

KAPITALVERWALTUNGSGESELLSCHAFT:



7orca Vega Return

HALBJAHRESBERICHT

ZUM 30. JUNI 2022

VERWAHRSTELLE:



ASSET MANAGEMENT UND VERTRIEB:



Halbjahresbericht 7orca Vega Return

Vermögensübersicht zum 30.06.2022

Anlageschwerpunkte	Tageswert in EUR	% Anteil am Fondsvermögen
I. Vermögensgegenstände	141.960.883,32	100,21
1. Anleihen	105.447.801,00	74,44
< 1 Jahr	39.689.331,00	28,02
>= 1 Jahr bis < 3 Jahre	62.397.945,00	44,05
>= 3 Jahre bis < 5 Jahre	3.360.525,00	2,37
2. Derivate	-5.800.197,70	-4,09
3. Bankguthaben	4.253.259,74	3,00
4. Geldmarktfonds	11.055.840,00	7,80
5. Sonstige Vermögensgegenstände	27.004.180,28	19,06
II. Verbindlichkeiten	-301.092,97	-0,21
III. Fondsvermögen	141.659.790,35	100,00

Halbjahresbericht 7orca Vega Return

Vermögensaufstellung zum 30.06.2022

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2022	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Bestandspositionen							EUR	105.447.801,00	74,44
Börsengehandelte Wertpapiere							EUR	101.108.301,00	71,37
Verzinsliche Wertpapiere							EUR	101.108.301,00	71,37
0,1250 % Aareal Bank AG MTN-HPF.S.226 v.2019(2024)	DE000AAR0249		EUR	1.000	0	0 %	98,387	983.870,00	0,69
0,5000 % Agence Française Développement EO-Medium-Term Notes 2015(22)	XS1326536155		EUR	1.000	0	0 %	100,129	1.001.290,00	0,71
0,3750 % Aktia Bank PLC EO-Cov. Med.-Term Nts 2018(23)	XS1827629384		EUR	1.000	0	0 %	99,725	997.250,00	0,70
0,3750 % Arkéa Home Loans SFH S.A. EO-Mortg. Cov. MTN 2018(24)	FR0013375797		EUR	1.000	1.000	0 %	98,619	986.190,00	0,70
0,2500 % Australia & N. Z. Bkg Grp Ltd. EO-Med.-Term Cov. Bds 2022(25)	XS2456253082		EUR	2.000	2.000	0 %	96,652	1.933.040,00	1,36
0,6250 % Banco BPM S.p.A. EO-Med.-Term Cov. Bds 2016(23)	IT0005199465		EUR	2.000	0	0 %	99,747	1.994.940,00	1,41
0,7500 % Banco Santander S.A. EO-Cédulas Hipotec. 2015(22)	ES0413900384		EUR	800	0	0 %	100,183	801.464,00	0,57
1,0000 % Banco Santander S.A. EO-Cédulas Hipotec. 2015(25)	ES0413790397		EUR	2.000	0	0 %	98,494	1.969.880,00	1,39
0,2000 % Bank of Montreal EO-M.-T. Mortg.Cov.Bds 17(23)	XS1706963284		EUR	1.000	0	0 %	99,946	999.460,00	0,71
0,3750 % Bank of Nova Scotia, The EO-M.-T. Mortg.Cov.Bds 16(23)	XS1377941106		EUR	1.000	0	0 %	99,942	999.420,00	0,71
0,2500 % Bank of Nova Scotia, The EO-M.-T. Mortg.Cov.Bds 18(22)	XS1799545758		EUR	2.000	0	0 %	100,120	2.002.400,00	1,41
0,0100 % Bank of Nova Scotia, The EO-M.-T. Mortg.Cov.Bds 20(25)	XS2138444661		EUR	2.000	0	0 %	95,994	1.919.880,00	1,36
0,5000 % Bank of Queensland Ltd. EO-M.-T. Mortg.Cov.Bds 17(22)	XS1640827843		EUR	1.300	0	0 %	100,013	1.300.169,00	0,92
0,2500 % Berlin Hyp AG Hyp.-Pfandbr. v.18(23) Ser.209	DE000BHY0150		EUR	1.500	0	0 %	99,632	1.494.480,00	1,05
0,3980 % BPCE SFH EO-Med.-T.Obl.Fin.Hab.2015(25)	FR0012695716		EUR	1.500	0	0 %	97,011	1.455.165,00	1,03
0,1250 % Bremen, Freie Hansestadt LandSchatz. A.204 v.16(23)	DE000A1680M0		EUR	1.000	0	0 %	99,601	996.010,00	0,70
0,2000 % Caisse Francaise d.Financ.Loc. EO-M.-T.Obl.Foncières 2015(23)	FR0012688208		EUR	1.000	0	0 %	99,685	996.850,00	0,70
2,4000 % Caisse Refinancement l'Habitat EO-Covered Bonds 2013(25)	FR0011388339		EUR	2.000	0	0 %	102,338	2.046.760,00	1,44
4,0000 % Caixabank S.A. EO-Cédulas Hip. 2005(25)	ES0414950628		EUR	2.000	0	0 %	106,293	2.125.860,00	1,50
0,6250 % Caixabank S.A. EO-Cédulas Hipotec. 2015(25)	ES0440609271		EUR	2.000	0	0 %	97,492	1.949.840,00	1,38
2,7820 % Cie de Financement Foncier EO-FLR Med.-T.Obl.Fonc.05(25)	FR0010198002		EUR	2.500	2.500	0 %	104,722	2.618.050,00	1,85
0,2500 % Cie de Financement Foncier EO-Med.-T. Obl.Fonc. 2018(23)	FR0013328218		EUR	1.000	0	0 %	99,788	997.880,00	0,70
0,0500 % Cie de Financement Foncier EO-Med.-T. Obl.Fonc. 2020(24)	FR0013507365		EUR	2.000	0	0 %	97,916	1.958.320,00	1,38
0,1250 % Commerzbank AG MTH S.P17 v.16(23)	DE000CZ40LS3		EUR	1.000	0	0 %	99,831	998.310,00	0,70
0,2500 % Coöperatieve Rabobank U.A. EO-Med.-Term Cov. Bds 2017(24)	XS1622193248		EUR	2.000	0	0 %	98,077	1.961.540,00	1,38
0,8750 % Credit Agricole Italia S.p.A. EO-M.-T.Mortg.Cov.Bds 2015(23)	IT0005121592		EUR	1.200	0	0 %	99,971	1.199.652,00	0,85
0,2500 % Credit Agricole Italia S.p.A. EO-M.-T.Mortg.Cov.Bds 2016(24)	IT0005216624		EUR	1.000	0	0 %	97,224	972.240,00	0,69
0,6250 % Crédit Mutuel Home Loan SFH SA EO-Med.-T.Obl.Fin.Hab.2017(25)	FR0013236247		EUR	2.000	0	0 %	97,855	1.957.100,00	1,38
0,2500 % Deutsche Bank AG MTN-HPF v.16(24)	DE000DL19SH3		EUR	2.000	0	0 %	98,459	1.969.180,00	1,39
0,2500 % Deutsche Pfandbriefbank AG MTN-HPF Reihe 15277 v.18(23)	DE000A2GSLF9		EUR	1.000	0	0 %	99,849	998.490,00	0,70

Halbjahresbericht Torca Vega Return

Vermögensaufstellung zum 30.06.2022

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2022	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
0,0100 % Deutsche Pfandbriefbank AG MTN-HPF Reihe 15292 v.19(25)	DE000A2YNVM8		EUR	1.500	1.500	0	95,059	1.425.885,00	1,01
0,3750 % DZ HYP AG MTN-Hyp.Pfbr.377 16(25) [WL]	DE000A2AASB4		EUR	1.000	0	0	96,847	968.470,00	0,68
0,5000 % Eika BoligKreditt A.S. EO-Med.-Term Cov. MTN 2018(25)	XS1869468808		EUR	2.000	0	0	96,732	1.934.640,00	1,37
0,3750 % Eika BoligKreditt A.S. EO-Med.-Term Cov. Nts 2017(25)	XS1725524471		EUR	2.000	0	0	97,170	1.943.400,00	1,37
0,6250 % Erste Group Bank AG EO-Med.-T. Hyp.Pfandb.2016(23)	XS1346557637		EUR	1.000	0	0	100,180	1.001.800,00	0,71
0,2500 % EUROFIMA EO-Medium-Term Notes 2016(23)	XS1400224546		EUR	1.000	0	0	99,726	997.260,00	0,70
0,3750 % Federat.caisses Desjard Quebec EO-M.-T. Mortg.Cov.Bds 18(23)	XS1829326716		EUR	800	0	0	99,707	797.656,00	0,56
0,3750 % Hessen, Land Schatzanzw. S.1507 v.2015(2023)	DE000A1RQCJ3		EUR	1.000	0	0	100,049	1.000.490,00	0,71
0,2500 % Ibercaja Banco S.A.U. EO-Cédulas Hipotec. 2016(23)	ES0444251047		EUR	1.000	0	0	98,888	988.880,00	0,70
0,6250 % ING Belgium SA/NV EO-Med.-T.Mortg.Cov.Bds 18(25)	BE0002594720		EUR	2.000	0	0	97,481	1.949.620,00	1,38
0,2500 % Jyske Realkredit A/S EO-Cov. Bonds 2016(23)	XS1435774903		EUR	1.000	0	0	99,467	994.670,00	0,70
0,3750 % Jyske Realkredit A/S EO-Mortg. Covered MTN 2019(25)	XS1961126775		EUR	1.000	0	0	96,946	969.460,00	0,68
1,4212 % L-Bank Bad.-Württ.-Förderbank FLR MTN Serie 5608 v.20(23)	XS2166345608		EUR	1.000	0	0	101,853	1.018.530,00	0,72
0,2500 % Landesbank Baden-Württemberg MTN-Pfandbr.Ser.791 v.18(25)	DE000LB1M2X2		EUR	2.000	0	0	97,137	1.942.740,00	1,37
0,1250 % Lb.Hessen-Thüringen GZ MTN IHS S.H339 v.19(24)	XS2080581189		EUR	2.000	0	0	95,827	1.916.540,00	1,35
0,0100 % Luminor Bank AS EO-Mortg.Covered MTN 2020(25)	XS2133077383		EUR	2.000	0	0	95,715	1.914.300,00	1,35
0,8750 % National Australia Bank Ltd. EO-Mortg.Cov.Med.-T.Bds 15(22)	XS1321466911		EUR	1.200	0	0	100,304	1.203.648,00	0,85
0,0000 % National Bank of Canada EO-Med.-Term Cov. Bds 2016(23)	XS1496770626		EUR	1.000	0	0	98,758	987.580,00	0,70
0,2500 % Nationale-Nederlanden Bank NV EO-M.-T. Mortg.Cov.Bds 19(24)	NL0013400401		EUR	1.500	1.500	0	98,429	1.476.435,00	1,04
0,1250 % Niedersachsen, Land Landessch.v.18(23) Ausg.880	DE000A2G8VK4		EUR	1.000	0	0	99,892	998.920,00	0,71
0,3750 % Nord/LB Lux.S.A. Cov.Bond Bk. EO-M.-T.Lett.d.Ga.Publ. 16(23)	XS1432510631		EUR	2.000	0	0	99,534	1.990.680,00	1,41
0,0100 % Norddeutsche Landesbank -GZ- MTN-HPF S.506 v.19(22)	DE000DHY5066		EUR	1.000	0	0	100,054	1.000.540,00	0,71
0,1250 % Oma Säästöpankki Oyj EO-Med.-T.Mort.Cov.Bds 17(22)	FI4000292669		EUR	1.000	0	0	99,966	999.660,00	0,71
0,3750 % Raiffeisenl.Niederöst.-Wien AG EO-Medium-Term Notes 2017(24)	XS1681119167		EUR	2.000	0	0	97,774	1.955.480,00	1,38
1,2500 % Santander UK PLC EO-Med.-T.Cov. Bds 2014(24)	XS1111559685		EUR	1.500	0	0	99,537	1.493.055,00	1,05
0,6250 % Skandinaviska Enskilda Banken EO-Cov.Med.-Term Nts 2015(23)	XS1314150878		EUR	2.000	0	0	100,181	2.003.620,00	1,41
0,0500 % Skandinaviska Enskilda Banken EO-Medium-Term Notes 2019(24)	XS2020568734		EUR	2.000	0	0	96,612	1.932.240,00	1,36
0,5000 % Société Générale SFH S.A. EO-M.-T.Obl.Fin.Hab. 16(23)	FR0013094869		EUR	1.000	0	0	100,119	1.001.190,00	0,71
0,1250 % Sp Mortgage Bank PLC EO-Med.-Term Cov. Bds 2017(22)	XS1705691563		EUR	1.000	0	0	100,066	1.000.660,00	0,71
0,3750 % SpareBank 1 Boligkreditt AS EO-M.-T. Mortg.Cov.Bds 17(24)	XS1637099026		EUR	2.000	0	0	98,155	1.963.100,00	1,39
0,5000 % SpareBank 1 Boligkreditt AS EO-M.-T.Mrtg.Cov.Gr.Bs 18(25)	XS1760129608		EUR	2.500	0	0	97,588	2.439.700,00	1,72
0,1250 % Sparebanken Vest Boligkred. AS EO-Med.-Term Hyp.Pf. 2018(23)	XS1854532865		EUR	1.200	0	0	99,765	1.197.180,00	0,85
0,7500 % SR-Boligkreditt A.S. EO-Mortg. Covered MTN 2016(23)	XS1344895450		EUR	1.000	0	0	100,233	1.002.330,00	0,71
0,3750 % Suomen Hypoteekkiyhdistys EO-Med.-Term Cov. Bds 2018(23)	FI4000315841		EUR	1.000	0	0	99,786	997.860,00	0,70
0,1250 % Swedbank Hypotek AB EO-M.-T. Mortg.Cov.Nts 17(22)	XS1550140674		EUR	1.000	0	0	100,019	1.000.190,00	0,71
0,5000 % Swedish Covered Bond Corp.,The EO-Medium-Term Notes 2018(25)	XS1759602953		EUR	3.000	0	0	97,614	2.928.420,00	2,07

Halbjahresbericht Torca Vega Return

Vermögensaufstellung zum 30.06.2022

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2022	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
0,2500 % Toronto-Dominion Bank, The EO-Med.-Term Cov.Bds 2018(23)	XS1790069790		EUR	800	0	0 %	99,974	799.792,00	0,56
0,0100 % UniCredit Bank AG HVB MTN-HPF S.2063 v.19(24)	DE000HV2AST3		EUR	3.000	0	0 %	97,105	2.913.150,00	2,06
0,1250 % Union Natle Interp.Em.Com.Ind. EO-Medium-Term Notes 2017(24)	FR0124665995		EUR	1.000	0	0 %	97,429	974.290,00	0,69
0,3750 % Van Lanschot Kempen N.V. EO-MT Covered Bonds 2016(23)	XS1387192435		EUR	500	0	0 %	99,852	499.260,00	0,35
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere							EUR	4.339.500,00	3,06
Verzinsliche Wertpapiere							EUR	4.339.500,00	3,06
0,0100 % Aareal Bank AG MTN-HPF.S.212 v.2017(2022)	DE000AAR0199		EUR	1.400	0	0 %	100,000	1.400.000,00	0,99
0,0100 % Development Bank of Japan EO-Medium-Term Notes 2020(24)	XS2243052490		EUR	1.000	0	0 %	96,696	966.960,00	0,68
0,8750 % Quebec, Provinz EO-Medium-Term Notes 2015(25)	XS1167203881		EUR	2.000	2.000	0 %	98,627	1.972.540,00	1,39
Summe Wertpapiervermögen 2)							EUR	105.447.801,00	74,44
Derivate							EUR	-5.800.197,70	-4,09
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)									
Aktienindex-Derivate Forderungen/Verbindlichkeiten							EUR	-3.266.313,80	-2,31
Aktienindex-Terminkontrakte							EUR	-134.495,41	-0,09
FUTURE EURO STOXX 50 PR.EUR 09.22 EUREX		185	EUR	Anzahl	-316			-75.840,00	-0,05
FUTURE E-MINI S+P 500 INDEX 09.22 CME		352	USD	Anzahl	-42			-58.655,41	-0,04
Optionsrechte							EUR	-3.131.818,39	-2,21
Optionsrechte auf Aktienindices							EUR	-3.131.818,39	-2,21
SMI CALL 15.07.22 BP 10900,00 EUREX		185		Anzahl	-310	CHF	83,300	-25.807,52	-0,02
SMI CALL 15.07.22 BP 11050,00 EUREX		185		Anzahl	-610	CHF	40,100	-24.446,33	-0,02
SMI CALL 15.07.22 BP 12050,00 EUREX		185		Anzahl	-640	CHF	0,100	-63,96	0,00
SMI PUT 15.07.22 BP 10000,00 EUREX		185		Anzahl	-310	CHF	28,600	-8.860,68	-0,01

Halbjahresbericht Torca Vega Return

Vermögensaufstellung zum 30.06.2022

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2022	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
SMI PUT 15.07.22 BP 10300,00 EUREX			185	Anzahl -300		CHF	63,700	-19.098,54	-0,01
SMI PUT 15.07.22 BP 10750,00 EUREX			185	Anzahl -640		CHF	202,800	-129.714,17	-0,09
SMI PUT 15.07.22 BP 9950,00 EUREX			185	Anzahl -310		CHF	25,200	-7.807,32	-0,01
ESTX 50 PR.EUR CALL 01.07.22 BP 3975,00 EUREX			185	Anzahl -5270		EUR	0,100	-527,00	0,00
ESTX 50 PR.EUR CALL 08.07.22 BP 3700,00 EUREX			185	Anzahl -2670		EUR	1,700	-4.539,00	0,00
ESTX 50 PR.EUR CALL 15.07.22 BP 3575,00 EUREX			185	Anzahl -2720		EUR	25,700	-69.904,00	-0,05
ESTX 50 PR.EUR CALL 22.07.22 BP 3675,00 EUREX			185	Anzahl -5350		EUR	14,100	-75.435,00	-0,05
ESTX 50 PR.EUR PUT 01.07.22 BP 3625,00 EUREX			185	Anzahl -5270		EUR	171,500	-903.805,00	-0,64
ESTX 50 PR.EUR PUT 08.07.22 BP 3325,00 EUREX			185	Anzahl -2670		EUR	17,200	-45.924,00	-0,03
ESTX 50 PR.EUR PUT 15.07.22 BP 3250,00 EUREX			185	Anzahl -2720		EUR	21,400	-58.208,00	-0,04
ESTX 50 PR.EUR PUT 22.07.22 BP 3350,00 EUREX			185	Anzahl -5350		EUR	57,300	-306.555,00	-0,22
NIKKEI 225 INDEX CALL 08.07.22 BP 27125,00 OSE			969	Anzahl -44000		JPY	76,000	-23.550,36	-0,02
NIKKEI 225 INDEX CALL 08.07.22 BP 27750,00 OSE			969	Anzahl -138000		JPY	13,000	-12.634,37	-0,01
NIKKEI 225 INDEX CALL 08.07.22 BP 28250,00 OSE			969	Anzahl -87000		JPY	4,000	-2.450,81	0,00
NIKKEI 225 INDEX CALL 08.07.22 BP 29250,00 OSE			969	Anzahl -85000		JPY	1,000	-598,62	0,00
NIKKEI 225 INDEX CALL 08.07.22 BP 29750,00 OSE			969	Anzahl -86000		JPY	1,000	-605,66	0,00
NIKKEI 225 INDEX PUT 08.07.22 BP 24625,00 OSE			969	Anzahl -44000		JPY	22,000	-6.817,21	0,00
NIKKEI 225 INDEX PUT 08.07.22 BP 25250,00 OSE			969	Anzahl -87000		JPY	56,000	-34.311,41	-0,02
NIKKEI 225 INDEX PUT 08.07.22 BP 25375,00 OSE			969	Anzahl -85000		JPY	70,000	-41.903,30	-0,03
NIKKEI 225 INDEX PUT 08.07.22 BP 25625,00 OSE			969	Anzahl -138000		JPY	105,000	-102.046,85	-0,07
NIKKEI 225 INDEX PUT 08.07.22 BP 26250,00 OSE			969	Anzahl -86000		JPY	270,000	-163.528,50	-0,12
S+P 500 INDEX CALL 01.07.22 BP 4320,00 CBOE			361	Anzahl -3200		USD	0,050	-153,07	0,00
S+P 500 INDEX CALL 08.07.22 BP 4095,00 CBOE			361	Anzahl -3300		USD	0,500	-1.578,49	0,00
S+P 500 INDEX CALL 15.07.22 BP 3850,00 CBOE			361	Anzahl -3300		USD	44,200	-139.538,89	-0,10
S+P 500 INDEX CALL 22.07.22 BP 4055,00 CBOE			361	Anzahl -3200		USD	9,600	-29.388,69	-0,02
S+P 500 INDEX PUT 01.07.22 BP 3945,00 CBOE			361	Anzahl -3200		USD	166,600	-510.016,26	-0,36
S+P 500 INDEX PUT 08.07.22 BP 3740,00 CBOE			361	Anzahl -3300		USD	40,350	-127.384,48	-0,09
S+P 500 INDEX PUT 15.07.22 BP 3525,00 CBOE			361	Anzahl -3300		USD	15,100	-47.670,53	-0,03
S+P 500 INDEX PUT 22.07.22 BP 3705,00 CBOE			361	Anzahl -3200		USD	67,600	-206.945,37	-0,15
Zins-Derivate						EUR		38.352,04	0,03
Forderungen/Verbindlichkeiten									

Halbjahresbericht 7orca Vega Return

Vermögensaufstellung zum 30.06.2022

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2022	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Zinsterminkontrakte							EUR	38.352,04	0,03
FUTURE EURO-BUND 09.22 EUREX			185	EUR	1.200.000			-1.200,00	0,00
FUTURE 10Y TREASURY NOTE (SYNTH.) 09.22 CBOT			362	USD	14.700.000			39.552,04	0,03
Optionsrechte							EUR	-1.444.196,75	-1,02
Optionsrechte auf Zinsterminkontrakte							EUR	-1.444.196,75	-1,02
FUTURE EU-BUND 09.22 CALL 22.07.22 BP 148,50 EUREX			185	EUR	Anzahl -257		EUR	1,990 -352.090,00	-0,25
FUTURE EU-BUND 09.22 CALL 22.07.22 BP 151,00 EUREX			185	EUR	Anzahl -258		EUR	0,940 -29.700,00	-0,02
FUTURE EU-BUND 09.22 PUT 22.07.22 BP 140,00 EUREX			185	EUR	Anzahl -257		EUR	0,190 192.750,00	0,14
FUTURE EU-BUND 09.22 PUT 22.07.22 BP 143,50 EUREX			185	EUR	Anzahl -258		EUR	0,430 107.040,00	0,08
FUT 10Y TR 1W 09.22 CALL 01.07.22 BP 119,75 CBOT			362	USD	Anzahl -453		USD	0,031 -13.542,76	-0,01
FUT 10Y TR 1W 09.22 PUT 01.07.22 BP 116,50 CBOT			362	USD	Anzahl -453		USD	0,001 -433,37	0,00
FUT 10Y TREA 2W 09.22 CALL 08.07.22 BP 117,00 CBOT			362	USD	Anzahl -420		USD	1,656 -665.478,81	-0,47
FUT 10Y TREA 2W 09.22 PUT 08.07.22 BP 113,00 CBOT			362	USD	Anzahl -420		USD	0,001 -401,80	0,00
FUT. 10Y TRE 3W 09.22 CALL 15.07.22 BP 119,00 CBOT			362	USD	Anzahl -419		USD	0,594 -237.999,86	-0,17
FUT. 10Y TRE 3W 09.22 PUT 15.07.22 BP 115,00 CBOT			362	USD	Anzahl -419		USD	0,063 -25.052,62	-0,02
FUTURE 10Y TREA 09.22 CALL 22.07.22 BP 118,50 CBOT			362	USD	Anzahl -425		USD	0,953 -387.523,32	-0,27
FUTURE 10Y TREA 09.22 PUT 22.07.22 BP 114,50 CBOT			362	USD	Anzahl -425		USD	0,078 -31.764,21	-0,02
Devisen-Derivate							EUR	-1.128.039,19	-0,80
Forderungen/Verbindlichkeiten									
Optionsrechte							EUR	-948.883,08	-0,67
Optionsrechte auf Devisen							EUR	-948.883,08	-0,67
F FX AUD/USD 2PM 09.22 CALL 08.07.22 BP 75,00 CME			352	USD	-124.000		USD	0,005 -593,13	0,00
F FX AUD/USD 2PM 09.22 PUT 08.07.22 BP 68,50 CME			352	USD	-124.000		USD	0,300 -35.587,87	-0,03
F FX EUR/USD 2PM 09.22 CALL 08.07.22 BP 1,11 CME			352	USD	-18.375.000		USD	0,000 -878,93	0,00
F FX EUR/USD 2PM 09.22 PUT 08.07.22 BP 1,04 CME			352	USD	-18.375.000		USD	0,002 -26.368,03	-0,02
F FX GBP/USD 2PM 09.22 CALL 08.07.22 BP 129,00 CME			359	USD	-142.500		USD	0,010 -1.363,25	0,00
F FX GBP/USD 2PM 09.22 PUT 08.07.22 BP 121,00 CME			359	USD	-142.500		USD	0,380 -51.803,31	-0,04
F FX JPY/USD 2PM 09.22 CALL 08.07.22 BP 78,25 CME			352	USD	-263.750		USD	0,005 -1.261,60	0,00

Halbjahresbericht Torca Vega Return

Vermögensaufstellung zum 30.06.2022

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2022	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
F FX JPY/USD 2PM 09.22 PUT 08.07.22 BP 72,00 CME			352	USD	-263.750	USD	0,035	-8.831,20	-0,01
FUT FX CAD/USD W09.22 CALL 01.07.22 BP 81,00 CME			352	USD	-106.000	USD	0,005	-507,03	0,00
FUT FX CAD/USD W09.22 CALL 15.07.22 BP 79,25 CME			352	USD	-117.000	USD	0,050	-5.596,48	0,00
FUT FX CAD/USD W09.22 CALL 22.07.22 BP 79,00 CME			352	USD	-120.000	USD	0,130	-14.923,95	-0,01
FUT FX CAD/USD W09.22 CALL 29.07.22 BP 79,25 CME			352	USD	-118.000	USD	0,140	-15.804,08	-0,01
FUT FX CAD/USD W09.22 PUT 01.07.22 BP 77,25 CME			352	USD	-106.000	USD	0,010	-1.014,06	0,00
FUT FX CAD/USD W09.22 PUT 15.07.22 BP 75,75 CME			352	USD	-117.000	USD	0,070	-7.835,07	-0,01
FUT FX CAD/USD W09.22 PUT 22.07.22 BP 75,25 CME			352	USD	-120.000	USD	0,080	-9.183,97	-0,01
FUT FX CAD/USD W09.22 PUT 29.07.22 BP 75,75 CME			352	USD	-118.000	USD	0,180	-20.319,53	-0,01
FUTURE FX CAD/USD 09.22 CALL 08.07.22 BP 81,25 CME			352	USD	-104.000	USD	0,005	-497,46	0,00
FUTURE FX CAD/USD 09.22 PUT 08.07.22 BP 77,75 CME			352	USD	-104.000	USD	0,350	-34.822,54	-0,02
FX AUD/USD 2PM W 09.22 CALL 01.07.22 BP 75,00 CME			352	USD	-124.000	USD	0,005	-593,13	0,00
FX AUD/USD 2PM W 09.22 CALL 15.07.22 BP 72,00 CME			352	USD	-118.000	USD	0,035	-3.951,02	0,00
FX AUD/USD 2PM W 09.22 CALL 22.07.22 BP 73,00 CME			352	USD	-117.000	USD	0,030	-3.357,89	0,00
FX AUD/USD 2PM W 09.22 CALL 29.07.22 BP 72,50 CME			352	USD	-119.000	USD	0,090	-10.245,86	-0,01
FX AUD/USD 2PM W 09.22 PUT 01.07.22 BP 68,50 CME			352	USD	-124.000	USD	0,030	-3.558,79	0,00
FX AUD/USD 2PM W 09.22 PUT 15.07.22 BP 65,50 CME			352	USD	-118.000	USD	0,050	-5.644,31	0,00
FX AUD/USD 2PM W 09.22 PUT 22.07.22 BP 66,50 CME			352	USD	-117.000	USD	0,190	-21.266,62	-0,02
FX AUD/USD 2PM W 09.22 PUT 29.07.22 BP 66,50 CME			352	USD	-119.000	USD	0,270	-30.737,59	-0,02
FX EUR/USD 2PM W 09.22 CALL 01.07.22 BP 1,11 CME			352	USD	-18.625.000	USD	0,000	-890,89	0,00
FX EUR/USD 2PM W 09.22 CALL 15.07.22 BP 1,09 CME			352	USD	-17.250.000	USD	0,000	-4.950,73	0,00
FX EUR/USD 2PM W 09.22 CALL 22.07.22 BP 1,095 CME			352	USD	-17.500.000	USD	0,000	-7.533,72	-0,01
FX EUR/USD 2PM W 09.22 CALL 29.07.22 BP 1,0825 CME			352	USD	-17.500.000	USD	0,002	-33.483,21	-0,02
FX EUR/USD 2PM W 09.22 PUT 01.07.22 BP 1,04 CME			352	USD	-18.625.000	USD	0,000	-890,89	0,00
FX EUR/USD 2PM W 09.22 PUT 15.07.22 BP 1,015 CME			352	USD	-17.250.000	USD	0,001	-8.251,22	-0,01
FX EUR/USD 2PM W 09.22 PUT 22.07.22 BP 1,025 CME			352	USD	-17.500.000	USD	0,002	-35.157,37	-0,02
FX EUR/USD 2PM W 09.22 PUT 29.07.22 BP 1,01 CME			352	USD	-17.500.000	USD	0,002	-25.112,41	-0,02
FX GBP/USD 2PM W 09.22 CALL 01.07.22 BP 130,00 CME			359	USD	-141.875	USD	0,010	-1.357,27	0,00
FX GBP/USD 2PM W 09.22 CALL 15.07.22 BP 125,25 CME			359	USD	-135.625	USD	0,120	-15.569,69	-0,01
FX GBP/USD 2PM W 09.22 CALL 22.07.22 BP 127,00 CME			359	USD	-133.125	USD	0,070	-8.914,90	-0,01
FX GBP/USD 2PM W 09.22 CALL 29.07.22 BP 126,50 CME			359	USD	-135.000	USD	0,180	-23.246,91	-0,02
FX GBP/USD 2PM W 09.22 PUT 01.07.22 BP 121,50 CME			359	USD	-141.875	USD	0,100	-13.572,66	-0,01
FX GBP/USD 2PM W 09.22 PUT 15.07.22 BP 117,00 CME			359	USD	-135.625	USD	0,090	-11.677,27	-0,01
FX GBP/USD 2PM W 09.22 PUT 22.07.22 BP 119,00 CME			359	USD	-133.125	USD	0,400	-50.942,31	-0,04
FX GBP/USD 2PM W 09.22 PUT 29.07.22 BP 118,00 CME			359	USD	-135.000	USD	0,390	-50.368,32	-0,04
FX JPY/USD 2PM W09.22 CALL 01.07.22 BP 80,50 CME			352	USD	-260.000	USD	0,005	-1.243,66	0,00

Halbjahresbericht 7orca Vega Return

Vermögensaufstellung zum 30.06.2022

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2022	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
FX JPY/USD 2PM W09.22 CALL 15.07.22 BP 77,75 CME			352	USD	-247.500	USD	0,050	-11.838,71	-0,01
FX JPY/USD 2PM W09.22 CALL 22.07.22 BP 78,00 CME			352	USD	-248.750	USD	0,160	-38.075,19	-0,03
FX JPY/USD 2PM W09.22 CALL 29.07.22 BP 77,00 CME			352	USD	-247.500	USD	0,330	-78.135,46	-0,06
FX JPY/USD 2PM W09.22 PUT 01.07.22 BP 74,50 CME			352	USD	-260.000	USD	0,410	-101.980,29	-0,07
FX JPY/USD 2PM W09.22 PUT 15.07.22 BP 72,00 CME			352	USD	-247.500	USD	0,100	-23.677,41	-0,02
FX JPY/USD 2PM W09.22 PUT 22.07.22 BP 71,75 CME			352	USD	-248.750	USD	0,190	-45.214,29	-0,03
FX JPY/USD 2PM W09.22 PUT 29.07.22 BP 71,00 CME			352	USD	-247.500	USD	0,170	-40.251,60	-0,03
							EUR	-179.156,11	-0,13
Währungsterminkontrakte									
FUTURE CROSS RATE EUR/AUD 09.22 CME			352	AUD	500.000	AUD	1,525	9.951,96	0,01
FUTURE CROSS RATE EUR/CHF 09.22 CME			352	CHF	250.000	CHF	1,000	-10.743,56	-0,01
FUTURE CROSS RATE EUR/JPY 09.22 CME			352	JPY	4.625.000	JPY	142,110	2.737,80	0,00
FUTURE CROSS RATE EUR/USD 09.22 CME			352	USD	15.375.000	USD	1,051	-180.265,23	-0,13
FUTURE CROSS RATE JPY/USD 09.22 CME			352	USD	-1.250	USD	74,155	-837,08	0,00
							EUR	15.309.099,74	10,81
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds									
							EUR	4.253.259,74	3,00
Bankguthaben									
EUR - Guthaben bei:									
BNP Paribas Securities Services S.C.A. Zweigniederlassung Frankfurt				EUR	482.577,63	%	100,000	482.577,63	0,34
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen bei:									
BNP Paribas Securities Services S.C.A. Zweigniederlassung Frankfurt				AUD	724.548,25	%	100,000	476.739,21	0,34
BNP Paribas Securities Services S.C.A. Zweigniederlassung Frankfurt				CHF	70.857,99	%	100,000	70.815,50	0,05
BNP Paribas Securities Services S.C.A. Zweigniederlassung Frankfurt				JPY	357.096.969,00	%	100,000	2.514.880,73	1,78
BNP Paribas Securities Services S.C.A. Zweigniederlassung Frankfurt				USD	740.330,24	%	100,000	708.246,67	0,50

Halbjahresbericht Torca Vega Return

Vermögensaufstellung zum 30.06.2022

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2022	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Geldmarktfonds							EUR	11.055.840,00	7,80
Gruppenfremde Geldmarktfonds							EUR	11.055.840,00	7,80
AMUNDI EURO LIQUIDITY SRI Actions au Porteur IC o.N.	FR0010251660		ANT	48	0	23	EUR 230.330,000	11.055.840,00	7,80
Sonstige Vermögensgegenstände							EUR	27.004.180,28	19,06
Zinsansprüche			EUR	199.487,19				199.487,19	0,14
Einschüsse (Initial Margins)			EUR	26.804.693,09				26.804.693,09	18,92
Sonstige Verbindlichkeiten							EUR	-301.092,97	-0,21
Zinsverbindlichkeiten			EUR	-1.626,52				-1.626,52	0,00
Verwaltungsvergütung			EUR	-40.676,39				-40.676,39	-0,03
Verwahrstellenvergütung			EUR	-16.265,28				-16.265,28	-0,01
Prüfungskosten			EUR	-12.000,00				-12.000,00	-0,01
Veröffentlichungskosten			EUR	-400,00				-400,00	0,00
Portfoliomanagervergütung			EUR	-230.124,78				-230.124,78	-0,16
Fondsvermögen							EUR	141.659.790,35	100,00 1)
Torca Vega Return Anteilklasse R									
Anteilwert							EUR	90,62	
Ausgabepreis							EUR	95,15	
Rücknahmepreis							EUR	90,62	
Anzahl Anteile							STK	49.910	

Halbjahresbericht 7orca Vega Return

Vermögensaufstellung zum 30.06.2022

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2022	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
7orca Vega Return Anteilklasse I									
Anteilwert							EUR	92,77	
Ausgabepreis							EUR	92,77	
Rücknahmepreis							EUR	92,77	
Anzahl Anteile							STK	1.478.270	

Fußnoten:

- 1) Durch Rundung der Prozent-Anteile bei der Berechnung können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.
- 2) Die Wertpapiere und Schuldscheindarlehen des Sondervermögens sind teilweise durch Geschäfte mit Finanzinstrumenten abgesichert.

Halbjahresbericht 7orca Vega Return

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

Die Vermögensgegenstände des Sondervermögens sind auf Grundlage der zuletzt festgestellten Kurse/Marktsätze bewertet.

Devisenkurse (in Mengennotiz)

		per 30.06.2022	
AUD	(AUD)	1,5198000	= 1 EUR (EUR)
CHF	(CHF)	1,0006000	= 1 EUR (EUR)
JPY	(JPY)	141,9936000	= 1 EUR (EUR)
USD	(USD)	1,0453000	= 1 EUR (EUR)

Marktschlüssel

b) Terminbörsen

185	Eurex Deutschland
352	Chicago - CME Globex
359	Chicago Merc. Ex.
361	Chicago - CBOE Opt. Ex.
362	Chicago Board of Trade
969	Osaka Exchange F.+O.

Halbjahresbericht Torca Vega 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 Whg. in 1.000	Käufe bzw. Zugänge	Verkäufe bzw. Abgänge	Volumen in 1.000
Börsengehandelte Wertpapiere					
Verzinsliche Wertpapiere					
0,2500 % Aktia Bank PLC EO-Cov. Med.-Term Nts 2015(22)	XS1210338015	EUR	0	1.000	
0,6250 % ANZ New Zealand (Itl)(Ldn Br.) EO-Med.-T.Mtg.Cov.Bds 2015(22)	XS1171526772	EUR	0	500	
0,1250 % AXA Bank Europe SCF EO-Med.-Term Obl.Fonc.2017(22)	FR0013242302	EUR	0	800	
0,7500 % Banco Bilbao Vizcaya Argent. EO-Cédulas Hip. 2015(22)	ES0413211824	EUR	0	500	
0,3750 % BAWAG P.S.K. EO-Medium-Term Bonds 2016(22)	XS1369268534	EUR	0	1.000	
0,8750 % Credit Agricole Italia S.p.A. EO-Mortg.Cov. MTN 2014(22)	IT0005057002	EUR	0	800	
0,2500 % Länsförsäkringar Hypotek AB EO-Cov.Med.-T.Nts 2015(22)	XS1222454032	EUR	0	800	
0,2500 % Sparebanken Vest Boligkred. AS EO-Med.-Term Hyp.Pf. 2015(22)	XS1225004115	EUR	0	800	
Nichtnotierte Wertpapiere *)					
Verzinsliche Wertpapiere					
0,1250 % Agence Française Développement EO-Medium-Term Notes 2017(22)	FR0013232105	EUR	0	1.000	
0,6250 % AIB Mortgage Bank Unlimited Co EO-Med.-Term Cov.Secs 2015(22)	XS1179936551	EUR	0	1.000	
0,5000 % Crédit Mutuel Home Loan SFH SA EO-Med.-T.Obl.Fin.Hab.2015(22)	FR0012452217	EUR	0	1.000	
0,0500 % DNB Boligkredit A.S. EO-Mortg. Covered MTN 2017(22)	XS1548410080	EUR	0	1.000	
0,0000 % Europäischer Stabilitäts.(ESM) EO-Medium-Term Notes 2018(22)	EU000A1Z99G8	EUR	0	800	
0,0500 % NATIXIS Pfandbriefbank AG MTN-HPF Ser.31 v.17(22)	DE000A14J0J5	EUR	0	600	
0,2500 % NIBC Bank N.V. EO-Mortg. Cov. MTN 2015(22)	XS1222431097	EUR	0	1.800	
0,0000 % Niedersachsen, Land Landessch.v.17(22) Ausg.867	DE000A2DAHG0	EUR	0	1.800	
0,1250 % Norddeutsche Landesbank -GZ- MTN-HPF S.445 v.15(22)	DE000DHY4457	EUR	0	1.000	
0,2500 % NRW.BANK Inh.-Schv.A.17E v.16(22)	DE000NWB17E6	EUR	0	800	
0,3750 % Sparkasse KölnBonn MTN-HPF S.024 v.15(2022)	DE000SK003C7	EUR	0	1.500	
0,0500 % Stadshypotek AB EO-Med.-T. Hyp.-Pfandbr.16(22)	XS1435031270	EUR	0	1.000	
0,2750 % Van Lanschot Kempen N.V. EO-MT Covered Bonds 2015(22)	XS1224002474	EUR	0	1.000	

Halbjahresbericht 7orca Vega 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 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

Aktienindex-Terminkontrakte

Verkaufte Kontrakte:

(Basiswert(e): ESTX 50 PR.EUR, NIKKEI 225 ST.AVERAGE JPY, S+P 500, SMI PR CHF)

EUR

440.523,95

Gekaufte Kontrakte:

(Basiswert(e): ESTX 50 PR.EUR, NIKKEI 225 ST.AVERAGE JPY, S+P 500, SMI PR CHF)

EUR

73.555,32

Zinsterminkontrakte

Gekaufte Kontrakte:

(Basiswert(e): 10Y.US TRE.NT.SYN.AN., EURO-BUND)

EUR

841.988,38

Verkaufte Kontrakte:

(Basiswert(e): 10Y.US TRE.NT.SYN.AN., EURO-BUND)

EUR

1.489.741,85

Währungsterminkontrakte

Gekaufte Kontrakte:

(Basiswert(e): CROSS RATE AD/DL, CROSS RATE CD/DL, CROSS RATE EO/AD, CROSS RATE EO/DL, CROSS RATE EO/SF, CROSS RATE EO/YN, CROSS RATE LS/DL, CROSS RATE YN/DL)

EUR

356.308,37

Verkaufte Kontrakte:

(Basiswert(e): CROSS RATE AD/DL, CROSS RATE CD/DL, CROSS RATE EO/DL, CROSS RATE LS/DL, CROSS RATE YN/DL)

EUR

548.901,70

Halbjahresbericht 7orca Vega 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 Whg. in 1.000	Käufe bzw. Zugänge	Verkäufe bzw. Abgänge	Volumen in 1.000
Optionsrechte					
Optionsrechte auf Aktienindex-Derivate					
Optionsrechte auf Aktienindices					
Verkaufte Kaufoptionen (Call): (Basiswert(e): ESTX 50 PR.EUR, NIKKEI 225 ST.AVERAGE JPY, S+P 500, SMI PR CHF)					4.604,33
Verkaufte Verkaufsoptionen (Put): (Basiswert(e): ESTX 50 PR.EUR, NIKKEI 225 ST.AVERAGE JPY, S+P 500, SMI PR CHF)					10.652,01
Optionsrechte auf Zins-Derivate					
Optionsrechte auf Zinsterminkontrakte					
Verkaufte Kaufoptionen (Call): , FUTURE 10YTRN2W 06.22 CBOT, FUTURE 10YTRN2W 09.22 CBOT, FUTURE EURO-BUND 03.22 EUREX, FUTURE EURO-BUND 06.22 EUREX, FUTURE EURO-BUND 09.22 EUREX) (Basiswert(e): FUTURE 10Y TREASURY NOTE (SY.) 1W. 03.22 CBOT, FUTURE 10Y TREASURY NOTE (SY.) 1W. 06.22 CBOT, FUTURE 10Y TREASURY NOTE (SY.) 1W. 09.22 CBOT, FUTURE 10Y TREASURY NOTE (SYNTH.) 03.22 CBOT, FUTURE 10Y TREASURY NOTE (SYNTH.) 06.22 CBOT, FUTURE 10Y TREASURY NOTE (SYNTH.) 09.22 CBOT, FUTURE 10Y TREASURY NOTE (SYNTH.) 3W. 06.22 CBOT, FUTURE 10Y TREASURY NOTE (SYNTH.) 3W. 09.22 CBOT, FUTURE 10Y TREASURY NOTE (SYNTH.) 4W. 03.22 CBOT, FUTURE 10Y TREASURY NOTE (SYNTH.) 4W. 06.22 CBOT, FUTURE 10Y TREASURY NOTE (SYNTH.) 4W. 09.22 CBOT, FUTURE 10Y TREASURY NOTE (SYNTH.) 5W. 06.22 CBOT, FUTURE 10YTRN2W 03.22 CBOT,					0,00
Gekaufte Kaufoptionen (Call): (Basiswert(e): FUTURE 10Y TREASURY NOTE (SYNTH.) 3W. 09.22 CBOT)					96,82

Halbjahresbericht Torca Vega 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 Whg. in 1.000	Käufe bzw. Zugänge	Verkäufe bzw. Abgänge	Volumen in 1.000
---------------------	------	-------------------------------------	--------------------------	-----------------------------	---------------------

Verkaufte Verkaufsoptionen (Put):

, FUTURE 10YTRN2W 06.22 CBOT, FUTURE 10YTRN2W 09.22 CBOT, FUTURE EURO-BUND 03.22 EUREX, FUTURE EURO-BUND 06.22 EUREX, FUTURE EURO-BUND 09.22 EUREX)

EUR

-3.443.391,56

(Basiswert(e): FUTURE 10Y TREASURY NOTE (SY.) 1W. 03.22 CBOT, FUTURE 10Y TREASURY NOTE (SY.) 1W. 06.22 CBOT, FUTURE 10Y TREASURY NOTE (SY.) 1W. 09.22 CBOT, FUTURE 10Y TREASURY NOTE (SYNTH.) 03.22 CBOT, FUTURE 10Y TREASURY NOTE (SYNTH.) 06.22 CBOT, FUTURE 10Y TREASURY NOTE (SYNTH.) 09.22 CBOT, FUTURE 10Y TREASURY NOTE (SYNTH.) 3W. 06.22 CBOT, FUTURE 10Y TREASURY NOTE (SYNTH.) 3W. 09.22 CBOT, FUTURE 10Y TREASURY NOTE (SYNTH.) 4W. 03.22 CBOT, FUTURE 10Y TREASURY NOTE (SYNTH.) 4W. 06.22 CBOT, FUTURE 10Y TREASURY NOTE (SYNTH.) 4W. 09.22 CBOT, FUTURE 10Y TREASURY NOTE (SYNTH.) 5W. 06.22 CBOT, FUTURE 10YTRN2W 03.22 CBOT,

Optionsrechte auf Devisen-Derivate

Optionsrechte auf Devisen

Verkaufte Kaufoptionen (Call):

, FUTURE CROSS RATE GBP/USD 2PM EUR 06.22 CME, FUTURE CROSS RATE GBP/USD 2PM W EUR 03.22 CME, FUTURE CROSS RATE GBP/USD 2PM W EUR 06.22 CME, FUTURE CROSS RATE GBP/USD 2PM W EUR 09.22 CME, FUTURE CROSS RATE JPY/USD 2PM EUR 03.22 CME, FUTURE CROSS RATE JPY/USD 2PM EUR 06.22 CME, FUTURE CROSS RATE JPY/USD 2PM W EUR 03.22 CME, FUTURE CROSS RATE JPY/USD 2PM W EUR 06.22 CME, FUTURE CROSS RATE JPY/USD 2PM W EUR 09.22 CME, FUTURE CROSS RATE AUD/USD 2PM EUR 03.22 CME, FUTURE CROSS RATE AUD/USD 2PM EUR 06.22 CME, FUTURE CROSS RATE AUD/USD 2PM W EUR 03.22 CME, FUTURE CROSS RATE AUD/USD 2PM W EUR 06.22 CME, FUTURE CROSS RATE AUD/USD 2PM W EUR 09.22 CME, FUTURE CROSS RATE CAD/USD 03.22 CME, FUTURE CROSS RATE CAD/USD 06.22 CME, FUTURE CROSS RATE CAD/USD 09.22 CME, FUTURE CROSS RATE EUR/USD 2PM EUR 03.22 CME, FUTURE CROSS RATE EUR/USD 2PM EUR 06.22 CME, FUTURE CROSS RATE EUR/USD 2PM W EUR 03.22 CME, FUTURE CROSS RATE EUR/USD 2PM W EUR 06.22 CME, FUTURE CROSS RATE EUR/USD 2PM W EUR 09.22 CME, FUTURE CROSS RATE GBP/USD 2PM EUR 03.22

EUR

0,00

Halbjahresbericht 7orca Vega 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 Whg. in 1.000	Käufe bzw. Zugänge	Verkäufe bzw. Abgänge	Volumen in 1.000
Verkaufte Verkaufsoptionen (Put):					
, FUTURE CROSS RATE GBP/USD 2PM EUR 06.22 CME, FUTURE CROSS RATE GBP/USD 2PM W EUR 03.22 CME, FUTURE CROSS RATE GBP/USD 2PM W EUR 06.22 CME, FUTURE CROSS RATE GBP/USD 2PM W EUR 09.22 CME, FUTURE CROSS RATE JPY/USD 2PM EUR 03.22 CME, FUTURE CROSS RATE JPY/USD 2PM EUR 06.22 CME, FUTURE CROSS RATE JPY/USD 2PM W EUR 03.22 CME, FUTURE CROSS RATE JPY/USD 2PM W EUR 06.22 CME, FUTURE CROSS RATE JPY/USD 2PM W EUR 09.22 CME, FUTURE CROSS RATE AUD/USD 2PM EUR 03.22 CME, FUTURE CROSS RATE AUD/USD 2PM EUR 06.22 CME, FUTURE CROSS RATE AUD/USD 2PM W EUR 03.22 CME, FUTURE CROSS RATE AUD/USD 2PM W EUR 06.22 CME, FUTURE CROSS RATE AUD/USD 2PM W EUR 09.22 CME, FUTURE CROSS RATE CAD/USD 03.22 CME, FUTURE CROSS RATE CAD/USD 06.22 CME, FUTURE CROSS RATE CAD/USD 09.22 CME, FUTURE CROSS RATE EUR/USD 2PM EUR 03.22 CME, FUTURE CROSS RATE EUR/USD 2PM EUR 06.22 CME, FUTURE CROSS RATE EUR/USD 2PM W EUR 03.22 CME, FUTURE CROSS RATE EUR/USD 2PM W EUR 06.22 CME, FUTURE CROSS RATE EUR/USD 2PM W EUR 09.22 CME, FUTURE CROSS RATE GBP/USD 2PM EUR 03.22		EUR			-1.063.319,07

Die Gesellschaft sorgt dafür, dass eine unangemessene Beeinträchtigung von Anlegerinteressen durch Transaktionskosten vermieden wird, indem unter Berücksichtigung der Anlageziele dieses Sondervermögens ein Schwellenwert für die Transaktionskosten bezogen auf das durchschnittliche Fondsvolumen sowie für eine Portfolioumschlagsrate festgelegt wurde. Die Gesellschaft überwacht die Einhaltung der Schwellenwerte und ergreift im Falle des Überschreitens weitere Maßnahmen.

*) Bei den nichtnotierten Wertpapieren können technisch bedingt auch endfällige Wertpapiere ausgewiesen werden.

**Halbjahresbericht
7orca Vega Return**

Anteilklassenmerkmale im Überblick

Anteilklasse	Mindestanlagesumme in Währung	Ausgabeaufschlag bis zu 5,00%, derzeit (Angabe in %)	Verwaltungsvergütung bis zu 0,300% p.a., derzeit (Angabe in % p.a.)	Ertragsverwendung	Währung
7orca Vega Return Anteilklasse R	keine	5,00	0,250	Ausschüttung ohne Zwischenausschüttung	EUR
7orca Vega Return Anteilklasse I	250.000	0,00	0,100	Ausschüttung ohne Zwischenausschüttung	EUR

Halbjahresbericht Torca Vega Return

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)	74,44
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)	-4,09

Sonstige Angaben

Torca Vega Return Anteilklasse R

Anteilwert	EUR	90,62
Ausgabepreis	EUR	95,15
Rücknahmepreis	EUR	90,62
Anzahl Anteile	STK	49.910

Torca Vega Return Anteilklasse I

Anteilwert	EUR	92,77
Ausgabepreis	EUR	92,77
Rücknahmepreis	EUR	92,77
Anzahl Anteile	STK	1.478.270

Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände

Bewertung

Die nachfolgend dargestellten Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände decken eventuelle aus der Covid-19 Pandemie resultierenden Marktauswirkungen ab. Darüber hinausgehende Bewertungsanpassungen waren nicht erforderlich.

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.

Halbjahresbericht 7orca Vega Return

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

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.

Frankfurt am Main, den 1. Juli 2022

Universal-Investment-Gesellschaft mbH
Die Geschäftsführung

Halbjahresbericht 7orca Vega Return

Anteilklassen im Überblick

Erstausgabedatum

Anteilklasse R	04.12.2017
Anteilklasse I	04.12.2017

Erstausgabepreise

Anteilklasse R	€ 100,00 zzgl. Ausgabeaufschlag
Anteilklasse I	€ 100,00 zzgl. Ausgabeaufschlag

Ausgabeaufschlag

Anteilklasse R	5,00%
Anteilklasse I	0,00%

Mindestanlagesumme

Anteilklasse R	keine
Anteilklasse I	€ 250.000,00 nur bei Erstanlage (bei Folgeanlagen: keine)

Verwaltungsvergütung

Anteilklasse R	0,155% p.a. effektiv
Anteilklasse I	0,10% p.a. effektiv

Verwahrstellenvergütung

Anteilklasse R	0,035% p.a. effektiv
Anteilklasse I	0,035% p.a. effektiv

Asset Management-Vergütung

Anteilklasse R	1,27% p.a. effektiv
Anteilklasse I	0,57% p.a. effektiv

Währung

Anteilklasse R	EUR
Anteilklasse I	EUR

Ertragsverwendung

Anteilklasse R	ausschüttend
Anteilklasse I	ausschüttend

Wertpapier-Kennnummer / ISIN:

Anteilklasse R	A2H5XX / DE000A2H5XX8
Anteilklasse I	A2H5XY / DE000A2H5XY6

Halbjahresbericht 7orca Vega Return

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 57.243.165,68 (Stand: September 2020)

Geschäftsführer:

Frank Eggloff, München
Ian Lees, Leverkusen
Katja Müller, Bad Homburg
Markus Neubauer, Frankfurt am Main
Michael Reinhard, Bad Vilbel
Stefan Rockel, Lauterbach (Hessen)
Stephan Scholl, Königstein im Taunus
Axel Vespermann, Dreieich

Aufsichtsrat:

Prof. Dr. Harald Wiedmann (Vorsitzender), Berlin
Dr. Axel Eckhardt, Düsseldorf
Daniel Fischer, Bad Vilbel
Daniel F. Just, Pöcking

2. Verwahrstelle

BNP Paribas Securities Services S.C.A.
Zweigniederlassung Frankfurt am Main

Hausanschrift:

Europa-Allee 12
60327 Frankfurt am Main

Telefon: 069 / 15205-0
Telefax: 069 / 15205-550
www.bnpparibas.de

Rechtsform: Société en commandite par actions
(Kommanditgesellschaft auf Aktien französischen Rechts)
Haftendes Eigenkapital: € 977,2 Mio. (Stand: 31.12.2018)

3. Asset Management-Gesellschaft und Vertrieb

7orca Asset Management AG

Postanschrift:

Am Sandtorkai 77
20457 Hamburg

Telefon: +49 40 334 60 46-0
www.7orca.com

4. Anlageausschuss

Jasper Dux
7orca Asset Management AG, Hamburg

Thimo Koch
7orca Asset Management AG, Hamburg

Tindaro Siragusano
7orca Asset Management AG, Hamburg