

Fonds für Stiftungen Invesco Halbjahresbericht

31.03.2016

Vermögensübersicht

Aufteilung des Fondsvermögens nach Assetklassen

Assetklasse	Betrag	Anteil in %
I. Vermögensgegenstände	48.605.200,80	100,23
1. Aktien	22.908.578,42	47,24
2. Anleihen	20.594.203,74	42,46
Verzinsliche Wertpapiere	20.594.203,74	42,46
3. Derivate	3.711,93	0,01
Devisentermingeschäfte	19.661,93	0,04
Futures	-15.950,00	-0,03
4. Forderungen	346.023,23	0,72
5. Kurzfristig liquidierbare Anlagen	2.500.000,00	5,16
Tagesgelder	2.500.000,00	5,16
6. Bankguthaben	2.241.698,91	4,62
7. Sonstige Vermögensgegenstände	10.984,57	0,02
II. Verbindlichkeiten	-109.575,38	-0,23
Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme	-62.381,64	-0,13
Sonstige Verbindlichkeiten	-47.193,74	-0,10
III. Fondsvermögen	48.495.625,42	100,00

Vermögensaufstellung

31.03.2016

Gattungsbezeichnung	Stück, Anteile bzw. Währung	Bestand 31.03.2016	Käufe/ Zugänge		Verkäufe/ Abgänge		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
			im Berichtszeitraum						
Börsengehandelte Wertpapiere								43.213.518,11	89,11
Aktien								22.908.578,42	47,24
Australien								502.405,93	1,04
Banken								171.385,62	0,35
Commonwealth Bank of Australia AU000000CBA7	Stück	3.395	2.673		0	74,9200	AUD	171.385,62	0,35
Versicherungen								331.020,31	0,68
Medibank Private AU000000MPL3	Stück	167.668	167.668		0	2,9300	AUD	331.020,31	0,68
Dänemark								1.297.912,77	2,68
Energie								871.463,23	1,80
Vestas Wind Systems DK0010268606	Stück	13.996	4.941		0	464,0000	DKK	871.463,23	1,80
Privater Konsum & Haushalt								426.449,54	0,88
Pandora DK0060252690	Stück	3.676	0		3.411	864,5000	DKK	426.449,54	0,88
Finnland								76.668,76	0,16
Industrie								76.668,76	0,16
Huhtamäki FI0009000459	Stück	2.324	0		3.626	32,9900	EUR	76.668,76	0,16

Fonds für Stiftungen Invesco

Gattungsbezeichnung	Stück, Anteile bzw. Währung	Bestand 31.03.2016	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
			im Berichtszeitraum				
Frankreich						2.036.439,83	4,20
<i>Automobil</i>						<i>950.259,96</i>	<i>1,96</i>
Peugeot FR0000121501	Stück	62.476	7.469	0	15,2100 EUR	950.259,96	1,96
<i>Gesundheit / Pharma</i>						<i>816.343,62</i>	<i>1,68</i>
Sanofi FR0000120578	Stück	11.443	726	0	71,3400 EUR	816.343,62	1,68
<i>Versicherungen</i>						<i>269.836,25</i>	<i>0,56</i>
AXA FR0000120628	Stück	13.237	13.237	0	20,3850 EUR	269.836,25	0,56
Großbritannien						853.320,62	1,76
<i>Automobil</i>						<i>126.823,98</i>	<i>0,26</i>
Auto Trader Group GB00BYYVFW23	Stück	25.716	25.716	0	3,9000 GBP	126.823,98	0,26
<i>Energie</i>						<i>277.714,39</i>	<i>0,57</i>
Noble GB00BFG3KF26	Stück	31.400	32.700	12.200	10,0300 USD	277.714,39	0,57
<i>Medien</i>						<i>448.782,25</i>	<i>0,93</i>
ITV GB0033986497	Stück	25.926	0	37.490	2,4120 GBP	79.076,27	0,16
Moneysupermarket.com Group GB00B1ZBKY84	Stück	92.112	0	0	3,1740 GBP	369.705,98	0,76
Irland						442.207,40	0,91
<i>Reise & Freizeit</i>						<i>442.207,40</i>	<i>0,91</i>
Ryanair Holdings IE00BYTBXV33	Stück	31.340	31.340	0	14,1100 EUR	442.207,40	0,91

Fonds für Stiftungen Invesco

Gattungsbezeichnung	Stück, Anteile bzw. Währung	Bestand 31.03.2016	Käufe/ Zugänge		Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
			im Berichtszeitraum					
Japan							1.647.445,85	3,40
<i>Bau & Materialien</i>							370.664,38	0,76
LIXIL Group JP3626800001	Stück	20.600	20.600	0	2.295,0000	JPY	370.664,38	0,76
<i>Finanzdienstleister</i>							342.466,85	0,71
IIDA Group Holdings Co. JP3131090007	Stück	19.900	0	0	2.195,0000	JPY	342.466,85	0,71
<i>Medien</i>							376.332,89	0,78
Dai Nippon Printing JP3493800001	Stück	48.000	0	0	1.000,0000	JPY	376.332,89	0,78
<i>Nahrungsmittel</i>							338.476,16	0,70
Ajinomoto JP3119600009	Stück	17.000	5.000	0	2.539,5000	JPY	338.476,16	0,70
<i>Technologie</i>							219.505,57	0,45
Seiko Epson JP3414750004	Stück	15.400	15.400	0	1.818,0000	JPY	219.505,57	0,45
Kanada							830.948,22	1,71
<i>Banken</i>							509.176,71	1,05
Bank of Nova Scotia CA0641491075	Stück	11.800	11.800	0	63,5500	CAD	509.176,71	1,05
<i>Handel</i>							321.771,51	0,66
Alimentation Couche-Tard B CA01626P4033	Stück	4.500	4.500	0	57,8900	CAD	176.883,38	0,36
Dollarama CA25675T1075	Stück	2.400	2.000	4.200	88,9100	CAD	144.888,13	0,30

Fonds für Stiftungen Invesco

Gattungsbezeichnung	Stück, Anteile bzw. Währung	Bestand 31.03.2016	Käufe/ Zugänge		Verkäufe/ Abgänge		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
			im Berichtszeitraum						
Niederlande								462.652,61	0,95
<i>Handel</i>								<i>462.652,61</i>	<i>0,95</i>
Ahold NL0010672325	Stück	23.029	0	0	20,0900	EUR	462.652,61	0,95	
Norwegen								153.714,92	0,32
<i>Banken</i>								<i>153.714,92</i>	<i>0,32</i>
DNB NO0010031479	Stück	14.988	0	13.191	96,6000	NOK	153.714,92	0,32	
Schweden								216.459,09	0,45
<i>Banken</i>								<i>136.481,50</i>	<i>0,28</i>
Swedbank NA SE0000242455	Stück	7.223	0	0	174,5000	SEK	136.481,50	0,28	
<i>Finanzdienstleister</i>								<i>79.977,59</i>	<i>0,16</i>
Intrum Justitia SE0000936478	Stück	2.578	2.578	0	286,5000	SEK	79.977,59	0,16	
Singapur								805.371,57	1,66
<i>Industrie</i>								<i>805.371,57</i>	<i>1,66</i>
Yangzijiang Shipbuilding Hldgs SG1U76934819	Stück	1.257.900	79.800	0	0,9800	SGD	805.371,57	1,66	
Spanien								264.427,61	0,54
<i>Handel</i>								<i>264.427,61</i>	<i>0,54</i>
Industria de Diseño Textil ES0148396007	Stück	8.863	8.863	0	29,8350	EUR	264.427,61	0,54	
USA								13.318.603,24	27,46
<i>Banken</i>								<i>839.812,18</i>	<i>1,73</i>
SunTrust Banks US8679141031	Stück	26.100	1.700	1.700	36,4900	USD	839.812,18	1,73	

Fonds für Stiftungen Invesco

Gattungsbezeichnung	Stück, Anteile bzw. Währung	Bestand 31.03.2016	im Berichtszeitraum		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
			Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge			
Energie						902.847,32	1,86
EOG Resources US26875P1012	Stück	13.900	1.600	1.100	73,6600 USD	902.847,32	1,86
Finanzdienstleister						2.903.424,90	5,99
American Express US0258161092	Stück	5.700	5.700	0	60,2900 USD	303.031,61	0,62
Bank of New York Mellon US0640581007	Stück	6.800	0	5.300	37,1400 USD	222.699,18	0,46
Synchrony Financial US87165B1035	Stück	3.800	0	0	28,3800 USD	95.096,34	0,20
VISA US92826C8394	Stück	9.500	1.300	7.700	76,7800 USD	643.190,34	1,33
Voya Financial US9290891004	Stück	26.200	1.700	0	30,5300 USD	705.335,74	1,45
Western Union Co US9598021098	Stück	54.800	2.800	0	19,3300 USD	934.071,69	1,93
Gesundheit / Pharma						1.937.572,41	4,00
AbbVie US00287Y1091	Stück	12.400	0	1.300	57,0000 USD	623.252,94	1,29
Anthem US0367521038	Stück	1.300	0	0	139,9700 USD	160.452,36	0,33
Gilead Sciences US3755581036	Stück	11.900	1.300	0	91,9700 USD	965.074,73	1,99
Stryker US8636671013	Stück	2.000	2.000	0	107,0500 USD	188.792,38	0,39
Handel						3.081.648,96	6,35
AmerisourceBergen US03073E1055	Stück	10.700	700	0	87,0900 USD	821.712,45	1,69
Cardinal Health US14149Y1082	Stück	2.700	0	0	81,7800 USD	194.705,70	0,40

Fonds für Stiftungen Invesco

Gattungsbezeichnung	Stück, Anteile bzw. Währung	Bestand 31.03.2016	Käufe/ Zugänge		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
			im Berichtszeitraum				
				Verkäufe/ Abgänge			
CVS Health US1266501006	Stück	11.100	1.200	600	104,0500 USD	1.018.433,93	2,10
Target US87612E1064	Stück	14.200	700	0	83,6000 USD	1.046.796,88	2,16
Immobilien						1.067.038,49	2,20
Annaly Capital Management US0357104092	Stück	14.200	0	0	10,1800 USD	127.468,81	0,26
Public Storage US74460D1090	Stück	3.900	0	1.000	273,2100 USD	939.569,68	1,94
Industrie						645.147,04	1,33
Crown Holdings US2283681060	Stück	1.100	1.100	0	49,6000 USD	48.110,75	0,10
Expeditors Intl of Wash. US3021301094	Stück	13.900	0	0	48,7100 USD	597.036,29	1,23
Privater Konsum & Haushalt						534.761,25	1,10
Activision Blizzard US00507V1098	Stück	17.800	3.900	0	34,0700 USD	534.761,25	1,10
Reise & Freizeit						961.089,02	1,98
Darden Restaurants US2371941053	Stück	5.900	5.900	0	66,5800 USD	346.388,61	0,71
McDonald's US5801351017	Stück	2.400	2.400	0	125,8300 USD	266.295,14	0,55
Priceline Group US7415034039	Stück	300	300	0	1.317,0300 USD	348.405,27	0,72
Versicherungen						445.261,67	0,92
Travelers Companies US89417E1091	Stück	4.300	0	3.300	117,4300 USD	445.261,67	0,92

Fonds für Stiftungen Invesco

Gattungsbezeichnung	Stück, Anteile bzw. Währung	Bestand 31.03.2016	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
			im Berichtszeitraum				
Verzinsliche Wertpapiere						20.304.939,69	41,87
EUR						17.337.826,68	35,75
<i>Öffentliche Anleihen</i>						<i>15.746.507,98</i>	<i>32,47</i>
1,250% Belgien, Königreich EO-Obl. Lin. 2013(18) BE0000329384	EUR	600.000	0	0	103,8040 %	622.823,88	1,28
4,000% Bundesrep.Deutschland Anl. 2006(16) DE0001135309	EUR	1.020.000	840.000	0	101,1475 %	1.031.704,50	2,13
3,500% Bundesrep.Deutschland Anl. 2009(19) DE0001135382	EUR	955.000	0	165.000	113,0336 %	1.079.471,12	2,23
2,250% Bundesrep. Deutschland Anl. 2010(20) DE0001135416	EUR	645.000	0	80.000	111,8988 %	721.747,45	1,49
0,500% Bundesrep.Deutschland Bundesobl. 2012(17) DE0001141646	EUR	880.000	880.000	0	101,5200 %	893.376,00	1,84
1,000% Bundesrep.Deutschland Bundesobl. 2014(19) DE0001141687	EUR	1.160.000	0	0	104,3418 %	1.210.364,65	2,50
0,500% Bundesrep.Deutschland Bundesobl. 2014(19) DE0001141695	EUR	1.045.000	0	545.000	103,0027 %	1.076.377,90	2,22
0,000% Bundesrep.Deutschland Bundesschatzanw. 2015(17) DE0001104602	EUR	660.000	660.000	0	100,5980 %	663.946,80	1,37
4,750% Italien, Republik EO-B.T.P. 2012(17) IT0004793474	EUR	1.375.000	0	0	105,1818 %	1.446.249,54	2,98
2,250% Italien, Republik EO-B.T.P. 2013(16) IT0004917792	EUR	700.000	0	0	100,2878 %	702.014,25	1,45
3,500% Italien, Republik EO-B.T.P. 2013(18) IT0004907843	EUR	755.000	0	0	107,5725 %	812.172,30	1,67
1,150% Italien, Republik EO-B.T.P. 2014(17) IT0005023459	EUR	600.000	100.000	0	101,3240 %	607.944,00	1,25
0,700% Italien, Republik EO-B.T.P. 2015(20) IT0005107708	EUR	300.000	0	0	102,0666 %	306.199,80	0,63
1,500% Italien, Republik EO-B.T.P. 2015(25) IT0005090318	EUR	600.000	0	0	103,2319 %	619.391,28	1,28

Fonds für Stiftungen Invesco

Gattungsbezeichnung	Stück, Anteile bzw. Währung	Bestand 31.03.2016	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
4,000% Niederlande EO-Anl. 2006(16) NL0000102283	EUR	475.000	0	0	101,2950 %	481.151,25	0,99
1,150% Österreich, Republik EO-Bundesobl. 2013(18) AT0000A12B06	EUR	450.000	0	0	104,0120 %	468.054,20	0,97
4,375% Slowakei EO-MTN 2007(17) XS0299989813	EUR	165.000	0	0	105,1242 %	173.454,93	0,36
5,125% Slowenien, Republik EO-Bonds 2011(26) SI0002103164	EUR	200.000	0	0	135,2500 %	270.500,00	0,56
3,250% Spanien EO-Bonos 2010(16) ES00000122X5	EUR	900.000	0	0	100,2588 %	902.329,20	1,86
1,600% Spanien EO-Bonos 2015(25) ES00000126Z1	EUR	620.000	0	0	102,7747 %	637.203,26	1,31
5,500% Spanien EO-Obl. 2002(17) ES0000012783	EUR	950.000	0	0	107,3718 %	1.020.031,67	2,10
Schuldverschreibungen der Kreditwirtschaft						744.849,49	1,54
0,875% Abbey Natl Treasury Serv. EO-MTN 2015(20) XS1325080890	EUR	100.000	100.000	0	99,7153 %	99.715,28	0,21
2,625% Bque Fédérative du Cr. Mutuel EO-MTN 2013(21) XS0954928783	EUR	100.000	0	0	110,2703 %	110.270,26	0,23
2,375% Brambles Finance EO-Bonds 2014(24) XS1028952312	EUR	150.000	0	0	107,1001 %	160.650,08	0,33
3,875% Credit Suisse (London Branch) EO-MTN 2010(17) XS0480903466	EUR	100.000	0	0	103,2830 %	103.283,00	0,21
1,375% PZU Finance EO-Notes 2014(19) XS1082661551	EUR	150.000	0	0	99,8065 %	149.709,75	0,31
4,375% Svenska Handelsbanken EO-MTN 2011(21) XS0693812355	EUR	100.000	0	0	121,2211 %	121.221,12	0,25
Andere Schuldverschreibungen / Industrie						846.469,21	1,75
4,250% Achmea EO-FLR MTN 2015(25/Und.) XS1180651587	EUR	200.000	0	0	90,4163 %	180.832,50	0,37
3,250% Alliander EO-FLR Hy.Secs 2013(18/Und.) XS0997535520	EUR	200.000	0	0	105,0392 %	210.078,34	0,43

Fonds für Stiftungen Invesco

Gattungsbezeichnung	Stück, Anteile bzw. Währung	Bestand 31.03.2016	Käufe/ Zugänge		Kurs	Verkäufe/ Abgänge	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
			im Berichtszeitraum					
1,750% Carrefour EO-MTN 2014(22) XS1086835979	EUR	200.000	0	0	106,3774 %		212.754,87	0,44
1,375% Hutchison Whampoa Fin. EO-Notes 2014(21) XS1132402709	EUR	150.000	0	0	101,3760 %		152.064,00	0,31
1,875% Redexis Gas Finance EO-MTN 2015(27) XS1223842847	EUR	100.000	100.000	0	90,7395 %		90.739,50	0,19
NOK							981.165,73	2,02
<i>Öffentliche Anleihen</i>							<i>981.165,73</i>	<i>2,02</i>
3,750% Norwegen, Königreich NK-Anl. 2010(21) NO0010572878	NOK	8.000.000	0	0	115,5200 %		981.165,73	2,02
SEK							539.975,42	1,12
<i>Öffentliche Anleihen</i>							<i>539.975,42</i>	<i>1,12</i>
1,250% European Investment Bank SK-MTN 2015(25) XS1171476143	SEK	5.000.000	0	0	99,7340 %		539.975,42	1,12
USD							1.445.971,86	2,98
<i>Schuldverschreibungen der Kreditwirtschaft</i>							<i>544.060,84</i>	<i>1,12</i>
6,250% ABN AMRO Bank DL-FLR MTN 2012(17/22) XS0827817650	USD	200.000	200.000	0	104,7611 %		184.755,70	0,38
5,150% BPCE DL-MTN 2014(24) US05578UAB08	USD	200.000	200.000	0	102,0092 %		179.902,47	0,37
2,750% Danske Bank DL-MTN 2015(20) US23636BAD10	USD	200.000	0	0	101,7258 %		179.402,67	0,37
<i>Andere Schuldverschreibungen / Industrie</i>							<i>901.911,02</i>	<i>1,86</i>
3,600% AbbVie DL-Notes 2015(25) US00287YAQ26	USD	200.000	0	0	104,7437 %		184.724,92	0,38
4,450% AT & T DL-Notes 2016(24) US00206RDC34	USD	200.000	200.000	0	107,9773 %		190.427,76	0,39
3,875% Celgene DL-Notes 2015(25) US151020AS39	USD	200.000	0	0	104,8978 %		184.996,69	0,38

Fonds für Stiftungen Invesco

Gattungsbezeichnung	Stück, Anteile bzw. Währung	Bestand 31.03.2016	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
im Berichtszeitraum							
2,750% Lam Research DL-Notes 2015(20) US512807AM03	USD	200.000	0	0	98,2282 %	173.234,34	0,36
3,800% Lam Research DL-Notes 2015(25) US512807AN85	USD	200.000	0	0	95,5592 %	168.527,31	0,35
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere						289.264,05	0,59
Verzinsliche Wertpapiere						289.264,05	0,59
EUR						102.355,80	0,21
<i>Andere Schuldverschreibungen / Industrie</i>						<i>102.355,80</i>	<i>0,21</i>
1,875% Carnival EO-Notes 2015(22) XS1317305198	EUR	100.000	100.000	0	102,3558 %	102.355,80	0,21
USD						186.908,25	0,38
<i>Andere Schuldverschreibungen / Industrie</i>						<i>186.908,25</i>	<i>0,38</i>
3,500% Medtronic DL-Notes 2014(25) US585055BS43	USD	200.000	200.000	0	105,9817 %	186.908,25	0,38
Summe Wertpapiervermögen						43.502.782,16	89,70

Fonds für Stiftungen Invesco

Gattungsbezeichnung	Stück, Anteile bzw. Währung	Bestand 31.03.2016	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
			im Berichtszeitraum				
Derivate							
Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen							
handelt es sich um verkaufte Positionen.							
Zins-Derivate						-15.950,00	-0,03
Zinsindex-Terminkontrakte						-15.950,00	-0,03
FUTURE Euro-BOBL-Future 06.16	Anzahl	-15				4.200,00	0,01
FUTURE Euro-Bund-Future langfristig 06.16	Anzahl	-31				-20.150,00	-0,04
Devisen-Derivate						19.661,93	0,04
Forderungen/Verbindlichkeiten							
Devisenterminkontrakte (Verkauf)						19.670,63	0,04
NOK EUR 25.05.16	NOK	-9.250.000				-11.020,71	-0,02
SEK EUR 25.05.16	SEK	-4.750.000				-7.635,62	-0,02
USD EUR 25.05.16	USD	-1.824.000				38.326,96	0,08
Devisenterminkontrakte (Kauf)						-8,70	0,00
USD EUR 25.05.16	USD	215.000				-8,70	0,00
Forderungen						346.023,23	0,72
Dividendenansprüche	EUR	56.006,63				56.006,63	0,12
Forderungen Quellensteuer	EUR	9.321,11				9.321,11	0,02
Zinsansprüche	EUR	280.695,49				280.695,49	0,58
Kurzfristig liquidierbare Anlagen						2.500.000,00	5,16
Tagesgelder						2.500.000,00	5,16
0,000% Bankguthaben BANK IM BISTUM ESSEN EG	EUR	2.500.000,00				2.500.000,00	5,16

Fonds für Stiftungen Invesco

Gattungsbezeichnung	Stück, Anteile bzw. Währung	Bestand 31.03.2016	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
			im Berichtszeitraum				
Bankguthaben						2.241.698,91	4,62
Bankguthaben	EUR	1.781.850,42				1.781.850,42	3,67
Bankguthaben	AUD	18.355,97				12.368,42	0,03
Bankguthaben	CAD	9.959,26				6.762,36	0,01
Bankguthaben	CHF	9.970,76				9.115,29	0,02
Bankguthaben	DKK	50.000,00				6.709,61	0,01
Bankguthaben	GBP	9.991,10				12.634,17	0,03
Bankguthaben	HKD	2.500.000,00				284.292,82	0,59
Bankguthaben	JPY	2.274.829,00				17.835,27	0,04
Bankguthaben	NOK	99.753,40				10.590,66	0,02
Bankguthaben	PLN	100.000,00				23.451,88	0,05
Bankguthaben	SEK	99.502,92				10.774,49	0,02
Bankguthaben	SGD	99.972,14				65.313,52	0,13
Sonstige Vermögensgegenstände						10.984,57	0,02
Forderungen aus Anteilsceingeschäften*	EUR	10.984,57				10.984,57	0,02
Verbindlichkeiten						-109.575,38	-0,23
Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme						-62.381,64	-0,13
Bankguthaben	USD	-70.743,90				-62.381,64	-0,13
Sonstige Verbindlichkeiten						-47.193,74	-0,10
Verwahrstellenvergütung	EUR	-3.195,33				-3.195,33	-0,01
Verwaltungsvergütung	EUR	-38.787,56				-38.787,56	-0,08
Prüfungskosten	EUR	-4.000,00				-4.000,00	-0,01
Verbindlichkeiten aus Anteilsceingeschäften*	EUR	-1.010,85				-1.010,85	0,00
Veröffentlichungskosten	EUR	-200,00				-200,00	0,00
Fondsvermögen					EUR	48.495.625,42	100,00**

Fonds für Stiftungen Invesco

Gattungsbezeichnung	Stück, Anteile bzw. Währung	Bestand 31.03.2016	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
			im Berichtszeitraum				
Anteilwert					EUR	67,37	
Umlaufende Anteile					Stück	719.801	

* 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 Schuldscheinanleihen (Marktzuordnung zum Berichtsstichtag)			
Börsengehandelte Wertpapiere			
Aktien			
Anadarko Petroleum US0325111070	Stück	0	2.400
Apache US0374111054	Stück	0	11.600
Danske Bank DK0010274414	Stück	0	3.013
Express Scripts Holding US30219G1085	Stück	1.700	1.700
H & M Hennes & Mauritz SE0000106270	Stück	0	6.287
Hino Motors JP3792600003	Stück	0	14.500
IGM Financial CA4495861060	Stück	0	1.200
Kawasaki Kisen Kaisha JP3223800008	Stück	0	21.000
KBC Groep BE0003565737	Stück	0	1.086
NEXT GB0032089863	Stück	0	1.257
Osaka Gas JP3180400008	Stück	0	73.000
Qantas Airways AU0000QANDA4	Stück	284.077	284.077

Gattungsbezeichnung	Stück, Anteile bzw. Währung	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
		im Berichtszeitraum	
Qantas Airways AU000000QAN2	Stück	0	302.532
Svenska Handelsbanken A SE0007100599	Stück	0	22.803
Swiss Re NA CH0126881561	Stück	8.885	10.418
Yahoo! US9843321061	Stück	0	3.700
Verzinsliche Wertpapiere			
2,000% Bundesrep.Deutschland Anl. 2013(23) DE0001102325	EUR	0	1.450.000
2,500% Bundesrep.Deutschland Anl. 2014(46) DE0001102341	EUR	0	500.000
0,000% Bundesrep.Deutschland Bundesschatzanw. 2013(15) DE0001137446	EUR	0	140.000
0,250% Bundesrep.Deutschland Bundesschatzanw. 2014(16) DE0001137453	EUR	640.000	755.000
4,450% DIRECTV Hldgs/Fin.Co. DL-Notes 2014(24) US25459HBL87	USD	200.000	200.000
3,875% Skandinaviska Enskilda Banken EO-MTN 2012(17) XS0730498143	EUR	0	100.000

Gattungsbezeichnung	Stück, Anteile bzw. Währung	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	im Berichtszeitraum	
					Volumen in 1.000
Umsätze in Derivaten					
(In Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte. Bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe.)					
Terminkontrakte					
Zinsindex-Terminkontrakte					
Verkaufte Kontrakte	EUR				6.943
(Basiswert[e]: Euro-BOBL-Future (4,5-5,5) Jahre, Euro-Bund-Future (8,5-10,5 Jahre) langfristig)					
Devisenterminkontrakte (Verkauf)					
NOK - EUR	EUR				997
SEK - EUR	EUR				512
USD - EUR	EUR				2.457
Devisenterminkontrakte (Kauf)					
NOK - EUR	EUR				1.973
SEK - EUR	EUR				507
USD - EUR	EUR				3.369

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben nach der Derivateverordnung

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)	89,70
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)	0,01

Sonstige Angaben

Anteilwert					EUR	67,37
Umlaufende Anteile					Stück	719.801

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
Aktien						
	Europa	31.03.2016		11,97 %		
	Asien	31.03.2016		5,06 %		
	Australien	31.03.2016		1,04 %		
	Nordamerika	30.03.2016		29,17 %		
Renten						
	Inland	30.03.2016		13,77 %		
	Europa	30.03.2016		25,60 %		
	Australien	30.03.2016		0,33 %		
	Nordamerika	30.03.2016		2,76 %		
Derivate - Futures						
	Inland	30.03.2016		-0,03 %		
Derivate - Devisentermingeschäfte						
		31.03.2016		0,04 %		
Übriges Vermögen						
		31.03.2016				10,29 %
				89,71 %		10,29 %

Die prozentualen Angaben beziehen sich auf den Anteil der einzelnen Vermögensgegenstände am Fondsvermögen.

Die Bewertung erfolgt durch die Verwahrstelle unter Mitwirkung der 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	31.03.2016					
Australische Dollar	(AUD)	1,484100	=	1 EUR			
Britische Pfund	(GBP)	0,790800	=	1 EUR			
Kanadische Dollar	(CAD)	1,472750	=	1 EUR			
Dänische Kronen	(DKK)	7,452000	=	1 EUR			
Hong Kong Dollar	(HKD)	8,793750	=	1 EUR			
Japanische Yen	(JPY)	127,546650	=	1 EUR			
Norwegische Kronen	(NOK)	9,419000	=	1 EUR			
Schwedische Kronen	(SEK)	9,235050	=	1 EUR			
Schweizer Franken	(CHF)	1,093850	=	1 EUR			
Singapur Dollar	(SGD)	1,530650	=	1 EUR			
US-Dollar	(USD)	1,134050	=	1 EUR			
Zloty (Polen)	(PLN)	4,264050	=	1 EUR			
Terminbörse							
Eurex - Frankfurt/Zürich							
Over-the-Counter							

Frankfurt am Main, den 31. März 2016

BNY Mellon Service
Kapitalanlage-Gesellschaft mbH
Frankfurt am Main

(Geschäftsführung)