

KAPITALVERWALTUNGSGESELLSCHAFT:



---

## Aquantum Active Range

JAHRESBERICHT

ZUM 30. JUNI 2024

---

VERWAHRSTELLE:



ASSET MANAGEMENT UND VERTRIEB:



# Jahresbericht

## Aquantum Active Range

### Tätigkeitsbericht für den Berichtszeitraum vom 1. Juli 2023 bis 30. Juni 2024

#### Anlageziele und Anlagepolitik zur Erreichung der Anlageziele

Der Fonds handelt systematisch Optionskombinationen auf US-amerikanische Aktienindizes mit dem Ziel, Schwankungen des Aktienmarktes zu nutzen und eine zum Basiswert möglichst un- bis negativ korrelierte positive Rendite zu erzielen. Durch den simultanen Kauf und Verkauf von börsengehandelten Optionen (Spreads) mit verschiedenen Laufzeiten wird ein Korridor eingerichtet. Ziel ist es, dass sich der Basiswert während der Laufzeit der jeweiligen Spreads in den zuvor eingerichteten Korridor bewegt, um damit über eine Wertsteigerung der gekauften Optionen zu profitieren. Bleibt diese Marktschwankung während der Laufzeit der eingesetzten Optionen aus, verfällt der jeweilige Spread wertlos, d.h. der Fonds zahlt oder erhält lediglich die eingesetzte Optionsprämie. Der Fonds verfolgt einen aktiven Management- und Risikomanagementansatz. Dafür wird die Positionierung des Fonds während der gesamten Handelssitzung an das aktuelle Markt- und Volatilitätsumfeld angepasst. Der Anteil des Fondsvermögens, der nicht zur Umsetzung der Strategie benötigt wird, wird in Euro-denominierte Anleihen mit Investmentgrade Rating und Tagesgeld bei deutschen Landesbanken angelegt. Es wird nicht angestrebt mit diesen Anlagen eine Zusatzrendite zu erwirtschaften.

#### Struktur des Portfolios und wesentliche Veränderungen im Berichtszeitraum

##### Fondsstruktur

	30.06.2024		30.06.2023	
	Kurswert	% Anteil Fondsvermögen	Kurswert	% Anteil Fondsvermögen
Optionen	40.329.138,66	6,80	-42.006,61	-0,01
Futures	68.499,53	0,01	0,00	0,00
Festgelder/Termingelder/Kredite	81.000.000,00	13,66	111.000.000,00	36,67
Bankguthaben	476.576.120,47	80,38	193.499.774,27	63,92
Zins- und Dividendenansprüche	622.748,01	0,11	364.338,24	0,12
Sonstige Ford./Verbindlichkeiten	-5.666.304,56	-0,96	-2.122.986,30	-0,70
Fondsvermögen	592.930.202,10	100,00	302.699.119,60	100,00

## **Jahresbericht**

### **Aquantum Active Range**

Im Berichtszeitraum vom 1. Juli 2023 bis 30. Juni 2024 hat der S&P 500 Index einen starken Aufwärtstrend ausgebildet. In diesem Zeitfenster stieg der für den Fonds relevante E-mini S&P 500 Future von 4.492,5 Punkten (ESU3 Index) auf einen Stand von 5.521,5 Punkten (ESU4 Index) zum Ende der Berichtsperiode. Die Aufwärtsbewegung wurde lediglich in den Monaten August bis Oktober 2023 und im April 2024 durch eine jeweils größere korrektive Abwärtsbewegung unterbrochen. Diese Marktschwankungen sind nötig, um positive Ergebnisse mit der Aquantum Active Range Strategie erzielen zu können.

Dank der Gewinne in den oben genannten, volatilitätsreichen Monaten konnte die Active Range Strategie sowohl im dritten und vierten Quartal 2023 als auch im zweiten Quartal 2024 eine positive Quartalsperformance erzielen. Im ersten Quartal des Jahres 2024 lief der S&P 500 Index in einer geradlinigen Aufwärtsbewegung, was zu einem negativen Ergebnis in der Active Range Strategie für dieses Quartal führte. Die Aquantum Active Range Strategie verzeichnete in seinem dritten Geschäftsjahr eine Jahresperformance von +7,78% (Anteilsklasse S), +7,28% (Anteilsklasse I) und von +6,95% (Anteilsklasse R). Die annualisierte Volatilität des Fonds liegt seit Auflage in der Anteilsklasse S bei 4,85%, in der Anteilsklasse I bei 4,85% und in der Anteilsklasse R bei 4,88%.

Mit der Auflage der Anteilsklasse S-CHF am 01.03.2024 (Rendite seit Auflage: +1,30%) und der Anteilsklasse X am 5.03.2024 (Rendite seit Auflage: +1,37%) sind zwei neue Anteilklassen geschaffen worden. Die Anteilsklasse S-CHF denominated in CHF und ist hedged. Die Anteilsklasse X wurde für Kunden mit einer Mindestinvestitionssumme von 100 Mio. EUR kreiert.

An der Anlagestrategie und am Investmentprozess wurden keine Veränderungen vorgenommen.

### **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.

## Jahresbericht

### Aquantum Active Range

#### 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.

#### **Fondsergebnis**

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

Wertentwicklung im Berichtszeitraum (1. Juli 2023 bis 30. Juni 2024)<sup>1</sup>.

Anteilklasse S:	+7,78%
Anteilklasse I:	+7,28%
Anteilklasse R:	+6,95%
Anteilklasse S – CHF:	+1,30%
Anteilklasse X:	+1,37%

<sup>1</sup>Eigene 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.

# Jahresbericht Aquantum Active Range

## Vermögensübersicht zum 30.06.2024

Anlageschwerpunkte	Tageswert in EUR	% Anteil am Fondsvermögen
<b>I. Vermögensgegenstände</b>	<b>598.661.320,50</b>	<b>100,97</b>
1. Derivate	40.397.638,19	6,81
2. Bankguthaben	157.245.603,10	26,52
3. Sonstige Vermögensgegenstände	401.018.079,21	67,63
<b>II. Verbindlichkeiten</b>	<b>-5.731.118,39</b>	<b>-0,97</b>
<b>III. Fondsvermögen</b>	<b>592.930.202,10</b>	<b>100,00</b>

# Jahresbericht

## Aquantum Active Range

### 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
<b>Derivate</b>							<b>EUR</b>	<b>40.397.638,19</b>	<b>6,81</b>
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)									
<b>Aktienindex-Derivate</b>							<b>EUR</b>	<b>40.329.138,66</b>	<b>6,80</b>
Forderungen/Verbindlichkeiten									
<b>Optionsrechte</b>							<b>EUR</b>	<b>40.329.138,66</b>	<b>6,80</b>
<b>Optionsrechte auf Aktienindex-Terminkontrakte</b>							<b>EUR</b>	<b>40.329.138,66</b>	<b>6,80</b>
FUT E-MI SP W3 09.24 PUT 19.07.24 BP 4700,00 CME			352	Anzahl -199200			USD 1,000	-185.890,26	-0,03
FUT E-MI SP W3 09.24 PUT 19.07.24 BP 4800,00 CME			352	Anzahl -99600			USD 1,250	-116.181,41	-0,02
FUT E-MI SP W3 09.24 PUT 19.07.24 BP 4850,00 CME			352	Anzahl -166000			USD 1,350	-209.126,54	-0,04
FUT E-MI SP W3 09.24 PUT 19.07.24 BP 4900,00 CME			352	Anzahl -49800			USD 1,550	-72.032,47	-0,01
FUT E-MI SP W3 09.24 PUT 19.07.24 BP 4930,00 CME			352	Anzahl -83000			USD 1,650	-127.799,55	-0,02
FUT E-MI SP W3 09.24 PUT 19.07.24 BP 4980,00 CME			352	Anzahl -49800			USD 1,950	-90.621,50	-0,02
FUT E-MI SP W3 09.24 PUT 19.07.24 BP 5000,00 CME			352	Anzahl 49800			USD 2,050	95.268,76	0,02
FUT E-MI SP W3 09.24 PUT 19.07.24 BP 5010,00 CME			352	Anzahl -66400			USD 2,100	-130.123,18	-0,02
FUT E-MI SP W3 09.24 PUT 19.07.24 BP 5070,00 CME			352	Anzahl -132800			USD 2,650	-328.406,12	-0,06
FUT E-MI SP W3 09.24 PUT 19.07.24 BP 5090,00 CME			352	Anzahl -33200			USD 2,850	-88.297,87	-0,01
FUT E-MI SP W3 09.24 PUT 19.07.24 BP 5100,00 CME			352	Anzahl 41500			USD 3,000	116.181,41	0,02
FUT E-MI SP W3 09.24 PUT 19.07.24 BP 5110,00 CME			352	Anzahl -66400			USD 3,100	-192.086,60	-0,03
FUT E-MI SP W3 09.24 PUT 19.07.24 BP 5140,00 CME			352	Anzahl -66400			USD 3,600	-223.068,31	-0,04
FUT E-MI SP W3 09.24 PUT 19.07.24 BP 5150,00 CME			352	Anzahl 24900			USD 3,750	87.136,06	0,01
FUT E-MI SP W3 09.24 PUT 19.07.24 BP 5180,00 CME			352	Anzahl -33200			USD 4,400	-136.319,52	-0,02
FUT E-MI SP W3 09.24 PUT 19.07.24 BP 5200,00 CME			352	Anzahl 41500			USD 4,900	189.762,97	0,03
FUT E-MI SP W3 09.24 PUT 19.07.24 BP 5250,00 CME			352	Anzahl 24900			USD 6,600	153.359,46	0,03
FUT E-MI SP W3 09.24 PUT 19.07.24 BP 5290,00 CME			352	Anzahl 16600			USD 8,550	132.446,81	0,02
FUT E-MI SP W3 09.24 PUT 19.07.24 BP 5330,00 CME			352	Anzahl 16600			USD 11,250	174.272,12	0,03
FUT E-MI SP W3 09.24 PUT 19.07.24 BP 5340,00 CME			352	Anzahl 33200			USD 12,250	379.525,94	0,06
FUT E-MI SP W3 09.24 PUT 19.07.24 BP 5390,00 CME			352	Anzahl 16600			USD 17,750	274.962,67	0,05
FUT E-MI SP W3 09.24 PUT 19.07.24 BP 5430,00 CME			352	Anzahl 16600			USD 24,750	383.398,66	0,06
FUT E-MI SP W3 09.24 PUT 19.07.24 BP 5440,00 CME			352	Anzahl 33200			USD 26,750	828.760,73	0,14

# Jahresbericht

## Aquantum Active Range

### Vermögensaufstellung zum 30.06.2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2024	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
FUT E-MI SP W3 12.24 CALL 18.10.24 BP 100,00 CME			352	Anzahl 20350			USD 5.389,750	102.352.941,86	17,26
FUT E-MI SP W3 12.24 CALL 18.10.24 BP 2100,00 CME			352	Anzahl -20350			USD 3.424,750	-65.037.012,41	-10,97
FUT E-MI SP W3 12.24 PUT 18.10.24 BP 100,00 CME			352	Anzahl -20350			USD 0,050	-949,51	0,00
FUT E-MI SP W3 12.24 PUT 18.10.24 BP 2100,00 CME			352	Anzahl 20350			USD 0,450	8.545,63	0,00
FUT E-MI SP W4 09.24 PUT 26.07.24 BP 4700,00 CME			352	Anzahl -232400			USD 1,550	-336.151,55	-0,06
FUT E-MI SP W4 09.24 PUT 26.07.24 BP 4800,00 CME			352	Anzahl -116200			USD 1,950	-211.450,17	-0,04
FUT E-MI SP W4 09.24 PUT 26.07.24 BP 4900,00 CME			352	Anzahl -174300			USD 2,500	-406.634,94	-0,07
FUT E-MI SP W4 09.24 PUT 26.07.24 BP 4980,00 CME			352	Anzahl -116200			USD 3,200	-346.995,15	-0,06
FUT E-MI SP W4 09.24 PUT 26.07.24 BP 5000,00 CME			352	Anzahl 58100			USD 3,400	184.341,17	0,03
FUT E-MI SP W4 09.24 PUT 26.07.24 BP 5060,00 CME			352	Anzahl -132800			USD 4,200	-520.492,72	-0,09
FUT E-MI SP W4 09.24 PUT 26.07.24 BP 5070,00 CME			352	Anzahl -33200			USD 4,400	-136.319,52	-0,02
FUT E-MI SP W4 09.24 PUT 26.07.24 BP 5110,00 CME			352	Anzahl -66400			USD 5,200	-322.209,78	-0,05
FUT E-MI SP W4 09.24 PUT 26.07.24 BP 5140,00 CME			352	Anzahl -66400			USD 5,900	-365.584,17	-0,06
FUT E-MI SP W4 09.24 PUT 26.07.24 BP 5150,00 CME			352	Anzahl 41500			USD 6,200	240.108,25	0,04
FUT E-MI SP W4 09.24 PUT 26.07.24 BP 5190,00 CME			352	Anzahl -33200			USD 7,550	-233.911,91	-0,04
FUT E-MI SP W4 09.24 PUT 26.07.24 BP 5250,00 CME			352	Anzahl 58100			USD 10,500	569.288,91	0,10
FUT E-MI SP W4 09.24 PUT 26.07.24 BP 5330,00 CME			352	Anzahl 33200			USD 17,250	534.434,49	0,09
FUT E-MI SP W4 09.24 PUT 26.07.24 BP 5350,00 CME			352	Anzahl 24900			USD 19,500	453.107,50	0,08
FUT E-MI SP W4 09.24 PUT 26.07.24 BP 5430,00 CME			352	Anzahl 33200			USD 33,500	1.037.887,27	0,18
FUT E-MI SP W4 09.24 PUT 26.07.24 BP 5450,00 CME			352	Anzahl 24900			USD 38,250	888.787,79	0,15
FUT MI SP W2 09.24 PUT 12.07.24 BP 4600,00 CME			352	Anzahl -199200			USD 0,400	-74.356,10	-0,01
FUT MI SP W2 09.24 PUT 12.07.24 BP 4700,00 CME			352	Anzahl -99600			USD 0,450	-41.825,31	-0,01
FUT MI SP W2 09.24 PUT 12.07.24 BP 4720,00 CME			352	Anzahl -132800			USD 0,450	-55.767,08	-0,01
FUT MI SP W2 09.24 PUT 12.07.24 BP 4800,00 CME			352	Anzahl -83000			USD 0,500	-38.727,14	-0,01
FUT MI SP W2 09.24 PUT 12.07.24 BP 4880,00 CME			352	Anzahl -33200			USD 0,600	-18.589,03	0,00
FUT MI SP W2 09.24 PUT 12.07.24 BP 4900,00 CME			352	Anzahl 49800			USD 0,650	30.207,17	0,01
FUT MI SP W2 09.24 PUT 12.07.24 BP 4940,00 CME			352	Anzahl -66400			USD 0,750	-46.472,56	-0,01
FUT MI SP W2 09.24 PUT 12.07.24 BP 4950,00 CME			352	Anzahl 33200			USD 0,750	23.236,28	0,00
FUT MI SP W2 09.24 PUT 12.07.24 BP 4970,00 CME			352	Anzahl -66400			USD 0,800	-49.570,74	-0,01
FUT MI SP W2 09.24 PUT 12.07.24 BP 5010,00 CME			352	Anzahl -66400			USD 0,900	-55.767,08	-0,01
FUT MI SP W2 09.24 PUT 12.07.24 BP 5020,00 CME			352	Anzahl -33200			USD 0,950	-29.432,62	0,00
FUT MI SP W2 09.24 PUT 12.07.24 BP 5040,00 CME			352	Anzahl -132800			USD 1,000	-123.926,84	-0,02
FUT MI SP W2 09.24 PUT 12.07.24 BP 5050,00 CME			352	Anzahl 16600			USD 1,050	16.265,40	0,00
FUT MI SP W2 09.24 PUT 12.07.24 BP 5080,00 CME			352	Anzahl -33200			USD 1,150	-35.628,97	-0,01
FUT MI SP W2 09.24 PUT 12.07.24 BP 5090,00 CME			352	Anzahl -66400			USD 1,200	-74.356,10	-0,01

# Jahresbericht

## Aquantum Active Range

### 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
FUT MI SP W2 09.24 PUT 12.07.24 BP 5100,00 CME			352	Anzahl -66400			USD 1,250	-77.454,27	-0,01
FUT MI SP W2 09.24 PUT 12.07.24 BP 5120,00 CME			352	Anzahl -66400			USD 1,400	-86.748,79	-0,01
FUT MI SP W2 09.24 PUT 12.07.24 BP 5150,00 CME			352	Anzahl 16600			USD 1,600	24.785,37	0,00
FUT MI SP W2 09.24 PUT 12.07.24 BP 5160,00 CME			352	Anzahl -33200			USD 1,650	-51.119,82	-0,01
FUT MI SP W2 09.24 PUT 12.07.24 BP 5170,00 CME			352	Anzahl -33200			USD 1,750	-54.217,99	-0,01
FUT MI SP W2 09.24 PUT 12.07.24 BP 5210,00 CME			352	Anzahl 33200			USD 2,200	68.159,76	0,01
FUT MI SP W2 09.24 PUT 12.07.24 BP 5260,00 CME			352	Anzahl 16600			USD 3,150	48.796,19	0,01
FUT MI SP W2 09.24 PUT 12.07.24 BP 5300,00 CME			352	Anzahl 33200			USD 4,450	137.868,61	0,02
FUT MI SP W2 09.24 PUT 12.07.24 BP 5310,00 CME			352	Anzahl 33200			USD 4,850	150.261,29	0,03
FUT MI SP W2 09.24 PUT 12.07.24 BP 5340,00 CME			352	Anzahl 16600			USD 6,400	99.141,47	0,02
FUT MI SP W2 09.24 PUT 12.07.24 BP 5360,00 CME			352	Anzahl 33200			USD 7,850	243.206,42	0,04
FUT MI SP W2 09.24 PUT 12.07.24 BP 5400,00 CME			352	Anzahl 33200			USD 11,750	364.035,09	0,06
FUT MI SP W2 09.24 PUT 12.07.24 BP 5440,00 CME			352	Anzahl 16600			USD 19,000	294.326,24	0,05
FUT MI SP W2 09.24 PUT 12.07.24 BP 5460,00 CME			352	Anzahl 16600			USD 24,500	379.525,94	0,06
FUT MINI S+P W1 09.24 PUT 02.08.24 BP 4700,00 CME			352	Anzahl -33200			USD 2,550	-79.003,36	-0,01
FUT MINI S+P W1 09.24 PUT 02.08.24 BP 4800,00 CME			352	Anzahl -16600			USD 3,200	-49.570,74	-0,01
FUT MINI S+P W1 09.24 PUT 02.08.24 BP 4900,00 CME			352	Anzahl -24900			USD 4,100	-95.268,76	-0,02
FUT MINI S+P W1 09.24 PUT 02.08.24 BP 4980,00 CME			352	Anzahl -16600			USD 5,250	-81.326,99	-0,01
FUT MINI S+P W1 09.24 PUT 02.08.24 BP 5000,00 CME			352	Anzahl 8300			USD 5,600	43.374,39	0,01
FUT MINI S+P W1 09.24 PUT 02.08.24 BP 5050,00 CME			352	Anzahl -33200			USD 6,700	-207.577,45	-0,04
FUT MINI S+P W1 09.24 PUT 02.08.24 BP 5130,00 CME			352	Anzahl -16600			USD 9,100	-140.966,78	-0,02
FUT MINI S+P W1 09.24 PUT 02.08.24 BP 5150,00 CME			352	Anzahl 8300			USD 9,900	76.679,73	0,01
FUT MINI S+P W1 09.24 PUT 02.08.24 BP 5250,00 CME			352	Anzahl 8300			USD 15,750	121.990,48	0,02
FUT MINI S+P W1 09.24 PUT 02.08.24 BP 5320,00 CME			352	Anzahl 8300			USD 22,750	176.208,47	0,03
FUT MINI S+P W1 09.24 PUT 02.08.24 BP 5420,00 CME			352	Anzahl 8300			USD 40,250	311.753,45	0,05
FUT MINI S+P W1 09.24 PUT 05.07.24 BP 4500,00 CME			352	Anzahl -132800			USD 0,050	-6.196,34	0,00
FUT MINI S+P W1 09.24 PUT 05.07.24 BP 4600,00 CME			352	Anzahl -66400			USD 0,100	-6.196,34	0,00
FUT MINI S+P W1 09.24 PUT 05.07.24 BP 4670,00 CME			352	Anzahl -132800			USD 0,100	-12.392,68	0,00
FUT MINI S+P W1 09.24 PUT 05.07.24 BP 4700,00 CME			352	Anzahl 33200			USD 0,150	4.647,26	0,00
FUT MINI S+P W1 09.24 PUT 05.07.24 BP 4750,00 CME			352	Anzahl -132800			USD 0,150	-18.589,03	0,00
FUT MINI S+P W1 09.24 PUT 05.07.24 BP 4800,00 CME			352	Anzahl 33200			USD 0,200	6.196,34	0,00
FUT MINI S+P W1 09.24 PUT 05.07.24 BP 4830,00 CME			352	Anzahl -33200			USD 0,200	-6.196,34	0,00
FUT MINI S+P W1 09.24 PUT 05.07.24 BP 4880,00 CME			352	Anzahl -66400			USD 0,250	-15.490,85	0,00
FUT MINI S+P W1 09.24 PUT 05.07.24 BP 4900,00 CME			352	Anzahl 33200			USD 0,250	7.745,43	0,00
FUT MINI S+P W1 09.24 PUT 05.07.24 BP 4950,00 CME			352	Anzahl -66400			USD 0,250	-15.490,85	0,00

# Jahresbericht

## Aquantum Active Range

### 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
FUT MINI S+P W1 09.24 PUT 05.07.24 BP 4960,00 CME			352	Anzahl -33200			USD 0,300	-9.294,51	0,00
FUT MINI S+P W1 09.24 PUT 05.07.24 BP 4980,00 CME			352	Anzahl -99600			USD 0,300	-27.883,54	0,00
FUT MINI S+P W1 09.24 PUT 05.07.24 BP 5000,00 CME			352	Anzahl 49800			USD 0,300	13.941,77	0,00
FUT MINI S+P W1 09.24 PUT 05.07.24 BP 5020,00 CME			352	Anzahl -66400			USD 0,300	-18.589,03	0,00
FUT MINI S+P W1 09.24 PUT 05.07.24 BP 5030,00 CME			352	Anzahl -33200			USD 0,300	-9.294,51	0,00
FUT MINI S+P W1 09.24 PUT 05.07.24 BP 5050,00 CME			352	Anzahl -49800			USD 0,300	-13.941,77	0,00
FUT MINI S+P W1 09.24 PUT 05.07.24 BP 5070,00 CME			352	Anzahl -66400			USD 0,300	-18.589,03	0,00
FUT MINI S+P W1 09.24 PUT 05.07.24 BP 5080,00 CME			352	Anzahl -166000			USD 0,300	-46.472,56	-0,01
FUT MINI S+P W1 09.24 PUT 05.07.24 BP 5090,00 CME			352	Anzahl -33200			USD 0,300	-9.294,51	0,00
FUT MINI S+P W1 09.24 PUT 05.07.24 BP 5130,00 CME			352	Anzahl -66400			USD 0,300	-18.589,03	0,00
FUT MINI S+P W1 09.24 PUT 05.07.24 BP 5150,00 CME			352	Anzahl -49800			USD 0,300	-13.941,77	0,00
FUT MINI S+P W1 09.24 PUT 05.07.24 BP 5160,00 CME			352	Anzahl -33200			USD 0,300	-9.294,51	0,00
FUT MINI S+P W1 09.24 PUT 05.07.24 BP 5180,00 CME			352	Anzahl 16600			USD 0,350	5.421,80	0,00
FUT MINI S+P W1 09.24 PUT 05.07.24 BP 5200,00 CME			352	Anzahl -33200			USD 0,350	-10.843,60	0,00
FUT MINI S+P W1 09.24 PUT 05.07.24 BP 5210,00 CME			352	Anzahl 24900			USD 0,350	8.132,70	0,00
FUT MINI S+P W1 09.24 PUT 05.07.24 BP 5230,00 CME			352	Anzahl 16600			USD 0,400	6.196,34	0,00
FUT MINI S+P W1 09.24 PUT 05.07.24 BP 5250,00 CME			352	Anzahl 33200			USD 0,450	13.941,77	0,00
FUT MINI S+P W1 09.24 PUT 05.07.24 BP 5280,00 CME			352	Anzahl 41500			USD 0,550	21.299,93	0,00
FUT MINI S+P W1 09.24 PUT 05.07.24 BP 5300,00 CME			352	Anzahl 16600			USD 0,600	9.294,51	0,00
FUT MINI S+P W1 09.24 PUT 05.07.24 BP 5310,00 CME			352	Anzahl 24900			USD 0,650	15.103,58	0,00
FUT MINI S+P W1 09.24 PUT 05.07.24 BP 5330,00 CME			352	Anzahl 16600			USD 0,800	12.392,68	0,00
FUT MINI S+P W1 09.24 PUT 05.07.24 BP 5340,00 CME			352	Anzahl 16600			USD 0,900	13.941,77	0,00
FUT MINI S+P W1 09.24 PUT 05.07.24 BP 5350,00 CME			352	Anzahl 16600			USD 1,000	15.490,85	0,00
FUT MINI S+P W1 09.24 PUT 05.07.24 BP 5380,00 CME			352	Anzahl 24900			USD 1,550	36.016,24	0,01
FUT MINI S+P W1 09.24 PUT 05.07.24 BP 5400,00 CME			352	Anzahl 16600			USD 2,300	35.628,97	0,01
FUT MINI S+P W1 09.24 PUT 05.07.24 BP 5440,00 CME			352	Anzahl 16600			USD 5,250	81.326,99	0,01
<b>Devisen-Derivate</b>							<b>EUR</b>	<b>68.499,53</b>	<b>0,01</b>
Forderungen/Verbindlichkeiten									
<b>Währungsterminkontrakte</b>							<b>EUR</b>	<b>68.499,53</b>	<b>0,01</b>
FUTURE CROSS RATE EUR/CHF 16.09.24 CME			352	CHF -21.000.000			CHF 0,958	-6.505,14	0,00
FUTURE CROSS RATE EUR/USD 16.09.24 CME			352	USD 37.750.000			USD 1,076	75.004,67	0,01

# Jahresbericht

## Aquantum Active Range

### 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
<b>Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds</b>							<b>EUR</b>	<b>157.245.603,10</b>	<b>26,52</b>
<b>Bankguthaben</b>							<b>EUR</b>	<b>157.245.603,10</b>	<b>26,52</b>
<b>EUR - Guthaben bei:</b>									
Bayerische Landesbank München (V)			EUR	50.000.000,00			% 100,000	50.000.000,00	8,43
BNP Paribas S.A., Niederlassung Deutschland			EUR	75.569.971,30			% 100,000	75.569.971,30	12,75
Unicredit Bank AG, München			EUR	121.877,21				121.877,21	0,02
DZ Bank AG Frankfurt (V)			EUR	23.000.000,00			% 100,000	23.000.000,00	3,88
Landesbank Baden-Württemberg (GD) Stuttgart (V)			EUR	6.000.000,00			% 100,000	6.000.000,00	1,01
Landesbank Hessen-Thüringen Girozentrale Frankfurt (V)			EUR	2.000.000,00			% 100,000	2.000.000,00	0,34
<b>Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen bei:</b>									
BNP Paribas S.A., Niederlassung Deutschland			CHF	481.178,72			% 100,000	499.822,08	0,08
BNP Paribas S.A., Niederlassung Deutschland			USD	57.794,08			% 100,000	53.932,51	0,01
<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>							<b>EUR</b>	<b>401.018.079,21</b>	<b>67,63</b>
Zinsansprüche			EUR	622.748,01				622.748,01	0,11
Einschüsse (Initial Margins)			EUR	292.515.820,86			% 100,000	292.515.820,86	49,33
Variation Margin			EUR	107.879.510,34				107.879.510,34	18,19

# Jahresbericht

## Aquantum Active Range

### 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
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>							<b>EUR</b>	<b>-5.731.118,39</b>	<b>-0,97</b>
Verwaltungsvergütung			EUR	-262.407,08				-262.407,08	-0,04
Performance Fee			EUR	-4.443.187,68				-4.443.187,68	-0,75
Verwahrstellenvergütung			EUR	-26.427,09				-26.427,09	0,00
Lagerstellenkosten			EUR	-3.490,66				-3.490,66	0,00
Prüfungskosten			EUR	-9.972,22				-9.972,22	0,00
Veröffentlichungskosten			EUR	-494,44				-494,44	0,00
Portfoliomanagervergütung			EUR	-920.325,39				-920.325,39	-0,16
Variation Margin			EUR	-64.813,83				-64.813,83	-0,01
<b>Fondsvermögen</b>							<b>EUR</b>	<b>592.930.202,10</b>	<b>100,00 1)</b>
<b>Aquantum Active Range S</b>									
Anteilwert							EUR	126,90	
Ausgabepreis							EUR	126,90	
Rücknahmepreis							EUR	126,90	
Anzahl Anteile							STK	2.430.000	
<b>Aquantum Active Range I</b>									
Anteilwert							EUR	125,36	
Ausgabepreis							EUR	125,36	
Rücknahmepreis							EUR	125,36	
Anzahl Anteile							STK	905.443	
<b>Aquantum Active Range R</b>									
Anteilwert							EUR	123,22	
Ausgabepreis							EUR	126,30	
Rücknahmepreis							EUR	123,22	
Anzahl Anteile							STK	357.825	

# Jahresbericht

## Aquantum Active Range

### 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
<b>Aquantum Active Range S - CHF</b>									
Anteilwert							CHF	101,30	
Ausgabepreis							CHF	101,30	
Rücknahmepreis							CHF	101,30	
Anzahl Anteile							STK	202.068	
<b>Aquantum Active Range X</b>									
Anteilwert							EUR	101,37	
Ausgabepreis							EUR	101,37	
Rücknahmepreis							EUR	101,37	
Anzahl Anteile							STK	1.042.724	

#### 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

## Aquantum Active Range

### Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

### Devisenkurse (in Mengennotiz)

		per 28.06.2024	
CHF	(CHF)	0,9627000	= 1 EUR (EUR)
USD	(USD)	1,0716000	= 1 EUR (EUR)

### Marktschlüssel

#### Terminbörsen

352 Chicago - CME Globex

**Jahresbericht**  
**Aquantum Active Range**

**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**

**Währungsterminkontrakte**

Verkaufte Kontrakte:

(Basiswert(e): CROSS RATE EO/SF)

EUR

37.345,09

## Jahresbericht Aquantum Active Range

### 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 Aktienindex-Derivate

##### Optionsrechte auf Aktienindex-Terminkontrakte

Gekaufte Verkaufsoptionen (Put):

(Basiswert(e): FUTURE E-MIN S+P 500 EOM 03.24 CME, FUTURE E-MIN S+P 500 EOM 09.23 CME, FUTURE E-MIN S+P 500 EOM 12.23 CME, FUTURE E-MIN S+P 500 EOM 20.09.24 CME, FUTURE E-MIN S+P 500 EOM 21.06.24 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP W1 03.24 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP W1 09.23 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP W1 12.23 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP W1 20.09.24 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP W1 21.06.24 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP W2 03.24 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP W2 09.23 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP W2 12.23 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP W2 20.09.24 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP W2 21.06.24 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP Week3 03.24 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP Week3 09.23 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP Week3 12.23 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP Week3 21.06.24 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP Week4 03.24 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP Week4 09.23 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP Week4 12.23 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP Week4 20.09.24 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP Week4 21.06.24 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 INDEX 09.23 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 INDEX 12.23 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 INDEX 15.03.24 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 INDEX 21.06.24 CME, FUTURE FU.EMI SP W WE 15.03.24 CME, )

EUR

317.111,86

## Jahresbericht Aquantum Active Range

### 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 E-MIN S+P 500 EOM 03.24 CME, FUTURE E-MIN S+P 500 EOM 09.23 CME, FUTURE E-MIN S+P 500 EOM 12.23 CME, FUTURE E-MIN S+P 500 EOM 20.09.24 CME, FUTURE E-MIN S+P 500 EOM 21.06.24 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP W1 03.24 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP W1 09.23 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP W1 12.23 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP W1 20.09.24 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP W1 21.06.24 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP W2 03.24 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP W2 09.23 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP W2 12.23 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP W2 20.09.24 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP W2 21.06.24 CME, , FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP Week3 03.24 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP Week3 09.23 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP Week3 12.23 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP Week3 20.09.24 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP Week3 21.06.24 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP Week4 03.24 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP Week4 09.23 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP Week4 12.23 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP Week4 20.09.24 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP Week4 21.06.24 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 INDEX 09.23 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 INDEX 12.23 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 INDEX 15.03.24 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 INDEX 21.06.24 CME, )		EUR			241.143,86

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.

# Jahresbericht

## Aquantum Active Range S

### Ertrags- und Aufwandsrechnung (inkl. Ertragsausgleich) für den Zeitraum vom 01.07.2023 bis zum 30.06.2024

			insgesamt	je Anteil
<b>I. Erträge</b>				
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		0,00	0,00
4. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer)	EUR		0,00	0,00
5. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland	EUR		8.480.228,42	3,49
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		0,00	0,00
11. Sonstige Erträge	EUR		0,00	0,00
<b>Summe der Erträge</b>	<b>EUR</b>		<b>8.480.228,42</b>	<b>3,49</b>
<b>II. Aufwendungen</b>				
1. Zinsen aus Kreditaufnahmen	EUR		0,00	0,00
2. <b>Verwaltungsvergütung</b>	EUR		-4.685.706,48	-1,93
- Verwaltungsvergütung	EUR	-275.524,23		
- Beratungsvergütung	EUR	0,00		
- Asset Management Gebühr	EUR	-4.410.182,25		
3. Verwahrstellenvergütung	EUR		-576.560,30	-0,24
4. Prüfungs- und Veröffentlichungskosten	EUR		-5.808,51	0,00
5. <b>Sonstige Aufwendungen</b>	EUR		-957.559,35	-0,39
- Depotgebühren	EUR	74,18		
- Ausgleich ordentlicher Aufwand	EUR	-560.609,54		
- Sonstige Kosten	EUR	-397.023,99		
<b>Summe der Aufwendungen</b>	<b>EUR</b>		<b>-6.225.634,65</b>	<b>-2,56</b>
<b>III. Ordentlicher Nettoertrag</b>	<b>EUR</b>		<b>2.254.593,77</b>	<b>0,93</b>

# Jahresbericht

## Aquantum Active Range S

### IV. Veräußerungsgeschäfte

1. Realisierte Gewinne	EUR	179.993.167,80	74,07
2. Realisierte Verluste	EUR	-161.318.359,01	-66,39

### Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften

**V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres** EUR **20.929.402,56** **8,61**

1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne	EUR	3.387.939,04	1,39
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste	EUR	-2.491.498,41	-1,03

### VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres

EUR **896.440,63** **0,36**

**VII. Ergebnis des Geschäftsjahres** EUR **21.825.843,19** **8,97**

## Entwicklung des Sondervermögens

**2023/2024**

<b>I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres</b>	EUR		<b>209.928.939,12</b>
1. Ausschüttung für das Vorjahr/Steuerabschlag für das Vorjahr	EUR		0,00
2. Zwischenausschüttungen	EUR		0,00
3. Mittelzufluss/-abfluss (netto)	EUR		79.379.665,79
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	EUR	162.917.185,32	
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	EUR	-83.537.519,53	
4. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich	EUR		-2.772.086,04
5. Ergebnis des Geschäftsjahres	EUR		21.825.843,19
davon nicht realisierte Gewinne	EUR	3.387.939,04	
davon nicht realisierte Verluste	EUR	-2.491.498,41	
<b>II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres</b>	EUR		<b>308.362.362,06</b>

## Verwendung der Erträge des Sondervermögens

### Berechnung der Wiederanlage insgesamt und je Anteil

			insgesamt	je Anteil
<b>I. Für die Wiederanlage verfügbar</b>				
1. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	EUR		20.929.402,56	8,61
2. Zuführung aus dem Sondervermögen	EUR		0,00	0,00
3. Steuerabschlag für das Geschäftsjahr	EUR		0,00	0,00
<b>II. Wiederanlage</b>	EUR		<b>20.929.402,56</b>	<b>8,61</b>

# Jahresbericht

## Aquantum Active Range S

### Vergleichende Übersicht seit Auflegung

Geschäftsjahr	Umlaufende Anteile am Ende des Geschäftsjahres		Fondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres		Anteilwert am Ende des Geschäftsjahres	
2021/2022 *)	Stück	1.151.151	EUR	131.196.751,61	EUR	113,97
2022/2023	Stück	1.783.019	EUR	209.928.939,12	EUR	117,74
2023/2024	Stück	2.430.000	EUR	308.362.362,06	EUR	126,90

\*) Auflegedatum 01.07.2021

# Jahresbericht

## Aquantum Active Range I

### Ertrags- und Aufwandsrechnung (inkl. Ertragsausgleich) für den Zeitraum vom 01.07.2023 bis zum 30.06.2024

			insgesamt	je Anteil
<b>I. Erträge</b>				
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		0,00	0,00
4. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer)	EUR		0,00	0,00
5. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland	EUR		2.924.849,50	3,23
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		0,00	0,00
11. Sonstige Erträge	EUR		0,00	0,00
<b>Summe der Erträge</b>	<b>EUR</b>		<b>2.924.849,50</b>	<b>3,23</b>
<b>II. Aufwendungen</b>				
1. Zinsen aus Kreditaufnahmen	EUR		0,00	0,00
2. <b>Verwaltungsvergütung</b>	EUR		-1.582.704,96	-1,75
- Verwaltungsvergütung	EUR	-76.228,98		
- Beratungsvergütung	EUR	0,00		
- Asset Management Gebühr	EUR	-1.506.475,98		
3. Verwahrstellenvergütung	EUR		-157.421,19	-0,17
4. Prüfungs- und Veröffentlichungskosten	EUR		-1.556,18	0,00
5. <b>Sonstige Aufwendungen</b>	EUR		-871.146,78	-0,96
- Depotgebühren	EUR	658,81		
- Ausgleich ordentlicher Aufwand	EUR	-759.174,62		
- Sonstige Kosten	EUR	-112.630,97		
<b>Summe der Aufwendungen</b>	<b>EUR</b>		<b>-2.612.829,11</b>	<b>-2,88</b>
<b>III. Ordentlicher Nettoertrag</b>	<b>EUR</b>		<b>312.020,40</b>	<b>0,35</b>

# Jahresbericht

## Aquantum Active Range I

### IV. Veräußerungsgeschäfte

1. Realisierte Gewinne	EUR	66.434.805,88	73,37
2. Realisierte Verluste	EUR	-59.528.811,87	-65,75

### Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften

EUR 6.905.994,00 7,62

### V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres

EUR 7.218.014,40 7,97

1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne	EUR	1.327.928,37	1,47
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste	EUR	-939.745,23	-1,04

### VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres

EUR 388.183,14 0,43

### VII. Ergebnis des Geschäftsjahres

EUR 7.606.197,54 8,40

## Entwicklung des Sondervermögens

2023/2024

I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres	EUR		60.989.057,56
1. Ausschüttung für das Vorjahr/Steuerabschlag für das Vorjahr	EUR		0,00
2. Zwischenausschüttungen	EUR		0,00
3. Mittelzufluss/-abfluss (netto)	EUR		48.012.162,61
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	EUR	71.388.966,63	
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	EUR	-23.376.804,02	
4. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich	EUR		-3.096.602,83
5. Ergebnis des Geschäftsjahres	EUR		7.606.197,54
davon nicht realisierte Gewinne	EUR	1.327.928,37	
davon nicht realisierte Verluste	EUR	-939.745,23	
II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres	EUR		113.510.814,88

## Verwendung der Erträge des Sondervermögens

### Berechnung der Wiederanlage insgesamt und je Anteil

		insgesamt	je Anteil
I. Für die Wiederanlage verfügbar			
1. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	EUR	7.218.014,40	7,96
2. Zuführung aus dem Sondervermögen	EUR	0,00	0,00
3. Steuerabschlag für das Geschäftsjahr	EUR	0,00	0,00
II. Wiederanlage	EUR	7.218.014,40	7,96

# Jahresbericht Aquantum Active Range I

## Vergleichende Übersicht seit Auflegung

Geschäftsjahr	Umlaufende Anteile am Ende des Geschäftsjahres		Fondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres		Anteilwert am Ende des Geschäftsjahres	
2021/2022 *)	Stück	185.639	EUR	21.100.674,20	EUR	113,67
2022/2023	Stück	521.939	EUR	60.989.057,56	EUR	116,85
2023/2024	Stück	905.443	EUR	113.510.814,88	EUR	125,36

\*) Auflegedatum 01.07.2021

# Jahresbericht

## Aquantum Active Range R

### Ertrags- und Aufwandsrechnung (inkl. Ertragsausgleich) für den Zeitraum vom 01.07.2023 bis zum 30.06.2024

			insgesamt	je Anteil
<b>I. Erträge</b>				
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		0,00	0,00
4. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer)	EUR		0,00	0,00
5. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland	EUR		1.206.930,07	3,37
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		0,00	0,00
11. Sonstige Erträge	EUR		0,00	0,00
<b>Summe der Erträge</b>	<b>EUR</b>		<b>1.206.930,07</b>	<b>3,37</b>
<b>II. Aufwendungen</b>				
1. Zinsen aus Kreditaufnahmen	EUR		0,00	0,00
2. <b>Verwaltungsvergütung</b>	EUR		-915.000,28	-2,55
- Verwaltungsvergütung	EUR	-37.626,39		
- Beratungsvergütung	EUR	0,00		
- Asset Management Gebühr	EUR	-877.373,89		
3. Verwahrstellenvergütung	EUR		-81.293,83	-0,23
4. Prüfungs- und Veröffentlichungskosten	EUR		-809,06	0,00
5. <b>Sonstige Aufwendungen</b>	EUR		-235.052,01	-0,66
- Depotgebühren	EUR	9,69		
- Ausgleich ordentlicher Aufwand	EUR	-178.594,49		
- Sonstige Kosten	EUR	-56.467,21		
<b>Summe der Aufwendungen</b>	<b>EUR</b>		<b>-1.232.155,18</b>	<b>-3,44</b>
<b>III. Ordentliches Nettoergebnis</b>	<b>EUR</b>		<b>-25.225,10</b>	<b>-0,07</b>

## Jahresbericht

### Aquantum Active Range R

#### IV. Veräußerungsgeschäfte

1. Realisierte Gewinne	EUR	25.908.493,33	72,41
2. Realisierte Verluste	EUR	-23.216.776,75	-64,88

#### Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften

<b>V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>	<b>EUR</b>	<b>2.691.716,59</b>	<b>7,53</b>
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne	EUR	263.848,54	0,74
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste	EUR	-100.188,65	-0,28

#### VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres

<b>VII. Ergebnis des Geschäftsjahres</b>	<b>EUR</b>	<b>163.659,89</b>	<b>0,46</b>
	<b>EUR</b>	<b>2.830.151,37</b>	<b>7,92</b>

## Entwicklung des Sondervermögens

2023/2024

<b>I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres</b>	<b>EUR</b>	<b>31.781.122,92</b>
1. Ausschüttung für das Vorjahr/Steuerabschlag für das Vorjahr	EUR	0,00
2. Zwischenausschüttungen	EUR	0,00
3. Mittelzufluss/-abfluss (netto)	EUR	10.158.649,99
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	EUR	21.442.935,77
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	EUR	-11.284.285,78
4. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich	EUR	-679.332,07
5. Ergebnis des Geschäftsjahres	EUR	2.830.151,37
davon nicht realisierte Gewinne	EUR	263.848,54
davon nicht realisierte Verluste	EUR	-100.188,65
<b>II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres</b>	<b>EUR</b>	<b>44.090.592,21</b>

## Verwendung der Erträge des Sondervermögens

### Berechnung der Wiederanlage insgesamt und je Anteil

		insgesamt	je Anteil
<b>I. Für die Wiederanlage verfügbar</b>			
1. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	EUR	2.666.491,48	7,46
2. Zuführung aus dem Sondervermögen	EUR	0,00	0,00
3. Steuerabschlag für das Geschäftsjahr	EUR	0,00	0,00
<b>II. Wiederanlage</b>	<b>EUR</b>	<b>2.666.491,48</b>	<b>7,46</b>

# Jahresbericht

## Aquantum Active Range R

### Vergleichende Übersicht seit Auflegung

Geschäftsjahr	Umlaufende Anteile am Ende des Geschäftsjahres		Fondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres		Anteilwert am Ende des Geschäftsjahres
2021/2022 *)	Stück	85.737	EUR	9.689.864,90	EUR 113,02
2022/2023	Stück	275.848	EUR	31.781.122,92	EUR 115,21
2023/2024	Stück	357.825	EUR	44.090.592,21	EUR 123,22

\*) Auflegedatum 09.07.2021

# Jahresbericht

## Aquantum Active Range S - CHF

### Ertrags- und Aufwandsrechnung (inkl. Ertragsausgleich) für den Zeitraum vom 01.03.2024 bis zum 30.06.2024

			insgesamt	je Anteil	insgesamt	je Anteil
<b>I. Erträge</b>						
1. Dividenden inländischer Aussteller (vor Körperschaft-/Kapitalertragsteuer)	CHF		0,00	0,00 EUR	0,00	0,00
2. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer)	CHF		0,00	0,00 EUR	0,00	0,00
3. Zinsen aus inländischen Wertpapieren	CHF		0,00	0,00 EUR	0,00	0,00
4. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer)	CHF		0,00	0,00 EUR	0,00	0,00
5. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland	CHF		190.666,66	0,94 EUR	198.054,08	0,98
6. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Ausland (vor Quellensteuer)	CHF		0,00	0,00 EUR	0,00	0,00
7. Erträge aus Investmentanteilen	CHF		0,00	0,00 EUR	0,00	0,00
8. Erträge aus Wertpapier- Darlehen- und -Pensionsgeschäften	CHF		0,00	0,00 EUR	0,00	0,00
9. Abzug inländischer Körperschaft-/Kapitalertragsteuer	CHF		0,00	0,00 EUR	0,00	0,00
10. Abzug ausländischer Quellensteuer	CHF		0,00	0,00 EUR	0,00	0,00
11. Sonstige Erträge	CHF		0,00	0,00 EUR	0,00	0,00
<b>Summe der Erträge</b>	<b>CHF</b>		<b>190.666,66</b>	<b>0,94 EUR</b>	<b>198.054,08</b>	<b>0,98</b>
<b>II. Aufwendungen</b>						
1. Zinsen aus Kreditaufnahmen	CHF		0,00	0,00 EUR	0,00	0,00
2. Verwaltungsvergütung	CHF		-71.007,01	-0,35 EUR	-73.758,19	-0,36
- Verwaltungsvergütung	CHF	-6.249,83 EUR		-6.491,98		
- Beratungsvergütung	CHF	0,00 EUR		0,00		
- Asset Management Gebühr	CHF	-64.757,18 EUR		-67.266,21		
3. Verwahrstellenvergütung	CHF		-8.134,50	-0,04 EUR	-8.449,67	-0,04
4. Prüfungs- und Veröffentlichungskosten	CHF		-57,60	0,00 EUR	-59,83	0,00
5. Sonstige Aufwendungen	CHF		-16.850,05	-0,08 EUR	-17.502,91	-0,08
- Depotgebühren	CHF	453,67 EUR		471,24		
- Ausgleich ordentlicher Aufwand	CHF	-6.558,97 EUR		-6.813,10		
- Sonstige Kosten	CHF	-10.744,75 EUR		-11.161,06		
- davon Kosten Clearingbroker	CHF	-9.841,52 EUR		-10.222,83		
<b>Summe der Aufwendungen</b>	<b>CHF</b>		<b>-96.049,15</b>	<b>-0,47 EUR</b>	<b>-99.770,59</b>	<b>-0,49</b>
<b>III. Ordentlicher Nettoertrag</b>	<b>CHF</b>		<b>94.617,51</b>	<b>0,47 EUR</b>	<b>98.283,48</b>	<b>0,49</b>

## Jahresbericht

### Aquantum Active Range S - CHF

#### IV. Veräußerungsgeschäfte

1. Realisierte Gewinne	CHF	3.796.755,03	18,79 EUR	3.943.861,05	19,52
2. Realisierte Verluste	CHF	-3.766.116,95	-18,64 EUR	-3.912.035,89	-19,36

#### Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften

**V. Realisiertes Ergebnis des Rumpfgeschäftsjahres** CHF **30.638,09** **0,15 EUR** **31.825,16** **0,16**

1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne	CHF	830.295,48	4,11 EUR	862.465,44	4,27
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste	CHF	-722.031,09	-3,57 EUR	-750.006,33	-3,71

#### VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Rumpfgeschäftsjahres

**VII. Ergebnis des Rumpfgeschäftsjahres** CHF **108.264,39** **0,54 EUR** **112.459,11** **0,56**

## Entwicklung des Sondervermögens

		2024		2024	
<b>I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Rumpfgeschäftsjahres</b>	CHF		<b>0,00</b>	EUR	<b>0,00</b>
1. Ausschüttung für das Vorjahr/Steuerabschlag für das Vorjahr	CHF		0,00	EUR	0,00
2. Zwischenausschüttungen	CHF		0,00	EUR	0,00
3. Mittelzufluss/-abfluss (netto)	CHF		20.241.723,45	EUR	21.025.992,98
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	CHF	20.278.170,85 EUR	21.063.852,54		
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	CHF	-36.447,40 EUR	-37.859,56		
4. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich	CHF		-5.659,47	EUR	-5.878,75
5. Ergebnis des Rumpfgeschäftsjahres	CHF		233.519,99	EUR	242.567,76
davon nicht realisierte Gewinne	CHF	830.295,48 EUR	862.465,44		
davon nicht realisierte Verluste	CHF	-722.031,09 EUR	-750.006,33		
<b>II. Wert des Sondervermögens am Ende des Rumpfgeschäftsjahres</b>	CHF		<b>20.469.583,96</b>	EUR	<b>21.262.682,00</b>

## Verwendung der Erträge des Sondervermögens

### Berechnung der Wiederanlage insgesamt und je Anteil

		insgesamt	je Anteil	insgesamt	je Anteil
<b>I. Für die Wiederanlage verfügbar</b>					
1. Realisiertes Ergebnis des Rumpfgeschäftsjahres	CHF	125.255,60	0,62 EUR	130.108,65	0,64
2. Zuführung aus dem Sondervermögen	CHF	0,00	0,00 EUR	0,00	0,00
3. Steuerabschlag für das Rumpfgeschäftsjahr	CHF	0,00	0,00 EUR	0,00	0,00
<b>II. Wiederanlage</b>	CHF	<b>125.255,60</b>	<b>0,62 EUR</b>	<b>130.108,65</b>	<b>0,64</b>

# Jahresbericht

## Aquantum Active Range S - CHF

### Vergleichende Übersicht seit Auflegung

Rumpfgeschäftsjahr	Umlaufende Anteile am Ende des Rumpfgeschäftsjahres		Fondsvermögen am Ende des Rumpfgeschäftsjahres		Anteilwert am Ende des Rumpfgeschäftsjahres	
2024 *)	Stück	202.068	CHF	20.469.583,96	CHF	101,30

\*) Auflegedatum 01.03.2024

# Jahresbericht

## Aquantum Active Range X

### Ertrags- und Aufwandsrechnung (inkl. Ertragsausgleich) für den Zeitraum vom 05.03.2024 bis zum 30.06.2024

			insgesamt	je Anteil
<b>I. Erträge</b>				
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		0,00	0,00
4. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer)	EUR		0,00	0,00
5. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland	EUR		961.108,01	0,92
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		0,00	0,00
11. Sonstige Erträge	EUR		0,00	0,00
<b>Summe der Erträge</b>	<b>EUR</b>		<b>961.108,01</b>	<b>0,92</b>
<b>II. Aufwendungen</b>				
1. Zinsen aus Kreditaufnahmen	EUR		0,00	0,00
2. <b>Verwaltungsvergütung</b>	EUR		-261.436,33	-0,25
- Verwaltungsvergütung	EUR	-33.613,27		
- Beratungsvergütung	EUR	0,00		
- Asset Management Gebühr	EUR	-227.823,06		
3. Verwahrstellenvergütung	EUR		-43.764,29	-0,04
4. Prüfungs- und Veröffentlichungskosten	EUR		-304,17	0,00
5. <b>Sonstige Aufwendungen</b>	EUR		-43.192,58	-0,04
- Depotgebühren	EUR	2.442,42		
- Ausgleich ordentlicher Aufwand	EUR	8.155,93		
- Sonstige Kosten	EUR	-53.790,93		
- davon Kosten Clearingbroker	EUR	-53.561,46		
<b>Summe der Aufwendungen</b>	<b>EUR</b>		<b>-348.697,37</b>	<b>-0,33</b>
<b>III. Ordentlicher Nettoertrag</b>	<b>EUR</b>		<b>612.410,64</b>	<b>0,59</b>

## Jahresbericht Aquantum Active Range X

### IV. Veräußerungsgeschäfte

1. Realisierte Gewinne	EUR	19.433.984,79	18,64
2. Realisierte Verluste	EUR	-18.395.097,86	-17,64

### Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften

**EUR 1.038.886,93 1,00**

### V. Realisiertes Ergebnis des Rumpfgeschäftsjahres

1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne	EUR	3.823.873,45	3,67
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste	EUR	-4.054.497,97	-3,89

### VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Rumpfgeschäftsjahres

**EUR -230.624,52 -0,22**

### VII. Ergebnis des Rumpfgeschäftsjahres

**EUR 1.420.673,06 1,37**

## Entwicklung des Sondervermögens

**2024**

<b>I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Rumpfgeschäftsjahres</b>	EUR		<b>0,00</b>
1. Ausschüttung für das Vorjahr/Steuerabschlag für das Vorjahr	EUR		0,00
2. Zwischenausschüttungen	EUR		0,00
3. Mittelzufluss/-abfluss (netto)	EUR		104.249.429,98
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	EUR	108.589.501,58	
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	EUR	-4.340.071,60	
4. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich	EUR		33.647,94
5. Ergebnis des Rumpfgeschäftsjahres	EUR		1.420.673,06
davon nicht realisierte Gewinne	EUR	3.823.873,45	
davon nicht realisierte Verluste	EUR	-4.054.497,97	
<b>II. Wert des Sondervermögens am Ende des Rumpfgeschäftsjahres</b>	EUR		<b>105.703.750,97</b>

## Verwendung der Erträge des Sondervermögens

### Berechnung der Wiederanlage insgesamt und je Anteil

		insgesamt	je Anteil
<b>I. Für die Wiederanlage verfügbar</b>			
1. Realisiertes Ergebnis des Rumpfgeschäftsjahres	EUR	1.651.297,58	1,59
2. Zuführung aus dem Sondervermögen	EUR	0,00	0,00
3. Steuerabschlag für das Rumpfgeschäftsjahr	EUR	0,00	0,00
<b>II. Wiederanlage</b>	EUR	<b>1.651.297,58</b>	<b>1,59</b>

# Jahresbericht Aquantum Active Range X

## Vergleichende Übersicht seit Auflegung

Rumpfgeschäftsjahr	Umlaufende Anteile am Ende des Rumpfgeschäftsjahres		Fondsvermögen am Ende des Rumpfgeschäftsjahres		Anteilwert am Ende des Rumpfgeschäftsjahres	
2024 *)	Stück	1.042.724	EUR	105.703.750,97	EUR	101,37

\*) Auflegedatum 05.03.2024

# Jahresbericht

## Aquantum Active Range

### Ertrags- und Aufwandsrechnung (inkl. Ertragsausgleich) für den Zeitraum vom 01.07.2023 bis zum 30.06.2024

			insgesamt
<b>I. Erträge</b>			
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		0,00
4. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer)	EUR		0,00
5. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland	EUR		13.771.170,08
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		0,00
11. Sonstige Erträge	EUR		0,00
<b>Summe der Erträge</b>	<b>EUR</b>		<b>13.771.170,08</b>
<b>II. Aufwendungen</b>			
1. Zinsen aus Kreditaufnahmen	EUR		0,00
2. Verwaltungsvergütung	EUR		-7.518.606,23
- Verwaltungsvergütung	EUR	-429.484,85	
- Beratungsvergütung	EUR	0,00	
- Asset Management Gebühr	EUR	-7.089.121,39	
3. Verwahrstellenvergütung	EUR		-867.489,29
4. Prüfungs- und Veröffentlichungskosten	EUR		-8.537,75
5. Sonstige Aufwendungen	EUR		-2.124.453,63
- Depotgebühren	EUR	3.656,34	
- Ausgleich ordentlicher Aufwand	EUR	-1.497.035,81	
- Sonstige Kosten	EUR	-631.074,16	
<b>Summe der Aufwendungen</b>	<b>EUR</b>		<b>-10.519.086,90</b>
<b>III. Ordentlicher Nettoertrag</b>	<b>EUR</b>		<b>3.252.083,19</b>
<b>IV. Veräußerungsgeschäfte</b>			
1. Realisierte Gewinne	EUR		295.714.312,85
2. Realisierte Verluste	EUR		-266.371.081,37
<b>Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften</b>	<b>EUR</b>		<b>29.343.231,48</b>

## Jahresbericht Aquantum Active Range

<b>V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>	<b>EUR</b>	<b>32.595.314,67</b>
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne	EUR	9.666.054,84
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste	EUR	-8.335.936,59
<b>VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>	<b>EUR</b>	<b>1.330.118,25</b>
<b>VII. Ergebnis des Geschäftsjahres</b>	<b>EUR</b>	<b>33.925.432,93</b>

### Entwicklung des Sondervermögens

**2023/2024**

<b>I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres</b>	<b>EUR</b>	<b>302.699.119,60</b>
1. Ausschüttung für das Vorjahr/Steuerabschlag für das Vorjahr	EUR	0,00
2. Zwischenausschüttungen	EUR	0,00
3. Mittelzufluss/-abfluss (netto)	EUR	262.825.901,35
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	EUR	385.402.441,84
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	EUR	-122.576.540,49
4. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich	EUR	-6.520.251,75
5. Ergebnis des Geschäftsjahres	EUR	33.925.432,93
davon nicht realisierte Gewinne	EUR	9.666.054,84
davon nicht realisierte Verluste	EUR	-8.335.936,59
<b>II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres</b>	<b>EUR</b>	<b>592.930.202,13</b>

**Jahresbericht**  
**Aquantum Active Range**

**Anteilklassenmerkmale im Überblick**

<b>Anteilkategorie</b>	<b>Mindestanlagesumme in Währung</b>	<b>Ausgabeaufschlag derzeit (Angabe in %) *)</b>	<b>Verwaltungsvergütung derzeit (Angabe in % p.a.) *)</b>	<b>Ertragsverwendung</b>	<b>Währung</b>
<b>Aquantum Active Range S</b>	10.000.000	0,00	0,100	Thesaurierer	EUR
<b>Aquantum Active Range I</b>	500.000	0,00	0,100	Thesaurierer	EUR
<b>Aquantum Active Range R</b>	keine	2,50	0,100	Thesaurierer	EUR
<b>Aquantum Active Range S - CHF</b>	5.000.000	0,00	0,100	Thesaurierer	CHF
<b>Aquantum Active Range X</b>	100.000.000	0,00	0,100	Thesaurierer	EUR

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

# Jahresbericht

## Aquantum Active Range

### Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

#### Angaben nach der Derivateverordnung

das durch Derivate erzielte zugrundeliegende Exposure	EUR	1.083.243.257,31
Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)		0,00
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)		6,81

Bei der Ermittlung der Auslastung der Marktrisikoobergrenze für diesen Fonds wendet die Gesellschaft seit 01.07.2021 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	0,12 %
größter potenzieller Risikobetrag	1,59 %
durchschnittlicher potenzieller Risikobetrag	0,68 %

Im Geschäftsjahr erreichte durchschnittliche Hebelwirkung durch Derivategeschäfte: **1,66**

#### Zusammensetzung des Vergleichsvermögens zum Berichtsstichtag

Bloomberg Global Aggregate Total Return (USD) (ID: XFI000000510   BB: I03351US)	10,00 %
S&P 500 Price Return (USD) (ID: XFI000000406   BB: SPX) in EUR	80,00 %
VSTOXX Short-Term Futures Inverse Investable ER (EUR) (ID: XFI000003138   BB: VST1MISE)	10,00 %

# Jahresbericht

## Aquantum Active Range

### Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

#### Sonstige Angaben

##### Aquantum Active Range S

Anteilwert	EUR	126,90
Ausgabepreis	EUR	126,90
Rücknahmepreis	EUR	126,90
Anzahl Anteile	STK	2.430.000

##### Aquantum Active Range I

Anteilwert	EUR	125,36
Ausgabepreis	EUR	125,36
Rücknahmepreis	EUR	125,36
Anzahl Anteile	STK	905.443

##### Aquantum Active Range R

Anteilwert	EUR	123,22
Ausgabepreis	EUR	126,30
Rücknahmepreis	EUR	123,22
Anzahl Anteile	STK	357.825

##### Aquantum Active Range S - CHF

Anteilwert	CHF	101,30
Ausgabepreis	CHF	101,30
Rücknahmepreis	CHF	101,30
Anzahl Anteile	STK	202.068

##### Aquantum Active Range X

Anteilwert	EUR	101,37
Ausgabepreis	EUR	101,37
Rücknahmepreis	EUR	101,37
Anzahl Anteile	STK	1.042.724

# Jahresbericht

## Aquantum Active Range

### Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

#### 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.

#### Angaben zur Transparenz sowie zur Gesamtkostenquote

##### Gesamtkostenquote

###### Aquantum Active Range Seed (S)

Die Gesamtkostenquote (ohne Transaktionskosten) für das abgelaufene Geschäftsjahr beträgt 0,95 %

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

Erfolgsabhängige Vergütung in % des durchschnittlichen Nettoinventarwertes 1,10 %

###### Aquantum Active Range Institutional (I)

Die Gesamtkostenquote (ohne Transaktionskosten) für das abgelaufene Geschäftsjahr beträgt 1,39 %

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

Erfolgsabhängige Vergütung in % des durchschnittlichen Nettoinventarwertes 1,02 %

# Jahresbericht

## Aquantum Active Range

### Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

#### Aquantum Active Range Retail (R)

Die Gesamtkostenquote (ohne Transaktionskosten) für das abgelaufene Geschäftsjahr beträgt

1,81 %

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

Erfolgsabhängige Vergütung in % des durchschnittlichen Nettoinventarwertes

0,98 %

#### Aquantum Active Range S - CHF

Die Gesamtkostenquote (ohne Transaktionskosten) für das abgelaufene Geschäftsjahr beträgt

0,87 %

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

Erfolgsabhängige Vergütung in % des durchschnittlichen Nettoinventarwertes

0,51 %

#### Aquantum Active Range X

Die Gesamtkostenquote (ohne Transaktionskosten) für das abgelaufene Geschäftsjahr beträgt

0,76 %

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

Erfolgsabhängige Vergütung in % des durchschnittlichen Nettoinventarwertes

0,26 %

#### 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.

An die Verwaltungsgesellschaft oder Dritte gezahlte Pauschalvergütungen

EUR

0,00

# Jahresbericht

## Aquantum Active Range

### Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

#### Wesentliche sonstige Erträge und sonstige Aufwendungen

##### Aquantum Active Range S

Wesentliche sonstige Erträge: EUR 0,00

Wesentliche sonstige Aufwendungen: EUR 0,00

##### Aquantum Active Range I

Wesentliche sonstige Erträge: EUR 0,00

Wesentliche sonstige Aufwendungen: EUR 0,00

##### Aquantum Active Range R

Wesentliche sonstige Erträge: EUR 0,00

Wesentliche sonstige Aufwendungen: EUR 0,00

##### Aquantum Active Range S - CHF

Wesentliche sonstige Erträge: CHF 0,00

Wesentliche sonstige Aufwendungen: CHF 10.744,75  
- davon Kosten Clearingbroker CHF 9.841,52

# Jahresbericht

## Aquantum Active Range

### Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

#### Aquantum Active Range X

<b>Wesentliche sonstige Erträge:</b>	<b>EUR</b>	<b>0,00</b>
<b>Wesentliche sonstige Aufwendungen:</b>	<b>EUR</b>	<b>53.790,93</b>
- davon Kosten Clearingbroker	EUR	53.561,46

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

Transaktionskosten	EUR	2.723.179,01
--------------------	-----	--------------

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.

# Jahresbericht

## Aquantum Active Range

### Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

#### Angaben zur Mitarbeitervergütung

<b>Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr der KVG gezahlten Mitarbeitervergütung</b>	<b>in Mio. EUR</b>	<b>84,3</b>
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
<b>Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr der KVG gezahlten Vergütung an Risktaker</b>	<b>in Mio. EUR</b>	<b>4,8</b>
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.

# Jahresbericht

## Aquantum Active Range

### 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>.

Frankfurt am Main, den 1. Juli 2024

Universal-Investment-Gesellschaft mbH  
Die Geschäftsführung

# Jahresbericht

## Aquantum Active Range

### VERMERK DES UNABHÄNGIGEN ABSCHLUSSPRÜFERS

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

#### *Prüfungsurteil*

Wir haben den Jahresbericht des Sondervermögens Aquantum Active Range - bestehend aus dem Tätigkeitsbericht für das Geschäftsjahr vom 1. Juli 2023 bis zum 30. Juni 2024, der Vermögensübersicht und der Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2024, der Ertrags- und Aufwandsrechnung, der Verwendungsrechnung, der Entwicklungsrechnung für das Geschäftsjahr vom 1. Juli 2023 bis zum 30. Juni 2024, sowie der vergleichenden Übersicht über die letzten drei Geschäftsjahre, der Aufstellung der während des Berichtszeitraums abgeschlossenen Geschäfte, soweit diese nicht mehr Gegenstand der Vermögensaufstellung sind, und dem Anhang - geprüft.

Die im Abschnitt Sonstige Informationen unseres Vermerks genannten Bestandteile des Jahresberichts haben wir in Einklang mit den deutschen gesetzlichen Vorschriften bei der Bildung unseres Prüfungsurteils zum Jahresbericht nicht berücksichtigt.

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 ermöglicht es unter Beachtung dieser Vorschriften, sich ein umfassendes Bild der tatsächlichen Verhältnisse und Entwicklungen des Sondervermögens zu verschaffen. Unser Prüfungsurteil zum Jahresbericht erstreckt sich nicht auf den Inhalt der im Abschnitt Sonstige Informationen genannten Bestandteile des Jahresberichts.

#### *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.

#### *Sonstige Informationen*

Die gesetzlichen Vertreter sind für die sonstigen Informationen verantwortlich. Die sonstigen Informationen umfassen die folgenden Bestandteile des Jahresberichts:

- die im Jahresbericht enthaltenen und als nicht vom Prüfungsurteil zum Jahresbericht umfasst gekennzeichneten Angaben.

Unser Prüfungsurteil zum Jahresbericht erstreckt sich nicht auf die sonstigen Informationen, und dementsprechend geben wir in diesem Vermerk weder ein Prüfungsurteil noch irgendeine andere Form von Prüfungsschlussfolgerung hierzu ab.

Im Zusammenhang mit unserer Prüfung haben wir die Verantwortung, die oben genannten sonstigen Informationen zu lesen und dabei zu würdigen, ob die sonstigen Informationen

- wesentliche Unstimmigkeiten zu den vom Prüfungsurteil umfassten Bestandteilen des Jahresberichts oder zu unseren bei der Prüfung erlangten Kenntnissen aufweisen oder

## Jahresbericht Aquantum Active Range

- anderweitig wesentlich falsch dargestellt erscheinen.

### *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 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.

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.

## Jahresbericht Aquantum Active Range

- 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 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 16. Oktober 2024

Deloitte GmbH  
Wirtschaftsprüfungsgesellschaft

René Rumpelt  
Wirtschaftsprüfer

Abelardo Rodríguez González  
Wirtschaftsprüfer

## **Jahresbericht Aquantum Active Range**

### **Sonstige Information - nicht vom Prüfungsurteil zum Jahresbericht umfasst**

#### **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.

# Jahresbericht

## Aquantum Active Range

### Anteilklassen im Überblick

#### Erstausgabedatum

Anteilklasse S	1. Juli 2021
Anteilklasse I	1. Juli 2021
Anteilklasse R	9. Juli 2021
Anteilklasse S (CHF)	1. März 2024
Anteilklasse X	5. März 2024

#### Erstausgabepreise

Anteilklasse S, I, R und X	EUR 100
Anteilklasse S (CHF)	CHF 100

#### Ausgabeaufschlag

Anteilklasse S	keiner
Anteilklasse I	keiner
Anteilklasse R	derzeit 2,50 %
Anteilklasse S (CHF)	keiner
Anteilklasse X	keiner

#### Mindestanlagesumme

Anteilklasse S	EUR 10.000.000
Anteilklasse I	EUR 500.000
Anteilklasse R	keine
Anteilklasse S (CHF)	CHF 5.000.000
Anteilklasse X	EUR 100.000.000

#### Verwaltungsvergütung\*

alle Anteilklassen	derzeit 0,10 % p.a.
--------------------	---------------------

#### Verwahrstellenvergütung\*

alle Anteilklassen	derzeit 0,015 % p.a.
--------------------	----------------------

#### Asset Management-Vergütung

Anteilklasse S	derzeit 0,50 % p.a.
Anteilklasse I	derzeit 0,95 % p.a.
Anteilklasse R	derzeit 1,35 % p.a.
Anteilklasse S (CHF)	derzeit 0,50 % p.a.
Anteilklasse X	derzeit 0,40 % p.a.

#### Erfolgsabhängige Vergütung

Anteilklasse S, I, R und X	15% der vom Fonds in der Abrechnungsperiode erwirtschafteten Rendite über dem Referenzwert (bisheriger Höchststand des Anteilwertes am Ende der fünf vorangegangenen Abrechnungsperioden und 50% der Wertentwicklung der €S
Anteilklasse S (CHF)	15% der vom Fonds in der Abrechnungsperiode erwirtschafteten Rendite über dem Referenzwert (bisheriger Höchststand des Anteilwertes am Ende der fünf vorangegangenen Abrechnungsperioden)

#### Währung

Anteilklasse S, I, R und X	Euro
Anteilklasse S (CHF)	Schweizer Franken

#### Ertragsverwendung

Anteilklasse S	Thesaurierung
Anteilklasse I	Thesaurierung
Anteilklasse R	Thesaurierung
Anteilklasse S (CHF)	Thesaurierung
Anteilklasse X	Thesaurierung

#### Wertpapier-Kennnummer / ISIN:

Anteilklasse S	A2QSF4 / DE000A2QSF49
Anteilklasse I	A2QSF6 / DE000A2QSF64
Anteilklasse R	A2QSF5 / DE000A2QSF56
Anteilklasse S (CHF)	A3E183 / DE000A3E1833
Anteilklasse X	A3E184 / DE000A3E1841

\*Unterliegt einer Staffelung

# Jahresbericht

## Aquantum Active Range

### 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](http://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 + 49 (0) 69 7193-0

Telefax + 49 (0) 69 7193-26 40

[www.bnpparibas.de](http://www.bnpparibas.de)

Rechtsform: Zweigniederlassung einer Aktiengesellschaft nach französischem Recht

Haftendes Eigenkapital: Mio. € 122.507 (Stand: 31.12.2021)

#### 3. Asset Management- und Vertriebsgesellschaft

Aquantum GmbH

##### Postanschrift:

Josephspitalstrasse 15

80331 München

Telefon: +49 893 837 744 0

[www.aquantumgroup.com](http://www.aquantumgroup.com)