



MPF Abakus

Halbjahresbericht für die Zeit vom:
01.07.2023 - 31.12.2023

Herausgeber dieses Jahresberichtes:

BANTLEON Invest AG

An der Börse 7, 30159 Hannover

Postanschrift: Postfach 4505

30045 Hannover

Telefon +49 511 12354-0; Telefax: +49 511 12354-333

<https://www.bantleon-invest-ag.de/>

Hinweis:

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

Halbjahresbericht für MPF Abakus

Vermögensübersicht zum 31.12.2023

Anlageschwerpunkte	Tageswert in EUR	% Anteil am Fondsvermögen
I. Vermögensgegenstände	42.647.874,06	100,05
1. Verzinsliche Wertpapiere	26.371.318,31	61,87
2. Zertifikate	8.727.617,00	20,47
3. Investmentanteile	6.433.060,00	15,09
4. Forderungen	406.090,72	0,95
5. Bankguthaben	709.788,03	1,67
II. Verbindlichkeiten	-20.740,11	-0,05
III. Fondsvermögen	42.627.133,95	100,00 ¹⁾

1) Auf Grund von Rundung bei der Berechnung % Anteil am Fondsvermögen, kann es zu geringfügigen Rundungsdifferenzen kommen.

Halbjahresbericht für MPF Abakus

Vermögensaufstellung zum 31.12.2023

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.12.2023	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens	
Bestandspositionen										
Börsengehandelte Wertpapiere							EUR	29.777.724,91	69,86	
Verzinsliche Wertpapiere										
3,1190 % AXA S.A. EO-FLR Med.-T. Nts 03(08/Und.)	XS0181369454		EUR	300	0	0	%	80,0018	240.005,44	0,56
3,1250 % Bayer AG FLR-Sub.Anl.v.2019(2027/2079)	XS2077670342		EUR	3.000	0	0	%	90,5353	2.716.060,17	6,37
6,6250 % Bayer AG FLR-Sub.Anl.v.2023(2028/2083)	XS2684826014		EUR	3.000	3.000	0	%	101,9909	3.059.728,32	7,18
0,5000 % BNP Paribas S.A. EO-FLR Non-Pref.MTN 20(27/28)	FR0013532280		EUR	500	0	0	%	89,8081	449.040,45	1,05
1,7500 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.2014 (2024)	DE0001102333		EUR	4.300	4.300	0	%	99,7753	4.290.337,99	10,06
1,3750 % Commerzbank AG Sub.Fix to Reset MTN 21(26/31)	DE000CZ45WP5		EUR	1.000	0	0	%	89,7406	897.406,04	2,11
0,2500 % Corporación Andina de Fomento EO-Medium-Term Notes 2021(26)	XS2296027217		EUR	800	0	0	%	93,4191	747.352,64	1,75
5,6250 % Deutsche Bank AG Sub.FLR-MTN v20(26/31)	DE000DL19VB0		EUR	2.000	0	0	%	101,2024	2.024.048,60	4,75
4,6790 % Deutsche Pfandbriefbank AG Nachr.FLR-MTN R35281 17(22/27)	XS1637926137		EUR	1.000	0	0	%	73,8023	738.022,62	1,73
0,0000 % LANXESS AG Medium-Term Nts 2021(27/27)	XS2383886947		EUR	400	0	0	%	86,7766	347.106,56	0,81
4,5000 % Lb.Hessen-Thüringen GZ FLR-MTN S.H354 v.22(27/32)	XS2489772991		EUR	1.500	0	0	%	95,5719	1.433.579,10	3,36
0,2500 % LeasePlan Corporation N.V. EO-Medium-Term Notes 2021(26)	XS2305244241		EUR	500	0	0	%	93,1585	465.792,30	1,09
3,5000 % RWE AG FLR-Sub.Anl. v.2015(2025/2075)	XS1219499032		EUR	500	0	0	%	98,7969	493.984,70	1,16
0,2500 % UBS Group AG EO-FLR Med.Trm.Nts.2021(25/26)	CH1142231682		EUR	1.000	1.000	0	%	93,7493	937.492,60	2,20
4,6250 % Volkswagen Intl Finance N.V. EO-FLR Notes 2014(26/Und.)	XS1048428442		EUR	2.500	0	0	%	99,4787	2.486.967,38	5,83
3,8750 % Volkswagen Intl Finance N.V. EO-FLR Notes 2020(29/Und.)	XS2187689380		EUR	4.000	0	0	%	91,5000	3.660.000,00	8,59
Zertifikate										
Deut. Börse Commodities GmbH Xetra-Gold IHS 2007(09/Und)	DE000A0S9GB0		STK	80.000	0	7.000	EUR	59,8850	4.790.800,00	11,24
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere							EUR	5.321.210,40	12,48	
Verzinsliche Wertpapiere										
2,6000 % Allianz SE FLR-Sub.Ter.Nts.v.21(31/unb.)	DE000A3E5TR0		EUR	600	0	0	%	72,5611	435.366,35	1,02
0,0000 % Credit Suisse AG EURO STOXX Exp.-Zt. 22/12.1.28	DE000CS8DHM2		STK	5.000	0	0	EUR	101,4600	507.300,00	1,19
0,2500 % McDonald's Corp. EO-Medium-Term Nts 2021(21/28)	XS2393236000		EUR	500	0	0	%	88,3454	441.727,05	1,04
Zertifikate										
J.P. Morgan Struct. Prod. B.V. Autoc.Z 29.03.28 Basket	XS2487080421		STK	1.000	0	0	EUR	1.056,9700	1.056.970,00	2,48
J.P. Morgan Struct. Prod. B.V. DIZ 22.03.24	DE000JP23SL5		STK	5.200	0	0	EUR	253,4600	1.317.992,00	3,09
UniCredit Bank GmbH HVB EXP.PL.Z15.02.30 Basket	DE000HVB8560		STK	500	500	0	EUR	1.021,8900	510.945,00	1,20
UniCredit Bank GmbH HVB Expr.Z11.06.30 BSKT	DE000HVB8G58		STK	1.000	1.000	0	EUR	1.050,9100	1.050.910,00	2,47
Investmentanteile							EUR	6.433.060,00	15,09	
Gruppenfremde Investmentanteile										
iShsIII-Core MSCI World U.ETF Registered Shs USD (Acc) o.N.	IE00B4L5Y983		ANT	15.000	0	0	EUR	82,0780	1.231.170,00	2,89
MPF Aktien Strat.Total Return Inhaber-Anteile o.N.	LU0330557819		ANT	7.000	0	5.500	EUR	166,3900	1.164.730,00	2,73
MPF Renten Strategie Chance Inhaber-Anteile o.N.	LU0330568691		ANT	13.000	0	4.500	EUR	124,3600	1.616.680,00	3,79
MUL Amundi MSCI AC World UCITS ETF Inh.Anteile Acc	LU1829220216		ANT	6.200	0	0	EUR	390,4000	2.420.480,00	5,68

Halbjahresbericht für MPF Abakus

Vermögensaufstellung zum 31.12.2023

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.12.2023	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Summe Wertpapiervermögen								EUR 41.531.995,31	97,43
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrument und Geldmarktfonds								EUR 709.788,03	1,67
Bankguthaben								EUR 709.788,03	1,67
EUR - Guthaben bei:									
M.M.Warburg & CO [AG & Co.] KGaA			EUR	709.788,03			% 100,0000	709.788,03	1,67
Sonstige Vermögensgegenstände								EUR 406.090,72	0,95
Zinsansprüche			EUR	406.090,72				406.090,72	0,95
Sonstige Verbindlichkeiten								EUR -20.740,11	-0,05
Verwaltungsvergütung			EUR	-5.832,18				-5.832,18	-0,01
Verwahrstellenvergütung			EUR	-795,53				-795,53	0,00
Externe Management-/Beratungsvergütung			EUR	-8.045,64				-8.045,64	-0,02
Prüfungskosten			EUR	-4.200,86				-4.200,86	-0,01
Veröffentlichungskosten			EUR	-1.865,90				-1.865,90	0,00
Fondsvermögen								EUR 42.627.133,95	100,00 1)
MPF Abakus									
Anteilwert							EUR	146,06	
Anzahl Anteile							STK	291.854,000	

Fußnoten:

1) Auf Grund von Rundung bei der Berechnung % Anteil am Fondsvermögen, kann es zu geringfügigen Rundungsdifferenzen kommen.

Halbjahresbericht für MPF Abakus

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Halbjahresbericht für MPF Abakus

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
Börsengehandelte Wertpapiere					
Verzinsliche Wertpapiere					
3,7500 % Bayer AG FLR-Sub.Anl.v.2014(2024/2074)	DE000A11QR73	EUR	0	1.000	
2,3750 % Bayer AG FLR-Sub.Anl.v.2019(2025/2079)	XS2077670003	EUR	0	3.000	
Nichtnotierte Wertpapiere					
Verzinsliche Wertpapiere					
3,7500 % Bayer AG z.Verkauf eing.Anl(2024/2074)	DE000A351397	EUR	1.000	1.000	
0,0000 % Bundesrep.Deutschland Bundesobl.Ser.178 v.2018(23)	DE0001141786	EUR	3.800	7.050	
0,0000 % Bundesrep.Deutschland Bundesschatzanw. v.21(23)	DE0001104867	EUR	5.400	5.400	
0,0000 % Credit Suisse AG EURO STOXX Exp.-Zt.21/18.11.27	DE000CS8DFX3	STK	0	5.000	
Zertifikate					
UniCredit Bank AG HVB EXP.PL Z11.08.28 Basket	DE000HVB5533	STK	0	500	
Investmentanteile					
Gruppenfremde Investmentanteile					
AIS-Am.EO H.Y.Co.Bd ESG UC.ETF Namens-Anteile Acc o.N.	LU1215415214	ANT	0	2.500	

Halbjahresbericht für MPF Abakus

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)	97,43
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)	0,00

Sonstige Angaben

MPF Abakus		
Anteilwert	EUR	146,06
Anzahl Anteile	STK	291.854,000

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

Das im Folgenden dargestellte Vorgehen bei der Bewertung der Vermögensgegenstände des Sondervermögens findet auch in Zeiten höherer Marktvolatilitäten oder auftretender Marktverwerfungen im Zusammenhang mit den Auswirkungen der Coronavirus-Pandemie Anwendung. Darüber hinausgehende Bewertungsanpassungen waren nicht erforderlich.

Der Anteilwert wird gem. § 169 KAGB von der Bantleon Invest AG 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.

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.

Weitere zum Verständnis des Berichts erforderliche Angaben

Für den vorliegenden Zeitraum sind keine weiteren Angaben erforderlich.

**Halbjahresbericht
für MPF Abakus**

Hannover, den 13. Februar 2024

BANTLEON Invest AG
(vormals Warburg Invest AG)

Caroline Specht

Gerd Lückel