



Halbjahresbericht

Lupus alpha Sustainable Return

zum 31.05.2024

Lupus alpha

Halbjahresbericht für Lupus alpha Sustainable Return

Vermögensübersicht zum 31.05.2024

Anlageschwerpunkte

Tagwert in EUR % Anteil am Fondsvermögen ¹⁾

Vermögensgegenstände

Aktien	14.522.522,55	68,82
Bundesrepublik Deutschland	580.744,00	2,76
Frankreich	661.280,00	3,14
Irland	648.661,29	3,06
Niederlande	589.179,20	2,79
Schweiz	260.534,19	1,23
USA	11.540.057,10	54,69
Kanada	242.066,77	1,15
Renten	4.283.162,56	20,30
Belgien	399.540,00	1,89
Bundesrepublik Deutschland	573.365,36	2,72
Frankreich	2.274.101,00	10,78
Schweden	550.771,20	2,61
Kanada	485.385,00	2,30
Devisentermingeschäfte	-63.379,42	-0,30
Optionen	452.086,59	2,14
Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds	2.014.377,34	9,55
Sonstige Vermögensgegenstände	59.656,66	0,28
Sonstige Verbindlichkeiten	-166.437,96	-0,79
Fondsvermögen	21.101.988,32	100,00

¹⁾ Durch Rundung der Prozent-Anteile bei der Berechnung können geringfügige Differenzen entstanden sein.

Halbjahresbericht für Lupus alpha Sustainable Return

Vermögensaufstellung zum 31.05.2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1000	Bestand 31.05.2024	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens ¹⁾	
Börsengehandelte Wertpapiere										
Aktien										
ADOBE INC.	US00724F1012		STK	500	100	0	USD	444,760	204.816,95	0,97
ADVANCED MIC.DEV. DL-,01	US0079031078		STK	2.200	2.200	0	USD	166,900	338.180,98	1,60
AIRBNB INC. DL-,01	US0090661010		STK	700	0	1.400	USD	144,930	93.438,64	0,44
ALPHABET INC.CL.A DL-,001	US02079K3059		STK	2.100	2.100	0	USD	172,500	333.640,34	1,58
AMERICAN TOWER DL -,01	US03027X1000		STK	1.000	1.000	0	USD	195,740	180.280,91	0,85
AMGEN INC. DL-,0001	US0311621009		STK	1.000	1.000	0	USD	305,850	281.694,68	1,33
ASML HOLDING EO -,09	NL0010273215		STK	400	0	200	EUR	870,800	348.320,00	1,65
AUTOM. DATA PROC. DL -,10	US0530151036		STK	500	500	0	USD	244,920	112.788,40	0,53
BLACKROCK CL. A DL -,01	US09247X1019		STK	400	400	0	USD	772,030	284.422,75	1,34
BOOKING HLDGS DL-,008	US09857L1089		STK	100	100	0	USD	3.776,350	347.810,27	1,65
BOSTON SCIENTIFIC DL-,01	US1011371077		STK	5.100	5.100	0	USD	75,570	354.968,45	1,68
BROADCOM INC. DL-,001	US11135F1012		STK	300	300	300	USD	1.328,550	367.087,27	1,74
CATERPILLAR INC. DL 1	US1491231015		STK	1.100	1.100	0	USD	338,520	342.962,93	1,62
CHUBB LTD. SF 24,15	CH0044328745		STK	500	500	0	USD	270,820	124.715,63	0,59
CISCO SYSTEMS DL-,001	US17275R1023		STK	5.800	5.800	0	USD	46,500	248.399,72	1,18
COMCAST CORP. A DL-,01	US20030N1019		STK	5.200	5.200	0	USD	40,030	191.716,33	0,91
COPART INC.	US2172041061		STK	4.000	4.000	0	USD	53,060	195.477,78	0,93
DANAHER CORP. DL-,01	US2358511028		STK	1.300	1.300	0	USD	256,800	307.474,10	1,46
DEERE CO. DL 1	US2441991054		STK	400	0	300	USD	374,760	138.064,93	0,65
EATON CORP.PLC DL -,01	IE00B8KQN827		STK	1.200	1.200	0	USD	332,850	367.874,74	1,74
ELI LILLY	US5324571083		STK	500	0	200	USD	820,340	377.775,73	1,79
ESSILORLUXO. INH. EO -,18	FR0000121667		STK	500	500	0	EUR	205,300	102.650,00	0,49
FASTENAL CO. DL-,01	US3119001044		STK	1.700	1.700	0	USD	65,980	103.307,39	0,49
FERRARI N.V.	NL0011585146		STK	300	300	0	EUR	377,400	113.220,00	0,54
GARMIN LTD NAM.SF 0,10	CH0114405324		STK	900	900	0	USD	163,850	135.818,56	0,64
GENERAL MOTORS DL-,01	US37045V1008		STK	4.200	4.200	0	USD	44,990	174.034,54	0,82
HERSHEY CO. DL 1	US4278661081		STK	700	700	0	USD	197,830	127.544,09	0,60
HOME DEPOT INC. DL-,05	US4370761029		STK	900	0	0	USD	334,870	277.580,47	1,32
ING GROEP NV EO -,01	NL0011821202		STK	7.800	0	15.400	EUR	16,364	127.639,20	0,60
INTEL CORP. DL-,001	US4581401001		STK	6.600	6.600	0	USD	30,850	187.529,36	0,89
INTUIT INC. DL-,01	US4612021034		STK	500	500	0	USD	576,440	265.457,06	1,26
LINDE PLC EO -,001	IE000S9YS762		STK	700	700	0	USD	435,520	280.786,55	1,33
LOWE'S COS INC. DL-,50	US5486611073		STK	1.300	1.300	0	USD	221,290	264.956,94	1,26
MARSH+MCLENNAN COS.INC.D1	US5717481023		STK	1.400	1.400	0	USD	207,580	267.660,14	1,27
MASTERCARD INC.A DL-,0001	US57636Q1040		STK	700	0	300	USD	447,070	288.233,02	1,37

¹⁾ Durch Rundung der Prozent-Anteile bei der Berechnung können geringfügige Differenzen entstanden sein.

Halbjahresbericht für Lupus alpha Sustainable Return Vermögensaufstellung zum 31.05.2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw.	Bestand	Käufe/	Verkäufe/	Kurs	Kurswert	% des	
			Anteile bzw.		Zugänge	Abgänge				Fondsver-
			Whg. in 1000	31.05.2024	im Berichtszeitraum		in EUR		mögens ¹⁾	
MCKESSON DL-,01	US58155Q1031		STK	400	400	0	USD	569,590	209.842,04	0,99
MONSTER BEVER.NEW DL-,005	US61174X1090		STK	5.200	5.200	0	USD	51,920	248.661,29	1,18
MORGAN STANLEY DL-,01	US6174464486		STK	2.500	2.500	0	USD	97,840	225.282,06	1,07
NETFLIX INC. DL-,001	US64110L1061		STK	600	600	0	USD	641,620	354.567,81	1,68
NVIDIA CORP. DL-,001	US67066G1040		STK	500	0	100	USD	1.096,330	504.872,21	2,39
PROGRESSIVE CORP. DL 1	US7433151039		STK	1.400	0	300	USD	211,180	272.302,10	1,29
PROLOGIS INC. DL-,01	US74340W1036		STK	2.300	2.300	0	USD	110,490	234.056,64	1,11
QUALCOMM INC. DL-,0001	US7475251036		STK	2.100	2.100	0	USD	204,050	394.662,68	1,87
S+P GLOBAL INC. DL 1	US78409V1044		STK	700	700	0	USD	427,510	275.622,38	1,31
SALESFORCE INC. DL-,001	US79466L3024		STK	1.100	1.100	0	USD	234,440	237.516,92	1,13
SAP SE O.N.	DE0007164600		STK	1.800	0	900	EUR	165,960	298.728,00	1,42
SCHNEIDER ELEC. INH. EO 4	FR0000121972		STK	1.500	1.500	0	EUR	227,450	341.175,00	1,62
SERVICENOW INC. DL-,001	US81762P1021		STK	400	400	0	USD	656,930	242.018,88	1,15
SIEMENS AG NA O.N.	DE0007236101		STK	1.600	0	300	EUR	176,260	282.016,00	1,34
STRYKER CORP. DL-,10	US8636671013		STK	1.000	1.000	0	USD	341,090	314.151,51	1,49
TARGET CORP. DL-,0833	US87612E1064		STK	800	800	0	USD	156,160	115.061,48	0,55
TEXAS INSTR. DL 1	US8825081040		STK	1.800	1.800	0	USD	195,010	323.295,42	1,53
TORONTO-DOMINION BK	CA8911605092		STK	4.700	4.700	0	USD	55,920	242.066,77	1,15
U.S. BANCORP DL-,01	US9029733048		STK	6.900	6.900	0	USD	40,550	257.697,44	1,22
VINCI S.A. INH. EO 2,50	FR0000125486		STK	1.900	0	700	EUR	114,450	217.455,00	1,03
VISA INC. CL. A DL -,0001	US92826C8394		STK	1.100	0	300	USD	272,460	276.035,92	1,31
WASTE MANAGEMENT	US94106L1098		STK	1.000	1.000	0	USD	210,730	194.087,04	0,92
ZOETIS INC. CL.A DL -,01	US98978V1035		STK	1.300	1.300	0	USD	169,560	203.019,11	0,96
Summe Aktien							EUR		14.522.522,55	68,82
Verzinsliche Wertpapiere										
1,7500 % BELFIUS BK 14/24 MTN	BE0002474493		EUR	400	400	0	%	99,885	399.540,00	1,89
0,3980 % BPCE SFH 15-25 MTN	FR0012695716		EUR	500	500	0	%	97,236	486.180,00	2,30
5,3750 % C.F.FINANC.LOC. 09/24 MTN	FR0010775486		EUR	500	500	0	%	100,134	500.670,00	2,37
0,5000 % CIE F.FONCIER 16/24 MTN	FR0013162302		EUR	700	700	0	%	99,191	694.337,00	3,30
1,2500 % DEXIA SA 14/24 MTN	XS1143093976		EUR	600	600	0	%	98,819	592.914,00	2,81
0,0500 % DZ HYP PF.R.1188 MTN	DE000A2AAW12		EUR	584	584	0	%	98,179	573.365,36	2,72
0,3750 % STADSHYPOTEK 17/24 MTN	XS1731734585		EUR	560	560	0	%	98,352	550.771,20	2,61
0,6250 % TORONTO-DOM. BK 18/25 MTN	XS1832967019		EUR	500	500	0	%	97,077	485.385,00	2,30
Summe Verzinsliche Wertpapiere							EUR		4.283.162,56	20,30
Summe Börsengehandelte Wertpapiere							EUR		18.805.685,11	89,12
Summe Wertpapiervermögen							EUR		18.805.685,11	89,12

1) Durch Rundung der Prozent-Anteile bei der Berechnung können geringfügige Differenzen entstanden sein.

Halbjahresbericht für Lupus alpha Sustainable Return

Vermögensaufstellung zum 31.05.2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1000	Bestand 31.05.2024	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens ¹⁾
Derivate									
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen)									
Derivate auf einzelne Wertpapiere									
Wertpapier-Optionsrechte									
Forderungen/ Verbindlichkeiten									
Optionsrechte auf Aktien									
Adobe Inc 560,000 25.01.17 P	PADEC0560M25	681	STK	500		USD	120,050	55.284,37	0,26
Advanced Micro Devices Inc 140,000 25.01.17 P	PAMDC0140M25	681	STK	2.200		USD	9,250	18.742,80	0,09
Airbnb Inc 130,000 25.01.17 P	PABBC0130M25	681	STK	700		USD	7,600	4.899,84	0,02
Alphabet Inc 125,000 24.12.20 P	PGOLC0125X24	681	STK	2.100		USD	1,200	2.320,98	0,01
American Tower Corp 190,000 25.01.17 P	PAMTC0190M25	681	STK	1.000		USD	11,850	10.914,11	0,05
Amgen Inc 250,000 25.01.17 P	PAMNC0250M25	681	STK	1.000		USD	7,475	6.884,64	0,03
ASML Holding N.V. 720,000 24.12.20 P	DE000C54TBQ2	EDT	STK	400		EUR	23,560	9.424,00	0,05
Automatic Data Processing Inc 210,000 25.01.17 P	PADPC0210M25	681	STK	500		USD	3,550	1.634,81	0,01
BlackRock Inc 690,000 25.01.17 P	PBLKC0690M25	AI6	STK	400		USD	22,450	8.270,78	0,04
Booking Holdings Inc 3000,000 25.01.17 P	PBKGC3000M25	681	STK	100		USD	63,900	5.885,33	0,03
Boston Scientific Corp 50,000 25.01.17 P	PBSXC0050M25	681	STK	5.100		USD	0,450	2.113,75	0,01
Broadcom Inc 1100,000 25.01.17 P	PAVOC1100M25	NAM	STK	300		USD	44,850	12.392,36	0,06
Caterpillar Inc 240,000 25.01.17 P	PCATC0240M25	681	STK	1.100		USD	2,410	2.441,63	0,01
Chubb Ltd 210,000 24.12.20 P	PCB0C0210X24	NAM	STK	500		USD	0,775	356,90	0,00
Cisco Systems Inc 45,000 25.01.17 P	PCSOC0045M25	681	STK	5.800		USD	2,200	11.752,24	0,06
Comcast Corp 37,500 25.01.17 P	PCMAC0375M25	681	STK	5.200		USD	1,915	9.171,54	0,04
Copart Inc 42,500 24.12.20 P	PCPTC0425X24	AI6	STK	4.000		USD	0,550	2.026,25	0,01
Danaher Corp 200,000 25.01.17 P	PDHRC0200M25	681	STK	1.300		USD	2,250	2.693,99	0,01
Deere & Co 330,000 25.01.17 P	PDE0C0330M25	681	STK	400		USD	9,450	3.481,46	0,02
Eaton Corp PLC 250,000 25.01.17 P	PETNC0250M25	681	STK	1.200		USD	3,800	4.199,86	0,02
Eli Lilly & Co 650,000 25.01.17 P	PLLYC0650M25	681	STK	500		USD	14,425	6.642,87	0,03
EssilorLuxottica S.A. 160,000 24.12.20 P	DE000C4STR95	EDT	STK	500		EUR	1,720	860,00	0,00
Fastenal Co 57,120 25.01.17 P	PFATC5712M25	681	STK	1.700		USD	1,550	2.426,89	0,01
Ferrari N.V. 310,000 24.12.19 P	DE000F0CRPD5	EDT	STK	300		EUR	6,240	1.872,00	0,01
Garmin Ltd 115,000 24.07.19 P	PGRNC0115S24	681	STK	900		USD	0,600	497,35	0,00
General Motors Co 38,000 25.01.17 P	PGM0C0038M25	681	STK	4.200		USD	1,240	4.796,68	0,02
Hershey Co/The 170,000 25.01.17 P	PHSYC0170M25	681	STK	700		USD	4,200	2.707,81	0,01
Home Depot Inc/The 300,000 25.01.17 P	PHD0C0300M25	681	STK	900		USD	8,000	6.631,36	0,03
ING Groep N.V. 12,000 24.12.20 P	DE000C7JX7W5	EDT	STK	7.800		EUR	0,170	1.326,00	0,01
Intel Corp 40,000 25.01.17 P	PINCC0040M25	681	STK	6.600		USD	9,400	57.140,23	0,27

¹⁾ Durch Rundung der Prozent-Anteile bei der Berechnung können geringfügige Differenzen entstanden sein.

Halbjahresbericht für Lupus alpha Sustainable Return

Vermögensaufstellung zum 31.05.2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1000	Bestand 31.05.2024	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens ¹⁾
Intuit Inc 530,000 25.01.17 P	PINUC0530M25	681	STK	500			USD 26,200	12.065,39	0,06
Linde plc 390,000 25.01.17 P	PLINC0390M25	NAX	STK	700			USD 7,400	4.770,90	0,02
Lowe's Cos Inc 190,000 25.01.17 P	PLOWC0190M25	681	STK	1.300			USD 4,675	5.597,51	0,03
Marsh & McLennan Cos Inc 180,000 24.12.20 P	PMMCC0180X24	681	STK	1.400			USD 1,875	2.417,68	0,01
Mastercard Inc 380,000 25.01.17 P	PMA0C0380M25	681	STK	700			USD 5,350	3.449,23	0,02
McKesson Corp 420,000 25.01.17 P	PMCKC0420M25	681	STK	400			USD 2,175	801,29	0,00
Monster Beverage Corp 50,000 25.01.17 P	PMNTC0050M25	681	STK	5.200			USD 2,425	11.614,09	0,06
Morgan Stanley 75,000 25.01.17 P	PMS0C0075M25	681	STK	2.500			USD 1,070	2.463,73	0,01
Netflix Inc 420,000 25.01.17 P	PNFXC0420M25	681	STK	600			USD 5,450	3.011,74	0,02
Nvidia Corp 720,000 25.01.17 P	PNVAC0720M25	681	STK	500			USD 20,725	9.544,09	0,05
Progressive Corp/The 150,000 25.01.17 P	PPGRC0150M25	AI6	STK	1.400			USD 2,050	2.643,33	0,01
Prologis Inc 110,000 25.01.17 P	PPLDC0110M25	NAM	STK	2.300			USD 9,150	19.382,92	0,09
QUALCOMM Inc 120,000 25.01.17 P	PQCMC0120M25	681	STK	2.100			USD 0,775	1.498,96	0,01
S&P Global Inc 380,000 25.01.17 P	PSPIC0380M25	681	STK	700			USD 9,150	5.899,15	0,03
Salesforce.com Inc 230,000 25.01.17 P	PCRMCO230M25	681	STK	1.100			USD 18,175	18.413,54	0,09
SAP SE 150,000 24.12.20 P	DE000C7MA8G8	EDT	STK	1.800			EUR 4,900	8.820,00	0,04
Schneider Electric SA 160,000 24.12.20 P	DE000C4TQVN3	EDT	STK	1.500			EUR 1,610	2.415,00	0,01
ServiceNow Inc. 640,000 25.01.17 P	PNOWC0640M25	NAM	STK	400			USD 52,700	19.415,15	0,09
Siemens AG 145,000 24.12.20 P	DE000FOFFCN0	EDT	STK	1.600			EUR 2,370	3.792,00	0,02
Stryker Corp 270,000 25.01.17 P	PSYKC0270M25	681	STK	1.000			USD 2,600	2.394,66	0,01
Target Corp 125,000 25.01.17 P	PTGTC0125M25	681	STK	800			USD 2,570	1.893,62	0,01
Texas Instruments Inc 145,000 25.01.17 P	PTXNC0145M25	681	STK	1.800			USD 1,615	2.677,41	0,01
Toronto-Dominion Bank/The 55,000 24.12.20 P	PTD0C0055X24	681	STK	4.700			USD 2,500	10.822,01	0,05
US Bancorp 37,500 25.01.17 P	PUSBC0375M25	681	STK	6.900			USD 2,250	14.298,87	0,07
Vinci SA 100,000 24.12.20 P	DE000C405QY5	EDT	STK	1.900			EUR 1,540	2.926,00	0,01
Visa Inc 240,000 25.01.17 P	PV00C0240M25	681	STK	1.100			USD 3,875	3.925,86	0,02
Waste Management Inc 160,000 25.01.17 P	PWM0C0160M25	681	STK	1.000			USD 0,925	851,95	0,00
Zoetis Inc. 170,000 25.01.17 P	PZTSC0170M25	681	STK	1.300			USD 12,100	14.487,68	0,07

Summe Wertpapier-Optionsrechte

EUR 452.086,59 2,14

Summe Derivate auf einzelne Wertpapiere

EUR 452.086,59 2,14

Devisen-Derivate

Forderungen/ Verbindlichkeiten

Devisenterminkontrakte (Verkauf)

Offene Positionen

USD/ EUR 14,6 Mio. OTC -53.276,29 -0,25

Geschlossene Positionen

USD/ EUR 0,9 Mio. OTC -10.103,13 -0,05

¹⁾ Durch Rundung der Prozent-Anteile bei der Berechnung können geringfügige Differenzen entstanden sein.

Halbjahresbericht für Lupus alpha Sustainable Return

Vermögensaufstellung zum 31.05.2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1000	Bestand 31.05.2024	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens ¹⁾
Summe Devisen-Derivate							EUR	-63.379,42	-0,30
Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds									
Bankguthaben									
EUR-Guthaben bei der Verwahrstelle									
Kreissparkasse Köln			EUR	1.620.834,72		%	100,000	1.620.834,72	7,69
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen									
Kreissparkasse Köln			CHF	165.704,47		%	100,000	169.283,12	0,80
Kreissparkasse Köln			USD	243.489,75		%	100,000	224.259,50	1,06
Summe Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen							EUR	393.542,62	1,86
Summe Bankguthaben							EUR	2.014.377,34	9,55
Summe der Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds							EUR	2.014.377,34	9,55
Sonstige Vermögensgegenstände									
Zinsansprüche			EUR	41.606,50				41.606,50	0,20
Dividendenansprüche			EUR	9.160,10				9.160,10	0,04
Quellensteuerrückerstattungsansprüche			EUR	8.890,06				8.890,06	0,04
Summe Sonstige Vermögensgegenstände							EUR	59.656,66	0,28
Sonstige Verbindlichkeiten									
Kostenabgrenzungen			EUR	-166.437,96				-166.437,96	-0,79
Summe Sonstige Verbindlichkeiten							EUR	-166.437,96	-0,79
Fondsvermögen							EUR	21.101.988,32	100,00
Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)									89,12

¹⁾ Durch Rundung der Prozent-Anteile bei der Berechnung können geringfügige Differenzen entstanden sein.

Halbjahresbericht für Lupus alpha Sustainable Return Vermögensaufstellung zum 31.05.2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1000	Bestand 31.05.2024	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens ¹⁾
Anteilumlauf Lupus alpha Sustainable Return C							STK		188.243
Anteilwert Lupus alpha Sustainable Return C							EUR		109,19
Anteilumlauf Lupus alpha Sustainable Return R							STK		5.602
Anteilwert Lupus alpha Sustainable Return R							EUR		97,66

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

Die Vermögensgegenstände des Sondervermögens sind auf der Grundlage nachstehender Kurse/Marktsätze bewertet:

Alle Vermögenswerte: Kurse bzw. Marktsätze per 31.05.2024 oder letztbekannte

Devisenkurs(e) bzw. Konversionsfaktor(en) (in Mengennotiz) per 31.05.2024

Schweizer Franken	(CHF)	0,97886	= 1 Euro (EUR)
US-Dollar	(USD)	1,08575	= 1 Euro (EUR)

b) Terminbörsen

681	New York/N.Y. - NYSE Amex Options
AI6	New York/N.Y. - NYSE Arca Options
EDT	EUREX
NAM	Chicago St.Exch.
NAX	Nasdaq PHLX

c) OTC

Over-the-Counter

¹⁾ Durch Rundung der Prozent-Anteile bei der Berechnung können geringfügige Differenzen entstanden sein.

Halbjahresbericht für Lupus alpha Sustainable Return

Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen:

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

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Nominal bzw. Whg. in 1000	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
Börsengehandelte Wertpapiere				
Aktien				
ABB LTD. NA SF 0,12	CH0012221716	STK	0,00	9.400,00
AKAMAI TECH. DL-,01	US00971T1016	STK	0,00	3.100,00
ALNYLAM PHARMACE.DL-,0001	US02043Q1076	STK	0,00	1.100,00
AMADEUS IT GRP SA EO 0,01	ES0109067019	STK	0,00	5.000,00
ASM INTL N.V. EO-,04	NL0000334118	STK	0,00	1.000,00
BAY.MOTOREN WERKE AG ST	DE0005190003	STK	0,00	3.000,00
BIOGEN INC. DL -,0005	US09062X1037	STK	0,00	900,00
CAMPBELL SOUP CO.DL-,0375	US1344291091	STK	0,00	5.400,00
CANADIAN NATL RAILWAY CO.	CA1363751027	STK	0,00	2.600,00
CHARLES SCHWAB CORP.DL-01	US8085131055	STK	0,00	4.900,00
CONAGRA BRANDS INC. DL 5	US2058871029	STK	0,00	7.800,00
CONSOLIDATED EDISON	US2091151041	STK	0,00	1.900,00
DAIMLER TRUCK HLDG NA ON	DE000DTR0CK8	STK	0,00	9.600,00
DASSAULT SYS SE INH.EO0,1	FR0014003TT8	STK	0,00	7.200,00
DEUTSCHE BOERSE NA O.N.	DE0005810055	STK	0,00	1.500,00
DIGITAL REALTY TR. DL-,01	US2538681030	STK	0,00	2.900,00
DOLLAR GENER.CORP.DL-,875	US2566771059	STK	0,00	1.100,00
DOMINOS PIZZA INC. DL-,01	US25754A2015	STK	0,00	500,00
EDENRED EO 2	FR0010908533	STK	0,00	4.800,00
EPAM SYSTEMS INC. DL-,001	US29414B1044	STK	0,00	800,00
GEBERIT AG NA DISP. SF-10	CH0030170408	STK	0,00	580,00
INFINEON TECH.AG NA O.N.	DE0006231004	STK	0,00	7.000,00
LOGITECH INTL NA SF -,25	CH0025751329	STK	0,00	6.500,00
MICROSOFT DL-,00000625	US5949181045	STK	0,00	700,00
NETAPP INC.	US64110D1046	STK	0,00	4.300,00
PARTNERS GR.HLDG SF -,01	CH0024608827	STK	0,00	200,00
QUEST DIAGNOSTICS DL-,01	US74834L1008	STK	0,00	2.300,00
SHOPIFY A SUB.VTG	CA82509L1076	STK	0,00	7.500,00
SIKA AG NAM. SF 0,01	CH0418792922	STK	0,00	1.100,00
SMUCKER -J.M.-	US8326964058	STK	0,00	1.600,00
SONOVA HLDG AG NA.SF 0,05	CH0012549785	STK	0,00	1.300,00
STANLEY BL. + DECK.DL2,50	US8545021011	STK	0,00	2.300,00

1) Durch Rundung der Prozent-Anteile bei der Berechnung können geringfügige Differenzen entstanden sein.

Halbjahresbericht für Lupus alpha Sustainable Return

Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen:

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

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Nominal bzw. Whg. in 1000	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
STEEL DYNAMIC DL-,0025	US8581191009	STK	0,00	2.700,00
STMICROELECTRONICS	NL0000226223	STK	0,00	5.800,00
SWISS RE AG NAM. SF -,10	CH0126881561	STK	0,00	3.600,00
SWISSCOM AG NAM. SF 1	CH0008742519	STK	0,00	470,00
TELEFONICA INH. EO 1	ES0178430E18	STK	0,00	71.500,00
TRAVELERS COS INC.	US89417E1091	STK	0,00	1.300,00
UNIVERSAL MUSIC GROUP EO1	NL0015000IY2	STK	0,00	12.500,00
UPM KYMMENE CORP.	FI0009005987	STK	0,00	10.700,00
UTD THERAP. (DEL.) DL-,01	US91307C1027	STK	0,00	1.000,00
VERIZON COMM. INC. DL-,10	US92343V1044	STK	0,00	6.300,00
WOLTERS KLUWER NAM. EO-12	NL0000395903	STK	0,00	2.500,00
ZURICH INSUR.GR.NA.SF0,10	CH0011075394	STK	0,00	740,00

1) Durch Rundung der Prozent-Anteile bei der Berechnung können geringfügige Differenzen entstanden sein.

Halbjahresbericht für Lupus alpha Sustainable Return

Gattungbezeichnung

Stück bzw.
Anteile bzw.
Wtg.

Volumen
in 1.000

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

Optionsrechte

Wertpapier-Optionsrechte

Optionsrechte auf Aktien

Gekaufte Verkaufsoptionen (Put):

EUR

2.045

(Basiswert(e): Advanced Micro Devices Inc., ASML Holding N.V., Broadcom Inc., Eaton Corporation PLC, Eli Lilly and Company, General Motors Co., Microsoft Corp., NVIDIA Corp., SAP SE)

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)		89,12
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)		1,84

Sonstige Angaben

Anteilwert Klasse C	EUR	109,19
Umlaufende Anteile Klasse C	STK	188.243
Anteilwert Klasse R	EUR	97,66
Umlaufende Anteile Klasse R	STK	5.602

Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände

Für Vermögensgegenstände, die zum Handel an einer Börse oder an einem anderen organisierten Markt zugelassen oder in diesen einbezogen sind, wird gemäß §27 KARBV der letzte verfügbare handelbare Kurs zugrunde gelegt, der eine verlässliche Bewertung gewährleistet. Für Vermögensgegenstände, die weder zum Handel an einer Börse noch an einem anderen organisierten Markt zugelassen oder in diesen 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. Der zugrunde gelegte Verkehrswert kann auch von einem Emittenten, Kontrahenten oder sonstigen Dritten ermittelt und mitgeteilt werden. In diesem Fall wird dieser Wert durch die Kapitalanlagegesellschaft beziehungsweise die Verwahrstelle auf Plausibilität geprüft und diese Plausibilitätsprüfung dokumentiert. Anteile an inländischen Investmentvermögen, EG-Investmentanteilen und ausländischen Investmentanteilen werden mit ihrem letzten festgestellten Rücknahmepreis oder mit einem aktuellen Kurs nach §27 Absatz 1 KARBV bewertet. Falls aktuelle Werte nicht zur Verfügung stehen, wird der Wert der Anteile gemäß §28 KARBV ermittelt; hierauf wird im Jahresbericht hingewiesen. Bankguthaben werden zu ihrem Nennwert zuzüglich zugeflossener Zinsen bewertet. Festgelder werden zum Verkehrswert bewertet. Verbindlichkeiten werden mit ihrem Rückzahlungsbetrag angesetzt.

Frankfurt am Main, den 27.06.2024

Lupus alpha Investment GmbH

Die Geschäftsführung