

**MPF Hera
Halbjahresbericht**

30.06.2016

Vermögensübersicht

Aufteilung des Fondsvermögens nach Assetklassen

Assetklasse	Betrag in CAD	Anteil in %
I. Vermögensgegenstände	74.300.015,75	100,07
1. Aktien	3.683.446,61	4,96
2. Anleihen	5.183.572,49	6,98
Verzinsliche Wertpapiere	5.183.572,49	6,98
3. Zertifikate	61.969.166,05	83,46
4. Forderungen	532.792,06	0,72
5. Bankguthaben	2.931.038,54	3,95
II. Verbindlichkeiten	-49.512,08	-0,07
Sonstige Verbindlichkeiten	-49.512,08	-0,07
III. Fondsvermögen	74.250.503,67	100,00

Vermögensaufstellung

30.06.2016

Gattungsbezeichnung	Stück, Anteile bzw. Währung	Bestand 30.06.2016	Käufe/ Zugänge		Verkäufe/ Abgänge		Kurs	Kurswert in CAD	% des Fonds- vermögens
			im Berichtszeitraum						
Börsengehandelte Wertpapiere								30.255.667,84	40,75
Aktien								3.683.446,61	4,96
USA								3.683.446,61	4,96
<i>Versicherungen</i>								<i>3.683.446,61</i>	<i>4,96</i>
Berkshire Hathaway B US0846707026	Stück	20.000	0	0	142,1200	USD		3.683.446,61	4,96
Verzinsliche Wertpapiere								5.183.572,49	6,98
USD								5.183.572,49	6,98
<i>Schuldverschreibungen der Kreditwirtschaft</i>								<i>5.183.572,49</i>	<i>6,98</i>
10,250% Fürstenberg Cap.I.SarI&Cie.DL-FLR Nts 2009(15/UND) XS0456513711	USD	4.000.000	0	0	100,0000	%		5.183.572,49	6,98
Zertifikate								21.388.648,74	28,81
Indexzertifikate								20.114.048,74	27,09
<i>Deutschland</i>								<i>12.446.048,74</i>	<i>16,76</i>
Deutsche Bank London Br. EXPR.Z. 19.06.24 ESTX 50 DE00DX6QLL4	Stück	6.000	0	0	946,7150	USD		7.361.048,74	9,91
Société Générale Effekten Express ZT. 14.09.20 DE00SG49GT8	Stück	75.000	0	0	67,8000	CAD		5.085.000,00	6,85
<i>Schweiz</i>								<i>7.668.000,00</i>	<i>10,33</i>
Notenstein La Roche Privatbank Expr. Z17.12.20 Basket CH0242066311	Stück	75.000	0	0	102,2400	CAD		7.668.000,00	10,33

Gattungsbezeichnung	Stück, Anteile bzw. Währung	Bestand 30.06.2016	im Berichtszeitraum		Kurs	Kurswert in CAD	% des Fonds- vermögens
			Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge			
Zertifikate auf Aktien						1.274.600,00	1,72
<i>Deutschland</i>						<i>1.274.600,00</i>	<i>1,72</i>
Société Générale Effekten Express Z. 29.12.20 DE000SG5VYR0	Stück	20.000	0	0	63,7300 CAD	1.274.600,00	1,72
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere						40.580.517,31	54,65
Zertifikate						40.580.517,31	54,65
Indezertifikate						34.048.568,03	45,86
<i>Deutschland</i>						<i>14.655.125,73</i>	<i>19,74</i>
Société Générale Effekten Express ZT. 19.07.21 DE000SG64309	Stück	30.000	0	0	104,8900 USD	4.077.786,89	5,49
UniCredit Bank HVB EXP.Z. 18.08.23 ESTX50 DE000HVB1VM2	Stück	30.000	0	0	101,5400 USD	3.947.549,63	5,32
UniCredit Bank HVB EXPRESS PL.Z04.03.22 BSKT DE000HVB13P5	Stück	50.000	50.000	0	102,3200 USD	6.629.789,21	8,93
<i>Guernsey</i>						<i>3.569.926,37</i>	<i>4,81</i>
Notenstein Finance Expr. Z. 08.07.22 ESTX Banks CH0283714803	Stück	40.000	0	0	68,8700 USD	3.569.926,37	4,81
<i>Schweiz</i>						<i>15.823.515,93</i>	<i>21,31</i>
Credit Suisse (London Branch) CSEXPZER 04.01.24 DE000CS8A1W6	Stück	50.000	0	0	91,9700 USD	5.959.164,52	8,03
Credit Suisse (London Branch) EXP. Z08.01.24 ESTX 50 DE000CS8A117	Stück	24.000	0	0	94,1800 USD	2.929.133,14	3,94
Credit Suisse (London Branch) EXP. Z09.01.24 ESTX Banks DE000CS8A2A0	Stück	40.000	0	0	58,2800 USD	3.020.986,05	4,07
Credit Suisse (London Branch) EXP. Z20.09.23 ESTX 50 DE000CS8AYM3	Stück	33.000	0	0	91,5300 USD	3.914.232,22	5,27

Gattungsbezeichnung	Stück, Anteile bzw. Währung	Bestand 30.06.2016	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in CAD	% des Fonds- vermögens
			im Berichtszeitraum				
Zertifikate auf Fonds						6.531.949,28	8,79
<i>Deutschland</i>						<i>6.531.949,28</i>	<i>8,79</i>
Société Générale Effekten ST.EXP.A.Z 19.07.21 DE000SG643Z7	Stück	50.000	0	0	100,8100 USD	6.531.949,28	8,79
Summe Wertpapiervermögen						70.836.185,15	95,40

Gattungsbezeichnung	Stück, Anteile bzw. Währung	Bestand 30.06.2016	im Berichtszeitraum		Kurs	Kurswert in CAD	% des Fonds- vermögens
			Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge			
Forderungen						532.792,06	0,72
Zinsansprüche	CAD	532.792,06				532.792,06	0,72
Bankguthaben						2.931.038,54	3,95
Bankguthaben	CAD	18.835,81				18.835,81	0,03
Bankguthaben	EUR	81.779,11				117.798,72	0,16
Bankguthaben	USD	2.156.353,76				2.794.404,01	3,76
Verbindlichkeiten						-49.512,08	-0,07
Sonstige Verbindlichkeiten						-49.512,08	-0,07
Beratervergütung	EUR	-16.185,78				-23.314,81	-0,03
Verwahrstellenvergütung	EUR	-1.812,96				-2.611,48	0,00
Verwaltungsvergütung	EUR	-12.467,42				-17.958,69	-0,03
Prüfungskosten	EUR	-3.404,04				-4.903,35	-0,01
Veröffentlichungskosten	EUR	-502,45				-723,75	0,00
Fondsvermögen						CAD 74.250.503,67	100,00*
Anteilwert					CAD	977,24	
Umlaufende Anteile					Stück	75,980	

* 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						
Credit Suisse (London Branch) EXP. Z04.01.23 ESTX 50 DE000CS8AQ05	Stück	0	25.000			
Credit Suisse (London Branch) Express 1 Z04.01.21 ESTX 50 DE000CS8AQZ1	Stück	0	30.000			

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV**Angaben nach der Derivateverordnung**

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)	95,40
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)	0,00

Sonstige Angaben

Anteilwert					CAD	977,24
Umlaufende Anteile					Stück	75.980

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						
	Nordamerika	29.06.2016	4,96 %			
Renten						
	Europa	29.06.2016	6,98 %			
Zertifikate						
	Inland	30.06.2016	47,01 %			
	Europa	30.06.2016	36,45 %			
Übriges Vermögen						
		30.06.2016				4,60 %
			95,40 %			4,60 %

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

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	30.06.2016				
Euro	(EUR)	0,694227	=	1 CAD		
US-Dollar	(USD)	0,771669	=	1 CAD		

Frankfurt am Main, den 30. Juni 2016

BNY Mellon Service
Kapitalanlage-Gesellschaft mbH
Frankfurt am Main

(Geschäftsführung)