

Halbjahresbericht

Barmenia Nachhaltigkeit Balanced

zum 30. Juni 2020

Halbjahresbericht des Barmenia Nachhaltigkeit Balanced

ZUM 30. JUNI 2020

■ Vermögensübersicht	2
■ Vermögensaufstellung	4
■ Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit diese nicht mehr Gegenstand der Vermögensaufstellung sind	9
■ Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV	10

■ Vermögensübersicht

	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
I. Vermögensgegenstände	21.975.421,63	100,09
1. Aktien	10.352.730,67	47,15
Technologie	1.742.823,53	7,94
Finanzwerte	1.701.259,38	7,75
Verbraucher-Dienstleistungen	1.557.799,05	7,10
Gesundheitswesen	1.215.233,24	5,54
Industriewerte	1.138.652,42	5,19
Konsumgüter	1.135.226,83	5,17
Versorgungsunternehmen	855.237,53	3,90
Telekommunikation	537.431,10	2,45
Rohstoffe	348.916,34	1,59
Öl & Gas	120.151,25	0,55
2. Anleihen	10.841.162,11	49,38
Banking/Bankwesen	2.561.210,39	11,67
Anleihen supranationaler Organisationen	2.463.803,63	11,22
Konsumgüter	1.084.281,76	4,94
Regierungsanleihen	1.019.175,85	4,64
Telekommunikation	772.176,68	3,52
Gebietskörperschaften	705.194,64	3,21
Agency	509.842,04	2,32
Technologie & Elektronik	489.414,24	2,23
Transportwesen	319.310,43	1,45
Finanzsektor	311.434,08	1,42
Staatlich garantierte Anlagen	310.359,73	1,41
Gesundheitswesen	294.958,64	1,34
3. Derivate	187,32	0,00
Devisen-Derivate	187,32	0,00
4. Forderungen	166.103,60	0,76
5. Kurzfristig liquidierbare Anlagen	0,00	0,00
6. Bankguthaben	615.237,93	2,80
7. Sonstige Vermögensgegenstände	0,00	0,00
II. Verbindlichkeiten	-20.251,24	-0,09
Sonstige Verbindlichkeiten	-20.251,24	-0,09

■ Vermögensübersicht

III. Fondsvermögen	21.955.170,39	100,00^{*)}
---------------------------	----------------------	----------------------------

^{*)} Durch Rundung der Prozent-Anteile bei der Berechnung können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.

Vermögensaufstellung

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.06.2020	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
Börsengehandelte Wertpapiere								17.791.678,01	81,04
Aktien									
Euro								2.396.219,77	10,91
AKZO NOBEL	NL0013267909	STK	1.562	1.562	-	-	EUR 79,740	124.553,88	0,57
ALLIANZ VINK.NAM.	DE0008404005	STK	575	575	-	-	EUR 181,760	104.512,00	0,48
ASML HOLD.	NL0010273215	STK	468	468	468	-	EUR 326,900	152.989,20	0,70
ATOS	FR0000051732	STK	1.875	1.875	1.875	-	EUR 75,900	142.312,50	0,65
BOUYGUES	FR0000120503	STK	1.250	1.250	-	-	EUR 30,410	38.012,50	0,17
CHRISTIAN DIOR	FR0000130403	STK	290	290	-	375	EUR 375,600	108.924,00	0,50
CNP	FR0000120222	STK	4.940	4.940	-	6.430	EUR 10,250	50.635,00	0,23
COLRUYT	BE0974256852	STK	2.145	2.145	-	-	EUR 48,970	105.040,65	0,48
DT.BÖRSE NAM.	DE0005810055	STK	937	937	312	-	EUR 161,050	150.903,85	0,69
ENDESA	ES0130670112	STK	7.657	7.657	-	1.875	EUR 21,930	167.918,01	0,76
ESSILORLUXOTTICA	FR0000121667	STK	625	625	-	-	EUR 114,250	71.406,25	0,33
HERMES INT.	FR0000052292	STK	168	168	168	-	EUR 743,800	124.958,40	0,57
KON.AHOLD DELHAIZE	NL0011794037	STK	6.775	6.775	-	-	EUR 24,260	164.361,50	0,75
KONE (NEW)	FI0009013403	STK	1.562	1.562	1.562	-	EUR 61,220	95.625,64	0,44
L'ORÉAL	FR0000120321	STK	655	655	-	125	EUR 285,700	187.133,50	0,85
MÜNCH.RÜCK. VINK.NAM.	DE0008430026	STK	527	527	-	219	EUR 231,400	121.947,80	0,56
ORION 'B'	FI0009014377	STK	2.359	2.359	-	-	EUR 43,060	101.578,54	0,46
SANOFI	FR0000120578	STK	1.562	1.562	-	-	EUR 90,650	141.595,30	0,64
SNAM	IT0003153415	STK	8.125	8.125	-	8.125	EUR 4,334	35.213,75	0,16
TOTAL	FR0000120271	STK	2.500	2.500	-	-	EUR 33,975	84.937,50	0,39
WOLTERS KLUWER	NL0000395903	STK	1.750	1.750	-	1.250	EUR 69,520	121.660,00	0,55
US-Dollar								4.377.880,16	19,94
ACCENTURE 'A'	IE00B4BNMY34	STK	1.300	1.300	-	-	USD 214,720	248.529,58	1,13
AIR PROD.&CHEM.	US0091581068	STK	374	374	-	313	USD 241,460	80.404,26	0,37
ALLSTATE	US0200021014	STK	778	778	-	-	USD 96,990	67.184,45	0,31
ALPHABET	US02079K1079	STK	112	112	112	-	USD 1.413,610	140.964,54	0,64
ANSYS	US03662Q1058	STK	1.062	1.062	375	-	USD 291,730	275.846,73	1,26
AT&T	US00206R1023	STK	1.875	1.875	-	1.875	USD 30,230	50.466,32	0,23
AUTO.DATA PROC.	US0530151036	STK	1.887	1.887	-	-	USD 148,890	250.149,52	1,14
CINCINNATI FIN.	US1720621010	STK	500	500	-	910	USD 64,030	28.504,65	0,13
CME GR.	US12572Q1058	STK	1.062	1.062	-	-	USD 162,540	153.690,50	0,70
COCA-COLA	US1912161007	STK	1.937	1.937	-	-	USD 44,680	77.055,75	0,35
COSTCO WHOLES.	US22160K1051	STK	825	825	-	-	USD 303,210	222.720,25	1,01
DOLLAR GENERAL (NEW)	US2566771059	STK	750	750	750	-	USD 190,510	127.215,87	0,58
EBAY	US2786421030	STK	3.125	3.125	3.125	-	USD 52,450	145.934,43	0,66
ELI LILLY	US5324571083	STK	625	625	625	-	USD 164,180	91.361,35	0,42
GARMIN NAM.	CH0114405324	STK	937	937	937	-	USD 97,500	81.340,43	0,37
HORMEL FOODS	US4404521001	STK	3.125	3.125	3.125	-	USD 48,270	134.304,19	0,61
HP	US40434L1052	STK	9.998	9.998	-	-	USD 17,430	155.157,49	0,71
JOHNSON&J.	US4781601046	STK	1.402	1.402	-	-	USD 140,630	175.544,90	0,80
KROGER	US5010441013	STK	3.750	3.750	3.750	-	USD 33,850	113.019,19	0,51
LIBERTY BROADBAND 'C'	US5303073051	STK	625	625	625	-	USD 123,960	68.980,10	0,31
MICROSOFT	US5949181045	STK	375	375	375	-	USD 203,510	67.948,40	0,31
MSCI 'A'	US55354G1004	STK	250	250	250	-	USD 333,820	74.304,41	0,34

Vermögensaufstellung

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.06.2020	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
NEXTERA EN.	US65339F1012		STK	550	-	-	USD 240,170	117.609,85	0,54
PAYCHEX	US7043261079		STK	1.136	-	3.750	USD 75,750	76.616,66	0,35
PFIZER	US7170811035		STK	3.125	3.125	-	USD 32,700	90.982,95	0,41
PROCTER & GAMBLE	US7427181091		STK	2.073	-	-	USD 119,570	220.690,57	1,01
PROGRESSIVE	US7433151039		STK	500	-	1.250	USD 80,110	35.663,09	0,16
PRUDENTIAL FIN.	US7443201022		STK	620	-	-	USD 60,900	33.617,95	0,15
SYNOPSIS	US8716071076		STK	1.954	-	375	USD 195,000	339.251,21	1,55
TARGET	US87612E1064		STK	625	625	-	USD 119,930	66.737,52	0,30
TRACTOR SUPPLY	US8923561067		STK	1.093	1.093	-	USD 131,790	128.252,21	0,58
VERIZON COMM.	US92343V1044		STK	5.148	-	1.375	USD 55,130	252.690,42	1,15
VERTEX PHARMA.	US92532F1003		STK	437	437	-	USD 290,310	112.955,05	0,51
WESTERN UNION	US9598021098		STK	3.750	-	2.500	USD 21,620	72.185,37	0,33
Australische Dollar								120.344,22	0,55
ALUMINA	AU000000AWC3		STK	80.032	-	-	AUD 1,625	79.722,92	0,36
BENDIGO & ADELAIDE BK.	AU000000BEN6		STK	9.453	-	-	AUD 7,010	40.621,30	0,19
Schweizer Franken								528.165,37	2,41
KÜHNE&NAGEL INT.	CH0025238863		STK	1.000	-	-	CHF 157,400	147.897,58	0,67
ROCHE HOLD. G.	CH0012032048		STK	300	300	-	CHF 328,350	92.558,14	0,42
SWISSCOM NAM.	CH0008742519		STK	150	-	-	CHF 495,900	69.894,29	0,32
SWISS LIFE HOLD. NAM.	CH0014852781		STK	470	-	-	CHF 351,000	155.010,57	0,71
ZURICH FIN.SERV. NAM.	CH0011075394		STK	200	-	-	CHF 334,200	62.804,79	0,29
Dänische Kronen								461.171,02	2,10
CARLSBERG 'B'	DK0010181759		STK	437	-	625	DKK 876,600	51.397,62	0,23
DONG EN.	DK0060094928		STK	2.062	-	250	DKK 765,400	211.756,75	0,96
NOVO-NORDISK NAM. 'B'	DK0060534915		STK	3.437	625	-	DKK 429,400	198.016,65	0,90
Englische Pfund								527.966,97	2,40
ANGLO AMER.	GB00B1XZS820		STK	7.000	-	-	GBP 18,694	143.958,20	0,66
ASS.BRIT.FOODS	GB0006731235		STK	3.125	3.125	-	GBP 19,150	65.834,71	0,30
BARRATT DEV.	GB0000811801		STK	6.250	6.250	-	GBP 4,959	34.096,53	0,16
HSBC HOLD.	GB0005405286		STK	13.027	-	-	GBP 3,786	54.257,67	0,25
NATIONAL GRID	GB00BDR05C01		STK	3.125	6.250	3.125	GBP 9,892	34.007,15	0,15
RELX	GB00B2B0DG97		STK	3.125	3.125	-	GBP 18,700	64.287,68	0,29
SEGRO	GB00B5ZN1N88		STK	9.375	-	-	GBP 8,950	92.306,11	0,42
TAYLOR WIMPEY	GB0008782301		STK	25.000	25.000	-	GBP 1,426	39.218,92	0,18
Hongkong Dollar								248.918,15	1,13
BK.CHINA (HK)	HK2388011192		STK	24.500	-	-	HKD 24,650	69.377,19	0,32
HANG SENG BK.	HK0011000095		STK	5.600	-	-	HKD 130,100	83.694,91	0,38
MTR	HK0066009694		STK	14.500	-	-	HKD 40,150	66.878,62	0,30
WHARF	HK0004000045		STK	16.000	-	-	HKD 15,760	28.967,43	0,13
Schwedische Kronen								98.480,60	0,45
SKANSKA 'B'	SE0000113250		STK	5.438	2.500	-	SEK 189,500	98.480,60	0,45
Japanische Yen								1.048.167,03	4,77
BRIDGESTONE	JP3830800003		STK	3.200	-	-	JPY 3.469,000	91.612,64	0,42
JAPAN POST BK.	JP3946750001		STK	9.400	9.400	-	JPY 802,000	62.216,18	0,28
KEIHAN HOLD.	JP3279400000		STK	3.100	-	-	JPY 4.805,000	122.929,53	0,56
KYOCERA	JP3249600002		STK	1.600	-	-	JPY 5.865,000	77.444,24	0,35
KYUSHU RAILW.CO.	JP3247010006		STK	2.500	-	-	JPY 2.799,000	57.748,94	0,26

Vermögensaufstellung

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.06.2020	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
NIPPON TEL. AND TEL.	JP3735400008		STK	4.000	-	-	JPY 2.515,500	83.039,64	0,38
NITORI	JP3756100008		STK	600	600	-	JPY 21.125,000	104.604,19	0,48
ORIENTAL LAND	JP3198900007		STK	1.100	-	-	JPY 14.240,000	129.271,80	0,59
SECOM	JP3421800008		STK	1.300	-	-	JPY 9.423,000	101.095,93	0,46
TOKYO ELECTRON	JP3571400005		STK	1.000	200	-	JPY 26.440,000	218.203,94	0,99
Neuseeland-Dollar								313.877,37	1,43
MERCURY NZ	NZMRPE0001S2		STK	34.404	-	-	NZD 4,700	92.680,00	0,42
MERIDIAN ENER.	NZMELE0002S7		STK	29.730	-	-	NZD 4,810	81.963,26	0,37
RYMAN HEALTHCARE	NZRYME0001S4		STK	18.572	-	-	NZD 13,080	139.234,11	0,63
Verzinsliche Wertpapiere									
Euro								3.578.155,10	16,30
1,3420 % MORGAN STANLEY FRN V.17-26 MTN	XS1706111793		EUR	500.000	-	-	% 103,102	515.510,35	2,35
1,3500 % ITALIEN B.T.P. V.19-30	IT0005383309		EUR	450.000	-	-	% 101,202	455.409,00	2,07
1,5000 % VODAFONE GR. MTN V.17-27	XS1652855815		EUR	400.000	100.000	-	% 105,617	422.469,88	1,92
2,0000 % GOLDMAN S.GR. MTN V.18-28	XS1861206636		EUR	300.000	-	-	% 107,946	323.836,98	1,47
2,6250 % COCA-COLA EUR.PART. V.13-23	XS0989155089		EUR	450.000	200.000	-	% 107,560	484.020,00	2,20
2,7500 % SPANIEN V.14-24	ES00000126B2		EUR	500.000	-	-	% 112,753	563.766,85	2,57
4,2500 % SNCF RÉSEAU MTN V.11-26	XS0611783928		EUR	400.000	-	-	% 127,461	509.842,04	2,32
6,0000 % MACQUARIE BK. MTN V.10-20	XS0543111768		EUR	300.000	-	-	% 101,100	303.300,00	1,38
US-Dollar								3.248.863,82	14,80
1,6250 % EIB MTN V.19-29	US298785JA59		USD	400.000	-	-	% 106,764	380.229,71	1,73
2,8750 % KFW V.18-28	US500769HS68		USD	300.000	-	-	% 116,194	310.359,73	1,41
3,2500 % EIB V.14-24	US298785GJ95		USD	700.000	-	200.000	% 110,306	687.479,03	3,13
3,6250 % IBM V.14-24	US459200HU86		USD	500.000	200.000	-	% 109,937	489.414,24	2,23
4,0000 % HSBC HOLD. V.12-22	US404280AN99		USD	350.000	-	-	% 105,605	329.090,68	1,50
4,7500 % WELTBANK V.05-35	US45905CAA27		USD	800.000	-	-	% 147,735	1.052.290,43	4,79
Englische Pfund								843.468,43	3,84
5,5000 % EIB V.00-25	XS0110373569		GBP	250.000	-	-	% 125,007	343.804,46	1,57
5,8750 % CITIGROUP MTN V.04-24	XS0195612592		GBP	250.000	-	-	% 114,042	313.647,63	1,43
6,5000 % HSBC BK. MTN V.98-23	XS0088317853		GBP	150.000	-	-	% 112,726	186.016,34	0,85
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere								3.090.007,87	14,07
Aktien									
Euro								82.237,50	0,37
POSTE ITALIANE	IT0003796171		STK	10.625	-	9.375	EUR 7,740	82.237,50	0,37
US-Dollar								149.302,51	0,68
DUKE EN.(NEW)	US26441C2044		STK	2.099	-	-	USD 79,890	149.302,51	0,68
Verzinsliche Wertpapiere									
Euro								947.469,93	4,32
1,6250 % MONDELEZ INT. V.15-27	XS1197270819		EUR	300.000	-	-	% 105,575	316.725,42	1,44
1,7500 % NASDAQ V.16-23	XS1418630023		EUR	300.000	-	-	% 103,811	311.434,08	1,42
3,7500 % ABERTIS INFRASTR. V.13-23	ES0211845260		EUR	300.000	-	-	% 106,437	319.310,43	1,45

■ Vermögensaufstellung

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.06.2020	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
US-Dollar								1.518.010,19	6,91
3,6000 % ABBVIE V.15-25	US00287YAQ26		USD	300.000	-	-	% 110,428	294.958,64	1,34
3,8750 % MORGAN STANLEY V.14-24	US61746BDQ68		USD	300.000	-	-	% 110,399	294.881,74	1,34
3,9500 % KRAFT HEINZ FOODS V.16-25	US50077LAK26		USD	300.000	-	-	% 106,151	283.536,34	1,29
4,0000 % GOLDMAN S. V.14-24	US38141GVM31		USD	300.000	-	-	% 110,416	294.926,67	1,34
4,4500 % AT&T V.15-24	US00206RDC34		USD	350.000	-	-	% 112,221	349.706,80	1,59
Canadische Dollar								392.987,74	1,79
9,0000 % BRIT.COLUMBIA V.94-24	CA110709DP43		CAD	450.000	-	-	% 133,594	392.987,74	1,79
Nicht notierte Wertpapiere								312.206,90	1,42
Verzinsliche Wertpapiere									
Canadische Dollar								312.206,90	1,42
2,1500 % NOVA SCOTIA V.15-25	CA669827BG14		CAD	450.000	-	300.000	% 106,133	312.206,90	1,42
Summe Wertpapiervermögen								21.193.892,78	96,53
Derivate								187,32	0,00
Devisen-Derivate									
Devisenterminkontrakte								187,32	0,00
GBP/EUR 630.000,00			OTC					3.726,34	0,02
USD/EUR 7.600.000,00			OTC					-3.539,02	-0,02
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds								615.237,93	2,80
Bankguthaben								615.237,93	2,80
EUR-Guthaben bei:									
Verwahrstelle									
HSBC TRINKAUS & BURKHARDT AG			EUR	615.237,93			% 100,000	615.237,93	2,80
Sonstige Vermögensgegenstände								166.103,60	0,76
ZINSANSPRÜCHE			EUR	149.758,31				149.758,31	0,68
DIVIDENDENANSPRÜCHE			EUR	16.345,29				16.345,29	0,07
Sonstige Verbindlichkeiten								-20.251,24	-0,09
VERBINDLICHKEITEN AUS SCHWEBENDEN GESCHÄFTEN			EUR	-1.030,75				-1.030,75	0,00
KOSTENABGRENZUNGEN			EUR	-19.220,49				-19.220,49	-0,09
Fondsvermögen							EUR	21.955.170,39	100,00*)
Anteilwert							EUR	52,31	
Umlaufende Anteile							STK	419.726,00	

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

■ Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

Die Vermögensgegenstände des Sondervermögens sind auf der Grundlage nachstehender Kurse/Marktsätze bewertet:

Alle Vermögenswerte: Kurse bzw. Marktsätze per 30.06.2020 oder letztbekannte.

Devisenkurs(e) bzw. Konversionsfaktor(en) (in Mengennotiz) per 30.06.2020

Australische Dollar	(AUD)	1,63130 = 1 (EUR)
Canadische Dollar	(CAD)	1,52975 = 1 (EUR)
Schweizer Franken	(CHF)	1,06425 = 1 (EUR)
Dänische Kronen	(DKK)	7,45315 = 1 (EUR)
Englische Pfund	(GBP)	0,90900 = 1 (EUR)
Hongkong Dollar	(HKD)	8,70495 = 1 (EUR)
Japanische Yen	(JPY)	121,17105 = 1 (EUR)
Neuseeland-Dollar	(NZD)	1,74470 = 1 (EUR)
Schwedische Kronen	(SEK)	10,46400 = 1 (EUR)
US-Dollar	(USD)	1,12315 = 1 (EUR)

■ Marktschlüssel

c) OTC Over-the-Counter

Im Berichtszeitraum haben gegebenenfalls Kapitalmaßnahmen und eventuelle unterjährige Änderungen der Stammdaten eines Wertpapiers stattgefunden. Diese Kapitalmaßnahmen und die Umbuchungen aufgrund von Stammdatenänderungen sind ohne Umsatzzahlen in der „Vermögensaufstellung“ und in den „Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen“ enthalten.

■ Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit diese nicht mehr Gegenstand der Vermögensaufstellung sind

Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schuldscheindarlehen (Marktzuordnung zum Berichtsstichtag):

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
---------------------	------	------------------------------	----------------	-------------------

Börsengehandelte Wertpapiere

Aktien

Euro

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
COVIVIO	FR0000064578	STK	-	1.225
MAPFRE	ES0124244E34	STK	-	21.232
PUMA	DE0006969603	STK	-	2.200
TUI NAM.	DE000TUAG000	STK	-	5.000

US-Dollar

AFLAC	US0010551028	STK	-	4.950
ARCH CAP.GR.	BMG0450A1053	STK	-	3.750
CUMMINS	US2310211063	STK	-	1.125
ENTERGY	US29364G1031	STK	-	1.909
EXELON	US30161N1019	STK	-	3.719
SYSCO	US8718291078	STK	-	1.861
WALMART	US9311421039	STK	-	1.375

Schweizer Franken

SWISS RE NAM.	CH0126881561	STK	-	1.603
---------------	--------------	-----	---	-------

Englische Pfund

BURBERRY GR.	GB0031743007	STK	-	4.700
EASYJET	GB00B7KR2P84	STK	6.250	6.250

Japanische Yen

CANON	JP3242800005	STK	-	2.400
DAI NIPPON PRINT.	JP3493800001	STK	-	5.400
TOPPAN PRINT.	JP3629000005	STK	-	5.500

Verzinsliche Wertpapiere

Euro

0,8750 % VW INT.FIN. XS1167644407 MTN V.15-23	EUR	-	350.000
---	-----	---	---------

US-Dollar

2,0000 % KFW V.12-22 US500769FH22	USD	-	250.000
-----------------------------------	-----	---	---------

■ Während des Berichtszeitraums abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen

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

Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Volumen in 1.000
---------------------	------------------------------	------------------

Terminkontrakte

Devisenterminkontrakte (Verkauf)	EUR	7.079
---	------------	--------------

GBP/EUR	EUR	683
---------	-----	-----

USD/EUR	EUR	6.396
---------	-----	-------

Devisenterminkontrakte (Kauf)	EUR	500
--------------------------------------	------------	------------

JPY/EUR	EUR	500
---------	-----	-----

■ Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben nach der Derivateverordnung

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen	96,53 %
Bestand der Derivate am Fondsvermögen	0,00 %

Sonstige Angaben

Anteilwert (EUR)	52,31
Umlaufende Anteile (STK)	419.726,00

Angaben zum Bewertungsverfahren gemäß §§ 26-31 und 34 KARBV

Das im Folgenden dargestellte Vorgehen bei der Bewertung der Vermögensgegenstände des Sondervermögens findet auch in Zeiten ggf. auftretender Marktverwerfungen i.Z.m. den Auswirkungen der Covid-19 Pandemie Anwendung. Darüber hinausgehende Bewertungsanpassungen waren nicht erforderlich.

Alle Vermögensgegenstände, die zum Handel an einer Börse oder einem anderem organisierten Markt zugelassen oder in diesen einbezogen sind, werden mit dem zuletzt verfügbaren Preis bewertet, der aufgrund von fest definierten Kriterien als handelbar eingestuft werden kann und der eine verlässliche Bewertung sicherstellt (§§ 27, 34 KARBV).

Die verwendeten Preise sind Börsenpreise, Notierungen auf anerkannten Informationssystemen oder Kurse aus emittentenunabhängigen Bewertungssystemen (§§ 28, 34 KARBV). Anteile an Investmentvermögen werden mit ihrem zuletzt verfügbaren veröffentlichten Rücknahmekurs der jeweiligen Kapitalverwaltungsgesellschaft bewertet.

Bankguthaben werden zum Nennwert zuzüglich zugeflossener Zinsen, kündbare Festgelder zum Verkehrswert und Verbindlichkeiten zum Rückzahlungsbetrag bewertet (§§ 29, 34 KARBV). Die Bewertung erfolgt grundsätzlich zum letzten gehandelten Preis gemäß festgelegtem Bewertungszeitpunkt (Vortag oder gleichartig).

Vermögensgegenstände, die nicht zum Handel an einem organisierten Markt zugelassen sind oder für die keine handelbaren Kurse festgestellt werden können, werden mit Hilfe von anerkannten Bewertungsmodellen auf Basis beobachtbarer Marktdaten bewertet. Ist keine Bewertung auf Basis von Modellen möglich, erfolgt eine Bewertung durch andere geeignete Verfahren zur Preisfeststellung (§§ 28, 34 KARBV). Andere geeignete Verfahren kann die Verwendung eines von einem Dritten ermittelten Preises sein und unterliegt einer Plausibilitätsprüfung durch die KVG.

Optionen und Futures, die zum Handel an einer Börse zugelassen oder in einem organisierten Markt einbezogen sind, werden zu dem jeweils verfügbaren handelbaren Kurs (Settlementpreis der jeweiligen Börse), der eine verlässliche Bewertung gewährleistet, bewertet.

