

KAPITALVERWALTUNGSGESELLSCHAFT:



finccam Volatility Premium

HALBJAHRESBERICHT

ZUM 30. JUNI 2024

VERWAHRSTELLE:



ASSET MANAGEMENT UND VERTRIEB:



Halbjahresbericht finccam Volatility Premium

Vermögensübersicht zum 30.06.2024

Anlageschwerpunkte	Tageswert in EUR	% Anteil am Fondsvermögen
I. Vermögensgegenstände	407.121.654,49	100,18
1. Anleihen	387.541.147,20	95,36
< 1 Jahr	162.847.038,20	40,07
>= 1 Jahr bis < 3 Jahre	224.694.109,00	55,29
2. Derivate	-1.848.591,80	-0,45
3. Bankguthaben	16.544.714,00	4,07
4. Sonstige Vermögensgegenstände	4.884.385,09	1,20
II. Verbindlichkeiten	-732.373,04	-0,18
III. Fondsvermögen	406.389.281,45	100,00

Halbjahresbericht finccam Volatility Premium

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
Bestandspositionen							EUR	387.541.147,20	95,36
Börsengehandelte Wertpapiere							EUR	355.309.739,20	87,43
Verzinsliche Wertpapiere							EUR	355.309.739,20	87,43
0,8750 % Allianz Finance II B.V. EO-Med.-Term Notes 19(25/26)	DE000A2RWAX4		EUR	7.000	0	0	% 96,427	6.749.890,00	1,66
0,6250 % Baden-Württemberg, Land Landessch.v.2015(2025)	DE000A14JYT7		EUR	8.000	0	0	% 98,448	7.875.840,00	1,94
0,6250 % Baden-Württemberg, Land Landessch.v.2016(2026)	DE000A14JYZ4		EUR	4.000	0	0	% 96,047	3.841.880,00	0,95
3,0500 % Bank of Nova Scotia, The EO-M.-T. Mortg.Cov.Bds 22(24)	XS2550897651		EUR	2.500	0	0	% 99,791	2.494.775,00	0,61
2,9500 % Bayerische Landesbank HPF-MTN v.22(25)	DE000BLB9SK3		EUR	5.000	0	0	% 99,250	4.962.500,00	1,22
0,5500 % Bayerische Landesbank Öff.Pfandbr.v.15(24)	DE000BLB29P5		EUR	5.000	0	0	% 98,900	4.945.000,00	1,22
0,7500 % Bayerische Landesbank Öff.Pfandbr.v.16(26)	DE000BLB6JB7		EUR	5.000	5.000	0	% 96,040	4.802.000,00	1,18
0,2500 % BNG Bank N.V. EO-Medium-Term Notes 2015(25)	XS1227748214		EUR	12.000	12.000	0	% 97,390	11.686.800,00	2,88
1,6250 % BNP Paribas S.A. EO-Medium-Term Notes 2016(26)	XS1369250755		EUR	3.000	3.000	0	% 97,144	2.914.320,00	0,72
0,7500 % BPCE SFH EO-Med.-T.Obl.Fin.Hab.2018(26)	FR0013383346		EUR	2.000	2.000	0	% 94,328	1.886.560,00	0,46
0,0000 % Bundesrep.Deutschland Bundesobl.Ser.180 v.2019(24)	DE0001141802		EUR	4.000	0	0	% 99,018	3.960.720,00	0,97
2,2000 % Bundesrep.Deutschland Bundesschatzanw. v.22(24)	DE0001104909		EUR	23.000	0	0	% 99,494	22.883.620,00	5,63
2,8000 % Bundesrep.Deutschland Bundesschatzanw. v.23(25)	DE000BUJ22015		EUR	5.000	5.000	0	% 99,607	4.980.350,00	1,23
0,6250 % Coöperatieve Rabobank U.A. EO-Med.-Term Cov. Bds 2018(26)	XS1811812145		EUR	7.000	5.000	0	% 95,449	6.681.430,00	1,64
1,2500 % Coöperatieve Rabobank U.A. EO-Medium-Term Notes 2016(26)	XS1382784509		EUR	3.000	3.000	0	% 96,530	2.895.900,00	0,71
0,7500 % Council of Europe Developm.Bk EO-Medium-Term Notes 2015(25)	XS1243995641		EUR	1.292	0	0	% 97,560	1.260.475,20	0,31
3,2500 % Crédit Agricole Home Loan SFH EO-Med.-T.Obl.Fin.Hab.2023(26)	FR001400G5S8		EUR	7.000	7.000	0	% 100,015	7.001.050,00	1,72
0,6250 % Crédit Mutuel Home Loan SFH SA EO-Med.-T.Obl.Fin.Hab.2017(25)	FR0013236247		EUR	2.000	0	0	% 98,237	1.964.740,00	0,48
1,2500 % Dexia S.A. EO-Medium-Term Notes 2014(24)	XS1143093976		EUR	6.700	0	0	% 99,030	6.635.010,00	1,63
1,6250 % DNB Bank ASA EO-FLR Preferred MTN 22(25/26)	XS2486092492		EUR	7.100	5.100	0	% 98,145	6.968.295,00	1,71
0,3750 % DZ HYP AG MTN-Hyp.Pfbr.1187 16(26) [DG]	DE000A14KKM9		EUR	5.000	0	0	% 95,035	4.751.750,00	1,17
0,5000 % DZ HYP AG MTN-Hyp.Pfbr.1189 17(26) [DG]	DE000A2AAW53		EUR	2.000	2.000	0	% 94,082	1.881.640,00	0,46
2,1250 % DZ HYP AG MTN-Hyp.Pfbr.1250 22(24)	DE000A3MQUV7		EUR	7.500	0	0	% 99,578	7.468.350,00	1,84
0,4000 % Europ.Fin.Stab.Facility (EFSF) EO-Medium-Term Notes 2018(25)	EU000A1G0D62		EUR	10.000	0	0	% 98,113	9.811.300,00	2,41
0,4000 % Europ.Fin.Stab.Facility (EFSF) EO-Medium-Term Notes 2019(26)	EU000A1G0EB6		EUR	10.000	7.000	0	% 95,878	9.587.800,00	2,36
0,8000 % Europäische Union EO-Med.-Term Nts 2022(25)	EU000A3K4DJ5		EUR	10.000	0	0	% 97,538	9.753.800,00	2,40
2,8750 % Europäische Union EO-Medium-Term Notes 2010(25)	EU000A1A2KZ4		EUR	4.000	4.000	0	% 99,482	3.979.280,00	0,98
0,5000 % Europäische Union EO-Medium-Term Notes 2018(25)	EU000A19VVY6		EUR	5.000	0	0	% 97,916	4.895.800,00	1,20
1,0000 % Europäischer Stabilitäts.(ESM) EO-Medium-Term Notes 2015(25)	EU000A1U9894		EUR	5.000	5.000	0	% 97,367	4.868.350,00	1,20
0,5000 % Europäischer Stabilitäts.(ESM) EO-Medium-Term Notes 2016(26)	EU000A1U9944		EUR	7.000	7.000	0	% 95,861	6.710.270,00	1,65

Halbjahresbericht finccam Volatility Premium

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
0,1250 % European Investment Bank EO-Medium-Term Notes 2015(25)	XS1207449684		EUR	5.000	0	0 %	97,554	4.877.700,00	1,20
1,7500 % Frankreich EO-OAT 2014(24)	FR0011962398		EUR	10.000	0	0 %	99,280	9.928.000,00	2,44
0,2500 % Hessen, Land Schatzanw. S.1512 v.2015(2025)	DE000A1RQCP0		EUR	5.000	5.000	0 %	97,110	4.855.500,00	1,19
2,7500 % ING Bank N.V. EO-M.-T. Mortg.Cov.Bds 22(25)	XS2557551889		EUR	5.000	0	0 %	99,215	4.960.750,00	1,22
3,0000 % ING Bank N.V. EO-M.-T. Mortg.Cov.Bds 23(26)	XS2585966257		EUR	10.100	7.000	0 %	99,493	10.048.793,00	2,47
0,3750 % Kreditanst.f.Wiederaufbau Anl.v.2016 (2026)	DE000A168Y55		EUR	2.000	2.000	0 %	95,598	1.911.960,00	0,47
0,1250 % Kreditanst.f.Wiederaufbau Anl.v.2017 (2024)	DE000A2DAJ57		EUR	3.000	0	0 %	99,125	2.973.750,00	0,73
0,3750 % Landesbank Baden-Württemberg MTN-Hyp.Pfandbr.v.17(25)	DE000LB1DSM2		EUR	10.000	0	0 %	97,918	9.791.800,00	2,41
2,8750 % Landesbank Baden-Württemberg MTN-Pfandbr.Ser.834 v.23(26)	DE000LB384E5		EUR	5.000	5.000	0 %	99,315	4.965.750,00	1,22
0,2500 % Landwirtschaftliche Rentenbank Med.T.Nts. v.17(24)	XS1564325550		EUR	9.000	0	0 %	99,880	8.989.200,00	2,21
0,0000 % Lb.Hessen-Thüringen GZ MTN HPF S.H335 v.19(24)	XS2022037795		EUR	5.000	0	0 %	100,000	5.000.000,00	1,23
2,3750 % Lb.Hessen-Thüringen GZ MTN HPF S.H357 v.22(26)	XS2536375368		EUR	5.000	5.000	0 %	98,205	4.910.250,00	1,21
2,1250 % LfA Förderbank Bayern Inh.-Schv.R.1206 v.22(26)	DE000LFA2063		EUR	3.000	3.000	0 %	98,050	2.941.500,00	0,72
2,7500 % Münchener Hypothekenbank MTN-HPF Ser.2017 v.23(25)	DE000MHB33J5		EUR	8.000	3.000	0 %	99,239	7.939.120,00	1,95
0,5000 % Niedersachsen, Land Landessch.v.16(26) Ausg.863	DE000A2AAWN1		EUR	2.000	2.000	0 %	95,097	1.901.940,00	0,47
0,3750 % Niedersachsen, Land Landessch.v.18(26) Ausg.878	DE000A2G9G15		EUR	5.000	5.000	0 %	95,800	4.790.000,00	1,18
0,0100 % Niedersachsen, Land Landessch.v.21(26) Ausg.903	DE000A3H2499		EUR	8.000	8.000	0 %	94,795	7.583.600,00	1,87
0,0100 % Norddeutsche Landesbank -GZ- MTN-Pfbr.v.21(2026)	DE000NLB3UX1		EUR	7.000	7.000	0 %	93,064	6.514.480,00	1,60
1,2500 % Nordrhein-Westfalen, Land Landessch.v.14(25) R.1325	DE000NRW0FU3		EUR	5.000	0	0 %	98,461	4.923.050,00	1,21
0,6250 % NRW.BANK Inh.-Schv.A.17G v.16(26)	DE000NWB17G1		EUR	3.000	3.000	0 %	95,882	2.876.460,00	0,71
2,8750 % NRW.BANK Inh.-Schv.A.1W2 v.23(25)	DE000NWB1W28		EUR	5.000	0	0 %	99,529	4.976.450,00	1,22
0,2500 % Oesterreichische Kontrollbk AG EO-Medium-Term Notes 2017(24)	XS1689595830		EUR	3.000	0	0 %	99,190	2.975.700,00	0,73
0,7500 % Rheinland-Pfalz, Land Landessch.v.2016 (2026)	DE000RLP0728		EUR	6.000	6.000	0 %	96,264	5.775.840,00	1,42
3,2500 % Rheinland-Pfalz, Land Landessch.v.2024 (2026)	DE000RLP1502		EUR	6.000	6.000	0 %	100,180	6.010.800,00	1,48
0,0500 % Royal Bank of Canada EO-M.-T. Mortg.Cov.Bds 19(26)	XS2014288315		EUR	2.000	2.000	0 %	93,856	1.877.120,00	0,46
0,1250 % Royal Bank of Canada EO-M.-T.Mortg.Cov.Bds 2020(25)	XS2143036718		EUR	5.000	0	0 %	97,687	4.884.350,00	1,20
0,6250 % Royal Bank of Canada EO-M.-T.Mortg.Cov.Bds 2022(26)	XS2460043743		EUR	2.000	2.000	0 %	95,548	1.910.960,00	0,47
0,5000 % Schleswig-Holstein, Land Landesschatzanw.v.16(26) A.1	DE000SHFM527		EUR	5.000	5.000	0 %	95,178	4.758.900,00	1,17
0,2500 % Schleswig-Holstein, Land Landesschatzanw.v.19(26) A.1	DE000SHFM667		EUR	1.000	1.000	0 %	95,280	952.800,00	0,23
3,0000 % Société Générale SFH S.A. EO-M.-T. Obl.Fin.Hab. 2022(25)	FR001400DHZ5		EUR	3.000	0	0 %	99,566	2.986.980,00	0,74
3,2500 % Svensk Exportkredit, AB EO-Medium-Term Notes 2023(26)	XS2610235801		EUR	4.500	0	0 %	99,899	4.495.455,00	1,11
1,7070 % Toronto-Dominion Bank, The EO-Med.-Term Cov.Bds 2022(25)	XS2508690612		EUR	4.400	0	0 %	98,239	4.322.516,00	1,06
3,2500 % Toronto-Dominion Bank, The EO-Med.-Term Cov.Bds 2022(26)	XS2549702475		EUR	2.000	2.000	0 %	99,878	1.997.560,00	0,49
0,0100 % UBS AG EO-Medium-Term Nts 2021(26)	XS2326546434		EUR	7.000	7.000	0 %	94,113	6.587.910,00	1,62
3,7030 % Westpac Banking Corp. EO-Medium-Term Notes 2023(26)	XS2575952853		EUR	7.000	2.000	0 %	100,190	7.013.300,00	1,73

Halbjahresbericht finccam Volatility Premium

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
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere							EUR	32.231.408,00	7,93
Verzinsliche Wertpapiere							EUR	32.231.408,00	7,93
0,0000 % Apple Inc. EO-Notes 2019(19/25)	XS2079716853		EUR	5.000	5.000	0 %	95,581	4.779.050,00	1,18
0,8750 % Nestlé Holdings Inc. EO-Medium-Term Notes 17(17/25)	XS1648298559		EUR	6.000	0	0 %	97,358	5.841.480,00	1,44
0,6250 % Ontario, Provinz EO-Medium-Term Notes 2018(25)	XS1807430811		EUR	5.500	0	0 %	97,724	5.374.820,00	1,32
0,8750 % Quebec, Provinz EO-Medium-Term Notes 2015(25)	XS1167203881		EUR	2.470	0	0 %	98,540	2.433.938,00	0,60
1,1250 % Quebec, Provinz EO-Medium-Term Notes 2015(25)	XS1311586967		EUR	3.000	0	0 %	97,117	2.913.510,00	0,72
3,7500 % Svenska Handelsbanken AB EO-Preferred MTN 2023(26)	XS2618499177		EUR	7.000	7.000	0 %	100,491	7.034.370,00	1,73
1,5000 % UBS AG EO-Medium-Term Notes 2016(26)	XS1392459381		EUR	4.000	4.000	0 %	96,356	3.854.240,00	0,95
Summe Wertpapiervermögen							EUR	387.541.147,20	95,36

Halbjahresbericht finccam Volatility Premium

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
Derivate							EUR	-1.848.591,80	-0,45
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)									
Aktienindex-Derivate							EUR	63.938,97	0,02
Forderungen/Verbindlichkeiten									
Optionsrechte							EUR	63.938,97	0,02
Optionsrechte auf Aktienindex-Terminkontrakte							EUR	63.938,97	0,02
CBOE VOLATIL. IND. CALL 17.07.24 BP 35,00 CBOE		361	Anzahl	15600			USD 0,080	1.164,61	0,00
CBOE VOLATIL. IND. CALL 17.07.24 BP 36,00 CBOE		361	Anzahl	122900			USD 0,075	8.601,62	0,00
CBOE VOLATIL. IND. CALL 17.07.24 BP 37,00 CBOE		361	Anzahl	27700			USD 0,070	1.809,44	0,00
CBOE VOLATIL. IND. CALL 17.07.24 BP 39,00 CBOE		361	Anzahl	93500			USD 0,065	5.671,43	0,00
CBOE VOLATIL. IND. CALL 17.07.24 BP 40,00 CBOE		361	Anzahl	82600			USD 0,060	4.624,86	0,00
CBOE VOLATIL. IND. CALL 17.07.24 BP 45,00 CBOE		361	Anzahl	228600			USD 0,045	9.599,66	0,00
CBOE VOLATIL. IND. CALL 17.07.24 BP 50,00 CBOE		361	Anzahl	223900			USD 0,035	7.312,90	0,00
CBOE VOLATIL. IND. CALL 21.08.24 BP 50,00 CBOE		361	Anzahl	15900			USD 0,145	2.151,46	0,00
CBOE VOLATIL. IND. CALL 21.08.24 BP 55,00 CBOE		361	Anzahl	197200			USD 0,125	23.002,99	0,01
Swaps							EUR	-1.912.530,77	-0,47
Forderungen/Verbindlichkeiten									
Total Return Swaps							EUR	-915.950,19	-0,23
Long Swap auf Rohstoff Index 28.03.24/28.03.25		OTC	USD	220.000.000				-892.490,48	-0,22
Long Swap auf Rohstoff Index 28.05.24/28.05.25		OTC	USD	40.021.118				-23.459,71	-0,01
Varianz Swaps							EUR	-996.580,58	-0,25
Short Varianz Swap 03.06.24/19.07.24		OTC	EUR	35.000				-223.131,73	-0,05
Short Varianz Swap 05.06.24/19.07.24		OTC	EUR	47.000				-261.315,93	-0,06
Short Varianz Swap 10.06.24/19.07.24		OTC	EUR	58.000				-326.596,18	-0,08
Short Varianz Swap 12.06.24/19.07.24		OTC	EUR	61.000				-280.720,58	-0,07

Halbjahresbericht finccam Volatility Premium

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
Short Varianz Swap 22.05.24/19.07.24		OTC	EUR	25.000				-140.391,92	-0,03
Short Varianz Swap 27.05.24/19.07.24		OTC	EUR	20.000				-125.290,38	-0,03
Short Varianz Swap 29.05.24/19.07.24		OTC	EUR	43.000				-215.828,94	-0,05
Short Varianz Swap 03.06.24/19.07.24		OTC	USD	28.000				60.127,51	0,01
Short Varianz Swap 05.06.24/19.07.24		OTC	USD	26.000				63.534,12	0,02
Short Varianz Swap 10.06.24/19.07.24		OTC	USD	25.000				49.385,36	0,01
Short Varianz Swap 12.06.24/19.07.24		OTC	USD	24.000				35.274,28	0,01
Short Varianz Swap 17.06.24/19.07.24		OTC	USD	24.000				38.715,22	0,01
Short Varianz Swap 20.06.24/19.07.24		OTC	USD	13.000				15.140,57	0,00
Short Varianz Swap 24.05.24/19.07.24		OTC	USD	35.000				82.558,56	0,02
Short Varianz Swap 24.06.24/16.08.24		OTC	USD	59.000				10.625,94	0,00
Short Varianz Swap 26.06.24/16.08.24		OTC	USD	18.000				-13.137,52	0,00
Short Varianz Swap 29.05.24/19.07.24		OTC	USD	83.000				234.471,04	0,06

Halbjahresbericht finccam Volatility Premium

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
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds							EUR	16.544.714,00	4,07
Bankguthaben							EUR	16.544.714,00	4,07
EUR - Guthaben bei:									
State Street Bank International GmbH			EUR	9.495.887,44			% 100,000	9.495.887,44	2,34
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen bei:									
State Street Bank International GmbH			CHF	840,00			% 100,000	872,55	0,00
State Street Bank International GmbH			USD	7.552.587,52			% 100,000	7.047.954,01	1,73
Sonstige Vermögensgegenstände							EUR	4.884.385,09	1,20
Zinsansprüche			EUR	2.464.385,09				2.464.385,09	0,61
Forderungen aus Cash Collateral			EUR	2.420.000,00				2.420.000,00	0,60
Sonstige Verbindlichkeiten							EUR	-732.373,04	-0,18
Verwaltungsvergütung			EUR	-672.136,78				-672.136,78	-0,17
Verwahrstellenvergütung			EUR	-39.352,43				-39.352,43	-0,01
Lagerstellenkosten			EUR	-5.295,50				-5.295,50	0,00
Prüfungskosten			EUR	-15.093,89				-15.093,89	0,00
Veröffentlichungskosten			EUR	-494,44				-494,44	0,00
Fondsvermögen							EUR	406.389.281,45	100,00 1)

Halbjahresbericht finccam Volatility Premium

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
finccam Volatility Premium AK I									
Anteilwert							EUR	116,46	
Ausgabepreis							EUR	116,46	
Rücknahmepreis							EUR	116,46	
Anzahl Anteile							STK	3.489.499	

Fußnoten:

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

Halbjahresbericht finccam Volatility Premium

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

361 Chicago - CBOE Opt. Ex.

OTC Over-the-Counter

Halbjahresbericht finccam Volatility Premium

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
Börsengehandelte Wertpapiere					
Verzinsliche Wertpapiere					
0,2500 % BNG Bank N.V. EO-Med.-T.Notes 2016(24) Reg.S	XS1428771809	EUR	0	11.250	
0,6250 % Dexia S.A. EO-Medium-Term Notes 2017(24)	XS1559352437	EUR	0	7.000	
0,1250 % Europäischer Stabilitäts.(ESM) EO-Medium-Term Notes 2016(24)	EU000A1U9951	EUR	0	5.000	
Nichtnotierte Wertpapiere *)					
Verzinsliche Wertpapiere					
0,1250 % Aareal Bank AG MTN-HPF.S.226 v.2019(2024)	DE000AAR0249	EUR	0	5.000	
2,3750 % Cais. d'Amort.de la Dette Soc. EO-Medium-Term Notes 2013(24)	FR0011521319	EUR	0	10.000	
0,0500 % Cie de Financement Foncier EO-Med.-T. Obl.Fonc. 2020(24)	FR0013507365	EUR	0	5.000	
2,9000 % Crédit Agricole S.A. EO-Obligations 2014(24)	FR0011780808	EUR	0	9.200	
0,6250 % DNB Boligkreditt A.S. EO-Mortg. Covered MTN 2015(24)	XS1193287304	EUR	0	4.500	
0,1000 % DZ BANK AG Deut.Zentral-Gen. MTN-IHS C328 DZ Br.v.22(24)	DE000DFK0PJ5	EUR	0	4.000	
0,2000 % Europ.Fin.Stab.Facility (EFSF) EO-Medium-Term Notes 2018(24)	EU000A1G0EA8	EUR	0	5.000	
0,0000 % Europ.Fin.Stab.Facility (EFSF) EO-Medium-Term Notes 2019(24)	EU000A1G0EC4	EUR	0	5.000	
0,5000 % HYPO TIROL BANK AG EO-Med.-T.Hyp.Pf.-Br. 2017(24)	AT0000A1W509	EUR	0	7.000	
1,5000 % Kreditanst.f.Wiederaufbau Anl.v.2014 (2024)	DE000A1R0709	EUR	0	16.000	
2,1250 % Niedersachsen, Land Landessch.v.14(24) Ausg.841	DE000A1YC244	EUR	0	3.000	
0,7500 % PKO Bank Hipoteczny S.A. EO-Mortg. Covered MTN 2018(24)	XS1795407979	EUR	0	5.000	
0,0100 % Rheinland-Pfalz, Land Landessch.v.2022 (2024)	DE000RLP1346	EUR	0	7.000	
0,0000 % Toronto-Dominion Bank, The EO-Med.-Term Cov.Bds 2019(24)	XS1980044728	EUR	0	10.000	
0,2500 % Vseobecná úverová Banka AS EO-Med.-T.Mortg.Cov.Bds 19(24)	SK4120015108	EUR	0	8.000	
0,1250 % Yorkshire Building Society EO-Med.-Term Cov. Bds 2019(24)	XS1991186500	EUR	0	5.000	

**Halbjahresbericht
finccam Volatility Premium**

**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

Devisenterminkontrakte (Verkauf)

Verkauf von Devisen auf Termin:
USD/EUR

EUR

3.683

Optionsrechte

Optionsrechte auf Aktienindex-Derivate

Optionsrechte auf Aktienindices

Gekaufte Kaufoptionen (Call):
(Basiswert(e): CBOE VOLATILITY)

EUR

1.014,62

Halbjahresbericht finccam Volatility Premium

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)	95,36
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)	-0,45

Sonstige Angaben

finccam Volatility Premium AK I

Anteilwert	EUR	116,46
Ausgabepreis	EUR	116,46
Rücknahmepreis	EUR	116,46
Anzahl Anteile	STK	3.489.499

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.

Halbjahresbericht finccam Volatility Premium

Zusätzliche Anhangsangaben gemäß der Verordnung (EU) 2015/2365 betreffend Wertpapierfinanzierungsgeschäfte

Angaben zu Wertpapierfinanzierungsgeschäften

Total Return Swaps

Marktwert der Total Return Swaps

absolut	EUR	-1.912.530,77
in % des Fondsvermögens		-0,47

Größte Gegenpartei(en) von Total Return Swaps

Rang	Name	Bruttovolumen der offenen Geschäfte in EUR	Sitzstaat
1	Citigroup Global Markets Europe AG (G) (V) - Frankfurt	205.300.485,26	Bundesrep. Deutschland
2	Societe Generale SA (GD), Paris (V)	82.000,00	Frankreich
3	UBS AG (GD) London (V)	61.000,00	Schweiz
4	Goldman Sachs Bank Europe SE (G) (V) - Frankfurt	58.000,00	Bundesrep. Deutschland
5	Barclays Bank Ireland PLC (G) (V) - Dublin	22.396,42	Irland
6	UniCredit Bank AG (G) München (V)	22.396,42	Bundesrep. Deutschland

Total Return Swaps gegliedert nach Restlaufzeit

Laufzeitband	Bruttovolumen in EUR
< 1 Tag	0,00
>= 1 Tag bis < 1 Woche	0,00
>= 1 Woche bis < 1 Monat	529.761,48
>= 1 Monat bis < 3 Monate	71.855,17
>= 3 Monate bis < 1 Jahr	242.647.552,97
>= 1 Jahr	0,00
unbefristet	0,00

Sicherheiten in Zusammenhang mit Total Return Swaps

Der Transfer von Sicherheiten zwischen dem Fonds und den Kontrahenten der Total Return Swaps basiert auf den im Besicherungsanhang zur Mantelvereinbarung für Finanzgeschäfte getroffenen Vereinbarungen mit dem jeweiligen Kontrahenten. Die Besicherung erfolgt genettet für alle OTC-Derivate des Fonds/Segments gegenüber einem Kontrahenten und nicht nur für Total Return Swaps. Die erforderliche Besicherung wird laufend auf Grundlage der Marktwerte der offenen Geschäfte überwacht.

Die Total Return Swaps im Bestand zum Stichtag wurden mit den Kontrahenten Citigroup Global Markets Europe AG (G) (V) - Frankfurt abgeschlossen.

Mit dem Kontrahenten Citigroup Global Markets Europe AG (G) (V) - Frankfurt wurde ein Minimumtransferbetrag in Höhe von € 250.000 sowie eine Rundung der Sicherheiten auf € 10.000 vereinbart.

Folgende Instrumente können als Sicherheit dienen:

- EUR-Cash zu einem Anrechnungssatz von 100%

Zusätzliche Anhangsangaben gemäß der Verordnung (EU) 2015/2365 betreffend Wertpapierfinanzierungsgeschäfte

Angaben zur Weiterverwendung von Sicherheiten

Die durch den Fonds erhaltenen Sicherheiten werden nicht wiederangelegt.

Frankfurt am Main, den 1. Juli 2024

Universal-Investment-Gesellschaft mbH
Die Geschäftsführung

Halbjahresbericht finccam Volatility Premium

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

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

State Street Bank International GmbH

Hausanschrift:

Brienner Straße 59
80333 München

Postanschrift:

Postfach 20 19 16
80019 München

Telefon: 089 / 55878 00
Telefax: 089 / 55878 460
www.statestreet.com

Rechtsform: Gesellschaft mit beschränkter Haftung
Haftendes Eigenkapital: Mio. € 2.627 (Stand: 31.12.2021)

3. Asset Management-Gesellschaft und Vertrieb

finccam investment GmbH

Postanschrift:

Ganghoferstraße 70
80339 München

Telefon +49 89 2153 8490
www.finccam.com

WKN / ISIN: A2JQK1/DE000A2JQK19