

Halbjahresbericht

Lupus alpha Volatility Invest

zum 30.06.2022

Lupus alpha

Halbjahresbericht für Lupus alpha Volatility Invest

Vermögensübersicht zum 30.06.20222

Anlageschwerpunkte	Tageswert in EUR	% Anteil am Fondsvermögen ¹
I. Vermögensgegenstände		
Renten	56.028.971,80	97,13
Australien	1.915.865,00	3,32
Belgien	1.591.598,00	2,76
Bundesrepublik Deutschland	23.896.609,50	41,40
Dänemark	2.675.397,00	4,64
Finnland	991.070,00	1,72
Frankreich	9.342.000,00	16,20
Neuseeland	443.848,50	0,77
Niederlande	611.604,00	1,06
Norwegen	5.580.371,00	9,68
Österreich	2.503.945,00	4,34
Schweden	2.068.577,00	3,59
Singapur	2.625.684,80	4,56
Kanada	1.782.402,00	3,09
Futures	-316.483,59	-0,54
Optionen	-991.504,78	-1,72
Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds	2.491.678,55	4,32
Sonstige Vermögensgegenstände	525.554,54	0,90
Sonstige Verbindlichkeiten	-49.326,50	-0,09
Fondsvermögen	57.688.890,02	100,00

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

Halbjahresbericht für Lupus alpha Volatility Invest Vermögensaufstellung zum 30.06.2022

Borsengehandelte Wertpapiere Verzinalishe We	Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw.	Bestand 30.06.2022	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver-
Name				Whg. in 1000		im Beric					mögens ¹⁾
2,770 AMB AMB CHAPA MITM \$350 (207867748 EUR	Börsengehandelte Wertpapiere										
9.3790 M. AREA PLANUE LOANS 18-248TN FR001373779* EUR 1.300 0 0 1	Verzinsliche Wertpapiere										
9.2250 A. SEPLINE DI 1225 MERLIN HOZAMIN PROSINCE PUR	2,3750 % ABN AMRO 14/24 MTN	XS1020769748		EUR	600	0	0	%	101,934	611.604,00	1,06
2.1290 M. SERFLIN SEN 13728 MTN	0,3750 % ARKEA HOME LOANS 18-24MTN	FR0013375797		EUR	1.300	0	0	%	98,618	1.282.034,00	2,22
	0,1250 % ASB FIN.(LDN) 16/23 MTN	XS1502534461		EUR	450	0	0	%	98,633	443.848,50	0,77
SAYTON AC FFRANKLICK GOAD ANT FRONTOYSHAM FRONTOYSHA	2,1250 % BELFIUS BK 13/23 MTN	BE0002424969		EUR	900	0	0	%	101,042	909.378,00	1,58
23750 KC FFRANCLICOL 1244 MTN FRO11986101 EUR 500 0 0 0 % 101.878 1903-000.0 0.88 0.2820 KC FFRANCLIDS MTN FRO1398510 EUR 700 700 0 0 0 % 101.878 1202.400 2.00 0.500 % CASS FRANC. 1925 MTN FRO11398535 EUR 700 700 0 0 % 97.688 683.676.00 1.19 2,400 % CASS FRANC. 1925 MTN FRO11398535 EUR 800 800 0 0 % 100.218 683.676.00 1.14 2,200 % CASS FRANC. 1925 MTN FRO11398535 EUR 800 800 0 0 % 100.218 683.676.00 1.42 2,200 % CASS FRANC. 1925 MTN FRO11398535 EUR 1.00 800 0 0 % 100.218 610.00 1.00 1.22 2,200 % CASS FRANC. 1925 MTN FRO1139852 EUR 1.00 500 0 0 % 100.28 10.00 1.00 1.00 1.00 1.00 1.00 1.00 1.	0,2500 % BERLIN HYP AG PF S209	DE000BHY0150		EUR	1.500	1.500	0	%	99,626	1.494.390,00	2,59
23750 KC FFRANCLICOL 1244 MTN FRO11986101 EUR 500 0 0 0 % 101.878 1903-000.0 0.88 0.2820 KC FFRANCLIDS MTN FRO1398510 EUR 700 700 0 0 0 % 101.878 1202.400 2.00 0.500 % CASS FRANC. 1925 MTN FRO11398535 EUR 700 700 0 0 % 97.688 683.676.00 1.19 2,400 % CASS FRANC. 1925 MTN FRO11398535 EUR 800 800 0 0 % 100.218 683.676.00 1.14 2,200 % CASS FRANC. 1925 MTN FRO11398535 EUR 800 800 0 0 % 100.218 683.676.00 1.42 2,200 % CASS FRANC. 1925 MTN FRO11398535 EUR 1.00 800 0 0 % 100.218 610.00 1.00 1.22 2,200 % CASS FRANC. 1925 MTN FRO1139852 EUR 1.00 500 0 0 % 100.28 10.00 1.00 1.00 1.00 1.00 1.00 1.00 1.	5,3750 % C.F.FINANC.LOC, 09/24 MTN	FR0010775486		EUR	800	0	0	%	107.984	863.872.00	1.50
							0				
2.4000 CAUSSE REF HAB 13-25 FR0011885339 EUR 8.00 8.00 9.00 9.5 102,318 818,544,00 1.42 2.000 CAUS F FROVER 7.22 MITH FR001356427 EUR 1.500 1.500 0.0 9.5 101,046 1.507,600,00 2.26 1.250 1.250 0.250											
2500 CM HOME LOAN SEP1 3234TN											
12100 COBA MTH S P323 DEDODCZAONNO EUR 1.500 1.500 0 % 98,504 1.5102 1.501 2.503 2.000 COBA MTH S P323 DEDODCZAOL26 EUR 1.500 1.500 0 % 99,506 1.5105,00 2.623 2.03700 K.DANSKE MTG PANKH 18623 MTN X51914467934 EUR 1.000 1.000 0 % 99,107 0 99,107 0 1.72 2.03700 K.DANSKE MTG PANKH 17624 MTN X51914467934 EUR 1.000 0 0 % 99,107 0 99,107 0 1.72 2.03700 K.DANSKE MTG PANKH 17624 MTN X51900061597 EUR 1.000 0 0 % 99,107 0 99,130 0 99,130 0 1.72 0.000 0 0 % 99,130 0 99,130 0 1.72 0.000 0 0 0 0 0 0 0 0	.,					-	-				
2000 S COBA MTH S P3 23 DEDODCAULSE EUR 1.500 1.500 0 % 101.281 1.512.15.00 2.283 0.1250 % CREDIT AGRIL 2012 MTN FRO013505575 EUR 1.500 1.500 0 % 99.077 99.07700 1.72 0.3750 % DASS BANK 1772 MTN X51720556737 EUR 8.58 0 0 % 99.107 99.07700 1.72 0.3750 % DASS BANK 1772 MTN X51720566737 EUR 8.58 0 0 % 99.13 99.13000 1.72 0.2500 % DT BANK MTH 1624 DE000DLISBH3 EUR 1.00 0 0 % 99.60 1.485 200.00 1.19 0.2500 % DT BANK MTH 1624 DE000DKB040 EUR 1.500 0 0 % 99.600 1.148 600.00 2.59 0.600 % DT FERB BANK FF R.15272 DE000DKB040 EUR 1.500 0 0 % 99.600 1.74 1.000 % 1.95 9.95 1.96 0.000 1.70 0 0											
1,250 C,REDIT AGR, LOZA MTN											
0,3750 % DANSKE MTG BANK 1923 MTN							-				
0.3750 % DBS BANK 1724 MTN X51700506737 EUR 858 0 0 0 % 97.360 835.348.80 1.45 0.3750 K DBS BCLIGKRED. 1823 MTN X51900061597 EUR 1.000 0 0 % 99.150 99.150.000 1.72 0.2500 % DT BANK MTH 18024 DE000DL159H3 EUR 700 0 0 0 % 99.861 688.157.00 2.250 0.2500 % DT BANK MTH 18023 DE000DL159H3 EUR 1.500 0 0 0 % 99.860 1.495.200.00 2.25 0.0500 % DT BANK MTH 18023 DE000DL69H44 EUR 1.500 0 0 0 % 99.860 1.495.200.00 2.25 0.0500 % DT BANK MTH 18023 DE000DK80440 EUR 1.500 0 0 0 % 99.860 1.495.200.00 2.25 0.0500 % DT FERR BANK FF. 1.5272 DE000A262E29 EUR 1.700 0 0 0 % 98.526 98.5260.00 1.71 0.000 % DT FFER BANK FF. 1.5272 DE000A262E29 EUR 1.700 40 0 0 % 98.526 98.5260.00 1.71 0.000 % DT FFER BANK FF. 1.5272 DE000A262E29 EUR 1.000 400 0 0 % 98.526 98.5260.00 1.71 0.000 % DT FFER BANK FF. 1.5272 DE000A262E29 EUR 1.000 400 0 0 % 98.526 98.5260.00 1.71 0.000 % DT FFER BANK FF. 1.5272 DE000A262E29 EUR 1.000 400 0 0 % 98.526 98.5260.00 1.71 0.000 % DT FFER BANK FF. 1.5272 DE000A262E29 EUR 2.000 2.000 0 % 98.526 98.5260.00 1.71 0.000 % DT FFER BANK FF. 1.5272 DE000A262E29 EUR 2.000 0 0 0 % 98.526 98.5260.00 1.71 0.000 % DT FFER BANK FF. 1.5272 DE000A262E29 EUR 2.000 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0											
0.3750 % DNB BOLIGKRED. 18/23 MTN XS190061997 EUR 1.000 0 0 % 99,130 991,300.00 1,72 0.2500 % DT BANK MTH 18/24 DE00DL195H3 EUR 7.00 0 0 % 99,630 1.496,200.00 2,59 0.6250 % DT AKRAK MTH 18/23 DE00DL195H3 EUR 1.500 0 0 % 99,680 1.496,200.00 2,59 0.6250 % DT AKREDITEANK OPF 16/23 DE00DAE24E2B EUR 1.500 0 0 % 99,684 1.494,680,00 2,59 0.6250 % DT AKREDITEANK OPF 16/23 DE00DAE24E2B EUR 1.500 0 0 % 99,684 1.494,680,00 2,59 0.5000 % DT FRER BANK PE F. 15/27 DE00DAE24E2B EUR 1.500 40 0 % 98,684 1.944,680,00 2,59 0.5000 % DT FPER BANK PE F. 15/280 DE00DAE24E2B EUR 1.500 40 0 % 98,586 985,280.00 1,71 0.0100 % DE 14*DP FE. 12/20 MTN DE00DAE25B17 EUR 2.000 2.000 0 % 98,586 985,280.00 1,75 0.5000 % DE 14*DP FE. 12/20 MTN DE00DAE25B17 EUR 1.000 0 0 % 99,849 98,490,00 1,73 0.3750 % HASPA PE A.33 17/24 DE00DAE24E4B EUR 1.000 0 0 % 99,849 98,490,00 1,73 0.3750 % HASPA PE A.33 17/24 DE00DAE24E4B EUR 2.000 3.00 0 % 99,515 1.208,973 0.3750 % HASPA PE A.33 17/24 DE00DAE24E4B EUR 2.000 3.00 0 % 99,515 1.208,973 0.3750 % HASPA PE A.33 17/24 DE00DAE24E4B EUR 2.000 1.000 0 % 99,515 1.208,973 1.00 3,62 0.3750 % HASPA RE A.33 17/24 DE00DAE24E4B EUR 2.000 1.000 0 % 99,515 1.208,973 1.00 3,62 0.3750 % HASPA RE A.33 17/24 DE00DAE24E4B EUR 7.00 1.000 0 % 99,515 1.208,973 1.00 3,62 0.3750 % HASPA RE A.33 17/24 EUR 7.00 1.000 0 % 99,515 1.208,973 1.00 3,62 0.3750 % HASPA RE A.34 17/24 MTN X51668966300 EUR 7.00 3.00 0 % 99,445 1.988,800,00 3,64 0.3750 % LEBK REALK 17/24 MTN X51668966300 EUR 7.00 3.00 0 % 99,515 1.986,800,00 3,64 0.3750 % LEBK REALK 17/24 MTN X5166896630B EUR 1.000 0 0 % 99,515 1.986,800,00 3,64 0.3750 % LEBK REALK 17/24 MTN X5166896630B EUR 1.000 0 0 % 99,515 1.986,800,00 3,64 0.3750 % LEBK REALK 17/24 MTN X516689630B EUR 1.000 0 0 % 99,515 1.99,940,00 1.77 0.0100 % MURINCH 14*PF B.523 MTN X516489630B EUR 1.000 0 0 % 99,515 1.99,940,00 1.77 0.0200 % NORDLB MTH 14*PF S.566 DE00DM1*2414 EUR 9.00 0 0 0 % 99,515 1.99,940,00 1.77 0.0200 % NORDLB MTH 14*PF S.566 DE00DM1*2414 EUR 9.00 0 0 0 % 99,517 1.99,741,10 1.01,20 1.02,20 0.00 0										991.070,00	
0.2500 % DT.BANK MTH 16/24 0.2500 % DT.BANK MTH 16/23 0.2500 % DT.BANK MTH 16/24 0.2500 % DT.BANK MTH 16/24 0.2500 % DT.BANK MTH 16/24 0.2500 % DT.PFBR BANK PF 15/27 0.2500 % DT.PFBR BANK PF R.15/27 0.2500	0,3750 % DBS BANK 17/24 MTN	XS1720526737		EUR	858	0	0	%	97,360	835.348,80	1,45
0.2500 % DT.BANK MTH 18/23 DE000DL19UA4 EUR 1.500 0 % 99,680 1.49520,00 2,59 0.6250 % DT.KREDITBANK PCP 15/23 DE0000K9040 EUR 1.500 0 % 99,604 1.494660,00 2,59 0.5000 % DT.PERB BANK PF.R.15272 DE000A2GLL7 EUR 1.000 400 0 % 98,526 1.903350,0 2,256 0.5000 % DT.PERB BANK PF.R.15280 DE000A2GSLL7 EUR 1.000 400 0 % 98,526 985,260,00 1.71 0,0100 % DT.PERB BANK PF.R.15280 DE000A2TSD55 EUR 2.000 2.000 0 % 98,838 1.966,160,00 3.41 0,3750 % EKRA BOLIGKRED. 1623 MTN X5139756424 EUR 1.000 0 % 98,349 98,840,00 1.71 0,3750 % EKRA BOLIGKRED. 1623 MTN X5139756424 EUR 2.000 300 0 % 98,345 1.966,100.00 3,41 0,3750 % HASPA PF.A.33 1702 DE000HSHB161 EUR 2.000 1.000 0	0,3750 % DNB BOLIGKRED. 18/23 MTN	XS1909061597		EUR	1.000	0	0	%	99,130	991.300,00	1,72
0.8250 % DT.KREDITBANK OPF 15/23 DE000DKB0440 EUR 1.500 0 % 99,604 1,494.060,00 2,58 0.6500 % DT.PERB.BANK PF.R.15272 DE000AZE4ZE9 EUR 1.700 0 0 % 100,055 1700.935,00 2,95 0.600 % DT.PERB.BANK PF.R.1527 DE000AZESLT2 EUR 1.000 400 0 % 98,526 985.260,00 1,71 0.0100 % DZ.PYP PF.R.1220 MTN DE000AZESD55 EUR 2.000 200 0 % 99,849 998.490,00 1,73 0.3750 % HCAS DUIGKRED. 1623 MTN X51397054245 EUR 1.000 0 % 98,849 1998.490,00 1,73 0,3750 % HCAS DUIGKRED. 1623 MTN DE000AZEAFL4 EUR 2.000 300 0 % 98,849 1998.490,00 1,73 0,3750 % HCAS HARSA PF.A.33 1774 DE000AZESD6 EUR 2.00 0 % 99,511 2.089.731,00 362 0,6250 % NG BELGIUM 18-25 MTN BED00AZESD6 EUR 700 700	0,2500 % DT.BANK MTH 16/24	DE000DL19SH3		EUR	700	0	0	%	98,451	689.157,00	1,19
0.5500 % DT.PFBR.BANK PF.R.15272 DE0002E4ZE99 EUR 1.700 0 0 % 100,055 1.700.935,00 2,95 0.5000 % DT.PFBR.BANK PF.R.15280 DE000AZGSLLT EUR 1.000 400 0 % 98,566 985,260,00 1,71 0,010 % DT.PFBR.BANK PF.R.15280 DE000AZGSLLT EUR 1.000 2.000 0 % 98,308 1.966,160,00 3,41 0,3750 % EIKA BOLIGKRED. 16/23 MTN XS1397054245 EUR 1.000 0 0 0 % 99,849 998,490,00 1,73 0,3750 % HASPA PF.A.32 17724 DE000AZDAFL4 EUR 2.000 300 0 % 98,308 1.966,100,00 3,41 0,3750 % HASPA PF.A.32 17724 DE000AZDAFL4 EUR 2.000 300 0 % 99,849 1.986,510 0,365 0,365 0,3750 % HOSP HPF S2893 DE000HSHEK16 EUR 2.100 1.000 0 % 99,511 2.088,731,00 3,62 0,6250 % ING BELGIUM 18-25 MTN BE0002594720 EUR 700 700 0 % 99,640 682,220,00 1,18 0,2500 % ING FERENCA PF.1823 DE000A1KRJR4 EUR 1.500 600 0 % 99,845 1.486,320,00 2,58 0,3750 % LOSE K FEALK. 1724 MTN XS1669865300 EUR 700 300 0 0 % 99,445 1.988,900,00 3,45 0,3750 % LOSE K FEALK. 1724 MTN XS1669865300 EUR 700 300 0 0 % 99,445 1.988,900,00 1,11 0,6250 % LAENSFOERSAEK HYP 1825 XS1799048704 EUR 1.000 0 0 0 % 99,445 1.387,296,00 1,11 0,6250 % LAENSFOERSAEK HYP 1825 XS1799048704 EUR 1.000 0 0 0 % 98,78 8 97,880 0 1,11 0,0250 % LAENSFOERSAEK HYP 1825 XS1799048704 EUR 1.000 0 0 0 % 98,78 8 98,78 8 98,780 0,3750 % LBERSS-THR. 1824 XS1767931477 EUR 1.000 0 0 0 % 98,78 8 97,880 0 1,11 0,0250 % LAENSFOERSAEK HYP 1825 XS1799048704 EUR 1.000 0 0 0 % 98,78 8 98,78 8 98,780 0 1,11 0,0250 % NATL AUSTR. ER 12223 MTN XS0864390358 EUR 1.900 0 0 0 % 98,78 8 98,78 8 98,780 0 1,15 1,17 0,0100 % MUENCH HYP BK. MTN-PF1839 DE000MHS24J4 EUR 9.000 0 0 0 % 99,95 2 79,9616,00 1,39 0,0100 % NORDH SKI BKG 1823 MTN XS1784059930 EUR 8.000 0 0 0 % 99,95 2 79,9616,00 1,39 0,0250 % NORDH SKI BKG 1823 MTN XS1784059930 EUR 8.000 0 0 0 % 99,95 2 79,9616,00 1,39 0,0250 % NORDH SKI BKG 1823 MTN XS178769145 EUR 7.000 0 0 0 % 99,97 2 1,999,440,00 3,47 0,3750 % SPAREBK V DOLIG 1823 MTN XS178768145 EUR 7.000 0 0 0 % 99,97 2 1,999,440,00 3,47 0,3750 % SPAREBK V DOLIG 1823 MTN XS178768145 EUR 7.000 0 0 0 % 99,97 2 1,999,440,00 3,47 0,3750 % SPAREBK V DOLIG 1823	0,2500 % DT.BANK MTH 18/23	DE000DL19UA4		EUR	1.500	0	0	%	99,680	1.495.200,00	2,59
0.5000 % DT.PFBR.BANK PF.R.15280 DE000A2GSLLT EUR 1.000 400 0 % 98,526 985,260,00 1.71 0,0100 % DZ HYP PF.R.1220 MTN DE000AZTSD555 EUR 2.000 2.000 0 % 98,308 1,966,160,00 3.41 0,3750 % HEAB DOLIGKRED 1.623 MTN X51397054245 EUR 2.000 300 0 % 98,305 1,966,160,00 3.41 0,3750 % HASPA PF.A.33 17/24 DE000AZDAFL4 EUR 2.000 300 0 % 99,511 2.08731,00 3.41 0,3750 % HOOB HPF S.2693 DE000HSH6K16 EUR 2.100 1.000 0 % 99,511 2.08731,00 3.62 0,6250 % ING BELGIUM 18-25 MTN BEE002594720 EUR 7.00 700 0 % 99,688 1.468,230,00 2.58 0,2550 % LABRITA HIS23 DE000A1KRJR4 EUR 1.500 600 0 % 99,445 1.988,900,00 3.45 0,3750 % JYSKE REALK 16/23 XS1435774903 EUR	0,6250 % DT.KREDITBANK OPF 15/23	DE000DKB0440		EUR	1.500	0	0	%	99,604	1.494.060,00	2,59
0,1010 % DZ HYP FR. 1/220 MTN DE000AZTSD55 EUR 2,000 200 0 % 98,308 1,966,160,00 3,41 0,3750 % EIKA BOLIGKRED. 16/23 MTN XS1397054245 EUR 1,000 0 0 % 99,849 998,400,00 1,73 0,3750 % HASPA PF.A.33 17/24 DE000APAFL4 EUR 2,000 300 0 % 99,511 2,989,730 3,41 0,3750 % HCOB HPF S2,693 DE000HSHEK16 EUR 2,100 1,000 0 % 99,511 2,989,731,00 3,62 0,6250 % ING BELGIUM 18-25 MTN BE0002594720 EUR 7,00 0 0 % 99,088 1,486,320,00 2,58 0,2500 % ING-DIBA AG HPF 18/23 DE000AHKRJH4 EUR 1,500 600 0 % 99,088 1,486,320,00 2,58 0,3750 % JYSKE REALK. 16/23 XS1435774903 EUR 7,00 30 0 % 99,445 1,988,900,00 3,45 0,3750 % LAENSFOERSAECHYP 18/25 XS149948774 EUR	0,0500 % DT.PFBR.BANK PF.R.15272	DE000A2E4ZE9		EUR	1.700	0	0	%	100,055	1.700.935,00	2,95
0.3750 % EIKA BOLIGKRED. 16/23 MTN XS1397054245 EUR 1.000 0 % 99,849 998,490,00 1,73 0.3750 % HASPA PF-A.33 17/24 DE000A2DAFL4 EUR 2.000 300 0 % 99,849 998,490,00 3,41 0.3750 % HASPA PF-A.33 17/24 DE000HSH6K16 EUR 2.000 1.000 0 % 99,511 2.089,731,00 3,62 0,2550 % ING-BIGLIUM 19-25 MTN BE E0002594720 EUR 700 700 0 % 99,088 1,486,320,00 2,58 0,2500 % ING-DIBA AG HPF 18/23 DE000A1KRJR4 EUR 1,500 600 0 % 99,445 1,988,900,00 3,45 0,2500 % JYSKE REALK. 16/23 X51435774903 EUR 2,000 0 0 % 99,445 1,988,900,00 1,45 0,2500 % LAENSFOERSAEKHYP 18/25 XS1799048704 EUR 1,000 1,400 1,400 0 % 98,781 98,788,00 1,71 0,6250 % LAENSFOERSAEKHYP 18/25 XS1799048704 EUR	0,5000 % DT.PFBR.BANK PF.R.15280	DE000A2GSLL7		EUR	1.000	400	0	%	98,526	985.260,00	1,71
0.3750 % EKA BOLIGKRED. 16/23 MTN XS1397054245 EUR 1.000 0 % 99,849 998,490,00 1,73 0.3750 % HASPA PF-A.33 17/24 DE00042DAFL4 EUR 2.000 300 0 % 99,305 1.966 100,00 3.41 0.3750 % HASPA PF-A.33 17/24 DE000HSH6K16 EUR 2.100 1.000 0 % 99,511 2.089,731,00 3.62 0.6250 % ING BELGIUM 18-25 MTN BE E0002594720 EUR 700 700 0 % 99,488 1.486,320,00 1,18 0.2500 % ING-DIBA AG HPF 18/23 DE0004 IKRJR4 EUR 1.500 600 0 % 99,485 1.496,320,00 2.58 0,2500 % JYSKE REALK, 16/23 XS1435774903 EUR 7.00 30 0 % 99,445 1.989,900,00 3,45 0,3750 % JYSKE REALK, 16/23 XS1439774903 EUR 7.00 30 0 % 99,45 1.989,900,00 3,45 0,2500 % LAENSFOERSAEKHYP 18/25 XS1799048704 EUR 1.00 0	0,0100 % DZ HYP PF.R.1220 MTN						0	%			
0.3750 % HASPA PF.A.33 17/24 DE000A2DAFL4 EUR 2.000 300 0 % 98,305 1.966.100,00 3,41 0,3750 % HCOB HPF S.2693 DE000HSH6K16 EUR 2.100 1.000 0 % 99,511 2.089,731,00 3,62 0,2500 % ING BELGIUM IR-25 MTN BE0002594720 EUR 700 700 0 % 99,611 2.089,731,00 3,62 0,2500 % ING BELGIUM IR-25 MTN BE0002594720 EUR 700 700 0 % 99,618 1.486,220,00 1,18 0,2500 % ING-DIBA AG HPF 18/23 DE000A1KRJR4 EUR 1.500 600 0 % 99,618 1.486,200 3,45 0,3750 % LYSKE REALK. 17/24 MTN X51689868300 EUR 700 300 0 % 99,445 1.988,900,0 1,19 0,3750 % LAENSFOERSAEK. HYP 18/25 XS17499048704 EUR 1.000 0 0 % 99,878 89,788,00 1,21 0,3750 % LAENSFOERSAEK. HYP 18/25 XS174567931477 EUR <td>0,3750 % EIKA BOLIGKRED. 16/23 MTN</td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td>0</td> <td>%</td> <td></td> <td></td> <td></td>	0,3750 % EIKA BOLIGKRED. 16/23 MTN						0	%			
0.3750 % HCOB HPF S 2693 DE000HSH6K16 EUR 2.100 1.000 0 % 99,511 2.08,71,00 3.62 0,6250 % ING BELGIUM 18-25 MTN BE0002594720 EUR 700 700 0 % 99,511 2.089,731,00 1.18 0,2500 % ING-DIBA AG HPF 18/23 DE000A1KRUR4 EUR 1.500 600 0 % 99,088 1.486,320,00 2.58 0,2500 % ING-DIBA AG HPF 18/23 DE000A1KRUR4 EUR 2.000 0 0 % 99,088 1.486,320,00 2.58 0,3750 % JYSKE REALK. 17/24 MTN X51668866300 EUR 7.00 300 0 % 98,071 666,497,00 1,19 0,6250 % LAENSFOERSAEK.HYP 18/25 X51799048704 EUR 1.400 1.400 0 % 98,071 666,497,00 1,19 0,6250 % LAENSFOERSAEK.HYP 18/25 X51799048704 EUR 1.00 0 0 % 98,076 41,367,296,00 2,37 0,3750 W MUENCH.HYP BK, MTN-PF1839 DE000MH8241 EUR	0.3750 % HASPA PF.A.33 17/24					300	0				
0,6250 % ING BELGIUM 18-25 MTN BE0002594720 EUR 700 700 0 % 97,460 682.220,00 1,18 0,2500 % INC-DIBA AG HPF 18/23 DE000A1KRJR4 EUR 1,500 600 0 % 99,088 1,486.320,00 2,58 0,2500 % JYSKE REALK. 16/23 XS1435774903 EUR 2,000 0 % 99,445 1,988.900,00 3,45 0,3750 % JYSKE REALK. 16/24 MTN XS166986300 EUR 700 300 0 % 99,764 1,367.296,00 2,37 0,3750 % LB.HESSTHR. 18/24 XS1767931477 EUR 1,000 0 % 99,764 1,367.296,00 2,37 0,3750 % LB.HESSTHR. 18/24 XS1767931477 EUR 1,000 0 % 99,878 987.880,00 1,71 0,0100 % MUENCH.HYP BK. MTN-PF1839 DE000MHB24,14 EUR 900 900 0 % 99,951 890,559,00 1,54 1,8750 % NATL AUSTR. BK 12/23 MTN XS184636388 EUR 1,900 0 % 100,83											
0,2500 % ING-DIBA AG HPF 18/23 DE000A1KRJR4 EUR 1.500 600 0 % 99,088 1.486.320,00 2.58 0,2500 % JYSKE REALK. 16/23 XS1435774903 EUR 2.000 0 0 0 % 99,445 1.988.900,00 3.45 0,3750 % JYSKE REALK. 17/24 MTN XS1669866300 EUR 700 300 0 % 98,071 686.497,00 1,19 0,6250 % LAENSFOERSAEK. HYP 18/25 XS1799048704 EUR 1.400 1.400 0 % 97,664 1.367.296,00 2,37 0,3750 % LB. HESSTHR. 18/24 XS1767931477 EUR 1.000 0 0 % 98,788 987.88 0,000 1,54 1,8750 % NATL AUSTR. BK 12/23 MTN XS0864360358 EUR 1.900 900 0 0 % 98,951 1890.595.00 1,54 1,8750 % NATL AUSTR. BK 12/23 MTN XS0864360358 EUR 1.900 900 0 0 % 100,835 1.915.865,00 3,32 0,0100 % NORDLB MTN.HFF S.506 DE000DHY5066 EUR 2.000 0 0 0 % 199,952 799.616,00 3,47 0,3750 % OVERSCHIN.BKG.18/23 MTN XS18476933119 EUR 1.500 0 0 0 % 199,952 799.616,00 1,39 0,2500 % ROYAL BK CDA 18/23 MTN XS1847633119 EUR 1.500 0 0 0 0 % 199,449 1.193.388,00 2,07 0,6250 % SKAND.ENSK. 15/23 MTN XS1847633119 EUR 1.200 1.200 0 0 0 % 199,449 1.193.388,00 2,07 0,6250 % SKAND.ENSK. 15/23 MTN XS1847633119 EUR 1.500 0 0 0 0 % 199,449 1.193.388,00 2,07 0,6250 % SKAND.ENSK. 15/23 MTN XS1847633119 EUR 1.200 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0,000 0 0 0 0 0 0 0 0,000 0 0 0,000 0 0,000 0 0,00											
0.2500 % JYSKE REALK. 16/23 XS1435774903 EUR 2.000 0 % 99,445 1.988.900,00 3,45 0,3750 % JYSKE REALK. 17/24 MTN XS166986300 EUR 700 300 0 % 98,071 686.497,00 1,19 0,6250 % LAENSFOERSAEK.HYP 18/25 XS1799048704 EUR 1.400 1.400 0 % 97,664 1.367.296,00 2,37 0,3750 % LB.HESSTHR. 18/24 XS1767931477 EUR 1.000 0 0 % 98,788 987.880,00 1,71 0,0100 % MUENCH.HYP.BK. MTN-PF1839 DE000MHB24J4 EUR 900 900 0 % 98,578 987.880,00 1,71 1,8750 % NATL AUSTR. BK 12/23 MTN XS0864360358 EUR 1.900 0 0 % 100,835 1.915.865,00 3,32 0,9100 % NORDLB MTN-HYP S.506 DE000DHY5066 EUR 2.000 0 % 100,056 2.011.120,00 3,47 0,3750 % OVERSCHIN.BKG, 18/23 MTN XS1784059930 EUR 800 0	*** *** ** ** * * * * * * * * * * * * *										
0.3750 % JYSKE REALK. 17/24 MTN XS1669866300 EUR 700 300 0 % 98,071 686.497,00 1,19 0,6250 % LAENSFOERSAEK.HYP 18/25 XS1799048704 EUR 1.400 1.400 0 % 97,664 1.367.296,00 2,37 0,3750 % LB.HESSTHR. 18/24 XS1767931477 EUR 1.000 0 0 % 98,788 987,880,00 1,71 0,0100 % MUENCH.HYP.BK. MTN-PF1839 DE000MHB24J4 EUR 900 900 0 % 98,781 890,559,00 1,54 1,8750 % NATL AUSTR. BK 12/23 MTN XS0864360358 EUR 1.900 0 0 % 100,855 1.915,865,00 3,32 0,3750 % NORDLB MTN.HPF S.506 DE000DHY5066 EUR 2.000 0 0 % 100,056 2.001,120,00 3,47 0,3750 % OVERSCHIN.BKG.18/23 MTN XS1784059930 EUR 1.500 0 % 100,137 1.502,055,00 2.60 0,2500 % ROYAL BK CDA 18/23 MTN XS1847633119 EUR 1.200											
0,6250 % LAENSFOERSAEK.HYP 18/25 XS1799048704 EUR 1.400 1.400 0 % 97,664 1.367.296,00 2,37 0,3750 % LB.HESSTHR. 18/24 XS1767931477 EUR 1.000 0 % 98,788 987.880,00 1,71 0,0100 % MUENCH.HYP JK. MTN-PF1839 DE000MHB24J4 EUR 900 900 0 % 98,951 890,559,00 1,54 1,8750 % NATL AUSTR. BK 12/23 MTN XS08643600588 EUR 1.900 0 % 100,056 2.001,120,00 3,47 0,0100 % NORDLB MTN-HPF S.506 DE000DHY5066 EUR 2.000 0 % 100,056 2.001,120,00 3,47 0,3750 % OVERSCHIN.BKG.18/23 MTN XS1784059930 EUR 800 0 0 % 100,056 2.001,120,00 3,47 0,2500 % RUB STEIERMARK 16-23MTN 9 AT0008092622 EUR 1.500 0 % 100,137 1.502,055,00 2,60 0,2500 % SKAND.ENSK. 15/23 MTN XS1341450878 EUR 1.200 1.20 0 %											
0.3750 % LB.HESSTHR. 18/24 XS1767931477 EUR 1.000 0 % 98,788 987.880,00 1,71 0,0100 % MUENCH.HYP.BK. MTN-PF1839 DE000MHB24J4 EUR 900 900 0 % 98,951 890.559,00 1,54 1,8750 % NATL AUSTR. BK 12/23 MTN XS0864360358 EUR 1,900 0 0 % 100,855 1,915,865,00 3,32 0,0100 % NORDLB MTN.HPF S.506 DE00DHY5066 EUR 2.000 0 0 % 100,056 2.001,120,00 3,47 0,3750 % OVERSCHIIN.BKG.18/23 MTN XS1784059930 EUR 800 0 0 % 99,952 799,616,00 1,39 0,6250 % RLB STEIERMARK 16-23MTN 9 AT0008092622 EUR 1.500 0 0 % 100,137 1.502.055,00 2,60 0,2500 % SKAND.ENSK. 15/23 MTN XS134150878 EUR 1.200 1.200 0 % 99,449 1.193.388,00 2,07 0,3750 % SPAR.SOR BOLIGKR.18/23MTN XS134150878 EUR 2.000											
0,0100 % MUENCH.HYP.BK. MTN-PF1839 DE000MHB24J4 EUR 900 900 0 % 98,951 890.559,00 1,54 1,8750 % NATL AUSTR. BK 12/23 MTN XS0864360358 EUR 1,900 0 0 % 100,835 1,915,865,00 3,32 0,0100 % NORDLB MTN.HPF S.506 DE000DHY5066 EUR 2,000 0 0 % 100,056 2,001,120,00 3,47 0,3750 % OVERSCHIN.BKG.18/23 MTN XS1784059930 EUR 800 0 0 % 99,952 799,616,00 1,39 0,6250 % RLB STEIERMARK 16-23MTN 9 AT000B092622 EUR 1.500 0 0 % 99,952 799,616,00 1,39 0,2500 % ROYAL BK CDA 18/23 MTN XS1847633119 EUR 1.200 1.200 0 % 99,449 1.193,388,00 2,07 0,6250 % SKAND.ENSK. 15/23 MTN XS1314150878 EUR 700 0 0 % 99,449 1.193,388,00 2,07 0,3750 % SPAR.SOR BOLIGKR.18/23MTN XS131450878 EUR 700 0 0 % 99,972 1.999,440,00 1,22 0,3750 % SPAR.SOR BOLIGKR.18/23MTN XS1575786145 EUR 2,000 0 0 % 99,972 1.999,440,00 3,47 0,3750 % SPAR.EBK V BOLIG.17/24 MTN XS1565074744 EUR 500 0 0 0 % 98,732 493,660,00 0,86 0,1250 % SPAR.EBK V BOLIG.18/23 MTN XS184532865 EUR 1.100 0 0 0 % 99,771 1.097,481,00 1,90 0,000 % TORON.DOM.BK 19/24 MTN XS1890044728 EUR 600 600 0 % 99,771 1.097,481,00 1,90 0,000 % TORON.DOM.BK 19/24 MTN XS1800044728 EUR 600 600 600 0 % 98,169 589,014,00 1,02 1,8750 % UC-HVB PF 1832 DE000HY2AK00 EUR 1.050 500 0 600 % 101,137 1.061,938,50 1,84 0,7500 % UNICR.BK AUS.15-22 MTN AT00004598 EUR 1.000 0 600 % 100,189 1.001,880 1.01,880 0 1,74											
1,8750 % NATL AUSTR. BK 12/23 MTN X50864360358 EUR 1,900 0 0 % 100,835 1,915.865,00 3,32 0,0100 % NORDLB MTN.HPF 5,506 DE000DHY5066 EUR 2,000 0 0 % 100,656 2,001.120,00 3,47 0,3750 % OVERSCHIN.BKG,18/23 MTN X51784059930 EUR 800 0 0 % 199,952 799,616,00 1,39 0,6250 % RLB STEIERMARK 16-23MTN 9 AT0008092622 EUR 1.500 0 0 % 199,449 1.1502,055,00 2,60 0,2500 % ROYAL BK CDA 18/23 MTN X51847633119 EUR 1.200 1.20 0 % 199,449 1.193.388,00 2,07 0,6250 % SKANDL-BISK. 15/23 MTN X5134150878 EUR 700 0 0 % 199,449 1.193.388,00 2,07 0,6250 % SPARSOR BOLIGKR. 18/23 MTN X5175786145 EUR 700 0 0 % 199,972 1,99,440,00 3,47 0,3750 % SPAREBK V BOLIG. 18/23 MTN X516565074744 EUR<						-	-				
0,0100 % NORDLB MTN.HPF \$.506 DE000DHY5066 EUR 2.000 0 % 100,056 2.001.120,00 3,47 0,3750 % OVERSCHIN.BKG.18/23 MTN X\$1784059930 EUR 800 0 0 % 99,952 799.616,00 1,39 0,6250 % RLB STEIERMARK 16-23MTN 9 A7000B092622 EUR 1.500 0 0 % 100,137 1.502.055,00 2,60 0,2500 % ROYAL BK CDA 18/23 MTN X\$1847633119 EUR 1.200 1.20 0 % 109,49 1.193.388,00 2,07 0,6250 % SKANDL-BNSK, 15/23 MTN X\$134150878 EUR 700 0 % 100,183 701.281,00 1,22 0,3750 % SPAR.SOR BOLIGKR.18/23MTN X\$1775786145 EUR 2.000 0 % 99,972 1.999.440,00 3,47 0,3750 % SPAREBK V BOLIG.17/24 MTN X\$1585074744 EUR 500 0 % 98,732 493.660,00 0,86 0,1250 % SPAREBK V BOLIG.18/23 MTN X\$18864532865 EUR 1.100 0 % 99,771											
0,3750 % OVERSCHIN.BKG.18/23 MTN XS1784059930 EUR 800 0 % 99,952 799.616,00 1,39 0,6250 % RLB STEIERMARK 16-23MTN 9 AT0008092622 EUR 1.500 0 % 100,137 1.502.055,00 2,60 0,2500 % ROYAL BK CDA 18/23 MTN XS1847633119 EUR 1.200 1.20 0 % 99,492 1.193.388,00 2,07 0,6250 % SKAND.ENSK. 15/23 MTN XS1314150878 EUR 700 0 0 % 99,972 1.99440,00 3,47 0,3750 % SPAR.SOR BOLIGKR.18/23MTN XS1775786145 EUR 2.000 0 0 % 99,972 1.999.440,00 3,47 0,3750 % SPAREBK V BOLIG.17/24 MTN XS1565074744 EUR 500 0 0 % 98,732 493.660,00 0,86 0,1250 % SPAREBK V BOLIG.18/23 MTN XS1864532865 EUR 1.100 0 0 % 99,771 1.097.481,00 1,90 0,0000 % TORON.DOM.BK 19/24 MTN XS1980044728 EUR 600 600											
0,6250 % RLB STEIERMARK 16-23MTN 9 AT000B092622 EUR 1.500 0 0 % 100,137 1.502.055,00 2,60 0,2500 % ROYAL BK CDA 18/23 MTN X51847633119 EUR 1.200 1.200 0 % 89,449 1.193.388,00 2,07 0,6250 % SKAND.ENSK. 15/23 MTN X51314150878 EUR 700 0 0 % 190,448 701.281,00 1,22 0,3750 % SPAR.SOR BOLIGKR.18/23MTN X513775786145 EUR 2.00 0 0 % 99,972 1.999.440,00 3,47 0,3750 % SPAREBK V BOLIG.17/24 MTN X51565074744 EUR 500 0 0 % 98,732 493.660,00 0,86 0,1250 % SPAREBK V BOLIG.18/23 MTN X51864532865 EUR 1.100 0 0 % 99,771 1.097.481,00 1,90 0,0000 % TORON.DOM.BK 19/24 MTN X51980044728 EUR 600 600 0 % 98,769 589.014,00 1,90 1,8750 % UC-HVB PF 1832 DE000HV2AK00 EUR <td< td=""><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td></td<>											
0,2500 % ROYAL BK CDA 18/23 MTN X\$1847633119 EUR 1.200 1.200 0 % 99,449 1.193.388,00 2,07 0,6250 % SKAND.ENSK. 15/23 MTN X\$1314150878 EUR 700 0 0 % 100,183 701.281,00 1,22 0,3750 % SPAR.SOR BOLIGKR. 18/23MTN X\$1775786145 EUR 2.000 0 0 % 99,972 1,999,440,00 3,47 0,3750 % SPAREBK V BOLIG.17/24 MTN X\$1565074744 EUR 500 0 0 % 98,732 493,660,00 0,86 0,1250 % SPAREBK V BOLIG.18/23 MTN X\$1854532865 EUR 1.100 0 % 99,771 1.097.481,00 1,90 0,0000 % TORON.DOM.BK 19/24 MTN X\$1894044728 EUR 600 600 0 % 99,771 1.097.481,00 1,02 1,8750 % UC-HVB PF 1832 DE000HV2AK00 EUR 1.050 500 0 % 101,137 1.061,938,50 1,84 0,7500 % UNICR.BK AUS. 15-22 MTN AT0008049598 EUR 1.000											
0.6250 % SKAND.ENSK. 15/23 MTN XS1314150878 EUR 700 0 0 % 100,183 701.281,00 1,22 0,3750 % SPAR.SOR BOLIGKR.18/23MTN XS1775786145 EUR 2,000 0 0 % 99,972 1,999.440,00 3,47 0,3750 % SPAREBK V BOLIG.17/24 MTN XS1854532865 EUR 500 0 0 % 99,771 1,097.481,00 0,86 0,1250 % SPAREBK V BOLIG.18/23 MTN XS1854532865 EUR 1.100 0 0 % 99,771 1,097.481,00 1,90 0,0000 % TORON.DOM.BK 19/24 MTN XS1980044728 EUR 600 600 0 % 98,169 589.014,00 1,02 1,8750 % UC-HVB PF 1832 DE000HV2AK00 EUR 1.050 500 0 % 101,137 1.061,938,50 1,84 0,7500 % UNICR.BK AUS.15-22 MTN AT0008049598 EUR 1.000 600 % 100,189 1.001,890,00 1,74											
0.3750 % SPAR.SOR BOLIGKR.18/23MTN XS1775786145 EUR 2.000 0 0 % 99,972 1.999.440,00 3,47 0.3750 % SPAREBK V BOLIG.17/24 MTN XS1565074744 EUR 500 0 0 % 98,732 493.660,00 0,86 0,1250 % SPAREBK V BOLIG.18/23 MTN XS1864532865 EUR 1.100 0 0 % 99,771 1.097.481,00 1,90 0,000% TORON.DOM.BK 19/24 MTN XS1980044728 EUR 600 600 0 % 98,169 589.014,00 1,02 1,8750 % UC-HVB PF 1832 DE000HV2AK00 EUR 1.050 500 0 % 101,137 1.061,938,50 1,84 0,7500 % UNICR.BK AUS. 15-22 MTN AT000B049598 EUR 1.000 0 600 % 100,189 1.001,890,00 1,74							-				
0.3750 % SPAREBK V BOLIG.17/24 MTN XS1565074744 EUR 500 0 0 % 98,732 493.660,00 0,86 0.1250 % SPAREBK V BOLIG.18/23 MTN XS18854532865 EUR 1.100 0 0 % 99,771 1.097.481,00 1,90 0,0000 % TORON.DOM.BK 19/24 MTN XS1980044728 EUR 600 600 0 % 98,169 589.014,00 1,02 1,8750 % UC-HVB PF 1832 DE000HV2AK00 EUR 1.050 500 0 % 101,137 1.061,938,50 1,84 0,7500 % UNICR.BK AUS. 15-22 MTN AT0008049598 EUR 1.000 0 600 % 100,189 1.001,890,00 1,74						-	-				
0,1250 % SPAREBK V BOLIG 18/23 MTN XS1854532865 EUR 1.100 0 0 % 99,771 1.097.481,00 1,90 0,0000 % TORON.DOM.BK 19/24 MTN XS1980044728 EUR 600 600 0 % 98,169 589.014,00 1,02 1,8750 % UC-HVB PF 1832 DE000HV2AK00 EUR 1.050 500 0 % 101,137 1.061.938,50 1,84 0,7500 % UNICR.BK AUS. 15-22 MTN AT000B049598 EUR 1.000 0 600 % 100,189 1.001.890,00 1,74	-,						-				
0,0000 % TORON.DOM.BK 19/24 MTN XS1980044728 EUR 600 600 0 % 98,169 589,014,00 1,02 1,8750 % UC-HVB PF 1832 DE000HV2AK00 EUR 1.050 500 0 % 101,137 1.061,938,50 1,84 0,7500 % UNICR.BK AUS. 15-22 MTN AT000B049598 EUR 1.000 0 600 % 100,189 1.001.890,00 1,74											
1,8750 % UC-HVB PF 1832 DE000HV2AK00 EUR 1.050 500 0 % 101,137 1.061.938,50 1,84 0,7500 % UNICR.BK AUS. 15-22 MTN AT000B049598 EUR 1.000 0 600 % 100,189 1.001.890,00 1,74											
						500	0	%			
0.2500 % UTD OV. BK 18/23 MTN XS1877520194 EUR 1.000 0 0 % 99,072 990.720,00 1,72	0,7500 % UNICR.BK AUS. 15-22 MTN	AT000B049598		EUR	1.000	0	600	%	100,189	1.001.890,00	1,74
	0,2500 % UTD OV. BK 18/23 MTN	XS1877520194		EUR	1.000	0	0	%	99,072	990.720,00	1,72

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

Summe Verzinsliche Wertpapiere Summe Börsengehandelte Wertpapiere Summe Wertpapiervermögen					EUR EUR EUR		56.028.971,80 56.028.971,80 56.028.971,80	97,13 97,13 97,13
Derivate (Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen	handelt es sich um verkaut	fte Positioner))					
Aktienindex-Derivate Forderungen/ Verbindlichkeiten								
Aktienindex-Terminkontrakte								
CBOE VIX FUTURE Jul22 - 20.07.2022	FUXNF2007G22	CBO	USD	-47			-79.638,33	-0,14
EURO STOXX 50 Sep22 - 16.09.2022	DE000C5SKSC4	EDT	EUR	82			-72.027,50	-0,12
S&P500 EMINI FUT Sep22 - 16.09.2022	FESUN1609I22	NAR	USD	12			-64.482,15	-0,11
S&P500 EMINI FUT Sep22 - 16.09.2022	FESUN1609I22	NAR	USD	-81			-100.335,61	-0,17
Summe Aktienindex-Terminkontrakte					EUR		-316.483,59	-0,54
Optionsrechte								
Optionsrechte auf Aktienindex								
DJES 50 2700,000 22.07.15 P	DE000C6NYHA1	EDT		-222	EUR	0,900	-1.998,00	0,00
DJES 50 2900,000 22.07.15 P	DE000C6NYHS3	EDT		-193	EUR	2,400	-4.632,00	-0,01
DJES 50 3100,000 22.07.15 P	DE000C6M1KS9	EDT		-169	EUR	7,400	-12.506,00	-0,02
DJES 50 3300,000 22.07.15 P	DE000C6MAHN6	EDT		-149	EUR	30,200	-44.998,00	-0,08
DJES 50 3500,000 22.07.15 C	DE000C6MAJ33	EDT		-132	EUR	52,200	-68.904,00	-0,12
DJES 50 3700,000 22.07.15 C	DE000C6MAJK8	EDT		-118	EUR	6,200	-7.316,00	-0,01
DJES 50 3900,000 22.07.15 C	DE000C6MAK14	EDT		-107	EUR	0,700	-749,00	0,00
S&P 500 2900,000 22.07.22 P	PSPC2900LC22	NAE		-20	USD	1,825	-3.491,49	-0,01
S&P 500 3100,000 22.07.08 P	PSPC3100LA22	NAE		-19	USD	0,500	-908,74	0,00
S&P 500 3100,000 22.07.22 P	PSPC3100LC22	NAE		-17	USD	3,350	-5.447,68	-0,01
S&P 500 3300,000 22.07.01 P	PSPC3300EZ22	NAE		-17	USD	0,050	-81,31	0,00
S&P 500 3300,000 22.07.08 P	PSPC3300LA22	NAE		-17	USD	1,075	-1.748,13	0,00
S&P 500 3300,000 22.07.22 P	PSPC3300LC22	NAE		-15	USD	7,450	-10.689,69	-0,02
S&P 500 3500,000 22.07.01 P	PSPC3500EZ22	NAE		-15	USD	0,100	-143,49	0,00
S&P 500 3500,000 22.07.08 P	PSPC3500LA22	NAE		-15	USD	3,400	-4.878,52	-0,01
S&P 500 3500,000 22.07.22 P	PSPC3500LC22	NAE		-14	USD	22,200	-29.730,25	-0,05
S&P 500 3700,000 22.07.01 P	PSPC3700EZ22	NAE		-13	USD	2,750	-3.419,74	-0,01
S&P 500 3700,000 22.07.08 P	PSPC3700LA22	NAE		-13	USD	27,800	-34.570,50	-0,06
S&P 500 3700,000 22.07.22 P	PSPC3700LC22	NAE		-12	USD	65,900	-75.645,69	-0,13
S&P 500 3900,000 22.07.01 P	PSPC3900EZ22	NAE		-12	USD	119,700	-137.401,95	-0,24
S&P 500 3900,000 22.07.08 P	PSPC3900LA22	NAE		-12	USD	133,900	-153.701,93	-0,27
S&P 500 3900,000 22.07.22 C	CSPC3900LC22	NAE		-11	USD	41,350	-43.509,66	-0,08
S&P 500 4100,000 22.07.01 C	CSPC4100EZ22	NAE		-11	USD	0,050	-52,61	0,00
S&P 500 4100,000 22.07.08 P	PSPC4100LA22	NAE		-11	USD	321,550	-338.344,17	-0,59
S&P 500 4100,000 22.07.22 C	CSPC4100LC22	NAE		-10	USD	6,000	-5.739,43	-0,01
S&P 500 4300,000 22.07.01 C	CSPC4300EZ22	NAE		-10	USD	0,050	-47,83	0,00
S&P 500 4300,000 22.07.08 C	CSPC4300LA22	NAE		-10	USD	0,100	-95,66	0,00
S&P 500 4300,000 22.07.22 C	CSPC4300LC22	NAE		-9	USD	0,775	-667,21	0,00
S&P 500 4500,000 22.07.01 C	CSPC4500EZ22	NAE		-9	USD	0,050	-43,05	0,00
S&P 500 4500,000 22.07.08 C	CSPC4500LA22	NAE		-9	USD	0,050	-43,05	0,00
Summe Optionsrechte					EUR		-991.504,78	-1,72
Summe Aktienindex-Derivate					EUR		-1.307.988,37	-2,26

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

Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds

Ban	kαι	ıth	ab	en

EUR-Guthaben bei der Verwahrstelle						
Kreissparkasse Köln	EUR	1.298.716,53	%	100,000	1.298.716,53	2,25
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen						
Kreissparkasse Köln	USD	1.247.122,50	%	100,000	1.192.962,02	2,07
Summe Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen			EUR		1.192.962,02	2,07
Summe der Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds			EUR	2	2.491.678,55	4,32
Sonstige Vermögensgegenstände						
Zinsansprüche	EUR	209.070,95			209.070,95	0,36
Bezahlte Variation Margin Derivate	EUR	316.483,59			316.483,59	0,54
Summe Sonstige Vermögensgegenstände			EUR		525.554,54	0,90
Sonstige Verbindlichkeiten						
Verbindlichkeiten aus schwebenden Geschäften	EUR	-21.889,85			-21.889,85	-0,04
Kostenabgrenzungen	EUR	-27.436,65			-27.436,65	-0,05
Summe Sonstige Verbindlichkeiten			EUR		-49.326,50	-0,09
Fondsvermögen			EUR	57	.688.890,02	100,00
Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)			LOK	31	.000.030,02	97,13
Destand der Wertpapiere am Fondsvermogen (m. 70)						37,13
Umlaufende Anteile Klasse C			STK		553.910	
Anteilwert Klasse C			EUR		103,04	
			2011		. 50,04	
Umlaufende Anteile Klasse R			STK		6.431	
Anteilwert Klasse R			EUR		95,57	
			2011		,	

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Alle Vermögenswerte: Kurse bzw. Marktsätze per 30.06.2022 oder letztbekannte

Devisenkurs(e) bzw. Konversionsfaktor(en) (in Mengennotiz) per 30.06.2022

US-Dollar (USD) 1,04540 = 1 Euro (EUR)

Marktschlüssel

b) Terminbörsen

CBO Chicago CBOE Futures Exchanges

EDT EUREX

 NAE
 Chicago (CBOE)

 NAR
 Chicago Merc. Exch.

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

Halbjahresbericht für Lupus alpha Volatility Invest

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
Amtlich gehandelte Wertpapiere				
Verzinsliche Wertpapiere				
0,1250 % BD.LAENDER 50 LSA 16/23	DE000A2AASV2	EUR	1.500	1.500
0,2500 % BELFIUS BK 16/22 MTN	BE0002499748	EUR	0	500
1,7500 % DT.BANK MTH 12/22	DE000DB5DCN5	EUR	0	2.050
0,2000 % DT.PFBR.BANK PF.R.15250	DE000A13SWE6	EUR	0	1.500
0,1000 % HASPA PF.A.30 16/22	DE000A2AAPV8	EUR	0	1.000
0,2500 % HCOB HPF 18/22	DE000HSH6K32	EUR	0	2.000
0,3750 % HSBC SFH (FR) 15/22 MTN	FR0012602522	EUR	0	1.000
0,2500 % LAENSFOERSAEK.HYP 15/22	XS1222454032	EUR	0	550
0,3750 % LB.HESSTHR. OP.1637 MTN	DE000DXA1NW1	EUR	0	2.000
0,1250 % NORDLB MTN.HPF S.445	DE000DHY4457	EUR	0	2.000
0,1250 % SPAR.SOR BOLIGKR.17/22MTN	XS1622285283	EUR	0	1.350
0,2500 % TORONTO-DOM. BK 15/22	XS1223216497	EUR	0	1.800
0,1250 % UTD OV. BK 17/22 MTN	XS1571315917	EUR	0	500
0,2500 % WESTPAC SEC.NZ 17/22 MTN	XS1591674459	EUR	0	800

Halbjahresbericht für Lupus alpha Volatility Invest

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

Gattungbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Volumen in 1.000
Terminkontrakte		
Aktienindex-Terminkontrakte		
Gekaufte Kontrakte:	EUR	1.135.247
(Basiswert(e): CBOE Volatility Index (VIX), EURO STOXX 50, S&P 500) Verkaufte Kontrakte: (Basiswert(e): CBOE Volatility Index (VIX), EURO STOXX 50, S&P 500)	EUR	1.280.870
Zinsterminkontrakte Gekaufte Kontrakte:	EUR	574.911
(Basiswert(e): TN1) Verkaufte Kontrakte: (Basiswert(e): TN1) Optionsrechte	EUR	25.289
Optionsrechte auf Aktienindex-Derivate		
Optionsrechte auf Aktienindices		
Gekaufte Verkaufoptionen (Put):	EUR	190.769
(Basiswert(e): EURO STOXX 50, S&P 500) Verkaufte Kaufoptionen (Call):	EUR	1.733.110
(Basiswert(e): EURO STOXX 50, S&P 500) Verkaufte Verkaufoptionen (Put): (Basiswert(e): EURO STOXX 50, S&P 500)	EUR	6.614.974
Optionsrechte auf Zins-Derivate		
Optionsrechte auf Zinsterminkontrakte		
Verkaufte Kaufoptionen (Call):	EUR	6.926
(Basiswert(e): US 10YR NOTE (CBT)Jun20, US 10YR NOTE (CBT)Mar20) Verkaufte Verkaufoptionen (Put): (Basiswert(e): US 10YR NOTE (CBT)Jun20, US 10YR NOTE (CBT)Mar20)	EUR	3.003

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)

Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)

-2,26

Sonstige Angaben

Anteilwert Klasse C Umlaufende Anteile Klasse C

Anteilwert Klasse R
Umlaufende Anteile Klasse R
STK

EUR

STK

103.04

95 57

6.431.000

553.910,000

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 verfässliche 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 KACB 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 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.

In der ersten Jahreshälfte 2022 belasteten eine hohe Inflation sowie steigende Zinsen und hohe Rohstoff- bzw. Energiepreise (z.B. Öl und Gas) die globalen Finanzmärkte. Auslöser war neben der andauernden Covid-19-Pandemie der Angriff Russlands auf die Ukraine:

Ukraine-Krise

Die aufgrund des Einmarsches der russischen Truppen in die Ukraine weltweit beschlossenen Maßnahmen wie u.a. der Ausschluss Russlands aus dem SWIFT-System und weitere weitreichende Sanktionen gegen die russische Wirtschaft führten zu deutlichen Kursverlusten – vor allem an europäischen Börsen. Dadurch waren die Rahmenbedingungen der globalen Wirtschaft und an den Finanzmärkten von erhöhter Unsicherheit geprägt. Damit einher ging eine steigende Volatilität an den Finanzplätzen.

Da diese Rahmenbedingungen anhalten, könnte auch die zukünftige Wertentwicklung dieses Sondervermögens erhöhten Schwankungsrisiken ausgesetzt sein.

Covid-19-Pandemie

Das Jahr 2021 stand im Zeichen der wirtschaftlichen Erholung von den Folgen der Corona Pandemie und deren Nachwirkungen. Steigende Impfquoten und verbesserte Therapiemöglichkeiten standen neue Varianten des SARS COV 2-Virus gegenüber und schienen im Jahresverlauf ein wirksames Mittel zur Bekämpfung der Pandemie zu sein. Die sich dadurch wieder langsam erholende Weltwirtschaft wurde jedoch schnell vor neue Herausforderungen gestellt, da die globalen Lieferketten viel stärker als zunächst erwartet von der Pandemie und deren Folgen betroffen waren: Steigende Frachtraten, Lieferengpässe in verschiedenen Sektoren (z.B. in der Halbleiterindustrie oder bei diversen Rohstoffen) und immer wieder auftretende Lockdowns als Reaktion auf lokale Corona-Ausbrüche haben die globalen Warenströme aus dem Gleichgewicht gebracht. Diese Entwicklung und insbesondere die Lieferkettenproblematik hat auch in den ersten beiden Quartalen 2022 angehalten. Der Effekt wurde durch den Krieg in der Ukraine sogar verstärkt.

Auf der politischen Ebene bieten vor allem die aktuellen Spannungen zwischen Russland und der Ukraine sowie zwischen China und Taiwan weiteres Potenzial für Unsicherheit an den Märkten. Der Antritt der neuen Bundesregierung im Dezember schien keinen signifikanten Einfluss auf die Märkte zu haben.

Die Kapitalverwaltungsgesellschaft ergreift weiterhin alle als angemessen erachteten Maßnahmen, um die Anlegerinteressen bestmöglich zu schützen.

Frankfurt am Main, den 08.07.2022

Lupus alpha Investment GmbH

Michael Frick Geschäftsführer **Dr. Götz Albert** Geschäftsführer