

**MPF Abakus
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 Abakus – ISIN DE000A0ORKY60, 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	35.875.721,59	100,06
1. Anleihen	20.818.079,54	58,06
Verzinsliche Wertpapiere	20.818.079,54	58,06
2. Zertifikate	6.553.780,00	18,28
3. Investmentfonds	7.674.860,00	21,40
4. Forderungen	288.742,01	0,81
5. Bankguthaben	540.260,04	1,51
II. Verbindlichkeiten	-19.801,85	-0,06
Sonstige Verbindlichkeiten	-19.801,85	-0,06
III. Fondsvermögen	35.855.919,74	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						23.180.639,54	64,65
Verzinsliche Wertpapiere						20.166.664,54	56,24
EUR						20.166.664,54	56,24
<i>Öffentliche Anleihen</i>						<i>5.513.085,00</i>	<i>15,38</i>
0,250% Bundesrep.Deutschland Bundesobl. 2015(20) DE0001141729	EUR	5.000.000	5.000.000	0	103,6058 %	5.180.287,50	14,45
2,875% Portugal, Republik EO-Obr. 2015(25) PTOTEKOE0011	EUR	350.000	0	150.000	95,0850 %	332.797,50	0,93
<i>Schuldverschreibungen der Kreditwirtschaft</i>						<i>10.085.225,86</i>	<i>28,12</i>
7,125% Aareal Bank Capital Fdg Tr.EO-Pref.Sec. 2001(Und.) XS0138973010	EUR	25.000	0	0	26,1200 %	653.000,00	1,82
2,088% Capital Funding FLR-Notes 2002(unb.) DE0007070088	EUR	950.000	0	0	73,6837 %	699.994,88	1,95
6,635% Commerzbank Nachr. MT 2008(18) XS0369543706	EUR	1.000.000	0	0	105,2350 %	1.052.350,00	2,93
3,750% Dt. Postbank Fdg Tr.II EO-FLR Pref.Sec. 2004(Und.) DE000A0DHUM0	EUR	1.100.000	0	0	98,5500 %	1.084.050,00	3,02
5,983% Deutsche Postb.Fdg Trust IV EO-FLR 2007(17/Und) XS0307741917	EUR	500.000	0	0	97,8440 %	489.220,00	1,36
5,625% Fürstenberg Capital II Subord.-Notes 2005(unb.) DE000A0EUBN9	EUR	600.000	0	0	65,5750 %	393.450,00	1,10
0,488% HSH Nordbank NACH.FLR-IHS 2007(17) DE000HSH2H23	EUR	300.000	0	0	99,0520 %	297.156,00	0,83
5,864% Hypo Real Estate I. Tr. I EO-FLR 2007(17) XS0303478118	EUR	500.000	500.000	0	98,1200 %	490.600,00	1,37

Gattungsbezeichnung	Stück, Anteile bzw. Währung	Bestand 31.12.2016	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
5,875% Landesbank Berlin Subordinated MTN-IHS 2009(19) XS0468940068	EUR	750.000	0	0	112,8833 %	846.624,98	2,36
5,750% Main Capital Fdg II EO-Cap.Sec. 2006(Und.) DE000A0G18M4	EUR	2.000.000	0	0	102,5550 %	2.051.100,00	5,72
5,500% Main Capital Funding EO-Cap. Sec. 2005(Und.) DE000A0E4657	EUR	2.000.000	0	0	101,3840 %	2.027.680,00	5,66
Andere Schuldverschreibungen / Industrie						4.568.353,68	12,74
1,300% AT & T EO-Notes 2015(23) XS1196373507	EUR	1.000.000	0	0	101,9404 %	1.019.403,80	2,84
3,000% Bayer FLR-Sub.Anl. 2014(20/75) DE000A11QR65	EUR	250.000	0	0	101,7391 %	254.347,81	0,71
2,375% Bayer FLR-Sub.Anl. 2015(22/75) DE000A14J611	EUR	450.000	450.000	0	95,6067 %	430.229,99	1,20
0,375% Evonik Finance EO-MTN 2016(24) DE000A185QA5	EUR	200.000	200.000	0	96,2705 %	192.541,08	0,54
0,500% Intl Business Machines EO-Notes 2016(21) XS1375841159	EUR	500.000	0	0	101,7477 %	508.738,63	1,42
3,000% K+S Anleihe 2012(22) DE000A1PGZ82	EUR	400.000	0	0	105,2863 %	421.145,04	1,17
3,750% Volkswagen Intl Finance EO-FLR Notes 2014(21/Und.) XS1048428012	EUR	1.000.000	0	0	101,9213 %	1.019.213,35	2,84
4,625% Volkswagen Intl Finance EO-FLR Notes 2014(26/Und.) XS1048428442	EUR	450.000	0	0	102,1543 %	459.694,15	1,28
2,000% Volkswagen Intl Finance EO-MTN 2013(20) XS0873793375	EUR	250.000	250.000	0	105,2159 %	263.039,83	0,73
Zertifikate						3.013.975,00	8,41
Zertifikate auf Rohstoffe						3.013.975,00	8,41
Jersey						3.013.975,00	8,41
DB ETC P GOLD EUR H60 DE000A1EK0G3	Stück	22.500	0	0	86,0300 EUR	1.935.675,00	5,40
DB ETC ETC Z 27.08.60 Gold DE000A1E0HR8	Stück	10.000	0	0	107,8300 EUR	1.078.300,00	3,01

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						4.191.220,00	11,69
Verzinsliche Wertpapiere						651.415,00	1,82
EUR						651.415,00	1,82
Schuldverschreibungen der Kreditwirtschaft						651.415,00	1,82
0,000% Credit Suisse (Ldn Br.) EO-Anl. 2016(22) DE000CS8BF72	EUR	4.000	4.000	0	100,7600 %	403.040,00	1,12
0,000% Notenstein Finance (Guernsey) EO-Anl. 2016(22) CH0340814364	EUR	250.000	250.000	0	99,3500 %	248.375,00	0,69
Zertifikate						3.539.805,00	9,87
Indexzertifikate						3.039.105,00	8,47
Deutschland						1.065.975,00	2,97
Société Générale Effekten Express ZT. 15.03.22 Basket DE000SE02VA1	Stück	7.500	0	0	106,3300 EUR	797.475,00	2,22
UniCredit Bank HVB Best Exp. 21.12.21 ESTX 50 DE000HVB1XX5	Stück	3.000	0	0	89,5000 EUR	268.500,00	0,75
Guernsey						1.351.305,00	3,77
Notenstein Finance (Guernsey) EXPRESS Z.05.07.22 ESTX Banks CH0283714779	Stück	5.000	0	0	93,5800 EUR	467.900,00	1,31
Notenstein Finance (Guernsey) EXPRESS Z.25.01.22 Basket CH0274762092	Stück	3.000	0	0	105,4300 EUR	316.290,00	0,88
Notenstein Finance (Guernsey) EO-Anl. 16(22)ESTX 50 CH0315255478	Stück	250.000	0	0	103,0300 %	257.575,00	0,72
Notenstein Finance (Guernsey) EO-Anl. 16(22) Eur.600 Oil&Gas CH0303242769	Stück	300.000	0	0	103,1800 %	309.540,00	0,86
Schweiz						621.825,00	1,73
3,000% Credit Suisse(Ldn Br) EURO STOXX Expr.-Zt. 23.6.22 DE000CS8BDK9	Stück	2.500	0	0	101,9400 %	254.850,00	0,71

Gattungsbezeichnung	Stück, Anteile bzw. Währung	Bestand 31.12.2016	Käufe/ Zugänge		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
			im Berichtszeitraum				
Credit Suisse (London Branch) EXP. Z06.12.23 ESTX 50 DE000CS8A125	Stück	3.500	0	0	104,8500 EUR	366.975,00	1,02
Andere Zertifikate						500.700,00	1,40
<i>Luxemburg</i>						<i>500.700,00</i>	<i>1,40</i>
SG Issuer EO-Index Linked MTN 2016(22) DE000SG6DAL9	Stück	500.000	0	0	100,1400 %	500.700,00	1,40
Investmentfonds						7.674.860,00	21,40
Aktienfonds						1.133.010,00	3,16
Gruppenfremde Aktienfonds						1.133.010,00	3,16
MPF Aktien Strat.Total Return LU0330557819	Anteile	9.000	0	0	125,8900 EUR	1.133.010,00	3,16
Rentenfonds						390.180,00	1,09
Gruppenfremde Rentenfonds						390.180,00	1,09
XAIA Credit Basis I EUR LU0418282934	Anteile	350	0	0	1.114,8000 EUR	390.180,00	1,09
Gemischte Fonds						5.576.050,00	15,55
Gruppenfremde Gemischte Fonds						5.576.050,00	15,55
MPF Renten Strategie Chance LU0330568691	Anteile	17.500	0	0	115,3600 EUR	2.018.800,00	5,63
MPF Renten Strategie Plus LU0330572701	Anteile	27.000	0	0	131,7500 EUR	3.557.250,00	9,92
Immobilienfonds						575.620,00	1,60
Gruppenfremde Immobilienfonds						575.620,00	1,60
AXA Immoselect DE0009846451	Anteile	9.000	0	0	5,3400 EUR	48.060,00	0,13
CS EUROREAL DE0009805002	Anteile	12.000	0	0	20,9200 EUR	251.040,00	0,70

MPF Abakus

Gattungsbezeichnung	Stück, Anteile bzw. Währung	Bestand 31.12.2016	Käufe/ Zugänge		Verkäufe/ Abgänge		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
			im Berichtszeitraum						
KanAm grundinvest Fonds DE0006791809	Anteile	6.000	0	0	0	0	19,0900 EUR	114.540,00	0,32
SEB ImmoInvest DE0009802306	Anteile	7.000	0	0	0	0	23,1400 EUR	161.980,00	0,45
Summe Wertpapiervermögen								35.046.719,54	97,74

Gattungsbezeichnung	Stück, Anteile bzw. Währung	Bestand 31.12.2016	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Forderungen						288.742,01	0,81
Zinsansprüche	EUR	288.742,01				288.742,01	0,81
Bankguthaben						540.260,04	1,51
Bankguthaben	EUR	540.260,04				540.260,04	1,51
Verbindlichkeiten						-19.801,85	-0,06
Sonstige Verbindlichkeiten						-19.801,85	-0,06
Beratervergütung	EUR	-7.030,96				-7.030,96	-0,02
Verwahrstellenvergütung	EUR	-1.171,62				-1.171,62	0,00
Verwaltungsvergütung	EUR	-8.349,27				-8.349,27	-0,03
Prüfungskosten	EUR	-3.000,00				-3.000,00	-0,01
Veröffentlichungskosten	EUR	-250,00				-250,00	0,00
Fondsvermögen					EUR	35.855.919,74	100,00*
Anteilwert					EUR	129,04	
Umlaufende Anteile					Stück	277,870	

*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)						
Börsengehandelte Wertpapiere						
Verzinsliche Wertpapiere						
0,638% Commerzbank Nachr.FLR-MTN 2006(16) DE000CB07899	EUR	0	600.000			
0,516% Dexia Kommunalbank Deutschl. FLR-ÖPF 2005(20) DE000DXA0M06	EUR	0	1.000.000			
4,668% ProSecure Funding EO-Securities 2006(16) XS0249466730	EUR	0	2.500.000			
3,125% ThyssenKrupp MTN 2014(19) DE000A1R0410	EUR	0	200.000			
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere						
Verzinsliche Wertpapiere						
0,000% Notenstein Finance EO-Anl. 2016(22) CH0326739502	EUR	0	500.000			

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben nach der Derivateverordnung

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)	97,74
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)	0,00

Sonstige Angaben

Anteilwert	EUR	129,04
Umlaufende Anteile	Stück	277.870

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
Renten						
	Inland	29.12.2016	24,76 %	1,95 %		
	Europa	29.12.2016	15,17 %	5,72 %		
	Nordamerika	29.12.2016	10,46 %			
Investmentanteile						
	Inland	29.12.2016				1,60 %
	Europa	29.12.2016				19,80 %
Zertifikate						
	Inland	30.12.2016	2,97 %			
	Europa	30.12.2016	15,31 %			
Übriges Vermögen						
		30.12.2016				2,26 %
			68,67 %	7,67 %		23,66 %

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.

Frankfurt am Main, den 31. Dezember 2016

BNY Mellon Service
Kapitalanlage-Gesellschaft mbH
Frankfurt am Main

(Geschäftsführung)