

KAPITALVERWALTUNGSGESELLSCHAFT:



EuropaInvest Dynamic Plus

HALBJAHRESBERICHT

ZUM 30. JUNI 2023

VERWAHRSTELLE:



HAUCK
AUFHÄUSER
LAMPE

BERATUNG UND VERTRIEB:

The logo for Kanon, featuring the word 'KANON' in a bold, sans-serif font with a horizontal orange bar underneath.

Aktiengesellschaft

Halbjahresbericht EuropaInvest Dynamic Plus

Vermögensübersicht zum 30.06.2023

| Anlageschwerpunkte | Tageswert in EUR | % Anteil am Fondsvermögen |
|--------------------------------|--------------------------------|------------------------------|
| I. Vermögensgegenstände | 25.867.858,15 | 100,23 |
| 1. Investmentanteile EUR | 23.852.510,80 23.852.510,80 | 92,42 92,42 |
| 2. Derivate | 1.989.045,00 | 7,71 |
| 3. Bankguthaben | 26.302,35 | 0,10 |
| II. Verbindlichkeiten | -60.253,59 | -0,23 |
| III. Fondsvermögen | 25.807.604,56 | 100,00 |

Halbjahresbericht Europalvest Dynamic Plus

Vermögensaufstellung zum 30.06.2023

| Gattungsbezeichnung | ISIN | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000 | Bestand 30.06.2023 | Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum | Verkäufe / Abgänge | Kurs | Kurswert in EUR | % des Fonds- vermögens |
|---|--------------|-------|---|-----------------------|---|-----------------------|-------------|----------------------|------------------------------|
| Bestandspositionen | | | | | | | EUR | 23.852.510,80 | 92,42 |
| Investmentanteile | | | | | | | EUR | 23.852.510,80 | 92,42 |
| Gruppenfremde Investmentanteile | | | | | | | EUR | 23.852.510,80 | 92,42 |
| AIS-Amundi EURO STOXX 50 Namens-Anteile D Cap.EUR o.N. | LU1681047319 | | ANT | 33.840 | 0 | 3.380 | EUR 70,750 | 2.394.180,00 | 9,28 |
| BNP P.E.FR-EURO STOXX 50 U.ETF Act. au Port. EUR C/D o.N. | FR0012740983 | | ANT | 219.600 | 10.700 | 27.700 | EUR 10,916 | 2.397.153,60 | 9,29 |
| Deka EURO STOXX 50 UCITS ETF Inhaber-Anteile | DE000ETFL029 | | ANT | 54.140 | 1.160 | 5.020 | EUR 44,300 | 2.398.402,00 | 9,29 |
| HSBC EURO STOXX 50 UCITS ETF Registered Shares o.N. | IE00B4K6B022 | | ANT | 50.480 | 0 | 5.550 | EUR 47,150 | 2.380.132,00 | 9,22 |
| InvescoMI EURO STOXX 50 ETF Registered Shares Dist o.N. | IE00B5B5TG76 | | ANT | 55.260 | 1.200 | 5.580 | EUR 43,060 | 2.379.495,60 | 9,22 |
| iShares Core EO STOXX 50 U.E.DE Inhaber-Anteile | DE0005933956 | | ANT | 52.890 | 0 | 5.010 | EUR 44,660 | 2.362.067,40 | 9,15 |
| LYXOR EURO ST.50 (DR)UCITS ETF Actions au Porteur Acc. o.N. | FR0007054358 | | ANT | 51.570 | 0 | 5.950 | EUR 46,060 | 2.375.314,20 | 9,20 |
| Lyxor Index-Cor.EO Stoxx50(DR) Act. Nom. EUR Dis. oN | LU0908501488 | | ANT | 26.220 | 0 | 2.810 | EUR 91,150 | 2.389.953,00 | 9,26 |
| UBS(L)FS-EURO STOXX 50 UC.ETF Inh.-Ant.(EUR) A-dis o.N. | LU0136234068 | | ANT | 53.000 | 0 | 5.290 | EUR 45,235 | 2.397.455,00 | 9,29 |
| Xtrackers Euro Stoxx 50 Inhaber-Anteile 1D o.N. | LU0274211217 | | ANT | 51.120 | 0 | 5.450 | EUR 46,525 | 2.378.358,00 | 9,22 |
| Summe Wertpapiervermögen 2) | | | | | | | EUR | 23.852.510,80 | 92,42 |
| Derivate | | | | | | | EUR | 1.989.045,00 | 7,71 |
| (Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.) | | | | | | | | | |
| Aktienindex-Derivate | | | | | | | EUR | 1.989.045,00 | 7,71 |
| Forderungen/Verbindlichkeiten | | | | | | | | | |
| Optionsrechte | | | | | | | EUR | 1.989.045,00 | 7,71 |
| Optionsrechte auf Aktienindices | | | | | | | EUR | 1.989.045,00 | 7,71 |
| ESTX 50 PR.EUR CALL 15.03.24 BP 3900,00 EUREX | | | 185 | Anzahl 1500 | | | EUR 645,300 | 967.950,00 | 3,75 |
| ESTX 50 PR.EUR CALL 15.03.24 BP 4400,00 EUREX | | | 185 | Anzahl -2250 | | | EUR 264,400 | -594.900,00 | -2,31 |
| ESTX 50 PR.EUR CALL 15.09.23 BP 4150,00 EUREX | | | 185 | Anzahl 1400 | | | EUR 309,200 | 432.880,00 | 1,68 |
| ESTX 50 PR.EUR CALL 15.09.23 BP 4550,00 EUREX | | | 185 | Anzahl -2100 | | | EUR 40,200 | -84.420,00 | -0,33 |

Halbjahresbericht Europainvest Dynamic Plus

Vermögensaufstellung zum 30.06.2023

| Gattungsbezeichnung | ISIN | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000 | Bestand 30.06.2023 | Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum | Verkäufe / Abgänge | Kurs | Kurswert in EUR | % des Fonds- vermögens |
|---|------|-------|---|-----------------------|---|-----------------------|---------------|----------------------|------------------------------|
| ESTX 50 PR.EUR CALL 15.12.23 BP 3500,00 EUREX | | 185 | Anzahl | 1200 | | | EUR 959,300 | 1.151.160,00 | 4,46 |
| ESTX 50 PR.EUR CALL 15.12.23 BP 4100,00 EUREX | | 185 | Anzahl | -1800 | | | EUR 419,600 | -755.280,00 | -2,93 |
| ESTX 50 PR.EUR CALL 20.06.25 BP 4400,00 EUREX | | 185 | Anzahl | 1400 | | | EUR 429,600 | 601.440,00 | 2,33 |
| ESTX 50 PR.EUR CALL 20.06.25 BP 4900,00 EUREX | | 185 | Anzahl | -2100 | | | EUR 198,400 | -416.640,00 | -1,61 |
| ESTX 50 PR.EUR CALL 20.09.24 BP 3500,00 EUREX | | 185 | Anzahl | 1700 | | | EUR 1.008,400 | 1.714.280,00 | 6,64 |
| ESTX 50 PR.EUR CALL 20.09.24 BP 3900,00 EUREX | | 185 | Anzahl | -2550 | | | EUR 682,500 | -1.740.375,00 | -6,74 |
| ESTX 50 PR.EUR CALL 20.12.24 BP 3900,00 EUREX | | 185 | Anzahl | 1700 | | | EUR 726,000 | 1.234.200,00 | 4,78 |
| ESTX 50 PR.EUR CALL 20.12.24 BP 4400,00 EUREX | | 185 | Anzahl | -2550 | | | EUR 384,700 | -980.985,00 | -3,80 |
| ESTX 50 PR.EUR CALL 21.03.25 BP 4100,00 EUREX | | 185 | Anzahl | 1600 | | | EUR 620,800 | 993.280,00 | 3,85 |
| ESTX 50 PR.EUR CALL 21.03.25 BP 4600,00 EUREX | | 185 | Anzahl | -2400 | | | EUR 317,900 | -762.960,00 | -2,96 |
| ESTX 50 PR.EUR CALL 21.06.24 BP 3500,00 EUREX | | 185 | Anzahl | 1700 | | | EUR 969,100 | 1.647.470,00 | 6,38 |
| ESTX 50 PR.EUR CALL 21.06.24 BP 4000,00 EUREX | | 185 | Anzahl | -2550 | | | EUR 556,100 | -1.418.055,00 | -5,49 |
| Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds | | | | | | | EUR | 26.302,35 | 0,10 |
| Bankguthaben | | | | | | | EUR | 26.302,35 | 0,10 |
| EUR - Guthaben bei: | | | | | | | | | |
| Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG | | | EUR | 26.302,35 | | | % 100,000 | 26.302,35 | 0,10 |
| Sonstige Verbindlichkeiten | | | | | | | EUR | -60.253,59 | -0,23 |
| Verwaltungsvergütung | | | EUR | -11.326,21 | | | | -11.326,21 | -0,04 |
| Verwahrstellenvergütung | | | EUR | -3.080,73 | | | | -3.080,73 | -0,01 |
| Anlageberatungsvergütung | | | EUR | -35.596,65 | | | | -35.596,65 | -0,14 |
| Prüfungskosten | | | EUR | -9.750,00 | | | | -9.750,00 | -0,04 |
| Veröffentlichungskosten | | | EUR | -500,00 | | | | -500,00 | 0,00 |
| Fondsvermögen | | | | | | | EUR | 25.807.604,56 | 100,00 1) |

Halbjahresbericht EuropaInvest Dynamic Plus

Vermögensaufstellung zum 30.06.2023

| Gattungsbezeichnung | ISIN | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000 | Bestand 30.06.2023 | Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum | Verkäufe / Abgänge | Kurs | Kurswert in EUR | % des Fonds- vermögens |
|--------------------------|------|-------|---|-----------------------|---|-----------------------|------------|--------------------|------------------------------|
| Anteilwert | | | | | | | EUR | 153,71 | |
| Ausgabepreis | | | | | | | EUR | 161,40 | |
| Anteile im Umlauf | | | | | | | STK | 167.895 | |

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 EuropaInvest Dynamic Plus

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Marktschlüssel

Terminbörsen

185

Eurex Deutschland

Halbjahresbericht EuropaInvest Dynamic Plus

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 |
|---------------------|------|-------------------------------------|--------------------------|-----------------------------|---------------------|
|---------------------|------|-------------------------------------|--------------------------|-----------------------------|---------------------|

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.

Während des Berichtszeitraumes wurden keine Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schuldscheindarlehen getätigt, die nicht in der Vermögensaufstellung genannt sind.

Halbjahresbericht EuropalInvest Dynamic Plus

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

| | |
|---|-------|
| Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %) | 92,42 |
| Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %) | 7,71 |

Sonstige Angaben

| | | |
|-------------------|-----|---------|
| Anteilwert | EUR | 153,71 |
| Ausgabepreis | EUR | 161,40 |
| Anteile im Umlauf | STK | 167.895 |

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.

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 EuropaInvest Dynamic Plus

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

Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG

Hausanschrift:

Kaiserstraße 24
60311 Frankfurt am Main

Postanschrift:

Postfach 10 10 40
60010 Frankfurt am Main

Telefon: 069 / 21 61-0
Telefax: 069 / 21 61-1340
www.hal-privatbank.com

Rechtsform: Aktiengesellschaft
Haftendes Eigenkapital: Mio. € 531 (Stand: 31.12.2021)

3. Anlageberatungsgesellschaft und Vertrieb

KANON AG

Postanschrift:

Große Straße 88
49074 Osnabrück

Telefon (0541) 2 00 746-0
Telefax (0541) 200 746-22
www.kanon.ag

4. Anlageausschuss

Thomas Dellwig
KANON Aktiengesellschaft, Osnabrück

Andreas Stahmeyer
KANON Aktiengesellschaft, Osnabrück

Daniel Tellkamp
KANON Aktiengesellschaft, Osnabrück

Stefan Vonderheide
KANON Aktiengesellschaft, Osnabrück

WKN / ISIN: A2JQK3 / DE000A2JQK35