

Halbjahresbericht

zum 31. Dezember 2020

ProFund Global Income

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
K807



HAUCK & AUFHÄUSER
Fund Services

Verwaltungsgesellschaft



HAUCK & AUFHÄUSER
PRIVATBANK SEIT 1796

Verwahrstelle

Inhalt

| | |
|---|---|
| Management und Verwaltung | 3 |
| Erläuterungen zu der Vermögensübersicht | 5 |
| ProFund Global Income | 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 2020: EUR 11,0 Mio.

Aufsichtsrat

Vorsitzender

Dr. Holger Sepp

Vorstand

Hauck & Aufhäuser Privatbankiers AG, Frankfurt am Main

Mitglieder

Marie-Anne van den Berg

Independent Director

Andreas Neugebauer

Independent Director

Vorstand

Achim Welschoff

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 Privatbankiers AG, Niederlassung Luxemburg

1c, rue Gabriel Lippmann, L-5365 Munsbach

Zahl- und Informationsstellen

Großherzogtum Luxemburg

Hauck & Aufhäuser Privatbankiers AG, Niederlassung Luxemburg

1c, rue Gabriel Lippmann, L-5365 Munsbach

Bundesrepublik Deutschland

Zahl- und Informationsstelle Deutschland:

Hauck & Aufhäuser Privatbankiers AG

Kaiserstraße 24, D-60311 Frankfurt am Main

Fondsmanager

JRS Finanzmandate GmbH

Am Kellerberg 20, D-86391 Stadlberg

Abschlussprüfer

BDO Audit, S.A.

Cabinet de révision agréé

1, rue Jean Piret, L-2350 Luxembourg

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 ProFund Global Income.

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 oder der wesentlichen Anlegerinformationen (Key Investor Information Document) zusammen mit dem Zeichnungsantragsformular, dem letzten Jahresbericht und gegebenenfalls dem letzten Halbjahresbericht erfolgen.

Wir möchten noch darauf hinweisen, dass Änderungen der Vertragsbedingungen des Sondervermögens sowie sonstige wesentliche Anlegerinformationen an die Anteilinhaber im Internet unter www.hauck-aufhaeuser.com bekannt gemacht werden. Hier finden Sie ebenfalls aktuelle Fondspreise und Fakten zu Ihren Fonds.

Der Bericht umfasst den Zeitraum vom 1. Juli 2020 bis zum 31. Dezember 2020.

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

ProFund Global Income B (vom 1. Juli 2020 bis 31. Dezember 2020)

3,25 %

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 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 Zelfondsanteile 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 für 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 eingeleitet, der unter Berücksichtigung des Grundsatzes von Treu und Glauben aktualisiert worden ist.

Im Berichtszeitraum kamen keine Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Gesamttrendite-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.

Ergänzende Informationen zu den Auswirkungen von COVID-19: Die mittel- bis langfristigen wirtschaftlichen und sozialen Auswirkungen der COVID-19 Pandemie können nur unzureichend prognostiziert werden. Nach Einschätzung der Verwaltungsgesellschaft ergeben sich für den Fonds zum Zeitpunkt der Erstellung des Halbjahresberichts keine Liquiditätsprobleme. Die Auswirkungen auf das Anteilscheingeschäft des Fonds werden von der Verwaltungsgesellschaft kontinuierlich überwacht. Das Anteilscheingeschäft wird zum Zeitpunkt der Erstellung des Halbjahresberichts ordnungsgemäß ausgeführt.



Vermögensaufstellung zum 31.12.2020

ProFund Global Income

| Gattungsbezeichnung | Markt | ISIN | Stück/ Anteile/ Whg. | Bestand zum 31.12.2020 | Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum | Verkäufe/ Abgänge | Whg. | Kurs | Kurswert in EUR | % des Fonds- vermögens |
|---|-------|--------------|----------------------------|------------------------------|--|----------------------|------|--------|---------------------|------------------------------|
| Wertpapiervermögen | | | | | | | | | 8.006.963,59 | 87,78 |
| Börsengehandelte Wertpapiere | | | | | | | | | | |
| Verzinsliche Wertpapiere | | | | | | | | | | |
| Bundesrep. Deutschland | | | | | | | | | | |
| Allianz SE - Anleihe (Fix to Float) - 3,375 | | DE000A13R7Z7 | Nominal | 100.000,00 | 0,00 | 0,00 | EUR | 110,26 | 110.260,00 | 1,21 |
| Allianz SE - Anleihe (Fix to Float) - 4,750 | | DE000A1YCQ29 | Nominal | 100.000,00 | 0,00 | 0,00 | EUR | 112,06 | 112.059,00 | 1,23 |
| BayWa AG - Anleihe (Fix to Float) - 4,250 | | XS1695284114 | Nominal | 350.000,00 | 0,00 | 0,00 | EUR | 102,78 | 359.738,75 | 3,94 |
| Bayer AG - Anleihe (Fix to Float) - 2,375 12.11.2079 | | XS2077670003 | Nominal | 100.000,00 | 0,00 | 0,00 | EUR | 101,86 | 101.859,00 | 1,12 |
| Bayer AG - Anleihe (Fix to Float) - 3,125 12.11.2079 | | XS2077670342 | Nominal | 100.000,00 | 0,00 | 0,00 | EUR | 105,20 | 105.201,50 | 1,15 |
| Bayer AG - Anleihe - 0,375 06.07.2024 | | XS2199265617 | Nominal | 100.000,00 | 100.000,00 | 0,00 | EUR | 101,49 | 101.489,00 | 1,11 |
| Commerzbank AG - Anleihe (Fix to Float) - 7,000 | | XS2024502960 | Nominal | 200.000,00 | 0,00 | 0,00 | USD | 107,16 | 175.049,42 | 1,92 |
| Deutsche Lufthansa AG - Anleihe (Fix to Float) - 5,125 12.08.2075 | | XS1271836600 | Nominal | 200.000,00 | 0,00 | 0,00 | EUR | 91,82 | 183.642,00 | 2,01 |
| Deutsche Lufthansa AG - Anleihe - 3,000 29.05.2026 | | XS2265369657 | Nominal | 100.000,00 | 100.000,00 | 0,00 | EUR | 99,90 | 99.898,00 | 1,10 |
| Evonik Industries AG - Anleihe (Fix to Float) - 2,125 07.07.2077 | | DE000A2GSFF1 | Nominal | 200.000,00 | 0,00 | 0,00 | EUR | 102,58 | 205.158,00 | 2,25 |
| Fraport AG Ffm.Airport.Ser.AG - Anleihe - 1,625 09.07.2024 | | XS2198798659 | Nominal | 200.000,00 | 200.000,00 | 0,00 | EUR | 103,22 | 206.437,00 | 2,26 |
| Hapag-Lloyd AG - Anleihe - 5,125 15.07.2024 | | XS1645113322 | Nominal | 200.000,00 | 0,00 | 0,00 | EUR | 103,65 | 138.202,67 | 1,52 |
| Kreditanst.f.Wiederaufbau - Anleihe - 1,000 12.10.2021 | | XS1489186947 | Nominal | 1.000.000,00 | 0,00 | 0,00 | NOK | 100,57 | 95.312,99 | 1,04 |
| MTU Aero Engines AG - Anleihe - 3,000 01.07.2025 | | XS2197673747 | Nominal | 200.000,00 | 0,00 | 0,00 | EUR | 108,75 | 217.500,00 | 2,38 |
| Merck KGaA - Anleihe (Fix to Float) - 2,625 12.12.2074 | | XS1152338072 | Nominal | 100.000,00 | 0,00 | 0,00 | EUR | 101,17 | 101.171,50 | 1,11 |
| Münchener Rückvers.-Ges. AG - Anleihe (Fix to Float) - 6,0 26.05.41 | | XS0608392550 | Nominal | 300.000,00 | 0,00 | 0,00 | EUR | 102,36 | 307.078,50 | 3,37 |
| ZF Finance GmbH - Anleihe - 3,000 21.09.2025 | | XS2231715322 | Nominal | 100.000,00 | 100.000,00 | 0,00 | EUR | 103,70 | 103.699,00 | 1,14 |
| Finnland | | | | | | | | | | |
| UPM Kymmene Corp. - Anleihe - 0,125 19.11.2028 | | XS2257961818 | Nominal | 100.000,00 | 100.000,00 | 0,00 | EUR | 99,78 | 99.779,00 | 1,09 |
| Frankreich | | | | | | | | | | |
| AXA S.A. - Anleihe (FRN) - 3,000 | | XS0210434782 | Nominal | 100.000,00 | 0,00 | 0,00 | EUR | 100,79 | 100.792,50 | 1,10 |
| Electricité de France (E.D.F.) - Anleihe (Fix to Float) - 5,000 | | FR0011697028 | Nominal | 200.000,00 | 0,00 | 0,00 | EUR | 115,09 | 230.173,00 | 2,52 |
| Electricité de France (E.D.F.) - Anleihe (Fix to Float) - 5,375 | | FR0011401751 | Nominal | 100.000,00 | 0,00 | 0,00 | EUR | 114,95 | 114.948,50 | 1,26 |
| La Poste - Anleihe (Fix to Float) - 3,125 | | FR0013331949 | Nominal | 200.000,00 | 0,00 | 0,00 | EUR | 107,55 | 215.106,00 | 2,36 |
| Total S.E. - Anleihe (Fix to Float) - 2,000 | | XS2224632971 | Nominal | 200.000,00 | 200.000,00 | 0,00 | EUR | 103,76 | 207.510,00 | 2,27 |
| Ubisoft Entertainment S.A. - Anleihe - 0,878 24.11.2027 | | FR0014000087 | Nominal | 100.000,00 | 100.000,00 | 0,00 | EUR | 100,46 | 100.460,50 | 1,10 |
| Griechenland | | | | | | | | | | |
| Griechenland - Anleihe - 1,875 23.07.2026 | | GR0118019679 | Nominal | 200.000,00 | 0,00 | 0,00 | EUR | 109,30 | 218.605,00 | 2,40 |
| Großbritannien | | | | | | | | | | |
| Royal Mail PLC - Anleihe - 1,250 08.10.2026 | | XS2063268754 | Nominal | 100.000,00 | 0,00 | 0,00 | EUR | 103,83 | 103.826,00 | 1,14 |
| Irland | | | | | | | | | | |
| Grenke Finance PLC - Anleihe - 0,625 09.01.2025 | | XS2078696866 | Nominal | 100.000,00 | 100.000,00 | 0,00 | EUR | 91,34 | 91.341,50 | 1,00 |



| Gattungsbezeichnung | Markt | ISIN | Stück/ Anteile/ Whg. | Bestand zum 31.12.2020 | Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum | Verkäufe/ Abgänge | Whg. | Kurs | Kurswert in EUR | % des Fonds- vermögens |
|--|-------|--------------|----------------------------|------------------------------|--|----------------------|------|--------|--------------------|------------------------------|
| Italien | | | | | | | | | | |
| Assicurazioni Generali S.p.A. - Anleihe (Fix to Float) - 4,596 | | XS1140860534 | Nominal | 200.000,00 | 0,00 | 0,00 | EUR | 112,53 | 225.055,00 | 2,47 |
| Kanada | | | | | | | | | | |
| Daimler Canada Finance Inc. - Anleihe - 1,875 20.01.2021 | | XS1346622803 | Nominal | 2.500.000,00 | 0,00 | 0,00 | NOK | 100,02 | 236.987,63 | 2,60 |
| Luxemburg | | | | | | | | | | |
| Gaz Capital S.A. - Loan Participation Notes - 3,600 26.02.2021 | | XS1038646078 | Nominal | 100.000,00 | 0,00 | 0,00 | EUR | 100,59 | 100.587,50 | 1,10 |
| Holcim Finance (Luxembg) S.A. - Anleihe - 0,500 23.04.2031 | | XS2261215011 | Nominal | 100.000,00 | 100.000,00 | 0,00 | EUR | 100,60 | 100.604,50 | 1,10 |
| Talanx Finanz (Luxemburg) S.A. - Anleihe (Fix to Float) - 8,367 15.06.2042 | | XS0768664731 | Nominal | 100.000,00 | 0,00 | 0,00 | EUR | 112,42 | 112.418,50 | 1,23 |
| Telecom Italia Finance S.A. - Anleihe - 7,750 24.01.2033 | | XS0161100515 | Nominal | 150.000,00 | 0,00 | 0,00 | EUR | 148,03 | 222.047,25 | 2,43 |
| Niederlande | | | | | | | | | | |
| Allianz Finance II B.V. - Anleihe (Fix to Float) - 5,750 08.07.2041 | | DE000A1GNAH1 | Nominal | 100.000,00 | 0,00 | 0,00 | EUR | 102,84 | 102.841,00 | 1,13 |
| Natle-Nederl.Levensv.Maats.NV. - Anleihe (Fix to Float) - 9,000 29.08.2042 | | XS0821168423 | Nominal | 200.000,00 | 0,00 | 0,00 | EUR | 114,85 | 229.697,00 | 2,52 |
| Repsol Intl Finance B.V. - Anleihe (Fix to Float) - 4,500 25.03.2075 | | XS1207058733 | Nominal | 100.000,00 | 0,00 | 0,00 | EUR | 110,01 | 110.009,00 | 1,21 |
| Südzucker Intl Finance B.V. - Anleihe (FRN) - 2,607 | | XS0222524372 | Nominal | 255.000,00 | 0,00 | 0,00 | EUR | 78,46 | 200.079,38 | 2,19 |
| Volkswagen Intl Finance N.V. - Anleihe (Fix to Float) - 2,700 31.12.2099 | | XS1629658755 | Nominal | 200.000,00 | 0,00 | 0,00 | EUR | 102,33 | 204.653,00 | 2,24 |
| Volkswagen Intl Finance N.V. - Anleihe (Fix to Float) - 3,500 | | XS1206541366 | Nominal | 300.000,00 | 0,00 | 0,00 | EUR | 105,84 | 317.505,00 | 3,48 |
| Volkswagen Intl Finance N.V. - Anleihe (Fix to Float) - 5,125 | | XS0968913342 | Nominal | 100.000,00 | 0,00 | 0,00 | EUR | 109,44 | 109.438,50 | 1,20 |
| Portugal | | | | | | | | | | |
| Portugal, Republik - Anleihe - 2,875 15.10.2025 | | PTOTEKOE0011 | Nominal | 100.000,00 | 0,00 | 0,00 | EUR | 116,13 | 116.132,50 | 1,27 |
| Ungarn | | | | | | | | | | |
| MOL Magyar Olaj-és Gázip. Nyrt - Anleihe - 2,625 28.04.2023 | | XS1401114811 | Nominal | 150.000,00 | 0,00 | 0,00 | EUR | 105,77 | 158.652,75 | 1,74 |
| Österreich | | | | | | | | | | |
| OMV AG - Anleihe (Fix to Float) - 5,250 09.12.2021 | | XS1294342792 | Nominal | 250.000,00 | 0,00 | 0,00 | EUR | 104,85 | 262.131,25 | 2,87 |
| Porr AG - Anleihe (Fix to Float) - 5,500 | | XS1555774014 | Nominal | 150.000,00 | 0,00 | 0,00 | EUR | 90,97 | 136.462,50 | 1,50 |
| Zertifikate | | | | | | | | | | |
| Bundesrep. Deutschland | | | | | | | | | | |
| Deut. Börse Commodities GmbH Xetra-Gold IHS 2007(09/Und) | | DE000A0S9GB0 | Stück | 4.000,00 | 0,00 | 0,00 | EUR | 49,45 | 197.816,00 | 2,17 |
| Organisierter Markt | | | | | | | | | | |
| Verzinsliche Wertpapiere | | | | | | | | | | |
| Großbritannien | | | | | | | | | | |
| INEOS Finance PLC - Anleihe - 3,375 31.03.2026 | | XS2250349581 | Nominal | 100.000,00 | 100.000,00 | 0,00 | EUR | 103,32 | 103.317,00 | 1,13 |
| Zertifikate | | | | | | | | | | |
| Bundesrep. Deutschland | | | | | | | | | | |
| Citigroup Global Mkts Europe DIZ 18.03.21 Bayer 55 | | DE000KA2P4Y6 | Stück | 1.000,00 | 0,00 | 0,00 | EUR | 47,26 | 47.260,00 | 0,52 |
| DZ BANK AG Deut.Zentral-Gen. DISC.Z 24.06.22 BASF 48 | | DE000DFL3LV2 | Stück | 1.500,00 | 1.500,00 | 0,00 | EUR | 45,68 | 68.520,00 | 0,75 |
| DZ BANK AG Deut.Zentral-Gen. DISC.Z 24.12.21 Fres. SE 40 | | DE000DF9FL58 | Stück | 1.200,00 | 1.200,00 | 0,00 | EUR | 35,10 | 42.120,00 | 0,46 |
| DZ BANK AG Deut.Zentral-Gen. DISC.Z 25.06.21 AnhBusch 48 | | DE000DDB93Z3 | Stück | 1.500,00 | 0,00 | 0,00 | EUR | 46,59 | 69.885,00 | 0,77 |
| DZ BANK AG Deut.Zentral-Gen. DISC.Z 25.06.21 Covestro 36 | | DE000DF36TY2 | Stück | 1.000,00 | 0,00 | 0,00 | EUR | 35,49 | 35.490,00 | 0,39 |
| DZ BANK AG Deut.Zentral-Gen. DISC.Z 25.06.21 Engie 9 | | DE000DF2XL8 | Stück | 5.000,00 | 0,00 | 0,00 | EUR | 8,89 | 44.450,00 | 0,49 |
| DZ BANK AG Deut.Zentral-Gen. DISC.Z 25.06.21 Linde 130 | | DE000DF7KEC1 | Stück | 450,00 | 0,00 | 0,00 | EUR | 129,84 | 58.428,00 | 0,64 |



| Gattungsbezeichnung | Markt | ISIN | Stück/ Anteile/ Whg. | Bestand zum 31.12.2020 | Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum | Verkäufe/ Abgänge | Whg. | Kurs | Kurswert in EUR | % des Fonds- vermögens |
|---|-------|--------------|----------------------------|------------------------------|--|----------------------|------|--------|---------------------|------------------------------|
| Goldman Sachs Wertpapier GmbH DISC.Z 21.09.21 Allianz 128 | | DE000GB3CRL1 | Stück | 450,00 | 0,00 | 0,00 | EUR | 126,86 | 57.087,00 | 0,63 |
| HSBC Trinkaus & Burkhardt AG DIZ 25.06.21 BSKT | | DE000TT1JAW8 | Stück | 1.000,00 | 0,00 | 0,00 | EUR | 54,94 | 54.940,00 | 0,60 |
| HSBC Trinkaus & Burkhardt AG DIZ 27.12.21 Fres. SE 47,5 | | DE000TR83874 | Stück | 1.000,00 | 0,00 | 0,00 | EUR | 37,05 | 37.050,00 | 0,41 |
| nicht notiert | | | | | | | | | | |
| Zertifikate | | | | | | | | | | |
| Bundesrep. Deutschland | | | | | | | | | | |
| BNP Paribas Em.-u.Handelsg.mbH DISC.Z 24.12.20 Fres. SE 40 | | DE000PZ6DZY9 | Stück | 1.000,00 | 0,00 | 0,00 | EUR | 39,00 | 39.000,00 | 0,43 |
| Investmentanteile* | | | | | | | | | 860.550,00 | 9,43 |
| Gruppenfremde Investmentanteile | | | | | | | | | | |
| Bundesrep. Deutschland | | | | | | | | | | |
| sentix Risk Return -M- Inhaber-Anteilsklasse I | | DE000A2AJHP8 | Anteile | 7.500,00 | 4.400,00 | -700,00 | EUR | 114,74 | 860.550,00 | 9,43 |
| Derivate | | | | | | | | | 440,00 | 0,00 |
| Derivate auf einzelne Wertpapiere | | | | | | | | | | |
| Wertpapier-Terminkontrakte auf Renten | | | | | | | | | | |
| Euro Bund Future (EURX) Mär.2021 | XEUR | | | -4,00 | | | EUR | | 440,00 | 0,00 |
| Bankguthaben | | | | | | | | | 130.685,54 | 1,43 |
| EUR - Guthaben | | | | | | | | | | |
| EUR bei Hauck & Aufhäuser Privatbankiers AG, Niederlassung Luxemburg | | | | 130.685,54 | | | EUR | | 130.685,54 | 1,43 |
| Sonstige Vermögensgegenstände | | | | | | | | | 144.943,28 | 1,59 |
| Einschüsse (Initial Margin) | | | | 10.961,00 | | | EUR | | 10.961,00 | 0,12 |
| Zinsansprüche aus Wertpapieren | | | | 133.982,28 | | | EUR | | 133.982,28 | 1,47 |
| Gesamtaktiva | | | | | | | | | 9.143.582,41 | 100,24 |
| Verbindlichkeiten | | | | | | | | | -21.911,47 | -0,24 |
| aus | | | | | | | | | | |
| Fondsmanagementvergütung | | | | -5.846,62 | | | EUR | | -5.846,62 | -0,06 |
| Future Variation Margin | | | | -440,00 | | | EUR | | -440,00 | 0,00 |
| Prüfungskosten | | | | -8.846,36 | | | EUR | | -8.846,36 | -0,10 |
| Risikomanagementvergütung | | | | -625,00 | | | EUR | | -625,00 | -0,01 |
| Sonstige Verbindlichkeiten | | | | -2.016,44 | | | EUR | | -2.016,44 | -0,02 |
| Taxe d'abonnement | | | | -1.140,35 | | | EUR | | -1.140,35 | -0,01 |
| Transfer- und Registerstellenvergütung | | | | -350,00 | | | EUR | | -350,00 | 0,00 |
| Verwahrstellenvergütung | | | | -641,15 | | | EUR | | -641,15 | -0,01 |

* 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.



**Anteilklasse
B in EUR**

zum 31.12.2020

| | |
|------------------------|--------------|
| Fondsvermögen | 9.121.670,94 |
| Inventarwert je Anteil | 49,33 |
| Umlaufende Anteile | 184.899,954 |

