



GENIUS 100 CROSS ASSET

Jahresbericht zum 31. Dezember 2024

Verwaltungsgesellschaft: BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT EUROPE

Gesellschaftssitz: 1, boulevard Haussmann 75009 Paris

Depotbank: BNP PARIBAS SA

Veröffentlichung der Zeichnungs- und Rücknahmepreise: Bereitstellung an die Anteilinhaber bei der Verwaltungsgesellschaft

Inhalt

Rechenschaftsbericht

Anlagepolitik	4
Bestätigungsvermerk	12

Jahresabschluss

Aktiva	17
Passiva	18
Gewinn- und Verlustrechnung	19

Jahresabschluss - Anhang

Anlagestrategie	21
Kennzeichnende Elemente des OGA in den letzten fünf Geschäftsjahren	22
Rechnungslegungsregeln und -methoden	23
Entwicklung des Eigenkapitals	28
Entwicklung der Anzahl der Anteile im Laufe des Geschäftsjahres	29
Aufschlüsselung des Nettovermögens nach Art der Anteile	30
Direktes Engagement am Aktienmarkt (ohne Wandelanleihen)	31
Engagement am Markt für Wandelanleihen	32
Direktes Engagement am Zinsmarkt (ohne Wandelanleihen) - Aufschlüsselung nach Art des Zinssatzes	33
Direktes Engagement am Zinsmarkt (ohne Wandelanleihen) - Aufschlüsselung nach Restlaufzeit	34
Direktes Engagement am Devisenmarkt	35
Direktes Engagement an den Kreditmärkten	36
Engagement aus Geschäften mit Gegenparteien	37
Indirekte Engagements für Multi-Management-OGAs	38
Forderungen und Verbindlichkeiten: Aufschlüsselung nach Art	39
Verwaltungsgebühren, sonstige Kosten und Aufwendungen	40
Erhaltene und eingegangene Verpflichtungen	41
Sonstige Informationen	42
Ermittlung und Aufschlüsselung der ausschüttungsfähigen Beträge	43
Anlagebestand	45
Aufstellung der Devisentermingeschäfte	47

GENIUS 100 CROSS ASSET

Aufstellung der Finanztermininstrumente (ohne solche zur Absicherung einer Anteilsklasse).....	48
Aufstellung der zur Absicherung einer Anteilsklasse eingesetzten Finanztermininstrumente	50
Zusammenfassung der Aufstellung.....	51
Anhang.....	52

RECHENSCHAFTSBERICHT

ABSCHLUSSPRÜFER

PriceWaterhouseCoopers Audit

ANLAGEPOLITIK

Der FCP GENIUS 100 Cross Asset, der am 30.05.2023 aufgelegt wurde, ist ein Fonds Commun de Placement („FCP“) gemäß der Richtlinie 2009/65/EG in der jeweils gültigen Fassung.

Das Anlageziel des FCP besteht darin, Anteilhabern, deren Anteile des FCP bis spätestens 7. September 2023 zentralisiert wurden, die Möglichkeit zu geben, einen Nettoinventarwert am Vergleichsdatum (31. Juli 2035) zu erhalten: (i) mindestens 106,61 % des Referenz-Nettoinventarwerts vom 10. August 2023 gemäß Definition unter „Garantie oder Schutz“ des Verkaufsprospekts, (ii) erhöht (durch eine Kaufoption) um eine, gegebenenfalls teilweise, Beteiligung an der positiven Wertentwicklung eines Korbs systematischer Strategien.

Der FCP wird am Fälligkeitsdatum automatisch aufgelöst.

Um sein Anlageziel zu erreichen, schließt der FCP ein oder mehrere Finanztermininstrumente ab, die es ihm ermöglichen, zum Fälligkeitsdatum einen Betrag zu erhalten, der es ihm – unter Berücksichtigung der Wertpapiere im Portfolio – ermöglicht, das Anlageziel und insbesondere die Beteiligung an der positiven Wertentwicklung des nachstehend beschriebenen Strategiekorbs zu erreichen.

Vom Datum der Einrichtung des FCP bis zum 10. August 2023 wird der FCP umsichtig verwaltet, indem in sehr kurzfristige Zinsinstrumente und/oder Geldmarktfonds aller Klassifizierungen und/oder durch ein derivatives Instrument abgedeckte Wertpapiere investiert wird.

Zum Fälligkeitstermin beträgt der Nettoinventarwert des FCP mindestens 106,61 % des Referenz-Nettoinventarwerts. Anteilhaber profitieren außerdem von der Beteiligung an der positiven Performance eines Korbs systematischer Strategien (im Folgenden als „Risikoanlage“ bezeichnet), wie nachstehend beschrieben.

Bei Risikoanlagen handelt es sich um eine diversifizierte, in Euro abgesicherte Strategie, die aus Long- und Short-Positionen besteht und ihre Vermögenswerte auf verschiedene Teilstrategien verteilt. Jede dieser Strategien zielt darauf ab, individuelle Renditequellen zu identifizieren, die sich aus Marktchancen oder Ineffizienzen in verschiedenen Anlageklassen ergeben.

Die Risikoanlage kann daher aus quantitativen Strategien auf Aktien bestehen, darunter Volatilität auf Aktien, Rohstoffe über Finanzindizes, Anleihen einschließlich Unternehmens- und Staatsanleihen, Zinssätze und Wechselkurse, unter anderem über Relative-Value-Strategien, Trendüberwachung („Momentum“), „Long/Short“, Volatilität und Fokus auf die Terminstruktur.

Der FCP ist jedoch möglicherweise nicht immer in allen oben genannten Anlageklassen oder Arten von Strategien engagiert.

Darüber hinaus verfügt die Risikoanlage ebenfalls über einen Mechanismus zur Volatilitätskontrolle. Dieser soll die jährliche Volatilität bei einem Zielniveau von rund 5 % halten. Für die Anlageklasse „Staatsanleihen“ der Risikoanlage wird ein Demokratie-Score auf der Grundlage der folgenden Kriterien angewendet: die Unterzeichnung internationaler Standards, Standards für soziale Kriterien in Bezug auf Menschenrechte, umstrittene Waffen, Ungleichheit zwischen den Geschlechtern, Meinungsfreiheit sowie Kriterien in Bezug auf Unternehmensführung und Korruptionsbekämpfung zugunsten von politischer Stabilität und Rechtsstaatlichkeit.

Das Engagement in der Risikoanlage wird über eine Kaufoption realisiert, um eine, gegebenenfalls teilweise, Beteiligung an der positiven Entwicklung des Strategiekorbs zu erhalten.

Darüber hinaus gibt ein zusätzlicher Mechanismus zur Beobachtung der Kurse auf jährlicher Basis (am 31. Juli jedes Jahres) den Inhabern die Möglichkeit, bis zu 90 % dieser jährlichen Beobachtungen zu sichern. Sollte die beobachtete Höhe der Strategie zum Fälligkeitstermin also weniger als 90 % einer dieser Zwischenbeobachtungen betragen, wird die Rücknahme der Kaufoption auf 90 % der höchsten jährlichen Beobachtung basieren.

Die Verwaltungsgesellschaft verfügt über Werkzeuge, mit denen sie jederzeit die Bewertung der Finanztermininstrumente prüfen kann, die von der Gegenpartei der Kontrakte gestellt werden.

Angesichts seines Anlageziels und der verfolgten Anlagestrategie kann die Wertentwicklung des FCP nicht mit der Wertentwicklung irgendeines Referenzindex verglichen werden.

Die Anteilsklasse I des FCP GENIUS 100 Cross Asset - FR001400GJT7, die allen Zeichnern offenstehen, jedoch besonders für institutionelle Anleger geeignet ist und insbesondere für die Wüstenrot & Württembergische AG bestimmt ist, wurde bei Auflegung des FCP, d. h. am 30.05.2023, mit einem anfänglichen Nettoinventarwert von 99,63 EUR aufgelegt. Der Mindestanlagebetrag bei Erstzeichnung dieser Anteilsklasse beträgt 100.000,00 EUR (Folgezeichnung: entfällt).

GENIUS 100 CROSS ASSET

ISIN-Code	Anteile	Währung	NIW zum 31. Dezember 2024	Jährliche Performance	Anzahl Anteile zum 31. Dezember 2024	Veränderung Anzahl der Anteile seit dem
FR001400GJT7	I CAP	EUR	95,80	-5,86 %	836.653,00	- 12.797,00

Änderungen während des Geschäftsjahres

1. März 2024: Umbenennung der SDG BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT France in BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT Europe.

Gesamtrisiko

Die Verwaltungsgesellschaft verwendet zur Berechnung des Gesamtrisikos des FCP die Berechnungsmethode des Value at Risk (absoluter VaR). Das Niveau des Hebels des FCP, bewertet als die Summe der Nominalbeträge der Positionen in den verwendeten Finanzkontrakten, beträgt 200 %. Es kann jedoch ein höheres Niveau erreicht werden.

GPS-ID	FUND	VAR					
		MIN		AVERAGE		MAX	
		HISTO	MC	HISTO	MC	HISTO	MC
44471	GENIUS 100 CROSS ASSET	1,57 %		5,63 %		11,94 %	

Wertentwicklung

Die jährliche Performance betrug -5,86 %.

Die frühere Wertentwicklung lässt nicht auf die zukünftige Wertentwicklung des OGA schließen.

GENIUS 100 CROSS ASSET

Wertpapierfinanzierungsgeschäfte gemäß der SFTR-Verordnung

Allgemeine Informationen		
Name des Fonds	GENIUS 100 CROSS ASSET	Jeder Vermögenswert, der von diesem Fonds einer anderen Partei gegeben wird, gilt als engagiert und wird von dieser Partei übernommen.
Fondswährung	EUR	Alle nachstehenden Beträge sind in Portfoliowährungen ausgedrückt.
Art der Transaktion	Total Return Swaps	
Abrechnung und Abwicklung	Bilateral	Die Abwicklung von SFT und TRS ist immer bilateral.
NIW-Datum	31. Dezember 2024	

Informationen über die Transaktion		
Absoluter Wert der engagierten Aktiva		167.335.090,66
Höhe der engagierten Aktiva im Verhältnis zum verwalteten Vermögen		208,77 %
Verliehene Wertpapiere im Verhältnis zu den verleihbaren Aktiva	Während des Berichtszeitraums wurden keine Wertpapiere verliehen	0,00 %
Verliehene Rohstoffe im Verhältnis zu den verleihbaren Aktiva	Während des Berichtszeitraums wurden keine Rohstoffe verliehen	0,00 %

Transaktion - Aufschlüsselung der Informationen	Zusätzliche Informationen	Value
Kontrahent		
BNP Paribas	Frankreich	167.335.090,66
Laufzeit		
Mehr als ein Jahr		167.335.090,66

Erhaltene Sicherheiten - Aufschlüsselung der Informationen	Zusätzliche Informationen	Value
Kontrahent		
BNP Paribas		1.962.900,12
Währung (bewertet in Referenzwährung)		
EUR		1.962.900,12
Emittent		
BNP PARIBAS ISSUANCE BV		1.962.900,12
Art des Instruments		
Anleihen		1.962.900,12
Laufzeit		
Mehr als ein Jahr		1.962.900,12
Rating		
A1	Moody's	1.962.900,12
Summe		1.962.900,12

Hinweis: Die im Berichtszeitraum ausgetauschten Sicherheiten umfassen das gesamte OTC-Derivategeschäft des Fonds und nicht nur die TRS.

Erhaltene Sicherheiten - Informationen zur Verwahrung	Name	Absoluter Wert
Depotbank	BNP PARIBAS SECURITIES SERVICES	1.962.900,12

Gewährte Sicherheiten - Aufschlüsselung der Informationen	Zusätzliche Informationen	Value
Summe		

Hinweis: Die im Berichtszeitraum ausgetauschten Sicherheiten umfassen das gesamte OTC-Derivategeschäft des Fonds und nicht nur die TRS.

Gewährte Sicherheiten - Informationen zur Verwahrung	Absoluter Wert der gewährten Sicherheiten	Zusätzliche Informationen
Getrennte Konten	0,00	
Sammelkonten	0,00	
Sonstige Konten	0,00	

Wirtschaftliche Leistung dieser Art von Transaktion	Absoluter Wert	In Prozent der Gesamterträge, die durch diese Art von Transaktion erzielt wurden
Fondsmanager		
Erträge	0,00	0,00 %
Kosten	0,00	0,00 %
Organismus für gemeinsame Anlagen		
Erträge	0,00	0,00 %
Kosten	0,00	0,00 %
Dritte		
Erträge	0,00	0,00 %
Kosten	0,00	0,00 %

Es besteht keine Vereinbarung über die Verteilung der mit den TRS verbundenen Kosten. 100 % dieser Kosten und Erträge werden in der Gewinn- und Verlustrechnung des Fonds unter „Sonstige Finanzerträge“ und „Sonstige Finanzaufwendungen“ ausgewiesen.

Gewährte Sicherheiten - Informationen zur Verwahrung	Absoluter Wert der gewährten Sicherheiten	Zusätzliche Informationen
Betrag der wiederverwendeten Wertpapiersicherheiten	0,00	Im Berichtszeitraums wurden keine Wertpapiersicherheiten vom Fonds wiederverwendet.
Erträge aus wiederverwendeten Barsicherheiten	0,00	

GENIUS 100 CROSS ASSET

DEONTOLOGIE

Im OGA gehaltene Finanzinstrumente der Gruppe

Diese Informationen sind im Anhang des Jahresberichts - Ergänzende Informationen enthalten.

Die wichtigsten Änderungen betreffend die Zusammensetzung des Wertpapierportfolios im Berichtszeitraum

ISIN-CODE	Produktbezeichnung	Sens	Bruttobetrag
US98389BBB53	XCEL ENERGY INC 5,5 % 24-15.03.2034	Kauf	4.223.419,11
US172967PA33	CITIGROUP INC 22-17.11.2033 FRN	Kauf	3.958.360,90
US172967PA33	CITIGROUP INC 22-17.11.2033 FRN	Kauf	3.958.360,90
US172967PA33	CITIGROUP INC 22-17.11.2033 FRN	Kauf	3.958.360,90
US750236AW16	RADIAN GROUP INC 4,875 % 19-15.03.2027	Kauf	3.937.252,07

ISIN-CODE	Produktbezeichnung	Sens	Bruttobetrag
XS2358383466	NOBIAN FINANCE B 3,625 % 21-15.07.2026	Verkauf	4.136.753,16
US172967PA33	CITIGROUP INC 22-17.11.2033 FRN	Verkauf	3.879.647,85
US025816DL03	AMERICAN EXPRESS 23-30.10.2026 FRN	Verkauf	3.827.710,56
US025816DL03	AMERICAN EXPRESS 23-30.10.2026 FRN	Verkauf	3.827.710,56
XS2401851485	SCIL IV LLC / SC 21-01.11.2026 FRN	Verkauf	3.821.531,95

Im Rahmen der Verwaltung der kollektiven Kapitalanlagen werden Transaktionsgebühren für Geschäfte mit Finanzinstrumenten (Kauf und Verkauf von Wertpapieren, Pensionsgeschäfte, Futures, Swaps) erhoben.

Offenlegung zur Bewertung von ökologischen oder sozialen Merkmalen und nachhaltigen Investitionen

I – Ansatz von BNP Paribas Asset Management

BNP Paribas Asset Management stellt den Anlegern auf seiner Website seine Richtlinie zur Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken in die Anlageentscheidungsprozesse gemäß Artikel 3 der Verordnung 2019/2088 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 27. November 2019 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (SFDR) zur Verfügung.

Darüber hinaus und gemäß Artikel L. 533-22-1 des code monétaire et financier wird BNP Paribas Asset Management Zeichnern und der Öffentlichkeit ein Dokument zur Verfügung stellen, in dem seine Richtlinie zur Berücksichtigung von Umwelt-, Gesellschafts- und Unternehmensführungskriterien und der Maßnahmen, die umgesetzt wurden, um zum energetischen und ökologischen Wandel beizutragen, in seiner Anlagestrategie sowie eine Strategie zur Umsetzung dieser Richtlinie dargelegt werden. Diese Informationen, für die die Regeln für die Transparenz der erforderlichen Angaben über negative Auswirkungen auf die Nachhaltigkeit gelten, stehen auf der Website der Verwaltungsgesellschaft gemäß Artikel 4 der Offenlegungsverordnung zur Verfügung.

Die Offenlegungsverordnung enthält Regeln für die Transparenz und die Bereitstellung von nachhaltigkeitsbezogenen Angaben.

GENIUS 100 CROSS ASSET

Ergänzend zur Offenlegungsverordnung hat die Verordnung 2020/852 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 18. Juni 2020 über die Schaffung eines Rahmens zur Förderung nachhaltiger Investitionen und zur Änderung der Offenlegungsverordnung (Taxonomieverordnung) Festlegung von Kriterien zum Ziel, anhand derer bestimmt werden kann, ob eine Wirtschaftstätigkeit als ökologisch nachhaltig anzusehen ist.

Die Europäische Taxonomie ist somit ein Klassifizierungssystem, das eine Liste ökologisch nachhaltiger Wirtschaftstätigkeiten festlegt.

Wirtschaftstätigkeiten, die nicht in der Taxonomieverordnung anerkannt sind, sind nicht notwendigerweise umweltschädlich oder nicht nachhaltig. Darüber hinaus sind andere Tätigkeiten, die einen wesentlichen Beitrag zu ökologischen und sozialen Zielen leisten können, noch nicht unbedingt Teil der Taxonomieverordnung.

Der allgemeine Ansatz von BNP Paribas Asset Management zur Berücksichtigung von Umwelt-, Gesellschafts- und Unternehmensführungskriterien (ESG) ist auf unserer Website angegeben: [Als Anleger - Website BNPP AM Global FR \(bnpparibas-am.com\)](https://www.bnpparibas-am.com).

Für BNP Paribas Asset Management beruht verantwortungsbewusstes Investieren auf sechs Säulen. Die ersten vier Säulen tragen zur Verbesserung unserer Managementpraktiken bei, unter anderem durch neue Anlageideen, die Optimierung der Zusammensetzung unserer Portfolios, die Steuerung von Risiken und die Ausübung unseres Einflusses auf die Unternehmen und die verschiedenen Märkte, in die wir investieren.

ESG-Integration:

Unsere Analysten und Vermögensverwalter berücksichtigen unabhängig vom Anlageprozess systematisch die relevantesten ESG-Faktoren. Unsere Weisungen und Richtlinien zur ESG-Integration gelten für alle unsere Anlageprozesse (und damit für Fonds, Mandate und thematische Fonds). Sie gelten jedoch nicht alle für Indexfonds, börsengehandelte Fonds (ETFs) und einige Ausnahmen für den spezifischen Verwaltungsprozess. Gemäß den Überzeugungen von BNP Paribas Asset Management ermöglicht uns dieser Ansatz, Risiken und Chancen zu erkennen, die anderen Marktteilnehmern nicht unbedingt bekannt sind, was uns einen komparativen Vorteil verschaffen kann. Der Prozess der Integration von ESG-Faktoren wird von gemeinsamen formalen Grundsätzen geleitet. Seit 2020 wird jeder Anlageprozess – und per Definition jede in Frage kommende Anlagestrategie – von einem ESG-Validierungsausschuss geprüft und genehmigt.

Abstimmung, Dialog und Engagement:

Wir investieren durchdacht und haben detaillierte Abstimmungsrichtlinien zu einer Reihe von ESG-Themen festgelegt. Darüber hinaus sind wir der Ansicht, dass ein verstärkter Dialog mit den Emittenten unsere Anlageprozesse verbessern und uns langfristig eine bessere Kontrolle der Risiken ermöglichen kann.

Unsere Vermögensverwalter sowie die Experten des Sustainability Center von BNP Paribas Asset Management stehen im Dialog mit den Unternehmen, in die wir investieren, mit dem Ziel, sie zu verantwortungsbewussten und umweltfreundlichen Praktiken zu bewegen.

Darüber hinaus haben wir uns zum Ziel gesetzt, uns häufig mit Behördenvertretern zu treffen, um die Maßnahmen zu besprechen, die im Kampf gegen die globale Erderwärmung umgesetzt wurden. Unsere Governance und Abstimmungspolitik sind hier abrufbar: [9EF0EE98-5C98-4D45-8B3C-7C1AD4C0358A \(bnpparibas-am.com\)](https://www.bnpparibas-am.com).

Verantwortungsvolles Geschäftsverhalten der Unternehmen und Ausschluss bestimmter Sektoren:

BNP Paribas Asset Management wendet daher bei allen seinen Anlagen ESG-Ausschlüsse an, die auf den zehn Prinzipien des Global Compact der Vereinten Nationen basieren. Der Global Compact ist ein universeller Referenzrahmen für die Bewertung von Unternehmen und gilt für alle Industriezweige. Er stützt sich auf internationale Übereinkommen in den Bereichen Menschenrechte, Arbeitsrechte, Umweltschutz und Korruptionsbekämpfung.

Zusätzlich zu den Prinzipien des Global Compact der Vereinten Nationen wendet BNP Paribas Asset Management die OECD-Leitlinien für Unternehmen an. Spezifische ESG-Standards, die Unternehmen, die in bestimmten, hinsichtlich ihrer sozialen und ökologischen Auswirkungen sensiblen Sektoren tätig sind, einhalten müssen. Sie werden in sektoralen Richtlinien festgelegt, die bislang Palmöl, Zellstoff, Kohle, Kernenergie, umstrittene Waffen, unkonventionelles Öl und Gas, Bergbau, Asbest, Landwirtschaft und Tabak betreffen. Die Nichteinhaltung der von BNP Paribas Asset Management definierten ESG-Standards führt zum Ausschluss von Unternehmen aus dem Anlageuniversum. Schließlich sind gemäß den Vorschriften bestimmte Bereiche wie der Bereich der umstrittenen Waffen (Antipersonenminen und Streumunition) von jeglichen Investitionen ausgeschlossen.

GENIUS 100 CROSS ASSET

Die Richtlinie für verantwortungsbewusstes Geschäftsverhalten der Unternehmen von BNPP AM und ihre einzelnen Bestandteile finden Sie hier: *Verantwortungsvolles Geschäftsverhalten der Unternehmen und Ausschluss bestimmter Sektoren*

Eine zukunftsorientierte Vision:

Wir sind der Ansicht, dass einem nachhaltigeren und integrativeren Wirtschaftssystem drei Schlüsselpunkte zugrunde liegen: Energiewende, Umweltschutz und Gleichberechtigung. Wir haben eine Reihe von Zielen definiert und Leistungsindikatoren entwickelt, um zu messen, wie wir unser Research, unsere Portfolios und unser Engagement bei Unternehmen und Behörden auf diese drei Säulen ausrichten.

Palette von OGA mit einem verstärkten nichtfinanziellen Ansatz

Ein Teil unserer Palette integriert die vier grundlegenden Säulen unseres nachhaltigen Ansatzes und ergänzt sie wie folgt: „verstärkte ESG-Strategien“, die Multi-Faktor-, Best-in-Class- und zertifizierte Fonds umfassen; „thematische“ Strategien, um in Unternehmen zu investieren, die Produkte und Dienstleistungen anbieten, die konkrete Lösungen für ökologische und/oder soziale Herausforderungen bieten, und schließlich „Impact“-Strategien, um zusätzlich zur finanziellen Performance eine beabsichtigte, positive und messbare ökologische und/oder soziale Wirkung zu erzielen.

Unser CSR-Ansatz

Als nachhaltiger Anleger müssen unsere Praktiken die Standards erfüllen oder übertreffen, die wir von den Unternehmen erwarten, in die wir investieren. So integrieren wir nachhaltige Entwicklung in unsere operativen und bürgerschaftlichen Aktivitäten mit folgenden Prioritäten: Gleichstellung der Geschlechter innerhalb unserer Belegschaft, Reduzierung unserer Abfälle und CO₂-Emissionen sowie die Förderung der Integration junger Menschen.

Die Ergebnisse unseres nachhaltigen Ansatzes sind in unserem nichtfinanziellen Bericht zusammengefasst, der auf unserer Website verfügbar ist: [Nachhaltigkeitsbericht 2022 - BNP Paribas Asset Management \(bnpparibas-am.com\)](https://www.bnpparibas-am.com/nachhaltigkeitsbericht-2022).

II - Anlagestrategie des Fonds

Im Rahmen der umgesetzten Anlagestrategie bewirbt der Fonds keine ökologischen und/oder sozialen Merkmale und Governance-Merkmale und zielt nicht auf nachhaltige Investitionen im Sinne der Artikel 8 und 9 der Offenlegungsverordnung ab.

Die Investitionen des Fonds berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten, die in der Taxonomieverordnung festgelegt sind.

* * *

INFORMATIONEN ÜBER DIE VERGÜTUNGSPOLITIK DER VERWALTUNGSGESELLSCHAFT

Qualitative Vergütungselemente

Informationen zur Vergütungspolitik für das Geschäftsjahr 2024 sind auf Anfrage bei der Verwaltungsgesellschaft erhältlich: BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT Europe - TSA 47000 -75318 Paris cedex 09. Beschreibende Informationen zur Vergütungspolitik der Verwaltungsgesellschaft sind auch auf der Website <http://www.bnpparibas-am.com/fr/politique-de-remuneration/> verfügbar.

Quantitative Vergütungselemente

Nachstehend die quantitativen Vergütungsinformationen, wie sie gemäß Artikel 22 der AIFM-Richtlinie (Richtlinie 2011/61/EU vom 8. Juni 2011) und gemäß Artikel 69-3 der OGAW V-Richtlinie (Richtlinie 2014/91/EU vom 23. Juli 2014) vorgeschrieben sind, in einem Format, das den Empfehlungen des Verbands Place AFG (Association Française de Gestion) entspricht¹.

¹ Hinweis: Die oben genannten Vergütungsbeträge sind nicht direkt mit den Buchhaltungsdaten des Jahres in Einklang zu bringen, da sie die zugeteilten Beträge widerspiegeln, basierend auf dem Umfang der Belegschaft am Ende der jährlichen Kampagne für variable Vergütungen. So beinhalten diese Beträge beispielsweise alle während dieser Kampagne gewährten variablen Vergütungen, unabhängig davon, ob sie aufgeschoben wurden oder nicht, und unabhängig davon, ob die Mitarbeiter letztendlich im Unternehmen geblieben sind oder nicht.

GENIUS 100 CROSS ASSET

Aggregierte Vergütungen der Mitarbeiter von BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT Europe („BNPP AM Europe“) (Art. 22-2-e der AIFM-Richtlinie und Art. 69-3 (a) der OGAW V-Richtlinie):

	Anzahl der Mitarbeiter	Gesamtvergütung (Tsd. EUR) (fest + variabel)	Davon variable Vergütung insgesamt (Tsd. EUR)
Alle Mitarbeiter von BNPP AM Europe ²	1.291	169.821	54.857

Aggregierte Vergütungen der Mitarbeiter von BNPP AM Europe, deren Tätigkeit einen wesentlichen Einfluss auf das Risikoprofil hat und die daher „Regulierte Mitarbeiter“³ (Art. 22-2-f der AIFM-Richtlinie und Art. 69-3 (b) der OGAW V-Richtlinie) sind:

Branche	Anzahl der Mitarbeiter	Gesamtvergütung (Tsd. EUR)
Von BNPP AM Europe angestellte Regulierte Mitarbeiter:	192	46.011
<i>darunter Manager von alternativen Investmentfonds / OGAW / Manager von europäischen Mandaten</i>	171	40.163

Sonstige Informationen:

- Anzahl der von BNPP AM Europe verwalteten AIF und OGAW-Fonds:

	Anzahl der Fonds (31.12.2024)	Verwaltetes Vermögen (Mrd. Euro) am 31.12.2024
OGAW	187	98
Alternative Investmentfonds	304	58

- Im Jahr 2024 wurden 3,69 Tsd. EUR als „Carried Interests“ an die Mitarbeiter von BNPP AM Europe gezahlt, die am 31.12.2024 betriebsangehörig waren.
- Unter der Aufsicht des Vergütungsausschusses der BNP Paribas Asset Management Holding und ihres Verwaltungsrats wurde zwischen April und Mai 2024 eine unabhängige und zentrale Prüfung der globalen Vergütungspolitik von BNP Paribas Asset Management und ihrer Umsetzung im Geschäftsjahr 2023 durchgeführt. Die Ergebnisse dieser Prüfung, die sich auf die AIFM- und/oder OGAW-lizenzierten Einheiten von BNP Paribas Asset Management erstreckte, wurden mit „Zufriedenstellend“ bewertet. Damit wurde

² Neben diesen Personalzahlen und den entsprechenden Beträgen sind folgende Mitarbeitergruppen zu beachten:

- 6 Mitarbeiter der österreichischen Niederlassung, von denen einer den Status „Identified Staff“ hat und deren Gesamtvergütung und variable Gesamtvergütung sich im Jahr 2024 auf 986 Tsd. EUR bzw. 289 Tsd. EUR belaufen;
- 269 Mitarbeiter der belgischen Niederlassung, von denen 10 den Status „Identified Staff“ haben und deren Gesamtvergütung und variable Gesamtvergütung sich im Jahr 2024 auf 26.859 Tsd. EUR bzw. 4.652 Tsd. EUR belaufen;
- 25 Mitarbeiter der deutschen Niederlassung, von denen einer den Status „Identified Staff“ hat und deren Gesamtvergütung und variable Gesamtvergütung sich im Jahr 2024 auf 5.859 Tsd. EUR bzw. 2.052 Tsd. EUR belaufen.
- 53 Mitarbeiter der italienischen Niederlassung, von denen 2 den Status „Identified Staff“ haben und deren Gesamtvergütung und variable Gesamtvergütung sich im Jahr 2024 auf 6.822 Tsd. EUR bzw. 1.883 Tsd. EUR belaufen.
- 66 Mitarbeiter der niederländischen Niederlassung, von denen 10 den Status „Identified Staff“ haben und deren Gesamtvergütung und variable Gesamtvergütung sich im Jahr 2024 auf 10.947 Tsd. EUR bzw. 3.009 Tsd. EUR belaufen.

³ Die Liste der regulierten Mitarbeiter wird anhand der am Jahresende durchgeführten Überprüfung festgelegt.

GENIUS 100 CROSS ASSET

die Solidität des bestehenden Systems unterstrichen, insbesondere in seinen Schlüsseletappen: Identifizierung der regulierten Mitarbeiter, Kohärenz der Verknüpfung von Leistung und Vergütung, Anwendung der Regeln für obligatorische Aufschübe, Umsetzung der Indexierungs- und Aufschubsmechanismen.

- Weitere Informationen zur Festlegung der variablen Vergütung und zu diesen aufgeschobenen Vergütungsinstrumenten finden sich in der Beschreibung der Vergütungspolitik, die auf der Internetseite des Unternehmens veröffentlicht ist.

* * *

INFORMATIONEN ÜBER DIE POLITIK ZUR AUSWAHL UND BEWERTUNG VON DIENSTLEISTUNGEN ZUR UNTERSTÜTZUNG VON ANLAGEENTSCHEIDUNGEN UND ZUR AUSFÜHRUNG VON AUFTRÄGEN

Informationen über die Politik zur Auswahl und Bewertung von Unternehmen, die Dienstleistungen zur Unterstützung von Anlageentscheidungen und zur Ausführung von Aufträgen für BNP Paribas Asset Management France erbringen, finden Sie unter www.bnpparibas-am.fr.

* * *

BERICHT ÜBER DIE VERMITTLUNGSKOSTEN

Der letzte Bericht über die Vermittlungsgebühren ist auf der Website www.bnpparibas-am.fr zu finden.

* * *

POLITIK ZUR BESTMÖGLICHEN AUSFÜHRUNG UND BESTMÖGLICHEN AUSWAHL VON BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT EUROPE (BNPP AM EUROPE)

Die Auswahl- und Ausführungspolitik ist unter www.bnpparibas-am.fr zu finden.

* * *

Seit dem 24. Februar 2022 haben wir uns intensiv mit den Auswirkungen des Konflikts zwischen Russland und der Ukraine sowie mit den Folgen für die Energieknappheit und die Lebensmittelversorgung in Europa befasst. Der Verwaltungsrat beobachtet die geopolitische Lage und deren Auswirkungen auf den Gesamtausblick sowie die Markt- und Finanzrisiken genau, um alle notwendigen Maßnahmen im Interesse der Aktionäre zu ergreifen.

* * *



GENIUS 100 CROSS ASSET

**BERICHT DES ABSCHLUSSPRÜFERS ÜBER DEN
JAHRESABSCHLUSS
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2024**

Dies ist eine freie Übersetzung des in französischer Sprache verfassten Bestätigungsvermerks des Abschlussprüfers zum Jahresabschluss des Fonds ins Deutsche, die ausschließlich für deutschsprachige Nutzer bestimmt ist.

Der Bestätigungsvermerk des Abschlussprüfers enthält Informationen, die durch europäische Vorschriften und französisches Recht vorgeschrieben sind, wie z. B. Informationen über die Bestellung des Abschlussprüfers oder die Prüfung des Lageberichts.

Dieser Bericht sollte in Verbindung mit dem französischen Recht und den in Frankreich geltenden Berufsstandards für Abschlussprüfer gelesen und ausgelegt werden.

**BERICHT DES ABSCHLUSSPRÜFERS
ÜBER DEN JAHRESABSCHLUSS
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2024**

GENIUS 100 CROSS ASSET
ALS FONDS COMMUN DE PLACEMENT ERRICHTETER OGAW
gemäß dem französischen Währungs- und Finanzgesetzbuch

Verwaltungsgesellschaft
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT Europe
1, boulevard Haussmann
75009 PARIS - FRANKREICH

Testat

In Ausübung des Mandats, das uns von der Verwaltungsgesellschaft erteilt wurde, haben wir den Jahresabschluss des als Fonds Commun de Placement errichteten GENIUS 100 CROSS ASSET über das am 31. Dezember 2024 abgelaufene Geschäftsjahr, der dem vorliegenden Bericht beiliegt, geprüft.

Wir bestätigen, dass der Jahresabschluss nach den in Frankreich geltenden Bilanzierungs- und Bewertungsmethoden ordnungsgemäß und wahrheitsgetreu erstellt wurde und ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild des Geschäftsergebnisses des abgelaufenen Geschäftsjahres sowie der Finanz- und Vermögenslage des als Fonds Commun de Placement errichteten OGAW zum Ende dieses Geschäftsjahres vermittelt.

Grundlage für das Prüfungsurteil

Prüfungsstandard

Unsere Prüfung wurde entsprechend den in Frankreich geltenden Vorschriften zur Berufsausübung durchgeführt. Nach unserer Auffassung sind die erhaltenen Prüfungsnachweise als Grundlage für die Erteilung unseres Testats ausreichend und angemessen. Die Verantwortlichkeiten, denen wir gemäß diesen Vorschriften unterliegen, sind in dem Abschnitt „*Verantwortlichkeiten des Abschlussprüfers für die Prüfung des Jahresabschlusses*“ des vorliegenden Berichts angegeben.

Unabhängigkeit

Wir haben unseren Prüfungsauftrag unter Beachtung der im Code de Commerce und im Berufskodex für Abschlussprüfer vorgesehenen Unabhängigkeitsregeln für den Zeitraum vom 30.12.2023 bis zum Tag der Herausgabe unseres Berichts durchgeführt.

PricewaterhouseCoopers Audit, 63, rue de Villiers, 92208 Neuilly-sur-Seine Cedex
Tel.: +33 (0) 1 56 57 58 59, Fax: +33 (0) 1 56 57 58 60, www.pwc.fr

Vorbehalte

Ohne das oben geäußerte Prüfungsurteil in Frage zu stellen, weisen wir Sie auf die Änderung der Rechnungslegungsmethoden im Anhang zum Jahresabschluss hin.

Begründung unserer Einschätzungen

Wir bringen nach Maßgabe der für die Begründung unserer Einschätzung relevanten Bestimmungen der Artikel L. 821-53 und R.821-180 des code de commerce die nachfolgenden Einschätzungen zu Ihrer Kenntnis, die nach unserem professionellen Ermessen am wichtigsten für die Prüfung des Jahresabschlusses für das Geschäftsjahr waren.

Die so erlangten Bewertungen gehören zur prüferischen Durchsicht des Jahresabschlusses insgesamt und haben zur Bildung unseres vorstehend zum Ausdruck gebrachten Urteils beigetragen. Wir geben kein Urteil über einzelne Elemente dieses Jahresabschlusses ab.

1. Außerbörslich gehandelte Kontrakte:

Die außerbörslichen Kontrakte des Portfolios werden mithilfe der in der Anhanganmerkung zu den Rechnungslegungsregeln und -methoden dargelegten Methoden bewertet. Die Preise werden von den Kontrahenten der Kontrakte berechnet und von der Verwaltungsgesellschaft anhand von Finanzmodellen validiert. Die angewandten mathematischen Modelle basieren auf externen Daten und Marktannahmen. Aufgrund der Elemente, die zur Ermittlung der gewählten Bewertungen führten, haben wir den von der Verwaltungsgesellschaft umgesetzten Ansatz beurteilt.

2. Andere Finanzinstrumente des Portfolios:

Unsere Einschätzungen beinhalten die Beurteilung der Angemessenheit der angewandten Rechnungslegungsprinzipien Bilanzierungsmethoden und der wesentlichen vorgenommenen Schätzungen.

Sonderprüfungen

Wir haben ferner in Übereinstimmung mit den in Frankreich geltenden Vorschriften zur Berufsausübung die gesetzlich und regulatorisch vorgeschriebenen Sonderprüfungen durchgeführt.

Wir haben keinerlei Vorbehalte gegen die Richtigkeit der Angaben, die im Rechenschaftsbericht der Verwaltungsgesellschaft enthalten sind, und ihre Übereinstimmung mit dem Jahresabschluss.

*PricewaterhouseCoopers Audit, 63, rue de Villiers, 92208 Neuilly-sur-Seine Cedex
Tel.: +33 (0) 1 56 57 58 59, Fax: +33 (0) 1 56 57 58 60, www.pwc.fr*

Verantwortlichkeiten der Verwaltungsgesellschaft für den Jahresabschluss

Die Verwaltungsgesellschaft ist für die Erstellung eines Jahresabschlusses verantwortlich, der nach den in Frankreich geltenden Bilanzierungs- und Bewertungsmethoden ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild vermittelt, und für die Umsetzung eines internen Kontrollsystems, das sie für die Erstellung von Jahresabschlüssen, die keine wesentlichen unzutreffenden Angaben, sei es durch Betrug oder Fehler, enthalten, für notwendig hält.

Bei der Erstellung des Jahresabschlusses obliegt es der Verwaltungsgesellschaft, die Fähigkeit des Fonds zu beurteilen, ihren Betrieb fortzuführen, in ihren Abschlüssen gegebenenfalls die erforderlichen Informationen in Bezug auf die Betriebsfortführung darzustellen und den Rechnungslegungsgrundsatz der Betriebsfortführung anzuwenden, es sei denn, der Fonds soll liquidiert oder seine Tätigkeit eingestellt werden.

Der Jahresabschluss wurde von der Verwaltungsgesellschaft erstellt.

Verantwortlichkeiten des Abschlussprüfers für die Prüfung des Jahresabschlusses

Prüfungsziel und -verfahren

Unsere Aufgabe ist es, einen Bericht über den Jahresabschluss zu erstellen. Unser Ziel ist es, uns in hinreichendem Maße zu vergewissern, dass der Jahresabschluss insgesamt keine wesentlichen unzutreffenden Angaben enthält. Eine hinreichend sichere Gewissheit entspricht einem hohen Maß an Zuverlässigkeit, ohne dass jedoch garantiert wird, dass durch eine gemäß den Vorschriften zur Berufsausübung durchgeführte Prüfung grundsätzlich alle wesentlichen unzutreffenden Angaben festgestellt werden. Unregelmäßigkeiten können aus Betrug oder Fehlern resultieren und werden als wesentlich eingestuft, wenn bei vernünftiger Einschätzung damit zu rechnen ist, dass sie einzeln oder gemeinsam die finanziellen Entscheidungen beeinflussen könnten, die die Adressaten des Jahresabschlusses im Vertrauen auf diesen treffen.

Wie in Artikel L. 821-55 des code de commerce bestimmt, besteht unsere Aufgabe bei der Prüfung des Jahresabschlusses nicht darin, die Nachhaltigkeit oder Qualität der Verwaltung des Fonds zu prüfen.

Im Rahmen einer in Übereinstimmung mit den in Frankreich geltenden Vorschriften zur Berufsausübung durchgeführten Prüfung wendet der Abschlussprüfer während der gesamten Prüfung professionelles Ermessen an. Darüber hinaus:

- identifiziert und beurteilt er die Risiken, dass der Jahresabschluss wesentliche unzutreffende Angaben, sei es durch Betrug oder Fehler, enthält, legt Prüfverfahren angesichts dieser Risiken fest und setzt diese um und trägt Unterlagen zusammen, die er für ausreichend und geeignet hält, um sein Urteil zu begründen. Das Risiko, dass wesentliche unzutreffende Angaben aufgrund eines Betrugs nicht erkannt werden, ist höher als das Risiko, dass wesentliche unzutreffende Angaben aufgrund eines Fehlers nicht erkannt werden, da Betrug geheime Absprachen, Fälschungen, bewusste Auslassungen, falsche Angaben oder das Unterlaufen der internen Kontrolle beinhalten kann;

*PricewaterhouseCoopers Audit, 63, rue de Villiers, 92208 Neuilly-sur-Seine Cedex
Tel.: +33 (0) 1 56 57 58 59, Fax: +33 (0) 1 56 57 58 60, www.pwc.fr*

- nimmt er die interne Kontrolle, die für die Prüfung angemessen ist, zur Kenntnis, um die unter den jeweiligen Umständen geeigneten Prüfverfahren festzulegen, nicht aber, um ein Urteil über die Effizienz der internen Kontrolle abzugeben;
- beurteilt er die Angemessenheit der angewandten Rechnungslegungsgrundsätze und -methoden und die Vertretbarkeit der von der Verwaltungsgesellschaft vorgenommenen bilanziellen Schätzungen sowie der im Jahresabschluss enthaltenen entsprechenden Angaben;
- beurteilt er die Angemessenheit des von der Verwaltungsgesellschaft angewandten Fortführungsprinzips und anhand der gesammelten Prüfungsnachweise das Vorhandensein oder Nichtvorhandensein einer wesentlichen Unsicherheit in Bezug auf Ereignisse oder Umstände, welche die Fähigkeit des Fonds zur Geschäftsfortführung beeinträchtigen könnten. Diese Beurteilung basiert auf bis zum Datum seines Berichts gesammelten Prüfungsnachweisen, wobei jedoch darauf hingewiesen wird, dass nachfolgende Umstände oder Ereignisse die Geschäftsfortführung gefährden können. Wenn er zu dem Schluss kommt, dass eine wesentliche Unsicherheit besteht, macht er die Leser seines Berichts über die im Jahresabschluss aufgeführten Angaben auf diese Unsicherheit aufmerksam, oder falls diese Angaben nicht vorhanden oder nicht aussagekräftig sind, formuliert er einen eingeschränkten Bestätigungsvermerk oder verweigert die Bestätigung des Jahresabschlusses;
- bewertet er die Gesamtdarstellung des Jahresabschlusses und beurteilt, ob der Jahresabschluss ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild der zugrunde liegenden Vorgänge und Umstände vermittelt.

In Anwendung des Gesetzes teilen wir Ihnen mit, dass wir nicht in der Lage waren, den vorliegenden Bericht innerhalb der vorgeschriebenen Fristen zu erstellen, da wir bestimmte Dokumente, die für die Fertigstellung unserer Arbeiten notwendig waren, verspätet erhalten haben.

Neuilly-sur-Seine, Datum der elektronischen Signatur

*Dokument beglaubigt durch elektronische
Unterschrift Der Abschlussprüfer
PricewaterhouseCoopers Audit
Arnaud Percheron*

2025.06.20 18:05:14 +0200

Aktiva (Währung: EUR)

	Geschäftsjahr zum 31.12.2024
Netto-Sachanlagen	-
Finanzwerte	-
Aktien und aktienähnliche Wertpapiere (A) (*)	-
An einem geregelten oder gleichwertigen Markt gehandelt	-
Nicht an einem geregelten oder gleichwertigen Markt gehandelt	-
In Aktien wandelbare Anleihen (B) (*)	-
An einem geregelten oder gleichwertigen Markt gehandelt	-
Nicht an einem geregelten oder gleichwertigen Markt gehandelt	-
Anleihen und ähnliche Wertpapiere (C) (*)	52.196.881,85
An einem geregelten oder gleichwertigen Markt gehandelt	52.196.881,85
Nicht an einem geregelten oder gleichwertigen Markt gehandelt	-
Schuldtitel (D)	29.686.016,98
An einem geregelten oder ähnlichen Markt gehandelt	29.686.016,98
Nicht an einem geregelten oder ähnlichen Markt gehandelt	-
Anteile von OGA und Investmentfonds (E)	-
OGAW	-
AIF und vergleichbare Anlagen anderer Mitgliedstaaten der Europäischen Union	-
Sonstige OGA und Investmentfonds	-
Einlagen (F)	-
Termin-Finanzinstrumente (G)	200.807,50
Temporäre Wertpapiergeschäfte (H)	1.962.900,12
Forderungen aus im Rahmen von Pensionsgeschäften erhaltenen Finanzwerten	-
Forderungen aus als Sicherheit gestellten Wertpapieren	1.962.900,12
Forderungen aus verliehenen Finanzwerten	-
Entliehene Finanzwerte	-
In Pension gegebene Finanzwerte	-
Sonstige temporäre Wertpapiergeschäfte	-
Kredite (I)	-
Sonstige zulässige Vermögenswerte (J)	-
Loans	-
Sonstige	-
Zwischensumme Zulässige Vermögenswerte I= (A+B+C+D+E+F+G+H+I+J)	84.046.606,45
Forderungen und aktive Rechnungsabgrenzungsposten	-
Finanzkonten	182.084,52
Zwischensumme Sonstige Vermögenswerte, die keine zulässigen Vermögenswerte sind II (*)	182.084,52
SUMME VERMÖGEN I+II	84.228.690,97

(*) Bei sonstigen Vermögenswerten handelt es sich um Vermögenswerte, die nicht als zulässige Vermögenswerte im Sinne des Reglements oder der Satzung des OGA mit variablem Kapital gelten, jedoch für dessen Betrieb erforderlich sind.

Passiva (Währung: EUR)

	Geschäftsjahr zum 31.12.2024
Eigenkapital:	-
Kapital	85.143.161,31
Vortrag auf neue Rechnung aus dem Nettoertrag	-
Vortrag auf neue Rechnung aus den nicht realisierten Nettogewinnen und -verlusten	-
Vortrag auf neue Rechnung aus den realisierten Nettogewinnen und -verlusten	-
Nettoergebnis des Geschäftsjahres	-4.991.472,09
Eigenkapital I:	80.151.689,22
Finanzierungsverbindlichkeiten II	-
Eigenkapital und Finanzierungsverbindlichkeiten (I+II)	80.151.689,22
Zulässige Verbindlichkeiten:	-
Finanzinstrumente (A)	-
Veräußerungen von Finanzinstrumenten	-
Temporäre Wertpapiergeschäfte	-
Termin-Finanzinstrumente (B)	3.905.496,20
Darlehen (C)	-
Sonstige zulässige Verbindlichkeiten (D)	-
Zwischensumme Zulässige Verbindlichkeiten III = A+B+C+D	3.905.496,20
Sonstige Verbindlichkeiten:	-
Verbindlichkeiten und passive Rechnungsabgrenzungsposten	171.505,55
Bankverbindlichkeiten	-
Zwischensumme Sonstige Verbindlichkeiten IV	171.505,55
SUMME VERBINDLICHKEITEN: I+II+III+IV	84.228.690,97

Gewinn- und Verlustrechnung (Währung: EUR)

	Geschäftsjahr zum 31.12.2024
Nettofinanzerträge	-
Erträge aus Finanzgeschäften	-
Erträge aus Aktien	-
Erträge aus Anleihen	1.916.666,03
Erträge aus Schuldtiteln	1.016.015,11
Erträge aus Anteilen von OGA	-
Erträge aus Termin-Finanzinstrumenten	4.143.161,74
Erträge aus temporären Wertpapiergeschäften	-
Erträge aus Krediten und Forderungen	-6.804,05
Erträge aus sonstigen zulässigen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten	-
Sonstige Finanzerträge	4.852,64
Zwischensumme Erträge aus Finanzgeschäften	7.073.891,47
Aufwendungen für Finanztransaktionen	-
Aufwendungen für Finanztransaktionen	-
Aufwendungen für Termin-Finanzinstrumente	-3.460.776,65
Aufwendungen für temporäre Wertpapiergeschäfte	-
Kreditaufwendungen	-
Aufwendungen für sonstige zulässige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	-
Aufwendungen für Finanzierungsverbindlichkeiten	-
Sonstige finanzielle Aufwendungen	-4.226,13
Zwischensumme Aufwendungen für Finanzgeschäfte	-3.465.002,78
Summe Nettofinanzerträge (A)	3.608.888,69
Sonstige Erträge:	-
Rückerstattung von Verwaltungsgebühren an den OGA	-
Leistungen für Kapital- oder Performancegarantien	-
Sonstige Erträge	-
Sonstige Aufwendungen:	-
Verwaltungsgebühren der Verwaltungsgesellschaft	-686.988,58
Prüfungs- und Due-Diligence-Kosten im Zusammenhang mit Beteiligungsfonds	-
Steuern und Abgaben	-
Sonstige Aufwendungen	-
Zwischensumme Sonstige Erträge und Sonstige Aufwendungen (B)	-686.988,58
Zwischensumme Nettoerträge vor Rechnungsabgrenzungsposten (C) = A + B	2.921.900,11

GENIUS 100 CROSS ASSET

Abgrenzung der Nettoerträge für das Geschäftsjahr (D)	-36.731,81
Zwischensumme Nettoerträge I = C + D	2.885.168,30
Realisierte Nettogewinne und -verluste vor Rechnungsabgrenzungsposten:	-
Realisierte Gewinne und Verluste	-3.716.295,77
Externe Transaktionsgebühren und Veräußerungskosten	0,01
Research-Kosten	-
Anteil der realisierten Gewinne, der an Versicherer zurückgezahlt wird	-
Erhaltene Versicherungsleistungen	-
Erhaltene Leistungen für Kapital- oder Performancegarantien	-
Zwischensumme Realisierte Nettogewinne und -verluste vor Rechnungsabgrenzungsposten E	-3.716.295,76
Abgrenzung der realisierten Nettogewinne und -verluste F	43.970,19
Realisierte Nettogewinne und -verluste II = E+F	-3.672.325,57
Nicht realisierte Nettogewinne und -verluste vor Rechnungsabgrenzungsposten:	-
Veränderung der nicht realisierten Gewinne und Verluste, einschließlich Wechselkursdifferenzen auf zulässige Vermögenswerte	-4.267.786,16
Wechselkursdifferenzen auf Finanzkonten in Fremdwährungen	-
Zu vereinnahmende Leistungen für Kapital- oder Performancegarantien	-
Anteil der nicht realisierten Gewinne, der an Versicherer zurückzuzahlen ist	-
Zwischensumme Nicht realisierte Nettogewinne und -verluste vor Rechnungsabgrenzungsposten G	-4.267.786,16
Abgrenzung der nicht realisierten Nettogewinne und -verluste H	63.471,34
Nicht realisierte Nettogewinne und -verluste III = G + H	-4.204.314,82
Anzahlungen:	-
Anzahlungen auf Nettoerträge für das Geschäftsjahr J	-
Anzahlungen auf realisierte Nettogewinne und -verluste für das Geschäftsjahr K	-
Anzahlungen auf nicht realisierte Nettogewinne und -verluste für das Geschäftsjahr L	-
Summe Geleistete Anzahlungen für das Geschäftsjahr IV = J+K+L	-
Steuer auf das Ergebnis V	-
Nettoergebnis I + II + III + IV + V	-4.991.472,09

STRATEGIE UND VERWALTUNGSPROFIL

ANLAGEZIEL

Das Anlageziel des FCP besteht darin, Anteilhabern, deren Anteile des FCP bis spätestens 7. September 2023 zentralisiert wurden, die Möglichkeit zu geben, einen Nettoinventarwert am Vergleichsdatum (31. Juli 2035) zu erhalten:

- (i) mindestens 106,61 % des Referenz-Nettoinventarwerts vom 10. August 2023 gemäß Definition unter „Garantie oder Schutz“,
- (ii) erhöht (durch eine Kaufoption) um eine, gegebenenfalls teilweise, Beteiligung an der positiven Wertentwicklung eines Korbs systematischer Strategien, die aus Long- und Short-Positionen innerhalb verschiedener Anlageklassen bestehen.

Der FCP wird am Fälligkeitsdatum automatisch aufgelöst.

Der Verkaufsprospekt des OGA beschreibt seine Merkmale vollständig und genau.

Kennzeichnende Elemente des OGA in den letzten fünf Geschäftsjahren

Klasse I (Währung: EUR)

	29. Dezember 2023	31. Dezember 2024
Nettoinventarwert (in EUR)		
C-Anteile	101,76	95,80
Nettovermögen (in Tsd. EUR)	86.445,40	80.151,69
Anzahl Anteile		
C-Anteile	849.450,000	836.653,000

Zahlungsdatum	29. Dezember 2023	31. Dezember 2024
Ausschüttung je Anteil auf realisierte Nettogewinne und -verluste (einschließlich Anzahlungen) (in EUR)	-	-
Ausschüttung je Anteil auf Nettoerträge (einschließlich Anzahlungen) (in EUR)	-	-
Auf den Inhaber übertragene Steuergutschrift je Anteil (*) Natürliche Personen (in EUR)	-	-
Thesaurierung je Anteil von Nettogewinnen und -verlusten		
C-Anteile	-4,16	-4,38
Thesaurierung je Anteil auf Erträge		
C-Anteile	0,86	3,44

(*) „die Steuergutschrift wird am Tag der Auszahlung gemäß der Steueranweisung vom 04.03.93 (Ints.4 K-1-93) ermittelt. Die nach den geltenden Regeln für natürliche Personen berechneten theoretischen Beträge werden hier nur zur Orientierung aufgeführt. „Die Verordnung 4 J-2-99 vom 08.11.99 besagt darüber hinaus, dass andere Anspruchsberechtigte als natürliche Personen, die Anspruch auf eine Steuergutschrift haben, die ihnen zustehende Steuergutschrift unter ihrer eigenen Verantwortung berechnen.“

Rechnungslegungsregeln und -methoden

Der Jahresabschluss wird zum ersten Mal in der Form vorgelegt, die in der Verordnung ANC 2020-07, geändert durch die Verordnung ANC 2022-03, vorgesehen ist.

Änderungen der Rechnungslegungsmethoden, einschließlich der Darstellung, im Zusammenhang mit der Anwendung der neuen Rechnungslegungsvorschriften für die Jahresabschlüsse von Organismen für gemeinsame Anlagen mit variablem Kapital (geänderte Verordnung ANC 2020- 07)

Diese neue Verordnung schreibt Änderungen der Rechnungslegungsmethoden vor, darunter auch Änderungen in der Darstellung des Jahresabschlusses. Eine Vergleichbarkeit mit dem Vorjahresabschluss ist daher nicht gegeben.

So werden gemäß dem zweiten Absatz von Artikel 3 der Verordnung ANC 2020-07 im Jahresabschluss nicht die Daten des Vorjahres dargestellt; der Jahresabschluss N-1 wird in den Anhang aufgenommen.

Die Änderungen in der Darstellung beziehen sich hauptsächlich auf:

- die Bilanzstruktur, die nun nach Arten von zulässigen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, einschließlich Krediten und Darlehen, dargestellt wird;
- die Struktur der Gewinn- und Verlustrechnung, die grundlegend verändert wird; die Gewinn- und Verlustrechnung enthält insbesondere: Wechselkursdifferenzen auf Finanzkonten, nicht realisierte Gewinne und Verluste, realisierte Gewinne und Verluste und Transaktionskosten;
- die Abschaffung der außerbilanziellen Tabelle (ein Teil der Informationen über die Elemente dieser Tabelle sind nun in den Anhängen enthalten);
- die Abschaffung der Option, die enthaltenen Kosten zu den Einstandspreisen zu verbuchen (nicht rückwirkend für Fonds, die früher die Methode der enthaltenen Kosten anwandten);
- die Unterscheidung zwischen Wandelanleihen und anderen Anleihen sowie ihre jeweiligen Buchungssätze;
- eine neue Klassifizierung der im Portfolio gehaltenen Zielfonds nach dem Muster: OGAW / AIF / Sonstige;
- die Verbuchung von Verbindlichkeiten aus Devisentermingeschäften, die nicht mehr auf der Ebene der Bilanz, sondern auf der Ebene der außerbilanziellen Posten vorgenommen wird, wobei die Informationen über Devisentermingeschäfte einen bestimmten Anteil abdecken;
- Hinzufügung von Informationen über direkte und indirekte Forderungen in verschiedenen Märkten;
- die Darstellung des Inventars, bei der nun zwischen zulässigen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten und Terminfinanzinstrumenten unterschieden wird;
- die Annahme eines einheitlichen Präsentationsmodells für alle Arten von OGA;
- die Abschaffung der Aggregation der Konten für Umbrella-Fonds.

Im Geschäftsjahr angewandte Rechnungslegungsregeln und -methoden

Es gelten die allgemeinen Grundsätze der Rechnungslegung (vorbehaltlich der oben beschriebenen Änderungen):

- wahrheitsgetreues Bild, Vergleichbarkeit, Kontinuität der Geschäftstätigkeit,
- Regelmäßigkeit, Aufrichtigkeit,
- Vorsicht,
- Stetigkeit der Methoden von einem Geschäftsjahr zum anderen.

Die Verbuchung von Erträgen aus festverzinslichen Wertpapieren erfolgt nach der Methode der vereinnahmten Zinsen.

Zugänge und Abgänge von Wertpapieren werden ohne Kosten verbucht.

Die Referenzwährung für die Buchhaltung des Portfolios ist der Euro. Die Dauer des Geschäftsjahres beträgt 12 Monate.

GENIUS 100 CROSS ASSET

Zusammenfassung des Anlageangebots

Anteils-kategorie	ISIN-Code	Zuweisung der ausschüttbaren Summe	Fondswährung	In Frage kommende Zeichner	Aufteilung der Anteile	Mindestbetrag bei der Zeichnung
„I“	FR001400GJT7	Nettoergebnis: Thesaurierung Realisierte Nettogewinne: Thesaurierung	EUR	Alle Zeichner, insbesondere für Wüstenrot & Württembergische AG bestimmt	Tausendstel	Erstzeichnung: 100.000 EUR* Folgezeichnung: n.z.

* mit Ausnahme der Verwaltungsgesellschaft, des Liquiditätsanbieters und von BNPP AM PARTICIPATIONS, die nur einen Anteil zeichnen dürfen

Regeln für die Bewertung der Vermögenswerte

Die Wertpapiere und Finanzinstrumente, die im Rahmen von bedingten und unbedingten Termingeschäften im Portfolio gehalten werden und auf Fremdwährungen lauten, werden auf der Basis der in Paris am Bewertungsstichtag gültigen Wechselkurse in die Buchführungswährung umgerechnet.

Das Portfolio wird somit bei jeder Feststellung des Nettoinventarwerts und bei jedem Jahresabschluss gemäß der nachfolgenden Methoden bewertet:

Wertpapiere

Notierte Wertpapiere: zum Börsenwert - einschließlich aufgelaufener Kupons (Schlusskurs des Tages)

Wertpapiere, deren Kurs am Bewertungsstichtag nicht ermittelt wurde oder die von Marktteilnehmern notiert werden und deren Kurs korrigiert wurde, sowie nicht an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere werden unter Verantwortung der Verwaltungsgesellschaft (oder bei einer Sicav vom Verwaltungsrat) mit ihrem wahrscheinlichen Handelswert bewertet. Die Preise werden von der Verwaltungsgesellschaft in Abhängigkeit von ihrer Kenntnis der Emittenten und/oder der Märkte korrigiert.

Organismen für gemeinsame Anlagen: zum letzten bekannten Nettoinventarwert. Falls kein solcher vorliegt, zum letzten geschätzten Wert. Die Nettoinventarwerte der Wertpapiere von ausländischen Organismen für gemeinsame Anlagen, die auf monatlicher Basis bewertet werden, werden von den Verwaltungsgesellschaften der Fonds bestätigt. Die Bewertungen werden wöchentlich auf der Basis der von den Verwaltungsgesellschaften der Organismen mitgeteilten Schätzungen aktualisiert, die vom Fondsmanager bestätigt werden.

Handelbare Forderungspapiere und ähnliche Wertpapiere, die nicht Gegenstand umfangreicher Transaktionen sind, werden nach einer versicherungsmathematischen Methode bewertet, wobei der Zinssatz gleichwertiger Papiere verwendet wird, der gegebenenfalls entsprechend den intrinsischen Merkmalen des Emittenten des zu bewertenden Papiers angepasst wird. Wenn keine Sensitivität besteht, werden die Wertpapiere mit einer Restlaufzeit von drei Monaten zum letzten Zinssatz bis zur Fälligkeit bewertet. Bei Wertpapieren, die mit einer Restlaufzeit von weniger als drei Monaten erworben werden, werden die Zinsen linearisiert.

Vorübergehende Käufe und Verkäufe von Wertpapieren:

- Die Verleihe von Wertpapieren: die den verliehenen Wertpapieren entsprechende Forderung wird zum Marktwert der Wertpapiere bewertet.
- Die Entleihe von Wertpapieren: die entliehenen Wertpapiere sowie die den entliehenen Wertpapieren entsprechende Schuld werden zum Marktwert der Wertpapiere bewertet.
- Sicherheiten: Im Hinblick auf die im Rahmen von Wertpapierleihgeschäften als Sicherheit erhaltenen Wertpapiere hat sich der OGA für eine Darstellung dieser Wertpapiere in den Bilanzkonten in Höhe der Schuld entschieden, die der Verpflichtung zur Rückgabe dieser Wertpapiere entspricht.
- Gelieferte Repos mit einer Restlaufzeit von bis zu drei Monaten: Individualisierung der Forderung auf der Grundlage des Vertragspreises. In diesem Fall erfolgt eine Linearisierung der Vergütung.
- Langfristige Repos: Sie werden zu ihrem Nennwert ausgewiesen und bewertet, auch wenn ihre Laufzeit länger als drei Monate ist. Zu diesem Betrag kommen die entsprechenden aufgelaufenen Zinsen hinzu. Bestimmte Verträge sehen jedoch Sonderbedingungen für Anträge auf vorzeitige Rückzahlung vor, um die Auswirkung des Anstiegs der Finanzierungskurve der Gegenpartei zu berücksichtigen. Die aufgelaufenen Zinsen können dann um diese Auswirkung verringert werden, ohne einen Planwert zu haben. Die Auswirkung ist proportional zur Restlaufzeit der Repos und der Differenz zwischen der vertraglich vereinbarten Marge und der Marktmarge für ein identisches Fälligkeitsdatum.

GENIUS 100 CROSS ASSET

- Pensionsgeschäfte mit einer Restlaufzeit von höchstens drei Monaten: Börsenkurswert. Die auf der Basis des Vertragswerts bewerteten Schulden werden auf der Passivseite der Bilanz ausgewiesen. In diesem Fall erfolgt eine Linearisierung der Vergütung.

Terminfinanzinstrumente und bedingte Finanzinstrumente

Futures: Abrechnungskurs des Tages.

Die Bewertung der außerbilanziellen Posten erfolgt auf der Basis des Nennwerts, ihres Ausgleichskurses und eventuell des Wechselkurses.

Optionen: Schlusskurs des Tages oder ansonsten der letzte bekannte Kurs.

OTC-Optionen: Diese Optionen werden zu ihrem Marktwert bewertet, der auf den von den Kontrahenten zur Verfügung gestellten Preisen basiert. Diese Bewertungen werden von der Verwaltungsgesellschaft überprüft.

Die außerbilanzielle Wertermittlung erfolgt entsprechend dem Basiswert in Abhängigkeit des Delta und des Kurses des Basiswerts sowie gegebenenfalls des Wechselkurses.

Devisentermingeschäfte: Neubewertung der Devisen des Engagements zum Tageskurs unter Berücksichtigung des in Abhängigkeit von der Fälligkeit des Kontrakts berechneten Aufpreises/Abschlags.

Termineinlagen: Sie werden zu ihrem Nennwert registriert und bewertet, auch wenn ihre Laufzeit länger als drei Monate ist. Zu diesem Betrag kommen die entsprechenden aufgelaufenen Zinsen hinzu. Bestimmte Verträge sehen jedoch Sonderbedingungen für Anträge auf vorzeitige Rückzahlung vor, um die Auswirkung des Anstiegs der Finanzierungskurve der Gegenpartei zu berücksichtigen. Die aufgelaufenen Zinsen können somit um diese Auswirkung verringert werden, ohne negativ werden zu können. Termineinlagen werden somit mindestens zu ihrem Nennwert bewertet.

Zinsswaps:

- Bei Swaps mit einer Laufzeit von weniger als drei Monaten werden die Zinsen linearisiert.
- Swaps mit einer Fälligkeit über drei Monaten werden zum Marktwert neu bewertet.

Synthetische Produkte (Verbindungen zwischen einem Wertpapier und einem Swap) werden in ihrer Gesamtheit verbucht. Die im Rahmen von synthetischen Produkten erzielbaren Zinsen für Swaps werden linear bewertet.

Assets-Swaps und synthetische Produkte werden auf Basis ihres Marktwerts bewertet. Die Bewertung von Asset-Swaps basiert auf der Bewertung der Basiswerte, wovon die Auswirkung der Schwankung der Kredit-Spreads abgezogen wird. Diese Auswirkung wird über den Mittelwert von 4 monatlich bei Gegenparteien abgefragten Spreads bewertet, korrigiert um eine Marge, die vom Rating des Emittenten abhängt. Das außerbilanzielle Engagement der Swaps entspricht ihrem Nennwert.

Strukturierte Swaps (Swaps mit optionalem Bestandteil): Diese Swaps werden zu ihrem Marktwert auf der Grundlage der von den Kontrahenten gemeldeten Preise bewertet. Diese Bewertungen werden von der Verwaltungsgesellschaft überprüft. Das außerbilanzielle Engagement dieser Swaps entspricht ihrem Nennwert.

Die Bewertung von Indexswaps, die vom Team OTC Pricing & Services berechnet wird, wird nach einer Konsistenzprüfung mit der Bewertung des Kontrahenten für die Berechnung des Nettoinventarwerts verwendet, wenn diese fristgerecht eingeht. Bei Nichtverfügbarkeit oder Inkonsistenzen setzt sich OTC Pricing and Services mit dem Kontrahenten in Verbindung, um die Probleme zu identifizieren und zu lösen. Das außerbilanzielle Engagement dieser Swaps entspricht ihrem Nennwert.

Betriebs- und Verwaltungskosten DEM FCP

IN RECHNUNG GESTELLTE KOSTEN:

Diese Kosten umfassen die Finanzverwaltungsgebühren, die Verwaltungsgebühren an andere Stellen als die Verwaltungsgesellschaft und die maximalen indirekten Kosten (Provisionen und Verwaltungskosten).

Zu den dem FCP in Rechnung gestellten Kosten kann Folgendes hinzugefügt werden:

- Erfolgsabhängige Gebühren: Diese werden an die Verwaltungsgesellschaft gezahlt, wenn der FCP sein Performanceziel übertroffen hat;
- dem FCP berechnete Transaktionsprovisionen.

Die Verwaltungsgesellschaft behält sich die Möglichkeit vor, einen Teil der Verwaltungsgebühren im Rahmen des Vertriebs des FCP durch Vertriebsstellen zurückzuübertragen.

GENIUS 100 CROSS ASSET

DEM FCP IN RECHNUNG GESTELLTE KOSTEN	GRUNDLAGE	STAFFELUNG
FINANZVERWALTUNGSGEBÜHREN	Nettovermögen	max. 1 % inkl. aller Steuern
BETRIEBSKOSTEN UND SONSTIGE DIENSTLEISTUNGEN	Nettovermögen	max. 0,20 % inkl. aller Steuern
MAXIMALE INDIREKTE KOSTEN (PROVISIONEN UND VERWALTUNGSGEBÜHREN)	Nettovermögen	n.z.
TRANSAKTIONSPROVISIONEN	Anfallend je Transaktion	n.z.
ERFOLGSABHÄNGIGE PROVISION	Nettovermögen	n.z.

Research-Kosten

n.z.

Zuweisung der ausschüttungsfähigen Beträge

Definition der ausschüttungsfähigen Beträge

Die ausschüttungsfähigen Beträge setzen sich zusammen aus:

1. dem Nettoertrag zuzüglich des Ergebnisvortrags sowie zuzüglich oder abzüglich der Ertragsabgrenzungen;
2. den im Laufe des Geschäftsjahres verbuchten realisierten Gewinnen, abzüglich der Kosten und realisierten Verluste, zuzüglich der in vorherigen Geschäftsjahren verbuchten Nettogewinne gleicher Art, die nicht ausgeschüttet oder thesauriert wurden, und abzüglich oder zuzüglich des Saldos der abgegrenzten Erträge.

Bestimmungen zur Verwendung der ausschüttungsfähigen Beträge

Verwendung der Nettoerträge

Thesaurierung

Verwendung der realisierten Nettogewinne

Thesaurierung

Veränderungen mit Auswirkung auf den Fonds

n.z.

Anhang

Gewährleistung oder Schutz

Der Inhaber des FCP, dessen Anteile am FCP spätestens bis zum 7. September 2023 zentralisiert worden sind, erhält eine Garantie, die sicherstellt, dass der Nettoinventarwert des FCP zum Fälligkeitsdatum mindestens 106,61 % des Referenz-Nettoinventarwerts beträgt.

GENIUS 100 CROSS ASSET

Definition:

Der Referenz-Nettoinventarwert ist definiert als Nettoinventarwert des FCP vom 10. August 2023.

Die Zeichnungen werden für ihren Betrag abzüglich der Zeichnungsgebühr ohne Steuern und Sozialversicherungsbeiträge oder gegebenenfalls abzüglich der im Rahmen der Investition in den FCP anfallenden spezifischen Ausgabeaufschläge gehalten.

Zugangsbedingungen:

BNP Paribas verpflichtet sich gegenüber dem FCP, dass jeder Inhaber, dessen Anteile ab dem Folgetag nach dem Gründungsdatum des FCP bis einschließlich 7. September 2023 um 16.00 Uhr Pariser Zeit zentralisiert wurden und der seine Anteile bis zum Fälligkeitsdatum behalten hat, zu diesem Zeitpunkt einen Nettoinventarwert von mindestens 106,61 % des Referenz-Nettoinventarwerts bekommt.

Aufgrund dieser Garantiezusage und gegebenenfalls auf Anforderung der Verwaltungsgesellschaft zahlt BNP Paribas an den FCP den zusätzlichen Betrag, der erforderlich ist, damit der Nettoinventarwert zum Fälligkeitsdatum der eingegangenen Verpflichtung entspricht.

Die Verwaltungsgesellschaft weist die Anleger darauf hin, dass die zwischen dem 10. August 2023 und dem 7. September 2023 zentralisierten Anteile zu einem Nettoinventarwert gezeichnet werden können, der je nach Marktbedingungen nach oben oder unten schwanken kann. Insbesondere können Anteile zu einem Nettoinventarwert von mehr als 106,61 % des Nettoinventarwerts des Referenz-Nettoinventarwerts gezeichnet werden.

Die Inhaber kommen unabhängig vom Zeichnungsdatum ihrer Anteile nicht in den Genuss der vorstehend beschriebenen Garantie, wenn sie den Rückkauf ihrer Anteile auf der Grundlage eines anderen Nettoinventarwerts als dem zum Fälligkeitsdatum datierten Nettoinventarwert beantragen.

Die Garantie wird von der Verwaltungsgesellschaft im Namen des FCP geltend gemacht.

Die Garantie oder den Schutz stellendes Institut: BNP Paribas SA

Auswirkungen der Besteuerung

Die Garantie wird vom Garantiegeber in der Fassung der zum Zeitpunkt der Gründung des FCP in Frankreich und in den Staaten, in denen der FCP abgeschlossen werden kann, geltenden Gesetze und Vorschriften geleistet.

Im Falle einer Änderung der genannten Texte (oder ihrer Auslegung durch die Rechtsprechung und/oder die Verwaltung der betreffenden Staaten), die nach dem Zeitpunkt der Einrichtung des FCP - gegebenenfalls rückwirkend - erfolgen und eine neue direkte oder indirekte finanzielle Belastung mit sich bringen könnte, was eine Verringerung des Nettoinventarwerts der Anteile des FCP aufgrund der Änderung der für ihn geltenden (oder für die daraus resultierenden Erträge geltenden) Pflichtabgaben zur Folge hätte, kann der Garantiegeber die im Rahmen der Garantie fälligen Beträge entsprechend der Auswirkung dieser neuen Finanzlast kürzen, vorbehaltlich der Zustimmung der französischen Finanzmarktaufsichtsbehörde.

Die Inhaber des FCP werden von der Verwaltungsgesellschaft im Falle des Eintretens eines solchen Ereignisses und einer solchen Änderung der Garantie informiert.

Entwicklung des Eigenkapitals

Entwicklung des Eigenkapitals im Laufe des Geschäftsjahres	Geschäftsjahr zum 31.12.2024
Eigenkapital zu Beginn des Geschäftsjahres	86.445.398,60
Transaktionen im Geschäftsjahr:	
Zeichnungen (einschließlich der Zeichnungsgebühren, die dem OGA zufließen) ¹	-
Rücknahmen (nach Abzug der Rücknahmeprovisionen, die dem OGA zustehen)	-1.231.527,57
Nettoergebnisse des Geschäftsjahres vor Rechnungsabgrenzungsposten	2.921.900,11
Realisierte Nettokapitalgewinne oder -Verluste vor Rechnungsabgrenzungen	-3.716.295,76
Veränderung der nicht realisierten Gewinne und Verluste vor Rechnungsabgrenzungsposten	-4.267.786,16
Für das vorhergehende Geschäftsjahr auf die Nettoerträge zugewiesene Ausschüttungen	-
Für das vorhergehende Geschäftsjahr auf realisierte Nettogewinne und -verluste zugewiesene Ausschüttungen	-
Für das vorhergehende Geschäftsjahr auf nicht realisierte Gewinne und Verluste zugewiesene Ausschüttungen ²	-
Im Laufe des Geschäftsjahres auf Nettoerträge geleistete Anzahlungen	-
Im Laufe des Geschäftsjahres auf realisierte Nettogewinne und -verluste geleistete Anzahlung(en)	-
Im Laufe des Geschäftsjahres auf nicht realisierte Gewinne geleistete Anzahlungen	-
Sonstige Elemente	-
Eigenkapital zum Jahresende (= Nettovermögen)	80.151.689,22

¹ Dieser Abschnitt umfasst ebenfalls die abgerufenen Beträge für Private-Equity-Gesellschaften.

² Abschnitt speziell für Geldmarktfonds.

Entwicklung der Anzahl der Anteile im Laufe des Geschäftsjahres

	Geschäftsjahr zum 31.12.2024
Emissionen und Rücknahmen während des Geschäftsjahres	Anzahl Anteile
Klasse I (Währung: EUR)	
Anzahl emittierter Anteile	-
Anzahl zurückgenommener Anteile	12.797.000
Zeichnungs- und/oder Rücknahmegebühr	Betrag (EUR)
An den OGA gezahlte Zeichnungsgebühren	-
Dem OGA zufließende Rücknahmegebühren	-
Vereinnahmte und zurückerstattete Zeichnungsgebühren	-
Vereinnahmte und zurückerstattete Rücknahmegebühren	-

GENIUS 100 CROSS ASSET

Aufschlüsselung des Nettovermögens nach Art der Anteile

ISIN-Code des Anteils	Bezeichnung der Anteile	Zuweisung der ausschüttbaren Summe	Währung des Anteils	Nettovermögen des Anteils	Anzahl der Anteile	Nettoinventarwert
FR001400GJT7	I	Thesaurierung	EUR	80.151.689,22	836.653,000	95,80

Direktes Engagement am Aktienmarkt (ohne Wandelanleihen)

Beträge in Tausend (Währung: EUR)	Engagement +/-	Aufschlüsselung der wesentlichen Engagements nach Ländern				
		Land	Land	Land	Land	Land
Aktiva		n.z.	n.z.	n.z.	n.z.	n.z.
Aktien und aktienähnliche Wertpapiere	-	-	-	-	-	-
Temporäre Wertpapiergeschäfte	-	-	-	-	-	-
Passiva		n.z.	n.z.	n.z.	n.z.	n.z.
Veräußerungen von Finanzinstrumenten	-	-	-	-	-	-
Temporäre Wertpapiergeschäfte	-	-	-	-	-	-
Außerbilanzielle Posten						
Futures	-					
Optionen	-					
Swaps	-					
Sonstige Finanzinstrumente	-					
SUMME	-					

Engagement am Markt für Wandelanleihen

Aufschlüsselung des Engagements nach Ländern und Laufzeiten

Beträge in Tausend (Währung: EUR)	Engagement +/-	Aufschlüsselung des Engagements nach Laufzeiten			Aufschlüsselung nach dem Deltawert	
		< 1 Jahr	1 Jahr < X < 5 Jahre	> 5 Jahre	< 0,6	0,6 < X < 1
SUMME	-	-	-	-	-	-

Direktes Engagement am Zinsmarkt (ohne Wandelanleihen) - Aufschlüsselung nach Art des Zinssatzes

Beträge in Tausend (Währung: EUR)	Engagement +/-	Festverzinslich	Variabler oder anpassbarer Zinssatz	Indexierter Zinssatz	Sonstige
Aktiva					
Einlagen	-	-	-	-	-
Anleihen	52.196,88	50.028,66	2.168,22	-	-
Schuldtitel	29.686,02	28.520,06	1.165,96	-	-
Temporäre Wertpapiergeschäfte	1.962,90	-	1.962,90	-	-
Sonstige Vermögenswerte: Loans	-	-	-	-	-
Finanzkonten	182,08	-	-	-	182,08
Passiva					
Veräußerungen von Finanzinstrumenten	-	-	-	-	-
Temporäre Wertpapiergeschäfte	-	-	-	-	-
Finanzkonten	-	-	-	-	-
Darlehen	-	-	-	-	-
Außerbilanzielle Posten					
Futures		-	-	-	-
Optionen		-	-	-	-
Swaps		-	-	-	-4,49
Sonstige Finanzinstrumente		-	-	-	-
SUMME		78.548,72	5.297,08	-	177,59

GENIUS 100 CROSS ASSET

Direktes Engagement am Zinsmarkt (ohne Wandelanleihen) - Aufschlüsselung nach Restlaufzeit

Beträge in Tausend (Währung: EUR)	[0 bis 3 Monate]] 3 Monate bis 1 Jahr]]1 bis 3 Jahre]]3 bis 5 Jahre]	> 5 Jahre
Aktiva					
Einlagen	-	-	-	-	-
Anleihen	-	-	16.281,46	18.885,55	17.029,87
Schuldtitel	-	-	11.393,35	11.001,15	9.254,41
Temporäre Wertpapiergeschäfte	-	-	-	1.962,90	-
Sonstige Vermögenswerte: Loans	-	-	-	-	-
Finanzkonten	182,08	-	-	-	-
Passiva					
Veräußerungen von Finanzinstrumenten	-	-	-	-	-
Temporäre Wertpapiergeschäfte	-	-	-	-	-
Finanzkonten	-	-	-	-	-
Darlehen	-	-	-	-	-
Außerbilanzielle Posten					
Futures	-	-	-	-	-
Optionen	-	-	-	-	-
Swaps	-	-	-	-	-4,49
Sonstige Finanzinstrumente	-	-	-	-	-
SUMME	182,08	-	27.674,82	31.849,60	26.279,79

Direktes Engagement am Devisenmarkt

Beträge in Tausend	USD
Aktiva	
Einlagen	-
Aktien und aktienähnliche Wertpapiere	-
Anleihen und ähnliche Wertpapiere	19.506,78
Schuldtitel	-
Temporäre Wertpapiergeschäfte	-
Sonstige Vermögenswerte: Loans	-
Sonstige Finanzinstrumente	-
Forderungen	-
Finanzkonten	0,77
Passiva	
Veräußerungen von Finanzinstrumenten	-
Temporäre Wertpapiergeschäfte	-
Verbindlichkeiten	-
Finanzkonten	-
Darlehen	-
Außerbilanzielle Posten	
Forderungen in Fremdwährung	-
Verbindlichkeiten in Fremdwährungen	-
Futures	-
Optionen	-
Swaps	-
Sonstige Transaktionen	-
SUMME	19.507,55

Direktes Engagement an den Kreditmärkten

Beträge in Tausend (Währung: EUR)	Investment Grade +/-	Außerhalb des Investment-Grade- Bereichs +/-	Ohne Rating +/-
Aktiva			
In Aktien wandelbare Anleihen	-	-	-
Anleihen und ähnliche Wertpapiere	39.522,57	12.674,31	-
Schuldtitel	22.229,90	6.290,16	1.165,96
Temporäre Wertpapiergeschäfte	-	-	1.962,90
Passiva			
Veräußerungen von Finanzinstrumenten	-	-	-
Temporäre Wertpapiergeschäfte	-	-	-
Außerbilanzielle Posten			
Kreditderivate	-	-	-
Nettosaldo	61.752,47	18.964,47	3.128,86

Wenn der OGA die vorstehend aufgeführten Instrumente hält, sind die für die Aufschlüsselung der Portfoliopositionen des OGA nach den Kategorien der Kreditmarktexponierung angewandten Methoden im Absatz „Zusätzliche Informationen zum Inhalt des Anhangs“ beschrieben, der dem Absatz zu den Rechnungslegungsregeln und -methoden folgt.

Engagement aus Geschäften mit Gegenparteien

Gegenparteien Beträge in Tausend (Währung: EUR)	Aktueller Barwert einer Forderung	Aktueller Barwert einer Verbindlichkeit
AUF DER AKTIVSEITE DER BILANZ AUSGEWIESENE GESCHÄFTE		
Einlagen	-	
Nicht abgewickelte Terminfinanzinstrumente	200,81	
Forderungen aus im Rahmen von Pensionsgeschäften erhaltenen Wertpapieren	-	
Forderungen aus als Sicherheit gestellten Wertpapieren	1.962,90	
Forderungen aus verliehenen Wertpapieren		
Entlehene Finanzwerte	-	
Als Sicherheit erhaltene Wertpapiere	-	
In Pension gegebene Finanzwerte		
Forderungen		
Barsicherheiten	-	
Hinterlegte Barsicherheit	-	
AUF DER PASSIVSEITE DER BILANZ AUSGEWIESENE GESCHÄFTE		
Verbindlichkeiten aus in Pension gegebenen Wertpapieren		
Nicht abgewickelte Terminfinanzinstrumente		3.905,50
Verbindlichkeiten		
Barsicherheiten		-
Erhaltene Barsicherheit		-

GENIUS 100 CROSS ASSET

Indirekte Engagements für Multi-Management-OGAs

ISIN-Code	Name des Fonds	Verwaltungsgesellschaft	Orientierung der Anlagen / Verwaltungsstil	Sitzland des Fonds	Währung des OGA-Anteils	Betrag des Engagements
SUMME						-

Der OGA ist nicht betroffen, da er nicht mehr als 10 % seines Nettovermögens in Anteilen anderer OGA hält.

Forderungen und Verbindlichkeiten: Aufschlüsselung nach Art

	Geschäftsjahr zum 31.12.2024
Auffächerung der Forderungen nach Art	
Einforderbares Steuerguthaben	
Depots EUR	
Depots andere Währungen	
Barsicherheiten	
Sonstige verschiedene Schuldner	
Zu vereinnahmende Kupons	
SUMME FORDERUNGEN	
Auffächerungen der Verbindlichkeiten nach Art	
Depots EUR	
Depots andere Währungen	
Barsicherheiten	
Rückstellung für Kreditaufwendungen	
Noch nicht gezahlte Kosten und Aufwendungen	171.505,55
Sonstige verschiedene Gläubiger	
Rückstellungen für Marktliquiditätsrisiken	
SUMME VERBINDLICHKEITEN	171.505,55

Verwaltungsgebühren, sonstige Kosten und Aufwendungen

Verwaltungsgebühren	Betrag (EUR)	% des durchschnittlichen Nettovermögens
Klasse I (Währung: EUR)		
Verwaltungs- und Betriebskosten (*)	686.988,58	0,84
Erfolgsabhängige Provision	-	-
Sonstige Kosten	-	-
Rückerstattungen von Verwaltungsgebühren (alle Anteile)	-	

(*) für OGA, deren Geschäftsjahr nicht 12 Monate entspricht, entspricht der Prozentsatz des durchschnittlichen Nettovermögens dem annualisierten Durchschnittssatz.

Erhaltene und eingegangene Verpflichtungen

Sonstige Verpflichtungen (nach Art der Produkte)

**Geschäftsjahr
31. Dezember 2024**

Erhaltene Sicherheiten	-
darunter als Sicherheit erhaltene, nicht in der Bilanz ausgewiesene Finanzinstrumente	
Gestellte Sicherheiten	1.962.900,12
darunter als Sicherheit gestellte, in ihrer ursprünglichen Position ausgewiesene Finanzinstrumente	
Erhaltene, aber noch nicht in Anspruch genommene Finanzierungszusagen	-
Erteilte, aber noch nicht in Anspruch genommene Finanzierungszusagen	-
Sonstige außerbilanzielle Verpflichtungen	-
Summe	1.962.900,12

Sonstige Informationen

	Geschäftsjahr zum 31.12.2024
Vom Leistungserbringer oder den Einheiten seiner Gruppe emittierte Finanzinstrumente des Portfolios	
Einlagen	-
Aktien	-
Zinspapiere	-
OGA	-
Vorübergehende Käufe und Verkäufe von Wertpapieren	-
Swaps (Nennwert)	167.335.090,66
Aktueller Wert der Finanzinstrumente, die Gegenstand eines vorübergehenden Erwerbs sind	
Mit Rückkaufsrecht erworbene Wertpapiere	-
In Pension genommene Wertpapiere	-
Entliehene Wertpapiere	-

Ermittlung und Aufschlüsselung der ausschüttungsfähigen Beträge

Klasse I (Währung: EUR)

Zuordnungstabelle der für die Nettoerträge ausschüttungsfähigen Beträge

	Geschäftsjahr zum 31.12.2024
Noch zuzuweisende Beträge	
Vortrag auf neue Rechnung	-
Nettoerträge	2.885.168,30
Ausschüttungsfähige Beträge aus dem Nettoertrag	2.885.168,30
Verwendung	
Ausschüttung	-
Vortrag auf neue Rechnung des Ertrags des Geschäftsjahres	-
Thesaurierung	2.885.168,30
Summe	2.885.168,30
Informationen über Aktien oder Anteile, die Anspruch auf Ausschüttung gewähren	
Anzahl der Aktien oder Anteile	-
Verbleibende Ausschüttung je Anteil nach Begleichung der Anzahlungen	-
Mit der Ertragsausschüttung verbundene Steuergutschriften	-

GENIUS 100 CROSS ASSET

Zuordnungstabelle der für die Netto-Wertzuwächse und -minderungen ausschüttungsfähigen Beträge

	Geschäftsjahr zum 31.12.2024
Noch zuzuweisende Beträge	
Nicht ausgeschüttete vorherige realisierte Nettogewinne und -verluste	-
Realisierte Nettogewinne und -verluste des Geschäftsjahres	-3.672.325,57
Für die Nettogewinne und -verluste des Geschäftsjahres geleistete Anzahlungen	-
Ausschüttungsfähige Beträge im Zusammenhang mit Gewinnen und Verlusten	-3.672.325,57
Verwendung	
Ausschüttung auf realisierte Nettogewinne und -verluste	-
Vortrag auf neue Rechnung aus den realisierten Nettogewinnen und -verlusten	-
Thesaurierung	-3.672.325,57
Summe	-3.672.325,57
Informationen über Aktien oder Anteile, die Anspruch auf Ausschüttung gewähren	
Anzahl der Aktien oder Anteile	-
Verbleibende Ausschüttung je Anteil auf realisierte Nettogewinne und -verluste nach Begleichung der Anzahlungen	-

Aufstellung der Finanzinstrumente zum 31. Dezember 2024

Art und Bezeichnung der Wertpapiere	Menge	Kurs	Notierungs- währung	Aktueller Wert	Gerundeter prozentualer Anteil am Nettovermögen
Anleihen und ähnliche Wertpapiere				52.196.881,85	65,12
An einem geregelten oder gleichwertigen Markt gehandelt				52.196.881,85	65,12
AUTOZONE INC 6,25 % 23-01.11.2028 Vertrieb – Handel	3.300.000,00	104,68	USD	3.369.098,76	4,20
EUROFINS SCIEN 4 % 22-06.07.2029 Pharmaprodukte	3.000.000,00	101,80	EUR	3.112.541,49	3,88
GROUPAMA SA 6 % 17-23.01.2027 Versicherungen	6.500.000,00	105,40	EUR	7.216.429,79	9,00
INTESA SANPAOLO 4 % 19-23.09.2029 Banken und Versicherungen	3.500.000,00	94,23	USD	3.221.665,16	4,02
JAGUAR LAND ROVR 4,5 % 18-15.01.2026 Maschinen und Fahrzeuge	5.500.000,00	100,85	EUR	5.660.294,09	7,06
KELLANOVA 3,75 % 24-16.05.2034 Konsumgüter	3.500.000,00	102,34	EUR	3.664.269,87	4,57
KRAFT HEINZ FOOD 4,375 % 16-01.06.2046 Konsumgüter	4.000.000,00	81,17	USD	3.149.692,83	3,93
RADIAN GROUP INC 4,875 % 19-15.03.2027 Sonstige Kreditinstitute	3.500.000,00	99,30	USD	3.404.741,11	4,25
SOLVAY SA 4,25 % 24-03.10.2031 Chemische Produkte	3.700.000,00	103,13	EUR	3.854.329,27	4,81
TEVA PHARM FNC 1,625 % 16-15.10.2028 Pharmaprodukte	7.500.000,00	93,18	EUR	7.014.020,65	8,75
UBS GROUP AG 22-01.03.2029 FRN Banken und Versicherungen	1.800.000,00	113,98	EUR	2.168.220,98	2,71
XCEL ENERGY INC 5,5 % 24-15.03.2034 Energieverteilung	6.500.000,00	99,74	USD	6.361.577,85	7,94
Schuldtitel				29.686.016,98	37,04
An einem geregelten oder ähnlichen Markt gehandelt				29.686.016,98	37,04
AIR FRANCE-KLM 7,25 % 23-31.05.2026 Transport und Transportmaterial	3.000.000,00	105,37	EUR	3.288.738,15	4,10
BANCO SANTANDER 4,875 % 23-18.10.2031 Banken und Versicherungen	3.000.000,00	108,17	EUR	3.274.655,52	4,09
BARCLAYS PLC 4,918 % 23-08.08.2030 Banken und Versicherungen	2.600.000,00	106,93	EUR	2.830.955,43	3,53
BNP PARIBAS ISS 23-20.09.2028 FRN Banken und Versicherungen	1.164.236,00	100,05	EUR	1.165.958,66	1,45
CRD MUTUEL ARKEA 3,25 % 16-01.06.2026 Banken und Versicherungen	5.000.000,00	100,17	EUR	5.103.193,67	6,37
ERICSSON LM 5,375 % 23-29.05.2028 Telekommunikation	1.500.000,00	106,96	EUR	1.652.083,59	2,06
HERA SPA 5,2 % 13-29.01.2028 Energieverteilung	3.000.000,00	106,75	EUR	3.346.044,39	4,17

GENIUS 100 CROSS ASSET

Aufstellung der Finanzinstrumente zum 31. Dezember 2024

Art und Bezeichnung der Wertpapiere	Menge	Kurs	Notierungs- währung	Aktueller Wert	Gerundeter prozentualer Anteil am Nettovermögen
INFORMA PLC 1,25 % 19-22.04.2028 Audiovisuell	3.000.000,00	94,94	EUR	2.874.168,13	3,59
RENAULT 2,5 % 21-02.06.2027 Maschinen und Fahrzeuge	3.000.000,00	98,60	EUR	3.001.419,05	3,74
TELEFONICA EMIS 4,183 % 23-21.11.2033 Telekommunikation	3.000.000,00	104,50	EUR	3.148.800,39	3,93
Temporäre Wertpapiergeschäfte				1.962.900,12	2,45
Sonstige temporäre Wertpapiergeschäfte				1.962.900,12	2,45
Auf Garantie - BNP PARIBAS ISS 23-20.09.2028 FRN Banken und Versicherungen	1.960.000,00	100,05	EUR	1.962.900,12	2,45
Termin-Finanzinstrumente				-3.704.688,70	-4,62
Equity Swaps				-	-
Zinsswaps				-3.704.688,70	-4,62
IRS6	83.669.790,66	-	EUR	200.807,50	0,25
IRS7	83.665.300,00	-	EUR	-3.905.496,20	-4,87
Forderungen				-	-
Verbindlichkeiten				-171.505,55	-0,21
Sonstige Finanzkonten				182.084,52	0,23
GESAMTNETTOVERMÖGEN			EUR	80.151.689,22	100,00

Die Branche bezeichnet die Hauptgeschäftstätigkeit des Emittenten des Finanzinstruments. Die Information stammt vom Anbieter Bloomberg.

GENIUS 100 CROSS ASSET

Aufstellung der Devisentermingeschäfte (Währung: EUR)

Transaktionsart	In der Bilanz ausgewiesener aktueller Wert		Betrag des Engagements (*)			
			Forderungen in Fremdwährung (+)		Verbindlichkeiten in Fremdwährungen (-)	
	Aktiva	Passiva	Währung	Betrag	Währung	Betrag
Devisentermingeschäfte						
Summe	-	-		-		-

* Nach den Vorgaben der Verordnung zur Darstellung der Engagements ermittelter Betrag, ausgedrückt in der Buchführungswährung des Fonds.

GENIUS 100 CROSS ASSET

Aufstellung der Finanztermininstrumente (ohne solche zur Absicherung einer Anteilsklasse) (Währung: EUR)

Finanztermininstrumente - Aktien

Bezeichnung des Instruments	Menge	In der Bilanz ausgewiesener aktueller Wert		Betrag des Engagements +/-
		Aktiva	Passiva	
Futures				
Zwischensumme		-	-	-
Optionen				
Zwischensumme		-	-	-
Swaps				
Zwischensumme		-	-	-
Andere Instrumente				
Zwischensumme		-	-	-
Summe		-	-	-

Finanztermininstrumente - Zinssätze

Bezeichnung des Instruments	Menge	In der Bilanz ausgewiesener aktueller Wert		Betrag des Engagements +/-
		Aktiva	Passiva	
Futures				
Zwischensumme		-	-	-
Optionen				
Zwischensumme		-	-	-
Swaps				
IRS6	83.669.790,66	200.807,50	-	-83.669.790,66
IRS7	83.665.300,00	-	-3.905.496,20	83.665.300,00
Zwischensumme		200.807,50	-3.905.496,20	-4.490,66
Andere Instrumente				
Zwischensumme		-	-	-
Summe		200.807,50	-3.905.496,20	-4.490,66

Finanztermininstrumente - Währungen

Bezeichnung des Instruments	Menge	In der Bilanz ausgewiesener aktueller Wert		Betrag des Engagements +/-
		Aktiva	Passiva	
Futures				
Zwischensumme		-	-	-
Optionen				
Zwischensumme		-	-	-
Swaps				
Zwischensumme		-	-	-
Andere Instrumente				
Zwischensumme		-	-	-
Summe		-	-	-

GENIUS 100 CROSS ASSET

Aufstellung der Finanztermininstrumente (ohne solche zur Absicherung einer Anteilsklasse) (Währung: EUR)

Finanztermininstrumente - Kreditrisiken

Bezeichnung des Instruments	Menge	In der Bilanz ausgewiesener aktueller Wert		Betrag des Engagements +/-
		Aktiva	Passiva	
Futures				
Zwischensumme		-	-	-
Optionen				
Zwischensumme		-	-	-
Swaps				
Zwischensumme		-	-	-
Andere Instrumente				
Zwischensumme		-	-	-
Summe		-	-	-

Finanztermininstrumente - sonstige Risikopositionen

Bezeichnung des Instruments	Menge	In der Bilanz ausgewiesener aktueller Wert		Betrag des Engagements +/-
		Aktiva	Passiva	
Futures				
Zwischensumme		-	-	-
Optionen				
Zwischensumme		-	-	-
Swaps				
Zwischensumme		-	-	-
Andere Instrumente				
Zwischensumme		-	-	-
Summe		-	-	-

Aufstellung der zur Absicherung einer Anteilsklasse eingesetzten Finanztermininstrumente (Währung: EUR)

Finanztermininstrumente - Währungen					
Bezeichnung des Instruments	Der Anteilsklasse zugeordnete Transaktion	Menge	In der Bilanz ausgewiesener aktueller Wert		Betrag des Engagements +/-
			Aktiva	Passiva	
Futures					
Zwischensumme				-	
Optionen					
Zwischensumme				-	
Swaps					
Zwischensumme				-	
Andere Instrumente					
Zwischensumme				-	
Summe				-	

Zusammenfassung der Aufstellung (Währung: EUR)

	In der Bilanz ausgewiesener aktueller Wert
Summe der zulässigen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten (ohne Finanztermininstrumente)	83.845.798,95
Aufstellung der Finanztermininstrumente (außer solchen, die zur Absicherung ausgegebener Anteile eingesetzt werden):	
Summe Devisentermingeschäfte	-
Summe Finanztermininstrumente - Aktien	-
Summe Finanztermininstrumente - Zinssätze	-3.704.688,70
Summe Finanztermininstrumente - Währungen	-
Summe Finanztermininstrumente - Kreditrisiken	-
Summe Finanztermininstrumente - sonstige Risikopositionen	-
Aufstellung der zur Absicherung ausgegebener Anteile eingesetzten Finanztermininstrumente	-
Sonstige Vermögenswerte (+)	182.084,52
Sonstige Verbindlichkeiten (-)	171.505,55
Finanzierungsverbindlichkeiten (-)	-
SUMME	80.151.689,22

ANHANG

Der Jahresbericht des Vorjahres (im alten Kontenplanformat) wird gemäß der Verordnung ANC 2022-03 im Anhang dargestellt.



GENIUS 100 CROSS ASSET

Jahresbericht zum 29. Dezember 2023

Verwaltungsgesellschaft: BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT FRANCE

Gesellschaftssitz: 1, boulevard Haussmann 75009 Paris

Depotbank: BNP PARIBAS SA

Aktiva

	Geschäftsjahr zum 29.12.2023
Netto-Anlagevermögen	
Einlagen	
Finanzinstrumente	86.421.504,87
Aktien und aktienähnliche Wertpapiere	
An einem geregelten oder gleichwertigen Markt gehandelt	
Nicht an einem geregelten oder gleichwertigen Markt gehandelt	
Anleihen und ähnliche Wertpapiere	51.896.443,41
An einem geregelten oder gleichwertigen Markt gehandelt	51.896.443,41
Nicht an einem geregelten oder gleichwertigen Markt gehandelt	
Schuldtitel	30.236.891,09
An einem geregelten oder ähnlichen Markt gehandelte handelbare Schuldtitel	
An einem geregelten oder ähnlichen Markt gehandelte sonstige Schuldtitel	30.236.891,09
Nicht an einem geregelten oder ähnlichen Markt gehandelt	
Anteile von Organismen für gemeinsame Anlagen	
OGAW und alternative Investmentfonds allgemeiner Ausrichtung für nicht professionelle Anleger und vergleichbare Anlagen anderer Mitgliedstaaten der Europäischen Union	
Sonstige Fonds für nicht professionelle Anleger und vergleichbare Anlagen in anderen EU-Mitgliedstaaten	
Fonds allgemeiner Ausrichtung für professionelle Anleger und vergleichbare Anlagen in anderen EU-Mitgliedstaaten und notierte Verbriefungsvehikel	
Sonstige Investmentfonds für professionelle Anleger und vergleichbare Anlagen in anderen EU-Mitgliedstaaten und nicht notierte Verbriefungsvehikel	
Sonstige außereuropäische Organismen	
Temporäre Wertpapiergeschäfte	2.861.688,98
Forderungen aus im Rahmen von Pensionsgeschäften erhaltenen Wertpapieren	
Forderungen aus verliehenen Wertpapieren	
Entliehene Wertpapiere	
In Pension gegebene Wertpapiere	
Sonstige temporäre Wertpapiergeschäfte	2.861.688,98
Termin-Finanzinstrumente	1.426.481,39
Transaktionen an geregelten oder gleichwertigen Märkten	
Sonstige Transaktionen	1.426.481,39
Sonstige Vermögenswerte: Loans	
Sonstige Finanzinstrumente	
Forderungen	
Devisen-Termingeschäfte	
Sonstige	
Finanzkonten	195.076,04
Zahlungsmittel	195.076,04
SUMME AKTIVA	86.616.580,91

Passiva

	Geschäftsjahr zum 29.12.2023
Eigenkapital	
Kapital	89.245.209,90
Nicht ausgeschüttete vorherige Nettogewinne und -verluste (a)	
Ergebnisvortrag (a)	
Nettogewinne und -verluste des Geschäftsjahrs (a, b)	-3.538.742,27
Ergebnis des Geschäftsjahrs (a, b)	738.930,97
Summe Eigenkapital (= Repräsentativer Betrag des Nettovermögens)	86.445.398,60
Finanzinstrumente	
Veräußerungen von Finanzinstrumenten	
Temporäre Wertpapiergeschäfte	
Verbindlichkeiten aus in Pension gegebenen Wertpapieren	
Verbindlichkeiten aus entliehenen Wertpapieren	
Sonstige temporäre Wertpapiergeschäfte	
Termin-Finanzinstrumente	
Transaktionen an geregelten oder gleichwertigen Märkten	
Sonstige Transaktionen	
Verbindlichkeiten	171.182,27
Devisen-Termingeschäfte	
Sonstige	171.182,27
Finanzkonten	0,04
Laufende Bankverbindlichkeiten	0,04
Darlehen	
SUMME PASSIVA	86.616.580,91

(a) Einschließlich Rechnungsabgrenzungsposten.

(b) Abzüglich der für das Geschäftsjahr geleisteten Anzahlungen.

Außerbilanzielle Posten

	Geschäftsjahr 29. Dezember 2023
Deckungsgeschäfte	
Verpflichtungen an geregelten oder ähnlichen Märkten	
Verpflichtungen an OTC-Märkten	
Zinsswaps	
Kauf IRS2	84.945.000,00
Sonstige Engagements	
 Sonstige Transaktionen	
Verpflichtungen an geregelten oder ähnlichen Märkten	
Verpflichtungen an OTC-Märkten	
Performance-Swap	
Kauf TRS3	84.945.000,00
Sonstige Engagements	

Gewinn- und Verlustrechnung

	Geschäftsjahr zum 29.12.2023
Erträge aus Finanzgeschäften	-
Erträge aus Aktien und aktienähnlichen Wertpapieren	2.709,69
Erträge aus Anleihen und ähnlichen Wertpapieren	451.325,91
Erträge aus Schuldtiteln	418.219,03
Erträge aus vorübergehenden Käufen und Verkäufen von Wertpapieren	-
Erträge aus Termin-Finanzinstrumenten	1.138.961,22
Erträge aus Einlagen und Finanzkonten	38.693,35
Erträge aus Krediten	-
Sonstige Finanzerträge	-
SUMME I	2.049.909,20
Aufwendungen für Finanztransaktionen	-
Aufwendungen für vorübergehende Käufe und Verkäufe von Wertpapieren	-
Aufwendungen für Termin-Finanzinstrumente	-882.765,14
Aufwendungen für Finanzschulden	-2.215,25
Sonstige finanzielle Aufwendungen	-
SUMME II	-884.980,39
Ergebnis aus Finanzgeschäften (I + II)	1.164.928,81
Sonstige Erträge (III)	-
Verwaltungskosten und Zuführungen zu den Abschreibungen (IV)	-372.164,92
Nettoergebnis des Geschäftsjahres (I + II + III + IV)	792.763,89
Ertragsabgrenzungen für das Geschäftsjahr (V)	-53.832,92
Für das Geschäftsjahr geleistete Ergebnisanzahlungen (VI)	-
Ergebnis (I + II + III + IV + V + VI)	738.930,97

Rechnungslegungsregeln und -methoden

Die Darstellung des Jahresabschlusses entspricht den Vorschriften der Verordnung ANC 2014-01 vom 14.

Januar 2014 in ihrer geänderten Fassung.

Das Geschäftsjahr hatte eine außergewöhnliche Dauer von 7 Monaten und 2 Tagen.

Die Buchführungswährung ist der Euro.

Sämtliche Wertpapiere, die das Portfolio zusammensetzen, wurden zu den Kosten der Vergangenheit verbucht, ohne Gebühren.

Die Wertpapiere und Finanzinstrumente, die im Rahmen von bedingten und unbedingten Termingeschäften im Portfolio gehalten werden und auf Fremdwährungen lauten, werden auf der Basis der in Paris am Bewertungsstichtag gültigen Wechselkurse in die Buchführungswährung umgerechnet.

Das Portfolio wird somit bei jeder Feststellung des Nettoinventarwerts und bei jedem Jahresabschluss gemäß der nachfolgenden Methoden bewertet:

Wertpapiere

Notierte Wertpapiere: zum Börsenwert - einschließlich aufgelaufener Kupons (Schlusskurs des Tages)

Wertpapiere, deren Kurs am Bewertungsstichtag nicht ermittelt wurde oder die von Marktteilnehmern notiert werden und deren Kurs korrigiert wurde, sowie nicht an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere werden unter Verantwortung der Verwaltungsgesellschaft (oder bei einer Sicav vom Verwaltungsrat) mit ihrem wahrscheinlichen Handelswert bewertet. Die Preise werden von der Verwaltungsgesellschaft in Abhängigkeit von ihrer Kenntnis der Emittenten und/oder der Märkte korrigiert.

Organismen für gemeinsame Anlagen: zum letzten bekannten Nettoinventarwert. Falls kein solcher vorliegt, zum letzten geschätzten Wert. Die Nettoinventarwerte der Wertpapiere von ausländischen Organismen für gemeinsame Anlagen, die auf monatlicher Basis bewertet werden, werden von den Verwaltungsgesellschaften der Fonds bestätigt. Die Bewertungen werden wöchentlich auf der Basis der von den Verwaltungsgesellschaften der Organismen mitgeteilten Schätzungen aktualisiert, die vom Fondsmanager bestätigt werden.

Handelbare Forderungspapiere und ähnliche Wertpapiere, die nicht Gegenstand umfangreicher Transaktionen sind, werden nach einer versicherungsmathematischen Methode bewertet, wobei der Zinssatz gleichwertiger Papiere verwendet wird, der gegebenenfalls entsprechend den intrinsischen Merkmalen des Emittenten des zu bewertenden Papiers angepasst wird. Wenn keine Sensitivität besteht, werden die Wertpapiere mit einer Restlaufzeit von drei Monaten zum letzten Zinssatz bis zur Fälligkeit bewertet. Bei Wertpapieren, die mit einer Restlaufzeit von weniger als drei Monaten erworben werden, werden die Zinsen linearisiert.

Vorübergehende Käufe und Verkäufe von Wertpapieren:

- Die Verleihe von Wertpapieren: die den verliehenen Wertpapieren entsprechende Forderung wird zum Marktwert der Wertpapiere bewertet.
- Die Entleihe von Wertpapieren: die entliehenen Wertpapiere sowie die den entliehenen Wertpapieren entsprechende Schuld werden zum Marktwert der Wertpapiere bewertet.
- Sicherheiten: Im Hinblick auf die im Rahmen von Wertpapierleihgeschäften als Sicherheit erhaltenen Wertpapiere hat sich der OGA für eine Darstellung dieser Wertpapiere in den Bilanzkonten in Höhe der Schuld entschieden, die der Verpflichtung zur Rückgabe dieser Wertpapiere entspricht.
- Gelieferte Repos mit einer Restlaufzeit von bis zu drei Monaten: Individualisierung der Forderung auf der Grundlage des Vertragspreises. In diesem Fall erfolgt eine Linearisierung der Vergütung.
- Langfristige Repos: Sie werden zu ihrem Nennwert ausgewiesen und bewertet, auch wenn ihre Laufzeit länger als drei Monate ist. Zu diesem Betrag kommen die entsprechenden aufgelaufenen Zinsen hinzu. Bestimmte Verträge sehen jedoch Sonderbedingungen für Anträge auf vorzeitige Rückzahlung vor, um die Auswirkung des Anstiegs der Finanzierungskurve der Gegenpartei zu berücksichtigen. Die aufgelaufenen Zinsen können dann um diese Auswirkung verringert werden, ohne einen Planwert zu haben. Die Auswirkung ist proportional zur Restlaufzeit der Repos und der Differenz zwischen der vertraglich vereinbarten Marge und der Marktmarge für ein identisches Fälligkeitsdatum.
- Pensionsgeschäfte mit einer Restlaufzeit von höchstens drei Monaten: Börsenkurswert. Die auf der Basis des Vertragswerts bewerteten Schulden werden auf der Passivseite der Bilanz ausgewiesen. In diesem Fall erfolgt eine Linearisierung der Vergütung.

GENIUS 100 CROSS ASSET

Terminfinanzinstrumente und bedingte Finanzinstrumente

Futures: Abrechnungskurs des Tages.

Die Bewertung der außerbilanziellen Posten erfolgt auf der Basis des Nennwerts, ihres Ausgleichskurses und eventuell des Wechselkurses.

Optionen: Schlusskurs des Tages oder ansonsten der letzte bekannte Kurs.

OTC-Optionen: Diese Optionen werden zu ihrem Marktwert bewertet, der auf den von den Kontrahenten zur Verfügung gestellten Preisen basiert. Diese Bewertungen werden von der Verwaltungsgesellschaft überprüft.

Die außerbilanzielle Wertermittlung erfolgt entsprechend dem Basiswert in Abhängigkeit des Delta und des Kurses des Basiswerts sowie gegebenenfalls des Wechselkurses.

Devisentermingeschäfte: Neubewertung der Devisen des Engagements zum Tageskurs unter Berücksichtigung des in Abhängigkeit von der Fälligkeit des Kontrakts berechneten Aufpreises/Abschlags.

Termineinlagen: Sie werden zu ihrem Nennwert registriert und bewertet, auch wenn ihre Laufzeit länger als drei Monate ist. Zu diesem Betrag kommen die entsprechenden aufgelaufenen Zinsen hinzu. Bestimmte Verträge sehen jedoch Sonderbedingungen für Anträge auf vorzeitige Rückzahlung vor, um die Auswirkung des Anstiegs der Finanzierungskurve der Gegenpartei zu berücksichtigen. Die aufgelaufenen Zinsen können somit um diese Auswirkung verringert werden, ohne negativ werden zu können. Termineinlagen werden somit mindestens zu ihrem Nennwert bewertet.

Zinsswaps:

- Bei Swaps mit einer Laufzeit von weniger als drei Monaten werden die Zinsen linearisiert.
- Swaps mit einer Fälligkeit über drei Monaten werden zum Marktwert neu bewertet.

Synthetische Produkte (Verbindungen zwischen einem Wertpapier und einem Swap) werden in ihrer Gesamtheit verbucht. Die im Rahmen von synthetischen Produkten erzielbaren Zinsen für Swaps werden linear bewertet.

Assets-Swaps und synthetische Produkte werden auf Basis ihres Marktwerts bewertet. Die Bewertung von Asset-Swaps basiert auf der Bewertung der Basiswerte, wovon die Auswirkung der Schwankung der Kredit-Spreads abgezogen wird. Diese Auswirkung wird über den Mittelwert von 4 monatlich bei Gegenparteien abgefragten Spreads bewertet, korrigiert um eine Marge, die vom Rating des Emittenten abhängt.

Das außerbilanzielle Engagement der Swaps entspricht ihrem Nennwert.

Strukturierte Swaps (Swaps mit optionalem Bestandteil): Diese Swaps werden zu ihrem Marktwert auf der Grundlage der von den Kontrahenten gemeldeten Preise bewertet. Diese Bewertungen werden von der Verwaltungsgesellschaft überprüft. Das außerbilanzielle Engagement dieser Swaps entspricht ihrem Nennwert.

Die Bewertung von Indexswaps, die vom Team OTC Pricing & Services berechnet wird, wird nach einer Konsistenzprüfung mit der Bewertung des Kontrahenten für die Berechnung des Nettoinventarwerts verwendet, wenn diese fristgerecht eingeht. Bei Nichtverfügbarkeit oder Inkonsistenzen setzt sich OTC Pricing and Services mit dem Kontrahenten in Verbindung, um die Probleme zu identifizieren und zu lösen. Das außerbilanzielle Engagement dieser Swaps entspricht ihrem Nennwert.

Finanzverwaltungsgebühren

- max. 1 % inkl. aller Steuern

Die Zuführung wird auf der Grundlage des Nettovermögens berechnet. Diese Gebühren verstehen sich ohne Transaktionskosten und werden direkt in der Gewinn- und Verlustrechnung des Fonds erfasst.

Diese Kosten decken sämtliche dem OGA belasteten Kosten, mit Ausnahme der Transaktionskosten. Die Transaktionsgebühren umfassen Vermittlergebühren (Maklergebühren, Börsensteuern usw.) und gegebenenfalls Transaktionsgebühren, die insbesondere von der Verwahrstelle und der Verwaltungsgesellschaft erhoben werden können.

Betriebskosten und sonstige Dienstleistungen

- 0,20 % inkl. aller Steuern auf der Basis des Nettovermögens

Research-Kosten

n.z.

Erfolgsabhängige Gebühren

n.z.

Rückerstattung von Verwaltungsgebühren

n.z.

Rechnungslegungsmethode für Zinsen

Vereinnahmte Zinsen

Verwendung der realisierten Ergebnisse

Thesaurierung

Verwendung der realisierten Nettogewinne

Thesaurierung

Veränderungen mit Auswirkung auf den Fonds

30. Mai 2023: Auflegung des Fonds und Berechnung des ersten Nettoinventarwerts.

Anhang

Gewährleistung oder Schutz

Der Inhaber des FCP, dessen Anteile am FCP spätestens bis zum 7. September 2023 zentralisiert worden sind, erhält eine Garantie, die sicherstellt, dass der Nettoinventarwert des FCP zum Fälligkeitsdatum mindestens 106,61 % des Referenz-Nettoinventarwerts beträgt.

Definition:

Der Referenz-Nettoinventarwert ist definiert als Nettoinventarwert des FCP vom 10. August 2023.

Die Zeichnungen werden für ihren Betrag abzüglich der Zeichnungsgebühr ohne Steuern und Sozialversicherungsbeiträge oder gegebenenfalls abzüglich der im Rahmen der Investition in den FCP anfallenden spezifischen Ausgabeaufschläge gehalten.

Zugangsbedingungen:

BNP Paribas verpflichtet sich gegenüber dem FCP, dass jeder Inhaber, dessen Anteile ab dem Folgetag nach dem Gründungsdatum des FCP bis einschließlich 7. September 2023 um 16.00 Uhr Pariser Zeit zentralisiert wurden und der seine Anteile bis zum Fälligkeitsdatum behalten hat, zu diesem Zeitpunkt einen Nettoinventarwert von mindestens 106,61 % des Referenz-Nettoinventarwerts bekommt.

Aufgrund dieser Garantiezusage und gegebenenfalls auf Anforderung der Verwaltungsgesellschaft zahlt BNP Paribas an den FCP den zusätzlichen Betrag, der erforderlich ist, damit der Nettoinventarwert zum Fälligkeitsdatum der eingegangenen Verpflichtung entspricht.

Die Verwaltungsgesellschaft weist die Anleger darauf hin, dass die zwischen dem 10. August 2023 und dem 7. September 2023 zentralisierten Anteile zu einem Nettoinventarwert gezeichnet werden können, der je nach Marktbedingungen nach oben oder unten schwanken kann. Insbesondere können Anteile zu einem Nettoinventarwert von mehr als 106,61 % des Nettoinventarwerts des Referenz-Nettoinventarwerts gezeichnet werden.

Die Inhaber kommen unabhängig vom Zeichnungsdatum ihrer Anteile nicht in den Genuss der vorstehend beschriebenen Garantie, wenn sie den Rückkauf ihrer Anteile auf der Grundlage eines anderen Nettoinventarwerts als dem zum Fälligkeitsdatum datierten Nettoinventarwert beantragen.

Die Garantie wird von der Verwaltungsgesellschaft im Namen des FCP geltend gemacht.

Die Garantie oder den Schutz stellendes Institut: BNP Paribas SA

Veränderung des Nettovermögens

	Geschäftsjahr zum 29.12.2023
Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres	-
Zeichnungen (einschließlich der Zeichnungsgebühren, die dem OGA zufließen)	135.309.399,63
Rücknahmen (nach Abzug der Rücknahmeprovisionen, die dem OGA zustehen)	-50.523.836,52
Realisierte Gewinne aus Einlagen und Finanzinstrumenten	5.840.079,33
Realisierte Verluste aus Einlagen und Finanzinstrumenten	-880.991,78
Realisierte Gewinne aus Finanztermininstrumenten	142.041,41
Realisierte Verluste aus Finanztermininstrumenten	-7.599.824,89
Transaktionskosten	3.397,55
Wechselkursdifferenzen	-26.471,26
Veränderung der Bewertungsdifferenzen bei Einlagen und Finanzinstrumenten:	1.962.359,85
Schätzungsdifferenz Geschäftsjahr N	1.962.359,85
Schätzungsdifferenz Geschäftsjahr N-1	-
Veränderung der Differenz bei der Schätzung von Termininstrumenten:	1.426.481,39
Schätzungsdifferenz Geschäftsjahr N	1.426.481,39
Schätzungsdifferenz Geschäftsjahr N-1	-
Für das vorhergehende Geschäftsjahr auf Netto-Wertzuwächse und -minderungen zugewiesene Ausschüttungen	-
Für das vorhergehende Geschäftsjahr auf das Ergebnis zugewiesene Ausschüttungen	-
Nettoergebnis des Geschäftsjahres vor Rechnungsabgrenzungsposten	792.763,89
Im Laufe des Geschäftsjahres auf Netto-Wertzuwächse und -minderungen geleistete Anzahlung(en)	-
Im Laufe des Geschäftsjahres auf das Ergebnis geleistete Anzahlung(en)	-
Sonstige Elemente	-
Nettovermögen zum Ende des Geschäftsjahres	86.445.398,60

Zusatzinformationen 1

	Geschäftsjahr zum 29.12.2023
Erhaltene oder eingegangene Verpflichtungen	
Erhaltene oder eingegangene Verpflichtungen (Kapitalgarantie oder sonstige Verpflichtungen) (*)	-
Aktueller Wert der Finanzinstrumente des Portfolios, die als Garantie dienen	
Als Garantie erhaltene, nicht in der Bilanz ausgewiesene Finanzinstrumente	-
Als Garantie gestellte, in ihrer ursprünglichen Position ausgewiesene Finanzinstrumente	-
Vom Leistungserbringer oder den Einheiten seiner Gruppe emittierte Finanzinstrumente des Portfolios	
Einlagen	-
Aktien	-
Zinspapiere	4.810.775,02
OGA	-
Vorübergehende Käufe und Verkäufe von Wertpapieren	2.861.688,98
Swaps (Nennwert)	169.890.000,00
Aktueller Wert der Finanzinstrumente, die Gegenstand eines vorübergehenden Erwerbs sind	
Mit Rückkaufsrecht erworbene Wertpapiere	-
In Pension genommene Wertpapiere	-
Entliehene Wertpapiere	-

(*) Für garantierte OGA ist diese Information den Rechnungslegungsregeln und -methoden zu entnehmen

Zusatzinformationen 2

		Geschäftsjahr 29. Dezember 2023	
Emissionen und Rücknahmen während des Geschäftsjahres		Anzahl Anteile	
Klasse I (Währung: EUR)			
Anzahl emittierter Anteile		1.354.944,000	
Anzahl zurückgenommener Anteile		505.494,000	
Zeichnungs- und/oder Rücknahmegebühr		Betrag (EUR)	
An den OGA gezahlte Zeichnungsgebühren		-	
Dem OGA zufließende Rücknahmegebühren		-	
Vereinnahmte und zurückerstattete Zeichnungsgebühren		-	
Vereinnahmte und zurückerstattete Rücknahmegebühren		-	
Verwaltungsgebühren		Betrag (EUR)	% des durchschnittlichen Nettovermögens
Klasse I (Währung: EUR)			
Verwaltungs- und Betriebskosten (*)		372.164,92	0,88
Erfolgsabhängige Provision		-	-
Sonstige Kosten		-	-
Rückerstattungen von Verwaltungsgebühren (alle Anteile)			

(*) für OGA, deren Geschäftsjahr nicht 12 Monate entspricht, entspricht der Prozentsatz des durchschnittlichen Nettovermögens dem annualisierten Durchschnittssatz.

Auffächerung der Forderungen und Verbindlichkeiten nach Art

	Geschäftsjahr zum 29.12.2023
Auffächerung der Forderungen nach Art	-
Einforderbares Steuerguthaben	-
Depots Euro	-
Depots andere Währungen	-
Barsicherheiten	-
Bewertung von Devisenterminkäufen	-
Gegenwert der Terminverkäufe	-
Sonstige verschiedene Schuldner	-
Zu vereinnahmende Kupons	-
SUMME FORDERUNGEN	-
Auffächerungen der Verbindlichkeiten nach Art	-
Depots Euro	-
Depots andere Währungen	-
Barsicherheiten	-
Rückstellung für Kreditaufwendungen	-
Bewertung von Devisenterminverkäufen	-
Gegenwert der Terminkäufe	-
Noch nicht gezahlte Kosten und Aufwendungen	171.182,27
Sonstige verschiedene Gläubiger	-
Rückstellungen für Marktliquiditätsrisiken	-
SUMME VERBINDLICHKEITEN	171.182,27

Auffächerung der Instrumente nach rechtlicher oder wirtschaftlicher Art

	Geschäftsjahr zum 29.12.2023
Aktiva	
Anleihen und ähnliche Wertpapiere	51.896.443,41
Indexierte Anleihen	-
Wandelanleihen	-
Beteiligungspapiere	-
Sonstige Anleihen und ähnliche Wertpapiere	51.896.443,41
Schuldtitel	30.236.891,09
An einem geregelten oder ähnlichen Markt gehandelt	30.236.891,09
Schatzanweisungen	-
Sonstige handelbare Schuldtitel	-
Sonstige Schuldtitel	30.236.891,09
Nicht an einem geregelten oder ähnlichen Markt gehandelt	-
Sonstige Vermögenswerte: Loans	-
Passiva	
Veräußerungen von Finanzinstrumenten	-
Aktien	-
Anleihen	-
Sonstige	-
Außerbilanzielle Posten	
Deckungsgeschäfte	
Zinssätze	-
Aktien	-
Sonstige	84.945.000,00
Sonstige Transaktionen	
Zinssätze	-
Aktien	-
Sonstige	84.945.000,00

GENIUS 100 CROSS ASSET

Aufschlüsselung der Aktiva, Passiva und außerbilanziellen Posten nach Art des Zinssatzes

	Festverzinslich	Variabel verzinslich	Anpassbarer Zinssatz	Sonstige
Aktiva				
Einlagen	-	-	-	-
Anleihen und ähnliche Wertpapiere	33.670.956,16	-	18.225.487,25	-
Schuldtitel	18.898.846,17	-	11.338.044,92	-
Temporäre Wertpapiergeschäfte	-	-	2.861.688,98	-
Sonstige Vermögenswerte: Loans	-	-	-	-
Finanzkonten	-	-	-	195.076,04
Passiva				
Temporäre Wertpapiergeschäfte	-	-	-	-
Finanzkonten	-	-	-	0,04
Außerbilanzielle Posten				
Deckungsgeschäfte	84.945.000,00	-	-	-
Sonstige Transaktionen	-	-	-	-

Aufschlüsselung der Aktiva, Passiva und außerbilanziellen Posten nach Restlaufzeit

	[0 bis 3 Monate]] 3 Monate bis 1 Jahr]]1 bis 3 Jahre]]3 bis 5 Jahre]	> 5 Jahre
Aktiva					
Einlagen	-	-	-	-	-
Anleihen und ähnliche Wertpapiere	-	-	24.816.979,51	27.079.463,90	-
Schuldtitel	-	-	20.285.530,08	9.951.361,01	-
Temporäre Wertpapiergeschäfte	-	-	-	2.861.688,98	-
Sonstige Vermögenswerte: Loans	-	-	-	-	-
Finanzkonten	195.076,04	-	-	-	-
Passiva					
Temporäre Wertpapiergeschäfte	-	-	-	-	-
Finanzkonten	0,04	-	-	-	-
Außerbilanzielle Posten					
Deckungsgeschäfte	-	-	-	-	84.945.000,00
Sonstige Transaktionen	-	-	-	-	-

Aufschlüsselung der Aktiva, Passiva und außerbilanziellen Posten nach Notierungswährung

	USD
Aktiva	
Einlagen	-
Aktien und aktienähnliche Wertpapiere	-
Anleihen und ähnliche Wertpapiere	14.191.512,46
Schuldtitel	3.385.359,56
OGA-Anteile	-
Temporäre Wertpapiergeschäfte	-
Sonstige Vermögenswerte: Loans	-
Sonstige Finanzinstrumente	-
Forderungen	-
Finanzkonten	-
Passiva	
Veräußerungen von Finanzinstrumenten	-
Temporäre Wertpapiergeschäfte	-
Verbindlichkeiten	-
Finanzkonten	0,04
Außerbilanzielle Posten	
Deckungsgeschäfte	-
Sonstige Transaktionen	-

Einzig die für die Zusammensetzung des Nettovermögens fünf repräsentativsten Devisen werden in dieser Tabelle aufgeführt.

Ergebnisverwendung

Klasse I (Währung: EUR)

Zuordnungstabelle der für das Ergebnis ausschüttungsfähigen Beträge

	Geschäftsjahr zum 29.12.2023
Noch zuzuweisende Beträge	
Vortrag auf neue Rechnung	-
Ergebnis	738.930,97
Summe	738.930,97
Verwendung	
Ausschüttung	-
Vortrag auf neue Rechnung des Geschäftsjahres	-
Thesaurierung	738.930,97
Summe	738.930,97
Informationen über Wertpapiere, die Anspruch auf Ausschüttung gewähren	
Anzahl Anteile	-
Ausschüttung je Anteil	-
Mit der Ergebnisausschüttung verbundene Steuerguthaben und Steuergutschriften	
Gesamtbetrag der Steuergutschriften und Steuererstattungsansprüche:	
Aus dem Geschäftsjahr	-
Aus dem Geschäftsjahr N-1	-
Aus dem Geschäftsjahr N-2	-
Aus dem Geschäftsjahr N-3	-
Aus dem Geschäftsjahr N-4	-

GENIUS 100 CROSS ASSET

Zuordnungstabelle der für die Netto-Wertzuwächse und -minderungen ausschüttungsfähigen Beträge

	Geschäftsjahr zum 29.12.2023
Noch zuzuweisende Beträge	
Nicht ausgeschüttete vorherige Nettogewinne und -verluste	-
Netto-Wertzuwächse und -minderungen des Geschäftsjahres	-3.538.742,27
Für die Netto-Wertzuwächse und -minderungen des Geschäftsjahres geleistete Anzahlungen	-
Summe	-3.538.742,27
Verwendung	
Ausschüttung	-
Nicht ausgeschüttete Nettogewinne und -verluste	-
Thesaurierung	-3.538.742,27
Summe	-3.538.742,27
Informationen über Wertpapiere, die Anspruch auf Ausschüttung gewähren	
Anzahl Anteile	-
Ausschüttung je Anteil	-

Tabelle der Ergebnisse und anderen kennzeichnenden Elemente während der letzten fünf Geschäftsjahre

Klasse I (Währung: EUR)

	29. Dezember 2023
Nettoinventarwert (in EUR)	
C-Anteile	101,76
Nettovermögen (in Tsd. EUR)	86.445,40
Anzahl Anteile	
C-Anteile	849.450,000

Zahlungsdatum	29. Dezember 2023
Einheitsausschüttung auf Nettogewinne und -verluste (einschließlich Anzahlungen) (in EUR)	-
Für das Ergebnis zugewiesene Ausschüttung je Anteil (einschließlich Anzahlungen) (in EUR)	-
Steuerzugschrift je Anteil (*) Natürliche Personen (in EUR)	-
Einheitskapitalisierung von Nettogewinnen und -verlusten (in EUR)	
C-Anteile	-4,16
Thesaurierung je Anteil auf das Ergebnis (in EUR)	
C-Anteile	0,86

(*) „die Steuerzugschrift wird am Tag der Auszahlung gemäß der Steueranweisung vom 04.03.93 (Ints.4 K-1-93) ermittelt. Die nach den geltenden Regeln für natürliche Personen berechneten theoretischen Beträge werden hier nur zur Orientierung aufgeführt. „Die Verordnung 4 J-2-99 vom 08.11.99 besagt darüber hinaus, dass andere Anspruchsberechtigte als natürliche Personen, die Anspruch auf eine Steuerzugschrift haben, die ihnen zustehende Steuerzugschrift unter ihrer eigenen Verantwortung berechnen.“

GENIUS 100 CROSS ASSET

Aufstellung der Finanzinstrumente zum 29. Dezember 2023

Art und Bezeichnung der Wertpapiere	Menge	Kurs	Notierung swährung	Aktueller Wert	Gerundeter prozentualer Anteil am Nettovermögen
Anleihen und ähnliche Wertpapiere				51.896.443,41	60,03
An einem geregelten oder gleichwertigen Markt gehandelt				51.896.443,41	60,03
AMERICAN EXPRESS 23-30.10.2026 FRN	4.000.000,00	102,03	USD	3.734.846,62	4,32
BAYER US FINANCE 6,125 % 23-21.11.2026	4.000.000,00	101,75	USD	3.710.161,13	4,29
ENEL FINANCE AM 7,1 % 22-14.10.2027	3.500.000,00	106,60	USD	3.426.840,40	3,96
FAURECIA 2,625 % 18-15.06.2025	2.764.000,00	98,43	EUR	2.724.163,84	3,15
GROUPAMA SA 6 % 17-23.01.2027	7.200.000,00	107,66	EUR	8.159.884,77	9,44
HSBC HOLDINGS 22-15.06.2027 FRN	3.990.000,00	98,92	EUR	4.013.310,54	4,64
JPMORGAN CHASE 20-01.06.2028 FRN	4.000.000,00	91,48	USD	3.319.664,31	3,84
NATWEST GROUP PLC 15.11.2025	3.408.000,00	97,25	EUR	3.317.821,25	3,84
NOBIAN FINANCE B 3,625 % 21-15.07.2026	4.230.000,00	96,18	EUR	4.140.056,10	4,79
PCF GMBH 4,75 % 21-15.04.2026	4.495.000,00	73,50	EUR	3.350.086,04	3,88
SCIL IV LLC / SC 21-01.11.2026 FRN	3.760.000,00	100,68	EUR	3.839.844,53	4,44
TEVA PHARM FNC 1,625 % 16-15.10.2028	9.500.000,00	85,54	EUR	8.159.763,88	9,44
Schuldtitel				30.236.891,09	34,98
An einem geregelten oder ähnlichen Markt gehandelt				30.236.891,09	34,98
Sonstige Schuldtitel				30.236.891,09	34,98
ABERTIS INFRAEST 0,625 % 19-15.07.2025	2.900.000,00	95,87	EUR	2.788.646,26	3,23
BANCO SABADELL 0,875 % 19-22.07.2025	2.300.000,00	96,31	EUR	2.224.191,25	2,57
BARCLAYS PLC 19-09.06.2025 FRN	1.010.000,00	98,47	EUR	998.902,42	1,16
BNP PARIBAS ISS 23-20.09.2028 FRN	7.705.735,00	99,40	EUR	7.672.464,00	8,88
Auf Garantie - BNP PARIBAS ISS 23-20.09.2028 FRN	-2.879.000,00	99,40	EUR	-2.861.688,98	-3,31
CRD MUTUEL ARKEA 3,25 % 16-01.06.2026	5.000.000,00	100,32	EUR	5.111.876,64	5,91
DEUTSCHE BANK AG 20-19.11.2025 FRN	2.200.000,00	97,29	EUR	2.143.007,92	2,48
RENAULT 1,25 % 19-24.06.2025	2.000.000,00	96,26	EUR	1.938.373,06	2,24
RENAULT 2,5 % 21-02.06.2027	1.800.000,00	96,04	EUR	1.755.226,43	2,03
SOCIETE GENERALE 22-19.01.2028 FRN	4.000.000,00	92,22	USD	3.385.359,56	3,92
VODAFONE GROUP 1,875 % 14-11.09.2025	3.419.000,00	97,35	EUR	3.348.398,21	3,87
VOLKSWAGEN INTFN 4,125 % 22-15.11.2025	1.700.000,00	101,34	EUR	1.732.134,32	2,00
Temporäre Wertpapiergeschäfte				2.861.688,98	3,31
Sonstige temporäre Wertpapiergeschäfte				2.861.688,98	3,31
Auf Garantie - BNP PARIBAS ISS 23-20.09.2028 FRN	2.879.000,00	99,40	EUR	2.861.688,98	3,31
Termin-Finanzinstrumente				1.426.481,39	1,65
Equity Swaps				-	-

GENIUS 100 CROSS ASSET

Aufstellung der Finanzinstrumente zum 29. Dezember 2023

Art und Bezeichnung der Wertpapiere	Menge	Kurs	Notierung swährung	Aktueller Wert	Gerundeter prozentualer Anteil am Nettovermögen
Performance-Swap				528.612,74	0,61
TRS3	84.945.000,00	-	EUR	528.612,74	0,61
Zinsswaps				897.868,65	1,04
IRS2	84.945.000,00	-	EUR	897.868,65	1,04
Forderungen				-	-
Verbindlichkeiten				-171.182,27	-0,20
Einlagen				-	-
Sonstige Finanzkonten				195.076,00	0,23
GESAMTNETTOVERMÖGEN			EUR	86.445.398,60	100,00