



Halbjahresbericht

Lupus alpha CLO High Quality Invest

zum 31.05.2024

Lupus alpha

Halbjahresbericht für Lupus alpha CLO High Quality Invest

Vermögensübersicht zum 31.05.2024

Anlageschwerpunkte

Tagswert in EUR % Anteil am Fondsvermögen ¹⁾

Vermögensgegenstände

Asset Backed Securities	93.643.324,51	93,74
Irland	92.713.020,46	92,81
Niederlande	930.304,05	0,93
Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds	7.404.873,42	7,41
Sonstige Vermögensgegenstände	818.841,55	0,82
Sonstige Verbindlichkeiten	-1.966.960,61	-1,97
Fondsvermögen	99.900.078,87	100,00

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

Halbjahresbericht für Lupus alpha CLO High Quality Invest

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									
Verzinsliche Wertpapiere									
8,0440 % ALBAC. EU VI 24/37 FLR D	XS2747765100	7)	EUR	4.000	4.000	0	100,182	4.007.294,00	4,01
6,2910 % ARMALO I 21/34 FLR C	XS2333785850	7)	EUR	1.325	0	0	100,020	1.325.259,37	1,33
6,2260 % AURILO I 19/32 CRR	XS2041077939	7)	EUR	1.000	0	0	99,723	997.231,00	1,00
6,3060 % BAIN C. 19-1 19/32 FLR C	XS2075848601	7)	EUR	1.500	0	0	99,696	1.495.434,23	1,50
8,3910 % BAIN C.E.WH 24/38 FLR D	XS2772094467	7)	EUR	2.000	2.000	0	100,758	2.015.157,10	2,02
7,5320 % BAR.EO 15-1 22/35 D FLR	XS2425515082	7)	EUR	1.000	0	0	97,987	979.873,00	0,98
7,1060 % BAR.EO 18-2 18/31 D FLR	XS1857762717	7)	EUR	1.000	0	0	100,085	1.000.849,60	1,00
6,8560 % BAR.EO 19-1 22/34 FLR C-R	XS2445168409	7)	EUR	1.375	1.375	0	100,049	1.375.672,79	1,38
5,6470 % BAR.EO 20-1 21/34 FLR B-R	XS2401843540	7)	EUR	2.500	0	0	99,730	2.493.255,00	2,50
6,3060 % BAR.EO 21-2 21/34 FLR C	XS2369919209	7)	EUR	3.000	1.000	0	99,119	2.973.558,00	2,98
7,4640 % BAR.EO 21-3 22/34 FLR D	XS2409287443	7)	EUR	1.000	0	0	96,728	967.284,00	0,97
10,0950 % BARINGS 23-1 23/36FLR D	XS2583347013	7)	EUR	1.700	0	0	101,431	1.724.329,81	1,73
5,3970 % BBAM E.CLO I 21/34 FLR B1R	XS2344625558	7)	EUR	1.000	0	0	99,507	995.070,00	1,00
5,8470 % BLACK DIAM.17-2 17/32 C	XS1713075627	7)	EUR	1.000	0	0	100,015	1.000.151,35	1,00
8,9060 % BRIDGEP. V 23/36 FLR D	XS2661945100	7)	EUR	2.000	0	0	101,702	2.034.030,70	2,04
5,5560 % BRIDGEPOINT2 21/35 FLR	XS2352782432	7)	EUR	1.000	0	0	99,654	996.537,00	1,00
7,0080 % CAR.E.C. 18-2 18/31 FLR C	XS1852486403	7)	EUR	1.000	1.000	0	98,995	989.948,25	0,99
5,6420 % CARL.GL.15-1 20/33 A-2A-R	XS2109446133	7)	EUR	1.000	0	0	99,508	995.081,95	1,00
6,3060 % CARLYLE 16-2 21/34FLR BRR	XS2305604550	7)	EUR	1.000	0	0	98,841	988.413,35	0,99
5,4820 % CARLYLE G.M.14-3 18/32 BR	XS1751481752	7)	EUR	500	0	0	99,131	495.655,95	0,50
7,8420 % CONT.CLO VII 19/32 FLR D	XS2053879354	7)	EUR	1.000	0	0	100,063	1.000.631,80	1,00
6,0720 % CVC C.LF.XXI 21/34 C REGS	XS2370712635	7)	EUR	2.000	0	0	99,729	1.994.581,00	2,00
6,1820 % CVC CL.XXIII 22/36 FLR B1	XS2441239881	7)	EUR	2.000	0	0	100,073	2.001.452,70	2,00
6,9060 % CVCVIII 21/34 FLR REGS DR	XS2337070234	7)	EUR	1.000	0	0	98,545	985.453,00	0,99
7,2400 % DRYD.96 2021 22/35 FLR C	XS2471068044	7)	EUR	2.000	2.000	0	100,019	2.000.382,00	2,00
3,0000 % DRYDEN 32 14 18/31 C2R	XS1864912461	7)	EUR	1.000	0	0	93,030	930.304,05	0,93
6,7060 % DRYDEN 48-16 19/32 FLR C1R	XS2044128473	7)	EUR	1.500	0	0	99,820	1.497.306,75	1,50
6,2660 % EURO-GALAXY VI 18/31D FLR	XS1766837592	7)	EUR	1.000	0	0	99,708	997.079,00	1,00
6,7067 % FIDEL.GR.H. 24/37 FLR C	XS2778277199	7)	EUR	2.000	2.000	0	99,568	1.991.363,60	1,99
6,4560 % HARVEST XVIII 18/30 FLR D	XS1728822005	7)	EUR	1.000	0	0	98,332	983.317,85	0,98
7,1280 % ICG E.C.22-1 22/35 C FLR	XS2469129634	7)	EUR	1.000	1.000	0	100,205	1.002.048,35	1,00
8,4280 % ICG E.C.22-1 22/35 D FLR	XS2469129717	7)	EUR	1.000	0	0	100,232	1.002.317,85	1,00
6,3060 % ICGEOCLO21-1 21/34 C FLR	XS2369927566	7)	EUR	4.250	2.250	0	99,550	4.230.875,00	4,24
0,0000 % INV.CLO VIII 24/36 FLR C	XS2831015099		EUR	2.000	2.000	0	100,000	2.000.000,00	2,00
10,3060 % INV.EU.X 23/36 FLR D REGS	XS2631222671	7)	EUR	2.000	0	0	103,600	2.072.005,00	2,07

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

Halbjahresbericht für **SVOSK 2022 LK 4 OLW, QHVV**

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				
5,6860 % BRIDGEPOINT3 21/36 FLR B	XS2395173748	EUR	0	2.000
5,4060 % F.OAKS FD.II 21/34 FLR B1R	XS2346331122	EUR	0	2.000
8,3320 % FIDEL.GR.H. 22/36 FLR C	XS2511429396	EUR	0	1.300
5,8040 % HA.L.AEF18-1 18/31 C	XS1840845462	EUR	0	2.000
7,1060 % TORO EURO.CLO 4 17/30 DR	XS1639911012	EUR	0	1.000

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

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)		93,74
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)		0,00
Sonstige Angaben		
Anteilwert	EUR	105,75
Umlaufende Anteile	STK	944.669

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