

IQAM OPTIONSPRÄMIENSTRATEGIE PROTECT

Miteigentumsfonds nach österreichischem Recht (OGAW gem. §§ 46 iVm 66ff Investmentfondsgesetz)
verwaltet durch die IQAM Invest GmbH

AT0000A2W9P5 / AT0000A2W9Q3

HALBJAHRESBERICHT

vom 1. März 2023 bis 31. August 2023

INHALTSVERZEICHNIS

Angaben zur IQAM Invest GmbH	1
Angaben zum IQAM OptionsprämienStrategie Protect.....	2
Fondsdetails in EUR.....	2
Wertpapiervermögen und derivative Produkte zum 31.08.2023.....	3
Aufgliederung des Fondsvermögens zum 31.08.2023 in EUR.....	5

ANGABEN ZUR IQAM INVEST GMBH

Fondsverwaltung:	IQAM Invest GmbH Franz-Josef-Straße 22, 5020 Salzburg T +43 505 8686-0, F +43 505 8686-869 office@iqam.com, www.iqam.com
Aufsichtsrat:	Dr. Ulrich Neugebauer Vorsitzender des Aufsichtsrates, Deko Investment GmbH Thomas Ketter Stellvertretender Vorsitzender des Aufsichtsrates, Deko Investment GmbH Thomas Leicher Deko Investment GmbH Sylvia Peroutka vom Betriebsrat entsandt Dr. Peter Pavlicek vom Betriebsrat entsandt
Geschäftsführung:	Holger Wern Mag. Leopold Huber (ab 19.09.2023) Dr. Thomas Steinberger (bis 31.12.2023)

ANGABEN ZUM IQAM OPTIONSPRÄMIENSTRATEGIE PROTECT

Fondsmanager:	Deka Investment GmbH, Frankfurt am Main
Depotbank:	Raiffeisen Bank International AG, Wien
Abschlussprüfer:	Deloitte Audit Wirtschaftsprüfungs GmbH, Wien
ISIN:	AT0000A2W9P5 Ausschüttende Tranche AT0000A2W9Q3 Thesaurierende Tranche

FONDSDETAILS IN EUR

	31.08.2023	28.02.2023
Fondsvermögen	43.902.363,44	46.986.378,34
Ausschüttende Tranche (ISIN AT0000A2W9P5)		
Rechenwert je Anteil	1.014,43	1.002,45
Anzahl der ausgegebenen Anteile	18.991	22.491
Thesaurierende Tranche (ISIN AT0000A2W9Q3)		
Rechenwert je Anteil	101,76	100,24
Anzahl der ausgegebenen Anteile	242.093	243.809

WERTPAPIERVERMÖGEN UND DERIVATIVE PRODUKTE ZUM 31.08.2023

ISIN	Wertpapier-Bezeichnung	Zinssatz	Käufe / Zugänge Stück / Nominale	Verkäufe / Abgänge (Nom. in 1.000, ger.)	Bestand	Kurs in Wertpapierwährung	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fondsvermögen
ZUM AMTLICHEN HANDEL ODER EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT ZUGELASSENE WERTPAPIERE								
ANLEIHEN auf EURO lautend								
BE0312795678	BELGIQUE 23/11.07.24	0,000	4.500	0	4.500	96,9031	4.360.639,50	9,93
BE0312793657	BELGIQUE 23/07.03.24	0,000	4.500	0	4.500	98,1205	4.415.422,50	10,06
BE0312794663	BELGIQUE 23/09.05.24	0,000	4.500	800	3.700	97,5057	3.607.710,90	8,22
DE000A3H2Y16	BERLIN, LAND LSA21/23A531	0,010	2.000	0	2.000	99,2060	1.984.120,00	4,52
DE000BU0E022	BRD USCHAT.AUSG.23/03	0,000	2.500	0	2.500	98,2865	2.457.162,50	5,60
DE000BU0E030	BRD USCHAT.AUSG.23/04	0,000	4.100	2.100	2.000	97,9930	1.959.860,00	4,46
DE000BU0E055	BRD USCHAT.AUSG.23/06	0,000	1.700	0	1.700	97,4730	1.657.041,00	3,77
DE000BU0E071	BRD USCHAT.AUSG.23/08	0,000	3.600	0	3.600	96,8610	3.486.996,00	7,94
FR0011133008	CAISSE REF.HAB 11-23	3,900	0	0	1.600	100,0150	1.600.240,00	3,64
DE000DKB0333	DT.KREDITBANK HPF 14/24	1,625	2.600	0	2.600	98,2300	2.553.980,00	5,82
DE000A2LQNP8	DT.PFBR.BANK PF.R.15286	0,250	1.000	0	1.000	98,5470	985.470,00	2,24
XS1909061597	DNB BOLIGKRED. 18/23 MTN	0,375	0	0	1.000	99,3260	993.260,00	2,26
DE000A2TSD55	DZ HYP PF.R.1220 MTN	0,010	1.000	0	1.354	98,4985	1.333.669,69	3,04
DE000A2BPJ45	DZ HYP PF.R.383	0,125	400	0	400	98,2155	392.862,00	0,89
FI4000549621	FINNLAND 23/24 ZO	0,000	3.000	0	3.000	98,3390	2.950.170,00	6,72
FI4000556188	FINNLAND 23/24 ZO	0,000	1.500	0	1.500	97,4355	1.461.532,50	3,33
DE000A2LQN95	STADT HAMBURG LSA 19/23	4,515	2.000	0	2.000	100,1785	2.003.570,00	4,56
Summe							38.203.706,59	87,02
SUMME DER ZUM AMTLICHEN HANDEL ODER EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT ZUGELASSENEN WERTPAPIERE							38.203.706,59	87,02
SUMME WERTPAPIERVERMÖGEN							38.203.706,59	87,02

Call / Put	Bezeichnung / Underlying	Fälligkeit	Whg.	Anzahl / Betrag	Kontraktkurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fondsvermögen
OPTIONEN							
VERKAUFTE OPTIONEN (SHORT)							
Put	OSEG Stoxx Euro PUT 09/2023 155.000	15.09.2023	EUR	-810	0,0400	-3.240,00	-0,01
Put	OSSX EuroStoxx PUT 09/2023 159.0000	15.09.2023	EUR	-1.837	0,0600	-11.022,00	-0,02
Summe						-14.262,00	-0,03
GEKAUFTE OPTIONEN (LONG)							
Put	OSEG Stoxx Euro PUT 09/2023 145.000	15.09.2023	EUR	810	0,0200	1.620,00	0,00
Put	OSSX EuroStoxx PUT 09/2023 144.0000	15.09.2023	EUR	1.837	0,0200	3.674,00	0,01
Summe						5.294,00	0,01
SUMME OPTIONEN						-8.968,00	-0,02

Aufgrund von Rundungen kann es bei der Spalte %-Anteil am Fondsvermögen hinsichtlich der Einzelpositionen, Zwischensummen und des Gesamtanteils in dieser Darstellung zu Abweichungen kommen.

WÄHRUNG	BETRAG	
	FONDSWÄHRUNG	FONDSWÄHRUNG
EURO	EUR	5.278.950,60
INITIAL MARGIN / VARIATION MARGIN	EUR	347.146,40
SUMME BANKGUTHABEN / BANKVERBINDLICHKEITEN		5.626.097,00

WÄHREND DES BERICHTSZEITRAUMES GETÄTIGTE KÄUFE UND VERKÄUFE, SOWEIT SIE NICHT IN DER VERMÖGENSAUFSTELLUNG GENANNT SIND

ISIN	Wertpapier-Bezeichnung	Zinssatz	Whg.	Käufe / Zugänge Stück / Nominale (Nom. in 1.000, ger.)	Verkäufe / Abgänge
WERTPAPIERE					
XS1811023735	COMMONW.BK AUSTR.18/23MTN	0,375	EUR	0	2.100
DE000A161ZU5	DZ HYP PF.R.374	0,200	EUR	0	1.500
XS1950839677	EIB 19/24 MTN	0,050	EUR	3.000	3.000
XS2148404994	EIB 20/23 MTN	0,000	EUR	0	2.000
XS1515245089	EIB EUR.INV.BK 16/24 MTN	0,000	EUR	3.500	3.500
XS1397054245	EIKA BOLIGKRED. 16/23 MTN	0,375	EUR	0	2.500
FI4000219787	FINLD 16-23	0,000	EUR	0	4.500
XS0935034651	ING BK NV 13/23 MTN	1,875	EUR	0	4.290
IE00B453JD47	IRLAND 2023	3,900	EUR	0	2.000
IE00B6X95T99	IRLAND 2024	3,400	EUR	3.000	3.000
DE000A2LQSP7	KRED.F.WIED.19/24 MTN	0,000	EUR	3.700	3.700
DE000A289RC9	KRED.F.WIED.20/23 MTN	0,000	EUR	0	2.450
NL0010418810	NEDERLD 13-23	1,750	EUR	500	2.500
AT0000A321V8	ATB'S 27.10.2023	0,000	EUR	1.300	1.300
BE0312787592	BELGIQUE 22/09.03.23	0,000	EUR	0	2.500
BE0312788608	BELGIQUE 22/11.05.23	0,000	EUR	0	2.500
BE0312792642	BELGIQUE 23/11.01.24	0,000	EUR	0	2.500
DE0001030849	BRD USCHAT.AUSG.22/05	0,000	EUR	0	2.000
DE0001030872	BRD USCHAT.AUSG.22/08	0,000	EUR	500	2.500
FI4000546353	FINNLAND 23/23 ZO	0,000	EUR	3.100	3.100
NL0015001516	NIEDERLANDE 22/23 ZO	0,000	EUR	0	2.000
NL00150012C6	NIEDERLANDE 22/23 ZO	0,000	EUR	0	1.300
NL0015001F08	NIEDERLANDE 23/23 ZO	0,000	EUR	500	500
NL0015001GL1	NIEDERLANDE 23/23 ZO	0,000	EUR	1.500	1.500
NL0015001DN4	NIEDERLANDE 23/23 ZO	0,000	EUR	1.000	1.000
OPTIONEN					
---	EUROSTOXX 50 ESG INDEX O P 20230317		EUR	0	1.898
---	EUROSTOXX 50 ESG INDEX O P 20230317		EUR	1.898	0
---	EUROSTOXX 50 ESG INDEX O P 20230421		EUR	1.814	1.814
---	EUROSTOXX 50 ESG INDEX O P 20230421		EUR	1.814	1.814
---	EUROSTOXX 50 ESG INDEX O P 20230519		EUR	1.952	1.952
---	EUROSTOXX 50 ESG INDEX O P 20230519		EUR	1.952	1.952
---	EUROSTOXX 50 ESG INDEX O P 20230616		EUR	1.492	1.492
---	EUROSTOXX 50 ESG INDEX O P 20230616		EUR	1.492	1.492
---	EUROSTOXX 50 ESG INDEX O P 20230721		EUR	1.587	1.587
---	EUROSTOXX 50 ESG INDEX O P 20230721		EUR	1.587	1.587
---	EUROSTOXX 50 ESG INDEX O P 20230818		EUR	1.834	1.834
---	EUROSTOXX 50 ESG INDEX O P 20230818		EUR	1.834	1.834
---	STOXX EUROPE 600 ESG OPT P 20230317		EUR	861	0
---	STOXX EUROPE 600 ESG OPT P 20230317		EUR	0	861
---	STOXX EUROPE 600 ESG OPT P 20230421		EUR	903	903
---	STOXX EUROPE 600 ESG OPT P 20230421		EUR	903	903
---	STOXX EUROPE 600 ESG OPT P 20230519		EUR	775	775
---	STOXX EUROPE 600 ESG OPT P 20230519		EUR	775	775
---	STOXX EUROPE 600 ESG OPT P 20230616		EUR	1.233	1.233
---	STOXX EUROPE 600 ESG OPT P 20230616		EUR	1.233	1.233
---	STOXX EUROPE 600 ESG OPT P 20230721		EUR	1.168	1.168
---	STOXX EUROPE 600 ESG OPT P 20230721		EUR	1.168	1.168
---	STOXX EUROPE 600 ESG OPT P 20230818		EUR	853	853
---	STOXX EUROPE 600 ESG OPT P 20230818		EUR	853	853

Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Gesamttrendite-Swaps im Sinne der Verordnung (EU) 2015/2365 wurden, insoweit sie laut Fondsbestimmungen zulässig sind, im Berichtszeitraum nicht eingesetzt.

AUFGliederung DES FONDSVERMÖGENS ZUM 31.08.2023 IN EUR

	EUR	%
Wertpapiervermögen	38.203.706,59	87,02
Optionen	-8.968,00	-0,02
Zinsenansprüche (inkl. negativer Habenzinsen)	94.792,62	0,22
Bankguthaben / Bankverbindlichkeiten	5.626.097,00	12,81
Gebührenverbindlichkeiten	-13.264,77	-0,03
FONDSVERMÖGEN	43.902.363,44	100,00

IQAM Invest GmbH

Holger Wern

Mag. Leopold Huber

Dr. Thomas Steinberger