

KAPITALVERWALTUNGSGESELLSCHAFT:



7orca Vega Income

HALBJAHRESBERICHT

ZUM 30. JUNI 2023

VERWAHRSTELLE:



BNP PARIBAS

ASSET MANAGEMENT UND VERTRIEB:



Halbjahresbericht 7orca Vega Income

Vermögensübersicht zum 30.06.2023

Anlageschwerpunkte	Tageswert in EUR	% Anteil am Fondsvermögen
I. Vermögensgegenstände	16.154.818,23	100,26
1. Anleihen	12.504.253,00	77,60
< 1 Jahr	3.831.973,00	23,78
>= 1 Jahr bis < 3 Jahre	8.672.280,00	53,82
2. Derivate	-175.543,64	-1,09
3. Bankguthaben	2.388.719,21	14,82
4. Geldmarktfonds	1.405.725,60	8,72
5. Sonstige Vermögensgegenstände	31.664,06	0,20
II. Verbindlichkeiten	-41.294,52	-0,26
III. Fondsvermögen	16.113.523,71	100,00

Halbjahresbericht 7orca Vega Income

Vermögensaufstellung zum 30.06.2023

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2023	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Bestandspositionen							EUR	12.504.253,00	77,60
Börsengehandelte Wertpapiere							EUR	12.504.253,00	77,60
Verzinsliche Wertpapiere							EUR	12.504.253,00	77,60
0,1250 % Aareal Bank AG MTN-HPF.S.226 v.2019(2024)	DE000AAR0249		EUR	600	0	0 %	97,893	587.358,00	3,65
1,0000 % Banco Santander S.A. EO-Cédulas Hipotec. 2015(25)	ES0413790397		EUR	400	0	0 %	94,985	379.940,00	2,36
0,3980 % BPCE SFH EO-Med.-T.Obl.Fin.Hab.2015(25)	FR0012695716		EUR	800	0	0 %	93,966	751.728,00	4,67
2,2380 % Cie de Financement Foncier EO-FLR MTN Obl. Fonc.2004(24)	FR0010101832		EUR	500	500	0 %	97,790	488.950,00	3,03
0,3750 % Cie de Financement Foncier EO-Med.-T. Obl.Fonc. 2017(24)	FR0013281748		EUR	500	0	0 %	95,126	475.630,00	2,95
0,0500 % Cie de Financement Foncier EO-Med.-T. Obl.Fonc. 2020(24)	FR0013507365		EUR	1.000	1.000	0 %	97,114	971.140,00	6,03
1,7500 % Council of Europe Developm.Bk EO-Medium-Term Notes 2014(24)	XS1060350326		EUR	500	500	0 %	98,358	491.790,00	3,05
0,6250 % Crédit Mutuel Home Loan SFH SA EO-Med.-T.Obl.Fin.Hab.2017(25)	FR0013236247		EUR	400	0	0 %	94,927	379.708,00	2,36
4,1250 % European Investment Bank EO-Medium-Term Notes 2007(24)	XS0290050524		EUR	500	500	0 %	100,405	502.025,00	3,12
0,2500 % Jyske Realkredit A/S EO-Cov. Bonds 2016(23)	XS1435774903		EUR	700	0	0 %	100,000	700.000,00	4,34
0,6250 % Länsförsäkringar Hypotek AB EO-Med.-Term Cov. Nts 2018(25)	XS1799048704		EUR	800	0	0 %	94,561	756.488,00	4,69
0,0000 % Lb.Hessen-Thüringen GZ MTN HPF S.H335 v.19(24)	XS2022037795		EUR	600	600	0 %	96,239	577.434,00	3,58
0,3750 % Norddeutsche Landesbank -GZ- MTN-HPF S.486 v.17(25)	DE000DHY4861		EUR	600	0	0 %	93,520	561.120,00	3,48
0,3750 % Raiffeisenl.Niederöst.-Wien AG EO-Medium-Term Notes 2017(24)	XS1681119167		EUR	600	0	0 %	95,804	574.824,00	3,57
3,0000 % Rheinland-Pfalz, Land Landessch.v.2023 (2025)	DE000RLP1395		EUR	500	500	0 %	98,950	494.750,00	3,07
0,0500 % Skandinaviska Enskilda Banken EO-Medium-Term Notes 2019(24)	XS2020568734		EUR	600	0	0 %	96,162	576.972,00	3,58
0,5000 % Société Générale SFH S.A. EO-M.-T.Obl.Fin.Hab. 2017(25)	FR0013259413		EUR	800	0	0 %	93,919	751.352,00	4,66
0,3750 % SpareBank 1 Boligkreditt AS EO-M.-T. Mortg.Cov.Bds 17(24)	XS1637099026		EUR	600	0	0 %	96,610	579.660,00	3,60
0,3750 % SR-Boligkreditt A.S. EO-Mortg. Covered MTN 2017(24)	XS1692489583		EUR	700	0	0 %	95,714	669.998,00	4,16
0,5000 % Swedish Covered Bond Corp.,The EO-Medium-Term Notes 2018(25)	XS1759602953		EUR	500	0	0 %	94,842	474.210,00	2,94
0,7500 % UniCredit Bank Austria AG EO-Med.-T.Hyp.Pf.-Br. 2015(25)	AT000B049572		EUR	800	0	0 %	94,897	759.176,00	4,71
Summe Wertpapiervermögen 2)							EUR	12.504.253,00	77,60

Halbjahresbericht Torca Vega Income

Vermögensaufstellung zum 30.06.2023

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2023	Käufe / Zugänge Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens	
Derivate						EUR	-175.543,64	-1,09	
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)									
Optionsrechte						EUR	-18.988,29	-0,12	
Optionsrechte auf Zinsterminkontrakte						EUR	-18.988,29	-0,12	
FUTURE EU-BUND 09.23 CALL 21.07.23 BP 137,00 EUREX			185	EUR	Anzahl -72	EUR	0,180	7.200,00	0,04
FUTURE EU-BUND 09.23 CALL 21.07.23 BP 138,00 EUREX			185	EUR	Anzahl -35	EUR	0,100	5.600,00	0,03
FUTURE EU-BUND 09.23 PUT 21.07.23 BP 129,50 EUREX			185	EUR	Anzahl -36	EUR	0,080	5.760,00	0,04
FUTURE EU-BUND 09.23 PUT 21.07.23 BP 130,50 EUREX			185	EUR	Anzahl -36	EUR	0,160	3.960,00	0,02
FUTURE EU-BUND 09.23 PUT 21.07.23 BP 131,50 EUREX			185	EUR	Anzahl -35	EUR	0,310	-3.500,00	-0,02
FUT 10Y TREA 2W 09.23 CALL 14.07.23 BP 115,75 CBOT			362	USD	Anzahl -57	USD	0,016	-816,41	-0,01
FUT 10Y TREA 2W 09.23 PUT 14.07.23 BP 111,25 CBOT			362	USD	Anzahl -57	USD	0,219	-11.429,78	-0,07
FUT 10Y TREA CALL 07.07.23 BP 115,50 CBOT			362	USD	Anzahl -57	USD	0,001	-52,25	0,00
FUT 10Y TREA PUT 07.07.23 BP 111,00 CBOT			362	USD	Anzahl -57	USD	0,047	-2.449,24	-0,02
FUTURE 10Y TREA 09.23 CALL 21.07.23 BP 115,50 CBOT			362	USD	Anzahl -58	USD	0,047	-2.492,21	-0,02
FUTURE 10Y TREA 09.23 PUT 21.07.23 BP 111,50 CBOT			362	USD	Anzahl -58	USD	0,391	-20.768,40	-0,13
Devisen-Derivate						EUR	-156.555,35	-0,97	
Forderungen/Verbindlichkeiten									
Optionsrechte						EUR	-155.575,66	-0,97	
Optionsrechte auf Devisen						EUR	-155.575,66	-0,97	
F FX AUD/USD 2PM 09.23 CALL 07.07.23 BP 69,00 CME			352	USD	-34.000	USD	0,010	-311,67	0,00
F FX AUD/USD 2PM 09.23 PUT 07.07.23 BP 64,50 CME			352	USD	-34.000	USD	0,005	-155,83	0,00
F FX AUD/USD W 09.23 CALL 14.07.23 BP 70,00 CME			352	USD	-34.000	USD	0,010	-311,67	0,00
F FX AUD/USD W 09.23 CALL 21.07.23 BP 69,75 CME			352	USD	-34.000	USD	0,015	-467,50	0,00
F FX AUD/USD W 09.23 CALL 28.07.23 BP 69,50 CME			352	USD	-34.000	USD	0,045	-1.402,51	-0,01
F FX AUD/USD W 09.23 PUT 14.07.23 BP 66,25 CME			352	USD	-34.000	USD	0,330	-10.285,09	-0,06
F FX AUD/USD W 09.23 PUT 21.07.23 BP 65,50 CME			352	USD	-34.000	USD	0,210	-6.545,05	-0,04
F FX AUD/USD W 09.23 PUT 28.07.23 BP 65,00 CME			352	USD	-34.000	USD	0,190	-5.921,72	-0,04

Halbjahresbericht 7orca Vega Income

Vermögensaufstellung zum 30.06.2023

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2023	Käufe / Zugänge Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens	
F FX EUR/USD 2PM 09.23 CALL 07.07.23 BP 1,10 CME			352	USD	-2.375.000	USD	0,002	-4.136,49	-0,03
F FX EUR/USD 2PM 09.23 CALL 14.07.23 BP 1,115 CME			352	USD	-2.375.000	USD	0,000	-870,84	-0,01
F FX EUR/USD 2PM 09.23 CALL 21.07.23 BP 1,1225 CME			352	USD	-2.375.000	USD	0,000	-761,99	0,00
F FX EUR/USD 2PM 09.23 CALL 28.07.23 BP 1,1125 CME			352	USD	-2.375.000	USD	0,002	-4.571,91	-0,03
F FX EUR/USD 2PM 09.23 PUT 07.07.23 BP 1,06 CME			352	USD	-2.375.000	USD	0,000	-108,86	0,00
F FX EUR/USD 2PM 09.23 PUT 14.07.23 BP 1,0725 CME			352	USD	-2.375.000	USD	0,000	-761,99	0,00
F FX EUR/USD 2PM 09.23 PUT 21.07.23 BP 1,0825 CME			352	USD	-2.375.000	USD	0,002	-4.789,62	-0,03
F FX EUR/USD 2PM 09.23 PUT 28.07.23 BP 1,07 CME			352	USD	-2.375.000	USD	0,001	-2.612,52	-0,02
F FX GBP/USD 2PM 09.23 CALL 07.07.23 BP 127,00 CME			359	USD	-18.125	USD	0,560	-9.304,24	-0,06
F FX GBP/USD 2PM 09.23 PUT 07.07.23 BP 121,00 CME			359	USD	-18.125	USD	0,010	-166,15	0,00
F FX GBP/USD W 09.23 CALL 14.07.23 BP 129,00 CME			359	USD	-18.125	USD	0,140	-2.326,06	-0,01
F FX GBP/USD W 09.23 CALL 21.07.23 BP 130,50 CME			359	USD	-18.125	USD	0,060	-996,88	-0,01
F FX GBP/USD W 09.23 CALL 28.07.23 BP 130,50 CME			359	USD	-18.125	USD	0,120	-1.993,77	-0,01
F FX GBP/USD W 09.23 PUT 14.07.23 BP 123,25 CME			359	USD	-18.125	USD	0,030	-498,44	0,00
F FX GBP/USD W 09.23 PUT 21.07.23 BP 124,00 CME			359	USD	-18.125	USD	0,120	-1.993,77	-0,01
F FX GBP/USD W 09.23 PUT 28.07.23 BP 124,00 CME			359	USD	-18.125	USD	0,210	-3.489,09	-0,02
F FX JPY/USD 2PM 09.23 CALL 07.07.23 BP 75,00 CME			352	USD	-35.000	USD	0,005	-160,42	0,00
F FX JPY/USD 2PM 09.23 CALL 14.07.23 BP 74,50 CME			352	USD	-36.250	USD	0,015	-498,44	0,00
F FX JPY/USD 2PM 09.23 CALL 21.07.23 BP 73,25 CME			352	USD	-36.250	USD	0,035	-1.163,03	-0,01
F FX JPY/USD 2PM 09.23 CALL 28.07.23 BP 72,50 CME			352	USD	-37.500	USD	0,200	-6.875,06	-0,04
F FX JPY/USD 2PM 09.23 PUT 07.07.23 BP 71,00 CME			352	USD	-35.000	USD	1,000	-32.083,60	-0,20
F FX JPY/USD 2PM 09.23 PUT 14.07.23 BP 70,25 CME			352	USD	-36.250	USD	0,600	-19.937,67	-0,12
F FX JPY/USD 2PM 09.23 PUT 21.07.23 BP 69,50 CME			352	USD	-36.250	USD	0,370	-12.294,89	-0,08
F FX JPY/USD 2PM 09.23 PUT 28.07.23 BP 68,00 CME			352	USD	-37.500	USD	0,150	-5.156,29	-0,03
FUT FX CAD/USD 09.23 CALL 14.07.23 BP 76,50 CME			352	USD	-34.000	USD	0,060	-1.870,02	-0,01
FUT FX CAD/USD 09.23 CALL 21.07.23 BP 77,50 CME			352	USD	-34.000	USD	0,010	-311,67	0,00
FUT FX CAD/USD 09.23 CALL 28.07.23 BP 76,75 CME			352	USD	-34.000	USD	0,110	-3.428,36	-0,02
FUT FX CAD/USD 09.23 PUT 14.07.23 BP 74,00 CME			352	USD	-34.000	USD	0,015	-467,50	0,00
FUT FX CAD/USD 09.23 PUT 21.07.23 BP 74,75 CME			352	USD	-34.000	USD	0,130	-4.051,70	-0,03
FUT FX CAD/USD 09.23 PUT 28.07.23 BP 74,00 CME			352	USD	-34.000	USD	0,060	-1.870,02	-0,01
FUTURE FX CAD/USD 09.23 CALL 07.07.23 BP 76,50 CME			352	USD	-34.000	USD	0,015	-467,50	0,00
FUTURE FX CAD/USD 09.23 PUT 07.07.23 BP 73,50 CME			352	USD	-34.000	USD	0,005	-155,83	0,00

Halbjahresbericht 7orca Vega Income

Vermögensaufstellung zum 30.06.2023

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2023	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Währungsterminkontrakte							EUR	-979,69	-0,01
FUTURE CROSS RATE EUR/USD 09.23 CME		352	USD	375.000			USD 1,095	-2.217,20	-0,01
FUTURE CROSS RATE JPY/USD 09.23 CME		352	USD	-22.500			USD 70,015	1.237,51	0,01
Bankguthaben, nicht verbrieft Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds							EUR	3.794.444,81	23,55
Bankguthaben							EUR	2.388.719,21	14,82
EUR - Guthaben bei:									
BNP Paribas S.A., Niederlassung Deutschland			EUR	1.792.502,90			% 100,000	1.792.502,90	11,12
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen bei:									
BNP Paribas S.A., Niederlassung Deutschland			USD	650.412,37			% 100,000	596.216,31	3,70
Geldmarktfonds							EUR	1.405.725,60	8,72
Gruppenfremde Geldmarktfonds							EUR	1.405.725,60	8,72
AMUNDI EURO LIQUIDITY SRI Actions au Porteur IC o.N.	FR0010251660		ANT	6	0	0	EUR 234.287,600	1.405.725,60	8,72
Sonstige Vermögensgegenstände							EUR	31.664,06	0,20
Zinsansprüche			EUR	31.664,06				31.664,06	0,20

Halbjahresbericht 7orca Vega Income

Vermögensaufstellung zum 30.06.2023

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2023	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Sonstige Verbindlichkeiten							EUR	-41.294,52	-0,26
Verwaltungsvergütung			EUR	-6.257,16				-6.257,16	-0,04
Verwahrstellenvergütung			EUR	-2.446,05				-2.446,05	-0,02
Prüfungskosten			EUR	-11.400,00				-11.400,00	-0,07
Veröffentlichungskosten			EUR	-500,00				-500,00	0,00
Portfoliomanagervergütung			EUR	-20.691,31				-20.691,31	-0,13
Fondsvermögen							EUR	16.113.523,71	100,00 1)
7orca Vega Income Anteilklasse I									
Anteilwert							EUR	82,55	
Ausgabepreis							EUR	82,55	
Rücknahmepreis							EUR	82,55	
Anzahl Anteile							STK	185.400	
7orca Vega Income Anteilklasse R									
Anteilwert							EUR	80,82	
Ausgabepreis							EUR	80,82	
Rücknahmepreis							EUR	80,82	
Anzahl Anteile							STK	10.003	

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 Income

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Devisenkurse (in Mengennotiz)

USD	(USD)	per 30.06.2023 1,0909000	= 1 EUR (EUR)
-----	-------	-----------------------------	---------------

Marktschlüssel

Terminbörsen

185	Eurex Deutschland
352	Chicago - CME Globex
359	Chicago Merc. Ex.
362	Chicago Board of Trade

Halbjahresbericht 7orca Vega Income

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					
0,3750 % Nord/LB Lux.S.A. Cov.Bond Bk. EO-M.-T.Lett.d.Ga.Publ. 16(23)	XS1432510631	EUR	0	400	
0,7500 % SR-Boligkredit A.S. EO-Mortg. Covered MTN 2016(23)	XS1344895450	EUR	0	600	
Nichtnotierte Wertpapiere *)					
Verzinsliche Wertpapiere					
0,2500 % Aegon Bank N.V. EO-Med.-Term Cov.Bds 2016(23)2	XS1418849482	EUR	0	500	
0,3750 % Bank of Nova Scotia, The EO-M.-T. Mortg.Cov.Bds 16(23)	XS1377941106	EUR	0	600	
0,2500 % Canadian Imperial Bk of Comm. EO-Med.-T. Cov.Bonds 2018(23)	XS1756725831	EUR	0	700	
0,3750 % Hessen, Land Schatzanw. S.1507 v.2015(2023)	DE000A1RQCJ3	EUR	0	600	
4,5621 % L-Bank Bad.-Württ.-Förderbank FLR MTN Serie 5608 v.20(23)	XS2166345608	EUR	0	500	
0,2500 % Nordea Mortgage Bank PLC EO-Med.-Term Cov. Bds 2018(23)	XS1784067529	EUR	0	500	
0,2500 % Royal Bank of Canada EO-M.-T. Mortg.Cov.Bds 18(23)	XS1847633119	EUR	0	600	
0,2500 % Toronto-Dominion Bank, The EO-Med.-Term Cov.Bds 2018(23)	XS1790069790	EUR	0	500	

Halbjahresbericht 7orca Vega Income

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

Zinsterminkontrakte

Gekaufte Kontrakte:

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

EUR

91.602,00

Verkaufte Kontrakte:

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

EUR

32.462,49

Währungsterminkontrakte

Gekaufte Kontrakte:

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

EUR

74.293,35

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

44.854,85

Halbjahresbericht 7orca Vega Income

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 Zins-Derivate

Optionsrechte auf Zinsterminkontrakte

Verkaufte Kaufoptionen (Call):

(Basiswert(e): FUTURE 10Y TREASURY NOTE (SY.) 1W. 03.23 CBOT, FUTURE 10Y TREASURY NOTE (SY.) 1W. 06.23 CBOT, FUTURE 10Y TREASURY NOTE (SY.) 1W. 09.23 CBOT, FUTURE 10Y TREASURY NOTE (SYNTH.) 03.23 CBOT, FUTURE 10Y TREASURY NOTE (SYNTH.) 06.23 CBOT, FUTURE 10Y TREASURY NOTE (SYNTH.) 09.23 CBOT, FUTURE 10Y TREASURY NOTE (SYNTH.) 3W. 03.23 CBOT, FUTURE 10Y TREASURY NOTE (SYNTH.) 3W. 06.23 CBOT, FUTURE 10Y TREASURY NOTE (SYNTH.) 3W. 09.23 CBOT, FUTURE 10Y TREASURY NOTE (SYNTH.) 4W. 06.23 CBOT, FUTURE 10Y TREASURY NOTE (SYNTH.) 5W. 06.23 CBOT, FUTURE 10Y TREASURY NOTE (SYNTH.) 5W. 09.23 CBOT, FUTURE 10YTRN2W 03.23 CBOT, FUTURE 10YTRN2W 06.23 CBOT, FUTURE 10YTRN2W 09.23 CBOT, FUTURE EURO-BUND 03.23 EUREX, FUTURE EURO-BUND 06.23 EUREX, FUTURE EURO-BUND 09.23 EUREX)		EUR			500,62
---	--	-----	--	--	--------

Verkaufte Verkaufsoptionen (Put):

(Basiswert(e): FUTURE 10Y TREASURY NOTE (SY.) 1W. 03.23 CBOT, FUTURE 10Y TREASURY NOTE (SY.) 1W. 06.23 CBOT, FUTURE 10Y TREASURY NOTE (SY.) 1W. 09.23 CBOT, FUTURE 10Y TREASURY NOTE (SYNTH.) 03.23 CBOT, FUTURE 10Y TREASURY NOTE (SYNTH.) 06.23 CBOT, FUTURE 10Y TREASURY NOTE (SYNTH.) 09.23 CBOT, FUTURE 10Y TREASURY NOTE (SYNTH.) 3W. 03.23 CBOT, FUTURE 10Y TREASURY NOTE (SYNTH.) 3W. 06.23 CBOT, FUTURE 10Y TREASURY NOTE (SYNTH.) 3W. 09.23 CBOT, FUTURE 10Y TREASURY NOTE (SYNTH.) 4W. 06.23 CBOT, FUTURE 10Y TREASURY NOTE (SYNTH.) 5W. 06.23 CBOT, FUTURE 10Y TREASURY NOTE (SYNTH.) 5W. 09.23 CBOT, FUTURE 10YTRN2W 03.23 CBOT, FUTURE 10YTRN2W 06.23 CBOT, FUTURE 10YTRN2W 09.23 CBOT, FUTURE EURO-BUND 03.23 EUREX, FUTURE EURO-BUND 06.23 EUREX, FUTURE EURO-BUND 09.23 EUREX)		EUR			456,28
---	--	-----	--	--	--------

**Halbjahresbericht
7orca Vega Income**

**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 auf Devisen-Derivate

Optionsrechte auf Devisen

Verkaufte Kaufoptionen (Call):

, FUTURE CROSS RATE GBP/USD 2PM EUR 06.23 CME, FUTURE CROSS RATE GBP/USD 2PM W EUR 03.23 CME, FUTURE CROSS RATE GBP/USD 2PM W EUR 06.23 CME, FUTURE CROSS RATE GBP/USD 2PM W EUR 09.23 CME, FUTURE CROSS RATE JPY/USD 2PM EUR 03.23 CME, FUTURE CROSS RATE JPY/USD 2PM EUR 06.23 CME, FUTURE CROSS RATE JPY/USD 2PM W EUR 03.23 CME, FUTURE CROSS RATE JPY/USD 2PM W EUR 06.23 CME, FUTURE CROSS RATE JPY/USD 2PM W EUR 09.23 (Basiswert(e): FUTURE CROSS RATE AUD/USD 2PM EUR 03.23 CME, FUTURE CROSS RATE AUD/USD 2PM EUR 06.23 CME, FUTURE CROSS RATE AUD/USD 2PM W EUR 03.23 CME, FUTURE CROSS RATE AUD/USD 2PM W EUR 06.23 CME, FUTURE CROSS RATE AUD/USD 2PM W EUR 09.23 CME, FUTURE CROSS RATE CAD/USD 03.23 CME, FUTURE CROSS RATE CAD/USD 06.23 CME, FUTURE CROSS RATE CAD/USD 09.23 CME, FUTURE CROSS RATE EUR/USD 2PM EUR 03.23 CME, FUTURE CROSS RATE EUR/USD 2PM EUR 06.23 CME, FUTURE CROSS RATE EUR/USD 2PM W EUR 03.23 CME, FUTURE CROSS RATE EUR/USD 2PM W EUR 06.23 CME, FUTURE CROSS RATE EUR/USD 2PM W EUR 09.23 CME, FUTURE CROSS RATE GBP/USD 2PM EUR 03.23		EUR			0,00
---	--	-----	--	--	------

Halbjahresbericht 7orca Vega Income

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 06.23 CME, FUTURE CROSS RATE GBP/USD 2PM W EUR 03.23 CME, FUTURE CROSS RATE GBP/USD 2PM W EUR 06.23 CME, FUTURE CROSS RATE GBP/USD 2PM W EUR 09.23 CME, FUTURE CROSS RATE JPY/USD 2PM EUR 03.23 CME, FUTURE CROSS RATE JPY/USD 2PM EUR 06.23 CME, FUTURE CROSS RATE JPY/USD 2PM W EUR 03.23 CME, FUTURE CROSS RATE JPY/USD 2PM W EUR 06.23 CME, FUTURE CROSS RATE JPY/USD 2PM W EUR 09.23 (Basiswert(e): FUTURE CROSS RATE AUD/USD 2PM EUR 03.23 CME, FUTURE CROSS RATE AUD/USD 2PM EUR 06.23 CME, FUTURE CROSS RATE AUD/USD 2PM W EUR 03.23 CME, FUTURE CROSS RATE AUD/USD 2PM W EUR 06.23 CME, FUTURE CROSS RATE AUD/USD 2PM W EUR 09.23 CME, FUTURE CROSS RATE CAD/USD 03.23 CME, FUTURE CROSS RATE CAD/USD 06.23 CME, FUTURE CROSS RATE CAD/USD 09.23 CME, FUTURE CROSS RATE EUR/USD 2PM EUR 03.23 CME, FUTURE CROSS RATE EUR/USD 2PM EUR 06.23 CME, FUTURE CROSS RATE EUR/USD 2PM W EUR 03.23 CME, FUTURE CROSS RATE EUR/USD 2PM W EUR 06.23 CME, FUTURE CROSS RATE EUR/USD 2PM W EUR 09.23 CME, FUTURE CROSS RATE GBP/USD 2PM EUR 03.23		EUR			-236.502,71

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 Income**

Anteilklassenmerkmale im Überblick

Anteilklasse	Mindestanlagesumme in Währung	Ausgabeaufschlag bis zu 5,00%, derzeit (Angabe in %)	Verwaltungsvergütung bis zu 0,250% p.a., derzeit (Angabe in % p.a.)	Ertragsverwendung	Währung
7orca Vega Income Anteilklasse I	250.000	0,00	0,150	Ausschüttung mit Zwischenausschüttung	EUR
7orca Vega Income Anteilklasse R	keine	0,00	0,200	Ausschüttung mit Zwischenausschüttung	EUR

Halbjahresbericht 7orca Vega Income

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)	77,60
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)	-1,09

Sonstige Angaben

7orca Vega Income Anteilklasse I

Anteilwert	EUR	82,55
Ausgabepreis	EUR	82,55
Rücknahmepreis	EUR	82,55
Anzahl Anteile	STK	185.400

7orca Vega Income Anteilklasse R

Anteilwert	EUR	80,82
Ausgabepreis	EUR	80,82
Rücknahmepreis	EUR	80,82
Anzahl Anteile	STK	10.003

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 Income

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 3. Juli 2023

Universal-Investment-Gesellschaft mbH
Die Geschäftsführung

Halbjahresbericht 7orca Vega Income

Anteilklassen im Überblick

Erstausgabedatum

Anteilklasse I	22. Juli 2019
Anteilklasse R	22. Juli 2019

Erstausgabepreise

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

Ausgabeaufschlag

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

Mindestanlagesumme

Anteilklasse I	EUR 250.000,-
Anteilklasse R	keine

Verwaltungsvergütung*

Anteilklasse I	0,15 % p.a. effektiv
Anteilklasse R	0,20 % p.a. effektiv

Verwahrstellenvergütung

Anteilklasse I	0,04 % p.a. effektiv
Anteilklasse R	0,04 % p.a. effektiv

Asset Management-Vergütung

Anteilklasse I	0,47 % p.a. effektiv
Anteilklasse R	1,17 % p.a. effektiv

Währung

Anteilklasse I	EUR
Anteilklasse R	EUR

Ertragsverwendung

Anteilklasse I	ausschüttend
Anteilklasse R	ausschüttend

Wertpapier-Kennnummer / ISIN:

Anteilklasse I	A2PMW0 / DE000A2PMW03
Anteilklasse R	A2PMW1 / DE000A2PMW11

*Unterliegt einer Staffelung

Halbjahresbericht 7orca Vega Income

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 71.352.213,88 (Stand: September 2022)

Geschäftsführer:

Frank Eggloff, München
Mathias Heiß, Langen
Katja Müller, Bad Homburg v. d. Höhe
Markus Neubauer, Frankfurt am Main
Axel Vespermann, Dreieich

Aufsichtsrat:

Prof. Dr. Harald Wiedmann (Vorsitzender), Berlin
Dr. Axel Eckhardt, Düsseldorf
Ellen Engelhardt
Daniel Fischer, Bad Vilbel
Janet Zirlewagen

2. Verwahrstelle

BNP Paribas S.A. Niederlassung Deutschland

Hausanschrift:

Senckenberganlage 19
60325 Frankfurt am Main

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

Rechtsform: Zweigniederlassung einer Aktiengesellschaft nach französischem Recht
Haftendes Eigenkapital: Mio. € 122.507 (Stand: 31.12.2021)

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 Düx
7orca Asset Management AG, Hamburg

Thimo Koch
7orca Asset Management AG, Hamburg

Tindaro Siragusano
7orca Asset Management AG, Hamburg