A	500,000	EUR	379,511	0.08
VERIZON COMM 2.625 14-31 01/12A31 01/12A	200,000	EUR	187,994	0.04
VERIZON COMMUNICATIO 0.375 21-29 22/03A	1,000,000	EUR	868,433	0.18
VERIZON COMMUNICATIO 1.85 20-40 18/05A	1,500,000	EUR	1,141,076	0.24
VERIZON COMMUNICATION 1.375 16-28 02/11A	100,000	EUR	92,082	0.02
VERIZON COMMUNICATION 1.50 19-39 19/09A	200,000	EUR	145,648	0.03
VERIZON COMMUNICATION 1.875 17-29 26/10A	500,000	EUR	461,382	0.10
VERIZON COMMUNICATION 3.25 14-26 17/02A	200,000	EUR	199,442	0.04

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 Euro Corporate Bonds

Anlageportfolio zum 30. Juni 2024

Bezeichnung	Anzahl	Wahrung	Marktwert (in EUR)	% des NV
VF CORP 0.25 20-28 25/02A	400,000	EUR	337,862	0.07
ZIMMER BIOMET HLDG 1.164 19-27 15/11A	100,000	EUR	92,228	0.02
ZIMMER BIOMET HOLDING 2.425 16-26 13/12A	500,000	EUR	487,592	0.10
			61,472,237	12.78
Anleihen gesamt			374,471,927	77.83
Variabel verzinsliche Anleihen				
Australien				
CWTH BANK AUSTRALIA FL.R 17-29 03/10A	100,000	EUR	99,370	0.02
			99,370	0.02
sterreich				
ERSTE GROUP BANK AG FL.R 20-31 08/09	400,000	EUR	377,865	0.08
OMV AG FL.R 20-XX 01/09A	800,000	EUR	730,201	0.15
VIENNA INSURANCE GRP FL.R 15-XX 02/03A	100,000	EUR	99,127	0.02
			1,207,193	0.25
Belgien				
AGEAS NV FL.R 19-XX 02/07A	100,000	EUR	94,128	0.02
AGEAS NV FL.R 20-51 24/11A	400,000	EUR	330,393	0.07
KBC GROUPE FL.R 22-28 21/01A	500,000	EUR	463,857	0.10
KBC GROUPE FL.R 23-33 25/04A	1,200,000	EUR	1,218,926	0.25
KBC GROUPE SA FL.R 19-29 03/12A	400,000	EUR	393,119	0.08
			2,500,423	0.52
Danemark				
DANSKE BANK A/S FL.R 19-30 12/02A	800,000	EUR	785,056	0.16
DANSKE BK FL.R 23-31 10/01A	1,000,000	EUR	1,022,626	0.21
ORSTED FL.R 19-XX 09/12A	400,000	EUR	359,348	0.07
			2,167,030	0.45
Frankreich				
AXA FL.R 22-43 10/03A	200,000	EUR	194,695	0.04
AXA FL.R 23-43 11/07A	1,000,000	EUR	1,056,759	0.22
AXA SA FL.R 14-XX 07/11A	100,000	EUR	99,574	0.02
AXA SA FL.R 16-47 06/07A	300,000	EUR	294,623	0.06
AXA SA FL.R 18-49 28/05A	500,000	EUR	476,580	0.10
BNP PARIBAS CARDIF FL.R 14-XX 25/11A	200,000	EUR	197,788	0.04
BNP PARIBAS SA FL.R 19-25 15/07A	400,000	EUR	399,510	0.08
BNP PARIBAS SA FL.R 19-26 04/06A	200,000	EUR	193,960	0.04
BNP PARIBAS SA FL.R 20-32 15/01A	2,900,000	EUR	2,669,669	0.55
BPCE ISSUER FL.R 24-36 26/02A	1,500,000	EUR	1,516,100	0.32
CNP ASSURANCES FL.R 14-45 05/06A	400,000	EUR	398,116	0.08
CNP ASSURANCES FL.R 14-XX 18/11A	200,000	EUR	199,210	0.04
CNP ASSURANCES FL.R 15-47 10/06A	500,000	EUR	500,857	0.10
CREDIT AGRICOLE FL.R 16-48 27/09A	100,000	EUR	100,575	0.02
CREDIT AGRICOLE SA FL.R 20-30 05/06A	500,000	EUR	487,316	0.10
CREDIT MUTUEL ARKEA FL.R 17-29 25/10A	100,000	EUR	99,127	0.02
CREDIT MUTUEL ARKEA FL.R 20-29 11/06A	200,000	EUR	180,656	0.04
DANONE SA FL.R 21-XX 16/12A	700,000	EUR	649,399	0.13
LA BANQUE POSTALE FL.R 20-26 17/06A	1,100,000	EUR	1,064,189	0.22
LA BANQUE POSTALE FL.R 21-32 02/02A	500,000	EUR	446,627	0.09
LA BANQUE POSTALE FL.R 22-28 09/02A	1,000,000	EUR	924,489	0.19
LA MONDIALE FL.R 14-XX 17/12A	500,000	EUR	499,877	0.10
ORANGE SA FL.R 14-26 01/10AA	400,000	EUR	405,321	0.08
ORANGE SA FL.R 20-XX 15/10A	500,000	EUR	446,096	0.09
ORANGE SA FL.R 23-XX 18/04A	1,500,000	EUR	1,555,603	0.32
SCOR FL.R 15-XX 05/06A	100,000	EUR	96,400	0.02
SCOR SE FL.R 16-48 27/05A	100,000	EUR	98,432	0.02
SOCIETE GENERALE SA FL.R 21-29 12/06A	200,000	EUR	174,530	0.04
SOGECAP FL.R 23-44 16/05A	500,000	EUR	534,362	0.11
SOGECAP SA FL.R 14-XX 18/02A14-49 29/12A	500,000	EUR	493,045	0.10
TOTALENERGIES SE FL.R 15-XX 26/02A	650,000	EUR	641,319	0.13

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

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



Cleome Index Euro Corporate Bonds

Anlageportfolio zum 30. Juni 2024

Bezeichnung	Anzahl	Wahrung	Marktwert (in EUR)	% des NV
TOTALENERGIES SE FL.R 16-XX 06/10A	400,000	EUR	391,406	0.08
TOTALENERGIES SE FL.R 20-XX 04/09A	300,000	EUR	259,239	0.05
TOTALENERGIES SE FL.R 21-XX 25/01A	300,000	EUR	248,252	0.05
VIGIE FL.R 19-XX 12/09A	1,100,000	EUR	1,033,818	0.21
			19,027,519	3.95
Deutschland				
ALLIANZ SE FL.R 19-49 25/09A	200,000	EUR	172,609	0.04
ALLIANZ SE FL.R 20-50 22/05A	1,900,000	EUR	1,690,604	0.35
COMMERZBANK AG FL.R 20-26 24/03A	100,000	EUR	97,729	0.02
DEUTSCHE BAHN FINANCE FL.R 19-XX 22/04A	1,000,000	EUR	975,495	0.20
DEUTSCHE BANK AG FL.R 20-25 19/11A	200,000	EUR	197,785	0.04
DEUTSCHE BANK AG FL.R 20-30 19/11A	100,000	EUR	87,978	0.02
DEUTSCHE BANK AG FL.R 22-32 24/06A	1,000,000	EUR	976,145	0.20
DEUTSCHE BANK FL. 22-30 05/09A	1,000,000	EUR	1,031,364	0.21
DEUTSCHE BOERSE AG FL.R 20-47 16/06A	1,000,000	EUR	923,513	0.19
DEUTSCHE BOERSE AG FL.R 22-48 23/06A	500,000	EUR	461,054	0.10
HANNOVER RUCKVERSICH FL.R 22-43 26/08A	300,000	EUR	333,274	0.07
MERCK KGAA FL.R 19-79 25/06A	100,000	EUR	98,895	0.02
MERCK KGAA FL.R 20-80 09/09A	500,000	EUR	473,204	0.10
MUNICH REINSURANCE FL.R 18-49 26/05A/05A	200,000	EUR	192,908	0.04
TALANX AG FL.R 17-47 05/12A	600,000	EUR	560,092	0.12
TALANX AG FL.R 21-42 01/12A	300,000	EUR	249,613	0.05
			8,522,262	1.77
Irland				
AIB GROUP PLC FL.R 22-28 04/04A	500,000	EUR	479,444	0.10
AIB GROUP PLC FL.R 23-29 23/07A	500,000	EUR	515,123	0.11
BANK OF IRELAND GROUP FL.R 23-29 13/11A	1,000,000	EUR	1,032,448	0.21
BANK OF IRELAND GRP FL.R 21-27 10/03A	500,000	EUR	470,499	0.10
BANK OF IRELAND GRP FL.R 22-26 05/06A	1,000,000	EUR	982,090	0.20
			3,479,604	0.72
Italien				
ASSICURAZ GENERALI FL.R 15-47 27/10A	800,000	EUR	827,038	0.17
ASSICURAZ GENERALI FL.R 16-48 08/06A	500,000	EUR	512,383	0.11
ENEL SPA FL.R 20-XX 10/03A	402,000	EUR	379,087	0.08
ENEL SPA FL.R 21-XX 08/09A	400,000	EUR	330,691	0.07
ENI SPA FL.R 20-XX 13/01A	577,000	EUR	561,553	0.12
ENI SPA FL.R 21-99 31/12A	1,083,000	EUR	1,004,437	0.21
MEDIOBANCA FL.R 22-29 07/02A	500,000	EUR	513,961	0.11
UNICREDIT SPA FL.R 19-29 23/09A	200,000	EUR	198,610	0.04
UNICREDIT SPA FL.R 20-27 22/07A	500,000	EUR	483,911	0.10
			4,811,671	1.00
Luxemburg				
HANNOVER RUECK SE FL.R 14-XX 26/06A	900,000	EUR	888,233	0.18
			888,233	0.18
Niederlande				
ASR NEDERLAND NV FL.R 15-45 29/09A	2,100,000	EUR	2,116,669	0.44
ASR NEDERLAND NV FL.R 22-43 07/12A	600,000	EUR	678,044	0.14
ASSICURAZ GENERALI FL.R 14-XX 21/11A	1,600,000	EUR	1,598,350	0.33
COOPERATIEVE RABOBANK FL.R 20-28 05/05A	900,000	EUR	834,735	0.17
COOPERATIEVE RABOBANK FL.R 22-32 30/11A	500,000	EUR	496,304	0.10
ELM BV FL.R 15-XX 01/09A	1,400,000	EUR	1,362,354	0.28
IBERDROLA INTL BV FL.R 19-XX 12/02A	200,000	EUR	198,644	0.04
IBERDROLA INTL BV FL.R 21-XX 09/02A/12A	500,000	EUR	434,565	0.09
ING GROEP NV FL.R 23-34 23/05A	800,000	EUR	846,888	0.18
ING GROEP NV FL.R 23-35 20/02A	500,000	EUR	511,846	0.11
ING GROUP NV FL.R 17-29 26/09A	500,000	EUR	496,533	0.10
ING GROUP NV FL.R 19-25 03/09A	400,000	EUR	397,363	0.08
ING GROUP NV FL.R 19-30 13/11A	300,000	EUR	285,688	0.06
ING GROUP NV FL.R 20-31 26/05A	1,100,000	EUR	1,058,206	0.22

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

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



Cleome Index Euro Corporate Bonds

Anlageportfolio zum 30. Juni 2024

Bezeichnung	Anzahl	Wahrung	Marktwert (in EUR)	% des NV
ING GROUP NV FL.R 22-33 14/11A	300,000	EUR	327,669	0.07
NN GROUP NV FL.R 14-XX 15/07A	700,000	EUR	699,646	0.15
NN GROUP NV FL.R 17-48 13/01A	100,000	EUR	100,965	0.02
VOLKSWAGEN INTL FIN FL.R 18-XX 27/06A	1,000,000	EUR	982,060	0.20
VOLKSWAGEN INTL FIN FL.R 20-XX 17/06A	1,000,000	EUR	931,982	0.19
			14,358,511	2.98
Norwegen				
DNB BANK ASA 4.625 22-33 28/02A	800,000	EUR	811,071	0.17
			811,071	0.17
Spanien				
BANCO BILBAO VIZCAYA FL.R 20-30 16/01A	500,000	EUR	489,715	0.10
BANCO DE SABADELL SA FL.R 19-25 07/11A	100,000	EUR	98,890	0.02
BANCO DE SABADELL SA FL.R 20-27 11/09A	100,000	EUR	95,958	0.02
BANKINTER SA FL.R 23-30 03/05A	1,000,000	EUR	1,027,379	0.21
CAIXABANK SA FL.R 18-30 17/04A	100,000	EUR	97,904	0.02
CAIXABANK SA FL.R 20-26 10/07A	900,000	EUR	873,069	0.18
CAIXABANK SA FL.R 20-26 18/11A11A	100,000	EUR	95,380	0.02
CAIXABANK SA FL.R 22-28 21/01A	1,000,000	EUR	931,008	0.19
CAIXABANK SA FL.R 22-33 23/02A	800,000	EUR	842,482	0.18
REDELA CORPORACTION 23-XX 07/08A	700,000	EUR	709,634	0.15
			5,261,419	1.09
Schweden				
SVENSKA HANDELSBANKEN 3.25 22-33 01/06A	500,000	EUR	482,239	0.10
SWEDBANK AB FL.R 22-32 23/08A	800,000	EUR	785,814	0.16
TELI CO FL.R 22-82 21/12A	1,200,000	EUR	1,202,376	0.25
			2,470,429	0.51
Schweiz				
UBS GROUP AG FL.R 22-30 15/06A	700,000	EUR	678,655	0.14
			678,655	0.14
Grobritannien				
AVIVA PLC FL.R 14-44 03/07A	100,000	EUR	100,000	0.02
BANCO DE SABADELL FL.R 22-28 10/11A	800,000	EUR	834,407	0.17
BARCLAYS PLC FL.R 21-32 12/05A	800,000	EUR	660,236	0.14
CREDIT SUISSE GROUP FL.R 22-32 02/04A	1,200,000	EUR	1,122,276	0.23
HSBC FL.R 23-32 10/03A	500,000	EUR	524,113	0.11
HSBC HOLDINGS PLC FL.R 20-26 13/11A	799,000	EUR	762,325	0.16
HSBC HOLDINGS PLC FL.R 20-31 13/11A	200,000	EUR	166,962	0.03
LLOYDS BANKING GROUP FL.R 22-30 24/08A	700,000	EUR	675,933	0.14
NATIONWIDE BUILDING FL.R 17-29 25/07A	400,000	EUR	399,443	0.08
NATIONWIDE BUILDING FL.R 18-26 08/03A	500,000	EUR	491,977	0.10
NATWEST GROUP FL.R 23-28 14/03A	1,300,000	EUR	1,334,838	0.28
NATWEST GROUP PLC FL.R 18-26 02/03A	200,000	EUR	197,228	0.04
NATWEST GROUP PLC FL.R 21-30 26/02A	800,000	EUR	695,417	0.14
STANDARD CHARTERED FL.R 20-28 16/01A	200,000	EUR	185,840	0.04
			8,150,995	1.69
Vereinigte Staaten von Amerika				
BANK OF AMERICA CORP FL.R 19-29 08/08A	300,000	EUR	266,319	0.06
BANK OF AMERICA CORP FL.R 20-31 26/10A	600,000	EUR	495,593	0.10
CITIGROUP INC FL.R 19-27 08/10A	400,000	EUR	373,098	0.08
CITIGROUP INC FL.R 20-26 06/05A	489,000	EUR	476,909	0.10
CITIGROUP INC FL.R 22-33 22/09A	300,000	EUR	304,709	0.06
JPM CHASE FL.R 24-34 21/03A	1,000,000	EUR	993,777	0.21
JPMORGAN CHASE & CO FL.R 19-32 04/11A	400,000	EUR	333,790	0.07
JPMORGAN CHASE CO FL.R 19-27 11/03A	224,000	EUR	214,595	0.04
JPMORGAN CHASE CO FL.R 19-31 25/07A	1,000,000	EUR	857,580	0.18
JPMORGAN CHASE CO FL.R 22-30 23/03A	1,000,000	EUR	926,104	0.19
MORGAN STANLEY CAPITAL FL.R 22-34 25/01A	2,400,000	EUR	2,604,886	0.54
MORGAN STANLEY FL.R 17-26 23/10A	200,000	EUR	194,112	0.04
MORGAN STANLEY FL.R 20-29 26/10A	166,000	EUR	145,111	0.03

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 Euro Corporate Bonds

Anlageportfolio zum 30. Juni 2024

Bezeichnung	Anzahl	Währung	Marktwert (in EUR)	% des NV
			8,186,583	1.70
Variabel verzinsliche Anleihen gesamt			82,620,968	17.17
Übertragbare Wertpapiere, die zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden gesamt			457,092,895	95.00
Sonstige übertragbare Wertpapiere				
Anleihen				
Niederlande				
MSD NETHERLANDS CAP 3.25 24-32 30/05A	1,000,000	EUR	991,369	0.21
			991,369	0.21
Anleihen gesamt			991,369	0.21
Sonstige übertragbare Wertpapiere, insgesamt			991,369	0.21
Anlageportfolio gesamt			458,084,264	95.21
Erwerbskosten			471,239,825	

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



Cleome Index Euro Corporate Bonds

Geografische und wirtschaftliche Zusammensetzung des Wertpapierbestandes zum 30. Juni 2024

Geografische Zusammensetzung (in % des Nettovermögens)

Frankreich	25.06
Vereinigte Staaten von Amerika	14.48
Niederlande	13.16
Deutschland	7.50
Spanien	6.00
Großbritannien	5.73
Italien	5.60
Luxemburg	3.34
Belgien	3.05
Irland	2.00
Schweden	1.55
Dänemark	1.51
Australien	1.39
Japan	1.31
Finnland	0.88
Österreich	0.86
Norwegen	0.50
Kaimaninseln	0.44
Schweiz	0.41
Kanada	0.37
Indonesien	0.06
Portugal	0.02
	95.21

Wirtschaftliche Zusammensetzung (in % des Nettovermögens)

Banken und andere Finanzinstitute	49.80
Versorger	5.43
Kommunikation	5.08
Versicherungen	4.63
Pharmazeutika	4.21
Immobilien	3.68
Erdöl	3.11
Tabak und alkoholische Getränke	2.38
Transport	2.33
Internet und Internet-Dienste	1.78
Chemikalien	1.55
Kraftfahrzeuge	1.33
Elektronik und Halbleiter	1.32
Baumaterialien	1.29
Büroausstattung und Computer	1.24
Lebensmittel und alkoholfreie Getränke	1.23
Grafik und Verlage	0.74
Elektrotechnik	0.73
Einzelhandel und Warenhäuser	0.70
Sonstige Konsumgüter	0.57
Hotels und Restaurants	0.47
Sonstige Dienstleistungen	0.47
Textilien und Bekleidung	0.31
Verpackungsindustrie	0.29
Maschinen- und Apparatebau	0.26
Gesundheitswesen	0.20
Luft- und Raumfahrt	0.08
	95.21

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



Cleome Index Euro Government Bonds

Anlageportfolio zum 30. Juni 2024

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 20/10U	850,000	EUR	504,934	0.19
AUSTRIA 0.00 21-25 20/04U	500,000	EUR	486,801	0.18
AUSTRIA 0.5 19-29 20/02A	1,200,000	EUR	1,077,683	0.41
AUSTRIA 0.50 17-27 20/04A	600,000	EUR	560,692	0.21
AUSTRIA 0.75 16-26 20/10A	850,000	EUR	808,417	0.30
AUSTRIA 0.9 22-32 20/02A	1,500,000	EUR	1,291,292	0.49
AUSTRIA 1.20 15-25 20/10A	500,000	EUR	487,132	0.18
AUSTRIA 1.50 16-47 20/02A	1,000,000	EUR	719,159	0.27
AUSTRIA 2.10 17-17 20/09A	600,000	EUR	433,318	0.16
AUSTRIA 2.40 13-34 23/05A	1,000,000	EUR	945,933	0.36
AUSTRIA 3.80 12-62 26/01A	400,000	EUR	442,883	0.17
AUSTRIA 4.85 09-26 15/03A	500,000	EUR	513,907	0.19
AUSTRIA 6.25 97-27 15/07A	1,000,000	EUR	1,093,626	0.41
AUSTRIA GOVERNMENT B 3.45 23-30 20/10A	1,000,000	EUR	1,029,674	0.39
			10,395,451	3.91
Belgien				
BELGIUM 0.00 21-31 22/10U	1,000,000	EUR	809,061	0.30
BELGIUM 0.0000 20-27 22/10U	1,000,000	EUR	911,495	0.34
BELGIUM 0.1000 20-30 22/06A	1,500,000	EUR	1,275,272	0.48
BELGIUM 0.35 22-32 22/06A	1,050,000	EUR	855,009	0.32
BELGIUM 0.80 15-25 22/06A	1,750,000	EUR	1,706,906	0.64
BELGIUM 0.80 17-27 22/06A	1,000,000	EUR	942,508	0.35
BELGIUM 0.80 18-28 22/06A	1,050,000	EUR	971,677	0.37
BELGIUM 1.60 16-47 22/06A	1,100,000	EUR	772,178	0.29
BELGIUM 1.90 15-38 22/06A	1,000,000	EUR	842,794	0.32
BELGIUM 2.25 17-57 22/06A	1,100,000	EUR	820,737	0.31
BELGIUM 3 23-33 22/06A	1,100,000	EUR	1,097,287	0.41
BELGIUM 3.00 14-34 22/06A	1,500,000	EUR	1,486,788	0.56
BELGIUM 3.45 23-43 22/06A	300,000	EUR	298,777	0.11
BELGIUM 3.75 13-45 22/06A	1,000,000	EUR	1,037,859	0.39
BELGIUM 5.00 04-35 28/03A	850,000	EUR	989,666	0.37
			14,818,014	5.57
Finnland				
FINLAND 0.000 20-30 15/09U	650,000	EUR	544,157	0.20
FINLAND 0.125 20-36 15/04A	450,000	EUR	317,341	0.12
FINLAND 0.5 18-28 15/09A	550,000	EUR	498,711	0.19
FINLAND 0.50 16-26 15/04A	1,000,000	EUR	956,093	0.36
FINLAND 0.50 17-27 15/09A	250,000	EUR	232,268	0.09
FINLAND 0.75 15-31 15/04A	1,000,000	EUR	868,073	0.33
FINLAND 0.875 15-25 15/09A	500,000	EUR	486,273	0.18
FINLAND 1.375 17-47 15/04A	500,000	EUR	352,041	0.13
FINLAND 1.5000 22-32 15/09A	500,000	EUR	446,593	0.17
FINLAND 2.625 12-42 04/07A	500,000	EUR	457,373	0.17
			5,158,923	1.94
Frankreich				
FRANCE (GOVT OF 2.5000 23-27 24/09A	1,000,000	EUR	983,380	0.37
FRANCE 0.00 19-25 25/03U	1,500,000	EUR	1,462,774	0.55
FRANCE 0.00 19-29 25/11U	1,900,000	EUR	1,618,654	0.61
FRANCE 0.00 20-26 25/02U	1,700,000	EUR	1,614,734	0.61
FRANCE 0.00 21-27 25/02U	1,750,000	EUR	1,615,582	0.61
FRANCE 0.00 21-31 25/11U	1,600,000	EUR	1,277,072	0.48
FRANCE 0.00 22-25 25/02U	1,500,000	EUR	1,466,738	0.55
FRANCE 0.00 22-32 25/05U	1,500,000	EUR	1,176,764	0.44

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



Cleome Index Euro Government Bonds

Anlageportfolio zum 30. Juni 2024

Bezeichnung	Anzahl	Wahrung	Marktwert (in EUR)	% des NV
FRANCE 0.0000 20-30 25/11U	2,000,000	EUR	1,650,236	0.62
FRANCE 0.25 15-26 25/11A	1,500,000	EUR	1,403,076	0.53
FRANCE 0.5 18-29 25/05A	2,400,000	EUR	2,128,104	0.80
FRANCE 0.5 20-44 25/06A	1,000,000	EUR	566,696	0.21
FRANCE 0.5 20-72 25/05A	750,000	EUR	262,622	0.10
FRANCE 0.50 14-25 25/05A	1,700,000	EUR	1,657,135	0.62
FRANCE 0.50 15-26 25/05A	2,000,000	EUR	1,904,784	0.72
FRANCE 0.50 20-40 25/05A	1,000,000	EUR	636,758	0.24
FRANCE 0.75 17-28 25/05A	2,500,000	EUR	2,295,279	0.86
FRANCE 0.75 17-28 25/11A	1,750,000	EUR	1,589,197	0.60
FRANCE 0.75 19-52 25/05A	1,000,000	EUR	500,309	0.19
FRANCE 0.75 21-53 25/05A	1,450,000	EUR	707,332	0.27
FRANCE 0.7500 22-28 25/02A	2,200,000	EUR	2,029,590	0.76
FRANCE 1 14-25 25/11A	1,500,000	EUR	1,454,855	0.55
FRANCE 1.00 16-27 25/05A	2,100,000	EUR	1,982,739	0.75
FRANCE 1.25 15-36 25/05A	1,500,000	EUR	1,191,789	0.45
FRANCE 1.25 17-34 25/04A	1,650,000	EUR	1,372,914	0.52
FRANCE 1.25 21-38 25/05A	1,500,000	EUR	1,136,034	0.43
FRANCE 1.50 15-31 25/05A	2,000,000	EUR	1,808,215	0.68
FRANCE 1.50 18-50 25/05A	1,500,000	EUR	965,507	0.36
FRANCE 1.75 15-66 25/05A	300,000	EUR	184,471	0.07
FRANCE 1.75 16-39 25/06A	800,000	EUR	641,403	0.24
FRANCE 2 21-32 25/11A	1,600,000	EUR	1,464,421	0.55
FRANCE 2.00 17-48 25/05A	700,000	EUR	518,498	0.20
FRANCE 2.5 22-43 25/05A	800,000	EUR	679,136	0.26
FRANCE 2.5 23-26 24/09A	1,600,000	EUR	1,578,898	0.59
FRANCE 2.50 13-30 25/05A	2,000,000	EUR	1,943,023	0.73
FRANCE 2.75 11-27 25/10A	1,300,000	EUR	1,287,920	0.48
FRANCE 2.75 23-29 25/02A	2,500,000	EUR	2,468,813	0.93
FRANCE 3 22-54 25/05A	700,000	EUR	609,412	0.23
FRANCE 3.0 23-33 25/05A	1,800,000	EUR	1,772,097	0.67
FRANCE 3.25 12-45 25/05A	1,200,000	EUR	1,138,247	0.43
FRANCE 3.50 10-26 25/04A	750,000	EUR	754,762	0.28
FRANCE 4 05-38 25/10A	1,000,000	EUR	1,059,276	0.40
FRANCE 4.00 04-55 25/04A	400,000	EUR	420,553	0.16
FRANCE 4.00 09-60 25/04A	700,000	EUR	742,356	0.28
FRANCE 4.50 09-41 25/04A	1,000,000	EUR	1,120,094	0.42
FRANCE 4.75 03-35 25/04A	1,600,000	EUR	1,805,745	0.68
FRANCE 5.5 97-29 25/04A	1,500,000	EUR	1,661,151	0.62
FRANCE 5.75 00-32 25/10A	1,600,000	EUR	1,896,297	0.71
FRANCE 6.00 94-25 25/10A	650,000	EUR	672,404	0.25
FRANCE GOVERNMENT BO 2.75 24-30 25/02A	1,000,000	EUR	984,115	0.37
FRANCE GOVERNMENT BO 3.25 24-55 25/05A	550,000	EUR	500,406	0.19
FRANCE GOVERNMENT BO 3.5 23-33 25/11A	1,450,000	EUR	1,479,732	0.56
FRANCE GOVT BD OAT 3.00 24-49 25/06A	900,000	EUR	807,230	0.30
ITALY 2.50 22-32 01/12S	2,000,000	EUR	1,808,535	0.68
			68,457,864	25.75
Deutschland				
GERMANY 0.00 16-26 15/08U	2,000,000	EUR	1,889,657	0.71
GERMANY 0.00 19-29 15/08U	2,300,000	EUR	2,035,981	0.77
GERMANY 0.00 19-50 15/08U	1,400,000	EUR	708,773	0.27
GERMANY 0.00 20-25 10/10U	2,500,000	EUR	2,407,221	0.91
GERMANY 0.00 20-30 15/02U	2,000,000	EUR	1,750,288	0.66
GERMANY 0.00 20-30 15/08U	2,000,000	EUR	1,731,785	0.65
GERMANY 0.00 20-35 15/05U	1,350,000	EUR	1,028,213	0.39
GERMANY 0.00 20-49 15/11U	2,300,000	EUR	2,113,790	0.80
GERMANY 0.00 21-28 15/11U	1,700,000	EUR	1,529,783	0.58
GERMANY 0.00 21-31 15/02U	2,150,000	EUR	1,839,682	0.69

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 Euro Government Bonds

Anlageportfolio zum 30. Juni 2024

Bezeichnung	Anzahl	Wahrung	Marktwert (in EUR)	% des NV
GERMANY 0.00 21-31 15/08U	2,000,000	EUR	1,692,672	0.64
GERMANY 0.00 21-50 15/08U	1,100,000	EUR	557,911	0.21
GERMANY 0.00 21-52 15/08A	1,100,000	EUR	530,218	0.20
GERMANY 0.25 17-27 15/02A	1,000,000	EUR	941,261	0.35
GERMANY 0.50 16-26 15/02A	2,500,000	EUR	2,407,751	0.91
GERMANY 1 22-38 15/05A	550,000	EUR	445,649	0.17
GERMANY 1.00 15-25 15/08A	3,000,000	EUR	2,931,420	1.10
GERMANY 1.25 17-48 15/08A	1,000,000	EUR	748,821	0.28
GERMANY 1.70 22-32 15/08A	2,100,000	EUR	1,990,583	0.75
GERMANY 1.8 22-53 15/08A	500,000	EUR	412,258	0.16
GERMANY 1.8 23-53 15/08A	700,000	EUR	578,101	0.22
GERMANY 2.20 23-28 13/04A	1,000,000	EUR	988,541	0.37
GERMANY 2.4 23-28 19/10A	1,800,000	EUR	1,792,947	0.67
GERMANY 2.5 23-25 13/03A	2,500,000	EUR	2,486,000	0.94
GERMANY 2.50 12-44 04/07A	1,750,000	EUR	1,694,641	0.64
GERMANY 2.50 14-46 15/08A	1,400,000	EUR	1,353,841	0.51
GERMANY 2.6 23-33 15/08A	3,500,000	EUR	3,539,351	1.33
GERMANY 3.25 10-42 04/07A	550,000	EUR	592,185	0.22
GERMANY 4.00 05-37 04/01A	1,100,000	EUR	1,262,023	0.47
GERMANY 4.25 07-39 04/07A	950,000	EUR	1,133,380	0.43
GERMANY 4.75 08-40 04/07A	1,100,000	EUR	1,393,538	0.52
GERMANY 4.75 98-28 04/07A	1,800,000	EUR	1,953,833	0.73
GERMANY 6.5 97-27 04/07A	2,000,000	EUR	2,222,363	0.84
			50,684,461	19.06
Irland				
IRELAND 0.00 21-31 18/10U	850,000	EUR	694,094	0.26
IRELAND 0.20 20-27 15/05A	400,000	EUR	371,570	0.14
IRELAND 0.20 20-30 18/10A	250,000	EUR	213,007	0.08
IRELAND 0.9 18-28 15/02A	200,000	EUR	186,545	0.07
IRELAND 1.00 16-26 15/05A	450,000	EUR	434,244	0.16
IRELAND 1.1 19-29 15/05A	500,000	EUR	462,833	0.17
IRELAND 1.30 18-33 15/05A	300,000	EUR	263,701	0.10
IRELAND 1.35 18-31 18/03A	250,000	EUR	228,273	0.09
IRELAND 1.50 19-50 15/05A	400,000	EUR	279,650	0.11
IRELAND 1.70 17-37 15/05A	850,000	EUR	726,642	0.27
IRELAND 2.00 15-45 18/02A	300,000	EUR	246,245	0.09
IRELAND 2.40 14-30 15/05A	400,000	EUR	391,974	0.15
IRELAND 5.40 09-25 13/03A	200,000	EUR	202,583	0.08
			4,701,361	1.77
Italien				
BUONI POLIENNAL 1.50 21-45 30/04S	1,350,000	EUR	825,941	0.31
ITALY 0.00 21-26 01/08U	1,400,000	EUR	1,305,574	0.49
ITALY 0.60 21-31 01/08S	2,000,000	EUR	1,614,817	0.61
ITALY 0.85 19-27 15/01S	2,000,000	EUR	1,879,077	0.71
ITALY 0.90 20-31 01/04S	600,000	EUR	500,565	0.19
ITALY 0.95 20-30 01/08S	3,300,000	EUR	2,817,824	1.06
ITALY 1.45 20-36 01/03S	1,750,000	EUR	1,321,624	0.50
ITALY 1.50 15-25 01/06S	2,000,000	EUR	1,963,549	0.74
ITALY 1.60 16-26 01/06S	3,000,000	EUR	2,901,697	1.09
ITALY 1.65 15-32 01/03S	3,000,000	EUR	2,582,894	0.97
ITALY 2.05 17-27 01/08S	1,400,000	EUR	1,346,299	0.51
ITALY 2.15 22-52 01/09S	1,600,000	EUR	1,018,979	0.38
ITALY 2.20 17-27 01/06S	1,500,000	EUR	1,452,155	0.55
ITALY 2.8 22-29 15/06S	3,000,000	EUR	2,901,151	1.09
ITALY 2.80 16-67 01/03S	1,750,000	EUR	1,229,372	0.46
ITALY 3.4 22-28 01/04S	2,500,000	EUR	2,497,413	0.94
ITALY 3.45 17-48 01/03S	2,100,000	EUR	1,797,511	0.68
ITALY 3.50 14-30 01/03S	2,000,000	EUR	1,992,743	0.75
ITALY 4.00 05-37 01/02S	2,500,000	EUR	2,468,797	0.93

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

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



Cleome Index Euro Government Bonds

Anlageportfolio zum 30. Juni 2024

Bezeichnung	Anzahl	Wahrung	Marktwert (in EUR)	% des NV
ITALY 4.75 13-28 01/09S	3,000,000	EUR	3,148,777	1.18
ITALY 5 07-39 01/08S	2,000,000	EUR	2,141,348	0.81
ITALY 5.00 03-34 01/08S	1,600,000	EUR	1,729,722	0.65
ITALY 5.00 09-40 01/09S	2,300,000	EUR	2,461,417	0.93
ITALY 5.25 98-29 01/11S	2,250,000	EUR	2,437,253	0.92
ITALY 5.75 02-33 01/02S	1,500,000	EUR	1,699,176	0.64
ITALY 7.25 96-26 01/11S	2,000,000	EUR	2,172,870	0.82
ITALY BTP 6.50 97-27 01/11S	2,500,000	EUR	2,744,803	1.03
			52,953,348	19.92
Niederlande				
NETHERLANDS 0.00 20-30 15/07U	1,150,000	EUR	979,438	0.37
NETHERLANDS 0.25 15-25 15/07A	1,000,000	EUR	970,754	0.37
NETHERLANDS 0.25 19-29 15/07A	400,000	EUR	354,949	0.13
NETHERLANDS 0.5 22-32 15/07A	1,100,000	EUR	923,629	0.35
NETHERLANDS 0.50 16-26 15/07A	1,450,000	EUR	1,384,440	0.52
NETHERLANDS 0.50 19-40 15/01A	1,400,000	EUR	981,860	0.37
NETHERLANDS 0.75 17-27 15/07A	1,200,000	EUR	1,132,134	0.43
NETHERLANDS 0.75 18-28 15/07A	1,300,000	EUR	1,204,651	0.45
NETHERLANDS 2 22-54 15/01A	500,000	EUR	411,317	0.15
NETHERLANDS 2.5 23-33 15/07A	400,000	EUR	391,174	0.15
NETHERLANDS 2.50 12-33 15/01A	550,000	EUR	540,101	0.20
NETHERLANDS 2.75 14-47 15/01A	1,500,000	EUR	1,461,223	0.55
NETHERLANDS 4.00 05-37 15/01A	1,400,000	EUR	1,559,910	0.59
NETHERLANDS GOVERNME 3.25 23-44 15/01A	250,000	EUR	261,019	0.10
			12,556,599	4.72
Portugal				
OBRIGACOES DO T 1.1500 22-42 11/04A	600,000	EUR	411,317	0.15
PORTUGAL 0.30 21-31 17/10A	600,000	EUR	497,491	0.19
PORTUGAL 2.125 18-28 17/10A	1,000,000	EUR	974,296	0.37
PORTUGAL 2.25 18-34 18/04A	350,000	EUR	323,194	0.12
PORTUGAL 2.875 15-25 15/10A	500,000	EUR	498,316	0.19
PORTUGAL 3.875 14-30 15/02A	850,000	EUR	894,487	0.34
PORTUGAL 4.10 06-37 15/04A	500,000	EUR	536,265	0.20
PORTUGAL 4.10 15-45 15/02A	500,000	EUR	530,376	0.20
PORTUGAL 4.125 17-27 14/04A	300,000	EUR	310,243	0.12
			4,975,985	1.87
Spanien				
SPAIN 0.5 21-31 31/10A	2,000,000	EUR	1,657,808	0.62
SPAIN 0.60 19-29 31/10A	1,900,000	EUR	1,674,467	0.63
SPAIN 0.8 22-29 30/07A	1,800,000	EUR	1,611,852	0.61
SPAIN 0.80 20-27 30/07A	1,200,000	EUR	1,121,713	0.42
SPAIN 1.00 20-50 31/10A	1,000,000	EUR	531,532	0.20
SPAIN 1.40 18-28 30/07A	1,700,000	EUR	1,596,480	0.60
SPAIN 1.45 17-27 31/10A	1,700,000	EUR	1,616,545	0.61
SPAIN 1.45 19-29 30/04A	1,950,000	EUR	1,814,374	0.68
SPAIN 1.50 17-27 30/04A	2,500,000	EUR	2,396,567	0.90
SPAIN 1.60 5-25 30/04A	1,000,000	EUR	985,255	0.37
SPAIN 1.85 19-35 30/07A	1,100,000	EUR	940,103	0.35
SPAIN 1.95 15-30 30/07A	2,500,000	EUR	2,347,582	0.88
SPAIN 2.15 15-25 31/10A	1,900,000	EUR	1,873,207	0.70
SPAIN 2.55 22-32 31/10A	3,000,000	EUR	2,851,173	1.07
SPAIN 2.8 23-26 31/05A	1,000,000	EUR	993,413	0.37
SPAIN 2.90 16-46 31/10A	1,200,000	EUR	1,029,850	0.39
SPAIN 3.15 23-33 30/04A	2,500,000	EUR	2,474,418	0.93
SPAIN 3.45 16-66 30/07A	1,500,000	EUR	1,330,403	0.50
SPAIN 3.9 23-39 30/07A	1,550,000	EUR	1,582,149	0.60
SPAIN 4.20 05-37 31/01A	1,000,000	EUR	1,066,695	0.40
SPAIN 4.70 09-41 30/07A	2,000,000	EUR	2,235,287	0.84
SPAIN 5.15 13-28 31/10A	1,000,000	EUR	1,085,363	0.41

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 Euro Government Bonds

Anlageportfolio zum 30. Juni 2024

Bezeichnung	Anzahl	Währung	Marktwert (in EUR)	% des NV
SPAIN 5.15 13-44 31/10A	800,000	EUR	946,490	0.36
SPAIN 5.90 11-26 30/07A	2,500,000	EUR	2,637,143	0.99
			38,399,869	14.44
Anleihen gesamt			263,101,875	98.96
Übertragbare Wertpapiere, die zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden gesamt			263,101,875	98.96
Anlageportfolio gesamt			263,101,875	98.96
Erwerbskosten			281,197,710	



Cleome Index Euro Government Bonds

Geografische und wirtschaftliche Zusammensetzung des Wertpapierbestandes zum 30. Juni 2024

Geografische Zusammensetzung (in % des Nettovermögens)

Frankreich	25.75
Italien	19.92
Deutschland	19.06
Spanien	14.44
Belgien	5.57
Niederlande	4.72
Österreich	3.91
Finnland	1.94
Portugal	1.87
Irland	1.77
	98.96

Wirtschaftliche Zusammensetzung (in % des Nettovermögens)

Anleihen von Staaten, Provinzen und Gemeinden	98.71
Anlagefonds	0.15
Banken und andere Finanzinstitute	0.10
	98.96



Cleome Index Euro Long Term Bonds

Anlageportfolio zum 30. Juni 2024

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				
Anleihen				
Österreich				
AUSTRIA 0.00 20-40 20/10U	20,000	EUR	11,881	0.19
AUSTRIA 0.25 21-36 20/10A	30,000	EUR	21,193	0.33
AUSTRIA 0.75 20-51 20/03A	45,000	EUR	25,225	0.40
AUSTRIA 2.10 17-17 20/09A	45,000	EUR	32,499	0.51
AUSTRIA 3.15 12-44 20/06A	40,000	EUR	39,183	0.62
AUSTRIA 3.80 12-62 26/01A	60,000	EUR	66,433	1.05
AUSTRIA 4.15 06-37 15/03A	45,000	EUR	49,511	0.78
			245,925	3.88
Belgien				
BELGIUM 1.4 22-53 22/06A	50,000	EUR	30,628	0.48
BELGIUM 1.60 16-47 22/06A	50,000	EUR	35,098	0.55
BELGIUM 1.90 15-38 22/06A	75,000	EUR	63,210	1.00
BELGIUM 2.15 16-66 22/06A	80,000	EUR	57,488	0.91
BELGIUM 2.75 22-39 22/04A	30,000	EUR	27,911	0.44
BELGIUM 2.8500 24-34 22/10A	30,000	EUR	29,248	0.46
BELGIUM 3.5 24-55 22/06A	45,000	EUR	43,769	0.69
BELGIUM 3.75 13-45 22/06A	45,000	EUR	46,704	0.74
BELGIUM 4.25 10-41 28/03A	70,000	EUR	77,337	1.22
BELGIUM 5.00 04-35 28/03A	100,000	EUR	116,431	1.84
			527,824	8.32
Finnland				
FINLAND 0.125 20-36 15/04A	85,000	EUR	59,942	0.95
FINLAND 0.125 21-52 15/04A	30,000	EUR	13,437	0.21
FINLAND 1.375 17-47 15/04A	25,000	EUR	17,602	0.28
FINLAND 2.625 12-42 04/07A	20,000	EUR	18,295	0.29
			109,276	1.72
Frankreich				
FRANCE 0.5 20-44 25/06A	110,000	EUR	62,337	0.98
FRANCE 0.75 19-52 25/05A	120,000	EUR	60,037	0.95
FRANCE 0.75 21-53 25/05A	110,000	EUR	53,660	0.85
FRANCE 1.25 21-38 25/05A	165,000	EUR	124,964	1.97
FRANCE 1.50 18-50 25/05A	125,000	EUR	80,459	1.27
FRANCE 1.75 15-66 25/05A	100,000	EUR	61,490	0.97
FRANCE 1.75 16-39 25/06A	250,000	EUR	200,438	3.16
FRANCE 2.00 17-48 25/05A	110,000	EUR	81,478	1.28
FRANCE 3.25 12-45 25/05A	110,000	EUR	104,339	1.64
FRANCE 4.00 04-55 25/04A	100,000	EUR	105,138	1.66
FRANCE 4.00 09-60 25/04A	120,000	EUR	127,261	2.01
FRANCE 4.50 09-41 25/04A	220,000	EUR	246,420	3.88
FRANCE 4.75 03-35 25/04A	145,000	EUR	163,646	2.58
			1,471,667	23.20
Deutschland				
GERMANY 0.00 19-50 15/08U	135,000	EUR	68,346	1.08
GERMANY 0.00 20-35 15/05U	80,000	EUR	60,931	0.96
GERMANY 0.00 21-36 15/05U	80,000	EUR	59,147	0.93
GERMANY 0.00 21-50 15/08U	60,000	EUR	30,432	0.48
GERMANY 0.00 21-52 15/08A	95,000	EUR	45,792	0.72
GERMANY 1 22-38 15/05A	70,000	EUR	56,719	0.89
GERMANY 1.25 17-48 15/08A	135,000	EUR	101,091	1.59
GERMANY 1.8 22-53 15/08A	85,000	EUR	70,084	1.10
GERMANY 1.8 23-53 15/08A	30,000	EUR	24,776	0.39
GERMANY 2.50 12-44 04/07A	120,000	EUR	116,204	1.83
GERMANY 2.50 14-46 15/08A	110,000	EUR	106,373	1.68
GERMANY 3.25 10-42 04/07A	50,000	EUR	53,835	0.85

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 Euro Long Term Bonds

Anlageportfolio zum 30. Juni 2024

Bezeichnung	Anzahl	Wahrung	Marktwert (in EUR)	% des NV
GERMANY 4.00 05-37 04/01A	65,000	EUR	74,574	1.18
GERMANY 4.25 07-39 04/07A	60,000	EUR	71,582	1.13
GERMANY 4.75 03-34 04/07A	65,000	EUR	77,834	1.23
GERMANY 4.75 08-40 04/07A	50,000	EUR	63,343	1.00
REPUBLIQUE FEDERALE 2.5 24-54 15/08A	15,000	EUR	14,435	0.23
			1,095,498	17.27
Irland				
IRELAND 1.50 19-50 15/05A	25,000	EUR	17,478	0.28
IRELAND 1.70 17-37 15/05A	40,000	EUR	34,195	0.54
IRELAND 2.00 15-45 18/02A	45,000	EUR	36,937	0.58
IRELAND 2.6 24-34 18/10A	20,000	EUR	19,400	0.31
IRELAND 3 23-43 18/10A	20,000	EUR	19,443	0.31
			127,453	2.01
Italien				
BUONI POLIENNAL 1.50 21-45 30/04S	70,000	EUR	42,827	0.68
BUONI POLIENNAL 2.15 21-72 01/03S	45,000	EUR	26,220	0.41
BUONI POLIENNAL 3.8500 18-49 01/09S	160,000	EUR	144,804	2.28
ITALY 1.80 20-41 01/03S	320,000	EUR	224,096	3.53
ITALY 2.80 16-67 01/03S	120,000	EUR	84,300	1.33
ITALY 3.25 14-46 01/09S	60,000	EUR	50,163	0.79
ITALY 3.45 17-48 01/03S	100,000	EUR	85,596	1.35
ITALY 4 22-35 30/04S	185,000	EUR	184,216	2.90
ITALY 4.00 05-37 01/02S	190,000	EUR	187,629	2.96
ITALY 5 07-39 01/08S	250,000	EUR	267,669	4.22
			1,297,520	20.46
Niederlande				
NETHERLANDS 0.00 20-52 15/01U	45,000	EUR	20,955	0.33
NETHERLANDS 0.50 19-40 15/01A	100,000	EUR	70,133	1.11
NETHERLANDS 2 22-54 15/01A	40,000	EUR	32,905	0.52
NETHERLANDS 2.75 14-47 15/01A	85,000	EUR	82,803	1.31
NETHERLANDS 4.00 05-37 15/01A	110,000	EUR	122,564	1.93
NETHERLANDS GOVERNME 3.25 23-44 15/01A	60,000	EUR	62,644	0.99
			392,004	6.18
Portugal				
OBRIGACOES DO T 1.1500 22-42 11/04A	25,000	EUR	17,138	0.27
PORTUGAL 1.00 21-52 12/04A	60,000	EUR	32,162	0.51
PORTUGAL 4.10 06-37 15/04A	70,000	EUR	75,077	1.18
			124,377	1.96
Spanien				
SPAIN 1 21-42 30/07A	65,000	EUR	41,651	0.66
SPAIN 1.9 22-52 31/10A	25,000	EUR	16,413	0.26
SPAIN 2.70 18-48 31/10A	75,000	EUR	61,151	0.96
SPAIN 2.90 16-46 31/10A	90,000	EUR	77,238	1.22
SPAIN 3.45 16-66 30/07A	155,000	EUR	137,475	2.17
SPAIN 3.45 22-43 30/07A	55,000	EUR	52,023	0.82
SPAIN 4.20 05-37 31/01A	70,000	EUR	74,669	1.18
SPAIN 4.70 09-41 30/07A	160,000	EUR	178,823	2.82
SPAIN 4.90 07-40 30/07A	130,000	EUR	147,882	2.33
SPAIN 5.15 13-44 31/10A	30,000	EUR	35,493	0.56
			822,818	12.97
Anleihen gesamt			6,214,362	97.97
Übertragbare Wertpapiere, die zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden gesamt			6,214,362	97.97
Sonstige übertragbare Wertpapiere				
Anleihen				
Deutschland				
REPUBLIQUE FEDERALE 2.6 24-41 15/05A	30,000	EUR	29,554	0.47
			29,554	0.47

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 Euro Long Term Bonds

Anlageportfolio zum 30. Juni 2024

Bezeichnung	Anzahl	Währung	Marktwert (in EUR)	% des NV
Anleihen gesamt			29,554	0.47
Sonstige übertragbare Wertpapiere, insgesamt			29,554	0.47
Anlageportfolio gesamt			6,243,916	98.44
Erwerbskosten			7,770,581	



Cleome Index Euro Long Term Bonds

Geografische und wirtschaftliche Zusammensetzung des Wertpapierbestandes zum 30. Juni 2024

Geografische Zusammensetzung (in % des Nettovermögens)

Frankreich	23.20
Italien	20.46
Deutschland	17.74
Spanien	12.97
Belgien	8.32
Niederlande	6.18
Österreich	3.88
Irland	2.01
Portugal	1.96
Finnland	1.72
	98.44

Wirtschaftliche Zusammensetzung (in % des Nettovermögens)

Anleihen von Staaten, Provinzen und Gemeinden	97.18
Banken und andere Finanzinstitute	0.99
Anlagefonds	0.27
	98.44



Cleome Index Euro Short Term Bonds

Anlageportfolio zum 30. Juni 2024

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				
Anleihen				
Österreich				
AUSTRIA 0.00 21-25 20/04U	250,000	EUR	243,401	0.47
AUSTRIA 0.50 17-27 20/04A	350,000	EUR	327,070	0.63
AUSTRIA 0.75 16-26 20/10A	300,000	EUR	285,324	0.55
AUSTRIA 1.20 15-25 20/10A	450,000	EUR	438,419	0.84
AUSTRIA 2 22-26 15/07A	300,000	EUR	293,851	0.56
AUSTRIA 4.85 09-26 15/03A	400,000	EUR	411,126	0.79
			1,999,191	3.83
Belgien				
BELGIUM 0.80 15-25 22/06A	550,000	EUR	536,456	1.03
BELGIUM 1.00 16-26 22/06A	550,000	EUR	529,253	1.01
BELGIUM 4.50 11-26 28/03A	400,000	EUR	409,806	0.79
			1,475,515	2.83
Finnland				
FINLAND 0 21-26 15/09A	300,000	EUR	281,108	0.54
FINLAND 0.875 15-25 15/09A	200,000	EUR	194,509	0.37
FINLAND 1.375 22-27 15/04A	150,000	EUR	143,853	0.28
FINLAND 4.00 09-25 04/07A	150,000	EUR	151,032	0.29
			770,502	1.48
Frankreich				
FRANCE 0.00 19-25 25/03U	1,500,000	EUR	1,462,774	2.80
FRANCE 0.00 20-26 25/02U	1,450,000	EUR	1,377,273	2.64
FRANCE 0.00 21-27 25/02U	500,000	EUR	461,595	0.88
FRANCE 0.25 15-26 25/11A	1,200,000	EUR	1,122,461	2.15
FRANCE 0.50 14-25 25/05A	2,000,000	EUR	1,949,572	3.74
FRANCE 0.50 15-26 25/05A	1,400,000	EUR	1,333,348	2.56
FRANCE 1 14-25 25/11A	1,000,000	EUR	969,904	1.86
FRANCE 1.00 16-27 25/05A	1,400,000	EUR	1,321,825	2.53
FRANCE 2.5 23-26 24/09A	1,500,000	EUR	1,480,217	2.84
FRANCE 3.50 10-26 25/04A	1,400,000	EUR	1,408,890	2.70
FRANCE 6.00 94-25 25/10A	1,200,000	EUR	1,241,361	2.38
			14,129,220	27.08
Deutschland				
BUNDESSCHATZANWEISUN 2.85 23-25 12/06A	1,000,000	EUR	996,061	1.91
BUNDESSCHATZANWEISUN 3.1 23-25 12/12A	550,000	EUR	550,797	1.06
BUNDESSCHATZANWEISUN 3.1 23-25 18/09A	500,000	EUR	500,081	0.96
GERMANY 0.00 16-26 15/08U	500,000	EUR	472,414	0.91
GERMANY 0.00 20-25 10/10U	850,000	EUR	818,455	1.57
GERMANY 0.00 20-25 10/10U	700,000	EUR	674,473	1.29
GERMANY 0.00 20-25 11/04U	1,000,000	EUR	975,563	1.87
GERMANY 0.00 21-26 09/10U	500,000	EUR	470,602	0.90
GERMANY 0.00 21-26 10/04U	1,500,000	EUR	1,428,162	2.74
GERMANY 0.00 22-27 16/04U	1,700,000	EUR	1,582,780	3.03
GERMANY 0.25 17-27 15/02A	500,000	EUR	470,630	0.90
GERMANY 0.50 16-26 15/02A	500,000	EUR	481,550	0.92
GERMANY 1.00 15-25 15/08A	500,000	EUR	488,570	0.94
GERMANY 2.5 23-25 13/03A	500,000	EUR	497,200	0.95
			10,407,338	19.95
Irland				
IRELAND 0.20 20-27 15/05A	200,000	EUR	185,785	0.36
IRELAND 1.00 16-26 15/05A	400,000	EUR	385,995	0.74
IRELAND 5.40 09-25 13/03A	600,000	EUR	607,748	1.16
			1,179,528	2.26
Italien				
BUONI POLIENNAL 0.5000 20-26 01/02S	1,000,000	EUR	955,102	1.83

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 Euro Short Term Bonds

Anlageportfolio zum 30. Juni 2024

Bezeichnung	Anzahl	Wahrung	Marktwert (in EUR)	% des NV
ITALY 0.00 21-26 01/04U	2,000,000	EUR	1,885,298	3.61
ITALY 1.60 16-26 01/06S	1,000,000	EUR	967,232	1.85
ITALY 1.85 20-25 01/07S	1,000,000	EUR	983,840	1.89
ITALY 2.00 15-25 01/12S	1,800,000	EUR	1,765,084	3.38
ITALY 4.50 10-26 01/03S	1,500,000	EUR	1,525,849	2.92
ITALY 7.25 96-26 01/11S	2,000,000	EUR	2,172,871	4.17
ITALY BUONI POL TESO 3.5 22-26 15/01S	1,000,000	EUR	1,000,300	1.92
			11,255,576	21.57
Niederlande				
NETHERLANDS 0 22-26 15/01A	500,000	EUR	478,065	0.92
NETHERLANDS 0.00 20-27 15/01U	700,000	EUR	653,008	1.25
NETHERLANDS 0.25 15-25 15/07A	300,000	EUR	291,226	0.56
NETHERLANDS 0.50 16-26 15/07A	500,000	EUR	477,393	0.92
			1,899,692	3.64
Portugal				
PORTUGAL 4.125 17-27 14/04A	600,000	EUR	620,486	1.19
			620,486	1.19
Spanien				
BONOS Y OBLIG D 2.5000 24-27 31/05A	400,000	EUR	393,646	0.75
SPAIN 0 22-25 31/05A	900,000	EUR	872,042	1.67
SPAIN 0.00 20-26 31/01U	800,000	EUR	761,398	1.46
SPAIN 0.00 21-27 31/01U	500,000	EUR	462,213	0.89
SPAIN 1.30 16-26 31/10A	1,000,000	EUR	960,817	1.84
SPAIN 1.50 17-27 30/04A	250,000	EUR	239,657	0.46
SPAIN 1.60 5-25 30/04A	500,000	EUR	492,627	0.94
SPAIN 1.95 16-26 30/04A	750,000	EUR	734,275	1.41
SPAIN 2.15 15-25 31/10A	800,000	EUR	788,718	1.51
SPAIN 2.8 23-26 31/05A	800,000	EUR	794,731	1.52
SPAIN 4.65 10-25 30/07A	500,000	EUR	506,502	0.97
SPAIN 5.90 11-26 30/07A	1,000,000	EUR	1,054,858	2.02
			8,061,484	15.45
Anleihen gesamt			51,798,532	99.29
Übertragbare Wertpapiere, die zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden gesamt			51,798,532	99.29
Anlageportfolio gesamt			51,798,532	99.29
Erwerbskosten			51,612,630	

Die Erlauerungen im Anhang sind fester Bestandteil des Abschlusses.
Etwaige Abweichungen bei den Prozentsatzen des Nettovermogens sind auf Rundungen zuruckzufuhren.



Cleome Index Euro Short Term Bonds

Geografische und wirtschaftliche Zusammensetzung des Wertpapierbestandes zum 30. Juni 2024

Geografische Zusammensetzung (in % des Nettovermögens)

Frankreich	27.08
Italien	21.57
Deutschland	19.95
Spanien	15.45
Österreich	3.83
Niederlande	3.64
Belgien	2.83
Irland	2.26
Finnland	1.48
Portugal	1.19
	99.29

Wirtschaftliche Zusammensetzung (in % des Nettovermögens)

Anleihen von Staaten, Provinzen und Gemeinden	99.29
	99.29



Cleome Index Europe Equities

Anlageportfolio zum 30. Juni 2024

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				
Anteile				
Österreich				
ERSTE GROUP BANK AG	49,859	EUR	2,205,762	0.18
VERBUND AG	16,901	EUR	1,244,759	0.10
			3,450,521	0.27
Belgien				
AGEAS NOM	35,157	EUR	1,500,501	0.12
ANHEUSER-BUSCH INBEV	119,228	EUR	6,452,620	0.51
ELIA SYSTEM OPERATOR SA	3,638	EUR	318,143	0.03
KBC GROUPE SA	29,886	EUR	1,969,487	0.16
SYENSQO SA	14,712	EUR	1,229,482	0.10
UCB	20,296	EUR	2,815,055	0.22
UMICORE SA	41,685	EUR	584,841	0.05
			14,870,129	1.18
Dänemark				
A.P. MOELLER-MAERSK -A-	412	DKK	653,017	0.05
A.P. MOELLER-MAERSK A/S -B-	569	DKK	923,606	0.07
CARLSBERG AS -B-	11,883	DKK	1,331,479	0.11
COLOPLAST -B-	14,247	DKK	1,598,273	0.13
DANSKE BANK	83,229	DKK	2,315,807	0.18
DEMANT A/S	11,926	DKK	482,001	0.04
DSV A/S	20,259	DKK	2,898,626	0.23
GENMAB AS	9,087	DKK	2,126,305	0.17
NOVO NORDISK - BEARER AND/OR - REG SHS	415,489	DKK	56,026,622	4.45
NOVOZYMES -B-	53,137	DKK	3,036,115	0.24
ORSTED	27,184	DKK	1,350,916	0.11
PANDORA	12,403	DKK	1,747,991	0.14
ROCKWOOL SHS -B-	2,867	DKK	1,086,449	0.09
TRYG A/S	22,588	DKK	461,001	0.04
VESTAS WIND SYSTEMS - BEARER AND/OR SHS	161,291	DKK	3,487,542	0.28
			79,525,750	6.32
Finnland				
ELISA CORPORATION -A-	20,515	EUR	878,863	0.07
KONE OYJ -B-	48,879	EUR	2,252,833	0.18
NESTE	51,588	EUR	857,651	0.07
NOKIA OYJ	757,181	EUR	2,694,428	0.21
NORDEA BANK	417,722	USD	4,667,069	0.37
ORION CORPORATION (NEW) -B-	12,406	EUR	494,503	0.04
SAMPO	40,852	EUR	1,638,165	0.13
STORA ENSO -R-	105,464	EUR	1,345,193	0.11
UPM KYMMENE CORP	80,854	EUR	2,637,457	0.21
WARTSILA CORPORATION -B-	92,584	EUR	1,666,512	0.13
			19,132,674	1.52
Frankreich				
ACCOR SA	20,753	EUR	794,840	0.06
AEROPORTS DE PARIS-ADP-	2,791	EUR	317,058	0.03
AIR LIQUIDE SA	75,422	EUR	12,164,060	0.97
ALSTOM SA	68,335	EUR	1,072,860	0.09
ARKEMA SA	11,315	EUR	918,212	0.07
AXA SA	248,068	EUR	7,583,439	0.60
BIOMERIEUX SA	9,767	EUR	866,821	0.07
BNP PARIBAS SA	136,519	EUR	8,126,976	0.65
BOLLORE --- ACT	63,191	EUR	346,287	0.03
BOUYGUES SA	39,331	EUR	1,178,749	0.09
BUREAU VERITAS SA	53,165	EUR	1,374,847	0.11
CAPGEMINI SE	20,172	EUR	3,745,940	0.30
CARREFOUR SA	123,685	EUR	1,632,643	0.13

Die Erläuterungen im Anhang sind fester Bestandteil des Abschlusses.

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



Cleome Index Europe Equities

Anlageportfolio zum 30. Juni 2024

Bezeichnung	Anzahl	Wahrung	Marktwert (in EUR)	% des NV
CIE DE SAINT-GOBAIN	86,598	EUR	6,288,747	0.50
CIE GENERALE DES ETABLISSEMENTS MICHELIN	95,893	EUR	3,462,696	0.27
COVIVIO SA	21,557	EUR	956,699	0.08
CREDIT AGRICOLE SA	155,274	EUR	1,978,191	0.16
DANONE SA	111,976	EUR	6,391,590	0.51
DASSAULT SYST.	85,305	EUR	3,011,267	0.24
EDENRED SA	31,188	EUR	1,229,119	0.10
EIFFAGE	11,774	EUR	1,009,738	0.08
ENGIE SA	239,296	EUR	3,191,012	0.25
ESSILORLUXOTTICA SA	36,933	EUR	7,430,920	0.59
GECINA	8,586	EUR	737,967	0.06
GETLINK ACT	68,769	EUR	1,062,481	0.08
HERMES INTERNATIONAL SA	4,201	EUR	8,990,140	0.71
IPSEN	6,198	EUR	709,671	0.06
KERING	9,839	EUR	3,330,502	0.26
KLEPIERRE SA	48,739	EUR	1,217,500	0.10
LEGRAND SA	60,555	EUR	5,609,815	0.45
L'OREAL SA	30,869	EUR	12,657,833	1.01
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	34,794	EUR	24,828,997	1.97
ORANGE	255,307	EUR	2,388,141	0.19
PERNOD RICARD SA	25,964	EUR	3,289,640	0.26
PUBLICIS GROUPE	35,889	EUR	3,566,649	0.28
REMY COINTREAU	2,845	EUR	221,626	0.02
RENAULT SA	36,580	EUR	1,749,987	0.14
SANOFI	151,288	EUR	13,606,842	1.08
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	3,797	EUR	582,081	0.05
SCHNEIDER ELECTRIC SE	84,043	EUR	18,850,844	1.50
SOCIETE GENERALE SA	101,446	EUR	2,223,696	0.18
SODEXO SA	16,555	EUR	1,390,620	0.11
TELEPERFORMANCE SE	7,021	EUR	690,446	0.05
TOTALENERGIES SE	280,661	EUR	17,493,600	1.39
UNIBAIL RODAMCO	25,009	EUR	1,838,662	0.15
VEOLIA ENVIRONNEMENT SA	66,050	EUR	1,844,116	0.15
VINCI SA	61,955	EUR	6,095,133	0.48
VIVENDI SA	123,706	EUR	1,206,876	0.10
			211,256,576	16.78
Deutschland				
ADIDAS AG - REG SHS	21,645	EUR	4,826,835	0.38
ALLIANZ SE PREFERENTIAL SHARE	47,663	EUR	12,368,549	0.98
BASF SE PREFERENTIAL SHARE	114,743	EUR	5,184,662	0.41
BECHTLE	5,325	EUR	233,980	0.02
BEIERSDORF AG	14,392	EUR	1,965,228	0.16
BMW AG	37,333	EUR	3,299,490	0.26
BMW VORZUG - STIMMRECHTSLOS	15,552	EUR	1,282,262	0.10
BRENNTAG - REG SHS	29,519	EUR	1,858,516	0.15
CARL ZEISS MEDITEC AG	5,556	EUR	364,751	0.03
COMMERZBK	142,358	EUR	2,019,348	0.16
CONTINENTAL AG	10,334	EUR	546,669	0.04
COVESTRO AG	26,425	EUR	1,448,090	0.12
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	74,985	EUR	2,787,192	0.22
DELIVERY HERO	24,058	EUR	532,885	0.04
DEUTSCHE BANK AG PREFERENTIAL SHARE	272,716	EUR	4,065,650	0.32
DEUTSCHE BOERSE AG - REG SHS	26,040	EUR	4,976,244	0.40
DEUTSCHE POST AG - REG SHS	127,880	EUR	4,832,585	0.38
DEUTSCHE TELEKOM AG - REG SHS	427,462	EUR	10,036,808	0.80
E.ON SE	326,715	EUR	4,003,893	0.32
EVONIK INDUSTRIES	49,782	EUR	948,347	0.08
FRESENIUS MEDICAL CARE AG	30,191	EUR	1,079,630	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 Europe Equities

Anlageportfolio zum 30. Juni 2024

Bezeichnung	Anzahl	Wahrung	Marktwert (in EUR)	% des NV
FRESENIUS SE	61,685	EUR	1,719,778	0.14
GEA GROUP AG	31,921	EUR	1,241,727	0.10
HANNOVER RUECK SE	7,340	EUR	1,737,378	0.14
HENKEL AG & CO KGAA	14,245	EUR	1,046,295	0.08
HENKEL AG & CO KGAA PREFERENTIAL SHARE	23,277	EUR	1,937,111	0.15
INFINEON TECHNOLOGIES - REG SHS	171,188	EUR	5,872,604	0.47
KNORR-BREMSE - BEARER SHS	16,056	EUR	1,144,793	0.09
LEG IMMOBILIEN - REG SHS	12,938	EUR	986,652	0.08
MERCEDES-BENZ GROUP	112,720	EUR	7,278,331	0.58
MERCK KGAA	17,652	EUR	2,731,647	0.22
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	10,040	EUR	2,397,552	0.19
MUENCHENER RUECK - REG SHS	19,487	EUR	9,100,429	0.72
NEMETSCHKE	7,471	EUR	686,211	0.05
PUMA AG	15,645	EUR	670,701	0.05
RATIONAL NAMEN	1,032	EUR	802,380	0.06
SAP AG	134,258	EUR	25,444,576	2.02
SARTORIUS VORZ.OHNE STIMMRECHT.	3,409	EUR	746,571	0.06
SCOUT24	8,405	EUR	598,436	0.05
SIEMENS AG PREFERENTIAL SHARE	105,574	EUR	18,340,315	1.46
SIEMENS ENERGY - REG SHS	95,302	EUR	2,316,792	0.18
SIEMENS HEALTHINEERS	32,173	EUR	1,730,907	0.14
SYMRISE AG	21,700	EUR	2,480,310	0.20
TALANX AG NAM AKT	13,495	EUR	1,006,052	0.08
VOLKSWAGEN AG	5,535	EUR	620,474	0.05
VOLKSWAGEN AG VORZ.AKT	32,959	EUR	3,473,879	0.28
VONOVIA SE	102,371	EUR	2,717,950	0.22
ZALANDO SE	28,341	EUR	620,385	0.05
			168,111,850	13.35
Irland				
AIB GRP - REGISTERED	288,989	EUR	1,426,450	0.11
BANK OF IRELAND - REGISTERED	147,457	EUR	1,440,360	0.11
DCC PLC	37,817	GBP	2,471,029	0.20
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	22,813	EUR	3,892,081	0.31
KERRY GROUP -A-	21,310	EUR	1,612,102	0.13
KINGSPAN GROUP	27,814	EUR	2,211,213	0.18
SMURFIT KAPPA PLC	45,200	EUR	1,880,320	0.15
			14,933,555	1.19
Isle of Man				
ENTAIN PLC	81,565	GBP	606,074	0.05
			606,074	0.05
Italien				
AMPLIFON SPA	17,428	EUR	579,307	0.05
ASSICURAZIONI GENERALI SPA	166,988	EUR	3,889,151	0.31
ENEL SPA	1,080,657	EUR	7,017,787	0.56
ENI SPA	254,912	EUR	3,659,007	0.29
FINECOBANK	72,696	EUR	1,011,929	0.08
INTESA SANPAOLO	2,054,350	EUR	7,130,649	0.57
MEDIOBANCA	46,835	EUR	641,171	0.05
MONCLER SPA	27,242	EUR	1,554,429	0.12
NEXI SPA	90,598	EUR	515,865	0.04
PRYSMIAN SPA	62,263	EUR	3,600,047	0.29
RECORDATI SPA	6,944	EUR	338,173	0.03
TELECOM ITALIA	787,386	EUR	175,982	0.01
TERNA SPA	151,808	EUR	1,095,750	0.09
UNICREDIT SPA - REG SHS	200,277	EUR	6,930,586	0.55
			38,139,833	3.03
Jersey				
WPP PLC	172,506	GBP	1,473,885	0.12
			1,473,885	0.12

Die Erlauterungen im Anhang sind fester Bestandteil des Abschlusses.
Etwaige Abweichungen bei den Prozentsatzen des Nettovermogens sind auf Rundungen zuruckzufuehren.



Cleome Index Europe Equities

Anlageportfolio zum 30. Juni 2024

Bezeichnung	Anzahl	Wahrung	Marktwert (in EUR)	% des NV
Luxemburg				
EUROFINS SCIENTIFIC SE	17,083	EUR	795,214	0.06
TENARIS - REG SHS	72,070	EUR	1,034,205	0.08
			1,829,419	0.15
Niederlande				
ABN AMRO GROUP DEP RECEIPT	61,165	EUR	938,883	0.07
ADYEN	2,607	EUR	2,902,112	0.23
AKZO NOBEL NV	31,289	EUR	1,776,590	0.14
ARGENX SE	7,797	EUR	3,185,854	0.25
ASM INTERNATIONAL NV	6,192	EUR	4,407,466	0.35
ASML HOLDING NV	50,863	EUR	49,042,103	3.89
ASR NEDERLAND NV	24,181	EUR	1,076,296	0.09
BESI - REG SHS	10,905	EUR	1,702,816	0.14
DAVIDE CAMPARI-MILANO N.V.	78,095	EUR	689,110	0.05
EURONEXT NV	13,540	EUR	1,171,210	0.09
EXOR NV	13,106	EUR	1,280,456	0.10
FERRARI NV	14,632	EUR	5,570,402	0.44
FERROVIAL INTERNATIONAL SE	58,518	EUR	2,121,863	0.17
HEINEKEN HOLDING	15,081	EUR	1,110,716	0.09
HEINEKEN NV	38,118	EUR	3,442,055	0.27
IMCD	12,997	EUR	1,680,512	0.13
ING GROUP NV	415,737	EUR	6,635,994	0.53
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	146,969	EUR	4,054,875	0.32
KONINKLIJKE KPN NV	526,161	EUR	1,883,656	0.15
NN GROUP NV	51,950	EUR	2,257,228	0.18
PROSUS NV	180,610	EUR	6,007,089	0.48
QIAGEN NV - REG SHS	31,417	EUR	1,211,125	0.10
RANDSTAD BR	15,870	EUR	671,777	0.05
ROYAL PHILIPS NV	95,375	EUR	2,249,896	0.18
STELLANTIS NV-BEARER AND REGISTERED SHS	310,031	EUR	5,726,272	0.45
STMICROELECTRONICS NV	87,197	EUR	3,214,517	0.26
UNIVERSAL MUSIC GROUP N.V.	108,964	EUR	3,027,020	0.24
WOLTERS KLUWER NV	34,135	EUR	5,284,098	0.42
			124,321,991	9.87
Norwegen				
AKER BP SHS	41,306	NOK	985,277	0.08
DNB BANK ASA	123,827	NOK	2,275,470	0.18
EQUINOR ASA	133,781	NOK	3,563,313	0.28
MOWI ASA	74,740	NOK	1,163,852	0.09
NORSK HYDRO ASA	337,098	NOK	1,964,423	0.16
ORKLA ASA	221,561	NOK	1,684,302	0.13
TELENOR ASA	90,289	NOK	962,904	0.08
			12,599,541	1.00
Portugal				
EDP ENERGIAS DE PORTUGAL SA - REG SHS	497,145	EUR	1,739,510	0.14
GALP ENERGIA SA REG SHS -B-	65,599	EUR	1,293,612	0.10
JERONIMO MARTINS SGPS SA	45,771	EUR	835,321	0.07
			3,868,443	0.31
Spanien				
ACS	38,403	EUR	1,546,873	0.12
AENA SME SA	10,364	EUR	1,948,432	0.15
AMADEUS IT GROUP SA -A-	63,758	EUR	3,961,922	0.31
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA	761,725	EUR	7,123,652	0.57
BANCO SANTANDER SA - REG SHS	1,944,677	EUR	8,421,424	0.67
CAIXABANK SA	559,492	EUR	2,765,569	0.22
CELLNEX TELECOM SA	58,424	EUR	1,774,338	0.14
EDP RENOVAVEIS SA	71,478	EUR	932,788	0.07
GRIFOLS SA -A-	46,729	EUR	367,290	0.03
IBERDROLA SA	833,488	EUR	10,097,707	0.80

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 Europe Equities

Anlageportfolio zum 30. Juni 2024

Bezeichnung	Anzahl	Wahrung	Marktwert (in EUR)	% des NV
INDITEX SHARE FROM SPLIT	139,643	EUR	6,473,849	0.51
REDEIA CORPORACION SA	81,659	EUR	1,332,675	0.11
REPSOL SA	166,026	EUR	2,446,393	0.19
TELEFONICA SA	613,746	EUR	2,430,434	0.19
			51,623,346	4.10
Schweden				
ALFA LAVAL	46,891	SEK	1,917,367	0.15
ASSA ABLOY -B- NEW I	185,075	SEK	4,885,328	0.39
ATLAS COPCO AB -A-	338,037	SEK	5,932,773	0.47
ATLAS COPCO AB -B-	238,878	SEK	3,602,112	0.29
BOLIDEN - REG SHS	83,308	SEK	2,488,964	0.20
EPIROC - REG SHS -A-	120,456	SEK	2,244,620	0.18
EQT AB	47,048	SEK	1,298,276	0.10
ESSITY AB REGISTERED -B-	64,984	SEK	1,553,891	0.12
EVOLUTION AB	19,606	SEK	1,907,051	0.15
FASTIGHETS-B SHS SHARES	25,006	SEK	159,994	0.01
GETINGE -B-	20,183	SEK	320,172	0.03
HENNES AND MAURITZ AB	68,929	SEK	1,018,145	0.08
HEXAGON - REG SHS -B-	270,184	SEK	2,848,239	0.23
HUSQVARNA -B-	59,574	SEK	445,834	0.04
INVESTOR - REG SHS -B-	222,351	SEK	5,685,133	0.45
LATOIR INVESTMENT REGISTERED B	78,888	SEK	1,989,229	0.16
LIFCO AB	69,596	SEK	1,784,356	0.14
NIBE INDUSTRIER	297,937	SEK	1,179,672	0.09
SAAB AB	71,490	SEK	1,606,163	0.13
SANDVIK AB	150,309	SEK	2,812,831	0.22
SECURITAS -B- FREE	84,988	SEK	787,730	0.06
SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN -A-	183,205	SEK	2,526,131	0.20
SKANSKA -B- FREE	46,865	SEK	787,828	0.06
SKF AB -B-	58,862	SEK	1,103,598	0.09
SVENSKA CELLULOSA SCA AB-SHS-B-	111,703	SEK	1,540,714	0.12
SVENSKA HANDELSBANKEN AB-A-	185,404	SEK	1,649,034	0.13
SWEDBANK -A-	108,610	SEK	2,087,034	0.17
TELE2 AB	75,012	SEK	705,178	0.06
TELIA COMPANY AB	313,191	SEK	784,495	0.06
VOLVO AB -B-	266,346	SEK	6,361,797	0.51
			64,013,689	5.08
Schweiz				
ABB LTD PREFERENTIAL SHARE	264,636	CHF	13,717,490	1.09
ADECCO REG.SHS	22,728	CHF	703,752	0.06
ALCON - REG SHS	66,386	CHF	5,529,812	0.44
BACHEM HOLDING LTD SHARES	1,652	CHF	141,434	0.01
BALOISE HOLDING - REG SHS	5,598	CHF	919,582	0.07
BARRY CALLEBAUT - NAMEN-AKT	719	CHF	1,093,002	0.09
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT & SP - REG SHS	17	CHF	1,832,304	0.15
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT & SP PARTIZIPSCH	105	CHF	1,143,710	0.09
CIE FINANCIERE RICHEMONT - REG SHS	66,159	CHF	9,634,806	0.77
CLARIANT - REG SHS	58,524	CHF	859,280	0.07
COCA COLA HBC - REG SHS	40,125	GBP	1,276,844	0.10
DSM FIRMENICH	27,293	EUR	2,882,141	0.23
GEBERIT AG	6,681	CHF	3,682,338	0.29
GIVAUDAN SA - REG SHS	1,327	CHF	5,869,913	0.47
JULIUS BAER GROUP - REG SHS	29,735	CHF	1,549,968	0.12
KUEHNE + NAGEL INTERNATIONAL AG	6,834	CHF	1,833,660	0.15
LOGITECH - REG SHS	24,391	USD	2,201,408	0.17
LONZA GROUP	9,587	CHF	4,881,849	0.39
NESTLE SA PREFERENTIAL SHARE	342,171	CHF	32,588,052	2.59
NOVARTIS AG PREFERENTIAL SHARE	254,618	CHF	25,426,107	2.02
PARTNERS GROUP HLDG - REG SHS	2,684	CHF	3,216,174	0.26

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

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



Cleome Index Europe Equities

Anlageportfolio zum 30. Juni 2024

Bezeichnung	Anzahl	Wahrung	Marktwert (in EUR)	% des NV
ROCHE HOLDING AG	3,101	CHF	881,630	0.07
ROCHE HOLDING LTD	91,409	CHF	23,681,579	1.88
SANDOZ GROUP AG	54,452	CHF	1,839,850	0.15
SCHINDLER HOLDING SA	8,218	CHF	1,926,820	0.15
SGS LTD	19,365	CHF	1,608,639	0.13
SIKA - REGISTERED SHS	20,184	CHF	5,390,504	0.43
SONOVA HOLDING NAM-AKT	7,078	CHF	2,040,240	0.16
STRAUMANN HOLDING LTDÄ	11,963	CHF	1,382,568	0.11
SWISS LIFE HOLDING - REG SHS	3,433	CHF	2,354,852	0.19
SWISS PRIME SITE AG-NAMEN AKT	5,047	CHF	446,503	0.04
SWISS RE - REG SHS	48,883	CHF	5,659,576	0.45
SWISSCOM SHS NOM	2,683	CHF	1,408,293	0.11
TEMENOS AG NAM.AKT	7,569	CHF	487,283	0.04
THE SWATCH GROUP	4,682	CHF	894,784	0.07
UBS GROUP SA	418,165	CHF	11,484,828	0.91
VAT GROUP SA	3,786	CHF	2,002,584	0.16
ZURICH INSURANCE GROUP - REG SHS	19,333	CHF	9,617,818	0.76
			194,091,977	15.41
Großbritannien				
3I GROUP PLC	161,466	GBP	5,838,943	0.46
ADMIRAL GROUP PLC	37,871	GBP	1,168,045	0.09
ANGLO AMERICAN PLC	181,086	GBP	5,343,836	0.42
ANTOFAGASTA PLC	96,557	GBP	2,402,963	0.19
ASHTREAD GROUP	70,189	GBP	4,372,687	0.35
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	60,247	GBP	1,757,989	0.14
ASTRAZENECA PLC	200,613	GBP	29,235,999	2.32
AUTO TRADER GROUP PLC	122,340	GBP	1,156,087	0.09
AVIVA PLC	469,543	GBP	2,639,432	0.21
BARCLAYS PLC	1,981,907	GBP	4,883,179	0.39
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	157,781	GBP	878,743	0.07
BP PLC	2,208,532	GBP	12,378,303	0.98
BT GROUP PLC	939,625	GBP	1,555,422	0.12
BUNZL PLC	92,017	GBP	3,266,747	0.26
BURBERRY GROUP PLC	58,689	GBP	607,622	0.05
CENTRICA	912,172	GBP	1,451,342	0.12
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS	32,496	EUR	2,222,726	0.18
COMPASS GROUP	229,757	GBP	5,853,336	0.46
CRODA INTL - REG SHS	24,542	GBP	1,142,795	0.09
DIAGEO PLC	288,154	GBP	8,460,924	0.67
ENDEAVOUR MNG --- REGISTERED	37,139	GBP	738,531	0.06
EXPERIAN GROUP	124,844	GBP	5,427,552	0.43
GSK REG SHS	563,244	GBP	10,160,780	0.81
HALEON PLC REGISTERED SHARE	909,629	GBP	3,461,063	0.27
HALMA PLC	57,083	GBP	1,821,862	0.14
HARGREAVES LANS - REGISTERED SHS	60,453	GBP	807,133	0.06
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	28,810	GBP	642,563	0.05
HSBC HOLDINGS PLC	2,407,674	GBP	19,420,984	1.54
INFORMA PLC	204,377	GBP	2,062,934	0.16
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	23,091	GBP	2,267,567	0.18
INTERTEK GROUP PLC	22,591	GBP	1,277,363	0.10
J SAINSBURY PLC	543,383	GBP	1,634,283	0.13
JD SPORTS FASHION PLC	426,650	GBP	601,341	0.05
KINGFISHER PLC	437,919	GBP	1,285,065	0.10
LAND SEC R.E.I.T	118,636	GBP	866,840	0.07
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	835,021	GBP	2,235,652	0.18
LLOYDS BANKING GROUP PLC	8,932,894	GBP	5,767,372	0.46
LSE GROUP	61,439	GBP	6,811,660	0.54
M AND G REGISTERED SHS	478,551	GBP	1,151,435	0.09

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 Europe Equities

Anlageportfolio zum 30. Juni 2024

Bezeichnung	Anzahl	Wahrung	Marktwert (in EUR)	% des NV
MELROSE IND --- REGISTERED SHS	260,759	GBP	1,702,000	0.14
MONDI PLC - REG SHS	76,161	GBP	1,364,044	0.11
NATIONAL GRID PLC	655,455	GBP	6,823,196	0.54
NATWEST GROUP PLC	944,434	GBP	3,473,191	0.28
NEXT PLC	18,346	GBP	1,955,233	0.16
PEARSON PLC	109,494	GBP	1,279,550	0.10
PERSIMMON PLC	39,766	GBP	634,118	0.05
PRUDENTIAL PLC	343,500	GBP	2,910,543	0.23
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	95,942	GBP	4,845,476	0.38
RELX PLC	269,079	GBP	11,548,959	0.92
RENTOKIL INITIAL PLC	356,153	GBP	1,937,345	0.15
RIO TINTO PLC	183,390	GBP	11,249,766	0.89
SAGE GROUP	134,121	GBP	1,721,893	0.14
SEGRO (REIT)	203,314	GBP	2,153,879	0.17
SEVERN TRENT PLC	48,206	GBP	1,353,191	0.11
SHELL PLC	394,668	GBP	13,192,063	1.05
SHELL PLC	432,149	GBP	14,518,045	1.15
SMITH AND NEPHEW PLC	118,979	GBP	1,376,078	0.11
SPIRAX-SARCO ENGIN	12,687	GBP	1,268,924	0.10
SSE PLC	171,416	GBP	3,617,962	0.29
STANDARD CHARTERED PLC	287,769	GBP	2,430,178	0.19
TAYLOR WIMPEY PLC	566,528	GBP	949,837	0.08
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	16,514	GBP	893,628	0.07
UNILEVER	199,966	GBP	10,247,712	0.81
UNILEVER	127,193	GBP	6,522,457	0.52
UNITED UTILITIES GROUP PLC	142,591	GBP	1,652,532	0.13
VODAFONE GROUP PLC	3,702,094	GBP	3,046,035	0.24
WHITBREAD	22,993	GBP	806,796	0.06
WISE PLC	82,563	GBP	663,640	0.05
			281,197,371	22.33
Vereinigte Staaten von Amerika				
AEGON - REGISTERED SHS	200,684	EUR	1,157,545	0.09
			1,157,545	0.09
Aktien gesamt			1,286,204,169	102.15
Ubertragbare Wertpapiere, die zur amtlichen Notierung an einer Borse zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden gesamt			1,286,204,169	102.15
Sonstige ubertragbare Wertpapiere				
Anteile				
Portugal				
BANCO ESPIRIT SANTO	548,704	EUR	0	0.00
			0	0.00
Grobritannien				
NMC HEALTH PLC	14,075	GBP	0	0.00
			0	0.00
Aktien gesamt			0	0.00
Rechte				
Italien				
DIR AMPLIFON	13,405	EUR	0	0.00
			0	0.00
Gesamtrechte			0	0.00
Sonstige ubertragbare Wertpapiere, insgesamt			0	0.00
Anlageportfolio gesamt			1,286,204,169	102.15
Erwerbskosten			1,066,880,868	

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 Europe Equities

Geografische und wirtschaftliche Zusammensetzung des Wertpapierbestandes zum 30. Juni 2024

Geografische Zusammensetzung (in % des Nettovermögens)

Großbritannien	22.33
Frankreich	16.78
Schweiz	15.41
Deutschland	13.35
Niederlande	9.87
Dänemark	6.32
Schweden	5.08
Spanien	4.10
Italien	3.03
Finnland	1.52
Irland	1.19
Belgien	1.18
Norwegen	1.00
Portugal	0.31
Österreich	0.27
Luxemburg	0.15
Jersey	0.12
Vereinigte Staaten von Amerika	0.09
Isle of Man	0.05
	102.15

Wirtschaftliche Zusammensetzung (in % des Nettovermögens)

Banken und andere Finanzinstitute	16.52
Pharmazeutika	16.48
Elektronik und Halbleiter	5.71
Erdöl	5.59
Versicherungen	5.54
Lebensmittel und alkoholfreie Getränke	5.43
Elektrotechnik	4.64
Versorger	4.26
Chemikalien	3.81
Maschinen- und Apparatebau	3.62
Internet und Internet-Dienste	3.61
Textilien und Bekleidung	3.44
Kraftfahrzeuge	3.03
Kommunikation	2.49
Baumaterialien	2.16
Grafik und Verlage	2.10
Tabak und alkoholische Getränke	1.99
Einzelhandel und Warenhäuser	1.81
NE-Metalle	1.56
Transport	1.18
Hotels und Restaurants	1.08
Papier und Forsterzeugnisse	0.96
Immobilien	0.96
Sonstige Dienstleistungen	0.94
Sonstige Konsumgüter	0.76
Biotechnologie	0.55
Gesundheitswesen	0.55
Luft- und Raumfahrt	0.32
Reifen und Kautschuk	0.32
Kohlebergbau und Stahlindustrie & Chemie	0.28
Büroausstattung und Computer	0.17
Landwirtschaft und Fischerei	0.09
Umweltdienste und Recycling	0.07
Uhrenindustrie, Schmuck	0.07
Edelmetalle und Edelsteine	0.06
	102.15

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



Cleome Index USA Equities

Anlageportfolio zum 30. Juni 2024

Bezeichnung	Anzahl	Wahrung	Marktwert (in USD)	% des NV
Übertragbare Wertpapiere, die zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden				
Anteile				
Bermuda				
ARCH CAPITAL GROUP LTD	29,575	USD	2,983,822	0.11
EVEREST GROUP LTD	3,903	USD	1,487,121	0.06
			4,470,943	0.17
Kanada				
WASTE CONNECTIONS	18,067	CAD	3,168,230	0.12
			3,168,230	0.12
Irland				
ACCENTURE - SHS CLASS A	36,009	USD	10,925,490	0.42
ALLEGION PLC	2,938	USD	347,125	0.01
AON PREFERENTIAL SHARE	9,950	USD	2,921,121	0.11
CRH PLC	32,485	EUR	2,435,725	0.09
EATON CORPORATION PUBLIC LIMITED COMPANY	24,938	USD	7,819,310	0.30
JOHNSON CONTROLS INTL	49,705	USD	3,303,891	0.13
LINDE PLC	31,387	USD	13,772,929	0.53
MEDTRONIC HLD	81,239	USD	6,394,322	0.25
PENTAIR PLC	34,284	USD	2,628,554	0.10
TRANE TECH - REG SHS	15,718	USD	5,170,122	0.20
WILLIS TOWERS WATSON PLC	9,791	USD	2,566,613	0.10
			58,285,202	2.24
Jersey				
APTIV PLC	18,774	USD	1,322,065	0.05
FERGUSON NEWCO PLC	18,516	USD	3,585,623	0.14
			4,907,688	0.19
Liberia				
ROYAL CARIBBEAN CRUISES	13,219	USD	2,107,505	0.08
			2,107,505	0.08
Luxemburg				
CLOUDFLARE INC	12,860	USD	1,065,194	0.04
PINTEREST PREFERENTIAL SHARE -A-	29,861	USD	1,315,974	0.05
SNOWFLAKE INC-CLASS A	14,917	USD	2,015,138	0.08
THE TRADE DESK -A-	20,330	USD	1,985,631	0.08
			6,381,937	0.25
Niederländische Antillen				
SLB	109,474	USD	5,164,983	0.20
			5,164,983	0.20
Niederlande				
LYONDELLBASELL -A-	16,070	USD	1,537,256	0.06
NXP SEMICONDUCTORS	16,342	USD	4,397,469	0.17
			5,934,725	0.23
Schweiz				
BUNGE GLOBAL LT	15,447	USD	1,649,276	0.06
CHUBB - REG SHS	23,821	USD	6,076,261	0.23
TE CONNECTIVITY LTD - REG SHS	18,039	USD	2,713,607	0.10
			10,439,144	0.40
Großbritannien				
ATLISSIAN CORPORATION PL	8,828	USD	1,561,497	0.06
			1,561,497	0.06
Vereinigte Staaten von Amerika				
3M CO	35,397	USD	3,617,219	0.14
ABBOTT LABORATORIES	97,533	USD	10,134,654	0.39
ABBVIE INC	93,408	USD	16,021,340	0.62
ADOBE INC	24,924	USD	13,846,279	0.53
ADVANCED MICRO DEVICES INC	89,318	USD	14,488,273	0.56
AFLAC INC	32,445	USD	2,897,663	0.11
AGILENT TECHNOLOGIES	14,765	USD	1,913,987	0.07

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 USA Equities

Anlageportfolio zum 30. Juni 2024

Bezeichnung	Anzahl	Wahrung	Marktwert (in USD)	% des NV
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	13,865	USD	3,577,863	0.14
AIRBNB INC	23,472	USD	3,559,060	0.14
AKAMAI TECHNOLOGIES	11,695	USD	1,053,486	0.04
ALBEMARLE - REGISTERED SHS	7,141	USD	682,108	0.03
ALEXANDRIA REAL ESTATE	12,020	USD	1,405,979	0.05
ALIGN TECHNOLOGY INC	2,593	USD	626,028	0.02
ALLSTATE CORP	15,684	USD	2,504,107	0.10
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	6,975	USD	1,694,925	0.07
ALPHABET INC -A-	290,540	USD	52,921,860	2.03
ALPHABET INC -C-	303,428	USD	55,654,763	2.14
AMAZON.COM INC	505,668	USD	97,720,340	3.75
AMERICAN EXPRESS	34,382	USD	7,961,152	0.31
AMERICAN INTL	42,207	USD	3,133,448	0.12
AMERICAN TOWER CORP	28,117	USD	5,465,382	0.21
AMERICAN WATER WORKS CO INC	24,998	USD	3,228,742	0.12
AMERIPRISE FINANCIAL INC	8,447	USD	3,608,474	0.14
AMETEK INC	15,445	USD	2,574,836	0.10
AMGEN INC	28,695	USD	8,965,753	0.34
AMPHENOL -A-	58,954	USD	3,971,731	0.15
ANALOG DEVICES INC	30,387	USD	6,936,137	0.27
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC, 	107,316	USD	2,045,443	0.08
ANSYS INC	4,768	USD	1,532,912	0.06
APOLLO GLB MGMT - REG SHS	29,917	USD	3,532,300	0.14
APPLE INC	795,518	USD	167,552,000	6.44
APPLIED MATERIALS INC	48,133	USD	11,358,907	0.44
AQUA AMERICA --- REGISTERED SHS	74,013	USD	2,762,905	0.11
ARCHER-DANIELS MIDLAND CO	25,068	USD	1,515,361	0.06
ARISTA NETWORKS INC	13,940	USD	4,885,692	0.19
ARTHUR J.GALLAGHER AN CO	12,616	USD	3,271,455	0.13
ASSURANT INC	6,445	USD	1,071,481	0.04
AT&T INC	420,769	USD	8,040,896	0.31
ATMOS ENERGY CORP	12,854	USD	1,499,419	0.06
AUTODESK INC	15,094	USD	3,735,010	0.14
AUTOMATIC DATA PROCESSING INC	36,386	USD	8,684,974	0.33
AUTOZONE INC	1,061	USD	3,144,910	0.12
AVALONBAY COMMUN	15,520	USD	3,210,933	0.12
AVANTOR - REG SHS	51,733	USD	1,096,740	0.04
AXON ENTERPRISE - REGISTERED	4,046	USD	1,190,495	0.05
BAKER HUGHES - REG SHS -A-	73,519	USD	2,585,663	0.10
BALL CORP	29,949	USD	1,797,539	0.07
BANK OF AMERICA CORP	417,121	USD	16,588,901	0.64
BANK OF NY MELLON	90,902	USD	5,444,121	0.21
BAXTER INTERNATIONAL INC	27,699	USD	926,532	0.04
BECTON DICKINSON	15,994	USD	3,737,958	0.14
BEST BUY CO INC	15,192	USD	1,280,533	0.05
BIOGEN IDEC INC	9,652	USD	2,237,527	0.09
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	9,599	USD	790,286	0.03
BLACKROCK INC	9,713	USD	7,647,239	0.29
BLACKSTONE INC - REGISTERED SHS	36,704	USD	4,543,955	0.17
BLOCK INC -A-	26,132	USD	1,685,252	0.06
BOOKING HOLDINGS INC	1,805	USD	7,150,508	0.27
BOOZ ALLEN HAMILTON -A-	10,579	USD	1,628,108	0.06
BOSTON PROPERTIES INC	15,791	USD	972,094	0.04
BOSTON SCIENTIF CORP	70,014	USD	5,391,778	0.21
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	124,552	USD	5,172,645	0.20
BROADCOM INC - REGISTERED SHS	23,722	USD	38,086,382	1.46
BROADRIDGE FINANCIAL SOL	12,931	USD	2,547,407	0.10
BUILDERS FIRSTSOURCE	7,297	USD	1,009,978	0.04

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

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



Cleome Index USA Equities

Anlageportfolio zum 30. Juni 2024

Bezeichnung	Anzahl	Wahrung	Marktwert (in USD)	% des NV
BURLINGTON STORES INC	3,892	USD	934,080	0.04
C.H.ROBINSON WORLWIDE INC	17,901	USD	1,577,436	0.06
CADENCE DESIGN SYSTEMS INC	16,767	USD	5,160,044	0.20
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	24,784	USD	3,431,345	0.13
CARDINAL HEALTH	20,113	USD	1,977,510	0.08
CARLISLE COS INC	3,567	USD	1,445,384	0.06
CARMAX INC	9,071	USD	665,268	0.03
CARRIER GLOBAL CORP-WI	54,296	USD	3,424,992	0.13
CATALENT	15,639	USD	879,381	0.03
CATERPILLAR - REG SHS	26,509	USD	8,830,148	0.34
CBOE HOLDINGS INC	15,719	USD	2,673,173	0.10
CBRE GROUP	24,125	USD	2,149,779	0.08
CDW	8,463	USD	1,894,358	0.07
CENCORA INC	7,135	USD	1,607,516	0.06
CENTENE CORP	29,527	USD	1,957,640	0.08
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	6,619	USD	490,600	0.02
CHARLES SCHWAB CORP/THE	81,482	USD	6,004,409	0.23
CHARTER COMM -A-	5,299	USD	1,584,189	0.06
CHENIERE ENERGY INC	21,690	USD	3,792,063	0.15
CHIPOTLE MEXICAN GRILL -A-	79,600	USD	4,986,940	0.19
CHURCH AND DWIGHT CO	18,863	USD	1,955,716	0.08
CINCINNATI FINANCIAL CORP	6,616	USD	781,350	0.03
CINTAS	8,225	USD	5,759,639	0.22
CISCO SYSTEMS INC	241,919	USD	11,493,572	0.44
CITIGROUP INC	128,761	USD	8,171,173	0.31
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	38,303	USD	1,380,057	0.05
CLOROX CO	11,451	USD	1,562,718	0.06
CME GROUP -A-	22,081	USD	4,341,125	0.17
COCA-COLA CO	234,671	USD	14,936,809	0.57
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS -A-	33,147	USD	2,253,996	0.09
COINBASE GLOBAL - REG SHS -A-	9,475	USD	2,105,629	0.08
COLGATE-PALMOLIVE CO	56,986	USD	5,529,921	0.21
COMCAST CORP	234,508	USD	9,183,333	0.35
CONAGRA BRANDS INC	89,478	USD	2,542,965	0.10
CONOCOPHILLIPS CO	67,247	USD	7,691,712	0.30
CONSOLIDATED EDISON INC	69,338	USD	6,200,204	0.24
CONSTELLATION BRANDS INC -A-	7,835	USD	2,015,788	0.08
CONSTELLATION ENERGY	19,141	USD	3,833,368	0.15
COPART INC	43,884	USD	2,376,757	0.09
CORNING INC	48,365	USD	1,878,980	0.07
CORTEVA - REG SHS	27,158	USD	1,464,903	0.06
COSTAR GROUP INC	14,924	USD	1,106,465	0.04
COSTCO WHOLESALE CORP	23,723	USD	20,164,312	0.77
COTERRA ENERGY INC	38,761	USD	1,033,756	0.04
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC	12,034	USD	4,611,309	0.18
CROWN CASTLE INC	27,755	USD	2,711,664	0.10
CUMMINS - REGISTERED	7,528	USD	2,084,729	0.08
CVS HEALTH	76,226	USD	4,501,908	0.17
DANAHER CORP	38,429	USD	9,601,486	0.37
DARDEN RESTAURANTS INC	6,233	USD	943,178	0.04
DATADOG INC	13,071	USD	1,695,178	0.07
DECKERS OUTDOOR	1,761	USD	1,704,560	0.07
DEERE AND CO	16,177	USD	6,044,213	0.23
DELL TECHNOLOGIES PREFERENTIAL SHARE	14,676	USD	2,023,967	0.08
DEVON ENERGY CORP	40,655	USD	1,927,047	0.07
DEXCOM INC	22,989	USD	2,606,493	0.10
DIAMONDBACK ENERGY	15,576	USD	3,118,159	0.12
DIGITAL REALTY TRUST INC	17,268	USD	2,625,599	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 USA Equities

Anlageportfolio zum 30. Juni 2024

Bezeichnung	Anzahl	Wahrung	Marktwert (in USD)	% des NV
DISCOVER FINANCIAL SERVICES - SHS	18,118	USD	2,370,016	0.09
DOLLAR GENERAL	10,757	USD	1,422,399	0.05
DOLLAR TREE INC	9,071	USD	968,511	0.04
DOMINO PIZZA INC	1,546	USD	798,246	0.03
DOORDASH - REGISTERED SHS -A-	13,912	USD	1,513,347	0.06
DOVER CORP	18,437	USD	3,326,957	0.13
DOW - REG SHS	12,500	USD	663,125	0.03
DOWDUPONT - REG SHS	24,421	USD	1,965,646	0.08
DR HORTON	13,516	USD	1,904,810	0.07
DRAFTKINGS INC	19,843	USD	757,407	0.03
EBAY INC	32,370	USD	1,738,916	0.07
ECOLAB INC	19,863	USD	4,727,394	0.18
EDISON INTERNATIONAL	43,817	USD	3,146,499	0.12
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	42,305	USD	3,907,712	0.15
ELECTRONIC ARTS - REGSHS	19,454	USD	2,710,526	0.10
ELEVANCE HEALTH	15,036	USD	8,147,407	0.31
ELI LILLY & CO	43,803	USD	39,658,359	1.52
EMCOR GROUP	3,175	USD	1,159,129	0.04
EMERSON ELECTRIC CO	44,976	USD	4,954,556	0.19
ENPHASE ENERGY	8,152	USD	812,836	0.03
EOG RESOURCES INC	32,719	USD	4,118,341	0.16
EQT	27,869	USD	1,030,596	0.04
EQTY RESIDENTIAL PPTYS TR SHS BEN.INT.	22,191	USD	1,538,724	0.06
EQUIFAX INC	7,057	USD	1,711,040	0.07
EQUINIX INC	5,361	USD	4,056,133	0.16
EQUITABLE HOLDINGS INC	26,770	USD	1,093,822	0.04
ESSEX PROPERTY TRUST	3,564	USD	970,121	0.04
ESTEE LAUDER COMPANIES INC -A-	12,193	USD	1,297,335	0.05
ETSY	6,880	USD	405,782	0.02
EVERSOURCE ENERGY	57,878	USD	3,282,261	0.13
EXACT SCIENCES CORP	12,517	USD	528,843	0.02
EXELON CORP	125,129	USD	4,330,715	0.17
EXPEDITORS INTERNATIONAL OF WASHINGTON	27,626	USD	3,447,449	0.13
EXTRA SPACE STORAGE INC	11,306	USD	1,757,065	0.07
EXXON MOBIL CORP	251,117	USD	28,908,588	1.11
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	4,697	USD	1,917,644	0.07
FAIR ISAAC CORP	1,477	USD	2,198,751	0.08
FASTENAL CO	42,102	USD	2,645,690	0.10
FEDEX CORP	16,916	USD	5,072,093	0.19
FIDELITY NATIONAL INFO SERVICES INC	46,434	USD	3,499,266	0.13
FIFTH THIRD BANCORP	52,482	USD	1,915,068	0.07
FIRST CITIZENS BANCSHARES INC	447	USD	752,574	0.03
FIRST SOLAR INC	6,511	USD	1,467,970	0.06
FISERV INC	47,925	USD	7,142,742	0.27
FLEETCOR TCHNGY --- REGISTERED SHS	3,897	USD	1,038,200	0.04
FORD MOTOR	231,882	USD	2,907,800	0.11
FORTINET	38,886	USD	2,343,659	0.09
FORTIVE CORP	47,145	USD	3,493,445	0.13
FRANKLIN RESOURCES INC	44,514	USD	994,888	0.04
FREEMPORT MCMORAN COPPER AND GOLD INC	88,170	USD	4,285,062	0.16
GARTNER INC	6,427	USD	2,886,109	0.11
GE HEALTHCARE TECHNOLOGIES INC � �	21,534	USD	1,677,929	0.06
GEN DIGITAL INC	38,704	USD	966,826	0.04
GENERAL ELECTRI	62,152	USD	9,880,303	0.38
GENERAL MILLS INC	52,713	USD	3,334,624	0.13
GENERAL MOTORS CO	65,879	USD	3,060,738	0.12
GILEAD SCIENCES INC	76,941	USD	5,278,922	0.20
GLOBAL PAYMENTS INC	18,459	USD	1,784,985	0.07

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

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



Cleome Index USA Equities

Anlageportfolio zum 30. Juni 2024

Bezeichnung	Anzahl	Wahrung	Marktwert (in USD)	% des NV
GODADDY -A-	13,189	USD	1,842,635	0.07
GRAIL INC-WI	1,056	USD	16,231	0.00
GS ACQN HLDG - REGISTERED SHS -A-	21,939	USD	1,899,259	0.07
HALLIBURTON	42,927	USD	1,450,074	0.06
HCA INC	11,876	USD	3,815,521	0.15
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	87,598	USD	1,716,921	0.07
HEICO -A-	4,970	USD	882,274	0.03
HERSHEY	7,791	USD	1,432,220	0.06
HESS CORP	17,128	USD	2,526,723	0.10
HILTON WORLDWIDE HLDGS INC - REG SHS	22,294	USD	4,864,551	0.19
HOLOGIC INC	26,339	USD	1,955,671	0.08
HOME DEPOT INC	56,986	USD	19,616,860	0.75
HORMEL FOODS CORP	26,820	USD	817,742	0.03
HOST HOTELS & RESORTS - SHS	41,102	USD	739,014	0.03
HOWMET AEROSPC - REGISTERED SHS	27,788	USD	2,157,182	0.08
HP ENTERPRISE CO	98,494	USD	2,085,118	0.08
HP INC	83,930	USD	2,939,229	0.11
HUBBELL	6,345	USD	2,318,971	0.09
HUBSPOT INC	2,791	USD	1,646,104	0.06
HUMANA INC	7,186	USD	2,685,049	0.10
HUNTINGTON BANCSHARES INC	139,403	USD	1,837,331	0.07
IBM CORP	50,844	USD	8,793,470	0.34
IDEX CORP	12,230	USD	2,460,676	0.09
IDEXX LABS CORP	5,504	USD	2,681,549	0.10
ILLINOIS TOOL WORKS	24,809	USD	5,878,741	0.23
ILLUMINA INC	6,342	USD	661,978	0.03
INCYTE CORP	9,755	USD	591,348	0.02
INGERSOLL RAND INC	42,333	USD	3,845,530	0.15
INSULET	3,238	USD	653,428	0.03
INTEL CORP	235,750	USD	7,301,178	0.28
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	49,862	USD	6,825,609	0.26
INTL FLAVORS & FRAG	17,751	USD	1,690,073	0.06
INTUIT	15,355	USD	10,091,460	0.39
INTUITIVE SURGICAL	19,727	USD	8,775,556	0.34
INVITATION HOMS - REG SHS	28,162	USD	1,010,734	0.04
IQVIA HOLDINGS INC	8,738	USD	1,847,563	0.07
IRON MOUNTAIN INC REIT	23,709	USD	2,124,801	0.08
J.B. HUNT TRANSPORT SERVICES INC	8,893	USD	1,422,880	0.05
J.M. SMUCKER CO SHS	9,428	USD	1,028,029	0.04
JOHNSON & JOHNSON	125,379	USD	18,325,394	0.70
JPMORGAN CHASE CO	154,981	USD	31,346,456	1.20
KELLANOVA	31,432	USD	1,812,998	0.07
KENVUE INC	79,946	USD	1,453,418	0.06
KEURIG DR PEPPR - REG SHS	103,159	USD	3,445,511	0.13
KEYCORP	44,071	USD	626,249	0.02
KEYSIGHT TECHNOLOGIES	10,336	USD	1,413,448	0.05
KIMBERLY-CLARK CORP	23,547	USD	3,254,195	0.13
KINDER MORGAN INC	241,449	USD	4,797,592	0.18
KKR & CO - REG SHS	43,596	USD	4,588,043	0.18
KLA CORPORATION	8,450	USD	6,967,110	0.27
KROGER CO	53,095	USD	2,651,034	0.10
LABCORP HOLDINGS INCÄ	9,969	USD	2,028,791	0.08
LAM RESEARCH CORP	7,687	USD	8,185,502	0.31
LAS VEGAS SANDS CORP	20,956	USD	927,303	0.04
LENNAR CORP -A-	7,894	USD	1,183,074	0.05
LIBERTY MEDI CORP-LIBERTY-C	13,427	USD	964,596	0.04
LIVE NATION ENT	5,262	USD	493,260	0.02
LOWE'S CO INC	36,969	USD	8,150,186	0.31

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

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



Cleome Index USA Equities

Anlageportfolio zum 30. Juni 2024

Bezeichnung	Anzahl	Wahrung	Marktwert (in USD)	% des NV
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	8,110	USD	2,265,123	0.09
LULULEMON ATHLETICA INC SHS WHEN ISSUED	7,203	USD	2,151,536	0.08
M&T BANK CORPORATION	11,900	USD	1,801,184	0.07
MARATHON OIL CORP	64,833	USD	1,858,762	0.07
MARATHON PETROLEUM	20,965	USD	3,637,008	0.14
MARKEL GROUP INC	703	USD	1,107,689	0.04
MARKETAXESS HOLDING INC	2,662	USD	533,811	0.02
MARRIOTT INTERNATIONAL -A-	12,625	USD	3,052,346	0.12
MARSH MCLENNAN COS	33,019	USD	6,957,764	0.27
MARTIN MARIETTA	3,841	USD	2,081,054	0.08
MARVELL TECH --- REGISTERED SHS	51,834	USD	3,623,197	0.14
MASCO CORP	26,269	USD	1,751,354	0.07
MASTERCARD INC -A-	48,906	USD	21,575,370	0.83
MCCORMICK & CO INC NON VOTING	18,943	USD	1,343,816	0.05
MCDONALD'S CORP	40,127	USD	10,225,965	0.39
MCKESSON CORP	6,127	USD	3,578,413	0.14
MERCADOLIBRE	2,558	USD	4,203,817	0.16
MERCK & CO INC	145,035	USD	17,955,332	0.69
META PLATFORMS INC A	117,541	USD	59,266,522	2.28
METLIFE INC	37,695	USD	2,645,812	0.10
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL	1,580	USD	2,208,192	0.08
MICROCHIP TECHNOLOGY	9,901	USD	905,942	0.03
MICRON TECHNOLOGY INC	62,220	USD	8,183,797	0.31
MICROSOFT CORP	383,663	USD	171,478,177	6.59
MICROSTRATEGY -A-	750	USD	1,033,110	0.04
MID-AMER APARTMENT COMMUNITIES INC	8,425	USD	1,201,489	0.05
MODERNA INC	17,294	USD	2,053,663	0.08
MOLINA HEALTHCARE	3,367	USD	1,001,009	0.04
MOLSON COORS - REG SHS -B-	12,966	USD	659,062	0.03
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	76,629	USD	5,014,602	0.19
MONGODB INC	3,279	USD	819,619	0.03
MONOLITHIC POWER	2,419	USD	1,987,644	0.08
MONSTER BEVERAGE CORP	29,107	USD	1,453,895	0.06
MOODY S CORP	12,693	USD	5,342,864	0.21
MORGAN STANLEY	74,670	USD	7,257,177	0.28
MOSAIC	19,712	USD	569,677	0.02
MOTOROLA SOLUTIONS INC	9,456	USD	3,650,489	0.14
MSCI INC -A-	5,996	USD	2,888,573	0.11
NASDAQ INC	50,799	USD	3,061,148	0.12
NETAPP	12,536	USD	1,614,637	0.06
NETFLIX INC	23,288	USD	15,716,605	0.60
NEWMONT CORPORATION	60,909	USD	2,550,260	0.10
NEXTERA ENERGY	126,660	USD	8,968,795	0.34
NIKE INC	74,424	USD	5,609,337	0.22
NORDSON	4,776	USD	1,107,745	0.04
NORTHERN TRUST CORP	20,028	USD	1,681,951	0.06
NUCOR CORP	14,012	USD	2,215,017	0.09
NVIDIA CORP	1,349,532	USD	166,721,182	6.41
O REILLY AUTO	3,032	USD	3,201,974	0.12
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	36,258	USD	2,285,342	0.09
OKTA -A-	9,339	USD	874,224	0.03
OLD DOMINION FREIGHT LINES INC	11,665	USD	2,060,039	0.08
OMNICOM GROUP INC	13,958	USD	1,252,033	0.05
ON SEMICONDUCTOR CORP	22,286	USD	1,527,705	0.06
ONEOK INC (NEW)	45,933	USD	3,745,836	0.14
ORACLE CORP	88,102	USD	12,440,002	0.48
OTIS WORLDWIDE CORPORATION	52,330	USD	5,037,286	0.19
OWENS CORNING SHS	9,773	USD	1,697,766	0.07

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

Etwaige Abweichungen bei den Prozentsatzen des Nettovermogens sind auf Rundungen zurckzufhren.



Cleome Index USA Equities

Anlageportfolio zum 30. Juni 2024

Bezeichnung	Anzahl	Wahrung	Marktwert (in USD)	% des NV
PACCAR INC	32,754	USD	3,371,697	0.13
PACKAGING CORP OF AMERICA	7,292	USD	1,331,228	0.05
PALANTIR TCHNLG - REGISTERED SHS -A-	92,970	USD	2,354,931	0.09
PALO ALTO NETWORKS	18,577	USD	6,297,789	0.24
PARKER-HANNIFIN CORP	9,289	USD	4,698,469	0.18
PAYCHEX INC	19,242	USD	2,281,332	0.09
PAYCOM SOFTWARE INC	4,154	USD	594,188	0.02
PAYPAL HOLDINGS	64,162	USD	3,723,321	0.14
PEPSICO INC	82,038	USD	13,530,527	0.52
PFIZER INC	314,723	USD	8,805,950	0.34
PG AND E CORP	271,081	USD	4,733,074	0.18
PHILLIPS 66	19,709	USD	2,782,320	0.11
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP INC	34,507	USD	5,365,148	0.21
PPG INDUSTRIES INC	18,194	USD	2,290,443	0.09
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP INC	22,811	USD	1,789,523	0.07
PROCTER & GAMBLE CO	133,418	USD	22,003,296	0.85
PROGRESSIVE CORP	34,951	USD	7,259,672	0.28
PROLOGIS	57,564	USD	6,465,013	0.25
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	40,027	USD	4,690,764	0.18
PTC INC	8,352	USD	1,517,308	0.06
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GROUP INC	58,416	USD	4,305,259	0.17
PUBLIC STORAGE INC	10,910	USD	3,138,262	0.12
QUALCOMM INC	62,005	USD	12,350,156	0.47
QUANTA SERVICES - REG SHS	12,023	USD	3,054,924	0.12
QUEST DIAGNOSTICS	16,538	USD	2,263,721	0.09
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	12,490	USD	1,543,889	0.06
REALTY INCOME CORP	41,963	USD	2,216,486	0.09
REGENERON PHARMACEUTICALS INC	5,757	USD	6,050,780	0.23
REGIONS FINANCIAL CORP	100,413	USD	2,012,277	0.08
RELIANCE STEEL ALUMINIUM CO	4,181	USD	1,194,094	0.05
RESMED	8,192	USD	1,568,113	0.06
REVVITY	8,122	USD	851,673	0.03
RIVIAN AUTOMOTIVE INC 	43,764	USD	587,313	0.02
ROCKWELL AUTOMATION	9,810	USD	2,700,497	0.10
ROPER TECHNOLOGIES	6,344	USD	3,575,859	0.14
ROSS STORES INC	15,202	USD	2,209,155	0.08
S&P GLOBAL INC	21,874	USD	9,755,804	0.37
SALESFORCE INC	54,335	USD	13,969,529	0.54
SBA COMMUNICATIONS -A	8,495	USD	1,667,569	0.06
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	14,682	USD	1,516,210	0.06
SEMPRA ENERGY	70,355	USD	5,351,201	0.21
SERVICENOW INC	11,707	USD	9,209,546	0.35
SHERWIN WILLIAMS CO	15,296	USD	4,564,785	0.18
SIMON PROPERTY GROUP - REG SHS	16,088	USD	2,442,158	0.09
SKYWORKS SOLUTIONS INC	9,793	USD	1,043,738	0.04
SNAP INC-A-	51,766	USD	859,833	0.03
SNAP ON INC	5,106	USD	1,334,657	0.05
STANLEY BLACK & DECKER INC	11,757	USD	939,267	0.04
STARBUCKS CORP	65,169	USD	5,073,407	0.19
STATE STREET CORP	43,866	USD	3,246,084	0.12
STEEL DYNAMICS	11,911	USD	1,542,475	0.06
STRYKER CORP	19,361	USD	6,587,580	0.25
SUN COMMUNITIES	4,820	USD	580,039	0.02
SUPER MICRO COMPUT -SHS-	2,757	USD	2,258,948	0.09
SYNCHRONY FINANCIAL	37,951	USD	1,790,908	0.07
SYNOPSYS	8,375	USD	4,983,628	0.19
SYSCO CORP	36,539	USD	2,608,519	0.10
T MOBILE USA INC	32,731	USD	5,766,548	0.22

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 USA Equities

Anlageportfolio zum 30. Juni 2024

Bezeichnung	Anzahl	Wahrung	Marktwert (in USD)	% des NV
T ROWE PRICE GROUP INC	19,697	USD	2,271,261	0.09
TAKE TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC	8,356	USD	1,299,274	0.05
TARGA RESOURCES CORP	17,779	USD	2,289,580	0.09
TARGET CORP	26,707	USD	3,953,704	0.15
TELEDYNE TECHNOLOGIES	3,837	USD	1,488,679	0.06
TESLA MOTORS INC	156,440	USD	30,956,346	1.19
TEXAS INSTRUMENTS INC	49,030	USD	9,537,806	0.37
THE CIGNA GROUP - REG SHS	18,610	USD	6,151,908	0.24
THE HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP	44,687	USD	4,492,831	0.17
THE KRAFT HEINZ	79,463	USD	2,560,298	0.10
THERMO FISHER SCIENT SHS	20,879	USD	11,546,087	0.44
TJX COS INC	67,690	USD	7,452,669	0.29
TRACTOR SUPPLY CO	5,775	USD	1,559,250	0.06
TRADEWEB MKTS/REGSH	12,703	USD	1,346,518	0.05
TRANSUNION	12,961	USD	961,188	0.04
TRAVELERS COS INC/THE	19,524	USD	3,970,010	0.15
TRIMBLE	19,728	USD	1,103,190	0.04
TRUIST FINANCIAL CORP	84,439	USD	3,280,455	0.13
TWILIO INC	11,973	USD	680,186	0.03
TYLER TECHNOLOGIES INC	2,331	USD	1,171,981	0.05
ULTA BEAUTY RG PREFERENTIAL SHARE	3,119	USD	1,203,529	0.05
UNITED PARCEL SERVICE INC	52,019	USD	7,118,800	0.27
UNITED RENTALS INC	4,622	USD	2,989,186	0.11
UNITED THERAPEUTICS CORP	2,892	USD	921,247	0.04
UNITEDHEALTH GROUP INC	51,962	USD	26,462,167	1.02
US BANCORP	102,170	USD	4,056,149	0.16
VALERO ENERGY CORP	19,466	USD	3,051,490	0.12
VEEVA SYSTEMS -A-	9,841	USD	1,801,001	0.07
VENTAS INC	42,286	USD	2,167,580	0.08
VERALTO CORPORATION	21,750	USD	2,076,473	0.08
VERISIGN INC	5,830	USD	1,036,574	0.04
VERISK ANALYTICS	12,299	USD	3,315,195	0.13
VERIZON COMMUNICATIONS INC	267,398	USD	11,027,494	0.42
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	16,076	USD	7,535,143	0.29
VIATRIS INC - REG SHS	109,295	USD	1,161,806	0.04
VISA INC -A-	94,245	USD	24,736,484	0.95
VULCAN MATERIALS CO	7,585	USD	1,886,238	0.07
W.P. CAREY	7,412	USD	408,031	0.02
WABTEC CORP	23,248	USD	3,674,346	0.14
WALGREENS BOOTS	67,050	USD	810,970	0.03
WALMART INC	243,903	USD	16,514,672	0.63
WALT DISNEY CO	110,485	USD	10,970,056	0.42
WARNER BROS DISCOVERY INC	148,204	USD	1,102,638	0.04
WASTE MANAGEMENT	27,243	USD	5,812,022	0.22
WATERS	4,650	USD	1,349,058	0.05
WELLTOWER OP - REG SHS	47,765	USD	4,979,502	0.19
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES INC	4,944	USD	1,628,504	0.06
WESTERN DIGITAL CORP	21,324	USD	1,615,719	0.06
WEYERHAEUSER CO	63,202	USD	1,794,304	0.07
WILLIAMS COS INC	109,814	USD	4,667,095	0.18
WILLIAMS-SONOMA	4,096	USD	1,156,588	0.04
WORKDAY INC -A-	13,370	USD	2,988,997	0.11
WW GRAINGER INC	4,139	USD	3,734,371	0.14
XYLEM INC	34,768	USD	4,715,584	0.18
YUM BRANDS INC	20,493	USD	2,714,503	0.10
ZEBRA TECHNOLOGIES -A-	2,965	USD	915,977	0.04
ZIMMER BIOMET HLDGS SHS	15,191	USD	1,648,679	0.06
ZOETIS INC -A-	26,631	USD	4,616,750	0.18

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

Etwige Abweichungen bei den Prozentsatzen des Nettovermogens sind auf Rundungen zuruckzufuhren.



Cleome Index USA Equities

Anlageportfolio zum 30. Juni 2024

Bezeichnung	Anzahl	Währung	Marktwert (in USD)	% des NV
			2,471,903,932	94.98
Aktien gesamt			2,574,325,786	98.91
Übertragbare Wertpapiere, die zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden gesamt			2,574,325,786	98.91
Sonstige übertragbare Wertpapiere				
Rechte				
Vereinigte Staaten von Amerika				
JOHNSON AND JOHNSONÄ	2,058	USD	0	0.00
			0	0.00
Gesamtrechte			0	0.00
Sonstige übertragbare Wertpapiere, insgesamt			0	0.00
Anlageportfolio gesamt			2,574,325,786	98.91
Erwerbskosten			1,741,332,055	

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



Cleome Index USA Equities

Geografische und wirtschaftliche Zusammensetzung des Wertpapierbestandes zum 30. Juni 2024

Geografische Zusammensetzung (in % des Nettovermögens)

Vereinigte Staaten von Amerika	94.98
Irland	2.24
Schweiz	0.40
Luxemburg	0.25
Niederlande	0.23
Niederländische Antillen	0.20
Jersey	0.19
Bermuda	0.17
Kanada	0.12
Liberia	0.08
Großbritannien	0.06
	98.91

Wirtschaftliche Zusammensetzung (in % des Nettovermögens)

Internet und Internet-Dienste	20.37
Elektronik und Halbleiter	10.93
Banken und andere Finanzinstitute	10.58
Büroausstattung und Computer	9.20
Pharmazeutika	7.70
Einzelhandel und Warenhäuser	7.53
Maschinen- und Apparatebau	3.09
Erdöl	3.00
Versorger	2.41
Lebensmittel und alkoholfreie Getränke	2.33
Versicherungen	2.30
Immobilien	2.12
Sonstige Dienstleistungen	1.86
Gesundheitswesen	1.76
Kommunikation	1.74
Sonstige Konsumgüter	1.58
Kraftfahrzeuge	1.58
Grafik und Verlage	1.27
Elektrotechnik	1.19
Hotels und Restaurants	1.17
Biotechnologie	1.12
Transport	0.80
Baumaterialien	0.75
Chemikalien	0.68
Textilien und Bekleidung	0.58
Umweltdienste und Recycling	0.35
Edelmetalle und Edelsteine	0.26
Kohlebergbau und Stahlindustrie & Chemie	0.14
Papier und Forsterzeugnisse	0.13
Verpackungsindustrie	0.12
Tabak und alkoholische Getränke	0.10
NE-Metalle	0.08
Landwirtschaft und Fischerei	0.06
Luft- und Raumfahrt	0.03
	98.91



Cleome Index World Equities

Anlageportfolio zum 30. Juni 2024

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				
Anteile				
Australien				
ANZ BANKING GROUP LTD	10,730	AUD	188,818	0.12
BRAMBLES	14,148	AUD	128,097	0.08
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	4,877	AUD	387,109	0.25
CSL LTD	1,286	AUD	236,565	0.16
FORTESCUE LTD	5,768	AUD	76,952	0.05
GOODMAN GROUP - STAPLED SECURITY	8,094	AUD	175,266	0.12
MACQUARIE GROUP	1,327	AUD	169,257	0.11
MINERAL RESOURCES	2,023	AUD	67,971	0.04
NAT. AUSTRALIA BANK	10,210	AUD	230,501	0.15
RIO TINTO	1,752	AUD	129,915	0.09
SCENTRE GRP - STAPLED SECURITY	79,773	AUD	155,092	0.10
SUNCORP GROUP	10,960	AUD	118,902	0.08
TRANSURBAN GROUP	24,544	AUD	189,647	0.12
WESFARMERS	4,381	AUD	177,937	0.12
WESTPAC BANKING CORP	11,195	AUD	189,955	0.13
WOODSIDE ENERGY SHARES	8,433	AUD	148,240	0.10
WOOLWORTHS GRP - REGISTERED	4,565	AUD	96,119	0.06
			2,866,343	1.89
Belgien				
ANHEUSER-BUSCH INBEV	2,203	EUR	119,226	0.08
UCB	819	EUR	113,595	0.07
			232,821	0.15
Bermuda				
ARCH CAPITAL GROUP LTD	1,692	USD	159,278	0.10
			159,278	0.10
Kanada				
AGNICO EAGLE MINES LTD	2,424	CAD	147,898	0.10
BANK OF MONTREAL	2,463	CAD	192,851	0.13
BANK OF NOVA SCOTIA	4,997	CAD	213,230	0.14
BROOKFIELD PREFERENTIAL SHARE	4,892	CAD	189,802	0.13
CAMECO CORP	2,637	CAD	121,030	0.08
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	4,657	CAD	206,565	0.14
CANADIAN NATIONAL RAILWAY	2,863	CAD	315,593	0.21
CANADIAN NATURAL RESOURCES	6,828	CAD	226,878	0.15
ENBRIDGE INC	7,221	CAD	239,641	0.16
FAIRFAX FINANCIAL HOLDINGS SUB.VTG	100	CAD	106,122	0.07
FRANCO-NEVADA CORP	765	CAD	84,609	0.06
KINROSS GOLD CORP	12,464	CAD	96,802	0.06
MAGNA INTL SHS -A- SUB.VTG	2,371	CAD	92,703	0.06
MANULIFE FINANCIAL REGISTERED	6,987	CAD	173,561	0.11
NATIONAL BK CANADA	2,332	CAD	172,545	0.11
NORTHLAND POWER INC	7,363	CAD	118,085	0.08
NUTRIEN - REGISTERED	2,280	CAD	108,283	0.07
ROYAL BANK OF CANADA	3,947	CAD	391,995	0.26
SHOPIFY -A- SUBORD VOTING	3,410	CAD	210,220	0.14
SUN LIFE FINANCIAL INC	2,500	CAD	114,350	0.08
SUNCOR ENERGY INC	4,951	CAD	176,056	0.12
TC ENERGY - REG SHS	4,566	CAD	161,462	0.11
TECK RESOURCES LTD -B-	2,831	CAD	126,556	0.08
TORONTO DOMINION BANK	5,425	CAD	278,177	0.18
			4,265,014	2.81
Kaimaninseln				
CK HUTCHISON	23,000	HKD	102,801	0.07
			102,801	0.07

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

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



Cleome Index World Equities

Anlageportfolio zum 30. Juni 2024

Bezeichnung	Anzahl	Wahrung	Marktwert (in EUR)	% des NV
Danemark				
DANSKE BANK	4,062	DKK	113,023	0.07
DSV A/S	671	DKK	96,006	0.06
GENMAB AS	390	DKK	91,258	0.06
NOVO NORDISK - BEARER AND/OR - REG SHS	8,254	DKK	1,113,011	0.73
NOVOZYMES -B-ORSTED	1,769	DKK	101,077	0.07
ORSTED	1,531	DKK	76,083	0.05
VESTAS WIND SYSTEMS - BEARER AND/OR SHS	4,986	DKK	107,811	0.07
			1,698,269	1.12
Finnland				
KONE OYJ -B-NOKIA OYJ	3,383	EUR	155,922	0.10
	28,374	EUR	100,969	0.07
			256,891	0.17
Frankreich				
ACCOR SA	2,718	EUR	104,099	0.07
AIR LIQUIDE SA	1,720	EUR	277,402	0.18
AXA SA	4,668	EUR	142,701	0.09
BNP PARIBAS SA	3,191	EUR	189,960	0.13
CAPGEMINI SE	689	EUR	127,947	0.08
CARREFOUR SA	6,250	EUR	82,500	0.05
CIE DE SAINT-GOBAIN	2,454	EUR	178,209	0.12
DANONE SA	3,525	EUR	201,207	0.13
ENGIE SA	6,687	EUR	89,171	0.06
ESSILORLUXOTTICA SA	727	EUR	146,272	0.10
HERMES INTERNATIONAL SA	100	EUR	214,000	0.14
KERING	274	EUR	92,749	0.06
LEGRAND SA	2,260	EUR	209,366	0.14
L'OREAL SA	599	EUR	245,620	0.16
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	681	EUR	485,962	0.32
ORANGE	9,289	EUR	86,889	0.06
PERNOD RICARD SA	627	EUR	79,441	0.05
SANOFI	2,996	EUR	269,460	0.18
SCHNEIDER ELECTRIC SE	2,273	EUR	509,834	0.34
SOCIETE GENERALE SA	3,797	EUR	83,230	0.05
TOTALENERGIES SE	6,650	EUR	414,494	0.27
VINCI SA	1,535	EUR	151,013	0.10
VIVENDI SA	8,630	EUR	84,194	0.06
			4,465,720	2.94
Deutschland				
ADIDAS AG - REG SHS	605	EUR	134,915	0.09
ALLIANZ SE PREFERENTIAL SHARE	849	EUR	220,316	0.15
BASF SE PREFERENTIAL SHARE	2,421	EUR	109,393	0.07
BMW AG	1,220	EUR	107,824	0.07
DEUTSCHE BANK AG PREFERENTIAL SHARE	7,985	EUR	119,040	0.08
DEUTSCHE BOERSE AG - REG SHS	948	EUR	181,163	0.12
DEUTSCHE POST AG - REG SHS	4,125	EUR	155,884	0.10
DEUTSCHE TELEKOM AG - REG SHS	9,607	EUR	225,573	0.15
E.ON SE	15,019	EUR	184,058	0.12
HENKEL AG & CO KGAA PREFERENTIAL SHARE	1,020	EUR	84,884	0.06
INFINEON TECHNOLOGIES - REG SHS	4,522	EUR	155,127	0.10
MERCEDES-BENZ GROUP	2,460	EUR	158,842	0.10
MUENCHENER RUECK - REG SHS	532	EUR	248,444	0.16
SAP AG	2,930	EUR	555,293	0.37
SIEMENS AG PREFERENTIAL SHARE	2,258	EUR	392,259	0.26
SIEMENS ENERGY - REG SHS	3,070	EUR	74,632	0.05
VONOVIA SE	3,456	EUR	91,758	0.06
			3,199,405	2.11
Hongkong				
AIA GROUP LTD	27,800	HKD	176,084	0.12

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 World Equities

Anlageportfolio zum 30. Juni 2024

Bezeichnung	Anzahl	Wahrung	Marktwert (in EUR)	% des NV
HANG SENG BANK LTD	5,900	HKD	70,792	0.05
HONG KONG CHINA GAS	110,623	HKD	78,529	0.05
HONG KONG EXCHANGES AND CLEARING LTD	4,500	HKD	134,555	0.09
SUN HUNG KAI PROPERTIES LTD	7,500	HKD	60,546	0.04
THE LINK REIT UNITS	20,900	HKD	75,806	0.05
			596,312	0.39
Irland				
ACCENTURE - SHS CLASS A	1,667	USD	471,923	0.31
AON PREFERENTIAL SHARE	511	USD	139,977	0.09
BANK OF IRELAND - REGISTERED	7,816	EUR	76,347	0.05
EATON CORPORATION PUBLIC LIMITED COMPANY	1,260	USD	368,624	0.24
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	640	EUR	109,189	0.07
JOHNSON CONTROLS INTL	2,731	USD	169,377	0.11
KERRY GROUP -A-	1,510	EUR	114,233	0.08
LINDE PLC	1,370	USD	560,923	0.37
MEDTRONIC HLD	3,524	USD	258,805	0.17
TRANE TECH - REG SHS	858	USD	263,328	0.17
			2,532,726	1.67
Israel				
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	912	USD	140,406	0.09
			140,406	0.09
Italien				
ASSICURAZIONI GENERALI SPA	4,624	EUR	107,693	0.07
ENEL SPA	31,428	EUR	204,093	0.13
ENI SPA	10,594	EUR	152,066	0.10
INTESA SANPAOLO	68,161	EUR	236,587	0.16
SNAM SPA	28,294	EUR	116,883	0.08
UNICREDIT SPA - REG SHS	5,302	EUR	183,476	0.12
			1,000,798	0.66
Japan				
ADVANTEST CORP	2,700	JPY	100,623	0.07
BRIDGESTONE CORP	4,300	JPY	157,682	0.10
CANON INC	5,600	JPY	141,428	0.09
CENTRAL JAPAN RAILWAY CO	8,900	JPY	179,289	0.12
DAI-ICHI LIFE HOLDINGS INC	3,600	JPY	89,749	0.06
DAIICHI SANKYO CO LTD	5,500	JPY	176,228	0.12
DAIWA SECURITIES GROUP INC	20,300	JPY	144,477	0.10
DENSO CORP	9,800	JPY	141,996	0.09
EAST JAPAN RAILWAY CO	10,800	JPY	166,916	0.11
FANUC CORP SHS	5,900	JPY	150,887	0.10
FAST RETAILING CO LTD	600	JPY	141,159	0.09
FUJIFILM HOLDINGS CORP	8,700	JPY	189,844	0.13
HITACHI LTD	17,500	JPY	365,527	0.24
HONDA MOTOR CO LTD	19,257	JPY	192,121	0.13
HOYA CORP	1,500	JPY	162,745	0.11
KAO CORP	2,500	JPY	94,605	0.06
KDDI CORP	6,400	JPY	157,920	0.10
KEYENCE CORP	600	JPY	245,531	0.16
KIRIN HOLDINGS CO LTD	13,000	JPY	156,315	0.10
KUBOTA CORP	9,100	JPY	118,763	0.08
KYOCERA CORP	11,600	JPY	124,578	0.08
MINITUBISHI ELECTRIC CORP	10,700	JPY	159,350	0.10
MINITUBISHI ESTATE	8,100	JPY	118,398	0.08
MINITUBISHI HEAVY INDUSTRIES LTD	13,700	JPY	136,919	0.09
MINITUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC	32,061	JPY	321,537	0.21
MINITSUI AND CO LTD	10,400	JPY	220,244	0.15
MINITSUI FUDOSAN CO LTD	15,100	JPY	128,620	0.08
MS&AD INSURANCE GROUP HOLDING	4,900	JPY	101,609	0.07
MURATA MANUFACTURING CO LTD	6,600	JPY	127,175	0.08

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

Etwlige Abweichungen bei den Prozentsatzen des Nettovermogens sind auf Rundungen zurckzufhren.



Cleome Index World Equities

Anlageportfolio zum 30. Juni 2024

Bezeichnung	Anzahl	Wahrung	Marktwert (in EUR)	% des NV
NINTENDO CO LTD	3,500	JPY	173,699	0.11
NIPPON TELEGRAPH AND TELEPHONE CORP	118,300	JPY	104,163	0.07
NOMURA HOLDINGS INC	23,500	JPY	125,677	0.08
ONO PHARMACEUTICAL CO LTD	10,600	JPY	135,050	0.09
ORIX CORP	7,800	JPY	160,704	0.11
OTSUKA HOLDINGS	2,400	JPY	94,245	0.06
PANASONIC HLDGS - REG SHS	14,400	JPY	110,004	0.07
RECRUIT HOLDINGS CO LTD	4,700	JPY	234,643	0.15
SECOM CO LTD	2,200	JPY	121,190	0.08
SEKISUI HOUSE LTD	7,200	JPY	148,801	0.10
SHIN-ETSU CHEM. CO LTD	6,200	JPY	224,334	0.15
SHISEIDO	2,200	JPY	58,547	0.04
SMC CORP	300	JPY	132,841	0.09
SOFTBANK GROUP	2,800	JPY	168,745	0.11
SONY CORP	3,800	JPY	300,647	0.20
SUMITOMO ELECTRIC INDUSTRIES LTD	8,900	JPY	129,188	0.09
TOKIO MARINE HOLDINGS INC	5,600	JPY	195,056	0.13
TOKYO ELECTRON LTD	1,400	JPY	283,408	0.19
TOKYO GAS CO LTD	3,900	JPY	78,158	0.05
TOKYU CORP	12,700	JPY	130,535	0.09
TOYOTA MOTOR CORP	29,600	JPY	564,867	0.37
WEST JAPAN RAILWAY COMPANY	8,400	JPY	145,927	0.10
YASKAWA ELECTRIC CORP	2,400	JPY	80,421	0.05
			8,613,085	5.67
Jersey				
APTIV PLC	1,374	USD	90,280	0.06
FERGUSON NEWCO PLC	957	USD	172,916	0.11
WPP PLC	11,771	GBP	100,571	0.07
			363,767	0.24
Luxemburg				
PINTEREST PREFERENTIAL SHARE -A-	2,130	USD	87,585	0.06
SNOWFLAKE INC-CLASS A	973	USD	122,643	0.08
THE TRADE DESK -A-	1,256	USD	114,461	0.08
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS INCÅ	1,182	USD	65,279	0.04
			389,968	0.26
Niederlandische Antillen				
SLB	5,212	USD	229,440	0.15
			229,440	0.15
Niederlande				
ADYEN	62	EUR	69,018	0.05
AKZO NOBEL NV	2,289	EUR	129,969	0.09
ASML HOLDING NV	1,025	EUR	988,305	0.65
HEINEKEN NV	1,134	EUR	102,400	0.07
ING GROUP NV	11,131	EUR	177,673	0.12
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	5,589	EUR	154,201	0.10
LYONDELLBASELL -A-	1,272	USD	113,533	0.07
NXP SEMICONDUCTORS	903	USD	226,721	0.15
PROSUS NV	3,957	EUR	131,610	0.09
QIAGEN NV - REG SHS	2,303	EUR	88,781	0.06
WOLTERS KLUWER NV	1,371	EUR	212,231	0.14
			2,394,442	1.58
Neuseeland				
MERCURY NZ	42,725	NZD	159,473	0.11
			159,473	0.11
Norwegen				
AKER BP SHS	4,966	NOK	118,455	0.08
EQUINOR ASA	5,598	NOK	149,105	0.10
			267,560	0.18
Singapur				
KEPPEL LTD	32,500	SGD	144,768	0.10

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 World Equities

Anlageportfolio zum 30. Juni 2024

Bezeichnung	Anzahl	Wahrung	Marktwert (in EUR)	% des NV
SINGAPORE TELECOM - SH BOARD LOT 1000	80,900	SGD	153,167	0.10
			297,935	0.20
Spanien				
AMADEUS IT GROUP SA -A-	2,259	EUR	140,374	0.09
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA	18,003	EUR	168,364	0.11
BANCO SANTANDER SA - REG SHS	34,949	EUR	151,347	0.10
CELLNEX TELECOM SA	2,336	EUR	70,944	0.05
EDP RENOVAVEIS SA	8,011	EUR	104,543	0.07
IBERDROLA SA	20,964	EUR	253,979	0.17
INDITEX SHARE FROM SPLIT	2,985	EUR	138,385	0.09
REPSOL SA	7,587	EUR	111,794	0.07
TELEFONICA SA	14,160	EUR	56,074	0.04
			1,195,804	0.79
Schweden				
ASSA ABLOY -B- NEW I	7,102	SEK	187,468	0.12
ATLAS COPCO AB -A-	14,642	SEK	256,977	0.17
BOLIDEN - REG SHS	4,898	SEK	146,336	0.10
EPIROC - REG SHS -A-	7,105	SEK	132,397	0.09
EVOLUTION AB	848	SEK	82,484	0.05
INVESTOR - REG SHS -B-	6,660	SEK	170,285	0.11
SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN -A-	9,083	SEK	125,241	0.08
SWEDBANK -A-	5,020	SEK	96,463	0.06
			1,197,651	0.79
Schweiz				
ABB LTD PREFERENTIAL SHARE	7,618	CHF	394,881	0.26
ALCON - REG SHS	2,078	CHF	173,093	0.11
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT & SP - REG SHS	1	CHF	107,783	0.07
CHUBB - REG SHS	1,184	USD	281,796	0.19
CIE FINANCIERE RICHEMONT - REG SHS	1,374	CHF	200,097	0.13
GEBERIT AG	260	CHF	143,303	0.09
GIVAUDAN SA - REG SHS	43	CHF	190,208	0.13
LONZA GROUP	242	CHF	123,230	0.08
NESTLE SA PREFERENTIAL SHARE	6,799	CHF	647,531	0.43
NOVARTIS AG PREFERENTIAL SHARE	5,197	CHF	518,971	0.34
ROCHE HOLDING LTD	1,876	CHF	486,020	0.32
SANDOZ GROUP AG	2,050	CHF	69,266	0.05
TE CONNECTIVITY LTD - REG SHS	1,259	USD	176,712	0.12
UBS GROUP SA	8,754	CHF	240,427	0.16
ZURICH INSURANCE GROUP - REG SHS	409	CHF	203,470	0.13
			3,956,788	2.61
Grobritannien				
3I GROUP PLC	5,728	GBP	207,136	0.14
ANGLO AMERICAN PLC	4,307	GBP	127,099	0.08
ASTRAZENECA PLC	4,050	GBP	590,221	0.39
ATLIASSIAN CORPORATION PL	551	USD	90,936	0.06
AVIVA PLC	24,700	GBP	138,846	0.09
BARCLAYS PLC	41,777	GBP	102,933	0.07
BP PLC	47,562	GBP	266,574	0.18
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS	225	EUR	15,298	0.01
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS	1,467	EUR	100,343	0.07
COMPASS GROUP	7,720	GBP	196,676	0.13
DIAGEO PLC	6,120	GBP	179,699	0.12
EXPERIAN GROUP	3,746	GBP	162,856	0.11
GSK REG SHS	12,410	GBP	223,873	0.15
HALEON PLC REGISTERED SHARE	26,134	GBP	99,438	0.07
HSBC HOLDINGS PLC	46,872	GBP	378,083	0.25
LAND SEC R.E.I.T	15,129	GBP	110,543	0.07
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	28,923	GBP	77,437	0.05
LLOYDS BANKING GROUP PLC	244,324	GBP	157,744	0.10

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 World Equities

Anlageportfolio zum 30. Juni 2024

Bezeichnung	Anzahl	Wahrung	Marktwert (in EUR)	% des NV
LSE GROUP	1,633	GBP	181,049	0.12
M AND G REGISTERED SHS	38,828	GBP	93,424	0.06
NATIONAL GRID PLC	16,949	GBP	176,437	0.12
PRUDENTIAL PLC	8,972	GBP	76,022	0.05
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	2,161	GBP	109,140	0.07
RELX PLC	7,591	GBP	325,808	0.21
RIO TINTO PLC	3,807	GBP	233,534	0.15
SEVERN TRENT PLC	4,614	GBP	129,520	0.09
SHELL PLC	6,293	GBP	210,348	0.14
SHELL PLC	10,801	GBP	362,860	0.24
STANDARD CHARTERED PLC	8,138	GBP	68,725	0.05
UNILEVER	1,407	GBP	72,105	0.05
UNILEVER	4,503	GBP	230,914	0.15
VODAFONE GROUP PLC	113,460	GBP	93,353	0.06
WHITBREAD	2,862	GBP	100,424	0.07
			5,689,398	3.75
Vereinigte Staaten von Amerika				
3M CO	1,847	USD	176,109	0.12
ABBOTT LABORATORIES	4,481	USD	434,449	0.29
ABBVIE INC	4,347	USD	695,682	0.46
ADOBE INC	1,153	USD	597,656	0.39
ADVANCED MICRO DEVICES INC	4,147	USD	627,651	0.41
AFLAC INC	2,062	USD	171,829	0.11
AGILENT TECHNOLOGIES	938	USD	113,453	0.07
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	707	USD	170,228	0.11
AIRBNB INC	1,236	USD	174,868	0.12
ALBEMARLE - REGISTERED SHS	576	USD	51,336	0.03
ALIGN TECHNOLOGY INC	246	USD	55,416	0.04
ALLSTATE CORP	997	USD	148,524	0.10
ALPHABET INC -A-	13,774	USD	2,340,969	1.54
ALPHABET INC -C-	13,586	USD	2,325,117	1.53
AMAZON.COM INC	23,169	USD	4,177,661	2.75
AMERICAN EXPRESS	1,635	USD	353,239	0.23
AMERICAN INTL	2,625	USD	181,833	0.12
AMERICAN TOWER CORP	1,451	USD	263,163	0.17
AMERICAN WATER WORKS CO INC	1,371	USD	165,224	0.11
AMERIPRISE FINANCIAL INC	512	USD	204,079	0.13
AMETEK INC	1,432	USD	222,747	0.15
AMGEN INC	1,344	USD	391,820	0.26
AMPHENOL -A-	4,264	USD	268,034	0.18
ANALOG DEVICES INC	1,466	USD	312,227	0.21
APOLLO GLB MGMT - REG SHS	1,753	USD	193,120	0.13
APPLE INC	36,229	USD	7,119,712	4.69
APPLIED MATERIALS INC	2,281	USD	502,256	0.33
ARCHER-DANIELS MIDLAND CO	1,820	USD	102,654	0.07
ARISTA NETWORKS INC	721	USD	235,779	0.16
AT&T INC	19,089	USD	340,369	0.22
ATMOS ENERGY CORP	1,397	USD	152,050	0.10
AUTODESK INC	828	USD	191,172	0.13
AUTOMATIC DATA PROCESSING INC	1,482	USD	330,057	0.22
AUTOZONE INC	65	USD	179,768	0.12
BALL CORP	2,264	USD	126,788	0.08
BANK OF AMERICA CORP	18,161	USD	673,910	0.44
BANK OF NY MELLON	4,058	USD	226,763	0.15
BAXTER INTERNATIONAL INC	1,931	USD	60,268	0.04
BECTON DICKINSON	818	USD	178,376	0.12
BIOGEN IDEC INC	531	USD	114,856	0.08
BLACKROCK INC	422	USD	310,006	0.20

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

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



Cleome Index World Equities

Anlageportfolio zum 30. Juni 2024

Bezeichnung	Anzahl	Wahrung	Marktwert (in EUR)	% des NV
BLACKSTONE INC - REGISTERED SHS	2,041	USD	235,760	0.16
BLOCK INC -A-	1,675	USD	100,789	0.07
BOOKING HOLDINGS INC	92	USD	340,059	0.22
BOSTON PROPERTIES INC	1,090	USD	62,608	0.04
BOSTON SCIENTIF CORP	4,172	USD	299,777	0.20
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	5,564	USD	215,603	0.14
BROADCOM INC - REGISTERED SHS	1,093	USD	1,637,363	1.08
CADENCE DESIGN SYSTEMS INC	906	USD	260,155	0.17
CAESARS ENTERTAINMENT - REGISTERED SHS	2,015	USD	74,715	0.05
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	1,191	USD	153,855	0.10
CARDINAL HEALTH	1,324	USD	121,461	0.08
CARRIER GLOBAL CORP-WI	3,014	USD	177,395	0.12
CATERPILLAR - REG SHS	1,320	USD	410,256	0.27
CENCORA INC	762	USD	160,185	0.11
CENTENE CORP	1,806	USD	111,722	0.07
CHARLES SCHWAB CORP/THE	3,975	USD	273,308	0.18
CHARTER COMM -A-	307	USD	85,637	0.06
CHENIERE ENERGY INC	1,165	USD	190,041	0.13
CHIPOTLE MEXICAN GRILL -A-	4,350	USD	254,283	0.17
CHURCH AND DWIGHT CO	1,418	USD	137,176	0.09
CINTAS	384	USD	250,898	0.17
CISCO SYSTEMS INC	10,440	USD	462,799	0.30
CITIGROUP INC	5,547	USD	328,447	0.22
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	2,688	USD	90,365	0.06
CLOROX CO	599	USD	76,273	0.05
CME GROUP -A-	1,125	USD	206,368	0.14
COCA-COLA CO	10,301	USD	611,765	0.40
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS -A-	2,136	USD	135,524	0.09
COINBASE GLOBAL - REG SHS -A-	512	USD	106,164	0.07
COLGATE-PALMOLIVE CO	2,596	USD	235,051	0.15
COMCAST CORP	10,491	USD	383,324	0.25
CONAGRA BRANDS INC	5,261	USD	139,508	0.09
CONOCOPHILLIPS CO	3,395	USD	362,323	0.24
CONSOLIDATED EDISON INC	2,966	USD	247,464	0.16
CONSTELLATION BRANDS INC -A-	599	USD	143,794	0.09
CONSTELLATION ENERGY	1,009	USD	188,544	0.12
CORNING INC	3,745	USD	135,753	0.09
COSTCO WHOLESALE CORP	1,105	USD	876,360	0.58
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC	620	USD	221,673	0.15
CROWN CASTLE INC	1,571	USD	143,211	0.09
CUMMINS - REGISTERED	668	USD	172,605	0.11
CVS HEALTH	3,443	USD	189,730	0.12
DANAHER CORP	1,841	USD	429,180	0.28
DATADOG INC	911	USD	110,238	0.07
DECKERS OUTDOOR	116	USD	104,765	0.07
DEERE AND CO	746	USD	260,068	0.17
DELL TECHNOLOGIES PREFERENTIAL SHARE	835	USD	107,446	0.07
DEVON ENERGY CORP	3,167	USD	140,066	0.09
DEXCOM INC	1,226	USD	129,698	0.09
DIGITAL REALTY TRUST INC	1,055	USD	149,674	0.10
DISCOVER FINANCIAL SERVICES - SHS	1,017	USD	124,128	0.08
DOLLAR GENERAL	754	USD	93,027	0.06
DOLLAR TREE INC	714	USD	71,130	0.05
DOVER CORP	1,245	USD	209,620	0.14
DOW - REG SHS	2,357	USD	116,668	0.08
DOWDUPONT - REG SHS	1,833	USD	137,661	0.09
EBAY INC	2,488	USD	124,708	0.08
ECOLAB INC	1,083	USD	240,498	0.16

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

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



Cleome Index World Equities

Anlageportfolio zum 30. Juni 2024

Bezeichnung	Anzahl	Wahrung	Marktwert (in EUR)	% des NV
EDISON INTERNATIONAL	2,457	USD	164,625	0.11
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	2,149	USD	185,214	0.12
ELECTRONIC ARTS - REGSHS	1,209	USD	157,173	0.10
ELEVANCE HEALTH	672	USD	339,753	0.22
ELI LILLY & CO	2,021	USD	1,707,276	1.12
EMERSON ELECTRIC CO	2,270	USD	233,322	0.15
ENPHASE ENERGY	478	USD	44,471	0.03
EOG RESOURCES INC	1,972	USD	231,598	0.15
EQTY RESIDENTIAL PPTYS TR SHS BEN.INT.	2,351	USD	152,105	0.10
EQUIFAX INC	527	USD	119,222	0.08
EQUINIX INC	309	USD	218,138	0.14
ESSEX PROPERTY TRUST	518	USD	131,560	0.09
ESTEE LAUDER COMPANIES INC -A-	719	USD	71,380	0.05
EXPEDITORS INTERNATIONAL OF WASHINGTON	1,388	USD	161,612	0.11
EXXON MOBIL CORP	11,298	USD	1,213,553	0.80
FAIR ISAAC CORP	103	USD	143,067	0.09
FASTENAL CO	2,949	USD	172,909	0.11
FEDEX CORP	832	USD	232,766	0.15
FIDELITY NATIONAL INFO SERVICES INC	2,306	USD	162,146	0.11
FIFTH THIRD BANCORP	3,587	USD	122,127	0.08
FIRST SOLAR INC	357	USD	75,101	0.05
FISERV INC	2,233	USD	310,526	0.20
FORD MOTOR	12,106	USD	141,646	0.09
FORTINET	2,378	USD	133,727	0.09
FORTIVE CORP	2,340	USD	161,786	0.11
FOX CORP -A-	2,474	USD	79,339	0.05
FRANKLIN RESOURCES INC	3,672	USD	76,575	0.05
FREEPORT MCMORAN COPPER AND GOLD INC	6,100	USD	276,613	0.18
GE HEALTHCARE TECHNOLOGIES INC  	1,240	USD	90,152	0.06
GENERAL ELECTRI	3,051	USD	452,547	0.30
GENERAL MILLS INC	2,991	USD	176,544	0.12
GENERAL MOTORS CO	3,575	USD	154,975	0.10
GENUINE PARTS CO	758	USD	97,827	0.06
GILEAD SCIENCES INC	3,606	USD	230,845	0.15
GS ACQN HLDG - REGISTERED SHS -A-	1,291	USD	104,280	0.07
HALLIBURTON	3,675	USD	115,831	0.08
HCA INC	648	USD	194,252	0.13
HENRY SCHEIN INC	1,217	USD	72,787	0.05
HESS CORP	1,297	USD	178,524	0.12
HOME DEPOT INC	2,515	USD	807,804	0.53
HP ENTERPRISE CO	5,127	USD	101,272	0.07
HP INC	4,890	USD	159,783	0.11
HUBBELL	464	USD	158,230	0.10
HUBSPOT INC	208	USD	114,464	0.08
HUMANA INC	395	USD	137,711	0.09
HUNTINGTON BANCSHARES INC	9,095	USD	111,847	0.07
IBM CORP	2,526	USD	407,624	0.27
IDEXX LABS CORP	265	USD	120,465	0.08
ILLINOIS TOOL WORKS	1,169	USD	258,462	0.17
INCYTE CORP	1,541	USD	87,162	0.06
INGERSOLL RAND INC	2,670	USD	226,305	0.15
INTEL CORP	10,897	USD	314,887	0.21
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	2,353	USD	300,539	0.20
INTERNATIONAL PAPER CO	1,525	USD	61,398	0.04
INTL FLAVORS & FRAG	1,177	USD	104,560	0.07
INTUIT	765	USD	469,107	0.31
INTUITIVE SURGICAL	927	USD	384,769	0.25
IQVIA HOLDINGS INC	573	USD	113,044	0.07

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

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



Cleome Index World Equities

Anlageportfolio zum 30. Juni 2024

Bezeichnung	Anzahl	Wahrung	Marktwert (in EUR)	% des NV
J.M. SMUCKER CO SHS	893	USD	90,854	0.06
JOHNSON & JOHNSON	5,731	USD	781,566	0.51
JPMORGAN CHASE CO	6,994	USD	1,319,903	0.87
KELLANOVA	2,568	USD	138,206	0.09
KENVUE INC	5,932	USD	100,624	0.07
KEYCORP	5,660	USD	75,044	0.05
KIMBERLY-CLARK CORP	1,287	USD	165,956	0.11
KINDER MORGAN INC	9,897	USD	183,488	0.12
KKR & CO - REG SHS	2,176	USD	213,671	0.14
KLA CORPORATION	428	USD	329,265	0.22
KROGER CO	2,769	USD	129,000	0.08
LABCORP HOLDINGS INC	626	USD	118,868	0.08
LAM RESEARCH CORP	388	USD	385,502	0.25
LOEWS CORP	2,043	USD	142,471	0.09
LOWE'S CO INC	1,659	USD	341,258	0.22
LULULEMON ATHLETICA INC SHS WHEN ISSUED	377	USD	105,071	0.07
M&T BANK CORPORATION	821	USD	115,947	0.08
MARATHON PETROLEUM	1,170	USD	189,383	0.12
MARRIOTT INTERNATIONAL -A-	939	USD	211,824	0.14
MARSH MCLENNAN COS	1,508	USD	296,492	0.20
MARVELL TECH --- REGISTERED SHS	2,517	USD	164,160	0.11
MASTERCARD INC -A-	2,166	USD	891,582	0.59
MCCORMICK & CO INC NON VOTING	1,309	USD	86,644	0.06
MCDONALD'S CORP	1,937	USD	460,579	0.30
MCKESSON CORP	427	USD	232,690	0.15
MERCADOLIBRE	129	USD	197,806	0.13
MERCK & CO INC	6,648	USD	767,924	0.51
META PLATFORMS INC A	5,440	USD	2,559,324	1.69
METLIFE INC	1,737	USD	113,758	0.07
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL	101	USD	131,707	0.09
MICRON TECHNOLOGY INC	2,907	USD	356,760	0.23
MICROSOFT CORP	17,487	USD	7,292,572	4.80
MICROSTRATEGY -A-	40	USD	51,411	0.03
MODERNA INC	876	USD	97,061	0.06
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	3,904	USD	238,374	0.16
MONGODB INC	319	USD	74,399	0.05
MONSTER BEVERAGE CORP	2,610	USD	121,642	0.08
MOODY S CORP	637	USD	250,182	0.16
MORGAN STANLEY	3,279	USD	297,351	0.20
MOTOROLA SOLUTIONS INC	542	USD	195,231	0.13
MSCI INC -A-	307	USD	137,996	0.09
NETFLIX INC	1,097	USD	690,780	0.45
NEWMONT CORPORATION	3,465	USD	135,367	0.09
NEXTERA ENERGY	5,690	USD	375,936	0.25
NIKE INC	3,526	USD	247,963	0.16
NORTHERN TRUST CORP	1,571	USD	123,100	0.08
NUCOR CORP	1,077	USD	158,854	0.10
NVIDIA CORP	61,582	USD	7,098,520	4.68
O REILLY AUTO	201	USD	198,057	0.13
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	2,643	USD	155,436	0.10
OLD DOMINION FREIGHT LINES INC	686	USD	113,037	0.07
OMNICOM GROUP INC	1,323	USD	110,728	0.07
ON SEMICONDUCTOR CORP	1,507	USD	96,389	0.06
ORACLE CORP	4,136	USD	544,906	0.36
OTIS WORLDWIDE CORPORATION	2,736	USD	245,736	0.16
PACCAR INC	2,175	USD	208,906	0.14
PALANTIR TCHNLG - REGISTERED SHS -A-	4,698	USD	111,033	0.07
PALO ALTO NETWORKS	936	USD	296,070	0.19

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

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



Cleome Index World Equities

Anlageportfolio zum 30. Juni 2024

Bezeichnung	Anzahl	Wahrung	Marktwert (in EUR)	% des NV
PARKER-HANNIFIN CORP	524	USD	247,301	0.16
PAYCHEX INC	1,359	USD	150,336	0.10
PAYCOM SOFTWARE INC	324	USD	43,242	0.03
PAYPAL HOLDINGS	3,121	USD	168,987	0.11
PEPSICO INC	3,592	USD	552,767	0.36
PFIZER INC	14,656	USD	382,622	0.25
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP INC	1,426	USD	206,871	0.14
PPG INDUSTRIES INC	1,197	USD	140,602	0.09
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP INC	1,215	USD	88,936	0.06
PROCTER & GAMBLE CO	5,554	USD	854,645	0.56
PROGRESSIVE CORP	1,750	USD	339,158	0.22
PROLOGIS	2,902	USD	304,105	0.20
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	1,459	USD	159,534	0.11
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GROUP INC	2,858	USD	196,533	0.13
PUBLIC STORAGE INC	599	USD	160,767	0.11
QUALCOMM INC	2,921	USD	542,855	0.36
QUANTA SERVICES - REG SHS	676	USD	160,266	0.11
QUEST DIAGNOSTICS	968	USD	123,629	0.08
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	1,177	USD	135,749	0.09
REGENERON PHARMACEUTICALS INC	285	USD	279,490	0.18
REGIONS FINANCIAL CORP	5,910	USD	110,507	0.07
ROCKWELL AUTOMATION	650	USD	166,953	0.11
ROPER TECHNOLOGIES	441	USD	231,933	0.15
ROSS STORES INC	1,278	USD	173,286	0.11
S&P GLOBAL INC	939	USD	390,757	0.26
SALESFORCE INC	2,532	USD	607,397	0.40
SBA COMMUNICATIONS -A	569	USD	104,217	0.07
SEA -A- ADR REPR1 SHS	1,061	USD	70,704	0.05
SEMPRA ENERGY	3,039	USD	215,672	0.14
SERVICENOW INC	592	USD	434,531	0.29
SHERWIN WILLIAMS CO	838	USD	233,342	0.15
SIMON PROPERTY GROUP - REG SHS	1,244	USD	176,197	0.12
SNAP ON INC	615	USD	149,993	0.10
STANLEY BLACK & DECKER INC	1,141	USD	85,052	0.06
STARBUCKS CORP	3,332	USD	242,031	0.16
STATE STREET CORP	1,804	USD	124,559	0.08
STEEL DYNAMICS	857	USD	103,552	0.07
STRYKER CORP	933	USD	296,201	0.20
SUPER MICRO COMPUT -SHS-	134	USD	102,443	0.07
SYNOPSIS	461	USD	255,958	0.17
SYSCO CORP	2,017	USD	134,354	0.09
T MOBILE USA INC	1,599	USD	262,852	0.17
T ROWE PRICE GROUP INC	1,283	USD	138,038	0.09
TARGET CORP	1,427	USD	197,110	0.13
TESLA MOTORS INC	7,146	USD	1,319,385	0.87
TEXAS INSTRUMENTS INC	2,413	USD	437,976	0.29
THE CIGNA GROUP - REG SHS	822	USD	253,537	0.17
THE HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP	2,247	USD	210,789	0.14
THE KRAFT HEINZ	4,608	USD	138,530	0.09
THERMO FISHER SCIENT SHS	963	USD	496,887	0.33
TJX COS INC	3,678	USD	377,838	0.25
TRAVELERS COS INC/THE	998	USD	189,348	0.12
TRUIST FINANCIAL CORP	3,975	USD	144,090	0.09
TWILIO INC	1,131	USD	59,951	0.04
UNITED PARCEL SERVICE INC	2,093	USD	267,252	0.18
UNITED RENTALS INC	248	USD	149,652	0.10
UNITEDHEALTH GROUP INC	2,324	USD	1,104,288	0.73
US BANCORP	4,425	USD	163,912	0.11

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

Etwilige Abweichungen bei den Prozentsatzen des Nettovermogens sind auf Rundungen zuruckzufuhren.



Cleome Index World Equities

Anlageportfolio zum 30. Juni 2024

Bezeichnung	Anzahl	Wahrung	Marktwert (in EUR)	% des NV
VALERO ENERGY CORP	1,069	USD	156,358	0.10
VEEVA SYSTEMS -A-	504	USD	86,062	0.06
VERALTO CORPORATION	1,331	USD	118,564	0.08
VERISK ANALYTICS	715	USD	179,826	0.12
VERIZON COMMUNICATIONS INC	11,012	USD	423,732	0.28
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	731	USD	319,696	0.21
VISA INC -A-	4,050	USD	991,839	0.65
VULCAN MATERIALS CO	834	USD	193,514	0.13
WABTEC CORP	1,640	USD	241,849	0.16
WALMART INC	11,216	USD	708,594	0.47
WALT DISNEY CO	4,967	USD	460,157	0.30
WARNER BROS DISCOVERY INC	9,962	USD	69,156	0.05
WASTE MANAGEMENT	1,536	USD	305,753	0.20
WATERS	336	USD	90,954	0.06
WELLTOWER OP - REG SHS	2,304	USD	224,112	0.15
WEYERHAEUSER CO	4,801	USD	127,176	0.08
WILLIAMS COS INC	5,768	USD	228,729	0.15
WORKDAY INC -A-	680	USD	141,844	0.09
WW GRAINGER INC	235	USD	197,832	0.13
XYLEM INC	1,663	USD	210,453	0.14
YUM BRANDS INC	1,458	USD	180,198	0.12
ZOETIS INC -A-	1,264	USD	204,458	0.13
			105,231,900	69.31
Aktien gesamt			151,503,995	99.78
Übertragbare Wertpapiere, die zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden gesamt			151,503,995	99.78
Anlageportfolio gesamt			151,503,995	99.78
Erwerbskosten			97,812,564	



Cleome Index World Equities

Geografische und wirtschaftliche Zusammensetzung des Wertpapierbestandes zum 30. Juni 2024

Geografische Zusammensetzung (in % des Nettovermögens)

Vereinigte Staaten von Amerika	69.31
Japan	5.67
Großbritannien	3.75
Frankreich	2.94
Kanada	2.81
Schweiz	2.61
Deutschland	2.11
Australien	1.89
Irland	1.67
Niederlande	1.58
Dänemark	1.12
Spanien	0.79
Schweden	0.79
Italien	0.66
Hongkong	0.39
Luxemburg	0.26
Jersey	0.24
Singapur	0.20
Norwegen	0.18
Finnland	0.17
Belgien	0.15
Niederländische Antillen	0.15
Neuseeland	0.11
Bermuda	0.10
Israel	0.09
Kaimaninseln	0.07
	99.78

Wirtschaftliche Zusammensetzung (in % des Nettovermögens)

Internet und Internet-Dienste	16.03
Banken und andere Finanzinstitute	13.90
Elektronik und Halbleiter	10.23
Pharmazeutika	8.56
Büroausstattung und Computer	6.58
Einzelhandel und Warenhäuser	6.00
Erdöl	3.85
Maschinen- und Apparatebau	3.34
Versicherungen	2.69
Lebensmittel und alkoholfreie Getränke	2.65
Versorger	2.54
Elektrotechnik	2.45
Kommunikation	2.09
Kraftfahrzeuge	2.02
Immobilien	1.84
Grafik und Verlage	1.57
Chemikalien	1.47
Sonstige Dienstleistungen	1.46
Gesundheitswesen	1.42
Sonstige Konsumgüter	1.39
Transport	1.29
Hotels und Restaurants	1.20
Biotechnologie	1.10
Textilien und Bekleidung	1.02
Baumaterialien	0.72
Kohlebergbau und Stahlindustrie & Chemie	0.49
Edelmetalle und Edelsteine	0.42
Tabak und alkoholische Getränke	0.41
NE-Metalle	0.39
Umweltdienste und Recycling	0.27

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



Cleome Index World Equities

Geografische und wirtschaftliche Zusammensetzung des Wertpapierbestandes zum 30. Juni 2024

Wirtschaftliche Zusammensetzung (in % des Nettovermögens)

Verpackungsindustrie	0.17
Papier und Forsterzeugnisse	0.15
Reifen und Kautschuk	0.10
	99.78



Anhang zum Abschluss – Aufstellung der derivativen Instrumente

Devisenterminkontrakte

Zum 30. Juni 2024 waren die folgenden Devisentermingeschäfte ausstehend:

Cleome Index USA Equities

Gekaufte Devisen	Gekaufte Anzahl	Verkaufte Devisen	Verkaufte Anzahl	Fälligkeits- datum	Gegenpartei	Nicht realisiert (in USD)
EUR	39,566,470	USD	42,379,920	17/07/2024	CACEIS Bank, Lux. Branch	55,093
USD	216,636	EUR	201,970	17/07/2024	CACEIS Bank, Lux. Branch	24
						<u>55,117</u>

Beachten Sie Anhangangabe 11 hinsichtlich erhaltener/verbuchter Sicherheiten in Verbindung mit den Devisenterminkontrakten. Diese Geschäfte mit Devisenterminkontrakten werden hauptsächlich den gegen Währungsrisiko abgesicherten Anteilsklassen zugewiesen.



Anhang zum Abschluss – Aufstellung der derivativen Instrumente

Futures

Zum 30. Juni 2024 waren die folgenden Futures-Kontrakte ausstehend:

Cleome Index Euro Corporate Bonds

Anzahl (Kauf/(Verkauf))	Bezeichnung	Währung	Gegenpartei	Verpflichtung (in EUR) (in absolutem Wert)	Nicht realisiert (in EUR)
Futures auf Anleihen					
330	EURO SCHATZ 202409	EUR	J.P. Morgan SE	33,040,260	92,400
130	EURO BOBL FU /202409	EUR	J.P. Morgan SE	12,778,870	59,800
(154)	EURO BUND FU /202409	EUR	J.P. Morgan SE	15,558,851	(72,380)
					79,820

Siehe Anhangangabe 10 zu Barmitteln bei Brokern im Zusammenhang mit Futures.



Sonstige Erläuterungen zum Abschluss

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	USD
Cleome Index World Equities	EUR

Mit Wirkung zum 24. Januar 2022 wurde die Referenzwährung des Teilfonds Cleome Index USA Equities von EUR in USD geändert.

Folgende Anteilsklassen wurden aufgelegt:

- 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 Plattformbetreibern), 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 **Klasse R2**, die 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. Der 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 **Klasse Z**, die folgenden Anlegern vorbehalten ist:
 - 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 Group verwaltet werden.



Sonstige Erläuterungen zum Abschluss

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 „Statistik“ zu den einzelnen Teilfonds ausführlich beschrieben.

Im Rahmen der Offenlegungsvorschriften für nachhaltige Finanzprodukte (Sustainable Finance Disclosure Regulation, SFDR) sind Informationen zu ökologischen und/oder sozialen Merkmalen und/oder nachhaltigen Investitionen in den entsprechenden Anhängen unter dem Abschnitt (ungeprüft) Sustainable Finance Disclosure Regulation verfügbar.

Anhangangabe 2 – Wesentliche Rechnungslegungsgrundsätze

Der Abschluss 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 Abschlusses geringfügige Abweichungen auftreten.

Dieser Jahresbericht wurde auf der Grundlage der letzten inoffiziellen technischen Nettoinventarwerte erstellt, die für den Jahresabschluss zum 30. Juni 2024 berechnet wurden. Der Nettoinventarwert jedes Teilfonds wurde zum 2. Januar 2024 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 Nettogewinne 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 30. Juni 2024 verwendete Wechselkurse:

1 EUR =	1.604800	AUD	1 EUR =	0.847850	GBP	1 EUR =	1.758850	NZD	1 EUR =	19.570150	ZAR
1 EUR =	1.466550	CAD	1 EUR =	8.367600	HKD	1 EUR =	11.350000	SEK			
1 EUR =	0.963050	CHF	1 EUR =	172.401700	JPY	1 EUR =	1.452500	SGD			
1 EUR =	7.457450	DKK	1 EUR =	11.411500	NOK	1 EUR =	1.071750	USD			

d) Kombinierte Abschlüsse 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.



Sonstige Erläuterungen zum Abschluss

Anhangangabe 2 – Wesentliche Rechnungslegungsgrundsätze (Fortsetzung)

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.

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 „Anhang zum Jahresabschluss – Aufstellung der derivativen 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 Gewinn/(Verlust) aus Devisenterminkontrakten wird in der Nettovermögensaufstellung unter „Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust) 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 des nicht realisierten Nettogewinns/-verlusts aus Devisenterminkontrakten“ enthalten.

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

g) Transaktionskosten

In der am 30. Juni 2024 endenden Periode 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

j) Pensionsgeschäfte

Ein umgekehrtes Pensionsgeschäft ist eine Vereinbarung, bei der die SICAV gegen Zahlung eines Betrags übertragbare Wertpapiere von einer Gegenpartei erhält (kauft), die sich verpflichtet, diese zu einem Preis und innerhalb einer Frist zurückzukaufen, die zwischen den beiden Parteien bei Abschluss der Vereinbarung festgelegt werden. In seinen Auswirkungen ähnelt ein umgekehrtes Pensionsgeschäft einem Darlehen der SICAV an die Gegenpartei, das durch übertragbare Wertpapiere gesichert ist. Die SICAV verbucht das Pensionsgeschäft wie ein Darlehen und weist es in der Nettovermögensaufstellung unter der Rubrik „Forderungen aus umgekehrten Pensionsgeschäften / Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensionsgeschäften“ aus. Zinsforderungen / Zinsverpflichtungen (im Falle negativer Zinsen) aus dieser Transaktion werden unter der Position sonstige Vermögenswerte/sonstige Verbindlichkeiten in der Vermögensaufstellung ausgewiesen. Ein umgekehrtes Pensionsgeschäft ist im Allgemeinen nur von kurzer Dauer und nicht übertragbar. Die SICAV bewertet diese Art von Vereinbarung zu Anschaffungskosten, was in Verbindung mit Stückzinsen eine Annäherung an den Wert darstellt, zu dem die Wertpapiere von der Gegenpartei zurückgekauft werden. Die erhaltenen oder gezahlten Zinsen (im Falle negativer Zinssätze) werden in der Entwicklung des Nettovermögens unter dem Posten „Zinsen aus umgekehrten Pensionsgeschäften“ ausgewiesen.



Sonstige Erläuterungen zum Abschluss

Anhangangabe 3 – Verwaltungsgebühren

Candriam, eine Kommanditgesellschaft auf Aktien luxemburgischen Rechts, mit Sitz in SERENITY - Bloc B, 19-21, Route d'Arlon, L-8009 Strassen, wurde zur Verwaltungsgesellschaft bestimmt. Eine entsprechende Vereinbarung wurde auf unbestimmte Zeit geschlossen. Jede Partei ist berechtigt, die Vereinbarung jederzeit per Einschreiben (mit unterschriebenem Rückschein) an die andere Partei zu kündigen, wobei eine Kündigungsfrist von 90 Tagen einzuhalten ist.

Candriam ist eine Tochtergesellschaft von Candriam Group, einem Unternehmen der Gruppe New York Life Insurance Company. 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.

Die Funktion der Portfolioverwaltung wird direkt von Candriam und/oder von einer oder mehrerer ihrer Niederlassungen sichergestellt: Candriam – Belgian Branch, Candriam – Succursale française, Candriam – UK Establishment.

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 30. Juni 2024 gelten die folgenden Gebührensätze:

Teilfonds	Anteilsklasse	Anteilsart	ISIN	Verwaltungsgebühr
Cleome Index EMU Equities	C	Thesaurierung	LU1292953335	0.80%
	C	Ausschüttung	LU1365257788	0.80%
	I	Thesaurierung	LU1292953418	0.12%
	R	Thesaurierung	LU1292953509	0.30%
	R	Ausschüttung	LU1718421743	0.30%
	V	Thesaurierung	LU1292953681	0.08%
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%
	R2	Ausschüttung	LU1622416649	0.12%
Cleome Index Euro Government Bonds	Y	Thesaurierung	LU1542321689	0.30%
	Z	Thesaurierung	LU1542321762	0.00%
	C	Thesaurierung	LU1542321929	0.20%
	I	Thesaurierung	LU1542322224	0.12%
	R2	Thesaurierung	LU1542322653	0.10%
	R2	Ausschüttung	LU1622416722	0.10%
Cleome Index Euro Long Term Bonds	S	Thesaurierung	LU1933089531	0.05%
	Z	Thesaurierung	LU1542322810	0.00%
	C	Thesaurierung	LU1542323032	0.20%
	I	Thesaurierung	LU1542323206	0.12%
	Y	Thesaurierung	LU1542323891	0.30%
	Z	Thesaurierung	LU1542324196	0.00%
Cleome Index Euro Short Term Bonds	C	Thesaurierung	LU1542324352	0.20%
	I	Thesaurierung	LU1542324519	0.12%
	V	Thesaurierung	LU1542324865	0.08%
	Y	Thesaurierung	LU1542324949	0.30%
	Z	Thesaurierung	LU1542325086	0.00%
	Cleome Index Europe Equities	C	Thesaurierung	LU0461106337
I		Thesaurierung	LU0461106683	0.12%
R		Thesaurierung	LU1006087669	0.30%
R		Ausschüttung	LU1718421826	0.30%
V2		Thesaurierung	LU0438017591	0.05%
Y		Thesaurierung	LU0102768701	0.30%
Z		Thesaurierung	LU0479710047	0.00%
Z		Ausschüttung	LU1379319319	0.00%
Cleome Index USA Equities		C	Ausschüttung	LU1365257515
	C	Thesaurierung	LU1006087313	0.80%
	C - EUR - Hedged	Thesaurierung	LU2403432581	0.80%
	C - EUR - Unhedged	Thesaurierung	LU0461105529	0.80%
	I	Thesaurierung	LU0461105875	0.12%
	I - EUR - Hedged	Thesaurierung	LU2197357408	0.12%
	I - EUR - Unhedged	Thesaurierung	LU2197357747	0.12%
	R	Thesaurierung	LU1718422477	0.30%
	R	Ausschüttung	LU1718422550	0.30%
	R - EUR - Hedged	Thesaurierung	LU2403432748	0.30%
	R - EUR - Unhedged	Thesaurierung	LU1006087586	0.30%
	R - EUR - Unhedged	Ausschüttung	LU1718422394	0.30%
	V	Thesaurierung	LU0438016601	0.08%
	V - EUR - Hedged	Thesaurierung	LU2403432821	0.08%



Sonstige Erläuterungen zum Abschluss

Anhangangabe 3 – Verwaltungsgebühren (Fortsetzung)

Teilfonds	Anteilsklasse	Anteilsart	ISIN	Verwaltungsgebühr
Cleome Index USA Equities (Fortsetzung)	V - EUR - Unhedged	Thesaurierung	LU2197358042	0.08%
	Y - EUR - Unhedged	Thesaurierung	LU0102768370	0.30%
	Z	Thesaurierung	LU0644256330	0.00%
	Z - EUR - Unhedged	Thesaurierung	LU0479709973	0.00%
	Z - EUR - Unhedged	Ausschüttung	LU1379320085	0.00%
Cleome Index World Equities	C	Thesaurierung	LU1292953848	0.80%
	C	Ausschüttung	LU1365257945	0.80%
	I	Thesaurierung	LU1292954903	0.12%
	R	Thesaurierung	LU1292955033	0.30%
	R	Ausschüttung	LU1718422634	0.30%
	Z	Thesaurierung	LU1292955207	0.00%

Anhangangabe 4 – Vertriebsgebühren

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 Euro Corporate Bonds	L	Thesaurierung	LU1542321689	0.84%
Cleome Index Euro Long Term Bonds	L	Thesaurierung	LU1542323891	0.84%
Cleome Index Euro Short Term Bonds	L	Thesaurierung	LU1542324949	0.58%
Cleome Index Europe Equities	L	Thesaurierung	LU0102768701	1.04%
Cleome Index USA Equities	L	Thesaurierung	LU0102768370	1.04%

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 Anteilhaber, der Finanzberichte oder aller sonstigen Dokumente für die Anteilhaber; 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.



Sonstige Erläuterungen zum Abschluss

Anhangangabe 5 – Betriebs- und Verwaltungskosten (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2024 gelten die folgenden Höchstsätze:

Teilfonds	Anteilsklasse	Anteilsart	ISIN	Höchstsatz
Cleome Index EMU Equities	C	Ausschüttung	LU1365257788	0.40%
	C	Thesaurierung	LU1292953335	0.40%
	I	Thesaurierung	LU1292953418	0.30%
	R	Ausschüttung	LU1718421743	0.40%
	R	Thesaurierung	LU1292953509	0.40%
	V	Thesaurierung	LU1292953681	0.30%
	Z	Thesaurierung	LU1292953764	0.30%
Cleome Index Euro Corporate Bonds	C	Ausschüttung	LU1542321176	0.33%
	C	Thesaurierung	LU1542321093	0.33%
	I	Thesaurierung	LU1542321259	0.25%
	R2	Ausschüttung	LU1622416649	0.33%
	R2	Thesaurierung	LU1542321416	0.33%
	Y	Thesaurierung	LU1542321689	0.25%
	Z	Thesaurierung	LU1542321762	0.25%
Cleome Index Euro Government Bonds	C	Thesaurierung	LU1542321929	0.33%
	I	Thesaurierung	LU1542322224	0.25%
	R2	Ausschüttung	LU1622416722	0.33%
	R2	Thesaurierung	LU1542322653	0.33%
	S	Thesaurierung	LU1933089531	0.25%
	Z	Thesaurierung	LU1542322810	0.25%
Cleome Index Euro Long Term Bonds	C	Thesaurierung	LU1542323032	0.33%
	I	Thesaurierung	LU1542323206	0.25%
	Y	Thesaurierung	LU1542323891	0.25%
	Z	Thesaurierung	LU1542324196	0.25%
Cleome Index Euro Short Term Bonds	C	Thesaurierung	LU1542324352	0.33%
	I	Thesaurierung	LU1542324519	0.25%
	V	Thesaurierung	LU1542324865	0.25%
	Y	Thesaurierung	LU1542324949	0.25%
	Z	Thesaurierung	LU1542325086	0.25%
Cleome Index Europe Equities	C	Thesaurierung	LU0461106337	0.40%
	I	Thesaurierung	LU0461106683	0.30%
	R	Ausschüttung	LU1718421826	0.40%
	R	Thesaurierung	LU1006087669	0.40%
	V2	Thesaurierung	LU0438017591	0.30%
	Y	Thesaurierung	LU0102768701	0.40%
	Z	Ausschüttung	LU1379319319	0.30%
	Z	Thesaurierung	LU0479710047	0.30%
Cleome Index USA Equities	C	Ausschüttung	LU1365257515	0.40%
	C - EUR - Hedged	Thesaurierung	LU2403432581	0.40%
	C - EUR - Unhedged	Thesaurierung	LU0461105529	0.40%
	I - EUR - Hedged	Thesaurierung	LU2197357408	0.23%
	I - EUR - Unhedged	Thesaurierung	LU2197357747	0.23%
	R	Ausschüttung	LU1718422550	0.40%
	R	Thesaurierung	LU1718422477	0.40%
	R - EUR - Hedged	Thesaurierung	LU2403432748	0.40%
	R - EUR - Unhedged	Ausschüttung	LU1718422394	0.40%
	R - EUR - Unhedged	Thesaurierung	LU1006087586	0.40%
	V	Thesaurierung	LU0438016601	0.23%
	V - EUR - Hedged	Thesaurierung	LU2403432821	0.23%
	V - EUR - Unhedged	Thesaurierung	LU2197358042	0.23%
	Z	Thesaurierung	LU0644256330	0.23%
	Z - EUR - Unhedged	Ausschüttung	LU1379320085	0.23%
	Z - EUR - Unhedged	Thesaurierung	LU0479709973	0.23%
	Y - EUR - Unhedged	Thesaurierung	LU0102768370	0.40%
C	Thesaurierung	LU1006087313	0.40%	
I	Thesaurierung	LU0461105875	0.23%	
Cleome Index World Equities	C	Ausschüttung	LU1365257945	0.40%
	C	Thesaurierung	LU1292953848	0.40%
	I	Thesaurierung	LU1292954903	0.30%
	R	Ausschüttung	LU1718422634	0.40%
	R	Thesaurierung	LU1292955033	0.40%
	Z	Thesaurierung	LU1292955207	0.30%



Sonstige Erläuterungen zum Abschluss

Anhangangabe 6 – Zeichnungssteuer

Die SICAV unterliegt dem luxemburgischen Steuerrecht.

Aufgrund der geltenden Gesetze und Vorschriften unterliegt die SICAV in Luxemburg einer jährlichen Steuer in Höhe von 0,05% des Nettoinventarwerts der SICAV; dieser Satz wird für die institutionellen Anlegern vorbehaltenen Klassen auf 0,01 % reduziert. Diese Steuer ist vierteljährlich auf der Grundlage des Nettovermögens der SICAV zu zahlen, das am Ende des Quartals berechnet wird, auf das sich die Steuer bezieht.

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. Mit dem belgischen Gesetz vom 17. Juni 2013, das steuerliche und finanzielle Bestimmungen sowie Bestimmungen zur nachhaltigen Entwicklung enthält, wurde der Satz der jährlichen Steuer für Organismen für gemeinsame Anlagen mit Wirkung vom 1. Januar 2014 auf 0,0925 % festgelegt.

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 30. Juni 2024 setzten sich die verliehenen Wertpapiere wie folgt zusammen:

Teilfonds	Währung	Marktwert von verliehenen Wertpapieren	Sicherheiten in Form von Wertpapieren
Cleome Index EMU Equities	EUR	13,351,644	17,043,544
Cleome Index Euro Corporate Bonds	EUR	6,975,662	6,838,060
Cleome Index Euro Government Bonds	EUR	72,115,285	75,716,555
Cleome Index Euro Short Term Bonds	EUR	11,518,904	13,046,824
Cleome Index Europe Equities	EUR	57,529,512	67,526,800
Cleome Index USA Equities	USD	36,298,081	38,127,904
Cleome Index World Equities	EUR	1,975,916	2,169,623

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, BNP Paribas Arbitrage, Natixis SA, Banco Santander, Goldman Sachs Bank Europe SE, Scotiabank, Société Générale SA, Barclays Bank, UniCredit AG, MLI BONDS und Morgan Stanley.

Die folgenden Ertragsposten wurden in der Periode zum 30. Juni 2024 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	10,453	4,181	6,272
Cleome Index Euro Corporate Bonds	EUR	29,605	11,842	17,763
Cleome Index Euro Government Bonds	EUR	29,828	11,931	17,897
Cleome Index Euro Long Term Bonds	EUR	293	117	176
Cleome Index Euro Short Term Bonds	EUR	8,197	3,279	4,918
Cleome Index Europe Equities	EUR	92,810	37,124	55,686
Cleome Index USA Equities	USD	25,897	10,359	15,538
Cleome Index World Equities	EUR	1,877	751	1,126

Der Ertrag, nach Abzug von Kosten, Gebühren und Kommissionen für die Verwaltungsstelle wird 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 CACEIS Bank, Luxembourg Branch erhaltenen Provisionen belaufen sich auf 20 % des Bruttoertrags.

Candriam France und Candriam Luxembourg sind verbundene Parteien der SICAV.



Sonstige Erläuterungen zum Abschluss

Anhangangabe 8 – Dividenden

Die SICAV hat in der Periode zum 30. Juni 2024 die folgenden Dividenden ausgeschüttet:

Teilfonds	Anteilsklasse	Währung	Ausschüttung	Ex-Tag
Cleome Index EMU Equities	C	EUR	5.09	29/04/2024
	R	EUR	4.56	29/04/2024
Cleome Index Euro Corporate Bonds	C	EUR	4.65	29/04/2024
	R2	EUR	6.11	29/04/2024
Cleome Index Euro Government Bonds	R2	EUR	4.57	29/04/2024
Cleome Index Europe Equities	R	EUR	5.20	29/04/2024
	Z	EUR	59.80	29/04/2024
Cleome Index USA Equities	C	USD	3.74	29/04/2024
	R	USD	3.00	29/04/2024
	R - EUR - Unhedged	EUR	3.56	29/04/2024
	Z - EUR - Unhedged	EUR	34.69	29/04/2024
Cleome Index World Equities	C	EUR	4.59	29/04/2024
	R	EUR	3.54	29/04/2024

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 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.

Während der Periode 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 30. Juni 2024 wurde kein Swing Pricing angewandt.

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	0.16	0.02
Cleome Index Europe Equities	0.21	0.02
Cleome Index USA Equities	0.02	0.04
Cleome Index World Equities	0.06	0.03

Anhangangabe 10 – Guthaben bei Banken und Brokern

Die in der Nettovermögensaufstellung ausgewiesenen Guthaben bei Banken und Brokern umfassen die Cash-Konten und die Liquiditätsbestände auf Broker-Konten für Futures.

Der in der Nettovermögensaufstellung zum 30. Juni 2024 enthaltene Teil der Guthaben bei Banken und Brokern stellt sich wie folgt dar:

Teilfonds	Währung	Barmittel bei Brokern
Cleome Index Euro Corporate Bonds	EUR	153,709



Sonstige Erläuterungen zum Abschluss

Anhangangabe 11 – Sicherheiten

Im Zusammenhang mit den OTC-Derivaten wurden keine Barsicherheiten erhalten oder verbucht.

Anhangangabe 12 – Änderungen der Portfoliozusammensetzung

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

Anhangangabe 13 – Ereignisse nach dem Bilanzstichtag

Es gibt keine Ereignisse nach dem Bilanzstichtag.



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

Unberührt bleibt eine etwaige im Rahmen des § 355 Absatz 4 Kapitalanlagegesetzbuch fortbestehende Berechtigung zu Tätigkeiten, die nach dem Investmentgesetz nicht als öffentlicher Vertrieb gelten.

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 Basisinformationsblätter, 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 Basisinformationsblätter, 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 Basisinformationsblätter, 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.



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.

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

a) Globale Daten

In Bezug auf Wertpapierleihgeschäfte und Total Return Swaps stellt sich der Gesamtmarktwert der ausgeliehenen Wertpapiere zum 30. Juni 2024 wie folgt dar:

Teilfonds	Währung	Marktwert (in absoluten Werten)	% der gesamten ausleihbaren Vermögenswerte	% des gesamten Nettoinventarwerts
Cleome Index EMU Equities	EUR	13,351,644	4.91	4.89
Cleome Index Euro Corporate Bonds	EUR	6,684,629	1.46	1.39
Cleome Index Euro Government Bonds	EUR	71,854,521	27.31	27.03
Cleome Index Euro Short Term Bonds	EUR	11,482,345	22.17	22.01
Cleome Index Europe Equities	EUR	57,529,512	4.47	4.57
Cleome Index USA Equities	USD	36,298,081	1.41	1.39
Cleome Index World Equities	EUR	1,975,916	1.30	1.30

b) Konzentrationsdaten

Die zehn größten Gegenparteien bei allen Wertpapierleihgeschäften zum 30. Juni 2024 sind wie folgt:

Cleome Index EMU Equities

Gegenpartei	Bruttovolumen von offenen Geschäften
NATIXIS	9,814,927
BARC EQTY	2,123,774
BP2S	1,046,641
SOCIETE GENERALE EQUITIES	308,810
MORGAN STANLEY EUROPE SE	44,804
BANCO SANTANDER	12,688

Cleome Index Euro Corporate Bonds

Gegenpartei	Bruttovolumen von offenen Geschäften
BNP SA	3,132,939
MORGAN STANLEY EUROPE SE BONDS	1,827,322
BARC FI	823,741
MLI BONDS	533,688
GOLDMAN SACHS BANK EUROPE SE EQ	366,940

Cleome Index Euro Government Bonds

Gegenpartei	Bruttovolumen von offenen Geschäften
BNP SA	31,379,058
SOCIETE GENERALE EQUITIES	17,611,412
BANK OF NOVA SCOTIA	6,207,897
BANCO SANTANDER	5,016,030
BP2STERM	4,449,810
BP2S	3,567,440
SOCIETE GENERALE FI	2,727,650
NATIXIS	895,224

Cleome Index Euro Short Term Bonds

Gegenpartei	Bruttovolumen von offenen Geschäften
BNP SA	3,674,574
BP2STERM	3,009,708
BP2S	1,639,710
BANCO SANTANDER	1,636,106
SOCIETE GENERALE EQUITIES	1,522,247



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
NATIXIS	23,574,685
BP2S	14,542,613
BARC EQTY	14,161,330
CACIB	4,691,173
SOCIETE GENERALE EQUITIES	304,753
UBS EQUITIES	142,684
MORGAN STANLEY EUROPE SE	83,560
BANCO SANTANDER	28,715

Cleome Index USA Equities

Gegenpartei	Bruttovolumen von offenen Geschäften
BP2S	27,667,335
NATIXIS	4,846,543
BANCO SANTANDER	1,929,315
BARC EQTY	1,166,968
UBS EQUITIES	687,920

Cleome Index World Equities

Gegenpartei	Bruttovolumen von offenen Geschäften
BP2S	1,245,237
NATIXIS	443,030
BARC EQTY	171,159
CACIB	116,489

Die zehn größten Aussteller von Sicherheiten, die bei Wertpapierleihgeschäften empfangen wurden, waren zum 30. Juni 2024:

Cleome Index EMU Equities

Gegenpartei	Bruttovolumen von offenen Geschäften
BPI FRA 0.625 05-26	3,351,047
INDITEX	982,701
VINCI SA	982,655
INDIVIOR PLC	981,513
TOKYO ELECTRON	981,491
MURATA MFG CO	981,486
FORTUM OYJ	981,482
FLUTTER ENTER-DI	981,405
JPMORGAN CHASE	981,401
BANC SA 5.5 06-29	674,818

Cleome Index Euro Corporate Bonds

Gegenpartei	Bruttovolumen von offenen Geschäften
QUEB MO 0.875 07-28	1,153,407
FINL GO 0.0 09-30	1,118,692
REPU FE 2.2 02-34	960,036
UNIT ST 0.625 07-32	639,477
UNIT ST 1.25 04-28	639,475
PORT OB 2.875 07-26	537,938
AUST GO 0.5 02-29	443,570
UNIT ST 2.375 04-26	227,050
LUXE GR 2.875 03-34	146,460
VEOL ENVI ZCP 01-25	128,429

Cleome Index Euro Government Bonds

Gegenpartei	Bruttovolumen von offenen Geschäften
ITAL CERT FLR 01-25	11,559,487
AUST GO 0.0 02-30	8,886,743
NETH GO 0.5 07-32	7,982,513
ITAL BU 5.75 02-33	4,068,523
BROADCOM INC	2,260,918
UNIT KI 3.25 01-33	2,172,763
ASML HOLDING-NY	2,117,629
SPAI GO 1.5 04-27	1,847,509
DNB BANK ASA	1,761,131
DEVON ENERGY CO	1,761,123



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 Short Term Bonds

Gegenpartei	Bruttovolumen von offenen Geschäften
QUEB MO 0.875 07-28	1,353,355
FINL GO 0.0 09-30	1,311,570
REPU FE 2.2 02-34	1,126,011
SANT UK 6.534 01-29	1,052,495
SPAI GO 4.9 07-40	532,137
IBERDROLA SA	464,566
INDITEX	464,537
ASML HOLDING-NY	315,970
BROADCOM INC	314,405
SNOWFLAKE INC-A	300,970

Cleome Index Europe Equities

Gegenpartei	Bruttovolumen von offenen Geschäften
BANC SA 5.5 06-29	4,611,259
INDITEX	4,094,932
VINCI SA	4,094,180
TOKYO ELECTRON	4,092,757
MURATA MFG CO	4,092,380
FLUTTER ENTER-DI	3,950,715
AIB GROUP PLC	3,314,777
FRAN GO 2.5 05-30	2,200,882
VAR ENERGI ASA	1,881,684
BPI FRA 0.625 05-26	1,720,808

Cleome Index USA Equities

Gegenpartei	Bruttovolumen von offenen Geschäften
TELEFONICA	2,766,748
BANCO SABADELL	2,766,732
SEB AB-A	2,766,732
AIB GROUP PLC	2,766,730
NORDEA BANK ABP	2,766,723
TORONTO-DOM BANK	2,766,714
INVESTOR AB-B	2,766,713
NIKON CORP	1,871,355
UBS GRO 5.711 01-27	1,696,047
UNITED THERAPEUT	1,382,286

Cleome Index World Equities

Gegenpartei	Bruttovolumen von offenen Geschäften
NORDEA BANK ABP	124,522
SEB AB-A	124,514
ALSTOM	124,514
KERRY GROUP-A	124,511
TORONTO-DOM BANK	124,507
INVESTOR AB-B	124,506
KION GROUP AG	124,501
HOCHTIEF AG	124,491
UNITED THERAPEUT	124,372
ASML HOLDING-NY	124,034

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	4,299,154	12,744,389	17,043,544
Cleome Index Euro Corporate Bonds	EUR	0	6,708,616	129,444	6,838,060
Cleome Index Euro Government Bonds	EUR	0	39,828,444	35,888,112	75,716,555
Cleome Index Euro Short Term Bonds	EUR	0	5,376,432	7,670,392	13,046,824
Cleome Index Europe Equities	EUR	0	10,891,052	56,635,749	67,526,800
Cleome Index USA Equities	USD	0	2,104,115	36,023,788	38,127,904
Cleome Index World Equities	EUR	0	195,794	1,973,829	2,169,623



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	0	0	4,299,154	12,744,389	17,043,544
Cleome Index Euro Corporate Bonds	EUR	0	0	3,476,481	3,361,579	6,838,060
Cleome Index Euro Government Bonds	EUR	0	0	7,331,178	68,385,377	75,716,555
Cleome Index Euro Short Term Bonds	EUR	0	0	1,585,495	11,461,328	13,046,824
Cleome Index Europe Equities	EUR	0	0	10,891,052	56,635,749	67,526,800
Cleome Index USA Equities	USD	0	0	2,104,115	36,023,788	38,127,904
Cleome Index World Equities	EUR	0	0	195,794	1,973,829	2,169,623