

**MPF Herkules
Halbjahresbericht**

31.12.2016

**Hinweis für
unsere Anleger**

**Kündigung der Verwaltung
über das Sonstige Investmentvermögen
und geplante Übertragung des Verwaltungsrechts sowie
der Verwahrstellenfunktion**

Die BNY Mellon Service Kapitalanlage-Gesellschaft mbH, Frankfurt am Main kündigt ihr Verwaltungsrecht an dem Sonstigen Investmentvermögen MPF Herkules – ISIN DE000A0ORKY29, gemäß § 99 des Kapitalanlagegesetzbuches (KAGB) bzw. § 22 Abs. 1 der Allgemeinen Anlagebedingungen mit Wirkung zum 30. Juni 2017.

Mit Wirksamwerden der Kündigung geht das Verfügungsrecht über das Sondervermögen kraft Gesetz auf die Verwahrstelle, The Bank of New York Mellon SA/NV, Asset Servicing, Niederlassung Frankfurt am Main, über.

Vorbehaltlich der Genehmigung durch die Bundesanstalt für Finanzdienstleistungsaufsicht (BaFin) wird die Verwahrstelle das Sonstige Investmentvermögen nicht liquidieren (auflösen), sondern es ist vorgesehen, dass die Verwahrstelle das Verwaltungsrecht zum 01. Juli 2017 auf die Warburg Invest Kapitalanlagegesellschaft mbH, Hamburg, überträgt, welche das Investmentvermögen fortführen wird. Darüber hinaus ist zum gleichen Zeitpunkt, vorbehaltlich einer Genehmigung der BaFin, ein Wechsel der Verwahrstelle hin zur M.M.Warburg & CO KGaA, Hamburg, geplant.

Vermögensübersicht

Aufteilung des Fondsvermögens nach Assetklassen

Assetklasse	Betrag	Anteil in %
I. Vermögensgegenstände	55.214.059,78	100,05
1. Aktien	898.090,00	1,63
2. Anleihen	36.092.540,80	65,40
Verzinsliche Wertpapiere	36.092.540,80	65,40
3. Zertifikate	4.681.885,00	8,48
4. Investmentfonds	11.380.663,21	20,62
5. Forderungen	872.384,78	1,58
6. Bankguthaben	1.288.495,99	2,34
II. Verbindlichkeiten	-27.705,28	-0,05
Sonstige Verbindlichkeiten	-27.705,28	-0,05
III. Fondsvermögen	55.186.354,50	100,00

Vermögensaufstellung

31.12.2016

Gattungsbezeichnung	Stück, Anteile bzw. Währung	Bestand 31.12.2016	im Berichtszeitraum		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
			Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge			
Börsengehandelte Wertpapiere						38.108.575,80	69,05
Aktien						898.090,00	1,63
Deutschland						898.090,00	1,63
<i>Banken</i>						<i>898.090,00</i>	<i>1,63</i>
Commerzbank DE000CBK1001	Stück	70.000	0	0	7,2310 EUR	506.170,00	0,92
Deutsche Bank NA DE0005140008	Stück	23.000	0	0	17,0400 EUR	391.920,00	0,71
Verzinsliche Wertpapiere						36.092.540,80	65,40
EUR						36.092.540,80	65,40
<i>Öffentliche Anleihen</i>						<i>2.011.960,38</i>	<i>3,65</i>
0,000% Nordrhein-Westfalen, Land FLR-Landessch. 2014(19) DE000NRW23R2	EUR	2.000.000	0	0	100,5980 %	2.011.960,38	3,65
<i>Schuldverschreibungen der Kreditwirtschaft</i>						<i>30.001.397,82</i>	<i>54,36</i>
7,125% Aareal Bank Capital Fdg Tr.EO-Pref.Sec. 2001(Und.) XS0138973010	EUR	40.000	0	0	26,1200 %	1.044.800,00	1,89
2,088% Capital Funding FLR-Notes 2002(unb.) DE0007070088	EUR	5.000.000	0	0	73,6837 %	3.684.183,60	6,68
6,460% Commerzbank Nachr.MTN 2002(22) XS0149398579	EUR	2.000.000	0	0	115,0362 %	2.300.724,22	4,17
1,750% Dt. Bank Cap.Fin.Tr.I EO-FLR Pr.Sec.2005(Und.) DE000A0E5JD4	EUR	1.000.000	0	0	76,3000 %	763.000,00	1,38
5,983% Deutsche Postb.Fdg Trust IV EO-FLR 2007(17/Und) XS0307741917	EUR	2.500.000	500.000	0	97,8440 %	2.446.100,00	4,43

MPF Herkules

Gattungsbezeichnung	Stück, Anteile bzw. Währung	Bestand 31.12.2016	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
5,625% Fürstenberg Capital II Subord.-Notes 2005(unb.) DE000A0EUBN9	EUR	5.500.000	0	0	65,5750 %	3.606.625,00	6,54
0,528% HSH Nordbank Nachr. FLR-IHS 2007(17) DE000HSH2H15	EUR	3.000.000	0	0	99,1185 %	2.973.555,00	5,39
5,864% Hypo Real Estate I. Tr. I EO-FLR 2007(17) XS0303478118	EUR	1.000.000	1.000.000	0	98,1200 %	981.200,00	1,78
5,750% Main Capital Fdg II EO-Cap.Sec. 2006(Und.) DE000A0G18M4	EUR	3.000.000	0	0	102,5550 %	3.076.650,00	5,57
5,500% Main Capital Funding EO-Cap. Sec. 2005(Und.) DE000A0E4657	EUR	9.000.000	0	0	101,3840 %	9.124.560,00	16,53
Andere Schuldverschreibungen / Industrie						4.079.182,60	7,39
3,750% Volkswagen Intl Finance EO-FLR Notes 2014(21/Und.) XS1048428012	EUR	3.000.000	0	0	101,9213 %	3.057.640,05	5,54
4,625% Volkswagen Intl Finance EO-FLR Notes 2014(26/Und.) XS1048428442	EUR	1.000.000	0	0	102,1543 %	1.021.542,55	1,85
Zertifikate						1.117.945,00	2,02
Indexzertifikate						558.750,00	1,01
Schweiz						558.750,00	1,01
Notenstein La Roche Privatbank Expr. Z17.12.20 Basket CH0242066329	Stück	5.000	0	0	111,7500 EUR	558.750,00	1,01
Zertifikate auf Rohstoffe						559.195,00	1,01
Jersey						559.195,00	1,01
DB ETC P GOLD EUR H60 DE000A1EK0G3	Stück	6.500	0	0	86,0300 EUR	559.195,00	1,01

MPF Herkules

Gattungsbezeichnung	Stück, Anteile bzw. Währung	Bestand 31.12.2016	im Berichtszeitraum		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
			Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge			
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere						3.563.940,00	6,46
Zertifikate						3.563.940,00	6,46
Indexzertifikate						3.563.940,00	6,46
Deutschland						524.340,00	0,95
Société Générale Effekt. Expr.Zt. 18.10.21 ESTX 50 DE000SG78RT4	Stück	6.000	0	0	87,3900 EUR	524.340,00	0,95
Schweiz						3.039.600,00	5,51
Credit Suisse (Ldn Br.) Express Z 12.02.24 ESTX 50 DE000CS8A3C4	Stück	30.000	0	0	101,3200 EUR	3.039.600,00	5,51
Investmentfonds						11.380.663,21	20,62
Aktienfonds						7.974.277,21	14,45
Gruppenfremde Aktienfonds						7.974.277,21	14,45
Aberdeen Global-Emerg.Mkts Eq. I2 USD LU0231479717	Anteile	22.000	0	0	63,1272 USD	1.319.774,21	2,39
AGIF-Allianz Hi.Div.As.Pac.Eq. I (EUR) LU1211504847	Anteile	7.200	0	0	146,6900 EUR	1.056.168,00	1,91
Allianz Nebenwerte Deu. I (EUR) DE0009797530	Anteile	700	0	0	1.646,8400 EUR	1.152.788,00	2,09
CS I.F.11-C.SL S.&M.C.Ger.Eq.Fd IB EUR LU0108803940	Anteile	450	0	0	2.791,8400 EUR	1.256.328,00	2,28
FPM Funds-Stockp.Germ.Sm./M.C. I LU1011670111	Anteile	1.400	0	0	1.286,2600 EUR	1.800.764,00	3,26
M&G Global Emerg. Mkts Cl. C acc.(EUR) GB00B3FFY088	Anteile	50.000	0	0	27,7691 EUR	1.388.455,00	2,52

MPF Herkules

Gattungsbezeichnung	Stück, Anteile bzw. Währung	Bestand 31.12.2016	im Berichtszeitraum		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
			Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge			
Gemischte Fonds						985.850,00	1,79
Gruppenfremde Gemischte Fonds						985.850,00	1,79
CHOM CAPITAL Act.Ret.Europe UI I DE000A1JCWS9	Anteile	5.000	5.000	0	197,1700 EUR	985.850,00	1,79
Indexfonds						2.420.536,00	4,38
Gruppenfremde Indexfonds						2.420.536,00	4,38
DB Platinum IV - Platow I 1C LU1239760371	Anteile	800	0	0	3.025,6700 EUR	2.420.536,00	4,38
Summe Wertpapiervermögen						53.053.179,01	96,13

MPF Herkules

Gattungsbezeichnung	Stück, Anteile bzw. Währung	Bestand 31.12.2016	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Forderungen						872.384,78	1,58
Zinsansprüche	EUR	872.384,78				872.384,78	1,58
Bankguthaben						1.288.495,99	2,34
Bankguthaben	EUR	1.288.495,99				1.288.495,99	2,34
Verbindlichkeiten						-27.705,28	-0,05
Sonstige Verbindlichkeiten						-27.705,28	-0,05
Beratervergütung	EUR	-9.875,94				-9.875,94	-0,02
Verwahrstellenvergütung	EUR	-1.785,49				-1.785,49	0,00
Verwaltungsvergütung	EUR	-12.793,85				-12.793,85	-0,02
Prüfungskosten	EUR	-3.000,00				-3.000,00	-0,01
Veröffentlichungskosten	EUR	-250,00				-250,00	0,00
Fondsvermögen					EUR	55.186.354,50	100,00*
Anteilwert					EUR	135,74	
Umlaufende Anteile					Stück	406,571	

* 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)					
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere					
Zertifikate					
Société Générale Effekt.Best Exp.Zt.09.08.21ESTX50 DE000SG7J3E3	Stück	0	20.000		
					Volumen in 1.000
Umsätze in Derivaten					
(In Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte. Bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe.)					
Optionsrechte					
Optionsrechte auf Aktienindex-Derivate					
Optionsrechte auf Aktienindizes					
Verkaufte Verkaufsoption	EUR				204
(Basiswert[e]: ESTX 50 Index (Price) (EUR))					

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben nach der Derivateverordnung

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)	96,13
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)	0,00

Sonstige Angaben

Anteilwert	EUR	135.74
Umlaufende Anteile	Stück	406.571

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	30.12.2016	1,63 %			
Renten						
	Inland	29.12.2016	11,93 %	14,50 %		
	Europa	29.12.2016	25,70 %	5,57 %		
	Nordamerika	29.12.2016	7,70 %			
Investmentanteile						
	Inland	29.12.2016				3,88 %
	Europa	29.12.2016				16,74 %
Zertifikate						
	Inland	30.12.2016	0,95 %			
	Europa	30.12.2016	7,53 %			
Übriges Vermögen						
		30.12.2016				3,87 %
			55,44 %	20,07 %		24,49 %

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	30.12.2016				
US-Dollar	(USD)	1,052300	=	1 EUR		

Frankfurt am Main, den 31. Dezember 2016

BNY Mellon Service
Kapitalanlage-Gesellschaft mbH
Frankfurt am Main

(Geschäftsführung)