

Plenum European Insurance Bond 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 Barend
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	Österreich: Erste Bank der österreichischen Sparkassen AG Am Belvedere 1 AT-1100 Wien 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
Steuerlicher Vertreter	Österreich: BDO Austria GmbH Am Belvedere 4 AT-1100 Wien
Bewertungsintervall	Täglich
Bewertungstag	Jeder liechtensteinische Bankarbeitstag
Ausgabe- und Rücknahmetag	Jeder Bewertungstag
Annahmeschluss Anteilsgeschäft Rücknahme	5 Werktage vor dem Bewertungstag um spätestens 16.00h MEZ (T-5)
Annahmeschluss Anteilsgeschäft	3 Werktage vor dem Bewertungstag um spätestens 16.00h MEZ (T-3)
Valuta Ausgabe- und Rücknahmetag	3 Bankgeschäftstage nach Berechnung des Nettoinventarwertes/NAV (T+3)
Rechnungswährung	EUR
Erfolgsverwendung	THES & AUS – je nach Anteilsklasse
Abschluss Rechnungsjahr	31. Dezember
Fondsdomizil	Barend, 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	LI1103026582 Class I EUR LI1103215169 Class S CHF LI1103215128 Class S EUR
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	bis zu einem Nettofondsvermögen von CHF 30 Mio. oder Gegenwert: Max. 0.13% p.a. für das übersteigende Nettofondsvermögen von CHF 30 Mio. oder Gegenwert: Max. 0.12% p.a. für das übersteigende Nettofondsvermögen von CHF 80 Mio. oder Gegenwert: Max. 0.11% p.a. für das übersteigende Nettofondsvermögen von CHF 130 Mio. oder Gegenwert: Max. 0.10% p.a. für das übersteigende Nettofondsvermögen von CHF 180 Mio. oder Gegenwert: Max. 0.09% p.a. zzgl. Maximum CHF 100'000.- p.a. zzgl. CHF 1'000.- p.a. / Anteilsklasse (thesaurierend) zzgl. CHF 2'500.- p.a. / Anteilsklasse (ausschüttend)
Vermögensverwaltungsvergütung	Class R: Max. 1.00% p.a. Class I: Max. 0.55% p.a. Class I2: Max. 0.50% p.a. Class P: Max. 0.40% p.a. Class S: Max. 0.25% p.a. Class ID: Max. 0.50% p.a. Class M: keine
Performance Fee	keine
Ausgabeaufschlag /-kommission	Max. 5% zugunsten Vertrieb
Rücknahmegebühr /-kommission	keine

Vermögensrechnung

per 30.06.2022

EUR

Bankguthaben, davon	2'080'967.62
Sichtguthaben	2'080'967.62
Zeitguthaben	0.00
Wertpapiere	38'249'915.51
Immobilien	0.00
Derivative Finanzinstrumente	-81'907.09
Rohstoffe und (Edel-)Metalle	0.00
Sonstige Vermögenswerte, davon	733'175.95
Zinsen / Dividenden	693'065.00
Gesamtvermögen	40'982'151.99
Verbindlichkeiten, davon	-36'460.07
gegenüber Banken	-8.31
Darlehen	0.00
Verwahrstellen- / Depotbankgebühren	-6'053.16
Verwaltungs- / Administrationsgebühren	-10'189.51
Vermögensverwaltungsgebühren	-9'454.38
Wertentwicklungsabhängige Gebühren	0.00
Revisionskosten	-7'499.67
Nettovermögen	40'945'691.92
Class I EUR	4'386'480.22
Class S CHF	15'209'056.05
Class S EUR	21'350'155.65
Anzahl der Anteile im Umlauf	
Class I EUR	50'880.000
Class S CHF	173'760.822
Class S EUR	243'581.000
Nettoinventarwert pro Anteil	
Class I EUR	EUR 86.21
Class S CHF	CHF 87.60
Class S EUR	EUR 87.65

Erfolgsrechnung

01.01.2022 - 30.06.2022

EUR

Erträge der Bankguthaben	673.29
Erträge der Wertpapiere, davon	880'754.28
Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen	880'754.28
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	158'543.38
Total Erträge	1'039'970.95
Passivzinsen	-2'168.89
Revisionsaufwand	-8'926.00
Reglementarische Vergütung an die Verwaltung	-73'819.03
Reglementarische Vergütung an die Verwahrstelle / Depotbank	-11'925.61
Sonstige Aufwendungen, davon	-16'982.56
Reise- / Werbekosten	-2'479.47
Ausrichtung laufender Erträge bei der Rücknahme von Anteilen	-30'523.30
Total Aufwendungen	-144'345.39
Nettoertrag	895'625.56
Realisierte Kapitalgewinne und Kapitalverluste	-643'975.58
Realisierter Erfolg	251'649.98
Nicht realisierte Kapitalgewinne und Kapitalverluste	-5'870'714.24
Gesamterfolg	-5'619'064.26

Ausserbilanzgeschäfte

per 30.06.2022

Bezeichnung	Währung	Anzahl	Bezugsverhältnis	Delta	Marktwert Underlying	Derivate-risiko	in % vom Gesamtvermögen
10YNTS.FUT.SEP22	USD	-10.00	0.00	1.0000	132.91	-1'271'282.70	-3.1020%
EUREX/F 202209 FGBL	EUR	-4.00	0.00	1.0000	148.78	-595'120.00	-1.4521%

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

EUR

Nettoertrag des Rechnungsjahres	895'625.56
Zur Ausschüttung bestimmte Kapitalgewinne des Rechnungsjahres	0.00
Zur Ausschüttung bestimmte Kapitalgewinne früherer Rechnungsjahre	0.00
Vortrag des Vorjahres	0.00
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	895'625.56
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg	0.00
Zur Wiederanlage zurückbehaltener Erfolg	895'625.56
Vortrag auf neue Rechnung	0.00

Veränderung des Nettovermögens

01.01.2022 - 30.06.2022

EUR

Nettovermögen zu Beginn der Berichtsperiode	37'244'887.81
Saldo aus dem Anteilsverkehr	9'319'868.36
Gesamterfolg	-5'619'064.26
Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode	40'945'691.91

Anzahl Anteile im Umlauf

01.01.2022 - 30.06.2022

Class I EUR

Anteile zu Beginn der Periode	50'300.000
Neu ausgegebene Anteile	2'380.000
Zurückgenommene Anteile	-1'800.000
Anteile am Ende der Periode	50'880.000

Class S CHF

Anteile zu Beginn der Periode	119'330.000
Neu ausgegebene Anteile	54'930.822
Zurückgenommene Anteile	-500.000
Anteile am Ende der Periode	173'760.822

Class S EUR

Anteile zu Beginn der Periode	197'934.000
Neu ausgegebene Anteile	67'367.000
Zurückgenommene Anteile	-21'720.000
Anteile am Ende der Periode	243'581.000

Entwicklung des Nettoinventarwertes

Datum	Nettovermögen	Anzahl Anteile	Nettoinventarwert	Performance
Class I EUR				
16.04.2021	1'200'000.00 EUR	12'000.000	100.00 EUR	
31.12.2021	5'091'004.99 EUR	50'300.000	101.21 EUR	1.21%
30.06.2022	4'386'480.22 EUR	50'880.000	86.21 EUR	-14.82%*
Class S CHF				
18.03.2021	11'498'000.00 CHF	114'980.000	100.00 CHF	
31.12.2021	12'242'900.34 CHF	119'330.000	102.60 CHF	2.60%
30.06.2022	15'222'159.56 CHF	173'760.822	87.60 CHF	-14.62%*
Class S EUR				
18.03.2021	10'876'000.00 EUR	108'760.000	100.00 EUR	
31.12.2021	20'338'233.75 EUR	197'934.000	102.75 EUR	2.75%
30.06.2022	21'350'155.65 EUR	243'581.000	87.65 EUR	-14.70%*

* 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

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

UBS AG
Bahnhofstrasse 45
CH-8001 Zürich

Währungstabelle

per 30.06.2022

			EUR
Britisches Pfund	GBP	1.00	1.1616
Holländischer Gulden	NLG	100.00	0.0000
Schwedische Krone	SEK	100.00	9.3343
Schweizer Franken	CHF	1.00	0.9991
US-Dollar	USD	1.00	0.9565

Total Expense Ratio (TER)

per 30.06.2022

Class I EUR

TER 1: laufende ordentliche Gebühren und ausserordentliche Dispositionsgebühren ohne Performance Fee 0.84% p.a.

TER 2: laufende ordentliche Gebühren und ausserordentliche Dispositionsgebühren mit Performance Fee 0.84% p.a.

Class S CHF

TER 1: laufende ordentliche Gebühren und ausserordentliche Dispositionsgebühren ohne Performance Fee 0.54% p.a.

TER 2: laufende ordentliche Gebühren und ausserordentliche Dispositionsgebühren mit Performance Fee 0.54% p.a.

Class S EUR

TER 1: laufende ordentliche Gebühren und ausserordentliche Dispositionsgebühren ohne Performance Fee 0.54% p.a.

TER 2: laufende ordentliche Gebühren und ausserordentliche Dispositionsgebühren mit Performance Fee 0.54% p.a.

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

Transaktionskosten

01.01.2022 - 30.06.2022

	EUR
Spesen	9'247.99
Courtage	3'922.78

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 EUR	Anteil in %
Wertpapiere						
Wertpapiere, die an einer Börse gehandelt werden						
Obligationen						
Belgien						
BE6317598850 - AGEAS FTFBN-S	1'000'000.00	1'200'000.00	600'000.00	1'600'000.00	1'247'584.00	3.05%
Summe Belgien					1'247'584.00	3.05%
Bermudainseln						
XS2312752400 - Lancashire Hold/Bd 20410918 JrSub	1'700'000.00	0.00	0.00	1'700'000.00	1'373'317.71	3.35%
Summe Bermudainseln					1'373'317.71	3.35%
Deutschland						
DE000A14J9N8 - Allianz/Bd 20450707 Sub Unsec RegS	0.00	500'000.00	0.00	500'000.00	482'655.00	1.18%
US018820AB64 - Allianz/CoCo Perp Sub 144A	1'200'000.00	0.00	0.00	1'200'000.00	843'311.49	2.06%
USX10001AB51 - Allianz/CoCo Perp Sub RegS	1'400'000.00	0.00	0.00	1'400'000.00	981'720.79	2.40%
XS1109836038 - HANNOVER RUECK VRN	0.00	1'000'000.00	1'000'000.00	0.00	0.00	0.00%
XS2381261424 - Muenchener Ruec/Bd 20420526 Sub RegS	400'000.00	0.00	400'000.00	0.00	0.00	0.00%
XS1843448314 - Muenchener Ruec/Bd 20490526 JrSub	0.00	400'000.00	400'000.00	0.00	0.00	0.00%
XS2378468420 - Wuestenrot & Wu/Bd 20410910 Sub	1'000'000.00	0.00	0.00	1'000'000.00	733'050.00	1.79%
Summe Deutschland					3'040'737.28	7.43%
Frankreich						
XS2431029441 - AXA 42 -S FTVN	0.00	1'100'000.00	1'100'000.00	0.00	0.00	0.00%
XS1799611642 - AXA 49 REG S FTFN	0.00	1'100'000.00	1'100'000.00	0.00	0.00	0.00%
XS0876682666 - AXA EMTN	1'050'000.00	0.00	1'050'000.00	0.00	0.00	0.00%
XS1489814340 - AXA Open EMTN-S	1'100'000.00	0.00	500'000.00	600'000.00	471'758.57	1.15%
XS2487052487 - AXA/Bd 20430310 JrSub	0.00	1'000'000.00	1'000'000.00	0.00	0.00	0.00%
FR0014002RQ0 - CNP Assurances/Bd Perp JrSub RegS	1'200'000.00	0.00	0.00	1'200'000.00	900'301.30	2.20%
FR0012317758 - CNP Assurances/Bd Perp Sub	0.00	500'000.00	0.00	500'000.00	490'000.00	1.20%
FR0013322823 - SCOR WFM Fixed/Floating Rate	1'800'000.00	0.00	0.00	1'800'000.00	1'394'442.58	3.41%
Summe Frankreich					3'256'502.45	7.95%
Grossbritannien						
XS1488459485 - Aviva/Bd 20490912 Sub Ser-13 RegS	600'000.00	0.00	600'000.00	0.00	0.00	0.00%
XS2485268150 - Aviva/Bd Perp JrSub	0.00	1'000'000.00	0.00	1'000'000.00	1'062'095.84	2.59%
XS0177447983 - Aviva/Bd Perp Sub Unsec RegS	0.00	2'000'000.00	1'500'000.00	500'000.00	583'618.35	1.43%
XS0237631097 - Brit/Var Bd 20301209 Sub RegS	1'000'000.00	0.00	0.00	1'000'000.00	946'744.07	2.31%
XS2434439548 - CHESNA 32 BDS	0.00	1'200'000.00	0.00	1'200'000.00	1'182'791.18	2.89%
XS1728036366 - Direct Line Ins/CoCo Perp Sub RegS	1'200'000.00	800'000.00	0.00	2'000'000.00	1'787'778.07	4.37%
XS2190956941 - LEGAL&GE -S CCVFTVN	600'000.00	0.00	0.00	600'000.00	590'559.20	1.44%
XS1888930150 - M&G/Bd 20481020 JrSub RegS	800'000.00	0.00	0.00	800'000.00	788'330.38	1.93%
XS1639849204 - Phoenix Grp/5.375 Bd 20270706 Sub	200'000.00	0.00	0.00	200'000.00	185'020.80	0.45%

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	EUR	in %
XS2182954797 - Phoenix Grp/EMTN 20310904 Sub Ser-5 Tra-1 RegS	800'000.00	0.00	0.00	800'000.00	715'328.33	1.75%
XS1243995302 - PRUDENTIAL 55 VRN	400'000.00	0.00	400'000.00	0.00	0.00	0.00%
XS1488414464 - Prudential Open 36 MTN-S	2'000'000.00	0.00	2'000'000.00	0.00	0.00	0.00%
XS1700429480 - Prudential/4.875 Bd Perp Sub	0.00	500'000.00	0.00	500'000.00	442'321.49	1.08%
XS2399976195 - Rothesay Life/CoCo Perp JrSub Ser-NC6	1'600'000.00	0.00	0.00	1'600'000.00	1'274'857.71	3.11%
XS1558089261 - SOCIETY OF LL47FTFB	730'000.00	0.00	0.00	730'000.00	826'846.20	2.02%
XS2434427709 - UTMOST GRP FTVB	0.00	400'000.00	0.00	400'000.00	365'873.02	0.89%
XS2384717703 - Utmost Grp/4 Bd 20311215 Sub	1'000'000.00	0.00	0.00	1'000'000.00	908'467.73	2.22%
Summe Grossbritannien					11'660'632.37	28.48%
Irland						
XS1508669790 - BEAZLE26NTS-S	300'000.00	0.00	0.00	300'000.00	281'519.92	0.69%
XS2010045438 - BEAZLEY 29BDS-S	1'000'000.00	0.00	0.00	1'000'000.00	894'256.06	2.18%
XS1385999492 - Cloverie/Bd 20460624 Sub Ser-01 Gtd RegS	0.00	1'500'000.00	1'500'000.00	0.00	0.00	0.00%
XS2416978190 - ZURICH 52 VRB	1'000'000.00	0.00	1'000'000.00	0.00	0.00	0.00%
Summe Irland					1'175'775.98	2.87%
Italien						
XS0257010206 - ASSICURAZ GENERALI 2006 VRN	1'250'000.00	0.00	1'250'000.00	0.00	0.00	0.00%
XS1140860534 - GENERALI FIN-S FTFN	0.00	1'500'000.00	0.00	1'500'000.00	1'457'250.00	3.56%
XS1078235733 - UNIPOLSAI VRN	700'000.00	900'000.00	0.00	1'600'000.00	1'560'960.00	3.81%
XS2249600771 - UnipolSai/CoCo Perp JrSub	600'000.00	0.00	0.00	600'000.00	528'060.00	1.29%
Summe Italien					3'546'270.00	8.66%
Niederlande						
XS2056491660 - Achmea/EMTN 20390924 Sub	500'000.00	0.00	0.00	500'000.00	404'900.00	0.99%
XS1886478806 - AEGON -S CCVFTVN	0.00	600'000.00	0.00	600'000.00	551'610.00	1.35%
NL0000120889 - Aegon/Bd Perp Sub	1'000'000.00	0.00	0.00	1'000'000.00	317'464.64	0.78%
XS1261170515 - ARGENTUM 50 VRN	450'000.00	0.00	450'000.00	0.00	0.00	0.00%
XS1418788755 - Argentum Nethld/Bd 20461001 Sub Unsec RegS	0.00	500'000.00	0.00	500'000.00	490'000.00	1.20%
XS1795323952 - Argentum Nethld/Bd 20480601 SrSub RegS	239'000.00	0.00	239'000.00	0.00	0.00	0.00%
XS1423777215 - Argentum Nethld/Bd 20520815 Sub RegS	1'250'000.00	0.00	500'000.00	750'000.00	679'767.08	1.66%
XS1700709683 - ASR CV FTVB	800'000.00	700'000.00	0.00	1'500'000.00	1'263'000.00	3.08%
XS2468390930 - Athora NL/Bd 20320831 JrSub Unsec RegS	0.00	700'000.00	0.00	700'000.00	673'225.00	1.64%
XS1028942354 - ATRADIUS FIN 44 VRN	830'000.00	1'250'000.00	0.00	2'080'000.00	2'076'464.00	5.07%
XS1076781589 - Delta Lloyd VRN	0.00	400'000.00	0.00	400'000.00	399'960.00	0.98%
XS1209031019 - ELM VRN JUNIOR	0.00	1'250'000.00	0.00	1'250'000.00	1'160'375.00	2.83%
XS1028950290 - NN GROUP VRN REG-S	750'000.00	1'000'000.00	750'000.00	1'000'000.00	975'000.00	2.38%
Summe Niederlande					8'991'765.72	21.96%
Norwegen						

Vermögensinventar per 30.06.2022

Käufe und Verkäufe 01.01.2022 - 30.06.2022

Bezeichnung	Bestand	Kauf	Verkauf	Bestand	Marktwert EUR	Anteil in %
	01.01.2022	1)	2)	30.06.2022		
XS2325328313 - Storebrand Livs/Bd 20510930 Sub RegS	500'000.00	0.00	0.00	500'000.00	379'725.00	0.93%
Summe Norwegen					379'725.00	0.93%
Spanien						
ES0224244097 - MAPFRE 48 FTFB	700'000.00	400'000.00	0.00	1'100'000.00	1'017'720.00	2.49%
Summe Spanien					1'017'720.00	2.49%
Österreich						
XS2199567970 - UNIQA 35 FTFB	0.00	1'700'000.00	0.00	1'700'000.00	1'582'785.00	3.87%
XS2418392143 - UNIQA 41 FTFN	100'000.00	900'000.00	1'000'000.00	0.00	0.00	0.00%
Summe Österreich					1'582'785.00	3.87%
Summe Obligationen					37'272'815.51	91.03%
Summe Wertpapiere, die an einer Börse gehandelt werden					37'272'815.51	91.03%
Wertpapiere, die an einem anderen geregeltm Markt gehandelt werden						
Obligationen						
Deutschland						
USD5558XAA66 - MUNICH 42 -S FTFB	0.00	400'000.00	400'000.00	0.00	0.00	0.00%
Summe Deutschland					0.00	0.00%
Summe Obligationen					0.00	0.00%
Summe Wertpapiere, die an einem anderen geregeltm Markt gehandelt werden					0.00	0.00%
Wertpapiere, die nicht an einem geregelten Markt gehandelt werden						
Obligationen						
Österreich						
AT0000A1VGA1 - Vienna Insur Gr/Bd 20470413 JrSub	0.00	1'000'000.00	0.00	1'000'000.00	977'100.00	2.39%
Summe Österreich					977'100.00	2.39%
Summe Obligationen					977'100.00	2.39%
Summe Wertpapiere, die nicht an einem geregelten Markt gehandelt werden					977'100.00	2.39%
Summe Wertpapiere					38'249'915.51	93.42%
Derivate						
Derivate, die an einer Börse gehandelt werden						
Futures						
Deutschland						
DE000C6EBR73 - EUREX/F 202203 FGBL	0.00	8.00	8.00	0.00	0.00	0.00%
DE000C1T6JE8 - EUREX/F 202206 FGBL	0.00	8.00	8.00	0.00	0.00	0.00%
DE000C6J0K11 - EUREX/F 202209 FGBL	0.00	4.00	8.00	-4.00	7'040.00	0.02%
Summe Deutschland					7'040.00	0.02%
Grossbritannien						
GB00JH7JGJ18 - ICE Futures EU/F 202203 R	-13.00	24.00	11.00	0.00	0.00	0.00%
GB00JL6LY922 - ICE Futures EU/F 202206 R	0.00	24.00	24.00	0.00	0.00	0.00%
Summe Grossbritannien					0.00	0.00%
USA						
95352388 - 10YNTS.FUT.SEP22	0.00	0.00	10.00	-10.00	16'290.83	0.04%
89438579 - CME Group/F 202203 ZN	-18.00	18.00	0.00	0.00	0.00	0.00%
92204405 - Future 10YNTS FUT JUN22	0.00	18.00	18.00	0.00	0.00	0.00%
Summe USA					16'290.83	0.04%
Summe Futures					23'330.83	0.06%

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 EUR	Anteil in %
Summe Derivate, die an einer Börse gehandelt werden					23'330.83	0.06%
Derivate, die nicht an einem geregelten Markt gehandelt werden						
Devisentermingeschäfte						
Liechtenstein						
FXF000008372 - MASTER // EUR/GBP 0.83 01.04.22	0.00	8'592'179.71	7'200'000.00	0.00	0.00	0.00%
FXF000008449 - MASTER // EUR/GBP 0.83 01.04.22	0.00	1'079'184.70	900'000.00	0.00	0.00	0.00%
FXF000008590 - MASTER // EUR/GBP 0.83 01.07.22	0.00	595'155.20	500'000.00	0.00	0.00	0.00%
FXF000008512 - MASTER // EUR/GBP 0.83 07.04.22	0.00	600'152.34	500'000.00	0.00	0.00	0.00%
FXF000008293 - MASTER // EUR/GBP 0.84 07.01.22	0.00	1'181'671.62	995'000.00	0.00	0.00	0.00%
FXF000008554 - MASTER // EUR/GBP 0.85 01.07.22	0.00	8'833'310.44	7'525'000.00	0.00	0.00	0.00%
FXF000008715 - MASTER // EUR/GBP 0.85 01.07.22	0.00	995'538.93	850'000.00	0.00	0.00	0.00%
FXF000008750 - MASTER // EUR/GBP 0.86 30.09.22	0.00	8'353'210.56	7'260'000.00	0.00	-41'363.20	-0.10%
FXF000008194 - MASTER // EUR/GBP 1.16 07.01.22	0.00	9'771'531.25	8'365'000.00	0.00	0.00	0.00%
FXF000008193 - MASTER // EUR/SEK 0.09 07.01.22	0.00	392'157.60	4'000'000.00	0.00	0.00	0.00%
FXF000008195 - MASTER // EUR/USD 0.85 07.01.22	0.00	14'092'692.90	16'500'000.00	0.00	0.00	0.00%
FXF000008751 - MASTER // EUR/USD 1.05 30.09.22	0.00	11'246'405.05	11'900'000.00	0.00	-64'424.28	-0.16%
FXF000008555 - MASTER // EUR/USD 1.11 01.07.22	0.00	14'726'431.75	16'490'000.00	0.00	0.00	0.00%
FXF000008373 - MASTER // EUR/USD 1.13 01.04.22	0.00	17'473'650.00	19'850'000.00	0.00	0.00	0.00%
FXF000008339 - MASTER // EUR/USD 1.13 07.01.22	0.00	442'046.59	500'000.00	0.00	0.00	0.00%
FXF000008218 - MASTER // EUR/USD 1.15 07.01.22	0.00	500'253.80	580'000.00	0.00	0.00	0.00%
FXF000008236 - MASTER // EUR/USD 1.16 07.01.22	0.00	267'073.79	310'000.00	0.00	0.00	0.00%
FXF000008209 - MASTER // EUR/USD 1.16 07.01.22	0.00	498'832.77	580'000.00	0.00	0.00	0.00%
FXF000008255 - MASTER // EUR/USD 1.16 07.01.22	0.00	1'377'624.30	1'600'000.00	0.00	0.00	0.00%
FXF000008535 - MASTER // GBP/EUR 0.83 01.04.22	0.00	600'000.00	714'544.31	0.00	0.00	0.00%
FXF000008237 - MASTER // GBP/EUR 0.84 07.01.22	0.00	100'000.00	118'462.60	0.00	0.00	0.00%
FXF000008256 - MASTER // GBP/EUR 0.84 07.01.22	0.00	1'150'000.00	1'360'194.53	0.00	0.00	0.00%
FXF000008719 - MASTER // GBP/EUR 0.85 01.07.2022	0.00	325'000.00	378'256.48	0.00	0.00	0.00%
FXF000008693 - MASTER // GBP/EUR 0.85 01.07.22	0.00	1'500'000.00	1'763'429.78	0.00	0.00	0.00%
FXF000008691 - MASTER // GBP/EUR 0.85 01.07.22	0.00	250'000.00	293'209.39	0.00	0.00	0.00%
FXF000008203 - MASTER // GBP/EUR 1.15 07.01.22	0.00	350'000.00	404'317.80	0.00	0.00	0.00%
FXF000008215 - MASTER // SEK/EUR 10.18 07.01.22	0.00	4'000'000.00	392'638.76	0.00	0.00	0.00%
FXF000008718 - MASTER // USD/EUR 1.05 01.07.22	0.00	350'000.00	332'443.57	0.00	0.00	0.00%
FXF000008743 - MASTER // USD/EUR 1.05 01.07.22	0.00	2'500'000.00	2'369'573.91	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	EUR	in %
FXF000008690 - MASTER // USD/EUR 1.06 01.07.22	0.00	1'150'000.00	1'075'237.65	0.00	0.00	0.00%
FXF000008534 - MASTER // USD/EUR 1.10 01.04.22	0.00	1'300'000.00	1'178'670.04	0.00	0.00	0.00%
FXF000008476 - MASTER // USD/EUR 1.13 01.04.22	0.00	341'164.62	300'000.00	0.00	0.00	0.00%
FXF000008430 - MASTER // USD/EUR 1.13 01.04.22	0.00	500'000.00	440'736.69	0.00	0.00	0.00%
FXF000008454 - MASTER // USD/EUR 1.14 01.04.22	0.00	1'200'000.00	1'046'730.22	0.00	0.00	0.00%
FXF000008752 - S CHF // CHF/EUR 1.00 30.09.22	0.00	15'430'000.00	15'416'835.56	0.00	549.56	0.00%
FXF000008425 - S CHF // CHF/EUR 1.03 01.04.22	0.00	110'000.00	105'775.64	0.00	0.00	0.00%
FXF000008371 - S CHF // CHF/EUR 1.03 01.04.22	0.00	12'315'000.00	11'872'640.84	0.00	0.00	0.00%
FXF000008556 - S CHF // CHF/EUR 1.03 01.07.22	0.00	12'715'000.00	12'330'630.81	0.00	0.00	0.00%
FXF000008413 - S CHF // CHF/EUR 1.04 01.04.22	0.00	370'000.00	353'023.12	0.00	0.00	0.00%
FXF000008705 - S CHF // CHF/EUR 1.04 01.07.22	0.00	3'350'000.00	3'202'851.40	0.00	0.00	0.00%
FXF000008196 - S CHF // CHF/EUR 1.08 07.01.22	0.00	12'400'000.00	11'439'442.59	0.00	0.00	0.00%
FXF000008720 - S CHF // EUR/CHF 1.01 01.07.22	0.00	490'912.87	500'000.00	0.00	0.00	0.00%
FXF000008533 - S CHF // EUR/CHF 1.02 01.04.22	0.00	121'487.66	125'000.00	0.00	0.00	0.00%
FXF000008694 - S CHF // EUR/CHF 1.03 01.07.22	0.00	96'665.10	100'000.00	0.00	0.00	0.00%
Summe Liechtenstein					-105'237.92	-0.26%
Summe Devisentermingeschäfte					-105'237.92	-0.26%
Summe Derivate, die nicht an einem geregelten Markt gehandelt werden					-105'237.92	-0.26%
Summe Derivate					-81'907.09	-0.20%
Bankguthaben						
Sichtguthaben					2'080'967.62	5.08%
Zeitguthaben					0.00	0.00%
Summe Bankguthaben					2'080'967.62	5.08%
Sonstige Vermögenswerte					733'175.95	1.79%
Gesamtvermögen					40'982'151.99	100.09%
Verbindlichkeiten					-36'460.07	-0.09%
Nettovermögen					40'945'691.92	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 30.06.2022 berechnet.

Berechnung

Allfällige Abweichungen in den Summenbildungen sind auf Rundungsdifferenzen zurückzuführen.

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.

Staffelung der Verwahrstellengebühr

Die effektive Belastung der Verwahrstellengebühr beträgt für das zurückliegende Geschäftsjahr:
0.04% p.a. oder Minimum CHF 10'000.00 p.a.

Staffelung Verwaltungsaufwand

Die effektive Belastung der Verwaltungsaufwands beträgt für das zurückliegende Geschäftsjahr:
bis CHF 30 Mio: 0.08% p.a.

für das übersteigende Nettofondsvermögen grösser als CHF 30 Mio: 0.07% p.a.

für das übersteigende Nettofondsvermögen von CHF 80 Mio: 0.06% p.a.

für das übersteigende Nettofondsvermögen von CHF 130 Mio: 0.05% p.a.

für das übersteigende Nettofondsvermögen von CHF 180 Mio: 0.04% p.a.

oder Minimum CHF 20'000.00 p.a.

Vergütungsinformation

Die Gesamtsumme der gezahlten Vergütung an die Verwaltung der Berichtsperiode beläuft sich auf EUR 73'819.03. Diese teilen sich wie folgt auf:

- Administrationsgebühr: EUR 18'342.11
- Vermögensverwaltungsvergütung: EUR 55'476.92

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.

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.