



MPF ARES

Halbjahresbericht für die Zeit vom:
01.11.2022 – 30.04.2023

Herausgeber dieses Jahresberichtes:

BANTLEON Invest AG

An der Börse 7, 30159 Hannover

Postanschrift: Postfach 4505

30045 Hannover

Telefon +49 511 12354-0; Telefax: +49 511 12354-333

<https://www.bantleon-invest-ag.de/>

Hinweis:

Allein verbindliche Grundlage für den Erwerb von Fondsanteilen der hier aufgeführten Fonds ist der jeweils gültige Verkaufsprospekt mit den Vertragsbedingungen.

Halbjahresbericht für MPF Ares

Vermögensübersicht zum 30.04.2024

Anlageschwerpunkte	Tageswert in EUR	% Anteil am Fondsvermögen
I. Vermögensgegenstände	31.363.776,19	100,06
1. Verzinsliche Wertpapiere	4.773.397,10	15,23
2. Zertifikate	23.045.924,50	73,53
3. Investmentanteile	3.020.733,00	9,64
4. Forderungen	125.685,06	0,40
5. Bankguthaben	398.036,53	1,27
II. Verbindlichkeiten	-19.962,63	-0,06
III. Fondsvermögen	31.343.813,56	100,00

Halbjahresbericht für MPF Ares

Vermögensaufstellung zum 30.04.2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.04.2024	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Bestandspositionen									
							EUR	9.090.382,10	29,00
Börsengehandelte Wertpapiere									
Verzinsliche Wertpapiere									
3,1250 % Bayer AG FLR-Sub.Anl.v.2019(2027/2079)	XS2077670342		EUR	1.000	0	0 %	88,4867	884.867,09	2,82
6,6250 % Bayer AG FLR-Sub.Anl.v.2023(2028/2083)	XS2684826014		EUR	1.000	0	0 %	99,9005	999.005,21	3,19
1,5000 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.2014 (2024)	DE0001102358		EUR	2.000	2.000	0 %	99,9227	1.998.454,28	6,38
4,6790 % Deutsche Pfandbriefbank AG Nachr.FLR-MTN R35281 17(22/27)	XS1637926137		EUR	1.500	0	0 %	59,4047	891.070,52	2,84
Zertifikate									
Bqe International à Luxembourg EXPRESS Z.10.12.27 Basket	CH0585068999		STK	1.500	0	0 EUR	1.131,5400	1.697.310,00	5,42
Bqe International à Luxembourg EXPRESS Z.15.05.28 BSKT	CH1143780174		EUR	2.250	0	0 %	116,4300	2.619.675,00	8,36
							EUR	18.728.939,50	59,75
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere									
Zertifikate									
Credit Suisse AG EXPR. Z16.08.29 SX5E	DE000CS8DSE6		STK	16.000	0	0 EUR	107,8000	1.724.800,00	5,50
Credit Suisse AG EXPR. Z23.07.29 SX5E	DE000CS8DR68		STK	10.000	0	0 EUR	109,9100	1.099.100,00	3,51
Deutsche Bank AG EXPR.AUTOC.NTS05.09.30 BSKT	XS0461577883		EUR	2.500	2.500	0 %	99,4100	2.485.250,00	7,93
J.P. Morgan Struct. Prod. B.V. Autoc.Z 11.06.29 Basket	XS2487079506		STK	1.500	0	0 EUR	1.192,6700	1.789.005,00	5,71
J.P. Morgan Struct. Prod. B.V. AUTOC.Z 13.05.30 Basket	XS2487075348		STK	1.000	1.000	0 EUR	1.049,8100	1.049.810,00	3,35
JPMorgan Chase Finl Co. LLC AUTOC.Z 24.07.29 Basket	XS2487079175		STK	1.000	0	0 EUR	1.086,2600	1.086.260,00	3,47
Landesbank Baden-Württemberg DISC.Z 03.01.25 ESTX50 4900	DE000LB4TQP9		STK	54.600	54.600	0 EUR	45,9900	2.511.054,00	8,01
Nordea Bank Abp NOTES 22.11.27 Index-Basket	XS2334471880		EUR	1.000	0	0 %	112,7250	1.127.250,00	3,60
Nordea Bank Abp NOTES 27.01.30 Index-Basket	XS2654692727		EUR	1.000	0	0 %	105,8600	1.058.600,00	3,38
Société Générale Effekten GmbH DISC.Z 31.12.24 ESTX50 5000	DE000SU7R673		STK	44.000	44.000	0 EUR	46,6400	2.052.160,00	6,55
UniCredit Bank GmbH HVB EXP.PL 20.01.28 Basket	DE000HVB5P92		STK	500	0	0 EUR	1.085,6000	542.800,00	1,73
UniCredit Bank GmbH HVB EXP.PL 213.03.30 Basket	DE000HVB8875		STK	550	0	0 EUR	1.035,9900	569.794,50	1,82
UniCredit Bank GmbH HVB EXP.PL 217.01.30 Basket	DE000HVB81V0		STK	600	0	0 EUR	1.063,9100	638.346,00	2,04
UniCredit Bank GmbH HVB Expr.Z01.08.30 BSKT	DE000HVB8LU1		STK	1.000	1.000	0 EUR	994,7100	994.710,00	3,17
							EUR	3.020.733,00	9,64
Investmentanteile									
KAG - eigene Investmentanteile									
MPF Odin Inhaber-Anteile	DE000A2DJU20		ANT	24.300	0	8.200 EUR	124,3100	3.020.733,00	9,64
							EUR	30.840.054,60	98,39
Summe Wertpapiervermögen									

Halbjahresbericht für MPF Ares

Vermögensaufstellung zum 30.04.2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.04.2024	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrument und Geldmarktfonds							EUR	398.036,53	1,27
Bankguthaben							EUR	398.036,53	1,27
EUR - Guthaben bei:									
M.M.Warburg & CO [AG & Co.] KGaA			EUR	398.036,53		%	100,0000	398.036,53	1,27
Sonstige Vermögensgegenstände							EUR	125.685,06	0,40
Zinsansprüche			EUR	125.685,06				125.685,06	0,40
Sonstige Verbindlichkeiten							EUR	-19.962,63	-0,06
Verwaltungsvergütung			EUR	-4.469,95				-4.469,95	-0,01
Verwahrstellenvergütung			EUR	-669,43				-669,43	0,00
Externe Management-/Beratungsvergütung			EUR	-9.242,74				-9.242,74	-0,03
Prüfungskosten			EUR	-4.165,30				-4.165,30	-0,01
Veröffentlichungskosten			EUR	-1.415,21				-1.415,21	0,00
Fondsvermögen							EUR	31.343.813,56	100,00
MPF Ares									
Anteilwert							EUR	117,46	
Anzahl Anteile							STK	266.850,000	

Halbjahresbericht für MPF Ares

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

Die Vermögensgegenstände des Sondervermögens sind auf Grundlage der zuletzt festgestellten Kurse/Marktsätze bewertet.

Halbjahresbericht für MPF Ares

Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen: - Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schuldscheindarlehen (Marktzuordnung zum Berichtsstichtag):

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile Whg. in 1.000	Käufe bzw. Zugänge	Verkäufe bzw. Abgänge	Volumen in 1.000
Börsengehandelte Wertpapiere					
Verzinsliche Wertpapiere					
5,6250 % Deutsche Bank AG Sub.FLR-MTN v20(26/31)	DE000DL19VB0	EUR	0	1.500	
4,6250 % Volkswagen Intl Finance N.V. EO-FLR Notes 2014(26/Und.)	XS1048428442	EUR	0	1.000	
4,6250 % Volkswagen Intl Finance N.V. EO-FLR Notes 2018(28/Und.)	XS1799939027	EUR	0	1.500	
3,8750 % Volkswagen Intl Finance N.V. EO-FLR Notes 2020(29/Und.)	XS2187689380	EUR	0	1.000	
Nichtnotierte Wertpapiere					
Verzinsliche Wertpapiere					
1,7500 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.2014 (2024)	DE0001102333	EUR	1.500	1.500	
0,0000 % Bundesrep.Deutschland Bundesschatzanw. v.21(23)	DE0001104867	EUR	0	200	
Zertifikate					
Bqe International à Luxembourg EXPRESS Z.29.03.28 BSKT	CH0585070987	EUR	0	1.200	
J.P. Morgan Struct. Prod. B.V. Autoc.Z 23.02.28 Basket	XS2487080264	STK	0	1.300	
J.P. Morgan Struct. Prod. B.V. Autoc.Z 29.02.28 Basket	XS2487080348	STK	0	1.500	
UniCredit Bank GmbH HVB EXP.PL 01.02.28 Basket	DE000HVB5QR2	STK	0	1.000	
UniCredit Bank GmbH HVB EXP.PL 02.05.28 Basket	DE000HVB5TP0	STK	0	1.750	
UniCredit Bank GmbH HVB EXP.PL 26.04.28 Basket	DE000HVB5TE4	STK	0	2.500	

Halbjahresbericht für MPF Ares

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)	98,39
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)	0,00

Sonstige Angaben

MPF Ares

Anteilwert	EUR	117,46
Anzahl Anteile	STK	266.850,000

Angewandte Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände (§§ 26 bis 29 und 34 KARBV)

Der Anteilwert wird gem. § 169 KAGB von der Bantleon Invest AG ermittelt.

Die der Anteilwertermittlung im Falle von handelbaren Kursen zugrunde liegenden Wertpapierkurse bzw. Marktsätze werden von der Gesellschaft täglich selbst über verschiedene Datenanbieter bezogen. Dabei erfolgt die Bewertung für Rentenpapiere mit Kursen per 17:15 Uhr des Börsenvortages und die Bewertung von Aktien und börsengehandelten Aktienderivaten mit Schlusskursen des Börsenvortages. Die Einspielung von Zinskurven sowie Kassa- und Terminkursen für die Bewertung von Devisentermingeschäften und Rentenderivaten erfolgt parallel zu den Rentenpapieren mit Kursen per 17:15 Uhr.

Für Vermögensgegenstände, die weder zum Handel an einer Börse noch an einem organisierten Markt zugelassen sind oder für die kein handelbarer Kurs verfügbar ist, werden gem. § 168 Abs. 3 KAGB die Verkehrswerte zugrunde gelegt, die sich bei sorgfältiger Einschätzung auf Basis geeigneter Bewertungsmodelle unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten ergeben (§ 28 Abs. 1 KARBV). Die Verkehrswerte werden in einem mehrstufigen Bewertungsverfahren ermittelt. Die der Anteilwertermittlung im Falle von nicht handelbaren Kursen zugrunde liegenden Wertpapierkurse bzw. Marktsätze werden soweit möglich aus Kursen vergleichbarer Wertpapiere bzw. Renditekursen abgeleitet.

Die bezogenen Kurse werden täglich auf Vollständigkeit und Plausibilität geprüft. Hierzu prüft die Gesellschaft in Abhängigkeit von der Assetklasse die Kursbewegungen zum Vortag, die Kursaktualität, die Abweichungen gegen weitere Kursquellen sowie die Inputparameter für Modellbewertungen.

Investmentanteile werden mit ihrem letzten festgestellten und erhältlichen Net Asset Value bewertet.

Die Bankguthaben und übrigen Forderungen werden mit dem Nominalbetrag, die übrigen Verbindlichkeiten mit dem Rückzahlungsbetrag angesetzt. Festgelder werden - sofern sie kündbar sind und die Rückzahlung bei der Kündigung nicht zum Nennwert zuzüglich Zinsen erfolgt - mit dem Verkehrswert bewertet.

Halbjahresbericht für MPF Ares

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Weitere zum Verständnis des Berichts erforderliche Angaben

Hinweis zu den Finanzaufstellungen:

Auf Grund von Rundungen bei der Berechnung, kann es innerhalb der Finanzaufstellungen zu geringfügigen Rundungsdifferenzen kommen.

**Halbjahresbericht
für MPF Ares**

Hannover, den 24. Mai 2024

BANTLEON Invest AG

Caroline Specht

Gerd Lückel