

# Halbjahresbericht

## CSR Bond Focus SDG Fonds

zum 28. Februar 2023

---

# Halbjahresbericht des CSR Bond Focus SDG Fonds

ZUM 28. FEBRUAR 2023

■ 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
<b>I. Vermögensgegenstände</b>	<b>5.748.074,02</b>	<b>100,21</b>
<b>1. Aktien</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>
<b>2. Anleihen</b>	<b>5.174.696,10</b>	<b>90,22</b>
Finanzsektor	1.235.768,86	21,55
Technologie & Elektronik	807.333,95	14,08
Energiewerte	710.546,50	12,39
Anleihen supranationaler Organisationen	545.607,55	9,51
Staatlich garantierte Anlagen	418.175,41	7,29
Regierungsanleihen	406.732,00	7,09
Banking/Bankwesen	395.034,11	6,89
Reise & Freizeit	300.040,00	5,23
Transportwesen	163.687,72	2,85
Versorgungswerte	102.520,00	1,79
Konsumgüter	89.250,00	1,56
<b>3. Derivate</b>	<b>-43.080,00</b>	<b>-0,75</b>
Zins-Derivate	-43.080,00	-0,75
<b>4. Forderungen</b>	<b>151.809,50</b>	<b>2,65</b>
<b>5. Kurzfristig liquidierbare Anlagen</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>
<b>6. Bankguthaben</b>	<b>291.123,32</b>	<b>5,08</b>
<b>7. Sonstige Vermögensgegenstände</b>	<b>173.525,10</b>	<b>3,03</b>
Zielfondsanteile	173.525,10	3,03
Indexfonds	173.525,10	3,03
<b>II. Verbindlichkeiten</b>	<b>-12.322,94</b>	<b>-0,21</b>
Sonstige Verbindlichkeiten	-12.322,94	-0,21
<b>III. Fondsvermögen</b>	<b>5.735.751,08</b>	<b>100,00*)</b>

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

## ■ Vermögensaufstellung

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 28.02.2023	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>								<b>2.464.286,65</b>	<b>42,96</b>
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>									
<b>Euro</b>								<b>2.464.286,65</b>	<b>42,96</b>
0,0000 % LAWI.RENTENBK. MTN V.21-31	XS2359292955		EUR	200.000	-	-	% 76,728	153.455,50	2,68
0,1000 % EUROFIMA MTN V.20-30	XS2176621253		EUR	300.000	-	-	% 79,250	237.750,00	4,15
0,1250 % BAY.LB MTN V.21-28	DE000BLB6J0		EUR	300.000	-	-	% 82,482	247.445,91	4,31
0,3750 % LBBW MTN S.822	DE000LB2CW16		EUR	200.000	-	-	% 73,794	147.588,20	2,57
0,5000 % BERLIN HYP V.19-29	DE000BHY0GA7		EUR	200.000	-	-	% 79,622	159.243,86	2,78
0,6250 % SNCF MTN V.20-30	FR0013507647		EUR	200.000	-	-	% 81,844	163.687,72	2,85
0,7500 % KFW MTN V.18-28	DE000A2LQSH4		EUR	300.000	-	-	% 88,240	264.719,91	4,62
1,0000 % EIB MTN V.19-42	XS1980857319		EUR	100.000	-	-	% 65,225	65.225,00	1,14
1,3500 % IRLAND TREA. V.18-31	IE00BFZRQ242		EUR	100.000	-	-	% 88,108	88.108,00	1,54
2,0000 % NIEDERLANDE V.14-24	NL0010733424		EUR	100.000	100.000	-	% 98,414	98.414,00	1,72
2,7500 % EIB MTN V.13-30	XS0960306578		EUR	250.000	-	-	% 97,053	242.632,55	4,23
4,7500 % BUND V.98-28	DE0001135085		EUR	200.000	200.000	-	% 110,105	220.210,00	3,84
5,2030 % SCATEC FRN V.21-25	NO0010931181		EUR	300.000	-	-	% 91,302	273.906,00	4,78
5,5000 % VEOLIA ENVIR. MTN V.09-24	FR0010780528		EUR	100.000	100.000	-	% 101,900	101.900,00	1,78
<b>An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere</b>								<b>2.710.409,45</b>	<b>47,25</b>
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>									
<b>Euro</b>								<b>2.710.409,45</b>	<b>47,25</b>
0,0000 % DEUTSCHE LICHTMIETE V.18-23	DE000A2G9JL5		EUR	400.000	-	-	% 2,500	10.000,00	0,17
0,0000 % HYLEA GR. V.17-22	DE000A19S801		EUR	200.000	-	-	% 0,310	620,00	0,01
4,2000 % AUDAX RENOVABLES V.20-27	ES0236463008		EUR	300.000	-	-	% 58,620	175.860,00	3,07
5,0000 % DT.BILDUNG STUDIENFD. V.13-23	DE000A1YCQ86		EUR	285.000	-	-	% 99,000	282.150,00	4,92
5,0000 % PNE V.22-27	DE000A30VJW3		EUR	150.000	-	-	% 102,375	153.562,50	2,68
5,5000 % OPUS-CHART.ISS.C35 V.16-24	DE000A184F09		EUR	125.000	-	125.000	% 99,200	124.000,00	2,16
5,5000 % SUNFARM. V.20-25	DE000A254UP9		EUR	231.000	-	-	% 100,000	231.000,00	4,03
6,0000 % NEXTBIKE V.20-25	DE000A254RZ4		EUR	400.000	-	-	% 75,010	300.040,00	5,23
6,5000 % AFRICA GREENTEC ASSET V.17-32	DE000A2GSGF9		EUR	150.000	-	-	% 98,000	147.000,00	2,56
6,5000 % GREENCELLS V.20-25	DE000A289YQ5		EUR	150.000	150.000	-	% 96,400	144.600,00	2,52
6,5000 % PHOTON EN. V.21-27	DE000A3KWKY4		EUR	80.000	-	-	% 99,405	79.524,00	1,39
6,5000 % PROCREDIT HOLD. V.14-24	DE000A11QHV9		EUR	500.000	-	-	% 102,500	512.500,00	8,94
6,7500 % RECONCEPT V.20-25	DE000A289R82		EUR	150.000	-	-	% 105,250	157.875,00	2,75
7,0000 % PAUL TECH V.20-25	DE000A3H2TU8		EUR	335.000	-	-	% 90,277	302.427,95	5,27
8,0000 % AGRI RES.GR. V.21-26	DE000A287088		EUR	170.000	-	90.000	% 52,500	89.250,00	1,56
<b>Investmentanteile</b>								<b>173.525,10</b>	<b>3,03</b>
<b>Gesellschaftsfremde Investmentanteile</b>									
<b>Euro</b>								<b>173.525,10</b>	<b>3,03</b>
MUL-LYXOR CORP.GREEN BD.DR 'B'	LU2370241684		ANT	19.950	19.950	-	EUR 8,698	173.525,10	3,03

## ■ Vermögensaufstellung

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 28.02.2023	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
<b>Summe Wertpapiervermögen</b>								<b>5.348.221,20</b>	<b>93,24</b>
<b>Derivate</b>								<b>-43.080,00</b>	<b>-0,75</b>
<b>Zins-Derivate</b>									
<b>Zinsterminkontrakte</b>								<b>-43.080,00</b>	<b>-0,75</b>
EURO-BUND-FUTURE 03/23		EUREX	STK	700.000			EUR	-43.080,00	-0,75
<b>Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds</b>								<b>291.123,32</b>	<b>5,08</b>
<b>Bankguthaben</b>								<b>291.123,32</b>	<b>5,08</b>
<b>EUR-Guthaben bei:</b>									
<b>Verwahrstelle</b>									
KREISSPARKASSE KÖLN			EUR	291.123,32			% 100,000	291.123,32	5,08
<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>								<b>151.809,50</b>	<b>2,65</b>
ZINSANSPRÜCHE			EUR	108.729,50				108.729,50	1,90
GELEISTETE VARIATION MARGIN			EUR	43.080,00				43.080,00	0,75
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>								<b>-12.322,94</b>	<b>-0,21</b>
VERBINDLICHKEITEN AUS SCHWEBENDEN GESCHÄFTEN			EUR	-7.061,20				-7.061,20	-0,12
KOSTENABGRENZUNGEN			EUR	-5.261,74				-5.261,74	-0,09
<b>Fondsvermögen</b>							<b>EUR</b>	<b>5.735.751,08</b>	<b>100,00<sup>*)</sup></b>

<sup>\*)</sup> Durch Rundung der Prozent-Anteile bei der Berechnung können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.

### CSR Bond Focus SDG Fonds (A)

ISIN	DE000A2PT145
Fondsvermögen (EUR)	5.735.751,08
Anteilwert (EUR)	79,01
Umlaufende Anteile (STK)	72.598,5170

## ■ Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

Die Vermögensgegenstände des Sondervermögens sind auf der Grundlage nachstehender Kurse/Marktsätze bewertet:  
Alle Vermögenswerte: Kurse bzw. Marktsätze per 28.02.2023 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
---------------------	------	------------------------------	----------------	-------------------

**Börsengehandelte Wertpapiere**

**Verzinsliche Wertpapiere**

**Euro**

0,0000 % BUND V.20-30	DE0001030708	EUR	-	100.000
0,0000 % EU MTN V.20-30	EU000A283859	EUR	-	200.000
0,0500 % DZ BANK MTN A.1536	DE000DFK0GB1	EUR	-	400.000

**Investmentanteile**

**Gesellschaftsfremde Investmentanteile**

**Euro**

MUL-LYX.G.GR.BD.1-10Y(DR)U.	LU1981859819	ANT	-	14.000
-----------------------------	--------------	-----	---	--------

■ **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**

**Zinsterminkontrakte**

**Gekaufte Kontrakte**

**EUR**

**705**

Basiswerte: (EURO-BUND-FUTURE 12/22)

## ■ Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

### Angaben nach der Derivateverordnung

<b>Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen</b>	<b>93,24 %</b>
<b>Bestand der Derivate am Fondsvermögen</b>	<b>-0,75 %</b>

### Sonstige Angaben

#### CSR Bond Focus SDG Fonds (A)

ISIN	DE000A2PT145
Fondsvermögen (EUR)	5.735.751,08
Anteilwert (EUR)	79,01
Umlaufende Anteile (STK)	72.598,5170
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.



## ■ Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

### Angaben zur Transparenz

#### Verwaltungsvergütungssatz für im Sondervermögen gehaltene Investmentanteile:

Investmentanteile	Verwaltungsvergütung <sup>1)</sup>
MUL-Lyx.G.Gr.Bd.1-10Y(DR)U.	0,25000 % p.a.
MUL-Lyxor Corp.Green Bd.DR 'B'	0,20000 % p.a.

<sup>1)</sup> Von anderen Kapitalverwaltungsgegesellschaften 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.

