

KAPITALVERWALTUNGSGESELLSCHAFT:



SEB Total Return Bond Fund

HALBJAHRESBERICHT

ZUM 31. MAI 2023

VERWAHRSTELLE:



ASSET MANAGEMENT:



Halbjahresbericht SEB Total Return Bond Fund

Wichtiger Hinweis

Zum 1. Februar 2023 wechselte die Verwahrstellenfunktion für das Sondervermögen von der Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG, Frankfurt am Main, zur Société Générale S.A. Zweigniederlassung Frankfurt, Frankfurt am Main.

Halbjahresbericht SEB Total Return Bond Fund

Vermögensübersicht zum 31.05.2023

Anlageschwerpunkte	Tageswert in EUR	% Anteil am Fondsvermögen
I. Vermögensgegenstände	32.323.362,03	100,16
1. Anleihen	31.629.491,50	98,01
< 1 Jahr	10.474.825,00	32,46
>= 1 Jahr bis < 3 Jahre	19.042.704,00	59,01
>= 3 Jahre bis < 5 Jahre	2.111.962,50	6,54
2. Bankguthaben	307.167,50	0,95
3. Sonstige Vermögensgegenstände	386.703,03	1,20
II. Verbindlichkeiten	-51.353,07	-0,16
III. Fondsvermögen	32.272.008,96	100,00

Halbjahresbericht SEB Total Return Bond Fund

Vermögensaufstellung zum 31.05.2023

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.05.2023	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Bestandspositionen							EUR	31.629.491,50	98,01
Börsengehandelte Wertpapiere							EUR	31.629.491,50	98,01
Verzinsliche Wertpapiere							EUR	31.629.491,50	98,01
2,6000 % Belgien, Königreich EO-Obl. Lin. 2014(24) Ser. 72	BE0000332412		EUR	6.000	1.700	0 %	99,427	5.965.620,00	18,49
0,2000 % Belgien, Königreich EO-Obl. Lin. 2016(23) Ser. 79	BE0000339482		EUR	2.100	0	0 %	98,849	2.075.829,00	6,43
3,6000 % Caisse Refinancement l'Habitat EO-Covered Bonds 2012(24)	FR0011213453		EUR	1.000	0	0 %	100,009	1.000.090,00	3,10
4,2500 % Frankreich EO-OAT 2007(23)	FR0010466938		EUR	3.200	0	0 %	100,404	3.212.928,00	9,96
2,0000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2015(25)	IT0005127086		EUR	6.400	0	0 %	96,851	6.198.464,00	19,21
1,7500 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2019(24)	IT0005367492		EUR	7.000	0	0 %	98,266	6.878.620,00	21,31
0,6000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2020(23)	IT0005405318		EUR	1.200	0	550 %	99,939	1.199.268,00	3,72
0,3500 % Spanien EO-Bonos 2018(23)	ES0000012B62		EUR	3.000	3.000	1.250 %	99,557	2.986.710,00	9,25
1,4500 % Spanien EO-Obligaciones 2017(27)	ES0000012A89		EUR	2.250	0	0 %	93,865	2.111.962,50	6,54
Summe Wertpapiervermögen							EUR	31.629.491,50	98,01

Halbjahresbericht SEB Total Return Bond Fund

Vermögensaufstellung zum 31.05.2023

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.05.2023	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds							EUR	307.167,50	0,95
Bankguthaben							EUR	307.167,50	0,95
EUR - Guthaben bei:									
Société Générale S.A. Zweigniederlassung Frankfurt			EUR	307.167,50			% 100,000	307.167,50	0,95
Sonstige Vermögensgegenstände							EUR	386.703,03	1,20
Zinsansprüche			EUR	386.471,91				386.471,91	1,20
Sonstige Forderungen			EUR	231,12				231,12	0,00
Sonstige Verbindlichkeiten							EUR	-51.353,07	-0,16
Verwaltungsvergütung			EUR	-40.739,45				-40.739,45	-0,13
Verwahrstellenvergütung			EUR	-463,62				-463,62	0,00
Prüfungskosten			EUR	-9.600,00				-9.600,00	-0,03
Veröffentlichungskosten			EUR	-550,00				-550,00	0,00
Fondsvermögen							EUR	32.272.008,96	100,00 1)
Anteilwert							EUR	21,02	
Ausgabepreis							EUR	21,86	
Anteile im Umlauf							STK	1.535.250	

Fußnoten:

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

Halbjahresbericht SEB Total Return Bond Fund

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

**Halbjahresbericht
SEB Total Return Bond Fund**

**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					
0,0000 % Finnland, Republik EO-Bonds 2016(23)	FI4000219787	EUR	0	400	
Nichtnotierte Wertpapiere *)					
Verzinsliche Wertpapiere					
5,4000 % Spanien EO-Bonos 2013(23)	ES00000123U9	EUR	0	4.500	

Die Gesellschaft sorgt dafür, dass eine unangemessene Beeinträchtigung von Anlegerinteressen durch Transaktionskosten vermieden wird, indem unter Berücksichtigung der Anlageziele dieses Sondervermögens ein Schwellenwert für die Transaktionskosten bezogen auf das durchschnittliche Fondsvolumen sowie für eine Portfolioumschlagsrate festgelegt wurde. Die Gesellschaft überwacht die Einhaltung der Schwellenwerte und ergreift im Falle des Überschreitens weitere Maßnahmen.

*) Bei den nichtnotierten Wertpapieren können technisch bedingt auch endfällige Wertpapiere ausgewiesen werden.

Halbjahresbericht SEB Total Return Bond Fund

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)	98,01
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)	0,00

Sonstige Angaben

Anteilwert	EUR	21,02
Ausgabepreis	EUR	21,86
Anteile im Umlauf	STK	1.535.250

Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände

Bewertung

Die nachfolgend dargestellten Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände decken eventuelle aus der Covid-19 Pandemie resultierenden Marktauswirkungen ab. Darüber hinausgehende Bewertungsanpassungen waren nicht erforderlich.

Für Devisen, Aktien, Anleihen und Derivate, die zum Handel an einer Börse oder an einem anderen organisierten Markt zugelassen oder in diesen einbezogen sind, wird der letzte verfügbare handelbare Kurs gemäß § 27 KARBV zugrunde gelegt.

Für Investmentanteile werden die aktuellen Werte, für Bankguthaben und Verbindlichkeiten der Nennwert bzw. Rückzahlungsbetrag gemäß § 29 KARBV zugrunde gelegt.

Für Vermögensgegenstände, die weder zum Handel an einer Börse noch an einem anderen organisierten Markt zugelassen oder in den regulierten Markt oder Freiverkehr einer Börse einbezogen sind oder für die kein handelbarer Kurs verfügbar ist, werden gemäß § 28 KARBV i.V.m. § 168 Absatz 3 KAGB die Verkehrswerte zugrunde gelegt, die sich bei sorgfältiger Einschätzung nach geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten ergeben.

Unter dem Verkehrswert ist der Betrag zu verstehen, zu dem der jeweilige Vermögensgegenstand in einem Geschäft zwischen sachverständigen, vertragswilligen und unabhängigen Geschäftspartnern ausgetauscht werden könnte.

Frankfurt am Main, den 1. Juni 2023

Universal-Investment-Gesellschaft mbH
Die Geschäftsführung

Halbjahresbericht SEB Total Return Bond Fund

Kurzübersicht über die Partner

1. Kapitalverwaltungsgesellschaft

Universal-Investment-Gesellschaft mbH

Hausanschrift:

Theodor-Heuss-Allee 70
60486 Frankfurt am Main

Postanschrift:

Postfach 17 05 48
60079 Frankfurt am Main

Telefon: 069 / 710 43-0
Telefax: 069 / 710 43-700
www.universal-investment.com

Gründung: 1968

Rechtsform: Gesellschaft mit beschränkter Haftung
Gezeichnetes und eingezahltes Kapital: EUR 10.400.000,–
Eigenmittel: EUR 71.352.213,88 (Stand: September 2022)

Geschäftsführer:

Frank Eggloff, München
Mathias Heiß, Langen
Katja Müller, Bad Homburg v. d. Höhe
Markus Neubauer, Frankfurt am Main
Michael Reinhard, Bad Vilbel
Axel Vespermann, Dreieich

Aufsichtsrat:

Prof. Dr. Harald Wiedmann (Vorsitzender), Berlin
Dr. Axel Eckhardt, Düsseldorf
Daniel Fischer, Bad Vilbel
Daniel F. Just, Pöcking

2. Verwahrstelle

Société Générale S.A., Zweigniederlassung Frankfurt am Main

Hausanschrift:

Neue Mainzer Straße 46-50
60311 Frankfurt am Main

Telefon (069) 7174-0
Telefax (069) 7174-196
www.societegenerale.de

Rechtsform: Zweigniederlassung einer Aktiengesellschaft nach französischem Recht
Handelsregister: Registergericht Frankfurt am Main (HRB 37465)
Haftendes Eigenkapital: Mio. € 70.863 (Stand: 31.12.2021)

3. Asset Management-Gesellschaft

SEB Investment Management AB

Postanschrift:

Sergels Torg 2
Stockholm 111 57 Sweden

Telefon +46 8 639 48 00
www.seb.se

WKN / ISIN: 847341 / DE0008473414