

Halbjahresbericht

Währungsdiversifikator Renten International

zum 30. Juni 2021

Halbjahresbericht des Währungsdiversifikator Renten International

ZUM 30. JUNI 2021

■ Vermögensübersicht	2
■ Vermögensaufstellung	3
■ Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit diese nicht mehr Gegenstand der Vermögensaufstellung sind	6
■ Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV	7

■ Vermögensübersicht

	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
I. Vermögensgegenstände	31.196.539,72	100,04
1. Aktien	0,00	0,00
2. Anleihen	28.157.282,60	90,29
Regierungsanleihen	7.707.061,51	24,71
Anleihen supranationaler Organisationen	5.892.765,03	18,90
Staatlich garantierte Anlagen	4.165.990,47	13,36
Gebietskörperschaften	3.715.877,74	11,92
Banking/Bankwesen	2.499.175,71	8,01
Gedekte Schuldverschreibungen	1.201.857,63	3,85
Agency	1.098.873,02	3,52
Technologie & Elektronik	820.087,43	2,63
Finanzsektor	662.684,77	2,13
Automobil	392.909,29	1,26
3. Derivate	0,00	0,00
4. Forderungen	571.275,87	1,83
5. Kurzfristig liquidierbare Anlagen	0,00	0,00
6. Bankguthaben	2.467.981,25	7,91
7. Sonstige Vermögensgegenstände	0,00	0,00
II. Verbindlichkeiten	-11.564,58	-0,04
Sonstige Verbindlichkeiten	-11.564,58	-0,04
III. Fondsvermögen	31.184.975,14	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 30.06.2021	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
Börsengehandelte Wertpapiere								20.332.444,06	65,20
Verzinsliche Wertpapiere									
Australische Dollar								3.554.468,40	11,40
0,2500 % AUSTRALIEN TREA. V.19-24	AU0000083768		AUD	800.000	800.000	-	% 99,400	503.402,65	1,61
2,6000 % WELTBANK MTN V.17-22	AU3CB0247245		AUD	1.000.000	-	-	% 102,966	651.827,94	2,09
2,9000 % KFW MTN V.16-22	AU000KFWHAF2		AUD	1.200.000	-	-	% 102,618	779.549,90	2,50
3,7000 % APPLE V.15-22	AU3CB0232296		AUD	600.000	-	-	% 103,940	394.796,32	1,27
4,2500 % QUEENSLAND TREA. V.12-23	AU0000XQLQX4		AUD	500.000	-	-	% 108,340	342.924,07	1,10
5,7500 % QUEENSLAND TREA. V.11-24	AU0000XQLQU0		AUD	1.200.000	-	-	% 116,100	881.967,52	2,83
Canadische Dollar								2.621.777,33	8,41
0,7500 % INT.-AMER.DEV.BK. V.20-25	CA458182EE85		CAD	1.100.000	1.100.000	-	% 98,410	737.153,56	2,36
2,2500 % LAWI.RENTENBK. MTN S.1105	XS1089927781		CAD	600.000	-	-	% 100,090	408.947,91	1,31
2,2500 % WELTBANK MTN V.18-23	CA459058GG23		CAD	1.000.000	-	-	% 102,710	699.421,18	2,24
2,3750 % EIB MTN V.18-23	XS1850436814		CAD	1.100.000	-	-	% 103,630	776.254,68	2,49
Norwegische Kronen								5.528.831,25	17,73
1,0000 % KFW MTN V.16-21	XS1489186947		NOK	4.000.000	-	-	% 100,200	392.752,50	1,26
1,5000 % KOMM.BK. MTN V.18-23	XS1770033014		NOK	8.000.000	-	-	% 100,750	789.816,66	2,53
1,6250 % KFW MTN V.19-24	XS1967658243		NOK	6.000.000	-	-	% 101,270	595.419,85	1,91
1,7500 % DAIMLER INT.FIN. MTN V.17-22	XS1617830648		NOK	4.000.000	-	-	% 100,240	392.909,29	1,26
1,7500 % NORWEGEN V.15-25	NO0010732555		NOK	6.000.000	-	-	% 102,650	603.533,60	1,94
1,8750 % NIB MTN V.18-24	XS1805263743		NOK	6.200.000	-	-	% 101,630	617.454,36	1,98
2,0000 % NORWEGEN V.12-23	NO0010646813		NOK	6.000.000	-	-	% 102,510	602.710,46	1,93
2,3500 % OSLO V.15-24	NO0010752702		NOK	7.000.000	-	-	% 102,913	705.926,56	2,26
3,0000 % NORWEGEN V.14-24	NO0010705536		NOK	8.000.000	-	-	% 105,660	828.307,97	2,66
Schwedische Kronen								5.213.298,18	16,72
0,2500 % KOMMUNIV.SVERIGE V.16-22	SE0009269418		SEK	9.000.000	-	-	% 100,240	889.528,69	2,85
0,5230 % INT.FIN. MTN V.18-23	XS1759252445		SEK	7.000.000	-	-	% 100,717	695.147,90	2,23
0,6250 % KOMMUNIV.SVERIGE MTN V.16-23	XS1504236198		SEK	7.000.000	-	-	% 101,172	698.288,31	2,24
1,0000 % KOMMUNIV.SVERIGE V.17-24	SE0010469205		SEK	9.000.000	-	-	% 102,700	911.358,71	2,92
1,0000 % NORDEA HYP. PFE V.15-22	SE0006991246		SEK	4.000.000	-	-	% 100,852	397.759,81	1,28
1,0000 % SWEDBK.HYP. HYP.-PFE 15-22	SE0007525654		SEK	4.000.000	-	-	% 101,046	398.524,95	1,28
1,2500 % EIB MTN V.15-25	XS1171476143		SEK	8.000.000	-	-	% 103,590	817.116,94	2,62
2,2500 % LÄNSF.HYPO. HYP.-PFE V.14-22	SE0007278429		SEK	4.000.000	-	-	% 102,833	405.572,87	1,30
Neuseeland-Dollar								1.440.588,63	4,62
3,3750 % KOMM.BK. MTN V.16-23	NZKBNDT010C4		NZD	500.000	-	-	% 104,903	309.056,36	0,99
4,6250 % WELTBANK V.14-21	NZIBDDT008C4		NZD	500.000	-	-	% 101,040	297.675,51	0,95
5,5000 % NEUSEELAND V.11-23	NZGOVDT423C0		NZD	1.300.000	-	-	% 108,860	833.856,76	2,67
Singapur-Dollar								1.973.480,27	6,33
2,0000 % SINGAPUR V.19-24	SGXF92110679		SGD	1.000.000	-	-	% 103,716	650.624,36	2,09
2,3750 % SINGAPUR V.15-25	SG31A0000001		SGD	1.000.000	-	-	% 106,369	667.267,74	2,14

■ Vermögensaufstellung

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.06.2021	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
2,7500 % SINGAPUR V.13-23	SG3260987684		SGD	1.000.000	-	-	% 104,507	655.588,17	2,10
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere								5.951.334,53	19,08
Verzinsliche Wertpapiere									
Australische Dollar								1.129.403,35	3,62
0,5000 % TREA VICTORIA V.21-25	AU3SG0002421		AUD	800.000	800.000	-	% 98,558	499.138,42	1,60
3,2000 % KFW MTN V.16-26	AU000KFWHAE5		AUD	900.000	-	-	% 110,622	630.264,93	2,02
Canadische Dollar								2.832.059,93	9,08
1,5000 % KANADA V.12-23	CA135087A610		CAD	1.400.000	-	-	% 102,020	972.611,51	3,12
2,5130 % APPLE V.17-24	CA037833CY47		CAD	600.000	-	-	% 104,090	425.291,11	1,36
2,6000 % ONTARIO V.17-23	CA68333ZAB37		CAD	1.400.000	-	-	% 104,295	994.300,31	3,19
3,5000 % ONTARIO V.13-24	CA68323ACG72		CAD	600.000	-	-	% 107,655	439.857,00	1,41
Neuseeland-Dollar								1.989.871,25	6,38
0,5000 % NEUSEELAND V.20-24	NZGOVDT524C5		NZD	1.300.000	-	-	% 99,270	760.398,31	2,44
1,7500 % INT.FIN. MTN V.19-24	NZIFCDT011C5		NZD	1.000.000	-	-	% 101,950	600.712,96	1,93
2,7500 % NEUSEELAND V.16-25	NZGOVDT425C5		NZD	1.000.000	-	-	% 106,710	628.759,98	2,02
Nicht notierte Wertpapiere								1.873.504,01	6,01
Verzinsliche Wertpapiere									
Australische Dollar								662.684,77	2,13
2,8000 % EXPORT DEV.CAN. V.18-23	AU3CB0253235		AUD	1.000.000	-	-	% 104,681	662.684,77	2,13
Canadische Dollar								350.902,28	1,13
2,5500 % ALBERTA V.12-22	CA013051DG93		CAD	500.000	-	-	% 103,060	350.902,28	1,13
Neuseeland-Dollar								859.916,96	2,76
4,0000 % L-BANK MTN S.5581	NZLBKDT003C1		NZD	1.300.000	-	-	% 112,262	859.916,96	2,76
Summe Wertpapiervermögen								28.157.282,60	90,29
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds								2.467.981,25	7,91
Bankguthaben								2.467.981,25	7,91
EUR-Guthaben bei:									
Verwahrstelle									
KREISSPARKASSE KÖLN			EUR	54.579,79			% 100,000	54.579,79	0,18
Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen									
KREISSPARKASSE KÖLN			NOK	934.469,75			% 100,000	91.570,69	0,29
KREISSPARKASSE KÖLN			SEK	3.752.029,39			% 100,000	369.949,65	1,19
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen									
KREISSPARKASSE KÖLN			AUD	138.246,97			% 100,000	87.517,47	0,28
KREISSPARKASSE KÖLN			CAD	206.797,41			% 100,000	140.822,21	0,45
KREISSPARKASSE KÖLN			NZD	2.703.480,70			% 100,000	1.592.953,30	5,11
KREISSPARKASSE KÖLN			SGD	208.170,56			% 100,000	130.588,14	0,42
Sonstige Vermögensgegenstände								571.275,87	1,83
ZINSANSPRÜCHE			EUR	183.515,13				183.515,13	0,59
FORDERUNGEN AUS SCHWEBENDEN GESCHÄFTEN			EUR	387.760,74				387.760,74	1,24
Sonstige Verbindlichkeiten								-11.564,58	-0,04
KOSTENABGRENZUNGEN			EUR	-11.564,58				-11.564,58	-0,04

■ Vermögensaufstellung

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.06.2021	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
Fondsvermögen							EUR	31.184.975,14	100,00*)
Anteilwert							EUR	894,81	
Umlaufende Anteile							STK	34.851,00	

*) 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 30.06.2021 oder letztbekannte.

Devisenkurs(e) bzw. Konversionsfaktor(en) (in Mengennotiz) per 30.06.2021

Australische Dollar	(AUD)	1,57965 = 1 (EUR)
Canadische Dollar	(CAD)	1,46850 = 1 (EUR)
Norwegische Kronen	(NOK)	10,20490 = 1 (EUR)
Neuseeland-Dollar	(NZD)	1,69715 = 1 (EUR)
Schwedische Kronen	(SEK)	10,14200 = 1 (EUR)
Singapur-Dollar	(SGD)	1,59410 = 1 (EUR)

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 Schuldscheinanleihen (Marktzuordnung zum Berichtsstichtag):

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

Börsengehandelte Wertpapiere

Verzinsliche Wertpapiere

Australische Dollar

3,3750 % RABOBK.NE XS1355183010 D.(AUS.BR.) MTN 16-21		AUD	-	600.000
---	--	-----	---	---------

Schwedische Kronen

2,8750 % DT.BAHN XS1027425328 FIN. MTN V.14-21		SEK	-	3.000.000
---	--	-----	---	-----------

Neuseeland-Dollar

6,0000 % NZGOVD0521C2 NEUSEELAND V.09-21		NZD	-	500.000
--	--	-----	---	---------

An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere

Verzinsliche Wertpapiere

Australische Dollar

4,2500 % AU3CB0222255 UNI.MELBOURNE V.14-21		AUD	-	600.000
---	--	-----	---	---------

Neuseeland-Dollar

3,5000 % NZIDBDT003C5 INTER-AM.DEV.BK. V.16-21		NZD	-	1.300.000
--	--	-----	---	-----------

Nicht notierte Wertpapiere

Verzinsliche Wertpapiere

Australische Dollar

2,2500 % L-BANK AU3CB0239085 MTN S.5569		AUD	-	1.000.000
--	--	-----	---	-----------

■ Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben nach der Derivateverordnung

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen	90,29 %
Bestand der Derivate am Fondsvermögen	0,00 %

Sonstige Angaben

Anteilwert (EUR)	894,81
Umlaufende Anteile (STK)	34.851,00

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 gleichtäglich).

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.

