

KAPITALVERWALTUNGSGESELLSCHAFT:



BfS Nachhaltigkeitsfonds Green Bonds

HALBJAHRESBERICHT

ZUM 31. MAI 2021

VERWAHRSTELLE:



VERTRIEB:



Halbjahresbericht BfS Nachhaltigkeitsfonds Green Bonds

Vermögensübersicht zum 31.05.2021

Anlageschwerpunkte	Tageswert in EUR	% Anteil am Fondsvermögen
I. Vermögensgegenstände	21.626.350,30	100,20
1. Anleihen	20.954.765,22	97,09
< 1 Jahr	400.878,00	1,86
>= 1 Jahr bis < 3 Jahre	2.410.296,44	11,17
>= 3 Jahre bis < 5 Jahre	5.624.382,39	26,06
>= 5 Jahre bis < 10 Jahre	10.743.845,89	49,78
>= 10 Jahre	1.775.362,50	8,23
2. Derivate	143.889,88	0,67
3. Bankguthaben	435.215,40	2,02
4. Sonstige Vermögensgegenstände	92.479,80	0,43
II. Verbindlichkeiten	-43.161,72	-0,20
III. Fondsvermögen	21.583.188,58	100,00

Halbjahresbericht

BfS Nachhaltigkeitsfonds Green Bonds

Vermögensaufstellung zum 31.05.2021

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.05.2021	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Bestandspositionen							EUR	20.954.765,22	97,09
Börsengehandelte Wertpapiere							EUR	18.303.198,24	84,80
Verzinsliche Wertpapiere							EUR	18.303.198,24	84,80
3,3000 % European Investment Bank AD-Medium-Term Notes 2017(28)	AU3CB0245884	AUD		300	0	0 %	112,218	213.207,09	0,99
1,0000 % A2A S.p.A. EO-Med.-Term Notes 2019(19/29)	XS2026150313	EUR		100	0	0 %	104,155	104.155,00	0,48
0,8750 % ABN AMRO Bank N.V. EO-Medium-Term Notes 2018(25)	XS1808739459	EUR		200	0	0 %	103,943	207.886,00	0,96
0,5000 % ABN AMRO Bank N.V. EO-Preferred Med.-T.Nts 19(26)	XS1982037696	EUR		100	0	0 %	102,661	102.661,00	0,48
1,8750 % ACS Servicios Comun.y Ener.SL EO-Med.-Term Nts 2018(26/26)	XS1799545329	EUR		100	0	0 %	105,966	105.966,00	0,49
1,2500 % Adif - Alta Velocidad EO-Medium-Term Notes 2018(26)	ES0200002030	EUR		100	0	0 %	106,531	106.531,00	0,49
0,9500 % Adif - Alta Velocidad EO-Medium-Term Notes 2019(27)	ES0200002048	EUR		100	0	0 %	105,283	105.283,00	0,49
1,3750 % Agence Française Développement EO-Medium-Term Notes 2014(24)	XS1111084718	EUR		100	0	100 %	105,764	105.764,00	0,49
0,5000 % AIB Group PLC EO-FLR Med.-T.Nts 2021(26/27)	XS2343340852	EUR		200	200	0 %	99,929	199.858,00	0,93
0,8750 % Alliander N.V. EO-Medium-T. Notes 2016(26/26)	XS1400167133	EUR		300	0	0 %	104,616	313.848,00	1,45
0,1250 % Arkema S.A. EO-Medium-Term Nts 2020(20/26)	FR00140005T0	EUR		200	200	0 %	100,544	201.088,00	0,93
1,3750 % AXA S.A. EO-FLR M.-T.Nts 2021(31/41)	XS2314312179	EUR		150	150	0 %	98,995	148.492,50	0,69
1,3750 % Banco Bilbao Vizcaya Argent. EO-Non-Preferred MTN 2018(25)	XS1820037270	EUR		100	0	0 %	105,001	105.001,00	0,49
0,3000 % Banco Santander S.A. EO-Preferred MTN 2019(26)	XS2063247915	EUR		100	0	0 %	100,719	100.719,00	0,47
0,6250 % Bankinter S.A. EO-Non-Preferred MTN 2020(27)	ES0213679JR9	EUR		100	0	0 %	100,407	100.407,00	0,47
0,1250 % Bayerische Landesbank Med.Term.Inh.-Schv.21(28)	DE000BLB6JJ0	EUR		200	200	0 %	98,881	197.762,00	0,92
1,2500 % Belgien, Königreich EO-Obl. Lin. 2018(33) Ser. 86	BE0000346552	EUR		100	0	0 %	112,269	112.269,00	0,52
0,5000 % Berlin Hyp AG Inh.-Schv.Ser.112 v.16(23)	DE000BHY0GU5	EUR		100	0	0 %	101,311	101.311,00	0,47
1,1250 % Berlin Hyp AG Inh.-Schv.Ser.114 v.17(27)	DE000BHY0GS9	EUR		200	0	0 %	105,069	210.138,00	0,97
1,0000 % BNP Paribas S.A. EO-Non-Preferred MTN 2018(24)	XS1808338542	EUR		200	0	0 %	103,120	206.240,00	0,96
1,1250 % BPCE S.A. EO-Medium-Term Notes 2015(22)	FR0013067170	EUR		200	0	0 %	102,366	204.732,00	0,95
0,1000 % Bque Fédérative du Cr. Mutuel EO-Preferred MTN 2020(27)	FR00140003P3	EUR		100	0	0 %	99,315	99.315,00	0,46
1,0000 % CA Immobilien Anlagen AG EO-Anl. 2020(20/25)	XS2248827771	EUR		100	0	0 %	102,044	102.044,00	0,47
0,3750 % Caixabank S.A. EO-FLR Non-Pref. MTN 20(25/26)	XS2258971071	EUR		200	200	0 %	99,775	199.550,00	0,92
2,0000 % CNP Assurances S.A. EO-FLR Med.-T.Nts 2019(30/50)	FR0013463775	EUR		200	0	0 %	103,566	207.132,00	0,96
0,7500 % Commerzbank AG FLR-MTN Ser.965 v.20(25/26)	DE000CB0HRQ9	EUR		100	0	0 %	101,569	101.569,00	0,47
1,2500 % Commerzbank AG MTN-IHS S.915 v.18(23)	DE000CZ40NG4	EUR		100	0	0 %	103,048	103.048,00	0,48
0,8270 % Comunidad Autónoma de Madrid EO-Obl. 2020(27)	ES0000101966	EUR		100	0	0 %	104,513	104.513,00	0,48
0,2500 % Coöperatieve Rabobank U.A. EO-Non-Preferred MTN 2019(26)	XS2068969067	EUR		200	0	0 %	101,061	202.122,00	0,94
0,6250 % Corporación Andina de Fomento EO-Medium-Term Notes 2019(26)	XS2081543204	EUR		200	0	0 %	101,500	203.000,00	0,94

Halbjahresbericht

BfS Nachhaltigkeitsfonds Green Bonds

Vermögensaufstellung zum 31.05.2021

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.05.2021	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
1,8750 % Covivio S.A. EO-Notes 2016(16/26)	FR0013170834		EUR	200	0	0 %	108,881	217.762,00	1,01
0,7500 % Credit Agricole S.A. (Ldn Br.) EO-Preferred Med.-T.Nts 18(23)	FR0013385515		EUR	100	0	0 %	102,620	102.620,00	0,48
0,7500 % Daimler AG Medium Term Notes v.20(30)	DE000A289QR9		EUR	200	0	0 %	101,981	203.962,00	0,95
0,0100 % De Volksbank N.V. EO-Preferred MTN 2019(24)	XS2052503872		EUR	100	0	0 %	100,629	100.629,00	0,47
0,7500 % Deutsche Kreditbank AG Inh.-Schv. v.2017(2024)	DE000GRN0016		EUR	100	0	0 %	102,613	102.613,00	0,48
0,6250 % Enexis Holding N.V. EO-Medium-Term Nts 2020(20/32)	XS2190255211		EUR	200	200	0 %	101,191	202.382,00	0,94
0,3750 % Enexis Holding N.V. EO-Medium-Term Nts 2021(21/33)	XS2331315635		EUR	200	200	0 %	97,334	194.668,00	0,90
1,8750 % ERG S.p.A. EO-Med.-T. Nts 2019(19/25)	XS1981060624		EUR	100	0	0 %	106,332	106.332,00	0,49
1,1250 % ESB Finance DAC EO-Medium-Term Nts 2019(19/30)	XS2009861480		EUR	200	200	0 %	105,667	211.334,00	0,98
0,2500 % EUROFIMA EO-Medium-Term Notes 2018(24)	XS1919899960		EUR	100	0	0 %	101,721	101.721,00	0,47
0,1000 % EUROFIMA EO-Medium-Term Notes 2020(30)	XS2176621253		EUR	100	0	200 %	99,654	99.654,00	0,46
1,1130 % Eurogrid GmbH MTN v.2020(2020/2032)	XS2171713006		EUR	200	0	0 %	104,752	209.504,00	0,97
0,8750 % Ferrovie dello Stato Ital.SpA EO-Medium-Term Notes 2017(23)	XS1732400319		EUR	100	0	0 %	102,664	102.664,00	0,48
0,8750 % Hera S.p.A. EO-Med.-Term Nts 2019(19/27)	XS2020608548		EUR	100	0	0 %	104,084	104.084,00	0,48
1,5000 % HSBC Holdings PLC EO-FLR Med.-T. Nts 2018(23/24)	XS1917601582		EUR	150	0	0 %	103,923	155.884,50	0,72
0,6250 % Hypo Vorarlberg Bank AG EO-Medium-Term Bonds 2017(22)	XS1685589027		EUR	200	0	0 %	100,919	201.838,00	0,94
1,5000 % Icade S.A. EO-Obl. 2017(17/27)	FR0013281755		EUR	200	0	0 %	107,517	215.034,00	1,00
2,0000 % Ignitis Group UAB EO-Medium-Term Notes 2017(27)	XS1646530565		EUR	100	0	0 %	110,312	110.312,00	0,51
1,8750 % Ignitis Group UAB EO-Medium-Term Nts 2018(18/28)	XS1853999313		EUR	100	0	0 %	109,909	109.909,00	0,51
0,8750 % Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Medium-Term Notes 2017(22)	XS1636000561		EUR	100	0	0 %	101,175	101.175,00	0,47
0,7500 % Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Preferred MTN 2021(28)	XS2317069685		EUR	200	200	0 %	99,990	199.980,00	0,93
1,9500 % Iren S.p.A. EO-Medium-Term Nts 2018(25/25)	XS1881533563		EUR	100	0	0 %	107,265	107.265,00	0,50
1,3500 % Irland EO-Treasury Bonds 2018(31)	IE00BFZRQ242		EUR	200	0	0 %	112,133	224.266,00	1,04
0,3750 % KBC Groep N.V. EO-FLR Med.-T.Nts 2020(26/27)	BE0974365976		EUR	200	0	0 %	100,756	201.512,00	0,93
1,3750 % La Banque Postale EO-Non-Pref. M.-T.Nts 2019(29)	FR0013415692		EUR	100	0	0 %	106,457	106.457,00	0,49
1,4500 % La Poste EO-Medium-Term Notes 2018(28)	FR0013384567		EUR	100	0	0 %	109,076	109.076,00	0,51
0,2000 % Landesbank Baden-Württemberg MTN Serie 790 v.17(21)	DE000LB1M214		EUR	200	0	0 %	100,333	200.666,00	0,93
0,3750 % Münchener Hypothekenbank MTN-IHS Serie 1927 v.21(29)	DE000MHB64E1		EUR	200	200	0 %	99,457	198.914,00	0,92
1,2500 % Münchener Rückvers.-Ges. AG FLR-Nachr.-Anl. v.20(30/41)	XS2221845683		EUR	300	0	0 %	100,776	302.328,00	1,40
0,1900 % National Grid Electr.Trans.PLC EO-Medium Term Nts 2020(20/25)	XS2104915033		EUR	100	0	0 %	100,699	100.699,00	0,47
0,5000 % Nordea Bank Abp EO-Non Preferred MTN 2021(31)	XS2321526480		EUR	200	200	0 %	99,056	198.112,00	0,92
0,3750 % NRW.BANK MTN-IHS Ausg. 0AD v.16(26)	DE000NWB0AD8		EUR	200	0	0 %	103,482	206.964,00	0,96
0,3750 % OP Yrityspankki Oyj EO-Medium-Term Notes 2019(24)	XS1956022716		EUR	100	0	0 %	101,782	101.782,00	0,47
1,5000 % Orsted A/S EO-Med.-Term Notes 2017(17/29)	XS1721760541		EUR	100	0	0 %	109,173	109.173,00	0,51
1,0000 % Polen, Republik EO-Medium-Term Notes 2019(29)	XS1958534528		EUR	100	0	0 %	107,377	107.377,00	0,50
0,3750 % Raiffeisen Bank Intl AG EO-Med.-Term Nts 2019(26)S.194	XS2055627538		EUR	200	0	0 %	101,635	203.270,00	0,94

Halbjahresbericht

BfS Nachhaltigkeitsfonds Green Bonds

Vermögensaufstellung zum 31.05.2021

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw.		Bestand 31.05.2021	Käufe / Verkäufe /		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
			Anteile bzw. Whg. in 1.000			Zugänge im Berichtszeitraum	Abgänge			
0,3750 % Red Eléctrica Financ. S.A.U. EO-Med.-Term Notes 2020(20/28)	XS2103013210		EUR		100	0	0 %	101,421	101.421,00	0,47
0,5000 % Red Eléctrica Financ. S.A.U. EO-Med.-Term Notes 2021(21/33)	XS2343540519		EUR		100	100	0 %	98,572	98.572,00	0,46
0,8750 % Régie Auton.Transp. Par.(RATP) EO-Medium-Term Notes 2017(27)	FR0013264488		EUR		200	0	0 %	105,453	210.906,00	0,98
0,2500 % Royal Bank of Canada EO-Medium-Term Notes 2019(24)	XS1989375412		EUR		100	0	0 %	101,073	101.073,00	0,47
0,5000 % SBAB Bank AB (publ) EO-Medium-Term Notes 2020(25)	XS2173114542		EUR		100	0	0 %	102,551	102.551,00	0,48
1,8410 % Schneider Electric SE EO-Med.-Term Notes 2015(15/25)	FR0013015559		EUR		200	0	0 %	108,956	217.912,00	1,01
1,2500 % Snam S.p.A. EO-Med.-T. Nts 2019(25/25)	XS1957442541		EUR		100	0	0 %	105,038	105.038,00	0,49
0,7500 % Snam S.p.A. EO-Med.-T. Nts 2020(30/30)	XS2190256706		EUR		100	0	0 %	101,241	101.241,00	0,47
1,0000 % SNCF Réseau S.A. EO-Medium-Term-Notes 2016(31)	XS1514051694		EUR		100	0	0 %	106,238	106.238,00	0,49
0,8750 % Société Générale S.A. EO-FLR Non-Pref. MTN 20(27/28)	FR0013536661		EUR		100	0	0 %	101,312	101.312,00	0,47
0,1250 % SpareBank 1 SMN EO-Preferred M.-T.Nts 2019(26)	XS2051032444		EUR		100	0	0 %	100,152	100.152,00	0,46
0,0100 % SpareBank 1 SMN EO-Preferred MTN 2021(28)	XS2303089697		EUR		200	200	0 %	97,767	195.534,00	0,91
0,8750 % SSE PLC EO-Med.-Term Notes 2017(17/25)	XS1676952481		EUR		150	0	0 %	103,513	155.269,50	0,72
0,5000 % Stedin Holding N.V. EO-Medium-Term Nts 2019(19/29)	XS2079678400		EUR		100	0	0 %	101,012	101.012,00	0,47
0,6250 % Stora Enso Oyj EO-Medium-Term Nts 2020(20/30)	XS2265360359		EUR		100	0	0 %	98,881	98.881,00	0,46
0,5000 % Tatra Banka AS EO-FLR Med.-T. Nts. 21(27/28)	SK4000018925		EUR		200	200	0 %	99,304	198.608,00	0,92
1,0690 % Telefonica Emisiones S.A.U. EO-Medium-Term Nts 2019(19/24)	XS1946004451		EUR		100	0	0 %	102,991	102.991,00	0,48
0,7500 % TenneT Holding B.V. EO-Med.-Term Notes 2017(17/25)	XS1632897762		EUR		100	0	0 %	103,431	103.431,00	0,48
0,1250 % TenneT Holding B.V. EO-Med.-Term Notes 2020(20/32)	XS2262065159		EUR		100	0	0 %	94,509	94.509,00	0,44
1,3750 % TenneT Holding B.V. EO-Medium-Term Nts 2017(17/29)	XS1632897929		EUR		100	0	0 %	108,440	108.440,00	0,50
1,0000 % Terna Rete Elettrica Nazio.SpA EO-Medium-Term Notes 2018(23)	XS1858912915		EUR		100	0	0 %	102,779	102.779,00	0,48
0,7500 % Terna Rete Elettrica Nazio.SpA EO-Medium-Term Notes 2020(32)	XS2209023402		EUR		100	0	0 %	99,268	99.268,00	0,46
1,0000 % Unibail-Rodamco-Westfield SE EO-Medium-Term Nts 2015(15/25)	XS1218319702		EUR		100	0	0 %	103,792	103.792,00	0,48
1,5000 % Verbund AG EO-Notes 2014(24)	XS1140300663		EUR		200	0	0 %	106,111	212.222,00	0,98
0,9000 % Vodafone Group PLC EO-Medium-Term Notes 2019(26)	XS2002017361		EUR		100	0	0 %	104,183	104.183,00	0,48
1,6250 % Anglian Water Svcs Financg PLC LS-Med.-Term Notes 2017(17/25)	XS1659112616		GBP		200	0	0 %	103,628	241.023,37	1,12
2,1250 % Orsted A/S LS-Medium-Term Nts 2019(19/27)	XS1997070781		GBP		100	0	0 %	105,108	122.232,82	0,57
2,1250 % Transport for London LS-Med.-Term Nts 2015(25)	XS1222743061		GBP		100	0	0 %	105,371	122.538,67	0,57
0,8750 % European Investment Bank SK-Medium-Term Notes 2018(25)	XS1757428088		SEK		3.000	0	0 %	102,310	302.775,91	1,40
3,0000 % Apple Inc. DL-Notes 2017(17/27)	US037833CX61		USD		250	0	0 %	110,387	225.740,29	1,05
1,7500 % Asian Development Bank DL-Medium-Term Notes 2016(26)	US045167DR18		USD		200	0	0 %	104,328	170.679,75	0,79
2,3750 % Asian Development Bank DL-Medium-Term Notes 2017(27)	US045167EC30		USD		900	0	0 %	107,116	788.584,05	3,65
3,1250 % Asian Development Bank DL-Medium-Term Notes 2018(28)	US045167EJ82		USD		300	0	0 %	112,412	275.857,67	1,28
0,7500 % European Investment Bank DL-Notes 2020(30)	US298785JH03		USD		450	0	0 %	92,735	341.355,83	1,58
1,7500 % John.Cont.Intl/Tyco F.+Sec.F. DL-Notes 2020(20/30)	US47837RAA86		USD		200	0	0 %	95,175	155.705,52	0,72
2,1250 % Kommunalbanken AS DL-Med.-Term Nts 2015(25)Reg.S	XS1188118100		USD		300	0	0 %	105,553	259.025,77	1,20

Halbjahresbericht BfS Nachhaltigkeitsfonds Green Bonds

Vermögensaufstellung zum 31.05.2021

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.05.2021	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
3,8750 % Korea Water Resources Corp. DL-Medium-Term Notes 2018(23)	XS1798774656		USD	200	0	0 %	106,625	174.437,63	0,81
0,7500 % Kreditanst.f.Wiederaufbau DL-Anl.v.2020 (2030)	US500769JG03		USD	200	200	0 %	92,619	151.523,93	0,70
1,7500 % Kreditanst.f.Wiederaufbau DL-Anleihe v.19(29)	US500769JD71		USD	550	0	0 %	102,030	459.030,67	2,13
2,5270 % Mitsubishi UFJ Finl Grp Inc. DL-Bonds 2016(23)	US606822AH76		USD	300	0	0 %	104,713	256.964,42	1,19
2,5000 % MTR Corp. [C.I.] Ltd. DL-Med.-Term Nts 2016(26)	XS1509084775		USD	200	0	0 %	106,531	174.283,84	0,81
2,3750 % Nederlandse Waterschapsbank NV DL-Med.-Term Nts 2016(26)Reg.S	XS1386139841		USD	500	0	0 %	107,120	438.118,61	2,03
1,0000 % Nederlandse Waterschapsbank NV DL-Med.-Term Nts 2020(30)Reg.S	XS2180643889		USD	400	0	0 %	94,270	308.449,90	1,43

An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere

EUR 2.651.566,98 12,29

Verzinsliche Wertpapiere

EUR 2.651.566,98 12,29

2,5000 % Queensland Treasury Corp. AD-Notes 2019(29)	AU3SG0001928		AUD	400	0	0 %	107,729	272.904,37	1,26
1,9500 % Ontario, Provinz CD-Bonds 2016(23)	CA68323ADL58		CAD	350	0	0 %	102,592	243.158,39	1,13
2,6500 % Ontario, Provinz CD-Bonds 2018(25)	CA68323AER10		CAD	300	0	0 %	106,394	216.145,46	1,00
2,6000 % Quebec, Provinz CD-Notes 2018(25)	CA748148RX35		CAD	190	0	0 %	106,648	137.218,93	0,64
0,7500 % Bank of China Ltd. (Lux Br.) EO-Medium-Term Notes 2016(21)	XS1437623355		EUR	200	0	0 %	100,106	200.212,00	0,93
0,8150 % FCC Serv.Medio Ambiente Hld.SA EO-Notes 2019(23/23)	XS2081491727		EUR	100	0	0 %	101,762	101.762,00	0,47
0,1250 % Hamburger Hochbahn AG Anleihe v.2021(2030/2031)	XS2233088132		EUR	200	200	0 %	98,695	197.390,00	0,91
0,9560 % Mizuho Financial Group Inc. EO-Medium-Term Notes 2017(24)	XS1691909920		EUR	200	0	0 %	103,281	206.562,00	0,96
1,7500 % ProLogis Intl Funding II S.A. EO-Med.-Term Nts 2018(18/28)	XS1789176846		EUR	125	0	0 %	109,168	136.460,00	0,63
0,9340 % Sumitomo Mitsui Financ. Group EO-Medium-Term Notes 2017(24)	XS1694219780		EUR	200	0	0 %	103,241	206.482,00	0,96
0,0100 % Svenska Handelsbanken AB EO-Non-Preferred MTN 2020(27)	XS2265968284		EUR	200	0	0 %	98,276	196.552,00	0,91
0,9500 % Can. Imp. Bk of Comm.(Tor.Br.) DL-Notes 2020(25)	US13607GRR73		USD	200	0	0 %	100,237	163.986,91	0,76
4,6250 % ING Groep N.V. DL-Med.-Term Nts 2018(26)Reg.S	USN4580HAA51		USD	200	0	0 %	114,814	187.834,76	0,87
3,8750 % Verizon Communications Inc. DL-Notes 2019(19/29)	US92343VES97		USD	200	0	0 %	113,019	184.898,16	0,86

Summe Wertpapiervermögen 2)

EUR 20.954.765,22 97,09

Derivate

EUR 143.889,88 0,67

(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)

Halbjahresbericht

BfS Nachhaltigkeitsfonds Green Bonds

Vermögensaufstellung zum 31.05.2021

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.05.2021	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens	
Zins-Derivate							EUR	16.595,50	0,08	
Forderungen/Verbindlichkeiten										
Zinsterminkontrakte							EUR	16.595,50	0,08	
FUTURE EURO-BUND 06.21 EUREX			185	EUR	-1.600.000			18.960,00	0,09	
FUTURE 10Y TREASURY NOTE (SYNTH.) 09.21 CBOT			362	USD	-1.000.000			-2.364,50	-0,01	
Devisen-Derivate							EUR	127.294,38	0,59	
Forderungen/Verbindlichkeiten										
Währungsterminkontrakte							EUR	127.294,38	0,59	
FUTURE CROSS RATE EUR/AUD 06.21 CME			352	AUD	500.000		AUD	1,582	11.130,46	0,05
FUTURE CROSS RATE EUR/CAD 06.21 CME			352	CAD	500.000		CAD	1,475	-9.446,74	-0,04
FUTURE CROSS RATE EUR/GBP 06.21 CME			352	GBP	500.000		GBP	0,860	886,73	0,00
FUTURE CROSS RATE EUR/USD 06.21 CME			352	USD	4.750.000		USD	1,223	124.723,93	0,58
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds							EUR	435.215,40	2,02	
Bankguthaben							EUR	435.215,40	2,02	
EUR - Guthaben bei:										
Hauck & Aufhäuser Privatbankiers AG				EUR	205.115,24		% 100,000	205.115,24	0,95	
Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen										
				SEK	162.321,56		% 100,000	16.012,46	0,07	
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen										
				AUD	36.112,98		% 100,000	22.870,79	0,11	
				CAD	59.050,01		% 100,000	39.987,82	0,19	
				GBP	59.858,14		% 100,000	69.610,58	0,32	
				USD	99.778,62		% 100,000	81.618,51	0,38	

Halbjahresbericht

BfS Nachhaltigkeitsfonds Green Bonds

Vermögensaufstellung zum 31.05.2021

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.05.2021	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Sonstige Vermögensgegenstände							EUR	92.479,80	0,43
Zinsansprüche			EUR	92.479,80				92.479,80	0,43
Sonstige Verbindlichkeiten							EUR	-43.161,72	-0,20
Zinsverbindlichkeiten			EUR	-258,28				-258,28	0,00
Verwaltungsvergütung			EUR	-32.287,18				-32.287,18	-0,15
Verwahrstellenvergütung			EUR	-856,26				-856,26	0,00
Prüfungskosten			EUR	-9.150,00				-9.150,00	-0,04
Veröffentlichungskosten			EUR	-610,00				-610,00	0,00
Fondsvermögen							EUR	21.583.188,58	100,00 1)
Anteilwert							EUR	49,68	
Ausgabepreis							EUR	51,17	
Anteile im Umlauf							STK	434.471	

Fußnoten:

1) Durch Rundung der Prozent-Anteile bei der Berechnung können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.

2) Die Wertpapiere und Schuldscheindarlehen des Sondervermögens sind teilweise durch Geschäfte mit Finanzinstrumenten abgesichert.

Halbjahresbericht

BfS Nachhaltigkeitsfonds Green Bonds

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Devisenkurse (in Mengennotiz)

		per 31.05.2021	
AUD	(AUD)	1,5790000	= 1 EUR (EUR)
CAD	(CAD)	1,4767000	= 1 EUR (EUR)
GBP	(GBP)	0,8599000	= 1 EUR (EUR)
SEK	(SEK)	10,1372000	= 1 EUR (EUR)
USD	(USD)	1,2225000	= 1 EUR (EUR)

Marktschlüssel

b) Terminbörsen

185	Eurex Deutschland
352	Chicago - CME Globex
362	Chicago Board of Trade

Halbjahresbericht BfS Nachhaltigkeitsfonds Green Bonds

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					
0,6250 % Deutsche Kreditbank AG Inh.-Schv. v.2016(2021)	DE000GRN0008	EUR	0	100	
1,2500 % European Investment Bank EO-Medium-Term Notes 2014(26)	XS1107718279	EUR	0	200	
0,5000 % European Investment Bank EO-Medium-Term Notes 2016(37)	XS1500338618	EUR	0	100	
1,5000 % European Investment Bank EO-Medium-Term Notes 2017(47)	XS1641457277	EUR	0	200	
1,5000 % Flämische Gemeinschaft EO-Med.-T.Notes 2019(44)	BE0001790444	EUR	0	100	
1,3750 % Paris, Stadt EO-Medium-Term Notes 2017(34)	FR0013296704	EUR	0	100	
0,3000 % Skandinaviska Enskilda Banken EO-Medium-Term Notes 2017(22)	XS1567475303	EUR	0	100	
2,2500 % SNCF Réseau S.A. EO-Medium-Term-Notes 2017(47)	XS1648462023	EUR	0	200	

Derivate

(In Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe)

Terminkontrakte

Zinsterminkontrakte

Verkaufte Kontrakte:

(Basiswert(e): 10Y.US TRE.INT.SYN.AN., EURO-BUND) EUR 2.883,29

Währungsterminkontrakte

Gekaufte Kontrakte:

(Basiswert(e): CROSS RATE EO/AD, CROSS RATE EO/CD, CROSS RATE EO/DL, CROSS RATE EO/LS) EUR 6.525,54

Die Gesellschaft sorgt dafür, dass eine unangemessene Beeinträchtigung von Anlegerinteressen durch Transaktionskosten vermieden wird, indem unter Berücksichtigung der Anlageziele dieses Sondervermögens ein Schwellenwert für die Transaktionskosten bezogen auf das durchschnittliche Fondsvolumen sowie für eine Portfolioumschlagsrate festgelegt wurde. Die Gesellschaft überwacht die Einhaltung der Schwellenwerte und ergreift im Falle des Überschreitens weitere Maßnahmen.

Halbjahresbericht BfS Nachhaltigkeitsfonds Green Bonds

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)	97,09
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)	0,67

Sonstige Angaben

Anteilwert	EUR	49,68
Ausgabepreis	EUR	51,17
Anteile im Umlauf	STK	434.471

Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände

Bewertung

Die nachfolgend dargestellten Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände decken eventuelle aus der Covid-19 Pandemie resultierenden Marktauswirkungen ab. Darüber hinausgehende Bewertungsanpassungen waren nicht erforderlich.

Für Devisen, Aktien, Anleihen und Derivate, die zum Handel an einer Börse oder an einem anderen organisierten Markt zugelassen oder in diesen einbezogen sind, wird der letzte verfügbare handelbare Kurs gemäß § 27 KARBV zugrunde gelegt.

Für Investmentanteile werden die aktuellen Werte, für Bankguthaben und Verbindlichkeiten der Nennwert bzw. Rückzahlungsbetrag gemäß § 29 KARBV zugrunde gelegt.

Für Vermögensgegenstände, die weder zum Handel an einer Börse noch an einem anderen organisierten Markt zugelassen oder in den regulierten Markt oder Freiverkehr einer Börse einbezogen sind oder für die kein handelbarer Kurs verfügbar ist, werden gemäß § 28 KARBV i.V.m. § 168 Absatz 3 KAGB die Verkehrswerte zugrunde gelegt, die sich bei sorgfältiger Einschätzung nach geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten ergeben.

Unter dem Verkehrswert ist der Betrag zu verstehen, zu dem der jeweilige Vermögensgegenstand in einem Geschäft zwischen sachverständigen, vertragswilligen und unabhängigen Geschäftspartnern ausgetauscht werden könnte.

Frankfurt am Main, den 1. Juni 2021

Universal-Investment-Gesellschaft mbH
Die Geschäftsführung

Halbjahresbericht

BfS Nachhaltigkeitsfonds Green Bonds

Kurzübersicht über die Partner

1. Kapitalverwaltungsgesellschaft

Universal-Investment-Gesellschaft mbH

Hausanschrift:

Theodor-Heuss-Allee 70
60486 Frankfurt am Main

Postanschrift:

Postfach 17 05 48
60079 Frankfurt am Main

Telefon: 069 / 710 43-0

Telefax: 069 / 710 43-700

www.universal-investment.com

Gründung: 1968

Rechtsform: Gesellschaft mit beschränkter Haftung

Gezeichnetes und eingezahltes Kapital: EUR 10.400.000,-

Eigenmittel: EUR 57.243.165,68 (Stand: September 2020)

Geschäftsführer:

Frank Eggloff, München

Ian Lees, Leverkusen

Katja Müller, Bad Homburg

Markus Neubauer, Frankfurt am Main

Michael Reinhard, Bad Vilbel

Stefan Rockel, Lauterbach (Hessen)

Stephan Scholl, Königstein im Taunus

Axel Vespermann, Dreieich

Aufsichtsrat:

Prof. Dr. Harald Wiedmann (Vorsitzender), Berlin

Dr. Axel Eckhardt, Düsseldorf

Daniel Fischer, Bad Vilbel

Daniel F. Just, Pöcking

2. Verwahrstelle

Hauck & Aufhäuser Privatbankiers AG

Hausanschrift:

Kaiserstraße 24
60311 Frankfurt am Main

Postanschrift:

Postfach 10 10 40
60010 Frankfurt am Main

Telefon: 069 / 21 61-0

Telefax: 069 / 21 61-1340

www.hauck-aufhaeuser.de

Rechtsform: Aktiengesellschaft

Haftendes Eigenkapital: EUR 251.528.081 (Stand: 31. Dezember 2019)

3. Asset Management-Gesellschaft

Raiffeisen Kapitalanlage-Gesellschaft mbH

Postanschrift:

Mooslackengasse 12
1190 Wien

Telefon +43 1 711 70-0

Telefax +43 1 711 70-761092

4. Vertrieb

Bank für Sozialwirtschaft AG

Zentrale Vermögensanlage

Postanschrift:

Wörthstraße 15–17
50669 Köln

Telefon (0221) 97356-0

www.sozialbank.de

5. Anlageausschuss

Joachim Baum

Bank für Sozialwirtschaft AG, Köln

WKN / ISIN: 979998 / DE0009799981