

KAPITALVERWALTUNGSGESELLSCHAFT:



Aquantum Active Range

JAHRESBERICHT

ZUM 30. JUNI 2023

VERWAHRSTELLE:



BNP PARIBAS

ASSET MANAGEMENT UND VERTRIEB:



Jahresbericht Aquantum Active Range

Tätigkeitsbericht für den Berichtszeitraum vom 1. Juli 2022 bis 30. Juni 2023

Anlageziele und Anlagepolitik zur Erreichung der Anlageziele

Der Fonds handelt systematisch Optionskombinationen auf US-amerikanische Aktienindizes mit dem Ziel, Schwankungen des Aktienmarktes zu nutzen und eine zum Basiswert möglichst un- bis negativ korrelierte positive Rendite zu erzielen. Durch den simultanen Kauf und Verkauf von börsengehandelten Optionen (Spreads) mit verschiedenen Laufzeiten wird ein Korridor eingerichtet. Ziel ist es, dass sich der Basiswert während der Laufzeit der jeweiligen Spreads in den zuvor eingerichteten Korridor bewegt, um damit über eine Wertsteigerung der gekauften Optionen zu profitieren. Bleibt diese Marktschwankung während der Laufzeit der eingesetzten Optionen aus, verfällt der jeweilige Spread wertlos, d.h. der Fonds zahlt oder erhält lediglich die eingesetzte Optionsprämie. Der Fonds verfolgt einen aktiven Management- und Risikomanagementansatz. Dafür wird die Positionierung des Fonds während der gesamten Handelssitzung an das aktuelle Markt- und Volatilitätsumfeld angepasst. Der Anteil des Fondsvermögens, der nicht zur Umsetzung der Strategie benötigt wird, wird in Euro-denominierte Anleihen mit Investmentgrade Rating und Tagesgeld bei deutschen Landesbanken angelegt. Es wird nicht angestrebt mit diesen Anlagen eine Zusatzrendite zu erwirtschaften.

Struktur des Portfolios und wesentliche Veränderungen im Berichtszeitraum

Fondsstruktur

	30.06.2023		30.06.2022	
	Kurswert	% Anteil Fondsvermögen	Kurswert	% Anteil Fondsvermögen
Renten	0,00	0,00	8.297.278,60	5,12
Optionen	-42.006,61	-0,01	812.781,01	0,50
Futures	0,00	0,00	-2.603.583,90	-1,61
Festgelder/Termingelder/Kredite	111.000.000,00	36,67	70.439.873,72	43,48
Bankguthaben	193.499.774,27	63,92	86.190.153,05	53,21
Zins- und Dividendenansprüche	364.338,24	0,12	56.519,15	0,03
Sonstige Ford./Verbindlichkeiten	-2.122.986,30	-0,70	-1.205.730,92	-0,74
Fondsvermögen	302.699.119,60	100,00	161.987.290,71	100,00

Jahresbericht Aquantum Active Range

Im Berichtszeitraum vom 1. Juli 2022 bis 30. Juni 2023 war die Aktienmarktentwicklung durch ausreichend ausgeprägte Marktschwankungen gekennzeichnet, die zur Erreichung eines positiven Ergebnisses nötig sind. In dieser Zeitperiode stieg der für den Fonds maßgeblich relevante E-mini S&P 500 Future vom 03. Juli 2022 von 3.789 Punkten (ESU 2 Index) auf einen Stand von 4.485 Punkten (ESU3 Index) zum Ende der Berichtsperiode. Unabhängig von diesem längerfristigen Entwicklungsbild konnten die schwankungsintensiven Phasen des E-mini S&P 500 Futures insbesondere im dritten und vierten Quartal des Jahres 2022 als auch im ersten Quartal des Jahres 2023 durch die Active Range Strategie genutzt werden, um jeweils eine positive Quartalsperformance zu erwirtschaften. Lediglich das II.Quartal 2023 verlief komplett schwankungsarm und war negativ für AAR. Der Aquantum Active Range verzeichnete in seinem zweiten Geschäftsjahr eine Jahresperformance von +3,31% (Anteilsklasse S), +2,80% (Anteilsklasse I) und von +1,94% (Anteilsklasse R). Die annualisierte Volatilität des Fonds bewegte sich dabei im unteren Bereich der Erwartung und lag in der Anteilsklasse S bei 4,48%, in der Anteilsklasse I bei 4,47% und in der Anteilsklasse R bei 4,48%. An der Anlagestrategie und am Investmentprozess wurden keine Veränderungen vorgenommen.

Wesentliche Risiken

Allgemeine Marktpreisrisiken

Die Kurs- oder Marktwertentwicklung von Finanzprodukten hängt insbesondere von der Entwicklung der Kapitalmärkte ab, die wiederum von der allgemeinen Lage der Weltwirtschaft sowie den wirtschaftlichen und politischen Rahmenbedingungen in den jeweiligen Ländern beeinflusst wird. Auf die allgemeine Kursentwicklung, insbesondere an einer Börse, können auch irrationale Faktoren wie Stimmungen, Meinungen und Gerüchte einwirken.

Die Ukraine-Krise und die dadurch ausgelösten Marktturbulenzen und Sanktionen der Industrienationen gegenüber Russland haben eine Vielzahl an unterschiedlichen Auswirkungen auf die Finanzmärkte im Allgemeinen und auf Fonds (Sondervermögen) im Speziellen. Die Bewegungen an den Börsen werden sich entsprechend auch im Fondsvermögen (Wert des Sondervermögens) widerspiegeln.

Zusätzlich belasten Unsicherheiten über den weiteren Verlauf des Konflikts sowie die wirtschaftlichen Folgen der diversen Sanktionen die Märkte.

Zinsänderungsrisiken

Mit der Investition in festverzinsliche Wertpapiere ist die Möglichkeit verbunden, dass sich das Marktzinsniveau, das im Zeitpunkt der Begebung eines Wertpapiers besteht, ändern kann. Steigen die Marktzinsen gegenüber den Zinsen zum Zeitpunkt der Emission, so fallen in der Regel die Kurse der festverzinslichen Wertpapiere. Fällt dagegen der Marktzins, so steigt der Kurs festverzinslicher Wertpapiere. Diese Kursentwicklung führt dazu, dass die aktuelle Rendite der festverzinslichen Wertpapiere in etwa dem aktuellen Marktzins entspricht. Diese Kursentwicklungen fallen jedoch je nach Laufzeit der festverzinslichen Wertpapiere unterschiedlich aus. Festverzinsliche Wertpapiere mit kürzeren Laufzeiten haben geringere Zinsänderungs-/Kursrisiken als festverzinsliche Wertpapiere mit längeren Laufzeiten.

Adressenausfallrisiken / Emittentenrisiken

Durch den Ausfall eines Ausstellers oder Kontrahenten können Verluste für das Sondervermögen entstehen. Das Ausstellerrisiko beschreibt die Auswirkung der besonderen Entwicklungen des jeweiligen Ausstellers, die neben den allgemeinen Tendenzen der Kapitalmärkte auf den Kurs eines Wertpapiers einwirken. Auch bei sorgfältiger Auswahl der Wertpapiere kann nicht ausgeschlossen werden, dass Verluste durch Vermögensverfall von Ausstellern eintreten. Das Kontrahentenrisiko beinhaltet das Risiko der Partei eines gegenseitigen Vertrages, mit der eigenen Forderung teilweise oder vollständig auszufallen. Dies gilt für alle Verträge, die für Rechnung eines Sondervermögens

Jahresbericht Aquantum Active Range

Bonitätsrisiken

Bei Anleihen kann es zu einer Ratingveränderung des Schuldners kommen. Je nachdem, ob die Bonität steigt oder fällt, kann es zu Kursveränderungen des Wertpapiers kommen.

Risiken im Zusammenhang mit Derivategeschäften

Die Gesellschaft darf für Rechnung des Sondervermögens sowohl zu Absicherungszwecken als auch zu Investitionszwecken Geschäfte mit Derivaten tätigen. Die Absicherungsgeschäfte dienen dazu, das Gesamtrisiko des Sondervermögens zu verringern, können jedoch ggf. auch die Renditechancen schmälern.

Kauf und Verkauf von Optionen sowie der Abschluss von Terminkontrakten oder Swaps sind mit folgenden Risiken verbunden:

- Kursänderungen des Basiswertes können den Wert eines Optionsrechts oder Terminkontraktes bis hin zur Wertlosigkeit vermindern. Durch Wertänderungen des einem Swap zugrunde liegenden Vermögenswertes kann das Sondervermögen ebenfalls Verluste erleiden.
- Der gegebenenfalls erforderliche Abschluss eines Gegengeschäfts (Glattstellung) ist mit Kosten verbunden.
- Durch die Hebelwirkung von Optionen kann der Wert des Sondervermögens stärker beeinflusst werden, als dies beim unmittelbaren Erwerb der Basiswerte der Fall ist.
- Der Kauf von Optionen birgt das Risiko, dass die Option nicht ausgeübt wird, weil sich die Preise der Basiswerte nicht wie erwartet entwickeln, so dass die vom Sondervermögen gezahlte Optionsprämie verfällt. Beim Verkauf von Optionen besteht die Gefahr, dass das Sondervermögen zur Abnahme / Lieferung von Vermögenswerten zu einem abweichenden Preis als dem aktuellen Marktpreis verpflichtet ist.
- Auch bei Terminkontrakten besteht das Risiko, dass das Sondervermögen infolge unerwarteter Entwicklungen der Marktpreise bei Fälligkeit Verluste erleidet.

Währungsrisiken

Sofern Vermögenswerte eines Sondervermögens in anderen Währungen als der jeweiligen Fondswährung angelegt sind, erhält es die Erträge, Rückzahlungen und Erlöse aus solchen Anlagen in der jeweiligen Währung. Fällt der Wert dieser Währung gegenüber der Fondswährung, so reduziert sich der Wert des Sondervermögens.

Fondsergebnis

Die wesentlichen Quellen des positiven Veräußerungsergebnisses während des Berichtszeitraums waren realisierte Gewinne aus verkauften Optionen.

Wertentwicklung im Berichtszeitraum (1. Juli 2022 bis 30. Juni 2023)¹.

Anteilklasse (S):	+3,31%
Anteilklasse (I):	+2,80%
Anteilklasse (R):	+1,94%

¹Eigene Berechnung nach der BVI-Methode (ohne Berücksichtigung von Ausgabeaufschlägen). Historische Wertentwicklungen lassen keine Rückschlüsse auf eine ähnliche Entwicklung in der Zukunft zu. Diese ist nicht prognostizierbar.

Jahresbericht Aquantum Active Range

Vermögensübersicht zum 30.06.2023

Anlageschwerpunkte	Tageswert in EUR	% Anteil am Fondsvermögen
I. Vermögensgegenstände	304.867.923,90	100,72
1. Derivate	-42.006,61	-0,01
2. Bankguthaben	304.327.472,75	100,54
3. Sonstige Vermögensgegenstände	582.457,76	0,19
II. Verbindlichkeiten	-2.168.804,30	-0,72
III. Fondsvermögen	302.699.119,60	100,00

Jahresbericht

Aquantum Active Range

Vermögensaufstellung zum 30.06.2023

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2023	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Derivate							EUR	-42.006,61	-0,01
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)									
Aktienindex-Derivate							EUR	-42.006,61	-0,01
Forderungen/Verbindlichkeiten									
Optionsrechte							EUR	-42.006,61	-0,01
Optionsrechte auf Aktienindex-Terminkontrakte							EUR	-42.006,61	-0,01
FUT E-MI SP W3 09.23 PUT 21.07.23 BP 4050,00 CME			352	Anzahl -52000			USD 2,100	-100.100,83	-0,03
FUT E-MI SP W3 09.23 PUT 21.07.23 BP 4060,00 CME			352	Anzahl -52000			USD 2,150	-102.484,19	-0,03
FUT E-MI SP W3 09.23 PUT 21.07.23 BP 4110,00 CME			352	Anzahl -52000			USD 2,550	-121.551,01	-0,04
FUT E-MI SP W3 09.23 PUT 21.07.23 BP 4130,00 CME			352	Anzahl -52000			USD 2,700	-128.701,07	-0,04
FUT E-MI SP W3 09.23 PUT 21.07.23 BP 4140,00 CME			352	Anzahl -26000			USD 2,800	-66.733,89	-0,02
FUT E-MI SP W3 09.23 PUT 21.07.23 BP 4150,00 CME			352	Anzahl -52000			USD 2,900	-138.234,49	-0,05
FUT E-MI SP W3 09.23 PUT 21.07.23 BP 4170,00 CME			352	Anzahl -26000			USD 3,100	-73.883,95	-0,02
FUT E-MI SP W3 09.23 PUT 21.07.23 BP 4200,00 CME			352	Anzahl -13000			USD 3,600	-42.900,36	-0,01
FUT E-MI SP W3 09.23 PUT 21.07.23 BP 4210,00 CME			352	Anzahl -13000			USD 3,800	-45.283,71	-0,01
FUT E-MI SP W3 09.23 PUT 21.07.23 BP 4230,00 CME			352	Anzahl 13000			USD 4,250	50.646,26	0,02
FUT E-MI SP W3 09.23 PUT 21.07.23 BP 4250,00 CME			352	Anzahl 13000			USD 4,700	56.008,80	0,02
FUT E-MI SP W3 09.23 PUT 21.07.23 BP 4270,00 CME			352	Anzahl 6500			USD 5,500	32.771,11	0,01
FUT E-MI SP W3 09.23 PUT 21.07.23 BP 4290,00 CME			352	Anzahl 13000			USD 6,250	74.479,79	0,02
FUT E-MI SP W3 09.23 PUT 21.07.23 BP 4310,00 CME			352	Anzahl 13000			USD 7,250	86.396,55	0,03
FUT E-MI SP W3 09.23 PUT 21.07.23 BP 4330,00 CME			352	Anzahl 13000			USD 8,500	101.292,51	0,03
FUT E-MI SP W3 09.23 PUT 21.07.23 BP 4350,00 CME			352	Anzahl 13000			USD 10,250	122.146,85	0,04
FUT E-MI SP W3 09.23 PUT 21.07.23 BP 4370,00 CME			352	Anzahl 6500			USD 12,250	72.990,19	0,02
FUT E-MI SP W3 09.23 PUT 21.07.23 BP 4390,00 CME			352	Anzahl 13000			USD 14,750	175.772,30	0,06
FUT E-MI SP W4 09.23 PUT 28.07.23 BP 4030,00 CME			352	Anzahl -26000			USD 3,300	-78.650,66	-0,03
FUT E-MI SP W4 09.23 PUT 28.07.23 BP 4070,00 CME			352	Anzahl -52000			USD 3,850	-183.518,20	-0,06
FUT E-MI SP W4 09.23 PUT 28.07.23 BP 4110,00 CME			352	Anzahl -65000			USD 4,500	-268.127,23	-0,09
FUT E-MI SP W4 09.23 PUT 28.07.23 BP 4140,00 CME			352	Anzahl -52000			USD 5,000	-238.335,32	-0,08
FUT E-MI SP W4 09.23 PUT 28.07.23 BP 4160,00 CME			352	Anzahl -26000			USD 5,500	-131.084,43	-0,04
FUT E-MI SP W4 09.23 PUT 28.07.23 BP 4170,00 CME			352	Anzahl -52000			USD 6,000	-286.002,38	-0,09

Jahresbericht

Aquantum Active Range

Vermögensaufstellung zum 30.06.2023

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2023	Käufe / Zugänge Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
FUT E-MI SP W4 09.23 PUT 28.07.23 BP 4190,00 CME		352	Anzahl	-26000		USD 6,500	-154.917,96	-0,05
FUT E-MI SP W4 09.23 PUT 28.07.23 BP 4210,00 CME		352	Anzahl	-19500		USD 7,250	-129.594,83	-0,04
FUT E-MI SP W4 09.23 PUT 28.07.23 BP 4240,00 CME		352	Anzahl	-26000		USD 8,500	-202.585,02	-0,07
FUT E-MI SP W4 09.23 PUT 28.07.23 BP 4250,00 CME		352	Anzahl	13000		USD 9,000	107.250,89	0,04
FUT E-MI SP W4 09.23 PUT 28.07.23 BP 4270,00 CME		352	Anzahl	13000		USD 10,250	122.146,85	0,04
FUT E-MI SP W4 09.23 PUT 28.07.23 BP 4290,00 CME		352	Anzahl	13000		USD 11,750	140.022,00	0,05
FUT E-MI SP W4 09.23 PUT 28.07.23 BP 4310,00 CME		352	Anzahl	6500		USD 13,250	78.948,57	0,03
FUT E-MI SP W4 09.23 PUT 28.07.23 BP 4320,00 CME		352	Anzahl	13000		USD 14,250	169.813,92	0,06
FUT E-MI SP W4 09.23 PUT 28.07.23 BP 4350,00 CME		352	Anzahl	13000		USD 17,500	208.543,40	0,07
FUT E-MI SP W4 09.23 PUT 28.07.23 BP 4370,00 CME		352	Anzahl	13000		USD 20,000	238.335,32	0,08
FUT E-MI SP W4 09.23 PUT 28.07.23 BP 4390,00 CME		352	Anzahl	13000		USD 23,000	274.085,62	0,09
FUT E-MI SP W4 09.23 PUT 28.07.23 BP 4420,00 CME		352	Anzahl	13000		USD 29,250	348.565,40	0,12
FUT MI SP W2 09.23 PUT 14.07.23 BP 4060,00 CME		352	Anzahl	-26000		USD 1,300	-30.983,59	-0,01
FUT MI SP W2 09.23 PUT 14.07.23 BP 4070,00 CME		352	Anzahl	13000		USD 1,350	16.087,63	0,01
FUT MI SP W2 09.23 PUT 14.07.23 BP 4090,00 CME		352	Anzahl	-52000		USD 1,400	-66.733,89	-0,02
FUT MI SP W2 09.23 PUT 14.07.23 BP 4130,00 CME		352	Anzahl	-52000		USD 1,550	-73.883,95	-0,02
FUT MI SP W2 09.23 PUT 14.07.23 BP 4140,00 CME		352	Anzahl	-39000		USD 1,550	-55.412,96	-0,02
FUT MI SP W2 09.23 PUT 14.07.23 BP 4150,00 CME		352	Anzahl	-39000		USD 1,600	-57.200,48	-0,02
FUT MI SP W2 09.23 PUT 14.07.23 BP 4170,00 CME		352	Anzahl	-26000		USD 1,700	-40.517,00	-0,01
FUT MI SP W2 09.23 PUT 14.07.23 BP 4190,00 CME		352	Anzahl	-26000		USD 1,800	-42.900,36	-0,01
FUT MI SP W2 09.23 PUT 14.07.23 BP 4220,00 CME		352	Anzahl	-6500		USD 2,050	-12.214,69	0,00
FUT MI SP W2 09.23 PUT 14.07.23 BP 4270,00 CME		352	Anzahl	26000		USD 2,650	63.158,86	0,02
FUT MI SP W2 09.23 PUT 14.07.23 BP 4310,00 CME		352	Anzahl	6500		USD 3,600	21.450,18	0,01
FUT MI SP W2 09.23 PUT 14.07.23 BP 4320,00 CME		352	Anzahl	6500		USD 3,900	23.237,69	0,01
FUT MI SP W2 09.23 PUT 14.07.23 BP 4350,00 CME		352	Anzahl	13000		USD 5,250	62.563,02	0,02
FUT MI SP W2 09.23 PUT 14.07.23 BP 4370,00 CME		352	Anzahl	26000		USD 6,500	154.917,96	0,05
FUT MI SP W2 09.23 PUT 14.07.23 BP 4410,00 CME		352	Anzahl	6500		USD 10,750	64.052,62	0,02
FUT MINI S+P W1 09.23 PUT 04.08.23 BP 4110,00 CME		352	Anzahl	-52000		USD 6,750	-321.752,68	-0,11
FUT MINI S+P W1 09.23 PUT 04.08.23 BP 4200,00 CME		352	Anzahl	-26000		USD 10,000	-238.335,32	-0,08
FUT MINI S+P W1 09.23 PUT 04.08.23 BP 4300,00 CME		352	Anzahl	13000		USD 17,000	202.585,02	0,07
FUT MINI S+P W1 09.23 PUT 04.08.23 BP 4400,00 CME		352	Anzahl	13000		USD 31,500	375.378,13	0,12
FUT MINI S+P W1 09.23 PUT 07.07.23 BP 3980,00 CME		352	Anzahl	13000		USD 0,350	4.170,87	0,00
FUT MINI S+P W1 09.23 PUT 07.07.23 BP 4000,00 CME		352	Anzahl	-39000		USD 0,350	-12.512,60	0,00
FUT MINI S+P W1 09.23 PUT 07.07.23 BP 4020,00 CME		352	Anzahl	-52000		USD 0,400	-19.066,83	-0,01
FUT MINI S+P W1 09.23 PUT 07.07.23 BP 4060,00 CME		352	Anzahl	-91000		USD 0,400	-33.366,94	-0,01
FUT MINI S+P W1 09.23 PUT 07.07.23 BP 4080,00 CME		352	Anzahl	-91000		USD 0,450	-37.537,81	-0,01

Jahresbericht

Aquantum Active Range

Vermögensaufstellung zum 30.06.2023

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2023	Käufe / Zugänge Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
FUT MINI S+P W1 09.23 PUT 07.07.23 BP 4090,00 CME			352	Anzahl -26000		USD 0,450	-10.725,09	0,00
FUT MINI S+P W1 09.23 PUT 07.07.23 BP 4120,00 CME			352	Anzahl -104000		USD 0,500	-47.667,06	-0,02
FUT MINI S+P W1 09.23 PUT 07.07.23 BP 4190,00 CME			352	Anzahl 13000		USD 0,550	6.554,22	0,00
FUT MINI S+P W1 09.23 PUT 07.07.23 BP 4200,00 CME			352	Anzahl 13000		USD 0,600	7.150,06	0,00
FUT MINI S+P W1 09.23 PUT 07.07.23 BP 4210,00 CME			352	Anzahl -26000		USD 0,600	-14.300,12	0,00
FUT MINI S+P W1 09.23 PUT 07.07.23 BP 4220,00 CME			352	Anzahl 13000		USD 0,600	7.150,06	0,00
FUT MINI S+P W1 09.23 PUT 07.07.23 BP 4240,00 CME			352	Anzahl 13000		USD 0,650	7.745,90	0,00
FUT MINI S+P W1 09.23 PUT 07.07.23 BP 4250,00 CME			352	Anzahl 13000		USD 0,700	8.341,74	0,00
FUT MINI S+P W1 09.23 PUT 07.07.23 BP 4260,00 CME			352	Anzahl 13000		USD 0,700	8.341,74	0,00
FUT MINI S+P W1 09.23 PUT 07.07.23 BP 4280,00 CME			352	Anzahl 13000		USD 0,750	8.937,57	0,00
FUT MINI S+P W1 09.23 PUT 07.07.23 BP 4290,00 CME			352	Anzahl 13000		USD 0,800	9.533,41	0,00
FUT MINI S+P W1 09.23 PUT 07.07.23 BP 4300,00 CME			352	Anzahl 13000		USD 0,800	9.533,41	0,00
FUT MINI S+P W1 09.23 PUT 07.07.23 BP 4320,00 CME			352	Anzahl 13000		USD 0,900	10.725,09	0,00
FUT MINI S+P W1 09.23 PUT 07.07.23 BP 4350,00 CME			352	Anzahl 13000		USD 1,150	13.704,28	0,00
FUT MINI S+P W1 09.23 PUT 07.07.23 BP 4380,00 CME			352	Anzahl 13000		USD 1,700	20.258,50	0,01
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds						EUR	304.327.472,75	100,54
Bankguthaben						EUR	304.327.472,75	100,54
EUR - Guthaben bei:								
Bayerische Landesbank München (V)				EUR	21.000.000,00	% 100,000	21.000.000,00	6,94
BNP Paribas S.A., Niederlassung Deutschland				EUR	193.327.472,75	% 100,000	193.327.472,75	63,87
DZ Bank AG Frankfurt (V)				EUR	45.000.000,00	% 100,000	45.000.000,00	14,87
Landesbank Baden-Württemberg (GD) Stuttgart (V)				EUR	40.000.000,00	% 100,000	40.000.000,00	13,21
Landesbank Hessen-Thüringen Girozentrale Frankfurt (V)				EUR	5.000.000,00	% 100,000	5.000.000,00	1,65
Sonstige Vermögensgegenstände						EUR	582.457,76	0,19
Zinsansprüche				EUR	364.338,24		364.338,24	0,12
Einschüsse (Initial Margins)				EUR	218.119,52		218.119,52	0,07

Jahresbericht

Aquantum Active Range

Vermögensaufstellung zum 30.06.2023

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2023	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme							EUR	-45.818,00	-0,02
Kredite in Nicht-EU/EWR-Währungen									
BNP Paribas S.A., Niederlassung Deutschland			USD	-49.982,85			% 100,000	-45.818,00	-0,02
Sonstige Verbindlichkeiten							EUR	-2.122.986,30	-0,70
Verwaltungsvergütung			EUR	-73.739,80				-73.739,80	-0,02
Performance Fee			EUR	-1.506.415,62				-1.506.415,62	-0,50
Verwahrstellenvergütung			EUR	-13.162,55				-13.162,55	0,00
Lagerstellenkosten			EUR	-7.140,00				-7.140,00	0,00
Prüfungskosten			EUR	-9.943,34				-9.943,34	0,00
Veröffentlichungskosten			EUR	-500,00				-500,00	0,00
Portfoliomanagervergütung			EUR	-512.084,99				-512.084,99	-0,17
Fondsvermögen							EUR	302.699.119,60	100,00 1)
Aquantum Active Range Seed (S)									
Anteilwert							EUR	117,74	
Ausgabepreis							EUR	117,74	
Rücknahmepreis							EUR	117,74	
Anzahl Anteile							STK	1.783.019	
Aquantum Active Range Institutional (I)									
Anteilwert							EUR	116,85	
Ausgabepreis							EUR	116,85	
Rücknahmepreis							EUR	116,85	
Anzahl Anteile							STK	521.939	

Jahresbericht

Aquantum Active Range

Vermögensaufstellung zum 30.06.2023

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2023	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Aquantum Active Range Retail (R)									
Anteilwert							EUR	115,21	
Ausgabepreis							EUR	118,09	
Rücknahmepreis							EUR	115,21	
Anzahl Anteile							STK	275.848	

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.

Jahresbericht

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 30.06.2023 1,0909000	= 1 EUR (EUR)
-----	-------	-----------------------------	---------------

Marktschlüssel

Terminbörsen

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

Jahresbericht
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
---------------------	------	-------------------------------------	--------------------------	-----------------------------	---------------------

Nichtnotierte Wertpapiere *)

Verzinsliche Wertpapiere

Europäischer Stabilitäts.(ESM) EO-Bills Tr. 13.4.2023	EU000A3JZQ93	EUR	0	3.000	
0,3750 % Kreditanst.f.Wiederaufbau Anl.v.2016 (2023)	DE000A168Y22	EUR	0	3.295	
1,8750 % Nordrhein-Westfalen, Land Landessch.v.12(22) R.1211	DE000NRW0E68	EUR	0	2.000	

Derivate

(In Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe)

Terminkontrakte

Aktienindex-Terminkontrakte

Verkaufte Kontrakte: (Basiswert(e): S+P 500)		EUR			33.054,06
---	--	-----	--	--	-----------

Währungsterminkontrakte

Gekaufte Kontrakte: (Basiswert(e): CROSS RATE EO/DL)		EUR			206.067,54
---	--	-----	--	--	------------

Jahresbericht 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
---------------------	------	-------------------------------------	--------------------------	-----------------------------	---------------------

Optionsrechte

Optionsrechte auf Aktienindex-Derivate

Optionsrechte auf Aktienindex-Terminkontrakte

Gekaufte Verkaufsoptionen (Put):

(Basiswert(e): FUTURE E-MIN S+P 500 EOM 03.23 CME, FUTURE E-MIN S+P 500 EOM 06.23 CME, FUTURE E-MIN S+P 500 EOM 09.22 CME, FUTURE E-MIN S+P 500 EOM 09.23 CME, FUTURE E-MIN S+P 500 EOM 12.22 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP W1 03.23 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP W1 06.23 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP W1 09.22 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP W1 12.22 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP W2 03.23 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP W2 06.23 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP W2 09.22 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP W2 09.23 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP W2 12.22 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 , FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP Week3 06.23 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP Week3 09.22 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP Week3 09.23 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP Week3 12.22 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP Week4 03.23 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP Week4 06.23 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP Week4 09.22 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP Week4 09.23 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP Week4 12.22 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 INDEX 03.23 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 INDEX 06.23 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 INDEX 09.22 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 INDEX 12.22 CME, FUTURE E-MINI S+P 500EUR Thurs F 06.23)					EUR	311.312,40
--	--	--	--	--	-----	------------

Jahresbericht 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 03.23 CME, FUTURE E-MIN S+P 500 EOM 06.23 CME, FUTURE E-MIN S+P 500 EOM 09.22 CME, FUTURE E-MIN S+P 500 EOM 09.23 CME, FUTURE E-MIN S+P 500 EOM 12.22 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP W1 03.23 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP W1 06.23 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP W1 09.22 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP W1 09.23 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP W1 12.22 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP W2 03.23 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP W2 06.23 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP W2 09.22 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP W2 09.23 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 , FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP Week3 03.23 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP Week3 06.23 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP Week3 09.22 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP Week3 09.23 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP Week3 12.22 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP Week4 03.23 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP Week4 06.23 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP Week4 09.22 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP Week4 09.23 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 EUROP Week4 12.22 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 INDEX 03.23 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 INDEX 06.23 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 INDEX 09.22 CME, FUTURE E-MINI S+P 500 INDEX 12.22 CME, , FUTURE E-MINI S+P 500EUR Thurs F 06.23 CME)		EUR		239.650,70	

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.

Jahresbericht

Aquantum Active Range Seed (S)

Ertrags- und Aufwandsrechnung (inkl. Ertragsausgleich) für den Zeitraum vom 01.07.2022 bis 30.06.2023

			insgesamt	je Anteil
I. Erträge				
1. Dividenden inländischer Aussteller (vor Körperschaft-/Kapitalertragsteuer)	EUR		0,00	0,00
2. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer)	EUR		0,00	0,00
3. Zinsen aus inländischen Wertpapieren	EUR		18.393,60	0,01
4. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer)	EUR		0,00	0,00
5. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland	EUR		3.218.573,76	1,81
6. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Ausland (vor Quellensteuer)	EUR		0,00	0,00
7. Erträge aus Investmentanteilen	EUR		0,00	0,00
8. Erträge aus Wertpapier- Darlehen- und -Pensionsgeschäften	EUR		0,00	0,00
9. Abzug inländischer Körperschaft-/Kapitalertragsteuer	EUR		0,00	0,00
10. Abzug ausländischer Quellensteuer	EUR		0,00	0,00
11. Sonstige Erträge	EUR		0,00	0,00
Summe der Erträge	EUR		3.236.967,36	1,82
II. Aufwendungen				
1. Zinsen aus Kreditaufnahmen	EUR		38.887,43	0,02
2. Verwaltungsvergütung	EUR		-2.018.555,30	-1,14
- Verwaltungsvergütung	EUR	-1.153.983,19		
- Beratungsvergütung	EUR	0,00		
- Asset Management Gebühr	EUR	-864.572,11		
3. Verwahrstellenvergütung	EUR		-212.983,37	-0,12
4. Prüfungs- und Veröffentlichungskosten	EUR		-5.039,68	0,00
5. Sonstige Aufwendungen	EUR		-863.779,27	-0,48
- Depotgebühren	EUR	-156,39		
- Ausgleich ordentlicher Aufwand	EUR	-735.909,69		
- Sonstige Kosten	EUR	-127.713,19		
- davon Aufwendungen aus negativen Habenzinsen	EUR	-31.610,16		
Summe der Aufwendungen	EUR		-3.061.470,19	-1,72
III. Ordentlicher Nettoertrag	EUR		175.497,17	0,10
IV. Veräußerungsgeschäfte				
1. Realisierte Gewinne	EUR		222.770.586,19	124,94
2. Realisierte Verluste	EUR		-215.339.579,85	-120,77
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften	EUR		7.431.006,35	4,17

Jahresbericht Aquantum Active Range Seed (S)

V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	EUR	7.606.503,52	4,27
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne	EUR	610.790,21	0,34
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste	EUR	-1.086.832,91	-0,61
VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	EUR	-476.042,70	-0,27
VII. Ergebnis des Geschäftsjahres	EUR	7.130.460,82	4,00

Entwicklung des Sondervermögens

				2022/2023
I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres			EUR	131.196.751,61
1. Ausschüttung für das Vorjahr/Steuerabschlag für das Vorjahr			EUR	0,00
2. Zwischenausschüttungen			EUR	0,00
3. Mittelzufluss/-abfluss (netto)			EUR	74.714.835,73
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	EUR	105.332.285,75		
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	EUR	-30.617.450,02		
4. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich			EUR	-3.113.109,03
5. Ergebnis des Geschäftsjahres			EUR	7.130.460,82
davon nicht realisierte Gewinne	EUR	610.790,21		
davon nicht realisierte Verluste	EUR	-1.086.832,91		
II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres			EUR	209.928.939,12

Verwendung der Erträge des Sondervermögens Berechnung der Wiederanlage insgesamt und je Anteil

				insgesamt	je Anteil
I. Für die Wiederanlage verfügbar					
1. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	EUR		7.606.503,52	4,27	
2. Zuführung aus dem Sondervermögen	EUR		0,00	0,00	
3. Steuerabschlag für das Geschäftsjahr	EUR		0,00	0,00	
II. Wiederanlage	EUR		7.606.503,52	4,27	

Jahresbericht Aquantum Active Range Seed (S)

Vergleichende Übersicht seit Auflegung

Geschäftsjahr	Umlaufende Anteile am Ende des Geschäftsjahres		Fondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres		Anteilwert am Ende des Geschäftsjahres	
2021/2022 *)	Stück	1.151.151	EUR	131.196.751,61	EUR	113,97
2022/2023	Stück	1.783.019	EUR	209.928.939,12	EUR	117,74

*) Auflegedatum 01.07.2021

Jahresbericht

Aquantum Active Range Institutional (I)

Ertrags- und Aufwandsrechnung (inkl. Ertragsausgleich) für den Zeitraum vom 01.07.2022 bis 30.06.2023

			insgesamt	je Anteil
I. Erträge				
1. Dividenden inländischer Aussteller (vor Körperschaft-/Kapitalertragsteuer)	EUR		0,00	0,00
2. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer)	EUR		0,00	0,00
3. Zinsen aus inländischen Wertpapieren	EUR		5.377,11	0,01
4. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer)	EUR		0,00	0,00
5. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland	EUR		937.374,91	1,80
6. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Ausland (vor Quellensteuer)	EUR		0,00	0,00
7. Erträge aus Investmentanteilen	EUR		0,00	0,00
8. Erträge aus Wertpapier- Darlehen- und -Pensionsgeschäften	EUR		0,00	0,00
9. Abzug inländischer Körperschaft-/Kapitalertragsteuer	EUR		0,00	0,00
10. Abzug ausländischer Quellensteuer	EUR		0,00	0,00
11. Sonstige Erträge	EUR		0,00	0,00
Summe der Erträge	EUR		942.752,02	1,81
II. Aufwendungen				
1. Zinsen aus Kreditaufnahmen	EUR		28.215,66	0,05
2. Verwaltungsvergütung	EUR		-637.688,20	-1,22
- Verwaltungsvergütung	EUR	-242.209,73		
- Beratungsvergütung	EUR	0,00		
- Asset Management Gebühr	EUR	-395.478,47		
3. Verwahrstellenvergütung	EUR		-60.238,50	-0,12
4. Prüfungs- und Veröffentlichungskosten	EUR		-1.507,87	0,00
5. Sonstige Aufwendungen	EUR		-516.938,81	-0,99
- Depotgebühren	EUR	-641,34		
- Ausgleich ordentlicher Aufwand	EUR	-481.336,52		
- Sonstige Kosten	EUR	-34.960,95		
- davon Aufwendungen aus negativen Habenzinsen	EUR	-4.282,69		
Summe der Aufwendungen	EUR		-1.188.157,71	-2,28
III. Ordentliches Nettoergebnis	EUR		-245.405,69	-0,47
IV. Veräußerungsgeschäfte				
1. Realisierte Gewinne	EUR		65.055.069,00	124,64
2. Realisierte Verluste	EUR		-62.882.197,79	-120,48
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften	EUR		2.172.871,21	4,16

Jahresbericht Aquantum Active Range Institutional (I)

V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	EUR	1.927.465,52	3,69
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne	EUR	746.085,02	1,43
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste	EUR	-1.011.873,53	-1,94
VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	EUR	-265.788,51	-0,51
VII. Ergebnis des Geschäftsjahres	EUR	1.661.677,01	3,18

Entwicklung des Sondervermögens

2022/2023

I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres	EUR		21.100.674,20
1. Ausschüttung für das Vorjahr/Steuerabschlag für das Vorjahr	EUR		0,00
2. Zwischenausschüttungen	EUR		0,00
3. Mittelzufluss/-abfluss (netto)	EUR		39.723.895,70
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	EUR	63.326.916,80	
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	EUR	-23.603.021,10	
4. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich	EUR		-1.497.189,35
5. Ergebnis des Geschäftsjahres	EUR		1.661.677,01
davon nicht realisierte Gewinne	EUR	746.085,02	
davon nicht realisierte Verluste	EUR	-1.011.873,53	
II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres	EUR		60.989.057,56

Verwendung der Erträge des Sondervermögens Berechnung der Wiederanlage insgesamt und je Anteil

		insgesamt	je Anteil
I. Für die Wiederanlage verfügbar			
1. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	EUR	1.927.465,52	3,69
2. Zuführung aus dem Sondervermögen	EUR	0,00	0,00
3. Steuerabschlag für das Geschäftsjahr	EUR	0,00	0,00
II. Wiederanlage	EUR	1.927.465,52	3,69

Jahresbericht Aquantum Active Range Institutional (I)

Vergleichende Übersicht seit Auflegung

Geschäftsjahr	Umlaufende Anteile am Ende des Geschäftsjahres		Fondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres		Anteilwert am Ende des Geschäftsjahres	
2021/2022 *)	Stück	185.639	EUR	21.100.674,20	EUR	113,67
2022/2023	Stück	521.939	EUR	60.989.057,56	EUR	116,85

*) Auflegedatum 01.07.2021

Jahresbericht

Aquantum Active Range Retail (R)

Ertrags- und Aufwandsrechnung (inkl. Ertragsausgleich) für den Zeitraum vom 01.07.2022 bis 30.06.2023

			insgesamt	je Anteil
I. Erträge				
1. Dividenden inländischer Aussteller (vor Körperschaft-/Kapitalertragsteuer)	EUR		0,00	0,00
2. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer)	EUR		0,00	0,00
3. Zinsen aus inländischen Wertpapieren	EUR		2.826,43	0,01
4. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer)	EUR		0,00	0,00
5. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland	EUR		493.484,60	1,79
6. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Ausland (vor Quellensteuer)	EUR		0,00	0,00
7. Erträge aus Investmentanteilen	EUR		0,00	0,00
8. Erträge aus Wertpapier- Darlehen- und -Pensionsgeschäften	EUR		0,00	0,00
9. Abzug inländischer Körperschaft-/Kapitalertragsteuer	EUR		0,00	0,00
10. Abzug ausländischer Quellensteuer	EUR		0,00	0,00
11. Sonstige Erträge	EUR		0,00	0,00
Summe der Erträge	EUR		496.311,03	1,80
II. Aufwendungen				
1. Zinsen aus Kreditaufnahmen	EUR		9.004,84	0,03
2. Verwaltungsvergütung	EUR		-670.991,70	-2,43
- Verwaltungsvergütung	EUR	-311.811,14		
- Beratungsvergütung	EUR	0,00		
- Asset Management Gebühr	EUR	-359.180,56		
3. Verwahrstellenvergütung	EUR		-34.931,46	-0,13
4. Prüfungs- und Veröffentlichungskosten	EUR		-673,82	0,00
5. Sonstige Aufwendungen	EUR		-203.271,07	-0,74
- Depotgebühren	EUR	-116,64		
- Ausgleich ordentlicher Aufwand	EUR	-183.545,54		
- Sonstige Kosten	EUR	-19.608,89		
- davon Aufwendungen aus negativen Habenzinsen	EUR	-3.370,22		
Summe der Aufwendungen	EUR		-900.863,22	-3,27
III. Ordentliches Nettoergebnis	EUR		-404.552,19	-1,47
IV. Veräußerungsgeschäfte				
1. Realisierte Gewinne	EUR		34.260.067,03	124,20
2. Realisierte Verluste	EUR		-33.115.362,37	-120,05
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften	EUR		1.144.704,66	4,15

Jahresbericht Aquantum Active Range Retail (R)

V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	EUR	740.152,47	2,68
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne	EUR	1.033.198,37	3,75
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste	EUR	-1.026.925,17	-3,72
VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	EUR	6.273,20	0,03
VII. Ergebnis des Geschäftsjahres	EUR	746.425,67	2,71

Entwicklung des Sondervermögens

2022/2023

I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres	EUR		9.689.864,90
1. Ausschüttung für das Vorjahr/Steuerabschlag für das Vorjahr	EUR		0,00
2. Zwischenausschüttungen	EUR		0,00
3. Mittelzufluss/-abfluss (netto)	EUR		21.862.156,52
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	EUR	35.938.774,81	
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	EUR	-14.076.618,29	
4. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich	EUR		-517.324,18
5. Ergebnis des Geschäftsjahres	EUR		746.425,67
davon nicht realisierte Gewinne	EUR	1.033.198,37	
davon nicht realisierte Verluste	EUR	-1.026.925,17	
II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres	EUR		31.781.122,92

Verwendung der Erträge des Sondervermögens Berechnung der Wiederanlage insgesamt und je Anteil

		insgesamt	je Anteil
I. Für die Wiederanlage verfügbar			
1. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	EUR	740.152,47	2,68
2. Zuführung aus dem Sondervermögen	EUR	0,00	0,00
3. Steuerabschlag für das Geschäftsjahr	EUR	0,00	0,00
II. Wiederanlage	EUR	740.152,47	2,68

Jahresbericht Aquantum Active Range Retail (R)

Vergleichende Übersicht seit Auflegung

Geschäftsjahr	Umlaufende Anteile am Ende des Geschäftsjahres		Fondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres		Anteilwert am Ende des Geschäftsjahres	
2021/2022 *)	Stück	85.737	EUR	9.689.864,90	EUR	113,02
2022/2023	Stück	275.848	EUR	31.781.122,92	EUR	115,21

*) Auflegedatum 09.07.2021

Jahresbericht

Aquantum Active Range

Ertrags- und Aufwandsrechnung (inkl. Ertragsausgleich) für den Zeitraum vom 01.07.2022 bis 30.06.2023

			insgesamt
I. Erträge			
1. Dividenden inländischer Aussteller (vor Körperschaft-/Kapitalertragsteuer)		EUR	0,00
2. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer)		EUR	0,00
3. Zinsen aus inländischen Wertpapieren		EUR	26.597,13
4. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer)		EUR	0,00
5. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland		EUR	4.649.433,27
6. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Ausland (vor Quellensteuer)		EUR	0,00
7. Erträge aus Investmentanteilen		EUR	0,00
8. Erträge aus Wertpapier- Darlehen- und -Pensionsgeschäften		EUR	0,00
9. Abzug inländischer Körperschaft-/Kapitalertragsteuer		EUR	0,00
10. Abzug ausländischer Quellensteuer		EUR	0,00
11. Sonstige Erträge		EUR	0,00
Summe der Erträge		EUR	4.676.030,40
II. Aufwendungen			
1. Zinsen aus Kreditaufnahmen		EUR	76.107,93
2. Verwaltungsvergütung		EUR	-3.327.235,19
- Verwaltungsvergütung	EUR	-1.708.004,05	
- Beratungsvergütung	EUR	0,00	
- Asset Management Gebühr	EUR	-1.619.231,14	
3. Verwahrstellenvergütung		EUR	-308.153,33
4. Prüfungs- und Veröffentlichungskosten		EUR	-7.221,37
5. Sonstige Aufwendungen		EUR	-1.583.989,15
- Depotgebühren	EUR	-914,37	
- Ausgleich ordentlicher Aufwand	EUR	-1.400.791,75	
- Sonstige Kosten	EUR	-182.283,03	
- davon Aufwendungen aus negativen Habenzinsen	EUR	-39.263,07	
Summe der Aufwendungen		EUR	-5.150.491,11
III. Ordentliches Nettoergebnis		EUR	-474.460,71
IV. Veräußerungsgeschäfte			
1. Realisierte Gewinne		EUR	322.085.722,22
2. Realisierte Verluste		EUR	-311.337.140,00
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften		EUR	10.748.582,22

Jahresbericht Aquantum Active Range

V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	EUR	10.274.121,51
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne	EUR	2.390.073,60
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste	EUR	-3.125.631,61
VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	EUR	-735.558,01
VII. Ergebnis des Geschäftsjahres	EUR	9.538.563,50

Entwicklung des Sondervermögens

		2022/2023	
I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres		EUR	161.987.290,71
1. Ausschüttung für das Vorjahr/Steuerabschlag für das Vorjahr		EUR	0,00
2. Zwischenausschüttungen		EUR	0,00
3. Mittelzufluss/-abfluss (netto)		EUR	136.300.887,95
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	EUR	204.597.977,36	
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	EUR	-68.297.089,41	
4. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich		EUR	-5.127.622,55
5. Ergebnis des Geschäftsjahres		EUR	9.538.563,50
davon nicht realisierte Gewinne	EUR	2.390.073,60	
davon nicht realisierte Verluste	EUR	-3.125.631,61	
II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres		EUR	302.699.119,60

**Jahresbericht
Aquantum Active Range**

Anteilklassenmerkmale im Überblick

Anteilklasse	Mindestanlagesumme in Währung	Ausgabeaufschlag bis zu 2,50%, derzeit (Angabe in %)	Verwaltungsvergütung bis zu 0,150% p.a., derzeit (Angabe in % p.a.)	Ertragsverwendung	Währung
Aquantum Active Range Seed (S)	10.000.000	0,00	0,125	Thesaurierer	EUR
Aquantum Active Range Institutional (I)	500.000	0,00	0,150	Thesaurierer	EUR
Aquantum Active Range Retail (R)	keine	2,50	0,150	Thesaurierer	EUR

Jahresbericht

Aquantum Active Range

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben nach der Derivateverordnung

das durch Derivate erzielte zugrundeliegende Exposure EUR 379.775.852,30

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %) 0,00
 Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %) -0,01

Bei der Ermittlung der Auslastung der Marktrisikoobergrenze für diesen Fonds wendet die Gesellschaft seit 01.07.2021 den qualifizierten Ansatz im Sinne der Derivate-Verordnung anhand eines Vergleichsvermögens an. Die Value-at-Risk-Kennzahlen wurden auf Basis der Methode der historischen Simulation mit den Parametern 99 % Konfidenzniveau und 1 Tag Haltedauer unter Verwendung eines effektiven, historischen Beobachtungszeitraums von einem Jahr berechnet. Unter dem Marktrisiko versteht man das Risiko, das sich aus der ungünstigen Entwicklung von Marktpreisen für das Sondervermögen ergibt.

Potenzieller Risikobetrag für das Marktrisiko gem. § 37 Abs. 4 DerivateV

kleinster potenzieller Risikobetrag 0,06 %
 größter potenzieller Risikobetrag 3,76 %
 durchschnittlicher potenzieller Risikobetrag 0,57 %

Im Geschäftsjahr erreichte durchschnittliche Hebelwirkung durch Derivategeschäfte: 2,07

Zusammensetzung des Vergleichsvermögens zum Berichtsstichtag

Bloomberg Global Aggregate Total Return (USD) (Bloomberg: I03351US INDEX) 10,00 %
 S&P 500 Price Return (USD) in EUR (Bloomberg: SPX INDEX) in EUR 80,00 %
 VSTOXX Short-Term Futures Inverse Investable ER (EUR) (Bloomberg: VST1MISE INDEX) 10,00 %

Sonstige Angaben

Aquantum Active Range Seed (S)

Anteilwert EUR 117,74
 Ausgabepreis EUR 117,74
 Rücknahmepreis EUR 117,74
 Anzahl Anteile STK 1.783.019

Jahresbericht

Aquantum Active Range

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Aquantum Active Range Institutional (I)

Anteilwert	EUR	116,85
Ausgabepreis	EUR	116,85
Rücknahmepreis	EUR	116,85
Anzahl Anteile	STK	521.939

Aquantum Active Range Retail (R)

Anteilwert	EUR	115,21
Ausgabepreis	EUR	118,09
Rücknahmepreis	EUR	115,21
Anzahl Anteile	STK	275.848

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.

Jahresbericht

Aquantum Active Range

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben zur Transparenz sowie zur Gesamtkostenquote

Gesamtkostenquote

Aquantum Active Range Seed (S)

Die Gesamtkostenquote (ohne Transaktionskosten) für das abgelaufene Geschäftsjahr beträgt

0,80 %

Die Gesamtkostenquote drückt sämtliche vom Sondervermögen im Jahresverlauf getragenen Kosten und Zahlungen (ohne Transaktionskosten) im Verhältnis zum durchschnittlichen Nettoinventarwert des Sondervermögens aus.

Erfolgsabhängige Vergütung in % des durchschnittlichen Nettoinventarwertes

0,56 %

Aquantum Active Range Institutional (I)

Die Gesamtkostenquote (ohne Transaktionskosten) für das abgelaufene Geschäftsjahr beträgt

1,29 %

Die Gesamtkostenquote drückt sämtliche vom Sondervermögen im Jahresverlauf getragenen Kosten und Zahlungen (ohne Transaktionskosten) im Verhältnis zum durchschnittlichen Nettoinventarwert des Sondervermögens aus.

Erfolgsabhängige Vergütung in % des durchschnittlichen Nettoinventarwertes

0,48 %

Aquantum Active Range Retail (R)

Die Gesamtkostenquote (ohne Transaktionskosten) für das abgelaufene Geschäftsjahr beträgt

1,66 %

Die Gesamtkostenquote drückt sämtliche vom Sondervermögen im Jahresverlauf getragenen Kosten und Zahlungen (ohne Transaktionskosten) im Verhältnis zum durchschnittlichen Nettoinventarwert des Sondervermögens aus.

Erfolgsabhängige Vergütung in % des durchschnittlichen Nettoinventarwertes

1,07 %

An die Verwaltungsgesellschaft oder Dritte gezahlte Pauschalvergütungen

EUR

0,00

Hinweis gem. § 101 Abs. 2 Nr. 3 KAGB (Kostentransparenz)

Die Gesellschaft erhält aus dem Sondervermögen die ihr zustehende Verwaltungsvergütung. Ein wesentlicher Teil der Verwaltungsvergütung wird für Vergütungen an Vermittler von Anteilen des Sondervermögens verwendet. Der Gesellschaft fließen keine Rückvergütungen von den an die Verwahrstelle und an Dritte aus dem Sondervermögen geleisteten Vergütungen und Aufwendererstattungen zu. Sie hat im Zusammenhang mit Handelsgeschäften für das Sondervermögen keine geldwerten Vorteile von Handelspartnern erhalten.

Jahresbericht Aquantum Active Range

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Wesentliche sonstige Erträge und sonstige Aufwendungen

Aquantum Active Range Seed (S)

Wesentliche sonstige Erträge: EUR 0,00

Wesentliche sonstige Aufwendungen: EUR 0,00

Aquantum Active Range Institutional (I)

Wesentliche sonstige Erträge: EUR 0,00

Wesentliche sonstige Aufwendungen: EUR 0,00

Aquantum Active Range Retail (R)

Wesentliche sonstige Erträge: EUR 0,00

Wesentliche sonstige Aufwendungen: EUR 0,00

Transaktionskosten (Summe der Nebenkosten des Erwerbs (Anschaffungsnebenkosten) und der Kosten der Veräußerung der Vermögensgegenstände)

Transaktionskosten EUR 1.922.001,45

Die Transaktionskosten berücksichtigen sämtliche Kosten, die im Geschäftsjahr für Rechnung des Fonds separat ausgewiesen bzw. abgerechnet wurden und in direktem Zusammenhang mit einem Kauf oder Verkauf von Vermögensgegenständen stehen.

Jahresbericht

Aquantum Active Range

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben zur Mitarbeitervergütung

Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr der KVG gezahlten Mitarbeitervergütung	in Mio. EUR	72,9
davon feste Vergütung	in Mio. EUR	64,8
davon variable Vergütung	in Mio. EUR	8,1
Zahl der Mitarbeiter der KVG		902
Höhe des gezahlten Carried Interest	in EUR	0
Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr der KVG gezahlten Vergütung an Risktaker	in Mio. EUR	5,7
davon Geschäftsleiter	in Mio. EUR	4,6
davon andere Risktaker	in Mio. EUR	1,1

Vergütungssystem der Kapitalverwaltungsgesellschaft

Die Universal-Investment-Gesellschaft mbH unterliegt den für Kapitalverwaltungsgesellschaften geltenden aufsichtsrechtlichen Vorgaben im Hinblick auf die Gestaltung ihres Vergütungssystems. Die detaillierte Ausgestaltung hat die Gesellschaft in einer Vergütungsrichtlinie geregelt, deren Ziel es ist, eine nachhaltige Vergütungssystematik unter Berücksichtigung von Sustainable Corporate Governance und unter Vermeidung von Fehlanreizen zur Eingehung übermäßiger Risiken (einschließlich einschlägiger Nachhaltigkeitsrisiken) sicherzustellen.

Das Vergütungssystem der Kapitalverwaltungsgesellschaft wird mindestens einmal jährlich durch den Vergütungsausschuss der Universal-Investment auf seine Angemessenheit und die Einhaltung aller rechtlichen sowie interner und externer regulatorischer Vorgaben überprüft. Es umfasst fixe und variable Vergütungselemente. Durch die Festlegung von Bandbreiten für die Gesamtzielvergütung ist gewährleistet, dass keine signifikante Abhängigkeit von der variablen Vergütung sowie ein angemessenes Verhältnis von variabler zu fixer Vergütung besteht. Für die Geschäftsführung der Kapitalverwaltungsgesellschaft und Mitarbeiter, deren Tätigkeiten einen wesentlichen Einfluss auf das Gesamtrisikoprofil der Kapitalverwaltungsgesellschaft und der von ihr verwalteten Investmentvermögen haben (Risk Taker) gelten besondere Regelungen. Risikorelevante Mitarbeiter, deren variable Vergütung für das jeweilige Geschäftsjahr einen Schwellenwert von 50 TEUR nicht überschreitet, erhalten die variable Vergütung vollständig in Form einer Barleistung ausgezahlt. Wird für risikorelevante Mitarbeiter dieser Schwellenwert überschritten, wird zwingend ein Anteil von 40 % der variablen Vergütung über einen Zeitraum von drei Jahren aufgeschoben. Der aufgeschobene Anteil der Vergütung ist während dieses Zeitraums risikoabhängig, d.h. er kann im Fall von negativen Erfolgsbeiträgen des Mitarbeiters oder der Kapitalverwaltungsgesellschaft insgesamt gekürzt werden. Jeweils am Ende jedes Jahres der Wartezeit wird der aufgeschobene Vergütungsanteil anteilig unverfallbar und zum jeweiligen Zahlungstermin ausgezahlt.

Soweit das Portfolio-Management ausgelagert ist, werden keine Mitarbeitervergütungen direkt aus dem Fonds gezahlt.

Jahresbericht

Aquantum Active Range

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben gemäß § 101 Abs. 2 Nr. 5 KAGB

Wesentliche mittel- bis langfristigen Risiken

Die Angaben der wesentlichen mittel- bis langfristigen Risiken erfolgt innerhalb des Tätigkeitsberichts.

Zusammensetzung des Portfolios, die Portfolioumsätze und die Portfolioumsatzkosten

Die Angaben zu der Zusammensetzung des Portfolios erfolgen innerhalb der Vermögensaufstellung.

Die Angaben zu den Portfolioumsätzen erfolgen innerhalb der Vermögensaufstellung und innerhalb der Aufstellung der während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte.

Die Angabe zu den Transaktionskosten erfolgt im Anhang.

Berücksichtigung der mittel- bis langfristigen Entwicklung der Gesellschaft bei der Anlageentscheidung

Die Auswahl von Einzeltiteln richtet sich nach der Anlagestrategie. Die vertraglichen Grundlagen für die Anlageentscheidung finden sich in den vereinbarten Anlagebedingungen und ggf. Anlagerichtlinien. Eine Berücksichtigung der mittel- bis langfristigen Entwicklung der Portfoliogesellschaften erfolgt, wenn diese in den Vertragsbedingungen vorgeschrieben ist.

Einsatz von Stimmrechtsberatern

Zum Einsatz von Stimmrechtsberatern verweisen wir auf den neuen Mitwirkungsbericht auf der Homepage <https://www.universal-investment.com/de/permanent-seiten/compliance/mitwirkungspolitik>.

Handhabung der Wertpapierleihe und zum Umgang mit Interessenkonflikten im Rahmen der Mitwirkung in den Gesellschaften, insbesondere durch Ausübung von Aktionärsrechten

Zur grundsätzlichen Handhabung der Wertpapierleihe und zum Umgang mit Interessenkonflikten im Rahmen der Mitwirkung der Gesellschaft, insbesondere durch die Ausübung von Aktionärsrechten, verweisen wir auf unsere aktuelle Mitwirkungspolitik auf der Homepage <https://www.universal-investment.com/de/permanent-seiten/compliance/mitwirkungspolitik>.

Jahresbericht Aquantum Active Range

Angaben zu nichtfinanziellen Leistungsindikatoren

Konventionelles Produkt Artikel 6 der Verordnung (EU) 2019/2088 (Offenlegungs-Verordnung)

Die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (Principal Adverse Impacts PAI) werden im Investitionsprozess auf Gesellschaftsebene berücksichtigt. Eine Berücksichtigung der PAI auf Ebene des Fonds ist nicht verbindlich und erfolgt insoweit nicht.

Dieser Fonds wird weder als ein Produkt eingestuft, das ökologische oder soziale Merkmale im Sinne der Offenlegungs-Verordnung (Artikel 8) bewirbt, noch als ein Produkt, das nachhaltige Investitionen zum Ziel hat (Artikel 9). Die diesem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Frankfurt am Main, den 3. Juli 2023

Universal-Investment-Gesellschaft mbH
Die Geschäftsführung

Jahresbericht

Aquantum Active Range

VERMERK DES UNABHÄNGIGEN ABSCHLUSSPRÜFERS

An die Universal-Investment-Gesellschaft mbH, Frankfurt am Main

Prüfungsurteil

Wir haben den Jahresbericht des Sondervermögens Aquantum Active Range - bestehend aus dem Tätigkeitsbericht für das Geschäftsjahr vom 1. Juli 2022 bis zum 30. Juni 2023, der Vermögensübersicht und der Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2023, der Ertrags- und Aufwandsrechnung, der Verwendungsrechnung, der Entwicklungsrechnung für das Geschäftsjahr vom 1. Juli 2022 bis zum 30. Juni 2023 sowie der vergleichenden Übersicht über die letzten drei Geschäftsjahre, der Aufstellung der während des Berichtszeitraumes abgeschlossenen Geschäfte, soweit diese nicht mehr Gegenstand der Vermögensaufstellung sind, und dem Anhang - geprüft.

Nach unserer Beurteilung aufgrund der bei der Prüfung gewonnenen Erkenntnisse entspricht der beigefügte Jahresbericht in allen wesentlichen Belangen den Vorschriften des deutschen Kapitalanlagegesetzbuchs (KAGB) und den einschlägigen europäischen Verordnungen und ermöglicht es unter Beachtung dieser Vorschriften, sich ein umfassendes Bild der tatsächlichen Verhältnisse und Entwicklungen des Sondervermögens zu verschaffen.

Grundlage für das Prüfungsurteil

Wir haben unsere Prüfung des Jahresberichts in Übereinstimmung mit § 102 KAGB unter Beachtung der vom Institut der Wirtschaftsprüfer (IDW) festgestellten deutschen Grundsätze ordnungsmäßiger Abschlussprüfung durchgeführt. Unsere Verantwortung nach diesen Vorschriften und Grundsätzen ist im Abschnitt "Verantwortung des Abschlussprüfers für die Prüfung des Jahresberichts" unseres Vermerks weitergehend beschrieben. Wir sind von der Universal-Investment-Gesellschaft mbH unabhängig in Übereinstimmung mit den deutschen handelsrechtlichen und berufsrechtlichen Vorschriften und haben unsere sonstigen deutschen Berufspflichten in Übereinstimmung mit diesen Anforderungen erfüllt. Wir sind der Auffassung, dass die von uns erlangten Prüfungsnachweise ausreichend und geeignet sind, um als Grundlage für unser Prüfungsurteil zum Jahresbericht zu dienen.

Verantwortung der gesetzlichen Vertreter für den Jahresbericht

Die gesetzlichen Vertreter der Universal-Investment-Gesellschaft mbH sind verantwortlich für die Aufstellung des Jahresberichts, der den Vorschriften des deutschen KAGB und den einschlägigen europäischen Verordnungen in allen wesentlichen Belangen entspricht und dafür, dass der Jahresbericht es unter Beachtung dieser Vorschriften ermöglicht, sich ein umfassendes Bild der tatsächlichen Verhältnisse und Entwicklungen des Sondervermögens zu verschaffen. Ferner sind die gesetzlichen Vertreter verantwortlich für die internen Kontrollen, die sie in Übereinstimmung mit diesen Vorschriften als notwendig bestimmt haben, um die Aufstellung eines Jahresberichts zu ermöglichen, der frei von wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen (d.h. Manipulationen der Rechnungslegung und Vermögensschädigungen) oder Irrtümern ist.

Bei der Aufstellung des Jahresberichts sind die gesetzlichen Vertreter dafür verantwortlich, Ereignisse, Entscheidungen und Faktoren, welche die weitere Entwicklung des Sondervermögens wesentlich beeinflussen können, in die Berichterstattung einzubeziehen. Das bedeutet u.a., dass die gesetzlichen Vertreter bei der Aufstellung des Jahresberichts die Fortführung des Sondervermögens durch die Universal-Investment-Gesellschaft mbH zu beurteilen haben und die Verantwortung haben, Sachverhalte im Zusammenhang mit der Fortführung des Sondervermögens, sofern einschlägig, anzugeben.

Verantwortung des Abschlussprüfers für die Prüfung des Jahresberichts

Unsere Zielsetzung ist, hinreichende Sicherheit darüber zu erlangen, ob der Jahresbericht als Ganzes frei von wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern ist, sowie einen Vermerk zu erteilen, der unser Prüfungsurteil zum Jahresbericht beinhaltet.

Jahresbericht Aquantum Active Range

Hinreichende Sicherheit ist ein hohes Maß an Sicherheit, aber keine Garantie dafür, dass eine in Übereinstimmung mit § 102 KAGB unter Beachtung der vom Institut der Wirtschaftsprüfer (IDW) festgestellten deutschen Grundsätze ordnungsmäßiger Abschlussprüfung durchgeführte Prüfung eine wesentliche falsche Darstellung stets aufdeckt. Falsche Darstellungen können aus dolosen Handlungen oder Irrtümern resultieren und werden als wesentlich angesehen, wenn vernünftigerweise erwartet werden könnte, dass sie einzeln oder insgesamt die auf der Grundlage dieses Jahresberichts getroffenen wirtschaftlichen Entscheidungen von Adressaten beeinflussen.

Während der Prüfung üben wir pflichtgemäßes Ermessen aus und bewahren eine kritische Grundhaltung. Darüber hinaus

- identifizieren und beurteilen wir die Risiken wesentlicher falscher Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern im Jahresbericht, planen und führen Prüfungshandlungen als Reaktion auf diese Risiken durch sowie erlangen Prüfungsnachweise, die ausreichend und geeignet sind, um als Grundlage für unser Prüfungsurteil zu dienen. Das Risiko, dass aus dolosen Handlungen resultierende wesentliche falsche Darstellungen nicht aufgedeckt werden, ist höher als das Risiko, dass aus Irrtümern resultierende wesentliche falsche Darstellungen nicht aufgedeckt werden, da dolose Handlungen kollusives Zusammenwirken, Fälschungen, beabsichtigte Unvollständigkeiten, irreführende Darstellungen bzw. das Außerkraftsetzen interner Kontrollen beinhalten können.
- gewinnen wir ein Verständnis von dem für die Prüfung des Jahresberichts relevanten internen Kontrollsystem, um Prüfungshandlungen zu planen, die unter den gegebenen Umständen angemessen sind, jedoch nicht mit dem Ziel, ein Prüfungsurteil zur Wirksamkeit dieses Systems der Universal-Investment-Gesellschaft mbH abzugeben.
- beurteilen wir die Angemessenheit der von den gesetzlichen Vertretern der Universal-Investment-Gesellschaft mbH bei der Aufstellung des Jahresberichts angewandten Rechnungslegungsmethoden sowie die Vertretbarkeit der von den gesetzlichen Vertretern dargestellten geschätzten Werte und damit zusammenhängenden Angaben.
- ziehen wir Schlussfolgerungen auf der Grundlage erlangter Prüfungsnachweise, ob eine wesentliche Unsicherheit im Zusammenhang mit Ereignissen oder Gegebenheiten besteht, die bedeutsame Zweifel an der Fortführung des Sondervermögens durch die Universal-Investment-Gesellschaft mbH aufwerfen können. Falls wir zu dem Schluss kommen, dass eine wesentliche Unsicherheit besteht, sind wir verpflichtet, im Vermerk auf die dazugehörigen Angaben im Jahresbericht aufmerksam zu machen oder, falls diese Angaben unangemessen sind, unser Prüfungsurteil zu modifizieren. Wir ziehen unsere Schlussfolgerungen auf der Grundlage der bis zum Datum unseres Vermerks erlangten Prüfungsnachweise. Zukünftige Ereignisse oder Gegebenheiten können jedoch dazu führen, dass das Sondervermögen durch die Universal-Investment-Gesellschaft mbH nicht fortgeführt wird.
- beurteilen wir Darstellung, Aufbau und Inhalt des Jahresberichts insgesamt, einschließlich der Angaben sowie ob der Jahresbericht die zugrunde liegenden Geschäftsvorfälle und Ereignisse so darstellt, dass der Jahresbericht es unter Beachtung der Vorschriften des deutschen KAGB und der einschlägigen europäischen Verordnungen ermöglicht, sich ein umfassendes Bild der tatsächlichen Verhältnisse und Entwicklungen des Sondervermögens zu verschaffen.

Wir erörtern mit den für die Überwachung Verantwortlichen u.a. den geplanten Umfang und die Zeitplanung der Prüfung sowie bedeutsame Prüfungsfeststellungen, einschließlich etwaiger bedeutsamer Mängel im internen Kontrollsystem, die wir während unserer Prüfung feststellen.

Frankfurt am Main, den 11. Oktober 2023

Deloitte GmbH
Wirtschaftsprüfungsgesellschaft

René Rumpelt
Wirtschaftsprüfer

Abelardo Rodríguez González
Wirtschaftsprüfer

Jahresbericht

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

Jahresbericht

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:

Frank Eggloff, München
Mathias Heiß, Langen
Katja Müller, Bad Homburg v. d. Höhe
Markus Neubauer, Frankfurt am Main
Axel Vespermann, Dreieich

Aufsichtsrat:

Prof. Dr. Harald Wiedmann (Vorsitzender), Berlin
Dr. Axel Eckhardt, Düsseldorf
Ellen Engelhardt
Daniel Fischer, Bad Vilbel
Janet Zirlewagen

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