

KAPITALVERWALTUNGSGESELLSCHAFT:



finccam EQ Tail Protect

HALBJAHRESBERICHT

ZUM 30. JUNI 2024

VERWAHRSTELLE:



ASSET MANAGEMENT UND VERTRIEB:



Halbjahresbericht finccam EQ Tail Protect

Vermögensübersicht zum 30.06.2024

Anlageschwerpunkte	Tageswert in EUR	% Anteil am Fondsvermögen
I. Vermögensgegenstände	1.349.560,91	101,02
1. Anleihen	1.059.586,00	79,31
>= 1 Jahr bis < 3 Jahre	1.059.586,00	79,31
2. Derivate	13.146,22	0,98
3. Bankguthaben	157.126,66	11,76
4. Sonstige Vermögensgegenstände	119.702,03	8,96
II. Verbindlichkeiten	-13.587,85	-1,02
III. Fondsvermögen	1.335.973,06	100,00

**Halbjahresbericht
finccam EQ Tail Protect**

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 im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Bestandspositionen							EUR	1.059.586,00	79,31
Börsengehandelte Wertpapiere							EUR	1.059.586,00	79,31
Verzinsliche Wertpapiere							EUR	1.059.586,00	79,31
0,0000 % Bundesrep.Deutschland Bundesobl.v.2020(25)	DE0001030716		EUR	1.100	1.100	0	% 96,326	1.059.586,00	79,31
Summe Wertpapiervermögen 2)							EUR	1.059.586,00	79,31

Halbjahresbericht finccam EQ Tail Protect

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
Derivate							EUR	13.146,22	0,98
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)									
Aktienindex-Derivate							EUR	4.047,68	0,30
Forderungen/Verbindlichkeiten									
Aktienindex-Terminkontrakte							EUR	-5.351,81	-0,40
FUTURE MSCI WR ESG SC 20.09.24 EUREX		185	USD	Anzahl	37			-5.351,81	-0,40
Optionsrechte							EUR	9.399,49	0,70
Optionsrechte auf Aktienindices							EUR	7.822,41	0,59
S+P 500 INDEX PUT 20.06.25 BP 2400,00 CBOE		361		Anzahl	400	USD	7,400	2.762,22	0,21
S+P 500 INDEX PUT 20.12.24 BP 2000,00 CBOE		361		Anzahl	300	USD	1,125	314,95	0,02
S+P 500 INDEX PUT 21.03.25 BP 2100,00 CBOE		361		Anzahl	400	USD	3,300	1.231,80	0,09
S+P 500 INDEX PUT 21.03.25 BP 2200,00 CBOE		361		Anzahl	300	USD	3,850	1.077,83	0,08
S+P 500 INDEX PUT 21.03.25 BP 2300,00 CBOE		361		Anzahl	600	USD	4,350	2.435,61	0,18
Optionsrechte auf Aktienindex-Terminkontrakte							EUR	1.577,08	0,12
CBOE VOLATIL. IND. CALL 17.07.24 BP 45,00 CBOE		361		Anzahl	9500	USD	0,045	398,94	0,03
CBOE VOLATIL. IND. CALL 21.08.24 BP 55,00 CBOE		361		Anzahl	10100	USD	0,125	1.178,14	0,09
Devisen-Derivate							EUR	9.098,54	0,68
Forderungen/Verbindlichkeiten									
Währungsterminkontrakte							EUR	9.098,54	0,68
FUTURE CROSS RATE EUR/USD 16.09.24 CME		352	USD		-1.375.000	USD	1,076	9.098,54	0,68

Halbjahresbericht finccam EQ Tail Protect

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
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds							EUR	157.126,66	11,76
Bankguthaben							EUR	157.126,66	11,76
EUR - Guthaben bei:									
State Street Bank International GmbH			EUR	32.307,13			% 100,000	32.307,13	2,42
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen bei:									
State Street Bank International GmbH			USD	133.756,61			% 100,000	124.819,53	9,34
Sonstige Vermögensgegenstände							EUR	119.702,03	8,96
Zinsansprüche			EUR	160,11				160,11	0,01
Einschüsse (Initial Margins)			EUR	114.190,11				114.190,11	8,55
Variation Margin			EUR	5.351,81				5.351,81	0,40
Sonstige Verbindlichkeiten							EUR	-13.587,85	-1,02
Verwaltungsvergütung			EUR	-1.421,34				-1.421,34	-0,11
Verwahrstellenvergütung			EUR	-78,11				-78,11	-0,01
Prüfungskosten			EUR	-1.591,29				-1.591,29	-0,12
Veröffentlichungskosten			EUR	-628,69				-628,69	-0,05
Variation Margin			EUR	-9.868,42				-9.868,42	-0,74
Fondsvermögen							EUR	1.335.973,06	100,00 1)

Halbjahresbericht finccam EQ Tail Protect

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 EQ Tail Protect - IS Institutional Seeding									
Anteilwert							EUR	105,45	
Ausgabepreis							EUR	105,45	
Rücknahmepreis							EUR	105,45	
Anzahl Anteile							STK	12.669	

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 finccam EQ Tail Protect

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Devisenkurse (in Mengennotiz)

USD	(USD)	per 28.06.2024 1,0716000	= 1 EUR (EUR)
-----	-------	-----------------------------	---------------

Marktschlüssel

Terminbörsen

185	Eurex Deutschland
352	Chicago - CME Globex
361	Chicago - CBOE Opt. Ex.

**Halbjahresbericht
finccam EQ Tail Protect**

**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

Gekaufte Kontrakte:

(Basiswert(e): MSCI WORLD ESG SCR.NR DL)

EUR

1.304,06

Devisenterminkontrakte (Kauf)

Kauf von Devisen auf Termin:

USD/EUR

EUR

93

Währungsterminkontrakte

Verkaufte Kontrakte:

(Basiswert(e): CROSS RATE EO/DL)

EUR

1.249,97

**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

Gekaufte Kaufoptionen (Call): (Basiswert(e): CBOE VOLATILITY)		EUR			1,56
Gekaufte Verkaufsoptionen (Put): (Basiswert(e): S+P 500)		EUR			0,58

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.

Halbjahresbericht finccam EQ Tail Protect

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)	79,31
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)	0,98

Sonstige Angaben

finccam EQ Tail Protect - IS Institutional Seeding

Anteilwert	EUR	105,45
Ausgabepreis	EUR	105,45
Rücknahmepreis	EUR	105,45
Anzahl Anteile	STK	12.669

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 EQ Tail Protect**

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben gemäß Verordnung (EU) 2015/2365 über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften und der Weiterverwendung sowie zur Änderung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 - Ausweis nach Abschnitt A

Im Berichtszeitraum lagen keine Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Gesamtrendite-Swaps gemäß der oben genannten rechtlichen Bestimmung vor.

Frankfurt am Main, den 1. Juli 2024

Universal-Investment-Gesellschaft mbH
Die Geschäftsführung

Halbjahresbericht finccam EQ Tail Protect

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: + 49 (89) 55878 100
Telefax: + 49 (89) 244471 464
www.statestreet.com

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

3. Asset Management- und Vertriebsgesellschaft

finccam investment GmbH

Postanschrift:

Ganghoferstraße 70
80339 München

Telefon +49 89 2153 8490
www.finccam.com

WKN / ISIN: A407LN / DE000A407LN7