

KAPITALVERWALTUNGSGESELLSCHAFT:



7orca Vega Income

HALBJAHRESBERICHT

ZUM 30. JUNI 2024

VERWAHRSTELLE:



BNP PARIBAS

ASSET MANAGEMENT UND VERTRIEB:



Halbjahresbericht 7orca Vega Income

Vermögensübersicht zum 30.06.2024

Anlageschwerpunkte	Tageswert in EUR	% Anteil am Fondsvermögen
I. Vermögensgegenstände	12.413.281,01	100,44
1. Anleihen	10.325.389,00	83,55
< 1 Jahr	9.358.224,00	75,72
>= 1 Jahr bis < 3 Jahre	967.165,00	7,83
2. Derivate	-101.723,05	-0,82
3. Bankguthaben	1.170.503,39	9,47
4. Geldmarktfonds	975.077,60	7,89
5. Sonstige Vermögensgegenstände	44.034,07	0,36
II. Verbindlichkeiten	-54.415,02	-0,44
III. Fondsvermögen	12.358.865,99	100,00

Halbjahresbericht Torca Vega Income

Vermögensaufstellung zum 30.06.2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2024	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Bestandspositionen							EUR	10.325.389,00	83,55
Börsengehandelte Wertpapiere							EUR	9.725.389,00	78,69
Verzinsliche Wertpapiere							EUR	9.725.389,00	78,69
1,0000 % Banco Santander S.A. EO-Cédulas Hipotec. 2015(25)	ES0413790397		EUR	400	0	0 %	98,045	392.180,00	3,17
0,6250 % Bank of Irel.Mortgage Bank PLC EO-M.-T. Mtg Cov.Nts 2018(25)	XS1791443440		EUR	500	500	0 %	97,965	489.825,00	3,96
0,3980 % BPCE SFH EO-Med.-T.Obl.Fin.Hab.2015(25)	FR0012695716		EUR	800	0	0 %	97,557	780.456,00	6,31
0,3328 % Cie de Financement Foncier EO-FLR MTN Obl. Fonc.2004(24)	FR0010101832		EUR	500	0	0 %	100,156	500.780,00	4,05
0,3750 % Cie de Financement Foncier EO-Med.-T. Obl.Fonc. 2017(24)	FR0013281748		EUR	500	0	0 %	98,586	492.930,00	3,99
0,6250 % Crédit Mutuel Home Loan SFH SA EO-Med.-T.Obl.Fin.Hab.2017(25)	FR0013236247		EUR	400	0	0 %	98,237	392.948,00	3,18
0,3750 % DZ HYP AG MTN-Hyp.Pfbr.377 16(25) [WL]	DE000A2AASB4		EUR	500	500	0 %	97,132	485.660,00	3,93
5,4000 % Irland EO-Treasury Bonds 2009(25)	IE00B4TV0D44		EUR	600	0	0 %	101,292	607.752,00	4,92
0,6250 % Länsförsäkringar Hypotek AB EO-Med.-Term Cov. Nts 2018(25)	XS1799048704		EUR	800	0	0 %	97,866	782.928,00	6,33
0,0000 % Lb.Hessen-Thüringen GZ MTN HPF S.H335 v.19(24)	XS2022037795		EUR	600	0	0 %	100,000	600.000,00	4,85
0,3750 % Norddeutsche Landesbank -GZ- MTN-HPF S.486 v.17(25)	DE000DHY4861		EUR	600	0	0 %	97,035	582.210,00	4,71
0,2500 % Nordrhein-Westfalen, Land Med.T.LSA v.19(26) Reihe 1477	DE000NRW0LN6		EUR	500	500	0 %	95,194	475.970,00	3,85
0,3750 % Raiffeisenl.Niederöst.-Wien AG EO-Medium-Term Notes 2017(24)	XS1681119167		EUR	600	0	0 %	99,334	596.004,00	4,82
0,5000 % Société Générale SFH S.A. EO-M.-T.Obl.Fin.Hab. 2017(25)	FR0013259413		EUR	800	0	0 %	97,316	778.528,00	6,30
0,5000 % Swedish Covered Bond Corp.,The EO-Medium-Term Notes 2018(25)	XS1759602953		EUR	500	0	0 %	98,275	491.375,00	3,98
1,7070 % Toronto-Dominion Bank, The EO-Med.-Term Cov.Bds 2022(25)	XS2508690612		EUR	500	500	0 %	98,239	491.195,00	3,97
0,7500 % UniCredit Bank Austria AG EO-Med.-T.Hyp.Pf.-Br. 2015(25)	AT000B049572		EUR	800	0	0 %	98,081	784.648,00	6,35
Nichtnotierte Wertpapiere							EUR	600.000,00	4,85
Verzinsliche Wertpapiere							EUR	600.000,00	4,85
0,0500 % Skandinaviska Enskilda Banken EO-Medium-Term Notes 2019(24)	XS2020568734		EUR	600	0	0 %	100,000	600.000,00	4,85
Summe Wertpapiervermögen 2)							EUR	10.325.389,00	83,55

Halbjahresbericht 7orca Vega Income

Vermögensaufstellung zum 30.06.2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2024	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens	
Derivate							EUR	-101.723,05	-0,82	
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)										
Optionsrechte							EUR	-16.739,17	-0,14	
Optionsrechte auf Zinsterminkontrakte							EUR	-16.739,17	-0,14	
FUTURE EU-BUND 09.24 CALL 26.07.24 BP 135,00 EUREX			185	EUR	Anzahl	-25	EUR	0,190	1.000,00	0,01
FUTURE EU-BUND 09.24 CALL 26.07.24 BP 136,50 EUREX			185	EUR	Anzahl	-25	EUR	0,090	4.000,00	0,03
FUTURE EU-BUND 09.24 CALL 26.07.24 BP 137,00 EUREX			185	EUR	Anzahl	-25	EUR	0,070	6.000,00	0,05
FUTURE EU-BUND 09.24 PUT 26.07.24 BP 129,50 EUREX			185	EUR	Anzahl	-25	EUR	0,270	-2.125,00	-0,02
FUTURE EU-BUND 09.24 PUT 26.07.24 BP 130,00 EUREX			185	EUR	Anzahl	-50	EUR	0,380	-5.250,00	-0,04
FUT 10Y TRE 1W 09.24 CALL 05.07.24 BP 111,25 CBOT			362	USD	Anzahl	-41	USD	0,047	-1.793,46	-0,01
FUT 10Y TRE 1W 09.24 PUT 05.07.24 BP 107,50 CBOT			362	USD	Anzahl	-41	USD	0,001	-38,26	0,00
FUT. 10Y TRE 2W 09.24 CALL 12.07.24 BP 112,75 CBOT			362	USD	Anzahl	-41	USD	0,031	-1.195,64	-0,01
FUT. 10Y TRE 2W 09.24 PUT 12.07.24 BP 108,75 CBOT			362	USD	Anzahl	-41	USD	0,156	-5.978,21	-0,05
FUTURE 10Y TREA 09.24 CALL 26.07.24 BP 112,75 CBOT			362	USD	Anzahl	-41	USD	0,078	-2.989,11	-0,02
FUTURE 10Y TREA 09.24 PUT 26.07.24 BP 108,50 CBOT			362	USD	Anzahl	-41	USD	0,219	-8.369,49	-0,07
Devisen-Derivate							EUR	-84.983,88	-0,69	
Forderungen/Verbindlichkeiten										

Halbjahresbericht Torca Vega Income

Vermögensaufstellung zum 30.06.2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2024	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens	
Optionsrechte							EUR	-86.249,51	-0,70	
Optionsrechte auf Devisen							EUR	-86.249,51	-0,70	
F FX AUD/USD 2PM 09.24 CALL 05.07.24 BP 68,50 CME			352	USD	-24.000		USD	0,005	-111,98	0,00
F FX AUD/USD 2PM 09.24 CALL 12.07.24 BP 68,00 CME			352	USD	-24.000		USD	0,080	-1.791,71	-0,01
F FX AUD/USD 2PM 09.24 CALL 19.07.24 BP 68,00 CME			352	USD	-24.000		USD	0,130	-2.911,53	-0,02
F FX AUD/USD 2PM 09.24 CALL 26.07.24 BP 68,25 CME			352	USD	-24.000		USD	0,140	-3.135,50	-0,03
F FX AUD/USD 2PM 09.24 PUT 05.07.24 BP 64,50 CME			352	USD	-24.000		USD	0,010	-223,96	0,00
F FX AUD/USD 2PM 09.24 PUT 12.07.24 BP 64,50 CME			352	USD	-24.000		USD	0,010	-223,96	0,00
F FX AUD/USD 2PM 09.24 PUT 19.07.24 BP 64,50 CME			352	USD	-24.000		USD	0,025	-559,91	0,00
F FX AUD/USD 2PM 09.24 PUT 26.07.24 BP 64,75 CME			352	USD	-24.000		USD	0,070	-1.567,75	-0,01
F FX EUR/USD 2PM 09.24 CALL 05.07.24 BP 1,11 CME			352	USD	-1.625.000		USD	0,000	-75,82	0,00
F FX EUR/USD 2PM 09.24 CALL 12.07.24 BP 1,105 CME			352	USD	-1.625.000		USD	0,000	-75,82	0,00
F FX EUR/USD 2PM 09.24 CALL 19.07.24 BP 1,0975 CME			352	USD	-1.625.000		USD	0,001	-758,21	-0,01
F FX EUR/USD 2PM 09.24 CALL 26.07.24 BP 1,095 CME			352	USD	-1.625.000		USD	0,001	-1.668,07	-0,01
F FX EUR/USD 2PM 09.24 PUT 05.07.24 BP 1,075 CME			352	USD	-1.625.000		USD	0,005	-6.823,91	-0,06
F FX EUR/USD 2PM 09.24 PUT 12.07.24 BP 1,065 CME			352	USD	-1.625.000		USD	0,003	-4.549,27	-0,04
F FX EUR/USD 2PM 09.24 PUT 19.07.24 BP 1,05 CME			352	USD	-1.625.000		USD	0,001	-1.971,35	-0,02
F FX EUR/USD 2PM 09.24 PUT 26.07.24 BP 1,0525 CME			352	USD	-1.625.000		USD	0,002	-3.032,85	-0,02
F FX GBP/USD 2PM 09.24 CALL 05.07.24 BP 130,50 CME			359	USD	-12.500		USD	0,010	-116,65	0,00
F FX GBP/USD 2PM 09.24 CALL 12.07.24 BP 130,00 CME			359	USD	-12.500		USD	0,010	-116,65	0,00
F FX GBP/USD 2PM 09.24 CALL 19.07.24 BP 129,25 CME			359	USD	-12.500		USD	0,030	-349,94	0,00
F FX GBP/USD 2PM 09.24 CALL 26.07.24 BP 129,00 CME			359	USD	-12.500		USD	0,080	-933,18	-0,01
F FX GBP/USD 2PM 09.24 PUT 05.07.24 BP 125,00 CME			359	USD	-12.500		USD	0,070	-816,54	-0,01
F FX GBP/USD 2PM 09.24 PUT 12.07.24 BP 125,00 CME			359	USD	-12.500		USD	0,170	-1.983,02	-0,02
F FX GBP/USD 2PM 09.24 PUT 19.07.24 BP 124,00 CME			359	USD	-12.500		USD	0,120	-1.399,78	-0,01
F FX GBP/USD 2PM 09.24 PUT 26.07.24 BP 124,50 CME			359	USD	-12.500		USD	0,240	-2.799,55	-0,02
F FX JPY/USD 2PM 09.24 CALL 05.07.24 BP 67,00 CME			352	USD	-27.500		USD	0,010	-256,63	0,00
F FX JPY/USD 2PM 09.24 CALL 12.07.24 BP 66,50 CME			352	USD	-27.500		USD	0,010	-256,63	0,00
F FX JPY/USD 2PM 09.24 CALL 19.07.24 BP 65,75 CME			352	USD	-27.500		USD	0,040	-1.026,50	-0,01

Halbjahresbericht Torca Vega Income

Vermögensaufstellung zum 30.06.2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2024	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
F FX JPY/USD 2PM 09.24 CALL 26.07.24 BP 65,00 CME			352	USD	-28.750	USD	0,120	-3.219,48	-0,03
F FX JPY/USD 2PM 09.24 PUT 05.07.24 BP 63,50 CME			352	USD	-27.500	USD	0,620	-15.910,79	-0,13
F FX JPY/USD 2PM 09.24 PUT 12.07.24 BP 63,00 CME			352	USD	-27.500	USD	0,430	-11.034,90	-0,09
F FX JPY/USD 2PM 09.24 PUT 19.07.24 BP 62,50 CME			352	USD	-27.500	USD	0,310	-7.955,39	-0,06
F FX JPY/USD 2PM 09.24 PUT 26.07.24 BP 61,25 CME			352	USD	-28.750	USD	0,110	-2.951,19	-0,02
FUT FX CAD/USD W 09.24 CALL 12.07.24 BP 74,00 CME			352	USD	-25.000	USD	0,030	-699,89	-0,01
FUT FX CAD/USD W 09.24 CALL 19.07.24 BP 74,00 CME			352	USD	-24.000	USD	0,060	-1.343,78	-0,01
FUT FX CAD/USD W 09.24 CALL 26.07.24 BP 74,25 CME			352	USD	-24.000	USD	0,050	-1.119,82	-0,01
FUT FX CAD/USD W 09.24 PUT 12.07.24 BP 71,75 CME			352	USD	-25.000	USD	0,005	-116,65	0,00
FUT FX CAD/USD W 09.24 PUT 19.07.24 BP 72,00 CME			352	USD	-24.000	USD	0,035	-783,87	-0,01
FUT FX CAD/USD W 09.24 PUT 26.07.24 BP 72,00 CME			352	USD	-24.000	USD	0,060	-1.343,78	-0,01
FUTURE FX CAD/USD 09.24 CALL 05.07.24 BP 74,50 CME			352	USD	-25.000	USD	0,005	-116,65	0,00
FUTURE FX CAD/USD 09.24 PUT 05.07.24 BP 72,00 CME			352	USD	-25.000	USD	0,005	-116,65	0,00
Währungsterminkontrakte							EUR	1.265,63	0,01
FUTURE CROSS RATE EUR/USD 16.09.24 CME			352	USD	375.000	USD	1,076	174,97	0,00
FUTURE CROSS RATE JPY/USD 16.09.24 CME			352	USD	-7.500	USD	62,905	1.090,66	0,01

Halbjahresbericht Torca Vega Income

Vermögensaufstellung zum 30.06.2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2024	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens	
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds							EUR	2.145.580,99	17,36	
Bankguthaben							EUR	1.170.503,39	9,47	
EUR - Guthaben bei:										
BNP Paribas S.A., Niederlassung Deutschland			EUR	611.867,13			%	100,000	611.867,13	4,95
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen bei:										
BNP Paribas S.A., Niederlassung Deutschland			USD	598.634,62			%	100,000	558.636,26	4,52
Geldmarktfonds							EUR	975.077,60	7,89	
Gruppenfremde Geldmarktfonds							EUR	975.077,60	7,89	
AMUNDI EURO LIQUIDITY SRI Actions au Porteur IC o.N.	FR0010251660		ANT	4	4	6	EUR	243.769,400	975.077,60	7,89
Sonstige Vermögensgegenstände							EUR	44.034,07	0,36	
Zinsansprüche			EUR	36.303,27				36.303,27	0,29	
Variation Margin			EUR	7.409,99				7.409,99	0,06	
Sonstige Forderungen			EUR	320,81				320,81	0,00	
Sonstige Verbindlichkeiten							EUR	-54.415,02	-0,44	
Verwaltungsvergütung			EUR	-10.213,54				-10.213,54	-0,08	
Verwahrstellenvergütung			EUR	-3.532,67				-3.532,67	-0,03	
Lagerstellenkosten			EUR	-2.933,33				-2.933,33	-0,02	
Prüfungskosten			EUR	-11.357,78				-11.357,78	-0,09	
Veröffentlichungskosten			EUR	-494,44				-494,44	0,00	
Portfoliomanagervergütung			EUR	-13.932,58				-13.932,58	-0,11	
Variation Margin			EUR	-11.950,68				-11.950,68	-0,10	
Fondsvermögen							EUR	12.358.865,99	100,00 1)	

Halbjahresbericht 7orca Vega Income

Vermögensaufstellung zum 30.06.2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2024	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
7orca Vega Income Anteilklasse I									
Anteilwert							EUR	91,14	
Ausgabepreis							EUR	91,14	
Rücknahmepreis							EUR	91,14	
Anzahl Anteile							STK	135.600	
7orca Vega Income Anteilklasse R									
Anteilwert							EUR	79,66	
Ausgabepreis							EUR	79,66	
Rücknahmepreis							EUR	79,66	
Anzahl Anteile							STK	1	

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 Income

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Devisenkurse (in Mengennotiz)

USD	(USD)	per 28.06.2024 1,0716000	= 1 EUR (EUR)
-----	-------	-----------------------------	---------------

Marktschlüssel

Terminbörsen

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

Halbjahresbericht 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					
2,8000 % Bundesrep.Deutschland Bundesschatzanw. v.23(25)	DE000BU22015	EUR	0	600	
1,7500 % Council of Europe Developm.Bk EO-Medium-Term Notes 2014(24)	XS1060350326	EUR	0	500	
0,5000 % Eika BoligKreditt A.S. EO-Med.-Term Cov. MTN 2018(25)	XS1869468808	EUR	0	600	
3,0000 % Rheinland-Pfalz, Land Landessch.v.2023 (2025)	DE000RLP1395	EUR	0	500	
0,3750 % SpareBank 1 Boligkreditt AS EO-M.-T. Mortg.Cov.Bds 17(24)	XS1637099026	EUR	0	600	
0,3750 % SR-Boligkreditt A.S. EO-Mortg. Covered MTN 2017(24)	XS1692489583	EUR	0	700	
Nichtnotierte Wertpapiere *)					
Verzinsliche Wertpapiere					
0,1250 % Aareal Bank AG MTN-HPF.S.226 v.2019(2024)	DE000AAR0249	EUR	0	600	
0,0500 % Cie de Financement Foncier EO-Med.-T. Obl.Fonc. 2020(24)	FR0013507365	EUR	0	1.000	
4,1250 % European Investment Bank EO-Medium-Term Notes 2007(24)	XS0290050524	EUR	0	500	

Halbjahresbericht 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
---------------------	------	-------------------------------------	--------------------------	-----------------------------	---------------------

Derivate

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

Terminkontrakte

Zinsterminkontrakte

Gekaufte Kontrakte:

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

EUR

20.000,87

Verkaufte Kontrakte:

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

EUR

26.184,62

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

38.026,48

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

34.074,96

Halbjahresbericht 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

Verkaufte Kaufoptionen (Call):

(Basiswert(e): FUTURE 10Y TRE.NT (SYN.)4W. 19.09.24 CBOT, FUTURE 10Y TREA.NT.(SYN.) 5W 18.06.24 CBOT, FUTURE 10Y TREA.NT.(SYN.) 5W 19.09.24 CBOT, FUTURE 10Y TREA.NT.(SYN.)3W 18.06.24 CBOT, FUTURE 10Y TREA.NT.(SYN.)3W 19.03.24 CBOT, FUTURE 10Y TREASURY NOTE (SY.) 1W. 18.06.24 CBOT, FUTURE 10Y TREASURY NOTE (SY.) 1W. 19.03.24 CBOT, FUTURE 10Y TREASURY NOTE (SY.) 1W. 19.09.24 CBOT, FUTURE 10Y TREASURY NOTE (SYNTH.) 18.06.24 CBOT, FUTURE 10Y TREASURY NOTE (SYNTH.) 19.03.24 CBOT, FUTURE 10Y TREASURY NOTE (SYNTH.) 19.09.24 CBOT, FUTURE 10YTRN2W 18.06.24 CBOT, FUTURE 10YTRN2W 19.03.24 CBOT, FUTURE 10YTRN2W 19.09.24 CBOT, , FUTURE EURO-BUND 06.06.24 EUREX, FUTURE EURO-BUND 06.09.24 EUREX, FUTURE EURO-BUND 07.03.24 EUREX)	EUR	286,52
--	-----	--------

Verkaufte Verkaufsoptionen (Put):

(Basiswert(e): FUTURE 10Y TRE.NT (SYN.)4W. 19.09.24 CBOT, FUTURE 10Y TREA.NT.(SYN.) 5W 18.06.24 CBOT, FUTURE 10Y TREA.NT.(SYN.) 5W 19.09.24 CBOT, FUTURE 10Y TREA.NT.(SYN.)3W 18.06.24 CBOT, FUTURE 10Y TREA.NT.(SYN.)3W 19.03.24 CBOT, FUTURE 10Y TREASURY NOTE (SY.) 1W. 18.06.24 CBOT, FUTURE 10Y TREASURY NOTE (SY.) 1W. 19.03.24 CBOT, FUTURE 10Y TREASURY NOTE (SY.) 1W. 19.09.24 CBOT, FUTURE 10Y TREASURY NOTE (SYNTH.) 18.06.24 CBOT, FUTURE 10Y TREASURY NOTE (SYNTH.) 19.03.24 CBOT, FUTURE 10Y TREASURY NOTE (SYNTH.) 19.09.24 CBOT, FUTURE 10YTRN2W 18.06.24 CBOT, FUTURE 10YTRN2W 19.03.24 CBOT, FUTURE 10YTRN2W 19.09.24 CBOT, , FUTURE EURO-BUND 06.06.24 EUREX, FUTURE EURO-BUND 06.09.24 EUREX, FUTURE EURO-BUND 07.03.24 EUREX)	EUR	259,31
--	-----	--------

**Halbjahresbericht
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 auf Devisen-Derivate

Optionsrechte auf Devisen

Verkaufte Kaufoptionen (Call):

, FUTURE CROSS RATE JPY/USD 2PM EUR 17.06.24 CME, FUTURE CROSS RATE JPY/USD 2PM W EUR 03.24 CME, FUTURE CROSS RATE JPY/USD 2PM W EUR 16.09.24 CME, FUTURE CROSS RATE JPY/USD 2PM W EUR 17.06.24 CME, FUTURE CROSS RT AUD/USD 2PM W EUR 03.24 CME, FUTURE CROSS RT AUD/USD 2PM W EUR 16.09.24 CME, FUTURE CROSS RT AUD/USD 2PM W EUR 17.06.24 CME, FUTURE CROSS RT GBP/USD 2PM W EUR 03.24 CME, FUTURE CROSS RT GBP/USD 2PM W EUR 16.09.24 CME, FUTURE CROSS RT GBP/USD 2PM W EUR 17.06.24 CME) (Basiswert(e): FUTURE CROSS RATE AUD/USD 2PM EUR 03.24 CME, FUTURE CROSS RATE AUD/USD 2PM EUR 17.06.24 CME, FUTURE CROSS RATE CAD/USD 03.24 CME, FUTURE CROSS RATE CAD/USD 17.09.24 CME, FUTURE CROSS RATE CAD/USD 18.06.24 CME, FUTURE CROSS RATE CAD/USD 19.03.24 CME, FUTURE CROSS RATE EUR/USD 2PM EUR 03.24 CME, FUTURE CROSS RATE EUR/USD 2PM EUR 17.06.24 CME, FUTURE CROSS RATE EUR/USD 2PM W EUR 03.24 CME, FUTURE CROSS RATE EUR/USD 2PM W EUR 16.09.24 CME, FUTURE CROSS RATE EUR/USD 2PM W EUR 17.06.24 CME, FUTURE CROSS RATE GBP/USD 2PM EUR 03.24 CME, FUTURE CROSS RATE GBP/USD 2PM EUR 17.06.24 CME, FUTURE CROSS RATE JPY/USD 2PM EUR	EUR			0,00
---	-----	--	--	------

Halbjahresbericht 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
Verkaufte Verkaufsoptionen (Put):					
, FUTURE CROSS RATE JPY/USD 2PM EUR 17.06.24 CME, FUTURE CROSS RATE JPY/USD 2PM W EUR 03.24 CME, FUTURE CROSS RATE JPY/USD 2PM W EUR 16.09.24 CME, FUTURE CROSS RATE JPY/USD 2PM W EUR 17.06.24 CME, FUTURE CROSS RT AUD/USD 2PM W EUR 03.24 CME, FUTURE CROSS RT AUD/USD 2PM W EUR 16.09.24 CME, FUTURE CROSS RT AUD/USD 2PM W EUR 17.06.24 CME, FUTURE CROSS RT GBP/USD 2PM W EUR 03.24 CME, FUTURE CROSS RT GBP/USD 2PM W EUR 16.09.24 CME, FUTURE CROSS RT GBP/USD 2PM W EUR 17.06.24 CME)		EUR			-167.684,77
(Basiswert(e): FUTURE CROSS RATE AUD/USD 2PM EUR 03.24 CME, FUTURE CROSS RATE AUD/USD 2PM EUR 17.06.24 CME, FUTURE CROSS RATE CAD/USD 03.24 CME, FUTURE CROSS RATE CAD/USD 17.09.24 CME, FUTURE CROSS RATE CAD/USD 18.06.24 CME, FUTURE CROSS RATE CAD/USD 19.03.24 CME, FUTURE CROSS RATE EUR/USD 2PM EUR 03.24 CME, FUTURE CROSS RATE EUR/USD 2PM EUR 17.06.24 CME, FUTURE CROSS RATE EUR/USD 2PM W EUR 03.24 CME, FUTURE CROSS RATE EUR/USD 2PM W EUR 16.09.24 CME, FUTURE CROSS RATE EUR/USD 2PM W EUR 17.06.24 CME, FUTURE CROSS RATE GBP/USD 2PM EUR 03.24 CME, FUTURE CROSS RATE GBP/USD 2PM EUR 17.06.24 CME, FUTURE CROSS RATE JPY/USD 2PM EUR					

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 Income**

Anteilklassenmerkmale im Überblick

Anteilklasse	Mindestanlagesumme in Währung	Ausgabeaufschlag derzeit (Angabe in %) *)	Verwaltungsvergütung 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

*) Die maximale Gebühr kann dem aktuellen Verkaufsprospekt entnommen werden.

Halbjahresbericht 7orca Vega Income

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)	83,55
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)	-0,82

Sonstige Angaben

7orca Vega Income Anteilklasse I

Anteilwert	EUR	91,14
Ausgabepreis	EUR	91,14
Rücknahmepreis	EUR	91,14
Anzahl Anteile	STK	135.600

7orca Vega Income Anteilklasse R

Anteilwert	EUR	79,66
Ausgabepreis	EUR	79,66
Rücknahmepreis	EUR	79,66
Anzahl Anteile	STK	1

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.

**Halbjahresbericht
7orca Vega Income**

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

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.

Frankfurt am Main, den 1. Juli 2024

Universal-Investment-Gesellschaft mbH
Die Geschäftsführung

Halbjahresbericht 7orca 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

Halbjahresbericht 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
Mathias Heiß, Langen
Dr. André Jäger, Witten
Corinna Jäger, Nidderau
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 Zirlewagen, 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 Dux
Torca Asset Management AG, Hamburg

Thimo Koch
Torca Asset Management AG, Hamburg

Tindaro Siragusano
Torca Asset Management AG, Hamburg