



# Halbjahresbericht

zum 30. September 2023

## Indexstrategie ausgewogen

Ein Investmentfonds mit Sondervermögenscharakter (fonds commun de placement) gemäß Teil I des Luxemburger Gesetzes vom 17. Dezember 2010 über Organismen für gemeinsame Anlagen in seiner jeweils gültigen Fassung  
K805



HAUCK  
AUFHÄUSER  
FUND SERVICES

Verwaltungsgesellschaft



HAUCK  
AUFHÄUSER  
LAMPE

Verwahrstelle

## Inhalt

Management und Verwaltung	3
Erläuterungen zu der Vermögensübersicht	5
Indexstrategie ausgewogen	6



# Management und Verwaltung

## Verwaltungsgesellschaft

**Hauck & Aufhäuser Fund Services S.A.**  
R.C.S. Luxembourg B28878  
1c, rue Gabriel Lippmann, L-5365 Munsbach  
Gezeichnetes Kapital zum 31. Dezember 2022: EUR 11,0 Mio.

## Aufsichtsrat

### Vorsitzender

**Dr. Holger Sepp**  
Vorstand  
Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG, Frankfurt am Main

### Mitglieder

**Marie-Anne van den Berg**  
Independent Director

**Andreas Neugebauer**  
Independent Director

## Vorstand

**Elisabeth Backes**  
Hauck & Aufhäuser Fund Services S.A., Luxemburg

**Christoph Kraiker**  
Hauck & Aufhäuser Fund Services S.A., Luxemburg

**Wendelin Schmitt**  
Hauck & Aufhäuser Fund Services S.A., Luxemburg

## Verwahrstelle

**Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG, Niederlassung Luxemburg**  
1c, rue Gabriel Lippmann, L-5365 Munsbach

## Zahl-, Vertriebs- und Kontaktstellen

### *Großherzogtum Luxemburg*

**Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG, Niederlassung Luxemburg**  
1c, rue Gabriel Lippmann, L-5365 Munsbach

### *Bundesrepublik Deutschland*

**Kontaktstelle Deutschland:**  
**Hauck & Aufhäuser Fund Services S.A.**  
1c, rue Gabriel Lippmann, L-5365 Munsbach

**Vertriebsstelle Deutschland:**  
**Performance Asset Management AG**  
Augustaanlage 3, D-68165 Mannheim

## Anlageberater

**Performance Swiss AG**  
Hauptstrasse 22, CH-4313 Möhlin

## Abschlussprüfer

**KPMG Audit S.à r.l.**  
Cabinet de révision agréé  
39, Avenue John F. Kennedy, L-1855 Luxemburg

## Register- und Transferstelle

**Hauck & Aufhäuser Fund Services S.A.**  
1c, rue Gabriel Lippmann, L-5365 Munsbach



**Sehr geehrte Damen und Herren,**

der vorliegende Bericht informiert Sie umfassend über die Entwicklung des Investmentfonds Indexstrategie ausgewogen.

Der Investmentfonds ist ein nach Luxemburger Recht in Form eines fonds commun de placement (FCP) errichtetes Sondervermögen aus Wertpapieren und sonstigen Vermögenswerten. Er wurde nach Teil I des Luxemburger Gesetzes vom 17. Dezember 2010 über Organismen für gemeinsame Anlagen in seiner jeweils gültigen Fassung ("Gesetz von 2010") gegründet und erfüllt die Anforderungen der Richtlinie des Rates der Europäischen Gemeinschaften Nr. 2009/65/EG vom 13. Juli 2009, zuletzt geändert durch die Richtlinie 2014/91/EU des Europäischen Parlamentes und des Rates vom 23. Juli 2014 ("Richtlinie 2009/65/EG").

Zeichnungen können nur auf Grundlage des aktuellen Verkaufsprospekts, des Basisinformationsblattes für verpackte Anlageprodukte für Kleinanleger und Versicherungsanlageprodukte (PRIIP) zusammen mit dem Zeichnungsantragsformular, dem letzten Jahresbericht und gegebenenfalls dem letzten Halbjahresbericht erfolgen.

Sonstige wichtige Informationen an die Anteilhaber werden grundsätzlich auf der Internetseite der Verwaltungsgesellschaft ([www.hal-privatbank.com](http://www.hal-privatbank.com)) veröffentlicht. Hier finden Sie ebenfalls aktuelle Fondspreise und Fakten zu Ihren Fonds. Daneben wird, in gesetzlich vorgeschriebenen Fällen, in Luxemburg außerdem eine Veröffentlichung in einer Luxemburger Tageszeitung geschaltet.

Der Bericht umfasst den Zeitraum vom 1. April 2023 bis zum 30. September 2023.

### Wertentwicklung des Netto-Fondsvermögens im Berichtszeitraum (nach BVI-Methode exkl. Verkaufsprovision)

Indexstrategie ausgewogen E / LU0282283927 (vom 1. April 2023 bis 30. September 2023)

0,67 %

Die Wertentwicklung ist die prozentuale Veränderung zwischen dem angelegten Vermögen am Anfang des Anlagezeitraumes und seinem Wert am Ende des Anlagezeitraumes und beruht auf der Annahme, dass etwaige Ausschüttungen wieder angelegt wurden. Historische Wertentwicklungen lassen keine Rückschlüsse auf eine ähnliche Entwicklung in der Zukunft zu.



Der vorliegende Bericht wurde gemäß den in Luxemburg geltenden Vorschriften nach Lux GAAP auf dem Grundsatz der Unternehmensfortführung erstellt.

Der Wert eines Anteils ("Anteilwert") lautet auf die im Verkaufsprospekt festgelegte Währung der Anteilklasse ("Anteilklassenwährung"). Er wird unter Aufsicht der Verwahrstelle von der Verwaltungsgesellschaft oder einem von ihr beauftragten Dritten an jedem im Verkaufsprospekt festgelegten Tag ("Bewertungstag") berechnet. Die Berechnung des Fonds und seiner Anteilklassen erfolgt durch Teilung des Netto-Fondsvermögens der jeweiligen Anteilklasse durch die Zahl der am Bewertungstag im Umlauf befindlichen Anteile dieser Anteilklasse. Soweit in Jahres- und Halbjahresberichten sowie sonstigen Finanzstatistiken aufgrund gesetzlicher Vorschriften oder gemäß den Regelungen des Verwaltungsreglements Auskunft über die Situation des Fondsvermögens des Fonds insgesamt gegeben werden muss, erfolgen diese Angaben in Euro ("Referenzwährung"), und die Vermögenswerte werden in die Referenzwährung umgerechnet.

Das Netto-Fondsvermögen wird nach folgenden Grundsätzen berechnet:

- a) Die im Fonds enthaltenen Zielfondsanteile werden zum letzten festgestellten und erhältlichen Anteilwert bzw. Rücknahmepreis bewertet.
- b) Der Wert von Kassenbeständen oder Bankguthaben, Einlagenzertifikaten und ausstehenden Forderungen, vorausbezahlten Auslagen, Bardividenden und erklärten oder aufgelaufenen und noch nicht erhaltenen Zinsen entspricht dem jeweiligen vollen Betrag, es sei denn, dass dieser wahrscheinlich nicht voll bezahlt oder erhalten werden kann, in welchem Falle der Wert unter Einschluss eines angemessenen Abschlages ermittelt wird, um den tatsächlichen Wert zu erhalten.
- c) Der Wert von Vermögenswerten, welche an einer Börse oder an einem anderen geregelten Markt notiert oder gehandelt werden, wird auf der Grundlage des letzten verfügbaren Kurses ermittelt, sofern nachfolgend nichts anderes geregelt ist.
- d) Sofern ein Vermögenswert nicht an einer Börse oder auf einem anderen geregelten Markt notiert oder gehandelt wird oder sofern Vermögenswerte, welche an einer Börse oder auf einem anderen Markt wie vorerwähnt notiert oder gehandelt werden, die Kurse entsprechend den Regelungen in c) den tatsächlichen Marktwert der entsprechenden Vermögenswerte nicht angemessen widerspiegeln, wird der Wert solcher Vermögenswerte auf der Grundlage des vernünftigerweise vorhersehbaren Verkaufspreises nach einer vorsichtigen Einschätzung ermittelt.
- e) Der Liquidationswert von Futures, Forwards oder Optionen, die nicht an Börsen oder anderen organisierten Märkten gehandelt werden, entspricht dem jeweiligen Nettoliquidationswert, wie er gemäß den Richtlinien des Vorstands auf einer konsistent für alle verschiedenen Arten von Verträgen angewandten Grundlage festgestellt wird. Der Liquidationswert von Futures, Forwards oder Optionen, welche an Börsen oder anderen organisierten Märkten gehandelt werden, wird auf der Grundlage der letzten verfügbaren Abwicklungspreise solcher Verträge an den Börsen oder organisierten Märkten, auf welchen diese Futures, Forwards oder Optionen vom Fonds gehandelt werden, berechnet; sofern ein Future, ein Forward oder eine Option an einem Tag, für welchen der Nettovermögenswert bestimmt wird, nicht liquidiert werden kann, wird die Bewertungsgrundlage für einen solchen Vertrag vom Vorstand in angemessener und vernünftiger Weise bestimmt.
- f) Swaps werden zu ihrem Marktwert bewertet. Es wird darauf geachtet, dass Swap-Kontrakte zu marktüblichen Bedingungen im exklusiven Interesse des Fonds abgeschlossen werden.
- g) Geldmarktinstrumente können zu ihrem jeweiligen Verkehrswert, wie ihn die Verwaltungsgesellschaft nach Treu und Glauben und allgemein anerkannten, von Wirtschaftsprüfern nachprüfbar festgelegten Bewertungsregeln festlegt, bewertet werden.
- h) Sämtliche sonstige Wertpapiere oder sonstige Vermögenswerte werden zu ihrem angemessenen Marktwert bewertet, wie dieser nach Treu und Glauben und entsprechend dem der Verwaltungsgesellschaft auszustellenden Verfahren zu bestimmen ist.
- i) Die auf Wertpapiere entfallenden anteiligen Zinsen werden mit einbezogen, soweit diese nicht im Kurswert berücksichtigt wurden (Dirty-Pricing).
- j) Der Wert aller Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, welche nicht in der Währung des Fonds ausgedrückt sind, wird in diese Währung zu den zuletzt verfügbaren Devisenkursen umgerechnet. Wenn solche Kurse nicht verfügbar sind, wird der Wechselkurs nach Treu und Glauben und nach dem vom Vorstand aufgestellten Verfahren bestimmt.

Die Verwaltungsgesellschaft kann nach eigenem Ermessen andere Bewertungsmethoden zulassen, wenn sie dieses im Interesse einer angemesseneren Bewertung eines Vermögenswertes des Fonds für angebracht hält.

Wenn die Verwaltungsgesellschaft der Ansicht ist, dass der ermittelte Anteilwert an einem bestimmten Bewertungstag den tatsächlichen Wert der Anteile des Fonds nicht wiedergibt, oder wenn es seit der Ermittlung des Anteilwertes beträchtliche Bewegungen an den betreffenden Börsen und/oder Märkten gegeben hat, kann die Verwaltungsgesellschaft beschließen, den Anteilwert noch am selben Tag zu aktualisieren. Unter diesen Umständen werden alle für diesen Bewertungstag eingegangenen Anträge auf Zeichnung und Rücknahme auf der Grundlage des Anteilwertes eingelöst, der unter Berücksichtigung des Grundsatzes von Treu und Glauben aktualisiert worden ist.

Im Berichtszeitraum kamen keine Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Gesamtrendite-Swaps im Sinne der Verordnung (EU) 2015/2365 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 25. November 2015 über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften und der Weiterverwendung sowie zur Änderung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 ("SFTR") zum Einsatz. Somit sind im Halbjahresbericht keine Angaben im Sinne von Artikel 13 der genannten Verordnung an die Anleger aufzuführen.

**Risikohinweise zum Ukraine-Konflikt:** Die Auswirkungen der Ukraine-Krise für den Fonds sind derzeit nicht abschließend zu beurteilen. Auch wenn keine direkten Wertpapierbestände in der Ukraine oder Russland vorhanden sind, besteht die Gefahr, dass indirekte Risiken aus den verhängten Sanktionen, entstehender Marktvolatilität oder steigenden Energiepreisen Einfluss auf die Entwicklung des Fonds oder von Geschäftspartnern nehmen.



# Vermögensaufstellung zum 30.09.2023

## Indexstrategie ausgewogen

Gattungsbezeichnung	Markt	ISIN	Stück/ Anteile/ Whg.	Bestand zum 30.09.2023	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Whg.	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
<b>Investmentanteile*</b>								<b>5.474.095,43</b>	<b>99,33</b>	
<b>Gruppenfremde Investmentanteile</b>										
<b>Irland</b>										
iShs VII-Co.MSCI Pac.xJP U.ETF Reg. Shares USD (Acc) o.N.		IE00B52MJY50	Anteile	1.500,00	1.500,00	0,00	EUR	146,86	220.290,00	4,00
iShsII-EO C.Bd 0-3yr ESG U.ETF Registered Shares o.N.		IE00BYZTVV78	Anteile	121.000,00	0,00	0,00	EUR	4,85	587.092,00	10,65
iShsIII-MSCI EM Sm.Cap U.ETF Registered Shares o.N.		IE00B3F81G20	Anteile	3.225,00	0,00	0,00	EUR	74,57	240.488,25	4,36
SPDR MSCI Wrld Small Cap U.ETF Registered Shares o.N.		IE00BCBJG560	Anteile	3.400,00	0,00	0,00	EUR	83,72	284.648,00	5,17
Xtr.(IE) - MSCI World Value Registered Shares 1C USD o.N.		IE00BL25JM42	Anteile	4.475,00	0,00	-4.475,00	EUR	36,85	164.903,75	2,99
Xtr.(IE)-MSCI World Minim.Vol. Registered Shares 1C USD o.N.		IE00BL25JN58	Anteile	5.000,00	0,00	0,00	EUR	35,53	177.625,00	3,22
<b>Liechtenstein</b>										
Quantex Fds-Quan.Global Val.Fd Inhaber-Anteile I EUR o.N.		LI0399611685	Anteile	1.165,00	0,00	0,00	EUR	264,45	308.084,25	5,59
<b>Luxemburg</b>										
AIS-AM.WORLD SRI PAB Act.Nom. UCITS ETF DR (C) o.N.		LU1861134382	Anteile	7.925,00	0,00	0,00	EUR	81,51	645.966,75	11,72
AIS-Amundi MSCI EM ASIA Namens-Anteile C Cap.EUR o.N.		LU1681044480	Anteile	5.750,00	0,00	0,00	EUR	31,51	181.180,78	3,29
Allianz Euro Cash Inhaber-Anteile A (EUR) o.N.		LU0052221412	Anteile	7.600,00	7.600,00	0,00	EUR	46,76	355.407,92	6,45
Am.Idx Sol.Amu.EUR C.0-1 Y ESG Act.N.UCITS ETF DR-EUR(D)o.N.		LU1686830065	Anteile	3.825,00	975,00	0,00	EUR	121,54	464.908,48	8,44
Amundi Index Solu.-A.PRIME GL. Nam-Ant.UC.ETF DR USD Acc.o.N.		LU2089238203	Anteile	25.250,00	0,00	0,00	EUR	23,88	602.970,00	10,94
CIF-CG Glb. High Inc. Opp. (L) Reg. Shs Class Zd EUR o.N.		LU0817816308	Anteile	6.500,00	0,00	-6.500,00	EUR	23,88	155.220,00	2,82
JPMorgan-China Fund Act.Nom.JPM China C(dis)USD o.N.		LU0822046875	Anteile	1.650,00	400,00	0,00	USD	157,74	246.398,75	4,47
MUL-LYX.MSCI Wd.IN.T.TR UC.ETF Nam.-An. ACC EUR o.N.		LU0533033667	Anteile	850,00	0,00	-350,00	EUR	551,70	468.945,00	8,51
Xtr.II Eurozone Gov.Bond 1-3 Inhaber-Anteile 1C o.N.		LU0290356871	Anteile	2.300,00	0,00	0,00	EUR	160,86	369.966,50	6,71
<b>Derivate</b>								<b>-23.613,07</b>	<b>-0,43</b>	
<b>Devisentermingeschäfte bei</b>										
<b>Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG</b>										
<b>Offene Positionen</b>										
Kauf EUR 600.000,00 / Verkauf USD 666.036,00		OTC							-23.613,07	-0,43
<b>Bankguthaben</b>								<b>81.437,14</b>	<b>1,48</b>	
<b>EUR - Guthaben</b>										
EUR bei Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG, Niederlassung Luxemburg				80.515,53		EUR		80.515,53		1,46

\* Angaben zu Ausgabeaufschlägen, Rücknahmeabschlägen sowie zur maximalen Höhe der Verwaltungsgebühr für Zielfondsanteile sind auf Anfrage am Sitz der Verwaltungsgesellschaft, bei der Verwahrstelle und bei den Zahlstellen kostenlos erhältlich.



Gattungsbezeichnung	Markt	ISIN	Stück/ Anteile/ Whg.	Bestand zum 30.09.2023	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Whg.	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens		
<b>Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen</b>												
USD bei Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG, Niederlassung Luxemburg				973,50			USD		921,61	0,02		
<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>									<b>508,04</b>	<b>0,01</b>		
Zinsansprüche aus Bankguthaben				508,04			EUR		508,04	0,01		
<b>Gesamtaktiva</b>									<b>5.532.427,54</b>	<b>100,39</b>		
<b>Verbindlichkeiten</b>									<b>-21.461,57</b>	<b>-0,39</b>		
<b>aus</b>												
Prüfungskosten				-10.324,50			EUR		-10.324,50	-0,19		
Risikomanagementvergütung				-800,00			EUR		-800,00	-0,01		
Sonstige Verbindlichkeiten				-2.325,00			EUR		-2.325,00	-0,04		
Taxe d'abonnement				-252,53			EUR		-252,53	0,00		
Transfer- und Registerstellenvergütung				-350,00			EUR		-350,00	-0,01		
Vertriebsstellenvergütung				-2.799,64			EUR		-2.799,64	-0,05		
Verwahrstellenvergütung				-410,45			EUR		-410,45	-0,01		
Verwaltungsvergütung				-4.199,45			EUR		-4.199,45	-0,08		
<b>Gesamtpassiva</b>									<b>-21.461,57</b>	<b>-0,39</b>		
<b>Fondsvermögen</b>									<b>5.510.965,97</b>	<b>100,00**</b>		
<b>Umlaufende Anteile E</b>			<b>STK</b>								<b>105.338,830</b>	
<b>Anteilwert E</b>			<b>EUR</b>								<b>52,32</b>	

\*\*Bei der Ermittlung der Prozentwerte können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.



## Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

Die Vermögensgegenstände des Fonds, welche nicht in Fondswährung ausgedrückt sind, sind auf Grundlage der zuletzt festgestellten Devisenkurse bewertet.

## Devisenkurse (in Mengennotiz)

US-Dollar	USD	1,0563	per 28.09.2023 = 1 Euro (EUR)
-----------	-----	--------	----------------------------------

## Marktschlüssel

### Außerbörslicher Handel

OTC Over-the-Counter





Fondsvermögen in EUR, umlaufende Anteile und Anteilwert in EUR  
Indexstrategie ausgewogen

	<b>Anteilklasse E in EUR</b>
<b>zum 30.09.2023</b>	
Fondsvermögen	5.510.965,97
Umlaufende Anteile	105.338,830
Anteilwert	52,32

