

KAPITALVERWALTUNGSGESELLSCHAFT:



Lloyd Fonds - Global Multi Asset Sustainable

JAHRESBERICHT
ZUM 31. MÄRZ 2022

VERWAHRSTELLE:



VERTRIEB:



Jahresbericht

Lloyd Fonds - Global Multi Asset Sustainable

Tätigkeitsbericht für den Berichtszeitraum vom 1. April 2021 bis 31. März 2022

Anlageziele und Anlagepolitik zur Erreichung der Anlageziele

Um dies zu erreichen, investiert der Fonds weltweit insbesondere in Aktien, Anleihen sowie Investmentfonds, wobei mindestens 51% des Wertes des Fonds in unter Nachhaltigkeitskriterien ausgewählten Vermögensgegenständen angelegt wird. Die Investitionen in Einzeltitel beziehen insbesondere Aktien und Anleihen von Unternehmen mit ein, die einen positiven Beitrag zur Erreichung von Nachhaltigkeitszielen, abgeleitet aus den im Jahr 2015 verabschiedeten 17 UN Sustainable Development Goals, leisten wollen. Im Rahmen des „MultiAsset“-Ansatzes und unter Berücksichtigung eines attraktiven Risiko-Renditeprofils können auch weitere Anlageklassen wie bspw. Wandelanleihen, Edelmetalle (bspw. Gold in Form von Aktien, Fonds und/oder Zertifikate), Infrastrukturfonds oder Immobilien (in Form von REITs und/oder Aktien von Immobilienunternehmen) berücksichtigt werden. Dieser Fonds bewirbt ökologische und/oder soziale Merkmale im Sinne des Artikel 8 der Offenlegungs-Verordnung (Verordnung (EU) 2019/2088).

Struktur des Portfolios und wesentliche Veränderungen im Berichtszeitraum

Fondsstruktur

	31.03.2022		31.03.2021	
	Kurswert	% Anteil Fondsvermögen	Kurswert	% Anteil Fondsvermögen
Renten	17.169.601,39	14,73	15.286.860,26	13,30
Aktien	87.340.350,14	74,95	80.630.677,09	70,13
Fondsanteile	0,00	0,00	6.822.085,00	5,93
Zertifikate	5.857.361,80	5,03	2.343.775,53	2,04
Optionen	-944.400,00	-0,81	-135.000,00	-0,12
Futures	-30.701,07	-0,03	-32.090,28	-0,03
Bankguthaben	6.949.959,64	5,96	13.277.976,18	11,55
Zins- und Dividendenansprüche	365.065,96	0,31	190.786,23	0,17
Sonstige Ford. /Verbindlichkeiten	-176.838,01	-0,15	-3.413.383,66	-2,97
Fondsvermögen	116.530.399,85	100,00	114.971.686,35	100,00

Jahresbericht

Lloyd Fonds - Global Multi Asset Sustainable

Im Gegensatz zum durch das Aufkommen der COVID-Pandemie geprägten Vorjahr verhielt sich die Anlagestruktur des Fotos im Berichtszeitraum wesentlich stabiler. Die Aktienquote des Fonds schwankte im Berichtszeitraum zwischen knapp 65% und 80%, während sich die Rentenquote zwischen 13% und 16% vom Fondsvolumen bewegte.

Die am stärksten gewichteten Branche bei der Aktienallokation war wie im Vorjahr der Industriesektor. Außerdem zählten der Finanzsektor und Titel der die Informationstechnologie, die im Vorjahr stark ausgebaut wurden, zu den Schwerpunktbranchen.

Die Bonität der mit einem Rating versehenen Anleihen lag im Berichtszeitraum nahezu ausschließlich im Bereich von BBB+ bis B-. Ein wesentlicher Anteil der vom Fonds gehaltenen Renten wurde allerdings jeweils als „not rated“ eingestuft.

In der regionalen Zusammensetzung war Deutschland durchweg die Region mit dem mit Abstand größten Anteil am Fondsvermögen.

Wesentliche Risiken

Allgemeine Marktpreisrisiken

Die Kurs- oder Marktwertentwicklung von Finanzprodukten hängt insbesondere von der Entwicklung der Kapitalmärkte ab, die wiederum von der allgemeinen Lage der Weltwirtschaft sowie den wirtschaftlichen und politischen Rahmenbedingungen in den jeweiligen Ländern beeinflusst wird. Auf die allgemeine Kursentwicklung, insbesondere an einer Börse, können auch irrationale Faktoren wie Stimmungen, Meinungen und Gerüchte einwirken.

Für die Kurs- oder Marktwertentwicklung stellten die Entwicklungen aufgrund von COVID 19 im abgelaufenen Geschäftsjahr einen besonderen Aspekt der Unsicherheit dar.

Die Ukraine-Krise und die dadurch ausgelösten Marktturbulenzen und Sanktionen der Industrienationen gegenüber Russland haben eine Vielzahl an unterschiedlichen Auswirkungen

auf die Finanzmärkte im Allgemeinen und auf Fonds (Sondervermögen) im Speziellen. Die Bewegungen an den Börsen werden sich entsprechend auch im Fondsvermögen (Wert des Sondervermögens) widerspiegeln.

Zusätzlich belasten Unsicherheiten über den weiteren Verlauf des Konflikts sowie die wirtschaftlichen Folgen der diversen Sanktionen die Märkte.

Zinsänderungsrisiken

Mit der Investition in festverzinsliche Wertpapiere ist die Möglichkeit verbunden, dass sich das Marktzinsniveau, das im Zeitpunkt der Begebung eines Wertpapiers besteht, ändern kann. Steigen die Marktzinsen gegenüber den Zinsen zum Zeitpunkt der Emission, so fallen in der Regel die Kurse der festverzinslichen Wertpapiere. Fällt dagegen der Marktzins, so steigt der Kurs festverzinslicher Wertpapiere. Diese Kursentwicklung führt dazu, dass die aktuelle Rendite der festverzinslichen Wertpapiere in etwa dem aktuellen Marktzins entspricht. Diese Kursentwicklungen fallen jedoch je nach Laufzeit der festverzinslichen Wertpapiere unterschiedlich aus. Festverzinsliche Wertpapiere mit kürzeren Laufzeiten haben geringere Zinsänderungs-/Kursrisiken als festverzinsliche Wertpapiere mit längeren Laufzeiten.

Jahresbericht

Lloyd Fonds - Global Multi Asset Sustainable

Adressenausfallrisiken / Emittentenrisiken

Durch den Ausfall eines Ausstellers oder Kontrahenten können Verluste für das Sondervermögen entstehen. Das Ausstellerrisiko beschreibt die Auswirkung der besonderen Entwicklungen des jeweiligen Ausstellers, die neben den allgemeinen Tendenzen der Kapitalmärkte auf den Kurs eines Wertpapiers einwirken. Auch bei sorgfältiger Auswahl der Wertpapiere kann nicht ausgeschlossen werden, dass Verluste durch Vermögensverfall von Ausstellern eintreten. Das Kontrahentenrisiko beinhaltet das Risiko der Partei eines gegenseitigen Vertrages, mit der eigenen Forderung teilweise oder vollständig auszufallen. Dies gilt für alle Verträge, die für Rechnung eines Sondervermögens geschlossen werden.

Bonitätsrisiken

Bei Anleihen kann es zu einer Ratingveränderung des Schuldners kommen. Je nachdem, ob die Bonität steigt oder fällt, kann es zu Kursveränderungen des Wertpapiers kommen.

Aktienrisiken

Mit dem Erwerb von Aktien können besondere Marktrisiken und Unternehmensrisiken verbunden sein. Der Wert von Aktien spiegelt nicht immer den tatsächlichen Wert des Unternehmens wider. Es kann daher zu großen und schnellen Schwankungen dieser Werte kommen, wenn sich Marktgegebenheiten und Einschätzungen von Marktteilnehmern hinsichtlich des Wertes dieser Anlagen ändern. Hinzu kommt, dass die Rechte aus Aktien stets nachrangig gegenüber den Ansprüchen sämtlicher Gläubiger des Emittenten befriedigt werden. Daher unterliegen Aktien im Allgemeinen größeren Wertschwankungen als z.B. festverzinsliche Wertpapiere.

Risiken im Zusammenhang mit Zielfonds

Die Risiken der Investmentanteile, die für das Sondervermögen erworben werden, stehen in engem Zusammenhang mit den Risiken der in diesen Sondervermögen enthaltenen Vermögensgegenstände. Zielfonds mit Rentenfokus weisen teilweise deutliche Zinsänderungsrisiken und Adressenausfallrisiken auf, während Zielfonds mit Aktienfokus stärkeren Marktschwankungen ausgesetzt sind. Eine breite Streuung des Sondervermögens kann jedoch zur Verringerung von Klumpenrisiken beitragen. Die laufende Überwachung der einzelnen Zielfonds hat zusätzlich zum Ziel, die genannten Einzelrisiken systematisch zu begrenzen.

Risiken im Zusammenhang mit Derivategeschäften

Die Gesellschaft darf für Rechnung des Sondervermögens sowohl zu Absicherungszwecken als auch zu Investitionszwecken Geschäfte mit Derivaten tätigen. Die Absicherungsgeschäfte dienen dazu, das Gesamtrisiko des Sondervermögens zu verringern, können jedoch ggf. auch die Renditechancen schmälern.

Kauf und Verkauf von Optionen sowie der Abschluss von Terminkontrakten oder Swaps sind mit folgenden Risiken verbunden:

- Kursänderungen des Basiswertes können den Wert eines Optionsrechts oder Terminkontraktes bis hin zur Wertlosigkeit vermindern. Durch Wertänderungen des einem Swap zugrunde liegenden Vermögenswertes kann das Sondervermögen ebenfalls Verluste erleiden.
- Der gegebenenfalls erforderliche Abschluss eines Gegengeschäfts (Glattstellung) ist mit Kosten verbunden.
- Durch die Hebelwirkung von Optionen kann der Wert des Sondervermögens stärker beeinflusst werden, als dies beim unmittelbaren Erwerb der Basiswerte der Fall ist.
- Der Kauf von Optionen birgt das Risiko, dass die Option nicht ausgeübt wird, weil sich die Preise der Basiswerte nicht wie erwartet entwickeln, so dass die vom Sondervermögen gezahlte Optionsprämie verfällt. Beim Verkauf von Optionen besteht die Gefahr, dass das Sondervermögen zur Abnahme / Lieferung von Vermögenswerten zu einem abweichenden Preis als dem aktuellen Marktpreis verpflichtet ist.
- Auch bei Terminkontrakten besteht das Risiko, dass das Sondervermögen infolge unerwarteter Entwicklungen der Marktpreise bei Fälligkeit Verluste erleidet.

Jahresbericht

Lloyd Fonds - Global Multi Asset Sustainable

Währungsrisiken

Sofern Vermögenswerte eines Sondervermögens in anderen Währungen als der jeweiligen Fondswährung angelegt sind, erhält es die Erträge, Rückzahlungen und Erlöse aus solchen Anlagen in der jeweiligen Währung. Fällt der Wert dieser Währung gegenüber der Fondswährung, so reduziert sich der Wert des Sondervermögens.

Fondsergebnis

Die wesentlichen Quellen des positiven Veräußerungsergebnisses während des Berichtszeitraums waren realisierte Gewinne aus ausländischen Aktien.

Wertentwicklung im Berichtszeitraum (1. April 2021 bis 31. März 2022)¹.

Anteilklasse R: -0,95 %

Anteilklasse I: -0,46 %

¹ Eigene Berechnung nach der BVI-Methode (ohne Berücksichtigung von Ausgabeaufschlägen). Historische Wertentwicklungen lassen keine Rückschlüsse auf eine ähnliche Entwicklung in der Zukunft zu. Diese ist nicht prognostizierbar.

Jahresbericht
Lloyd Fonds - Global Multi Asset Sustainable

Vermögensübersicht zum 31.03.2022

Anlageschwerpunkte	Tageswert in EUR	% Anteil am Fondsvermögen
I. Vermögensgegenstände	116.710.690,20	100,15
1. Aktien	87.340.350,14	74,95
Bundesrep. Deutschland	43.662.513,93	37,47
Canada	3.379.588,31	2,90
Dänemark	6.635.674,63	5,69
Finnland	3.243.622,40	2,78
Frankreich	3.987.700,00	3,42
Irland	1.050.516,85	0,90
Italien	1.213.600,00	1,04
Japan	3.805.263,20	3,27
Norwegen	5.902.717,94	5,07
Schweden	2.152.157,56	1,85
Schweiz	3.038.686,99	2,61
Südkorea	1.275.505,62	1,09
Taiwan	1.387.009,44	1,19
USA	6.605.793,27	5,67
2. Anleihen	15.864.673,96	13,61
< 1 Jahr	498.880,00	0,43
>= 1 Jahr bis < 3 Jahre	2.562.055,48	2,20
>= 3 Jahre bis < 5 Jahre	8.051.417,00	6,91
>= 5 Jahre bis < 10 Jahre	2.590.519,01	2,22
>= 10 Jahre	2.161.802,47	1,86
3. Zertifikate	5.857.361,80	5,03
EUR	3.040.200,00	2,61
USD	2.817.161,80	2,42
4. Wandelanleihen	1.304.927,43	1,12
EUR	1.304.927,43	1,12
5. Derivate	-975.101,07	-0,84

Jahresbericht
Lloyd Fonds - Global Multi Asset Sustainable

Vermögensübersicht zum 31.03.2022

Anlageschwerpunkte	Tageswert in EUR	% Anteil am Fondsvermögen
6. Bankguthaben	4.213.691,73	3,62
7. Sonstige Vermögensgegenstände	3.104.786,21	2,66
II. Verbindlichkeiten	-180.290,35	-0,15
III. Fondsvermögen	116.530.399,85	100,00

Jahresbericht

Lloyd Fonds - Global Multi Asset Sustainable

Vermögensaufstellung zum 31.03.2022

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.03.2022	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Bestandspositionen							EUR	110.367.313,33	94,71
Börsengehandelte Wertpapiere							EUR	91.688.159,74	78,68
Aktien							EUR	73.967.872,98	63,48
Canadian National Railway Co. Registered Shares o.N.	CA1363751027		STK	28.000	28.000	0 CAD	167,700	3.379.588,31	2,90
Meyer Burger Technology AG Nam.-Aktien SF -,05	CH0108503795		STK	8.000.000	3.800.000	0 CHF	0,389	3.038.686,99	2,61
Ambu A/S Navne-Aktier B DK -,50	DK0060946788		STK	50.000	131.000	131.000 DKK	100,000	672.196,60	0,58
Christian Hansen Holding AS Navne-Aktier DK 10	DK0060227585		STK	43.000	16.000	3.000 DKK	496,700	2.871.368,46	2,46
SP Group AS Navne-Aktier DK 2	DK0061027356		STK	16.659	66.000	49.341 DKK	354,000	792.827,12	0,68
Atos SE Actions au Porteur EO 1	FR0000051732		STK	60.000	80.000	20.000 EUR	24,770	1.486.200,00	1,28
Danone S.A. Actions Port. EO-,25	FR0000120644		STK	50.000	55.000	5.000 EUR	50,030	2.501.500,00	2,15
ENEL S.p.A. Azioni nom. EO 1	IT0003128367		STK	200.000	200.000	300.000 EUR	6,068	1.213.600,00	1,04
Energiekontor AG Inhaber-Aktien o.N.	DE0005313506		STK	114.480	33.387	34.907 EUR	87,300	9.994.104,00	8,58
JOST Werke AG Inhaber-Aktien o.N.	DE000JST4000		STK	76.500	12.513	28.555 EUR	36,500	2.792.250,00	2,40
KION GROUP AG Inhaber-Aktien o.N.	DE000KGX8881		STK	31.000	52.000	21.000 EUR	60,000	1.860.000,00	1,60
Koenig & Bauer AG Inhaber-Aktien o.N.	DE0007193500		STK	190.000	10.000	56.000 EUR	21,050	3.999.500,00	3,43
KONE Oyj Registered Shares Cl.B o.N.	FI0009013403		STK	35.000	35.000	0 EUR	47,590	1.665.650,00	1,43
KSB SE & Co. KGaA Inhaber-Vorzugsakt.o.St.o.N.	DE0006292030		STK	3.077	3.100	23 EUR	382,000	1.175.414,00	1,01
MLP SE Inhaber-Aktien o.N.	DE0006569908		STK	1.142.000	62.679	253.679 EUR	7,250	8.279.500,00	7,11
Multitude SE Registered Shares o.N.	FI4000106299		STK	431.140	1.116	0 EUR	3,660	1.577.972,40	1,35
Münchener Rückvers.-Ges. AG vink.Namens-Aktien o.N.	DE0008430026		STK	6.000	6.000	0 EUR	243,000	1.458.000,00	1,25
SAF-HOLLAND SE Inhaber-Aktien EO 1	DE000SAFH001		STK	145.000	145.000	0 EUR	7,625	1.105.625,00	0,95
SAP SE Inhaber-Aktien o.N.	DE0007164600		STK	12.000	12.000	0 EUR	101,120	1.213.440,00	1,04
Sixt SE Inhaber-Vorzugsakt. o.St.o.N.	DE0007231334		STK	17.000	35.614	18.614 EUR	68,000	1.156.000,00	0,99
Sto SE & Co. KGaA Inhaber-Vorzugsakt. o.St.o.N.	DE0007274136		STK	6.000	8.000	2.000 EUR	207,000	1.242.000,00	1,07
SÜSS MicroTec SE Namens-Aktien o.N.	DE000A1K0235		STK	140.000	37.383	61.800 EUR	15,960	2.234.400,00	1,92
Asahi Group Holdings Ltd. Registered Shares o.N.	JP3116000005		STK	40.000	40.000	0 JPY	4.461,000	1.321.650,51	1,13
Panasonic Holdings Corp. Registered Shares o.N.	JP3866800000		STK	140.000	140.000	0 JPY	1.188,500	1.232.399,84	1,06
Shimano Inc. Registered Shares o.N.	JP3358000002		STK	6.000	6.000	0 JPY	28.155,000	1.251.212,85	1,07
Cloudberry Clean Energy ASA Navne-Aksjer NK -,25	NO0010876642		STK	1.050.000	1.050.000	0 NOK	18,360	1.981.804,16	1,70
Bulten AB Namn-Aktier o.N.	SE0003849223		STK	180.000	180.000	0 SEK	65,100	1.130.186,53	0,97
Volvo (publ), AB Namn-Aktier B (fria) o.N.	SE0000115446		STK	60.000	60.000	0 SEK	176,600	1.021.971,03	0,88
Greif Inc. Registered Shares Class A o.N.	US3976241071		STK	30.000	0	29.000 USD	65,060	1.754.426,97	1,51
Merck & Co. Inc. Registered Shares DL-,01	US58933Y1055		STK	10.000	10.000	0 USD	82,050	737.528,09	0,63

Jahresbericht

Lloyd Fonds - Global Multi Asset Sustainable

Vermögensaufstellung zum 31.03.2022

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.03.2022	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Microsoft Corp. Registered Shares DL-,00000625	US5949181045		STK	4.500	4.500	0 USD	308,310	1.247.096,63	1,07
Pfizer Inc. Registered Shares DL -,05	US7170811035		STK	25.000	25.000	0 USD	51,770	1.163.370,79	1,00
Samsung Electronics Co. Ltd. R.Sh(sp.GDRs144A/95) 25/SW 100	US7960508882		STK	1.000	1.000	0 USD	1.419,000	1.275.505,62	1,09
Seagate Technolog.Holdings PLC Registered Shares DL -,00001	IE00BKVD2N49		STK	13.000	13.000	0 USD	89,900	1.050.516,85	0,90
Taiwan Semiconduct.Manufact.Co Reg.Shs (Spons.ADRs)/5 TA 10	US8740391003		STK	14.800	0	0 USD	104,260	1.387.009,44	1,19
Weyerhaeuser Co. Registered Shares DL 1,25	US9621661043		STK	50.000	50.000	0 USD	37,900	1.703.370,79	1,46
							EUR	11.862.924,96	10,18
Verzinsliche Wertpapiere									
3,8750 % AGEAS SA/NV EO-FLR Notes 2019(30/UND.)	BE6317598850		EUR	400	400	0 %	93,310	373.240,00	0,32
5,0000 % AT&S Austria Techn.&Systemt.AG EO-FLR Notes 2022(22/Und.)	XS2432941693		EUR	700	700	0 %	97,916	685.412,00	0,59
2,6160 % BEWi ASA EO-FLR Bonds 2021(25/26)	SE0016276398		EUR	800	800	0 %	97,749	781.992,00	0,67
4,8750 % Eurofins Scientific S.E. EO-FLR Notes 2015(23/Und.)	XS1224953882		EUR	500	500	0 %	102,566	512.830,00	0,44
8,9000 % Multitude SE EO-FLR Notes 2021(26/Und.)	NO0011037327		EUR	2.500	2.500	0 %	100,500	2.512.500,00	2,16
5,5000 % Norske Skog AS EO-FLR Notes 2021(21/26)	NO0010936065		EUR	600	600	0 %	102,600	615.600,00	0,53
3,5000 % Paprec Holding S.A. EO-Notes 2021(21/28) Reg.S	XS2349786835		EUR	800	800	0 %	95,626	765.008,00	0,66
5,3750 % Porr AG EO-Var. Schuldv. 2020(25/Und.)	XS2113662063		EUR	400	400	0 %	92,138	368.552,00	0,32
6,5000 % Stichting AK Rabobank Cert. EO-FLR Certs 2014(Und.)	XS1002121454		EUR	1.000	1.000	0 %	116,938	1.169.380,00	1,00
5,5000 % UBM Development AG EO-FLR Notes 2021(26/Und.)	XS2355161956		EUR	1.600	2.300	700 %	93,759	1.500.144,00	1,29
6,2500 % Norddeutsche Landesbank -GZ- Nachr.DL-IHS.S.1748 v.14(24)	XS1055787680		USD	1.200	1.200	0 %	100,015	1.078.813,48	0,93
5,2500 % SCOR SE DL-FLR Notes 2018(29/Und.)	FR0013322823		USD	600	600	1.000 %	94,012	507.031,01	0,44
7,0000 % Vodafone Group PLC DL-FLR Notes 2019(29/79)	US92857WBQ24		USD	1.000	1.000	0 %	110,407	992.422,47	0,85
							EUR	5.857.361,80	5,03
Zertifikate									
HANetf ETC Securities PLC OPEN END ZT 21(O.End) EUAs	XS2353177293		STK	40.000	50.000	10.000 EUR	76,005	3.040.200,00	2,61
HANetf ETC Securities PLC OPEN END ZT 20(O.End) Gold	XS2115336336		STK	162.000	0	0 USD	19,346	2.817.161,80	2,42
							EUR	17.433.913,59	14,96
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere									
							EUR	13.372.477,16	11,48
Aktien									
Digizuite A/S Navne-Aktier DK 1	DK0061535937		STK	1.376.062	1.630.000	253.938 DKK	7,300	1.350.476,94	1,16
Movinn A/S Navne-Aktier DK -,040	DK0061555539		STK	941.000	948.618	7.618 DKK	7,500	948.805,51	0,81
Deutsche Eff.-u.Wechs.-Bet. AG Inhaber-Aktien o.N.	DE0008041005		STK	1.508.000	0	14.242 EUR	1,720	2.593.760,00	2,23
HELMA Eigenheimbau AG Inhaber-Aktien o.N.	DE000A0EQ578		STK	54.873	24.673	0 EUR	57,800	3.171.659,40	2,72

Jahresbericht

Lloyd Fonds - Global Multi Asset Sustainable

Vermögensaufstellung zum 31.03.2022

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.03.2022	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
mVISE AG Inhaber-Aktien o.N.	DE0006204589		STK	880.547	0	0 EUR	1,575	1.386.861,53	1,19
Høegh Autoliners ASA Navne-Aksjer NK 21,20	NO0011082075		STK	947.944	1.000.000	52.056 NOK	30,915	3.012.663,97	2,59
Lumi Gruppen AS Navne-Aksjer NK -,01	NO0010927288		STK	285.000	25.000	40.000 NOK	31,000	908.249,81	0,78
Verzinsliche Wertpapiere							EUR	3.056.509,00	2,62
5,7500 % Lenzing AG EO-FLR Notes 2020(20/Und.)	XS2250987356		EUR	1.000	400	0 %	102,885	1.028.850,00	0,88
6,5000 % Nordex SE Senior Notes v.18(18/23)Reg.S	XS1713474168		EUR	500	500	0 %	99,776	498.880,00	0,43
5,8750 % QUATRIM S.A.S. EO-Notes 2019(19/24) Reg.S	XS2010039118		EUR	600	600	0 %	100,310	601.860,00	0,52
4,0000 % Vossloh AG Sub.-FLR-Nts.v.21(26/unb.)	DE000A3H2VA6		EUR	900	0	0 %	102,991	926.919,00	0,80
Wandelanleihen							EUR	1.004.927,43	0,86
3,0000 % GK Software SE Wandelschuld.v.17(22)	DE000A2GSM75		EUR	700	700	0 %	100,000	700.000,00	0,60
3,7500 % mVISE AG Wandelanleihe v.17(21/22)	DE000A2GSE26		EUR	300	0	0 %	101,642	304.927,43	0,26
Neuemissionen							EUR	945.240,00	0,81
Zulassung oder Einbeziehung in organisierte Märkte vorgesehen							EUR	945.240,00	0,81
Verzinsliche Wertpapiere							EUR	945.240,00	0,81
3,5000 % MBT Systems GmbH Umtausch-Anl.v.21(27) M6YA	CH1118223390		EUR	1.000	2.000	1.000 %	94,524	945.240,00	0,81
Nichtnotierte Wertpapiere							EUR	300.000,00	0,26
Wandelanleihen							EUR	300.000,00	0,26
4,0000 % mVISE AG Wandelanleihe v.17(17/22)	DE000A2E4FN2		EUR	300	0	0 %	100,000	300.000,00	0,26
Summe Wertpapiervermögen 2)							EUR	110.367.313,33	94,71

Jahresbericht

Lloyd Fonds - Global Multi Asset Sustainable

Vermögensaufstellung zum 31.03.2022

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.03.2022	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Derivate							EUR	-975.101,07	-0,84
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)									
Derivate auf einzelne Wertpapiere							EUR	-944.400,00	-0,81
Wertpapier-Optionsrechte Forderungen/Verbindlichkeiten							EUR	-944.400,00	-0,81
Optionsrechte auf Aktien							EUR	-944.400,00	-0,81
ATOS SE PUT 17.06.22 BP 56,00 EUREX			185	STK	-30.000		EUR	31,480 -944.400,00	-0,81
Aktienindex-Derivate Forderungen/Verbindlichkeiten							EUR	-103.875,00	-0,09
Aktienindex-Terminkontrakte							EUR	-103.875,00	-0,09
FUTURE DAX (PERFORMANCE-INDEX) 06.22 EUREX			185	EUR	Anzahl -30			-103.875,00	-0,09
Devisen-Derivate Forderungen/Verbindlichkeiten							EUR	73.173,93	0,06
Währungsterminkontrakte							EUR	73.173,93	0,06
FUTURE CROSS RATE EUR/CHF 06.22 CME			352	CHF	2.000.000		CHF	1,021 24.814,38	0,02
FUTURE CROSS RATE EUR/USD 06.22 CME			352	USD	2.625.000		USD	1,115 48.359,55	0,04

Jahresbericht

Lloyd Fonds - Global Multi Asset Sustainable

Vermögensaufstellung zum 31.03.2022

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.03.2022	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens	
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds							EUR	4.213.691,73	3,62	
Bankguthaben							EUR	4.213.691,73	3,62	
EUR - Guthaben bei:										
HSBC Trinkaus & Burkhardt AG Düsseldorf Depotbank			EUR	2.799.730,89			%	100,000	2.799.730,89	2,40
Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen bei:										
HSBC Trinkaus & Burkhardt AG Düsseldorf Depotbank			DKK	4.028.454,08			%	100,000	541.582,63	0,46
HSBC Trinkaus & Burkhardt AG Düsseldorf Depotbank			NOK	6.247.342,24			%	100,000	642.235,13	0,55
HSBC Trinkaus & Burkhardt AG Düsseldorf Depotbank			SEK	912.921,79			%	100,000	88.050,17	0,08
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen bei:										
HSBC Trinkaus & Burkhardt AG Düsseldorf Depotbank			CHF	102.146,28			%	100,000	99.791,21	0,09
HSBC Trinkaus & Burkhardt AG Düsseldorf Depotbank			GBP	15.337,90			%	100,000	18.155,66	0,02
HSBC Trinkaus & Burkhardt AG Düsseldorf Depotbank			USD	26.862,47			%	100,000	24.146,04	0,02
Sonstige Vermögensgegenstände							EUR	3.104.786,21	2,66	
Zinsansprüche			EUR	274.910,07				274.910,07	0,24	
Dividendenansprüche			EUR	40.372,17				40.372,17	0,03	
Quellensteueransprüche			EUR	53.236,06				53.236,06	0,05	
Einschüsse (Initial Margins)			EUR	2.736.267,91				2.736.267,91	2,35	

Jahresbericht

Lloyd Fonds - Global Multi Asset Sustainable

Vermögensaufstellung zum 31.03.2022

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.03.2022	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Sonstige Verbindlichkeiten							EUR	-180.290,35	-0,15
Zinsverbindlichkeiten			EUR	-3.452,34				-3.452,34	0,00
Verwaltungsvergütung			EUR	-150.483,63				-150.483,63	-0,13
Verwahrstellenvergütung			EUR	-13.954,38				-13.954,38	-0,01
Prüfungskosten			EUR	-12.000,00				-12.000,00	-0,01
Veröffentlichungskosten			EUR	-400,00				-400,00	0,00
Fondsvermögen							EUR	116.530.399,85	100,00 1)
Lloyd Fonds - Global Multi Asset Sustainable R									
Anteilwert			EUR					92,84	
Ausgabepreis			EUR					97,48	
Rücknahmepreis			EUR					92,84	
Anzahl Anteile			STK					1.155.286	
Lloyd Fonds - Global Multi Asset Sustainable I									
Anteilwert			EUR					1.959,87	
Ausgabepreis			EUR					1.959,87	
Rücknahmepreis			EUR					1.959,87	
Anzahl Anteile			STK					4.731	

Fußnoten:

1) Durch Rundung der Prozent-Anteile bei der Berechnung können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.

2) Die Wertpapiere und Schuldscheindarlehen des Sondervermögens sind teilweise durch Geschäfte mit Finanzinstrumenten abgesichert.

Jahresbericht

Lloyd Fonds - Global Multi Asset Sustainable

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

Die Vermögensgegenstände des Sondervermögens sind auf Grundlage der zuletzt festgestellten Kurse/Marktsätze bewertet.

Devisenkurse (in Mengennotiz)

		per 31.03.2022	
CAD	(CAD)	1,3894000	= 1 EUR (EUR)
CHF	(CHF)	1,0236000	= 1 EUR (EUR)
DKK	(DKK)	7,4383000	= 1 EUR (EUR)
GBP	(GBP)	0,8448000	= 1 EUR (EUR)
JPY	(JPY)	135,0130000	= 1 EUR (EUR)
NOK	(NOK)	9,7275000	= 1 EUR (EUR)
SEK	(SEK)	10,3682000	= 1 EUR (EUR)
USD	(USD)	1,1125000	= 1 EUR (EUR)

Marktschlüssel

b) Terminbörsen

185	Eurex Deutschland
352	Chicago - CME Globex

Jahresbericht

Lloyd Fonds - Global Multi Asset Sustainable

Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen: - Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schuldscheindarlehen (Marktzuordnung zum Berichtsstichtag):

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile Whg. in 1.000	Käufe bzw. Zugänge	Verkäufe bzw. Abgänge	Volumen in 1.000
Börsengehandelte Wertpapiere					
Aktien					
Alstom S.A. Actions Port. EO 7	FR0010220475	STK	55.000	55.000	
Anheuser-Busch InBev S.A./N.V. Actions au Port. o.N.	BE0974293251	STK	0	35.000	
Atlantica Sustainable Infr.PLC Registered Shares DL -,10	GB00BLP5YB54	STK	0	40.000	
AXA S.A. Actions Port. EO 2,29	FR0000120628	STK	0	83.000	
Cisco Systems Inc. Registered Shares DL-,001	US17275R1023	STK	15.000	112.500	
Engie S.A. Actions Port. EO 1	FR0010208488	STK	99.000	230.000	
Fabasoft AG Inhaber-Aktien o.N.	AT0000785407	STK	4.000	4.000	
Friedrich Vorwerk Group SE Inhaber-Aktien o.N.	DE000A255F11	STK	0	57.500	
Hemnet Group AB Namn-Aktier o.N.	SE0015671995	STK	10.000	10.000	
hGears AG Inhaber-Aktien o.N.	DE000A3CMGN3	STK	50.760	50.760	
LINC AB Namn-Aktier o.N.	SE0015949433	STK	104.477	104.477	
LPKF Laser & Electronics AG Inhaber-Aktien o.N.	DE0006450000	STK	14.035	96.000	
Melexis N.V. Actions au Port. o.N.	BE0165385973	STK	0	25.729	
Porsche Automobil Holding SE Inhaber-Vorzugsaktien o.St.o.N	DE000PAH0038	STK	10.000	10.000	
Profoto Holding AB Namn-Aktier	SE0015962147	STK	200.000	200.000	
Reckitt Benckiser Group Registered Shares LS -,10	GB00B24CGK77	STK	0	40.000	
RVRC Holding AB Namn-Aktier o.N.	SE0015962485	STK	75.000	75.000	
Schaeffler AG Inhaber-Vorzugsakt.o.St. o.N.	DE000SHA0159	STK	179.874	179.874	
Siemens AG Namens-Aktien o.N.	DE0007236101	STK	0	20.000	
SIG Combibloc Group AG Namens-Aktien SF-,01	CH0435377954	STK	0	60.000	
Storskogen Group AB Namn-Aktier Ser.B o.N.	SE0016797732	STK	235.000	235.000	
Svenska Cellulosa AB Namn-Aktier B (fria) SK 10	SE0000112724	STK	170.000	170.000	
TeamViewer AG Inhaber-Aktien o.N.	DE000A2YN900	STK	1.000	1.000	
Veolia Environnement S.A. Actions au Porteur EO 5	FR0000124141	STK	5.000	65.000	
Verzinsliche Wertpapiere					
4,3600 % Aker Horizons ASA NK-FLR Notes 2021(23/25)	NO0010923220	NOK	2.500	10.500	
6,9600 % AXA S.A. EO-FLR Med.-T. Nts 04(09/Und.)	XS0207825364	EUR	182	182	
5,4400 % AXA S.A. EO-FLR Med.-T. Nts 05(10/Und.)	XS0210434782	EUR	1.200	1.200	
6,8600 % Barclays Bank PLC DL-FLR Nts 2002(32/Und.) Reg.S	XS0155141830	USD	0	700	

Jahresbericht Lloyd Fonds - Global Multi Asset Sustainable

Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen: - Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schuldscheindarlehen (Marktzuordnung zum Berichtsstichtag):

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile Whg. in 1.000	Käufe bzw. Zugänge	Verkäufe bzw. Abgänge	Volumen in 1.000
4,8750 % Egger Holzwerkstoffe GmbH EO-Var. Schuldv. 2018(23/Und.)	AT0000A208R5	EUR	200	1.600	
5,0000 % Ethias Vie EO-Bonds 2015(26)	BE6279619330	EUR	0	1.200	
5,5000 % Ferratum Capital Germany GmbH FLR-Bonds v.19(22/23)	SE0012453835	EUR	159	700	
1,6000 % Mowi ASA EO-FLR Notes 2020(23/25)	NO0010874050	EUR	0	1.600	
4,2500 % Oriiflame Investment Hold. PLC EO-FLR Notes 2021(26) Reg.S	XS2337349265	EUR	600	600	
2,3900 % Salmar ASA NK-FLR Notes 2021(27)	NO0010980683	NOK	6.000	6.000	
5,5000 % UBM Development AG EO-FLR Notes 2018(23/Und.)	XS1785474294	EUR	600	600	

Sonstige Beteiligungswertpapiere

Bertelsmann SE & Co. KGaA Genussscheine 2001	DE0005229942	EUR	65	65	
--	--------------	-----	----	----	--

An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere

Aktien

APONTIS PHARMA AG Inhaber-Aktien o.N.	DE000A3CMGM5	STK	130.000	130.000	
Elopak AS Navne-Aksjer NK -69,75584	NO0011002586	STK	550.000	550.000	
Nilar International AB Namn-Aktier o.N.	SE0015950001	STK	150.000	150.000	

Verzinsliche Wertpapiere

4,0000 % Deutsche Eff.-u.Wechs.-Bet. AG Anleihe v.2018(2019/2023)	DE000A2LQL97	EUR	0	1.500	
8,1510 % Dresdner Funding Trust I DL-Cert. 99(99/31) Reg.S	XS0097772965	USD	500	1.500	
3,7500 % ELM B.V. EO-FLR M.-T. Nts 2020(25/Und.)	XS2182055009	EUR	0	1.000	
6,0000 % Goldcup 100774 AB SK-FLR Notes 2021(24/26)	SE0017085285	SEK	5.500	5.500	
4,8750 % Golden Goose S.p.A. EO-FLR Nts 2021(21/27) REGS	XS2342638033	EUR	800	800	
4,2500 % International Design Group SpA EO-FLR Notes 2021(21/26) Reg.S	XS2344474320	EUR	600	600	
2,8500 % Koninklijke FrieslandCampina EO-FLR Notes 2020(25/Und.)	XS2228900556	EUR	0	1.000	
6,1250 % Marcolin S.p.A. EO-Notes 2021(21/26) Reg.S	XS2346563500	EUR	500	500	
3,0000 % Wintershall Dea Finance 2 B.V. EO-FLR Bonds 2021(21/Und.)	XS2286041947	EUR	0	800	

Jahresbericht

Lloyd Fonds - Global Multi Asset Sustainable

Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen: - Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schuldscheindarlehen (Marktzuordnung zum Berichtsstichtag):

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile Whg. in 1.000	Käufe bzw. Zugänge	Verkäufe bzw. Abgänge	Volumen in 1.000
Nichtnotierte Wertpapiere *)					
Aktien					
Electrolux, AB Namn-Aktier B SK 5	SE0000103814	STK	70.000	70.000	
Movinn AS Navne-Aktier DK -,040	DK0061555885	STK	833.334	833.334	
Investmentanteile					
KVG - eigene Investmentanteile					
Hansen&Heinrich Universal Fds Inhaber-Anteile A	DE000A0LERW5	ANT	0	27.500	
Gruppenfremde Investmentanteile					
Bonafide Global Fish Fund Inhaber-Anteile A EUR o.N.	LI0329781608	ANT	43.000	44.000	
Bonafide Global Fish Fund Inhaber-Anteile EUR o.N.	LI0181468138	ANT	3.000	3.000	
S&H Smaller Companies EMU Inhaber-Anteile I (a)	DE000A2N65U0	ANT	0	13.300	
SQUAD Point Five Inhaber-Anteile I	DE000A2H9BF3	ANT	0	10.000	
Derivate					
(In Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe)					
Terminkontrakte					
Aktienindex-Terminkontrakte					
Verkaufte Kontrakte: (Basiswert(e): DAX PERFORMANCE-INDEX)			EUR		131.998,59

Jahresbericht
Lloyd Fonds - Global Multi Asset Sustainable

**Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen:
 - Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schuldscheindarlehen (Marktzuordnung zum Berichtsstichtag):**

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile Whg. in 1.000	Käufe bzw. Zugänge	Verkäufe bzw. Abgänge	Volumen in 1.000
---------------------	------	-------------------------------------	--------------------------	-----------------------------	---------------------

Währungsterminkontrakte

Gekaufte Kontrakte: (Basiswert(e): CROSS RATE EO/DL, CROSS RATE EO/SF)		EUR			19.675,59
---	--	-----	--	--	-----------

Optionsrechte

Wertpapier-Optionsrechte

Optionsrechte auf Aktien

Gekaufte Verkaufsoptionen (Put): (Basiswert(e): ATOS SE NOM. EO 1)		EUR			202,42
---	--	-----	--	--	--------

Verkaufte Verkaufsoptionen (Put): (Basiswert(e): VESTAS WIND SYS. DK -,20)		EUR			174,39
---	--	-----	--	--	--------

Die Gesellschaft sorgt dafür, dass eine unangemessene Beeinträchtigung von Anlegerinteressen durch Transaktionskosten vermieden wird, indem unter Berücksichtigung der Anlageziele dieses Sondervermögens ein Schwellenwert für die Transaktionskosten bezogen auf das durchschnittliche Fondsvolumen sowie für eine Portfolioumschlagsrate festgelegt wurde. Die Gesellschaft überwacht die Einhaltung der Schwellenwerte und ergreift im Falle des Überschreitens weitere Maßnahmen.

Jahresbericht

Lloyd Fonds - Global Multi Asset Sustainable R

Ertrags- und Aufwandsrechnung (inkl. Ertragsausgleich) für den Zeitraum vom 01.04.2021 bis 31.03.2022

			insgesamt	je Anteil
I. Erträge				
1. Dividenden inländischer Aussteller (vor Körperschaft-/Kapitalertragsteuer)		EUR	160.948,76	0,14
2. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer)		EUR	757.038,20	0,65
3. Zinsen aus inländischen Wertpapieren		EUR	147.536,89	0,13
4. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer)		EUR	839.936,51	0,73
5. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland		EUR	58,76	0,00
6. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Ausland (vor Quellensteuer)		EUR	0,00	0,00
7. Erträge aus Investmentanteilen		EUR	40.681,29	0,04
8. Erträge aus Wertpapier- Darlehen- und -Pensionsgeschäften		EUR	0,00	0,00
9. Abzug inländischer Körperschaft-/Kapitalertragsteuer		EUR	-29.554,59	-0,03
10. Abzug ausländischer Quellensteuer		EUR	-127.331,62	-0,11
11. Sonstige Erträge		EUR	53,03	0,00
Summe der Erträge		EUR	1.789.367,23	1,55
II. Aufwendungen				
1. Zinsen aus Kreditaufnahmen		EUR	-14.120,19	-0,01
2. Verwaltungsvergütung		EUR	-1.946.567,96	-1,69
- Verwaltungsvergütung	EUR	-1.946.567,96		
- Beratungsvergütung	EUR	0,00		
- Asset Management Gebühr	EUR	0,00		
3. Verwahrstellenvergütung		EUR	-79.060,91	-0,07
4. Prüfungs- und Veröffentlichungskosten		EUR	-10.641,78	-0,01
5. Sonstige Aufwendungen		EUR	-115.888,92	-0,10
- Depotgebühren	EUR	-17.419,26		
- Ausgleich ordentlicher Aufwand	EUR	-33.663,23		
- Sonstige Kosten	EUR	-64.806,42		
- davon Aufwendungen aus negativen Habenzinsen	EUR	-53.102,78		
Summe der Aufwendungen		EUR	-2.166.279,76	-1,88
III. Ordentliches Nettoergebnis		EUR	-376.912,53	-0,33
IV. Veräußerungsgeschäfte				
1. Realisierte Gewinne		EUR	14.868.361,10	12,87
2. Realisierte Verluste		EUR	-7.377.946,11	-6,39
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften		EUR	7.490.415,00	6,48

Jahresbericht Lloyd Fonds - Global Multi Asset Sustainable R

V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	EUR	7.113.502,46	6,15
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne	EUR	-2.332.318,00	-2,02
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste	EUR	-5.784.134,69	-5,01
VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	EUR	-8.116.452,69	-7,03
VII. Ergebnis des Geschäftsjahres	EUR	-1.002.950,23	-0,88

Entwicklung des Sondervermögens

2021/2022

I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres	EUR	107.703.638,32
1. Ausschüttung für das Vorjahr/Steuerabschlag für das Vorjahr	EUR	-2.697.057,60
2. Zwischenausschüttungen	EUR	0,00
3. Mittelzufluss/-abfluss (netto)	EUR	3.374.670,58
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	EUR	12.631.714,44
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	EUR	-9.257.043,86
4. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich	EUR	-120.059,77
5. Ergebnis des Geschäftsjahres	EUR	-1.002.950,23
davon nicht realisierte Gewinne	EUR	-2.332.318,00
davon nicht realisierte Verluste	EUR	-5.784.134,69
II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres	EUR	107.258.241,31

Verwendung der Erträge des Sondervermögens

Berechnung der Ausschüttung insgesamt und je Anteil

		insgesamt	je Anteil
I. Für die Ausschüttung verfügbar	EUR	28.740.620,89	24,86
1. Vortrag aus Vorjahr	EUR	16.658.329,73	14,41
2. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	EUR	7.113.502,46	6,15
3. Zuführung aus dem Sondervermögen *)	EUR	4.968.788,70	4,30
II. Nicht für die Ausschüttung verwendet	EUR	25.505.820,09	22,06
1. Der Wiederanlage zugeführt	EUR	9.417.083,89	8,15
2. Vortrag auf neue Rechnung	EUR	16.088.736,20	13,91
III. Gesamtausschüttung	EUR	3.234.800,80	2,80
1. Zwischenausschüttung	EUR	0,00	0,00
2. Endausschüttung	EUR	3.234.800,80	2,80

*) Die Zuführung aus dem Sondervermögen resultiert aus der Berücksichtigung von realisierten Verlusten und beruht auf der Annahme einer nach den Anlagebedingungen maximalen Ausschüttung.

Jahresbericht

Lloyd Fonds - Global Multi Asset Sustainable R

Lloyd Fonds - Global Multi Asset Sustainable R

Vergleichende Übersicht über die letzten drei Geschäftsjahre

Geschäftsjahr	Umlaufende Anteile am Ende des Geschäftsjahres		Fondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres		Anteilwert am Ende des Geschäftsjahres
30.06.2019	Stück	1.912.563	EUR	146.743.189,82	EUR 76,73
2019/2020	Stück	1.437.857	EUR	96.773.901,68	EUR 67,30
2020/2021	Stück	1.120.417	EUR	107.703.638,32	EUR 96,13
2021/2022	Stück	1.155.286	EUR	107.258.241,31	EUR 92,84

Jahresbericht

Lloyd Fonds - Global Multi Asset Sustainable I

Ertrags- und Aufwandsrechnung (inkl. Ertragsausgleich) für den Zeitraum vom 01.04.2021 bis 31.03.2022

			insgesamt	je Anteil
I. Erträge				
1. Dividenden inländischer Aussteller (vor Körperschaft-/Kapitalertragsteuer)		EUR	13.882,91	2,93
2. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer)		EUR	65.298,19	13,80
3. Zinsen aus inländischen Wertpapieren		EUR	12.724,07	2,69
4. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer)		EUR	72.437,60	15,32
5. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland		EUR	5,06	0,00
6. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Ausland (vor Quellensteuer)		EUR	0,00	0,00
7. Erträge aus Investmentanteilen		EUR	3.509,61	0,74
8. Erträge aus Wertpapier- Darlehen- und -Pensionsgeschäften		EUR	0,00	0,00
9. Abzug inländischer Körperschaft-/Kapitalertragsteuer		EUR	-2.549,22	-0,54
10. Abzug ausländischer Quellensteuer		EUR	-10.987,38	-2,32
11. Sonstige Erträge		EUR	4,57	0,00
Summe der Erträge		EUR	154.325,39	32,62
II. Aufwendungen				
1. Zinsen aus Kreditaufnahmen		EUR	-1.080,47	-0,23
2. Verwaltungsvergütung		EUR	-99.393,04	-21,02
- Verwaltungsvergütung	EUR	-99.393,04		
- Beratungsvergütung	EUR	0,00		
- Asset Management Gebühr	EUR	0,00		
3. Verwahrstellenvergütung		EUR	-6.220,85	-1,31
4. Prüfungs- und Veröffentlichungskosten		EUR	-2.053,04	-0,43
5. Sonstige Aufwendungen		EUR	-31.556,94	-6,67
- Depotgebühren	EUR	-1.379,20		
- Ausgleich ordentlicher Aufwand	EUR	-25.131,04		
- Sonstige Kosten	EUR	-5.046,69		
Summe der Aufwendungen		EUR	-140.304,33	-29,66
III. Ordentlicher Nettoertrag		EUR	14.021,06	2,96
IV. Veräußerungsgeschäfte				
1. Realisierte Gewinne		EUR	1.283.083,02	271,21
2. Realisierte Verluste		EUR	-637.255,78	-134,70
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften		EUR	645.827,24	136,51

Jahresbericht Lloyd Fonds - Global Multi Asset Sustainable I

V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	EUR	659.848,30	139,47
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne	EUR	-154.348,31	-32,62
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste	EUR	-533.215,42	-112,71
VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	EUR	-687.563,73	-145,33
VII. Ergebnis des Geschäftsjahres	EUR	-27.715,43	-5,86

Entwicklung des Sondervermögens

2021/2022

I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres	EUR	7.268.048,03
1. Ausschüttung für das Vorjahr/Steuerabschlag für das Vorjahr	EUR	-176.550,00
2. Zwischenausschüttungen	EUR	0,00
3. Mittelzufluss/-abfluss (netto)	EUR	2.311.309,08
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	EUR	3.097.665,64
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	EUR	-786.356,56
4. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich	EUR	-102.933,13
5. Ergebnis des Geschäftsjahres	EUR	-27.715,43
davon nicht realisierte Gewinne	EUR	-154.348,31
davon nicht realisierte Verluste	EUR	-533.215,42
II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres	EUR	9.272.158,54

Verwendung der Erträge des Sondervermögens

Berechnung der Ausschüttung insgesamt und je Anteil

		insgesamt	je Anteil
I. Für die Ausschüttung verfügbar	EUR	2.521.803,29	533,03
1. Vortrag aus Vorjahr	EUR	1.432.713,96	302,83
2. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	EUR	659.848,30	139,47
3. Zuführung aus dem Sondervermögen *)	EUR	429.241,03	90,73
II. Nicht für die Ausschüttung verwendet	EUR	2.242.674,29	474,03
1. Der Wiederanlage zugeführt	EUR	851.850,51	180,06
2. Vortrag auf neue Rechnung	EUR	1.390.823,78	293,97
III. Gesamtausschüttung	EUR	279.129,00	59,00
1. Zwischenausschüttung	EUR	0,00	0,00
2. Endausschüttung	EUR	279.129,00	59,00

*) Die Zuführung aus dem Sondervermögen resultiert aus der Berücksichtigung von realisierten Verlusten und beruht auf der Annahme einer nach den Anlagebedingungen maximalen Ausschüttung.

Jahresbericht

Lloyd Fonds - Global Multi Asset Sustainable I

Lloyd Fonds - Global Multi Asset Sustainable I

Vergleichende Übersicht über die letzten drei Geschäftsjahre

Geschäftsjahr	Umlaufende Anteile am Ende des Geschäftsjahres		Fondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres		Anteilwert am Ende des Geschäftsjahres
30.06.2019	Stück	8.373	EUR	13.381.540,47	EUR 1.598,32
2019/2020	Stück	4.559	EUR	6.418.818,16	EUR 1.407,94
2020/2021	Stück	3.600	EUR	7.268.048,03	EUR 2.018,90
2021/2022	Stück	4.731	EUR	9.272.158,54	EUR 1.959,87

Jahresbericht

Lloyd Fonds - Global Multi Asset Sustainable

Ertrags- und Aufwandsrechnung (inkl. Ertragsausgleich) für den Zeitraum vom 01.04.2021 bis 31.03.2022

			insgesamt
I. Erträge			
1. Dividenden inländischer Aussteller (vor Körperschaft-/Kapitalertragsteuer)		EUR	174.831,67
2. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer)		EUR	822.336,39
3. Zinsen aus inländischen Wertpapieren		EUR	160.260,96
4. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer)		EUR	912.374,10
5. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland		EUR	63,82
6. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Ausland (vor Quellensteuer)		EUR	0,00
7. Erträge aus Investmentanteilen		EUR	44.190,90
8. Erträge aus Wertpapier- Darlehen- und -Pensionsgeschäften		EUR	0,00
9. Abzug inländischer Körperschaft-/Kapitalertragsteuer		EUR	-32.103,82
10. Abzug ausländischer Quellensteuer		EUR	-138.318,99
11. Sonstige Erträge		EUR	57,59
Summe der Erträge		EUR	1.943.692,63
II. Aufwendungen			
1. Zinsen aus Kreditaufnahmen		EUR	-15.200,66
2. Verwaltungsvergütung		EUR	-2.045.961,00
- Verwaltungsvergütung	EUR	-2.045.961,00	
- Beratungsvergütung	EUR	0,00	
- Asset Management Gebühr	EUR	0,00	
3. Verwahrstellenvergütung		EUR	-85.281,76
4. Prüfungs- und Veröffentlichungskosten		EUR	-12.694,82
5. Sonstige Aufwendungen		EUR	-147.445,86
- Depotgebühren	EUR	-18.798,46	
- Ausgleich ordentlicher Aufwand	EUR	-58.794,28	
- Sonstige Kosten	EUR	-69.853,12	
Summe der Aufwendungen		EUR	-2.306.584,10
III. Ordentlicher Nettoertrag		EUR	-362.891,47
IV. Veräußerungsgeschäfte			
1. Realisierte Gewinne		EUR	16.151.444,12
2. Realisierte Verluste		EUR	-8.015.201,89
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften		EUR	8.136.242,23

Jahresbericht

Lloyd Fonds - Global Multi Asset Sustainable

V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	EUR	7.773.350,76
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne	EUR	-2.486.666,31
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste	EUR	-6.317.350,11
VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	EUR	-8.804.016,42
VII. Ergebnis des Geschäftsjahres	EUR	-1.030.665,66

Entwicklung des Sondervermögens

2021/2022

I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres	EUR	114.971.686,35
1. Ausschüttung für das Vorjahr/Steuerabschlag für das Vorjahr	EUR	-2.873.607,60
2. Zwischenausschüttungen	EUR	0,00
3. Mittelzufluss/-abfluss (netto)	EUR	5.685.979,66
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	EUR	15.729.380,08
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	EUR	-10.043.400,42
4. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich	EUR	-222.992,90
5. Ergebnis des Geschäftsjahres	EUR	-1.030.665,66
davon nicht realisierte Gewinne	EUR	-2.486.666,31
davon nicht realisierte Verluste	EUR	-6.317.350,11
II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres	EUR	116.530.399,85

Jahresbericht
Lloyd Fonds - Global Multi Asset Sustainable

Anteilklassenmerkmale im Überblick

Anteilklasse	Mindestanlagesumme in Währung	Ausgabeaufschlag bis zu 5,00%, derzeit (Angabe in %)	Verwaltungsvergütung bis zu 1,600% p.a., derzeit (Angabe in % p.a.)	Ertragsverwendung	Währung
Lloyd Fonds - Global Multi Asset Sustainable R	keine	5,00	1,600	Ausschüttung ohne Zwischenausschüttung	EUR
Lloyd Fonds - Global Multi Asset Sustainable I	keine	0,00	1,000	Ausschüttung ohne Zwischenausschüttung	EUR

Jahresbericht

Lloyd Fonds - Global Multi Asset Sustainable

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben nach der Derivateverordnung

das durch Derivate erzielte zugrundeliegende Exposure

EUR

16.113.803,13

die Vertragspartner der Derivate-Geschäfte

Baader Bank AG (Broker) DE

Newedge Group (Broker) GB

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)

94,71

Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)

-0,84

Bei der Ermittlung der Auslastung der Marktrisikoobergrenze für diesen Fonds wendet die Gesellschaft seit 01.07.2019 den qualifizierten Ansatz im Sinne der Derivate-Verordnung anhand eines Vergleichsvermögens an. Die Value-at-Risk-Kennzahlen wurden auf Basis der Methode der historischen Simulation mit den Parametern 99 % Konfidenzniveau und 1 Tag Haltedauer unter Verwendung eines effektiven, historischen Beobachtungszeitraums von einem Jahr berechnet.

Unter dem Marktrisiko versteht man das Risiko, das sich aus der ungünstigen Entwicklung von Marktpreisen für das Sondervermögen ergibt.

Potenzieller Risikobetrag für das Marktrisiko gem. § 37 Abs. 4 DerivateV

kleinster potenzieller Risikobetrag

1,40 %

größter potenzieller Risikobetrag

2,65 %

durchschnittlicher potenzieller Risikobetrag

1,77 %

Im Geschäftsjahr erreichte durchschnittliche Hebelwirkung durch Derivategeschäfte:

1,05

Zusammensetzung des Vergleichsvermögens zum Berichtsstichtag

JPM Global Aggregate Bond Index Total Return (USD) (Bloomberg: JGAGGUSD INDEX) in EUR

10,00 %

MSCI Europe Net Return (EUR) (Bloomberg: MSDEE15N INDEX)

80,00 %

MSCI North America Net Return (EUR) (Bloomberg: MSDENAN INDEX)

10,00 %

Jahresbericht

Lloyd Fonds - Global Multi Asset Sustainable

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Sonstige Angaben

Lloyd Fonds - Global Multi Asset Sustainable R

Anteilwert	EUR	92,84
Ausgabepreis	EUR	97,48
Rücknahmepreis	EUR	92,84
Anzahl Anteile	STK	1.155.286

Lloyd Fonds - Global Multi Asset Sustainable I

Anteilwert	EUR	1.959,87
Ausgabepreis	EUR	1.959,87
Rücknahmepreis	EUR	1.959,87
Anzahl Anteile	STK	4.731

Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände

Bewertung

Die nachfolgend dargestellten Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände decken eventuelle aus der Covid-19 Pandemie resultierenden Marktauswirkungen ab. Darüber hinausgehende Bewertungsanpassungen waren nicht erforderlich.

Für Devisen, Aktien, Anleihen und Derivate, die zum Handel an einer Börse oder an einem anderen organisierten Markt zugelassen oder in diesen einbezogen sind, wird der letzte verfügbare handelbare Kurs gemäß § 27 KARBV zugrunde gelegt.

Für Investmentanteile werden die aktuellen Werte, für Bankguthaben und Verbindlichkeiten der Nennwert bzw. Rückzahlungsbetrag gemäß § 29 KARBV zugrunde gelegt.

Für Vermögensgegenstände, die weder zum Handel an einer Börse noch an einem anderen organisierten Markt zugelassen oder in den regulierten Markt oder Freiverkehr einer Börse einbezogen sind oder für die kein handelbarer Kurs verfügbar ist, werden gemäß § 28 KARBV i.V.m. § 168 Absatz 3 KAGB die Verkehrswerte zugrunde gelegt, die sich bei sorgfältiger Einschätzung nach geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten ergeben.

Unter dem Verkehrswert ist der Betrag zu verstehen, zu dem der jeweilige Vermögensgegenstand in einem Geschäft zwischen sachverständigen, vertragswilligen und unabhängigen Geschäftspartnern ausgetauscht werden könnte.

Jahresbericht

Lloyd Fonds - Global Multi Asset Sustainable

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben zur Transparenz sowie zur Gesamtkostenquote

Gesamtkostenquote

Lloyd Fonds - Global Multi Asset Sustainable R

Die Gesamtkostenquote (ohne Transaktionskosten) für das abgelaufene Geschäftsjahr beträgt 1,71 %

Die Gesamtkostenquote drückt sämtliche vom Sondervermögen im Jahresverlauf getragenen Kosten und Zahlungen (ohne Transaktionskosten) im Verhältnis zum durchschnittlichen Nettoinventarwert des Sondervermögens aus.

Erfolgsabhängige Vergütung in % des durchschnittlichen Nettoinventarwertes 0,17 %

Lloyd Fonds - Global Multi Asset Sustainable I

Die Gesamtkostenquote (ohne Transaktionskosten) für das abgelaufene Geschäftsjahr beträgt 1,12 %

Die Gesamtkostenquote drückt sämtliche vom Sondervermögen im Jahresverlauf getragenen Kosten und Zahlungen (ohne Transaktionskosten) im Verhältnis zum durchschnittlichen Nettoinventarwert des Sondervermögens aus.

Erfolgsabhängige Vergütung in % des durchschnittlichen Nettoinventarwertes 0,15 %

An die Verwaltungsgesellschaft oder Dritte gezahlte Pauschalvergütungen EUR 0,00

Hinweis gem. § 101 Abs. 2 Nr. 3 KAGB (Kostentransparenz)

Die Gesellschaft erhält aus dem Sondervermögen die ihr zustehende Verwaltungsvergütung. Ein wesentlicher Teil der Verwaltungsvergütung wird für Vergütungen an Vermittler von Anteilen des Sondervermögens verwendet. Der Gesellschaft fließen keine Rückvergütungen von den an die Verwahrstelle und an Dritte aus dem Sondervermögen geleisteten Vergütungen und Aufwendererstattungen zu. Sie hat im Zusammenhang mit Handelsgeschäften für das Sondervermögen keine geldwerten Vorteile von Handelspartnern erhalten.

Ausgabeauf- und Rücknahmeabschläge, die dem Sondervermögen für den Erwerb und die Rücknahme von Investmentanteilen berechnet wurden EUR 0,00

Jahresbericht
Lloyd Fonds - Global Multi Asset Sustainable

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Verwaltungsvergütungssätze für im Sondervermögen gehaltene Investmentanteile

Investmentanteile	Identifikation	Verwaltungsvergütungssatz p.a. in %
-------------------	----------------	--

Während des Berichtszeitraumes gehaltene Bestände in Investmentanteilen, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen:

KVG - eigene Investmentanteile

Hansen&Heinrich Universal Fds Inhaber-Anteile A	DE000A0LERW5	0,250
---	--------------	-------

Gruppenfremde Investmentanteile

Bonafide Global Fish Fund Inhaber-Anteile A EUR o.N.	LI0329781608	1,500
Bonafide Global Fish Fund Inhaber-Anteile EUR o.N.	LI0181468138	1,500
S&H Smaller Companies EMU Inhaber-Anteile I (a)	DE000A2N65U0	0,900
SQUAD Point Five Inhaber-Anteile I	DE000A2H9BF3	1,280

Wesentliche sonstige Erträge und sonstige Aufwendungen

Lloyd Fonds - Global Multi Asset Sustainable R

Wesentliche sonstige Erträge:	EUR	0,00
--------------------------------------	------------	-------------

Wesentliche sonstige Aufwendungen:	EUR	64.806,42
- davon Aufwendungen aus negativen Habenzinsen	EUR	53.102,78

Lloyd Fonds - Global Multi Asset Sustainable I

Wesentliche sonstige Erträge:	EUR	0,00
--------------------------------------	------------	-------------

Wesentliche sonstige Aufwendungen:	EUR	0,00
---	------------	-------------

Jahresbericht

Lloyd Fonds - Global Multi Asset Sustainable

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Transaktionskosten (Summe der Nebenkosten des Erwerbs (Anschaffungsnebenkosten) und der Kosten der Veräußerung der Vermögensgegenstände)

Transaktionskosten	EUR	178.140,06
--------------------	-----	------------

Die Transaktionskosten berücksichtigen sämtliche Kosten, die im Geschäftsjahr für Rechnung des Fonds separat ausgewiesen bzw. abgerechnet wurden und in direktem Zusammenhang mit einem Kauf oder Verkauf von Vermögensgegenständen stehen.

Angaben zur Mitarbeitervergütung

Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr der KVG gezahlten Mitarbeitervergütung	in Mio. EUR	67,4
davon feste Vergütung	in Mio. EUR	59,3
davon variable Vergütung	in Mio. EUR	8,1
Zahl der Mitarbeiter der KVG		737
Höhe des gezahlten Carried Interest	in EUR	0
Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr der KVG gezahlten Vergütung an Risktaker	in Mio. EUR	7,8
davon Geschäftsleiter	in Mio. EUR	6,6
davon andere Risktaker	in Mio. EUR	1,2

Vergütungssystem der Kapitalverwaltungsgesellschaft

Die Universal-Investment-Gesellschaft mbH unterliegt den für Kapitalverwaltungsgesellschaften geltenden aufsichtsrechtlichen Vorgaben im Hinblick auf die Gestaltung ihres Vergütungssystems. Die detaillierte Ausgestaltung hat die Gesellschaft in einer Vergütungsrichtlinie geregelt, deren Ziel es ist, eine nachhaltige Vergütungssystematik unter Berücksichtigung von Sustainable Corporate Governance und unter Vermeidung von Fehlanreizen zur Eingehung übermäßiger Risiken (einschließlich einschlägiger Nachhaltigkeitsrisiken) sicherzustellen.

Das Vergütungssystem der Kapitalverwaltungsgesellschaft wird mindestens einmal jährlich durch den Vergütungsausschuss der Universal-Investment auf seine Angemessenheit und die Einhaltung aller rechtlichen sowie interner und externer regulatorischer Vorgaben überprüft. Es umfasst fixe und variable Vergütungselemente. Durch die Festlegung von Bandbreiten für die Gesamtzielvergütung ist gewährleistet, dass keine signifikante Abhängigkeit von der variablen Vergütung sowie ein angemessenes Verhältnis von variabler zu fixer Vergütung besteht. Für die Geschäftsführung der Kapitalverwaltungsgesellschaft und Mitarbeiter, deren Tätigkeiten einen wesentlichen Einfluss auf das Gesamtrisikoprofil der Kapitalverwaltungsgesellschaft und der von ihr verwalteten Investmentvermögen haben (Risk Taker) gelten besondere Regelungen. Risikorelevante Mitarbeiter, deren variable Vergütung für das jeweilige Geschäftsjahr einen Schwellenwert von 50 TEUR nicht überschreitet, erhalten die variable Vergütung vollständig in Form einer Barleistung ausgezahlt. Wird für risikorelevante Mitarbeiter dieser Schwellenwert überschritten, wird zwingend ein Anteil von 40 % der variablen Vergütung über einen Zeitraum von drei Jahren aufgeschoben. Der aufgeschobene Anteil der Vergütung ist während dieses Zeitraums risikoabhängig, d.h. er kann im Fall von negativen Erfolgsbeiträgen des Mitarbeiters oder der Kapitalverwaltungsgesellschaft insgesamt gekürzt werden. Jeweils am Ende jedes Jahres der Wartezeit wird der aufgeschobene Vergütungsanteil anteilig unverfallbar und zum jeweiligen Zahlungstermin ausgezahlt.

Soweit das Portfolio-Management ausgelagert ist, werden keine Mitarbeitervergütungen direkt aus dem Fonds gezahlt.

Jahresbericht

Lloyd Fonds - Global Multi Asset Sustainable

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben gemäß § 101 Abs. 2 Nr. 5 KAGB

Wesentliche mittel- bis langfristigen Risiken

Die Angaben der wesentlichen mittel- bis langfristigen Risiken erfolgt innerhalb des Tätigkeitsberichts.

Zusammensetzung des Portfolios, die Portfolioumsätze und die Portfolioumsatzkosten

Die Angaben zu der Zusammensetzung des Portfolios erfolgen innerhalb der Vermögensaufstellung.

Die Angaben zu den Portfolioumsätzen erfolgen innerhalb der Vermögensaufstellung und innerhalb der Aufstellung der während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte.

Die Angabe zu den Transaktionskosten erfolgt im Anhang.

Berücksichtigung der mittel- bis langfristigen Entwicklung der Gesellschaft bei der Anlageentscheidung

Die Auswahl von Einzeltiteln richtet sich nach der Anlagestrategie. Die vertraglichen Grundlagen für die Anlageentscheidung finden sich in den vereinbarten Anlagebedingungen und ggf. Anlagerichtlinien.

Eine Berücksichtigung der mittel- bis langfristigen Entwicklung der Portfoliogesellschaften erfolgt, wenn diese in den Vertragsbedingungen vorgeschrieben ist.

Einsatz von Stimmrechtsberatern

Zum Einsatz von Stimmrechtsberatern verweisen wir auf den neuen Mitwirkungsbericht auf der Homepage <https://www.universal-investment.com/de/permanent-seiten/compliance/mitwirkungspolitik>.

Handhabung der Wertpapierleihe und zum Umgang mit Interessenkonflikten im Rahmen der Mitwirkung in den Gesellschaften, insbesondere durch Ausübung von Aktionärsrechten

Zur grundsätzlichen Handhabung der Wertpapierleihe und zum Umgang mit Interessenkonflikten im Rahmen der Mitwirkung der Gesellschaft, insbesondere durch die Ausübung von Aktionärsrechten, verweisen wir auf unsere aktuelle Mitwirkungspolitik auf der Homepage <https://www.universal-investment.com/de/permanent-seiten/compliance/mitwirkungspolitik>.

Anhang Angaben zu nichtfinanziellen Leistungsindikatoren

Artikel 8 Offenlegungs-Verordnung (Finanzprodukte, die ökologische und/oder soziale Merkmale bewerben)

Neben der Berücksichtigung von relevanten Nachhaltigkeitsrisiken im Sinne der Verordnung (EU) 2019/2088 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 27. November 2019 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (nachfolgend Offenlegungs-Verordnung) in den Investitionsentscheidungsprozessen, bewirbt dieses Sondervermögen ökologische und/oder soziale Merkmale (nachhaltigkeitsbezogene Kriterien) gemäß Artikel 8 der Offenlegungs-Verordnung.

Angaben zur Erfüllung dieser Merkmale, sowie gegebenenfalls zur Vereinbarung dieser Merkmale mit einem Index, der als Referenzwert dient, sowie der Methodik zur Bewertung, Messung und Überwachung der zugrunde liegenden Vermögenswerte, wurden zum Stichtag 10. März 2021 in den vorvertraglichen Informationen sowie auf der relevanten Internetseite der Universal-Investment (Fondssektor) veröffentlicht.

Grundsätzlich legen Jahresberichte die Geschäftsergebnisse für vollständige Geschäftsjahre vor. Da die Transparenzanforderungen der Offenlegungs-Verordnung gemäß vorigem Absatz zum 10. März 2021 umgesetzt wurden, beziehen sich die Angaben im Jahresbericht jedoch nur auf den Zeitraum ab dem Stichtag.

Die ökologischen und/oder sozialen Merkmale wurden im Einklang mit den Vorgaben in den vorvertraglichen Informationen/ auf der relevanten Internetseite der Universal-Investment (Fondssektor) erfüllt. Die nachhaltigkeitsbezogenen Kriterien wurden im Rahmen der Investitionsentscheidung zugrunde gelegt und das Portfoliomanagement entsprechend ausgerichtet. Anlagestandards nach ökologischen und/oder sozialen Kriterien sind gemäß den Anlagerichtlinien in den Administrationssystemen der Universal-Investment hinterlegt und werden auf deren Einhaltung ex-ante und ex-post kontrolliert. Die individuellen nachhaltigkeitsbezogenen Kriterien des Sondervermögens werden standardmäßig über Positiv- oder Negativlisten abgebildet und geprüft. Soweit vertraglich fixiert werden Datenpunkte von MSCI zur Prüfung herangezogen.

Die Auswahl der Vermögensgegenstände erfolgt überwiegend im Einklang mit den beworbenen ökologischen und/oder sozialen Kriterien. Die diesem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen jedoch nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten im Sinne der Taxonomie-Verordnung.

Die entsprechenden Ausweise, wie diese nachhaltigkeitsbezogenen Kriterien erfüllt werden, unterliegen gemäß Artikel 11 Absatz 4 der Offenlegungs-Verordnung der Ausarbeitung und Umsetzung entsprechender technischer Regulierungsstandards, in denen die Einzelheiten zu Inhalt und Darstellung festgelegt werden. Diese technischen Regulierungsstandards kommen entsprechend ab dem Anwendungszeitpunkt zum Einsatz. Derzeit können die vom Sondervermögen beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale den vorvertraglichen Informationen sowie der relevanten Internetseite der Universal-Investment (Fondssektor) entnommen werden.

Frankfurt am Main, den 1. April 2022

Universal-Investment-Gesellschaft mbH
Die Geschäftsführung

Jahresbericht

Lloyd Fonds - Global Multi Asset Sustainable

VERMERK DES UNABHÄNGIGEN ABSCHLUSSPRÜFERS

An die Universal-Investment-Gesellschaft mbH, Frankfurt am Main

Prüfungsurteil

Wir haben den Jahresbericht des Sondervermögens Lloyd Fonds - Global Multi Asset Sustainable - bestehend aus dem Tätigkeitsbericht für das Geschäftsjahr vom 1. April 2021 bis zum 31. März 2022, der Vermögensübersicht und der Vermögensaufstellung zum 31. März 2022, der Ertrags- und Aufwandsrechnung, der Verwendungsrechnung, der Entwicklungsrechnung für das Geschäftsjahr vom 1. April 2021 bis zum 31. März 2022 sowie der vergleichenden Übersicht über die letzten drei Geschäftsjahre, der Aufstellung der während des Berichtszeitraumes abgeschlossenen Geschäfte, soweit diese nicht mehr Gegenstand der Vermögensaufstellung sind, und dem Anhang - geprüft.

Nach unserer Beurteilung aufgrund der bei der Prüfung gewonnenen Erkenntnisse entspricht der beigefügte Jahresbericht in allen wesentlichen Belangen den Vorschriften des deutschen Kapitalanlagegesetzbuchs (KAGB) und den einschlägigen europäischen Verordnungen und ermöglicht es unter Beachtung dieser Vorschriften, sich ein umfassendes Bild der tatsächlichen Verhältnisse und Entwicklungen des Sondervermögens zu verschaffen.

Grundlage für das Prüfungsurteil

Wir haben unsere Prüfung des Jahresberichts in Übereinstimmung mit § 102 KAGB unter Beachtung der vom Institut der Wirtschaftsprüfer (IDW) festgestellten deutschen Grundsätze ordnungsmäßiger Abschlussprüfung durchgeführt. Unsere Verantwortung nach diesen Vorschriften und Grundsätzen ist im Abschnitt "Verantwortung des Abschlussprüfers für die Prüfung des Jahresberichts" unseres Vermerks weitergehend beschrieben. Wir sind von der Universal-Investment-Gesellschaft mbH unabhängig in Übereinstimmung mit den deutschen handelsrechtlichen und berufsrechtlichen Vorschriften und haben unsere sonstigen deutschen Berufspflichten in Übereinstimmung mit diesen Anforderungen erfüllt. Wir sind der Auffassung, dass die von uns erlangten Prüfungsnachweise ausreichend und geeignet sind, um als Grundlage für unser Prüfungsurteil zum Jahresbericht zu dienen.

Verantwortung der gesetzlichen Vertreter für den Jahresbericht

Die gesetzlichen Vertreter der Universal-Investment-Gesellschaft mbH sind verantwortlich für die Aufstellung des Jahresberichts, der den Vorschriften des deutschen KAGB und den einschlägigen europäischen Verordnungen in allen wesentlichen Belangen entspricht und dafür, dass der Jahresbericht es unter Beachtung dieser Vorschriften ermöglicht, sich ein umfassendes Bild der tatsächlichen Verhältnisse und Entwicklungen des Sondervermögens zu verschaffen. Ferner sind die gesetzlichen Vertreter verantwortlich für die internen Kontrollen, die sie in Übereinstimmung mit diesen Vorschriften als notwendig bestimmt haben, um die Aufstellung des Jahresberichts zu ermöglichen, der frei von wesentlichen - beabsichtigten oder unbeabsichtigten - falschen Darstellungen ist. Bei der Aufstellung des Jahresberichts sind die gesetzlichen Vertreter dafür verantwortlich, Ereignisse, Entscheidungen und Faktoren, welche die weitere Entwicklung des Investmentvermögens wesentlich beeinflussen können, in die Berichterstattung einzubeziehen. Das bedeutet u.a., dass die gesetzlichen Vertreter bei der Aufstellung des Jahresberichts die Fortführung des Sondervermögens durch die Universal-Investment-Gesellschaft mbH zu beurteilen haben und die Verantwortung haben, Sachverhalte im Zusammenhang mit der Fortführung des Sondervermögens, sofern einschlägig, anzugeben.

Verantwortung des Abschlussprüfers für die Prüfung des Jahresberichts

Unsere Zielsetzung ist, hinreichende Sicherheit darüber zu erlangen, ob der Jahresbericht als Ganzes frei von wesentlichen - beabsichtigten oder unbeabsichtigten - falschen Darstellungen ist, sowie einen Vermerk zu erteilen, der unser Prüfungsurteil zum Jahresbericht beinhaltet.

Hinreichende Sicherheit ist ein hohes Maß an Sicherheit, aber keine Garantie dafür, dass eine in Übereinstimmung mit § 102 KAGB unter Beachtung der vom Institut der Wirtschaftsprüfer (IDW) festgestellten deutschen Grundsätze ordnungsmäßiger Abschlussprüfung durchgeführte Prüfung eine wesentliche falsche Darstellung stets aufdeckt. Falsche Darstellungen können aus Verstößen oder Unrichtigkeiten resultieren und werden als wesentlich angesehen, wenn vernünftigerweise erwartet werden könnte, dass sie einzeln oder insgesamt die auf der Grundlage dieses Jahresberichts getroffenen wirtschaftlichen Entscheidungen von Adressaten beeinflussen.

Jahresbericht Lloyd Fonds - Global Multi Asset Sustainable

Während der Prüfung üben wir pflichtgemäßes Ermessen aus und bewahren eine kritische Grundhaltung. Darüber hinaus

- identifizieren und beurteilen wir die Risiken wesentlicher - beabsichtigter oder unbeabsichtigter - falscher Darstellungen im Jahresbericht, planen und führen Prüfungshandlungen als Reaktion auf diese Risiken durch sowie erlangen Prüfungsnachweise, die ausreichend und geeignet sind, um als Grundlage für unser Prüfungsurteil zu dienen. Das Risiko, dass wesentliche falsche Darstellungen nicht aufgedeckt werden, ist bei Verstößen höher als bei Unrichtigkeiten, da Verstöße betrügerisches Zusammenwirken, Fälschungen, beabsichtigte Unvollständigkeiten, irreführende Darstellungen bzw. das Außerkraft setzen interner Kontrollen beinhalten können.
- gewinnen wir ein Verständnis von dem für die Prüfung des Jahresberichts relevanten internen Kontrollsystem, um Prüfungshandlungen zu planen, die unter den gegebenen Umständen angemessen sind, jedoch nicht mit dem Ziel, ein Prüfungsurteil zur Wirksamkeit dieses Systems der Universal-Investment-Gesellschaft mbH abzugeben.
- beurteilen wir die Angemessenheit der von den gesetzlichen Vertretern der Universal-Investment-Gesellschaft mbH bei der Aufstellung des Jahresberichts angewandten Rechnungslegungsmethoden sowie die Vertretbarkeit der von den gesetzlichen Vertretern dargestellten geschätzten Werte und damit zusammenhängenden Angaben.
- ziehen wir Schlussfolgerungen auf der Grundlage erlangter Prüfungsnachweise, ob eine wesentliche Unsicherheit im Zusammenhang mit Ereignissen oder Gegebenheiten besteht, die bedeutsame Zweifel an der Fortführung des Sondervermögens durch die Universal-Investment-Gesellschaft mbH aufwerfen können. Falls wir zu dem Schluss kommen, dass eine wesentliche Unsicherheit besteht, sind wir verpflichtet, im Vermerk auf die dazugehörigen Angaben im Jahresbericht aufmerksam zu machen oder, falls diese Angaben unangemessen sind, unser Prüfungsurteil zu modifizieren. Wir ziehen unsere Schlussfolgerungen auf der Grundlage der bis zum Datum unseres Vermerks erlangten Prüfungsnachweise. Zukünftige Ereignisse oder Gegebenheiten können jedoch dazu führen, dass das Sondervermögen durch die Universal-Investment-Gesellschaft mbH nicht fortgeführt wird.
- beurteilen wir die Gesamtdarstellung, den Aufbau und den Inhalt des Jahresberichts, einschließlich der Angaben sowie ob der Jahresbericht die zugrunde liegenden Geschäftsvorfälle und Ereignisse so darstellt, dass der Jahresbericht es unter Beachtung der Vorschriften des deutschen KAGB und der einschlägigen europäischen Verordnungen ermöglicht, sich ein umfassendes Bild der tatsächlichen Verhältnisse und Entwicklungen des Sondervermögens zu verschaffen.

Wir erörtern mit den für die Überwachung Verantwortlichen u.a. den geplanten Umfang und die Zeitplanung der Prüfung sowie bedeutsame Prüfungsfeststellungen, einschließlich etwaiger Mängel im internen Kontrollsystem, die wir während unserer Prüfung feststellen.

Frankfurt am Main, den 11. Juli 2022

KPMG AG
Wirtschaftsprüfungsgesellschaft

Schobel
Wirtschaftsprüfer

Rodriguez Gonzalez
Wirtschaftsprüfer

Jahresbericht

Lloyd Fonds - Global Multi Asset Sustainable

Anteilklassen im Überblick

Erstausgabedatum

Anteilklasse R	1. Oktober 2013
Anteilklasse I	1. Oktober 2013

Erstausgabepreise

Anteilklasse R	50,00 € zzgl. Ausgabeaufschlag
Anteilklasse I	1.000,00 € zzgl. Ausgabeaufschlag

Ausgabeaufschlag

Anteilklasse R	derzeit 5,00 %
Anteilklasse I	derzeit 0,00 %

Mindestanlagesumme

Anteilklasse R	keine
Anteilklasse I	keine

Verwaltungsvergütung

Anteilklasse R	derzeit 1,60 %
Anteilklasse I	derzeit 1,00 %

Verwahrstellenvergütung

Anteilklasse R	derzeit 0,065 %
Anteilklasse I	derzeit 0,065 %

Vertriebsfolgeprovision

Anteilklasse R	derzeit 0,5 %
Anteilklasse I	keine

Erfolgsabhängige Vergütung

Anteilklasse R und I	Bis zu 15 % der von der Anteilklasse in der Abrechnungsperiode erwirtschafteten Rendite über dem Referenzwert (absolute Anteilwertentwicklung zzgl. 3 %)
----------------------	--

Währung

Anteilklasse R	Euro
Anteilklasse I	Euro

Ertragsverwendung

Anteilklasse R	Ausschüttung
Anteilklasse I	Ausschüttung

Wertpapier-Kennnummer / ISIN:

Anteilklasse R	A1WZ2J / DE000A1WZ2J4
Anteilklasse I	A1WZ2K / DE000A1WZ2K2

Jahresbericht

Lloyd Fonds - Global Multi Asset Sustainable

Kurzübersicht über die Partner

1. Kapitalverwaltungsgesellschaft

Universal-Investment-Gesellschaft mbH

Hausanschrift:

Theodor-Heuss-Allee 70
60486 Frankfurt am Main

Postanschrift:

Postfach 17 05 48
60079 Frankfurt am Main

Telefon: 069 / 710 43-0
Telefax: 069 / 710 43-700
www.universal-investment.com

Gründung: 1968

Rechtsform: Gesellschaft mit beschränkter Haftung
Gezeichnetes und eingezahltes Kapital: EUR 10.400.000,-
Eigenmittel: EUR 57.243.165,68 (Stand: September 2020)

Geschäftsführer:

Frank Eggloff, München
Ian Lees, Leverkusen
Katja Müller, Bad Homburg
Markus Neubauer, Frankfurt am Main
Michael Reinhard, Bad Vilbel
Stefan Rockel, Lauterbach (Hessen)
Stephan Scholl, Königstein im Taunus
Axel Vespermann, Dreieich

Aufsichtsrat:

Prof. Dr. Harald Wiedmann (Vorsitzender), Berlin
Dr. Axel Eckhardt, Düsseldorf
Daniel Fischer, Bad Vilbel
Daniel F. Just, Pöcking

2. Verwahrstelle

HSBC Trinkaus & Burkhardt AG

Hausanschrift:

Königsallee 21/23
40212 Düsseldorf

Telefon: (0211) 910 - 0
Telefax: (0211) 910 - 616

Rechtsform: Aktiengesellschaft
Haftendes Eigenkapital: € 2.528.588.962,46 (Stand: 31.12.2020)

3. Asset Management-Gesellschaft

SPSW Capital GmbH

Postanschrift:

An der Alster 42
20099 Hamburg

Telefon +49 40 2263437-0
Telefax +49 40 2263437-99
www.spsw-capital.com

4. Vertrieb

Lloyd Fonds AG

Postanschrift:

An der Alster 42
20099 Hamburg

Telefon (040) 32 56 78-0
Telefax (040) 32 56 78-99