



**Rapport semestriel non révisé  
au 30 juin 2022**

**FFG**

SICAV à compartiments multiples de droit luxembourgeois

R.C.S. Luxembourg B211660

---

Les souscriptions ne peuvent être effectuées que sur base du prospectus ("Prospectus") comprenant les fiches signalétiques de chacun des compartiments et des informations clés pour l'investisseur ("Informations Clés"). Le Prospectus ne peut être distribué qu'accompagné du dernier rapport annuel et du dernier rapport semestriel, si celui-ci est plus récent que le rapport annuel.

---

<b>Organisation .....</b>	<b>2</b>
<b>Etat globalisé du patrimoine .....</b>	<b>4</b>
<b>FFG - European Equities Sustainable Moderate .....</b>	<b>5</b>
Etat du patrimoine .....	5
Statistiques .....	6
Etat du portefeuille-titres et des autres actifs nets .....	7
Répartition économique et géographique du portefeuille-titres .....	8
<b>FFG - Global Flexible Sustainable .....</b>	<b>9</b>
Etat du patrimoine .....	9
Statistiques .....	10
Etat du portefeuille-titres et des autres actifs nets .....	11
Répartition économique et géographique du portefeuille-titres .....	13
<b>FFG - European Equities Sustainable .....</b>	<b>14</b>
Etat du patrimoine .....	14
Statistiques .....	15
Etat du portefeuille-titres et des autres actifs nets .....	16
Répartition économique et géographique du portefeuille-titres .....	20
<b>FFG - Cleantech II .....</b>	<b>21</b>
Etat du patrimoine .....	21
Statistiques .....	22
Etat du portefeuille-titres et des autres actifs nets .....	23
Répartition économique et géographique du portefeuille-titres .....	24
<b>Notes aux états financiers .....</b>	<b>25</b>
<b>Informations supplémentaires .....</b>	<b>35</b>

<b>Siège social</b>	2, Rue d'Alsace L-1122 LUXEMBOURG
<b>Conseil d'Administration</b>	Nicolas CROCHET Administrateur FUNDS FOR GOOD S.A. 1, Rue Guillaume de Machault L-2111 LUXEMBOURG  Patrick SOMERHAUSEN Administrateur FUNDS FOR GOOD S.A. 1, Rue Guillaume de Machault L-2111 LUXEMBOURG  Britta BORNEFF-O'BRIEN Administrateur indépendant
<b>Société de Gestion</b>	WAYSTONE MANAGEMENT COMPANY (LUX) S.A. (anciennement MDO MANAGEMENT COMPANY S.A.) 19, Rue de Bitbourg L-1273 LUXEMBOURG
<b>Conseil d'Administration de la Société de Gestion</b>	
<b>Président</b>	Géry DAENINCK
<b>Administrateurs</b>	John LI HOW CHEONG Martin Peter VOGEL
<b>Dirigeants de la Société de Gestion</b>	Riccardo DEL TUFO Pall EYJOLFSSON Alessandro GABURRI Kim KIRSCH Thierry LELIEVRE
<b>Gestionnaire</b>	BLI-BANQUE DE LUXEMBOURG INVESTMENTS S.A. 16, Boulevard Royal L-2449 LUXEMBOURG  ACADIAN ASSET MANAGEMENT LLC 260, Franklin Street 02110 BOSTON, Massachusetts USA  CAPRICORN PARTNERS NV Lei 19/1 B-3000 LEUVEN, BELGIQUE

<b>Dépositaire et Agent Payeur Principal</b>	BANQUE DE LUXEMBOURG Société Anonyme 14, Boulevard Royal L-2449 LUXEMBOURG
<b>Administration Centrale et agent domiciliataire</b>	EUROPEAN FUND ADMINISTRATION Société Anonyme 2, Rue d'Alsace L-1122 LUXEMBOURG
<b>Auditeur</b>	PRICEWATERHOUSECOOPERS, Société coopérative 2, Rue Gerhard Mercator L-2182 LUXEMBOURG
<b>Conseiller juridique</b>	ELVINGER HOSS PRUSSEN Société Anonyme 2, Place Winston Churchill L-1340 LUXEMBOURG
<b>Coordinateur de distribution</b>	FUNDS FOR GOOD S.A. 1, Rue Guillaume de Machault L-2111 LUXEMBOURG
<b>Distributeurs</b>	DEUTSCHE BANK AG Brussels Branch 13-15, Avenue Marnix B-1000 BRUSSELS  ALLFUNDS BANK, S.A.U. 7, Padres Dominicos ES-28050 MADRID  ALLFUNDS BANK INTERNATIONAL S.A. 30, Boulevard Royal L-2449 LUXEMBOURG  BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL 6, Avenue de Provence F-75009 PARIS

**FFG****Etat globalisé du patrimoine (en EUR)**  
au 30 juin 2022

<b>Actif</b>	
Portefeuille-titres à la valeur d'évaluation	458.245.206,52
Dépôts de garantie sur futures	10.053.627,47
Avoirs bancaires	15.932.858,24
Frais d'établissement, nets	8.915,13
A recevoir sur ventes de titres	151.223,35
A recevoir sur garantie en espèces payée	340.000,00
A recevoir sur émissions d'actions	642.326,28
Revenus à recevoir sur portefeuille-titres	529.935,98
Plus-values non réalisées sur futures	1.809.884,33
Plus-values non réalisées sur changes à terme	2.448,89
Autres créances	708.662,44
Charges payées d'avance	5.394,02
Total de l'actif	488.430.482,65
<b>Exigible</b>	
Dettes bancaires	2.087.912,39
Garantie en espèces reçue à rembourser	15.000,00
Moins-values non réalisées sur changes à terme	361.321,62
Frais à payer	1.436.645,57
Autres dettes	1.070.258,13
Total de l'exigible	4.971.137,71
Actif net à la fin de la période	483.459.344,94

Les notes annexées font partie intégrante de ces états financiers.

## FFG - European Equities Sustainable Moderate

### Etat du patrimoine (en EUR)

au 30 juin 2022

#### Actif

Portefeuille-titres à la valeur d'évaluation	33.057.996,00
Dépôts de garantie sur futures	2.528.801,74
Avoirs bancaires	912.918,19
Plus-values non réalisées sur futures	137.637,04
Plus-values non réalisées sur changes à terme	2.448,89
Autres créances	261.856,13
Charges payées d'avance	411,60
Total de l'actif	36.902.069,59

#### Exigible

Garantie en espèces reçue à rembourser	15.000,00
Frais à payer	57.638,35
Total de l'exigible	72.638,35

Actif net à la fin de la période 36.829.431,24

#### Répartition des actifs nets par classe d'action

Classe d'action	Nombre d'actions	Devise action	VNI par action en devise de la classe d'action	Actifs nets par classe d'action (en EUR)
R Dis	258,000	EUR	93,42	24.103,10
R Acc	176.607,310	EUR	106,37	18.785.046,05
I Acc	161.240,214	EUR	111,76	18.020.282,09
				<u><u>36.829.431,24</u></u>

Les notes annexées font partie intégrante de ces états financiers.

## FFG - European Equities Sustainable Moderate

### Statistiques (en EUR)

au 30 juin 2022

<b>Total de l'actif net</b>	<b>Devise</b>	<b>31.12.2020</b>	<b>31.12.2021</b>	<b>30.06.2022</b>
	EUR	38.290.825,51	41.692.014,84	36.829.431,24

  

<b>VNI par classe d'action</b>	<b>Devise</b>	<b>31.12.2020</b>	<b>31.12.2021</b>	<b>30.06.2022</b>
R Dis	EUR	95,66	105,08	93,42
R Acc	EUR	108,91	119,63	106,37
I Acc	EUR	113,50	125,36	111,76

  

<b>Nombre d'actions</b>	<b>en circulation au début de la période</b>	<b>émises</b>	<b>remboursées</b>	<b>en circulation en fin de la période</b>
R Dis	258,000	-	-	258,000
R Acc	176.591,866	6.497,222	-6.481,778	176.607,310
I Acc	163.843,942	8.083,460	-10.687,188	161.240,214



## FFG - European Equities Sustainable Moderate

### Etat du portefeuille-titres et des autres actifs nets (en EUR)

au 30 juin 2022

Devise	Valeur nominale/ Quantité	Dénomination	Coût d'acquisition	Valeur d'évaluation	% de l'actif net *
<b><u>Portefeuille-titres</u></b>					
<b><u>Fonds d'investissement ouverts</u></b>					
<b>Fonds d'investissement (OPCVM)</b>					
EUR	280.200	FFG European Equity Sustain I C	<u>30.824.423,04</u>	<u>33.057.996,00</u>	<u>89,76</u>
Total portefeuille-titres			<u>30.824.423,04</u>	<u>33.057.996,00</u>	<u>89,76</u>
Avoirs bancaires				912.918,19	2,48
Autres actifs/(passifs) nets				2.858.517,05	7,76
Total				<u><u>36.829.431,24</u></u>	<u><u>100,00</u></u>

\* Des différences mineures peuvent apparaître résultant des arrondis lors du calcul des pourcentages.

Les notes annexées font partie intégrante de ces états financiers.

## FFG - European Equities Sustainable Moderate

Répartition économique et géographique du portefeuille-titres  
au 30 juin 2022

---

### Répartition économique

(en pourcentage de l'actif net)

Fonds d'investissement	<u>89,76 %</u>
Total	<u><u>89,76 %</u></u>

### Répartition géographique

(par pays de résidence de l'émetteur)  
(en pourcentage de l'actif net)

Luxembourg	<u>89,76 %</u>
Total	<u><u>89,76 %</u></u>

## FFG - Global Flexible Sustainable

### Etat du patrimoine (en EUR)

au 30 juin 2022

#### **Actif**

Portefeuille-titres à la valeur d'évaluation	300.197.961,90
Dépôts de garantie sur futures	7.524.825,73
Avoirs bancaires	10.337.901,60
Frais d'établissement, nets	2.074,09
A recevoir sur garantie en espèces payée	340.000,00
A recevoir sur émissions d'actions	204.291,84
Revenus à recevoir sur portefeuille-titres	402.176,17
Plus-values non réalisées sur futures	1.672.247,29
Autres créances	446.806,31
Charges payées d'avance	3.130,37
Total de l'actif	321.131.415,30

#### **Exigible**

Dettes bancaires	2.087.907,91
Moins-values non réalisées sur changes à terme	361.321,62
Frais à payer	967.756,55
Autres dettes	1.070.258,13
Total de l'exigible	4.487.244,21
Actif net à la fin de la période	316.644.171,09

#### **Répartition des actifs nets par classe d'action**

Classe d'action	Nombre d'actions	Devise action	VNI par action en devise de la classe d'action	Actifs nets par classe d'action (en EUR)
R Dis	300.454,635	EUR	117,07	35.174.774,08
R Acc	1.356.199,156	EUR	120,62	163.591.190,12
I Acc	333.869,385	EUR	113,87	38.016.094,21
C Dis	488.686,377	EUR	118,68	57.997.459,31
C Acc	156.553,048	EUR	120,15	18.810.359,88
F Acc	500.000,000	EUR	0,01250	6.247,52
S Dis	3.151,000	EUR	120,93	381.048,40
S Acc	21.329,755	EUR	125,04	2.666.997,57
				316.644.171,09

Les notes annexées font partie intégrante de ces états financiers.

## FFG - Global Flexible Sustainable

### Statistiques (en EUR)

au 30 juin 2022

Total de l'actif net	Devise	31.12.2020	31.12.2021	30.06.2022
	EUR	198.297.843,53	316.967.705,97	316.644.171,09

VNI par classe d'action	Devise	31.12.2020	31.12.2021	30.06.2022
R Dis	EUR	120,38	129,60	117,07
R Acc	EUR	121,03	131,71	120,62
I Acc	EUR	113,20	123,94	113,87
C Dis	EUR	121,62	131,39	118,68
C Acc	EUR	120,06	131,00	120,15
F Acc	EUR	0,01242	0,01360	0,01250
S Dis	EUR	123,55	133,71	120,93
S Acc	EUR	124,04	136,03	125,04

Nombre d'actions	en circulation au début de la période	émises	réinvesties	remboursées	en circulation en fin de la période
R Dis	291.476,142	18.046,383	35,626	-9.103,516	300.454,635
R Acc	1.197.136,156	267.799,746	-	-108.736,746	1.356.199,156
I Acc	294.471,917	57.104,898	-	-17.707,430	333.869,385
C Dis	478.773,577	25.406,000	-	-15.493,200	488.686,377
C Acc	142.574,298	29.465,432	-	-15.486,682	156.553,048
F Acc	500.000,000	-	-	-	500.000,000
S Dis	3.296,000	-	-	-145,000	3.151,000
S Acc	21.959,755	-	-	-630,000	21.329,755

Dividendes payés	Devise	Dividende par classe d'action	Date ex-dividende
R Dis	EUR	1,64	01.06.2022
C Dis	EUR	1,85	01.06.2022
S Dis	EUR	2,03	01.06.2022

## FFG - Global Flexible Sustainable

### Etat du portefeuille-titres et des autres actifs nets (en EUR) au 30 juin 2022

Devise	Valeur nominale/ Quantité	Dénomination	Coût d'acquisition	Valeur d'évaluation	% de l'actif net *
<b>Portefeuille-titres</b>					
<b>Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs</b>					
<b>Actions</b>					
CAD	120.000	Agnico Eagle Mines Ltd	5.611.262,05	5.239.488,90	1,66
CAD	85.000	Endeavour Mining PLC	1.669.099,33	1.677.393,80	0,53
CAD	100.000	Franco Nevada Corporation	10.605.923,56	12.547.384,31	3,96
CAD	240.000	Lundin Gold Inc	1.609.959,99	1.643.342,75	0,52
CAD	175.000	Osisko Gold Royalties Ltd	1.994.138,78	1.683.285,11	0,53
CAD	150.000	Wheaton Precious Metals Corp Reg	4.618.061,12	5.155.454,33	1,63
			26.108.444,83	27.946.349,20	8,83
CHF	3.900	Geberit AG Reg	1.843.811,83	1.788.053,70	0,56
CHF	510	Givaudan SA Reg	1.621.709,55	1.710.858,37	0,54
CHF	63.000	Logitech Intl SA Reg	4.174.835,03	3.139.586,54	0,99
CHF	50.000	Novartis AG Reg	3.929.714,09	4.039.639,13	1,28
CHF	50.000	Roche Holding Ltd Pref	14.692.414,02	15.916.228,13	5,03
CHF	1.500	SGS SA Reg	3.408.413,07	3.275.180,52	1,03
CHF	20.000	Straumann Holding AG	2.146.058,08	2.291.377,25	0,72
CHF	10.000	VAT Gr SA Reg	2.619.606,77	2.274.389,28	0,72
			34.436.562,44	34.435.312,92	10,87
DKK	39.000	Chr. Hansen Holding A/S	2.780.330,84	2.708.825,79	0,86
DKK	30.486	Coloplast A/S B	3.419.401,85	3.313.514,05	1,05
DKK	25.000	Novo Nordisk AS B	1.363.071,94	2.645.983,68	0,84
DKK	30.000	Novozymes AS B	1.356.997,23	1.718.275,98	0,54
			8.919.801,86	10.386.599,50	3,29
EUR	18.500	Adidas AG Reg	3.282.122,22	3.122.060,00	0,99
EUR	30.000	Amadeus IT Group SA A	1.909.717,00	1.594.800,00	0,50
EUR	160.000	Industria de Diseno Textil SA	3.838.272,05	3.454.400,00	1,09
EUR	34.000	Kerry Group Plc A	3.789.787,54	3.105.560,00	0,98
EUR	130.000	Kone Oyj B	6.602.648,37	5.896.800,00	1,86
EUR	10.000	L'Oréal SA	2.729.852,74	3.293.000,00	1,04
EUR	4.200	LVMH Moët Hennessy L Vuit SE	1.517.931,63	2.443.140,00	0,77
EUR	60.000	SAP SE	6.305.284,91	5.215.800,00	1,65
EUR	150.000	Unilever Plc Reg	7.139.992,22	6.498.000,00	2,05
			37.115.608,68	34.623.560,00	10,93
GBP	360.000	GSK Plc	6.012.921,96	7.380.984,46	2,33
GBP	90.000	Reckitt Benckiser Group Plc	6.434.423,85	6.448.328,35	2,04
			12.447.345,81	13.829.312,81	4,37
HKD	750.000	Alibaba Group Holding Ltd Reg	11.884.508,51	10.224.371,98	3,23
HKD	4.500.000	China Feihe Ltd Unitary Share Reg	5.212.436,70	4.944.977,76	1,56
HKD	100.000	Hong Kong Sec Clearing Co Ltd	3.988.255,28	4.702.541,06	1,49
HKD	313.000	Techtronic Industries Co Ltd	3.725.320,93	3.121.104,52	0,99
HKD	2.400.000	Travelsky Technology Ltd H	3.547.370,31	4.455.962,22	1,41
			28.357.891,73	27.448.957,54	8,68
IDR	30.000.000	Kalbe Farma Tbk (PT)	2.438.998,44	3.195.817,40	1,01
JPY	150.000	Asahi Group Holdings Ltd	4.953.958,74	4.693.702,64	1,48
JPY	50.000	Daifuku Co Ltd	2.869.849,97	2.731.393,51	0,86
JPY	6.900	Disco Corp	1.722.012,32	1.564.074,77	0,49
JPY	21.000	Fanuc Corp	3.303.874,40	3.139.976,19	0,99
JPY	33.000	Hoya Corp	2.776.248,12	2.691.302,57	0,85
JPY	115.000	Kao Corp	5.533.059,74	4.429.926,05	1,40
JPY	8.500	Keyence Corp	2.785.680,12	2.775.250,68	0,88
JPY	258.000	Nabtesco Corp	6.592.967,15	5.757.467,77	1,82
JPY	13.500	Nintendo Co Ltd	5.302.353,47	5.576.688,95	1,76
JPY	115.000	Recruit Holdings Co Ltd	3.517.346,48	3.234.202,23	1,02
JPY	108.000	Secom Co Ltd	7.204.814,77	6.373.467,41	2,01

\* Des différences mineures peuvent apparaître résultant des arrondis lors du calcul des pourcentages.

Les notes annexées font partie intégrante de ces états financiers.

## FFG - Global Flexible Sustainable

### Etat du portefeuille-titres et des autres actifs nets (en EUR) (suite) au 30 juin 2022

Devise	Valeur nominale/ Quantité	Dénomination	Coût d'acquisition	Valeur d'évaluation	% de l'actif net *
JPY	85.000	Shiseido Co Ltd	3.417.725,01	3.258.735,49	1,03
JPY	39.000	Sony Group Corp	3.466.143,27	3.046.102,14	0,96
JPY	112.000	Terumo Corp	3.591.789,23	3.223.156,98	1,02
			57.037.822,79	52.495.447,38	16,57
KRW	67.000	Coway Co Ltd	3.471.425,54	3.153.668,61	1,00
KRW	6.900	LG H&H Co Ltd	5.719.736,15	3.456.196,28	1,09
			9.191.161,69	6.609.864,89	2,09
SEK	151.731	Assa Abloy AB B	3.363.222,70	3.077.307,88	0,97
TWD	370.000	President Chain Store Corp	2.935.686,41	3.240.469,71	1,02
USD	9.000	Adobe Inc Reg	3.660.830,42	3.149.655,83	1,00
USD	1.530	Alphabet Inc A	2.034.460,59	3.187.636,52	1,01
USD	30.000	Amazon.com Inc	3.810.881,03	3.046.175,91	0,96
USD	20.000	Analog Devices Inc	2.060.184,59	2.793.307,84	0,88
USD	36.000	AptarGroup Inc	3.710.445,81	3.552.160,61	1,12
USD	16.000	Becton Dickinson & Co	3.302.345,78	3.771.013,38	1,19
USD	30.000	Clorox Co	4.305.870,59	4.043.403,44	1,28
USD	24.000	Ecolab Inc	3.855.528,60	3.527.954,11	1,11
USD	79.000	Gilead Sciences Inc	4.606.566,15	4.668.250,48	1,47
USD	10.500	Henry Jack & Associates Inc	1.631.533,74	1.807.084,13	0,57
USD	30.000	Johnson & Johnson	4.109.127,85	5.091.108,99	1,61
USD	10.000	Mastercard Inc A	2.683.688,26	3.016.061,19	0,95
USD	13.000	Microsoft Corp	2.499.172,31	3.191.959,85	1,01
USD	150.000	Osisko Gold Royalties Ltd	1.652.435,29	1.448.374,76	0,46
USD	60.000	Royal Gold Inc	5.465.002,16	6.125.047,80	1,93
USD	45.000	Taiwan Semiconduct Mfg Co Ltd ADR repr 5 Shares	3.204.714,87	3.516.969,41	1,11
			52.592.788,04	55.936.164,25	17,66
<b>Total actions</b>			274.945.335,42	273.225.163,48	86,29
<b>Obligations</b>					
USD	13.000.000	US 1.25% T-Notes 20/15.05.50	9.050.687,74	7.874.492,11	2,49
USD	10.000.000	US 2% Ser Bonds 21/15.08.51	8.041.565,42	7.359.882,89	2,32
USD	8.500.000	US 2.25% Ser 2049 19/15.08.49	7.638.991,09	6.645.069,21	2,10
USD	6.000.000	US ILB Sen 20/15.02.50	5.711.209,59	5.093.354,21	1,61
<b>Total obligations</b>			30.442.453,84	26.972.798,42	8,52
<b>Total portefeuille-titres</b>			305.387.789,26	300.197.961,90	94,81
<b>Avoirs bancaires</b>				10.337.901,60	3,26
<b>Dettes bancaires</b>				-2.087.907,91	-0,66
<b>Autres actifs/(passifs) nets</b>				8.196.215,50	2,59
<b>Total</b>				316.644.171,09	100,00

\* Des différences mineures peuvent apparaître résultant des arrondis lors du calcul des pourcentages.

Les notes annexées font partie intégrante de ces états financiers.

## FFG - Global Flexible Sustainable

### Répartition économique et géographique du portefeuille-titres

au 30 juin 2022

#### Répartition économique

(en pourcentage de l'actif net)

Services de santé	18,40 %
Biens de consommation non-cyclique	15,83 %
Technologies	14,80 %
Matières premières	14,53 %
Industrie	13,71 %
Pays et gouvernements	8,52 %
Biens de consommation durable	7,53 %
Finances	1,49 %
Total	<u>94,81 %</u>

#### Répartition géographique

(par pays de résidence de l'émetteur)

(en pourcentage de l'actif net)

Etats-Unis d'Amérique	24,61 %
Japon	16,57 %
Suisse	10,87 %
Canada	8,76 %
Royaume-Uni	6,95 %
Caïmans (Iles)	4,79 %
Danemark	3,29 %
Allemagne	2,64 %
Hong Kong	2,48 %
Taiïwan	2,13 %
Corée du Sud	2,09 %
Finlande	1,86 %
France	1,81 %
Espagne	1,59 %
Chine	1,41 %
Indonésie	1,01 %
Irlande	0,98 %
Suède	0,97 %
Total	<u>94,81 %</u>

## FFG - European Equities Sustainable

### Etat du patrimoine (en EUR)

au 30 juin 2022

#### Actif

Portefeuille-titres à la valeur d'évaluation	66.912.454,25
Avoirs bancaires	409.419,68
Frais d'établissement, nets	3.504,61
Revenus à recevoir sur portefeuille-titres	26.900,42
Charges payées d'avance	1.057,11
Total de l'actif	67.353.336,07

#### Exigible

Dettes bancaires	4,48
Frais à payer	171.674,07
Total de l'exigible	171.678,55
Actif net à la fin de la période	67.181.657,52

#### Répartition des actifs nets par classe d'action

Classe d'action	Nombre d'actions	Devise action	VNI par action en devise de la classe d'action	Actifs nets par classe d'action (en EUR)
R Acc	6.666,947	EUR	109,94	732.958,57
I Acc	557.326,417	EUR	117,98	65.753.086,63
C Dis	1.170,000	EUR	103,28	120.839,32
C Acc	5.339,128	EUR	106,54	568.842,15
F Acc	500.000,000	EUR	0,01186	5.930,85
				67.181.657,52

Les notes annexées font partie intégrante de ces états financiers.



## FFG - European Equities Sustainable

### Statistiques (en EUR)

au 30 juin 2022

Total de l'actif net	Devise	31.12.2020	31.12.2021	30.06.2022
	EUR	87.493.755,54	107.069.292,87	67.181.657,52

VNI par classe d'action	Devise	31.12.2020	31.12.2021	30.06.2022
R Acc	EUR	108,93	139,73	109,94
I Acc	EUR	115,52	149,36	117,98
C Dis	EUR	103,98	133,92	103,28
C Acc	EUR	104,93	135,14	106,54
F Acc	EUR	0,01160	0,01501	0,01186

Nombre d'actions	en circulation au début de la période	émises	remboursées	en circulation en fin de la période
R Acc	6.289,238	1.395,763	-1.018,054	6.666,947
I Acc	700.976,920	128.415,538	-272.066,041	557.326,417
C Dis	2.670,000	-	-1.500,000	1.170,000
C Acc	8.334,128	-	-2.995,000	5.339,128
F Acc	500.000,000	-	-	500.000,000

Dividendes payés	Devise	Dividende par classe d'action	Date ex-dividende
C Dis	EUR	2,49	01.06.2022

## FFG - European Equities Sustainable

Etat du portefeuille-titres et des autres actifs nets (en EUR)  
au 30 juin 2022

Devise	Valeur nominale/ Quantité	Dénomination	Coût d'acquisition	Valeur d'évaluation	% de l'actif net *
<b>Portefeuille-titres</b>					
<b>Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs</b>					
<b>Actions</b>					
CHF	1.649	Belimo Holding AG	708.087,30	553.671,89	0,82
CHF	3.613	Bucher Industries SA Reg	1.137.917,53	1.198.667,10	1,78
CHF	1.572	Burkhalter Holding Ltd Reg	91.287,41	118.130,74	0,18
CHF	109	Chocolade Lindt & Spruengli AG Partizsch	997.448,96	1.057.640,98	1,57
CHF	4.160	Georg Fischer SA	222.819,75	195.215,35	0,29
CHF	5.596	Kuehne & Nagel Intl AG Reg	997.783,82	1.263.800,98	1,88
CHF	177	Meier Tobler Gr AG Partizsch	3.090,24	4.244,99	0,01
CHF	16	Metall Zug Ltd B Reg	18.607,42	30.538,37	0,05
CHF	13.243	Nestlé SA Reg	1.304.083,44	1.474.755,50	2,20
CHF	10.458	Roche Holding Ltd Pref	2.879.417,94	3.329.038,28	4,96
CHF	1.488	SFS Group SA	132.247,13	143.490,38	0,21
CHF	3.956	Sonova Holding AG	850.900,70	1.201.772,90	1,79
CHF	8.733	Straumann Holding AG	1.107.124,46	1.000.529,87	1,49
CHF	1.854	U-blox Hg AG Reg	170.220,87	179.154,92	0,27
			10.621.036,97	11.750.652,25	17,50
DKK	505	AP Moeller Maersk AS B	909.147,32	1.124.042,23	1,67
DKK	2.573	Genmab A/S	750.540,69	794.626,14	1,18
DKK	2.631	H Lundbeck AS	11.378,01	12.048,35	0,02
DKK	10.524	H Lundbeck AS	46.833,02	48.773,53	0,07
DKK	25.543	Novo Nordisk AS B	2.210.309,63	2.703.454,44	4,02
DKK	8.884	Pandora A/S	844.394,95	533.325,17	0,79
DKK	854	SolarAS B	31.647,34	69.581,30	0,10
DKK	4.309	Sparekassen Sjælland	94.860,55	85.453,64	0,13
			4.899.111,51	5.371.304,80	7,98
EUR	1.914	Aalberts NV	103.803,49	71.181,66	0,11
EUR	33.813	Acerinox SA Reg	399.879,30	312.296,87	0,46
EUR	10.043	Aegon NV	50.798,50	41.457,50	0,06
EUR	1.885	Alkemy SpA	36.970,32	26.390,00	0,04
EUR	1.246	Altamir	21.108,39	30.614,22	0,05
EUR	25.504	Andritz AG	767.731,21	980.373,76	1,46
EUR	1.059	ASML Holding NV	468.317,77	482.745,15	0,72
EUR	11.339	Aurubis AG	1.057.504,03	734.313,64	1,09
EUR	984	Banca Mediolanum	6.867,78	6.177,55	0,01
EUR	90.496	Bankinter SA Reg	515.269,30	538.632,19	0,80
EUR	5.070	Barco NV Reg	104.913,00	102.211,20	0,15
EUR	12.478	Bayerische Motorenwerke AG	986.131,28	916.633,88	1,36
EUR	574	BIC SA	27.866,78	29.962,80	0,04
EUR	34	Caisse Reg CA Mutuel Languedoc	2.865,92	1.635,40	0,00
EUR	10.702	CBO Territoria	40.024,21	38.741,24	0,06
EUR	1.759	Cenit AG	21.865,51	27.968,10	0,04
EUR	8.309	Clearwise AG Reg	17.122,36	17.615,08	0,03
EUR	8.554	CNH Industrial NV	107.103,40	94.265,08	0,14
EUR	15.162	Coface SA	166.814,01	151.089,33	0,22
EUR	1.721	Consti Plc	22.318,79	15.626,68	0,02
EUR	30.945	Derichebourg	285.455,81	170.197,50	0,25
EUR	63.713	Deutsche Bank AG Reg	667.426,84	529.964,73	0,79
EUR	2.326	Deutsche Boerse AG Reg	366.351,15	371.229,60	0,55
EUR	3.711	Eramet SA	546.349,42	367.945,65	0,55
EUR	14.703	Erste Group Bank AG	406.568,83	355.812,60	0,53
EUR	7.062	Gaztransport et technigaz SA	704.987,27	843.909,00	1,26
EUR	11.594	Gefran SpA	108.240,85	101.563,44	0,15
EUR	9.549	Group SFPI SA	32.418,86	23.681,52	0,04
EUR	1.733	Guerbet SA	46.430,36	38.559,25	0,06
EUR	5.364	Ilkka Oyj	24.252,18	23.655,24	0,04
EUR	680	Infotel SA	28.227,55	33.320,00	0,05
EUR	1.036	Ion Beam Applications SA	15.161,41	16.120,16	0,02

\* Des différences mineures peuvent apparaître résultant des arrondis lors du calcul des pourcentages.

Les notes annexées font partie intégrante de ces états financiers.

## FFG - European Equities Sustainable

### Etat du portefeuille-titres et des autres actifs nets (en EUR) (suite) au 30 juin 2022

Devise	Valeur nominale/ Quantité	Dénomination	Coût d'acquisition	Valeur d'évaluation	% de l'actif net *
EUR	10.476	Ipsen	541.844,16	943.363,80	1,40
EUR	72.311	Jeronimo Martins SA Reg	1.431.847,50	1.499.730,14	2,23
EUR	35.517	K+S Aktiengesellschaft Reg	580.901,85	823.639,23	1,23
EUR	50.193	Kesko Oyj B	1.441.901,07	1.129.844,43	1,68
EUR	5.465	Laboratorios Farmaceu Rovi SA	312.133,13	319.156,00	0,48
EUR	347	Mediaset Espana Com SA	2.104,79	1.360,93	0,00
EUR	18.716	Mercedes-Benz Group AG Reg	1.259.127,29	1.033.497,52	1,54
EUR	7.818	Merck KGaA	1.133.383,44	1.258.698,00	1,87
EUR	1.644	Mwb Fairtrade Wertpapierha AG	18.692,93	19.317,00	0,03
EUR	9.612	Navigator (The) Co SA Reg	36.528,48	36.871,63	0,05
EUR	328	Ned Apparatenfabriek Nedap NV Bearer	14.058,25	19.614,40	0,03
EUR	7.628	Nemetschek SE	620.713,98	440.593,28	0,66
EUR	2.901	Neurones	76.219,93	103.275,60	0,15
EUR	26.218	NN Group NV	1.315.250,16	1.136.288,12	1,69
EUR	42.619	Oci NV Reg	986.394,30	1.341.646,12	2,00
EUR	1.924	Orion Corp (New)	69.236,91	81.577,60	0,12
EUR	5.157	Pihlajalinna Plc	49.941,31	59.202,36	0,09
EUR	1.370	PSI Software AG	62.893,75	39.113,50	0,06
EUR	24.114	Publicis Groupe SA	1.082.645,58	1.125.159,24	1,67
EUR	17.971	Randstad NV	933.992,50	830.260,20	1,24
EUR	8.028	Redes Energetic Nacio SGPS SA	22.219,10	23.080,50	0,03
EUR	54.918	Rexel SA	646.199,03	805.921,65	1,20
EUR	13.439	Salzgitter AG	423.555,29	312.053,58	0,46
EUR	80	Samse SA	12.953,50	13.760,00	0,02
EUR	3.778	Sanlorenzo SpA	134.859,56	121.273,80	0,18
EUR	1.782	Sartorius AG Pref	567.488,59	594.118,80	0,88
EUR	2.591	Seche Environnement SA	159.469,79	214.793,90	0,32
EUR	121.778	SES SA FDR repr 1 Reg Sh A	1.017.174,32	1.015.872,08	1,51
EUR	30	Siili Solutions Plc	490,39	420,00	0,00
EUR	907	Sipef SA	53.146,10	57.594,50	0,09
EUR	20.018	Sonae SGPS SA Reg	21.261,12	23.441,08	0,03
EUR	1.215	Ste Informatique Industrielle	47.157,03	48.417,75	0,07
EUR	4.225	Strabag SE	80.859,10	171.323,75	0,26
EUR	1.396	Surteco Group SE	29.621,48	31.410,00	0,05
EUR	628	Sword Group SA Reg	20.609,73	22.608,00	0,03
EUR	1.616	Technotrans SE Reg	40.886,74	42.662,40	0,06
EUR	1.468	Titanium Oyj	20.831,36	18.276,60	0,03
EUR	54.318	Télévision Française 1 SA TF1	360.582,42	366.918,09	0,55
EUR	11.533	UCB	1.212.311,66	930.021,12	1,38
EUR	7.626	Uponor Oyj A Reg	109.420,16	100.434,42	0,15
EUR	1.057	USU Software AG	20.073,12	18.867,45	0,03
EUR	2.238	Van Lanschot Kempen NV Certif	51.514,32	49.795,50	0,07
EUR	6.033	Verbund AG A	504.451,10	563.180,55	0,84
EUR	849	Virbac SA	230.831,90	315.403,50	0,47
EUR	42.934	Voestalpine	1.332.457,28	870.701,52	1,30
EUR	6.050	Wacker Chemie AG	818.224,02	832.480,00	1,24
EUR	4.450	Wendel SE	492.956,48	354.887,50	0,53
EUR	10.662	Wienerberger AG	223.787,92	218.357,76	0,33
EUR	16.926	Wolters Kluwer NV	1.620.610,06	1.566.670,56	2,33
			<b>30.402.959,86</b>	<b>29.442.845,48</b>	<b>43,81</b>
GBP	16.699	3i Group Plc	241.054,50	214.954,06	0,32
GBP	195	888 Holdings Plc Reg	893,86	379,51	0,00
GBP	22.218	A G Barr Plc Reg	132.906,42	133.387,45	0,20
GBP	3.274	Accesso Technology Group Plc	26.547,62	23.343,53	0,03
GBP	39.977	Allergy Therapeutics Plc Reg	5.992,29	9.632,70	0,01
GBP	4.063	Antofagasta Plc	70.811,56	54.493,95	0,08
GBP	221.111	Breedon Group Plc	240.211,03	146.097,27	0,22
GBP	646	Castings Plc Reg	3.132,00	2.400,50	0,00
GBP	2.773	Clarkson Plc	112.570,16	96.925,01	0,14
GBP	91.527	GSK Plc	1.807.240,55	1.876.553,79	2,79
GBP	76.704	Harbour Energy PLC	454.003,82	324.041,16	0,48
GBP	2.092	Headlam Group Plc	11.334,78	7.215,02	0,01
GBP	7.388	Hikma Pharmaceutical Plc	174.111,81	138.768,42	0,21

\* Des différences mineures peuvent apparaître résultant des arrondis lors du calcul des pourcentages.

Les notes annexées font partie intégrante de ces états financiers.

## FFG - European Equities Sustainable

### Etat du portefeuille-titres et des autres actifs nets (en EUR) (suite) au 30 juin 2022

Devise	Valeur nominale/ Quantité	Dénomination	Coût d'acquisition	Valeur d'évaluation	% de l'actif net *
GBP	96.769	Howden Joinery Group Plc	1.028.393,66	677.149,94	1,01
GBP	125.061	Hunting Plc	480.472,07	313.685,99	0,47
GBP	66.647	IG Group Holdings Plc	571.340,16	534.396,69	0,80
GBP	623	Impellam Group PLC Reg	3.288,61	3.327,86	0,00
GBP	52.160	Inchcape Plc	420.052,24	421.263,84	0,63
GBP	92.293	Investec Plc	315.445,13	476.708,62	0,71
GBP	198.046	M&G PLC Reg	499.880,81	447.536,42	0,67
GBP	21.323	Macfarlane Group Plc	25.584,18	28.351,32	0,04
GBP	132.252	Man Group Plc Reg	351.188,14	383.631,41	0,57
GBP	4.052	Mediclinic International Plc	17.594,53	21.540,95	0,03
GBP	4.305	Morgan Sindall Group Plc	105.032,57	91.083,77	0,14
GBP	5.669	MP Evans Group Plc	63.279,11	58.457,32	0,09
GBP	324.645	NatWest Gr Plc	863.729,06	822.966,06	1,23
GBP	30.090	Next Fifteen Com Gr Plc	404.628,57	314.473,58	0,47
GBP	110.083	Ninety One PLC Reg	279.589,17	252.723,95	0,38
GBP	524	NMCN Plc Reg	4.950,24	0,00	0,00
GBP	11.734	Norcros PLC Reg	31.518,48	31.612,11	0,05
GBP	7.111	Page Gr Plc	39.588,28	32.997,09	0,05
GBP	35.675	Petra Diamonds Ltd	37.803,53	37.077,17	0,06
GBP	25.121	Savills Plc	348.791,09	295.213,97	0,44
GBP	22.614	Schroders Plc	952.631,06	701.670,65	1,04
GBP	5.686	ScS Group Plc Reg	17.967,45	10.828,55	0,02
GBP	47.620	SSE Plc	1.014.222,95	893.614,52	1,33
GBP	8.326	St James's Place Plc	130.690,88	106.594,42	0,16
GBP	90.312	Standard Chartered Plc	568.540,27	648.746,23	0,97
GBP	4.173	SThree Plc	23.718,17	17.275,38	0,03
GBP	5.014	Travis Perkins Plc	105.126,41	56.337,77	0,08
GBP	2.369	Vertu Motors Plc Reg	1.180,52	1.485,52	0,00
GBP	330	Wise Plc	3.461,57	1.139,66	0,00
			11.990.499,31	10.710.083,13	15,96
NOK	9.916	2020 Bulkera Ltd	119.384,43	107.864,90	0,16
NOK	11.766	American Shipping Company ASA	32.245,28	46.686,36	0,07
NOK	53.587	DNB Bank ASA	980.895,45	915.597,25	1,36
NOK	35.845	Mowi ASA Reg	926.624,37	777.405,76	1,16
NOK	7.486	Nordic Semiconductor ASA	178.416,18	110.700,73	0,16
NOK	11.594	Pareto Bk ASA Reg	48.296,23	53.016,67	0,08
NOK	34.804	TGS ASA	533.246,25	465.831,29	0,69
NOK	1.918	Wilh Wilhelmsen Hg ASA A	34.711,33	41.764,61	0,06
NOK	16.624	Yara Intl ASA	844.605,94	662.198,52	0,99
			3.698.425,46	3.181.066,09	4,73
SEK	1.558	B3 Consulting Group AB (publ)	17.297,07	14.686,75	0,02
SEK	842	Getinge AB B	27.596,85	18.577,89	0,03
SEK	1.149	Skistar AB B Emission 2019	18.938,73	14.863,47	0,02
SEK	21.154	SSAB AB B	116.696,73	83.555,50	0,12
SEK	11.573	Swedish Orphan Biovitrum AB	249.337,42	238.928,51	0,36
SEK	46.054	Tele2 AB B	494.746,29	500.760,64	0,75
SEK	139.871	Telefon AB LM Ericsson B	1.108.605,58	995.676,67	1,48
			2.033.218,67	1.867.049,43	2,78
USD	25.397	Cazoo Group Ltd	240.590,19	17.481,68	0,03
USD	23.424	Criteo SA Sh Spons ADR Repr 1 Sh	563.703,39	546.410,71	0,81
USD	6.380	Endava Ltd A spons ADR repr 1 Share Reg	643.623,06	538.396,37	0,80
USD	13.251	GSK Plc ADR repr 2 Shares	490.653,44	551.449,36	0,82
USD	15.583	Qiagen NV	665.852,95	703.171,70	1,05
USD	23.376	Rio Tinto Plc ADR DR	1.555.299,78	1.363.227,53	2,03
USD	24.000	STMicroelectronics NV Reg	859.626,44	722.065,01	1,07
			5.019.349,25	4.442.202,36	6,61
<b>Total actions</b>			<b>68.664.601,03</b>	<b>66.765.203,54</b>	<b>99,37</b>

\* Des différences mineures peuvent apparaître résultant des arrondis lors du calcul des pourcentages.

Les notes annexées font partie intégrante de ces états financiers.

## FFG - European Equities Sustainable

Etat du portefeuille-titres et des autres actifs nets (en EUR) (suite)  
au 30 juin 2022

Devise	Valeur nominale/ Quantité	Dénomination	Coût d'acquisition	Valeur d'évaluation	% de l'actif net *
<b><u>Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé</u></b>					
<b>Actions</b>					
EUR	3.229	Efecte Plc Reg	48.615,14	37.456,40	0,06
GBP	12.971	Science Group PLC Reg	30.464,13	58.893,81	0,09
GBP	7.174	Wynnstay Group Plc	30.349,14	50.900,50	0,08
			60.813,27	109.794,31	0,17
<b>Total actions</b>			109.428,41	147.250,71	0,23
Total portefeuille-titres			68.774.029,44	66.912.454,25	99,60
Avoirs bancaires				409.419,68	0,61
Dettes bancaires				-4,48	0,00
Autres actifs/(passifs) nets				-140.211,93	-0,21
<b>Total</b>				67.181.657,52	100,00

\* Des différences mineures peuvent apparaître résultant des arrondis lors du calcul des pourcentages.

Les notes annexées font partie intégrante de ces états financiers.

## FFG - European Equities Sustainable

### Répartition économique et géographique du portefeuille-titres

au 30 juin 2022

#### Répartition économique

(en pourcentage de l'actif net)

Services de santé	25,12 %
Industrie	16,90 %
Finances	13,87 %
Matières premières	12,33 %
Biens de consommation non-cyclique	9,25 %
Biens de consommation durable	8,51 %
Technologies	5,73 %
Energie	2,90 %
Services de télécommunication	2,26 %
Services aux collectivités	2,23 %
Immobilier	0,50 %
Total	<u>99,60 %</u>

#### Répartition géographique

(par pays de résidence de l'émetteur)

(en pourcentage de l'actif net)

Royaume-Uni	19,53 %
Suisse	17,50 %
Allemagne	11,97 %
Pays-Bas	10,51 %
France	9,77 %
Danemark	7,98 %
Autriche	4,72 %
Norvège	4,57 %
Suède	2,78 %
Portugal	2,34 %
Finlande	2,19 %
Espagne	1,74 %
Belgique	1,64 %
Luxembourg	1,54 %
Italie	0,38 %
Jersey	0,22 %
Bermudes (Iles)	0,22 %
Total	<u>99,60 %</u>

## FFG - Cleantech II

### Etat du patrimoine (en EUR)

au 30 juin 2022

#### Actif

Portefeuille-titres à la valeur d'évaluation	58.076.794,37
Avoirs bancaires	4.272.618,77
Frais d'établissement, nets	3.336,43
A recevoir sur ventes de titres	151.223,35
A recevoir sur émissions d'actions	438.034,44
Revenus à recevoir sur portefeuille-titres	100.859,39
Charges payées d'avance	794,94
Total de l'actif	63.043.661,69

#### Exigible

Frais à payer	239.576,60
Total de l'exigible	239.576,60
Actif net à la fin de la période	62.804.085,09

#### Répartition des actifs nets par classe d'action

Classe d'action	Nombre d'actions	Devise action	VNI par action en devise de la classe d'action	Actifs nets par classe d'action (en EUR)
R Acc	767.295,397	EUR	78,85	60.500.606,44
I Acc	29.475,521	EUR	78,15	2.303.478,65
				62.804.085,09

Les notes annexées font partie intégrante de ces états financiers.

## FFG - Cleantech II

### Statistiques (en EUR)

au 30 juin 2022

<b>Total de l'actif net</b>	<b>Devise</b>	<b>31.12.2021</b>	<b>30.06.2022</b>
	EUR	80.492.719,14	62.804.085,09

  

<b>VNI par classe d'action</b>	<b>Devise</b>	<b>31.12.2021</b>	<b>30.06.2022</b>
R Acc	EUR	100,04	78,85
I Acc	EUR	98,89	78,15

  

<b>Nombre d'actions</b>	<b>en circulation au début de la période</b>	<b>émises</b>	<b>remboursées</b>	<b>en circulation en fin de la période</b>
R Acc	795.834,901	161.110,182	-189.649,686	767.295,397
I Acc	8.889,941	24.499,560	-3.913,980	29.475,521



## FFG - Cleantech II

### Etat du portefeuille-titres et des autres actifs nets (en EUR) au 30 juin 2022

Devise	Valeur nominale/ Quantité	Dénomination	Coût d'acquisition	Valeur d'évaluation	% de l'actif net *
<b>Portefeuille-titres</b>					
<b>Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs</b>					
<b>Actions</b>					
CHF	12.990	Gurit Holding AG Partizsch	2.272.687,91	1.316.253,83	2,10
CHF	976	LEM Holding SA	2.129.959,47	1.778.964,14	2,83
			4.402.647,38	3.095.217,97	4,93
EUR	71.914	Aalberts NV	3.656.307,32	2.674.481,66	4,26
EUR	95.000	Aixtron SE Reg	1.946.581,21	2.297.100,00	3,66
EUR	58.691	Andritz AG	2.855.904,06	2.256.082,04	3,59
EUR	95.103	Arcadis NV	3.990.521,88	3.052.806,30	4,86
EUR	18.000	Dredging Env & Marine Engineer	2.029.242,89	1.890.000,00	3,01
EUR	34.415	Kerry Group Plc A	4.183.140,81	3.143.466,10	5,01
EUR	43.755	Kingspan Group	4.081.553,20	2.511.537,00	4,00
EUR	40.689	Knorr Bremse AG Bearer	3.813.757,85	2.214.295,38	3,53
EUR	14.180	Koninklijke DSM NV	2.411.225,03	1.944.078,00	3,10
EUR	38.447	Legrand Holding SA	3.629.641,64	2.708.975,62	4,31
EUR	22.707	Mayr-Melnhof Karton AG Bearer	4.028.658,14	3.678.534,00	5,86
EUR	41.427	Melexis NV	3.923.856,26	2.835.678,15	4,51
EUR	65.048	Neste Corporation	3.163.877,54	2.747.627,52	4,37
EUR	67.000	Signify NV	3.128.242,80	2.119.210,00	3,37
EUR	36.409	Steico SE	4.171.817,40	2.457.607,50	3,91
EUR	59.531	Umicore SA	3.255.816,60	1.983.572,92	3,16
			54.270.144,63	40.515.052,19	64,51
GBP	23.280	Croda International Plc Reg	2.445.399,76	1.749.608,80	2,79
GBP	40.000	Intertek Group Plc	2.212.206,98	1.953.658,85	3,11
			4.657.606,74	3.703.267,65	5,90
SEK	90.000	Alfa Laval AB	2.888.405,00	2.071.440,60	3,30
SEK	130.000	Lindab Intl AB	3.365.571,68	1.799.373,86	2,86
			6.253.976,68	3.870.814,46	6,16
USD	55.000	LKQ Corp	2.366.976,38	2.581.214,15	4,11
USD	29.478	Waste Management Inc	3.873.380,98	4.311.227,95	6,86
			6.240.357,36	6.892.442,10	10,97
Total portefeuille-titres			75.824.732,79	58.076.794,37	92,47
Avoirs bancaires				4.272.618,77	6,80
Autres actifs/(passifs) nets				454.671,95	0,73
Total				62.804.085,09	100,00

\* Des différences mineures peuvent apparaître résultant des arrondis lors du calcul des pourcentages.

Les notes annexées font partie intégrante de ces états financiers.

## FFG - Cleantech II

### Répartition économique et géographique du portefeuille-titres au 30 juin 2022

#### Répartition économique

(en pourcentage de l'actif net)

Industrie	49,89 %
Matières premières	17,82 %
Technologies	8,17 %
Biens de consommation non-cyclique	8,11 %
Energie	4,37 %
Biens de consommation durable	4,11 %
Total	<u>92,47 %</u>

#### Répartition géographique

(par pays de résidence de l'émetteur)  
(en pourcentage de l'actif net)

Pays-Bas	15,59 %
Allemagne	11,10 %
Etats-Unis d'Amérique	10,97 %
Belgique	10,68 %
Autriche	9,45 %
Irlande	9,01 %
Suède	6,16 %
Royaume-Uni	5,90 %
Suisse	4,93 %
Finlande	4,37 %
France	4,31 %
Total	<u>92,47 %</u>

**Note 1 - Informations générales**

FFG est une Société d'Investissement à Capital Variable ("SICAV") à compartiments multiples de droit luxembourgeois, soumise à la Partie I de la loi du 17 décembre 2010 concernant les organismes de placement collectif, telle que modifiée ("Loi de 2010"). La SICAV a été créée pour une durée illimitée en date du 23 décembre 2016.

La SICAV publie chaque année un rapport annuel au 31 décembre révisé par l'auditeur et un rapport semestriel non révisé au 30 juin.

La devise de globalisation est l'Euro.

Les documents suivants sont tenus à disposition du public au siège social de la SICAV et au siège social de la Société de Gestion :

- le Prospectus de la SICAV, comprenant les fiches signalétiques,
- les Statuts,
- les Informations Clés de la SICAV (également publiées sur le site <https://www.waystone.com>),
- les rapports financiers de la SICAV.

**Note 2 - Principales méthodes comptables**

## a) Présentation des états financiers

Les états financiers de la SICAV sont établis conformément aux prescriptions légales et réglementaires en vigueur au Luxembourg relatives aux Organismes de Placement Collectif et aux principales méthodes comptables généralement admises au Luxembourg.

Les états financiers de la SICAV ont été préparés selon le principe de la continuité d'exploitation.

## b) Evaluation des actifs

1. La valeur des espèces en caisse ou en dépôt, effets et billets payables à vue et comptes à recevoir, des dépenses payées d'avance, des dividendes et intérêts annoncés ou venus à échéance non encore touchés, sera constituée par la valeur nominale de ces avoirs, sauf toutefois s'il s'avère improbable que cette valeur puisse être touchée entièrement ; dans ce dernier cas, la valeur sera déterminée en retranchant un certain montant qui semblera adéquat à la SICAV en vue de refléter la valeur réelle de ces avoirs.
2. La valeur de toutes valeurs mobilières et/ou instruments du marché monétaire et/ou de tout instrument financier dérivé qui sont négociés ou cotés sur une bourse sera déterminée suivant le dernier prix disponible.
3. La valeur de toutes valeurs mobilières et/ou instruments du marché monétaire et/ou de tout instrument financier dérivé qui sont négociés sur un marché réglementé est basée sur le dernier prix disponible.
4. Dans la mesure où des valeurs mobilières en portefeuille le jour en question ne sont pas négociées ou cotées sur une bourse ou un marché réglementé ou si pour des valeurs cotées ou négociées sur une bourse ou un marché réglementé le prix déterminé conformément au sous-paragraphe 2. ou 3. n'est pas représentatif de la valeur réelle de ces valeurs mobilières, celles-ci seront évaluées sur base de la valeur probable de réalisation laquelle doit être estimée avec prudence et bonne foi.
5. La valeur des instruments financiers dérivés qui ne sont pas cotés sur une bourse de valeurs ou négociés sur un autre marché organisé sera déterminée quotidiennement d'une manière fiable et vérifiée par un professionnel compétent nommé par la SICAV conformément à la pratique du marché.

6. Les actions ou parts de fonds d'investissement sous-jacents de type ouvert seront évaluées à leurs dernières valeurs nettes d'inventaire disponibles, réduites éventuellement des commissions applicables.
7. La valeur des instruments du marché monétaire qui ne sont pas cotés sur une bourse de valeurs ou négociés sur un autre marché organisé sera basée sur la valeur nominale plus tous les intérêts capitalisés ou sur base d'amortissement des coûts.
8. Dans l'hypothèse où les méthodes de calcul susmentionnées sont inappropriées ou trompeuses, le Conseil d'Administration peut adopter tout autre principe d'évaluation appropriée pour les avoirs de la SICAV.
9. Dans les circonstances où les intérêts de la SICAV ou de ses actionnaires le justifient (notamment pour éviter les pratiques de *market timing*), le Conseil d'Administration peut prendre toutes autres mesures appropriées, telles qu'appliquer une méthodologie d'évaluation d'une valeur juste pour ajuster la valeur des avoirs de la SICAV.

c) Coût d'acquisition des titres en portefeuille

Le coût d'acquisition des titres de chaque compartiment libellé en devises autres que la devise du compartiment est converti dans cette devise au cours de change en vigueur au jour de l'achat.

d) Bénéfice/(perte) net(te) réalisé(e) sur portefeuille-titres

Les bénéfices et pertes réalisés sur portefeuille-titres sont calculés sur base du coût moyen d'acquisition.

e) Revenus sur portefeuille-titres

Les dividendes sont enregistrés à la date de détachement ("*ex-date*"), nets de retenue à la source éventuelle.

Les revenus d'intérêts courus et échus sont enregistrés, nets de retenue à la source éventuelle.

f) Evaluation des contrats de futures

Les contrats de futures ouverts sont évalués à leur dernier cours de règlement ("*settlement Price*") ou cours de clôture aux bourses de valeurs ou marchés règlementés. Les plus- ou moins-values non réalisées des contrats ouverts sont présentées dans l'état du patrimoine

g) Evaluation des contrats de change à terme

Les contrats de change à terme ouverts sont évalués aux cours de change à terme pour la période restante à partir de la date d'évaluation jusqu'à l'échéance des contrats. Les plus- ou moins-values nettes non réalisées des contrats ouverts sont présentées dans l'état du patrimoine.

h) Frais d'établissement

Les frais d'établissement sont amortis linéairement sur une période de cinq ans.

Si le lancement d'un compartiment intervient après la date de lancement de la SICAV, les frais d'établissement en relation avec le lancement du nouveau compartiment seront imputés à ce seul compartiment et pourront être amortis sur un maximum de cinq ans à partir de la date de lancement de ce compartiment.

i) Conversion des devises étrangères

Les avoirs bancaires, les autres actifs nets ainsi que la valeur d'évaluation des titres en portefeuille exprimés en d'autres devises que la devise de référence du compartiment sont convertis dans cette devise aux cours de change en vigueur à la date des états financiers. Les revenus et charges exprimés en d'autres devises

## FFG

### Notes aux états financiers (suite)

au 30 juin 2022

que la devise de référence du compartiment sont convertis dans cette devise aux cours de change en vigueur à la date d'opération.

A la date des états financiers, les cours de change utilisés sont les suivants :

1	EUR	=	1,3494446	CAD	Dollar canadien
			1,0007082	CHF	Franc suisse
			7,0092460	CNY	Yuan Renminbi Chinois
			7,4376876	DKK	Couronne danoise
			0,8611534	GBP	Livre anglaise
			8,2083281	HKD	Dollar de Hong Kong
			15.582,8677832	IDR	Rupiah indonésienne
			142,0520326	JPY	Yen japonais
			1.357,5617878	KRW	Won sud coréen
			21,1040437	MXN	Peso mexicain
			10,3329110	NOK	Couronne norvégienne
			10,7142826	SEK	Couronne suédoise
			1,4559797	SGD	Dollar de Singapour
			36,9865600	THB	Baht thaïlandais
			31,1143164	TWD	Nouveau dollar taïwanais
			1,0460000	USD	Dollar américain

#### j) Etats financiers globalisés

Les états financiers globalisés de la SICAV sont établis en EUR et sont égaux à la somme des rubriques correspondantes dans les états financiers de chaque compartiment.

#### k) Autres créances / Autres dettes

Pour le compartiment FFG - European Equities Sustainable Moderate, les rubriques "Autres créances"/ "Autres dettes" figurant dans l'état du patrimoine comprennent les comptes de marge sur les contrats de futures reflétant les variations de marge quotidiennes.

### Note 3 - Commissions de gestion et de distribution et commission de Sur-performance

Pour le compartiment FFG - European Equities Sustainable Moderate :

La SICAV a nommé WAYSTONE MANAGEMENT COMPANY (LUX) S.A. (anciennement MDO MANAGEMENT COMPANY S.A.) en tant que Société de Gestion pour lui rendre des services de gestion, d'administration et de commercialisation. La Société de Gestion est agréée comme Société de Gestion suivant les dispositions du chapitre 15 de la Loi de 2010.

La Société de Gestion reçoit une commission de société de gestion de maximum 0,05 % p.a. basée sur l'actif net moyen du compartiment avec un minimum n'excédant pas EUR 10.000.

La Société de Gestion a nommé ACADIAN ASSET MANAGEMENT LLC comme gestionnaire pour fournir des services de gestion de portefeuille.

La Société de Gestion a nommé FUNDS FOR GOOD S.A. comme coordinateur de distribution. A ce titre, le coordinateur de distribution aura pour tâche de nommer un ou plusieurs distributeurs en vue de placer les actions des compartiments de la SICAV.

La Commission de Gestion et de Distribution est payée respectivement au Gestionnaire et au Coordinateur de Distribution par la SICAV. La Commission de Gestion et de Distribution est différente suivant la classe d'actions à laquelle elle s'applique.

La commission de Gestion comporte des frais de sur-performance. La commission de sur-performance rémunère le Gestionnaire dans le cas où la performance de sa couverture contre les risques du marché est supérieure à celle qui aurait été générée par une couverture fixe de 70 % de l'exposition au Compartiment Maître, via des futures. La rémunération sera calculée de la manière suivante :

1. Pour chaque année sociale durant laquelle la performance de la classe d'actions excède celle du Benchmark composite (30% EMIX + 70 % GETB1 + Alpha EES\*poids EES) (le « Benchmark de Référence ») correspondant à une couverture fixe dont la performance équivaut à 70 % sur l'indice EMIX World Europe NTR Index, exprimée en pourcentage (la "Sur-performance"), une commission de 15 % de la Sur-performance calculée sur les actifs nets du jour avant déduction de la commission de performance, est due dans les conditions déterminées au paragraphe 2. La Sur-performance est la différence (positive) entre la performance (positive ou négative) de la classe d'actions et la performance (positive ou négative) du Benchmark de Référence sur l'année considérée. Une provision sera constituée au titre de cette commission de performance chaque Jour d'Evaluation. Si le cumul de performance est négatif durant cette période, aucune commission de Sur-performance ne sera exigible.

2. La commission de Sur-performance n'est due que dans l'hypothèse où (1) la performance de la classe d'actions excède la performance du Benchmark de Référence sur l'année, et (2) en cas de Sur-performance négative à la fin de l'année sociale, cette Sur-performance négative sera reconduite à la période de calcul suivante (Principe "High Watermark"). Dans l'hypothèse où la performance de la classe d'actions n'excède pas le Benchmark de Référence, aucune commission de performance n'est appliquée.

3. L'attention des investisseurs est attirée sur le fait que la commission de Sur-performance est soumise au principe de cristallisation. Lorsqu'un rachat d'actions est effectué à une autre date que celle à laquelle une commission de Sur-performance est versée et qu'une provision a été constituée au titre de commission de Sur-performance, le montant de commission de Sur-performance provisionnée imputable aux actions rachetées sera considérée comme acquise au Gestionnaire et payée à la fin de l'année concernée. En cas de souscription, le calcul de la commission de performance est ajusté afin d'éviter que cette souscription n'ait un impact sur le montant des provisions de commissions de performance. Aux fins de cet ajustement, le montant relatif à la souscription est retiré du calcul de la Sur-performance pour le jour considéré. La provision effectuée au titre de la commission de Sur-performance sera diminuée de 15 % de la Sur-performance déterminée le Jour d'Evaluation sur lequel les souscriptions ont été décomptées, multiplié par le nombre d'actions souscrites.

A la date des états financiers, aucune commission de Sur-performance n'a été enregistrée dans le compartiment FFG - European Equities Sustainable Moderate.

Les frais présentés ci-dessous englobent les frais de Gestion et de Distribution du Compartiment Maître.

Actions de la classe R Dis et R Acc :

Max. 1,5 % p.a. calculé trimestriellement et basée sur l'actif net moyen de la classe d'actions concernée + frais de sur-performance.

Actions de la classe I Acc :

Max. 0,95 % p.a. calculé trimestriellement et basée sur l'actif net moyen de la classe d'actions concernée + frais de sur-performance.

Pour le compartiment FFG - Global Flexible Sustainable :

La SICAV a nommé WAYSTONE MANAGEMENT COMPANY (LUX) S.A. (anciennement MDO MANAGEMENT COMPANY S.A.) en tant que Société de Gestion pour lui rendre des services de gestion, d'administration et de commercialisation. La Société de Gestion est agréée comme Société de Gestion suivant les dispositions du chapitre 15 de la Loi de 2010.

## FFG

### Notes aux états financiers (suite)

au 30 juin 2022

La Société de Gestion reçoit une commission de société de gestion de maximum 0,05 % p.a. basée sur l'actif net moyen du compartiment avec un minimum n'excédant pas EUR 10.000.

La Société de Gestion a nommé BLI - BANQUE DE LUXEMBOURG INVESTMENTS S.A. comme gestionnaire pour fournir des services de gestion de portefeuille.

La Société de Gestion a nommé FUNDS FOR GOOD S.A. coordinateur de distribution. A ce titre, le coordinateur de distribution aura pour tâche de nommer un ou plusieurs distributeurs en vue de placer les actions des compartiments de la SICAV

La Commission de Gestion et de Distribution est payée respectivement au gestionnaire et au Coordinateur de Distribution par la SICAV. La Commission de Gestion et de Distribution est différente suivant la classe d'actions à laquelle elle s'applique.

#### Actions de la classe R Dis et R Acc :

Max. 1,30 % p.a. calculée trimestriellement et basée sur l'actif net moyen de la classe d'actions concernée.

#### Actions de la classe I Acc :

Max. 0,65 % p.a. calculée trimestriellement et basée sur l'actif net moyen de la classe d'actions concernée.

#### Actions de la classe C Acc et C Dis :

Max 0,95 % p.a. calculée trimestriellement et basée sur l'actif net moyen de la classe d'action concernée.

#### Actions de la classe F Acc :

Max. 0,55 % p.a. calculée trimestriellement et basée sur l'actif net moyen de la classe d'action concernée.

#### Actions de la classe S Dis et S Acc :

Max 0,80 % p.a. calculée trimestriellement et basée sur l'actif net moyen de la classe d'action concernée. La période de souscription pour ces actions prendra fin lorsque la somme de sa valeur nette d'inventaire et la valeur nette d'inventaire de la classe d'actions « S Acc » et « S Dis » atteindra ou dépassera 50 millions d'euros ou à tout autre date laissés à la discrétion du Conseil d'Administration.

#### Pour le compartiment FFG - European Equities Sustainable:

La SICAV a nommé WAYSTONE MANAGEMENT COMPANY (LUX) S.A. (anciennement MDO MANAGEMENT COMPANY S.A.) en tant que Société de Gestion pour lui rendre des services de gestion, d'administration et de commercialisation. La Société de Gestion est agréée comme Société de Gestion suivant les dispositions du chapitre 15 de la Loi de 2010.

La Société de Gestion reçoit une commission de société de gestion de maximum 0,05 % p.a. basée sur l'actif net moyen du compartiment avec un minimum n'excédant pas EUR 10.000.

La Société de Gestion a nommé ACADIAN ASSET MANAGEMENT LLC comme gestionnaire pour fournir des services de gestion de portefeuille.

La Société de Gestion a nommé FUNDS FOR GOOD S.A. coordinateur de distribution. A ce titre, le coordinateur de distribution aura pour tâche de nommer un ou plusieurs distributeurs en vue de placer les actions des compartiments de la SICAV.

## FFG

### Notes aux états financiers (suite)

au 30 juin 2022

La Commission de Gestion et de Distribution est payée respectivement au Gestionnaire et au Coordinateur de Distribution par la SICAV. La Commission de Gestion et de Distribution est différente suivant la classe d'actions à laquelle elle s'applique.

Actions de la classe R Dis et R Acc :

1,50 % p.a. calculée trimestriellement et basée sur l'actif net moyen de la classe d'actions concernée.

Actions de la classe I Acc :

0,75 % p.a. calculée trimestriellement et basée sur l'actif net moyen de la classe d'actions concernée.

Actions de la classe C Acc et C Dis :

1,10 % p.a. calculée trimestriellement et basée sur l'actif net moyen de la classe d'action concernée.

Actions de la classe F Acc :

0,625 % p.a. calculée trimestriellement et basée sur l'actif net moyen de la classe d'action concernée.

Pour le compartiment FFG - Cleantech II:

La SICAV a nommé WAYSTONE MANAGEMENT COMPANY (LUX) S.A. (anciennement MDO MANAGEMENT COMPANY S.A.) en tant que Société de Gestion pour lui rendre des services de gestion, d'administration et de commercialisation. La Société de Gestion est agréée comme Société de Gestion suivant les dispositions du chapitre 15 de la Loi de 2010.

La Société de Gestion reçoit une commission de société de gestion de maximum 0,05 % p.a. basée sur l'actif net moyen du compartiment avec un minimum n'excédant pas EUR 10.000.

La Société de Gestion a nommé CAPRICORN PARTNERS NV comme gestionnaire pour fournir des services de gestion de portefeuille.

La Société de Gestion a nommé FUNDS FOR GOOD S.A. coordinateur de distribution. A ce titre, le coordinateur de distribution aura pour tâche de nommer un ou plusieurs distributeurs en vue de placer les actions des compartiments de la SICAV.

La Commission de Gestion et de Distribution est payée respectivement au Gestionnaire et au Coordinateur de Distribution par la SICAV. La Commission de Gestion et de Distribution est différente suivant la classe d'actions à laquelle elle s'applique.

Actions de la classe R Acc :

Max. 1,60 % p.a. calculée trimestriellement et basée sur l'actif net moyen de la classe d'actions concernée.

Actions de la classe I Acc :

Max. 0,85 % p.a. calculée trimestriellement et basée sur l'actif net moyen de la classe d'actions concernée.

#### **Note 4 - Taxe d'abonnement**

La SICAV est régie par les lois luxembourgeoises.

En vertu de la législation et des règlements actuellement en vigueur, la SICAV est soumise à une taxe d'abonnement au taux annuel de 0,05 % de l'actif net, calculée et payable par trimestre sur base de l'actif net à la fin de chaque trimestre.



Conformément à l'article 175 a) de la loi modifiée du 17 décembre 2010, la partie des actifs nets investis en OPC déjà soumis à la taxe d'abonnement est exonérée de cette taxe.

Un taux réduit de 0,01 % est applicable aux actions des classes I Acc réservées à des investisseurs institutionnels.

**Note 5 - Taxe annuelle belge**

La réglementation belge (le Code des droits de succession, Livre II bis) impose aux Organismes de Placement Collectif autorisés à la commercialisation au public en Belgique le paiement d'une taxe annuelle. Cette taxe s'élève à 0,0925 % sur le total, au 31 décembre de l'année précédente, des montants nets placés en Belgique, à partir de leur inscription auprès de l'Autorité des Services et Marchés Financiers ("FSMA").

La SICAV paie la taxe au plus tard le 31 mars de chaque année.

Cette taxe est présentée sous la rubrique "Autres impôts" dans l'état des opérations et des autres variations de l'actif net.

**Note 6 - Changements dans la composition du portefeuille-titres**

La liste des changements intervenus dans la composition du portefeuille-titres pour la période de référence des états financiers peut être obtenue à titre gratuit au siège social de la SICAV.

**Note 7 - Structure Fonds Nourricier - Fonds Maître**

Le Compartiment FFG - European Equities Sustainable Moderate est un compartiment nourricier qui investit au moins 85% de ses actifs nets dans le compartiment FFG - European Equities Sustainable (le « Fonds Maître »), et plus précisément dans la classe I Acc. La performance du Compartiment peut différer de celle du Fonds Maître à cause (i) des frais supportés par le Compartiment, (ii) des avoirs liquides détenus et (iii) des techniques de couverture mis en place par le Compartiment.

A la date des états financiers, le pourcentage de participation de l'OPCVM Nourricier dans la part I Acc de l'OPCVM Maître FFG - European Equities Sustainable est de 50,28%.

A côté de son objectif financier, le Compartiment génère un impact social concret, par l'intermédiaire du Coordinateur de Distribution de la SICAV, dont l'approche est certifiée par Forum Ethibel. Après déduction de ses frais de fonctionnement, le Coordinateur de Distribution reverse le montant le plus important entre 50 % de ses bénéfices nets et 10 % de son chiffre d'affaires au projet social qu'il a lui-même mis en place et qu'il anime, « Funds For Good Impact ».

« Funds for Good Impact » consacre la totalité de ses moyens financiers à la lutte contre la pauvreté et à la création d'emploi, en allouant des prêts d'honneur et de l'accompagnement à des personnes précarisées ayant un projet d'entreprise, leur permettant ainsi de démarrer leur activité. Plus d'informations sont disponibles sur [www.fundsforgood.eu](http://www.fundsforgood.eu)

Le Compartiment investit au minimum 85 % de ses actifs nets dans le Fonds Maître. De manière accessoire et afin de limiter l'exposition du Compartiment aux risques des marchés d'actions, une couverture systématique de l'exposition action sera mise en place. La couverture limitera l'exposition du fonds au marché des actions à 50 % maximum. Les avoirs du portefeuille non investis dans le Fonds Maître ou dans les instruments de couverture seront conservés sous forme de liquidités dans le Compartiment.

## FFG

### Notes aux états financiers (suite)

au 30 juin 2022

#### Informations sur le Fonds Maître

Le Fonds Maître est un compartiment de la SICAV et est géré par la Société de Gestion, qui a nommé ACADIAN ASSET MANAGEMENT LLC en tant que gestionnaire. La Société de Gestion a mis en place des règles de conduite internes (les « Règles de Conduite ») décrivant, entre autres, la coordination de la fréquence et du moment de calcul de la VNI et la publication du prix des actions, la coordination de la transmission des ordres de souscription, de rachat et de conversion du Compartiment et des événements ayant un impact sur les opérations de souscription, de rachat ou de conversion. Des informations sur les Règles de Conduite sont disponibles à la demande auprès de la Société de Gestion.

Le Prospectus (y inclus sa fiche signalétique relative au Fonds Maître), le KIID et les rapports annuels et semi-annuels du Fonds Maître les plus récents sont disponibles à la demande au siège de la Société de Gestion et sur le site internet suivant : <https://www.waystone.com>. L'objectif d'investissement et les caractéristiques principales du Fonds Maître sont décrites plus en détail ci-dessous.

#### Note 8 - Investissements croisés

Conformément à l'article 181 (8) de la Loi modifiée du 17 décembre 2010 relative aux Organismes de Placement Collectif, le compartiment FFG - European Equities Sustainable Moderate a investi dans le compartiment suivant au 30 juin 2022 :

Compartiment	Désignation	Devise	Nombre	Valeur d'évaluation	en % de l'actif net
FFG - European Equities Sustainable Moderate	FFG European Equity Sustain I C	EUR	280.200	33.057.996,00	89,76 %

L'état globalisé du patrimoine n'a pas été ajusté pour neutraliser l'impact de ce qui précède. L'actif net globalisé au 30 juin 2022 tel que corrigé sans le montant de l'investissement croisé s'élève à EUR 450.401.348,94.

Les commissions sur souscription et rachat ne sont pas appliquées sur la valeur nette d'inventaire du compartiment ci-dessus.

#### Note 9 - Valorisation de titre détenu par le compartiment FFG – European Equities Sustainable

La valorisation à 0 au 31 décembre 2021 de la position NMCN Plc Reg détenue dans le compartiment FFG – European Equities Sustainable a été approuvée par le Board qui s'est tenu le 28 janvier 2022 et confirmée par le Board du 20 avril 2022.

Cette décision se base sur une analyse effectuée par ACADIAN ASSET MANAGEMENT LLC qui, compte tenu du rapport des administrateurs nommés par la société, Grand Thornton, suggère que la liquidation n'entraînera probablement aucune valeur pour les actionnaires.

#### Note 10 - Contrats de changes à terme

A la date des états financiers, les compartiments ci-dessous sont engagé auprès de BANQUE DE LUXEMBOURG dans les contrats de change à terme suivants :

##### FFG - European Equities Sustainable Moderate

Devise	Achats	Devise	Ventes	Echéance	Résultat non réalisé (en EUR)
CHF	273.047,00	EUR	261.112,59	21.07.2022	11.712,42
CHF	308.744,00	EUR	306.264,48	21.07.2022	2.227,30
CHF	411.826,00	EUR	405.543,72	21.07.2022	5.946,18

## FFG

### Notes aux états financiers (suite) au 30 juin 2022

Devise	Achats	Devise	Ventes	Echéance	Résultat non réalisé (en EUR)
CHF	226.160,00	EUR	226.298,04	21.07.2022	-323,00
EUR	197.898,04	CHF	206.526,00	21.07.2022	-8.460,01
EUR	273.859,59	SEK	2.879.773,00	21.07.2022	5.228,65
EUR	33.884,94	SEK	363.573,00	21.07.2022	-30,24
GBP	95.911,00	EUR	111.572,03	21.07.2022	-293,69
GBP	111.731,00	EUR	131.136,29	21.07.2022	-1.504,19
GBP	483.244,00	EUR	562.514,04	21.07.2022	-1.842,55
GBP	91.766,00	EUR	106.909,64	21.07.2022	-440,57
GBP	979.759,00	EUR	1.143.385,46	21.07.2022	-6.647,67
NOK	1.270.570,00	EUR	125.171,18	21.07.2022	-2.312,96
NOK	68.186,00	EUR	6.477,68	21.07.2022	115,79
SEK	424.321,00	EUR	40.295,55	21.07.2022	-714,02
SEK	975.410,00	EUR	91.201,57	21.07.2022	-212,55
					2.448,89

#### FFG - Global Flexible Sustainable

Devise	Achats	Devise	Ventes	Echéance	Résultat non réalisé (en EUR)
EUR	18.884.564,32	USD	20.000.000,00	02.08.2022	-199.977,79
EUR	23.680.072,75	USD	25.000.000,00	10.08.2022	-161.343,83
					-361.321,62

En vertu des dispositions de l'*European Market Infrastructure Regulation* "EMIR" visant à atténuer le risque de contrepartie pour les contreparties financières contractant des instruments financiers dérivés négociés de gré à gré (p. ex. des contrats de change à terme et des opérations de swap de change), les instruments financiers dérivés négociés de gré à gré contractés par la SICAV auprès de la BANQUE DE LUXEMBOURG (p. ex. contrats de change à terme et opérations de swap de change) sont soumis à des variations de marge quotidiennes. En fonction de la valorisation des instruments financiers dérivés négociés de gré à gré, les variations de marge sont soit versées, soit perçues par la SICAV. Les variations de marge sont versées ou perçues au comptant dans la devise de référence du compartiment et sont soumises à un seuil minimum et à un montant minimum de transfert.

Pour réduire le risque de contrepartie sur l'exposition en contrats de changes à terme :

- BANQUE DE LUXEMBOURG S.A. paie du collatéral en espèces si le résultat non réalisé est positif : le collatéral en espèces ainsi reçu est enregistré dans le poste "Avoirs bancaires" de l'Etat du Patrimoine. Le montant reçu et à rembourser à la BANQUE DE LUXEMBOURG S.A. est renseigné dans le poste "Garantie en espèces reçue à rembourser",

- BANQUE DE LUXEMBOURG S.A. reçoit du collatéral en espèces si le résultat non réalisé est négatif : le collatéral en espèces ainsi payé est débité du poste "Avoirs bancaires" de l'Etat du Patrimoine. Le montant payé et à recevoir par la SICAV de la part de BANQUE DE LUXEMBOURG S.A. est renseigné dans le poste "A recevoir sur garantie en espèces payée".

## FFG

### Notes aux états financiers (suite)

au 30 juin 2022

#### Note 11 - Contrats de futures

A la date des états financiers, les compartiments ci-dessous sont engagé dans les contrats futures suivants :

##### FFG - European Equities Sustainable Moderate

	Quantité	Dénomination	Devise	Exposition (en EUR)	Résultat non réalisé (en EUR)
Vente	3	AEX Index FUT 07/22 EOE	EUR	-395.382,00	-570,00
Vente	14	CAC 40 Index FUT 07/22 MONEP	EUR	-827.960,00	9.200,00
Vente	12	DAX Germany Index FUT 09/22 EUX	EUR	-766.260,00	32.190,00
Vente	1	FTSE MIB Index FUT 09/22 MIL	EUR	-106.040,00	3.385,00
Vente	2	IBEX 35 Index FUT 07/22 MEFF	EUR	-160.792,00	1.138,00
Vente	870	MSCI Europe NR EUR Index FUT 09/22 EUX	EUR	-22.084.950,00	87.996,30
Vente	8	FTSE 100 Index FUT 09/22 ICE	GBP	-661.531,37	1.701,21
Vente	17	OMX Stockholm 30 Index FUT 07/22 OMX	SEK	-296.786,09	2.596,53
					<u>137.637,04</u>

##### FFG - Global Flexible Sustainable

	Quantité	Dénomination	Devise	Exposition (en EUR)	Résultat non réalisé (en EUR)
Vente	135	SWISS MARKET INDEX FUT 09/22 EUX	CHF	-14.417.239,71	-311.901,85
Vente	1.000	Euro Stoxx 50 EUR (Price) Index FUT 09/22 EUX	EUR	-34.410.000,00	820.000,00
Vente	220	S&P 500 Index FUT 09/22 CME	USD	-39.851.338,43	1.164.149,14
					<u>1.672.247,29</u>

A la date des états financiers, les compartiments FFG - European Equities Sustainable Moderate et FFG - Global Flexible Sustainable ont déposé des actifs en garantie, présentés dans la rubrique "Dépôts de garantie sur futures", en faveur de BANQUE DE LUXEMBOURG S.A..

#### Note 12 - Evénements

Il n'y a pas d'événements significatifs.

#### Note 13 - Evénements subséquents

Il n'y a pas d'événements subséquents significatifs.

**Informations concernant la transparence des opérations de financement sur titres et de la réutilisation du collatéral cash (règlement UE 2015/2365, ci-après "SFTR")**

Durant la période de référence des états financiers, la SICAV n'a pas été engagée dans des opérations sujettes aux exigences de publications SFTR. En conséquence, aucune information concernant la transparence des opérations de financement sur titres et de la réutilisation du collatéral cash ne doit être présentée.