

KAPITALVERWALTUNGSGESELLSCHAFT:



LeanVal Equity Protect

HALBJAHRESBERICHT

ZUM 30. JUNI 2024

VERWAHRSTELLE:



HAUCK
AUFHÄUSER
LAMPE

ASSET MANAGEMENT UND VERTRIEB:



Halbjahresbericht LeanVal Equity Protect

Wichtiger Hinweis

Zum 15.07.2024 werden die Besonderen Anlagebedingungen für das OGAW-Sondervermögen geändert.

Halbjahresbericht LeanVal Equity Protect

Vermögensübersicht zum 30.06.2024

Anlageschwerpunkte	Tageswert in EUR	% Anteil am Fondsvermögen
I. Vermögensgegenstände	6.138.640,55	100,42
1. Aktien	5.559.661,00	90,95
Belgien	32.147,28	0,53
Bundesrep. Deutschland	1.519.423,13	24,86
Finnland	61.629,78	1,01
Frankreich	1.938.136,71	31,71
Italien	413.608,35	6,77
Niederlande	1.075.303,64	17,59
Spanien	519.412,11	8,50
2. Derivate	48.253,12	0,79
3. Bankguthaben	524.464,35	8,58
4. Sonstige Vermögensgegenstände	6.262,08	0,10
II. Verbindlichkeiten	-25.925,49	-0,42
III. Fondsvermögen	6.112.715,06	100,00

Halbjahresbericht LeanVal Equity 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
Bestandspositionen							EUR	5.559.661,00	90,95
Börsengehandelte Wertpapiere							EUR	5.559.661,00	90,95
Aktien							EUR	5.559.661,00	90,95
adidas AG Namens-Aktien o.N.	DE000A1EWWW0	STK	231	231	0	EUR	223,000	51.513,00	0,84
Adyen N.V. Aandelen op naam EO-,01	NL0012969182	STK	85	85	0	EUR	1.113,200	94.622,00	1,55
Ahold Delhaize N.V., Konkinkl. Aandelen aan toonder EO -,01	NL0011794037	STK	1.310	1.310	0	EUR	27,590	36.142,90	0,59
Air Liquide-SA Ét.Expl.P.G.Cl. Actions Port. EO 5,50	FR0000120073	STK	799	799	0	EUR	161,280	128.798,21	2,11
Airbus SE Aandelen aan toonder EO 1	NL0000235190	STK	829	829	0	EUR	128,260	106.327,54	1,74
Allianz SE vink.Namens-Aktien o.N.	DE0008404005	STK	1.107	1.107	0	EUR	259,500	287.266,50	4,70
Amadeus IT Group S.A. Acciones Port. EO 0,01	ES0109067019	STK	1.311	1.311	0	EUR	62,140	81.465,54	1,33
Anheuser-Busch InBev S.A./N.V. Actions au Port. o.N.	BE0974293251	STK	594	594	0	EUR	54,120	32.147,28	0,53
ASML Holding N.V. Aandelen op naam EO -,09	NL0010273215	STK	533	574	41	EUR	964,200	513.918,60	8,41
AXA S.A. Actions Port. EO 2,29	FR0000120628	STK	2.509	2.509	0	EUR	30,570	76.700,13	1,25
Banco Bilbao Vizcaya Argent. Acciones Nom. EO 0,49	ES0113211835	STK	16.148	12.887	1.586	EUR	9,352	151.016,10	2,47
Banco Santander S.A. Acciones Nom. EO 0,50	ES0113900J37	STK	21.099	21.099	0	EUR	4,331	91.369,22	1,49
BASF SE Namens-Aktien o.N.	DE000BASF111	STK	611	611	0	EUR	45,185	27.608,04	0,45
Bayer AG Namens-Aktien o.N.	DE000BAY0017	STK	668	668	0	EUR	26,380	17.621,84	0,29
Bayerische Motoren Werke AG Stammaktien EO 1	DE0005190003	STK	788	788	0	EUR	88,380	69.643,44	1,14
BNP Paribas S.A. Actions Port. EO 2	FR0000131104	STK	662	662	0	EUR	59,530	39.408,86	0,64
Danone S.A. Actions Port. EO-,25	FR0000120644	STK	908	908	0	EUR	57,080	51.828,64	0,85
Deutsche Börse AG Namens-Aktien o.N.	DE0005810055	STK	128	128	0	EUR	191,100	24.460,80	0,40
Deutsche Post AG Namens-Aktien o.N.	DE0005552004	STK	1.345	1.345	0	EUR	37,790	50.827,55	0,83
Deutsche Telekom AG Namens-Aktien o.N.	DE0005557508	STK	2.243	2.243	0	EUR	23,480	52.665,64	0,86
ENEL S.p.A. Azioni nom. EO 1	IT0003128367	STK	5.506	5.506	0	EUR	6,494	35.755,96	0,58
Engie S.A. Actions Port. EO 1	FR0010208488	STK	1.225	1.225	0	EUR	13,335	16.335,38	0,27
ENI S.p.A. Azioni nom. o.N.	IT0003132476	STK	2.741	2.741	0	EUR	14,354	39.344,31	0,64
EssilorLuxottica S.A. Actions Port. EO 0,18	FR0000121667	STK	207	207	0	EUR	201,200	41.648,40	0,68
Ferrari N.V. Aandelen op naam EO -,01	NL0011585146	STK	380	380	0	EUR	380,700	144.666,00	2,37
Hermes International S.C.A. Actions au Porteur o.N.	FR0000052292	STK	92	92	0	EUR	2.140,000	196.880,00	3,22
Iberdrola S.A. Acciones Port. EO -,75	ES0144580Y14	STK	4.046	4.047	1	EUR	12,115	49.017,29	0,80
Industria de Diseño Textil SA Acciones Port. EO 0,03	ES0148396007	STK	3.161	3.161	0	EUR	46,360	146.543,96	2,40
Infinion Technologies AG Namens-Aktien o.N.	DE0006231004	STK	897	139	152	EUR	34,305	30.771,59	0,50
ING Groep N.V. Aandelen op naam EO -,01	NL0011821202	STK	4.392	4.392	0	EUR	15,962	70.105,10	1,15

Halbjahresbericht LeanVal Equity 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
Intesa Sanpaolo S.p.A. Azioni nom. o.N.	IT0000072618		STK	10.753	10.753	0 EUR	3,471	37.323,66	0,61
Kering S.A. Actions Port. EO 4	FR0000121485		STK	49	49	0 EUR	338,500	16.586,50	0,27
L'Oréal S.A. Actions Port. EO 0,2	FR0000120321		STK	329	329	0 EUR	410,050	134.906,45	2,21
LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE Actions Port. (C.R.) EO 0,3	FR0000121014		STK	375	375	0 EUR	713,600	267.600,00	4,38
Mercedes-Benz Group AG Namens-Aktien o.N.	DE0007100000		STK	1.085	1.085	0 EUR	64,570	70.058,45	1,15
Münchener Rückvers.-Ges. AG vink.Namens-Aktien o.N.	DE0008430026		STK	392	279	0 EUR	467,000	183.064,00	2,99
Nokia Oyj Registered Shares EO 0,06	FI0009000681		STK	3.788	3.788	0 EUR	3,559	13.479,60	0,22
Nordea Bank Abp Registered Shares o.N.	FI4000297767		STK	4.332	4.332	0 EUR	11,115	48.150,18	0,79
Pernod Ricard S.A. Actions Port. (C.R.) o.N.	FR0000120693		STK	142	142	0 EUR	126,700	17.991,40	0,29
Prosus N.V. Registered Shares EO -,05	NL0013654783		STK	3.934	3.934	0 EUR	33,260	130.844,84	2,14
SAFRAN Actions Port. EO -,20	FR0000073272		STK	1.003	1.003	0 EUR	197,400	197.992,20	3,24
Sanofi S.A. Actions Port. EO 2	FR0000120578		STK	785	785	0 EUR	89,940	70.602,90	1,16
SAP SE Inhaber-Aktien o.N.	DE0007164600		STK	1.456	1.456	0 EUR	189,520	275.941,12	4,51
Schneider Electric SE Actions Port. EO 4	FR0000121972		STK	794	794	0 EUR	224,300	178.094,20	2,91
Siemens AG Namens-Aktien o.N.	DE0007236101		STK	2.103	1.864	0 EUR	173,720	365.333,16	5,98
Stellantis N.V. Aandelen op naam EO -,01	NL00150001Q9		STK	6.678	4.456	0 EUR	18,470	123.342,66	2,02
TotalEnergies SE Actions au Porteur EO 2,50	FR0000120271		STK	5.888	5.146	0 EUR	62,330	366.999,04	6,00
UniCredit S.p.A. Azioni nom. o.N.	IT0005239360		STK	4.523	2.651	0 EUR	34,605	156.518,42	2,56
VINCI S.A. Actions Port. EO 2,50	FR0000125486		STK	1.380	1.380	0 EUR	98,380	135.764,40	2,22
Volkswagen AG Vorzugsaktien o.St. o.N.	DE0007664039		STK	120	120	0 EUR	105,400	12.648,00	0,21
Summe Wertpapiervermögen 2)						EUR		5.559.661,00	90,95

Halbjahresbericht LeanVal Equity 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	48.253,12	0,79	
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)										
Aktienindex-Derivate							EUR	48.253,12	0,79	
Forderungen/Verbindlichkeiten										
Aktienindex-Terminkontrakte							EUR	760,00	0,01	
FUTURE EURO STOXX 50 PR.EUR 20.09.24 EUREX		185	EUR	Anzahl	18			760,00	0,01	
Optionsrechte							EUR	47.493,12	0,78	
Optionsrechte auf Aktienindices							EUR	29.604,00	0,48	
ESTX 50 PR.EUR PUT 16.08.24 BP 4600,00 EUREX		185		Anzahl	400		EUR	32,500	13.000,00	0,21
ESTX 50 PR.EUR PUT 19.07.24 BP 4350,00 EUREX		185		Anzahl	400		EUR	4,200	1.680,00	0,03
ESTX 50 PR.EUR PUT 20.09.24 BP 4475,00 EUREX		185		Anzahl	410		EUR	36,400	14.924,00	0,24

Halbjahresbericht LeanVal Equity 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
Optionsrechte auf Aktienindex-Terminkontrakte						EUR	17.889,12	0,29
FUT E-MI SP W3 09.24 PUT 19.07.24 BP 4400,00 CME			352	Anzahl 600		USD 0,650	363,94	0,01
FUT E-MI SP W3 09.24 PUT 19.07.24 BP 5340,00 CME			352	Anzahl -1200		USD 12,250	-13.717,81	-0,22
FUT E-MI SP W3 09.24 PUT 19.07.24 BP 5470,00 CME			352	Anzahl 600		USD 34,500	19.316,91	0,32
FUT E-MI SP W4 09.24 PUT 26.07.24 BP 4400,00 CME			352	Anzahl 1200		USD 0,950	1.063,83	0,02
FUT E-MI SP W4 09.24 PUT 26.07.24 BP 5200,00 CME			352	Anzahl -1800		USD 7,950	-13.353,86	-0,22
FUT E-MI SP W4 09.24 PUT 26.07.24 BP 5400,00 CME			352	Anzahl 600		USD 27,250	15.257,56	0,25
FUT MI SP W2 09.24 PUT 12.07.24 BP 4200,00 CME			352	Anzahl 1200		USD 0,150	167,97	0,00
FUT MI SP W2 09.24 PUT 12.07.24 BP 5350,00 CME			352	Anzahl -1200		USD 7,050	-7.894,74	-0,13
FUT MI SP W2 09.24 PUT 12.07.24 BP 5450,00 CME			352	Anzahl 600		USD 21,750	12.178,05	0,20
FUT MINI S+P W1 09.24 PUT 02.08.24 BP 4600,00 CME			352	Anzahl 1200		USD 2,100	2.351,62	0,04
FUT MINI S+P W1 09.24 PUT 02.08.24 BP 5250,00 CME			352	Anzahl -1800		USD 15,750	-26.455,77	-0,43
FUT MINI S+P W1 09.24 PUT 02.08.24 BP 5440,00 CME			352	Anzahl 600		USD 45,250	25.335,95	0,41
FUT MINI S+P W1 09.24 PUT 05.07.24 BP 4200,00 CME			352	Anzahl 1200		USD 0,050	55,99	0,00
FUT MINI S+P W1 09.24 PUT 05.07.24 BP 5300,00 CME			352	Anzahl -600		USD 0,600	-335,95	-0,01
FUT MINI S+P W1 09.24 PUT 05.07.24 BP 5400,00 CME			352	Anzahl -300		USD 2,300	-643,90	-0,01
FUT MINI S+P W1 09.24 PUT 05.07.24 BP 5480,00 CME			352	Anzahl 300		USD 15,000	4.199,33	0,07

Halbjahresbericht LeanVal Equity 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	
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds						EUR	524.464,35	8,58	
Bankguthaben						EUR	524.464,35	8,58	
EUR - Guthaben bei:									
Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG			EUR	459.795,50		%	100,000	459.795,50	7,52
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen bei:									
Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG			USD	69.299,14		%	100,000	64.668,85	1,06
Sonstige Vermögensgegenstände						EUR	6.262,08	0,10	
Zinsansprüche			EUR	1.164,21				1.164,21	0,02
Dividendenansprüche			EUR	4.651,52				4.651,52	0,08
Quellensteueransprüche			EUR	446,35				446,35	0,01
Sonstige Verbindlichkeiten						EUR	-25.925,49	-0,42	
Verwaltungsvergütung			EUR	-2.125,82				-2.125,82	-0,03
Verwahrstellenvergütung			EUR	-1.352,05				-1.352,05	-0,02
Prüfungskosten			EUR	-8.966,67				-8.966,67	-0,15
Veröffentlichungskosten			EUR	-593,33				-593,33	-0,01
Portfoliomanagervergütung			EUR	-12.127,62				-12.127,62	-0,20
Variation Margin			EUR	-760,00				-760,00	-0,01
Fondsvermögen						EUR	6.112.715,06	100,00 1)	
LeanVal Equity Protect - AK I									
Anteilwert						EUR	109,53		
Ausgabepreis						EUR	109,53		
Rücknahmepreis						EUR	109,53		
Anzahl Anteile						STK	39.351		

Halbjahresbericht LeanVal Equity 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
LeanVal Equity Protect - AK R									
Anteilwert							EUR	108,79	
Ausgabepreis							EUR	108,79	
Rücknahmepreis							EUR	108,79	
Anzahl Anteile							STK	16.570	

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 LeanVal Equity 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

Halbjahresbericht LeanVal Equity 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
Börsengehandelte Wertpapiere					
Aktien					
Andritz AG Inhaber-Aktien o.N.	AT0000730007	STK	0	716	
Arcadis N.V. Aandelen aan toonder EO -,02	NL0006237562	STK	0	955	
ArcelorMittal S.A. Actions Nouvelles Nominat. oN	LU1598757687	STK	0	1.369	
ASM International N.V. Bearer Shares EO 0,04	NL0000334118	STK	0	100	
Associated British Foods PLC Registered Shares LS -,0568	GB0006731235	STK	0	1.682	
Balfour Beatty PLC Registered Shares LS -,50	GB0000961622	STK	0	9.212	
Banco BPM S.p.A. Azioni o.N.	IT0005218380	STK	0	8.576	
Banco de Sabadell S.A. Acciones Nom. Serie A EO -,125	ES0113860A34	STK	0	27.175	
Beazley PLC Registered Shares LS -,05	GB00BYQ0JC66	STK	0	5.685	
bioMerieux Actions au Porteur (P.S.) o.N.	FR0013280286	STK	0	363	
BP PLC Registered Shares DL -,25	GB0007980591	STK	0	7.306	
Britvic PLC Registered Shares LS -,20	GB00B0N8QD54	STK	0	3.912	
Carl Zeiss Meditec AG Inhaber-Aktien o.N.	DE0005313704	STK	0	366	
Centrica PLC Reg. Shares LS -,061728395	GB00B033F229	STK	0	30.577	
CTS Eventim AG & Co. KGaA Inhaber-Aktien o.N.	DE0005470306	STK	0	672	
Dino Polska S.A. Inhaber-Aktien ZY -,10	PLDINPL00011	STK	0	435	
Greggs PLC Registered Shares LS -,02	GB00B63QSB39	STK	0	1.202	
Heineken N.V. Aandelen aan toonder EO 1,60	NL0000009165	STK	0	414	
Hikma Pharmaceuticals PLC Registered Shares LS -,10	GB00B0LCW083	STK	0	1.688	
HUGO BOSS AG Namens-Aktien o.N.	DE000A1PHFF7	STK	0	514	
IG Group Holdings PLC Registered Shares LS 0,00005	GB00B06QFB75	STK	0	4.946	
Inchcape PLC Registered Shares LS -,10	GB00B61TVQ02	STK	0	3.948	
Indivior PLC Registered Shares DL0,50	GB00BN4HT335	STK	0	1.959	
Ipsen S.A. Actions au Porteur EO 1	FR0010259150	STK	0	332	
Jerónimo Martins, SGPS, S.A. Acções Nominativas EO 1	PTJMT0AE0001	STK	0	1.847	
Kindred Group PLC Shares (SDR's)/1 LS-,000625	SE0007871645	STK	0	3.662	
Metso Oyj Registered Shares o.N.	FI0009014575	STK	0	3.272	
Novo Nordisk A/S	DK0062498333	STK	0	500	
Powszechny Zakład Ubezpieczeń Namens-Aktien ZY 0,10	PLPZU0000011	STK	0	4.518	
Randstad N.V. Aandelen aan toonder EO 0,10	NL0000379121	STK	0	757	
Repsol S.A. Acciones Port. EO 1	ES0173516115	STK	0	2.925	

Halbjahresbericht LeanVal Equity 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
Rexel S.A. Actions au Porteur EO 5	FR0010451203	STK	0	1.617	
RWE AG Inhaber-Aktien o.N.	DE0007037129	STK	0	977	
Sainsbury PLC, J. Registered Shs LS -,28571428	GB00B019KW72	STK	0	12.449	
Siemens Energy AG	DE000ENER6Y0	STK	0	1.678	
Sopra Steria Group S.A. Actions Port. EO 1	FR0000050809	STK	0	187	
Spectris PLC Registered Shares LS -,05	GB0003308607	STK	0	815	
SSAB AB Namn-Aktier B (fria) o.N.	SE0000120669	STK	0	5.374	
Straumann Holding AG Namens-Aktien SF 0,01	CH1175448666	STK	0	257	
Swatch Group AG, The Inhaber-Aktien SF 2,25	CH0012255151	STK	0	134	
Swedish Orphan Biovitrum AB Namn-Aktier SK 1	SE0000872095	STK	0	2.044	
Telefónica Deutschland Hldg AG Namens-Aktien o.N.	DE000A1J5RX9	STK	0	15.102	
Verallia SA Actions Port. (Prom.) EO 3,38	FR0013447729	STK	0	992	
voestalpine AG Inhaber-Aktien o.N.	AT0000937503	STK	0	1.037	
Warehouses De Pauw N.V. Actions Nom. o.N.	BE0974349814	STK	0	623	
Wendel SE Actions Port. EO 4	FR0000121204	STK	0	415	

Nichtnotierte Wertpapiere

Andere Wertpapiere

Iberdrola S.A. Anrechte	ES06445809R9	STK	1.614	1.614	
-------------------------	--------------	-----	-------	-------	--

Halbjahresbericht LeanVal Equity 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): ESTX 50 PR.EUR)

EUR

949,58

Optionsrechte

Optionsrechte auf Aktienindex-Derivate

Optionsrechte auf Aktienindices

Gekaufte Verkaufsoptionen (Put):

(Basiswert(e): ESTX 50 PR.EUR)

EUR

20,40

Optionsrechte auf Aktienindex-Terminkontrakte

Gekaufte Verkaufsoptionen (Put):

, FUTURE E-MINI S+P 500 INDEX 15.03.24 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 INDEX
21.06.24 CME)

EUR

0,00

(Basiswert(e): FUTURE E-MIN S+P 500 EOM 20.09.24 CME, FUTURE E-MIN S+P 500 EOM
21.06.24 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP W1 03.24 CME, FUTURE E-MINI S+P
500 EUROP W1 20.09.24 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP W1 21.06.24 CME,
FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP W2 03.24 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP W2
20.09.24 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP W2 21.06.24 CME, FUTURE E-MINI S+P
500 EUROP Week3 03.24 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP Week3 20.09.24 CME,
FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP Week3 21.06.24 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP
Week4 03.24 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP Week4 20.09.24 CME, FUTURE E-
MINI S+P 500 EUROP Week4 21.06.24 CME,

Halbjahresbericht LeanVal Equity 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
Verkaufte Verkaufsoptionen (Put): (Basiswert(e): FUTURE E-MIN S+P 500 EOM 20.09.24 CME, FUTURE E-MIN S+P 500 EOM 21.06.24 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP W1 03.24 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP W1 20.09.24 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP W1 21.06.24 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP W2 03.24 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP W2 20.09.24 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP W2 21.06.24 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP Week3 03.24 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP Week3 20.09.24 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP Week3 21.06.24 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP Week4 03.24 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP Week4 21.06.24 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 INDEX 15.03.24 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 INDEX 21.06.24 CME)		EUR			554,31

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
LeanVal Equity Protect**

Anteilklassenmerkmale im Überblick

Anteilklasse	Mindestanlagesumme in Währung	Ausgabeaufschlag derzeit (Angabe in %) *)	Verwaltungsvergütung derzeit (Angabe in % p.a.) *)	Ertragsverwendung	Währung
LeanVal Equity Protect - AK I	1.000.000	0,00	0,150	Ausschüttung ohne Zwischenausschüttung	EUR
LeanVal Equity Protect - AK R	keine	0,00	0,150	Ausschüttung ohne Zwischenausschüttung	EUR

*) Die maximale Gebühr kann dem aktuellen Verkaufsprospekt entnommen werden.

Halbjahresbericht LeanVal Equity Protect

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)	90,95
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)	0,79

Sonstige Angaben

LeanVal Equity Protect - AK I

Anteilwert	EUR	109,53
Ausgabepreis	EUR	109,53
Rücknahmepreis	EUR	109,53
Anzahl Anteile	STK	39.351

LeanVal Equity Protect - AK R

Anteilwert	EUR	108,79
Ausgabepreis	EUR	108,79
Rücknahmepreis	EUR	108,79
Anzahl Anteile	STK	16.570

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 LeanVal Equity 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 LeanVal Equity Protect

Anteilklassen im Überblick

Erstausgabedatum

Anteilklasse I	1. März 2023
Anteilklasse R	1. März 2023

Erstausgabepreise

Anteilklasse I	EUR 100 zzgl. Ausgabeaufschlag
Anteilklasse R	EUR 100 zzgl. Ausgabeaufschlag

Ausgabeaufschlag

Anteilklasse I	derzeit 0,00 %
Anteilklasse R	derzeit 0,00 %

Mindestanlagesumme

Anteilklasse I	EUR 1.000.000
Anteilklasse R	keine

Verwaltungsvergütung*

Anteilklasse I	derzeit 0,150 % p.a.
Anteilklasse R	derzeit 0,150 % p.a.

Verwahrstellenvergütung*

Anteilklasse I	derzeit 0,08 % p.a.
Anteilklasse R	derzeit 0,08 % p.a.

Asset Management-Vergütung

Anteilklasse I	derzeit 0,75 % p.a.
Anteilklasse R	derzeit 1,25 % p.a.

Erfolgsabhängige Vergütung

Anteilklasse I und R	derzeit 20 % der vom Fonds in der Abrechnungsperiode erwirtschafteten Rendite über dem Referenzwert (EURO STOXX ® 50 Net Return Index).
----------------------	---

Währung

Anteilklasse I	Euro
Anteilklasse R	Euro

Ertragsverwendung

Anteilklasse I	Ausschüttung
Anteilklasse R	Ausschüttung

Wertpapier-Kennnummer / ISIN:

Anteilklasse I	A3D05K / DE000A3D05K6
Anteilklasse R	A3D05L / DE000A3D05L4

*Unterliegt einer Staffelung

Halbjahresbericht LeanVal Equity 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

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. € 599 (Stand: 31.12.2022)

3. Asset Management-Gesellschaft und Vertrieb

LeanVal Asset Management AG

Postanschrift:

Bleichstraße 52
60313 Frankfurt am Main

Telefon 069 949488000
Telefax 069 949488010
www.lvam.de