

KAPITALVERWALTUNGSGESELLSCHAFT:



finccam Roll Premium

HALBJAHRESBERICHT

ZUM 31. MÄRZ 2023

VERWAHRSTELLE:



STATE STREET.

ASSET MANAGEMENT UND VERTRIEB:

finccam
PURISTIC INVESTING

Halbjahresbericht finccam Roll Premium

Vermögensübersicht zum 31.03.2023

Anlageschwerpunkte	Tageswert in EUR	% Anteil am Fondsvermögen
I. Vermögensgegenstände	93.468.118,86	101,11
1. Anleihen	87.628.190,44	94,79
< 1 Jahr	72.704.690,84	78,65
>= 1 Jahr bis < 3 Jahre	14.923.499,60	16,14
2. Derivate	3.507.689,53	3,79
3. Bankguthaben	885.286,45	0,96
4. Sonstige Vermögensgegenstände	1.446.952,44	1,57
II. Verbindlichkeiten	-1.023.901,84	-1,11
III. Fondsvermögen	92.444.217,02	100,00

Halbjahresbericht finccam Roll Premium

Vermögensaufstellung zum 31.03.2023

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.03.2023	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Bestandspositionen							EUR	87.628.190,44	94,79
Börsengehandelte Wertpapiere							EUR	87.628.190,44	94,79
Verzinsliche Wertpapiere							EUR	87.628.190,44	94,79
0,1250 % Aareal Bank AG MTN-HPF.S.226 v.2019(2024)	DE000AAR0249		EUR	5.000	0	0 %	97,311	4.865.550,00	5,26
0,3750 % Bank of Nova Scotia, The EO-M.-T. Mortg.Cov.Bds 18(23)	XS1897129950		EUR	2.000	0	0 %	98,411	1.968.220,00	2,13
1,6250 % Bayerische Landesbank Öff.Pfandbrief v.14(24)	DE000BLB2TQ3		EUR	3.210	0	0 %	97,726	3.137.004,60	3,39
0,3750 % Belfius Bank S.A. EO-M.-T.Mortg.Pandbr. 2018(23)	BE0002620012		EUR	5.500	0	0 %	98,380	5.410.900,00	5,85
0,3750 % Berlin Hyp AG Hyp.-Pfandbr. v.16(24) Ser.198	DE000BHY0BE0		EUR	2.500	0	0 %	96,787	2.419.675,00	2,62
0,0500 % BNG Bank N.V. EO-Med.-Term Notes 2018(23)	XS1855427859		EUR	1.500	0	0 %	99,191	1.487.865,00	1,61
0,0000 % BNP Paribas Fortis S.A. EO-Med.-T.Mortg.Cov.Bds 16(23)	BE0002265347		EUR	3.000	0	0 %	98,161	2.944.830,00	3,19
0,0000 % Bundesrep.Deutschland Bundesschatzanw. v.21(23)	DE0001104842		EUR	1.000	0	2.000 %	99,473	994.730,00	1,08
0,6250 % Corporación Andina de Fomento EO-Medium-Term Notes 2019(24)	XS1943474483		EUR	6.300	0	0 %	97,419	6.137.397,00	6,64
0,2500 % Deutsche Bank AG MTN-HPF v.16(24)	DE000DL19SH3		EUR	5.000	0	0 %	97,138	4.856.900,00	5,25
0,2500 % Dexia Crédit Local S.A. EO-Med.-T. Nts 2018(23) Reg.S	XS1829348793		EUR	2.200	0	4.500 %	99,564	2.190.408,00	2,37
0,0000 % Dexia Crédit Local S.A. EO-Medium-Term Notes 2019(24)	XS2003512824		EUR	4.500	0	0 %	96,176	4.327.920,00	4,68
0,2500 % DNB Bank ASA EO-Preferred Med.-T.Nts 19(24)	XS1979262448		EUR	2.000	0	0 %	96,586	1.931.720,00	2,09
0,0100 % DZ BANK AG Deut.Zentral-Gen. MTN-IHS C278 DZ Br.v.21(23)	DE000DFK0KJ6		EUR	6.000	0	0 %	97,646	5.858.760,00	6,34
3,2500 % EUROFIMA EO-Medium-Term Notes 2010(23)	XS0530146405		EUR	2.000	0	0 %	99,920	1.998.400,00	2,16
0,1250 % Europ.Fin.Stab.Facility (EFSF) EO-Medium-Term Notes 2017(23)	EU000A1G0D39		EUR	2.000	0	0 %	98,474	1.969.480,00	2,13
0,2000 % Europ.Fin.Stab.Facility (EFSF) EO-Medium-Term Notes 2018(24)	EU000A1G0EA8		EUR	3.500	0	0 %	97,769	3.421.915,00	3,70
0,0000 % Europ.Fin.Stab.Facility (EFSF) EO-Medium-Term Notes 2019(23)	EU000A1G0EF7		EUR	5.000	0	5.000 %	99,205	4.960.250,00	5,37
0,0000 % Europ.Fin.Stab.Facility (EFSF) EO-Medium-Term Notes 2020(23)	EU000A1G0EH3		EUR	2.599	0	0 %	99,855	2.595.231,45	2,81
0,5000 % Europäische Union EO-Medium-Term Notes 2018(25)	EU000A19VVY6		EUR	1.200	1.200	0 %	95,140	1.141.680,00	1,23
0,1000 % Europäischer Stabilitäts.(ESM) EO-Medium-Term Notes 2018(23)	EU000A1Z99E3		EUR	3.823	0	0 %	99,083	3.787.943,09	4,10
2,1250 % European Investment Bank EO-Medium-Term Notes 2014(24)	XS1023039545		EUR	1.366	0	0 %	99,230	1.355.481,80	1,47
0,1250 % Hessen, Land Schatzanw. S.1701 v.2017(2024)	DE000A1RQC36		EUR	4.000	0	0 %	97,585	3.903.400,00	4,22
2,1250 % Kreditanst.f.Wiederaufbau Anl.v.2013 (2023)	DE000A1R07S9		EUR	1.400	0	0 %	99,708	1.395.912,00	1,51
1,5000 % Kreditanst.f.Wiederaufbau Anl.v.2014 (2024)	DE000A1R0709		EUR	2.000	2.000	0 %	98,275	1.965.500,00	2,13
0,5000 % Lloyds Bank PLC EO-Med.-Term Cov. Bds 2016(23)	XS1391589626		EUR	750	0	0 %	99,953	749.647,50	0,81
0,1250 % Novartis Finance S.A. EO-Notes 2016(16/23) Reg.S	XS1492825051		EUR	3.000	0	0 %	98,640	2.959.200,00	3,20

Halbjahresbericht finccam Roll Premium

Vermögensaufstellung zum 31.03.2023

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.03.2023	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
0,7500 % PKO Bank Hipoteczny S.A. EO-Mortg. Covered MTN 2018(24)	XS1795407979		EUR	4.500	0	0 %	97,631	4.393.395,00	4,75
0,3750 % Yorkshire Building Society EO-Med.-Term Cov. Bds 2017(23)	XS1594364033		EUR	2.500	0	0 %	99,955	2.498.875,00	2,70
Summe Wertpapiervermögen 2)							EUR	87.628.190,44	94,79
Derivate							EUR	3.507.689,53	3,79
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)									
Aktienindex-Derivate Forderungen/Verbindlichkeiten							EUR	3.507.689,53	3,79
Aktienindex-Terminkontrakte							EUR	1.908.640,00	2,06
FUTURE ESTX 50 TR 12.23 EUREX		185	EUR	Anzahl 9600				72.993.520,00	78,96
FUTURE ESTX 50 TR 12.27 EUREX		185	EUR	Anzahl -9600				-71.084.880,00	-76,89
Optionsrechte							EUR	1.599.049,53	1,73
Optionsrechte auf Aktienindex-Terminkontrakte							EUR	1.599.049,53	1,73
CBOE VOLATIL. IND. PUT 17.05.23 BP 27,00 CBOE		361		Anzahl 145800			USD 6,325	848.922,95	0,92
CBOE VOLATIL. IND. PUT 19.04.23 BP 26,00 CBOE		361		Anzahl 138700			USD 5,875	750.126,58	0,81

Halbjahresbericht finccam Roll Premium

Vermögensaufstellung zum 31.03.2023

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.03.2023	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds							EUR	885.286,45	0,96
Bankguthaben							EUR	885.286,45	0,96
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen bei:									
State Street Bank International GmbH			USD	961.686,67			% 100,000	885.286,45	0,96
Sonstige Vermögensgegenstände							EUR	1.446.952,44	1,57
Zinsansprüche			EUR	207.948,68				207.948,68	0,22
Einschüsse (Initial Margins)			EUR	1.237.610,10				1.237.610,10	1,34
Sonstige Forderungen			EUR	1.393,66				1.393,66	0,00
Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme							EUR	-713.172,85	-0,77
EUR - Kredite			EUR	-713.172,85			% 100,000	-713.172,85	-0,77
Sonstige Verbindlichkeiten							EUR	-310.728,99	-0,34
Verwaltungsvergütung			EUR	-288.335,25				-288.335,25	-0,31
Verwahrstellenvergütung			EUR	-14.243,74				-14.243,74	-0,02
Prüfungskosten			EUR	-7.500,00				-7.500,00	-0,01
Veröffentlichungskosten			EUR	-650,00				-650,00	0,00
Fondsvermögen							EUR	92.444.217,02	100,00 1)

Halbjahresbericht finccam Roll Premium

Vermögensaufstellung zum 31.03.2023

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.03.2023	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
finccam Roll Premium AK I									
Anteilwert							EUR	92,66	
Ausgabepreis							EUR	92,66	
Rücknahmepreis							EUR	92,66	
Anzahl Anteile							STK	997.695	

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 Roll Premium

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Devisenkurse (in Mengennotiz)

USD	(USD)	per 31.03.2023 1,0863000	= 1 EUR (EUR)
-----	-------	-----------------------------	---------------

Marktschlüssel

b) Terminbörsen

185	Eurex Deutschland
361	Chicago - CBOE Opt. Ex.

Halbjahresbericht finccam Roll Premium

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					
0,0100 % Berlin, Land Landessch.v.2021(2023)Ausg.531	DE000A3H2Y16	EUR	0	5.000	
2,3750 % Coöperatieve Rabobank U.A. EO-Medium-Term Notes 2013(23)	XS0933540527	EUR	0	5.000	
0,6250 % Crédit Agricole Home Loan SFH EO-Med.-T.Obl.Fin.Hab.2015(23)	FR0013066743	EUR	0	3.000	
0,2500 % Skandinaviska Enskilda Banken EO-Medium-Term Notes 2020(23)	XS2176534282	EUR	0	2.000	
5,1250 % TotalEnergies Capital S.A. EO-Medium-Term Notes 2009(24)	XS0418669429	EUR	0	2.300	
Nichtnotierte Wertpapiere *)					
Verzinsliche Wertpapiere					
0,3750 % Bank of Nova Scotia, The EO-M.-T. Mortg.Cov.Bds 16(23)	XS1377941106	EUR	0	500	
0,7500 % Canadian Imperial Bk of Comm. EO-Medium-Term Notes 2018(23)	XS1796257092	EUR	0	1.100	
0,5000 % Svenska Handelsbanken AB EO-Medium-Term Nts 2018(23)	XS1795254025	EUR	0	1.750	
0,7500 % UBS AG EO-Medium-Term Nts 2020(23/23)	XS2149270477	EUR	0	2.000	

Halbjahresbericht finccam Roll Premium

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 Aktienindices

Gekaufte Verkaufsoptionen (Put):
(Basiswert(e): CBOE VOLATILITY)

EUR

3.848,29

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 finccam Roll Premium

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)	94,79
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)	3,79

Sonstige Angaben

finccam Roll Premium AK I

Anteilwert	EUR	92,66
Ausgabepreis	EUR	92,66
Rücknahmepreis	EUR	92,66
Anzahl Anteile	STK	997.695

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 finccam Roll Premium

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. April 2023

Universal-Investment-Gesellschaft mbH
Die Geschäftsführung

Halbjahresbericht finccam Roll Premium

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:

Frank Eggloff, München
Mathias Heiß, Langen
Katja Müller, Bad Homburg
Markus Neubauer, Frankfurt am Main
Michael Reinhard, Bad Vilbel
Axel Vespermann, Dreieich

Aufsichtsrat:

Prof. Dr. Harald Wiedmann (Vorsitzender), Berlin
Dr. Axel Eckhardt, Düsseldorf
Daniel Fischer, Bad Vilbel
Daniel F. Just, Pöcking

2. Verwahrstelle

State Street Bank International GmbH

Hausanschrift:

Brienner Straße 59
80333 München

Postanschrift:

Postfach 20 19 16
80019 München

Telefon: 089 / 55878 00
Telefax: 089 / 55878 460
www.statestreet.com

Rechtsform: Gesellschaft mit beschränkter Haftung
Haftendes Eigenkapital: € 2.071.917,00 (Stand: Juni 2021)

3. Asset Management-Gesellschaft und Vertrieb

finccam investment GmbH

Postanschrift:

Uhlandstr. 4
80336 München

Telefon +49 89 2153 8490
www.finccam.com

WKN / ISIN: A2QCXU / DE000A2QCXU6