



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 im Berichtszeitraum | 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