

Halbjahresbericht

FO Core plus

zum 30. April 2023

Halbjahresbericht des FO Core plus

ZUM 30. APRIL 2023

■ Vermögensübersicht	2
■ Vermögensaufstellung	3
■ Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit diese nicht mehr Gegenstand der Vermögensaufstellung sind	5
■ Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV	6

■ Vermögensübersicht

	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
I. Vermögensgegenstände	17.041.498,27	100,06
1. Aktien	0,00	0,00
2. Anleihen	0,00	0,00
3. Derivate	91.649,43	0,54
Aktienindex-Derivate	91.649,43	0,54
4. Forderungen	0,00	0,00
5. Kurzfristig liquidierbare Anlagen	0,00	0,00
6. Bankguthaben	122.416,91	0,72
7. Sonstige Vermögensgegenstände	16.827.431,93	98,80
Zielfondsanteile	16.827.431,93	98,80
Indexfonds	16.827.431,93	98,80
II. Verbindlichkeiten	-9.435,45	-0,06
Sonstige Verbindlichkeiten	-9.435,45	-0,06
III. Fondsvermögen	17.032.062,82	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 30.04.2023	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens	
Investmentanteile								16.827.431,93	98,80	
Gesellschaftsfremde Investmentanteile										
Euro								11.457.882,20	67,27	
DEKA DAX ETF	DE000ETFL011		ANT	12.240	-	1.800	EUR	141,980	1.737.835,20	10,20
DEKA MDAX UCITS ETF	DE000ETFL441		ANT	5.990	-	-	EUR	263,100	1.575.969,00	9,25
ISHARES STOXX EUROPE 600	DE0002635307		ANT	64.680	-	9.000	EUR	46,500	3.007.620,00	17,66
ISHARES V-S&P 500 EUR-HD.	IE00B3ZW0K18		ANT	23.700	23.700	-	EUR	88,250	2.091.525,00	12,28
LYXOR IND.-L.CO.ST.EUR.600(DR)	LU0908500753		ANT	14.590	-	1.800	EUR	208,700	3.044.933,00	17,88
US-Dollar								3.748.004,73	22,01	
ISHARES VII- CORE S&P 500	IE00B5BMR087		ANT	4.410	-	-	USD	431,530	1.723.774,73	10,12
ISHARES VII-NASDAQ 100	IE00B53SZB19		ANT	2.990	-	-	USD	747,408	2.024.230,00	11,88
Japanische Yen								1.621.545,00	9,52	
ISHARES VII-NIKKEI 225	IE00B52MJD48		ANT	8.500	-	-	JPY	28.677,720	1.621.545,00	9,52
Summe Wertpapiervermögen								16.827.431,93	98,80	
Derivate								91.649,43	0,54	
Aktienindex-Derivate										
Optionsrechte								91.649,43	0,54	
Optionsrechte auf Aktienindices										
C DAX 16800 160623		EUREX	STK	-37			EUR	45,600	-8.436,00	-0,05
PUT DAX 14700 06/23		EUREX	STK	37			EUR	89,200	16.502,00	0,10
PUT NASDAQ-100 12200 06/23		CBOE	STK	1			USD	104,612	9.475,71	0,06
PUT NIKKEI 225 STOCK AVERAGE 27500 06/23		OSE	STK	8			JPY	165,000	8.780,91	0,05
PUT STXE 600 INDEX FUTURE 440 06/23		EUREX	STK	260			EUR	2,900	37.700,00	0,22
Optionsrechte auf Aktienindex-Terminkontrakte										
PUT E-MINI S&P 500 FUT.3940 06/23		CME	STK	20			USD	30,500	27.626,81	0,16
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds								122.416,91	0,72	
Bankguthaben								122.416,91	0,72	
EUR-Guthaben bei:										
Verwahrstelle										
KREISSPARKASSE KÖLN			EUR	44.735,38			%	100,000	44.735,38	0,26
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen										
KREISSPARKASSE KÖLN			JPY	3.516.799,00			%	100,000	23.394,46	0,14
KREISSPARKASSE KÖLN			USD	59.932,93			%	100,000	54.287,07	0,32
Sonstige Verbindlichkeiten								-9.435,45	-0,06	
KOSTENABGRENZUNGEN			EUR	-9.435,45					-9.435,45	-0,06
Fondsvermögen							EUR	17.032.062,82	100,00*	

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

FO Core plus	
ISIN	DE000A2JN5A6
Fondsvermögen (EUR)	17.032.062,82
Anteilwert (EUR)	112,44
Umlaufende Anteile (STK)	151.475,61

■ Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Alle Vermögenswerte: Kurse bzw. Marktsätze per 28.04.2023 oder letztbekannte.

Devisenkurs(e) bzw. Konversionsfaktor(en) (in Mengennotiz) per 28.04.2023

Japanische Yen	(JPY)	150,32615 = 1 (EUR)
US-Dollar	(USD)	1,10400 = 1 (EUR)

■ Marktschlüssel

b) Terminbörsen

CBOE	Chicago - Chicago Board Options Exchange (CBOE)
CME	Chicago - Chicago Mercantile Exchange (CME)
EUREX	Frankfurt/Zürich - Eurex (Eurex DE/Eurex Zürich)
OSE	Osaka - Osaka Securities Ex - Options and Futures

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
---------------------	------	------------------------------	----------------	-------------------

Investmentanteile
Gesellschaftsfremde Investmentanteile

US-Dollar

SPDR S&P 500	IE00B6YX5C33	ANT	-	5.260
--------------	--------------	-----	---	-------

■ **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

Aktienindex-Terminkontrakte

Verkaufte Kontrakte **EUR** **3.858**

Basiswerte: (S&P 500 INDEX MINI FUT. 12/22)

Optionsrechte

Optionsrechte auf Aktienindex-Derivate

Optionsrechte auf Aktienindices

Gekaufte Verkaufsoptionen (put) **EUR** **11.184**

Basiswerte: (PUT DAX 13900 03/23, PUT DAX 14300 03/23, PUT NASDAQ-100 11500 03/23, PUT NIKKEI 225 STOCK AVERAGE 27500 03/23, PUT STXE 600 INDEX FUTURE 430 03/23)

Verkaufte Kaufoptionen (call) **EUR** **9.664**

Basiswerte: (CALL DAX 16250 03/23, CALL STXE 600 INDEX FUTURE 480 03/23)

■ Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben nach der Derivateverordnung

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen	98,80 %
Bestand der Derivate am Fondsvermögen	0,54 %

Sonstige Angaben

FO Core plus

ISIN	DE000A2JN5A6
Fondsvermögen (EUR)	17.032.062,82
Anteilwert (EUR)	112,44
Umlaufende Anteile (STK)	151.475,61
Ausgabeaufschlag	bis zu 5,00%, derzeit 0,00%
Verwaltungsvergütung (p.a.)	bis zu 1,50%, derzeit 0,68%
Mindestanlagesumme (EUR)	25.000,00
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 ¹⁾
Deka DAX ETF	0,15000 % p.a.
Deka MDAX UCITS ETF	0,30000 % p.a.
iShares STOXX Europe 600	0,19000 % p.a.
iSharesVII- Core S&P 500	0,07000 % p.a.
iSharesVII-NASDAQ 100	0,33000 % p.a.
iSharesVII-Nikkei 225	0,48000 % p.a.
iSharesV-S&P 500 EUR-Hd.	0,20000 % p.a.
Lyxor Ind.-L.Co.St.Eur.600(DR)	0,07000 % p.a.
SPDR S&P 500	0,09000 % p.a.

¹⁾ 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 Rücknahmeaufschläge gezahlt.

