

KAPITALVERWALTUNGSGESELLSCHAFT:



---

## Aquantum Active Range

HALBJAHRESBERICHT

ZUM 31. DEZEMBER 2023

---

VERWAHRSTELLE:



ASSET MANAGEMENT UND VERTRIEB:



# Halbjahresbericht Aquantum Active Range

## Vermögensübersicht zum 31.12.2023

Anlageschwerpunkte	Tageswert in EUR	% Anteil am Fondsvermögen
<b>I. Vermögensgegenstände</b>	<b>390.678.179,53</b>	<b>101,05</b>
1. Derivate	233.408,82	0,06
2. Bankguthaben	389.065.215,35	100,63
3. Sonstige Vermögensgegenstände	1.379.555,36	0,36
<b>II. Verbindlichkeiten</b>	<b>-4.041.646,93</b>	<b>-1,05</b>
<b>III. Fondsvermögen</b>	<b>386.636.532,60</b>	<b>100,00</b>

# Halbjahresbericht Aquantum Active Range

## Vermögensaufstellung zum 31.12.2023

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.12.2023	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
<b>Derivate</b>							<b>EUR</b>	<b>233.408,82</b>	<b>0,06</b>
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)									
<b>Aktienindex-Derivate</b>							<b>EUR</b>	<b>233.408,82</b>	<b>0,06</b>
Forderungen/Verbindlichkeiten									
<b>Optionsrechte</b>							<b>EUR</b>	<b>233.408,82</b>	<b>0,06</b>
<b>Optionsrechte auf Aktienindex-Terminkontrakte</b>							<b>EUR</b>	<b>233.408,82</b>	<b>0,06</b>
FU.EMI SP W WE03.24 PUT 03.01.24 BP 3850,00 CME			352	Anzahl 125000			USD 0,100	11.317,34	0,00
FU.EMI SP W WE03.24 PUT 03.01.24 BP 3900,00 CME			352	Anzahl 1250000			USD 0,100	113.173,38	0,03
FU.EMI SP W WE03.24 PUT 03.01.24 BP 3925,00 CME			352	Anzahl 125000			USD 0,100	11.317,34	0,00
FUT E-MI SP W3 03.24 PUT 19.01.24 BP 4120,00 CME			352	Anzahl -140000			USD 1,050	-133.091,90	-0,03
FUT E-MI SP W3 03.24 PUT 19.01.24 BP 4200,00 CME			352	Anzahl -126000			USD 1,300	-148.302,40	-0,04
FUT E-MI SP W3 03.24 PUT 19.01.24 BP 4240,00 CME			352	Anzahl -56000			USD 1,350	-68.447,26	-0,02
FUT E-MI SP W3 03.24 PUT 19.01.24 BP 4290,00 CME			352	Anzahl -28000			USD 1,500	-38.026,26	-0,01
FUT E-MI SP W3 03.24 PUT 19.01.24 BP 4300,00 CME			352	Anzahl 35000			USD 1,550	49.117,25	0,01
FUT E-MI SP W3 03.24 PUT 19.01.24 BP 4320,00 CME			352	Anzahl -56000			USD 1,600	-81.122,68	-0,02
FUT E-MI SP W3 03.24 PUT 19.01.24 BP 4330,00 CME			352	Anzahl -28000			USD 1,650	-41.828,88	-0,01
FUT E-MI SP W3 03.24 PUT 19.01.24 BP 4360,00 CME			352	Anzahl -56000			USD 1,800	-91.263,01	-0,02
FUT E-MI SP W3 03.24 PUT 19.01.24 BP 4400,00 CME			352	Anzahl 7000			USD 2,000	12.675,42	0,00
FUT E-MI SP W3 03.24 PUT 19.01.24 BP 4410,00 CME			352	Anzahl -56000			USD 2,100	-106.473,52	-0,03
FUT E-MI SP W3 03.24 PUT 19.01.24 BP 4440,00 CME			352	Anzahl 14000			USD 2,300	29.153,46	0,01
FUT E-MI SP W3 03.24 PUT 19.01.24 BP 4460,00 CME			352	Anzahl -28000			USD 2,450	-62.109,55	-0,02
FUT E-MI SP W3 03.24 PUT 19.01.24 BP 4480,00 CME			352	Anzahl -42000			USD 2,650	-100.769,58	-0,03
FUT E-MI SP W3 03.24 PUT 19.01.24 BP 4490,00 CME			352	Anzahl -28000			USD 2,800	-70.982,34	-0,02
FUT E-MI SP W3 03.24 PUT 19.01.24 BP 4520,00 CME			352	Anzahl 14000			USD 3,200	40.561,34	0,01
FUT E-MI SP W3 03.24 PUT 19.01.24 BP 4540,00 CME			352	Anzahl 14000			USD 3,600	45.631,51	0,01
FUT E-MI SP W3 03.24 PUT 19.01.24 BP 4550,00 CME			352	Anzahl -28000			USD 3,800	-96.333,18	-0,02
FUT E-MI SP W3 03.24 PUT 19.01.24 BP 4560,00 CME			352	Anzahl 14000			USD 4,050	51.335,45	0,01
FUT E-MI SP W3 03.24 PUT 19.01.24 BP 4580,00 CME			352	Anzahl 14000			USD 4,650	58.940,70	0,02
FUT E-MI SP W3 03.24 PUT 19.01.24 BP 4590,00 CME			352	Anzahl 14000			USD 5,000	63.377,09	0,02
FUT E-MI SP W3 03.24 PUT 19.01.24 BP 4620,00 CME			352	Anzahl 14000			USD 6,350	80.488,91	0,02

# Halbjahresbericht

## Aquantum Active Range

### Vermögensaufstellung zum 31.12.2023

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.12.2023	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
FUT E-MI SP W3 03.24 PUT 19.01.24 BP 4640,00 CME			352	Anzahl 14000			USD 7,550	95.699,41	0,02
FUT E-MI SP W3 03.24 PUT 19.01.24 BP 4660,00 CME			352	Anzahl 14000			USD 9,100	115.346,31	0,03
FUT E-MI SP W3 03.24 PUT 19.01.24 BP 4690,00 CME			352	Anzahl 14000			USD 12,250	155.273,88	0,04
FUT E-MI SP W3 03.24 PUT 19.01.24 BP 4740,00 CME			352	Anzahl 14000			USD 20,000	253.508,37	0,07
FUT E-MI SP W4 03.24 PUT 26.01.24 BP 4160,00 CME			352	Anzahl -56000			USD 1,600	-81.122,68	-0,02
FUT E-MI SP W4 03.24 PUT 26.01.24 BP 4250,00 CME			352	Anzahl -84000			USD 1,950	-148.302,40	-0,04
FUT E-MI SP W4 03.24 PUT 26.01.24 BP 4330,00 CME			352	Anzahl -56000			USD 2,450	-124.219,10	-0,03
FUT E-MI SP W4 03.24 PUT 26.01.24 BP 4350,00 CME			352	Anzahl -28000			USD 2,600	-65.912,18	-0,02
FUT E-MI SP W4 03.24 PUT 26.01.24 BP 4400,00 CME			352	Anzahl -42000			USD 3,100	-117.881,39	-0,03
FUT E-MI SP W4 03.24 PUT 26.01.24 BP 4410,00 CME			352	Anzahl -28000			USD 3,250	-82.390,22	-0,02
FUT E-MI SP W4 03.24 PUT 26.01.24 BP 4480,00 CME			352	Anzahl -28000			USD 4,450	-112.811,23	-0,03
FUT E-MI SP W4 03.24 PUT 26.01.24 BP 4500,00 CME			352	Anzahl 28000			USD 4,950	125.486,65	0,03
FUT E-MI SP W4 03.24 PUT 26.01.24 BP 4560,00 CME			352	Anzahl 14000			USD 7,100	89.995,47	0,02
FUT E-MI SP W4 03.24 PUT 26.01.24 BP 4600,00 CME			352	Anzahl 28000			USD 9,300	235.762,79	0,06
FUT E-MI SP W4 03.24 PUT 26.01.24 BP 4660,00 CME			352	Anzahl 14000			USD 14,500	183.793,57	0,05
FUT E-MI SP W4 03.24 PUT 26.01.24 BP 4700,00 CME			352	Anzahl 14000			USD 20,000	253.508,37	0,07
FUT MI SP W2 03.24 PUT 12.01.24 BP 3920,00 CME			352	Anzahl -112000			USD 0,400	-40.561,34	-0,01
FUT MI SP W2 03.24 PUT 12.01.24 BP 4020,00 CME			352	Anzahl -56000			USD 0,550	-27.885,92	-0,01
FUT MI SP W2 03.24 PUT 12.01.24 BP 4100,00 CME			352	Anzahl 28000			USD 0,600	15.210,50	0,00
FUT MI SP W2 03.24 PUT 12.01.24 BP 4180,00 CME			352	Anzahl -112000			USD 0,700	-70.982,34	-0,02
FUT MI SP W2 03.24 PUT 12.01.24 BP 4200,00 CME			352	Anzahl 28000			USD 0,750	19.013,13	0,00
FUT MI SP W2 03.24 PUT 12.01.24 BP 4260,00 CME			352	Anzahl -28000			USD 0,850	-21.548,21	-0,01
FUT MI SP W2 03.24 PUT 12.01.24 BP 4270,00 CME			352	Anzahl -56000			USD 0,850	-43.096,42	-0,01
FUT MI SP W2 03.24 PUT 12.01.24 BP 4280,00 CME			352	Anzahl -28000			USD 0,850	-21.548,21	-0,01
FUT MI SP W2 03.24 PUT 12.01.24 BP 4310,00 CME			352	Anzahl -56000			USD 0,900	-45.631,51	-0,01
FUT MI SP W2 03.24 PUT 12.01.24 BP 4350,00 CME			352	Anzahl -84000			USD 1,000	-76.052,51	-0,02
FUT MI SP W2 03.24 PUT 12.01.24 BP 4380,00 CME			352	Anzahl -14000			USD 1,050	-13.309,19	0,00
FUT MI SP W2 03.24 PUT 12.01.24 BP 4390,00 CME			352	Anzahl -56000			USD 1,100	-55.771,84	-0,01
FUT MI SP W2 03.24 PUT 12.01.24 BP 4400,00 CME			352	Anzahl 14000			USD 1,100	13.942,96	0,00
FUT MI SP W2 03.24 PUT 12.01.24 BP 4430,00 CME			352	Anzahl -56000			USD 1,200	-60.842,01	-0,02
FUT MI SP W2 03.24 PUT 12.01.24 BP 4440,00 CME			352	Anzahl -28000			USD 1,250	-31.688,55	-0,01
FUT MI SP W2 03.24 PUT 12.01.24 BP 4450,00 CME			352	Anzahl 14000			USD 1,300	16.478,04	0,00
FUT MI SP W2 03.24 PUT 12.01.24 BP 4460,00 CME			352	Anzahl -28000			USD 1,300	-32.956,09	-0,01
FUT MI SP W2 03.24 PUT 12.01.24 BP 4480,00 CME			352	Anzahl 28000			USD 1,400	35.491,17	0,01
FUT MI SP W2 03.24 PUT 12.01.24 BP 4490,00 CME			352	Anzahl -56000			USD 1,450	-73.517,43	-0,02
FUT MI SP W2 03.24 PUT 12.01.24 BP 4500,00 CME			352	Anzahl -14000			USD 1,500	-19.013,13	0,00

## Halbjahresbericht Aquantum Active Range

### Vermögensaufstellung zum 31.12.2023

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.12.2023	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
FUT MI SP W2 03.24 PUT 12.01.24 BP 4530,00 CME			352	Anzahl 14000			USD 1,750	22.181,98	0,01
FUT MI SP W2 03.24 PUT 12.01.24 BP 4550,00 CME			352	Anzahl 14000			USD 1,950	24.717,07	0,01
FUT MI SP W2 03.24 PUT 12.01.24 BP 4560,00 CME			352	Anzahl -14000			USD 2,050	-25.984,61	-0,01
FUT MI SP W2 03.24 PUT 12.01.24 BP 4580,00 CME			352	Anzahl 14000			USD 2,300	29.153,46	0,01
FUT MI SP W2 03.24 PUT 12.01.24 BP 4600,00 CME			352	Anzahl 14000			USD 2,700	34.223,63	0,01
FUT MI SP W2 03.24 PUT 12.01.24 BP 4630,00 CME			352	Anzahl 14000			USD 3,500	44.363,97	0,01
FUT MI SP W2 03.24 PUT 12.01.24 BP 4640,00 CME			352	Anzahl 14000			USD 3,850	48.800,36	0,01
FUT MI SP W2 03.24 PUT 12.01.24 BP 4660,00 CME			352	Anzahl 14000			USD 4,750	60.208,24	0,02
FUT MI SP W2 03.24 PUT 12.01.24 BP 4700,00 CME			352	Anzahl 14000			USD 7,700	97.600,72	0,03
FUT MI SP W2 03.24 PUT 12.01.24 BP 4740,00 CME			352	Anzahl 14000			USD 13,250	167.949,30	0,04
FUT MINI S+P W1 03.24 PUT 02.02.24 BP 4250,00 CME			352	Anzahl -28000			USD 3,000	-76.052,51	-0,02
FUT MINI S+P W1 03.24 PUT 02.02.24 BP 4330,00 CME			352	Anzahl -28000			USD 3,950	-100.135,81	-0,03
FUT MINI S+P W1 03.24 PUT 02.02.24 BP 4350,00 CME			352	Anzahl -14000			USD 4,250	-53.870,53	-0,01
FUT MINI S+P W1 03.24 PUT 02.02.24 BP 4420,00 CME			352	Anzahl -14000			USD 5,650	-71.616,12	-0,02
FUT MINI S+P W1 03.24 PUT 02.02.24 BP 4450,00 CME			352	Anzahl 7000			USD 6,500	41.195,11	0,01
FUT MINI S+P W1 03.24 PUT 02.02.24 BP 4450,00 CME			352	Anzahl 7000			USD 11,250	71.299,23	0,02
FUT MINI S+P W1 03.24 PUT 02.02.24 BP 4570,00 CME			352	Anzahl 7000			USD 12,500	79.221,37	0,02
FUT MINI S+P W1 03.24 PUT 02.02.24 BP 4670,00 CME			352	Anzahl 7000			USD 23,500	148.936,17	0,04
FUT MINI S+P W1 03.24 PUT 05.01.24 BP 4000,00 CME			352	Anzahl -56000			USD 0,150	-7.605,25	0,00
FUT MINI S+P W1 03.24 PUT 05.01.24 BP 4020,00 CME			352	Anzahl -56000			USD 0,150	-7.605,25	0,00
FUT MINI S+P W1 03.24 PUT 05.01.24 BP 4100,00 CME			352	Anzahl -28000			USD 0,150	-3.802,63	0,00
FUT MINI S+P W1 03.24 PUT 05.01.24 BP 4120,00 CME			352	Anzahl -28000			USD 0,200	-5.070,17	0,00
FUT MINI S+P W1 03.24 PUT 05.01.24 BP 4150,00 CME			352	Anzahl -56000			USD 0,200	-10.140,33	0,00
FUT MINI S+P W1 03.24 PUT 05.01.24 BP 4200,00 CME			352	Anzahl 28000			USD 0,200	5.070,17	0,00
FUT MINI S+P W1 03.24 PUT 05.01.24 BP 4250,00 CME			352	Anzahl -28000			USD 0,250	-6.337,71	0,00
FUT MINI S+P W1 03.24 PUT 05.01.24 BP 4270,00 CME			352	Anzahl -56000			USD 0,250	-12.675,42	0,00
FUT MINI S+P W1 03.24 PUT 05.01.24 BP 4300,00 CME			352	Anzahl -28000			USD 0,250	-6.337,71	0,00
FUT MINI S+P W1 03.24 PUT 05.01.24 BP 4320,00 CME			352	Anzahl -56000			USD 0,300	-15.210,50	0,00
FUT MINI S+P W1 03.24 PUT 05.01.24 BP 4350,00 CME			352	Anzahl -28000			USD 0,300	-7.605,25	0,00
FUT MINI S+P W1 03.24 PUT 05.01.24 BP 4360,00 CME			352	Anzahl -56000			USD 0,300	-15.210,50	0,00
FUT MINI S+P W1 03.24 PUT 05.01.24 BP 4380,00 CME			352	Anzahl -84000			USD 0,300	-22.815,75	-0,01
FUT MINI S+P W1 03.24 PUT 05.01.24 BP 4390,00 CME			352	Anzahl -28000			USD 0,300	-7.605,25	0,00
FUT MINI S+P W1 03.24 PUT 05.01.24 BP 4400,00 CME			352	Anzahl 14000			USD 0,300	3.802,63	0,00
FUT MINI S+P W1 03.24 PUT 05.01.24 BP 4430,00 CME			352	Anzahl -28000			USD 0,350	-8.872,79	0,00
FUT MINI S+P W1 03.24 PUT 05.01.24 BP 4450,00 CME			352	Anzahl 14000			USD 0,350	4.436,40	0,00
FUT MINI S+P W1 03.24 PUT 05.01.24 BP 4460,00 CME			352	Anzahl -14000			USD 0,350	-4.436,40	0,00

## Halbjahresbericht Aquantum Active Range

### Vermögensaufstellung zum 31.12.2023

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.12.2023	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
FUT MINI S+P W1 03.24 PUT 05.01.24 BP 4480,00 CME			352	Anzahl 14000			USD 0,350	4.436,40	0,00
FUT MINI S+P W1 03.24 PUT 05.01.24 BP 4500,00 CME			352	Anzahl 14000			USD 0,350	4.436,40	0,00
FUT MINI S+P W1 03.24 PUT 05.01.24 BP 4510,00 CME			352	Anzahl 14000			USD 0,400	5.070,17	0,00
FUT MINI S+P W1 03.24 PUT 05.01.24 BP 4540,00 CME			352	Anzahl 14000			USD 0,400	5.070,17	0,00
FUT MINI S+P W1 03.24 PUT 05.01.24 BP 4550,00 CME			352	Anzahl 14000			USD 0,400	5.070,17	0,00
FUT MINI S+P W1 03.24 PUT 05.01.24 BP 4560,00 CME			352	Anzahl 14000			USD 0,400	5.070,17	0,00
FUT MINI S+P W1 03.24 PUT 05.01.24 BP 4580,00 CME			352	Anzahl 14000			USD 0,450	5.703,94	0,00
FUT MINI S+P W1 03.24 PUT 05.01.24 BP 4610,00 CME			352	Anzahl 14000			USD 0,500	6.337,71	0,00
FUT MINI S+P W1 03.24 PUT 05.01.24 BP 4640,00 CME			352	Anzahl 14000			USD 0,650	8.239,02	0,00

# Halbjahresbericht Aquantum Active Range

## Vermögensaufstellung zum 31.12.2023

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.12.2023	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
<b>Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds</b>							<b>EUR</b>	<b>389.065.215,35</b>	<b>100,63</b>
<b>Bankguthaben</b>							<b>EUR</b>	<b>389.065.215,35</b>	<b>100,63</b>
<b>EUR - Guthaben bei:</b>									
Bayerische Landesbank München (V)			EUR	10.000.000,00			% 100,000	10.000.000,00	2,59
BNP Paribas S.A., Niederlassung Deutschland			EUR	187.169.782,86			% 100,000	187.169.782,86	48,41
CME - CCP Clearing			EUR	159.817.985,89			% 100,000	159.817.985,89	41,34
DZ Bank AG Frankfurt (V)			EUR	12.000.000,00			% 100,000	12.000.000,00	3,10
Landesbank Baden-Württemberg (GD) Stuttgart (V)			EUR	15.000.000,00			% 100,000	15.000.000,00	3,88
Landesbank Hessen-Thüringen Girozentrale Frankfurt (V)			EUR	5.000.000,00			% 100,000	5.000.000,00	1,29
<b>Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen bei:</b>									
BNP Paribas S.A., Niederlassung Deutschland			USD	85.539,77			% 100,000	77.446,60	0,02
<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>							<b>EUR</b>	<b>1.379.555,36</b>	<b>0,36</b>
Zinsansprüche			EUR	479.679,55				479.679,55	0,12
Einschüsse (Initial Margins)			EUR	899.875,81				899.875,81	0,23
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>							<b>EUR</b>	<b>-4.041.646,93</b>	<b>-1,05</b>
Zinsverbindlichkeiten			EUR	-70.395,27				-70.395,27	-0,02
Verwaltungsvergütung			EUR	-87.352,33				-87.352,33	-0,02
Performance Fee			EUR	-3.263.348,29				-3.263.348,29	-0,84
Verwahrstellenvergütung			EUR	-15.592,39				-15.592,39	0,00
Lagerstellenkosten			EUR	-14.240,34				-14.240,34	0,00
Prüfungskosten			EUR	-7.486,11				-7.486,11	0,00
Veröffentlichungskosten			EUR	-497,22				-497,22	0,00
Portfoliomanagervergütung			EUR	-582.734,98				-582.734,98	-0,15
<b>Fondsvermögen</b>							<b>EUR</b>	<b>386.636.532,60</b>	<b>100,00 1)</b>

# Halbjahresbericht Aquantum Active Range

## Vermögensaufstellung zum 31.12.2023

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.12.2023	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
<b>Aquantum Active Range Seed (S)</b>									
Anteilwert							EUR	125,66	
Ausgabepreis							EUR	125,66	
Rücknahmepreis							EUR	125,66	
Anzahl Anteile							STK	2.229.051	
<b>Aquantum Active Range Institutional (I)</b>									
Anteilwert							EUR	124,46	
Ausgabepreis							EUR	124,46	
Rücknahmepreis							EUR	124,46	
Anzahl Anteile							STK	544.133	
<b>Aquantum Active Range Retail (R)</b>									
Anteilwert							EUR	122,52	
Ausgabepreis							EUR	125,58	
Rücknahmepreis							EUR	122,52	
Anzahl Anteile							STK	316.691	

### 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 Aquantum Active Range

## Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

## Devisenkurse (in Mengennotiz)

USD	(USD)	per 29.12.2023 1,1045000	= 1 EUR (EUR)
-----	-------	-----------------------------	---------------

## Marktschlüssel

### Terminbörsen

352	Chicago - CME Globex
-----	----------------------

## Halbjahresbericht Aquantum Active Range

### 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)

#### Optionsrechte

##### Optionsrechte auf Aktienindex-Derivate

##### Optionsrechte auf Aktienindex-Terminkontrakte

Gekaufte Verkaufsoptionen (Put):

(Basiswert(e): FUTURE E-MIN S+P 500 EOM 03.24 CME, FUTURE E-MIN S+P 500 EOM 09.23 CME, FUTURE E-MIN S+P 500 EOM 12.23 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP W1 03.24 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP W1 09.23 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP W1 12.23 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP W2 03.24 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP W2 09.23 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP W2 12.23 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP Week3 03.24 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP Week3 09.23 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP Week3 12.23 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP Week4 03.24 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP Week4 09.23 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP Week4 12.23 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 INDEX 09.23 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 INDEX 12.23	EUR	139.519,83
---	-----	------------

## Halbjahresbericht Aquantum Active Range

### 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):					
(Basiswert(e): FUTURE E-MIN S+P 500 EOM 03.24 CME, FUTURE E-MIN S+P 500 EOM 09.23 CME, FUTURE E-MIN S+P 500 EOM 12.23 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP W1 03.24 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP W1 09.23 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP W1 12.23 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP W2 09.23 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP W2 12.23 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP Week3 03.24 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP Week3 09.23 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP Week3 12.23 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP Week4 03.24 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP Week4 09.23 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP , FUTURE E-MINI S+P 500 INDEX 09.23 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 INDEX 12.23		EUR			104.053,71

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.

**Halbjahresbericht  
Aquantum Active Range**

**Anteilklassenmerkmale im Überblick**

<b>Anteilklasse</b>	<b>Mindestanlagesumme in Währung</b>	<b>Ausgabeaufschlag bis zu 2,50%, derzeit (Angabe in %)</b>	<b>Verwaltungsvergütung bis zu 0,150% p.a., derzeit (Angabe in % p.a.)</b>	<b>Ertragsverwendung</b>	<b>Währung</b>
<b>Aquantum Active Range Seed (S)</b>	10.000.000	0,00	0,150	Thesaurierer	EUR
<b>Aquantum Active Range Institutional (I)</b>	500.000	0,00	0,150	Thesaurierer	EUR
<b>Aquantum Active Range Retail (R)</b>	keine	2,50	0,150	Thesaurierer	EUR

# Halbjahresbericht Aquantum Active Range

## Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)	0,00
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)	0,06

## Sonstige Angaben

### Aquantum Active Range Seed (S)

Anteilwert	EUR	125,66
Ausgabepreis	EUR	125,66
Rücknahmepreis	EUR	125,66
Anzahl Anteile	STK	2.229.051

### Aquantum Active Range Institutional (I)

Anteilwert	EUR	124,46
Ausgabepreis	EUR	124,46
Rücknahmepreis	EUR	124,46
Anzahl Anteile	STK	544.133

### Aquantum Active Range Retail (R)

Anteilwert	EUR	122,52
Ausgabepreis	EUR	125,58
Rücknahmepreis	EUR	122,52
Anzahl Anteile	STK	316.691

# Halbjahresbericht Aquantum Active Range

## Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

### 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.

### 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 Gesamttrendite-Swaps gemäß der oben genannten rechtlichen Bestimmung vor.

Frankfurt am Main, den 2. Januar 2024

Universal-Investment-Gesellschaft mbH  
Die Geschäftsführung

# Halbjahresbericht Aquantum Active Range

## Anteilklassen im Überblick

### Erstausgabedatum

Anteilklasse (S)	1. Juli 2021
Anteilklasse (I)	1. Juli 2021
Anteilklasse (R)	9. Juli 2021

### Erstausgabepreise

Anteilklasse (S)	EUR 100
Anteilklasse (I)	EUR 100
Anteilklasse (R)	EUR 100

### Ausgabeaufschlag

Anteilklasse (S)	keiner
Anteilklasse (I)	keiner
Anteilklasse (R)	derzeit 2,50 %

### Mindestanlagesumme

Anteilklasse (S)	EUR 10.000.000
Anteilklasse (I)	EUR 500.000
Anteilklasse (R)	keine

### Verwaltungsvergütung\*

Anteilklasse (S)	derzeit 0,15 % p.a.
Anteilklasse (I)	derzeit 0,15 % p.a.
Anteilklasse (R)	derzeit 0,15 % p.a.

### Verwahrstellenvergütung\*

Anteilklasse (S)	derzeit 0,05 % p.a.
Anteilklasse (I)	derzeit 0,05 % p.a.
Anteilklasse (R)	derzeit 0,05 % p.a.

### Asset Management-Vergütung

Anteilklasse (S)	derzeit 0,50 % p.a.
Anteilklasse (I)	derzeit 0,95 % p.a.
Anteilklasse (R)	derzeit 1,35 % p.a.

### Erfolgsabhängige Vergütung

Anteilklasse (S), (I) und (R)	15% der vom Fonds in der Abrechnungsperiode erwirtschafteten Rendite über dem Referenzwert (bisheriger Höchststand des Anteilwertes am Ende der fünf vorangegangenen Abrechnungsperioden)
-------------------------------	---

### Währung

Anteilklasse (S)	EUR
Anteilklasse (I)	EUR
Anteilklasse (R)	EUR

### Ertragsverwendung

Anteilklasse (S)	Thesaurierung
Anteilklasse (I)	Thesaurierung
Anteilklasse (R)	Thesaurierung

### Wertpapier-Kennnummer / ISIN:

Anteilklasse (S)	A2QSF4 / DE000A2QSF49
Anteilklasse (I)	A2QSF6 / DE000A2QSF64
Anteilklasse (R)	A2QSF5 / DE000A2QSF56

\*Unterliegt einer Staffelung

# Halbjahresbericht

## Aquantum Active Range

### 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  
Frank Eggloff, München  
Mathias Heiß, Langen  
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

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

Aquantum GmbH

##### Postanschrift:

Josephspitalstrasse 15  
80331 München

Telefon +49 893 837 744 0  
www.aquantumgroup.com