

# **Halbjahresbericht**

## **Lupus alpha Dynamic Return**

**zum 30.06.2024**

Lupus alpha

# Halbjahresbericht für Lupus alpha Dynamic Return

## Vermögensübersicht zum 30.06.2024

### Anlageschwerpunkte

Tagswert in EUR    % Anteil am Fondsvermögen <sup>1)</sup>

### Vermögensgegenstände

<b>Renten</b>	<b>16.338.887,00</b>	<b>78,15</b>
Belgien	675.115,00	3,23
Bundesrepublik Deutschland	6.097.535,00	29,17
Frankreich	6.425.190,00	30,73
Niederlande	2.261.306,00	10,81
Kanada	879.741,00	4,21
<b>Devisentermingeschäfte</b>	<b>6.283,92</b>	<b>0,03</b>
<b>Futures</b>	<b>48.239,08</b>	<b>0,23</b>
<b>Optionen</b>	<b>2.404.828,13</b>	<b>11,53</b>
<b>Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b>	<b>2.205.275,24</b>	<b>10,54</b>
<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>	<b>87.831,69</b>	<b>0,42</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>	<b>-188.940,41</b>	<b>-0,90</b>
<b>Fondsvermögen</b>	<b>20.902.404,65</b>	<b>100,00</b>

<sup>1)</sup> Durch Rundung der Prozent-Anteile bei der Berechnung können geringfügige Differenzen entstanden sein.

# Halbjahresbericht für Lupus alpha Dynamic Return

## Vermögensaufstellung zum 30.06.2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1000	Bestand 30.06.2024	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens <sup>1)</sup>	
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>										
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>										
0,3750 % ACHMEA BANK 17/24 MTN	XS1722558258		EUR	900	0	0	%	98,726	888.534,00	4,25
0,6250 % ALBERTA 18/25 MTN	XS1808478710		EUR	900	900	0	%	97,749	879.741,00	4,21
0,1250 % AXA BANK EU. 20/24 MTN	FR0013499977		EUR	1.000	0	0	%	99,125	991.250,00	4,74
0,2500 % BAY.LDSBK MTH 19/25	DE000BLB6JG6		EUR	613	613	0	%	98,200	601.966,00	2,88
0,3750 % BERLIN HYP AG PF S200	DE000BHY0MQ1		EUR	500	500	0	%	97,973	489.865,00	2,34
0,5000 % BERLIN, LAND LSA15/25A459	DE000A13R6Z9		EUR	1.000	1.000	0	%	98,199	981.990,00	4,70
0,6250 % BNP PAR.FORTIS 18-25 MTN	BE0002614924		EUR	700	700	0	%	96,445	675.115,00	3,23
0,3750 % BNP PAR.H.L.SFH 15/25 MTN	FR0012716371		EUR	1.000	0	0	%	97,359	973.590,00	4,66
0,3980 % BPCE SFH 15-25 MTN	FR0012695716		EUR	500	500	0	%	97,550	487.750,00	2,33
4,0000 % CA HOME LOAN SFH 10/25MTN	FR0010920900		EUR	1.000	1.000	0	%	100,543	1.005.430,00	4,80
0,5000 % CIE F.FONCIER 16/24 MTN	FR0013162302		EUR	1.000	0	0	%	99,453	994.530,00	4,76
0,6250 % CM HOME LOAN SFH 17/25MTN	FR0013236247		EUR	1.000	0	0	%	98,240	982.400,00	4,70
1,2500 % DEXIA SA 14/24 MTN	XS1143093976		EUR	1.000	1.000	0	%	99,024	990.240,00	4,74
0,0100 % DT.PFBR.BANK PF.R.15292	DE000A2YNVN8		EUR	500	500	0	%	95,160	475.800,00	2,28
0,0100 % LB.HESS.-THR. 20/25	XS2106576494		EUR	1.000	1.000	0	%	98,039	980.390,00	4,69
0,2500 % LBBW MTN.HYP.18/25	DE000LB1M2X2		EUR	800	0	0	%	98,268	786.144,00	3,76
2,7500 % LBBW MTN OPF 22/24	DE000LB381U7		EUR	800	0	0	%	99,750	798.000,00	3,82
0,5000 % NAT.-NEDERL.BANK 17/24MTN	NL0012650477		EUR	800	800	0	%	99,124	792.992,00	3,79
0,6250 % NAT.-NEDERL.BANK 18/25MTN	NL0013019375		EUR	600	600	0	%	96,630	579.780,00	2,77
0,5000 % RHEINL.PF.SCHATZ.V.2015	DE000RLP0645		EUR	1.000	0	0	%	98,338	983.380,00	4,70
<b>Summe Verzinsliche Wertpapiere</b>							<b>EUR</b>	<b>16.338.887,00</b>	<b>78,15</b>	
<b>Summe Börsengehandelte Wertpapiere</b>							<b>EUR</b>	<b>16.338.887,00</b>	<b>78,15</b>	
<b>Summe Wertpapiervermögen</b>							<b>EUR</b>	<b>16.338.887,00</b>	<b>78,15</b>	
<b>Derivate</b>										
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um <b>verkaufte</b> Positionen)										
<b>Derivate auf einzelne Wertpapiere</b>										
<b>Wertpapier-Optionsrechte</b>										
Forderungen/ Verbindlichkeiten										
<b>Optionsrechte auf Aktien</b>										
Abbott Laboratories 95,000 25.01.17 C	CABTC0095A25	681	STK	800			USD	13,150	9.815,26	0,05

<sup>1)</sup> Durch Rundung der Prozent-Anteile bei der Berechnung können geringfügige Differenzen entstanden sein.

# Halbjahresbericht für Lupus alpha Dynamic Return

## Vermögensaufstellung zum 30.06.2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw.	Bestand	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens <sup>1)</sup>	
			Anteile bzw. Whg. in 1000							30.06.2024
AbbVie Inc 135,000 25.01.17 C	CABVC0135A25	681	STK	600			USD	38,325	21.454,56	0,10
Accenture PLC 310,000 25.01.17 C	CACNC0310A25	681	STK	300			USD	22,500	6.297,82	0,03
Adobe Inc 540,000 25.01.17 C	CADEC0540A25	681	STK	100			USD	67,425	6.290,82	0,03
Advanced Micro Devices Inc 120,000 25.01.17 C	CAMDC0120A25	681	STK	600			USD	49,875	27.920,32	0,13
Alamos Gold Inc 12,500 25.01.17 C	CAGIC0125A25	NAM	STK	6.400			USD	3,800	22.690,80	0,11
Allianz SE 220,000 24.12.20 C	DE000C6NQ798	EDT	STK	300			EUR	46,220	13.866,00	0,07
Alphabet Inc 125,000 24.12.20 C	CGOLC0125L24	681	STK	600			USD	61,050	34.176,15	0,16
Amazon.com Inc 135,000 25.01.17 C	CAMNC0135A25	681	STK	600			USD	64,375	36.037,51	0,17
Apple Inc 175,000 24.12.20 C	CAALC0175L24	NAM	STK	400			USD	42,625	15.907,82	0,08
Aptiv PLC 77,500 25.01.17 C	CAPVC0775A25	681	STK	1.000			USD	5,300	4.944,95	0,02
ASML Holding N.V. 600,000 24.12.20 C	DE000F0HRPD4	EDT	STK	100			EUR	379,040	37.904,00	0,18
Bank of America Corp 30,000 25.01.17 C	CBACC0030A25	681	STK	2.700			USD	9,875	24.876,38	0,12
Berkshire Hathaway Inc 320,000 25.01.17 C	CBRBC0320A25	NAM	STK	200			USD	97,950	18.277,66	0,09
Broadcom Inc 1000,000 25.01.17 C	CAVOC1000A25	NAM	STK	100			USD	633,950	59.148,16	0,28
Caterpillar Inc 260,000 25.01.17 C	CCATC0260A25	681	STK	300			USD	81,500	22.812,09	0,11
Chevron Corp 135,000 25.01.17 C	CCVXC0135A25	681	STK	600			USD	24,700	13.827,21	0,07
Cisco Systems Inc 45,000 25.01.17 C	CCSOC0045A25	681	STK	1.800			USD	4,625	7.767,31	0,04
Coca-Cola Co/The 52,500 25.01.17 C	CKO0C0525A25	681	STK	1.500			USD	12,075	16.899,14	0,08
Comcast Corp 40,000 25.01.17 C	CCMAC0040A25	681	STK	2.000			USD	2,700	5.038,25	0,02
Costco Wholesale Corp 575,000 25.01.17 C	CCOTC0575A25	681	STK	100			USD	292,500	27.290,54	0,13
Eli Lilly & Co 510,000 25.01.17 C	CLLYC0510A25	681	STK	200			USD	411,500	76.786,71	0,37
Exxon Mobil Corp 92,500 25.01.17 C	CXOMC0925A25	681	STK	900			USD	24,150	20.278,97	0,10
Facebook Inc 310,000 25.01.17 C	CMEAC0310A25	681	STK	300			USD	206,325	57.750,98	0,28
Goldman Sachs Group Inc/The 340,000 25.01.17 C	CGS0C0340A25	681	STK	200			USD	120,450	22.476,21	0,11
Home Depot Inc/The 310,000 25.01.17 C	CHD0C0310A25	681	STK	300			USD	48,875	13.680,26	0,07
Intel Corp 40,000 25.01.17 C	CINCC0040A25	681	STK	1.900			USD	1,135	2.012,04	0,01
International Business Machine 145,000 25.01.17 C	CIBMC0145A25	681	STK	500			USD	32,000	14.928,16	0,07
Johnson & Johnson 140,000 25.01.17 C	CJNJC0140A25	681	STK	600			USD	12,225	6.843,63	0,03
JPMorgan Chase & Co 150,000 25.01.17 C	CJPMC0150A25	681	STK	500			USD	55,200	25.751,07	0,12
Linde plc 370,000 25.01.17 C	CLINC0370A25	NAX	STK	200			USD	81,450	15.198,73	0,07
LVMH SE 680,000 24.12.20 C	DE000F0GG6H2	EDT	STK	100			EUR	73,190	7.319,00	0,04
Marsh & McLennan Cos Inc 165,000 24.12.20 C	CMMCC0165L24	681	STK	500			USD	48,700	22.718,79	0,11
Mastercard Inc 380,000 25.01.17 C	CMA0C0380A25	681	STK	200			USD	76,800	14.331,03	0,07
McDonald's Corp 260,000 25.01.17 C	CMCDC0260A25	681	STK	300			USD	13,200	3.694,72	0,02
Merck & Co Inc 95,000 25.01.17 C	CMRKC0095A25	681	STK	800			USD	30,750	22.952,04	0,11
Microsoft Corp 335,000 24.12.20 C	CMSTC0335L24	NAM	STK	200			USD	121,500	22.672,14	0,11
Nestle SA 88,000 24.12.20 C	DE000C7H65W5	EDT	STK	800			CHF	6,390	5.307,14	0,03

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

# Halbjahresbericht für Lupus alpha Dynamic Return

## Vermögensaufstellung zum 30.06.2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1000	Bestand 30.06.2024	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens <sup>1)</sup>
Netflix Inc 440,000 25.01.17 C	CNFXC0440A25	681	STK	200			USD 253,550	47.312,93	0,23
Newmont Mining Corp 37,500 25.01.17 C	CNEMC0375A25	681	STK	2.100			USD 6,800	13.323,38	0,06
NextEra Energy Inc 55,000 25.01.17 C	CNEEC0055A25	681	STK	1.500			USD 17,550	24.561,49	0,12
Nike Inc 110,000 24.12.20 C	CNKEC0110L24	681	STK	700			USD 0,365	238,38	0,00
Nvidia Corp 43,000 24.12.20 C	CNVAC0043L24	681	STK	2.000			USD 81,900	152.827,02	0,73
Oracle Corp 92,500 25.01.17 C	CORLC0925A25	681	STK	800			USD 51,125	38.160,10	0,18
Procter & Gamble Co 130,000 25.01.17 C	CPG0C0130A25	681	STK	600			USD 37,225	20.838,78	0,10
Prologis Inc 115,000 25.01.17 C	CPLDC0115A25	NAM	STK	700			USD 8,700	5.682,03	0,03
QUALCOMM Inc 125,000 25.01.17 C	CQCMC0125A25	681	STK	600			USD 77,600	43.440,94	0,21
Rio Tinto PLC 65,000 25.01.17 C	CRIOC0065A25	681	STK	1.200			USD 5,150	5.766,00	0,03
Royal Dutch Shell PLC 27,000 24.12.20 C	DE000F0DSU46	EDT	STK	2.700			EUR 6,830	18.441,00	0,09
S&P Global Inc 390,000 25.01.17 C	CSPIC0390A25	NAX	STK	200			USD 72,750	13.575,29	0,06
Salesforce.com Inc 230,000 25.01.17 C	CCRMC0230A25	681	STK	300			USD 43,350	12.133,79	0,06
SAP SE 125,000 24.12.20 C	DE000C7L0YU8	EDT	STK	600			EUR 67,830	40.698,00	0,19
Schlumberger NV 47,500 25.01.17 C	CSLBC0475A25	681	STK	1.700			USD 4,675	7.415,10	0,04
Siemens AG 150,000 24.12.20 C	DE000F0G4Y25	EDT	STK	500			EUR 29,990	14.995,00	0,07
Southern Co/The 62,500 25.01.17 C	CSO0C0625A25	681	STK	1.300			USD 16,500	20.013,06	0,10
Tesla Motors Inc. 220,000 25.01.17 C	CTSAC0220A25	681	STK	400			USD 23,725	8.854,26	0,04
Texas Instruments Inc 150,000 25.01.17 C	CTXNC0150A25	681	STK	500			USD 48,200	22.485,54	0,11
Thermo Fisher Scientific Inc 470,000 25.01.17 C	CTMOC0470A25	681	STK	200			USD 103,900	19.387,95	0,09
Union Pacific Corp 210,000 25.01.17 C	CUNPC0210A25	681	STK	400			USD 27,100	10.113,83	0,05
United Parcel Service Inc 140,000 25.01.17 C	CUPSC0140A25	681	STK	600			USD 8,350	4.674,38	0,02
UnitedHealth Group Inc 460,000 25.01.17 C	CUNHC0460A25	681	STK	200			USD 72,625	13.551,97	0,06
Vinci SA 100,000 24.12.20 C	DE000C405QX7	EDT	STK	700			EUR 5,960	4.172,00	0,02
Visa Inc 230,000 25.01.17 C	CV00C0230A25	681	STK	300			USD 42,725	11.958,85	0,06
Wells Fargo & Co 45,000 25.01.17 C	CWFCC0045A25	681	STK	1.800			USD 15,825	26.576,79	0,13
<b>Summe Optionsrechte auf Aktien</b>							<b>EUR</b>	<b>1.389.142,23</b>	<b>6,67</b>
<b>Summe Wertpapier-Optionsrechte</b>							<b>EUR</b>	<b>1.389.142,23</b>	<b>6,67</b>
<b>Summe Derivate auf einzelne Wertpapiere</b>							<b>EUR</b>	<b>1.389.142,23</b>	<b>6,67</b>
<b>Aktienindex-Derivate</b>									
Forderungen/ Verbindlichkeiten									
<b>Aktienindex-Terminkontrakte</b>									
EURO STOXX 50 Sep24 - 20.09.2024	DE000C6XKBX4	EDT	EUR	61				1.810,00	0,01
S&P500 EMINI FUT Sep24 - 20.09.2024	FESUN2009I24	NAR	USD	54				46.429,08	0,22
<b>Summe Aktienindex-Terminkontrakte</b>							<b>EUR</b>	<b>48.239,08</b>	<b>0,23</b>

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

# Halbjahresbericht für Lupus alpha Dynamic Return

## Vermögensaufstellung zum 30.06.2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1000	Bestand 30.06.2024	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens <sup>1)</sup>	
<b>Optionsrechte</b>										
<b>Optionsrechte auf Aktienindex</b>										
DJES 50 3800,000 25.12.19 P	DE000P8FC6J4	EDT		61			EUR	87,800	53.558,00	0,26
FTSE 100 7000,000 24.12.20 C	GB00F7DG8N84	ICE		10			GBP	1.275,000	150.352,00	0,72
HANG SENG 15800,000 24.12.30 C	CHSIH1580L24	FHF		10			HKD	0,000	18.660,93	0,09
Nikkei 225 Stock Average 29750,000 24.12.13 C	CNKYJ2975L24	FJO		8			JPY	9.733,833	451.790,79	2,16
RUSSELL 2000 INDEX 1850,000 24.12.20 C	CRUC1850LY24	NAE		5			USD	265,950	124.066,99	0,59
S&P 500 4300,000 25.06.20 P	PSPXC4300R25	NAE		27			USD	51,650	130.112,89	0,62
SWISS MARKET 10000,000 24.12.20 C	DE000C4SKJ86	EDT		4			CHF	2.098,500	87.144,30	0,42
<b>Summe Optionsrechte auf Aktienindex</b>							<b>EUR</b>	<b>1.015.685,90</b>	<b>4,86</b>	
<b>Summe Optionsrechte</b>							<b>EUR</b>	<b>1.015.685,90</b>	<b>4,86</b>	
<b>Summe Aktienindex-Derivate</b>							<b>EUR</b>	<b>1.063.924,98</b>	<b>5,09</b>	
<b>Devisen-Derivate</b>										
Forderungen/ Verbindlichkeiten										
<b>Devisenterminkontrakte (Verkauf)</b>										
<b>Offene Positionen</b>										
USD/ EUR 2,6 Mio.		OTC						6.283,92	0,03	
<b>Summe Devisenterminkontrakte (Verkauf)</b>							<b>EUR</b>	<b>6.283,92</b>	<b>0,03</b>	
<b>Summe Devisen-Derivate</b>							<b>EUR</b>	<b>6.283,92</b>	<b>0,03</b>	
<b>Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b>										
<b>Bankguthaben</b>										
<b>EUR-Guthaben bei der Verwahrstelle</b>										
Kreissparkasse Köln			EUR	853.373,67		%	100,000	853.373,67	4,08	
<b>Summe EUR-Guthaben bei der Verwahrstelle</b>							<b>EUR</b>	<b>853.373,67</b>	<b>4,08</b>	
<b>Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen</b>										
Kreissparkasse Köln			CHF	56.172,94		%	100,000	58.317,27	0,28	
Kreissparkasse Köln			GBP	77.932,00		%	100,000	91.899,86	0,44	
Kreissparkasse Köln			HKD	1.063.758,24		%	100,000	125.858,36	0,60	
Kreissparkasse Köln			JPY	12.834.084,00		%	100,000	74.460,92	0,36	
Kreissparkasse Köln			USD	1.007.113,18		%	100,000	1.001.365,16	4,78	
<b>Summe Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen</b>							<b>EUR</b>	<b>1.351.901,57</b>	<b>6,46</b>	

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

## Halbjahresbericht für Lupus alpha Dynamic Return Vermögensaufstellung zum 30.06.2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1000	Bestand 30.06.2024	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens <sup>1)</sup>
<b>Summe Bankguthaben</b>							EUR	<b>2.205.275,24</b>	<b>10,54</b>
<b>Summe der Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b>							EUR	<b>2.205.275,24</b>	<b>10,54</b>
<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>									
Zinsansprüche			EUR	87.831,69				87.831,69	0,42
<b>Summe Sonstige Vermögensgegenstände</b>							EUR	<b>87.831,69</b>	<b>0,42</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>									
Verbindlichkeiten aus schwebenden Geschäften			EUR	-111.713,33				-111.713,33	-0,53
Eingenommene Variation Margin Derivate			EUR	-66.900,01				-66.900,01	-0,32
Kostenabgrenzungen			EUR	-10.327,07				-10.327,07	-0,05
<b>Summe Sonstige Verbindlichkeiten</b>							EUR	<b>-188.940,41</b>	<b>-0,90</b>
<b>Fondsvermögen</b>							EUR	<b>20.902.404,65</b>	<b>100,00</b>
<b>Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)</b>									<b>78,15</b>
<b>Anteilumlauf Klasse C</b>							STK	185.064	
<b>Anteilwert Klasse C</b>							EUR	112,95	

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

## Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

Die Vermögensgegenstände des Sondervermögens sind auf der Grundlage nachstehender Kurse/Marktsätze bewertet:

Alle Vermögenswerte: Kurse bzw. Marktsätze per 28.06.2024 oder letztbekannte

### Devisenkurs(e) bzw. Konversionsfaktor(en) (in Mengennotiz) per 28.06.2024

Englische Pfunde	(GBP)	0,84801	= 1 Euro (EUR)
Hongkong Dollar	(HKD)	8,36860	= 1 Euro (EUR)
Japanische Yen	(JPY)	172,36000	= 1 Euro (EUR)
Schweizer Franken	(CHF)	0,96323	= 1 Euro (EUR)
US-Dollar	(USD)	1,07180	= 1 Euro (EUR)

### Marktschlüssel

#### b) Terminbörsen

681	New York/N.Y. - NYSE Amex Options
EDT	EUREX
FHF	Hong Kong Futures Exchange Ltd.
FJO	Osaka
ICE	ICE Futures Europe
NAE	Cboe Global Markets Inc.
NAM	Chicago St.Exch.
NAR	Chicago Merc. Exch.
NAX	Nasdaq PHLX

#### c) OTC

Over-the-Counter



## Halbjahresbericht für Lupus alpha Dynamic Return

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 bzw. Nominal bzw. Whg. in 1000	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>				
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>				
3,4370 % A.N.Z.BKG.GR 23/25 MTN	XS2607079493	EUR	0	1.000
0,5000 % DT.PFBR.BANK PF.R.15280	DE000A2GSLL7	EUR	0	700
0,5000 % SANTANDER UK 18/25 MTN	XS1748479919	EUR	0	1.000
0,6250 % TORONTO-DOM. BK 18/25 MTN	XS1832967019	EUR	0	1.000

# Halbjahresbericht für Lupus alpha Dynamic Return

Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Volumen in 1.000
---------------------	------------------------------------	---------------------

---

**Derivate** (In Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe.)

## Terminkontrakte

### Aktienindex-Terminkontrakte

Gekaufte Kontrakte:

(Basiswert(e): EURO STOXX 50, S&P 500)

EUR	15.528
-----	--------

### Devisentermingeschäfte

#### Devisenterminkontrakte (Verkauf)

Verkauf von Devisen auf Termin:

USD/EUR

EUR	554
-----	-----

USD/EUR

EUR	2.293
-----	-------

## Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)		78,15
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)		11,79
<b>Sonstige Angaben</b>		
Anteilwert Klasse C	EUR	112,95
Umlaufende Anteile Klasse C	STK	185.064

### Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände

Für Vermögensgegenstände, die zum Handel an einer Börse oder an einem anderen organisierten Markt zugelassen oder in diesen einbezogen sind, wird gemäß §27 KARBV der letzte verfügbare handelbare Kurs zugrunde gelegt, der eine verlässliche Bewertung gewährleistet. Für Vermögensgegenstände, die weder zum Handel an einer Börse noch an einem anderen organisierten Markt zugelassen oder in diesen 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. Der zugrunde gelegte Verkehrswert kann auch von einem Emittenten, Kontrahenten oder sonstigen Dritten ermittelt und mitgeteilt werden. In diesem Fall wird dieser Wert durch die Kapitalanlagegesellschaft beziehungsweise die Verwahrstelle auf Plausibilität geprüft und diese Plausibilitätsprüfung dokumentiert. Anteile an inländischen Investmentvermögen, EG-Investmentanteilen und ausländischen Investmentanteilen werden mit ihrem letzten festgestellten Rücknahmepreis oder mit einem aktuellen Kurs nach §27 Absatz 1 KARBV bewertet. Falls aktuelle Werte nicht zur Verfügung stehen, wird der Wert der Anteile gemäß §28 KARBV ermittelt; hierauf wird im Jahresbericht hingewiesen. Bankguthaben werden zu ihrem Nennwert zuzüglich zugeflossener Zinsen bewertet. Festgelder werden zum Verkehrswert bewertet. Verbindlichkeiten werden mit ihrem Rückzahlungsbetrag angesetzt.

Frankfurt am Main, den 18.07.2024

Lupus alpha Investment GmbH

*Die Geschäftsführung*