

AAA Multi Asset Portfolio Rendite Halbjahresbericht

31.03.2016

Vermögensübersicht

Aufteilung des Fondsvermögens nach Assetklassen

Assetklasse	Betrag	Anteil in %
I. Vermögensgegenstände	1.918.614,99	101,13
1. Aktien	580.990,70	30,62
2. Zertifikate	174.600,00	9,21
3. Sonstige Beteiligungspapiere	24.905,53	1,31
4. Investmentfonds	724.905,27	38,21
5. Derivate	16.874,04	0,89
Futures	-3.015,96	-0,16
Optionen	19.890,00	1,05
6. Forderungen	1.520,96	0,08
7. Kurzfristig liquidierbare Anlagen	230.850,00	12,17
Geldmarktfonds	230.850,00	12,17
8. Bankguthaben	155.638,44	8,20
II. Verbindlichkeiten	-13.128,75	-0,69
Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme	-2.461,13	-0,13
Sonstige Verbindlichkeiten	-10.667,62	-0,56
III. Fondsvermögen	1.897.156,19	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								780.496,23	41,14
Aktien								580.990,70	30,62
Deutschland								180.591,90	9,52
<i>Chemie</i>								28.811,25	1,52
Linde DE0006483001	Stück	225	225	0	128,0500	EUR	28.811,25	1,52	
<i>Gesundheit / Pharma</i>								30.378,90	1,60
Merck DE0006599905	Stück	240	65	200	73,3100	EUR	17.594,40	0,93	
STRATEC Biomedical NA DE000STRA555	Stück	300	0	175	42,6150	EUR	12.784,50	0,67	
<i>Medien</i>								18.948,00	1,00
Axel Springer vinkulierte NA DE0005501357	Stück	400	0	200	47,3700	EUR	18.948,00	1,00	
<i>Privater Konsum & Haushalt</i>								20.600,00	1,09
adidas NA DE000A1EWWW0	Stück	200	0	250	103,0000	EUR	20.600,00	1,09	
<i>Rohstoffe</i>								32.797,50	1,73
Aurubis DE0006766504	Stück	750	750	0	43,7300	EUR	32.797,50	1,73	
<i>Technologie</i>								17.775,00	0,94
SAP DE0007164600	Stück	250	50	150	71,1000	EUR	17.775,00	0,94	

AAA Multi Asset Portfolio Rendite

Gattungsbezeichnung	Stück, Anteile bzw. Währung	Bestand 31.03.2016	Käufe/ Zugänge		Verkäufe/ Abgänge		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
			im Berichtszeitraum						
Versicherungen								31.281,25	1,65
Münchener Rückversicherung vinkulierte NA DE0008430026	Stück	175	0	0	178,7500	EUR	31.281,25	1,65	
Dänemark								23.838,45	1,26
Gesundheit / Pharma								23.838,45	1,26
Novo-Nordisk B DK0060534915	Stück	500	500	0	355,2000	DKK	23.838,45	1,26	
Frankreich								56.420,00	2,97
Immobilien								31.434,00	1,66
Unibail-Rodamco FR0000124711	Stück	130	0	0	241,8000	EUR	31.434,00	1,66	
Versorger								24.986,00	1,32
Suez Environnement FR0010613471	Stück	1.550	1.550	0	16,1200	EUR	24.986,00	1,32	
Großbritannien								33.912,82	1,79
Privater Konsum & Haushalt								33.912,82	1,79
Reckitt Benckiser Group GB00B24CGK77	Stück	400	0	0	67,3000	GBP	33.912,82	1,79	
Norwegen								52.429,88	2,76
Energie								27.606,66	1,46
StatoilHydro NO0010096985	Stück	2.000	2.000	0	130,3000	NOK	27.606,66	1,46	
Telekommunikation								24.823,22	1,31
Telenor NO0010063308	Stück	1.750	1.750	0	133,9000	NOK	24.823,22	1,31	

AAA Multi Asset Portfolio Rendite

Gattungsbezeichnung	Stück, Anteile bzw. Währung	Bestand 31.03.2016	Käufe/ Zugänge		Verkäufe/ Abgänge		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
			im Berichtszeitraum						
Schweden								25.100,92	1,32
<i>Bau & Materialien</i>								25.100,92	1,32
Skanska SE0000113250	Stück	1.250	1.250	1.600	185,3000	SEK	25.100,92	1,32	
Schweiz								29.582,78	1,56
<i>Nahrungsmittel</i>								29.582,78	1,56
Nestlé NA CH0038863350	Stück	450	0	0	71,8500	CHF	29.582,78	1,56	
USA								179.113,95	9,44
<i>Gesundheit / Pharma</i>								78.263,19	4,13
Abbott Laboratories US0028241000	Stück	675	675	0	41,8300	USD	24.757,99	1,31	
AbbVie US00287Y1091	Stück	500	0	0	57,1200	USD	25.042,75	1,32	
Johnson & Johnson US4781601046	Stück	300	0	0	108,2000	USD	28.462,45	1,50	
<i>Nahrungsmittel</i>								51.375,99	2,71
Coca-Cola US1912161007	Stück	825	0	0	46,3900	USD	33.558,46	1,77	
WhiteWave Foods Co. US9662441057	Stück	500	500	0	40,6400	USD	17.817,53	0,94	
<i>Privater Konsum & Haushalt</i>								25.260,64	1,33
Procter & Gamble US7427181091	Stück	350	0	0	82,3100	USD	25.260,64	1,33	
<i>Technologie</i>								24.214,13	1,28
Microsoft US5949181045	Stück	500	500	0	55,2300	USD	24.214,13	1,28	

AAA Multi Asset Portfolio Rendite

Gattungsbezeichnung	Stück, Anteile bzw. Währung	Bestand 31.03.2016	Käufe/ Zugänge		Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
			im Berichtszeitraum					
Zertifikate							174.600,00	9,21
Zertifikate auf Rohstoffe							174.600,00	9,21
<i>Deutschland</i>							<i>174.600,00</i>	<i>9,21</i>
Deutsche Börse Comm. Xetra-Gold IHS 2007(09/Und) DE000A0S9GB0	Stück	5.000	0	1.000	34,9200	EUR	174.600,00	9,21
Sonstige Beteiligungswertpapiere							24.905,53	1,31
Schweiz							24.905,53	1,31
<i>Gesundheit / Pharma</i>							<i>24.905,53</i>	<i>1,31</i>
Roche Holding Inhaber-Genussscheine CH0012032048	Stück	115	0	0	236,7000	CHF	24.905,53	1,31
Investmentfonds							724.905,27	38,21
Aktienfonds							629.075,27	33,16
Gruppenfremde Aktienfonds							629.075,27	33,16
CME Gold & Silver Equity Fund I LU1276853808	Anteile	600	725	125	117,0000	EUR	70.200,00	3,70
First St.I.-St.I.A.Pac.Sust.Fd B EUR GB00B2PDS698	Anteile	175.000	0	25.000	1,9090	EUR	334.075,00	17,61
JPMorgan-Europe Eq.Abs.Alp.Fd C (acc) EUR LU1001748398	Anteile	1.483	1.483	0	108,9800	EUR	161.575,27	8,52
ÖkoWorld - Growing Markets 2.0 C Cap. EUR LU0800346016	Anteile	500	0	2.400	126,4500	EUR	63.225,00	3,33
Gemischte Fonds							95.830,00	5,05
Gruppenfremde Gemischte Fonds							95.830,00	5,05
Vicenda Mult.Ass.Oppo.Fd UC.UI I (EUR) DE000A1XDWP4	Anteile	1.000	1.000	0	95,8300	EUR	95.830,00	5,05
Summe Wertpapiervermögen							1.505.401,50	79,35

AAA Multi Asset Portfolio Rendite

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.								
Aktienindex-Derivate						16.874,04	0,89	
Aktienindex-Terminkontrakte						-3.015,96	-0,16	
FUTURE ESTX 50 Index 06.16	Anzahl	-7				-180,00	-0,01	
MINI FUTURE DAX Performance-Index 06.16	Anzahl	-2				-600,00	-0,03	
MINI FUTURE S&P 500 Index 06.16	Anzahl	-2				-2.235,96	-0,12	
Optionsrechte						19.890,00	1,05	
<i>Optionsrechte auf Aktienindizes</i>						<i>19.890,00</i>	<i>1,05</i>	
PUT ESTX 50 Index 06.16 2700,00	Anzahl	200				9.960,00	0,53	
PUT ESTX 50 Index 06.16 2775,00	Anzahl	150				9.930,00	0,52	
Forderungen						1.520,96	0,08	
Dividendenansprüche	EUR	845,71				845,71	0,04	
Forderungen Quellensteuer	EUR	675,25				675,25	0,04	
Kurzfristig liquidierbare Anlagen						230.850,00	12,17	
Geldmarktfonds						230.850,00	12,17	
Gruppenfremde Geldmarktfonds						230.850,00	12,17	
AL Trust Euro Cash DE0008471780	Anteile	5.000,00	0	2.500	46,1700	EUR	230.850,00	12,17
Bankguthaben						155.638,44	8,20	
Bankguthaben	EUR	155.638,44					155.638,44	8,20

AAA Multi Asset Portfolio Rendite

Gattungsbezeichnung	Stück, Anteile bzw. Währung	Bestand 31.03.2016	im Berichtszeitraum		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
			Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge			
Verbindlichkeiten						-13.128,75	-0,69
Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme						-2.461,13	-0,13
Bankguthaben	USD	-2.806,80				-2.461,13	-0,13
Sonstige Verbindlichkeiten						-10.667,62	-0,56
Verwahrstellenvergütung	EUR	-375,55				-375,55	-0,02
Verwaltungsvergütung	EUR	-5.940,10				-5.940,10	-0,31
Prüfungskosten	EUR	-4.101,97				-4.101,97	-0,22
Veröffentlichungskosten	EUR	-250,00				-250,00	-0,01
Fondsvermögen					EUR	1.897.156,19	100,00*
Anteilwert					EUR	92,36	
Umlaufende Anteile					Stück	20.541	

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

AAA Multi Asset Portfolio Rendite

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)						
Börsengehandelte Wertpapiere						
Aktien						
Novozymes DK0060336014	Stück	600	600			
Investmentfonds						
Gruppenfremde Investmentanteile						
ComStage NYSE Arca Gold BUGS Ucits ETF I LU0488317701	Anteile	0	4.000			
JP Morgan-Europe Eq.Abs.Alp.Fd B (acc) EUR LU1001748042	Anteile	0	1.400			

AAA Multi Asset Portfolio Rendite

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					
Aktienindex-Terminkontrakte					
Verkaufte Kontrakte	EUR				1.097
<small>(Basiswert[e]: ESTX 50 Index (Price) (EUR), DAX Performance-Index, S&P 500 Index)</small>					
Zinsindex-Terminkontrakte					
Verkaufte Kontrakte	EUR				321
<small>(Basiswert[e]: Euro-Bund-Future (8,5-10,5 Jahre) langfristig)</small>					
Devisenterminkontrakte (Verkauf)					
USD - EUR	EUR				786
USD - JPY	EUR				0
Devisenterminkontrakte (Kauf)					
AUD - EUR	EUR				70
NOK - EUR	EUR				100

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben nach der Derivateverordnung

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)	79,35
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)	0,89

Sonstige Angaben

Anteilwert	EUR	92,36
Umlaufende Anteile	Stück	20.541

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	31.03.2016	9,52 %			
	Europa	31.03.2016	12,97 %			
	Nordamerika	30.03.2016	9,44 %			
Investmentanteile						
	Inland	30.03.2016				17,22 %
	Europa	30.03.2016				33,16 %
Zertifikate						
	Inland	31.03.2016	9,21 %			
Derivate - Futures						
	Inland	30.03.2016	-0,03 %			
	Europa	30.03.2016	-0,01 %			
	Nordamerika	30.03.2016	-0,12 %			
Derivate - Optionen						
	Europa	30.03.2016	1,05 %			
Übriges Vermögen						
		31.03.2016				7,59 %
			42,03 %			57,97 %

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	31.03.2016				
Britische Pfund	(GBP)	0,793800	=	1 EUR		
Dänische Kronen	(DKK)	7,450150	=	1 EUR		
Norwegische Kronen	(NOK)	9,439750	=	1 EUR		
Schwedische Kronen	(SEK)	9,227750	=	1 EUR		
Schweizer Franken	(CHF)	1,092950	=	1 EUR		
US-Dollar	(USD)	1,140450	=	1 EUR		
Terminbörse						
Chicago - Chicago Mercantile Exchange (CME)						
Eurex - Frankfurt/Zürich						

Frankfurt am Main, den 31. März 2016

BNY Mellon Service
Kapitalanlage-Gesellschaft mbH
Frankfurt am Main

(Geschäftsführung)