GAMMA PLUS PREMIUM

Halbjahresbericht für die Zeit vom:
04.05.2026 – 31.08.2026

BANTLEON
Institutional Investing

Herausgeber dieses Halbjahresberichts:
BANTLEON Invest Kapitalverwaltungsgesellschaft mbH
Aegidientorplatz 2a, 30159 Hannover
Telefon +49 511 12354-0; Telefax: +49 511 12354-333
https://www.bantleon.com

Hinweis:
Allein verbindliche Grundlage für den Erwerb von Fondsanteilen der hier aufgeführten Fonds ist der jeweils gültige Verkaufsprospekt mit den Vertragsbedingungen.

BANTLEON
Institutional Investing

Halbjahresbericht
für Gamma Plus Premium

Vermögensübersicht zum 31.08.2026

Anlageschwerpunkte	Tageswert in EUR	% Anteil am Fondsvermögen
I. Vermögensgegenstände	**8.392.448,52**	**100,24**
1. Verzinsliche Wertpapiere	7.939.815,98	94,84
2. Derivate	34.405,97	0,41
3. Forderungen	1.356,16	0,02
4. Bankguthaben	416.870,41	4,98
II. Verbindlichkeiten	**-20.259,94**	**-0,24**
III. Fondsvermögen	**8.372.188,58**	**100,00**

Halbjahresbericht
für Gamma Plus Premium

Vermögensaufstellung zum 31.08.2026

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.08.2026	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds-vermögens
Bestandspositionen										
Börsengehandelte Wertpapiere							**EUR**		**1.977.903,37**	**23,62**
Verzinsliche Wertpapiere										
0,2500 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.2017 (2027)	DE0001102416		EUR	1.000	1.000	0	%	98,9569	989.568,85	11,82
Italien, Republik EO-B.O.T. 2026(27)	IT0005695256		EUR	1.000	1.000	0	%	98,8335	988.334,52	11,80
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere							**EUR**		**5.961.912,61**	**71,21**
Verzinsliche Wertpapiere										
Bundesrep.Deutschland Unv.Schatz.A.25/10 f.16.09.26	DE000BU0E337		EUR	1.000	1.000	0	%	99,9100	999.099,54	11,93
Bundesrep.Deutschland Unv.Schatz.A.25/11 f.14.10.26	DE000BU0E345		EUR	1.000	1.000	0	%	99,7260	997.259,90	11,91
Bundesrep.Deutschland Unv.Schatz.A.25/12 f.18.11.26	DE000BU0E352		EUR	1.000	1.000	0	%	99,4939	994.939,44	11,88
Bundesrep.Deutschland Unv.Schatz.A.26/01 f.13.01.27	DE000BU0E360		EUR	1.000	1.000	0	%	99,0861	990.860,68	11,84
Bundesrep.Deutschland Unv.Schatz.A.26/02 f.09.12.26	DE000BU0E378		EUR	1.000	1.000	0	%	99,3487	993.486,93	11,87
Bundesrep.Deutschland Unv.Schatz.A.26/04 f.17.03.27	DE000BU0E394		EUR	1.000	1.000	0	%	98,6266	986.266,12	11,78
Summe Wertpapiervermögen							**EUR**		**7.939.815,98**	**94,84**
Derivate										
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)										
Aktienindex-Derivate							**EUR**		**34.405,97**	**0,41**
Forderungen/Verbindlichkeiten										
Aktienindex-Terminkontrakte										
FUTURE E-Mini S&P 500 Index 09.26		359	USD	Anzahl 29					168.773,16	2,02
Optionsrechte										
Optionsrechte auf Aktienindices										
CALL S&P 500 Index 09.26 7525.00		361		Anzahl -1200			USD	182,3000	-188.472,47	-2,25
PUT S&P 500 Index 10.26 7175.00		361		Anzahl 2000			USD	31,4000	54.105,28	0,65

Halbjahresbericht
für Gamma Plus Premium

Vermögensaufstellung zum 31.08.2026

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.08.2026	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds-vermögens
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrument und Geldmarktfonds							**EUR**		**416.870,41**	**4,98**
Bankguthaben							**EUR**		**416.870,41**	**4,98**
EUR - Guthaben bei:										
Kreissparkasse Köln			EUR	294.899,46			%	100,0000	294.899,46	3,52
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen										
			USD	141.571,68			%	100,0000	121.970,95	1,46
Sonstige Vermögensgegenstände							**EUR**		**1.356,16**	**0,02**
Zinsansprüche			EUR	1.356,16					1.356,16	0,02
Sonstige Verbindlichkeiten							**EUR**		**-20.259,94**	**-0,24**
Verwaltungsvergütung			EUR	-6.166,51					-6.166,51	-0,07
Verwahrstellenvergütung			EUR	-808,55					-808,55	-0,01
Performanceabhängige Managementvergütung			EUR	-9.031,67					-9.031,67	-0,11
Prüfungskosten			EUR	-3.750,43					-3.750,43	-0,04
Veröffentlichungskosten			EUR	-502,78					-502,78	-0,01

Fondsvermögen	**EUR**	**8.372.188,58**	**100,00**
Gamma Plus Premium - Anteilklasse I			
Anteilwert	EUR	102,08	
Anzahl Anteile	STK	79.000,000	
Gamma Plus Premium - Anteilklasse R			
Anteilwert	EUR	102,42	
Anzahl Anteile	STK	1.000,000	
Gamma Plus Premium - Anteilklasse C			
Anteilwert	EUR	100,16	
Anzahl Anteile	STK	2.050,000	

Hinweise:

Aufgrund einer Globalverpfändung dient der Wertpapierbestand ganz oder teilweise der Sicherung von Marginverpflichtungen aus Finanzterminkontrakten.

Halbjahresbericht
für Gamma Plus Premium

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Devisenkurse (in Mengennotiz)

		per 28.08.2026	
US-Dollar	(USD)	1,1607000	= 1 Euro (EUR)

Marktschlüssel

Terminbörsen

359	Chicago Merc. Ex.
361	Chicago - CBOE Opt. Ex.

Halbjahresbericht
für Gamma Plus Premium

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
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere					
Verzinsliche Wertpapiere					
Bundesrep.Deutschland Unv.Schatz.A.25/08 f.15.07.26	DE000BU0E311	EUR	1.000	1.000	
Bundesrep.Deutschland Unv.Schatz.A.25/09 f.19.08.26	DE000BU0E329	EUR	1.000	1.000	
Derivate					
Terminkontrakte					
Aktienindex-Terminkontrakte					
Gekaufte Kontrakte:					
(Basiswert(e): S+P 500)		EUR			10.945,59
Optionsrechte					
Optionsrechte auf Aktienindex-Derivate					
Optionsrechte auf Aktienindices					
Gekaufte Verkaufoptionen (Put):					
(Basiswert(e): S+P 500)		EUR			245,11
Verkaufte Kaufoptionen (Call):					
(Basiswert(e): S+P 500)		EUR			2.952,78

Halbjahresbericht
für Gamma Plus Premium

Überblick der Anteilklassen gemäß § 15 Abs. 1 KARBV

Anteilsklasse	Ertragsverwendung	Mindestanlage-volumen EUR	Verwaltungs-vergütung in % p.a.	Vertriebsprovision	Verwahrstellen-vergütung	Ausgabeaufschlag bis zu 5,00 % p.a., derzeit	Rücknahmeabschlag
Gamma Plus Premium - Anteilklasse I	Thesaurierung	2.500.000,00	0,850	0,000	0,040	0,000	0,000
Gamma Plus Premium - Anteilklasse R	Thesaurierung	0,00	1,750	0,000	0,040	0,000	0,000
Gamma Plus Premium - Anteilklasse C	Thesaurierung	100.000,00	1,150	0,000	0,040	0,000	0,000

Halbjahresbericht
für Gamma Plus Premium

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)	**94,84**
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)	**0,41**

Sonstige Angaben

Gamma Plus Premium - Anteilklasse I

Anteilwert	EUR	102,08
Anzahl Anteile	STK	79.000,000

Gamma Plus Premium - Anteilklasse R

Anteilwert	EUR	102,42
Anzahl Anteile	STK	1.000,000

Gamma Plus Premium - Anteilklasse C

Anteilwert	EUR	100,16
Anzahl Anteile	STK	2.050,000

Angewandte Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände (§§ 26 bis 29 und 34 KARBV)

Der Anteilwert wird gem. § 169 KAGB von der BANTLEON Invest Kapitalverwaltungsgesellschaft mbH ermittelt.

Die der Anteilwertermittlung im Falle von handelbaren Kursen zugrunde liegenden Wertpapierkurse bzw. Marktsätze werden von der Gesellschaft täglich selbst über verschiedene Datenanbieter bezogen. Dabei erfolgt die Bewertung für Rentenpapiere mit Kursen per 17:15 Uhr des Börsenvortages und die Bewertung von Aktien und börsengehandelten Aktienderivaten mit Schlusskursen des Börsenvortages. Die Einspielung von Zinskurven sowie Kassa- und Terminkursen für die Bewertung von Devisentermingeschäften und Rentenderivaten erfolgt parallel zu den Rentenpapieren mit Kursen per 17:15 Uhr.

Für Vermögensgegenstände, die weder zum Handel an einer Börse noch an einem organisierten Markt zugelassen sind oder für die kein handelbarer Kurs verfügbar ist, werden gem. § 168 Abs. 3 KAGB die Verkehrswerte zugrunde gelegt, die sich bei sorgfältiger Einschätzung auf Basis geeigneter Bewertungsmodelle unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten ergeben (§ 28 Abs. 1 KARBV). Die Verkehrswerte werden in einem mehrstufigen Bewertungsverfahren ermittelt. Die der Anteilwertermittlung im Falle von nicht handelbaren Kursen zugrunde liegenden Wertpapierkurse bzw. Marktsätze werden soweit möglich aus Kursen vergleichbarer Wertpapiere bzw. Renditekursen abgeleitet.

Die bezogenen Kurse werden täglich auf Vollständigkeit und Plausibilität geprüft. Hierzu prüft die Gesellschaft in Abhängigkeit von der Assetklasse die Kursbewegungen zum Vortag, die Kursaktualität, die Abweichungen gegen weitere Kursquellen sowie die Inputparameter für Modellbewertungen.

Halbjahresbericht
für Gamma Plus Premium

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Investmentanteile werden mit ihrem letzten festgestellten und erhältlichen Net Asset Value bewertet.

Die Bankguthaben und übrigen Forderungen werden mit dem Nominalbetrag, die übrigen Verbindlichkeiten mit dem Rückzahlungsbetrag angesetzt. Festgelder werden - sofern sie kündbar sind und die Rückzahlung bei der Kündigung nicht zum Nennwert zuzüglich Zinsen erfolgt - mit dem Verkehrswert bewertet.

Hinweis an die Anleger

Angaben zu ökologischen und sozialen Merkmalen gem. Offenlegungsverordnung finden sich im Anhang "Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019 / 2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020 / 852 genannten Finanzprodukten" des Jahresberichts.

Weitere zum Verständnis des Berichts erforderliche Angaben

Hinweis zu den Finanzaufstellungen:
Auf Grund von Rundungen bei der Berechnung, kann es innerhalb der Finanzaufstellungen zu geringfügigen Rundungsdifferenzen kommen.

Halbjahresbericht
für Gamma Plus Premium

Hannover, den 05. Oktober 2026

BANTLEON Invest
Kapitalverwaltungsgesellschaft mbH

Jörg Schubert

Stefan Krapf

BANTLEON
Institutional Investing