

KAPITALVERWALTUNGSGESELLSCHAFT:



EuropaInvest Dynamic Plus

HALBJAHRESBERICHT

ZUM 30. JUNI 2020

VERWAHRSTELLE:



BERENBERG
PRIVATBANKIERS SEIT 1590

BERATUNG UND VERTRIEB:

KANON

Aktiengesellschaft

**Halbjahresbericht
EuropaInvest Dynamic Plus**

Vermögensübersicht zum 30.06.2020

Anlageschwerpunkte	Tageswert in EUR	% Anteil am Fondsvermögen
I. Vermögensgegenstände	18.229.492,15	100,30
1. Investmentanteile EUR	16.779.345,25 16.779.345,25	92,32 92,32
2. Derivate	1.138.860,00	6,27
3. Bankguthaben	285.219,30	1,57
4. Sonstige Vermögensgegenstände	26.067,60	0,14
II. Verbindlichkeiten	-54.877,71	-0,30
III. Fondsvermögen	18.174.614,44	100,00

Halbjahresbericht

EuropaInvest Dynamic Plus

Vermögensaufstellung zum 30.06.2020

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2020	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Bestandspositionen							EUR	16.779.345,25	92,32
Investmentanteile							EUR	16.779.345,25	92,32
Gruppenfremde Investmentanteile							EUR	16.779.345,25	92,32
AIS-Amundi EURO STOXX 50 Namens-Anteile D Cap.EUR o.N.	LU1681047319		ANT	32.800	1.550	750	EUR 51,050	1.674.440,00	9,21
BNP P.E.FR-EURO STOXX 50 U.ETF Act. au Port. EUR C/D o.N.	FR0012740983		ANT	211.650	17.550	4.600	EUR 7,950	1.682.617,50	9,26
ComSta.-EURO STOXX 50 U.ETF Inhaber-Anteile I o.N.	LU0378434079		ANT	25.060	1.170	560	EUR 66,830	1.674.759,80	9,21
Deka EURO STOXX 50 UCITS ETF Inhaber-Anteile	DE000ETFL029		ANT	52.000	3.700	1.150	EUR 32,585	1.694.420,00	9,32
HSBC EURO STOXX 50 UCITS ETF Registered Shares o.N.	IE00B4K6B022		ANT	49.210	49.210	0	EUR 33,945	1.670.433,45	9,19
I.M.-I.EURO STOXX 50 UETF Registered Shares Dist o.N.	IE00B5B5TG76		ANT	52.950	52.950	0	EUR 32,050	1.697.047,50	9,34
iShares Core EO STOXX.50 U.E.DE Inhaber-Anteile	DE0005933956		ANT	50.900	2.600	1.150	EUR 32,675	1.663.157,50	9,15
LYXOR EURO ST.50 (DR)UCITS ETF Actions au Porteur Dist o.N.	FR0007054358		ANT	52.550	2.600	1.200	EUR 31,905	1.676.607,75	9,22
UBS ETF - EURO STOXX 50 U.ETF Inh.-Ant.(EUR) A-dis o.N.	LU0136234068		ANT	51.150	2.650	1.150	EUR 32,745	1.674.906,75	9,22
Xtrackers Euro Stoxx 50 Inhaber-Anteile 1D o.N.	LU0274211217		ANT	49.400	3.900	1.100	EUR 33,825	1.670.955,00	9,19
Summe Wertpapiervermögen							EUR	16.779.345,25	92,32
Derivate							EUR	1.138.860,00	6,27
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)									
Aktienindex-Derivate							EUR	1.138.860,00	6,27
Forderungen/Verbindlichkeiten									
Optionsrechte							EUR	1.138.860,00	6,27
Optionsrechte auf Aktienindices							EUR	1.138.860,00	6,27
ESTX 50 PR.EUR CALL 16.06.23 BP 3300,00 EUREX		185		Anzahl 1200			EUR 299,500	359.400,00	1,98
ESTX 50 PR.EUR CALL 16.06.23 BP 3800,00 EUREX		185		Anzahl -1800			EUR 134,500	-242.100,00	-1,33
ESTX 50 PR.EUR CALL 16.12.22 BP 3550,00 EUREX		185		Anzahl 1200			EUR 181,200	217.440,00	1,20

Halbjahresbericht

EuropaInvest Dynamic Plus

Vermögensaufstellung zum 30.06.2020

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2020	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
ESTX 50 PR.EUR CALL 16.12.22 BP 3800,00 EUREX		185	Anzahl	500			EUR 111,700	55.850,00	0,31
ESTX 50 PR.EUR CALL 16.12.22 BP 4300,00 EUREX		185	Anzahl	-1800			EUR 36,500	-65.700,00	-0,36
ESTX 50 PR.EUR CALL 16.12.22 BP 4700,00 EUREX		185	Anzahl	-750			EUR 13,400	-10.050,00	-0,06
ESTX 50 PR.EUR CALL 17.06.22 BP 3350,00 EUREX		185	Anzahl	1000			EUR 231,400	231.400,00	1,27
ESTX 50 PR.EUR CALL 17.06.22 BP 3550,00 EUREX		185	Anzahl	200			EUR 156,800	31.360,00	0,17
ESTX 50 PR.EUR CALL 17.06.22 BP 3800,00 EUREX		185	Anzahl	500			EUR 88,900	44.450,00	0,24
ESTX 50 PR.EUR CALL 17.06.22 BP 4000,00 EUREX		185	Anzahl	-1500			EUR 52,400	-78.600,00	-0,43
ESTX 50 PR.EUR CALL 17.06.22 BP 4200,00 EUREX		185	Anzahl	-300			EUR 28,800	-8.640,00	-0,05
ESTX 50 PR.EUR CALL 17.06.22 BP 4400,00 EUREX		185	Anzahl	-750			EUR 14,800	-11.100,00	-0,06
ESTX 50 PR.EUR CALL 17.12.21 BP 3150,00 EUREX		185	Anzahl	800			EUR 325,800	260.640,00	1,43
ESTX 50 PR.EUR CALL 17.12.21 BP 3550,00 EUREX		185	Anzahl	400			EUR 141,700	56.680,00	0,31
ESTX 50 PR.EUR CALL 17.12.21 BP 3800,00 EUREX		185	Anzahl	-300			EUR 72,400	-21.720,00	-0,12
ESTX 50 PR.EUR CALL 17.12.21 BP 3850,00 EUREX		185	Anzahl	500			EUR 62,300	31.150,00	0,17
ESTX 50 PR.EUR CALL 17.12.21 BP 3900,00 EUREX		185	Anzahl	-900			EUR 53,200	-47.880,00	-0,26
ESTX 50 PR.EUR CALL 17.12.21 BP 4050,00 EUREX		185	Anzahl	-600			EUR 32,100	-19.260,00	-0,11
ESTX 50 PR.EUR CALL 17.12.21 BP 4300,00 EUREX		185	Anzahl	-750			EUR 12,800	-9.600,00	-0,05
ESTX 50 PR.EUR CALL 18.06.21 BP 3100,00 EUREX		185	Anzahl	800			EUR 324,100	259.280,00	1,43
ESTX 50 PR.EUR CALL 18.06.21 BP 3550,00 EUREX		185	Anzahl	400			EUR 107,600	43.040,00	0,24
ESTX 50 PR.EUR CALL 18.06.21 BP 3600,00 EUREX		185	Anzahl	-300			EUR 92,000	-27.600,00	-0,15
ESTX 50 PR.EUR CALL 18.06.21 BP 3700,00 EUREX		185	Anzahl	-900			EUR 65,700	-59.130,00	-0,33
ESTX 50 PR.EUR CALL 18.06.21 BP 3900,00 EUREX		185	Anzahl	-600			EUR 30,200	-18.120,00	-0,10
ESTX 50 PR.EUR CALL 18.09.20 BP 3750,00 EUREX		185	Anzahl	-600			EUR 6,600	-3.960,00	-0,02
ESTX 50 PR.EUR CALL 18.12.20 BP 3150,00 EUREX		185	Anzahl	800			EUR 271,500	217.200,00	1,20
ESTX 50 PR.EUR CALL 18.12.20 BP 3500,00 EUREX		185	Anzahl	-300			EUR 93,500	-28.050,00	-0,15
ESTX 50 PR.EUR CALL 18.12.20 BP 3600,00 EUREX		185	Anzahl	-900			EUR 61,800	-55.620,00	-0,31
ESTX 50 PR.EUR CALL 19.03.21 BP 3300,00 EUREX		185	Anzahl	1200			EUR 212,800	255.360,00	1,41
ESTX 50 PR.EUR CALL 19.03.21 BP 3500,00 EUREX		185	Anzahl	-1800			EUR 120,700	-217.260,00	-1,20

Halbjahresbericht

EuropaInvest Dynamic Plus

Vermögensaufstellung zum 30.06.2020

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2020	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds							EUR	285.219,30	1,57
Bankguthaben							EUR	285.219,30	1,57
Guthaben bei Joh. Berenberg, Gossler & Co. Hamburg (V)									
Guthaben in Fondswährung									
			EUR	285.219,30			% 100,000	285.219,30	1,57
Sonstige Vermögensgegenstände							EUR	26.067,60	0,14
Ansprüche auf Ausschüttung									
			EUR	26.067,60				26.067,60	0,14
Sonstige Verbindlichkeiten							EUR	-54.877,71	-0,30
Zinsverbindlichkeiten									
			EUR	-100,69				-100,69	0,00
Verwaltungsvergütung									
			EUR	-26.954,40				-26.954,40	-0,15
Verwahrstellenvergütung									
			EUR	-2.852,17				-2.852,17	-0,02
Anlageberatungsvergütung									
			EUR	-21.970,45				-21.970,45	-0,12
Prüfungskosten									
			EUR	-2.500,00				-2.500,00	-0,01
Veröffentlichungskosten									
			EUR	-500,00				-500,00	0,00
Fondsvermögen							EUR	18.174.614,44	100,00 1)
Anteilwert							EUR	107,65	
Ausgabepreis							EUR	113,03	
Anteile im Umlauf							STK	168.823	

Fußnoten:

1) Durch Rundung der Prozent-Anteile bei der Berechnung können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.

Halbjahresbericht EuropaInvest Dynamic Plus

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Marktschlüssel

b) Terminbörsen
185

Eurex Deutschland

Halbjahresbericht EuropaInvest Dynamic Plus

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
Investmentanteile					
Gruppenfremde Investmentanteile					
HSBC EURO STOXX 50 UCITS ETF Bearer Shares (Dt. Zert.) o.N.	DE000A1C0BB7	ANT	1.000	48.750	
Vanguard Euro STOXX 50 U.ETF Registered Shares EUR Dis.oN	IE00BF4R5F15	ANT	4.400	76.100	

Derivate

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

Optionsrechte

Optionsrechte auf Aktienindex-Derivate

Optionsrechte auf Aktienindices

Verkaufte Kaufoptionen (Call):
(Basiswert(e): ESTX 50 PR.EUR)

EUR

81,22

Die Gesellschaft sorgt dafür, dass eine unangemessene Beeinträchtigung von Anlegerinteressen durch Transaktionskosten vermieden wird, indem unter Berücksichtigung der Anlageziele dieses Sondervermögens ein Schwellenwert für die Transaktionskosten bezogen auf das durchschnittliche Fondsvolumen sowie für eine Portfolioumschlagsrate festgelegt wurde. Die Gesellschaft überwacht die Einhaltung der Schwellenwerte und ergreift im Falle des Überschreitens weitere Maßnahmen.

Halbjahresbericht EuropaInvest Dynamic Plus

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)	92,32
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)	6,27

Sonstige Angaben

Anteilwert	EUR	107,65
Ausgabepreis	EUR	113,03
Anteile im Umlauf	STK	168.823

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.

Frankfurt am Main, den 1. Juli 2020

Universal-Investment-Gesellschaft mbH
Die Geschäftsführung

Halbjahresbericht

EuropaInvest Dynamic Plus

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 56.838.000,- (Stand: November 2019)

Geschäftsführer:

Frank Eggloff, München

Katja Müller, Bad Homburg

Markus Neubauer, Frankfurt am Main

Michael Reinhard, Bad Vilbel

Stefan Rockel, Lauterbach (Hessen)

Stephan Scholl, Königstein im Taunus

Axel Vespermann, Dreieich

Aufsichtsrat:

Prof. Dr. Harald Wiedmann (Vorsitzender), Berlin

Dr. Axel Eckhardt, Düsseldorf

Daniel Fischer, Bad Vilbel

Daniel F. Just, Pöcking

2. Verwahrstelle

Joh. Berenberg, Gossler & Co. KG

Hausanschrift:

Neuer Jungfernstieg 20
20354 Hamburg

Postanschrift:

Postfach 30 05 47
20302 Hamburg

Telefon: 040 / 350 60-0

Telefax: 040 / 350 60-900

www.berenberg.de

Rechtsform: Kommanditgesellschaft

Haftendes Eigenkapital: € 289.164.474,97 (Stand: Dezember 2018)

3. Anlageberatungsgesellschaft und Vertrieb

KANON AG

Postanschrift:

Große Straße 88
49074 Osnabrück

Telefon +49 541 200 746-0

Telefax +49 541 200 746-22

www.kanon.ag

4. Anlageausschuss

Thomas Dellwig

KANON Aktiengesellschaft, Osnabrück

Andreas Stahmeyer

KANON Aktiengesellschaft, Osnabrück

Daniel Tellkamp

KANON Aktiengesellschaft, Osnabrück

Stefan Vonderheide

KANON Aktiengesellschaft, Osnabrück

WKN / ISIN: A2JQK3 / DE000A2JQK35