



NÜRNBERGER Multi Asset Protect

Halbjahresbericht zum 30.06.2024

| | |
|---|----|
| Ihre Partner | 3 |
| Vermögensübersicht | 4 |
| Vermögensaufstellung | 5 |
| Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit diese nicht mehr Gegenstand der Vermögensaufstellung sind | 9 |
| Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV | 10 |

| | | |
|---------------------------------------|---|--|
| Kapitalverwaltungsgesellschaft | Internationale Kapitalanlagegesellschaft mbH Hansaallee 3, 40549 Düsseldorf E-Mail: info@inka-kag.de Internet: www.inka-kag.de | Gezeichnetes und eingezahltes Eigenkapital: 5.000 TEUR Haftendes Eigenkapital: 59.000.000,00 EUR (Stand: 31.12.2023) |
| Aufsichtsrat | Marius Nolte (Vorsitzender) Head of Markets & Securities Services HSBC Continental Europe S.A., Germany Professor Dr. Monika Barbara Gehde-Trapp Inhaberin des Lehrstuhls für Financial Institutions an der Eberhard Karls Universität Tübingen Gina Slotosch-Salamone Global Chief Operating Officer (COO) Securities Services HSBC Bank plc, London | |
| Geschäftsführer | Urs Walbrecht (Vorsitzender) Sabine Sander | |
| Gesellschafter | HSBC Trinkaus & Burkhardt Gesellschaft für Bankbeteiligungen mbH, Düsseldorf | |
| Verwahrstelle | HSBC Continental Europe S.A., Germany, Hansaallee 3, 40549 Düsseldorf, Zweigniederlassung der HSBC Continental Europe S.A. mit Sitz: 38, Avenue Kléber, 75116 Paris, Frankreich Gezeichnetes und eingezahltes Eigenkapital: 6.326.776.961,00 Euro modifiziert verfügbare haftende Eigenmittel: 12.304.623.397,00 Euro (Stand: 31.12.2023) | |
| Wirtschaftsprüfer | PricewaterhouseCoopers GmbH Wirtschaftsprüfungsgesellschaft, Georg-Glock-Straße 22, 40474 Düsseldorf | |
| Fondsmanager | Nürnberger Asset Management GmbH, Ostendstr. 100, 90334 Nürnberg | |
| Sonstige Angaben | WKN: A2PTX6 ISIN: DE000A2PTX62 | |

Vermögensübersicht

| | Kurswert in EUR | % des Fondsver- mögens |
|---|-----------------------|------------------------------|
| I. Vermögensgegenstände | 552.006.819,23 | 100,24 |
| 1. Aktien | 0,00 | 0,00 |
| 2. Anleihen | 95.763.268,10 | 17,39 |
| Gedekte Schuldverschreibungen | 32.630.906,15 | 5,93 |
| Banking/Bankwesen | 14.668.026,00 | 2,66 |
| Gesundheitswesen | 9.917.390,80 | 1,80 |
| Staatlich garantierte Anlagen | 9.911.946,00 | 1,80 |
| Konsumgüter | 5.917.366,00 | 1,07 |
| Handel | 4.950.700,00 | 0,90 |
| Versorgungswerte | 3.943.788,40 | 0,72 |
| Regierungsanleihen | 2.990.700,00 | 0,54 |
| Investitionsgüter | 2.483.338,65 | 0,45 |
| Automobil | 2.381.071,00 | 0,43 |
| Basisindustrie | 2.008.563,20 | 0,36 |
| Technologie & Elektronik | 1.961.200,00 | 0,36 |
| Reise & Freizeit | 1.012.771,90 | 0,18 |
| Finanzsektor | 985.500,00 | 0,18 |
| 3. Derivate | 681.605,21 | 0,12 |
| Aktienindex-Derivate | 681.605,21 | 0,12 |
| 4. Forderungen | 1.935.567,77 | 0,35 |
| 5. Kurzfristig liquidierbare Anlagen | 0,00 | 0,00 |
| 6. Bankguthaben | 5.346.662,37 | 0,97 |
| 7. Sonstige Vermögensgegenstände | 448.279.715,78 | 81,40 |
| Zertifikate | 17.181.936,09 | 3,12 |
| Zielfondsanteile | 431.097.779,69 | 78,28 |
| Indexfonds | 261.593.313,49 | 47,50 |
| Rentenfonds | 109.732.416,90 | 19,93 |
| Geldmarktfonds | 31.680.647,30 | 5,75 |
| Gemischte Fonds | 23.786.222,00 | 4,32 |
| Aktienfonds | 4.305.180,00 | 0,78 |
| II. Verbindlichkeiten | -1.310.954,43 | -0,24 |
| Sonstige Verbindlichkeiten | -1.310.954,43 | -0,24 |
| III. Fondsvermögen | 550.695.864,80 | 100,00^{*)} |

^{*)} Durch Rundung der Prozent-Anteile bei der Berechnung können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.

Vermögensaufstellung

| Gattungsbezeichnung | ISIN | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. | Bestand 30.06.2024 | Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum | Verkäufe/ Abgänge | Kurs | Kurswert in EUR | % des Fondsvermögens |
|---|--------------|-------|------------------------------|--------------------|------------------------------------|-------------------|---------|----------------------|----------------------|
| Börsengehandelte Wertpapiere | | | | | | | | 99.509.790,99 | 18,07 |
| Verzinsliche Wertpapiere | | | | | | | | | |
| Euro | | | | | | | | 82.327.854,90 | 14,95 |
| 0,0000 % adidas v.20-24 | XS2224621347 | | EUR | 2.000.000 | - | - % | 99,240 | 1.984.800,00 | 0,36 |
| 0,0500 % 1.Bk.Gr. MTN v.20-25 | AT0000A2JAF6 | | EUR | 1.000.000 | - | - % | 95,707 | 957.073,40 | 0,17 |
| 0,2500 % Dt.Pfd.br.bk. MTN R.35413 | DE000A3TOX97 | | EUR | 1.000.000 | - | - % | 96,910 | 969.100,00 | 0,18 |
| 0,3750 % Bayer v.20-24 | XS2199265617 | | EUR | 2.000.000 | - | - % | 99,960 | 1.999.200,00 | 0,36 |
| 0,5000 % BMW Fin. MTN v.22-25 | XS2447561403 | | EUR | 400.000 | - | - % | 97,930 | 391.720,00 | 0,07 |
| 0,6250 % Infineon Techn. MTN v.22-25 | XS2443921056 | | EUR | 2.000.000 | - | - % | 98,060 | 1.961.200,00 | 0,36 |
| 0,6250 % RBC Hyp.-Pfe v.22-26 MTN | XS2460043743 | | EUR | 5.000.000 | - | - % | 95,498 | 4.774.883,50 | 0,87 |
| 0,7500 % Novo Nordisk F.[NL] MTN 22-25 | XS2441244535 | | EUR | 2.000.000 | - | - % | 97,820 | 1.956.400,00 | 0,36 |
| 0,7500 % Thermo Fish.Scienc. v.16-24 | XS1405775708 | | EUR | 2.000.000 | - | - % | 99,310 | 1.986.200,00 | 0,36 |
| 0,8750 % E.ON MTN v.22-25 | XS2463505581 | | EUR | 2.000.000 | - | - % | 98,500 | 1.970.000,00 | 0,36 |
| 0,8750 % Kon.Ahold Delhaize v.17-24 | XS1685798370 | | EUR | 2.000.000 | - | - % | 99,320 | 1.986.400,00 | 0,36 |
| 0,8750 % Sanofi MTN v.22-25 | FR0014009KS6 | | EUR | 2.000.000 | - | - % | 97,860 | 1.957.200,00 | 0,36 |
| 1,0000 % Bund v.14-24 | DE0001102366 | | EUR | 3.000.000 | - | - % | 99,690 | 2.990.700,00 | 0,54 |
| 1,0000 % Crédit Agric. MTN v.22-25 | FR00140098S7 | | EUR | 2.000.000 | - | - % | 96,879 | 1.937.582,40 | 0,35 |
| 1,0000 % Dt.Pfdbrbk. Hyp-Pfe R15317 MTN | DE000A3TOYH5 | | EUR | 3.000.000 | - | - % | 95,311 | 2.859.334,50 | 0,52 |
| 1,2500 % Berlin Hyp Hyp.-Pfe v.22-25 | DE000BHY0GK6 | | EUR | 5.000.000 | - | - % | 97,519 | 4.875.966,50 | 0,89 |
| 1,2500 % Kering MTN v.22-25 | FR001400A5N5 | | EUR | 1.000.000 | - | - % | 97,950 | 979.500,00 | 0,18 |
| 1,7500 % BBVA MTN v.22-25 | XS2485259241 | | EUR | 1.000.000 | - | - % | 97,363 | 973.630,20 | 0,18 |
| 2,1030 % Morgan Stanley Frn v.22-26 MTN | XS2446386356 | | EUR | 1.000.000 | - | - % | 98,550 | 985.500,00 | 0,18 |
| 2,1250 % ING Gr. Frn v.22-26 MTN | XS2483607474 | | EUR | 2.000.000 | - | - % | 98,430 | 1.968.600,00 | 0,36 |
| 2,5000 % KfW MTN v.22-25 | DE000A30VUG3 | | EUR | 10.000.000 | - | - % | 99,119 | 9.911.946,00 | 1,80 |
| 2,5000 % RWE MTN v.22-25 | XS2523390271 | | EUR | 2.000.000 | - | - % | 98,689 | 1.973.788,40 | 0,36 |
| 2,7500 % LBBW Öff. v.22-24 MTN | DE000LB381U7 | | EUR | 1.700.000 | - | - % | 99,730 | 1.695.410,00 | 0,31 |
| 3,2500 % Carlsberg Brew. MTN v.22-25 | XS2545263399 | | EUR | 1.000.000 | - | - % | 99,402 | 994.023,00 | 0,18 |
| 3,3750 % Bco.Sant. Hyp.-Pfe v.23-26 | ES0413900905 | | EUR | 5.000.000 | - | - % | 99,772 | 4.988.575,00 | 0,91 |
| 3,3900 % CS (CH) Hyp.-Pfe v.22-25 | CH1230759495 | | EUR | 2.500.000 | - | - % | 99,891 | 2.497.281,25 | 0,45 |
| 3,5000 % Bay.LB Hyp.-Pfe v.23-27 MTN | DE000BLB6J02 | | EUR | 2.000.000 | - | - % | 100,639 | 2.012.782,00 | 0,37 |
| 3,6250 % Dt.Bk. Hyp.-Pfe v.23-26 | ES0413320153 | | EUR | 2.000.000 | - | - % | 100,450 | 2.009.006,60 | 0,36 |
| 3,6250 % Heineken MTN v.23-26 | XS2719096831 | | EUR | 2.000.000 | - | - % | 100,234 | 2.004.680,80 | 0,36 |
| 3,7500 % Cie d.St.Gobain MTN v.23-26 | XS2723549528 | | EUR | 2.000.000 | - | - % | 100,428 | 2.008.563,20 | 0,36 |
| 3,7500 % RLB Steierm. Hyp-Pfe 23-26 MTN | AT0000A35Y69 | | EUR | 4.000.000 | - | - % | 100,432 | 4.017.266,80 | 0,73 |
| 3,9700 % Sandoz Fin. v.23-27 | XS2715297672 | | EUR | 2.000.000 | - | - % | 100,920 | 2.018.390,80 | 0,37 |
| 4,0000 % Booking Hold. v.22-26 | XS2555218291 | | EUR | 1.000.000 | - | - % | 101,277 | 1.012.771,90 | 0,18 |
| 4,1250 % TRATON Fin.Lux. MTN v.22-25 | DE000A3LBGG1 | | EUR | 1.500.000 | - | - % | 100,156 | 1.502.338,65 | 0,27 |

Vermögensaufstellung

| Gattungsbezeichnung | ISIN | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. | Bestand 30.06.2024 | Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum | Verkäufe/ Abgänge | Kurs | Kurswert in EUR | % des Fondsvermögens |
|---|---------------|-------|------------------------------|--------------------|------------------------------------|-------------------|-----------|-----------------------|----------------------|
| 4,3490 % Intesa Sanpaolo Frn 23-25 MTN | XS2597970800 | | EUR | 2.000.000 | - | - % | 100,220 | 2.004.400,00 | 0,36 |
| 4,8860 % NatWest Mark. Frn v.23-26 MTN | XS2576255751 | | EUR | 1.200.000 | - | - % | 100,970 | 1.211.640,00 | 0,22 |
| Zertifikate | | | | | | | | | |
| Euro | | | | | | | | 17.181.936,09 | 3,12 |
| Invesco Ph.M. XAU IZ 09-00 | IE00B579F325 | | STK | 82.000 | - | 10.000 EUR | 209,536 | 17.181.936,09 | 3,12 |
| An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere | | | | | | | | 13.435.413,20 | 2,44 |
| Verzinsliche Wertpapiere | | | | | | | | | |
| Euro | | | | | | | | 13.435.413,20 | 2,44 |
| 1,2500 % Daimler T.Int.Fin. MTN v.22-25 | XS2466172280 | | EUR | 1.000.000 | - | - % | 98,100 | 981.000,00 | 0,18 |
| 1,2500 % Haleon Neth.Cap. MTN v.22-26 | XS2462324745 | | EUR | 2.000.000 | - | - % | 95,843 | 1.916.862,20 | 0,35 |
| 1,5000 % LB Berlin Hyp.-Pfe S.565 | DE000A162BF5 | | EUR | 3.000.000 | - | - % | 96,680 | 2.900.400,00 | 0,53 |
| 3,2500 % Paccar Fin.Eur. MTN v.22-25 | XS2559453431 | | EUR | 2.000.000 | - | - % | 99,468 | 1.989.351,00 | 0,36 |
| 4,0000 % Dt.Bk. Frn v.23-38 | DE000DM34HB6 | | EUR | 5.000.000 | - | - % | 92,920 | 4.646.000,00 | 0,84 |
| 4,2880 % Kraft Heinz Foods Frn v.23-25 | XS2622214745 | | EUR | 1.000.000 | - | - % | 100,180 | 1.001.800,00 | 0,18 |
| Investmentanteile | | | | | | | | 399.417.132,39 | 72,53 |
| Gruppeneigene Investmentanteile | | | | | | | | | |
| US-Dollar | | | | | | | | 3.215.395,38 | 0,58 |
| HSBC G.Inv.F.-As.HY Bd. 'IC' | LU2065168440 | | ANT | 450.000 | - | 350.000 USD | 7,658 | 3.215.395,38 | 0,58 |
| Gruppenfremde Investmentanteile | | | | | | | | | |
| Euro | | | | | | | | 302.381.930,60 | 54,91 |
| AIS-PRIME EURO GOV BdS 0-1Y | LU2233156582 | | ANT | 250.000 | - | - EUR | 20,620 | 5.155.000,00 | 0,94 |
| ASSENAGON ALPHA-PREMIUM 'IS' | LU2078662611 | | ANT | 5.000 | - | - EUR | 1.121,460 | 5.607.300,00 | 1,02 |
| Assenagon Alpha Vol. 'I' | LU0575255335 | | ANT | 9.000 | - | - EUR | 1.052,710 | 9.474.390,00 | 1,72 |
| Assenagon Cred.Opp.Plus 'I' | LU1802294691 | | ANT | 5.000 | - | - EUR | 899,570 | 4.497.850,00 | 0,82 |
| BGF-Eur.HY Bd. 'Z2' | LU2099034311 | | ANT | 1.150.000 | - | - EUR | 11,140 | 12.811.000,00 | 2,33 |
| BlueBalance-Gl.Opp.Fd. 'EB' | LU2022233972 | | ANT | 30.000 | - | - EUR | 117,102 | 3.513.060,00 | 0,64 |
| BNY M.G.F-Eff.US.Fa.An.B. 'W' | IE00BM94ZV20 | | ANT | 12.442.738 | - | - EUR | 0,849 | 10.560.151,97 | 1,92 |
| Empureon Vola.One Fd. 'F' | DE000A3D9GM1 | | ANT | 2.800 | 2.800 | - EUR | 1.083,740 | 3.034.472,00 | 0,55 |
| Finreon Green Inc. 'S5' | DE000A3D9GE8 | | ANT | 20.000 | - | - EUR | 107,850 | 2.157.000,00 | 0,39 |
| Gl.Evol.Fd.-Emer.Mark.Loc.D. | LU2528851293 | | ANT | 4.500 | - | - EUR | 1.087,640 | 4.894.380,00 | 0,89 |
| HANETF-EUR.GRE.DEAL E ACC | IE0007WMMHDE3 | | ANT | 385.824 | - | - EUR | 7,218 | 2.784.877,63 | 0,51 |
| In.M.I Inv.AT1 Cap Bd. ETF | IE00BFZPF439 | | ANT | 300.000 | - | - EUR | 15,928 | 4.778.400,00 | 0,87 |
| InvescoMI2 EUR Gov B | IE00BGJWWV33 | | ANT | 220.000 | - | - EUR | 35,812 | 7.878.640,00 | 1,43 |
| iSh.eb.r.Gov.Ger.0-1y U.ETF | DE000A0Q4RZ9 | | ANT | 90.000 | - | - EUR | 74,754 | 6.727.860,00 | 1,22 |
| iSh.STOXX Eur.600 Oil&Gas | DE000A0H08M3 | | ANT | 110.000 | - | - EUR | 37,400 | 4.114.000,00 | 0,75 |
| iShares-EO Gov.Bd 1-3yr | IE00B14X4Q57 | | ANT | 36.000 | - | - EUR | 140,590 | 5.061.240,00 | 0,92 |
| iShares IV-EO Ultrash.Bd. | IE00BCRY6557 | | ANT | 130.000 | - | - EUR | 100,755 | 13.098.150,00 | 2,38 |
| iShares Pfandbriefe | DE0002635265 | | ANT | 130.000 | - | - EUR | 93,618 | 12.170.340,00 | 2,21 |
| JPM I.-EO Ul.-Sh.Inc.U.ETF | IE00BD9MMF62 | | ANT | 265.000 | - | 55.000 EUR | 103,910 | 27.536.150,00 | 5,00 |
| Lyxor IF-Lyx.Sm.Overn.Ret. 'C' | LU1190417599 | | ANT | 250.000 | - | - EUR | 103,332 | 25.832.900,00 | 4,69 |
| MULAmundi ESt600 Banks | LU1834983477 | | ANT | 130.000 | - | 20.000 EUR | 30,741 | 3.996.330,00 | 0,73 |
| MULAmundi ESt600 Insurance | LU1834987973 | | ANT | 70.000 | - | - EUR | 62,110 | 4.347.700,00 | 0,79 |

Vermögensaufstellung

| Gattungsbezeichnung | ISIN | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. | Bestand 30.06.2024 | Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum | Verkäufe/ Abgänge | Kurs | Kurswert in EUR | % des Fondsvermögens |
|--|--------------|-------|------------------------------|--------------------|------------------------------------|-------------------|-----------|-----------------------|----------------------|
| Nord.2-LCR ODCB Fd.-EO H. 'AI' | LU1536901389 | | ANT | 120.000 | - | - EUR | 85,264 | 10.231.704,00 | 1,86 |
| Ubam-EO Corp.IG Sol. 'IC' | LU1808451352 | | ANT | 85.000 | - | - EUR | 99,060 | 8.420.100,00 | 1,53 |
| UBAM-GI.HY Sol. 'IH' | LU0569863755 | | ANT | 76.500 | - | - EUR | 187,410 | 14.336.865,00 | 2,60 |
| UI-Aktia EM Front.Bd.+ 'IX' | LU1669794049 | | ANT | 60.000 | - | - EUR | 123,120 | 7.387.200,00 | 1,34 |
| UI I-LGIM EM Al.Ret.Bd.Fd. 'A' | LU2243831778 | | ANT | 82.000 | - | - EUR | 121,230 | 9.940.860,00 | 1,81 |
| Value Int.Gold Comp.Fd.AMI 'I' | DE000A2N65Y2 | | ANT | 33.000 | - | - EUR | 130,460 | 4.305.180,00 | 0,78 |
| XAIA Credit Basis II 'I' | LU0462885301 | | ANT | 16.000 | - | - EUR | 1.010,060 | 16.160.960,00 | 2,93 |
| Xtr.(IE)-iB. EUR C.B.Y.P. '1D' | IE00BYPHT736 | | ANT | 500.000 | - | - EUR | 14,808 | 7.404.000,00 | 1,34 |
| Xtr.II EO Corp.Bd.SRI PAB '1D' | LU0484968812 | | ANT | 117.000 | - | - EUR | 138,830 | 16.243.110,00 | 2,95 |
| Xtr.II EUR HY Corp.Bd. '1D' | LU1109942653 | | ANT | 450.000 | - | - EUR | 15,621 | 7.029.450,00 | 1,28 |
| Xtr.II Euroz.Inf.-Lkd.Bd. '1C' | LU0290358224 | | ANT | 67.000 | - | - EUR | 232,430 | 15.572.810,00 | 2,83 |
| Xtr.MSCI Eur.H.C.ESG Scr. '1C' | LU0292103222 | | ANT | 22.000 | - | 4.000 EUR | 241,750 | 5.318.500,00 | 0,97 |
| US-Dollar | | | | | | | | 90.074.332,56 | 16,36 |
| AB SICAV I-Em.M.Corp.Debt 'S1' | LU0736563973 | | ANT | 175.000 | 175.000 | - USD | 25,460 | 4.157.219,50 | 0,75 |
| InvescoMI2 US-T Bd.1-3Y | IE00BF2FNG46 | | ANT | 520.000 | - | - USD | 38,290 | 18.577.839,98 | 3,37 |
| InvescoMI NASDAQ 100 Swap | IE00BNRQM384 | | ANT | 80.000 | - | 10.000 USD | 61,680 | 4.604.058,78 | 0,84 |
| iSh.IV-DL Ultrashort Bd.U. | IE00BCRY6227 | | ANT | 50.000 | - | - USD | 99,740 | 4.653.137,39 | 0,84 |
| iShares-\$ Treas.Bd 1-3 | IE00B14X4S71 | | ANT | 110.000 | - | - USD | 127,415 | 13.077.350,13 | 2,37 |
| iSharesII-\$ TIPS | IE00B1FZSC47 | | ANT | 53.000 | - | - USD | 236,940 | 11.717.116,86 | 2,13 |
| iSV-iShs JPM \$ EM C.B.U. | IE00B6TLBW47 | | ANT | 25.000 | - | 25.000 USD | 87,990 | 2.052.484,25 | 0,37 |
| Lyxor Small Overn.Ret. 'C' | LU1248511575 | | ANT | 14.000 | - | 1.000 USD | 1.192,075 | 15.571.775,13 | 2,83 |
| T.Rowe P.-R.Asia Cred.Bd. 'I9' | LU2332152870 | | ANT | 350.000 | - | - USD | 9,550 | 3.118.731,05 | 0,57 |
| Xtr.(IE)-MSCI USA Fin. '1D' | IE00BCHWNT26 | | ANT | 120.000 | 40.000 | - USD | 30,180 | 3.379.146,26 | 0,61 |
| Xtr.(IE) - MSCI World En. '1C' | IE00BM67HM91 | | ANT | 45.000 | - | 15.000 USD | 50,750 | 2.130.860,74 | 0,39 |
| Xtr.II US Trea.1-3 '1D' | LU0429458895 | | ANT | 35.000 | - | - USD | 163,400 | 5.336.132,49 | 0,97 |
| Xtrackers CSI300 Swap '1C' | LU0779800910 | | ANT | 140.000 | - | 90.000 USD | 13,002 | 1.698.480,00 | 0,31 |
| Englische Pfund | | | | | | | | 3.745.473,85 | 0,68 |
| iShares-Core FTSE100 UE(DIST) | IE0005042456 | | ANT | 400.000 | - | - GBP | 7,939 | 3.745.473,85 | 0,68 |
| Summe Wertpapiervermögen | | | | | | | | 512.362.336,58 | 93,04 |
| Derivate | | | | | | | | 681.605,21 | 0,12 |
| Aktienindex-Derivate | | | | | | | | | |
| Aktienindex-Terminkontrakte | | | | | | | | 668.910,00 | 0,12 |
| ESTX 50 IND.-DIV.-FUT. 12/25 | | EUREX | STK | 300 | | EUR | | 668.910,00 | 0,12 |
| Optionsrechte | | | | | | | | 12.695,21 | 0,00 |
| Optionsrechte auf Aktienindices | | | | | | | | | |
| CALL S&P 500 5700 09/24 | | CBOE | STK | -15 | | USD | 40,933 | -57.288,59 | -0,01 |
| C EURO STOXX 50 5200 190724 | | EUREX | STK | -150 | | EUR | 2,300 | -3.450,00 | 0,00 |
| P EURO STOXX 50 4600 190724 | | EUREX | STK | 150 | | EUR | 15,800 | 23.700,00 | 0,00 |
| PUT S&P 500 4800 09/24 | | CBOE | STK | -20 | | USD | 14,557 | -27.165,29 | 0,00 |
| PUT S&P 500 5200 09/24 | | CBOE | STK | 20 | | USD | 41,208 | 76.899,09 | 0,01 |

Vermögensaufstellung

| Gattungsbezeichnung | ISIN | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. | Bestand 30.06.2024 | Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum | Verkäufe/ Abgänge im Berichtszeitraum | Kurs | Kurswert in EUR | % des Fondsvermögens |
|---|--------------|-------|------------------------------|--------------------|------------------------------------|---------------------------------------|-------------|-----------------------|----------------------|
| Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds | | | | | | | | 37.027.309,67 | 6,72 |
| Bankguthaben | | | | | | | | 5.346.662,37 | 0,97 |
| EUR-Guthaben bei: | | | | | | | | | |
| Verwahrstelle | | | | | | | | | |
| HSBC Continental Europe S.A., Germany | | | EUR | 2.384.318,62 | | % | 100,000 | 2.384.318,62 | 0,43 |
| Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen | | | | | | | | | |
| HSBC Continental Europe S.A., Germany | | | GBP | 510.591,57 | | % | 100,000 | 602.219,23 | 0,11 |
| HSBC Continental Europe S.A., Germany | | | USD | 2.529.463,45 | | % | 100,000 | 2.360.124,52 | 0,43 |
| Geldmarktfonds | | | | | | | | 31.680.647,30 | 5,75 |
| Gruppenfremde Geldmarktfonds | | | | | | | | | |
| AMUNDI EO LIQUID.SRI IC | FR0010251660 | | ANT | 130,00 | - | 5 EUR | 243.697,287 | 31.680.647,30 | 5,75 |
| Sonstige Vermögensgegenstände | | | | | | | | 1.935.567,77 | 0,35 |
| Zinsansprüche | | | EUR | 971.135,72 | | | | 971.135,72 | 0,18 |
| Geleistete Initial Margins | | | EUR | 868.418,05 | | | | 868.418,05 | 0,16 |
| Forderungen aus schwebenden Geschäften | | | EUR | 96.014,00 | | | | 96.014,00 | 0,02 |
| Sonstige Verbindlichkeiten | | | | | | | | -1.310.954,43 | -0,24 |
| Verbindlichkeiten aus schwebenden Geschäften | | | EUR | -0,02 | | | | -0,02 | 0,00 |
| Kostenabgrenzungen | | | EUR | -642.044,41 | | | | -642.044,41 | -0,12 |
| Erhaltene Variation Margin | | | EUR | -668.910,00 | | | | -668.910,00 | -0,12 |
| Fondsvermögen | | | | | | | EUR | 550.695.864,80 | 100,00* |
| Anteilwert | | | | | | | EUR | 105,08 | |
| Umlaufende Anteile | | | | | | | STK | 5.240.657,00 | |

*) Durch Rundung der Prozent-Anteile bei der Berechnung können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

Die Vermögensgegenstände des Sondervermögens sind auf der Grundlage nachstehender Kurse/Marktsätze bewertet: Alle Vermögenswerte: Kurse bzw. Marktsätze per 28.06.2024 oder letztbekannte.

| Devisenkurs(e) bzw. Konversionsfaktor(en) (in Mengennotiz) per 28.06.2024 | | |
|--|-------|-------------------|
| Englische Pfund | (GBP) | 0,84785 = 1 (EUR) |
| US-Dollar | (USD) | 1,07175 = 1 (EUR) |

Marktschlüssel

b) Terminbörsen

| | |
|-------|--|
| CBOE | Chicago - Chicago Board Options Exchange (CBOE) |
| EUREX | Frankfurt/Zürich - Eurex (Eurex DE/Eurex Zürich) |

Im Berichtszeitraum haben gegebenenfalls Kapitalmaßnahmen und eventuelle unterjährige Änderungen der Stammdaten eines Wertpapiers stattgefunden. Diese Kapitalmaßnahmen und die Umbuchungen aufgrund von Stammdatenänderungen sind ohne Umsatzzahlen in der „Vermögensaufstellung“ und in den „Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen“ enthalten.

Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit diese nicht mehr Gegenstand der Vermögensaufstellung sind:

Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schuldscheindarlehen (Marktzuordnung zum Berichtsstichtag):

| Gattungsbezeichnung | ISIN | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. | Käufe/ Zugänge | Verkäufe/ Abgänge |
|---|--------------|------------------------------|----------------|-------------------|
| Börsengehandelte Wertpapiere | | | | |
| Verzinsliche Wertpapiere | | | | |
| Euro | | | | |
| 0,0000 % Bco.Sant. Frn v.22-25 MTN | XS2436160779 | EUR | - | 1.000.000 |
| 0,0000 % CA Auto Bk. MTN v.21-24 | XS2332254015 | EUR | - | 2.000.000 |
| 0,0100 % Asahi Gr.Hold. v.21-24 | XS2328980979 | EUR | - | 2.000.000 |
| 0,2500 % Alfa Laval Trea.Int. MTN 19-24 | XS2017324844 | EUR | - | 2.000.000 |
| 0,3750 % L'Oréal v.22-24 | FR0014009E10 | EUR | - | 2.000.000 |
| 1,0000 % Kellanova v.16-24 | XS1410417544 | EUR | - | 2.000.000 |
| 1,2000 % Linde v.16-24 | XS1362384262 | EUR | - | 2.000.000 |
| 1,3750 % Goldman S.Gr. MTN v.17-24 | XS1614198262 | EUR | - | 2.000.000 |
| 2,8750 % Philip Morris Int. MTN v.12-24 | XS0787527349 | EUR | - | 2.000.000 |
| 4,2500 % CA Auto Bk. MTN v.22-24 | XS2549047244 | EUR | - | 1.000.000 |
| 5,5160 % CA Auto Bk. Frn 22-24 MTN | XS2549047673 | EUR | - | 1.000.000 |
| An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere | | | | |
| Verzinsliche Wertpapiere | | | | |
| Euro | | | | |
| 0,2500 % PepsiCo v.20-24 | XS2168625460 | EUR | - | 2.000.000 |
| 0,6250 % ABB Fin. MTN v.22-24 | XS2463974571 | EUR | - | 2.000.000 |
| Investmentanteile | | | | |
| Gruppenfremde Investmentanteile | | | | |
| Euro | | | | |
| OptoFlex | LU0834815101 | ANT | - | 2.200 |

| Gattungsbezeichnung | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. | Volumen in 1.000 |
|---|------------------------------|------------------|
| Derivate (In Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe) | | |
| Optionsrechte | | |
| Optionsrechte auf Aktienindex-Derivate | | |
| Optionsrechte auf Aktienindices | | |
| Gekaufte Verkaufsoptionen (put) | EUR | 15.274 |
| Basiswerte: (P EURO STOXX 50 4400 210624, PUT S&P 500 4700 06/24) | | |
| Verkaufte Kaufoptionen (call) | EUR | 17.616 |
| Basiswerte: (C EURO STOXX 50 5100 210624, CALL S&P 500 5400 06/24) | | |
| Verkaufte Verkaufsoptionen (put) | EUR | 13.902 |
| Basiswerte: (P EURO STOXX 50 4100 210624, PUT S&P 500 4200 06/24) | | |

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben nach Derivateverordnung

| | |
|--|---------|
| Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen | 93,04 % |
| Bestand der Derivate am Fondsvermögen | 0,12 % |

Sonstige Angaben

| | |
|--------------------------|--------------|
| Anteilwert (EUR) | 105,08 |
| Umlaufende Anteile (STK) | 5.240.657,00 |

Angaben zum Bewertungsverfahren gemäß §§ 26-31 und 34 KARBV

Alle Vermögensgegenstände, die zum Handel an einer Börse oder einem anderem organisierten Markt zugelassen oder in diesen einbezogen sind, werden mit dem zuletzt verfügbaren Preis bewertet, der aufgrund von fest definierten Kriterien als handelbar eingestuft werden kann und der eine verlässliche Bewertung sicherstellt (§§ 27, 34 KARBV).

Die verwendeten Preise sind Börsenpreise, Notierungen auf anerkannten Informationssystemen oder Kurse aus emittentenunabhängigen Bewertungssystemen (§§ 28, 34 KARBV).

Anteile an Investmentvermögen werden mit ihrem zuletzt verfügbaren veröffentlichten Rücknahmekurs der jeweiligen Kapitalverwaltungsgesellschaft bewertet.

Bankguthaben werden zum Nennwert zuzüglich zugeflossener Zinsen, kündbare Festgelder zum Verkehrswert und Verbindlichkeiten zum Rückzahlungsbetrag bewertet (§§ 29, 34 KARBV).

Die Bewertung erfolgt grundsätzlich zum letzten gehandelten Preis gemäß festgelegtem Bewertungszeitpunkt (Vortag oder gleichartig).

Vermögensgegenstände, die nicht zum Handel an einem organisierten Markt zugelassen sind oder für die keine handelbaren Kurse festgestellt werden können, werden mit Hilfe von anerkannten Bewertungsmodellen auf Basis beobachtbarer Marktdaten bewertet. Ist keine Bewertung auf Basis von Modellen möglich, erfolgt eine Bewertung durch andere geeignete Verfahren zur Preisfeststellung (§§ 28, 34 KARBV). Andere geeignete Verfahren kann die Verwendung eines von einem Dritten ermittelten Preises sein und unterliegt einer Plausibilitätsprüfung durch die KVG.

Optionen und Futures, die zum Handel an einer Börse zugelassen oder in einem organisierten Markt einbezogen sind, werden zu dem jeweils verfügbaren handelbaren Kurs (Settlementpreis der jeweiligen Börse), der eine verlässliche Bewertung gewährleistet, bewertet.

Angaben zur Transparenz

Verwaltungsvergütungssatz für im Sondervermögen gehaltene Investmentanteile:

| Investmentanteile | Verwaltungsvergütung ¹⁾ |
|--------------------------------|------------------------------------|
| AB SICAV I-Em.M.Corp.Debt 'S1' | 0,70000 % p.a. |
| AIS-PRIME EURO GOV BdS 0-1Y | 0,03000 % p.a. |
| AMUNDI EO LIQUID.SRI IC | 0,09190 % p.a. |
| Assenagon Alpha Vol. 'I' | 0,80000 % p.a. |
| ASSENAGON ALPHA-PREMIUM 'IS' | 0,55000 % p.a. |
| Assenagon Cred.Opp.Plus 'I' | 0,70000 % p.a. |
| BGF-Eur.HY Bd. 'Z2' | 0,25000 % p.a. |
| BlueBalance-Gl.Opp.Fd. 'EB' | 0,95000 % p.a. |
| BNY M.G.F-Eff.US.Fa.An.B. 'W' | 0,30000 % p.a. |
| Empureon Vola.One Fd. 'F' | 1,10000 % p.a. |
| Finreon Green Inc. 'S5' | 0,30000 % p.a. |
| Gl.Evol.Fd.-Emer.Mark.Loc.D. | 0,50000 % p.a. |
| HANETF-EUR.GRE.DEAL E ACC | 0,60000 % p.a. |
| HSBC G.Inv.F.-As.HY Bd. 'IC' | 0,62500 % p.a. |
| In.M.I Inv.AT1 Cap Bd. ETF | 0,39000 % p.a. |
| InvescoMI NASDAQ 100 Swap | 0,20000 % p.a. |
| InvescoMI2 EUR Gov B | 0,10000 % p.a. |
| InvescoMI2 US-T Bd. 1-3Y | 0,06000 % p.a. |
| iShares IV-EO Ultrash.Bd. | 0,09000 % p.a. |
| iShares Pfandbriefe | 0,10000 % p.a. |

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

| Investmentanteile | Verwaltungsvergütung ¹⁾ |
|--------------------------------|------------------------------------|
| iShares-\$ Treas.Bd 1-3 | 0,07000 % p.a. |
| iShares-Core FTSE100 UE(DIST) | 0,07000 % p.a. |
| iShares-EO Gov.Bd 1-3yr | 0,15000 % p.a. |
| iSharesII-\$ TIPS | 0,10000 % p.a. |
| iSh.eb.r.Gov.Ger.0-1y U.ETF | 0,13000 % p.a. |
| iSh.IV-DL Ultrashort Bd.U. | 0,09000 % p.a. |
| iSh.STOXX Eur.600 Oil&Gas | 0,46000 % p.a. |
| iSV-iShs JPM \$ EM C.B.U. | 0,50000 % p.a. |
| JPM I.-EO UI.-Sh.Inc.U.ETF | 0,18000 % p.a. |
| Lyxor IF-Lyx.Sm.Overn.Ret. 'C' | 0,05000 % p.a. |
| Lyxor Small Overn.Ret. 'C' | 0,09000 % p.a. |
| MUL-Amundi Est600 Banks | 0,30000 % p.a. |
| MUL-Amundi Est600 Insurance | 0,30000 % p.a. |
| Nord.2-LCR ODCB Fd.-EO H. 'AI' | 0,20000 % p.a. |
| OptoFlex | 0,70000 % p.a. |
| T.Rowe P.-R.Asia Cred.Bd. 'I9' | 0,25000 % p.a. |
| Ubam-EO Corp.IG Sol. 'IC' | 0,15000 % p.a. |
| UBAM-Gl.HY Sol. 'IH' | 0,25000 % p.a. |
| UI I-LGIM EM AI.Ret.Bd.Fd. 'A' | 1,05000 % p.a. |
| UI-Aktia EM Front.Bd.+ 'IX' | 0,30000 % p.a. |
| Value Int.Gold Comp.Fd.AMI 'I' | 0,95000 % p.a. |
| XAIA Credit Basis II 'I' | 0,80000 % p.a. |
| Xtrackers CSI300 Swap '1C' | 0,30000 % p.a. |
| Xtr.(IE) - MSCI World En. '1C' | 0,10000 % p.a. |
| Xtr.(IE)-iB. EUR C.B.Y.P. '1D' | 0,15000 % p.a. |
| Xtr.(IE)-MSCI USA Fin. '1D' | 0,02000 % p.a. |
| Xtr.II EO Corp.Bd.SRI PAB '1D' | 0,06000 % p.a. |
| Xtr.II EUR HY Corp.Bd. '1D' | 0,10000 % p.a. |
| Xtr.II Euroz.Inf.-Lkd.Bd. '1C' | 0,05000 % p.a. |
| Xtr.II US Trea.1-3 '1D' | 0,01000 % p.a. |
| Xtr.MSCI Eur.H.C.ESG Scr. '1C' | 0,07000 % p.a. |

¹⁾ Von anderen Kapitalverwaltungsgegesellschaften bzw. ausländischen Investmentgesellschaften berechnete Verwaltungsvergütung.

Bei den Angaben zu Verwaltungsvergütungen handelt es sich um den von den Gesellschaften maximal belasteten Prozentsatz.
Quelle: WM Datenservice oder andere öffentlich verfügbare Quellen

Im Berichtszeitraum wurden keine Ausgabeaufschläge gezahlt.
Im Berichtszeitraum wurden keine Rücknahmeaufschläge gezahlt.