

KAPITALVERWALTUNGSGESELLSCHAFT:



7orca Vega Return

HALBJAHRESBERICHT

ZUM 30. JUNI 2023

VERWAHRSTELLE:



BNP PARIBAS

ASSET MANAGEMENT UND VERTRIEB:



Halbjahresbericht 7orca Vega Return

Vermögensübersicht zum 30.06.2023

Anlageschwerpunkte	Tageswert in EUR	% Anteil am Fondsvermögen
I. Vermögensgegenstände	76.130.089,67	100,22
1. Anleihen	68.813.930,00	90,59
< 1 Jahr	7.798.880,00	10,27
>= 1 Jahr bis < 3 Jahre	61.015.050,00	80,32
2. Derivate	-839.021,39	-1,10
3. Bankguthaben	3.733.471,60	4,91
4. Geldmarktfonds	4.217.176,80	5,55
5. Sonstige Vermögensgegenstände	204.532,66	0,27
II. Verbindlichkeiten	-165.224,36	-0,22
III. Fondsvermögen	75.964.865,31	100,00

Halbjahresbericht Torca Vega Return

Vermögensaufstellung zum 30.06.2023

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2023	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Bestandspositionen							EUR	68.813.930,00	90,59
Börsengehandelte Wertpapiere							EUR	64.825.230,00	85,34
Verzinsliche Wertpapiere							EUR	64.825.230,00	85,34
0,2500 % Australia & N. Z. Bkg Grp Ltd. EO-Med.-Term Cov. Bds 2022(25)	XS2456253082		EUR	2.000	0	0 %	94,002	1.880.040,00	2,47
1,0000 % Banco Santander S.A. EO-Cédulas Hipotec. 2015(25)	ES0413790397		EUR	2.000	0	0 %	94,985	1.899.700,00	2,50
0,0100 % Bank of Nova Scotia, The EO-M.-T. Mortg.Cov.Bds 20(25)	XS2138444661		EUR	2.000	0	0 %	93,488	1.869.760,00	2,46
0,0500 % BNG Bank N.V. EO-Med.-Term Notes 2020(25)	XS2150024540		EUR	2.000	0	0 %	94,012	1.880.240,00	2,48
1,7500 % BPCE SFH EO-Med.-T.Obl.Fin.Hab.2014(24)	FR0011993518		EUR	2.000	2.000	0 %	97,966	1.959.320,00	2,58
0,3980 % BPCE SFH EO-Med.-T.Obl.Fin.Hab.2015(25)	FR0012695716		EUR	1.500	0	0 %	93,966	1.409.490,00	1,86
2,4000 % Caisse Refinancement l'Habitat EO-Covered Bonds 2013(25)	FR0011388339		EUR	2.000	0	0 %	97,786	1.955.720,00	2,57
4,0000 % Caixabank S.A. EO-Cédulas Hip. 2005(25)	ES0414950628		EUR	2.000	0	0 %	99,815	1.996.300,00	2,63
0,6250 % Caixabank S.A. EO-Cédulas Hipotec. 2015(25)	ES0440609271		EUR	2.000	0	0 %	94,318	1.886.360,00	2,48
0,0000 % Cie de Financement Foncier EO-FLR Med.-T.Obl.Fonc.05(25)	FR0010198002		EUR	2.500	0	0 %	92,837	2.320.925,00	3,06
2,2380 % Cie de Financement Foncier EO-FLR MTN Obl. Fonc.2004(24)	FR0010101832		EUR	1.000	1.000	0 %	97,790	977.900,00	1,29
0,0500 % Cie de Financement Foncier EO-Med.-T. Obl.Fonc. 2020(24)	FR0013507365		EUR	1.000	0	1.000 %	97,114	971.140,00	1,28
0,2500 % Coöperatieve Rabobank U.A. EO-Med.-Term Cov. Bds 2017(24)	XS1622193248		EUR	2.000	0	0 %	96,811	1.936.220,00	2,55
0,2500 % Credit Agricole Italia S.p.A. EO-M.-T.Mortg.Cov.Bds 2016(24)	IT0005216624		EUR	1.000	0	0 %	95,382	953.820,00	1,26
0,6250 % Crédit Mutuel Home Loan SFH SA EO-Med.-T.Obl.Fin.Hab.2017(25)	FR0013236247		EUR	2.000	0	0 %	94,927	1.898.540,00	2,50
0,0100 % Deutsche Pfandbriefbank AG MTN-HPF Reihe 15292 v.19(25)	DE000A2YNV/M8		EUR	1.500	0	0 %	91,881	1.378.215,00	1,81
0,3750 % DZ HYP AG MTN-Hyp.Pfbr.377 16(25) [WL]	DE000A2AASB4		EUR	1.000	0	0 %	93,727	937.270,00	1,23
0,5000 % Eika BoligKreditt A.S. EO-Med.-Term Cov. MTN 2018(25)	XS1869468808		EUR	2.000	0	0 %	93,202	1.864.040,00	2,45
0,3750 % Eika BoligKreditt A.S. EO-Med.-Term Cov. Nts 2017(25)	XS1725524471		EUR	2.000	0	0 %	94,412	1.888.240,00	2,49
1,3750 % Equitable Bank EO-Med.-Term Cov. Bds 2022(25)	XS2484201467		EUR	2.000	0	0 %	94,897	1.897.940,00	2,50
0,6250 % ING Belgium SA/NV EO-Med.-T.Mortg.Cov.Bds 18(25)	BE0002594720		EUR	2.000	0	0 %	94,061	1.881.220,00	2,48
0,2500 % Jyske Realkredit A/S EO-Cov. Bonds 2016(23)	XS1435774903		EUR	1.000	0	0 %	100,000	1.000.000,00	1,32
0,3750 % Jyske Realkredit A/S EO-Mortg. Covered MTN 2019(25)	XS1961126775		EUR	1.000	0	0 %	94,042	940.420,00	1,24
0,0000 % KBC Bank N.V. EO-Med.-T.Mortg.Cov.Bds 20(25)	BE0002707884		EUR	1.000	0	0 %	91,507	915.070,00	1,20
0,2500 % Landesbank Baden-Württemberg MTN-Pfandbr.Ser.791 v.18(25)	DE000LB1M2X2		EUR	2.000	0	0 %	94,731	1.894.620,00	2,49
0,0000 % Lb.Hessen-Thüringen GZ MTN HPF S.H335 v.19(24)	XS2022037795		EUR	1.000	1.000	0 %	96,239	962.390,00	1,27
0,1250 % Lb.Hessen-Thüringen GZ MTN IHS S.H339 v.19(24)	XS2080581189		EUR	2.000	0	0 %	94,570	1.891.400,00	2,49
0,0100 % Luminor Bank AS EO-Mortg.Covered MTN 2020(25)	XS2133077383		EUR	2.000	0	0 %	93,364	1.867.280,00	2,46
0,3750 % Raiffeisenl.Niederöst.-Wien AG EO-Medium-Term Notes 2017(24)	XS1681119167		EUR	2.000	0	0 %	95,804	1.916.080,00	2,52
1,2500 % Santander UK PLC EO-Med.-T.Cov. Bds 2014(24)	XS1111559685		EUR	1.500	0	0 %	96,677	1.450.155,00	1,91

Halbjahresbericht Torca Vega Return

Vermögensaufstellung zum 30.06.2023

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2023	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens	
0,0500 % Skandinaviska Enskilda Banken EO-Medium-Term Notes 2019(24)	XS2020568734		EUR	2.000	0	0 %	96,162	1.923.240,00	2,53	
4,1250 % SNCF S.A. EO-Medium-Term Notes 2010(25)	XS0488101527		EUR	1.500	1.500	0 %	100,578	1.508.670,00	1,99	
0,3750 % SpareBank 1 Boligkreditt AS EO-M.-T. Mortg.Cov.Bds 17(24)	XS1637099026		EUR	2.000	0	0 %	96,610	1.932.200,00	2,54	
0,5000 % SpareBank 1 Boligkreditt AS EO-M.-T.Mrtg.Cov.Gr.Bs 18(25)	XS1760129608		EUR	2.500	0	0 %	94,845	2.371.125,00	3,12	
0,5000 % Swedish Covered Bond Corp.,The EO-Medium-Term Notes 2018(25)	XS1759602953		EUR	3.000	0	0 %	94,842	2.845.260,00	3,75	
1,7070 % Toronto-Dominion Bank, The EO-Med.-Term Cov.Bds 2022(25)	XS2508690612		EUR	1.000	1.000	0 %	95,635	956.350,00	1,26	
0,0100 % UniCredit Bank AG HVB MTN-HPF S.2063 v.19(24)	DE000HV2AST3		EUR	3.000	0	0 %	95,536	2.866.080,00	3,77	
0,1250 % Union Natle Interp.Em.Com.Ind. EO-Medium-Term Notes 2017(24)	FR0124665995		EUR	1.000	0	0 %	95,132	951.320,00	1,25	
3,4570 % Westpac Banking Corp. EO-Mortg. Cov. MTN 2023(25)	XS2606993694		EUR	1.000	1.000	0 %	99,117	991.170,00	1,30	
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere							EUR	3.988.700,00	5,25	
Verzinsliche Wertpapiere							EUR	3.988.700,00	5,25	
0,0100 % Development Bank of Japan EO-Medium-Term Notes 2020(24)	XS2243052490		EUR	1.000	0	0 %	94,994	949.940,00	1,25	
0,5000 % Ontario Teachers Finance Trust EO-Notes 2020(25) Reg.S	XS2162004209		EUR	1.200	1.200	0 %	93,870	1.126.440,00	1,48	
0,8750 % Quebec, Provinz EO-Medium-Term Notes 2015(25)	XS1167203881		EUR	2.000	0	0 %	95,616	1.912.320,00	2,52	
Summe Wertpapiervermögen 2)							EUR	68.813.930,00	90,59	
Derivate							EUR	-839.021,39	-1,10	
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)										
Aktienindex-Derivate							EUR	-282.796,60	-0,37	
Forderungen/Verbindlichkeiten										
Optionsrechte							EUR	-282.796,60	-0,37	
Optionsrechte auf Aktienindices							EUR	-282.796,60	-0,37	
SMI CALL 21.07.23 BP 11500,00 EUREX		185		Anzahl	-810		CHF	18,100	-15.024,60	-0,02
SMI CALL 21.07.23 BP 11700,00 EUREX		185		Anzahl	-530		CHF	3,200	-1.738,06	0,00
SMI CALL 21.07.23 BP 11750,00 EUREX		185		Anzahl	-270		CHF	2,100	-581,06	0,00

Halbjahresbericht Torca Vega Return

Vermögensaufstellung zum 30.06.2023

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2023	Käufe / Zugänge Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
SMI CALL 21.07.23 BP 11850,00 EUREX		185	Anzahl	-260	CHF	1,000	-266,45	0,00
SMI CALL 21.07.23 BP 11900,00 EUREX		185	Anzahl	-260	CHF	0,700	-186,51	0,00
SMI PUT 21.07.23 BP 10800,00 EUREX		185	Anzahl	-270	CHF	11,200	-3.099,00	0,00
SMI PUT 21.07.23 BP 10850,00 EUREX		185	Anzahl	-270	CHF	13,000	-3.597,05	0,00
SMI PUT 21.07.23 BP 10900,00 EUREX		185	Anzahl	-540	CHF	15,300	-8.466,90	-0,01
SMI PUT 21.07.23 BP 10950,00 EUREX		185	Anzahl	-530	CHF	18,100	-9.830,91	-0,01
SMI PUT 21.07.23 BP 11000,00 EUREX		185	Anzahl	-520	CHF	21,700	-11.563,85	-0,02
ESTX 50 PR.EUR CALL 07.07.23 BP 4475,00 EUREX		185	Anzahl	-900	EUR	3,000	-2.700,00	0,00
ESTX 50 PR.EUR CALL 07.07.23 BP 4525,00 EUREX		185	Anzahl	-890	EUR	0,700	-623,00	0,00
ESTX 50 PR.EUR CALL 14.07.23 BP 4500,00 EUREX		185	Anzahl	-890	EUR	5,000	-4.450,00	-0,01
ESTX 50 PR.EUR CALL 14.07.23 BP 4550,00 EUREX		185	Anzahl	-880	EUR	1,700	-1.496,00	0,00
ESTX 50 PR.EUR CALL 21.07.23 BP 4425,00 EUREX		185	Anzahl	-910	EUR	35,000	-31.850,00	-0,04
ESTX 50 PR.EUR CALL 21.07.23 BP 4500,00 EUREX		185	Anzahl	-900	EUR	10,000	-9.000,00	-0,01
ESTX 50 PR.EUR PUT 07.07.23 BP 4200,00 EUREX		185	Anzahl	-900	EUR	1,000	-900,00	0,00
ESTX 50 PR.EUR PUT 07.07.23 BP 4250,00 EUREX		185	Anzahl	-890	EUR	1,200	-1.068,00	0,00
ESTX 50 PR.EUR PUT 14.07.23 BP 4225,00 EUREX		185	Anzahl	-890	EUR	4,500	-4.005,00	-0,01
ESTX 50 PR.EUR PUT 14.07.23 BP 4250,00 EUREX		185	Anzahl	-880	EUR	5,600	-4.928,00	-0,01
ESTX 50 PR.EUR PUT 21.07.23 BP 4100,00 EUREX		185	Anzahl	-910	EUR	4,300	-3.913,00	-0,01
ESTX 50 PR.EUR PUT 21.07.23 BP 4200,00 EUREX		185	Anzahl	-900	EUR	7,600	-6.840,00	-0,01
NIKKEI 225 INDEX CALL 14.07.23 BP 34500,00 OSE		969	Anzahl	-29000	JPY	83,000	-15.267,33	-0,02
NIKKEI 225 INDEX CALL 14.07.23 BP 35000,00 OSE		969	Anzahl	-28000	JPY	38,000	-6.748,83	-0,01
NIKKEI 225 INDEX CALL 14.07.23 BP 35500,00 OSE		969	Anzahl	-28000	JPY	17,000	-3.019,21	0,00
NIKKEI 225 INDEX CALL 14.07.23 BP 36000,00 OSE		969	Anzahl	-29000	JPY	8,000	-1.471,55	0,00
NIKKEI 225 INDEX PUT 14.07.23 BP 30625,00 OSE		969	Anzahl	-29000	JPY	16,000	-2.943,10	0,00
NIKKEI 225 INDEX PUT 14.07.23 BP 30875,00 OSE		969	Anzahl	-28000	JPY	22,000	-3.907,22	-0,01
NIKKEI 225 INDEX PUT 14.07.23 BP 31375,00 OSE		969	Anzahl	-29000	JPY	38,000	-6.989,86	-0,01
NIKKEI 225 INDEX PUT 14.07.23 BP 32000,00 OSE		969	Anzahl	-28000	JPY	93,000	-16.516,88	-0,02
S+P 500 INDEX CALL 05.07.23 BP 4450,00 CBOE		361	Anzahl	-900	USD	12,550	-10.353,84	-0,01
S+P 500 INDEX CALL 07.07.23 BP 4480,00 CBOE		361	Anzahl	-900	USD	8,850	-7.301,31	-0,01
S+P 500 INDEX CALL 12.07.23 BP 4550,00 CBOE		361	Anzahl	-900	USD	3,075	-2.536,90	0,00
S+P 500 INDEX CALL 14.07.23 BP 4630,00 CBOE		361	Anzahl	-900	USD	0,750	-618,76	0,00
S+P 500 INDEX CALL 19.07.23 BP 4550,00 CBOE		361	Anzahl	-900	USD	8,050	-6.641,31	-0,01
S+P 500 INDEX CALL 21.07.23 BP 4515,00 CBOE		361	Anzahl	-900	USD	17,600	-14.520,12	-0,02
S+P 500 INDEX CALL 26.07.23 BP 4550,00 CBOE		361	Anzahl	-900	USD	14,600	-12.045,10	-0,02
S+P 500 INDEX CALL 28.07.23 BP 4630,00 CBOE		361	Anzahl	-900	USD	5,300	-4.372,54	-0,01
S+P 500 INDEX PUT 05.07.23 BP 4170,00 CBOE		361	Anzahl	-900	USD	0,425	-350,63	0,00

Halbjahresbericht Torca Vega Return

Vermögensaufstellung zum 30.06.2023

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2023	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
S+P 500 INDEX PUT 07.07.23 BP 4195,00 CBOE			361	Anzahl -900			USD 0,925	-763,13	0,00
S+P 500 INDEX PUT 12.07.23 BP 4240,00 CBOE			361	Anzahl -900			USD 2,400	-1.980,02	0,00
S+P 500 INDEX PUT 14.07.23 BP 4305,00 CBOE			361	Anzahl -900			USD 5,650	-4.661,29	-0,01
S+P 500 INDEX PUT 19.07.23 BP 4250,00 CBOE			361	Anzahl -900			USD 5,600	-4.620,04	-0,01
S+P 500 INDEX PUT 21.07.23 BP 4225,00 CBOE			361	Anzahl -900			USD 5,650	-4.661,29	-0,01
S+P 500 INDEX PUT 26.07.23 BP 4240,00 CBOE			361	Anzahl -900			USD 9,100	-7.507,56	-0,01
S+P 500 INDEX PUT 28.07.23 BP 4340,00 CBOE			361	Anzahl -900			USD 20,450	-16.871,39	-0,02
							EUR	-83.583,17	-0,11
Optionsrechte									
Optionsrechte auf Zinsterminkontrakte							EUR	-83.583,17	-0,11
FUTURE EU-BUND 09.23 CALL 21.07.23 BP 136,50 EUREX			185	EUR Anzahl -218			EUR 0,240	-1.630,00	0,00
FUTURE EU-BUND 09.23 CALL 21.07.23 BP 137,50 EUREX			185	EUR Anzahl -108			EUR 0,130	14.040,00	0,02
FUTURE EU-BUND 09.23 PUT 21.07.23 BP 129,50 EUREX			185	EUR Anzahl -109			EUR 0,080	15.260,00	0,02
FUTURE EU-BUND 09.23 PUT 21.07.23 BP 130,50 EUREX			185	EUR Anzahl -109			EUR 0,160	3.270,00	0,00
FUTURE EU-BUND 09.23 PUT 21.07.23 BP 131,00 EUREX			185	EUR Anzahl -108			EUR 0,230	1.080,00	0,00
FUT 10Y TREA 2W 09.23 CALL 14.07.23 BP 115,75 CBOT			362	USD Anzahl -174			USD 0,016	-2.492,21	0,00
FUT 10Y TREA 2W 09.23 PUT 14.07.23 BP 111,25 CBOT			362	USD Anzahl -174			USD 0,219	-34.890,92	-0,05
FUT 10Y TREA CALL 07.07.23 BP 115,50 CBOT			362	USD Anzahl -174			USD 0,001	-159,50	0,00
FUT 10Y TREA PUT 07.07.23 BP 111,00 CBOT			362	USD Anzahl -174			USD 0,047	-7.476,62	-0,01
FUTURE 10Y TREA 09.23 CALL 21.07.23 BP 115,50 CBOT			362	USD Anzahl -176			USD 0,047	-7.562,56	-0,01
FUTURE 10Y TREA 09.23 PUT 21.07.23 BP 111,50 CBOT			362	USD Anzahl -176			USD 0,391	-63.021,36	-0,08
							EUR	-472.641,62	-0,62
Devisen-Derivate									
Forderungen/Verbindlichkeiten									
Optionsrechte							EUR	-472.332,49	-0,62
Optionsrechte auf Devisen							EUR	-472.332,49	-0,62
F FX AUD/USD 2PM 09.23 CALL 07.07.23 BP 69,00 CME			352	USD -103.000			USD 0,010	-944,17	0,00
F FX AUD/USD 2PM 09.23 PUT 07.07.23 BP 64,50 CME			352	USD -103.000			USD 0,005	-472,09	0,00
F FX AUD/USD W 09.23 CALL 14.07.23 BP 70,00 CME			352	USD -103.000			USD 0,010	-944,17	0,00
F FX AUD/USD W 09.23 CALL 21.07.23 BP 69,75 CME			352	USD -103.000			USD 0,015	-1.416,26	0,00
F FX AUD/USD W 09.23 CALL 28.07.23 BP 69,50 CME			352	USD -105.000			USD 0,045	-4.331,29	-0,01

Halbjahresbericht Torca Vega Return

Vermögensaufstellung zum 30.06.2023

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2023	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens	
F FX AUD/USD W 09.23 PUT 14.07.23 BP 66,25 CME			352	USD	-103.000		USD	0,330	-31.157,76	-0,04
F FX AUD/USD W 09.23 PUT 21.07.23 BP 65,50 CME			352	USD	-103.000		USD	0,210	-19.827,67	-0,03
F FX AUD/USD W 09.23 PUT 28.07.23 BP 65,00 CME			352	USD	-105.000		USD	0,190	-18.287,65	-0,02
F FX EUR/USD 2PM 09.23 CALL 07.07.23 BP 1,10 CME			352	USD	-7.125.000		USD	0,002	-12.409,48	-0,02
F FX EUR/USD 2PM 09.23 CALL 14.07.23 BP 1,115 CME			352	USD	-7.125.000		USD	0,000	-2.612,52	0,00
F FX EUR/USD 2PM 09.23 CALL 21.07.23 BP 1,1225 CME			352	USD	-7.125.000		USD	0,000	-2.285,96	0,00
F FX EUR/USD 2PM 09.23 CALL 28.07.23 BP 1,1125 CME			352	USD	-7.250.000		USD	0,002	-13.956,37	-0,02
F FX EUR/USD 2PM 09.23 PUT 07.07.23 BP 1,06 CME			352	USD	-7.125.000		USD	0,000	-326,57	0,00
F FX EUR/USD 2PM 09.23 PUT 14.07.23 BP 1,0725 CME			352	USD	-7.125.000		USD	0,000	-2.285,96	0,00
F FX EUR/USD 2PM 09.23 PUT 21.07.23 BP 1,0825 CME			352	USD	-7.125.000		USD	0,002	-14.368,87	-0,02
F FX EUR/USD 2PM 09.23 PUT 28.07.23 BP 1,07 CME			352	USD	-7.250.000		USD	0,001	-7.975,07	-0,01
F FX GBP/USD 2PM 09.23 CALL 07.07.23 BP 127,00 CME			359	USD	-55.000		USD	0,560	-28.233,57	-0,04
F FX GBP/USD 2PM 09.23 PUT 07.07.23 BP 121,00 CME			359	USD	-55.000		USD	0,010	-504,17	0,00
F FX GBP/USD W 09.23 CALL 14.07.23 BP 129,00 CME			359	USD	-55.625		USD	0,140	-7.138,60	-0,01
F FX GBP/USD W 09.23 CALL 21.07.23 BP 130,50 CME			359	USD	-55.000		USD	0,060	-3.025,03	0,00
F FX GBP/USD W 09.23 CALL 28.07.23 BP 130,50 CME			359	USD	-55.625		USD	0,120	-6.118,80	-0,01
F FX GBP/USD W 09.23 PUT 14.07.23 BP 123,25 CME			359	USD	-55.625		USD	0,030	-1.529,70	0,00
F FX GBP/USD W 09.23 PUT 21.07.23 BP 124,00 CME			359	USD	-55.000		USD	0,120	-6.050,05	-0,01
F FX GBP/USD W 09.23 PUT 28.07.23 BP 124,00 CME			359	USD	-55.625		USD	0,210	-10.707,90	-0,01
F FX JPY/USD 2PM 09.23 CALL 07.07.23 BP 75,00 CME			352	USD	-106.250		USD	0,005	-486,98	0,00
F FX JPY/USD 2PM 09.23 CALL 14.07.23 BP 74,50 CME			352	USD	-108.750		USD	0,015	-1.495,32	0,00
F FX JPY/USD 2PM 09.23 CALL 21.07.23 BP 73,25 CME			352	USD	-111.250		USD	0,035	-3.569,30	0,00
F FX JPY/USD 2PM 09.23 CALL 28.07.23 BP 72,50 CME			352	USD	-112.500		USD	0,200	-20.625,17	-0,03
F FX JPY/USD 2PM 09.23 PUT 07.07.23 BP 71,00 CME			352	USD	-106.250		USD	1,000	-97.396,64	-0,13
F FX JPY/USD 2PM 09.23 PUT 14.07.23 BP 70,25 CME			352	USD	-108.750		USD	0,600	-59.813,00	-0,08
F FX JPY/USD 2PM 09.23 PUT 21.07.23 BP 69,50 CME			352	USD	-111.250		USD	0,370	-37.732,61	-0,05
F FX JPY/USD 2PM 09.23 PUT 28.07.23 BP 68,00 CME			352	USD	-112.500		USD	0,150	-15.468,88	-0,02
FUT FX CAD/USD 09.23 CALL 14.07.23 BP 76,50 CME			352	USD	-105.000		USD	0,060	-5.775,05	-0,01
FUT FX CAD/USD 09.23 CALL 21.07.23 BP 77,50 CME			352	USD	-104.000		USD	0,010	-953,34	0,00
FUT FX CAD/USD 09.23 CALL 28.07.23 BP 76,75 CME			352	USD	-105.000		USD	0,110	-10.587,59	-0,01
FUT FX CAD/USD 09.23 PUT 14.07.23 BP 74,00 CME			352	USD	-105.000		USD	0,015	-1.443,76	0,00
FUT FX CAD/USD 09.23 PUT 21.07.23 BP 74,75 CME			352	USD	-104.000		USD	0,130	-12.393,44	-0,02
FUT FX CAD/USD 09.23 PUT 28.07.23 BP 74,00 CME			352	USD	-105.000		USD	0,060	-5.775,05	-0,01
FUTURE FX CAD/USD 09.23 CALL 07.07.23 BP 76,50 CME			352	USD	-104.000		USD	0,015	-1.430,01	0,00
FUTURE FX CAD/USD 09.23 PUT 07.07.23 BP 73,50 CME			352	USD	-104.000		USD	0,005	-476,67	0,00

Halbjahresbericht 7orca Vega Return

Vermögensaufstellung zum 30.06.2023

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2023	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Währungsterminkontrakte							EUR	-309,13	0,00
FUTURE CROSS RATE EUR/CHF 09.23 CME			352	CHF -125.000			CHF 0,972	-269,01	0,00
FUTURE CROSS RATE EUR/USD 09.23 CME			352	USD 750.000			USD 1,095	-3.850,04	-0,01
FUTURE CROSS RATE JPY/USD 09.23 CME			352	USD -67.500			USD 70,015	3.809,92	0,01
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds							EUR	7.950.648,40	10,47
Bankguthaben							EUR	3.733.471,60	4,91
EUR - Guthaben bei:									
BNP Paribas S.A., Niederlassung Deutschland				EUR 1.458.869,41			% 100,000	1.458.869,41	1,92
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen bei:									
BNP Paribas S.A., Niederlassung Deutschland				AUD 139.740,84			% 100,000	85.285,83	0,11
BNP Paribas S.A., Niederlassung Deutschland				CHF 374.402,39			% 100,000	383.687,63	0,51
BNP Paribas S.A., Niederlassung Deutschland				HKD 39.750,30			% 100,000	4.649,86	0,01
BNP Paribas S.A., Niederlassung Deutschland				JPY 38.208.324,00			% 100,000	242.351,11	0,32
BNP Paribas S.A., Niederlassung Deutschland				USD 1.700.307,02			% 100,000	1.558.627,76	2,05
Geldmarktfonds							EUR	4.217.176,80	5,55
Gruppenfremde Geldmarktfonds							EUR	4.217.176,80	5,55
AMUNDI EURO LIQUIDITY SRI Actions au Porteur IC o.N.	FR0010251660			ANT 18	18	46	EUR 234.287,600	4.217.176,80	5,55
Sonstige Vermögensgegenstände							EUR	204.532,66	0,27
Zinsansprüche				EUR 204.532,66				204.532,66	0,27

Halbjahresbericht 7orca Vega Return

Vermögensaufstellung zum 30.06.2023

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2023	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Sonstige Verbindlichkeiten							EUR	-165.224,36	-0,22
Zinsverbindlichkeiten			EUR	-13,86				-13,86	0,00
Verwaltungsvergütung			EUR	-29.886,68				-29.886,68	-0,04
Verwahrstellenvergütung			EUR	-5.701,10				-5.701,10	-0,01
Prüfungskosten			EUR	-12.000,00				-12.000,00	-0,02
Veröffentlichungskosten			EUR	-400,00				-400,00	0,00
Portfoliomanagervergütung			EUR	-117.222,72				-117.222,72	-0,15
Fondsvermögen							EUR	75.964.865,31	100,00 1)
7orca Vega Return Anteilklasse R									
Anteilwert							EUR	87,24	
Ausgabepreis							EUR	91,60	
Rücknahmepreis							EUR	87,24	
Anzahl Anteile							STK	52.001	
7orca Vega Return Anteilklasse I									
Anteilwert							EUR	90,05	
Ausgabepreis							EUR	90,05	
Rücknahmepreis							EUR	90,05	
Anzahl Anteile							STK	793.183	

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.

Halbjahresbericht 7orca Vega Return

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Devisenkurse (in Mengennotiz)

		per 30.06.2023	
AUD	(AUD)	1,6385000	= 1 EUR (EUR)
CHF	(CHF)	0,9758000	= 1 EUR (EUR)
HKD	(HKD)	8,5487000	= 1 EUR (EUR)
JPY	(JPY)	157,6569000	= 1 EUR (EUR)
USD	(USD)	1,0909000	= 1 EUR (EUR)

Marktschlüssel

Terminbörsen

185	Eurex Deutschland
352	Chicago - CME Globex
359	Chicago Merc. Ex.
361	Chicago - CBOE Opt. Ex.
362	Chicago Board of Trade
969	Osaka Exchange F.+O.

Halbjahresbericht Torca Vega 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 Whg. in 1.000	Käufe bzw. Zugänge	Verkäufe bzw. Abgänge	Volumen in 1.000
Börsengehandelte Wertpapiere					
Verzinsliche Wertpapiere					
0,1250 % Aareal Bank AG MTN-HPF.S.226 v.2019(2024)	DE000AAR0249	EUR	0	1.000	
0,3750 % Arkéa Home Loans SFH S.A. EO-Mortg. Cov. MTN 2018(24)	FR0013375797	EUR	0	1.000	
0,6250 % Banco BPM S.p.A. EO-Med.-Term Cov. Bds 2016(23)	IT0005199465	EUR	0	2.000	
0,2000 % Caisse Francaise d.Financ.Loc. EO-M.-T.Obl.Foncières 2015(23)	FR0012688208	EUR	0	1.000	
0,2500 % Cie de Financement Foncier EO-Med.-T. Obl.Fonc. 2018(23)	FR0013328218	EUR	0	1.000	
0,8750 % Credit Agricole Italia S.p.A. EO-M.-T.Mortg.Cov.Bds 2015(23)	IT0005121592	EUR	0	1.200	
0,2500 % Deutsche Bank AG MTN-HPF v.16(24)	DE000DL19SH3	EUR	0	2.000	
0,5000 % Frankreich EO-OAT 2015(25)	FR0012517027	EUR	2.000	2.000	
0,0000 % Frankreich EO-OAT 2021(25)	FR0014007TY9	EUR	0	2.000	
0,0000 % Hessen, Land Schatzanw. S.2001 v.2020(2025)	DE000A1RQDR4	EUR	2.000	2.000	
0,2500 % Ibercaja Banco S.A.U. EO-Cédulas Hipotec. 2016(23)	ES0444251047	EUR	0	1.000	
0,0000 % National Bank of Canada EO-Med.-Term Cov. Bds 2016(23)	XS1496770626	EUR	0	1.000	
0,2500 % Nationale-Niederlanden Bank NV EO-M.-T. Mortg.Cov.Bds 19(24)	NL0013400401	EUR	0	1.500	
0,3750 % Nord/LB Lux.S.A. Cov.Bond Bk. EO-M.-T.Lett.d.Ga.Publ. 16(23)	XS1432510631	EUR	0	2.000	
0,0000 % Österreich, Republik EO-Medium-Term Notes 2021(25)	AT0000A2QRW0	EUR	0	2.000	
0,0100 % Schleswig-Holstein, Land Landesschatzanw.v.20(25) A.1	DE000SHFM758	EUR	0	3.000	
0,7500 % SR-Boligkredit A.S. EO-Mortg. Covered MTN 2016(23)	XS1344895450	EUR	0	1.000	
Nichtnotierte Wertpapiere *)					
Verzinsliche Wertpapiere					
0,3750 % Aktia Bank PLC EO-Cov. Med.-Term Nts 2018(23)	XS1827629384	EUR	0	1.000	
0,2000 % Bank of Montreal EO-M.-T. Mortg.Cov.Bds 17(23)	XS1706963284	EUR	0	1.000	
0,3750 % Bank of Nova Scotia, The EO-M.-T. Mortg.Cov.Bds 16(23)	XS1377941106	EUR	0	1.000	
0,2500 % Berlin Hyp AG Hyp.-Pfandbr. v.18(23) Ser.209	DE000BHY0150	EUR	0	1.500	
0,1250 % Bremen, Freie Hansestadt LandSchatz. A.204 v.16(23)	DE000A1680M0	EUR	0	1.000	
0,6250 % Erste Group Bank AG EO-Med.-T. Hyp.Pfandb.2016(23)	XS1346557637	EUR	0	1.000	
0,2500 % EUROFIMA EO-Medium-Term Notes 2016(23)	XS1400224546	EUR	0	1.000	
0,3750 % Federat.caisses Desjard Quebec EO-M.-T. Mortg.Cov.Bds 18(23)	XS1829326716	EUR	0	800	

Halbjahresbericht 7orca Vega 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 Whg. in 1.000	Käufe bzw. Zugänge	Verkäufe bzw. Abgänge	Volumen in 1.000
0,3750 % Hessen, Land Schatzanzw. S.1507 v.2015(2023)	DE000A1RQCJ3	EUR	0	1.000	
4,5621 % L-Bank Bad.-Württ.-Förderbank FLR MTN Serie 5608 v.20(23)	XS2166345608	EUR	0	1.000	
0,6250 % Skandinaviska Enskilda Banken EO-Cov.Med.-Term Nts 2015(23)	XS1314150878	EUR	0	2.000	
0,5000 % Société Générale SFH S.A. EO-M.-T.Obl.Fin.Hab. 16(23)	FR0013094869	EUR	0	1.000	
0,1250 % Sparebanken Vest Boligkred. AS EO-Med.-Term Hyp.Pf. 2018(23)	XS1854532865	EUR	0	1.200	
0,3750 % Suomen Hypoteekkiyhdistys EO-Med.-Term Cov. Bds 2018(23)	FI4000315841	EUR	0	1.000	
0,2500 % Toronto-Dominion Bank, The EO-Med.-Term Cov.Bds 2018(23)	XS1790069790	EUR	0	800	
0,3750 % Van Lanschot Kempen N.V. EO-MT Covered Bonds 2016(23)	XS1387192435	EUR	0	500	

Derivate

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

Terminkontrakte

Aktienindex-Terminkontrakte

Gekaufte Kontrakte:

(Basiswert(e): ESTX 50 PR.EUR, NIKKEI 225 ST.AVERAGE JPY, S+P 500, SMI PR CHF)

EUR

139.272,41

Verkaufte Kontrakte:

(Basiswert(e): ESTX 50 PR.EUR, NIKKEI 225 ST.AVERAGE JPY, S+P 500, SMI PR CHF)

EUR

89.316,56

Zinsterminkontrakte

Gekaufte Kontrakte:

(Basiswert(e): 10Y.US TRE.NT.SYN.AN., EURO-BUND)

EUR

421.812,05

Verkaufte Kontrakte:

(Basiswert(e): 10Y.US TRE.NT.SYN.AN., EURO-BUND)

EUR

125.262,11

Halbjahresbericht 7orca Vega 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 Whg. in 1.000	Käufe bzw. Zugänge	Verkäufe bzw. Abgänge	Volumen in 1.000
Währungsterminkontrakte					
Verkaufte Kontrakte: (Basiswert(e): CROSS RATE AD/DL, CROSS RATE CD/DL, CROSS RATE EO/DL, CROSS RATE EO/SF, CROSS RATE EO/YN, CROSS RATE LS/DL, CROSS RATE YN/DL)		EUR			175.065,00
Gekaufte Kontrakte: (Basiswert(e): CROSS RATE AD/DL, CROSS RATE CD/DL, CROSS RATE EO/DL, CROSS RATE EO/SF, CROSS RATE EO/YN, CROSS RATE LS/DL, CROSS RATE YN/DL)		EUR			262.478,61
Optionsrechte					
Optionsrechte auf Aktienindex-Derivate					
Optionsrechte auf Aktienindices					
Verkaufte Kaufoptionen (Call): (Basiswert(e): ESTX 50 PR.EUR, NIKKEI 225 ST.AVERAGE JPY, S+P 500, SMI PR CHF)		EUR			1.198,09
Verkaufte Verkaufsoptionen (Put): (Basiswert(e): ESTX 50 PR.EUR, NIKKEI 225 ST.AVERAGE JPY, S+P 500, SMI PR CHF)		EUR			4.106,23

Halbjahresbericht 7orca Vega 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 Whg. in 1.000	Käufe bzw. Zugänge	Verkäufe bzw. Abgänge	Volumen in 1.000
---------------------	------	-------------------------------------	--------------------------	-----------------------------	---------------------

Optionsrechte auf Zins-Derivate

Optionsrechte auf Zinsterminkontrakte

Verkaufte Kaufoptionen (Call):

, FUTURE 10YTRN2W 06.23 CBOT, FUTURE 10YTRN2W 09.23 CBOT, FUTURE EURO-BUND 03.23 EUREX, FUTURE EURO-BUND 06.23 EUREX, FUTURE EURO-BUND 09.23 EUREX)

EUR

0,00

(Basiswert(e): FUTURE 10Y TREASURY NOTE (SY.) 1W. 03.23 CBOT, FUTURE 10Y TREASURY NOTE (SY.) 1W. 06.23 CBOT, FUTURE 10Y TREASURY NOTE (SY.) 1W. 09.23 CBOT, FUTURE 10Y TREASURY NOTE (SYNTH.) 03.23 CBOT, FUTURE 10Y TREASURY NOTE (SYNTH.) 06.23 CBOT, FUTURE 10Y TREASURY NOTE (SYNTH.) 09.23 CBOT, FUTURE 10Y TREASURY NOTE (SYNTH.) 3W. 03.23 CBOT, FUTURE 10Y TREASURY NOTE (SYNTH.) 3W. 06.23 CBOT, FUTURE 10Y TREASURY NOTE (SYNTH.) 3W. 09.23 CBOT, FUTURE 10Y TREASURY NOTE (SYNTH.) 4W. 06.23 CBOT, FUTURE 10Y TREASURY NOTE (SYNTH.) 5W. 06.23 CBOT, FUTURE 10Y TREASURY NOTE (SYNTH.) 5W. 09.23 CBOT, FUTURE 10YTRN2W 03.23 CBOT,

Verkaufte Verkaufsoptionen (Put):

, FUTURE 10YTRN2W 06.23 CBOT, FUTURE 10YTRN2W 09.23 CBOT, FUTURE EURO-BUND 03.23 EUREX, FUTURE EURO-BUND 06.23 EUREX, FUTURE EURO-BUND 09.23 EUREX)

EUR

-956.675,25

(Basiswert(e): FUTURE 10Y TREASURY NOTE (SY.) 1W. 03.23 CBOT, FUTURE 10Y TREASURY NOTE (SY.) 1W. 06.23 CBOT, FUTURE 10Y TREASURY NOTE (SY.) 1W. 09.23 CBOT, FUTURE 10Y TREASURY NOTE (SYNTH.) 03.23 CBOT, FUTURE 10Y TREASURY NOTE (SYNTH.) 06.23 CBOT, FUTURE 10Y TREASURY NOTE (SYNTH.) 09.23 CBOT, FUTURE 10Y TREASURY NOTE (SYNTH.) 3W. 03.23 CBOT, FUTURE 10Y TREASURY NOTE (SYNTH.) 3W. 06.23 CBOT, FUTURE 10Y TREASURY NOTE (SYNTH.) 3W. 09.23 CBOT, FUTURE 10Y TREASURY NOTE (SYNTH.) 4W. 06.23 CBOT, FUTURE 10Y TREASURY NOTE (SYNTH.) 5W. 06.23 CBOT, FUTURE 10Y TREASURY NOTE (SYNTH.) 5W. 09.23 CBOT, FUTURE 10YTRN2W 03.23 CBOT,

Halbjahresbericht Torca Vega 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 Whg. in 1.000	Käufe bzw. Zugänge	Verkäufe bzw. Abgänge	Volumen in 1.000
---------------------	------	-------------------------------------	--------------------------	-----------------------------	---------------------

Optionsrechte auf Devisen-Derivate

Optionsrechte auf Devisen

Verkaufte Kaufoptionen (Call):

, FUTURE CROSS RATE GBP/USD 2PM EUR 06.23 CME, FUTURE CROSS RATE GBP/USD 2PM W EUR 03.23 CME, FUTURE CROSS RATE GBP/USD 2PM W EUR 06.23 CME, FUTURE CROSS RATE GBP/USD 2PM W EUR 09.23 CME, FUTURE CROSS RATE JPY/USD 2PM EUR 03.23 CME, FUTURE CROSS RATE JPY/USD 2PM EUR 06.23 CME, FUTURE CROSS RATE JPY/USD 2PM W EUR 03.23 CME, FUTURE CROSS RATE JPY/USD 2PM W EUR 06.23 CME, FUTURE CROSS RATE JPY/USD 2PM W EUR 09.23 CME, FUTURE CROSS RATE AUD/USD 2PM EUR 03.23 CME, FUTURE CROSS RATE AUD/USD 2PM EUR 06.23 CME, FUTURE CROSS RATE AUD/USD 2PM W EUR 03.23 CME, FUTURE CROSS RATE AUD/USD 2PM W EUR 06.23 CME, FUTURE CROSS RATE AUD/USD 2PM W EUR 09.23 CME, FUTURE CROSS RATE CAD/USD 03.23 CME, FUTURE CROSS RATE CAD/USD 06.23 CME, FUTURE CROSS RATE CAD/USD 09.23 CME, FUTURE CROSS RATE EUR/USD 2PM EUR 03.23 CME, FUTURE CROSS RATE EUR/USD 2PM EUR 06.23 CME, FUTURE CROSS RATE EUR/USD 2PM W EUR 03.23 CME, FUTURE CROSS RATE EUR/USD 2PM W EUR 06.23 CME, FUTURE CROSS RATE EUR/USD 2PM W EUR 09.23 CME, FUTURE CROSS RATE GBP/USD 2PM EUR 03.23		EUR			0,00
---	--	-----	--	--	------

Verkaufte Verkaufsoptionen (Put):

, FUTURE CROSS RATE GBP/USD 2PM EUR 06.23 CME, FUTURE CROSS RATE GBP/USD 2PM W EUR 03.23 CME, FUTURE CROSS RATE GBP/USD 2PM W EUR 06.23 CME, FUTURE CROSS RATE GBP/USD 2PM W EUR 09.23 CME, FUTURE CROSS RATE JPY/USD 2PM EUR 03.23 CME, FUTURE CROSS RATE JPY/USD 2PM EUR 06.23 CME, FUTURE CROSS RATE JPY/USD 2PM W EUR 03.23 CME, FUTURE CROSS RATE JPY/USD 2PM W EUR 06.23 CME, FUTURE CROSS RATE JPY/USD 2PM W EUR 09.23		EUR			-851.260,37
---	--	-----	--	--	-------------

Halbjahresbericht 7orca Vega 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 Whg. in 1.000	Käufe bzw. Zugänge	Verkäufe bzw. Abgänge	Volumen in 1.000
---------------------	------	-------------------------------------	--------------------------	-----------------------------	---------------------

(Basiswert(e): FUTURE CROSS RATE AUD/USD 2PM EUR 03.23 CME, FUTURE CROSS RATE AUD/USD 2PM EUR 06.23 CME, FUTURE CROSS RATE AUD/USD 2PM W EUR 03.23 CME, FUTURE CROSS RATE AUD/USD 2PM W EUR 06.23 CME, FUTURE CROSS RATE AUD/USD 2PM W EUR 09.23 CME, FUTURE CROSS RATE CAD/USD 03.23 CME, FUTURE CROSS RATE CAD/USD 06.23 CME, FUTURE CROSS RATE CAD/USD 09.23 CME, FUTURE CROSS RATE EUR/USD 2PM EUR 03.23 CME, FUTURE CROSS RATE EUR/USD 2PM EUR 06.23 CME, FUTURE CROSS RATE EUR/USD 2PM W EUR 03.23 CME, FUTURE CROSS RATE EUR/USD 2PM W EUR 06.23 CME, FUTURE CROSS RATE EUR/USD 2PM W EUR 09.23 CME, FUTURE CROSS RATE GBP/USD 2PM EUR 03.23

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.

*) Bei den nichtnotierten Wertpapieren können technisch bedingt auch endfällige Wertpapiere ausgewiesen werden.

Halbjahresbericht 7orca Vega Return

Anteilklassenmerkmale im Überblick

Anteilklasse	Mindestanlagesumme in Währung	Ausgabeaufschlag bis zu 5,00%, derzeit (Angabe in %)	Verwaltungsvergütung bis zu 0,300% p.a., derzeit (Angabe in % p.a.)	Ertragsverwendung	Währung
7orca Vega Return Anteilklasse R	keine	5,00	0,155	Ausschüttung ohne Zwischenausschüttung	EUR
7orca Vega Return Anteilklasse I	250.000	0,00	0,100	Ausschüttung ohne Zwischenausschüttung	EUR

Halbjahresbericht Torca Vega Return

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)	90,59
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)	-1,10

Sonstige Angaben

Torca Vega Return Anteilklasse R

Anteilwert	EUR	87,24
Ausgabepreis	EUR	91,60
Rücknahmepreis	EUR	87,24
Anzahl Anteile	STK	52.001

Torca Vega Return Anteilklasse I

Anteilwert	EUR	90,05
Ausgabepreis	EUR	90,05
Rücknahmepreis	EUR	90,05
Anzahl Anteile	STK	793.183

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.

Halbjahresbericht 7orca Vega Return

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

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.

Frankfurt am Main, den 3. Juli 2023

Universal-Investment-Gesellschaft mbH
Die Geschäftsführung

Halbjahresbericht 7orca Vega Return

Anteilklassen im Überblick

Erstausgabedatum

Anteilklasse R	4. Dezember 2017
Anteilklasse I	4. Dezember 2017

Erstausgabepreise

Anteilklasse R	€ 100,00 zzgl. Ausgabeaufschlag
Anteilklasse I	€ 100,00 zzgl. Ausgabeaufschlag

Ausgabeaufschlag

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

Mindestanlagesumme

Anteilklasse R	keine
Anteilklasse I	€ 250.000,00 nur bei Erstanlage (bei Folgeanlagen: keine)

Verwaltungsvergütung*

Anteilklasse R	0,155% p.a. effektiv
Anteilklasse I	0,10% p.a. effektiv

Verwahrstellenvergütung

Anteilklasse R	0,025% p.a. effektiv
Anteilklasse I	0,025% p.a. effektiv

Asset Management-Vergütung

Anteilklasse R	1,27% p.a. effektiv
Anteilklasse I	0,57% p.a. effektiv

Währung

Anteilklasse R	EUR
Anteilklasse I	EUR

Ertragsverwendung

Anteilklasse R	ausschüttend
Anteilklasse I	ausschüttend

Wertpapier-Kennnummer / ISIN:

Anteilklasse R	A2H5XX / DE000A2H5XX8
Anteilklasse I	A2H5XY / DE000A2H5XY6

*Unterliegt einer Staffelung

Halbjahresbericht 7orca Vega Return

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 71.352.213,88 (Stand: September 2022)

Geschäftsführer:

Frank Eggloff, München
Mathias Heiß, Langen
Katja Müller, Bad Homburg v. d. Höhe
Markus Neubauer, Frankfurt am Main
Axel Vespermann, Dreieich

Aufsichtsrat:

Prof. Dr. Harald Wiedmann (Vorsitzender), Berlin
Dr. Axel Eckhardt, Düsseldorf
Ellen Engelhardt
Daniel Fischer, Bad Vilbel
Janet Zirlewagen

2. Verwahrstelle

BNP Paribas S.A. Niederlassung Deutschland

Hausanschrift:

Senckenberganlage 19
60325 Frankfurt am Main

Telefon: 069 / 15205-0
Telefax: 069 / 15205-550
www.bnpparibas.de

Rechtsform: Zweigniederlassung einer Aktiengesellschaft nach französischem Recht
Haftendes Eigenkapital: Mio. € 122.507 (Stand: 31.12.2021)

3. Asset Management-Gesellschaft und Vertrieb

7orca Asset Management AG

Postanschrift:

Am Sandtorkai 77
20457 Hamburg

Telefon +49 40 334 60 46-0
www.7orca.com

4. Anlageausschuss

Jasper Dux
7orca Asset Management AG, Hamburg

Thimo Koch
7orca Asset Management AG, Hamburg

Tindaro Siragusano
7orca Asset Management AG, Hamburg