

Halbjahresbericht

CSR Bond Focus SDG Fonds

zum 28. Februar 2021

Halbjahresbericht des CSR Bond Focus SDG Fonds

ZUM 28. FEBRUAR 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	7.639.822,32	100,20
1. Aktien	0,00	0,00
2. Anleihen	6.265.184,21	82,17
Finanzsektor	1.109.020,00	14,54
Anleihen supranationaler Organisationen	1.066.950,43	13,99
Regierungsanleihen	968.404,00	12,70
Technologie & Elektronik	748.997,50	9,82
Energiewerte	551.581,90	7,23
Staatlich garantierte Anlagen	536.509,20	7,04
Investitionsgüter	419.396,00	5,50
Reise & Freizeit	399.000,00	5,23
Banking/Bankwesen	294.325,18	3,86
Versorgungswerte	171.000,00	2,24
3. Derivate	4.710,00	0,06
Zins-Derivate	4.710,00	0,06
4. Forderungen	68.941,69	0,90
5. Kurzfristig liquidierbare Anlagen	0,00	0,00
6. Bankguthaben	818.160,12	10,73
7. Sonstige Vermögensgegenstände	482.826,30	6,33
Zielfondsanteile	482.826,30	6,33
Indexfonds	482.826,30	6,33
II. Verbindlichkeiten	-15.001,88	-0,20
Sonstige Verbindlichkeiten	-15.001,88	-0,20
III. Fondsvermögen	7.624.820,44	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 28.02.2021	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
Börsengehandelte Wertpapiere								2.866.188,81	37,59
Verzinsliche Wertpapiere									
Euro								2.866.188,81	37,59
0,0000 % BUND V.20-30	DE0001030708		EUR	500.000	500.000	- %	103,176	515.880,00	6,77
0,0000 % EU MTN V.20-30	EU000A283859		EUR	400.000	400.000	- %	100,909	403.634,00	5,29
0,1250 % BAY.LB MTN V.21-28	DE000BLB6J0		EUR	100.000	100.000	- %	98,670	98.670,00	1,29
0,3750 % LBBW MTN S.822	DE000LB2CW16		EUR	200.000	200.000	- %	97,828	195.655,18	2,57
0,7500 % KFW MTN V.18-28	DE000A2LQSH4		EUR	500.000	500.000	- %	107,302	536.509,20	7,04
1,0000 % EIB MTN V.19-42	XS1980857319		EUR	300.000	300.000	- %	114,894	344.680,50	4,52
1,3500 % IRLAND TREA. V.18-31	IE00BFZRQ242		EUR	400.000	400.000	- %	113,131	452.524,00	5,93
2,7500 % EIB MTN V.13-30	XS0960306578		EUR	250.000	250.000	- %	127,454	318.635,93	4,18
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere								3.099.745,40	40,65
Verzinsliche Wertpapiere									
Euro								3.099.745,40	40,65
0,5000 % PROCREDIT HOLD. V.20-23	DE000A289FD2		EUR	500.000	500.000	- %	99,500	497.500,00	6,52
5,0000 % DT.BILDUNG STUDIENFD. V.13-23	DE000A1YQC86		EUR	400.000	400.000	- %	102,880	411.520,00	5,40
5,2500 % AVES ONE V.20-25	DE000A289R74		EUR	400.000	400.000	- %	104,849	419.396,00	5,50
5,5000 % SUNFARM. V.20-25	DE000A254UP9		EUR	250.000	250.000	- %	99,899	249.747,50	3,28
5,7500 % DEUTSCHE LICHTMIETE V.18-23	DE000A2G9JL5		EUR	400.000	400.000	- %	102,043	404.581,90	5,31
6,0000 % NEXTBIKE V.20-25	DE000A254RZ4		EUR	400.000	400.000	- %	99,750	399.000,00	5,23
6,5000 % AFRICA GREENTEC ASSET V.17-32	DE000A2GSGF9		EUR	150.000	150.000	- %	98,000	147.000,00	1,93
7,0000 % ACTAQUA V.20-25	DE000A3H2TU8		EUR	400.000	400.000	- %	100,000	400.000,00	5,25
7,2500 % HYLEA GR. V.17-22	DE000A19S801		EUR	200.000	200.000	- %	85,500	171.000,00	2,24
Neuemissionen								299.250,00	3,92
Zulassung zum Börsenhandel vorgesehen									
Verzinsliche Wertpapiere									
Euro								99.250,00	1,30
2,9700 % SCATEC FRN V.21-25	NO0010931181		EUR	100.000	100.000	- %	99,250	99.250,00	1,30
Zulassung oder Einbeziehung in organisierte Märkte vorgesehen									
Verzinsliche Wertpapiere									
Euro								200.000,00	2,62
6,0000 % INDESTO GC WIND V.20-23	DE000A3E46Z6		EUR	200.000	200.000	- %	100,000	200.000,00	2,62
Investmentanteile								482.826,30	6,33
Gesellschaftsfremde Investmentanteile									
Euro								482.826,30	6,33
M.U.L.-LYX.GR.BD.ESG S.DR U.	LU1981859819		ANT	24.200	24.200	- EUR	19,952	482.826,30	6,33

■ Vermögensaufstellung

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 28.02.2021	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
Summe Wertpapiervermögen								6.748.010,51	88,50
Derivate								4.710,00	0,06
Zins-Derivate									
Optionsrechte								4.710,00	0,06
Optionsrechte auf Zinsterminkontrakte									
CALL EURO-BUND-FUT. 171,5 04/21		EUREX	STK	-4			EUR	1.200,00	0,02
CALL EURO-BUND-FUT. 172,50 04/21		EUREX	STK	-4			EUR	1.360,00	0,02
CALL EURO-BUND-FUT. 172 04/21		EUREX	STK	-5			EUR	2.150,00	0,03
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds								818.160,12	10,73
Bankguthaben								818.160,12	10,73
EUR-Guthaben bei:									
Verwahrstelle									
KREISSPARKASSE KÖLN			EUR	818.160,12			% 100,000	818.160,12	10,73
Sonstige Vermögensgegenstände								68.941,69	0,90
ZINSANSPRÜCHE			EUR	68.941,69				68.941,69	0,90
Sonstige Verbindlichkeiten								-15.001,88	-0,20
VERBINDLICHKEITEN AUS SCHWEBENDEN GESCHÄFTEN			EUR	-4.056,04				-4.056,04	-0,05
KOSTENABGRENZUNGEN			EUR	-6.235,84				-6.235,84	-0,08
ERHALTENE VARIATION MARGIN			EUR	-4.710,00				-4.710,00	-0,06
Fondsvermögen						EUR		7.624.820,44	100,00^{*)}

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

CSR Bond Focus SDG Fonds (A)

ISIN	DE000A2PT145
Fondsvermögen (EUR)	7.624.820,44
Anteilwert (EUR)	99,22
Umlaufende Anteile (STK)	76.845,00

■ Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

Die Vermögensgegenstände des Sondervermögens sind auf der Grundlage nachstehender Kurse/Marktsätze bewertet:
Alle Vermögenswerte: Kurse bzw. Marktsätze per 26.02.2021 oder letztbekannte.

■ Marktschlüssel

b) Terminbörsen

EUREX Frankfurt/Zürich - Eurex (Eurex DE/Eurex Zürich)

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
---------------------	------	------------------------------	----------------	-------------------

Investmentanteile

Gesellschaftsfremde Investmentanteile

Euro

MUL-LYXOR GREEN	LU1563454310	ANT	9.000	9.000
-----------------	--------------	-----	-------	-------

BD.(DR)UC.

■ **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

Zinsterminkontrakte

Verkaufte Kontrakte **EUR** **886**

Basiswerte: (EURO-BUND-FUTURE 03/21)

Optionsrechte

Optionrechte auf Zins-Derivate

Optionrechte auf Zinsterminkontrakte

Verkaufte Kaufoptionen (call) **EUR** **4.438**

Basiswerte: (CALL EURO-BUND-FUT. 177 03/21, CALL EURO-BUND-FUT. 177,50 01/21, CALL EURO-BUND-FUT. 177,50 02/21, CALL EURO-BUND-FUT. 177,50 03/21, CALL EURO-BUND-FUT. 178 01/21)

■ Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben nach der Derivateverordnung

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen	88,50 %
Bestand der Derivate am Fondsvermögen	0,06 %
Sonstige Angaben	

CSR Bond Focus SDG Fonds (A)

ISIN	DE000A2PT145
Fondsvermögen (EUR)	7.624.820,44
Anteilwert (EUR)	99,22
Umlaufende Anteile (STK)	76.845,00
Ausgabeaufschlag	bis zu 0,00%, derzeit 0,00%
Verwaltungsvergütung (p.a.)	bis zu 1,02%, derzeit 1,02%
Mindestanlagesumme (EUR)	keine
Ertragsverwendung	Ausschüttung

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.

Angaben zur Transparenz

Verwaltungsvergütungssatz für im Sondervermögen gehaltene Investmentanteile:

Investmentanteile	Verwaltungsvergütung ¹⁾
M.U.L.-Lyx.Gr.Bd.ESG S.DR U.	0,25000 % p.a.
MUL-Lyxor Green Bd.(DR)UC.	0,40000 % p.a.

¹⁾ Von anderen Kapitalverwaltungsgesellschaften bzw. ausländischen Investmentgesellschaften berechnete Verwaltungsvergütung.

Bei den Angaben zu Verwaltungsvergütungen handelt es sich um den von den Gesellschaften maximal belasteten Prozentsatz.

Quelle: WM Datenservice, Verkaufsprospekte

Im Berichtszeitraum wurden keine Ausgabeaufschläge gezahlt.

Im Berichtszeitraum wurden keine Rücknahmeabschlüsse gezahlt.

