

FM Core Index Selection Fund Halbjahresbericht

30.11.2015

Vermögensübersicht

Aufteilung des Fondsvermögens nach Assetklassen

Assetklasse	Betrag	Anteil in %
I. Vermögensgegenstände	4.838.149,04	100,68
1. Investmentfonds	3.167.581,31	65,92
2. Forderungen	434,40	0,01
3. Kurzfristig liquidierbare Anlagen	940.460,50	19,57
Geldmarktfonds	940.460,50	19,57
4. Bankguthaben	729.672,83	15,18
II. Verbindlichkeiten	-32.871,02	-0,68
Sonstige Verbindlichkeiten	-32.871,02	-0,68
III. Fondsvermögen	4.805.278,02	100,00

Vermögensaufstellung

30.11.2015

Gattungsbezeichnung	Stück, Anteile bzw. Währung	Bestand 30.11.2015	Käufe/ Zugänge		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
			im Berichtszeitraum				
Investmentfonds						3.167.581,31	65,92
Aktienfonds						554.871,97	11,55
Gruppenfremde Aktienfonds						554.871,97	11,55
BGF - World Gold Fund USD LU0055631609	Anteile	12.500	0	0	19,2400 USD	227.410,27	4,73
Craton Capital Precious Metal A LI0016742681	Anteile	3.300	0	0	59,6700 USD	186.193,69	3,87
Pictet - Timber P USD LU0340557775	Anteile	338	0	1.662	146,3000 USD	46.758,01	0,97
UBS(Lux)Eq.-Global Income(USD) P-dist LU1013383804	Anteile	1.000	1.000	0	99,9500 USD	94.510,00	1,97
Rentenfonds						637.573,66	13,27
Gruppenfremde Rentenfonds						637.573,66	13,27
AXA World -Global HighYield Bds I (thes.) USD LU0252440952	Anteile	605	0	0	210,2100 USD	120.255,16	2,50
Pictet - Emerg. Local Curr. Debt I EUR LU0280437160	Anteile	1.750	0	0	155,0489 USD	256.567,50	5,34
Zantke EO Corporate Bonds AMI I(a) DE000A0Q8HQ0	Anteile	2.300	0	0	113,3700 EUR	260.751,00	5,43
Gemischte Fonds						553.589,77	11,52
Gruppenfremde Gemischte Fonds						553.589,77	11,52
Carmignac Portf.-Patrimoine F EUR Acc LU0992627611	Anteile	1.335	1.335	0	113,0800 EUR	150.961,80	3,14
Nordea 1-Stable Return Fund BI-EUR LU0351545230	Anteile	15.000	2.500	0	16,8400 EUR	252.600,00	5,26

FM Core Index Selection Fund

Gattungsbezeichnung	Stück, Anteile bzw. Währung	Bestand 30.11.2015	Käufe/ Zugänge		Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
			im Berichtszeitraum					
Stand.Life I.G.-Gl.Ab.Ret.Str. D EUR Dis. LU0548153955	Anteile	11.943	11.943	0	0	12,5620 EUR	150.027,97	3,12
Immobilienfonds							205.467,55	4,27
Gruppenfremde Immobilienfonds							205.467,55	4,27
AXA Immoselect DE0009846451	Anteile	6.220	0	0	0	10,3900 EUR	64.625,80	1,34
SEB ImmoInvest DE0009802306	Anteile	4.825	0	0	0	29,1900 EUR	140.841,75	2,93
Indexfonds							1.216.078,36	25,31
Gruppenfremde Indexfonds							1.216.078,36	25,31
ComStage MSCI Emerg. Markets 2x D.L.TRN U.ETF I LU0675401409	Anteile	3.700	0	0	0	51,3340 USD	179.598,00	3,74
ComStage STOXX Europe 600 Real Estate NR U. ETF I LU0378436793	Anteile	1.540	0	8.460	0	31,0300 EUR	47.786,20	0,99
iShares STOXX Gl.Sel.Div.100 UCITS ETF (DE) DE000A0F5UH1	Anteile	11.000	0	0	0	26,6200 EUR	292.820,00	6,09
iShares III MSCI Em.Mkts Sm.C. (Dt. Zert.) DE000A0YBR04	Anteile	189	0	4.811	0	58,7168 USD	10.493,47	0,22
iShares II JPM.USD Em.Mkts Bd (Dt. Zert.) DE000A0RFFT0	Anteile	1.000	0	0	0	107,7548 USD	101.890,00	2,12
iShares II S&P Global Water 50 (Dt. Zert.) DE000A0MSAG2	Anteile	1.277	0	8.723	0	33,4284 USD	40.364,69	0,84
RBS M.A.-NYSE Arc.Gold Bgs U.E LU0259322260	Anteile	3.800	0	0	0	42,5700 EUR	161.766,00	3,37
RBS M.A.-Roger.Int.Comm.I.U.E. LU0249326488	Anteile	21.000	0	0	0	18,1600 EUR	381.360,00	7,94
Summe Wertpapiervermögen							3.167.581,31	65,92

FM Core Index Selection Fund

Gattungsbezeichnung	Stück, Anteile bzw. Währung	Bestand 30.11.2015	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
im Berichtszeitraum							
Forderungen						434,40	0,01
Ausschüttung Zielfonds	EUR	434,40				434,40	0,01
Kurzfristig liquidierbare Anlagen						940.460,50	19,57
Geldmarktfonds						940.460,50	19,57
Gruppenfremde Geldmarktfonds						940.460,50	19,57
db x-trackers II-Eonia ETF 1C LU0378436793	Anteile	3.600,00	4.317	717	139,4730	EUR 502.102,80	10,45
iShares eb.r.Money Market U.ETF (DE) LU0290358497	Anteile	5.300,00	6.504	1.204	82,7090	EUR 438.357,70	9,12
Bankguthaben						729.672,83	15,18
Bankguthaben	EUR	340.828,86				340.828,86	7,09
Bankguthaben	USD	411.225,83				388.843,97	8,09
Verbindlichkeiten						-32.871,02	-0,68
Sonstige Verbindlichkeiten						-32.871,02	-0,68
Verwahrstellenvergütung	EUR	-23.052,24				-23.052,24	-0,48
Verwaltungsvergütung	EUR	-5.662,81				-5.662,81	-0,12
Prüfungskosten	EUR	-3.600,00				-3.600,00	-0,07
Verbindlichkeiten aus Anteilsceingeschäften*	EUR	-305,97				-305,97	-0,01
Veröffentlichungskosten	EUR	-250,00				-250,00	0,00
Fondsvermögen					EUR	4.805.278,02	100,00**
Anteilwert					EUR	43,64	
Umlaufende Anteile					Stück	110,122	

* Noch nicht valutierte Transaktionen

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

Gattungsbezeichnung	Stück, Anteile bzw. Währung	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
		im Berichtszeitraum	
Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen:			
Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schuldscheindarlehen (Marktzuordnung zum Berichtsstichtag)			
Investmentfonds			
Gruppenfremde Investmentanteile			
RBS M.A.-RICI Agric.Index U.E. LU0259321452	Anteile	0	5.300

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben nach der Derivateverordnung

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)	65,92
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)	0,00

Sonstige Angaben

Anteilwert	EUR	43,64
Umlaufende Anteile	Stück	110.122

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

Die Vermögensgegenstände des Sondervermögens sind auf der Grundlage der Kapitalanlage-Rechnungslegungs- und Bewertungsverordnung mit nachstehenden Kursen/Marktsätzen bewertet:

Wertpapierart	Region	Bewertungsdatum	\$27 Bewertung mit handelbaren Kursen	\$28 Bewertung mit Bewertungsmodellen	\$32 Besonderheiten bei der Bewertung unternehmerischer Beteiligungen	\$29 Besonderheiten bei Investmentanteilen, Bankguthaben und Verbindlichkeiten
Investmentanteile						
	Inland	27.11.2015	15,22 %			9,70 %
	Europa	27.11.2015	29,66 %			30,91 %
Übriges Vermögen						
		30.11.2015				14,51 %
			44,88 %			55,12 %

Die prozentualen Angaben beziehen sich auf den Anteil der einzelnen Vermögensgegenstände am Fondsvermögen. Für Investmentanteile ist der Sitz der Kapitalverwaltungsgesellschaft für die Region und das Bewertungsdatum maßgebend. Die Bewertung erfolgt durch die Kapitalverwaltungsgesellschaft. Die Bewertung von börsengehandelten Vermögensgegenständen erfolgt mit entsprechend handelbaren Kursen. Sollten für diese Vermögensgegenstände keine handelbaren Kurse verfügbar sein, erfolgt die Bewertung auf Basis geeigneter Modelle. Bewertungseinheiten werden nicht gebildet.

Devisenkurse	per	30.11.2015
US-Dollar	(USD)	1,057560 = 1 EUR

Frankfurt am Main, den 30. November 2015

BNY Mellon Service
Kapitalanlage-Gesellschaft mbH
Frankfurt am Main

(Geschäftsführung)