

Plenum Insurance Capital Fund

OGAW nach liechtensteinischem Recht
in der Rechtsform der Kollektivtreuhänderschaft

Ungeprüfter Halbjahresbericht

30.06.2022

CAIAC Fund Management AG

Haus Atzig
Industriestrasse 2
FL-9487 Bendern
Tel. +423 375 83 33
Fax. +423 375 83 38
www.caiac.li
info@caiac.li

Allgemeine Informationen

Organisation

Verwaltungsgesellschaft	CAIAC Fund Management AG Haus Atzig Industriestrasse 2 FL-9487 Bendern
Asset Manager / Vermögensverwalter	Plenum Investments AG Brandschenkestrasse 41 CH-8002 Zürich
Verwahrstelle / Depotbank	Liechtensteinische Landesbank AG Städtle 44 FL-9490 Vaduz
Führung des Anteilsregisters	Liechtensteinische Landesbank AG Städtle 44 FL-9490 Vaduz
Wirtschaftsprüfer / Revisionsstelle	Deloitte (Liechtenstein) AG Kirchstrasse 3 FL-9490 Vaduz
Vertreter	Schweiz: ACOLIN Fund Services AG Leutschenbachstrasse 50 CH-8050 Zürich
Zahlstelle	Schweiz: Frankfurter Bankgesellschaft (Schweiz) AG Börsenstrasse 16 CH-8001 Zürich
Zahl- und Informationsstelle	Deutschland: DZ Bank AG Frankfurt Platz der Republik 60 DE-60265 Frankfurt
Bewertungsintervall	Wöchentlich
Bewertungstag	Freitag
Bewertungsfrist	Vor dem nächsten Bewertungstag
Ausgabe- und Rücknahmetag	Jeder Bewertungstag
Annahmeschluss Anteilsgeschäft Rücknahme	5 Werktage vor dem Bewertungstag um spätestens 16.00h (MEZ) - alle R, I, I2, RD, ID2 und ID Classen 10 Werktage vor dem Bewertungstag um spätestens 16.00h (MEZ) - alle P und S Classen sowie PD EUR
Annahmeschluss Anteilsgeschäft	3 Werktage vor dem Bewertungstag um spätestens 16.00h (MEZ)
Valuta Ausgabe- und Rücknahmetag	drei Bankgeschäftstage nach Berechnung des Nettoinventarwertes/NAV
Rechnungswährung	USD
Erfolgsverwendung	THES & AUS – je nach Anteilsklasse
Abschluss Rechnungsjahr	31. Dezember
Fondsdomizil	Bendern, Liechtenstein
Fondstyp	OGAW (UCITS V)
Rechtsform	Kollektivtreuhänderschaft
Rechtsgrundlage	Gesetz vom 28. Juni 2011 über bestimmte Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren (UCITSG)
Publikationsorgan	Web-Seite des LAFV Liechtensteinischer Anlagefondsverband www.lafv.li

Fondsdaten

ISIN	LI0542471078 Class I2 CHF LI0542471060 Class I2 EUR LI0542471052 Class I2 USD LI0542471029 Class I CHF LI0542471219 Class ID EUR LI0542471011 Class I EUR LI0542471003 Class I USD LI1175513228 Class P2 CHF LI0542471110 Class P EUR LI0542471102 Class P USD LI0542471177 Class S CHF LI0542471151 Class S USD
Verwahrstellen- / Depotbankgebühr	Max. 0.10% p.a. oder Minimum CHF 50'000.- p.a. zzgl. pro Anteilsklasse CHF 500.- p.a. zzgl. CHF 500.- pro Ausschüttung je ausschüttende Anteilsklasse zzgl. Service Fee CHF 420.- pro Quartal
Verwaltungs- / Administrationsgebühr	Max. bis zu einem Nettofondsvermögen von CHF 50 Mio. oder Gegenwert: 0.20% p.a. Für das übersteigende Nettofondsvermögen von CHF 50 - 100 Mio. oder Gegenwert: 0.15% p.a. Für das übersteigende Nettofondsvermögen von CHF 100 – 150 Mio. oder Gegenwert: 0.10% p.a. Für das übersteigende Nettofondsvermögen von CHF 150 Mio. oder Gegenwert: 0.05% p.a. zzgl. Maximum CHF 100'000.- p.a. zzgl. CHF 1'000.- p.a. / Anteilklasse (thesaurierend) zzgl. CHF 2'500.- p.a. / Anteilklasse (ausschüttend)
Vertriebsstellen /-gebühr	Keine
Vermögensverwaltungsvergütung	Max. Class R USD, Class R EUR, Class R CHF, Class R GBP, Class R JPY & RD EUR: 1.20% Max. Class I USD, Class I EUR, Class I CHF, Class I GBP, Class I JPY & ID EUR: 0.70% Max. Class I2 USD, Class I2 EUR, Class I2 CHF, Class I2 GBP, Class I2 JPY & ID2 EUR: 0.60% Max. Class P USD, Class P EUR, Class P2 CHF, Class P GBP, Class P JPY & PD EUR: 0.55% Max. Class S USD, Class S CHF: 0.30% Max. Class P2D GBP: bis zu einem Nettofondsvermögen von USD 800 Mio. oder Gegenwert: 0.00% p.a. Sobald das Nettofondsvermögen USD 800 Mio. oder Gegenwert erstmalig erreicht wurde: 0.55% p.a.
Performance Fee	Keine
Ausgabeaufschlag /-kommission	Max. 5% zugunsten Vertrieb
Rücknahmegebühr /-kommission	Keine

Vermögensrechnung

per 30.06.2022

USD

Bankguthaben, davon	5'851'318.48
Sichtguthaben	5'851'318.48
Zeitguthaben	0.00
Wertpapiere	288'496'981.76
Immobilien	0.00
Derivative Finanzinstrumente	-3'539'008.25
Rohstoffe und (Edel-)Metalle	0.00
Sonstige Vermögenswerte, davon	3'306'698.63
Zinsen / Dividenden	3'266'173.63
Gesamtvermögen	294'115'990.62
Verbindlichkeiten, davon	-305'216.31
gegenüber Banken	-87'611.64
Darlehen	0.00
Verwahrstellen- / Depotbankgebühren	-36'077.34
Verwaltungs- / Administrationsgebühren	-49'786.90
Vermögensverwaltungsgebühren	-118'668.78
Wertentwicklungsabhängige Gebühren	0.00
Revisionskosten	-3'925.00
Nettovermögen	293'810'774.31
Class I2 CHF	53'582'086.97
Class I2 EUR	33'746'200.36
Class I2 USD	18'071'032.17
Class I CHF	22'997'191.46
Class ID EUR	975'907.27
Class I EUR	18'155'328.21
Class I USD	17'355'188.30
Class P2 CHF (Start: 17.06.2022)	9'060'433.35
Class P EUR	28'904'253.04
Class P USD	18'219'713.63
Class S CHF	17'092'301.37
Class S USD	55'651'138.16
Anzahl der Anteile im Umlauf	
Class I2 CHF	514'433.578
Class I2 EUR	330'866.890
Class I2 USD	181'283.878
Class I CHF	218'025.012
Class ID EUR	10'000.000
Class I EUR	170'472.278
Class I USD	162'297.035
Class P2 CHF (Start: 17.06.2022)	86'690.448
Class P EUR	270'710.000
Class P USD	188'325.769
Class S CHF	155'192.970
Class S USD	516'259.266
Nettoinventarwert pro Anteil	
Class I2 CHF	CHF 99.45

Vermögensrechnung

per 30.06.2022

	USD
Class I2 EUR	EUR 96.73
Class I2 USD	USD 99.68
Class I CHF	CHF 100.72
Class ID EUR	EUR 92.55
Class I EUR	EUR 101.00
Class I USD	USD 106.93
Class P2 CHF (Start: 17.06.2022)	CHF 99.80
Class P EUR	EUR 101.26
Class P USD	USD 96.75
Class S CHF	CHF 105.16
Class S USD	USD 107.80

Erfolgsrechnung

01.01.2022 - 30.06.2022

	USD
Erträge der Bankguthaben	3.20
Erträge der Geldmarktinstrumente	0.00
Erträge der Wertpapiere, davon	2'556'966.85
Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen	2'556'966.85
Aktien und sonstige Beteiligungspapiere einschliesslich Erträge Gratisaktien	0.00
Anteile anderer Investmentunternehmen	0.00
Sonstige Erträge	0.00
Einkauf in laufende Erträge bei der Ausgabe von Anteilen	124'660.99
Total Erträge	2'681'631.04
Passivzinsen	-239.97
Revisionsaufwand	-9'109.59
Reglementarische Vergütung an die Verwaltung	-830'547.66
Reglementarische Vergütung an die Verwahrstelle / Depotbank	-69'074.76
Sonstige Aufwendungen, davon	-63'004.41
Reise- / Werbekosten	-14'383.58
Ausrichtung laufender Erträge bei der Rücknahme von Anteilen	-26'126.89
Total Aufwendungen	-998'103.28
Nettoertrag	1'683'527.76
Realisierte Kapitalgewinne und Kapitalverluste	3'295'888.34
Realisierter Erfolg	4'979'416.10
Nicht realisierte Kapitalgewinne und Kapitalverluste	-31'138'521.88
Gesamterfolg	-26'159'105.78

Ausserbilanzgeschäfte

per 30.06.2022

Bezeichnung	Währung	Anzahl	Bezugsverhältnis	Delta	Marktwert Underlying	Derivate-risiko	in % vom Gesamtvermögen
10YNTS.FUT.SEP22	USD	-39.00	0.00	1.0000	132.91	-5'183'343.75	-1.7623%
ICE Futures EU/F 202209 R	GBP	-26.00	0.00	1.0000	115.80	-3'700'239.62	-1.2581%

Im Berichtszeitraum wurden keine Wertpapiere ausgeliehen.

Devisentermingeschäfte werden im Vermögensinventar ausgewiesen.

Methode für die Berechnung des Gesamtrisikos

Die unter "Ausserbilanzgeschäfte" ausgewiesenen Werte werden gem. Commitment-Ansatz berechnet.

Verwendung des Erfolgs

USD

Nettoertrag des Rechnungsjahres	1'683'527.76
Zur Ausschüttung bestimmte Kapitalgewinne des Rechnungsjahres	14'773.05
Zur Ausschüttung bestimmte Kapitalgewinne früherer Rechnungsjahre	0.00
Vortrag des Vorjahres	0.00
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	1'683'527.76
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg	-22'630.55
Zur Wiederanlage zurückbehaltener Erfolg	1'660'897.21
Vortrag auf neue Rechnung	0.00

Veränderung des Nettovermögens

01.01.2022 - 30.06.2022

USD

Nettovermögen zu Beginn der Berichtsperiode	273'498'241.91
Saldo aus dem Anteilsverkehr	46'471'638.19
Gesamterfolg	-26'159'105.78
Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode	293'810'774.32

Anzahl Anteile im Umlauf

01.01.2022 - 30.06.2022

Class I2 CHF

Anteile zu Beginn der Periode	392'338.283
Neu ausgegebene Anteile	126'761.552
Zurückgenommene Anteile	-4'666.257
Anteile am Ende der Periode	514'433.578

Class I2 EUR

Anteile zu Beginn der Periode	305'900.656
Neu ausgegebene Anteile	32'962.200
Zurückgenommene Anteile	-7'995.966
Anteile am Ende der Periode	330'866.890

Class I2 USD

Anteile zu Beginn der Periode	164'822.194
Neu ausgegebene Anteile	18'949.702
Zurückgenommene Anteile	-2'488.018
Anteile am Ende der Periode	181'283.878

Class I CHF

Anteile zu Beginn der Periode	183'331.984
Neu ausgegebene Anteile	40'280.028
Zurückgenommene Anteile	-5'587.000
Anteile am Ende der Periode	218'025.012

Class ID EUR

Anteile zu Beginn der Periode	10'000.000
Neu ausgegebene Anteile	0.000
Zurückgenommene Anteile	0.000
Anteile am Ende der Periode	10'000.000

Class I EUR

Anteile zu Beginn der Periode	136'184.721
Neu ausgegebene Anteile	51'669.557
Zurückgenommene Anteile	-17'382.000
Anteile am Ende der Periode	170'472.278

Class I USD

Anteile zu Beginn der Periode	135'639.690
Neu ausgegebene Anteile	32'090.893
Zurückgenommene Anteile	-5'433.548
Anteile am Ende der Periode	162'297.035

Class P2 CHF (Start: 17.06.2022)

Anteile zu Beginn der Periode	0.000
Neu ausgegebene Anteile	86'690.448
Zurückgenommene Anteile	0.000
Anteile am Ende der Periode	86'690.448

Class P EUR

Anteile zu Beginn der Periode	223'710.000
Neu ausgegebene Anteile	47'000.000
Zurückgenommene Anteile	0.000
Anteile am Ende der Periode	270'710.000

Anzahl Anteile im Umlauf

01.01.2022 - 30.06.2022

Class P USD

Anteile zu Beginn der Periode	150'000.000
Neu ausgegebene Anteile	38'325.769
Zurückgenommene Anteile	0.000
Anteile am Ende der Periode	188'325.769

Class S CHF

Anteile zu Beginn der Periode	155'692.970
Neu ausgegebene Anteile	0.000
Zurückgenommene Anteile	-500.000
Anteile am Ende der Periode	155'192.970

Class S USD

Anteile zu Beginn der Periode	516'416.873
Neu ausgegebene Anteile	0.000
Zurückgenommene Anteile	-157.607
Anteile am Ende der Periode	516'259.266

Entwicklung des Nettoinventarwertes

Datum	Nettovermögen	Anzahl Anteile	Nettoinventarwert	Performance
Class I2 CHF				
31.12.2020	10'034'735.19 CHF	100'000.000	100.35 CHF	* 0.35%
31.12.2021	41'304'938.92 CHF	392'338.283	105.28 CHF	4.91%
30.06.2022	51'162'855.74 CHF	514'433.578	99.45 CHF	* -5.54%
Class I2 EUR				
28.05.2021	2'499'999.99 EUR	25'000.000	100.00 EUR	
31.12.2021	31'314'468.68 EUR	305'900.656	102.37 EUR	* 2.37%
30.06.2022	32'003'604.20 EUR	330'866.890	96.73 EUR	* -5.51%
Class I2 USD				
19.02.2021	10'000'000.00 USD	100'000.000	100.00 USD	
31.12.2021	17'284'603.38 USD	164'822.194	104.87 USD	* 4.87%
30.06.2022	18'071'032.17 USD	181'283.878	99.68 USD	* -4.95%
Class I CHF				
31.12.2020	7'289'391.33 CHF	71'580.000	101.84 CHF	* 1.84%
31.12.2021	19'562'982.70 CHF	183'331.984	106.71 CHF	4.78%
30.06.2022	21'958'868.27 CHF	218'025.012	100.72 CHF	* -5.61%
Class ID EUR				
23.07.2021	1'000'000.00 EUR	10'000.000	100.00 EUR	
31.12.2021	1'004'517.00 EUR	10'000.000	100.45 EUR	* 0.45%
30.06.2022	925'513.08 EUR	10'000.000	92.55 EUR	* -7.86%
Class I EUR				
31.12.2020	3'376'304.57 EUR	33'153.310	101.84 EUR	* 1.84%
31.12.2021	14'561'842.24 EUR	136'184.721	106.93 EUR	5.00%
30.06.2022	17'217'818.06 EUR	170'472.278	101.00 EUR	* -5.55%
Class I USD				
31.12.2020	6'690'458.67 USD	62'953.252	106.28 USD	* 6.28%
31.12.2021	15'266'251.23 USD	135'639.690	112.55 USD	5.90%
30.06.2022	17'355'188.30 USD	162'297.035	106.93 USD	* -4.99%
Class P2 CHF (Start: 17.06.2022)				
17.06.2022	8'669'044.80 CHF	86'690.448	100.00 CHF	
30.06.2022	8'651'354.78 CHF	86'690.448	99.80 CHF	* -0.20%
Class P EUR				
31.12.2020	1'655'789.79 EUR	16'260.000	101.83 EUR	* 1.83%
31.12.2021	23'965'332.36 EUR	223'710.000	107.13 EUR	5.20%
30.06.2022	27'411'686.77 EUR	270'710.000	101.26 EUR	* -5.48%
Class P USD				
23.07.2021	15'000'000.00 USD	150'000.000	100.00 USD	
31.12.2021	15'262'834.54 USD	150'000.000	101.75 USD	* 1.75%
30.06.2022	18'219'713.63 USD	188'325.769	96.75 USD	* -4.91%
Class S CHF				
31.12.2020	16'167'641.19 CHF	152'984.970	105.68 CHF	* 5.68%
31.12.2021	17'311'134.87 CHF	155'692.970	111.19 CHF	5.21%
30.06.2022	16'320'583.96 CHF	155'192.970	105.16 CHF	* -5.42%

Entwicklung des Nettoinventarwertes

Datum	Nettovermögen	Anzahl Anteile	Nettoinventarwert	Performance
Class S USD				
31.12.2020	38'551'705.11 USD	361'985.866	106.50 USD	* 6.50%
31.12.2021	58'479'034.86 USD	516'416.873	113.24 USD	6.33%
30.06.2022	55'651'138.16 USD	516'259.266	107.80 USD	* -4.80%

* Die ausgewiesene Performance ist unterjährig.

Die historische Performance stellt keinen Indikator für die laufende oder zukünftige Performance dar. Die Performancedaten lassen die bei der Ausgabe und Rücknahme der Anteile erhobenen Kommissionen und Kosten unberücksichtigt.

Hinterlegungsstellen

Die Finanzinstrumente waren per Abschlussdatum hinterlegt bei:

Euroclear Bank S.A./N.V.
1 Boulevard du Roi Albert II
BE-1220 Brüssel

Liechtensteinische Landesbank AG
Städtle 44
FL-9490 Vaduz

SIX SIS AG (ZH)
Brandschenkestrasse 47
CH-8021 Zürich

UBS AG
Bahnhofstrasse 45
CH-8001 Zürich

Währungstabelle

per 30.06.2022

				USD
Britisches Pfund	GBP	1.00		1.2290
EURO	EUR	1.00		1.0544
Schwedische Krone	SEK	100.00		9.8726
Schweizer Franken	CHF	1.00		1.0473

Total Expense Ratio (TER)

per 30.06.2022

Class I2 CHF

TER 1: laufende ordentliche Gebühren und ausserordentliche Dispositionsgebühren ohne Performance Fee 0.77% p.a.

TER 2: laufende ordentliche Gebühren und ausserordentliche Dispositionsgebühren mit Performance Fee 0.77% p.a.

Class I2 EUR

TER 1: laufende ordentliche Gebühren und ausserordentliche Dispositionsgebühren ohne Performance Fee 0.77% p.a.

TER 2: laufende ordentliche Gebühren und ausserordentliche Dispositionsgebühren mit Performance Fee 0.77% p.a.

Class I2 USD

TER 1: laufende ordentliche Gebühren und ausserordentliche Dispositionsgebühren ohne Performance Fee 0.77% p.a.

TER 2: laufende ordentliche Gebühren und ausserordentliche Dispositionsgebühren mit Performance Fee 0.77% p.a.

Class I CHF

TER 1: laufende ordentliche Gebühren und ausserordentliche Dispositionsgebühren ohne Performance Fee 0.87% p.a.

TER 2: laufende ordentliche Gebühren und ausserordentliche Dispositionsgebühren mit Performance Fee 0.87% p.a.

Class ID EUR

TER 1: laufende ordentliche Gebühren und ausserordentliche Dispositionsgebühren ohne Performance Fee 0.87% p.a.

TER 2: laufende ordentliche Gebühren und ausserordentliche Dispositionsgebühren mit Performance Fee 0.87% p.a.

Class I EUR

TER 1: laufende ordentliche Gebühren und ausserordentliche Dispositionsgebühren ohne Performance Fee 0.87% p.a.

TER 2: laufende ordentliche Gebühren und ausserordentliche Dispositionsgebühren mit Performance Fee 0.87% p.a.

Class I USD

TER 1: laufende ordentliche Gebühren und ausserordentliche Dispositionsgebühren ohne Performance Fee 0.87% p.a.

TER 2: laufende ordentliche Gebühren und ausserordentliche Dispositionsgebühren mit Performance Fee 0.87% p.a.

Class P2 CHF (Start: 17.06.2022)

TER 1: laufende ordentliche Gebühren und ausserordentliche Dispositionsgebühren ohne Performance Fee 0.63% p.a.

TER 2: laufende ordentliche Gebühren und ausserordentliche Dispositionsgebühren mit Performance Fee 0.63% p.a.

Class P EUR

Total Expense Ratio (TER)

per 30.06.2022

TER 1: laufende ordentliche Gebühren und ausserordentliche Dispositionsgebühren ohne Performance Fee	0.72% p.a.
--	------------

TER 2: laufende ordentliche Gebühren und ausserordentliche Dispositionsgebühren mit Performance Fee	0.72% p.a.
---	------------

Class P USD

TER 1: laufende ordentliche Gebühren und ausserordentliche Dispositionsgebühren ohne Performance Fee	0.72% p.a.
--	------------

TER 2: laufende ordentliche Gebühren und ausserordentliche Dispositionsgebühren mit Performance Fee	0.72% p.a.
---	------------

Class S CHF

TER 1: laufende ordentliche Gebühren und ausserordentliche Dispositionsgebühren ohne Performance Fee	0.47% p.a.
--	------------

TER 2: laufende ordentliche Gebühren und ausserordentliche Dispositionsgebühren mit Performance Fee	0.47% p.a.
---	------------

Class S USD

TER 1: laufende ordentliche Gebühren und ausserordentliche Dispositionsgebühren ohne Performance Fee	0.47% p.a.
--	------------

TER 2: laufende ordentliche Gebühren und ausserordentliche Dispositionsgebühren mit Performance Fee	0.47% p.a.
---	------------

Kosten, welche auf Stufe der Zielfonds anfallen, werden in der TER-Berechnung nicht berücksichtigt.

Transaktionskosten

01.01.2022 - 30.06.2022

	USD
Spesen	11'870.18
Courtage	5'460.11

Die Transaktionskosten werden direkt mit dem Einstands- und Verkaufswert der betreffenden Anlagen verrechnet und sind deshalb in der TER-Berechnung nicht berücksichtigt.

Vermögensinventar per 30.06.2022

Käufe und Verkäufe 01.01.2022 - 30.06.2022

Bezeichnung	Bestand 01.01.2022	Kauf 1)	Verkauf 2)	Bestand 30.06.2022	Marktwert USD	Anteil in %
Wertpapiere						
Wertpapiere, die an einer Börse gehandelt werden						
Obligationen						
Belgien						
BE6317598850 - AGEAS FTFBN-S	3'000'000.00	600'000.00	600'000.00	3'000'000.00	2'517'994.97	0.86%
Summe Belgien					2'517'994.97	0.86%
Bermudainseln						
XS2312752400 - Lancashire Hold/Bd 20410918 JrSub	5'500'000.00	0.00	0.00	5'500'000.00	4'659'875.00	1.59%
Summe Bermudainseln					4'659'875.00	1.59%
Deutschland						
XS1485742438 - Allianz Nts 2016- open end Series 73 Reg S	2'000'000.00	0.00	0.00	2'000'000.00	1'437'200.00	0.49%
US018820AB64 - Allianz/CoCo Perp Sub 144A	0.00	1'000'000.00	0.00	1'000'000.00	750'050.00	0.26%
USX10001AB51 - Allianz/CoCo Perp Sub RegS	4'200'000.00	2'000'000.00	0.00	6'200'000.00	4'647'830.00	1.58%
DE000A289FK7 - Allianz/WrDwn Perp JrSub RegS	1'000'000.00	0.00	1'000'000.00	0.00	0.00	0.00%
XS2378468420 - Wuestenrot & Wu/Bd 20410910 Sub	1'500'000.00	0.00	0.00	1'500'000.00	1'172'732.93	0.40%
Summe Deutschland					8'007'812.93	2.73%
Frankreich						
XS0876682666 - AXA EMTN	3'400'000.00	0.00	3'400'000.00	0.00	0.00	0.00%
XS1489814340 - AXA Open EMTN-S	3'320'000.00	200'000.00	1'566'000.00	1'954'000.00	1'643'020.90	0.56%
FR0014002RQ0 - CNP Assurances/Bd Perp JrSub RegS	2'200'000.00	0.00	0.00	2'200'000.00	1'758'130.00	0.60%
FR0014003XY0 - MACIF/Bd Perp JrSub RegS	3'000'000.00	0.00	0.00	3'000'000.00	2'353'374.23	0.80%
FR0013322823 - SCOR WFM Fixed/Floating Rate	7'200'000.00	0.00	0.00	7'200'000.00	5'937'480.00	2.02%
Summe Frankreich					11'692'005.13	3.98%
Grossbritannien						
XS0177447983 - Aviva/Bd Perp Sub Unsec RegS	0.00	4'600'000.00	4'600'000.00	0.00	0.00	0.00%
XS0237631097 - Brit/Var Bd 20301209 Sub RegS	4'200'000.00	1'500'000.00	0.00	5'700'000.00	5'882'647.29	2.00%
XS2434439548 - CHESNA 32 BDS	0.00	3'700'000.00	700'000.00	3'000'000.00	3'189'041.71	1.09%
XS1728036366 - Direct Line Ins/CoCo Perp Sub RegS	5'000'000.00	600'000.00	0.00	5'600'000.00	5'463'199.54	1.86%
XS1802140894 - PHOENIX -S FTVN	0.00	1'000'000.00	0.00	1'000'000.00	1'074'627.85	0.37%
XS1243995302 - PRUDENTIAL 55 VRN	2'600'000.00	0.00	2'600'000.00	0.00	0.00	0.00%
XS1488414464 - Prudential Open 36 MTN-S	4'978'000.00	0.00	4'978'000.00	0.00	0.00	0.00%
XS1700429480 - Prudential/4.875 Bd Perp Sub	0.00	1'500'000.00	0.00	1'500'000.00	1'402'125.00	0.48%
XS1865334020 - ROTHESAY FTVB	1'824'000.00	0.00	1'824'000.00	0.00	0.00	0.00%
XS2393498204 - Rothesay Life/Bd Perp Sub RegS	500'000.00	0.00	0.00	500'000.00	471'900.99	0.16%
XS2399976195 - Rothesay Life/CoCo Perp JrSub Ser-NC6	4'000'000.00	2'800'000.00	0.00	6'800'000.00	5'735'800.00	1.95%
XS2434427709 - UTMOST GRP FTVB	0.00	2'300'000.00	0.00	2'300'000.00	2'277'310.19	0.78%
XS2384717703 - Utmost Grp/4 Bd 20311215 Sub	5'000'000.00	0.00	1'200'000.00	3'800'000.00	3'734'258.03	1.27%
Summe Grossbritannien					29'230'910.60	9.95%
Irland						

Vermögensinventar per 30.06.2022

Käufe und Verkäufe 01.01.2022 - 30.06.2022

Bezeichnung	Bestand	Kauf	Verkauf	Bestand	Marktwert	Anteil
	01.01.2022	1)	2)	30.06.2022	USD	in %
XS1508669790 - BEAZLE26NTS-S	800'000.00	0.00	0.00	800'000.00	783'440.00	0.27%
XS2010045438 - BEAZLEY 29BDS-S	3'000'000.00	0.00	0.00	3'000'000.00	2'837'250.00	0.97%
XS1385999492 - Cloverie/Bd 20460624 Sub Ser-01 Gtd RegS	0.00	2'500'000.00	0.00	2'500'000.00	2'507'000.00	0.85%
XS2416978190 - ZURICH 52 VRB	2'500'000.00	0.00	2'500'000.00	0.00	0.00	0.00%
Summe Irland					6'127'690.00	2.09%
Italien						
XS0257010206 - ASSICURAZ GENERALI 2006 VRN	2'650'000.00	0.00	2'650'000.00	0.00	0.00	0.00%
XS1140860534 - GENERALI FIN-S FTFN	0.00	3'500'000.00	0.00	3'500'000.00	3'625'989.94	1.23%
XS1078235733 - UNIPOLSAI VRN	0.00	2'000'000.00	0.00	2'000'000.00	2'073'259.59	0.71%
XS2249600771 - UnipolSai/CoCo Perp JrSub	5'300'000.00	590'000.00	0.00	5'890'000.00	5'578'770.71	1.90%
Summe Italien					11'278'020.24	3.84%
Niederlande						
XS1886478806 - AEGON -S CCVFTVN	0.00	600'000.00	0.00	600'000.00	592'938.32	0.20%
XS1418788755 - Argentum Nethld/Bd 20461001 Sub Unsec RegS	0.00	1'500'000.00	0.00	1'500'000.00	1'550'674.17	0.53%
XS1795323952 - Argentum Nethld/Bd 20480601 SrSub RegS	1'500'000.00	0.00	1'500'000.00	0.00	0.00	0.00%
XS1423777215 - Argentum Nethld/Bd 20520815 Sub RegS	4'400'000.00	0.00	0.00	4'400'000.00	4'193'420.00	1.43%
XS1700709683 - ASR CV FTVB	1'850'000.00	1'000'000.00	0.00	2'850'000.00	2'564'322.23	0.87%
XS2468390930 - Athora NL/Bd 20320831 JrSub Unsec RegS	0.00	1'300'000.00	0.00	1'300'000.00	1'330'072.69	0.45%
XS1028942354 - ATRADIUS FIN 44 VRN	0.00	1'000'000.00	0.00	1'000'000.00	1'063'360.10	0.36%
Summe Niederlande					11'294'787.51	3.84%
Österreich						
XS2199567970 - UNIQA 35 FTFB	0.00	400'000.00	0.00	400'000.00	395'692.91	0.13%
Summe Österreich					395'692.91	0.13%
Summe Obligationen					85'204'789.29	29.00%
Summe Wertpapiere, die an einer Börse gehandelt werden					85'204'789.29	29.00%
Wertpapiere, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden						
Obligationen						
Bermudainseln						
XS2423688279 - ARTEX SAC LTD. (SILVER CRANE 2021-1)	1'645'621.00	0.00	0.00	1'645'621.00	1'522'199.43	0.52%
US095538AF12 - Blue Halo Re 2022- 14.02.25 Secd Prin at Risk Cl A	0.00	950'000.00	0.00	950'000.00	936'985.00	0.32%
US09785EAJ01 - Bonanza A-144A FRN	0.00	5'400'000.00	0.00	5'400'000.00	5'362'740.00	1.83%
US09785EAC57 - BONANZA 24 FRB	750'000.00	0.00	0.00	750'000.00	748'725.00	0.25%
US09785EAG61 - Bonanza Re Ltd. 2021-1 Class B	3'250'000.00	0.00	0.00	3'250'000.00	3'012'425.00	1.03%
US09785EAE14 - Bonanza Re/Var Bd 20220606 Cl-B 144A	3'750'000.00	0.00	3'750'000.00	0.00	0.00	0.00%
US09785EAD31 - Bonanza Re/Var Bd 20241223 Cl-A 144A	3'300'000.00	0.00	0.00	3'300'000.00	3'290'067.00	1.12%
US10260PAC23 - BOWL 23- 144A3C7FRN	500'000.00	0.00	0.00	500'000.00	498'600.00	0.17%
US10260PAF53 - Bowline Re Prin at Risk Sr 144A3C7	0.00	1'250'000.00	0.00	1'250'000.00	1'246'250.00	0.42%
US10260PAB40 - BWL 23 144A3C7 FRN	500'000.00	0.00	0.00	500'000.00	500'805.00	0.17%

Vermögensinventar per 30.06.2022

Käufe und Verkäufe 01.01.2022 - 30.06.2022

Bezeichnung	Bestand	Kauf	Verkauf	Bestand	Marktwert	Anteil
	01.01.2022	1)	2)	30.06.2022	USD	in %
US30014LAJ35 - EVE 25 VRN-144A3C7	0.00	2'600'000.00	0.00	2'600'000.00	2'595'060.00	0.88%
US30014LAH78 - Everglades Re/Var FRN 20240514 Sr CI-A 144A+3c7	3'000'000.00	0.00	0.00	3'000'000.00	2'951'700.00	1.00%
US30014LAF13 - Everglades Re/Var FRN 20240514 Sr CI-A 144A+3c7	250'000.00	0.00	0.00	250'000.00	245'750.00	0.08%
US33975CAE57 - FLD 23 144A-3C7 FRN	1'750'000.00	0.00	0.00	1'750'000.00	1'684'900.00	0.57%
US33975CAJ45 - FloodSmart Re 2022-25.02.25 Ser 2022-1 Prin at Risk	0.00	6'500'000.00	0.00	6'500'000.00	6'246'500.00	2.13%
US33975CAD74 - FloodSmart Re/Var FRN 20220307 144A+3c7	3'500'000.00	0.00	3'500'000.00	0.00	0.00	0.00%
US33975CAG06 - FloodSmart Re/Var FRN 20240301 CI-A 144A+3c7	3'750'000.00	0.00	0.00	3'750'000.00	3'556'612.50	1.21%
US35087TAC27 - FOU252021-1A144A3C7	7'750'000.00	0.00	2'000'000.00	5'750'000.00	5'709'750.00	1.94%
US35087TAA60 - Four Lakes Re --- Notes 2020-05.01.24 Prin At Risk Series 20	1'000'000.00	1'000'000.00	0.00	2'000'000.00	1'982'000.00	0.67%
US36354TAL61 - GAL 24 144A3C7 FRN	500'000.00	0.00	0.00	500'000.00	494'550.00	0.17%
US42703VAB99 - Herbie/Var FRN 20250108 Sub CI-A Ser-2020-2 144A+3c7	1'000'000.00	0.00	0.00	1'000'000.00	1'007'300.00	0.34%
US42703VAC72 - Herbie/Var FRN 20250108 Sub CI-B Ser-2020-2 144A+3c7	1'000'000.00	800'000.00	0.00	1'800'000.00	1'815'300.00	0.62%
US42703VAA17 - HERBIE24 144A3C7FRN	750'000.00	0.00	0.00	750'000.00	740'625.00	0.25%
US42815KAA07 - HEST 25 - 144A3C7 VR	0.00	2'000'000.00	0.00	2'000'000.00	1'989'920.00	0.68%
US45833EAA55 - INTEG23 144A3C7 FRN	750'000.00	0.00	0.00	750'000.00	745'500.00	0.25%
US45833UAF84 - Integrity Re 2022 Prin at Risk Sr1443c7	0.00	1'000'000.00	0.00	1'000'000.00	997'400.00	0.34%
US49407QAF54 - KILIM 22 NTS-144A	250'000.00	0.00	250'000.00	0.00	0.00	0.00%
US494074AL19 - Kilimanjaro 23-144A 3C7 FRN	750'000.00	0.00	0.00	750'000.00	736'500.00	0.25%
US49407PAK66 - Kilimanjaro III/Var FRN 20260420 CI-C-2 Ser-2021-2 144A+3c7	350'000.00	0.00	0.00	350'000.00	342'195.00	0.12%
US49407PAH38 - Kilimanjaro III/Var FRN 20260420 Sr CI-A-2 Ser-2021-2 144A+3	750'000.00	1'300'000.00	0.00	2'050'000.00	1'998'586.00	0.68%
US54143LAA61 - LOG24 A-144A3C7	750'000.00	0.00	0.00	750'000.00	747'450.00	0.25%
US577092AP49 - MA 25 A 144A3C7 VRN	0.00	4'100'000.00	0.00	4'100'000.00	4'046'905.00	1.38%
US577092AS87 - MATT22 A 144A3C7	0.00	2'000'000.00	0.00	2'000'000.00	1'827'000.00	0.62%
US577092AQ22 - Matterhorn 25 B 144A3C7 VRN	0.00	4'000'000.00	0.00	4'000'000.00	3'956'800.00	1.35%
US577092AN90 - MATTERN 25 FRN	2'750'000.00	0.00	0.00	2'750'000.00	2'662'302.50	0.91%
US59013MAE21 - MERNA II 30-144A3C7	0.00	4'500'000.00	0.00	4'500'000.00	4'478'130.00	1.52%
US59013MAC64 - Merna Reins II/Var FRN 20240405 Sr CI-B 144A+3c7	500'000.00	0.00	500'000.00	0.00	0.00	0.00%
US608800AD07 - MONA 23 144A3C7 FRN	750'000.00	0.00	0.00	750'000.00	740'250.00	0.25%
US608800AE89 - Mona Lisa Re/Var FRN 20250708 Sr 144A+3c7	2'500'000.00	0.00	0.00	2'500'000.00	2'453'250.00	0.83%
US62865LAB36 - Mystic Re IV/Var FRN 20250108 Sr CI-A Ser-2021-2 144A+3c7	2'000'000.00	3'500'000.00	0.00	5'500'000.00	5'332'250.00	1.81%

Vermögensinventar per 30.06.2022

Käufe und Verkäufe 01.01.2022 - 30.06.2022

Bezeichnung	Bestand	Kauf	Verkauf	Bestand	Marktwert	Anteil
	01.01.2022	1)	2)	30.06.2022	USD	in %
US666842AB56 - NORT 22 144A-3C7FRN	3'250'000.00	0.00	0.00	3'250'000.00	3'248'375.00	1.11%
US666842AC30 - NRTSHR 23-144A3C7	750'000.00	0.00	0.00	750'000.00	758'925.00	0.26%
US705809AD36 - Pelican IV Re/Var FRN 20240507 Cl-B Ser-2021-1 144A+3c7	500'000.00	0.00	0.00	500'000.00	402'910.00	0.14%
US73934DAB55 - Power Prot Re/Var FRN 20240909 Sr Cl-A Ser-2021-1 144A+3c7	2'300'000.00	0.00	0.00	2'300'000.00	2'299'540.00	0.78%
US76870YAE23 - Riverfront Re/Var FRN 20250107 Sr 144A+3c7	2'500'000.00	0.00	0.00	2'500'000.00	2'472'250.00	0.84%
US76870YAD40 - Riverfront Re/Var FRN 20250107 Sr Cl-A 144A+3c7	2'500'000.00	0.00	0.00	2'500'000.00	2'465'000.00	0.84%
US79381MAB00 - Sakura Re/Var FRN 20250407 Sr Cl-A Ser-2021-1 144A+3c7	250'000.00	0.00	0.00	250'000.00	247'585.00	0.08%
US80000RAJ14 - SAND 22 144A3C7 FRN	1'000'000.00	0.00	1'000'000.00	0.00	0.00	0.00%
US80000XAB55 - SAND 26 B-144A3C7	0.00	2'750'000.00	0.00	2'750'000.00	2'717'550.00	0.92%
US80000WAA99 - SANDERS 23 144A3C7	500'000.00	0.00	0.00	500'000.00	495'950.00	0.17%
US80001PAA30 - Sanders Re II/Var FRN 20280407 Sr 144A+3c7	5'000'000.00	0.00	0.00	5'000'000.00	4'909'500.00	1.67%
US78414BAB71 - SD Re -14.07.23 Prin at Risk Ser 20-1 Cl A	3'300'000.00	0.00	0.00	3'300'000.00	3'284'193.00	1.12%
US78414BAD38 - SD Re/Var FRN 20311119 144A+3c7	1'500'000.00	580'000.00	0.00	2'080'000.00	2'072'283.20	0.71%
US826359AD34 - Sierra/Var Bd 20240131 Cl-B Ser-2021-1 144A+3c7	2'750'000.00	0.00	0.00	2'750'000.00	2'717'467.50	0.92%
US86944RAD08 - Sutter Re -6.6.22 Prin at Risk FRN	0.00	2'000'000.00	2'000'000.00	0.00	0.00	0.00%
US86944RAA68 - SUTTER23-144A3C7FRN	1'000'000.00	0.00	0.00	1'000'000.00	1'004'300.00	0.34%
US87403TAD81 - TA 25 A 144A3C7 FRN	0.00	4'750'000.00	0.00	4'750'000.00	4'683'500.00	1.59%
US87403TAE64 - Tailwind 25 B144A3C7 FRN	0.00	2'150'000.00	0.00	2'150'000.00	2'126'350.00	0.72%
US87403TAA43 - Tailwind Re 22 A 144A-3C7FRN	3'250'000.00	0.00	3'250'000.00	0.00	0.00	0.00%
US87403TAC09 - Tailwind Re/Var FRN 20220108 Sr Cl-C Ser-2017-1 144A+3c7	1'000'000.00	0.00	1'000'000.00	0.00	0.00	0.00%
US888329AB58 - Titania Re Ltd. 2021-2 Class A	3'000'000.00	0.00	0.00	3'000'000.00	2'952'300.00	1.00%
US888329AA75 - Titania Re/Var FRN 20280621 Sr Cl-A 144A+3c7	1'250'000.00	0.00	0.00	1'250'000.00	1'234'375.00	0.42%
US89055TAA16 - TOPA 26 FRB	7'250'000.00	0.00	0.00	7'250'000.00	7'141'975.00	2.43%
US89055TAB98 - Topanga Re Bds 24	4'000'000.00	0.00	0.00	4'000'000.00	3'976'000.00	1.35%
US90323WAK62 - URSA 22-144A3C7 FRN	1'000'000.00	0.00	0.00	1'000'000.00	996'510.00	0.34%
US91734PAB22 - Ursa Re II/Var FRN 20231207 Cl-D 144A+3c7	1'750'000.00	0.00	0.00	1'750'000.00	1'730'452.50	0.59%
US91734PAC05 - Ursa Re II/Var FRN 20241206 Sr Cl-F Ser-2021-1 144A+3c7	4'500'000.00	0.00	0.00	4'500'000.00	4'380'210.00	1.49%
US91734PAD87 - URSA25 VRN-144A3C7	0.00	2'000'000.00	0.00	2'000'000.00	2'000'000.00	0.68%
US92840DAA00 - Vista RE/Var FRN 20240521 Sr 144A+3c7	1'000'000.00	0.00	0.00	1'000'000.00	973'590.00	0.33%
XS2363934618 - Wht Rck Insrnc/MMkt 20220706 Sr	3'700'000.00	0.00	0.00	3'700'000.00	3'689'270.00	1.26%

Vermögensinventar per 30.06.2022

Käufe und Verkäufe 01.01.2022 - 30.06.2022

Bezeichnung	Bestand	Kauf	Verkauf	Bestand	Marktwert	Anteil
	01.01.2022	1)	2)	30.06.2022	USD	in %
US98740RAA77 - YOSEMITE 25 VRB	0.00	1'000'000.00	0.00	1'000'000.00	999'800.00	0.34%
Summe Bermudainseln					145'183'443.63	49.41%
Cayman Islands						
US76120FAA93 - RES 23 -144A3C7 VRN	500'000.00	0.00	0.00	500'000.00	471'500.00	0.16%
US76120FAD33 - Resid Reins/Var FRN 20231206 Sr 144A	250'000.00	0.00	0.00	250'000.00	243'282.50	0.08%
US76114NAC65 - Resid Reins/Var FRN 20250606 Sr CI-13 Ser-2021-I 144A	1'000'000.00	0.00	0.00	1'000'000.00	973'300.00	0.33%
US76114NAF96 - Resid Reins/Var FRN 20251206 Sr CI-3 Ser-2021-II 144A	3'000'000.00	0.00	0.00	3'000'000.00	2'915'550.00	0.99%
US76120AAB89 - Residential/Var FRN 20241206 Sr CI-3 Ser-2020-II 144A	1'750'000.00	0.00	0.00	1'750'000.00	1'715'000.00	0.58%
US76120AAC62 - Residential/Var FRN 20241206 Sr CI-4 Ser-2020-II 144A	1'500'000.00	0.00	0.00	1'500'000.00	1'502'100.00	0.51%
Summe Cayman Islands					7'820'732.50	2.66%
Grossbritannien						
US04921AAA34 - ATLAS22 144A-3C7FRN	1'000'000.00	0.00	1'000'000.00	0.00	0.00	0.00%
XS2451864107 - BALTIC PCC LTD 2022-1 CLASS A	0.00	4'250'000.00	0.00	4'250'000.00	5'170'970.57	1.76%
US869255AA73 - Sussex Cap UK/Var FRN 20250108 Sr Ser-2020-1 144A+3c7	2'250'000.00	0.00	0.00	2'250'000.00	2'230'515.00	0.76%
Summe Grossbritannien					7'401'485.57	2.52%
Guernsey						
GG00BMG7J671 - DUNANT RE IC 2021-1 VE	300'000.00	0.00	0.00	300'000.00	300'030.00	0.10%
Summe Guernsey					300'030.00	0.10%
Hong Kong						
US092168AA11 - BLACK25 144A3C7VRN	0.00	2'400'000.00	0.00	2'400'000.00	2'400'000.00	0.82%
Summe Hong Kong					2'400'000.00	0.82%
Irland						
US04921RAA68 - Atlas 24 2020-1 A FRN	250'000.00	0.00	0.00	250'000.00	245'475.00	0.08%
XS2193952053 - AZZURRO 24 FRN	250'000.00	0.00	0.00	250'000.00	265'774.12	0.09%
XS2066695433 - HEX II R24-144A FRB	500'000.00	0.00	0.00	500'000.00	537'558.61	0.18%
XS1735822857 - Hexagon Reins/Var FRN 20220119 Sr Ser-B	2'425'000.00	0.00	2'425'000.00	0.00	0.00	0.00%
XS2181578233 - WINDMILL 24 VRN	500'000.00	0.00	500'000.00	0.00	0.00	0.00%
Summe Irland					1'048'807.73	0.36%
Singapur						
US148805AA28 - Catahoula II Re/Var FRN 20250616 Sr CI-A 144A+3c7	0.00	1'000'000.00	0.00	1'000'000.00	1'000'000.00	0.34%
US31971CAA18 - First Coast III/Var FRN 20250407 Sr CI-A 144A+3c7	3'000'000.00	0.00	0.00	3'000'000.00	2'863'500.00	0.97%
US31970MAA09 - FST 23 C19 144-FRN	1'000'000.00	0.00	0.00	1'000'000.00	988'300.00	0.34%
XS2411653293 - HEXAGO 26 FRN	1'000'000.00	0.00	0.00	1'000'000.00	1'075'855.34	0.37%
XS2423598528 - PHEI 28 BDS	1'125'000.00	0.00	0.00	1'125'000.00	1'138'567.50	0.39%
XS2275151715 - Phoenix 1 Re/Var Bd 20270104 CI-A Ser-2021-1 RegS	500'000.00	0.00	0.00	500'000.00	550'335.00	0.19%

Vermögensinventar per 30.06.2022

Käufe und Verkäufe 01.01.2022 - 30.06.2022

Bezeichnung	Bestand	Kauf	Verkauf	Bestand	Marktwert	Anteil
	01.01.2022	1)	2)	30.06.2022	USD	in %
XS2423597801 - PHOENIX 2 RE Ser 22-1	375'000.00	0.00	0.00	375'000.00	402'045.00	0.14%
US74686TAA07 - Putnam Re/Var FRN 20240607 Cl-A Ser-2021-1 144A+3c7	250'000.00	0.00	0.00	250'000.00	0.00	0.00%
US89142MAB90 - Torrey Pines/Var FRN 20240607 Sr Cl-B Ser-2021-1 144A	4'650'000.00	1'500'000.00	0.00	6'150'000.00	6'099'385.50	2.08%
Summe Singapur					14'117'988.34	4.81%
USA						
US13947LAC63 - Cape Lookout Re/Var FRN 20240322 Sr Cl-A Ser-2021-1 144A+3c7	4'000'000.00	0.00	3'000'000.00	1'000'000.00	992'900.00	0.34%
US40428NAC39 - HSB Group/Var Bd 20270715 JrSub Ser-B	0.00	3'300'000.00	0.00	3'300'000.00	2'872'023.00	0.98%
XS2368221680 - WELTBANK 23 FRN	4'500'000.00	0.00	0.00	4'500'000.00	4'433'850.00	1.51%
XS2127855125 - WELTBANK 24 A FRB	750'000.00	0.00	0.00	750'000.00	752'250.00	0.26%
XS2127856016 - WELTBANK 24 D FRN	1'000'000.00	0.00	0.00	1'000'000.00	1'009'000.00	0.34%
XS2127855398 - World Bank/Var FRN 20240313 Sr Cl-B Ser-CAR 126 Tra-1 Gtd	2'000'000.00	0.00	0.00	2'000'000.00	2'005'400.00	0.68%
Summe USA					12'065'423.00	4.11%
Summe Obligationen					190'337'910.77	64.78%
Summe Wertpapiere, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden					190'337'910.77	64.78%
Wertpapiere, die nicht an einem geregelten Markt gehandelt werden						
Obligationen						
Bermudainseln						
US88577CAA99 - 3264 23 144A3C7 FRN	500'000.00	0.00	0.00	500'000.00	490'960.00	0.17%
Summe Bermudainseln					490'960.00	0.17%
Finnland						
FI4000513692 - AKTIA LIVF 31 FRN	3'000'000.00	200'000.00	0.00	3'200'000.00	3'004'355.81	1.02%
Summe Finnland					3'004'355.81	1.02%
Grossbritannien						
XS2361739415 - esure Group/CvBd Perp RegS	3'000'000.00	1'200'000.00	0.00	4'200'000.00	4'498'003.32	1.53%
Summe Grossbritannien					4'498'003.32	1.53%
Italien						
XS2296002228 - Amiss Vit/Bd 20310816 Sub	1'000'000.00	1'000'000.00	0.00	2'000'000.00	2'216'137.57	0.75%
Summe Italien					2'216'137.57	0.75%
Singapur						
US90421FAC23 - Umigame Re/Var FRN 20250407 Sr Cl-B Ser-2021-1 144A+3c7	1'750'000.00	0.00	0.00	1'750'000.00	1'742'125.00	0.59%
Summe Singapur					1'742'125.00	0.59%
USA						
XS2082419404 - WELTBAA22 A-144A FRN	1'000'000.00	0.00	0.00	1'000'000.00	1'002'700.00	0.34%
Summe USA					1'002'700.00	0.34%
Summe Obligationen					12'954'281.70	4.41%
Summe Wertpapiere, die nicht an einem geregelten Markt gehandelt werden					12'954'281.70	4.41%
Summe Wertpapiere					288'496'981.76	98.19%
Derivate						
Derivate, die an einer Börse gehandelt werden						

Vermögensinventar per 30.06.2022

Käufe und Verkäufe 01.01.2022 - 30.06.2022

Bezeichnung	Bestand	Kauf	Verkauf	Bestand	Marktwert	Anteil
	01.01.2022	1)	2)	30.06.2022	USD	in %
Futures						
Grossbritannien						
GB00JH7JGJ18 - ICE Futures EU/F 202203 R	-57.00	93.00	36.00	0.00	0.00	0.00%
GB00JL6LY922 - ICE Futures EU/F 202206 R	0.00	93.00	93.00	0.00	0.00	0.00%
GB00JSZRJX95 - ICE Futures EU/F 202209 R	0.00	0.00	26.00	-26.00	140'596.32	0.05%
Summe Grossbritannien					140'596.32	0.05%
USA						
95352388 - 10YNTS.FUT.SEP22	0.00	7.00	46.00	-39.00	112'734.38	0.04%
89438579 - CME Group/F 202203 ZN	-69.00	69.00	0.00	0.00	0.00	0.00%
92204405 - Future 10YNTS FUT JUN22	0.00	69.00	69.00	0.00	0.00	0.00%
Summe USA					112'734.38	0.04%
Summe Futures					253'330.70	0.09%
Summe Derivate, die an einer Börse gehandelt werden					253'330.70	0.09%
Derivate, die nicht an einem geregelten Markt gehandelt werden						
Devisentermingeschäfte						
Liechtenstein						
FXF000008435 - I CHF // CHF/USD 0.91 01.04.22	0.00	550'000.00	602'432.07	0.00	0.00	0.00%
FXF000008485 - I CHF // CHF/USD 0.91 01.04.22	0.00	2'400'000.00	2'624'026.24	0.00	0.00	0.00%
FXF000008383 - I CHF // CHF/USD 0.91 01.04.22	0.00	19'565'000.00	21'419'336.19	0.00	0.00	0.00%
FXF000008279 - I CHF // CHF/USD 0.91 07.01.22	0.00	150'000.00	163'322.60	0.00	0.00	0.00%
FXF000008593 - I CHF // CHF/USD 0.92 01.07.22	0.00	600'000.00	649'707.85	0.00	-21'115.29	-0.01%
FXF000008566 - I CHF // CHF/USD 0.92 01.07.22	0.00	22'418'000.00	24'310'212.10	0.00	-823'886.52	-0.28%
FXF000008212 - I CHF // CHF/USD 0.92 07.01.22	0.00	425'000.00	458'964.27	0.00	0.00	0.00%
FXF000008243 - I CHF // CHF/USD 0.92 07.01.22	0.00	230'000.00	248'963.82	0.00	0.00	0.00%
FXF000008543 - I CHF // CHF/USD 0.93 01.04.22	0.00	180'000.00	193'474.53	0.00	0.00	0.00%
FXF000008611 - I CHF // CHF/USD 0.94 01.07.22	0.00	100'000.00	106'016.21	0.00	-1'251.56	-0.00%
FXF000008172 - I CHF // USD/CHF 0.9196887 07.01.2022	0.00	18'650'000.00	20'278'600.79	0.00	0.00	0.00%
FXF000008662 - I CHF // USD/CHF 0.99 01.07.22	0.00	303'231.44	300'000.00	0.00	-11'061.38	-0.00%
FXF000008683 - I CHF // USD/CHF 0.99 01.07.22	0.00	450'811.46	450'000.00	0.00	-20'627.77	-0.01%
FXF000008663 - I EUR // EUR/USD 1.06 01.07.22	0.00	263'944.86	250'000.00	0.00	228.96	0.00%
FXF000008699 - I EUR // EUR/USD 1.07 01.07.22	0.00	40'000.00	43'073.56	0.00	-878.69	-0.00%
FXF000008645 - I EUR // EUR/USD 1.08 01.07.22	0.00	150'000.00	162'498.45	0.00	-4'267.33	-0.00%
FXF000008544 - I EUR // EUR/USD 1.10 01.04.22	0.00	40'000.00	44'152.60	0.00	0.00	0.00%
FXF000008569 - I EUR // EUR/USD 1.11 01.07.22	0.00	18'480'000.00	20'646'194.18	0.00	-1'151'874.98	-0.39%
FXF000008348 - I EUR // EUR/USD 1.12 07.01.22	0.00	530'000.00	598'304.81	0.00	0.00	0.00%
FXF000008434 - I EUR // EUR/USD 1.13 01.04.22	0.00	420'000.00	475'978.44	0.00	0.00	0.00%

Vermögensinventar per 30.06.2022

Käufe und Verkäufe 01.01.2022 - 30.06.2022

Bezeichnung	Bestand	Kauf	Verkauf	Bestand	Marktwert	Anteil
	01.01.2022	1)	2)	30.06.2022	USD	in %
FXF000008468 - I EUR // EUR/USD 1.13 01.04.22	0.00	700'000.00	793'618.00	0.00	0.00	0.00%
FXF000008404 - I EUR // EUR/USD 1.13 01.04.22	0.00	500'000.00	565'919.50	0.00	0.00	0.00%
FXF000008386 - I EUR // EUR/USD 1.13 01.04.22	0.00	15'605'000.00	17'716'601.50	0.00	0.00	0.00%
FXF000008367 - I EUR // EUR/USD 1.13 07.01.22	0.00	1'045'000.00	1'186'483.60	0.00	0.00	0.00%
FXF000008459 - I EUR // EUR/USD 1.14 01.04.22	0.00	450'000.00	515'275.65	0.00	0.00	0.00%
FXF000008423 - I EUR // EUR/USD 1.14 01.04.22	0.00	725'000.00	828'226.95	0.00	0.00	0.00%
FXF000008283 - I EUR // EUR/USD 1.14 07.01.22	0.00	140'000.00	160'629.85	0.00	0.00	0.00%
FXF000008261 - I EUR // EUR/USD 1.16 07.01.22	0.00	85'000.00	98'738.27	0.00	0.00	0.00%
FXF000008244 - I EUR // EUR/USD 1.16 07.01.22	0.00	660'000.00	765'961.02	0.00	0.00	0.00%
FXF000008191 - I EUR // EUR/USD 1.17 07.01.22	0.00	150'000.00	176'060.40	0.00	0.00	0.00%
FXF000008709 - I EUR // USD/EUR 1.04 01.07.22	0.00	994'256.70	950'000.00	0.00	-7'863.74	-0.00%
FXF000008168 - I EUR // USD/EUR 1.1770206 07.01.2022	0.00	12'970'000.00	15'265'957.18	0.00	0.00	0.00%
FXF000008486 - I2 CHF // CHF/USD 0.91 01.04.22	0.00	1'000'000.00	1'093'344.27	0.00	0.00	0.00%
FXF000008385 - I2 CHF // CHF/USD 0.91 01.04.22	0.00	41'275'000.00	45'186'971.70	0.00	0.00	0.00%
FXF000008278 - I2 CHF // CHF/USD 0.91 07.01.22	0.00	16'450'000.00	17'911'045.15	0.00	0.00	0.00%
FXF000008460 - I2 CHF // CHF/USD 0.92 01.04.22	0.00	6'800'000.00	7'379'577.24	0.00	0.00	0.00%
FXF000008594 - I2 CHF // CHF/USD 0.92 01.07.22	0.00	60'000.00	64'970.78	0.00	-2'111.53	-0.00%
FXF000008567 - I2 CHF // CHF/USD 0.92 01.07.22	0.00	49'030'000.00	53'168'422.66	0.00	-1'801'907.22	-0.61%
FXF000008322 - I2 CHF // CHF/USD 0.92 07.01.22	0.00	1'350'000.00	1'462'585.44	0.00	0.00	0.00%
FXF000008347 - I2 CHF // CHF/USD 0.92 07.01.22	0.00	3'200'000.00	3'469'617.00	0.00	0.00	0.00%
FXF000008190 - I2 CHF // CHF/USD 0.92 07.01.22	0.00	150'000.00	162'345.04	0.00	0.00	0.00%
FXF000008634 - I2 CHF // CHF/USD 0.95 01.07.22	0.00	1'900'000.00	1'988'879.03	0.00	1'640.73	0.00%
FXF000008697 - I2 CHF // CHF/USD 0.95 01.07.22	0.00	950'000.00	992'906.47	0.00	2'352.88	0.00%
FXF000008681 - I2 CHF // CHF/USD 0.99 01.07.22	0.00	2'000'000.00	2'005'213.56	0.00	90'040.26	0.03%
FXF000008173 - I2 CHF // USD/CHF 0.9196887 07.01.2022	0.00	20'050'000.00	21'800'855.01	0.00	0.00	0.00%
FXF000008473 - I2 CHF // USD/CHF 0.92 01.04.22	0.00	324'431.68	300'000.00	0.00	0.00	0.00%
FXF000008542 - I2 CHF // USD/CHF 0.93 01.04.22	0.00	322'068.45	300'000.00	0.00	0.00	0.00%
FXF000008682 - I2 CHF // USD/CHF 0.99 01.07.22	0.00	2'019'439.12	2'000'000.00	0.00	-75'846.37	-0.03%
FXF000008664 - I2 CHF // USD/CHF 0.99 01.07.22	0.00	353'770.01	350'000.00	0.00	-12'904.95	-0.00%
FXF000008665 - I2 EUR // EUR/USD 1.06 01.07.22	0.00	475'100.74	450'000.00	0.00	412.11	0.00%
FXF000008553 - I2 EUR // EUR/USD 1.09 01.04.22	0.00	2'550'000.00	2'797'653.45	0.00	0.00	0.00%

Vermögensinventar per 30.06.2022

Käufe und Verkäufe 01.01.2022 - 30.06.2022

Bezeichnung	Bestand	Kauf	Verkauf	Bestand	Marktwert	Anteil
	01.01.2022	1)	2)	30.06.2022	USD	in %
FXF000008571 - I2 EUR // EUR/USD 1.11 01.07.22	0.00	33'265'000.00	37'164'266.75	0.00	-2'073'437.30	-0.71%
FXF000008323 - I2 EUR // EUR/USD 1.12 07.01.22	0.00	10'600'000.00	11'957'467.80	0.00	0.00	0.00%
FXF000008388 - I2 EUR // EUR/USD 1.13 01.04.22	0.00	31'390'000.00	35'637'559.82	0.00	0.00	0.00%
FXF000008368 - I2 EUR // EUR/USD 1.13 07.01.22	0.00	140'000.00	158'954.74	0.00	0.00	0.00%
FXF000008336 - I2 EUR // EUR/USD 1.13 07.01.22	0.00	600'000.00	678'659.40	0.00	0.00	0.00%
FXF000008329 - I2 EUR // EUR/USD 1.13 07.01.22	0.00	1'550'000.00	1'752'644.99	0.00	0.00	0.00%
FXF000008424 - I2 EUR // EUR/USD 1.14 01.04.21	0.00	125'000.00	142'891.50	0.00	0.00	0.00%
FXF000008282 - I2 EUR // EUR/USD 1.14 07.01.22	0.00	6'270'000.00	7'193'922.75	0.00	0.00	0.00%
FXF000008273 - I2 EUR // EUR/USD 1.15 07.01.22	0.00	5'120'000.00	5'931'381.76	0.00	0.00	0.00%
FXF000008262 - I2 EUR // EUR/USD 1.16 07.01.22	0.00	2'580'000.00	2'996'996.89	0.00	0.00	0.00%
FXF000008687 - I2 EUR // USD/EUR 1.06 01.07.22	0.00	213'894.60	200'000.00	0.00	2'921.88	0.00%
FXF000008541 - I2 EUR // USD/EUR 1.10 01.04.22	0.00	330'881.40	300'000.00	0.00	0.00	0.00%
FXF000008469 - I2 EUR // USD/EUR 1.13 01.04.22	0.00	566'480.00	500'000.00	0.00	0.00	0.00%
FXF000008169 - I2 EUR // USD/EUR 1.1770206 07.01.2022	0.00	4'540'000.00	5'343'673.52	0.00	0.00	0.00%
FXF000008666 - ID EUR // EUR/USD 1.06 01.07.22	0.00	11'613.57	11'000.00	0.00	10.07	0.00%
FXF000008570 - ID EUR // EUR/USD 1.11 01.07.22	0.00	965'000.00	1'078'115.66	0.00	-60'149.32	-0.02%
FXF000008389 - ID EUR // EUR/USD 1.13 01.04.22	0.00	1'005'000.00	1'140'992.28	0.00	0.00	0.00%
FXF000008609 - ID EUR // USD/EUR 1.08 01.07.22	0.00	11'888.23	11'000.00	0.00	284.73	0.00%
FXF000008403 - ID EUR // USD/EUR 1.12 01.04.22	0.00	16'945.59	15'000.00	0.00	0.00	0.00%
FXF000008470 - ID EUR // USD/EUR 1.13 01.04.22	0.00	20'384.12	18'000.00	0.00	0.00	0.00%
FXF000008171 - ID EUR // USD/EUR 1.1770206 07.01.2022	0.00	1'007'000.00	1'185'259.74	0.00	0.00	0.00%
FXF000008711 - MASTER // EUR/USD 1.04 01.07.22	0.00	250'000.00	261'993.85	0.00	1'721.22	0.00%
FXF000008472 - MASTER // EUR/USD 1.13 01.04.22	0.00	1'350'000.00	1'531'006.92	0.00	0.00	0.00%
FXF000008217 - MASTER // EUR/USD 1.15 07.01.22	0.00	1'750'000.00	2'024'757.18	0.00	0.00	0.00%
FXF000008213 - MASTER // EUR/USD 1.16 07.01.21	0.00	450'000.00	523'901.70	0.00	0.00	0.00%
FXF000008204 - MASTER // EUR/USD 1.16 07.01.22	0.00	3'580'000.00	4'184'679.54	0.00	0.00	0.00%
FXF000008176 - MASTER // EUR/USD 1.1765617 07.01.2022	0.00	24'578'373.91	20'890'000.00	0.00	0.00	0.00%
FXF000008658 - MASTER // EUR/USD 1.58 01.07.22	0.00	70'000.00	74'076.88	0.00	-236.38	-0.00%
FXF000008710 - MASTER // GBP/USD 1.22 01.07.22	0.00	350'000.00	427'492.80	0.00	2'692.81	0.00%
FXF000008659 - MASTER // GBP/USD 1.24 01.07.22	0.00	800'000.00	989'072.99	0.00	-5'790.48	-0.00%
FXF000008692 - MASTER // GBP/USD 1.25 01.07.22	0.00	4'500'000.00	5'647'896.00	0.00	-116'924.11	-0.04%

Vermögensinventar per 30.06.2022

Käufe und Verkäufe 01.01.2022 - 30.06.2022

Bezeichnung	Bestand	Kauf	Verkauf	Bestand	Marktwert	Anteil
	01.01.2022	1)	2)	30.06.2022	USD	in %
FXF000008546 - MASTER // GBP/USD 1.31 01.04.22	0.00	500'000.00	657'479.26	0.00	0.00	0.00%
FXF000008475 - MASTER // GBP/USD 1.35 01.04.22	0.00	1'450'000.00	1'961'576.50	0.00	0.00	0.00%
FXF000008205 - MASTER // GBP/USD 1.35 07.01.22	0.00	935'000.00	1'264'775.72	0.00	0.00	0.00%
FXF000008216 - MASTER // GBP/USD 1.35 07.01.22	0.00	2'200'000.00	2'983'214.52	0.00	0.00	0.00%
FXF000008178 - MASTER // GBP/USD 1.3651883 07.01.2022	0.00	27'331'069.77	20'020'000.00	0.00	0.00	0.00%
FXF000008257 - MASTER // GBP/USD 1.37 07.01.22	0.00	1'850'000.00	2'541'641.37	0.00	0.00	0.00%
FXF000008177 - MASTER // SEK/USD 0.1157187 07.01.2022	0.00	1'622'376.17	14'020'000.00	0.00	0.00	0.00%
FXF000008330 - MASTER // SEK/USD 9.08 07.01.22	0.00	14'020'000.00	1'542'920.50	0.00	0.00	0.00%
FXF000008733 - MASTER // USD/EUR 1.05 01.07.22	0.00	4'853'193.20	4'600'000.00	0.00	820.56	0.00%
FXF000008727 - MASTER // USD/EUR 1.05 01.07.22	0.00	1'576'027.50	1'500'000.00	0.00	-6'267.93	-0.00%
FXF000008647 - MASTER // USD/EUR 1.05 01.07.22	0.00	654'551.36	620'000.00	0.00	535.92	0.00%
FXF000008704 - MASTER // USD/EUR 1.06 01.07.22	0.00	2'460'011.00	2'300'000.00	0.00	33'824.68	0.01%
FXF000008573 - MASTER // USD/EUR 1.11 01.07.22	0.00	30'780'831.71	27'510'000.00	0.00	1'761'533.59	0.60%
FXF000008314 - MASTER // USD/EUR 1.12 07.01.22	0.00	6'579'851.50	5'840'000.00	0.00	0.00	0.00%
FXF000008390 - MASTER // USD/EUR 1.13 01.04.22	0.00	30'818'817.51	27'150'000.00	0.00	0.00	0.00%
FXF000008307 - MASTER // USD/EUR 1.13 07.01.22	0.00	1'133'262.80	1'000'000.00	0.00	0.00	0.00%
FXF000008291 - MASTER // USD/EUR 1.13 07.01.22	0.00	951'112.18	840'000.00	0.00	0.00	0.00%
FXF000008416 - MASTER // USD/EUR 1.14 01.04.22	0.00	1'951'776.12	1'700'000.00	0.00	0.00	0.00%
FXF000008270 - MASTER // USD/EUR 1.15 07.01.22	0.00	869'165.55	750'000.00	0.00	0.00	0.00%
FXF000008275 - MASTER // USD/EUR 1.15 07.01.22	0.00	1'342'538.30	1'160'000.00	0.00	0.00	0.00%
FXF000008269 - MASTER // USD/EUR 1.15 07.01.22	0.00	462'769.84	400'000.00	0.00	0.00	0.00%
FXF000008263 - MASTER // USD/EUR 1.16 07.01.22	0.00	2'323'025.80	2'000'000.00	0.00	0.00	0.00%
FXF000008603 - MASTER // USD/GBP 1.29 01.07.22	0.00	1'297'254.40	1'000'000.00	0.00	68'151.89	0.02%
FXF000008515 - MASTER // USD/GBP 1.31 01.04.22	0.00	3'015'819.57	2'300'000.00	0.00	0.00	0.00%
FXF000008595 - MASTER // USD/GBP 1.31 01.07.22	0.00	1'313'490.80	1'000'000.00	0.00	84'388.29	0.03%
FXF000008574 - MASTER // USD/GBP 1.31 01.07.22	0.00	40'454'805.19	30'770'000.00	0.00	2'635'321.06	0.90%
FXF000008511 - MASTER // USD/GBP 1.31 07.04.22	0.00	1'311'370.60	1'000'000.00	0.00	0.00	0.00%
FXF000008496 - MASTER // USD/GBP 1.33 01.04.22	0.00	5'324'812.00	4'000'000.00	0.00	0.00	0.00%
FXF000008295 - MASTER // USD/GBP 1.34 07.01.22	0.00	1'350'073.08	1'005'000.00	0.00	0.00	0.00%
FXF000008306 - MASTER // USD/GBP 1.34 07.01.22	0.00	2'828'557.41	2'100'000.00	0.00	0.00	0.00%
FXF000008292 - MASTER // USD/GBP 1.34 07.01.22	0.00	3'368'498.75	2'500'000.00	0.00	0.00	0.00%

Vermögensinventar per 30.06.2022

Käufe und Verkäufe 01.01.2022 - 30.06.2022

Bezeichnung	Bestand	Kauf	Verkauf	Bestand	Marktwert	Anteil
	01.01.2022	1)	2)	30.06.2022	USD	in %
FXF000008284 - MASTER // USD/GBP 1.34 07.01.22	0.00	1'145'104.79	850'000.00	0.00	0.00	0.00%
FXF000008391 - MASTER // USD/GBP 1.35 01.04.22	0.00	35'200'276.42	25'990'000.00	0.00	0.00	0.00%
FXF000008450 - MASTER // USD/GBP 1.35 01.04.22	0.00	542'070.48	400'000.00	0.00	0.00	0.00%
FXF000008266 - MASTER // USD/GBP 1.35 07.01.22	0.00	1'350'508.40	1'000'000.00	0.00	0.00	0.00%
FXF000008242 - MASTER // USD/GBP 1.37 07.01.22	0.00	4'804'535.75	3'500'000.00	0.00	0.00	0.00%
FXF000008366 - P CHF // USD/CHF 0.91 07.01.22	0.00	827'322.54	760'000.00	0.00	0.00	0.00%
FXF000008174 - P CHF // USD/CHF 0.9196887 07.01.2022	0.00	6'370'000.00	6'926'256.68	0.00	0.00	0.00%
FXF000008312 - P CHF // USD/CHF 0.92 07.01.22	0.00	1'617'351.81	1'500'000.00	0.00	0.00	0.00%
FXF000008324 - P CHF // USD/CHF 0.92 07.01.22	0.00	2'500'982.53	2'310'000.00	0.00	0.00	0.00%
FXF000008225 - P CHF // USD/CHF 0.92 07.01.22	0.00	1'944'837.91	1'800'000.00	0.00	0.00	0.00%
FXF000008661 - P EUR // EUR/USD 1.06 01.07.22	0.00	369'522.80	350'000.00	0.00	320.53	0.00%
FXF000008572 - P EUR // EUR/USD 1.11 01.07.22	0.00	28'270'000.00	31'583'761.34	0.00	-1'762'094.46	-0.60%
FXF000008490 - P EUR // EUR/USD 1.12 01.04.22	0.00	3'000'000.00	3'370'104.87	0.00	0.00	0.00%
FXF000008387 - P EUR // EUR/USD 1.13 01.04.22	0.00	25'785'000.00	29'274'115.32	0.00	0.00	0.00%
FXF000008369 - P EUR // EUR/USD 1.13 07.01.22	0.00	1'850'000.00	2'100'473.35	0.00	0.00	0.00%
FXF000008328 - P EUR // EUR/USD 1.13 07.01.22	0.00	1'950'000.00	2'204'940.47	0.00	0.00	0.00%
FXF000008281 - P EUR // EUR/USD 1.14 07.01.22	0.00	110'000.00	126'209.17	0.00	0.00	0.00%
FXF000008274 - P EUR // EUR/USD 1.15 07.01.22	0.00	4'300'000.00	4'981'433.90	0.00	0.00	0.00%
FXF000008545 - P EUR // USD/EUR 1.10 01.04.22	0.00	110'293.80	100'000.00	0.00	0.00	0.00%
FXF000008471 - P EUR // USD/EUR 1.13 01.04.22	0.00	509'602.95	450'000.00	0.00	0.00	0.00%
FXF000008170 - P EUR // USD/EUR 1.1770206 07.01.2022	0.00	17'530'000.00	20'633'171.12	0.00	0.00	0.00%
FXF000008725 - P2 CHF // CHF/USD 0.96 01.07.22	0.00	8'670'000.00	8'973'715.40	0.00	109'305.80	0.04%
FXF000008384 - S CHF // CHF/USD 0.91 01.04.22	0.00	17'310'000.00	18'950'611.27	0.00	0.00	0.00%
FXF000008568 - S CHF // CHF/USD 0.92 01.07.22	0.00	16'880'000.00	18'304'772.07	0.00	-620'358.84	-0.21%
FXF000008313 - S CHF // CHF/USD 0.92 07.01.22	0.00	110'000.00	118'651.73	0.00	0.00	0.00%
FXF000008175 - S CHF // USD/CHF 0.919689 07.01.2022	0.00	17'190'000.00	18'691'101.01	0.00	0.00	0.00%
FXF000008474 - S CHF // USD/CHF 0.92 01.04.22	0.00	324'431.68	300'000.00	0.00	0.00	0.00%
FXF000008540 - S CHF // USD/CHF 0.93 01.04.22	0.00	161'034.23	150'000.00	0.00	0.00	0.00%
FXF000008698 - S CHF // USD/CHF 0.95 01.07.22	0.00	104'516.47	100'000.00	0.00	-247.80	-0.00%
FXF000008660 - S CHF // USD/CHF 0.99 01.07.22	0.00	212'262.01	210'000.00	0.00	-7'742.97	-0.00%
Summe Liechtenstein					-3'792'338.95	-1.29%
Summe Devisentermingeschäfte					-3'792'338.95	-1.29%

Vermögensinventar per 30.06.2022

Käufe und Verkäufe 01.01.2022 - 30.06.2022

Bezeichnung	Bestand	Kauf	Verkauf	Bestand	Marktwert	Anteil
	01.01.2022	1)	2)	30.06.2022	USD	in %
Summe Derivate, die nicht an einem geregelten Markt gehandelt werden					-3'792'338.95	-1.29%
Summe Derivate					-3'539'008.25	-1.20%
Bankguthaben						
Sichtguthaben					5'851'318.48	1.99%
Zeitguthaben					0.00	0.00%
Summe Bankguthaben					5'851'318.48	1.99%
Sonstige Vermögenswerte					3'306'698.63	1.13%
Gesamtvermögen					294'115'990.62	100.10%
Verbindlichkeiten					-305'216.31	-0.10%
Nettovermögen					293'810'774.31	100.00%

1) Kauf umfasst die Transaktionen: Gratistitel / Käufe / Konversionen / Namensänderungen / "Splits" / Stock- / Wahldividenden / Titelaufteilungen / Überträge / Umbuchungen in Folge Redenominierung in Euro / Umtausch zwischen Gesellschaften / Zuteilungen aus Bezugs- / Optionsrechten / Zuteilung von Bezugsrechten ab Basistiteln

2) Verkauf umfasst die Transaktionen: Auslosungen / Ausbuchung in Folge Verfall / Ausübung von Bezugs- / Optionsrechten / "Reverse Splits" / Überträge / Umbuchungen in Folge Redenominierung in Fondswährung / Umtausch zwischen Gesellschaften / Verkäufe / Rückzahlungen

Auskünfte über Angelegenheiten von besonderer wirtschaftlicher oder rechtlicher Bedeutung

Bewertungsstichtag

Als Basis für den Bericht dient der letzte NAV des Berichtszeitraumes. Dieser wurde per 24.06.2022 berechnet.

Berechnung

Allfällige Abweichungen in den Summenbildungen sind auf Rundungsdifferenzen zurückzuführen.

Mitteilung an die Anteilhaber vom 05.01.2022

Mit dieser Mitteilung wurden die Anteilhaber über folgende Ausschüttung für das 4. Quartal 2021 (Zahltag 10. Januar 2022) informiert:

- Class ID EUR

Es wird eine Ertragsausschüttung von EUR 0.22 pro Anteil und eine Kapitalausschüttung von EUR 1.17 pro Anteil vorgenommen.

Mitteilung an die Anteilhaber vom 15.03.2022

Mit dieser Mitteilung wurden die Anteilhaber über die Änderung in der Berechnung eines Sonder-NAV, Löschung der Anteilklasse Class P CHF (ISIN: LI0542471128) und die Auflegung einer neuen Anteilklasse Class P2 CHF (ISIN: LI1175513228) informiert.

Mitteilung an die Anteilhaber vom 11.04.2022

Mit dieser Mitteilung wurden die Anteilhaber über folgende Ausschüttung für das 1. Quartal 2022 (Zahltag 19. April 2022) informiert:

- Class ID EUR

Es wird eine Ertragsausschüttung von EUR 0.26 pro Anteil und eine Kapitalausschüttung von EUR 0.76 pro Anteil vorgenommen.

Mitteilung an die Anteilhaber vom 20.05.2022

Mit dieser Mitteilung wurden die Anteilhaber über redaktionelle Änderungen sowie der Hinzufügung einer neuen Anteilklasse Class P2D GBP (ISIN: LI1191030926) in Kenntnis gesetzt.

Vergütungsinformation

Die Gesamtsumme der gezahlten Vergütung an die Verwaltung der Berichtsperiode beläuft sich auf USD 830'547.66. Diese teilen sich wie folgt auf:

- Administrationsgebühr: USD 95'324.64
- Vermögensverwaltungsvergütung: USD 735'223.02

Informationen zur aktuellen Vergütungspolitik der Verwaltungsgesellschaft sind im Internet unter www.caiac.li (Dienstleistungen – Anlegerinformationen) veröffentlicht. Hierzu zählen eine Beschreibung der Berechnungsmethoden für Vergütungen und sonstigen Zuwendungen an bestimmte Kategorien von Angestellten sowie Identität der für die Zuteilung der Vergütung und sonstigen Zuwendungen zuständigen Personen. Auf Wunsch des Anlegers werden ihm die Informationen von der Verwaltungsgesellschaft ebenfalls in Papierform kostenlos zur Verfügung gestellt.

Staffelung Verwaltungsaufwand

Die effektive Belastung der Verwaltungsaufwands beträgt für das zurückliegende Geschäftsjahr:

Bis zu einem Nettofondsvermögen von CHF 100 Mio. oder Gegenwert 0.07% p.a.

Für das übersteigende Nettofondsvermögen von CHF 100 Mio. oder Gegenwert 0.05% oder Minimum CHF 15'000.00 p.a.

Staffelung der Verwahrstellengebühr

Die effektive Belastung der Verwahrstellengebühr beträgt für das zurückliegende Geschäftsjahr:

Bis zu einem Nettofondsvermögen von CHF 20 Mio oder Gegenwert 0.08% p.a.

Für das übersteigende Nettofondsvermögen von CHF 20 Mio. oder Gegenwert Mio. 0.05% p.a.

Für das übersteigende Nettofondsvermögen von CHF 100 Mio. oder Gegenwert 0.045% p.a.

Für das übersteigende Nettofondsvermögen von CHF 200 Mio. oder Gegenwert 0.04% p.a.

oder Minimum CHF 12'000.00 p.a.

Zusätzliche Informationen für Anleger in der Schweiz

Der Treuhandvertrag & Prospekt, die wesentlichen Informationen für den Anleger und der Jahres- und Halbjahresbericht, die aktuellen Anteilspreise sowie weitere Informationen zum Fonds, finden Sie kostenlos in deutscher Sprache auf der Webseite des LAFV Liechtensteinischen Anlagefondsverband www.lafv.li und können kostenlos bei der CAIAC Fund Management AG sowie beim Vertreter in der Schweiz angefordert werden. Die Gesamtkostenquote (TER) wurde gemäss den CESR-Vorgaben (CESR-Guideline 09-949/CESR-Guideline 09-1028) berechnet. Dabei weicht diese Berechnung in Bezug auf den Plenum Insurance Capital Fund nicht von der aktuell gültigen „Richtlinie zur Berechnung und Offenlegung der Total Expense Ratio (TER) von kollektiven Kapitalanlagen“ der Swiss Funds & Asset Management Association (SFAMA) ab.

ESG Bestimmungen

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.