



Halbjahresbericht

La Tullius Absolute Return Europe

zum 31.05.2024

Lupus alpha

Halbjahresbericht für La Tullius Absolute Return Europe

Vermögensübersicht zum 31.05.2024

	Tagswert in EUR	% Anteil am Fondsvermögen ¹⁾
Anlageschwerpunkte		
Vermögensgegenstände		
Renten	116.157.750,00	80,00
Bundesrepublik Deutschland	116.157.750,00	80,00
Futures	851.560,00	0,57
Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds	28.370.674,87	19,55
Sonstige Vermögensgegenstände	773.922,79	0,53
Sonstige Verbindlichkeiten	-939.537,43	-0,65
Fondsvermögen	145.214.370,23	100,00

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

Halbjahresbericht für La Tullius Absolute Return Europe

Vermögensaufstellung zum 31.05.2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1000	Bestand 31.05.2024	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens ¹⁾
					im Berichtszeitraum					
Börsengehandelte Wertpapiere										
Verzinsliche Wertpapiere										
0,2000 % BUND SCHATZANW. 22/24	DE0001104883		EUR	25.000	0	0	%	99,916	24.979.000,00	17,20
0,4000 % BUND SCHATZANW. 22/24	DE0001104891		EUR	25.000	10000	0	%	99,128	24.782.000,00	17,07
2,2000 % BUND SCHATZANW. 22/24	DE0001104909		EUR	25.000	20000	0	%	99,299	24.824.750,00	17,10
2,5000 % BUND SCHATZANW. 23/25	DE000BU22007		EUR	5.000	0	0	%	99,288	4.964.400,00	3,42
2,8000 % BUND SCHATZANW. 23/25	DE000BU22015		EUR	12.000	12000	0	%	99,455	11.934.600,00	8,22
0,0000 % BUNDESABL.V.19/24 S.180	DE0001141802		EUR	25.000	15000	0	%	98,692	24.673.000,00	16,99
Summe Verzinsliche Wertpapiere								EUR	116.157.750,00	80,00
Summe Börsengehandelte Wertpapiere								EUR	116.157.750,00	80,00
Summe Wertpapiervermögen								EUR	116.157.750,00	80,00
Derivate										
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen)										
Aktienindex-Derivate										
Forderungen/ Verbindlichkeiten										
Aktienindex-Terminkontrakte										
DAX INDEX FUTURE Jun24 - 21.06.2024	DE000C6LWLW5	EDT	EUR	-68					278.900,00	0,19
Summe Aktienindex-Terminkontrakte								EUR	278.900,00	0,19
Summe Aktienindex-Derivate								EUR	278.900,00	0,19
Zins-Derivate										
Forderungen/ Verbindlichkeiten										
Zinsterminkontrakte										
EURO-BOBL FUTURE Jun24 - 06.06.2024	DE000C75XMV6	EDT	EUR	-7.000.000					120.820,00	0,08
EURO-BOBL FUTURE Sep24 - 06.09.2024	DE000F0FSQP8	EDT	EUR	-14.500.000					-15.900,00	-0,01
EURO-BUND FUTURE Jun24 - 06.06.2024	DE000C75XMU8	EDT	EUR	-22.900.000					296.000,00	0,20
EURO-BUND FUTURE Sep24 - 06.09.2024	DE000F0FSQN3	EDT	EUR	-12.600.000					-14.260,00	-0,01
EURO-SCHATZ FUT Jun24 - 06.06.2024	DE000C75XMW4	EDT	EUR	-25.000.000					194.000,00	0,13
EURO-SCHATZ FUT Sep24 - 06.09.2024	DE000F0FSQQ6	EDT	EUR	-20.000.000					-8.000,00	-0,01
Summe Zinsterminkontrakte								EUR	572.660,00	0,38
Summe Zins-Derivate								EUR	572.660,00	0,38

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

Halbjahresbericht für La Tullius Absolute Return Europe 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⁾
Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds									
Bankguthaben									
EUR-Guthaben bei der Verwahrstelle									
State Street Bank International GmbH			EUR	28.370.674,87		%	100,000	28.370.674,87	19,55
Summe Bankguthaben						EUR		28.370.674,87	19,55
Summe der Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds						EUR		28.370.674,87	19,55
Sonstige Vermögensgegenstände									
Zinsansprüche			EUR	773.922,79				773.922,79	0,53
Summe Sonstige Vermögensgegenstände						EUR		773.922,79	0,53
Sonstige Verbindlichkeiten									
Verbindlichkeiten aus schwebenden Geschäften			EUR	-465,93				-465,93	0,00
Eingenommene Variation Margin Derivate			EUR	-851.560,00				-851.560,00	-0,59
Kostenabgrenzungen			EUR	-87.511,50				-87.511,50	-0,06
Summe Sonstige Verbindlichkeiten						EUR		-939.537,43	-0,65
Fondsvermögen						EUR		145.214.370,23	100,00
Umlaufende Anteile						STK		1.506.798	
Anteilwert						EUR		96,37	
Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)									80,00
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

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

Halbjahresbericht für La Tullius Absolute Return Europe

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- ¹⁾ mögens
---------------------	------	-------	--	-----------------------	--	----------------------	------	--------------------	--

Marktschlüssel

b) Terminbörsen

EDT	EUREX
-----	-------

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

Halbjahresbericht für La Tullius Absolute Return Europe

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
---------------------	------	--	-------------------	----------------------

Börsengehandelte Wertpapiere

Verzinsliche Wertpapiere

0,0000 % BUND SCHATZANW. 21/23	DE0001104867	EUR		25.000
0,0000 % BUND SCHATZANW. 22/24	DE0001104875	EUR		25.000
0,0000 % BUNDESUBL.V.19/24 S.179	DE0001141794	EUR		12.000

Halbjahresbericht für La Tullius Absolute Return Europe

Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Volumen in 1.000
---------------------	------------------------------------	---------------------

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

Terminkontrakte

Aktienindex-Terminkontrakte

Gekaufte Kontrakte: (Basiswert(e): DAX)	EUR	11.097
Verkaufte Kontrakte: (Basiswert(e): DAX)	EUR	445.849

Zinsterminkontrakte

Gekaufte Kontrakte: (Basiswert(e): FGBL, FGBM)	EUR	31.284
Verkaufte Kontrakte: (Basiswert(e): FGBL, FGBM, FGBS)	EUR	888.921

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)	80,00	
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)	0,57	
Sonstige Angaben		
Umlaufende Anteile	STK	1.506.798
Anteilwert	EUR	96,37

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 14.06.2024

Lupus alpha Investment GmbH

Die Geschäftsführung