

AAA Multi Asset Portfolio Sicherheit Halbjahresbericht

31.03.2016

Vermögensübersicht

Aufteilung des Fondsvermögens nach Assetklassen

Assetklasse	Betrag	Anteil in %
I. Vermögensgegenstände	2.793.273,35	101,32
1. Aktien	145.326,96	5,27
2. Anleihen	558.923,75	20,28
Verzinsliche Wertpapiere	558.923,75	20,28
3. Zertifikate	157.140,00	5,70
4. Investmentfonds	1.516.290,79	55,00
5. Forderungen	61,85	0,00
6. Kurzfristig liquidierbare Anlagen	415.530,00	15,07
Geldmarktfonds	415.530,00	15,07
II. Verbindlichkeiten	-36.541,44	-1,32
Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme	-24.287,01	-0,88
Sonstige Verbindlichkeiten	-12.254,43	-0,44
III. Fondsvermögen	2.756.731,91	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								861.390,71	31,25
Aktien								145.326,96	5,27
Deutschland								57.876,00	2,10
<i>Chemie</i>								<i>29.451,50</i>	<i>1,07</i>
Linde DE0006483001	Stück	230	230	0	128,0500	EUR	29.451,50	1,07	
<i>Rohstoffe</i>								<i>28.424,50</i>	<i>1,03</i>
Aurubis DE0006766504	Stück	650	650	0	43,7300	EUR	28.424,50	1,03	
Dänemark								28.606,14	1,04
<i>Gesundheit / Pharma</i>								<i>28.606,14</i>	<i>1,04</i>
Novo-Nordisk B DK0060534915	Stück	600	600	0	355,2000	DKK	28.606,14	1,04	
Norwegen								29.787,87	1,08
<i>Telekommunikation</i>								<i>29.787,87</i>	<i>1,08</i>
Telenor NO0010063308	Stück	2.100	2.100	0	133,9000	NOK	29.787,87	1,08	
USA								29.056,95	1,05
<i>Technologie</i>								<i>29.056,95</i>	<i>1,05</i>
Microsoft US5949181045	Stück	600	600	0	55,2300	USD	29.056,95	1,05	

AAA Multi Asset Portfolio Sicherheit

Gattungsbezeichnung	Stück, Anteile bzw. Währung	Bestand 31.03.2016	Käufe/ Zugänge		Kurs	Verkäufe/ Abgänge	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
			im Berichtszeitraum					
Verzinsliche Wertpapiere							558.923,75	20,28
EUR							558.923,75	20,28
<i>Öffentliche Anleihen</i>							<i>558.923,75</i>	<i>20,28</i>
0,000% Schleswig-Holstein, Land FLR-Landesschatz. 2015(23) DE000SHFM451	EUR	550.000	0	0	101,6225 %		558.923,75	20,28
Zertifikate							157.140,00	5,70
Zertifikate auf Rohstoffe							157.140,00	5,70
<i>Deutschland</i>							<i>157.140,00</i>	<i>5,70</i>
Deutsche Börse Comm. Xetra-Gold IHS 2007(09/Und) DE000A0S9GB0	Stück	4.500	1.700	0	34,9200 EUR		157.140,00	5,70
Investmentfonds							1.516.290,79	55,00
Aktienfonds							591.781,73	21,47
Gruppenfremde Aktienfonds							591.781,73	21,47
CME Gold & Silver Equity Fund I LU1276853808	Anteile	450	450	0	117,0000 EUR		52.650,00	1,91
Hen.Gart.-UK Absolute Return.I Acc.EUR Hdgd LU0490769915	Anteile	15.000	15.000	0	5,5914 GBP		105.657,00	3,83
JPMorgan-Europe Eq.Abs.Alp.Fd C (perf)(acc)EUR LU1001748398	Anteile	847	847	0	108,9800 EUR		92.328,73	3,35
LOYS - Global L/S I LU0720542298	Anteile	1.600	0	0	70,9600 EUR		113.536,00	4,12
ÖkoWorld - Growing Markets 2.0 C Cap. EUR LU0800346016	Anteile	1.800	0	1.400	126,4500 EUR		227.610,00	8,26
Rentenfonds							68.435,20	2,48
Gruppenfremde Rentenfonds							68.435,20	2,48
Tungsten PARAGON I DE000A1J31W8	Anteile	640	0	0	106,9300 EUR		68.435,20	2,48

AAA Multi Asset Portfolio Sicherheit

Gattungsbezeichnung	Stück, Anteile bzw. Währung	Bestand 31.03.2016	im Berichtszeitraum		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
			Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge			
Gemischte Fonds						752.693,86	27,30
Gruppenfremde Gemischte Fonds						752.693,86	27,30
DNCA Invest-Miuri I Cap. EUR LU0641746143	Anteile	1.110	0	0	128,5200 EUR	142.657,20	5,17
First Private Wealth B DE000A0KFTH1	Anteile	1.920	0	0	71,0500 EUR	136.416,00	4,95
HERALD (LUX)-US Absolute Return I Cap. EUR LU0350637061*	Anteile	721	0	0	0,0000 EUR	0,01	0,00
JPMorg.I.-Global Macro Opp.Fd A EUR LU0247992398	Anteile	725	725	0	134,8500 EUR	97.766,25	3,55
ML Inv.Sols-AQR Glb.Rel.Val.U. B Acc. EUR LU0562189042	Anteile	800	800	0	139,1235 USD	97.592,00	3,54
Stand.Life I.G.-Gl.Ab.Ret.Str. A EUR Dis. LU0548153443	Anteile	8.000	0	0	11,8572 EUR	94.857,60	3,44
Tungsten PARITON UI I DE000A1W8945	Anteile	835	0	0	104,8800 EUR	87.574,80	3,18
Vicenda Mult.Ass.Oppo.Fd UC.UI I (EUR) DE000A1XDWP4	Anteile	1.000	1.000	0	95,8300 EUR	95.830,00	3,47
Immobilienfonds						103.380,00	3,75
Gruppenfremde Immobilienfonds						103.380,00	3,75
Morgan Stanley P2 Value DE000A0F6G89	Anteile	9.000	0	0	2,4800 EUR	22.320,00	0,81
TMW Immobilien Weltfonds DE000A0DJ328	Anteile	10.500	0	0	7,7200 EUR	81.060,00	2,94
Summe Wertpapiervermögen						2.377.681,50	86,25

* Infolge des Bekanntheitsverlusts des "Madoff"-Betrugsfalls wurde die Position seit dem 17.12.2009 mit 0 bewertet.

AAA Multi Asset Portfolio Sicherheit

Gattungsbezeichnung	Stück, Anteile bzw. Währung	Bestand 31.03.2016	Käufe/ Zugänge		Verkäufe/ Abgänge		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
im Berichtszeitraum									
Forderungen								61,85	0,00
Forderungen Quellensteuer	EUR	61,85						61,85	0,00
Kurzfristig liquidierbare Anlagen								415.530,00	15,07
Geldmarktfonds								415.530,00	15,07
Gruppenfremde Geldmarktfonds								415.530,00	15,07
AL Trust Euro Cash DE0008471780	Anteile	9.000,00	0	2.150	46,1700	EUR		415.530,00	15,07
Verbindlichkeiten								-36.541,44	-1,32
Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme								-24.287,01	-0,88
Bankguthaben	EUR	-24.287,01						-24.287,01	-0,88
Sonstige Verbindlichkeiten								-12.254,43	-0,44
Verwahrstellenvergütung	EUR	-398,43						-398,43	-0,01
Verwaltungsvergütung	EUR	-7.398,07						-7.398,07	-0,27
Prüfungskosten	EUR	-4.082,93						-4.082,93	-0,15
Veröffentlichungskosten	EUR	-375,00						-375,00	-0,01
Fondsvermögen							EUR	2.756.731,91	100,00*
Anteilwert							EUR	88,71	
Umlaufende Anteile							Stück	31,077	

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

AAA Multi Asset Portfolio Sicherheit

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)				
Investmentfonds				
Gruppenfremde Investmentanteile				
iShares USD Corporate Bond UCITS ETF DE000A0DPYY0	Anteile	0	850	
JP Morgan-Europe Eq.Abs.Alp.Fd B (acc) EUR LU1001748042	Anteile	0	800	
				Volumen in 1.000
Umsätze in Derivaten				
(In Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte. Bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe.)				
Terminkontrakte				
Devisenterminkontrakte (Verkauf)				
EUR - JPY	EUR			1
USD - EUR	EUR			507
USD - JPY	EUR			1

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben nach der Derivateverordnung

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)	86,25
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)	0,00

Sonstige Angaben

Anteilwert					EUR	88,71
Umlaufende Anteile					Stück	31.077

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		2,10 %		
	Europa	31.03.2016		2,12 %		
	Nordamerika	30.03.2016		1,05 %		
Renten						
	Inland	30.03.2016		20,28 %		
Investmentanteile						
	Inland	30.03.2016				32,90 %
	Europa	30.03.2016				37,17 %
Zertifikate						
	Inland	31.03.2016		5,70 %		
Übriges Vermögen						
		31.03.2016				-1,32 %
				31,25 %		68,75 %

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.

AAA Multi Asset Portfolio Sicherheit

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		
US-Dollar	(USD)	1,140450	=	1 EUR		

Frankfurt am Main, den 31. März 2016

BNY Mellon Service
Kapitalanlage-Gesellschaft mbH
Frankfurt am Main

(Geschäftsführung)