

MPF Dynamic Halbjahresbericht

30.04.2014

Zusammengefasste Vermögensaufstellung

Aufteilung des Fondsvermögens nach Assetklassen

Assetklasse	Betrag	Anteil in %
Verzinsliche Wertpapiere	8.059.779,28	86,78
Derivate	85.000,00	0,92
Futures	85.000,00	0,92
Liquiditätsanlagen	1.156.474,54	12,45
Bankguthaben	1.156.474,54	12,45
Sonstige Vermögensgegenstände	849,78	0,01
Sonstige Verbindlichkeiten	-14.880,88	-0,16
Fondsvermögen	9.287.222,72	100,00

Vermögensaufstellung

30.04.2014

Gattungsbezeichnung	Stück, Anteile bzw. Währung	Bestand 30.04.2014	Käufe/ Zugänge		Verkäufe/ Abgänge		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
			im Berichtszeitraum						
Börsengehandelte Wertpapiere								8.059.779,28	86,78
Verzinsliche Wertpapiere								8.059.779,28	86,78
EUR								8.059.779,28	86,78
<i>Öffentliche Anleihen</i>								<i>8.059.779,28</i>	<i>86,78</i>
0,277% Kreditanst.f.Wiederaufbau FLR-MTN 2009(14) DE000A0Z2KR4	EUR	2.000.000	0	0	100,0013	%	2.000.026,70	21,53	
0,413% L-Bank Bad.-Württ.-Förderbank FLR-IHS 2010(15) DE000A0Z13U8	EUR	2.000.000	2.000.000	0	99,9147	%	1.998.294,50	21,52	
0,132% Saarland FLR-Landesobl. 2011(15) DE000A1H3K64	EUR	3.650.000	1.650.000	0	100,2955	%	3.660.786,48	39,42	
0,146% Schleswig-Holstein, Land FLR-Landesschatz. 2011(15) DE000SHFM048	EUR	400.000	400.000	0	100,1679	%	400.671,60	4,31	
Summe Wertpapiervermögen								8.059.779,28	86,78

Gattungsbezeichnung	Stück, Anteile bzw. Währung	Bestand 30.04.2014	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						85.000,00	0,92
Aktienindex-Terminkontrakte						85.000,00	0,92
FUTURE ESTX 50 Index 06.14	Anzahl	100			3.151,0000 EUR	85.000,00	0,92
Liquiditätsanlagen						1.156.474,54	12,45
Bankguthaben						1.156.474,54	12,45
Bankguthaben	EUR	1.156.474,54				1.156.474,54	12,45
Sonstige Vermögensgegenstände						849,78	0,01
Zinsansprüche	EUR	849,78				849,78	0,01
Sonstige Verbindlichkeiten						-14.880,88	-0,16
Beratervergütung	EUR	-9.393,90				-9.393,90	-0,11
Depotbankvergütung	EUR	-835,62				-835,62	-0,01
Verwaltungsvergütung	EUR	-2.179,36				-2.179,36	-0,02
Prüfungskosten	EUR	-2.222,00				-2.222,00	-0,02
Veröffentlichungskosten	EUR	-250,00				-250,00	0,00
Fondsvermögen						EUR 9.287.222,72	100,00*
Anteilwert						EUR 94,58	
Umlaufende Anteile						Stück 98,190	
Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)							86,78
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)							0,92

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

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

Die Vermögensgegenstände des Sondervermögens sind auf der Grundlage der Investment-Rechnungslegungs- und Bewertungsverordnung mit nachstehenden Kursen/Marktsätzen bewertet:

Wertpapierart	Region	Bewertungsdatum	§23 Bewertung mit handelbaren Kursen	§24 Bewertung mit Bewertungsmodellen	§25 Besonderheiten bei der Bewertung unternehmerischer Beteiligungen	§26 Besonderheiten bei Investmentanteilen, Bankguthaben und Verbindlichkeiten
Renten						
	Inland	29.04.2014	47,36 %	39,42 %		
Derivate - Futures						
	Europa	29.04.2014	0,92 %			
Liquiditätsanlagen						
		30.04.2014				12,30 %
			48,28 %	39,42 %		12,30 %

Die prozentualen Angaben beziehen sich auf den Anteil der einzelnen Vermögensgegenstände am Fondsvermögen.

Die Bewertung erfolgt durch die Depotbank unter Mitwirkung der Kapitalanlagegesellschaft. 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

Terminbörse

Eurex - Frankfurt/Zürich

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)				
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere				
Verzinsliche Wertpapiere				
0,125% Europ.Fin.Stab.Facility EO- MTN 2012(13) EU000A1G0A32	EUR	0	2.000.000	
0,224% FMS Wertmanagement FLR-Inh.-Schv. 2011(14) DE000A1H3DC0	EUR	0	2.000.000	
				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			30.897
(Basiswert[e]: DAX Performance-Index, ESTX 50 Index)				
Optionsrechte				
Optionsrechte auf Aktienindex-Derivate				
Optionsrechte auf Aktienindizes				
Verkaufte Kaufoption	EUR			57
(Basiswert[e]: DAX Performance-Index)				

Gattungsbezeichnung	Stück, Anteile bzw. Währung	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge							
		im Berichtszeitraum								
Verkaufte Verkaufsoption	EUR									63
(Basiswert[e]: DAX Performance-Index, ESTX 50 Index)										

Frankfurt am Main, den 30. April 2014

BNY Mellon Service
Kapitalanlage-Gesellschaft mbH
Frankfurt am Main

(Geschäftsführung)