

KAPITALVERWALTUNGSGESELLSCHAFT:



7orca Vega Income

JAHRESBERICHT

ZUM 31. DEZEMBER 2023

VERWAHRSTELLE:



ASSET MANAGEMENT UND VERTRIEB:



Jahresbericht 7orca Vega Income

Tätigkeitsbericht

für den Berichtszeitraum vom 1. Januar 2023 bis 31. Dezember 2023

Anlageziele und Anlagepolitik zur Erreichung der Anlageziele

Die Anlagestrategie des Fonds zielt auf eine langfristige positive Rendite ab, die überwiegend unabhängig vom vorherrschenden Wirtschafts- und Zinszyklus ist. Dazu wird die Volatilitätsrisikoprämie in unterschiedlichen Anlageklassen (mit Ausnahme von Aktien) und Basiswerten über den Verkauf von Optionen systematisch vereinnahmt. Kern der Strategie ist eine dynamische und regelbasierte Optionsstrategie. Durch ein striktes und kontinuierliches Risikomanagement wird darüber hinaus ein attraktives Rendite-Risiko-Verhältnis angestrebt. Als Basisinvestment wird physisch überwiegend in Anleihen mit kurzer Laufzeit und hervorragender Bonität angelegt.

Struktur des Portfolios und wesentliche Veränderungen im Berichtszeitraum

Fondsstruktur

| | 31.12.2023 | | 31.12.2022 | |
|----------------------------------|---------------|---------------------------|---------------|---------------------------|
| | Kurswert | % Anteil Fondsvermögen | Kurswert | % Anteil Fondsvermögen |
| Renten | 13.826.710,00 | 82,90 | 14.402.242,00 | 87,65 |
| Fondsanteile | 1.432.942,80 | 8,59 | 1.386.403,80 | 8,44 |
| Optionen | -229.604,79 | -1,38 | -436.544,86 | -2,66 |
| Futures | -3.037,57 | -0,02 | 24.335,01 | 0,15 |
| Bankguthaben | 1.583.773,18 | 9,50 | 1.056.865,12 | 6,43 |
| Zins- und Dividendenansprüche | 104.995,77 | 0,63 | 43.762,63 | 0,27 |
| Sonstige Ford./Verbindlichkeiten | -37.829,93 | -0,23 | -45.548,24 | -0,28 |
| Fondsvermögen | 16.677.949,46 | 100,00 | 16.431.515,47 | 100,00 |

Jahresbericht 7orca Vega Income

Im Jahr 2023 hat das Tempo der Zinserhöhung seitens der meisten globalen Zentralbanken deutlich abgenommen. Die US Federal Reserve hatte die Federal Funds Target Rate seit Ende Juli bei einem Level von 5,50% (Upper Bound) belassen. Auch die Europäische Zentralbank hat zuletzt im September agiert, sodass der Leitzins seitdem auf einem etwas niedrigeren Niveau von 4,50% verharrte.

Für Turbulenzen am Zinsmarkt sorgte die Insolvenz der Silicon Valley Bank in den USA und die Schieflage der Credit Suisse mit der späteren Übernahme durch die UBS im März. Die implizite Volatilität des Bund Futures schnellte kurzzeitig auf die extremen Werte aus dem Vorjahr, infolge der massiven Zinserhöhungsschritte der EZB, hoch. Der globale Anleihenindex in USD (LEGATRUU Index) verzeichnete einen Wertzuwachs von +5,72% in 2023. Diese Performance kam allerdings hauptsächlich aus den Monaten November/Dezember, als auf erste Zinssenkungen früh in 2024 spekuliert wurde. Im Zuge der massiven Zinserhöhungen in 2022 und Anfang 2023 stieg die laufende Rendite bei Anleihen merklich.

Der 7orca Vega Income verzeichnete eine Jahresperformance von +7,89% (Anteilsklasse I). Beide Optionsteilstrategien im Anleihen- und Währungsbereich erzielten einen positiven Performancebeitrag. Die Optionsteilstrategie im Anleihenbereich zeigte sich im Zuge der o.g. Turbulenzen im März schwächer, konnte den Drawdown im weiteren Jahresverlauf jedoch aufholen. Alle Einzelstrategien bei den Optionen auf Währungsfutures lieferten einen positiven Performancebeitrag. Dabei stachen die Teilstrategien auf AUD/USD und GBP/USD Futures hervor. Die physischen Anleihen im Portfolio konnten mit einer hohen laufenden Rendite ebenfalls signifikant zur Jahresperformance beitragen.

Zum Januar wurde die Allokation der Optionsstrategien angepasst, sodass alle Teilstrategien innerhalb der zwei Anlageklassen Anleihen (2 Basiswerte) und Währungen (5 Basiswerte) gleichgewichtet wurden.

Wesentliche Risiken

Allgemeine Marktpreisrisiken

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

Die Ukraine-Krise und die dadurch ausgelösten Marktturbulenzen und Sanktionen der Industrienationen gegenüber Russland haben eine Vielzahl an unterschiedlichen Auswirkungen auf die Finanzmärkte im Allgemeinen und auf Fonds (Sondervermögen) im Speziellen. Die Bewegungen an den Börsen werden sich entsprechend auch im Fondsvermögen (Wert des Sondervermögens) widerspiegeln.

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

Zinsänderungsrisiken

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

Jahresbericht Torca Vega Income

Adressenausfallrisiken / Emittentenrisiken

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

Bonitätsrisiken

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

Risiken im Zusammenhang mit Zielfonds

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

Risiken im Zusammenhang mit Derivategeschäften

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

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

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

Währungsrisiken

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

Jahresbericht 7orca Vega Income

Fondsergebnis

Die wesentlichen Quellen des positiven Veräußerungsergebnisses während des Berichtszeitraums waren realisierte Gewinne aus verkauften Optionen.

Wertentwicklung im Berichtszeitraum (1. Januar 2023 bis 31. Dezember 2023)¹.

Anteilklasse I: +7,89%

Anteilklasse R: +7,11%

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

Vermögensübersicht zum 31.12.2023

| Anlageschwerpunkte | Tageswert in EUR | % Anteil am Fondsvermögen |
|----------------------------------|----------------------|------------------------------|
| I. Vermögensgegenstände | 16.715.779,39 | 100,23 |
| 1. Anleihen | 13.826.710,00 | 82,90 |
| < 1 Jahr | 6.603.463,00 | 39,59 |
| >= 1 Jahr bis < 3 Jahre | 7.223.247,00 | 43,31 |
| 2. Derivate | -232.642,36 | -1,39 |
| 3. Bankguthaben | 1.583.773,18 | 9,50 |
| 4. Geldmarktfonds | 1.432.942,80 | 8,59 |
| 5. Sonstige Vermögensgegenstände | 104.995,77 | 0,63 |
| II. Verbindlichkeiten | -37.829,93 | -0,23 |
| III. Fondsvermögen | 16.677.949,46 | 100,00 |

Jahresbericht Torca Vega Income

Vermögensaufstellung zum 31.12.2023

| Gattungsbezeichnung | ISIN | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000 | Bestand 31.12.2023 | Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum | Verkäufe / Abgänge | Kurs | Kurswert in EUR | % des Fonds- vermögens |
|--|--------------|-------|---|-----------------------|---|-----------------------|------------|----------------------|------------------------------|
| Bestandspositionen | | | | | | | EUR | 13.826.710,00 | 82,90 |
| Börsengehandelte Wertpapiere | | | | | | | EUR | 13.826.710,00 | 82,90 |
| Verzinsliche Wertpapiere | | | | | | | EUR | 13.826.710,00 | 82,90 |
| 0,1250 % Aareal Bank AG MTN-HPF.S.226 v.2019(2024) | DE000AAR0249 | | EUR | 600 | 0 | 0 % | 99,694 | 598.164,00 | 3,59 |
| 1,0000 % Banco Santander S.A. EO-Cédulas Hipotec. 2015(25) | ES0413790397 | | EUR | 400 | 0 | 0 % | 97,172 | 388.688,00 | 2,33 |
| 0,3980 % BPCE SFH EO-Med.-T.Obl.Fin.Hab.2015(25) | FR0012695716 | | EUR | 800 | 0 | 0 % | 96,424 | 771.392,00 | 4,63 |
| 2,8000 % Bundesrep.Deutschland Bundesschatzanw. v.23(25) | DE000BU22015 | | EUR | 600 | 600 | 0 % | 100,185 | 601.110,00 | 3,60 |
| 3,2170 % Cie de Financement Foncier EO-FLR MTN Obl. Fonc.2004(24) | FR0010101832 | | EUR | 500 | 500 | 0 % | 99,033 | 495.165,00 | 2,97 |
| 0,3750 % Cie de Financement Foncier EO-Med.-T. Obl.Fonc. 2017(24) | FR0013281748 | | EUR | 500 | 0 | 0 % | 97,174 | 485.870,00 | 2,91 |
| 0,0500 % Cie de Financement Foncier EO-Med.-T. Obl.Fonc. 2020(24) | FR0013507365 | | EUR | 1.000 | 1.000 | 0 % | 98,937 | 989.370,00 | 5,93 |
| 1,7500 % Council of Europe Developm.Bk EO-Medium-Term Notes 2014(24) | XS1060350326 | | EUR | 500 | 500 | 0 % | 99,378 | 496.890,00 | 2,98 |
| 0,6250 % Crédit Mutuel Home Loan SFH SA EO-Med.-T.Obl.Fin.Hab.2017(25) | FR0013236247 | | EUR | 400 | 0 | 0 % | 97,042 | 388.168,00 | 2,33 |
| 0,5000 % Eika BoligKreditt A.S. EO-Med.-Term Cov. MTN 2018(25) | XS1869468808 | | EUR | 600 | 600 | 0 % | 95,925 | 575.550,00 | 3,45 |
| 4,1250 % European Investment Bank EO-Medium-Term Notes 2007(24) | XS0290050524 | | EUR | 500 | 500 | 0 % | 100,132 | 500.660,00 | 3,00 |
| 5,4000 % Irland EO-Treasury Bonds 2009(25) | IE00B4TV0D44 | | EUR | 600 | 600 | 0 % | 102,808 | 616.848,00 | 3,70 |
| 0,6250 % Länsförsäkringar Hypotek AB EO-Med.-Term Cov. Nts 2018(25) | XS1799048704 | | EUR | 800 | 0 | 0 % | 96,775 | 774.200,00 | 4,64 |
| 0,0000 % Lb.Hessen-Thüringen GZ MTN HPF S.H335 v.19(24) | XS2022037795 | | EUR | 600 | 600 | 0 % | 98,142 | 588.852,00 | 3,53 |
| 0,3750 % Norddeutsche Landesbank -GZ- MTN-HPF S.486 v.17(25) | DE000DHY4861 | | EUR | 600 | 0 | 0 % | 96,122 | 576.732,00 | 3,46 |
| 0,3750 % Raiffeisenl.Niederöst.-Wien AG EO-Medium-Term Notes 2017(24) | XS1681119167 | | EUR | 600 | 0 | 0 % | 97,726 | 586.356,00 | 3,52 |
| 3,0000 % Rheinland-Pfalz, Land Landessch.v.2023 (2025) | DE000RLP1395 | | EUR | 500 | 500 | 0 % | 99,784 | 498.920,00 | 2,99 |
| 0,0500 % Skandinaviska Enskilda Banken EO-Medium-Term Notes 2019(24) | XS2020568734 | | EUR | 600 | 0 | 0 % | 98,077 | 588.462,00 | 3,53 |
| 0,5000 % Société Générale SFH S.A. EO-M.-T.Obl.Fin.Hab. 2017(25) | FR0013259413 | | EUR | 800 | 0 | 0 % | 96,392 | 771.136,00 | 4,62 |
| 0,3750 % SpareBank 1 Boligkreditt AS EO-M.-T. Mortg.Cov.Bds 17(24) | XS1637099026 | | EUR | 600 | 0 | 0 % | 98,361 | 590.166,00 | 3,54 |
| 0,3750 % SR-Boligkreditt A.S. EO-Mortg. Covered MTN 2017(24) | XS1692489583 | | EUR | 700 | 0 | 0 % | 97,644 | 683.508,00 | 4,10 |
| 0,5000 % Swedish Covered Bond Corp.,The EO-Medium-Term Notes 2018(25) | XS1759602953 | | EUR | 500 | 0 | 0 % | 96,971 | 484.855,00 | 2,91 |
| 0,7500 % UniCredit Bank Austria AG EO-Med.-T.Hyp.Pf.-Br. 2015(25) | AT000B049572 | | EUR | 800 | 0 | 0 % | 96,956 | 775.648,00 | 4,65 |
| Summe Wertpapiervermögen 2) | | | | | | | EUR | 13.826.710,00 | 82,90 |

Jahresbericht Torca Vega Income

Vermögensaufstellung zum 31.12.2023

| Gattungsbezeichnung | ISIN | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000 | Bestand 31.12.2023 | Käufe / Zugänge | Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum | Kurs | Kurswert in EUR | % des Fonds- vermögens | |
|---|------|-------|---|-----------------------|--------------------|--|------------|--------------------|------------------------------|-------|
| Derivate | | | | | | | EUR | -232.642,36 | -1,39 | |
| (Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.) | | | | | | | | | | |
| Optionsrechte | | | | | | | EUR | -59.043,44 | -0,35 | |
| Optionsrechte auf Zinsterminkontrakte | | | | | | | EUR | -59.043,44 | -0,35 | |
| FUTURE EU-BUND 03.24 CALL 26.01.24 BP 139,50 EUREX | | | 185 | EUR | Anzahl | -34 | EUR | 0,510 | -6.800,00 | -0,04 |
| FUTURE EU-BUND 03.24 CALL 26.01.24 BP 142,00 EUREX | | | 185 | EUR | Anzahl | -33 | EUR | 0,170 | 2.640,00 | 0,02 |
| FUTURE EU-BUND 03.24 CALL 26.01.24 BP 142,50 EUREX | | | 185 | EUR | Anzahl | -33 | EUR | 0,130 | 4.950,00 | 0,03 |
| FUTURE EU-BUND 03.24 PUT 26.01.24 BP 131,50 EUREX | | | 185 | EUR | Anzahl | -34 | EUR | 0,080 | 5.440,00 | 0,03 |
| FUTURE EU-BUND 03.24 PUT 26.01.24 BP 134,50 EUREX | | | 185 | EUR | Anzahl | -33 | EUR | 0,380 | -3.300,00 | -0,02 |
| FUTURE EU-BUND 03.24 PUT 26.01.24 BP 135,00 EUREX | | | 185 | EUR | Anzahl | -33 | EUR | 0,490 | -7.260,00 | -0,04 |
| FUT 10Y TR 1W 03.24 CALL 05.01.24 BP 112,75 CBOT | | | 362 | USD | Anzahl | -56 | USD | 0,563 | -28.519,69 | -0,17 |
| FUT 10Y TR 1W 03.24 PUT 05.01.24 BP 108,25 CBOT | | | 362 | USD | Anzahl | -56 | USD | 0,001 | -50,70 | 0,00 |
| FUT 10Y TR 2W 03.24 CALL 12.01.24 BP 115,00 CBOT | | | 362 | USD | Anzahl | -56 | USD | 0,125 | -6.337,71 | -0,04 |
| FUT 10Y TR 2W 03.24 PUT 12.01.24 BP 110,25 CBOT | | | 362 | USD | Anzahl | -56 | USD | 0,047 | -2.376,64 | -0,01 |
| FUTURE 10Y TREA 03.24 CALL 26.01.24 BP 115,75 CBOT | | | 362 | USD | Anzahl | -56 | USD | 0,172 | -8.714,35 | -0,05 |
| FUTURE 10Y TREA 03.24 PUT 26.01.24 BP 110,50 CBOT | | | 362 | USD | Anzahl | -56 | USD | 0,172 | -8.714,35 | -0,05 |
| Devisen-Derivate | | | | | | | EUR | -173.598,92 | -1,04 | |
| Forderungen/Verbindlichkeiten | | | | | | | | | | |
| Optionsrechte | | | | | | | EUR | -170.561,35 | -1,02 | |
| Optionsrechte auf Devisen | | | | | | | EUR | -170.561,35 | -1,02 | |
| F FX AUD/USD 2PM 03.24 CALL 05.01.24 BP 68,00 CME | | | 352 | USD | | -34.000 | USD | 0,510 | -15.699,41 | -0,09 |
| F FX AUD/USD 2PM 03.24 PUT 05.01.24 BP 64,00 CME | | | 352 | USD | | -34.000 | USD | 0,005 | -153,92 | 0,00 |
| F FX AUD/USD W 03.24 CALL 12.01.24 BP 67,75 CME | | | 352 | USD | | -33.000 | USD | 0,840 | -25.097,33 | -0,15 |
| F FX AUD/USD W 03.24 CALL 19.01.24 BP 69,50 CME | | | 352 | USD | | -33.000 | USD | 0,180 | -5.378,00 | -0,03 |
| F FX AUD/USD W 03.24 CALL 26.01.24 BP 70,50 CME | | | 352 | USD | | -32.000 | USD | 0,080 | -2.317,79 | -0,01 |
| F FX AUD/USD W 03.24 PUT 12.01.24 BP 64,00 CME | | | 352 | USD | | -33.000 | USD | 0,005 | -149,39 | 0,00 |
| F FX AUD/USD W 03.24 PUT 19.01.24 BP 65,75 CME | | | 352 | USD | | -33.000 | USD | 0,030 | -896,33 | -0,01 |

Jahresbericht Torca Vega Income

Vermögensaufstellung zum 31.12.2023

| Gattungsbezeichnung | ISIN | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000 | Bestand 31.12.2023 | Käufe / Zugänge | Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum | Kurs | Kurswert in EUR | % des Fonds- vermögens | |
|--|------|-------|---|-----------------------|--------------------|--|------|--------------------|------------------------------|-------|
| F FX AUD/USD W 03.24 PUT 26.01.24 BP 66,50 CME | | | 352 | USD | -32.000 | | USD | 0,130 | -3.766,41 | -0,02 |
| F FX EUR/USD 2PM 03.24 CALL 05.01.24 BP 1,105 CME | | | 352 | USD | -2.250.000 | | USD | 0,007 | -13.648,71 | -0,08 |
| F FX EUR/USD 2PM 03.24 PUT 05.01.24 BP 1,06 CME | | | 352 | USD | -2.250.000 | | USD | 0,000 | -101,86 | 0,00 |
| F FX EUR/USD W 03.24 CALL 12.01.24 BP 1,12 CME | | | 352 | USD | -2.250.000 | | USD | 0,002 | -4.481,67 | -0,03 |
| F FX EUR/USD W 03.24 CALL 19.01.24 BP 1,125 CME | | | 352 | USD | -2.250.000 | | USD | 0,002 | -3.870,53 | -0,02 |
| F FX EUR/USD W 03.24 CALL 26.01.24 BP 1,135 CME | | | 352 | USD | -2.250.000 | | USD | 0,001 | -2.240,83 | -0,01 |
| F FX EUR/USD W 03.24 PUT 12.01.24 BP 1,08 CME | | | 352 | USD | -2.250.000 | | USD | 0,000 | -305,57 | 0,00 |
| F FX EUR/USD W 03.24 PUT 19.01.24 BP 1,0825 CME | | | 352 | USD | -2.250.000 | | USD | 0,001 | -1.222,27 | -0,01 |
| F FX EUR/USD W 03.24 PUT 26.01.24 BP 1,09 CME | | | 352 | USD | -2.250.000 | | USD | 0,002 | -3.870,53 | -0,02 |
| F FX GBP/USD 03.24 CALL 12.01.24 BP 128,25 CME | | | 359 | USD | -17.500 | | USD | 0,390 | -6.179,27 | -0,04 |
| F FX GBP/USD 03.24 CALL 19.01.24 BP 130,00 CME | | | 359 | USD | -17.500 | | USD | 0,130 | -2.059,76 | -0,01 |
| F FX GBP/USD 03.24 CALL 26.01.24 BP 130,50 CME | | | 359 | USD | -17.500 | | USD | 0,120 | -1.901,31 | -0,01 |
| F FX GBP/USD 03.24 PUT 12.01.24 BP 123,00 CME | | | 359 | USD | -17.500 | | USD | 0,010 | -158,44 | 0,00 |
| F FX GBP/USD 03.24 PUT 19.01.24 BP 124,75 CME | | | 359 | USD | -17.500 | | USD | 0,090 | -1.425,98 | -0,01 |
| F FX GBP/USD 03.24 PUT 26.01.24 BP 125,00 CME | | | 359 | USD | -17.500 | | USD | 0,190 | -3.010,41 | -0,02 |
| F FX GBP/USD 2PM 03.24 CALL 05.01.24 BP 129,50 CME | | | 359 | USD | -17.500 | | USD | 0,010 | -158,44 | 0,00 |
| F FX GBP/USD 2PM 03.24 PUT 05.01.24 BP 123,50 CME | | | 359 | USD | -17.500 | | USD | 0,010 | -158,44 | 0,00 |
| F FX JPY/USD 2PM 03.24 CALL 05.01.24 BP 73,00 CME | | | 352 | USD | -35.000 | | USD | 0,040 | -1.267,54 | -0,01 |
| F FX JPY/USD 2PM 03.24 PUT 05.01.24 BP 68,00 CME | | | 352 | USD | -35.000 | | USD | 0,005 | -158,44 | 0,00 |
| F FX JPY/USD W 03.24 CALL 12.01.24 BP 74,50 CME | | | 352 | USD | -35.000 | | USD | 0,025 | -792,21 | 0,00 |
| F FX JPY/USD W 03.24 CALL 19.01.24 BP 73,50 CME | | | 352 | USD | -35.000 | | USD | 0,140 | -4.436,40 | -0,03 |
| F FX JPY/USD W 03.24 CALL 26.01.24 BP 74,50 CME | | | 352 | USD | -35.000 | | USD | 0,150 | -4.753,28 | -0,03 |
| F FX JPY/USD W 03.24 PUT 12.01.24 BP 69,25 CME | | | 352 | USD | -35.000 | | USD | 0,010 | -316,89 | 0,00 |
| F FX JPY/USD W 03.24 PUT 19.01.24 BP 69,50 CME | | | 352 | USD | -35.000 | | USD | 0,050 | -1.584,43 | -0,01 |
| F FX JPY/USD W 03.24 PUT 26.01.24 BP 69,75 CME | | | 352 | USD | -35.000 | | USD | 0,160 | -5.070,17 | -0,03 |
| FUT FX CAD/USD W 03.24 CALL 12.01.24 BP 75,75 CME | | | 352 | USD | -34.000 | | USD | 0,410 | -12.621,10 | -0,08 |
| FUT FX CAD/USD W 03.24 CALL 19.01.24 BP 76,25 CME | | | 352 | USD | -33.000 | | USD | 0,250 | -7.469,44 | -0,04 |
| FUT FX CAD/USD W 03.24 CALL 26.01.24 BP 77,00 CME | | | 352 | USD | -33.000 | | USD | 0,110 | -3.286,56 | -0,02 |
| FUT FX CAD/USD W 03.24 PUT 12.01.24 BP 73,50 CME | | | 352 | USD | -34.000 | | USD | 0,005 | -153,92 | 0,00 |
| FUT FX CAD/USD W 03.24 PUT 19.01.24 BP 74,00 CME | | | 352 | USD | -33.000 | | USD | 0,015 | -448,17 | 0,00 |
| FUT FX CAD/USD W 03.24 PUT 26.01.24 BP 74,50 CME | | | 352 | USD | -33.000 | | USD | 0,070 | -2.091,44 | -0,01 |
| FUTURE FX CAD/USD 03.24 CALL 05.01.24 BP 75,00 CME | | | 352 | USD | -34.000 | | USD | 0,900 | -27.704,84 | -0,17 |
| FUTURE FX CAD/USD 03.24 PUT 05.01.24 BP 72,50 CME | | | 352 | USD | -34.000 | | USD | 0,005 | -153,92 | 0,00 |

**Jahresbericht
7orca Vega Income**

Vermögensaufstellung zum 31.12.2023

| Gattungsbezeichnung | ISIN | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000 | Bestand 31.12.2023 | Käufe / Zugänge | Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum | Kurs | Kurswert in EUR | % des Fonds- vermögens |
|-------------------------------------|------|-------|---|-----------------------|--------------------|--|------------|--------------------|------------------------------|
| Währungsterminkontrakte | | | | | | | EUR | -3.037,57 | -0,02 |
| FUTURE CROSS RATE AUD/USD 03.24 CME | | 352 | USD | 11.000 | | | USD 68,395 | -3.001,36 | -0,02 |
| FUTURE CROSS RATE CAD/USD 03.24 CME | | 352 | USD | 16.000 | | | USD 75,930 | 1.435,04 | 0,01 |
| FUTURE CROSS RATE EUR/USD 03.24 CME | | 352 | USD | 250.000 | | | USD 1,108 | -1.471,25 | -0,01 |

Jahresbericht Torca Vega Income

Vermögensaufstellung zum 31.12.2023

| Gattungsbezeichnung | ISIN | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000 | Bestand 31.12.2023 | Käufe / Zugänge | Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum | Kurs | Kurswert in EUR | % des Fonds- vermögens |
|---|--------------|-------|---|-----------------------|--------------------|--|-----------------|----------------------|------------------------------|
| Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds | | | | | | | EUR | 3.016.715,98 | 18,09 |
| Bankguthaben | | | | | | | EUR | 1.583.773,18 | 9,50 |
| EUR - Guthaben bei: | | | | | | | | | |
| BNP Paribas S.A., Niederlassung Deutschland | | | EUR | 1.119.609,51 | | | % 100,000 | 1.119.609,51 | 6,71 |
| Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen bei: | | | | | | | | | |
| BNP Paribas S.A., Niederlassung Deutschland | | | USD | 512.668,78 | | | % 100,000 | 464.163,67 | 2,78 |
| Geldmarktfonds | | | | | | | EUR | 1.432.942,80 | 8,59 |
| Gruppenfremde Geldmarktfonds | | | | | | | EUR | 1.432.942,80 | 8,59 |
| AMUNDI EURO LIQUIDITY SRI Actions au Porteur IC o.N. | FR0010251660 | | ANT | 6 | 1 | 1 | EUR 238.823,800 | 1.432.942,80 | 8,59 |
| Sonstige Vermögensgegenstände | | | | | | | EUR | 104.995,77 | 0,63 |
| Zinsansprüche | | | EUR | 104.995,77 | | | | 104.995,77 | 0,63 |
| Sonstige Verbindlichkeiten | | | | | | | EUR | -37.829,93 | -0,23 |
| Verwaltungsvergütung | | | EUR | -6.327,07 | | | | -6.327,07 | -0,04 |
| Verwahrstellenvergütung | | | EUR | -2.471,45 | | | | -2.471,45 | -0,01 |
| Prüfungskosten | | | EUR | -7.578,89 | | | | -7.578,89 | -0,05 |
| Veröffentlichungskosten | | | EUR | -497,22 | | | | -497,22 | 0,00 |
| Portfoliomanagervergütung | | | EUR | -20.955,30 | | | | -20.955,30 | -0,13 |
| Fondsvermögen | | | | | | | EUR | 16.677.949,46 | 100,00 1) |

Jahresbericht Torca Vega Income

Vermögensaufstellung zum 31.12.2023

| Gattungsbezeichnung | ISIN | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000 | Bestand 31.12.2023 | Käufe / Zugänge | Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum | Kurs | Kurswert in EUR | % des Fonds- vermögens |
|---|------|-------|---|-----------------------|--------------------|--|------|--------------------|------------------------------|
| Torca Vega Income Anteilklasse I | | | | | | | | | |
| Anteilwert | | | | | | | EUR | 85,46 | |
| Ausgabepreis | | | | | | | EUR | 85,46 | |
| Rücknahmepreis | | | | | | | EUR | 85,46 | |
| Anzahl Anteile | | | | | | | STK | 185.400 | |
| Torca Vega Income Anteilklasse R | | | | | | | | | |
| Anteilwert | | | | | | | EUR | 83,36 | |
| Ausgabepreis | | | | | | | EUR | 83,36 | |
| Rücknahmepreis | | | | | | | EUR | 83,36 | |
| Anzahl Anteile | | | | | | | STK | 10.003 | |

Fußnoten:

- 1) Durch Rundung der Prozent-Anteile bei der Berechnung können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.
- 2) Die Wertpapiere und Schuldscheindarlehen des Sondervermögens sind teilweise durch Geschäfte mit Finanzinstrumenten abgesichert.

Jahresbericht 7orca Vega Income

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Devisenkurse (in Mengennotiz)

| | | | |
|-----|-------|-----------------------------|---------------|
| USD | (USD) | per 29.12.2023 1,1045000 | = 1 EUR (EUR) |
|-----|-------|-----------------------------|---------------|

Marktschlüssel

Terminbörsen

| | |
|-----|------------------------|
| 185 | Eurex Deutschland |
| 352 | Chicago - CME Globex |
| 359 | Chicago Merc. Ex. |
| 362 | Chicago Board of Trade |

**Jahresbericht
Torca Vega Income**

**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 | | | | | |
| 0,3750 % Nord/LB Lux.S.A. Cov.Bond Bk. EO-M.-T.Lett.d.Ga.Publ. 16(23) | XS1432510631 | EUR | 0 | 400 | |
| 0,7500 % SR-Boligkredit A.S. EO-Mortg. Covered MTN 2016(23) | XS1344895450 | EUR | 0 | 600 | |
| Nichtnotierte Wertpapiere *) | | | | | |
| Verzinsliche Wertpapiere | | | | | |
| 0,2500 % Aegon Bank N.V. EO-Med.-Term Cov.Bds 2016(23)2 | XS1418849482 | EUR | 0 | 500 | |
| 0,3750 % Bank of Nova Scotia, The EO-M.-T. Mortg.Cov.Bds 16(23) | XS1377941106 | EUR | 0 | 600 | |
| 0,2500 % Canadian Imperial Bk of Comm. EO-Med.-T. Cov.Bonds 2018(23) | XS1756725831 | EUR | 0 | 700 | |
| 0,3750 % Hessen, Land Schatzanw. S.1507 v.2015(2023) | DE000A1RQCJ3 | EUR | 0 | 600 | |
| 0,2500 % Jyske Realkredit A/S EO-Cov. Bonds 2016(23) | XS1435774903 | EUR | 0 | 700 | |
| 4,5621 % L-Bank Bad.-Württ.-Förderbank FLR MTN Serie 5608 v.20(23) | XS2166345608 | EUR | 0 | 500 | |
| 0,2500 % Nordea Mortgage Bank PLC EO-Med.-Term Cov. Bds 2018(23) | XS1784067529 | EUR | 0 | 500 | |
| 0,2500 % Royal Bank of Canada EO-M.-T. Mortg.Cov.Bds 18(23) | XS1847633119 | EUR | 0 | 600 | |
| 0,2500 % Toronto-Dominion Bank, The EO-Med.-Term Cov.Bds 2018(23) | XS1790069790 | EUR | 0 | 500 | |

**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 |
|---------------------|------|-------------------------------------|--------------------------|-----------------------------|---------------------|
|---------------------|------|-------------------------------------|--------------------------|-----------------------------|---------------------|

Derivate

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

Terminkontrakte

Zinsterminkontrakte

Verkaufte Kontrakte:

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

EUR

66.625,94

Gekaufte Kontrakte:

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

EUR

130.262,24

Währungsterminkontrakte

Gekaufte Kontrakte:

(Basiswert(e): CROSS RATE AD/DL, CROSS RATE CD/DL, CROSS RATE EO/DL, CROSS RATE LS/DL, CROSS RATE YN/DL)

EUR

172.084,92

Verkaufte Kontrakte:

(Basiswert(e): CROSS RATE AD/DL, CROSS RATE CD/DL, CROSS RATE EO/DL, CROSS RATE LS/DL, CROSS RATE YN/DL)

EUR

91.913,21

Jahresbericht 7orca Vega Income

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

Optionsrechte auf Zins-Derivate

Optionsrechte auf Zinsterminkontrakte

Gekaufte Verkaufsoptionen (Put):

(Basiswert(e): FUTURE EURO-BUND 07.12.23 EUREX)

EUR

8,57

Verkaufte Kaufoptionen (Call):

(Basiswert(e): FUTURE 10Y TREA.NT.(SYN.) 5W 19.03.24 CBOT, FUTURE 10Y TREA.NT.(SYN.) 5W 19.12.23 CBOT, FUTURE 10Y TREA.NT.(SYN.)3W 19.03.24 CBOT, FUTURE 10Y TREA.NT.(SYN.)3W 19.12.23 CBOT, 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 (SY.) 1W. 19.03.24 CBOT, FUTURE 10Y TREASURY NOTE (SY.) 1W. 19.12.23 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.) 19.03.24 CBOT, FUTURE 10Y TREASURY NOTE (SYNTH.) 19.12.23 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.) 4W. 09.23 CBOT, FUTURE 10Y TREASURY NOTE (SYNTH.) 5W. 06.23 CBOT, FUTURE 10Y TREASURY NOTE (SYNTH.) 5W. 09.23 CBOT, FUTURE 10YTRN2W 03.23 CBOT, FUTURE 10YTRN2W 06.23 CBOT, FUTURE 10YTRN2W 09.23 CBOT, FUTURE 10YTRN2W 19.03.24 CBOT, FUTURE 10YTRN2W 19.12.23 CBOT, FUTURE EURO-BUND 03.23 EUREX, FUTURE EURO-BUND 06.23 EUREX, FUTURE EURO-BUND 07.03.24 EUREX, FUTURE EURO-BUND 07.12.23 EUREX, FUTURE EURO-BUND 09.23 EUREX)

EUR

945,17

**Jahresbericht
Torca Vega Income**

**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 |
|--|------|-------------------------------------|--------------------------|-----------------------------|---------------------|
| Verkaufte Verkaufsoptionen (Put): (Basiswert(e): FUTURE 10Y TREA.NT.(SYN.) 5W 19.03.24 CBOT, FUTURE 10Y TREA.NT.(SYN.) 5W 19.12.23 CBOT, FUTURE 10Y TREA.NT.(SYN.)3W 19.03.24 CBOT, FUTURE 10Y TREA.NT.(SYN.)3W 19.12.23 CBOT, 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 (SY.) 1W. 19.03.24 CBOT, FUTURE 10Y TREASURY NOTE (SY.) 1W. 19.12.23 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.) 19.03.24 CBOT, FUTURE 10Y TREASURY NOTE (SYNTH.) 19.12.23 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.) 4W. 09.23 CBOT, FUTURE 10Y TREASURY NOTE (SYNTH.) 5W. 06.23 CBOT, FUTURE 10Y TREASURY NOTE (SYNTH.) 5W. 09.23 CBOT, FUTURE 10YTRN2W 03.23 CBOT, FUTURE 10YTRN2W 06.23 CBOT, FUTURE 10YTRN2W 09.23 CBOT, FUTURE 10YTRN2W 19.03.24 CBOT, FUTURE 10YTRN2W 19.12.23 CBOT, FUTURE EURO-BUND 03.23 EUREX, FUTURE EURO-BUND 06.23 EUREX, FUTURE EURO-BUND 07.03.24 EUREX, FUTURE EURO-BUND 07.12.23 EUREX, FUTURE EURO-BUND 09.23 EUREX) | | EUR | | | 887,87 |

Optionsrechte auf Devisen-Derivate

Optionsrechte auf Devisen

| | | | | | |
|-------------------------------------|--|-----|--|--|------|
| Verkaufte Kaufoptionen (Call):) | | EUR | | | 0,00 |
|-------------------------------------|--|-----|--|--|------|

**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 EUR 09.23 CME, FUTURE CROSS RATE AUD/USD 2PM EUR 12.23 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 AUD/USD 2PM W EUR 12.23 CME, FUTURE CROSS RATE CAD/USD 03.23 CME, FUTURE CROSS RATE CAD/USD 03.24 CME, FUTURE CROSS RATE CAD/USD 06.23 CME, FUTURE CROSS RATE CAD/USD 09.23 CME, FUTURE CROSS RATE CAD/USD 12.23 CME, FUTURE CROSS RATE CAD/USD 19.09.23 CME, FUTURE CROSS RATE CAD/USD 19.12.23 CME, FUTURE CROSS RATE EUR/USD 2PM , FUTURE CROSS RATE EUR/USD 2PM EUR 06.23 CME, FUTURE CROSS RATE EUR/USD 2PM EUR 09.23 CME, FUTURE CROSS RATE EUR/USD 2PM EUR 12.23 CME, FUTURE CROSS RATE EUR/USD 2PM W EUR 03.23 CME, FUTURE CROSS RATE EUR/USD 2PM W EUR 03.24 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 EUR/USD 2PM W EUR 12.23 CME, FUTURE CROSS RATE GBP/USD 2PM EUR 03.23 CME, FUTURE CROSS RATE GBP/USD 2PM EUR 06.23 CME, FUTURE CROSS RATE GBP/USD 2PM EUR 09.23 CME, FUTURE CROSS RATE GBP/USD 2PM EUR 12.23 CME, FUTURE CROSS RATE GBP/USD 2PM W EUR 03.23 CME, FUTURE CROSS RATE , 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 EUR 09.23 CME, FUTURE CROSS RATE JPY/USD 2PM EUR 12.23 CME, FUTURE CROSS RATE JPY/USD 2PM W EUR 03.23 CME, FUTURE CROSS RATE JPY/USD 2PM W EUR 03.24 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 JPY/USD 2PM W EUR 12.23 CME, FUTURE CROSS RT AUD/USD 2PM W EUR 03.24 CME, FUTURE CROSS RT AUD/USD 2PM W EUR 12.23 CME, FUTURE CROSS RT GBP/USD 2PM W EUR 03.24 CME, FUTURE CROSS RT GBP/USD 2PM W

**Jahresbericht
Torca Vega Income**

**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 |
|--|------|-------------------------------------|--------------------------|-----------------------------|---------------------|
| Verkaufte Verkaufsoptionen (Put):) | | | | | |
| (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 EUR 09.23 CME, FUTURE CROSS RATE AUD/USD 2PM EUR 12.23 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 03.24 CME, FUTURE CROSS RATE CAD/USD 06.23 CME, FUTURE CROSS RATE CAD/USD 09.23 CME, FUTURE CROSS RATE CAD/USD 12.23 CME, FUTURE CROSS RATE CAD/USD 19.09.23 CME, FUTURE CROSS RATE CAD/USD 19.12.23 CME, FUTURE CROSS RATE EUR/USD 2PM , FUTURE CROSS RATE EUR/USD 2PM EUR 06.23 CME, FUTURE CROSS RATE EUR/USD 2PM EUR 09.23 CME, FUTURE CROSS RATE EUR/USD 2PM EUR 12.23 CME, FUTURE CROSS RATE EUR/USD 2PM W EUR 03.23 CME, FUTURE CROSS RATE EUR/USD 2PM W EUR 03.24 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 EUR/USD 2PM W EUR 12.23 CME, FUTURE CROSS RATE GBP/USD 2PM EUR 03.23 CME, FUTURE CROSS RATE GBP/USD 2PM EUR 06.23 CME, FUTURE CROSS RATE GBP/USD 2PM EUR 09.23 CME, FUTURE CROSS RATE GBP/USD 2PM EUR 12.23 CME, FUTURE CROSS RATE GBP/USD 2PM W EUR 03.23 CME, FUTURE CROSS RATE , 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 EUR 09.23 CME, FUTURE CROSS RATE JPY/USD 2PM EUR 12.23 CME, FUTURE CROSS RATE JPY/USD 2PM W EUR 03.23 CME, FUTURE CROSS RATE JPY/USD 2PM W EUR 03.24 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 JPY/USD 2PM W EUR 12.23 CME, FUTURE CROSS RT AUD/USD 2PM W EUR 03.24 CME, FUTURE CROSS RT AUD/USD 2PM W EUR 12.23 CME, FUTURE CROSS RT GBP/USD 2PM W EUR 03.24 CME, FUTURE CROSS RT GBP/USD 2PM W | | EUR | | | -32.507,25 |

**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 |
|--|------|-------------------------------------|--------------------------|-----------------------------|---------------------|
| Gekaufte Verkaufsoptionen (Put): | | | | | |
| (Basiswert(e): FUTURE CROSS RATE EUR/USD 2PM W EUR 12.23 CME, FUTURE CROSS RT GBP/USD 2PM W EUR 12.23 CME) | | EUR | | | 0,09 |

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.

Jahresbericht

7orca Vega Income Anteilklasse I

Ertrags- und Aufwandsrechnung (inkl. Ertragsausgleich) für den Zeitraum vom 01.01.2023 bis zum 31.12.2023

| | | | insgesamt | je Anteil |
|---|-----|------------|--------------------|--------------|
| I. Erträge | | | | |
| 1. Dividenden inländischer Aussteller (vor Körperschaft-/Kapitalertragsteuer) | | EUR | 0,00 | 0,00 |
| 2. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer) | | EUR | 0,00 | 0,00 |
| 3. Zinsen aus inländischen Wertpapieren | | EUR | 31.873,83 | 0,17 |
| 4. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer) | | EUR | 88.002,16 | 0,47 |
| 5. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland | | EUR | 57.751,82 | 0,31 |
| 6. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Ausland (vor Quellensteuer) | | EUR | 0,00 | 0,00 |
| 7. Erträge aus Investmentanteilen | | EUR | 0,00 | 0,00 |
| 8. Erträge aus Wertpapier- Darlehen- und -Pensionsgeschäften | | EUR | 0,00 | 0,00 |
| 9. Abzug inländischer Körperschaft-/Kapitalertragsteuer | | EUR | 0,00 | 0,00 |
| 10. Abzug ausländischer Quellensteuer | | EUR | -679,24 | 0,00 |
| 11. Sonstige Erträge | | EUR | 20,11 | 0,00 |
| Summe der Erträge | | EUR | 176.968,68 | 0,95 |
| II. Aufwendungen | | | | |
| 1. Zinsen aus Kreditaufnahmen | | EUR | -119,84 | 0,00 |
| 2. Verwaltungsvergütung | | EUR | -97.288,71 | -0,53 |
| - Verwaltungsvergütung | EUR | -23.537,59 | | |
| - Beratungsvergütung | EUR | 0,00 | | |
| - Asset Management Gebühr | EUR | -73.751,12 | | |
| 3. Verwahrstellenvergütung | | EUR | -22.724,03 | -0,12 |
| 4. Prüfungs- und Veröffentlichungskosten | | EUR | -5.715,98 | -0,03 |
| 5. Sonstige Aufwendungen | | EUR | -13.679,37 | -0,07 |
| - Depotgebühren | EUR | -17.731,68 | | |
| - Ausgleich ordentlicher Aufwand | EUR | 3.599,66 | | |
| - Sonstige Kosten | EUR | 452,65 | | |
| Summe der Aufwendungen | | EUR | -139.527,92 | -0,75 |
| III. Ordentlicher Nettoertrag | | EUR | 37.440,76 | 0,20 |
| IV. Veräußerungsgeschäfte | | | | |
| 1. Realisierte Gewinne | | EUR | 4.071.676,13 | 21,96 |
| 2. Realisierte Verluste | | EUR | -3.499.099,70 | -18,87 |
| Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften | | EUR | 572.576,43 | 3,09 |
| V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres | | | | |
| 1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne | | EUR | -8.111,91 | -0,04 |
| 2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste | | EUR | 591.128,15 | 3,19 |

Jahresbericht Torca Vega Income Anteilklasse I

| | | | |
|---|-----|--------------|------|
| VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres | EUR | 583.016,24 | 3,15 |
| VII. Ergebnis des Geschäftsjahres | EUR | 1.193.033,43 | 6,44 |

Entwicklung des Sondervermögens

2023

| | | | |
|--|-----|---------------|----------------------|
| I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres | EUR | | 15.653.191,13 |
| 1. Ausschüttung für das Vorjahr/Steuerabschlag für das Vorjahr | EUR | | 0,00 |
| 2. Zwischenausschüttungen | EUR | | 0,00 |
| 3. Mittelzufluss/-abfluss (netto) | EUR | | -1.003.708,70 |
| a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen | EUR | 0,00 | |
| b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen | EUR | -1.003.708,70 | |
| 4. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich | EUR | | 1.575,60 |
| 5. Ergebnis des Geschäftsjahres | EUR | | 1.193.033,43 |
| davon nicht realisierte Gewinne | EUR | -8.111,91 | |
| davon nicht realisierte Verluste | EUR | 591.128,15 | |
| II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres | EUR | | 15.844.091,45 |

Verwendung der Erträge des Sondervermögens

Berechnung der Ausschüttung insgesamt und je Anteil

| | | insgesamt | je Anteil |
|---|-----|-------------------|-------------|
| I. Für die Ausschüttung verfügbar | EUR | 535.481,18 | 2,89 |
| 1. Vortrag aus Vorjahr | EUR | -74.536,01 | -0,40 |
| 2. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres | EUR | 610.017,19 | 3,29 |
| 3. Zuführung aus dem Sondervermögen | EUR | 0,00 | 0,00 |
| II. Nicht für die Ausschüttung verwendet | EUR | 535.481,18 | 2,89 |
| 1. Der Wiederanlage zugeführt | EUR | 0,00 | 0,00 |
| 2. Vortrag auf neue Rechnung | EUR | 535.481,18 | 2,89 |
| III. Gesamtausschüttung | EUR | 0,00 | 0,00 |
| 1. Zwischenausschüttung | EUR | 0,00 | 0,00 |
| 2. Endausschüttung | EUR | 0,00 | 0,00 |

Jahresbericht

7orca Vega Income Anteilklasse I

Vergleichende Übersicht über die letzten drei Geschäftsjahre

| Geschäftsjahr | Umlaufende Anteile am Ende des Geschäftsjahres | | Fondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres | | Anteilwert am Ende des Geschäftsjahres | |
|---------------|---|---------|--|---------------|---|--------|
| 2020 | Stück | 135.528 | EUR | 13.672.349,29 | EUR | 100,88 |
| 2021 | Stück | 237.146 | EUR | 23.978.494,75 | EUR | 101,11 |
| 2022 | Stück | 197.618 | EUR | 15.653.191,13 | EUR | 79,21 |
| 2023 | Stück | 185.400 | EUR | 15.844.091,45 | EUR | 85,46 |

Jahresbericht

7orca Vega Income Anteilklasse R

Ertrags- und Aufwandsrechnung (inkl. Ertragsausgleich) für den Zeitraum vom 01.01.2023 bis zum 31.12.2023

| | | | insgesamt | je Anteil |
|---|-----|------------|-------------------|--------------|
| I. Erträge | | | | |
| 1. Dividenden inländischer Aussteller (vor Körperschaft-/Kapitalertragsteuer) | | EUR | 0,00 | 0,00 |
| 2. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer) | | EUR | 0,00 | 0,00 |
| 3. Zinsen aus inländischen Wertpapieren | | EUR | 1.685,84 | 0,16 |
| 4. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer) | | EUR | 4.652,43 | 0,47 |
| 5. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland | | EUR | 3.053,83 | 0,31 |
| 6. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Ausland (vor Quellensteuer) | | EUR | 0,00 | 0,00 |
| 7. Erträge aus Investmentanteilen | | EUR | 0,00 | 0,00 |
| 8. Erträge aus Wertpapier- Darlehen- und -Pensionsgeschäften | | EUR | 0,00 | 0,00 |
| 9. Abzug inländischer Körperschaft-/Kapitalertragsteuer | | EUR | 0,00 | 0,00 |
| 10. Abzug ausländischer Quellensteuer | | EUR | -36,00 | 0,00 |
| 11. Sonstige Erträge | | EUR | 1,06 | 0,00 |
| Summe der Erträge | | EUR | 9.357,16 | 0,94 |
| II. Aufwendungen | | | | |
| 1. Zinsen aus Kreditaufnahmen | | EUR | -5,97 | 0,00 |
| 2. Verwaltungsvergütung | | EUR | -11.091,30 | -1,11 |
| - Verwaltungsvergütung | EUR | -1.619,17 | | |
| - Beratungsvergütung | EUR | 0,00 | | |
| - Asset Management Gebühr | EUR | -9.472,13 | | |
| 3. Verwahrstellenvergütung | | EUR | -1.171,09 | -0,12 |
| 4. Prüfungs- und Veröffentlichungskosten | | EUR | -296,08 | -0,03 |
| 5. Sonstige Aufwendungen | | EUR | -850,96 | -0,09 |
| - Depotgebühren | EUR | -908,57 | | |
| - Ausgleich ordentlicher Aufwand | EUR | 5,28 | | |
| - Sonstige Kosten | EUR | 52,32 | | |
| Summe der Aufwendungen | | EUR | -13.415,41 | -1,35 |
| III. Ordentliches Nettoergebnis | | EUR | -4.058,25 | -0,41 |
| IV. Veräußerungsgeschäfte | | | | |
| 1. Realisierte Gewinne | | EUR | 215.390,26 | 21,53 |
| 2. Realisierte Verluste | | EUR | -185.159,93 | -18,51 |
| Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften | | EUR | 30.230,32 | 3,02 |
| V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres | | | | |
| 1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne | | EUR | -8.318,58 | -0,83 |
| 2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste | | EUR | 37.391,19 | 3,74 |

Jahresbericht 7orca Vega Income Anteilklasse R

| | | | |
|---|-----|-----------|------|
| VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres | EUR | 29.072,61 | 2,91 |
| VII. Ergebnis des Geschäftsjahres | EUR | 55.244,69 | 5,52 |

Entwicklung des Sondervermögens

| | | 2023 | |
|--|-----|-------------------|--|
| I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres | EUR | 778.324,33 | |
| 1. Ausschüttung für das Vorjahr/Steuerabschlag für das Vorjahr | EUR | 0,00 | |
| 2. Zwischenausschüttungen | EUR | 0,00 | |
| 3. Mittelzufluss/-abfluss (netto) | EUR | 242,91 | |
| a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen | EUR | 5.316,57 | |
| b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen | EUR | -5.073,66 | |
| 4. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich | EUR | 46,08 | |
| 5. Ergebnis des Geschäftsjahres | EUR | 55.244,69 | |
| davon nicht realisierte Gewinne | EUR | -8.318,58 | |
| davon nicht realisierte Verluste | EUR | 37.391,19 | |
| II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres | EUR | 833.858,01 | |

Verwendung der Erträge des Sondervermögens

Berechnung der Ausschüttung insgesamt und je Anteil

| | | insgesamt | je Anteil |
|---|-----|------------------|-------------|
| I. Für die Ausschüttung verfügbar | EUR | 15.686,14 | 1,56 |
| 1. Vortrag aus Vorjahr | EUR | -10.485,94 | -1,05 |
| 2. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres | EUR | 26.172,08 | 2,61 |
| 3. Zuführung aus dem Sondervermögen | EUR | 0,00 | 0,00 |
| II. Nicht für die Ausschüttung verwendet | EUR | 15.686,14 | 1,56 |
| 1. Der Wiederanlage zugeführt | EUR | 0,00 | 0,00 |
| 2. Vortrag auf neue Rechnung | EUR | 15.686,14 | 1,56 |
| III. Gesamtausschüttung | EUR | 0,00 | 0,00 |
| 1. Zwischenausschüttung | EUR | 0,00 | 0,00 |
| 2. Endausschüttung | EUR | 0,00 | 0,00 |

Jahresbericht

7orca Vega Income Anteilklasse R

Vergleichende Übersicht über die letzten drei Geschäftsjahre

| Geschäftsjahr | Umlaufende Anteile am Ende des Geschäftsjahres | | Fondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres | | Anteilwert am Ende des Geschäftsjahres | |
|---------------|---|--------|--|--------------|---|--------|
| 2020 | Stück | 10.011 | EUR | 1.000.231,98 | EUR | 99,91 |
| 2021 | Stück | 10.011 | EUR | 1.002.559,32 | EUR | 100,15 |
| 2022 | Stück | 10.000 | EUR | 778.324,33 | EUR | 77,83 |
| 2023 | Stück | 10.003 | EUR | 833.858,01 | EUR | 83,36 |

Jahresbericht 7orca Vega Income

Ertrags- und Aufwandsrechnung (inkl. Ertragsausgleich) für den Zeitraum vom 01.01.2023 bis zum 31.12.2023

| | | | insgesamt |
|---|-----|------------|--------------------|
| I. Erträge | | | |
| 1. Dividenden inländischer Aussteller (vor Körperschaft-/Kapitalertragsteuer) | | EUR | 0,00 |
| 2. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer) | | EUR | 0,00 |
| 3. Zinsen aus inländischen Wertpapieren | | EUR | 33.559,66 |
| 4. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer) | | EUR | 92.654,59 |
| 5. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland | | EUR | 60.805,66 |
| 6. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Ausland (vor Quellensteuer) | | EUR | 0,00 |
| 7. Erträge aus Investmentanteilen | | EUR | 0,00 |
| 8. Erträge aus Wertpapier- Darlehen- und -Pensionsgeschäften | | EUR | 0,00 |
| 9. Abzug inländischer Körperschaft-/Kapitalertragsteuer | | EUR | 0,00 |
| 10. Abzug ausländischer Quellensteuer | | EUR | -715,24 |
| 11. Sonstige Erträge | | EUR | 21,17 |
| Summe der Erträge | | EUR | 186.325,84 |
| II. Aufwendungen | | | |
| 1. Zinsen aus Kreditaufnahmen | | EUR | -125,81 |
| 2. Verwaltungsvergütung | | EUR | -108.380,01 |
| - Verwaltungsvergütung | EUR | -25.156,76 | |
| - Beratungsvergütung | EUR | 0,00 | |
| - Asset Management Gebühr | EUR | -83.223,25 | |
| 3. Verwahrstellenvergütung | | EUR | -23.895,12 |
| 4. Prüfungs- und Veröffentlichungskosten | | EUR | -6.012,06 |
| 5. Sonstige Aufwendungen | | EUR | -14.530,33 |
| - Depotgebühren | EUR | -18.640,25 | |
| - Ausgleich ordentlicher Aufwand | EUR | 3.604,95 | |
| - Sonstige Kosten | EUR | 504,97 | |
| Summe der Aufwendungen | | EUR | -152.943,33 |
| III. Ordentlicher Nettoertrag | | EUR | 33.382,51 |
| IV. Veräußerungsgeschäfte | | | |
| 1. Realisierte Gewinne | | EUR | 4.287.066,38 |
| 2. Realisierte Verluste | | EUR | -3.684.259,63 |
| Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften | | EUR | 602.806,75 |
| V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres | | | |
| 1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne | | EUR | -16.430,49 |
| 2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste | | EUR | 628.519,34 |

Jahresbericht 7orca Vega Income

| | | |
|---|-----|--------------|
| VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres | EUR | 612.088,85 |
| VII. Ergebnis des Geschäftsjahres | EUR | 1.248.278,11 |

Entwicklung des Sondervermögens

2023

| | | | | |
|--|-----|---------------|-----|----------------------|
| I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres | | | EUR | 16.431.515,46 |
| 1. Ausschüttung für das Vorjahr/Steuerabschlag für das Vorjahr | | | EUR | 0,00 |
| 2. Zwischenausschüttungen | | | EUR | 0,00 |
| 3. Mittelzufluss/-abfluss (netto) | | | EUR | -1.003.465,79 |
| a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen | EUR | 5.316,57 | | |
| b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen | EUR | -1.008.782,36 | | |
| 4. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich | | | EUR | 1.621,67 |
| 5. Ergebnis des Geschäftsjahres | | | EUR | 1.248.278,11 |
| davon nicht realisierte Gewinne | EUR | -16.430,49 | | |
| davon nicht realisierte Verluste | EUR | 628.519,34 | | |
| II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres | | | EUR | 16.677.949,46 |

Anteilklassenmerkmale im Überblick

| Anteilklasse | Mindestanlagesumme in Währung | Ausgabeaufschlag bis zu 5,00%, derzeit (Angabe in %) | Verwaltungsvergütung bis zu 0,250% p.a., derzeit (Angabe in % p.a.) | Ertragsverwendung | Währung |
|---|--|---|--|--|----------------|
| 7orca Vega Income Anteilklasse I | 250.000 | 0,00 | 0,150 | Ausschüttung mit Zwischenausschüttung | EUR |
| 7orca Vega Income Anteilklasse R | keine | 0,00 | 0,200 | Ausschüttung mit Zwischenausschüttung | EUR |

Jahresbericht 7orca Vega Income

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben nach der Derivateverordnung

das durch Derivate erzielte zugrundeliegende Exposure EUR **29.433.769,23**

die Vertragspartner der Derivate-Geschäfte

BNP Paribas (Broker) GB
Deutsche Bank AG (Broker) GB
Societe Generale (Broker) GB

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %) **82,90**

Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %) **-1,39**

Bei der Ermittlung der Auslastung der Marktrisikoobergrenze für diesen Fonds wendet die Gesellschaft seit 22.07.2019 den qualifizierten Ansatz im Sinne der Derivate-Verordnung anhand eines Vergleichsvermögens an. Die Value-at-Risk-Kennzahlen wurden auf Basis der Methode der historischen Simulation mit den Parametern 99 % Konfidenzniveau und 1 Tag Haltedauer unter Verwendung eines effektiven, historischen Beobachtungszeitraums von einem Jahr berechnet. Unter dem Marktrisiko versteht man das Risiko, das sich aus der ungünstigen Entwicklung von Marktpreisen für das Sondervermögen ergibt.

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

| | |
|--|--------|
| kleinster potenzieller Risikobetrag | 0,83 % |
| größter potenzieller Risikobetrag | 3,86 % |
| durchschnittlicher potenzieller Risikobetrag | 1,74 % |

Im Geschäftsjahr erreichte durchschnittliche Hebelwirkung durch Derivategeschäfte: **2,58**

Zusammensetzung des Vergleichsvermögens zum Berichtsstichtag

absolutLimit 4,4% 100,00 %

Jahresbericht Torca Vega Income

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Sonstige Angaben

Torca Vega Income Anteilklasse I

| | | |
|----------------|-----|---------|
| Anteilwert | EUR | 85,46 |
| Ausgabepreis | EUR | 85,46 |
| Rücknahmepreis | EUR | 85,46 |
| Anzahl Anteile | STK | 185.400 |

Torca Vega Income Anteilklasse R

| | | |
|----------------|-----|--------|
| Anteilwert | EUR | 83,36 |
| Ausgabepreis | EUR | 83,36 |
| Rücknahmepreis | EUR | 83,36 |
| Anzahl Anteile | STK | 10.003 |

Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände

Bewertung

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

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

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

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

Jahresbericht Torca Vega Income

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben zur Transparenz sowie zur Gesamtkostenquote

Gesamtkostenquote

Torca Vega Income Anteilklasse I

Die Gesamtkostenquote (ohne Transaktionskosten) für das abgelaufene Geschäftsjahr beträgt

0,91 %

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

An die Verwaltungsgesellschaft oder Dritte gezahlte Pauschalvergütungen

EUR

0,00

Torca Vega Income Anteilklasse R

Die Gesamtkostenquote (ohne Transaktionskosten) für das abgelaufene Geschäftsjahr beträgt

1,65 %

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

An die Verwaltungsgesellschaft oder Dritte gezahlte Pauschalvergütungen

EUR

0,00

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

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

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

EUR

0,00

**Jahresbericht
Torca Vega Income**

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Verwaltungsvergütungssätze für im Sondervermögen gehaltene Investmentanteile

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

Gruppenfremde Geldmarktfonds

| | | |
|--|--------------|-------|
| AMUNDI EURO LIQUIDITY SRI Actions au Porteur IC o.N. | FR0010251660 | 0,092 |
|--|--------------|-------|

Wesentliche sonstige Erträge und sonstige Aufwendungen

Torca Vega Income Anteilklasse I

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

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

Torca Vega Income Anteilklasse R

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

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

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

| | | |
|--------------------|-----|-----------|
| Transaktionskosten | EUR | 93.273,82 |
|--------------------|-----|-----------|

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

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben zur Mitarbeitervergütung

| | | |
|---|--------------------|-------------|
| Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr der KVG gezahlten Mitarbeitervergütung | in Mio. EUR | 84,3 |
| davon feste Vergütung | in Mio. EUR | 75,0 |
| davon variable Vergütung | in Mio. EUR | 9,3 |
| Zahl der Mitarbeiter der KVG | | 998 |
| Höhe des gezahlten Carried Interest | in EUR | 0 |
| Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr der KVG gezahlten Vergütung an Risktaker | in Mio. EUR | 4,8 |
| davon Geschäftsleiter | in Mio. EUR | 3,9 |
| davon andere Risktaker | in Mio. EUR | 0,9 |

Vergütungssystem der Kapitalverwaltungsgesellschaft

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

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

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

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben gemäß § 101 Abs. 2 Nr. 5 KAGB

Wesentliche mittel- bis langfristigen Risiken

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

Zusammensetzung des Portfolios, die Portfolioumsätze und die Portfolioumsatzkosten

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

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

Die Angabe zu den Transaktionskosten erfolgt im Anhang.

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

Die Auswahl von Einzeltiteln richtet sich nach der Anlagestrategie. Die vertraglichen Grundlagen für die Anlageentscheidung finden sich in den vereinbarten Anlagebedingungen und ggf. Anlagerichtlinien. Eine Berücksichtigung der mittel- bis langfristigen Entwicklung der Portfoliogesellschaften erfolgt, wenn diese in den Vertragsbedingungen vorgeschrieben ist.

Einsatz von Stimmrechtsberatern

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

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

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

Angaben gemäß Verordnung (EU) 2015/2365 über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften und der Weiterverwendung sowie zur Änderung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 - Ausweis nach Abschnitt A

Im Berichtszeitraum lagen keine Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Gesamtrendite-Swaps gemäß der oben genannten rechtlichen Bestimmung vor.

Angaben zu nichtfinanziellen Leistungsindikatoren

Konventionelles Produkt Artikel 6 der Verordnung (EU) 2019/2088 (Offenlegungs-Verordnung)

Die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (Principal Adverse Impacts PAI) werden im Investitionsprozess auf Gesellschaftsebene berücksichtigt. Eine Berücksichtigung der PAI auf Ebene des Fonds ist nicht verbindlich und erfolgt insoweit nicht.

Dieser Fonds wird weder als ein Produkt eingestuft, das ökologische oder soziale Merkmale im Sinne der Offenlegungs-Verordnung (Artikel 8) bewirbt, noch als ein Produkt, das nachhaltige Investitionen zum Ziel hat (Artikel 9). Die diesem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Frankfurt am Main, den 2. Januar 2024

Universal-Investment-Gesellschaft mbH
Die Geschäftsführung

Jahresbericht Torca Vega Income

VERMERK DES UNABHÄNGIGEN ABSCHLUSSPRÜFERS

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

Prüfungsurteil

Wir haben den Jahresbericht des Sondervermögens Torca Vega Income - bestehend aus dem Tätigkeitsbericht für das Geschäftsjahr vom 1. Januar 2023 bis zum 31. Dezember 2023, der Vermögensübersicht und der Vermögensaufstellung zum 31. Dezember 2023, der Ertrags- und Aufwandsrechnung, der Verwendungsrechnung, der Entwicklungsrechnung für das Geschäftsjahr vom 1. Januar 2023 bis zum 31. Dezember 2023 sowie der vergleichenden Übersicht über die letzten drei Geschäftsjahre, der Aufstellung der während des Berichtszeitraumes abgeschlossenen Geschäfte, soweit diese nicht mehr Gegenstand der Vermögensaufstellung sind, und dem Anhang - geprüft.

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

Grundlage für das Prüfungsurteil

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

Verantwortung der gesetzlichen Vertreter für den Jahresbericht

Die gesetzlichen Vertreter der Universal-Investment-Gesellschaft mbH sind verantwortlich für die Aufstellung des Jahresberichts, der den Vorschriften des deutschen KAGB und den einschlägigen europäischen Verordnungen in allen wesentlichen Belangen entspricht und dafür, dass der Jahresbericht es unter Beachtung dieser Vorschriften ermöglicht, sich ein umfassendes Bild der tatsächlichen Verhältnisse und Entwicklungen des Sondervermögens zu verschaffen. Ferner sind die gesetzlichen Vertreter verantwortlich für die internen Kontrollen, die sie in Übereinstimmung mit diesen Vorschriften als notwendig bestimmt haben, um die Aufstellung eines Jahresberichts zu ermöglichen, der frei von wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen (d.h. Manipulationen der Rechnungslegung und Vermögensschädigungen) oder Irrtümern ist.

Bei der Aufstellung des Jahresberichts sind die gesetzlichen Vertreter dafür verantwortlich, Ereignisse, Entscheidungen und Faktoren, welche die weitere Entwicklung des Sondervermögens wesentlich beeinflussen können, in die Berichterstattung einzubeziehen. Das bedeutet u.a., dass die gesetzlichen Vertreter bei der Aufstellung des Jahresberichts die Fortführung des Sondervermögens durch die Universal-Investment-Gesellschaft mbH zu beurteilen haben und die Verantwortung haben, Sachverhalte im Zusammenhang mit der Fortführung des Sondervermögens, sofern einschlägig, anzugeben.

Verantwortung des Abschlussprüfers für die Prüfung des Jahresberichts

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

Jahresbericht Torca Vega Income

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

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

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

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

Frankfurt am Main, den 19. April 2024

KPMG AG
Wirtschaftsprüfungsgesellschaft

Schobel
Wirtschaftsprüfer

Neuf
Wirtschaftsprüfer

Jahresbericht Torca Vega Income

Anteilklassen im Überblick

Erstausgabedatum

| | |
|----------------|---------------|
| Anteilklasse I | 22. Juli 2019 |
| Anteilklasse R | 22. Juli 2019 |

Erstausgabepreise

| | |
|----------------|--------------------------------|
| Anteilklasse I | € 100,- zzgl. Ausgabeaufschlag |
| Anteilklasse R | € 100,- zzgl. Ausgabeaufschlag |

Ausgabeaufschlag

| | |
|----------------|-------|
| Anteilklasse I | 0,00% |
| Anteilklasse R | 0,00% |

Mindestanlagesumme

| | |
|----------------|---------------|
| Anteilklasse I | EUR 250.000,- |
| Anteilklasse R | keine |

Verwaltungsvergütung*

| | |
|----------------|----------------------|
| Anteilklasse I | 0,15 % p.a. effektiv |
| Anteilklasse R | 0,20 % p.a. effektiv |

Verwahrstellenvergütung

| | |
|----------------|----------------------|
| Anteilklasse I | 0,04 % p.a. effektiv |
| Anteilklasse R | 0,04 % p.a. effektiv |

Asset Management-Vergütung

| | |
|----------------|----------------------|
| Anteilklasse I | 0,47 % p.a. effektiv |
| Anteilklasse R | 1,17 % p.a. effektiv |

Währung

| | |
|----------------|------|
| Anteilklasse I | Euro |
| Anteilklasse R | Euro |

Ertragsverwendung

| | |
|----------------|--------------|
| Anteilklasse I | ausschüttend |
| Anteilklasse R | ausschüttend |

Wertpapier-Kennnummer / ISIN:

| | |
|----------------|-----------------------|
| Anteilklasse I | A2PMW0 / DE000A2PMW03 |
| Anteilklasse R | A2PMW1 / DE000A2PMW11 |

*Unterliegt einer Staffelung

Jahresbericht Torca Vega Income

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 71.352.000,00 (Stand: Oktober 2022)

Geschäftsführer:

David Blumer, Schaan
Frank Eggloff, München
Mathias Heiß, Langen
Katja Müller, Bad Homburg v. d. Höhe
Axel Vespermann, Dreieich

Aufsichtsrat:

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

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

Torca Asset Management AG

Postanschrift:

Am Sandtorkai 77
20457 Hamburg

Telefon +49 40 3346046-0
Telefax +49 40 3346046-49
www.7orca.com

4. Anlageausschuss

Jasper Düx
Torca Asset Management AG, Hamburg

Thimo Koch
Torca Asset Management AG, Hamburg

Tindaro Siragusano
Torca Asset Management AG, Hamburg