

Halbjahresbericht

Barmenia Nachhaltigkeit Balanced

zum 30. Juni 2022

Halbjahresbericht des Barmenia Nachhaltigkeit Balanced

ZUM 30. JUNI 2022

| | |
|--|----|
| ■ Vermögensübersicht | 2 |
| ■ Vermögensaufstellung | 4 |
| ■ Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit diese nicht mehr Gegenstand der Vermögensaufstellung sind | 10 |
| ■ Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV | 11 |

■ Vermögensübersicht

| | Kurswert in EUR | % des Fondsver- mögens |
|---|----------------------|------------------------------|
| I. Vermögensgegenstände | 21.782.033,07 | 100,09 |
| 1. Aktien | 10.844.881,02 | 49,83 |
| Technologie | 2.098.784,58 | 9,64 |
| Finanzwerte | 1.864.042,81 | 8,57 |
| Industriewerte | 1.733.098,66 | 7,96 |
| Gesundheitswesen | 1.338.111,92 | 6,15 |
| Konsumgüter | 1.272.079,77 | 5,85 |
| Verbraucher-Dienstleistungen | 1.072.784,64 | 4,93 |
| Telekommunikation | 526.631,61 | 2,42 |
| Rohstoffe | 393.310,24 | 1,81 |
| Energiewerte | 226.890,63 | 1,04 |
| Versorgungsunternehmen | 214.181,01 | 0,98 |
| Immobilien | 104.965,15 | 0,48 |
| 2. Anleihen | 10.445.450,46 | 48,00 |
| Anleihen supranationaler Organisationen | 2.567.573,60 | 11,80 |
| Finanzsektor | 1.498.641,40 | 6,89 |
| Regierungsanleihen | 1.349.770,25 | 6,20 |
| Staatlich garantierte Anlagen | 877.153,05 | 4,03 |
| Banking/Bankwesen | 818.418,86 | 3,76 |
| Gebietskörperschaften | 693.881,95 | 3,19 |
| Technologie & Elektronik | 481.393,18 | 2,21 |
| Telekommunikation | 474.494,25 | 2,18 |
| Konsumgüter | 427.857,80 | 1,97 |
| Gesundheitswesen | 424.877,22 | 1,95 |
| Automobil | 380.863,40 | 1,75 |
| Immobilien | 302.759,32 | 1,39 |
| Versorgungswerte | 147.766,18 | 0,68 |
| 3. Derivate | -132.537,58 | -0,61 |
| Devisen-Derivate | -132.537,58 | -0,61 |
| 4. Forderungen | 118.695,69 | 0,55 |
| 5. Kurzfristig liquidierbare Anlagen | 0,00 | 0,00 |
| 6. Bankguthaben | 505.543,48 | 2,32 |
| 7. Sonstige Vermögensgegenstände | 0,00 | 0,00 |

■ Vermögensübersicht

| | Kurswert in EUR | % des Fondsver- mögens |
|------------------------------|----------------------|------------------------------|
| II. Verbindlichkeiten | -19.258,30 | -0,09 |
| Sonstige Verbindlichkeiten | -19.258,30 | -0,09 |
| III. Fondsvermögen | 21.762.774,77 | 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 30.06.2022 | Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum | Verkäufe/ Abgänge | Kurs | Kurswert in EUR | % des Fondsver- mögens |
|-------------------------------------|--------------|-------|------------------------------------|-----------------------|--|----------------------|---------------|----------------------|------------------------------|
| Börsengehandelte Wertpapiere | | | | | | | | 18.167.224,22 | 83,48 |
| Aktien | | | | | | | | | |
| Euro | | | | | | | | 2.745.001,74 | 12,61 |
| AIR LIQUIDE | FR0000120073 | | STK | 825 | - | - | EUR 128,120 | 105.699,00 | 0,49 |
| ALLIANZ VINK.NAM. | DE0008404005 | | STK | 575 | - | - | EUR 182,120 | 104.719,00 | 0,48 |
| ARCELORMITTAL NOUV. | LU1598757687 | | STK | 3.125 | - | - | EUR 21,510 | 67.218,75 | 0,31 |
| ASML HOLD. | NL0010273215 | | STK | 357 | 62 | 80 | EUR 455,850 | 162.738,45 | 0,75 |
| BCO.SANT. | ES0113900J37 | | STK | 18.750 | 18.750 | - | EUR 2,688 | 50.400,00 | 0,23 |
| BEIERSDORF | DE0005200000 | | STK | 312 | 312 | - | EUR 97,480 | 30.413,76 | 0,14 |
| BNP PARIBAS | FR0000131104 | | STK | 2.937 | - | 500 | EUR 45,365 | 133.237,01 | 0,61 |
| BOUYGUES | FR0000120503 | | STK | 3.775 | 1.625 | - | EUR 29,360 | 110.834,00 | 0,51 |
| CIE D.ST.GOBAIN | FR0000125007 | | STK | 1.247 | - | 315 | EUR 40,945 | 51.058,42 | 0,23 |
| DAIMLER TRUCK HOLD. NAM. | DE000DTR0CK8 | | STK | 562 | - | - | EUR 24,910 | 13.999,42 | 0,06 |
| DANONE | FR0000120644 | | STK | 500 | 500 | - | EUR 53,260 | 26.630,00 | 0,12 |
| DT.BÖRSE NAM. | DE0005810055 | | STK | 625 | 156 | - | EUR 159,600 | 99.750,00 | 0,46 |
| DT.POST NAM. | DE0005552004 | | STK | 2.725 | 875 | 625 | EUR 35,740 | 97.391,50 | 0,45 |
| DT.TELEKOM NAM. | DE0005557508 | | STK | 8.000 | 1.750 | - | EUR 18,946 | 151.568,00 | 0,70 |
| E.ON NAM. | DE000ENAG999 | | STK | 5.000 | - | 1.250 | EUR 8,008 | 40.040,00 | 0,18 |
| EIFFAGE | FR0000130452 | | STK | 250 | 250 | - | EUR 85,880 | 21.470,00 | 0,10 |
| ENAGAS | ES0130960018 | | STK | 5.875 | 2.750 | - | EUR 21,070 | 123.786,25 | 0,57 |
| ESSILORLUXOTTICA | FR0000121667 | | STK | 625 | - | - | EUR 142,900 | 89.312,50 | 0,41 |
| EUROAPI | FR0014008VX5 | | STK | 57 | - | 0 | EUR 15,054 | 858,08 | 0,00 |
| HERMES INT. | FR0000052292 | | STK | 125 | 25 | - | EUR 1.067,000 | 133.375,00 | 0,61 |
| KON.AHOLD DELHAIZE | NL0011794037 | | STK | 3.713 | - | 1.500 | EUR 24,860 | 92.305,18 | 0,42 |
| KONINKLIJKE DSM | NL0000009827 | | STK | 500 | - | - | EUR 137,100 | 68.550,00 | 0,31 |
| KPN | NL0000009082 | | STK | 9.375 | 9.375 | - | EUR 3,401 | 31.884,38 | 0,15 |
| L'ORÉAL | FR0000120321 | | STK | 425 | 120 | 225 | EUR 329,300 | 139.952,50 | 0,64 |
| MERCEDES-BENZ GR. NAM. | DE0007100000 | | STK | 1.937 | - | - | EUR 55,220 | 106.961,14 | 0,49 |
| MERCK | DE0006599905 | | STK | 469 | - | - | EUR 161,000 | 75.509,00 | 0,35 |
| MÜNCH.RÜCK. VINK.NAM. | DE0008430026 | | STK | 215 | - | - | EUR 224,200 | 48.203,00 | 0,22 |
| NN GR. | NL0010773842 | | STK | 725 | - | - | EUR 43,340 | 31.421,50 | 0,14 |
| NORDEA BK. | FI4000297767 | | STK | 3.000 | - | - | EUR 8,401 | 25.202,67 | 0,12 |
| RANDSTAD | NL0000379121 | | STK | 1.250 | - | - | EUR 46,200 | 57.750,00 | 0,27 |
| SANOFI | FR0000120578 | | STK | 1.687 | 375 | - | EUR 96,340 | 162.525,58 | 0,75 |
| SAP | DE0007164600 | | STK | 1.093 | 343 | 250 | EUR 86,930 | 95.014,49 | 0,44 |
| SNAM | IT0003153415 | | STK | 20.625 | 4.375 | - | EUR 4,999 | 103.104,38 | 0,47 |
| TELEFÓNICA | ES0178430E18 | | STK | 6.250 | 6.250 | - | EUR 4,862 | 30.387,50 | 0,14 |
| TERNA R.E.N. | IT0003242622 | | STK | 4.375 | 4.375 | - | EUR 7,488 | 32.760,00 | 0,15 |
| WOLTERS KLUWER NAM. | NL0000395903 | | STK | 313 | - | 500 | EUR 92,560 | 28.971,28 | 0,13 |
| US-Dollar | | | | | | | | 4.255.530,68 | 19,55 |
| ABBOTT LAB. | US0028241000 | | STK | 187 | - | 188 | USD 108,650 | 19.434,26 | 0,09 |
| ABBVIE | US00287Y1091 | | STK | 437 | - | - | USD 153,160 | 64.021,16 | 0,29 |
| ACCENTURE 'A' | IE00B4BNMY34 | | STK | 343 | - | 210 | USD 277,650 | 91.093,74 | 0,42 |
| ALPHABET | US02079K1079 | | STK | 143 | - | - | USD 2.187,450 | 299.206,42 | 1,37 |
| AMAZON.COM | US0231351067 | | STK | 620 | - | - | USD 106,210 | 62.987,42 | 0,29 |
| AMER.FIN.GR. | US0259321042 | | STK | 1.592 | 467 | - | USD 138,810 | 211.378,37 | 0,97 |
| ANSYS | US03662Q1058 | | STK | 203 | - | - | USD 239,290 | 46.464,08 | 0,21 |

■ Vermögensaufstellung

| Gattungsbezeichnung | ISIN | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. | Bestand 30.06.2022 | Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum | Verkäufe/ Abgänge | Kurs | Kurswert in EUR | % des Fondsver- mögens |
|---------------------------|--------------|-------|------------------------------------|-----------------------|---|----------------------|---------------|--------------------|------------------------------|
| APPLE | US0378331005 | STK | | 2.692 | - | - | USD 136,720 | 352.049,59 | 1,62 |
| AUTO.DATA PROC. | US0530151036 | STK | | 542 | - | - | USD 210,040 | 108.892,52 | 0,50 |
| BK.AMERICA | US0605051046 | STK | | 4.187 | 750 | - | USD 31,130 | 124.674,84 | 0,57 |
| CELANESE (DEL.) | US1508701034 | STK | | 437 | - | 188 | USD 117,610 | 49.161,19 | 0,23 |
| CISCO SYS. | US17275R1023 | STK | | 2.150 | - | 800 | USD 42,640 | 87.690,47 | 0,40 |
| CITIGROUP | US1729674242 | STK | | 625 | - | - | USD 45,990 | 27.494,14 | 0,13 |
| COCA-COLA | US1912161007 | STK | | 3.374 | 550 | - | USD 62,910 | 203.030,60 | 0,93 |
| COSTCO WHOLES. | US22160K1051 | STK | | 316 | 50 | - | USD 479,280 | 144.868,22 | 0,67 |
| CSX | US1264081035 | STK | | 1.375 | - | - | USD 29,060 | 38.220,38 | 0,18 |
| DOLLAR GENERAL (NEW) | US2566771059 | STK | | 500 | 125 | - | USD 245,440 | 117.384,86 | 0,54 |
| EDISON INT. | US2810201077 | STK | | 1.874 | 937 | - | USD 63,240 | 113.359,57 | 0,52 |
| ELI LILLY | US5324571083 | STK | | 581 | - | 200 | USD 324,230 | 180.188,08 | 0,83 |
| HOME DEPOT | US4370761029 | STK | | 126 | - | 312 | USD 274,270 | 33.055,64 | 0,15 |
| HP | US40434L1052 | STK | | 2.761 | - | - | USD 32,780 | 86.570,93 | 0,40 |
| HUNT (J.B.) TRANSP.SERV. | US4456581077 | STK | | 313 | - | 437 | USD 157,470 | 47.145,35 | 0,22 |
| JOHNSON&J. | US4781601046 | STK | | 752 | 187 | 300 | USD 177,510 | 127.684,27 | 0,59 |
| JPMORGAN | US46625H1005 | STK | | 875 | 250 | - | USD 112,610 | 94.250,08 | 0,43 |
| KROGER | US5010441013 | STK | | 1.525 | - | 1.250 | USD 47,330 | 69.040,37 | 0,32 |
| META PLATFORMS 'A' | US30303M1027 | STK | | 187 | - | 188 | USD 161,250 | 28.842,84 | 0,13 |
| MICROSOFT | US5949181045 | STK | | 1.380 | 200 | - | USD 256,830 | 339.017,07 | 1,56 |
| MOTOROLA SOLUTIONS | US6200763075 | STK | | 250 | - | - | USD 209,600 | 50.121,96 | 0,23 |
| OLD DOMINION FREIGHT LINE | US6795801009 | STK | | 382 | - | 180 | USD 256,280 | 93.642,89 | 0,43 |
| PAYCHEX | US7043261079 | STK | | 375 | 375 | - | USD 113,870 | 40.844,85 | 0,19 |
| PEPSICO | US7134481081 | STK | | 187 | - | - | USD 166,660 | 29.810,53 | 0,14 |
| PFIZER | US7170811035 | STK | | 1.887 | - | 1.238 | USD 52,430 | 94.634,28 | 0,43 |
| PROCTER & GAMBLE | US7427181091 | STK | | 1.366 | - | 350 | USD 143,790 | 187.878,08 | 0,86 |
| PROGRESSIVE | US7433151039 | STK | | 650 | 312 | - | USD 116,270 | 72.289,92 | 0,33 |
| PRUDENTIAL FIN. | US7443201022 | STK | | 620 | - | - | USD 95,680 | 56.742,65 | 0,26 |
| PUB.STORAGE | US74460D1090 | STK | | 187 | - | - | USD 312,670 | 55.927,39 | 0,26 |
| SYNOPSIS | US8716071076 | STK | | 199 | - | 125 | USD 303,700 | 57.808,89 | 0,27 |
| TEXAS INSTR. | US8825081040 | STK | | 468 | - | 219 | USD 153,650 | 68.782,06 | 0,32 |
| TRACTOR SUPPLY | US8923561067 | STK | | 541 | - | 240 | USD 193,850 | 100.313,60 | 0,46 |
| UNION PAC. | US9078181081 | STK | | 187 | 187 | - | USD 213,280 | 38.149,47 | 0,18 |
| WASTE MANAGEMENT (DEL.) | US94106L1098 | STK | | 775 | - | - | USD 152,980 | 113.405,23 | 0,52 |
| WILLIAMS CO. | US9694571004 | STK | | 937 | 937 | - | USD 31,210 | 27.972,42 | 0,13 |
| Schweizer Franken | | | | | | | | 791.787,02 | 3,64 |
| ABB NAM. | CH0012221716 | STK | | 3.125 | - | - | CHF 25,460 | 79.490,96 | 0,37 |
| GIVAUDAN NAM. | CH0010645932 | STK | | 13 | - | - | CHF 3.357,000 | 43.601,76 | 0,20 |
| KÜHNE&NAGEL INT. | CH0025238863 | STK | | 220 | - | - | CHF 226,000 | 49.675,29 | 0,23 |
| NESTLÉ | CH0038863350 | STK | | 2.098 | - | 588 | CHF 111,440 | 233.590,89 | 1,07 |
| ROCHE HOLD. G. | CH0012032048 | STK | | 440 | 93 | 140 | CHF 318,550 | 140.035,97 | 0,64 |
| SIKA NAM. | CH0418792922 | STK | | 186 | - | 157 | CHF 220,000 | 40.883,21 | 0,19 |
| UBS GR. NAM. | CH0244767585 | STK | | 7.500 | 1.250 | - | CHF 15,390 | 115.321,21 | 0,53 |
| ZURICH FIN.SERV. NAM. | CH0011075394 | STK | | 215 | 140 | - | CHF 415,200 | 89.187,73 | 0,41 |
| Dänische Kronen | | | | | | | | 185.076,02 | 0,85 |
| NOVO-NORDISK NAM. 'B' | DK0060534915 | STK | | 1.458 | 156 | 810 | DKK 787,200 | 154.335,30 | 0,71 |
| PANDORA | DK0060252690 | STK | | 512 | - | 500 | DKK 446,500 | 30.740,72 | 0,14 |

Vermögensaufstellung

| Gattungsbezeichnung | ISIN | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. | Bestand 30.06.2022 | Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum | Verkäufe/ Abgänge | Kurs | Kurswert in EUR | % des Fondsver- mögens |
|---------------------------|--------------|-------|------------------------------------|-----------------------|--|----------------------|----------------|---------------------|------------------------------|
| Englische Pfund | | | | | | | | 499.415,62 | 2,29 |
| BUNZL | GB00B0744B38 | STK | | 2.812 | 625 | - | GBP 27,190 | 88.822,35 | 0,41 |
| FERGUSON HOLD. | JE00BJVNSS43 | STK | | 437 | - | - | GBP 91,880 | 46.644,47 | 0,21 |
| HSBC HOLD. | GB0005405286 | STK | | 14.125 | 5.625 | - | GBP 5,356 | 87.887,43 | 0,40 |
| RELX | GB00B2B0DG97 | STK | | 5.512 | 1.250 | 938 | GBP 22,260 | 142.538,48 | 0,65 |
| RIO TINTO | GB0007188757 | STK | | 500 | 500 | - | GBP 49,165 | 28.557,74 | 0,13 |
| SEGRO | GB00B5ZN1N88 | STK | | 9.250 | - | - | GBP 9,768 | 104.965,15 | 0,48 |
| Schwedische Kronen | | | | | | | | 43.001,21 | 0,20 |
| SKANSKA 'B' | SE0000113250 | STK | | 2.938 | - | 2.500 | SEK 156,800 | 43.001,21 | 0,20 |
| Japanische Yen | | | | | | | | 2.276.517,51 | 10,46 |
| AJINOMOTO | JP3119600009 | STK | | 900 | 900 | - | JPY 3.300,000 | 20.911,13 | 0,10 |
| BANDAI NAMCO HOLD. | JP3778630008 | STK | | 300 | - | - | JPY 9.579,000 | 20.233,10 | 0,09 |
| BRIDGESTONE | JP3830800003 | STK | | 1.900 | - | - | JPY 4.950,000 | 66.218,57 | 0,30 |
| DAI-ICHI LIFE HOLD. | JP3476480003 | STK | | 3.900 | 900 | - | JPY 2.510,000 | 68.922,23 | 0,32 |
| DAI NIPPON PRINT. | JP3493800001 | STK | | 3.000 | - | - | JPY 2.926,000 | 61.804,00 | 0,28 |
| DAIWA SEC.GR. | JP3502200003 | STK | | 11.000 | - | - | JPY 606,000 | 46.933,86 | 0,22 |
| DENSO | JP3551500006 | STK | | 400 | - | 600 | JPY 7.208,000 | 20.299,99 | 0,09 |
| FANUC | JP3802400006 | STK | | 600 | - | - | JPY 21.240,000 | 89.727,74 | 0,41 |
| FUJI ELEC. | JP3820000002 | STK | | 2.100 | - | - | JPY 5.620,000 | 83.095,33 | 0,38 |
| FUJIFILM HOLD. | JP3814000000 | STK | | 700 | 700 | - | JPY 7.278,000 | 35.869,98 | 0,16 |
| FUJITSU | JP3818000006 | STK | | 600 | - | - | JPY 16.965,000 | 71.668,13 | 0,33 |
| HITACHI | JP3788600009 | STK | | 1.200 | - | - | JPY 6.438,000 | 54.394,28 | 0,25 |
| ITOCHU | JP3143600009 | STK | | 1.500 | - | - | JPY 3.667,000 | 38.727,83 | 0,18 |
| KAO | JP3205800000 | STK | | 1.000 | 1.000 | - | JPY 5.472,000 | 38.527,17 | 0,18 |
| KDDI | JP3496400007 | STK | | 3.200 | - | - | JPY 4.289,000 | 96.633,34 | 0,44 |
| KOBAYASHI PHARMA. | JP3301100008 | STK | | 400 | 400 | - | JPY 8.360,000 | 23.544,38 | 0,11 |
| KYOCERA | JP3249600002 | STK | | 1.500 | - | 600 | JPY 7.256,000 | 76.631,89 | 0,35 |
| MAKITA | JP3862400003 | STK | | 800 | - | - | JPY 3.382,000 | 19.049,54 | 0,09 |
| MITSUBISHI UFJ FIN.GR. | JP3902900004 | STK | | 22.000 | 4.000 | - | JPY 729,400 | 112.982,04 | 0,52 |
| MITSUMI CHEM. | JP3888300005 | STK | | 1.500 | - | - | JPY 2.890,000 | 30.521,80 | 0,14 |
| NINTENDO | JP3756600007 | STK | | 100 | - | - | JPY 58.680,000 | 41.315,32 | 0,19 |
| NIPPON TEL. AND TEL. | JP3735400008 | STK | | 4.400 | - | - | JPY 3.896,000 | 120.695,93 | 0,55 |
| NITTO DENKO | JP3684000007 | STK | | 1.100 | - | - | JPY 8.780,000 | 67.999,89 | 0,31 |
| ONO PHARMA. | JP3197600004 | STK | | 2.500 | - | - | JPY 3.482,000 | 61.290,02 | 0,28 |
| ORIENTAL LAND | JP3198900007 | STK | | 500 | - | - | JPY 18.920,000 | 66.605,81 | 0,31 |
| OTSUKA HOLD.COMP. | JP3188220002 | STK | | 1.500 | - | - | JPY 4.818,000 | 50.883,74 | 0,23 |
| RESONA | JP3500610005 | STK | | 22.800 | 3.800 | - | JPY 508,100 | 81.565,22 | 0,37 |
| SEKISUI HOUSE | JP3420600003 | STK | | 1.200 | 1.200 | - | JPY 2.376,500 | 20.078,91 | 0,09 |
| SHIMADZU | JP3357200009 | STK | | 1.500 | - | - | JPY 4.290,000 | 45.307,44 | 0,21 |
| SOFTBK. | JP3732000009 | STK | | 9.000 | 3.000 | - | JPY 1.506,500 | 95.462,46 | 0,44 |
| SOMPO HOLD. | JP3165000005 | STK | | 1.000 | 1.000 | - | JPY 5.983,000 | 42.125,01 | 0,19 |
| SONY GR. | JP3435000009 | STK | | 1.500 | - | - | JPY 11.095,000 | 117.176,24 | 0,54 |
| SUMIT.MITSUI FIN.GR. | JP3890350006 | STK | | 1.500 | - | - | JPY 4.032,000 | 42.582,66 | 0,20 |
| SUMITOMO RUBBER IND. | JP3404200002 | STK | | 2.500 | - | - | JPY 1.159,000 | 20.400,67 | 0,09 |
| SYSMEX | JP3351100007 | STK | | 800 | - | - | JPY 8.166,000 | 45.996,03 | 0,21 |
| TOKYO ELECTRON | JP3571400005 | STK | | 400 | - | - | JPY 44.300,000 | 124.762,68 | 0,57 |
| TOYOTA MOTOR | JP3633400001 | STK | | 8.000 | - | - | JPY 2.100,000 | 118.285,16 | 0,54 |
| TREND MICRO | JP3637300009 | STK | | 800 | - | - | JPY 6.620,000 | 37.287,99 | 0,17 |

■ Vermögensaufstellung

| Gattungsbezeichnung | ISIN | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. | Bestand 30.06.2022 | Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum | Verkäufe/ Abgänge | Kurs | Kurswert in EUR | % des Fondsvermögens |
|---|---------------|-------|------------------------------|--------------------|------------------------------------|-------------------|-----------|---------------------|----------------------|
| Neuseeland-Dollar | | | | | | | | 48.551,22 | 0,22 |
| MERCURY NZ | NZMRPE0001S2 | | STK | 1 | - | - | NZD 5,650 | 3,36 | 0,00 |
| RYMAN HEALTHCARE | NZRYME0001S4 | | STK | 9.172 | - | - | NZD 8,900 | 48.547,86 | 0,22 |
| Verzinsliche Wertpapiere | | | | | | | | | |
| Euro | | | | | | | | 3.402.602,86 | 15,63 |
| 0,6250 % A2A MTN V.21-31 | XS2364001078 | | EUR | 200.000 | - | - | % 73,883 | 147.766,18 | 0,68 |
| 0,7500 % MERCEDES-B.GR. MTN V.19-30 | DE000A2YNZX6 | | EUR | 450.000 | - | - | % 84,636 | 380.863,40 | 1,75 |
| 0,9500 % ITALIEN B.T.P. V.21-31 | IT0005449969 | | EUR | 400.000 | - | - | % 81,620 | 326.480,00 | 1,50 |
| 1,0000 % HEIMSTADEN BOS.TREA. MTN 21-28 | XS2397252102 | | EUR | 400.000 | 135.000 | - | % 75,690 | 302.759,32 | 1,39 |
| 1,2500 % SPANIEN V.20-30 | ES0000012G34 | | EUR | 100.000 | - | - | % 92,725 | 92.724,50 | 0,43 |
| 1,3420 % MORGAN STANLEY FRN V.17-26 MTN | XS1706111793 | | EUR | 500.000 | - | - | % 94,836 | 474.178,15 | 2,18 |
| 1,3500 % ITALIEN B.T.P. V.19-30 | IT0005383309 | | EUR | 550.000 | - | - | % 88,812 | 488.463,25 | 2,24 |
| 1,5000 % VODAFONE GR. MTN V.17-27 | XS1652855815 | | EUR | 500.000 | - | - | % 94,899 | 474.494,25 | 2,18 |
| 2,0000 % GOLDMAN S.GR. MTN V.18-28 | XS1861206636 | | EUR | 300.000 | - | - | % 90,924 | 272.771,31 | 1,25 |
| 2,3500 % SPANIEN V.17-33 | ES00000128Q6 | | EUR | 450.000 | - | - | % 98,245 | 442.102,50 | 2,03 |
| US-Dollar | | | | | | | | 3.118.910,03 | 14,33 |
| 0,7500 % KFW V.20-30 | US500769JG03 | | USD | 750.000 | - | - | % 82,924 | 594.895,53 | 2,73 |
| 0,8750 % EIB V.20-30 | US298785JE71 | | USD | 300.000 | - | - | % 84,497 | 242.470,76 | 1,11 |
| 1,6250 % EIB MTN V.19-29 | US298785JA59 | | USD | 600.000 | - | - | % 90,262 | 518.030,17 | 2,38 |
| 1,7500 % ASIAN DEV.BK. V.19-29 | US045167EP43 | | USD | 150.000 | - | - | % 90,604 | 129.997,17 | 0,60 |
| 2,8750 % KFW V.18-28 | US500769HS68 | | USD | 300.000 | - | - | % 98,362 | 282.257,52 | 1,30 |
| 3,2500 % EIB V.14-24 | US298785GJ95 | | USD | 500.000 | - | - | % 100,263 | 479.519,44 | 2,20 |
| 4,7500 % WELTBANK V.05-35 | US45905CAA27 | | USD | 800.000 | - | - | % 113,920 | 871.739,44 | 4,01 |
| Englische Pfund | | | | | | | | 800.830,31 | 3,68 |
| 4,5000 % EIB MTN V.09-29 | XS0415532273 | | GBP | 250.000 | - | - | % 112,185 | 325.816,62 | 1,50 |
| 5,8750 % CITIGROUP MTN V.04-24 | XS0195612592 | | GBP | 250.000 | - | - | % 102,404 | 297.410,00 | 1,37 |
| 6,5000 % HSBC BK. MTN V.98-23 | XS0088317853 | | GBP | 150.000 | - | - | % 101,921 | 177.603,69 | 0,82 |
| An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere | | | | | | | | 2.801.461,79 | 12,87 |
| Verzinsliche Wertpapiere | | | | | | | | | |
| Euro | | | | | | | | 508.765,52 | 2,34 |
| 0,8750 % NASDAQ V.20-30 | XS2010032881 | | EUR | 100.000 | - | - | % 80,908 | 80.907,72 | 0,37 |
| 1,6250 % MONDELEZ INT. V.15-27 | XS1197270819 | | EUR | 450.000 | - | - | % 95,080 | 427.857,80 | 1,97 |
| US-Dollar | | | | | | | | 1.920.459,79 | 8,82 |
| 1,3750 % U.S.BANCORP MTN V.20-30 | US91159HJA95 | | USD | 450.000 | - | - | % 79,781 | 343.405,17 | 1,58 |
| 1,9500 % IBM V.20-30 | US459200KJ94 | | USD | 600.000 | - | - | % 83,879 | 481.393,18 | 2,21 |
| 3,6000 % ABBVIE V.15-25 | US00287YQAQ26 | | USD | 450.000 | - | - | % 98,708 | 424.877,22 | 1,95 |
| 3,8750 % MORGAN STANLEY V.14-24 | US61746BDQ68 | | USD | 400.000 | - | - | % 100,127 | 383.095,66 | 1,76 |
| 4,0000 % GOLDMAN S. V.14-24 | US38141GVM31 | | USD | 300.000 | - | - | % 100,255 | 287.688,56 | 1,32 |
| Canadische Dollar | | | | | | | | 372.236,48 | 1,71 |
| 9,0000 % BRIT.COLUMBIA V.94-24 | CA110709DP43 | | CAD | 450.000 | - | - | % 111,551 | 372.236,48 | 1,71 |

■ Vermögensaufstellung

| Gattungsbezeichnung | ISIN | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. | Bestand 30.06.2022 | Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum | Verkäufe/ Abgänge | Kurs | Kurswert in EUR | % des Fondsver- mögens |
|---|--------------|-------|------------------------------------|-----------------------|--|----------------------|------------|----------------------|------------------------------|
| Nicht notierte Wertpapiere | | | | | | | | 321.645,47 | 1,48 |
| Verzinsliche Wertpapiere | | | | | | | | | |
| Canadische Dollar | | | | | | | | 321.645,47 | 1,48 |
| 2,1500 % NOVA SCOTIA V.15-25 | CA669827BG14 | | CAD | 450.000 | - | - | % 96,390 | 321.645,47 | 1,48 |
| Summe Wertpapiervermögen | | | | | | | | 21.290.331,48 | 97,83 |
| Derivate | | | | | | | | -132.537,58 | -0,61 |
| Devisen-Derivate | | | | | | | | | |
| Devisenterminkontrakte | | | | | | | | -132.537,58 | -0,61 |
| GBP/EUR 500.000,00 | | OTC | | | | | | 16.788,73 | 0,08 |
| USD/EUR 3.000.000,00 | | OTC | | | | | | -149.326,31 | -0,69 |
| Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds | | | | | | | | 505.543,48 | 2,32 |
| Bankguthaben | | | | | | | | 505.543,48 | 2,32 |
| EUR-Guthaben bei: | | | | | | | | | |
| Verwahrstelle | | | | | | | | | |
| HSBC TRINKAUS & BURKHARDT GMBH | | | EUR | 505.543,48 | | | % 100,000 | 505.543,48 | 2,32 |
| Sonstige Vermögensgegenstände | | | | | | | | 118.695,69 | 0,55 |
| ZINSANSPRÜCHE | | | EUR | 113.318,95 | | | | 113.318,95 | 0,52 |
| DIVIDENDENANSPRÜCHE | | | EUR | 5.376,74 | | | | 5.376,74 | 0,02 |
| Sonstige Verbindlichkeiten | | | | | | | | -19.258,30 | -0,09 |
| KOSTENABGRENZUNGEN | | | EUR | -19.258,30 | | | | -19.258,30 | -0,09 |
| Fondsvermögen | | | | | | | EUR | 21.762.774,77 | 100,00*) |
| Anteilwert | | | | | | | EUR | 53,37 | |
| Umlaufende Anteile | | | | | | | STK | 407.765,00 | |

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

■ Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Alle Vermögenswerte: Kurse bzw. Marktsätze per 30.06.2022 oder letztbekannte.

Devisenkurs(e) bzw. Konversionsfaktor(en) (in Mengennotiz) per 30.06.2022

| | | |
|--------------------|-------|---------------------|
| Canadische Dollar | (CAD) | 1,34855 = 1 (EUR) |
| Schweizer Franken | (CHF) | 1,00090 = 1 (EUR) |
| Dänische Kronen | (DKK) | 7,43665 = 1 (EUR) |
| Englische Pfund | (GBP) | 0,86080 = 1 (EUR) |
| Japanische Yen | (JPY) | 142,02965 = 1 (EUR) |
| Neuseeland-Dollar | (NZD) | 1,68145 = 1 (EUR) |
| Schwedische Kronen | (SEK) | 10,71315 = 1 (EUR) |
| US-Dollar | (USD) | 1,04545 = 1 (EUR) |

■ Marktschlüssel

c) OTC Over-the-Counter

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

Aktien

Euro

| | | | | |
|------------|--------------|-----|---|-------|
| AKZO NOBEL | NL0013267909 | STK | - | 1.187 |
| COLRUYT | BE0974256852 | STK | - | 1.020 |
| FORTUM | F10009007132 | STK | - | 1.350 |

US-Dollar

| | | | | |
|---------------------|--------------|-----|---|-----|
| LENNAR 'A' | US5260571048 | STK | - | 562 |
| METTLER-TOLEDO INT. | US5926881054 | STK | - | 63 |
| MOODY'S | US6153691059 | STK | - | 162 |
| MSCI 'A' | US55354G1004 | STK | - | 187 |
| NVR | US62944T1051 | STK | - | 10 |

Dänische Kronen

| | | | | |
|---------------|--------------|-----|---|-----|
| CARLSBERG 'B' | DK0010181759 | STK | - | 312 |
|---------------|--------------|-----|---|-----|

Englische Pfund

| | | | | |
|--------------|--------------|-----|---|-------|
| BARRATT DEV. | GB0000811801 | STK | - | 9.375 |
|--------------|--------------|-----|---|-------|

Japanische Yen

| | | | | |
|-----------------|--------------|-----|---|-----|
| ADVANTEST | JP3122400009 | STK | - | 700 |
| KEYENCE | JP3236200006 | STK | - | 200 |
| OMRON | JP3197800000 | STK | - | 700 |
| SHIN-ETSU CHEM. | JP3371200001 | STK | - | 400 |

Verzinsliche Wertpapiere

Euro

| | | | | |
|------------------------------------|--------------|-----|---|---------|
| 0,5000 % SPANIEN V.20-30 | ES0000012F76 | EUR | - | 350.000 |
| 3,7500 % ABERTIS INFRASTR. V.13-23 | ES0211845260 | EUR | - | 300.000 |

US-Dollar

| | | | | |
|-----------------------------|--------------|-----|---|---------|
| 4,0000 % HSBC HOLD. V.12-22 | US404280AN99 | USD | - | 350.000 |
|-----------------------------|--------------|-----|---|---------|

■ 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

| | | |
|--------------------------------------|------------|--------------|
| Devisenterminkontrakte (Kauf) | EUR | 3.594 |
| GBP/EUR | EUR | 781 |
| USD/EUR | EUR | 2.813 |

■ Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben nach der Derivateverordnung

| | |
|---|----------------|
| Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen | 97,83 % |
| Bestand der Derivate am Fondsvermögen | -0,61 % |

Sonstige Angaben

| | |
|---------------------------------|-------------------|
| Anteilwert (EUR) | 53,37 |
| Umlaufende Anteile (STK) | 407.765,00 |

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 gleichartig).

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.

