

Halbjahresbericht

CSR Bond Focus SDG Fonds

zum 28. Februar 2022

Halbjahresbericht des CSR Bond Focus SDG Fonds

ZUM 28. FEBRUAR 2022

■ Vermögensübersicht	2
■ Vermögensaufstellung	3
■ Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV	7

■ Vermögensübersicht

	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
I. Vermögensgegenstände	9.573.617,05	100,09
1. Aktien	0,00	0,00
2. Anleihen	7.976.303,88	83,39
Finanzsektor	2.090.546,77	21,86
Anleihen supranationaler Organisationen	1.074.576,14	11,23
Technologie & Elektronik	911.468,00	9,53
Banking/Bankwesen	838.010,57	8,76
Energiewerte	741.110,00	7,75
Regierungsanleihen	513.837,98	5,37
Staatlich garantierte Anlagen	495.497,84	5,18
Investitionsgüter	398.080,00	4,16
Reise & Freizeit	346.000,00	3,62
Transportwesen	297.176,58	3,11
Konsumgüter	258.000,00	2,70
Versorgungswerte	12.000,00	0,13
3. Derivate	-1.860,00	-0,02
Zins-Derivate	-1.860,00	-0,02
4. Forderungen	1.116.558,65	11,67
5. Kurzfristig liquidierbare Anlagen	0,00	0,00
6. Bankguthaben	213.422,52	2,23
7. Sonstige Vermögensgegenstände	269.192,00	2,81
Zielfondsanteile	269.192,00	2,81
Indexfonds	269.192,00	2,81
II. Verbindlichkeiten	-8.146,75	-0,09
Sonstige Verbindlichkeiten	-8.146,75	-0,09
III. Fondsvermögen	9.565.470,30	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 28.02.2022	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
Börsengehandelte Wertpapiere								3.862.046,65	40,37
Verzinsliche Wertpapiere									
Euro								3.862.046,65	40,37
0,0000 % BUND V.20-30	DE0001030708		EUR	300.000	-	-	% 99,911	299.733,00	3,13
0,0000 % EU MTN V.20-30	EU000A283859		EUR	200.000	-	200.000	% 95,499	190.997,34	2,00
0,0000 % LAWI.RENTENBK. MTN V.21-31	XS2359292955		EUR	200.000	-	-	% 93,757	187.513,52	1,96
0,0500 % DZ BANK MTN A.1536	DE000DFK0GB1		EUR	400.000	-	-	% 94,790	379.160,00	3,96
0,1000 % EUROFIMA MTN V.20-30	XS2176621253		EUR	300.000	-	-	% 94,650	283.950,00	2,97
0,1250 % BAY.LB MTN V.21-28	DE000BLB6JJ0		EUR	300.000	-	-	% 93,288	279.864,39	2,93
0,2500 % NIBC BK. MTN V.21-26	XS2384734542		EUR	200.000	200.000	-	% 95,067	190.133,78	1,99
0,3750 % LBBW MTN S.822	DE000LB2CW16		EUR	200.000	-	200.000	% 89,493	178.986,18	1,87
0,5000 % BERLIN HYP V.19-29	DE000BHY0GA7		EUR	200.000	-	-	% 94,173	188.345,76	1,97
0,6250 % SNCF MTN V.20-30	FR0013507647		EUR	300.000	-	-	% 99,059	297.176,58	3,11
0,7500 % KFW MTN V.18-28	DE000A2LQSH4		EUR	300.000	-	200.000	% 102,661	307.984,32	3,22
1,0000 % EIB MTN V.19-42	XS1980857319		EUR	300.000	-	-	% 101,635	304.905,00	3,19
1,3500 % IRLAND TREA. V.18-31	IE00BFZRQ242		EUR	200.000	-	200.000	% 107,052	214.104,98	2,24
1,9710 % SCATEC FRN V.21-25	NO0010931181		EUR	300.000	-	-	% 88,156	264.468,00	2,76
2,7500 % EIB MTN V.13-30	XS0960306578		EUR	250.000	-	-	% 117,890	294.723,80	3,08
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere								4.114.257,23	43,01
Verzinsliche Wertpapiere									
Euro								4.114.257,23	43,01
0,0000 % DEUTSCHE LICHTMIETE V.18-23	DE000A2G9JL5		EUR	400.000	-	-	% 17,010	68.040,00	0,71
0,0000 % HYLEA GR. V.17-22	DE000A19S801		EUR	200.000	-	-	% 6,000	12.000,00	0,13
4,2000 % AUDAX RENOVABLES V.20-27	ES0236463008		EUR	300.000	-	-	% 82,090	246.270,00	2,57
5,0000 % DT.BILDUNG STUDIENFD. V.13-23	DE000A1YCQ86		EUR	400.000	-	-	% 97,250	389.000,00	4,07
5,2500 % AVES ONE V.20-25	DE000A289R74		EUR	400.000	-	-	% 99,520	398.080,00	4,16
5,5000 % OPUS-CHARTER.I.C.35 V.16-24	DE000A184F09		EUR	250.000	250.000	-	% 99,000	247.500,00	2,59
6,0000 % INDESTO GC WIND V.20-23	DE000A3E46Z6		EUR	400.000	-	-	% 100,500	402.000,00	4,20
6,0000 % NEXTBIKE V.20-25	DE000A254RZ4		EUR	400.000	-	-	% 86,500	346.000,00	3,62
6,5000 % AFRICA GREENTEC ASSET V.17-32	DE000A2GSGF9		EUR	150.000	-	-	% 98,000	147.000,00	1,54
6,5000 % PHOTON EN. V.21-27	DE000A3KWKY4		EUR	80.000	80.000	-	% 101,000	80.800,00	0,84
6,5000 % PROCREDIT HOLD. V.14-24	DE000A11QHV9		EUR	500.000	-	-	% 104,998	524.992,23	5,49
6,5000 % SUNFARM. V.20-25	DE000A254UP9		EUR	250.000	-	-	% 102,000	255.000,00	2,67
6,7500 % RECONCEPT V.20-25	DE000A289R82		EUR	150.000	-	-	% 99,050	148.575,00	1,55
7,0000 % ACTAQUA V.20-25	DE000A3H2TU8		EUR	400.000	-	-	% 98,000	392.000,00	4,10
8,0000 % AGRI RES.GR. V.21-26	DE000A287088		EUR	300.000	-	-	% 86,000	258.000,00	2,70
10,0000 % CCE GR. V.20-22	DE000A285FP4		EUR	200.000	-	-	% 99,500	199.000,00	2,08
Investmentanteile								269.192,00	2,81
Gesellschaftsfremde Investmentanteile									
Euro								269.192,00	2,81
M.U.L.-LYX.GR.BD.ESG S.DR U.	LU1981859819		ANT	14.000	-	10.200	EUR 19,228	269.192,00	2,81

■ Vermögensaufstellung

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 28.02.2022	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
Summe Wertpapiervermögen								8.245.495,88	86,20
Derivate								-1.860,00	-0,02
Zins-Derivate									
Optionsrechte								-1.860,00	-0,02
Optionsrechte auf Zinsterminkontrakte									
CALL EURO-BUND-FUT. 164 04/22		EUREX	STK	-6			EUR	-1.860,00	-0,02
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds								213.422,52	2,23
Bankguthaben								213.422,52	2,23
EUR-Guthaben bei:									
Verwahrstelle									
KREISSPARKASSE KÖLN			EUR	213.422,52			% 100,000	213.422,52	2,23
Sonstige Vermögensgegenstände								1.116.558,65	11,67
ZINSANSPRÜCHE			EUR	122.711,20				122.711,20	1,28
FORDERUNGEN AUS SCHWEBENDEN GESCHÄFTEN			EUR	991.987,45				991.987,45	10,37
GELEISTETE VARIATION MARGIN			EUR	1.860,00				1.860,00	0,02
Sonstige Verbindlichkeiten								-8.146,75	-0,09
KOSTENABGRENZUNGEN			EUR	-8.146,75				-8.146,75	-0,09
Fondsvermögen							EUR	9.565.470,30	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)	9.565.470,30
Anteilwert (EUR)	89,80
Umlaufende Anteile (STK)	106.516,5170

■ Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Alle Vermögenswerte: Kurse bzw. Marktsätze per 28.02.2022 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 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 2.744

Basiswerte: (EURO-BUND-FUTURE 12/21)

Optionsrechte

Optionrechte auf Zins-Derivate

Optionsrechte auf Zinsterminkontrakte

Verkaufte Kaufoptionen (call) EUR 4.152

Basiswerte: (CALL EURO-BUND-FUT. 170 03/22, CALL EURO-BUND-FUT. 173 02/22, CALL EURO-BUND-FUT. 174,50 01/22, CALL EURO-BUND-FUT. 174,50 02/22)

■ Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben nach der Derivateverordnung

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen	86,20 %
Bestand der Derivate am Fondsvermögen	-0,02 %

Sonstige Angaben

CSR Bond Focus SDG Fonds (A)

ISIN	DE000A2PT145
Fondsvermögen (EUR)	9.565.470,30
Anteilwert (EUR)	89,80
Umlaufende Anteile (STK)	106.516,5170
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.

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 Rücknahmeabschläge gezahlt.

