

**MPF Athene
Halbjahresbericht**

30.04.2016

Vermögensübersicht

Aufteilung des Fondsvermögens nach Assetklassen

Assetklasse	Betrag	Anteil in %
I. Vermögensgegenstände	24.382.292,14	100,09
1. Aktien	6.965.327,59	28,59
2. Anleihen	7.354.677,07	30,19
Verzinsliche Wertpapiere	7.354.677,07	30,19
3. Zertifikate	508.750,00	2,09
4. Sonstige Beteiligungspapiere	68.600,00	0,28
5. Investmentfonds	7.187.165,14	29,51
6. Derivate	-14.550,00	-0,06
Optionen	-14.550,00	-0,06
7. Forderungen	130.258,87	0,53
8. Bankguthaben	2.182.063,47	8,96
II. Verbindlichkeiten	-21.644,81	-0,09
Sonstige Verbindlichkeiten	-21.644,81	-0,09
III. Fondsvermögen	24.360.647,33	100,00

Vermögensaufstellung

30.04.2016

Gattungsbezeichnung	Stück, Anteile bzw. Währung	Bestand 30.04.2016	Käufe/ Zugänge		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
			im Berichtszeitraum				
Börsengehandelte Wertpapiere						14.388.604,66	59,06
Aktien						6.965.327,59	28,59
Deutschland						3.588.055,00	14,73
<i>Automobil</i>						<i>248.760,00</i>	<i>1,02</i>
Daimler NA DE0007100000	Stück	4.000	4.000	0	62,1900 EUR	248.760,00	1,02
<i>Chemie</i>						<i>863.310,00</i>	<i>3,54</i>
BASF NA DE000BASF111	Stück	9.000	0	0	73,0900 EUR	657.810,00	2,70
Bayer NA DE000BAY0017	Stück	2.000	0	0	102,7500 EUR	205.500,00	0,84
<i>Industrie</i>						<i>596.965,00</i>	<i>2,45</i>
Deutsche Post NA DE0005552004	Stück	23.000	0	0	25,9550 EUR	596.965,00	2,45
<i>Telekommunikation</i>						<i>546.895,00</i>	<i>2,24</i>
Deutsche Telekom NA DE0005557508	Stück	23.000	0	12.000	15,6200 EUR	359.260,00	1,47
freenet NA DE000A0Z2ZZ5	Stück	7.000	7.000	0	26,8050 EUR	187.635,00	0,77
<i>Versicherungen</i>						<i>1.332.125,00</i>	<i>5,47</i>
Allianz vinkulierte NA DE0008404005	Stück	4.500	0	0	149,8500 EUR	674.325,00	2,77
Münchener Rückversicherung vinkulierte NA DE0008430026	Stück	4.000	0	0	164,4500 EUR	657.800,00	2,70

Gattungsbezeichnung	Stück, Anteile bzw. Währung	Bestand 30.04.2016	Käufe/ Zugänge		Verkäufe/ Abgänge		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
			im Berichtszeitraum						
Dänemark								372.826,02	1,53
<i>Gesundheit / Pharma</i>								<i>372.826,02</i>	<i>1,53</i>
Novo-Nordisk B DK0060534915	Stück	7.500	0	0	370,0000	DKK		372.826,02	1,53
Großbritannien								757.722,43	3,11
<i>Energie</i>								<i>370.060,34</i>	<i>1,52</i>
ROYAL DUTCH SHELL A GB00B03MLX29	Stück	16.000	0	0	18,0150	GBP		370.060,34	1,52
<i>Privater Konsum & Haushalt</i>								<i>387.662,09</i>	<i>1,59</i>
Reckitt Benckiser Group GB00B24CGK77	Stück	4.500	0	0	67,1000	GBP		387.662,09	1,59
Schweiz								1.534.741,36	6,30
<i>Gesundheit / Pharma</i>								<i>256.025,91</i>	<i>1,05</i>
Novartis NA CH0012005267	Stück	3.800	3.800	0	73,8500	CHF		256.025,91	1,05
<i>Nahrungsmittel</i>								<i>880.941,52</i>	<i>3,62</i>
Chocoladef. Lindt & Sprüngli vinkulierte NA CH0010570759	Stück	5	0	0	71.060,0000	CHF		324.149,26	1,33
Nestlé NA CH0038863350	Stück	8.500	0	0	71,8000	CHF		556.792,26	2,29
<i>Versicherungen</i>								<i>397.773,93</i>	<i>1,63</i>
Swiss Re NA CH0126881561	Stück	5.000	0	0	87,2000	CHF		397.773,93	1,63
USA								711.982,78	2,92
<i>Gesundheit / Pharma</i>								<i>375.575,77</i>	<i>1,54</i>
Johnson & Johnson US4781601046	Stück	3.800	3.800	0	112,4800	USD		375.575,77	1,54

Gattungsbezeichnung	Stück, Anteile bzw. Währung	Bestand 30.04.2016	Käufe/ Zugänge		Verkäufe/ Abgänge		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
			im Berichtszeitraum						
Privater Konsum & Haushalt								336.407,01	1,38
Procter & Gamble US7427181091	Stück	4.800	4.800	0	79,7600	USD	336.407,01	1,38	
Verzinsliche Wertpapiere								7.354.677,07	30,19
EUR								4.669.735,09	19,17
Öffentliche Anleihen								2.074.295,00	8,51
1,000% Bundesrep.Deutschland Bundesobl. 2013(18) DE0001141679	EUR	2.000.000	2.000.000	0	103,7148	%	2.074.295,00	8,51	
Schuldverschreibungen der Kreditwirtschaft								1.866.168,15	7,66
6,660% Commerzbank Nachr. MTN 2000(16) DE0002234622	EUR	200.000	0	0	101,0990	%	202.198,00	0,83	
5,750% Main Capital Fdg II EO-Cap.Sec. 2006(Und.) DE000A0G18M4	EUR	300.000	0	0	100,9770	%	302.931,00	1,24	
5,500% Main Capital Funding EO-Cap. Sec. 2005(Und.) DE000A0E4657	EUR	700.000	0	0	101,2497	%	708.747,90	2,91	
4,668% ProSecure Funding EO-Securities 2006(16) XS0249466730	EUR	650.000	0	0	100,3525	%	652.291,25	2,68	
Andere Schuldverschreibungen / Industrie								729.271,94	2,99
2,750% SGL CARBON Wandelschuldv. 2012(18) DE000A1ML4A7	EUR	300.000	0	0	90,0500	%	270.150,00	1,11	
4,000% Telecom Italia EO-MTN 2012(20) XS0868458653	EUR	150.000	0	0	111,1230	%	166.684,43	0,68	
3,750% Volkswagen Intl Finance EO-FLR Notes 2014(21/Und.) XS1048428012	EUR	300.000	0	0	97,4792	%	292.437,51	1,20	
USD								2.684.941,98	11,02
Öffentliche Anleihen								1.584.133,80	6,50
1,125% Canada DL-Bonds 2015(18) US135087E426	USD	750.000	750.000	0	100,5068	%	662.361,93	2,72	

Gattungsbezeichnung	Stück, Anteile bzw. Währung	Bestand 30.04.2016	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
1,000% FMS Wertmanagement DL IHS 2012(17) US30254WAA71	USD	550.000	0	0	99,9040 %	482.818,62	1,98
0,625% United States of America DL-Notes 2012(17) US912828TS94	USD	500.000	500.000	0	99,9102 %	438.953,25	1,80
Andere Schuldverschreibungen / Industrie						1.100.808,18	4,52
1,000% Apple DL-Notes 2013(18) US037833AJ95	USD	750.000	0	0	100,0298 %	659.218,40	2,71
1,125% Johnson & Johnson DL-Notes 2014(17) US478160BL73	USD	500.000	500.000	0	100,5103 %	441.589,78	1,81
Sonstige Beteiligungswertpapiere						68.600,00	0,28
Deutschland						68.600,00	0,28
Schuldverschreibungen der Kreditwirtschaft						68.600,00	0,28
Dexia Kommunalbank Deutschl.Genussscheine 2006(16) DE00DXA0RM5	EUR	200.000	0	0	34,3000 %	68.600,00	0,28
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere						508.750,00	2,09
Zertifikate						508.750,00	2,09
Indezertifikat						508.750,00	2,09
Guernsey						508.750,00	2,09
Notenstein Finance (Guernsey) EO-Anl. 2016(22) CH0303242769	Nominal	500.000	500.000	0	101,7500 %	508.750,00	2,09
Investmentfonds						7.187.165,14	29,51
Aktienfonds						1.486.052,97	6,10
Gruppenfremde Aktienfonds						1.486.052,97	6,10
Invesco-Asia Consumer Demand C Cap. USD LU0334857512	Anteile	40.000	0	0	13,2100 USD	464.302,97	1,91
MPF Aktien Strat.Total Return LU0330557819	Anteile	5.000	0	5.000	121,5900 EUR	607.950,00	2,50

MPF Athene

Gattungsbezeichnung	Stück, Anteile bzw. Währung	Bestand 30.04.2016	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
MPF Global Fonds-Warburg DE0005153860	Anteile	10.000	0	0	41,3800 EUR	413.800,00	1,70
Rentenfonds						240.858,20	0,99
Gruppenfremde Rentenfonds						240.858,20	0,99
XAIA Credit Basis I EUR LU0418282934	Anteile	220	0	0	1.094,8100 EUR	240.858,20	0,99
Gemischte Fonds						2.658.624,00	10,91
KVG - eigene Gemischte Fonds						2.658.624,00	10,91
MPF Andante DE000A0RKY11	Anteile	19,200	0	0	138,4700 EUR	2.658.624,00	10,91
Indexfonds						2.801.629,97	11,51
Gruppenfremde Indexfonds						2.801.629,97	11,51
DB Platinum IV - Platow I 1C LU1239760371	Anteile	520	600	80	2.935,1800 EUR	1.526.293,60	6,27
iShares S&P 500 UCITS ETF DIS IE0031442068	Anteile	70.000	0	30.000	18,2191 EUR	1.275.336,37	5,24
Summe Wertpapiervermögen						22.084.519,80	90,66

Gattungsbezeichnung	Stück, Anteile bzw. Währung	Bestand 30.04.2016	im Berichtszeitraum		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
			Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge			
Derivate							
Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen							
handelt es sich um verkaufte Positionen.							
Aktienindex-Derivate						-14.550,00	-0,06
Optionsrechte						-14.550,00	-0,06
<i>Optionsrechte auf Aktienindizes</i>							
CALL ESTX 50 Index 05.16 3175,00	Anzahl	-750				-14.550,00	-0,06
Forderungen						130.258,87	0,53
Dividendenansprüche	EUR	7.524,74				7.524,74	0,03
Forderungen Quellensteuer	EUR	16.282,59				16.282,59	0,06
Zinsansprüche	EUR	106.451,54				106.451,54	0,44
Bankguthaben						2.182.063,47	8,96
Bankguthaben	EUR	1.216.773,77				1.216.773,77	5,00
Bankguthaben	CAD	757.711,51				531.540,87	2,18
Bankguthaben	CHF	116.635,83				106.409,84	0,44
Bankguthaben	DKK	62.415,00				8.385,56	0,03
Bankguthaben	GBP	21.276,94				27.316,65	0,11
Bankguthaben	NOK	1.622.335,14				175.717,17	0,72
Bankguthaben	USD	131.922,31				115.919,61	0,48
Verbindlichkeiten						-21.644,81	-0,09
Sonstige Verbindlichkeiten						-21.644,81	-0,09
Beratervergütung	EUR	-5.976,94				-5.976,94	-0,03
Verwahrstellenvergütung	EUR	-819,67				-819,67	0,00
Verwaltungsvergütung	EUR	-5.464,20				-5.464,20	-0,02
Prüfungskosten	EUR	-9.134,00				-9.134,00	-0,04

MPF Athene

Gattungsbezeichnung	Stück, Anteile bzw. Währung	Bestand 30.04.2016	im Berichtszeitraum		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
			Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge			
Veröffentlichungskosten	EUR	-250,00				-250,00	0,00
Fondsvermögen					EUR	24.360.647,33	100,00*
Anteilwert					EUR	105,58	
Umlaufende Anteile					Stück	230.740	

* 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					
Verzinsliche Wertpapiere					
3,625% Goldman Sachs Group DL-Notes 2011(16) US38143USC61	USD	0	750.000		
4,000% HeidelbergCement Finance EO-MTN 2012(16) XS0755521142	EUR	0	200.000		
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere					
Verzinsliche Wertpapiere					
6,750% KION Finance EO-Notes 2013(20) XS0889217716	EUR	0	300.000		
Nichtnotierte Wertpapiere					
Andere Wertpapiere					
Royal Dutch Shell A Anrechte NL0011683560	Stück	16.000	16.000		
Royal Dutch Shell A Anrechte NL0011542568	Stück	16.000	16.000		
Investmentfonds					
Gruppenfremde Investmentanteile					
DB Platinum III Platow I1C LU0247468878	Anteile	0	450		
De.Inv.-I-Top Asia FC LU0145649181	Anteile	0	2.000		

Gattungsbezeichnung	Stück, Anteile bzw. Währung	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Volumen in 1.000
		im Berichtszeitraum		
M&G Global Basics Euro-Class C GB0030932783	Anteile	0	15.000	
Nordea 1-North Amer.All Cap Fd AI USD LU0772956743	Anteile	0	7.000	
				Volumen in 1.000
Umsätze in Derivaten				
(In Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte. Bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe.)				
Terminkontrakte				
Aktienindex-Terminkontrakte				
Gekaufte Kontrakte	EUR			7.400
(Basiswert[e]: DAX Performance-Index)				
Optionsrechte				
Optionsrechte auf Aktienindex-Derivate				
Optionsrechte auf Aktienindizes				
Verkaufte Kaufoption	EUR			41
(Basiswert[e]: DAX Performance-Index, ESTX 50 Index (Price) (EUR))				
Verkaufte Verkaufsoption	EUR			91
(Basiswert[e]: DAX Performance-Index, ESTX 50 Index (Price) (EUR))				

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV**Angaben nach der Derivateverordnung**

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)	90,66
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)	-0,06

Sonstige Angaben

Anteilwert					EUR	105,58
Umlaufende Anteile					Stück	230.740

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						
	Inland	29.04.2016		14,73 %		
	Europa	29.04.2016		10,94 %		
	Nordamerika	28.04.2016		2,92 %		
Renten						
	Inland	28.04.2016		12,71 %		
	Europa	28.04.2016		8,72 %		
	Nordamerika	28.04.2016		9,04 %		
Investmentanteile						
	Inland	28.04.2016				12,61 %
	Europa	28.04.2016		5,24 %		11,66 %
Zertifikate						
	Europa	29.04.2016		2,09 %		
Derivate - Optionen						
	Europa	28.04.2016		-0,06 %		

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
Übriges Vermögen						
		29.04.2016				9,40 %
				66,33 %		33,67 %

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	29.04.2016				
Britische Pfund	(GBP)	0,778900	=	1 EUR		
Kanadische Dollar	(CAD)	1,425500	=	1 EUR		
Dänische Kronen	(DKK)	7,443150	=	1 EUR		
Norwegische Kronen	(NOK)	9,232650	=	1 EUR		
Schweizer Franken	(CHF)	1,096100	=	1 EUR		
US-Dollar	(USD)	1,138050	=	1 EUR		
Terminbörse						
Eurex – Frankfurt/ Zürich						

Frankfurt am Main, den 30. April 2016

BNY Mellon Service
Kapitalanlage-Gesellschaft mbH
Frankfurt am Main

(Geschäftsführung)