

Alquant Convexus

R.C.S. Luxembourg K2194

Jahresbericht zum 31. Dezember 2023

Investmentfonds gemäß Teil I des Luxemburger Gesetzes
vom 17. Dezember 2010 über Organismen für gemeinsame Anlagen
in seiner derzeit gültigen Fassung in der Rechtsform eines
Fonds Commun de Placement (FCP)

Verwaltungsgesellschaft
IPConcept
R.C.S. Luxemburg B 82183

Alquant Convexus

Inhalt

Bericht zum Geschäftsverlauf	Seite	2
Geografische Länderaufteilung des Fonds Alquant Convexus	Seite	3
Wirtschaftliche Aufteilung des Fonds Alquant Convexus	Seite	4
Zusammensetzung des Netto-Fondsvermögens des Fonds Alquant Convexus	Seite	5
Veränderung des Netto-Fondsvermögen des Fonds Alquant Convexus	Seite	5
Ertrags- und Aufwandsrechnung des Fonds Alquant Convexus	Seite	6
Vermögensaufstellung zum 31. Dezember 2023 des Fonds Alquant Convexus	Seite	7
Erläuterungen zum Jahresabschluss zum 31. Dezember 2023	Seite	22
Bericht des Réviseur d'entreprises agréé	Seite	27
Zusätzliche Erläuterungen (ungeprüft)	Seite	30
Verwaltung, Vertrieb und Beratung	Seite	33

Der Verkaufsprospekt mit integriertem Verwaltungsreglement, das Basisinformationsblatt und die Aufstellung der Zu- und Abgänge des Fonds sowie der Jahres- und Halbjahresbericht des Fonds sind am Sitz der Verwaltungsgesellschaft, der Verwahrstelle und bei den Einrichtungen gemäß den Bestimmungen nach EU-Richtlinie 2019/1160 Art. 92 der jeweiligen Vertriebsländer sowie bei dem Vertreter und der Zahlstelle in der Schweiz kostenlos erhältlich. Weitere Informationen sind jederzeit während der üblichen Geschäftszeiten bei der Verwaltungsgesellschaft erhältlich.

Anteilzeichnungen sind nur gültig, wenn sie auf der Basis der neuesten Ausgabe des Verkaufsprospektes (einschließlich seiner Anhänge) in Verbindung mit dem letzten erhältlichen Jahresbericht und dem eventuell danach veröffentlichten Halbjahresbericht vorgenommen werden.

Alquant Convexus

Bericht zum Geschäftsverlauf

Der Fondsmanager berichtet im Auftrag der Verwaltungsgesellschaft:

Der Alquant Convexus investiert in weltweit etablierte Unternehmen und versucht, die Performance bei Marktabschwüngen durch ein systematisches Derivate-Overlay zu verbessern. Das Aktienportfolio bildet den S&P 500 ab, und das Derivate-Overlay wird durch VIX-Futures und Short-Index-Futures umgesetzt. Das Herzstück unseres Anlageprozesses sind unsere firmeneigenen Risikoindikatoren, die verschiedene Marktfaktoren systematisch auf täglicher Basis messen und zu einem Gesamtsignal kombinieren. Sie bestimmen die Gewichtung der Derivate und zielen darauf ab, Panikphasen an den Aktienmärkten zu erkennen, die Weltwirtschaft anhand von wirtschaftlichen Frühindikatoren und Hochfrequenz-Wirtschaftsdaten zu überwachen, Credit Spreads zu analysieren, implizite Volatilitäten verschiedener Anlageklassen zu erfassen und bärisches Anlegerverhalten aufzuzeigen. Die Gewichtungen sind regelbasiert und losgelöst von Emotionen.

Convexus wurde als Alternative zum traditionellen Aktienportfolio konzipiert und zielt darauf ab, das Risiko auf kosteneffiziente Weise zu mindern, mit geringerer Volatilität und etwas niedrigeren Renditen in steigenden Märkten und einer besseren Verlustbegrenzung in Krisenzeiten.

Das Jahr 2023 war für die Alquant Convexus-Strategie ein Meilenstein. Es war das erste vollständige Kalenderjahr seit der Gründung des Fonds am 5. Mai 2022. Über das Jahr hinweg erreichte der Fonds eine Performance von +19.6% bei einer Volatilität von 13.6%, was in einem Sharpe-Verhältnis von 1.04 resultierte. Diese Leistung war nicht nur an sich stark, sondern zeigte sich auch im Vergleich zu den Benchmarks im Segment der US-Aktien mit geringer Volatilität als beeindruckend. Der VXTH-Index brachte eine Rendite von +12,8%. Die Differenz in der Performance zwischen Alquant Convexus und dem VXTH-Index, einem bedingungslos gegen Volatilität abgesicherten Aktienindex, verdeutlicht die effektive Absicherungsoptimierung, die Alquant Convexus anwendet. Diese zielt darauf ab, Kosten in Bullenmärkten zu reduzieren, während gleichzeitig Schutz bei extremen Marktereignissen gewährleistet bleibt. Die ETFs iShares MSCI USA Min Vol Factor und Invesco S&P 500 Low Volatility verzeichneten Zuwächse von +10.3% bzw. +0.5%, konnten jedoch nicht mit der Performance von Alquant Convexus mithalten. Obwohl diese Benchmarks ähnliche Volatilitätsniveaus wie unsere Strategie aufwiesen, erzielten sie für erstere eine niedrigere Sharpe Ratio von 0.56, während letztere sogar negative Werte aufwies. Das Jahr 2023 bot somit einen wertvollen Einblick in die hohe Kosteneffizienz und die Wirksamkeit der Schutzmechanismen von Alquant Convexus in einem bullischen Markt.

Ausblick: Das bevorzugte Konsens-Szenario für die US-Wirtschaft im Jahr 2024 ist eine „weiche Landung“, d.h. eine Verlangsamung des Wachstums, des Arbeitsmarktes und der Inflation. Die FED-Präsidenten und die Mitglieder des FOMC rechnen mit drei Zinssenkungen von jeweils 25 Basispunkten im Laufe des Jahres, während der Marktkonsens doppelt so hoch ist. Der Zeitpunkt der Zinssenkungen ist noch nicht festgelegt, wird aber von der Entwicklung der US-Inflationsrate im Verhältnis zum 2%-Ziel der Fed sowie von der Abkühlung auf dem US-Arbeitsmarkt abhängen. In Europa deuten stagnierendes Wachstum und sinkende Inflation darauf hin, dass die EZB möglicherweise mit Zinssenkungen beginnt, nicht später als die Fed, um die Wirtschaft der Eurozone zu unterstützen und eine „harte Landung“ zu vermeiden. In China ist der Konsum trotz eines BIP-Wachstums von 5,2% im Jahr 2023 schwach, die Inflation ist nahezu negativ und der Immobilienmarkt erholt sich nicht. Auch die Wahlen in den USA und die Kriege im Nahen Osten und in der Ukraine sind bei diesem Ausblick zu berücksichtigen. Dies sind nicht-marktbezogene Faktoren mit potenziellen Auswirkungen auf die Weltwirtschaft und die globalen Märkte im Jahr 2024.

Wir glauben, dass die Unsicherheit, die sich aus den makro- und geopolitischen Rahmenbedingungen ergibt, ein starker Anreiz für unseren risikobewussten und disziplinierten Ansatz ist. Die Strategie von Alquant Convexus wird weiterhin auf der Grundlage unserer eigenen Indikatoren definiert werden. So können Marktphasen mit geringem und hohem Crash-Risiko identifiziert und das Derivate-Overlay risikokontrolliert und prognosefrei gesteuert werden.

Strassen, im Februar 2024

Der Vorstand der Verwaltungsgesellschaft

Die in diesem Bericht enthaltenen Angaben und Zahlen sind vergangenheitsbezogen und geben keinen Hinweis auf die zukünftige Entwicklung.

Alquant Convexus

Jahresbericht
1. Januar 2023 - 31. Dezember 2023

Die Verwaltungsgesellschaft ist berechtigt, Anteilklassen mit unterschiedlichen Rechten hinsichtlich der Anteile zu bilden.

Derzeit besteht die folgende Anteilklasse mit den Ausgestaltungsmerkmalen:

	I
WP-Kenn-Nr.:	A2QBQ5
ISIN-Code:	LU2220388479
Ausgabeaufschlag:	keiner
Rücknahmeabschlag:	keiner
Verwaltungsvergütung:	0,10 % p.a
Mindestfolgeanlage:	keine
Ertragsverwendung:	thesaurierend
Währung:	USD

Zum Berichtsstichtag waren noch keine Anteile der Klasse II (LU2400591850) gezeichnet.

Geografische Länderaufteilung ¹⁾

Vereinigte Staaten von Amerika	78,34 %
Irland	5,67 %
Schweiz	0,32 %
Niederlande	0,17 %
Curacao	0,15 %
Vereinigtes Königreich	0,08 %
Bermudas	0,07 %
Liberia	0,06 %
Panama	0,04 %
Wertpapiervermögen	84,90 %
Optionen	0,07 %
Terminkontrakte	0,81 %
Bankguthaben ²⁾	14,14 %
Saldo aus sonstigen Forderungen und Verbindlichkeiten	0,08 %
	100,00 %

¹⁾ Aufgrund von Rundungsdifferenzen in den Einzelpositionen können die Summen vom tatsächlichen Wert abweichen.

²⁾ Siehe Erläuterungen zum Jahresabschluss.

Alquant Convexus

Wirtschaftliche Aufteilung ¹⁾

Software & Dienste	9,70 %
Hardware & Ausrüstung	7,08 %
Halbleiter & Geräte zur Halbleiterproduktion	6,52 %
Media & Entertainment	6,26 %
Pharmazeutika, Biotechnologie & Biowissenschaften	6,00 %
Diversifizierte Finanzdienste	5,00 %
Groß- und Einzelhandel	4,65 %
Gesundheitswesen: Ausstattung & Dienste	4,48 %
Investitionsgüter	4,10 %
Investmentfondsanteile	4,06 %
Energie	3,26 %
Versicherungen	2,94 %
Banken	2,76 %
Lebensmittel, Getränke & Tabak	2,37 %
Roh-, Hilfs- & Betriebsstoffe	1,96 %
Versorgungsbetriebe	1,95 %
Immobilien	1,87 %
Verbraucherdienste	1,79 %
Automobile & Komponenten	1,70 %
Lebensmittel- und Basisartikeleinzelhandel	1,48 %
Transportwesen	1,22 %
Haushaltsartikel & Körperpflegeprodukte	1,15 %
Gewerbliche Dienste & Betriebsstoffe	1,07 %
Telekommunikationsdienste	0,75 %
Gebrauchsgüter & Bekleidung	0,64 %
Real Estate Management & Development	0,14 %
Wertpapiervermögen	84,90 %
Optionen	0,07 %
Terminkontrakte	0,81 %
Bankguthaben ²⁾	14,14 %
Saldo aus sonstigen Forderungen und Verbindlichkeiten	0,08 %
	100,00 %

Entwicklung seit Auflegung

Datum	Netto- Fondsvermögen Mio. USD	Umlaufende Anteile	Netto- Mittelaufkommen Tsd. USD	Anteilwert USD
06.05.2022	Tag der ersten NAV Berechnung	-	-	100,00
31.12.2022	9,83	105.769	10.551,33	92,92
31.12.2023	13,53	121.682	1.613,03	111,18

¹⁾ Aufgrund von Rundungsdifferenzen in den Einzelpositionen können die Summen vom tatsächlichen Wert abweichen.

²⁾ Siehe Erläuterungen zum Jahresabschluss.

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

Alquant Convexus

Zusammensetzung des Netto-Fondsvermögens

zum 31. Dezember 2023

	USD
Wertpapiervermögen	11.493.576,18
(Wertpapiereinstandskosten: USD 9.868.090,67)	
Optionen	9.380,00
Bankguthaben ¹⁾	1.912.843,25
Nicht realisierte Gewinne aus Terminkontrakten	109.872,20
Zinsforderungen	19.731,84
Dividendenforderungen	9.036,98
Forderungen aus Wertpapiergeschäften	128,23
Sonstige Aktiva ²⁾	6.547,77
	13.561.116,45
Sonstige Passiva ³⁾	-32.818,81
	-32.818,81
Netto-Fondsvermögen	13.528.297,64
Umlaufende Anteile	121.682,483
Anteilwert	111,18 USD

Veränderung des Netto-Fondsvermögens

im Berichtszeitraum vom 1. Januar 2023 bis zum 31. Dezember 2023

	USD
Netto-Fondsvermögen zu Beginn des Berichtszeitraumes	9.827.646,45
Ordentlicher Nettoaufwand	-9.472,96
Ertrags- und Aufwandsausgleich	1.153,69
Mittelzuflüsse aus Anteilverkäufen	1.841.405,21
Mittelabflüsse aus Anteilrücknahmen	-228.378,00
Realisierte Gewinne	615.918,58
Realisierte Verluste	-757.766,43
Nettoveränderung nicht realisierter Gewinne	1.807.964,21
Nettoveränderung nicht realisierter Verluste	429.826,89
Netto-Fondsvermögen zum Ende des Berichtszeitraumes	13.528.297,64

Entwicklung der Anzahl der Anteile im Umlauf

	Stück
Umlaufende Anteile zu Beginn des Berichtszeitraumes	105.768,716
Ausgegebene Anteile	18.163,767
Zurückgenommene Anteile	-2.250,000
Umlaufende Anteile zum Ende des Berichtszeitraumes	121.682,483

¹⁾ Siehe Erläuterungen zum Jahresabschluss.

²⁾ Die Position enthält aktivierte Gründungskosten.

³⁾ Diese Position setzt sich im Wesentlichen zusammen aus Verpflichtungen im Zusammenhang mit der Fondsmanagementvergütung und Prüfungskosten.

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

Alquant Convexus

Ertrags- und Aufwandsrechnung

im Berichtszeitraum vom 1. Januar 2023 bis zum 31. Dezember 2023

USD

Erträge

Dividenden	111.438,55
Bankzinsen	80.638,29
Sonstige Erträge	2.275,62
Ertragsausgleich	11.046,28
Erträge insgesamt	205.398,74

Aufwendungen

Zinsaufwendungen	-2.237,37
Verwaltungsvergütung / Fondsmanagementvergütung	-98.251,23
Verwahrstellenvergütung	-6.973,67
Zentralverwaltungsstellenvergütung	-3.480,70
Taxe d'abonnement	-5.543,61
Veröffentlichungs- und Prüfungskosten	-22.358,42
Satz-, Druck- und Versandkosten der Jahres- und Halbjahresberichte	-3.765,52
Register- und Transferstellenvergütung	-35,28
Staatliche Gebühren	-7.440,87
Gründungskosten	-2.238,12
Sonstige Aufwendungen ¹⁾	-50.346,94
Aufwandsausgleich	-12.199,97
Aufwendungen insgesamt	-214.871,70
Ordentlicher Nettoaufwand	-9.472,96

Transaktionskosten im Geschäftsjahr gesamt ²⁾ **14.220,56**

Total Expense Ratio in Prozent ²⁾ **1,73**

Schweizer Total Expense Ratio ohne Performancevergütung in Prozent ²⁾ **1,73**
(für den Zeitraum vom 1. Januar 2023 bis zum 31. Dezember 2023)

Schweizer Total Expense Ratio mit Performancevergütung in Prozent ^{2), 3)} **1,73**
(für den Zeitraum vom 1. Januar 2023 bis zum 31. Dezember 2023)

Schweizer Performancevergütung in Prozent ^{2), 3)} **-**
(für den Zeitraum vom 1. Januar 2023 bis zum 31. Dezember 2023)

¹⁾ Die Position setzt sich im Wesentlichen zusammen aus Lagerstellengebühren und allgemeinen Verwaltungskosten.

²⁾ Siehe Erläuterungen zum Jahresabschluss.

³⁾ Die Berechnung einer wertentwicklungsorientierten Performancevergütung ist für den Fonds nicht vorgesehen.

Alquant Convexus

Vermögensaufstellung zum 31. Dezember 2023

ISIN	Wertpapiere		Zugänge im Berichtszeitraum (ungeprüft)	Abgänge im Berichtszeitraum (ungeprüft)	Bestand	Kurs	Kurswert USD	%-Anteil vom NFV ¹⁾
Aktien, Anrechte und Genussscheine								
Börsengehandelte Wertpapiere								
Bermudas								
BMG3223R1088	Everest Group Ltd.	USD	3	1	11	352,6100	3.878,71	0,03
BMG491BT1088	Invesco Ltd.	USD	59	18	140	18,0700	2.529,80	0,02
BMG667211046	Norwegian Cruise Line Holdings Ltd	USD	37	33	119	20,4700	2.435,93	0,02
							8.844,44	0,07
Curacao								
AN8068571086	Schlumberger NV (Schlumberger Ltd.)	USD	93	32	395	52,2400	20.634,80	0,15
							20.634,80	0,15
Irland								
IE00B4BNMY34	Accenture Plc.	USD	34	7	175	351,5900	61.528,25	0,45
IE00BFRT3W74	Allegion Plc.	USD	5	1	28	126,8600	3.552,08	0,03
IE00BLP1HW54	AON Plc.	USD	9	4	56	289,3100	16.201,36	0,12
IE00B8KQN827	Eaton Corporation Plc.	USD	20	3	114	240,7500	27.445,50	0,20
IE00BY7QL619	Johnson Controls International Plc.	USD	48	16	190	57,7000	10.963,00	0,08
IE00S9YS762	Linde Plc.	USD	126	0	126	409,7700	51.631,02	0,38
IE00BTN1Y115	Medtronic Plc.	USD	63	17	371	82,7300	30.692,83	0,23
IE00BLS09M33	Pentair Plc.	USD	15	3	47	73,0000	3.431,00	0,03
IE00BKVD2N49	Seagate Technology Holdings Plc.	USD	21	1	60	86,7900	5.207,40	0,04
IE00BFY8C754	Steris Plc.	USD	7	1	28	221,7400	6.208,72	0,05
							216.861,16	1,61
Liberia								
LR0008862868	Royal Caribbean Cruises Ltd.	USD	19	8	65	129,9700	8.448,05	0,06
							8.448,05	0,06
Niederlande								
NL0009434992	Lyondellbasell Industries NV	USD	17	0	74	95,6900	7.081,06	0,05
NL0009538784	NXP Semiconductors NV	USD	9	2	70	231,0700	16.174,90	0,12
							23.255,96	0,17
Panama								
PA1436583006	Carnival Corporation	USD	20	26	288	18,6700	5.376,96	0,04
							5.376,96	0,04
Schweiz								
CH0044328745	Chubb Ltd.	USD	19	1	116	224,4300	26.033,88	0,19
CH0114405324	Garmin Ltd.	USD	7	5	39	128,7600	5.021,64	0,04
CH0102993182	TE Connectivity Ltd.	USD	15	3	89	141,0700	12.555,23	0,09
							43.610,75	0,32

¹⁾ NFV = Netto-Fondsvermögen. Aufgrund von Rundungsdifferenzen in den Einzelpositionen können die Summen vom tatsächlichen Wert abweichen.

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

Alquant Convexus

Vermögensaufstellung zum 31. Dezember 2023

ISIN	Wertpapiere		Zugänge im Berichtszeitraum (ungeprüft)	Abgänge im Berichtszeitraum (ungeprüft)	Bestand	Kurs	Kurswert USD	%-Anteil vom NFV ¹⁾
Vereinigte Staaten von Amerika								
US0028241000	Abbott Laboratories	USD	103	30	489	110,4000	53.985,60	0,40
US00287Y1091	AbbVie Inc.	USD	72	21	490	154,7500	75.827,50	0,56
US00724F1012	Adobe Inc.	USD	23	8	124	595,5200	73.844,48	0,55
US00751Y1064	Advance Auto Parts Inc.	USD	2	0	15	61,4900	922,35	0,01
US0079031078	Advanced Micro Devices Inc.	USD	70	9	444	148,7600	66.049,44	0,49
US0010551028	AFLAC Inc.	USD	16	0	156	82,1100	12.809,16	0,09
US00846U1016	Agilent Technologies Inc.	USD	9	0	80	139,7700	11.181,60	0,08
US0091581068	Air Products & Chemicals Inc.	USD	12	4	61	274,2300	16.728,03	0,12
US0090661010	Airbnb Inc.	USD	124	0	124	137,0000	16.988,00	0,13
US00971T1016	Akamai Technologies Inc.	USD	10	8	38	119,0200	4.522,76	0,03
US0116591092	Alaska Air Group Inc.	USD	5	14	27	39,9200	1.077,84	0,01
US0126531013	Albemarle Corporation	USD	11	2	36	149,4300	5.379,48	0,04
US0152711091	Alexandria Real Estate Equities Inc.	USD	10	5	41	128,9000	5.284,90	0,04
US0162551016	Align Technology Inc.	USD	5	1	20	276,6700	5.533,40	0,04
US0188021085	Alliant Energy Corporation	USD	22	26	65	51,3200	3.335,80	0,02
US02079K3059	Alphabet Inc.	USD	576	334	2.970	140,2300	416.483,10	3,08
US02209S1033	Altria Group Inc.	USD	82	11	503	40,1800	20.210,54	0,15
US0231351067	Amazon.com Inc.	USD	468	97	2.457	153,3800	376.854,66	2,79
US0236081024	Ameren Corporation	USD	14	6	71	72,3000	5.133,30	0,04
US02376R1023	American Airlines Group Inc.	USD	9	32	153	13,9800	2.138,94	0,02
US0255371017	American Electric Power Co. Inc.	USD	26	0	152	81,3300	12.362,16	0,09
US0258161092	American Express Co.	USD	28	11	160	187,8000	30.048,00	0,22
US0268747849	American International Group Inc.	USD	24	4	199	67,8700	13.506,13	0,10
US03027X1000	American Tower Corporation	USD	22	2	130	217,1600	28.230,80	0,21
US0304201033	American Water Works Co. Inc.	USD	14	0	58	132,9800	7.712,84	0,06
US03076C1062	Ameriprise Financial Inc.	USD	3	0	28	381,1500	10.672,20	0,08
US0311001004	AMETEK Inc.	USD	15	5	61	165,1200	10.072,32	0,07
US0311621009	Amgen Inc.	USD	22	2	150	288,4600	43.269,00	0,32
US0320951017	Amphenol Corporation	USD	29	0	168	99,4400	16.705,92	0,12
US0326541051	Analog Devices Inc.	USD	21	7	136	200,2400	27.232,64	0,20
US03662Q1058	ANSYS Inc.	USD	7	3	24	361,8600	8.684,64	0,06
US8318652091	A.O. Smith Corporation	USD	12	11	30	82,2400	2.467,20	0,02
US03743Q1085	APA Corporation	USD	49	26	102	36,1000	3.682,20	0,03
US0378331005	Apple Inc.	USD	652	338	3.995	193,5800	773.352,10	5,72
US0382221051	Applied Materials Inc.	USD	38	15	228	163,1200	37.191,36	0,27
US0394831020	Archer Daniels Midland Company	USD	27	12	148	72,2700	10.695,96	0,08
US0404131064	Arista Networks Inc.	USD	15	4	69	236,9700	16.350,93	0,12
US3635761097	Arthur J. Gallagher & Co.	USD	10	0	61	223,4600	13.631,06	0,10
US04621X1081	Assurant Inc.	USD	4	5	14	168,0600	2.352,84	0,02
US00206R1023	AT & T Inc.	USD	352	29	2.034	16,7400	34.049,16	0,25
US0495601058	Atmos Energy Corporation	USD	10	6	39	116,0800	4.527,12	0,03
US0527691069	Autodesk Inc.	USD	13	6	57	244,9100	13.959,87	0,10
US0530151036	Automatic Data Processing Inc.	USD	18	0	117	232,4900	27.201,33	0,20
US0533321024	AutoZone Inc.	USD	0	0	5	2.567,6500	12.838,25	0,09
US0534841012	Avalonbay Communities Inc.	USD	9	0	41	189,6000	7.773,60	0,06

¹⁾ NFV = Netto-Fondsvermögen. Aufgrund von Rundungsdifferenzen in den Einzelpositionen können die Summen vom tatsächlichen Wert abweichen.

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

Alquant Convexus

Vermögensaufstellung zum 31. Dezember 2023

ISIN	Wertpapiere		Zugänge im Berichtszeitraum (ungeprüft)	Abgänge im Berichtszeitraum (ungeprüft)	Bestand	Kurs	Kurswert USD	%-Anteil vom NFV ¹⁾
Vereinigte Staaten von Amerika (Fortsetzung)								
US0536111091	Avery Dennison Corporation	USD	7	3	22	202,7800	4.461,16	0,03
US05464C1018	Axon Enterprise Inc.	USD	22	1	21	258,5900	5.430,39	0,04
US05722G1004	Baker Hughes Co.	USD	73	17	288	34,2000	9.849,60	0,07
US0584981064	Ball Corporation	USD	15	11	80	57,9500	4.636,00	0,03
US0605051046	Bank of America Corporation	USD	333	8	1.976	33,8800	66.946,88	0,49
US0708301041	Bath & Body Works Inc.	USD	10	16	59	43,1300	2.544,67	0,02
US0718131099	Baxter International Inc.	USD	25	10	134	38,8000	5.199,20	0,04
US0758871091	Becton, Dickinson & Co.	USD	13	0	81	243,0300	19.685,43	0,15
US0846707026	Berkshire Hathaway Inc.	USD	511	5	506	357,5700	180.930,42	1,34
US0865161014	Best Buy Co. Inc.	USD	13	3	56	78,4600	4.393,76	0,03
US09062X1037	Biogen Inc.	USD	5	2	40	260,5800	10.423,20	0,08
US0905722072	Bio-Rad Laboratories Inc.	USD	0	0	5	324,6200	1.623,10	0,01
US09073M1045	Bio-Techne Corporation	USD	11	3	44	78,2200	3.441,68	0,03
US09247X1019	Blackrock Inc.	USD	7	4	39	814,4100	31.761,99	0,23
US09260D1072	Blackstone Inc.	USD	201	0	201	133,1300	26.759,13	0,20
US0970231058	Boeing Co.	USD	36	10	159	260,3500	41.395,65	0,31
US09857L1089	Booking Holdings Inc.	USD	0	0	10	3.550,4700	35.504,70	0,26
US0997241064	BorgWarner Inc.	USD	30	1	74	35,9900	2.663,26	0,02
US1011211018	Boston Properties Inc.	USD	9	4	35	71,9500	2.518,25	0,02
US1011371077	Boston Scientific Corporation	USD	91	31	396	56,2800	22.286,88	0,16
US1101221083	Bristol-Myers Squibb Co.	USD	95	41	585	51,2200	29.963,70	0,22
US11135F1012	Broadcom Inc.	USD	24	5	114	1.122,4100	127.954,74	0,95
US11133T1034	Broadridge Financial Solutions Inc.	USD	3	0	33	205,8300	6.792,39	0,05
US1152361010	Brown & Brown Inc.	USD	15	4	71	70,9200	5.035,32	0,04
US1156372096	Brown-Forman Corporation	USD	51	0	51	57,3500	2.924,85	0,02
US1273871087	Cadence Design Systems Inc.	USD	10	1	76	273,2400	20.766,24	0,15
US1331311027	Camden Property Trust	USD	10	3	31	100,4300	3.113,33	0,02
US1344291091	Campbell Soup Co.	USD	12	10	50	42,9900	2.149,50	0,02
US14040H1059	Capital One Financial Corporation	USD	13	1	105	132,0200	13.862,10	0,10
US14149Y1082	Cardinal Health Inc.	USD	6	2	69	100,2800	6.919,32	0,05
US1431301027	Carmax Inc.	USD	18	9	43	77,8400	3.347,12	0,02
US14448C1045	Carrier Global Corporation	USD	38	0	237	57,6400	13.660,68	0,10
US1488061029	Catalent Inc.	USD	18	12	45	45,5400	2.049,30	0,02
US1491231015	Caterpillar Inc.	USD	23	4	143	296,8800	42.453,84	0,31
US12503M1080	Cboe Global Markets Inc.	USD	5	0	31	177,7800	5.511,18	0,04
US12504L1098	CBRE Group Inc.	USD	19	9	82	93,8200	7.693,24	0,06
US12514G1085	CDW Corporation	USD	7	0	40	228,7000	9.148,00	0,07
US1508701034	Celanese Corporation	USD	4	3	25	157,3300	3.933,25	0,03
US03073E1055	Cencora Inc.	USD	7	0	44	203,4900	8.953,56	0,07
US15135B1017	Centene Corporation	USD	35	24	144	73,8900	10.640,16	0,08
US15189T1079	CenterPoint Energy Inc.	USD	56	20	192	28,5600	5.483,52	0,04
US15677J1088	Ceridian HCM Holding Inc.	USD	13	6	44	67,9900	2.991,56	0,02
US1252691001	CF Industries Holdings Inc.	USD	16	0	60	79,6600	4.779,60	0,04
US12541W2098	C.H. Robinson Worldwide Inc.	USD	7	4	34	86,8900	2.954,26	0,02

¹⁾ NFV = Netto-Fondsvermögen. Aufgrund von Rundungsdifferenzen in den Einzelpositionen können die Summen vom tatsächlichen Wert abweichen.

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

Alquant Convexus

Vermögensaufstellung zum 31. Dezember 2023

ISIN	Wertpapiere		Zugänge im Berichtszeitraum (ungeprüft)	Abgänge im Berichtszeitraum (ungeprüft)	Bestand	Kurs	Kurswert USD	%-Anteil vom NFV ¹⁾
Vereinigte Staaten von Amerika (Fortsetzung)								
US1598641074	Charles River Laboratories International Inc.	USD	4	0	15	238,7800	3.581,70	0,03
US8085131055	Charles Schwab Corporation	USD	67	0	427	69,5500	29.697,85	0,22
US16119P1084	Charter Communications Inc. [Del.]	USD	4	2	28	392,3900	10.986,92	0,08
US1667641005	Chevron Corporation	USD	118	34	496	149,7700	74.285,92	0,55
US1696561059	Chipotle Mexican Grill Inc.	USD	2	0	8	2.278,3800	18.227,04	0,13
US1713401024	Church & Dwight Co. Inc.	USD	17	13	66	93,9900	6.203,34	0,05
US1255231003	Cigna Group, The	USD	19	8	84	299,4000	25.149,60	0,19
US1720621010	Cincinnati Financial Corporation	USD	5	4	40	103,3900	4.135,60	0,03
US1729081059	Cintas Corporation	USD	5	1	25	601,0900	15.027,25	0,11
US17275R1023	Cisco Systems Inc.	USD	184	65	1.124	50,4800	56.739,52	0,42
US1729674242	Citigroup Inc.	USD	87	9	541	51,5200	27.872,32	0,21
US1746101054	Citizens Financial Group Inc.	USD	48	0	153	33,5700	5.136,21	0,04
US12572Q1058	CME Group Inc.	USD	16	4	100	211,0200	21.102,00	0,16
US1258961002	CMS Energy Corporation	USD	19	15	79	58,0000	4.582,00	0,03
US1924461023	Cognizant Technology Solutions Corporation	USD	22	14	133	75,8400	10.086,72	0,07
US1941621039	Colgate-Palmolive Co.	USD	25	11	225	79,2400	17.829,00	0,13
US20030N1019	Comcast Corporation	USD	1.149	1.085	1.148	44,1200	50.649,76	0,37
US2003401070	Comerica Inc.	USD	18	0	49	56,5700	2.771,93	0,02
US2058871029	ConAgra Brands Inc.	USD	48	12	148	28,5700	4.228,36	0,03
US20825C1045	ConocoPhillips	USD	93	38	340	116,5000	39.610,00	0,29
US2091151041	Consolidated Edison Inc.	USD	15	3	97	90,6500	8.793,05	0,06
US21036P1084	Constellation Brands Inc.	USD	8	2	45	242,1600	10.897,20	0,08
US21037T1097	Constellation Energy Corporation	USD	23	7	94	117,1100	11.008,34	0,08
US2166484020	Cooper Companies Inc.	USD	3	1	13	379,5400	4.934,02	0,04
US2172041061	Copart Inc.	USD	157	35	228	48,9100	11.151,48	0,08
US2193501051	Corning Inc.	USD	41	15	198	30,6300	6.064,74	0,04
US22052L1044	Corteva Inc.	USD	41	4	199	48,0900	9.569,91	0,07
US22160N1090	CoStar Group Inc.	USD	30	5	118	88,0100	10.385,18	0,08
US22160K1051	Costco Wholesale Corporation	USD	18	4	122	663,1000	80.898,20	0,60
US1270971039	Coterra Energy Inc.	USD	38	0	226	25,6500	5.796,90	0,04
US22822V1017	Crown Castle Inc.	USD	19	0	120	116,1100	13.933,20	0,10
US1264081035	CSX Corporation	USD	79	42	554	34,7400	19.245,96	0,14
US2310211063	Cummins Inc.	USD	7	0	39	240,5800	9.382,62	0,07
US1266501006	CVS Health Corporation	USD	71	32	357	78,9700	28.192,29	0,21
US2358511028	Danaher Corporation	USD	55	0	209	233,1300	48.724,17	0,36
US2371941053	Darden Restaurants Inc.	USD	6	0	34	164,2700	5.585,18	0,04
US23918K1088	DaVita Inc.	USD	0	6	11	104,4400	1.148,84	0,01
US2441991054	Deere & Co.	USD	11	0	77	399,2600	30.743,02	0,23
US2473617023	Delta Air Lines Inc.	USD	50	9	191	40,6300	7.760,33	0,06
US24906P1093	Dentsply Sirona Inc.	USD	14	6	58	35,5900	2.064,22	0,02
US25179M1036	Devon Energy Corporation	USD	30	0	175	45,7600	8.008,00	0,06
US2521311074	DexCom Inc.	USD	25	3	106	124,1600	13.160,96	0,10
US25278X1090	Diamondback Energy Inc.	USD	13	0	52	155,3300	8.077,16	0,06

¹⁾ NFV = Netto-Fondsvermögen. Aufgrund von Rundungsdifferenzen in den Einzelpositionen können die Summen vom tatsächlichen Wert abweichen.

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

Alquant Convexus

Vermögensaufstellung zum 31. Dezember 2023

ISIN	Wertpapiere		Zugänge im Berichtszeitraum (ungeprüft)	Abgänge im Berichtszeitraum (ungeprüft)	Bestand	Kurs	Kurswert USD	%-Anteil vom NFV ¹⁾
Vereinigte Staaten von Amerika (Fortsetzung)								
US2538681030	Digital Realty Trust Inc.	USD	17	0	84	136,1200	11.434,08	0,08
US2547091080	Discover Financial Services	USD	9	6	66	112,5700	7.429,62	0,05
US25470M1099	Dish Network Corporation	USD	51	0	101	5,6600	571,66	0,00
US2566771059	Dollar General Corporation	USD	6	4	58	135,5500	7.861,90	0,06
US2567461080	Dollar Tree Inc.	USD	9	0	58	142,2900	8.252,82	0,06
US25746U1097	Dominion Energy Inc.	USD	41	8	236	47,0600	11.106,16	0,08
US25754A2015	Dominos Pizza Inc.	USD	2	1	10	411,2100	4.112,10	0,03
US2600031080	Dover Corporation	USD	5	0	36	154,1600	5.549,76	0,04
US2605571031	Dow Inc.	USD	35	5	194	55,2300	10.714,62	0,08
US23331A1097	D.R.Horton Inc.	USD	17	4	85	151,9800	12.918,30	0,10
US2333311072	DTE Energy Co.	USD	15	4	62	110,4100	6.845,42	0,05
US26441C2044	Duke Energy Corporation	USD	35	2	222	96,9200	21.516,24	0,16
US26614N1028	DuPont de Nemours Inc.	USD	24	2	135	77,0400	10.400,40	0,08
US23355L1061	DXC Technology Co.	USD	26	31	48	23,0400	1.105,92	0,01
US2774321002	Eastman Chemical Co.	USD	10	1	39	90,4700	3.528,33	0,03
US2786421030	eBay Inc.	USD	29	7	160	43,4700	6.955,20	0,05
US2788651006	Ecolab Inc.	USD	12	0	71	198,8700	14.119,77	0,10
US2810201077	Edison International	USD	26	0	114	71,6000	8.162,40	0,06
US28176E1082	Edwards Lifesciences Corporation	USD	27	2	173	76,7100	13.270,83	0,10
US2855121099	Electronic Arts Inc.	USD	12	8	67	136,7600	9.162,92	0,07
US0367521038	Elevance Health Inc.	USD	14	8	64	468,6700	29.994,88	0,22
US5324571083	Eli Lilly and Company	USD	45	22	220	580,8500	127.787,00	0,94
US2910111044	Emerson Electric Co.	USD	35	16	156	97,0900	15.146,04	0,11
US29355A1079	Enphase Energy Inc.	USD	11	0	42	134,7900	5.661,18	0,04
US29364G1031	Entergy Corporation	USD	10	4	56	100,9100	5.650,96	0,04
US26875P1012	EOG Resources Inc.	USD	36	10	161	121,3300	19.534,13	0,14
US29414B1044	EPAM Systems Inc.	USD	4	2	16	298,7900	4.780,64	0,04
US26884L1098	EQT Corporation	USD	120	17	103	39,0200	4.019,06	0,03
US2944291051	Equifax Inc.	USD	9	4	34	249,6100	8.486,74	0,06
US29444U7000	Equinix Inc.	USD	5	0	27	814,0900	21.980,43	0,16
US29476L1070	Equity Residential Properties Trust	USD	24	0	103	62,5000	6.437,50	0,05
US2971781057	Essex Property Trust Inc.	USD	3	0	18	252,7500	4.549,50	0,03
US29786A1060	Etsy Inc.	USD	10	8	30	81,9200	2.457,60	0,02
US30034W1062	Evergy Inc.	USD	18	16	63	52,2400	3.291,12	0,02
US30040W1080	Eversource Energy	USD	23	0	107	61,9600	6.629,72	0,05
US30161N1019	Exelon Corporation	USD	58	15	272	35,8500	9.751,20	0,07
US30212P3038	Expedia Group Inc.	USD	2	2	38	153,2800	5.824,64	0,04
US3021301094	Expeditors International of Washington Inc.	USD	6	3	44	127,5800	5.613,52	0,04
US30225T1025	Extra Space Storage Inc.	USD	28	0	58	162,1600	9.405,28	0,07
US30231G1022	Exxon Mobil Corporation	USD	251	96	1.127	100,1900	112.914,13	0,83
US3030751057	FactSet Research Systems Inc.	USD	2	0	11	476,7900	5.244,69	0,04
US3032501047	Fair Isaac Corporation	USD	6	0	6	1.169,3400	7.016,04	0,05
US3119001044	Fastenal Co.	USD	30	7	164	64,8400	10.633,76	0,08
US31428X1063	Fedex Corporation	USD	12	6	64	253,5800	16.229,12	0,12

¹⁾ NFV = Netto-Fondsvermögen. Aufgrund von Rundungsdifferenzen in den Einzelpositionen können die Summen vom tatsächlichen Wert abweichen.

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

Alquant Convexus

Vermögensaufstellung zum 31. Dezember 2023

ISIN	Wertpapiere		Zugänge im Berichtszeitraum (ungeprüft)	Abgänge im Berichtszeitraum (ungeprüft)	Bestand	Kurs	Kurswert USD	%-Anteil vom NFV ¹⁾
Vereinigte Staaten von Amerika (Fortsetzung)								
US31620M1062	Fidelity National Information Services Inc.	USD	26	4	166	60,8000	10.092,80	0,07
US3167731005	Fifth Third Bancorp	USD	0	0	180	34,8000	6.264,00	0,05
US3364331070	First Solar Inc.	USD	32	1	31	173,2200	5.369,82	0,04
US3379321074	FirstEnergy Corporation	USD	38	23	153	36,5900	5.598,27	0,04
US3377381088	Fiserv Inc.	USD	26	12	168	133,3800	22.407,84	0,17
US3390411052	FleetCor Technologies Inc.	USD	4	1	20	282,4600	5.649,20	0,04
US3024913036	FMC Corporation	USD	16	12	31	63,3100	1.962,61	0,01
US3453708600	Ford Motor Co.	USD	197	0	1.131	12,3400	13.956,54	0,10
US34959E1091	Fortinet Inc.	USD	27	0	186	59,4000	11.048,40	0,08
US34959J1088	Fortive Corporation	USD	16	6	95	73,5800	6.990,10	0,05
US34965K1079	Fortrea Holdings Inc.	USD	22	0	22	35,2300	775,06	0,01
US34964C1062	Fortune Brands Innovations Inc.	USD	0	0	26	76,8900	1.999,14	0,01
US35137L1052	Fox Corporation	USD	54	26	98	29,7400	2.914,52	0,02
US35137L2043	Fox Corporation	USD	0	0	25	27,7000	692,50	0,01
US3546131018	Franklin Resources Inc.	USD	23	8	81	30,0600	2.434,86	0,02
US35671D8570	Freeport-McMoRan Inc.	USD	82	0	407	43,0200	17.509,14	0,13
US3156161024	F5 Inc.	USD	5	2	18	179,7000	3.234,60	0,02
US3666511072	Gartner Inc.	USD	4	0	23	452,2700	10.402,21	0,08
US36266G1076	GE Healthcare Technologies Inc.	USD	107	4	103	77,5400	7.986,67	0,06
US6687711084	Gen Digital Inc.	USD	29	4	170	22,9800	3.906,60	0,03
US3687361044	Generac Holdings Inc.	USD	5	3	18	130,9300	2.356,74	0,02
US3695501086	General Dynamics Corp.	USD	10	1	63	258,1400	16.262,82	0,12
US3696043013	General Electric Co.	USD	112	61	302	128,3200	38.752,64	0,29
US3703341046	General Mills Inc.	USD	26	12	159	64,9700	10.330,23	0,08
US37045V1008	General Motors Co.	USD	53	0	398	36,2000	14.407,60	0,11
US3724601055	Genuine Parts Co.	USD	6	0	41	138,3900	5.673,99	0,04
US3755581036	Gilead Sciences Inc.	USD	60	15	349	81,1400	28.317,86	0,21
US37940X1028	Global Payments Inc.	USD	10	7	69	127,9400	8.827,86	0,07
US37959E1029	Globe Life Inc.	USD	8	2	28	121,7100	3.407,88	0,03
US4062161017	Halliburton Co.	USD	83	24	251	36,2100	9.088,71	0,07
US4180561072	Hasbro Inc.	USD	7	8	31	51,4700	1.595,57	0,01
US40412C1018	HCA Healthcare Inc.	USD	12	4	57	270,4800	15.417,36	0,11
US42250P1030	Healthpeak Properties Inc.	USD	47	8	166	20,1800	3.349,88	0,02
US8064071025	Henry Schein Inc.	USD	10	2	40	76,0600	3.042,40	0,02
US42809H1077	Hess Corporation	USD	20	2	80	144,7400	11.579,20	0,09
US42824C1099	Hewlett Packard Enterprise Co.	USD	91	47	342	17,1700	5.872,14	0,04
US43300A2033	Hilton Worldwide Holdings Inc.	USD	6	0	73	181,7400	13.267,02	0,10
US4364401012	Hologic Inc.	USD	15	0	72	71,2600	5.130,72	0,04
US4385161066	Honeywell International Inc.	USD	35	9	186	209,1700	38.905,62	0,29
US4404521001	Hormel Foods Corporation	USD	21	7	79	31,9400	2.523,26	0,02
US4432011082	Howmet Aerospace Inc.	USD	27	10	109	54,1100	5.897,99	0,04
US40434L1052	HP Inc.	USD	43	12	233	30,1800	7.031,94	0,05
US4448591028	Humana Inc.	USD	7	2	35	455,6100	15.946,35	0,12
US4456581077	Hunt [J.B.] Transport Services Inc.	USD	2	2	22	201,8600	4.440,92	0,03

¹⁾ NFV = Netto-Fondsvermögen. Aufgrund von Rundungsdifferenzen in den Einzelpositionen können die Summen vom tatsächlichen Wert abweichen.

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

Alquant Convexus

Vermögensaufstellung zum 31. Dezember 2023

ISIN	Wertpapiere		Zugänge im Berichtszeitraum (ungeprüft)	Abgänge im Berichtszeitraum (ungeprüft)	Bestand	Kurs	Kurswert USD	%-Anteil vom NFV ¹⁾
Vereinigte Staaten von Amerika (Fortsetzung)								
US4461501045	Huntington Bancshares Inc.	USD	71	1	396	12,8100	5.072,76	0,04
US4464131063	Huntington Ingalls Industries Inc.	USD	0	1	9	258,4700	2.326,23	0,02
US45167R1041	IDEX Corporation	USD	2	0	20	217,0600	4.341,20	0,03
US45168D1046	IDEXX Laboratories Inc.	USD	4	0	24	557,0200	13.368,48	0,10
US4523081093	Illinois Tool Works Inc.	USD	13	3	78	261,8800	20.426,64	0,15
US4523271090	Illumina Inc.	USD	9	2	44	142,1300	6.253,72	0,05
US45337C1027	Incyte Corporation	USD	11	3	51	62,7300	3.199,23	0,02
US45687V1061	Ingersoll-Rand Inc.	USD	19	104	110	77,7800	8.555,80	0,06
US45784P1012	Insulet Corporation	USD	22	3	19	219,4300	4.169,17	0,03
US4581401001	Intel Corporation	USD	221	40	1.150	50,3900	57.948,50	0,43
US45866F1049	Intercontinental Exchange Inc.	USD	24	7	155	128,6000	19.933,00	0,15
US4592001014	International Business Machines Corporation	USD	45	16	248	163,7500	40.610,00	0,30
US4595061015	International Flavors & Fragrances Inc.	USD	15	3	75	81,8500	6.138,75	0,05
US4601461035	International Paper Co.	USD	12	20	84	36,2500	3.045,00	0,02
US4612021034	Intuit Inc.	USD	15	6	77	628,0200	48.357,54	0,36
US46120E6023	Intuitive Surgical Inc.	USD	18	4	98	338,3900	33.162,22	0,25
US46187W1071	Invitation Homes Inc.	USD	28	0	158	34,7000	5.482,60	0,04
US46266C1053	IQVIA Holdings Inc.	USD	10	1	52	232,7300	12.101,96	0,09
US46284V1017	Iron Mountain Inc.	USD	33	12	85	70,6000	6.001,00	0,04
US4628211015	Jack Henry & Associates Inc.	USD	2	0	19	163,8800	3.113,72	0,02
US46982L1089	JACOBS SOLUTIONS Inc.	USD	6	1	37	130,0400	4.811,48	0,04
US8326964058	J.M. Smucker Co.	USD	2	3	25	125,7800	3.144,50	0,02
US4781601046	Johnson & Johnson	USD	142	125	667	156,5800	104.438,86	0,77
US46625H1005	JPMorgan Chase & Co.	USD	147	29	810	170,3000	137.943,00	1,02
US48203R1041	Juniper Networks Inc.	USD	26	38	71	29,5100	2.095,21	0,02
US4878361082	Kellanova Co.	USD	19	7	76	55,6200	4.227,12	0,03
US49177J1025	Kenvue Inc.	USD	496	0	496	21,4700	10.649,12	0,08
US49271V1008	Keurig Dr Pepper Inc.	USD	84	3	286	33,3500	9.538,10	0,07
US4932671088	Keycorp	USD	60	0	283	14,5400	4.114,82	0,03
US49338L1035	Keysight Technologies Inc.	USD	14	3	52	159,9300	8.316,36	0,06
US4943681035	Kimberly-Clark Corporation	USD	19	11	93	120,8200	11.236,26	0,08
US49456B1017	Kinder Morgan Inc.	USD	82	5	554	17,6900	9.800,26	0,07
US4824801009	KLA Corporation	USD	6	2	37	586,2700	21.691,99	0,16
US5007541064	Kraft Heinz Co., The	USD	44	32	211	36,7400	7.752,14	0,06
US50540R4092	Laboratory Corporation of America Holdings	USD	9	6	25	227,0600	5.676,50	0,04
US5128071082	Lam Research Corporation	USD	4	0	37	789,6700	29.217,79	0,22
US5132721045	Lamb Weston Holdings Inc.	USD	13	7	44	108,1300	4.757,72	0,04
US5178341070	Las Vegas Sands Corporation	USD	18	5	87	49,0900	4.270,83	0,03
US5253271028	Leidos Holdings Inc.	USD	11	1	42	107,9400	4.533,48	0,03
US5260571048	Lennar Corporation	USD	20	5	72	149,1800	10.740,96	0,08
US5341871094	Lincoln National Corporation	USD	15	6	41	27,3000	1.119,30	0,01
US5380341090	Live Nation Entertainment Inc.	USD	12	14	35	94,0500	3.291,75	0,02
US5018892084	LKQ Corporation	USD	21	2	80	47,8900	3.831,20	0,03

¹⁾ NFV = Netto-Fondsvermögen. Aufgrund von Rundungsdifferenzen in den Einzelpositionen können die Summen vom tatsächlichen Wert abweichen.

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

Alquant Convexus

Vermögensaufstellung zum 31. Dezember 2023

ISIN	Wertpapiere		Zugänge im Berichtszeitraum (ungeprüft)	Abgänge im Berichtszeitraum (ungeprüft)	Bestand	Kurs	Kurswert USD	%-Anteil vom NFV ¹⁾
Vereinigte Staaten von Amerika (Fortsetzung)								
US5404241086	Loews Corporation	USD	18	13	48	69,4700	3.334,56	0,02
US5486611073	Lowe's Companies Inc.	USD	25	15	165	222,9000	36.778,50	0,27
US5658491064	Marathon Oil Corporation	USD	63	49	159	24,3800	3.876,42	0,03
US56585A1025	Marathon Petroleum Corporation	USD	9	10	113	146,8800	16.597,44	0,12
US57060D1081	MarketAxess Holdings Inc.	USD	3	2	10	296,4200	2.964,20	0,02
US5719032022	Marriott International Inc.	USD	10	5	72	224,0800	16.133,76	0,12
US5717481023	Marsh & McLennan Cos. Inc.	USD	25	8	137	188,7900	25.864,23	0,19
US5732841060	Martin Marietta Materials Inc.	USD	3	0	18	498,2400	8.968,32	0,07
US5745991068	Masco Corporation	USD	29	18	57	67,1700	3.828,69	0,03
US57638P1049	MasterBrand Inc.	USD	0	0	26	15,0800	392,08	0,00
US57636Q1040	Mastercard Inc.	USD	37	10	229	426,3200	97.627,28	0,72
US57667L1070	Match Group Inc.	USD	23	4	78	36,7300	2.864,94	0,02
US5797802064	McCormick & Co. Inc.	USD	17	12	67	68,2300	4.571,41	0,03
US5801351017	McDonald's Corporation	USD	33	7	205	295,8400	60.647,20	0,45
US58155Q1031	McKesson Corporation	USD	7	5	37	457,5000	16.927,50	0,13
US58933Y1055	Merck & Co. Inc.	USD	127	39	708	108,7700	77.009,16	0,57
US30303M1027	Meta Platforms Inc.	USD	103	50	600	358,3200	214.992,00	1,59
US59156R1086	MetLife Inc.	USD	36	10	178	66,2900	11.799,62	0,09
US5926881054	Mettler-Toledo International Inc.	USD	1	0	6	1.225,2600	7.351,56	0,05
US5529531015	MGM Resorts International	USD	30	20	81	45,0500	3.649,05	0,03
US5950171042	Microchip Technology Inc.	USD	26	0	153	90,8400	13.898,52	0,10
US5951121038	Micron Technology Inc.	USD	66	12	308	86,0000	26.488,00	0,20
US5949181045	Microsoft Corporation	USD	441	207	2.010	375,2800	754.312,80	5,58
US59522J1034	Mid-America Apartment Communities Inc.	USD	6	3	32	136,5500	4.369,60	0,03
US60770K1079	Moderna Inc.	USD	19	11	87	98,7900	8.594,73	0,06
US6081901042	Mohawk Industries Inc.	USD	1	5	11	104,8700	1.153,57	0,01
US60855R1005	Molina Healthcare Inc.	USD	4	2	15	356,4200	5.346,30	0,04
US60871R2094	Molson Coors Beverage Co.	USD	3	2	47	61,2500	2.878,75	0,02
US6092071058	Mondelez International Inc.	USD	63	17	378	72,2600	27.314,28	0,20
US6098391054	Monolithic Power Systems Inc.	USD	3	0	13	632,2200	8.218,86	0,06
US61174X1090	Monster Beverage Corporation	USD	134	18	208	57,4200	11.943,36	0,09
US6153691059	Moody's Corporation	USD	8	2	44	390,6300	17.187,72	0,13
US6174464486	Morgan Stanley	USD	54	13	359	93,6400	33.616,76	0,25
US61945C1036	Mosaic Co., The	USD	20	8	86	36,1100	3.105,46	0,02
US6200763075	Motorola Solutions Inc.	USD	7	0	47	311,0700	14.620,29	0,11
US55354G1004	MSCI Inc.	USD	3	0	22	570,6000	12.553,20	0,09
US55261F1049	M&T Bank Corporation	USD	9	1	49	138,3900	6.781,11	0,05
US6311031081	Nasdaq Inc.	USD	31	4	103	58,2400	5.998,72	0,04
US64110D1046	NetApp Inc.	USD	4	9	53	88,2100	4.675,13	0,03
US64110L1061	Netflix Inc.	USD	22	12	121	490,5100	59.351,71	0,44
US6512291062	Newell Brands Inc.	USD	58	41	120	8,8200	1.058,40	0,01
US6516391066	Newmont Corporation	USD	40	5	224	41,7000	9.340,80	0,07
US65249B1098	News Corporation	USD	70	15	149	24,6300	3.669,87	0,03
US65339F1012	NextEra Energy Inc.	USD	140	3	609	61,0200	37.161,18	0,27

¹⁾ NFV = Netto-Fondsvermögen. Aufgrund von Rundungsdifferenzen in den Einzelpositionen können die Summen vom tatsächlichen Wert abweichen.

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

Alquant Convexus

Vermögensaufstellung zum 31. Dezember 2023

ISIN	Wertpapiere		Zugänge im Berichtszeitraum (ungeprüft)	Abgänge im Berichtszeitraum (ungeprüft)	Bestand	Kurs	Kurswert USD	%-Anteil vom NFV ¹⁾
Vereinigte Staaten von Amerika (Fortsetzung)								
US6541061031	NIKE Inc.	USD	68	54	348	108,8200	37.869,36	0,28
US65473P1057	NISOURCE Inc.	USD	65	24	127	26,5500	3.371,85	0,02
US6556631025	Nordson Corporation	USD	4	3	14	264,5200	3.703,28	0,03
US6558441084	Norfolk Southern Corporation	USD	10	2	63	236,5300	14.901,39	0,11
US6658591044	Northern Trust Corporation	USD	10	2	58	84,9600	4.927,68	0,04
US6293775085	NRG Energy Inc.	USD	6	10	53	51,8600	2.748,58	0,02
US6703461052	Nucor Corporation	USD	13	0	71	175,1900	12.438,49	0,09
US67066G1040	NVIDIA Corporation	USD	108	32	661	495,2200	327.340,42	2,42
US6745991058	Occidental Petroleum Corporation	USD	35	16	192	59,9700	11.514,24	0,09
US6795801009	Old Dominion Freight Line Inc.	USD	4	1	25	411,0600	10.276,50	0,08
US6819191064	Omnicom Group Inc.	USD	9	1	55	86,7300	4.770,15	0,04
US6821891057	ON Semiconductor Corporation	USD	20	3	118	84,9800	10.027,64	0,07
US6826801036	Oneok Inc. [New]	USD	57	6	160	70,5200	11.283,20	0,08
US68389X1054	Oracle Corporation	USD	99	19	429	106,2500	45.581,25	0,34
US67103H1077	O'Reilly Automotive Inc.[New]	USD	3	2	17	941,2100	16.000,57	0,12
US68622V1061	Organon & Co.	USD	22	22	59	14,4800	854,32	0,01
US68902V1070	Otis Worldwide Corporation	USD	21	10	113	89,6700	10.132,71	0,07
US6937181088	PACCAR Inc.	USD	69	13	141	97,8300	13.794,03	0,10
US6951561090	Packaging Corporation of America	USD	0	0	25	163,3300	4.083,25	0,03
US6974351057	Palo Alto Networks Inc.	USD	87	3	84	295,5800	24.828,72	0,18
US92556H2067	Paramount Global	USD	165	7	158	15,1500	2.393,70	0,02
US7010941042	Parker-Hannifin Corporation	USD	6	0	36	461,9600	16.630,56	0,12
US7043261079	Paychex Inc.	USD	18	8	88	119,5000	10.516,00	0,08
US70432V1026	Paycom Software Inc.	USD	5	0	15	207,5600	3.113,40	0,02
US70450Y1038	PayPal Holdings Inc.	USD	56	24	306	63,0800	19.302,48	0,14
US7134481081	PepsiCo Inc.	USD	66	26	383	169,3900	64.876,37	0,48
US7170811035	Pfizer Inc.	USD	275	140	1.524	28,7900	43.875,96	0,32
US69331C1080	PG & E Corporation	USD	586	0	586	18,0700	10.589,02	0,08
US7181721090	Philip Morris International Inc.	USD	67	15	436	94,0800	41.018,88	0,30
US7185461040	Phillips 66	USD	22	8	126	132,8400	16.737,84	0,12
US71880K1016	Phinia, Inc.	USD	11	0	11	30,6100	336,71	0,00
US7234841010	Pinnacle West Capital Corporation	USD	9	4	27	71,8400	1.939,68	0,01
US7237871071	Pioneer Natural Resources Co.	USD	16	3	67	224,8500	15.064,95	0,11
US73278L1052	Pool Corporation	USD	2	0	11	402,3900	4.426,29	0,03
US6935061076	PPG Industries Inc.	USD	8	4	62	150,3800	9.323,56	0,07
US69351T1060	PPL Corporation	USD	53	4	220	27,1500	5.973,00	0,04
US74251V1026	Principal Financial Group Inc.	USD	21	13	57	79,2500	4.517,25	0,03
US7433151039	Progressive Corporation	USD	27	4	165	158,3400	26.126,10	0,19
US74340W1036	ProLogis Inc.	USD	44	0	263	135,1900	35.554,97	0,26
US7443201022	Prudential Financial Inc.	USD	26	1	107	104,2300	11.152,61	0,08
US69370C1009	PTC Inc.	USD	8	1	35	175,9200	6.157,20	0,05
US7445731067	Public Service Enterprise Group Inc.	USD	34	5	145	60,9700	8.840,65	0,07
US74460D1090	Public Storage Inc. - Management	USD	7	0	45	307,8000	13.851,00	0,10
US7458671010	Pulte Group Inc.	USD	18	6	68	103,4900	7.037,32	0,05
US74736K1016	Qorvo Inc.	USD	5	0	31	114,1800	3.539,58	0,03

¹⁾ NFV = Netto-Fondsvermögen. Aufgrund von Rundungsdifferenzen in den Einzelpositionen können die Summen vom tatsächlichen Wert abweichen.

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

Alquant Convexus

Vermögensaufstellung zum 31. Dezember 2023

ISIN	Wertpapiere		Zugänge im Berichtszeitraum (ungeprüft)	Abgänge im Berichtszeitraum (ungeprüft)	Bestand	Kurs	Kurswert USD	%-Anteil vom NFV ¹⁾
Vereinigte Staaten von Amerika (Fortsetzung)								
US7475251036	QUALCOMM Inc.	USD	58	16	305	145,8600	44.487,30	0,33
US74762E1029	Quanta Services Inc.	USD	12	0	45	216,4700	9.741,15	0,07
US74834L1008	Quest Diagnostics Inc.	USD	3	0	32	137,6600	4.405,12	0,03
US7512121010	Ralph Lauren Corporation	USD	0	0	8	145,7000	1.165,60	0,01
US7547301090	Raymond James Financial Inc.	USD	8	0	51	112,7300	5.749,23	0,04
US7561091049	Realty Income Corporation	USD	53	1	203	58,5800	11.891,74	0,09
US75886F1075	Regeneron Pharmaceuticals Inc.	USD	6	1	30	881,7000	26.451,00	0,20
US7591EP1005	Regions Financial Corporation	USD	79	53	240	19,5500	4.692,00	0,03
US7607591002	Republic Services Inc.	USD	8	0	56	164,3100	9.201,36	0,07
US7611521078	ResMed Inc.	USD	10	3	41	173,0000	7.093,00	0,05
US7140461093	Revvity Inc.	USD	7	1	36	110,7700	3.987,72	0,03
US7703231032	Robert Half International Inc.	USD	6	7	28	88,1600	2.468,48	0,02
US7739031091	Rockwell Automation Inc.	USD	5	0	32	310,6200	9.939,84	0,07
US7757111049	Rollins Inc.	USD	22	0	83	43,7700	3.632,91	0,03
US7766961061	Roper Technologies Inc.	USD	5	2	29	546,1500	15.838,35	0,12
US7782961038	Ross Stores Inc.	USD	15	5	96	138,2000	13.267,20	0,10
US75513E1010	RTX Corporation	USD	73	24	405	84,1700	34.088,85	0,25
US79466L3024	Salesforce Inc.	USD	48	14	269	265,5800	71.441,02	0,53
US78410G1040	SBA Communications Corporation	USD	6	1	31	254,2500	7.881,75	0,06
US81211K1007	Sealed Air Corporation	USD	21	24	30	36,9700	1.109,10	0,01
US8168511090	Sempra	USD	105	0	182	74,6700	13.589,94	0,10
US81762P1021	ServiceNow Inc.	USD	10	0	57	702,4600	40.040,22	0,30
US8243481061	Sherwin-Williams Co.	USD	14	3	67	312,8400	20.960,28	0,15
US8288061091	Simon Property Group Inc.	USD	16	1	95	144,2800	13.706,60	0,10
US83088M1027	Skyworks Solutions Inc.	USD	9	10	41	113,9200	4.670,72	0,03
US8330341012	Snap-on Inc.	USD	4	0	15	289,9400	4.349,10	0,03
US83417M1045	SolarEdge Technologies Inc.	USD	3	0	16	96,7300	1.547,68	0,01
US8447411088	Southwest Airlines Co.	USD	35	27	146	29,3800	4.289,48	0,03
US78409V1044	S&P Global Inc.	USD	12	4	90	441,8400	39.765,60	0,29
US8545021011	Stanley Black & Decker Inc.	USD	18	6	49	99,1000	4.855,90	0,04
US8552441094	Starbucks Corporation	USD	65	23	317	95,9300	30.409,81	0,22
US8574771031	State Street Corporation	USD	18	10	90	78,4200	7.057,80	0,05
US8581191009	Steel Dynamics Inc.	USD	48	1	47	119,0800	5.596,76	0,04
US8636671013	Stryker Corporation	USD	19	5	95	299,1200	28.416,40	0,21
US87165B1035	Synchrony Financial	USD	10	0	131	38,3700	5.026,47	0,04
US8716071076	Synopsys Inc.	USD	8	3	41	517,4100	21.213,81	0,16
US8718291078	Sysco Corporation	USD	21	4	138	73,0400	10.079,52	0,07
US74144T1088	T. Rowe Price Group Inc.	USD	14	2	66	109,0100	7.194,66	0,05
US8740541094	Take-Two Interactive Software Inc.	USD	7	3	43	161,4700	6.943,21	0,05
US8760301072	Tapestry Inc.	USD	25	4	70	37,0800	2.595,60	0,02
US87612G1013	Targa Resources Corporation	USD	69	9	60	86,3500	5.181,00	0,04
US87612E1064	Target Corporation	USD	24	5	131	142,5400	18.672,74	0,14
US8793601050	Teledyne Technologies Inc.	USD	2	0	13	444,2100	5.774,73	0,04
US8793691069	Teleflex Inc.	USD	5	2	15	249,7700	3.746,55	0,03
US8807701029	Teradyne Inc.	USD	11	8	40	110,4400	4.417,60	0,03

¹⁾ NFV = Netto-Fondsvermögen. Aufgrund von Rundungsdifferenzen in den Einzelpositionen können die Summen vom tatsächlichen Wert abweichen.

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

Alquant Convexus

Vermögensaufstellung zum 31. Dezember 2023

ISIN	Wertpapiere		Zugänge im Berichtszeitraum (ungeprüft)	Abgänge im Berichtszeitraum (ungeprüft)	Bestand	Kurs	Kurswert USD	%-Anteil vom NFV ¹⁾
Vereinigte Staaten von Amerika (Fortsetzung)								
US88160R1014	Tesla Inc.	USD	44	8	759	253,1800	192.163,62	1,42
US8825081040	Texas Instruments Inc.	USD	45	13	249	171,7200	42.758,28	0,32
US00130H1059	The AES Corporation	USD	58	0	210	19,3500	4.063,50	0,03
US0200021014	The Allstate Corporation	USD	17	9	72	139,8200	10.067,04	0,07
US0640581007	The Bank of New York Mellon Corporation	USD	48	1	213	52,2200	11.122,86	0,08
US1890541097	The Clorox Co.	USD	10	1	38	142,0600	5.398,28	0,04
US1912161007	The Coca-Cola Co.	USD	166	55	1.076	58,7500	63.215,00	0,47
US5184391044	The Estée Lauder Companies Inc.	USD	8	2	63	147,5500	9.295,65	0,07
US38141G1040	The Goldman Sachs Group Inc.	USD	14	1	94	386,4100	36.322,54	0,27
US4165151048	The Hartford Financial Services Group Inc.	USD	15	12	85	80,4200	6.835,70	0,05
US4278661081	The Hershey Co.	USD	7	4	40	184,1100	7.364,40	0,05
US4370761029	The Home Depot Inc.	USD	51	17	279	347,3600	96.913,44	0,72
US4606901001	The Interpublic Group of Companies Inc.	USD	26	5	105	32,9400	3.458,70	0,03
US5010441013	The Kroger Co.	USD	19	10	180	45,1700	8.130,60	0,06
US6934751057	The PNC Financial Services Group Inc.	USD	21	0	117	155,6300	18.208,71	0,13
US7427181091	The Procter & Gamble Co.	USD	105	39	651	145,7300	94.870,23	0,70
US8425871071	The Southern Co.	USD	59	1	317	70,1600	22.240,72	0,16
US2546871060	The Walt Disney Co.	USD	92	30	500	90,4000	45.200,00	0,33
US9694571004	The Williams Companies Inc.	USD	62	27	333	34,9300	11.631,69	0,09
US8835561023	Thermo Fisher Scientific Inc.	USD	18	2	109	532,9400	58.090,46	0,43
US8725401090	TJX Companies Inc.	USD	67	23	314	93,2400	29.277,36	0,22
US8725901040	T-Mobile US Inc.	USD	25	22	143	158,9500	22.729,85	0,17
US8923561067	Tractor Supply Co.	USD	0	0	28	215,9000	6.045,20	0,04
US8936411003	TransDigm Group Inc.	USD	3	0	15	1.012,7900	15.191,85	0,11
US89417E1091	Travelers Companies Inc.	USD	12	6	62	189,3300	11.738,46	0,09
US8962391004	Trimble Inc.	USD	29	7	75	53,6400	4.023,00	0,03
US89832Q1094	Truist Financial Corporation	USD	83	0	396	37,2900	14.766,84	0,11
US9022521051	Tyler Technologies Inc.	USD	3	0	13	418,2900	5.437,77	0,04
US9024941034	Tyson Foods Inc.	USD	16	2	82	53,6700	4.400,94	0,03
US9026531049	UDR Inc.	USD	26	14	84	38,7700	3.256,68	0,02
US90384S3031	Ulta Beauty Inc.	USD	2	1	14	486,8400	6.815,76	0,05
US9078181081	Union Pacific Corporation	USD	24	9	167	246,0200	41.085,34	0,30
US9100471096	United Airlines Holdings Inc.	USD	16	7	95	41,9700	3.987,15	0,03
US9113121068	United Parcel Service Inc.	USD	28	5	199	157,3100	31.304,69	0,23
US9113631090	United Rentals Inc.	USD	3	0	19	578,6900	10.995,11	0,08
US91324P1021	UnitedHealth Group Inc.	USD	70	44	252	524,9000	132.274,80	0,98
US9139031002	Universal Health Services Inc.	USD	7	6	16	152,6800	2.442,88	0,02
US9029733048	U.S. Bancorp	USD	119	6	434	43,6300	18.935,42	0,14
US91913Y1001	Valero Energy Corporation	USD	11	2	101	130,0900	13.139,09	0,10
US92276F1003	Ventas Inc.	USD	27	0	120	50,9500	6.114,00	0,05
US92338C1036	Veralto Corporation	USD	65	1	64	83,0400	5.314,56	0,04
US92343E1029	Verisign Inc.	USD	3	0	24	206,2800	4.950,72	0,04
US92345Y1064	Verisk Analytics Inc.	USD	5	0	43	237,6100	10.217,23	0,08

¹⁾ NFV = Netto-Fondsvermögen. Aufgrund von Rundungsdifferenzen in den Einzelpositionen können die Summen vom tatsächlichen Wert abweichen.

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

Alquant Convexus

Vermögensaufstellung zum 31. Dezember 2023

ISIN	Wertpapiere		Zugänge im Berichtszeitraum (ungeprüft)	Abgänge im Berichtszeitraum (ungeprüft)	Bestand	Kurs	Kurswert USD	%-Anteil vom NFV ¹⁾
Vereinigte Staaten von Amerika (Fortsetzung)								
US92343V1044	Verizon Communications Inc.	USD	211	39	1.191	37,4900	44.650,59	0,33
US92532F1003	Vertex Pharmaceuticals Inc.	USD	13	2	72	409,2700	29.467,44	0,22
US9182041080	V.F. Corporation	USD	49	1	120	19,0600	2.287,20	0,02
US92556V1061	Viatis Inc.	USD	81	36	296	10,8500	3.211,60	0,02
US9256521090	Vici Properties Inc.	USD	95	38	278	32,1800	8.946,04	0,07
US92826C8394	VISA Inc.	USD	69	21	443	260,4000	115.357,20	0,85
US9291601097	Vulcan Materials Co.	USD	6	3	35	225,4400	7.890,40	0,06
US9314271084	Walgreens Boots Alliance Inc.	USD	63	47	177	26,6000	4.708,20	0,03
US9311421039	Walmart Inc.	USD	56	9	392	157,5700	61.767,44	0,46
US9344231041	Warner Bros. Discovery Inc.	USD	202	32	663	11,6900	7.750,47	0,06
US94106L1098	Waste Management Inc.	USD	16	0	106	178,1400	18.882,84	0,14
US9418481035	Waters Corporation	USD	2	1	15	332,7700	4.991,55	0,04
US92939U1060	WEC Energy Group Inc.	USD	15	0	90	84,0500	7.564,50	0,06
US9497461015	Wells Fargo & Co.	USD	181	8	1.055	49,4800	52.201,40	0,39
US95040Q1040	Welltower Inc.	USD	29	2	146	91,1600	13.309,36	0,10
US9553061055	West Pharmaceutical Services Inc.	USD	5	0	22	354,9300	7.808,46	0,06
US9581021055	Western Digital Corporation	USD	37	14	87	52,9300	4.604,91	0,03
US9297401088	Westinghouse Air Brake Technologies Corporation	USD	7	3	48	126,9600	6.094,08	0,05
US9621661043	Weyerhaeuser Co.	USD	51	31	199	35,1000	6.984,90	0,05
US9633201069	Whirlpool Corporation	USD	4	0	15	123,0400	1.845,60	0,01
US92942W1071	W.K. Kellogg Co.	USD	20	1	19	13,1400	249,66	0,00
US0844231029	W.R. Berkley Corporation	USD	19	1	63	70,4200	4.436,46	0,03
US96145D1054	WRKCo Inc.	USD	24	11	82	42,1200	3.453,84	0,03
US3848021040	W.W. Grainger Inc.	USD	2	0	12	827,1000	9.925,20	0,07
US9831341071	Wynn Resorts Ltd.	USD	10	10	22	91,7600	2.018,72	0,01
US98389B1008	Xcel Energy Inc.	USD	28	4	162	61,8900	10.026,18	0,07
US98419M1009	Xylem Inc.	USD	27	2	65	114,3200	7.430,80	0,05
US9884981013	Yum! Brands, Inc.	USD	11	0	79	130,5200	10.311,08	0,08
US9892071054	Zebra Technologies Corporation	USD	1	1	13	275,3500	3.579,55	0,03
US98956P1021	Zimmer Biomet Holdings Inc.	USD	14	0	62	121,6300	7.541,06	0,06
US9897011071	Zions Bancorporation N.A.	USD	9	8	30	44,6600	1.339,80	0,01
US98978V1035	Zoetis Inc.	USD	25	11	127	197,1600	25.039,32	0,19
US88579Y1010	3M Co.	USD	26	4	155	109,6900	17.001,95	0,13
							10.605.578,38	78,34
Vereinigtes Königreich								
JE00BJ1F3079	AMCOR Plc.	USD	115	18	434	9,7100	4.214,14	0,03
JE00B783TY65	Aptiv Plc.	USD	131	61	82	90,4700	7.418,54	0,05
							11.632,68	0,08
Börsengehandelte Wertpapiere							10.944.243,18	80,84

¹⁾ NFV = Netto-Fondsvermögen. Aufgrund von Rundungsdifferenzen in den Einzelpositionen können die Summen vom tatsächlichen Wert abweichen.

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

Alquant Convexus

Vermögensaufstellung zum 31. Dezember 2023

ISIN	Wertpapiere		Zugänge im Berichtszeitraum (ungeprüft)	Abgänge im Berichtszeitraum (ungeprüft)	Bestand	Kurs	Kurswert USD	%-Anteil vom NFV ¹⁾
Nicht notierte Wertpapiere								
Vereinigte Staaten von Amerika								
US003CVR0169	Abiomed Inc. -Nachbesserungsrechte-	USD	12	0	12	15,5241	186,29	0,00
US33616C1009	First Republic Bank	USD	22	0	65	0,0380	2,47	0,00
							188,76	0,00
Nicht notierte Wertpapiere							188,76	0,00
Aktien, Anrechte und Genussscheine							10.944.431,94	80,84
Investmentfondsanteile²⁾								
Irland								
IE00B5BMR087	iShares Core S&P 500 UCITS ETF	USD	78	938	1.094	501,9600	549.144,24	4,06
							549.144,24	4,06
Investmentfondsanteile²⁾							549.144,24	4,06
Wertpapiervermögen							11.493.576,18	84,90
Optionen								
Long-Positionen								
USD								
Put on S&P 500 Index September 2024/4.250,00			2	0	2		15.140,00	0,11
							15.140,00	0,11
Long-Positionen							15.140,00	0,11
Short-Positionen³⁾								
USD								
Put on S&P 500 Index September 2024/3.600,00			0	2	-2		-5.760,00	-0,04
							-5.760,00	-0,04
Short-Positionen							-5.760,00	-0,04
Optionen							9.380,00	0,07

¹⁾ NFV = Netto-Fondsvermögen. Aufgrund von Rundungsdifferenzen in den Einzelpositionen können die Summen vom tatsächlichen Wert abweichen.

²⁾ Angaben zu Ausgabeaufschlägen, Rücknahmeabschlägen sowie der maximalen Höhe der Verwaltungsvergütung für Zielfondsanteile sind auf Anfrage am Sitz der Verwaltungsgesellschaft, der Verwahrstelle und bei den Zahlstellen kostenlos erhältlich.

³⁾ Der Gesamtbetrag der Verpflichtungen der zum Stichtag laufenden geschriebenen Optionen, bewertet mit dem Basispreis, beträgt EUR 652.248,00.

Alquant Convexus

Vermögensaufstellung zum 31. Dezember 2023

ISIN	Wertpapiere	Zugänge im Berichtszeitraum (ungeprüft)	Abgänge im Berichtszeitraum (ungeprüft)	Bestand	Kurs	Kurswert USD	%-Anteil vom NFV ¹⁾
Terminkontrakte							
Long-Positionen							
USD							
	CBOE Volatility Index (VIX) Future April 2024	14	0	14		7.172,20	0,05
	S&P 500 Index Future März 2024	13	0	13		102.700,00	0,76
						109.872,20	0,81
Long-Positionen						109.872,20	0,81
Terminkontrakte						109.872,20	0,81
Bankguthaben - Kontokorrent²⁾						1.912.843,25	14,14
Saldo aus sonstigen Forderungen und Verbindlichkeiten						2.626,01	0,08
Netto-Fondsvermögen in USD						13.528.297,64	100,00

Terminkontrakte

	Bestand	Verpflichtungen USD	%-Anteil vom NFV ¹⁾
Long-Positionen			
USD			
	14	237.052,20	1,75
	13	3.140.962,50	23,22
		3.378.014,70	24,97
Long-Positionen		3.378.014,70	24,97
Terminkontrakte		3.378.014,70	24,97

¹⁾ NFV = Netto-Fondsvermögen. Aufgrund von Rundungsdifferenzen in den Einzelpositionen können die Summen vom tatsächlichen Wert abweichen.

²⁾ Siehe Erläuterungen zum Jahresabschluss.

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

Alquant Convexus

.....

Devisenkurse

Für die Bewertung von Vermögenswerten in fremder Währung wurde zum nachstehenden Devisenkurs zum 28. Dezember 2023 in US-Dollar umgerechnet.

Euro	EUR	1	0,9006
------	-----	---	--------

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

Alquant Convexus

Erläuterungen zum Jahresabschluss zum 31. Dezember 2023

1.) ALLGEMEINES

Der Fonds Alquant Convexus (der „Fonds“) wurde auf Initiative der Alquant AG aufgelegt und wird von der IPConcept (Luxemburg) S.A. entsprechend dem Verwaltungsreglement des Fonds verwaltet.

Das Verwaltungsreglement trat erstmals am 15. März 2022 in Kraft und wurde beim Handels- und Gesellschaftsregister in Luxemburg hinterlegt. Es wurde im „Recueil électronique des sociétés et associations“ („RESA“), der Informationsplattform des Handels- und Gesellschaftsregisters in Luxemburg, veröffentlicht.

Das Verwaltungsreglement wurde letztmalig am 30. Dezember 2022 geändert und im RESA veröffentlicht.

Das Sondervermögen ist ein Luxemburger Investmentfonds (*fonds commun de placement*), der gemäß Teil I des Luxemburger Gesetzes vom 17. Dezember 2010 über Organismen für gemeinsame Anlagen in seiner derzeit gültigen Fassung („Gesetz vom 17. Dezember 2010“) in der Form eines Mono-Fonds auf unbestimmte Dauer errichtet wurde.

Verwaltungsgesellschaft des Fonds ist die IPConcept (Luxemburg) S.A. („Verwaltungsgesellschaft“), eine Aktiengesellschaft nach dem Recht des Großherzogtums Luxemburg mit eingetragenem Sitz in 4, rue Thomas Edison, L-1445 Strassen, Luxemburg. Sie wurde am 23. Mai 2001 auf unbestimmte Zeit gegründet. Ihre Satzung wurde am 19. Juni 2001 im Mémorial veröffentlicht. Die letzte Änderung der Satzung trat am 27. November 2019 in Kraft und wurde am 20. Dezember 2019 im RESA veröffentlicht. Die Verwaltungsgesellschaft ist beim Handels- und Gesellschaftsregister in Luxemburg unter der Registernummer R.C.S. Luxembourg B 82183 eingetragen. Das Geschäftsjahr der Verwaltungsgesellschaft endet am 31. Dezember eines jeden Jahres. Das Eigenkapital der Verwaltungsgesellschaft belief sich am 31. Dezember 2023 auf 10.080.000 EUR nach Gewinnverwendung.

2.) WESENTLICHE BUCHFÜHRUNGS- UND BEWERTUNGSGRUNDSÄTZE

Dieser Jahresabschluss wurde in der Verantwortung des Vorstands der Verwaltungsgesellschaft in Übereinstimmung mit den in Luxemburg geltenden gesetzlichen Bestimmungen und Verordnungen zur Erstellung und Darstellung von Jahresabschlüssen unter der Annahme der Unternehmensfortführung erstellt.

1. Das Netto-Fondsvermögen des Fonds lautet auf USD („Referenzwährung“).
2. Der Wert eines Anteils („Anteilwert“) lautet auf die im Anhang zum Verkaufsprospekt angegebene Währung („Fondswährung“), sofern nicht für etwaige weitere Anteilklassen im jeweiligen Anhang zum Verkaufsprospekt eine von der Fondswährung abweichende Währung angegeben ist („Anteilklassenwährung“).
3. Der Anteilwert wird von der Verwaltungsgesellschaft oder einem von ihr Beauftragten unter Aufsicht der Verwahrstelle an jedem Tag, der Bankarbeitstag in Luxemburg ist, mit Ausnahme des 24. und 31. Dezember eines jeden Jahres („Bewertungstag“) berechnet und bis auf zwei Dezimalstellen gerundet, wobei zu berücksichtigen ist, dass der Anteilwert mindestens zweimal im Monat zu berechnen ist. Die Verwaltungsgesellschaft kann im Falle einer nicht täglichen Berechnung jederzeit beschließen, eine weitere Anteilwertberechnung an einem Bankarbeitstag zusätzlich zu dem im Anhang zum Verkaufsprospekt angegebenen Tag vorzunehmen.

Die Verwaltungsgesellschaft kann ferner beschließen, den Anteilwert per 24. und 31. Dezember eines Jahres zum Zwecke der Berichtserstellung zu ermitteln, ohne dass es sich bei diesen Wertermittlungen um Berechnungen des Anteilwertes an einem Bewertungstag im Sinne des vorstehenden Satz 1 dieser Ziffer 3 handelt. Folglich können die Anleger keine Ausgabe, Rücknahme und/oder Umtausch von Anteilen auf Grundlage eines am 24. Dezember und/oder 31. Dezember eines Jahres ermittelten Anteilwertes verlangen.

4. Zur Berechnung des Anteilwertes wird der Wert der zu dem Fonds gehörenden Vermögenswerte abzüglich der Verbindlichkeiten des Fonds („Netto-Fondsvermögen“) an jedem Bewertungstag ermittelt und durch die Anzahl der am Bewertungstag im Umlauf befindlichen Anteile des Fonds geteilt. Bei einem Fonds mit mehreren Anteilklassen wird aus dem Netto-Fondsvermögen das jeweilige rechnerisch anteilige Netto-Anteilklassenvermögen ermittelt und durch die Anzahl der am Bewertungstag im Umlauf befindlichen Anteile der jeweiligen Anteilklasse geteilt.
5. Soweit in Jahres- und Halbjahresberichten sowie sonstigen Finanzstatistiken aufgrund gesetzlicher Vorschriften oder gemäß den Regelungen des Verwaltungsreglements Auskunft über die Situation des Fondsvermögens des Fonds insgesamt gegeben werden muss, werden die Vermögenswerte des Fonds in die Referenzwährung umgerechnet. Das Fondsvermögen wird nach folgenden Grundsätzen berechnet:
 - a) Wertpapiere, Geldmarktinstrumente, abgeleitete Finanzinstrumente (Derivate) sowie sonstige Anlagen, die an einer Wertpapierbörse amtlich notiert sind, werden zum letzten verfügbaren Kurs, der eine verlässliche Bewertung gewährleistet, des dem Bewertungstag vorhergehenden Börsentages bewertet.

Die Verwaltungsgesellschaft kann für den Fonds festlegen, dass Wertpapiere, Geldmarktinstrumente, abgeleitete Finanzinstrumente (Derivate) sowie sonstige Anlagen, die an einer Wertpapierbörse amtlich notiert sind, zum letzten verfügbaren Schlusskurs, der eine verlässliche Bewertung gewährleistet, bewertet werden. Dies findet im Anhang zum Verkaufsprospekt des Fonds Erwähnung.

Soweit Wertpapiere, Geldmarktinstrumente, abgeleitete Finanzinstrumente (Derivate) sowie sonstige Anlagen an mehreren Wertpapierbörsen amtlich notiert sind, ist die Börse mit der höchsten Liquidität maßgeblich.

Alquant Convexus

Erläuterungen zum Jahresabschluss zum 31. Dezember 2023

- b) Wertpapiere, Geldmarktinstrumente, abgeleitete Finanzinstrumente (Derivate) sowie sonstige Anlagen, die nicht an einer Wertpapierbörse amtlich notiert sind (oder deren Börsenkurse z. B. aufgrund mangelnder Liquidität als nicht repräsentativ angesehen werden), die aber an einem geregelten Markt gehandelt werden, werden zu einem Kurs bewertet, der nicht geringer als der Geldkurs und nicht höher als der Briefkurs des dem Bewertungstag vorhergehenden Handelstages sein darf und den die Verwaltungsgesellschaft nach Treu und Glauben für den bestmöglichen Kurs hält, zu dem die Wertpapiere, Geldmarktinstrumente, abgeleiteten Finanzinstrumente (Derivate) sowie sonstigen Anlagen verkauft werden können.

Die Verwaltungsgesellschaft kann für den Fonds festlegen, dass Wertpapiere, Geldmarktinstrumente, abgeleitete Finanzinstrumente (Derivate) sowie sonstige Anlagen, die nicht an einer Wertpapierbörse amtlich notiert sind (oder deren Börsenkurse z.B. aufgrund mangelnder Liquidität als nicht repräsentativ angesehen werden), die aber an einem geregelten Markt gehandelt werden, zu dem letzten dort verfügbaren Kurs, den die Verwaltungsgesellschaft nach Treu und Glauben für den bestmöglichen Kurs hält, zu dem die Wertpapiere, Geldmarktinstrumente, abgeleiteten Finanzinstrumente (Derivate) sowie sonstigen Anlagen verkauft werden können, bewertet werden. Dies findet im Anhang zum Verkaufsprospekt des Fonds Erwähnung.

- c) OTC-Derivate werden auf einer von der Verwaltungsgesellschaft festzulegenden und überprüfaren Grundlage auf Tagesbasis bewertet.
- d) Anteile an OGAW bzw. OGA werden grundsätzlich zum letzten vor dem Bewertungstag festgestellten Rücknahmepreis angesetzt oder zum letzten verfügbaren Kurs, der eine verlässliche Bewertung gewährleistet, bewertet. Falls für Investmentanteile die Rücknahme ausgesetzt ist oder keine Rücknahmepreise festgelegt werden, werden diese Anteile ebenso wie alle anderen Vermögenswerte zum jeweiligen Verkehrswert bewertet, wie ihn die Verwaltungsgesellschaft nach Treu und Glauben, allgemein anerkannten und nachprüfaren Bewertungsregeln festlegt.
- e) Falls die jeweiligen Kurse nicht marktgerecht sind, falls die unter b) genannten Finanzinstrumente nicht an einem geregelten Markt gehandelt werden und falls für andere als die unter den Buchstaben a) bis d) genannten Finanzinstrumente keine Kurse festgelegt wurden, werden diese Finanzinstrumente ebenso wie die sonstigen gesetzlich zulässigen Vermögenswerte zum jeweiligen Verkehrswert bewertet, wie ihn die Verwaltungsgesellschaft nach Treu und Glauben, allgemein anerkannten und nach nachprüfaren Bewertungsregeln (z.B. geeignete Bewertungsmodelle unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten) festlegt.
- f) Die flüssigen Mittel werden zu deren Nennwert zuzüglich Zinsen bewertet.
- g) Forderungen, z.B. abgegrenzte Zinsansprüche und Verbindlichkeiten, werden grundsätzlich zum Nennwert angesetzt.
- h) Der Marktwert von Wertpapieren, Geldmarktinstrumenten, abgeleiteten Finanzinstrumenten (Derivaten) und anderen Anlagen, die auf eine andere Währung als die Fondswährung lauten, wird zu dem unter Zugrundelegung des WM/Reuters-Fixings um 17.00 Uhr (16.00 Uhr Londoner Zeit) ermittelten Devisenkurs des dem Bewertungstag vorhergehenden Börsentages in die Fondswährung umgerechnet. Gewinne und Verluste aus Devisentransaktionen werden jeweils hinzugerechnet oder abgesetzt.

Die Verwaltungsgesellschaft kann für den Fonds festlegen, dass Wertpapiere Geldmarktinstrumente, abgeleitete Finanzinstrumente (Derivate) sowie sonstige Anlagen, die auf eine andere Währung als die Fondswährung lauten, zu dem unter Zugrundelegung des am Bewertungstag ermittelten Devisenkurses in die Fondswährung umgerechnet werden. Gewinne und Verluste aus Devisentransaktionen werden jeweils hinzugerechnet oder abgesetzt. Dies findet im Anhang zum Verkaufsprospekt des Fonds Erwähnung.

Das Netto-Fondsvermögen wird um die Ausschüttungen reduziert, die gegebenenfalls an die Anleger des Fonds gezahlt wurden.

6. Die Anteilwertberechnung erfolgt nach den vorstehend aufgeführten Kriterien. Soweit jedoch innerhalb des Fonds Anteilklassen gebildet wurden, erfolgt die daraus resultierende Anteilwertberechnung nach den vorstehend aufgeführten Kriterien für jede Anteilklasse getrennt.

Die in diesem Jahresabschluss veröffentlichten Tabellen können aus rechnerischen Gründen Rundungsdifferenzen in Höhe von +/- einer Einheit (Währung, Prozent etc.) enthalten.

Alquant Convexus

Erläuterungen zum Jahresabschluss zum 31. Dezember 2023

3.) BESTEUERUNG

Besteuerung des Fonds

Aus luxemburgischer Steuerperspektive hat der Fonds als Sondervermögen keine Rechtspersönlichkeit und ist steuertransparent.

Der Fonds unterliegt im Großherzogtum Luxemburg keiner Besteuerung auf seine Einkünfte und Gewinne. Das Fondsvermögen unterliegt im Großherzogtum Luxemburg lediglich, der sog. „*taxe d'abonnement*“ in Höhe von derzeit 0,05% p.a. Eine reduzierte „*taxe d'abonnement*“ von 0,01% p.a. ist anwendbar für (i) den Fonds oder Anteilklassen, deren Anteile ausschließlich an institutionelle Anleger im Sinne des Artikel 174 des Gesetzes vom 17. Dezember 2010 ausgegeben werden, (ii) Fonds, deren ausschließlicher Zweck die Anlage in Geldmarktinstrumente, in Termingelder bei Kreditinstituten oder beides ist. Investiert der Fonds in nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß Artikel 3 der Verordnung (EU) 2020/852 (EU-Taxonomie), kann eine Reduzierung der „*taxe d'abonnement*“ gemäß Artikel 174 Abs. 3 des Gesetzes vom 17. Dezember 2010 erfolgen. Die „*taxe d'abonnement*“ ist vierteljährlich auf das jeweils am Quartalsende ausgewiesene Netto-Fondsvermögen zahlbar. Die Höhe der „*taxe d'abonnement*“ ist für den Fonds oder die Anteilklassen im jeweiligen Anhang zum Verkaufsprospekt erwähnt. Eine Befreiung von der „*taxe d'abonnement*“ findet u.a. Anwendung, soweit das Fondsvermögen in anderen Luxemburger Investmentfonds angelegt ist, die ihrerseits bereits der *taxe d'abonnement* unterliegen.

Vom Fonds erhaltene Einkünfte (insbesondere Zinsen und Dividenden) können in den Ländern, in denen das Fondsvermögen angelegt ist, dort einer Quellenbesteuerung oder Veranlagungsbesteuerung unterworfen werden. Der Fonds kann auch auf realisierte oder unrealisierte Kapitalzuwächse seiner Anlagen im Quellenland einer Besteuerung unterliegen.

Ausschüttungen des Fonds sowie Liquidations- und Veräußerungsgewinne unterliegen im Großherzogtum Luxemburg keiner Quellensteuer. Weder die Verwahrstelle noch die Verwaltungsgesellschaft sind zur Einholung von Steuerbescheinigungen verpflichtet.

Besteuerung der Erträge aus Anteilen am Investmentfonds beim Anleger

Anleger, die nicht im Großherzogtum Luxemburg steuerlich ansässig sind, bzw. waren, und dort keine Betriebsstätte unterhalten oder einen permanenten Vertreter haben, unterliegen keiner luxemburger Ertragsbesteuerung im Hinblick auf ihre Einkünfte oder Veräußerungsgewinne aus ihren Anteilen am Fonds. Natürliche Personen, die im Großherzogtum Luxemburg steuerlich ansässig sind, unterliegen der progressiven luxemburgischen Einkommensteuer.

Gesellschaften, die im Großherzogtum Luxemburg steuerlich ansässig sind, unterliegen mit den Einkünften aus den Fondsanteilen der Körperschaftsteuer.

Interessenten und Anlegern wird empfohlen, sich über Gesetze und Verordnungen, die auf die Besteuerung des Fondsvermögens, die Zeichnung, den Kauf, den Besitz, die Rücknahme oder die Übertragung von Anteilen Anwendung finden, zu informieren und sich durch externe Dritte, insbesondere durch einen Steuerberater, beraten zu lassen.

4.) VERWENDUNG DER ERTRÄGE

Nähere Details zur Ertragsverwendung sind im aktuellen Verkaufsprospekt enthalten.

5.) INFORMATIONEN ZU DEN GEBÜHREN BZW. AUFWENDUNGEN

Angaben zu Management- und Verwahrstellengebühren können dem aktuellen Verkaufsprospekt entnommen werden.

6.) TOTAL EXPENSE RATIO (TER)

Für die Berechnung der Total Expense Ratio (TER) wurde folgende Berechnungsmethode angewandt:

$$\text{TER} = \frac{\text{Gesamtkosten in Fondswahrung}}{\text{Durchschnittliches Fondsvolumen (Basis: bewertungstagliches NFV¹⁾}} \times 100$$

¹⁾ NFV = Netto-Fondsvermögen

Die TER gibt an, wie stark das Fondsvermögen mit Kosten belastet wird. Berücksichtigt werden neben der Pauschalkommission sowie der „*taxe d'abonnement*“ alle übrigen Kosten mit Ausnahme der im Fonds angefallenen Transaktionskosten. Sie weist den Gesamtbetrag dieser Kosten als Prozentsatz des durchschnittlichen Fondsvolumens während eines Berichtszeitraumes aus. (Etwaige performanceabhängige Vergütungen werden in direktem Zusammenhang mit der TER gesondert ausgewiesen.)

Sofern der Fonds in Zielfonds investiert, wird auf die Berechnung einer synthetischen TER verzichtet.

7.) ERTRAGS- UND AUFWANDSAUSGLEICH

In den ordentlichen Nettoerträgen sind ein Ertragsausgleich und ein Aufwandsausgleich verrechnet. Diese beinhalten während des Berichtszeitraumes angefallene Nettoerträge, die der Aktienkäufer im Ausgabepreis mitbezahlt und der Aktienverkäufer im Rücknahmepreis vergütet erhält.

Alquant Convexus

Erläuterungen zum Jahresabschluss zum 31. Dezember 2023

8.) TRANSAKTIONSKOSTEN

Die Transaktionskosten berücksichtigen sämtliche Kosten, die im Berichtszeitraum auf Rechnung des Fonds separat ausgewiesen bzw. abgerechnet wurden und in direktem Zusammenhang mit einem Kauf oder Verkauf von Wertpapieren, Geldmarktinstrumenten, Derivaten oder anderen Vermögensgegenständen stehen. Zu diesen Kosten zählen im Wesentlichen Kommissionen, Abwicklungsgebühren und Steuern.

9.) KONTOKORRENTKONTEN (BANKGUTHABEN BZW. BANKVERBINDLICHKEITEN) DES FONDS

Sämtliche Kontokorrentkonten des jeweiligen Fonds (auch solche in unterschiedlichen Währungen), die tatsächlich und rechtlich nur Teile eines einheitlichen Kontokorrentkontos bilden, werden in der Zusammensetzung des jeweiligen Netto-Fondsvermögens als einheitliches Kontokorrent ausgewiesen. Kontokorrentkonten Fremdwährung, sofern vorhanden, werden in die jeweilige Fondswährung umgerechnet. Als Basis für die Zinsberechnung gelten die Bedingungen des jeweiligen Einzelkontos.

10.) AUFSTELLUNG ÜBER DIE ENTWICKLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS UND DER DERIVATE

Auf Anfrage ist am eingetragenen Sitz der Verwaltungsgesellschaft eine kostenfreie Aufstellung mit detaillierten Angaben über sämtliche während des Berichtszeitraums getätigte Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Schuldscheindarlehen und Derivaten, einschließlich Änderungen ohne Geldbewegungen, soweit sie nicht in der Vermögensaufstellung genannt sind, erhältlich.

11.) WESENTLICHE EREIGNISSE IM BERICHTSZEITRAUM

Russland/Ukraine-Konflikt

Infolge der weltweit beschlossenen Maßnahmen aufgrund des Ende Februar 2022 erfolgten Einmarschs russischer Truppen in die Ukraine verzeichneten vor allem europäische Börsen deutliche Kursverluste sowie eine steigende Volatilität. Die Finanzmärkte sowie die globale Wirtschaft sehen mittelfristig einer vor allem durch Unsicherheit geprägten Zukunft entgegen. Die konkreten bzw. möglichen mittel- bis langfristigen Implikationen des Russland/Ukraine Konflikts für die Weltwirtschaft, die Konjunktur, einzelne Märkte und Branchen sowie die sozialen Strukturen angesichts der Unsicherheit sind zum Zeitpunkt der Aufstellung des vorliegenden Jahresberichts nicht abschließend beurteilbar. Vor diesem Hintergrund können die Auswirkungen auf die Vermögenswerte des Fonds resultierend aus dem andauernden Konflikt, nicht antizipiert werden.

Die Verwaltungsgesellschaft hat entsprechende Überwachungsmaßnahmen und Kontrollen eingerichtet, um die Auswirkungen auf den Fonds zeitnah zu beurteilen und die Anlegerinteressen bestmöglich zu schützen. Zum Zeitpunkt der Aufstellung des vorliegenden Berichts liegen nach Auffassung der Verwaltungsgesellschaft des Fonds weder Anzeichen vor, die gegen die Fortführung des Fonds sprechen, noch ergaben sich für diesen bedeutsame Bewertungs- oder Liquiditätsprobleme.

Im Berichtszeitraum ergaben sich darüber hinaus keine wesentlichen Änderungen oder sonstige wesentliche Ereignisse.

12.) WESENTLICHE EREIGNISSE NACH DEM BERICHTSZEITRAUM

Nach dem Berichtszeitraum ergaben sich keine wesentlichen Änderungen oder sonstigen wesentliche Ereignisse.

13.) INFORMATIONEN FÜR SCHWEIZER ANLEGER

a) Allgemeines

Der Verkaufsprospekt mit integriertem Verwaltungsreglement, das Basisinformationsblatt und die Aufstellung der Zu- und Abgänge des Fonds sowie der Jahres- und Halbjahresbericht sind bei dem Vertreter in der Schweiz kostenlos erhältlich.

b.) Valorenummern:

Fondsname – Anteilklasse	Valorenummer
Alquant Convexus I	113722289
Alquant Convexus II ¹⁾	114590111

¹⁾ Zum Berichtsstichtag waren noch keine Anteile dieser Anteilklasse gezeichnet.

Alquant Convexus

Erläuterungen zum Jahresabschluss zum 31. Dezember 2023

c.) Total Expense Ratio (TER) nach der Richtlinie der Asset Management Association Switzerland vom 16. Mai 2008 (Fassung vom 5. August 2021).

Die bei der Verwaltung der kollektiven Kapitalanlage angefallenen Kommissionen und Kosten sind entsprechend der international unter dem Begriff „Total Expense Ratio (TER)“ bekannten Kennziffer offenzulegen. Diese Kennziffer drückt die Gesamtheit derjenigen Kommissionen und Kosten, die laufend dem Vermögen der Kollektivanlage belastet werden (Betriebsaufwand), retrospektiv in einem Prozentsatz des jeweiligen Netto-Fondsvermögens aus und ist grundsätzlich nach der folgenden Formel zu berechnen:

$$\text{TER} = \frac{\text{Total Betriebsaufwand in RE}^*}{\text{Durchschnittliches Netto-Fondsvermögen in RE}^*} \times 100$$

* RE = Einheiten in Rechnungswährung der kollektiven Kapitalanlage

Nach Richtlinie der Asset Management Association Switzerland vom 16. Mai 2008 (Fassung vom 5. August 2021) wurde für den Zeitraum vom 1. Januar 2023 bis zum 31. Dezember 2023 folgende TER in Prozent ermittelt:

Fondsname - Anteilklasse	Schweizer TER mit Performance Fee	Schweizer TER ohne Performance Fee
Alquant Convexus I	1,73	1,73

d.) Wertentwicklung in Prozent*

Stand: 31. Dezember 2023

Fonds	ISIN WKN	Anteilklassen-währung	6 Monate	1 Jahr	3 Jahre	10 Jahre	seit Auflegung
Alquant Convexus I seit 06.05.2022 (Tag der ersten NAV-Berechnung)	LU2220388479 A2QBQ5	USD	7,53%	19,65%	---	---	11,18%

* Auf Basis veröffentlichter Anteilwerte (BVI-Methode und AMAS-Richtlinie zur Berechnung und Publikation der Performance von kollektiven Kapitalanlagen vom 16. Mai 2008 (Fassung vom 5. August 2021))

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

e.) Hinweise für Anleger

Aus der Fondsmanagementvergütung können Vergütungen für den Vertrieb des Anlagefonds (Bestandspflegekommissionen) an Vertriebssträger und Vermögensverwalter ausgerichtet werden. Aus der Verwaltungskommission können institutionellen Anlegern, welche die Fondsanteile wirtschaftlich für Dritte halten, Rückvergütungen gewährt werden.

f.) Prospektänderungen im Berichtszeitraum

Publikationen zu Prospektänderungen im Berichtszeitraum werden auf www.swissfunddata.ch zum Abruf zur Verfügung gestellt.

Alquant Convexus

Bericht des Réviseur d'entreprises agréé

An die Anteilinhaber des
Alquant Convexus
4, rue Thomas Edison
L-1445 Strassen, Luxemburg

Prüfungsurteil

Wir haben den Jahresabschluss des Alquant Convexus (der „Fonds“) - bestehend aus der Zusammensetzung des Netto-Fondsvermögens, der Vermögensaufstellung zum 31. Dezember 2023, der Ertrags- und Aufwandsrechnung und der Veränderung des Netto-Fondsvermögens für das an diesem Datum endende Geschäftsjahr sowie den Erläuterungen zum Jahresabschluss, mit einer Zusammenfassung bedeutsamer Rechnungslegungsmethoden - geprüft.

Nach unserer Beurteilung vermittelt der beigefügte Jahresabschluss in Übereinstimmung mit den in Luxemburg geltenden gesetzlichen Bestimmungen und Verordnungen betreffend die Aufstellung und Darstellung des Jahresabschlusses ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild der Vermögens- und Finanzlage des Alquant Convexus zum 31. Dezember 2023 sowie der Ertragslage und der Entwicklung des Nettofondsvermögens für das an diesem Datum endende Geschäftsjahr.

Grundlage für das Prüfungsurteil

Wir führten unsere Abschlussprüfung in Übereinstimmung mit dem Gesetz über die Prüfungstätigkeit (Gesetz vom 23. Juli 2016) und nach den für Luxemburg von der *Commission de Surveillance du Secteur Financier* (CSSF) angenommenen internationalen Prüfungsstandards (ISA) durch. Unsere Verantwortung gemäß dem Gesetz vom 23. Juli 2016 und den ISA-Standards, wie sie in Luxemburg von der CSSF angenommen wurden, wird im Abschnitt „Verantwortung des *réviseur d'entreprises agréé* für die Jahresabschlussprüfung“ weitergehend beschrieben. Wir sind unabhängig von dem Fonds in Übereinstimmung mit dem *International Code of Ethics for Professional Accountants, including International Independence Standards*, herausgegeben vom *International Ethics Standards Board for Accountants* (IESBA Code) und für Luxemburg von der CSSF angenommen, zusammen mit den beruflichen Verhaltensanforderungen, welche wir im Rahmen der Jahresabschlussprüfung einzuhalten haben und haben alle sonstigen Berufspflichten in Übereinstimmung mit diesen Verhaltensanforderungen erfüllt. Wir sind der Auffassung, dass die von uns erlangten Prüfungsnachweise ausreichend und geeignet sind, um als Grundlage für unser Prüfungsurteil zu dienen.

Sonstige Informationen

Der Vorstand der Verwaltungsgesellschaft des Fonds ist verantwortlich für die sonstigen Informationen. Die sonstigen Informationen beinhalten die Informationen, welche im Jahresbericht enthalten sind, jedoch beinhalten sie nicht den Jahresabschluss oder unseren Bericht des *réviseur d'entreprises agréé* zu diesem Jahresabschluss.

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

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

Alquant Convexus

Bericht des Réviseur d'entreprises agréé

Verantwortung des Vorstands der Verwaltungsgesellschaft des Fonds für den Jahresabschluss

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

Bei der Aufstellung des Jahresabschlusses ist der Vorstand der Verwaltungsgesellschaft des Fonds verantwortlich für die Beurteilung der Fähigkeit des Fonds zur Fortführung der Unternehmenstätigkeit und - sofern einschlägig - Angaben zu Sachverhalten zu machen, die im Zusammenhang mit der Fortführung der Unternehmenstätigkeit stehen, und die Annahme der Unternehmensfortführung als Rechnungslegungsgrundsatz zu nutzen, sofern nicht der Vorstand der Verwaltungsgesellschaft des Fonds beabsichtigt, den Fonds zu liquidieren, die Geschäftstätigkeit einzustellen oder keine andere realistische Alternative mehr hat, als so zu handeln.

Verantwortung des réviseur d'entreprises agréé für die Jahresabschlussprüfung

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

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

Darüber hinaus:

- Identifizieren und beurteilen wir das Risiko von wesentlichen falschen Darstellungen im Jahresabschluss aus Unrichtigkeiten oder Verstößen, planen und führen Prüfungshandlungen durch als Antwort auf diese Risiken und erlangen Prüfungsnachweise, die ausreichend und angemessen sind, um als Grundlage für unser Prüfungsurteil zu dienen. Das Risiko, dass wesentliche falsche Darstellungen nicht aufgedeckt werden, ist bei Verstößen höher als bei Unrichtigkeiten, da Verstöße betrügerisches Zusammenwirken, Fälschungen, beabsichtigte Unvollständigkeiten, irreführende Angaben bzw. das Außerkraftsetzen interner Kontrollen beinhalten können.
- Gewinnen wir ein Verständnis von dem für die Abschlussprüfung relevanten internen Kontrollsystem, um Prüfungshandlungen zu planen, die unter den gegebenen Umständen angemessen sind, jedoch nicht mit dem Ziel, ein Prüfungsurteil zur Wirksamkeit des internen Kontrollsystems des Fonds abzugeben.
- Beurteilen wir die Angemessenheit der von dem Vorstand der Verwaltungsgesellschaft des Fonds angewandten Bilanzierungsmethoden, der rechnungslegungsrelevanten Schätzungen und der entsprechenden Erläuterungen.
- Schlussfolgern wir über die Angemessenheit der Anwendung des Rechnungslegungsgrundsatzes der Fortführung der Unternehmenstätigkeit durch den Vorstand der Verwaltungsgesellschaft des Fonds sowie auf der Grundlage der erlangten Prüfungsnachweise, ob eine wesentliche Unsicherheit im Zusammenhang mit Ereignissen oder Gegebenheiten besteht, die bedeutsame Zweifel an der Fähigkeit des Fonds zur Fortführung der Unternehmenstätigkeit aufwerfen könnten. Sollten wir schlussfolgern, dass eine wesentliche Unsicherheit besteht, sind wir verpflichtet, im Bericht des réviseur d'entreprises agréé auf die dazugehörigen Erläuterungen zum Jahresabschluss hinzuweisen oder, falls die Angaben unangemessen sind, das Prüfungsurteil zu modifizieren. Diese Schlussfolgerungen basieren auf der Grundlage der bis zum Datum des Berichts des réviseur d'entreprises agréé erlangten Prüfungsnachweise. Zukünftige Ereignisse oder Gegebenheiten können jedoch dazu führen, dass der Fonds seine Unternehmenstätigkeit nicht mehr fortführen kann.

Alquant Convexus

Bericht des Réviseur d'entreprises agréé

- Beurteilen wir die Gesamtdarstellung, den Aufbau und den Inhalt des Jahresabschlusses einschließlich der Erläuterungen, und beurteilen ob dieser die zugrundeliegenden Geschäftsvorfälle und Ereignisse sachgerecht darstellt.

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

Für Deloitte Audit, Cabinet de révision agréé

Rainer Mahnkopf, Réviseur d'entreprises agréé
Managing Director

Den 26. April 2024
20, Boulevard de Kockelscheuer
L-1821 Luxembourg

Alquant Convexus

Zusätzliche Erläuterungen (ungeprüft)

1.) RISIKOMANAGEMENT

Die Verwaltungsgesellschaft verwendet ein Risikomanagement-Verfahren, das es ihr erlaubt, das mit den Anlagepositionen verbundene Risiko sowie ihren Anteil am Gesamtrisikoprofil des Anlageportfolios ihrer verwalteten Fonds jederzeit zu überwachen und zu messen. Im Einklang mit dem Gesetz vom 17. Dezember 2010 und den anwendbaren aufsichtsbehördlichen Anforderungen der Commission de Surveillance du Secteur Financier („CSSF“) berichtet die Verwaltungsgesellschaft regelmäßig der CSSF über das eingesetzte Risikomanagement-Verfahren. Die Verwaltungsgesellschaft stellt im Rahmen des Risikomanagement-Verfahrens anhand zweckdienlicher und angemessener Methoden sicher, dass das mit Derivaten verbundene Gesamtrisiko der verwalteten Fonds den Gesamtnettwert deren Portfolios nicht überschreitet. Dazu bedient sich die Verwaltungsgesellschaft folgender Methoden:

- **Commitment Approach:**

Bei der Methode „Commitment Approach“ werden die Positionen aus derivativen Finanzinstrumenten in ihre entsprechenden (ggf. delta-gewichteten) Basiswertäquivalente oder Nominale umgerechnet. Dabei werden Netting- und Hedgingeffekte zwischen derivativen Finanzinstrumenten und ihren Basiswerten berücksichtigt. Die Summe dieser Basiswertäquivalente darf den Gesamtnettwert des Fondsportfolios nicht überschreiten.

- **VaR-Ansatz:**

Die Kennzahl Value-at-Risk (VaR) ist ein mathematisch-statistisches Konzept und wird als ein Standard-Risikomaß im Finanzsektor verwendet. Der VaR gibt den möglichen Verlust eines Portfolios während eines bestimmten Zeitraums (sogenannte Halteperiode) an, der mit einer bestimmten Wahrscheinlichkeit (sogenanntes Konfidenzniveau) nicht überschritten wird.

- **Relativer VaR-Ansatz:**

Bei dem relativen VaR-Ansatz darf der VaR des Fonds den VaR eines Referenzportfolios um einen von der Höhe des Risikoprofils des Fonds abhängigen Faktor nicht übersteigen. Der aufsichtsrechtlich maximal zulässige Faktor beträgt 200%. Dabei ist das Referenzportfolio grundsätzlich ein korrektes Abbild der Anlagepolitik des Fonds.

- **Absoluter VaR-Ansatz:**

Bei dem absoluten VaR-Ansatz darf der VaR (99% Konfidenzniveau, 20 Tage Haltedauer) des Fonds einen von der Höhe des Risikoprofils des Fonds abhängigen Anteil des Fondsvermögens nicht überschreiten. Das aufsichtsrechtlich maximal zulässige Limit beträgt 20% des Fondsvermögens.

Für Fonds, deren Ermittlung des Gesamtrisikos durch die VaR-Ansätze erfolgt, schätzt die Verwaltungsgesellschaft den erwarteten Grad der Hebelwirkung. Dieser Grad der Hebelwirkung kann in Abhängigkeit der jeweiligen Marktlagen vom tatsächlichen Wert abweichen und über- als auch unterschritten werden. Der Aktionär wird darauf hingewiesen, dass sich aus dieser Angabe keine Rückschlüsse auf den Risikogehalt des Fonds ergeben. Darüber hinaus ist der veröffentlichte erwartete Grad der Hebelwirkung explizit nicht als Anlagegrenze zu verstehen. Die verwendete Methode zur Bestimmung des Gesamtrisikos und, soweit anwendbar, die Offenlegung des Referenzportfolios und des erwarteten Grades der Hebelwirkung sowie dessen Berechnungsmethode werden im fondsspezifischen Anhang angegeben.

Gemäß dem zum Berichtszeitraumende 31. Dezember 2023 gültigen Verkaufsprospekt unterliegt der Fonds folgenden Risikomanagement-Verfahren:

- **Commitment Approach:**

Im Zeitraum vom 1. Januar 2023 bis zum 31. Dezember 2023 wurde zur Überwachung und Messung des mit Derivaten verbundenen Gesamtrisikos für den Fonds Alquant Convexus der Commitment Approach verwendet.

2.) ANGABEN ZUM VERGÜTUNGSSYSTEM

Die Verwaltungsgesellschaft IPConcept (Luxemburg) S.A. hat eine Vergütungssystematik festgelegt, welche den gesetzlichen und aufsichtsrechtlichen Vorschriften entspricht. Sie ist mit einem soliden und wirksamen Risikomanagement vereinbar und diesem förderlich und ermutigt weder zur Übernahme von Risiken, die mit den Risikoprofilen, Vertragsbedingungen oder Satzungen der verwalteten Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren (nachfolgend „OGAW“) nicht vereinbar sind, noch hindert sie die IPConcept (Luxemburg) S.A. daran, pflichtgemäß im besten Interesse des OGAW zu handeln.

Die Vergütungssystematik steht im Einklang mit der Geschäftsstrategie, den Zielen, den Werten und den Interessen der IPConcept (Luxemburg) S.A. und der von ihr verwalteten OGAW und ihrer Anleger und berücksichtigt dabei den Grundsatz zur Vermeidung von Interessenkonflikten.

Die IPConcept (Luxemburg) S.A. unterscheidet neben der Vergütung auf Grundlage des individualvertraglich in Bezug genommenen Kollektivvertrages für Bankangestellte in der jeweils gültigen Fassung die Vergütungssysteme für außertarifliche Mitarbeiter und für identifizierte Mitarbeiter.

Alquant Convexus

Zusätzliche Erläuterungen (ungeprüft)

Außertarifliche Mitarbeiter unterliegen dem Vergütungssystem für Mitarbeiter im außertariflichen Bereich der IPConcept (Luxemburg) S.A. Die Vergütung der außertariflichen Mitarbeiter setzt sich aus einem angemessenen Jahresfestgehalt und einer variablen leistungs- und ergebnisorientierten Vergütung zusammen, wobei der Schwerpunkt auf der fixen Vergütung liegt. Jede außertarifliche Stelle wird anhand festgelegter Kriterien bewertet und einer von vier Verantwortungsstufen zugeordnet. Die außertariflichen Mitarbeiter erhalten einen individuellen Referenzbonus, der an die jeweils relevante Verantwortungsstufe gekoppelt ist. Das Bonussystem für außertarifliche Mitarbeiter verknüpft den Referenzbonus sowohl mit der individuellen Leistung des Mitarbeiters, der Entwicklung des jeweiligen Segmentes sowie dem Erfolg der IPConcept (Luxemburg) S.A.

Die identifizierten Mitarbeiter unterliegen dem Vergütungssystem für identifizierte Mitarbeiter der IPConcept (Luxemburg) S.A. Dieses leitet sich aus dem Vergütungssystem der außertariflichen Mitarbeiter ab, sieht jedoch im Bereich der variablen Vergütung einen Maximalbonus vor. Die Zielvereinbarungssystematik berücksichtigt quantitative und qualitative Ziele. Die variable Vergütung von identifizierten Mitarbeitern wird bei Erreichen eines festgelegten Schwellenwertes in Teilen zurückbehalten und mit einer Sperrfrist versehen.

Die Gesamtvergütung der 50 Mitarbeiter der IPConcept (Luxemburg) S.A. als Verwaltungsgesellschaft beläuft sich zum 31. Dezember 2023 auf 6.535.175,29 EUR. Diese unterteilt sich in:

Fixe Vergütung:	5.964.761,69 EUR
Variable Vergütung:	570.413,60 EUR
Für Führungskräfte der Verwaltungsgesellschaft, deren Tätigkeit sich wesentlich auf das Risikoprofil der OGAWs auswirkt:	1.234.472,80 EUR
Für Mitarbeiter der Verwaltungsgesellschaft, deren Tätigkeit sich wesentlich auf das Risikoprofil der OGAWs auswirkt:	0,00 EUR

Die oben genannte Vergütung bezieht sich auf die Gesamtheit der OGAWs und alternativen Investmentfonds, die von der IPConcept (Luxemburg) S.A. verwaltet werden. Alle Mitarbeiter sind ganzheitlich mit der Verwaltung aller Fonds befasst, so dass eine Aufteilung pro Fonds nicht möglich ist.

Mindestens einmal jährlich findet eine zentrale und unabhängige interne Prüfung statt, ob die Vergütungspolitik gemäß den vom Aufsichtsrat der IPConcept (Luxemburg) S.A. festgelegten Vergütungsvorschriften und -verfahren umgesetzt wird. Die Überprüfung hat ergeben, dass die Vergütungssysteme der IPConcept (Luxemburg) S.A. in Bezug auf die definierten Prüfungsgegenstände angemessen ausgestaltet sind. Der Aufsichtsrat hat den Bericht über die zentrale und unabhängige Überprüfung der Umsetzung der Vergütungspolitik 2023 zur Kenntnis genommen.

Gegenüber dem Vorjahr wurde keine Änderung der Vergütungssystematik vorgenommen.

Weitere Einzelheiten der aktuellen Vergütungspolitik können kostenlos auf der Internetseite der Verwaltungsgesellschaft www.ipconcept.com unter der Rubrik „Anlegerinformationen“ abgerufen werden. Auf Anfrage wird Anlegern kostenlos eine Papierversion zur Verfügung gestellt.

Angaben zur Mitarbeitervergütung im Auslagerungsfall

Die IPConcept (Luxemburg) S.A. hat die Portfolioverwaltung an die Alquant AG ausgelagert. Die IPConcept (Luxemburg) S.A. zahlt keine direkte Vergütung aus dem Fonds an Mitarbeiter des Auslagerungsunternehmens. Das Auslagerungsunternehmen hat folgende Informationen selbst veröffentlicht:

Gesamtsumme der im abgelaufenen Geschäftsjahr des Auslagerungsunternehmens gezahlten Mitarbeitervergütung	470.632,00 CHF
Davon feste Vergütung:	468.632,00 CHF
Davon variable Vergütung:	2.000,00 CHF
Direkt aus dem Fonds gezahlte Vergütungen:	0,00 CHF
Anzahl der Mitarbeiter des Auslagerungsunternehmens:	8

3.) KLASSIFIZIERUNG NACH SFDR-VERORDNUNG (EU 2019/2088)

Der Fonds ist ein Produkt im Sinne des Artikels 6 der Verordnung (EU) 2019/2088 (Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor).

Erklärung gemäß Artikel 7 der Verordnung (EU) 2020/852 vom 18. Juni 2020 (Taxonomie): Die diesem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alquant Convexus

Zusätzliche Erläuterungen (ungeprüft)

4.) TRANSPARENZ VON WERTPAPIERGESCHÄFTEN UND DEREN WEITERVERWENDUNG

Die IPCConcept (Luxemburg) S.A., als Verwaltungsgesellschaft von Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren (OGAW) sowie als Manager alternativer Investmentfonds („AIFM“), fällt per Definition in den Anwendungsbereich der Verordnung (EU) 2015/2365 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 25. November 2015 über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften und der Weiterverwendung sowie zur Änderung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 („SFTR“).

Im Berichtszeitraum des Investmentfonds kamen keine Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Gesamtrendite-Swaps im Sinne dieser Verordnung zum Einsatz. Somit sind im vorliegenden Bericht keine Angaben im Sinne von Artikel 13 der genannten Verordnung an die Anleger aufzuführen.

Details zur Anlagestrategie und den eingesetzten Finanzinstrumenten des Investmentfonds können jeweils aus dem aktuellen Verkaufsprospekt entnommen sowie kostenlos auf der Internetseite der Verwaltungsgesellschaft www.ipconcept.com unter der Rubrik „Anlegerinformationen“ abgerufen werden.

Alquant Convexus

Verwaltung, Vertrieb und Beratung

Verwaltungsgesellschaft

IPConcept (Luxemburg) S.A.

4, rue Thomas Edison
L-1445 Strassen, Luxemburg

Vorstand der Verwaltungsgesellschaft

Vorstandsvorsitzender:

Marco Onischschenko
Vorstandsvorsitzender

Vorstandsmitglieder:

Nikolaus Rummler
Silvia Mayers (bis zum 30. September 2023)
Jörg Hügel (seit dem 30. Januar 2024)

Aufsichtsrat der Verwaltungsgesellschaft

Aufsichtsratsvorsitzender:

Dr. Frank Müller
Mitglied des Vorstandes
DZ PRIVATBANK S.A.

Aufsichtsratsmitglieder:

Klaus-Peter Bräuer
Bernhard Singer

Abschlussprüfer der Verwaltungsgesellschaft

PricewaterhouseCoopers, Société coopérative

2, rue Gerhard Mercator
B.P. 1443
L-1014 Luxemburg

Verwahrstelle

DZ PRIVATBANK S.A.

4, rue Thomas Edison
L-1445 Strassen, Luxemburg

Abschlussprüfer des Fonds

Deloitte Audit, Société à responsabilité limitée

Cabinet de Révision Agréé
20, Boulevard de Kockelscheuer
L-1821 Luxemburg

Register- und Transferstelle sowie Zentralverwaltungsstelle

DZ PRIVATBANK S.A.

4, rue Thomas Edison
L-1445 Strassen, Luxemburg

Einrichtung gemäß den Bestimmungen nach
EU-Richtlinie 2019/1160 Art. 92 verantwortlich
für Luxemburg:

DZ PRIVATBANK S.A.

4, rue Thomas Edison
L-1445 Strassen, Luxemburg

Fondsmanager

Alquant AG

Chemin de Mongevon 25
1023 Crissier, Schweiz

Zusätzliche Angaben für Anleger in der Schweiz
Zahlstelle

DZ PRIVATBANK (Schweiz) AG

Münsterhof 12
Postfach
CH-8022 Zürich

Vertreter

IPConcept (Schweiz) AG

Münsterhof 12
Postfach
CH-8022 Zürich

