

KAPITALVERWALTUNGSGESELLSCHAFT:



BfS Nachhaltigkeitsfonds Green Bonds

HALBJAHRESBERICHT

ZUM 31. MAI 2022

VERWAHRSTELLE:



VERTRIEB:



Halbjahresbericht BfS Nachhaltigkeitsfonds Green Bonds

Vermögensübersicht zum 31.05.2022

Anlageschwerpunkte	Tageswert in EUR	% Anteil am Fondsvermögen
I. Vermögensgegenstände	22.405.572,82	100,20
1. Anleihen	21.621.519,36	96,70
< 1 Jahr	874.344,62	3,91
>= 1 Jahr bis < 3 Jahre	4.036.854,84	18,05
>= 3 Jahre bis < 5 Jahre	4.962.542,62	22,19
>= 5 Jahre bis < 10 Jahre	9.483.893,28	42,41
>= 10 Jahre	2.263.884,00	10,12
2. Derivate	20.944,65	0,09
3. Bankguthaben	664.300,35	2,97
4. Sonstige Vermögensgegenstände	98.808,46	0,44
II. Verbindlichkeiten	-45.124,00	-0,20
III. Fondsvermögen	22.360.448,82	100,00

Halbjahresbericht

BfS Nachhaltigkeitsfonds Green Bonds

Vermögensaufstellung zum 31.05.2022

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.05.2022	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Bestandspositionen							EUR	21.621.519,36	96,70
Börsengehandelte Wertpapiere							EUR	19.126.582,34	85,54
Verzinsliche Wertpapiere							EUR	19.126.582,34	85,54
3,3000 % European Investment Bank AD-Medium-Term Notes 2017(28)	AU3CB0245884	AUD		300	0	0 %	97,751	196.444,94	0,88
1,0000 % A2A S.p.A. EO-Med.-Term Notes 2019(19/29)	XS2026150313	EUR		100	0	0 %	89,245	89.245,00	0,40
1,0000 % A2A S.p.A. EO-Med.-Term Notes 2021(21/33)	XS2403533263	EUR		100	0	0 %	78,904	78.904,00	0,35
0,8750 % ABN AMRO Bank N.V. EO-Medium-Term Notes 2018(25)	XS1808739459	EUR		200	0	0 %	98,525	197.050,00	0,88
0,5000 % ABN AMRO Bank N.V. EO-Preferred Med.-T.Nts 19(26)	XS1982037696	EUR		100	0	0 %	95,974	95.974,00	0,43
1,8750 % ACS Servicios Comun.y Ener.SL EO-Med.-Term Nts 2018(26/26)	XS1799545329	EUR		100	0	0 %	97,187	97.187,00	0,43
1,2500 % Adif - Alta Velocidad EO-Medium-Term Notes 2018(26)	ES0200002030	EUR		100	0	0 %	99,229	99.229,00	0,44
0,9500 % Adif - Alta Velocidad EO-Medium-Term Notes 2019(27)	ES0200002048	EUR		100	0	0 %	96,878	96.878,00	0,43
0,5500 % Adif - Alta Velocidad EO-Medium-Term Notes 2020(30)	ES0200002055	EUR		100	0	0 %	89,561	89.561,00	0,40
1,3750 % Agence Française Développement EO-Medium-Term Notes 2014(24)	XS11111084718	EUR		100	0	0 %	101,018	101.018,00	0,45
0,5000 % AIB Group PLC EO-FLR Med.-T.Nts 2021(26/27)	XS2343340852	EUR		100	0	0 %	90,566	90.566,00	0,41
0,8750 % Alliander N.V. EO-Medium-T. Notes 2016(26/26)	XS1400167133	EUR		300	0	0 %	96,782	290.346,00	1,30
0,1250 % Arkema S.A. EO-Medium-Term Nts 2020(20/26)	FR00140005T0	EUR		200	0	0 %	92,964	185.928,00	0,83
1,3750 % AXA S.A. EO-FLR M.-T.Nts 2021(31/41)	XS2314312179	EUR		150	0	0 %	81,440	122.160,00	0,55
1,3750 % Banco Bilbao Vizcaya Argent. EO-Non-Preferred MTN 2018(25)	XS1820037270	EUR		100	0	0 %	99,124	99.124,00	0,44
0,6250 % Banco Santander S.A. EO-FLR Non-Pref. MTN 21(28/29)	XS2357417257	EUR		200	100	0 %	87,953	175.906,00	0,79
0,3000 % Banco Santander S.A. EO-Preferred MTN 2019(26)	XS2063247915	EUR		100	0	0 %	92,810	92.810,00	0,42
0,6250 % Bankinter S.A. EO-Non-Preferred MTN 2020(27)	ES0213679JR9	EUR		100	0	0 %	90,058	90.058,00	0,40
0,1250 % Bayerische Landesbank Med.Term.Inh.-Schv.21(28)	DE000BLB6JJ0	EUR		200	0	0 %	87,934	175.868,00	0,79
1,2500 % Belgien, Königreich EO-Obl. Lin. 2018(33) Ser. 86	BE0000346552	EUR		700	200	0 %	96,297	674.079,00	3,01
0,5000 % Berlin Hyp AG Inh.-Schv.Ser.112 v.16(23)	DE000BHY0GU5	EUR		100	0	0 %	99,149	99.149,00	0,44
1,1250 % Berlin Hyp AG Inh.-Schv.Ser.114 v.17(27)	DE000BHY0GS9	EUR		200	0	0 %	94,007	188.014,00	0,84
1,0000 % BNP Paribas S.A. EO-Non-Preferred MTN 2018(24)	XS1808338542	EUR		200	0	0 %	99,371	198.742,00	0,89
1,1250 % BPCE S.A. EO-Medium-Term Notes 2015(22)	FR0013067170	EUR		200	0	0 %	100,602	201.204,00	0,90
0,1000 % Bque Fédérative du Cr. Mutuel EO-Preferred MTN 2020(27)	FR00140003P3	EUR		100	0	0 %	89,691	89.691,00	0,40
1,0000 % CA Immobilien Anlagen AG EO-Anl. 2020(20/25)	XS2248827771	EUR		100	0	0 %	91,592	91.592,00	0,41
0,3750 % Caixabank S.A. EO-FLR Non-Pref. MTN 20(25/26)	XS2258971071	EUR		200	0	0 %	93,290	186.580,00	0,83
2,0000 % CNP Assurances S.A. EO-FLR Med.-T.Nts 2019(30/50)	FR0013463775	EUR		200	0	0 %	87,196	174.392,00	0,78
0,7500 % Commerzbank AG FLR-MTN Ser.965 v.20(25/26)	DE000CB0HRQ9	EUR		100	0	0 %	95,712	95.712,00	0,43
1,2500 % Commerzbank AG MTN-IHS S.915 v.18(23)	DE000CZ40NG4	EUR		100	0	0 %	99,777	99.777,00	0,45

Halbjahresbericht

BfS Nachhaltigkeitsfonds Green Bonds

Vermögensaufstellung zum 31.05.2022

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw.		Bestand	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
			Anteile bzw. Whg. in 1.000	31.05.2022						
0,8270 % Comunidad Autónoma de Madrid EO-Obl. 2020(27)	ES0000101966		EUR		100	0	0 %	96,136	96.136,00	0,43
0,1600 % Comunidad Autónoma de Madrid EO-Obl. 2021(28)	ES00001010G6		EUR		200	200	0 %	90,821	181.642,00	0,81
0,2500 % Coöperatieve Rabobank U.A. EO-Non-Preferred MTN 2019(26)	XS2068969067		EUR		200	0	0 %	92,998	185.996,00	0,83
0,6250 % Corporación Andina de Fomento EO-Medium-Term Notes 2019(26)	XS2081543204		EUR		200	0	0 %	94,788	189.576,00	0,85
1,8750 % Covivio S.A. EO-Notes 2016(16/26)	FR0013170834		EUR		200	0	0 %	98,644	197.288,00	0,88
0,7500 % Credit Agricole S.A. (Ldn Br.) EO-Preferred Med.-T.Nts 18(23)	FR0013385515		EUR		100	0	0 %	99,891	99.891,00	0,45
0,0100 % De Volksbank N.V. EO-Preferred MTN 2019(24)	XS2052503872		EUR		100	0	0 %	97,081	97.081,00	0,43
0,7500 % Deutsche Kreditbank AG Inh.-Schv. v.2017(2024)	DE000GRN0016		EUR		100	0	0 %	98,572	98.572,00	0,44
0,6250 % Enexis Holding N.V. EO-Medium-Term Nts 2020(20/32)	XS2190255211		EUR		200	0	0 %	84,322	168.644,00	0,75
0,3750 % Enexis Holding N.V. EO-Medium-Term Nts 2021(21/33)	XS2331315635		EUR		200	0	0 %	80,570	161.140,00	0,72
1,8750 % ERG S.p.A. EO-Med.-T. Nts 2019(19/25)	XS1981060624		EUR		100	0	0 %	99,517	99.517,00	0,45
1,1250 % ESB Finance DAC EO-Medium-Term Nts 2019(19/30)	XS2009861480		EUR		200	0	0 %	92,120	184.240,00	0,82
0,2500 % EUROFIMA EO-Medium-Term Notes 2018(24)	XS1919899960		EUR		100	0	0 %	99,019	99.019,00	0,44
0,1000 % EUROFIMA EO-Medium-Term Notes 2020(30)	XS2176621253		EUR		100	0	0 %	88,025	88.025,00	0,39
1,1130 % Eurogrid GmbH MTN v.2020(2020/2032)	XS2171713006		EUR		200	0	0 %	86,676	173.352,00	0,78
0,4000 % Europäische Union EO-Medium-Term Notes 2021(37)	EU000A3K4C42		EUR		200	0	0 %	80,782	161.564,00	0,72
0,8750 % Ferrovie dello Stato Ital.SpA EO-Medium-Term Notes 2017(23)	XS1732400319		EUR		100	0	0 %	99,759	99.759,00	0,45
0,8750 % Hera S.p.A. EO-Med.-Term Nts 2019(19/27)	XS2020608548		EUR		100	0	0 %	93,625	93.625,00	0,42
1,3750 % HYPO NOE LB f. Nied.u.Wien AG EO-Med.-Term Nts 2022(25)	AT0000A2XG57		EUR		100	100	0 %	98,849	98.849,00	0,44
0,6250 % Hypo Vorarlberg Bank AG EO-Medium-Term Bonds 2017(22)	XS1685589027		EUR		200	0	0 %	100,114	200.228,00	0,90
1,5000 % Icade S.A. EO-Obl. 2017(17/27)	FR0013281755		EUR		200	0	0 %	94,818	189.636,00	0,85
2,0000 % Ignitis Group UAB EO-Medium-Term Notes 2017(27)	XS1646530565		EUR		100	0	0 %	95,976	95.976,00	0,43
1,8750 % Ignitis Group UAB EO-Medium-Term Nts 2018(18/28)	XS1853999313		EUR		100	0	0 %	94,248	94.248,00	0,42
0,8750 % Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Medium-Term Notes 2017(22)	XS1636000561		EUR		100	0	0 %	100,100	100.100,00	0,45
0,7500 % Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Preferred MTN 2021(28)	XS2317069685		EUR		100	0	0 %	88,723	88.723,00	0,40
1,9500 % Iren S.p.A. EO-Medium-Term Nts 2018(25/25)	XS1881533563		EUR		100	0	0 %	100,048	100.048,00	0,45
1,3500 % Irland EO-Treasury Bonds 2018(31)	IE00BFZRQ242		EUR		700	200	0 %	99,093	693.651,00	3,10
0,3750 % KBC Groep N.V. EO-FLR Med.-T.Nts 2020(26/27)	BE0974365976		EUR		200	0	0 %	92,986	185.972,00	0,83
1,3750 % La Banque Postale EO-Non-Pref. M.-T.Nts 2019(29)	FR0013415692		EUR		100	0	0 %	91,952	91.952,00	0,41
1,4500 % La Poste EO-Medium-Term Notes 2018(28)	FR0013384567		EUR		100	0	0 %	97,301	97.301,00	0,44
0,7500 % Mercedes-Benz Group AG Medium Term Notes v.20(30)	DE000A289QR9		EUR		200	0	0 %	88,983	177.966,00	0,80
0,3750 % Münchener Hypothekenbank MTN-IHS Serie 1927 v.21(29)	DE000MHB64E1		EUR		200	0	0 %	85,897	171.794,00	0,77
1,2500 % Münchener Rückvers.-Ges. AG FLR-Nachr.-Anl. v.20(30/41)	XS2221845683		EUR		300	0	0 %	81,445	244.335,00	1,09
1,0000 % Münchener Rückvers.-Ges. AG FLR-Nachr.-Anl. v.21(31/42)	XS2381261424		EUR		100	0	0 %	76,875	76.875,00	0,34
0,1900 % National Grid Electr.Trans.PLC EO-Medium Term Nts 2020(20/25)	XS2104915033		EUR		100	0	0 %	96,024	96.024,00	0,43
0,2500 % National Grid PLC EO-Medium Term Nts 2021(21/28)	XS2381853279		EUR		120	0	0 %	86,715	104.058,00	0,47

Halbjahresbericht

BfS Nachhaltigkeitsfonds Green Bonds

Vermögensaufstellung zum 31.05.2022

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw.		Bestand 31.05.2022	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
			Anteile bzw. Whg. in 1.000							
0,5000 % Nordea Bank Abp EO-Non Preferred MTN 2021(31)	XS2321526480		EUR		300	0	0 %	83,677	251.031,00	1,12
0,3750 % NRW.BANK MTN-IHS Ausg. 0AD v.16(26)	DE000NWB0AD8		EUR		200	0	0 %	95,957	191.914,00	0,86
0,0820 % NTT Finance Corp. EO-Medium-Term Nts 2021(21/25)	XS2411311579		EUR		300	300	0 %	94,453	283.359,00	1,27
0,3990 % NTT Finance Corp. EO-Medium-Term Nts 2021(21/28)	XS2411311652		EUR		100	100	0 %	89,678	89.678,00	0,40
0,3750 % OP Yrityspankki Oyj EO-Medium-Term Notes 2019(24)	XS1956022716		EUR		100	0	0 %	98,602	98.602,00	0,44
1,5000 % Orsted A/S EO-Med.-Term Notes 2017(17/29)	XS1721760541		EUR		100	0	0 %	95,063	95.063,00	0,43
0,7500 % Proximus S.A. EO-Med.-Term Notes 2021(21/36)	BE0002830116		EUR		100	0	0 %	76,810	76.810,00	0,34
1,0000 % Raiffeisenbank a.s. EO-FLR Non-Pref. MTN 21(27/28)	XS2348241048		EUR		100	0	0 %	85,690	85.690,00	0,38
0,3750 % Red Eléctrica Financ. S.A.U. EO-Med.-Term Notes 2020(20/28)	XS2103013210		EUR		100	0	0 %	92,209	92.209,00	0,41
0,5000 % Red Eléctrica Financ. S.A.U. EO-Med.-Term Notes 2021(21/33)	XS2343540519		EUR		100	0	0 %	84,618	84.618,00	0,38
0,8750 % Régie Auton. Transp. Par.(RATP) EO-Medium-Term Notes 2017(27)	FR0013264488		EUR		200	0	0 %	97,501	195.002,00	0,87
0,2500 % Royal Bank of Canada EO-Medium-Term Notes 2019(24)	XS1989375412		EUR		100	0	0 %	98,362	98.362,00	0,44
0,5000 % SBAB Bank AB (publ) EO-Medium-Term Notes 2020(25)	XS2173114542		EUR		100	0	0 %	96,892	96.892,00	0,43
1,8410 % Schneider Electric SE EO-Med.-Term Notes 2015(15/25)	FR0013015559		EUR		200	0	0 %	101,254	202.508,00	0,91
0,2500 % SFIL S.A. EO-Medium-Term Notes 2021(31)	FR0014006V25		EUR		200	0	0 %	86,747	173.494,00	0,78
0,7500 % Snam S.p.A. EO-Med.-T. Nts 2020(30/30)	XS2190256706		EUR		100	0	0 %	85,634	85.634,00	0,38
1,0000 % SNCF Réseau S.A. EO-Medium-Term-Notes 2016(31)	XS1514051694		EUR		100	0	0 %	93,117	93.117,00	0,42
0,8750 % Société Générale S.A. EO-FLR Non-Pref. MTN 20(27/28)	FR0013536661		EUR		100	0	0 %	90,721	90.721,00	0,41
0,1250 % SpareBank 1 SMN EO-Preferred M.-T.Nts 2019(26)	XS2051032444		EUR		100	0	0 %	93,093	93.093,00	0,42
0,0100 % SpareBank 1 SMN EO-Preferred MTN 2021(28)	XS2303089697		EUR		300	0	0 %	87,837	263.511,00	1,18
0,8750 % SSE PLC EO-Med.-Term Notes 2017(17/25)	XS1676952481		EUR		150	0	0 %	97,007	145.510,50	0,65
0,5000 % Stedin Holding N.V. EO-Medium-Term Nts 2019(19/29)	XS2079678400		EUR		100	0	0 %	86,622	86.622,00	0,39
0,0000 % Stedin Holding N.V. EO-Medium-Term Nts 2021(21/26)	XS2407985220		EUR		100	0	0 %	91,316	91.316,00	0,41
0,6250 % Stora Enso Oyj EO-Medium-Term Nts 2020(20/30)	XS2265360359		EUR		100	0	0 %	83,313	83.313,00	0,37
0,5000 % Swiss Life Finance I Ltd. EO-Bonds 2021(21/31)	CH1130818847		EUR		200	0	0 %	81,809	163.618,00	0,73
0,5000 % Tatra Banka AS EO-FLR Med.-T. Nts. 21(27/28)	SK4000018925		EUR		200	0	0 %	87,161	174.322,00	0,78
1,0690 % Telefonica Emisiones S.A.U. EO-Medium-Term Nts 2019(19/24)	XS1946004451		EUR		100	0	0 %	100,245	100.245,00	0,45
0,1250 % TenneT Holding B.V. EO-Med.-Term Notes 2020(20/32)	XS2262065159		EUR		100	0	0 %	78,143	78.143,00	0,35
0,8750 % TenneT Holding B.V. EO-Med.-Term Notes 2021(21/35)	XS2406569579		EUR		100	0	0 %	78,821	78.821,00	0,35
1,3750 % TenneT Holding B.V. EO-Medium-Term Nts 2017(17/29)	XS1632897929		EUR		100	0	0 %	94,660	94.660,00	0,42
1,0000 % Terna Rete Elettrica Nazio.SpA EO-Medium-Term Notes 2018(23)	XS1858912915		EUR		100	0	0 %	100,316	100.316,00	0,45
0,7500 % Terna Rete Elettrica Nazio.SpA EO-Medium-Term Notes 2020(32)	XS2209023402		EUR		100	0	0 %	83,399	83.399,00	0,37
1,0000 % Unibail-Rodamco-Westfield SE EO-Medium-Term Nts 2015(15/25)	XS1218319702		EUR		100	0	0 %	96,425	96.425,00	0,43
1,5000 % Verbund AG EO-Notes 2014(24)	XS1140300663		EUR		200	0	0 %	101,118	202.236,00	0,90
0,9000 % Vodafone Group PLC EO-Medium-Term Notes 2019(26)	XS2002017361		EUR		100	0	0 %	96,061	96.061,00	0,43
1,6250 % Anglian Water Svcs Financg PLC LS-Med.-Term Notes 2017(17/25)	XS1659112616		GBP		200	0	0 %	96,970	228.245,26	1,02

Halbjahresbericht

BfS Nachhaltigkeitsfonds Green Bonds

Vermögensaufstellung zum 31.05.2022

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw.		Bestand	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
			Anteile bzw. Whg. in 1.000	31.05.2022						
2,1250 % Orsted A/S LS-Medium-Term Nts 2019(19/27)	XS1997070781	GBP		100	0	0	%	96,975	114.128,52	0,51
2,1250 % Transport for London LS-Med.-Term Nts 2015(25)	XS1222743061	GBP		100	0	0	%	97,847	115.154,76	0,51
0,8750 % European Investment Bank SK-Medium-Term Notes 2018(25)	XS1757428088	SEK		3.000	0	0	%	96,637	276.643,19	1,24
3,0000 % Apple Inc. DL-Notes 2017(17/27)	US037833CX61	USD		100	0	0	%	99,638	93.023,99	0,42
1,7500 % Asian Development Bank DL-Medium-Term Notes 2016(26)	US045167DR18	USD		200	0	0	%	95,516	178.351,23	0,80
2,3750 % Asian Development Bank DL-Medium-Term Notes 2017(27)	US045167EC30	USD		700	0	100	%	97,304	635.914,48	2,84
3,1250 % Asian Development Bank DL-Medium-Term Notes 2018(28)	US045167EJ82	USD		300	0	0	%	100,867	282.514,24	1,26
0,7500 % European Investment Bank DL-Notes 2020(30)	US298785JH03	USD		450	0	0	%	83,922	352.580,52	1,58
1,7500 % John.Cont.Intl/Tyco F.+Sec.F. DL-Notes 2020(20/30)	US47837RAA86	USD		200	0	0	%	83,816	156.504,53	0,70
2,1250 % Kommunalbanken AS DL-Med.-Term Nts 2015(25)Reg.S	XS1188118100	USD		300	0	0	%	98,229	275.125,57	1,23
3,8750 % Korea Water Resources Corp. DL-Medium-Term Notes 2018(23)	XS1798774656	USD		200	0	0	%	101,047	188.678,93	0,84
0,7500 % Kreditanst.f.Wiederaufbau DL-Anl.v.2020 (2030)	US500769JG03	USD		200	0	0	%	83,903	156.666,98	0,70
1,7500 % Kreditanst.f.Wiederaufbau DL-Anleihe v.19(29)	US500769JD71	USD		550	0	0	%	92,297	473.936,61	2,12
2,5270 % Mitsubishi UFJ Finl Grp Inc. DL-Bonds 2016(23)	US606822AH76	USD		300	0	0	%	99,560	278.853,52	1,25
2,5000 % MTR Corp. [C.I.] Ltd. DL-Med.-Term Nts 2016(26)	XS1509084775	USD		200	0	0	%	96,492	180.173,65	0,81
2,3750 % Nederlandse Waterschapsbank NV DL-Med.-Term Nts 2016(26)Reg.S	XS1386139841	USD		500	0	0	%	98,143	458.141,16	2,05
1,0000 % Nederlandse Waterschapsbank NV DL-Med.-Term Nts 2020(30)Reg.S	XS2180643889	USD		400	0	0	%	85,591	319.637,76	1,43

An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere

EUR 2.494.937,02 11,16

Verzinsliche Wertpapiere

EUR 2.494.937,02 11,16

2,5000 % Queensland Treasury Corp. AD-Notes 2019(29)	AU3SG0001928	AUD		400	0	0	%	94,229	252.489,28	1,13
1,9500 % Ontario, Provinz CD-Bonds 2016(23)	CA68323ADL58	CAD		250	0	100	%	99,771	184.133,69	0,82
2,6500 % Ontario, Provinz CD-Bonds 2018(25)	CA68323AER10	CAD		300	0	0	%	99,251	219.808,80	0,98
2,6000 % Quebec, Provinz CD-Notes 2018(25)	CA748148RX35	CAD		190	0	0	%	98,953	138.794,26	0,62
0,5000 % Česká Sporitelna AS EO-FLR Non-Pref.MTN 21(27/28)	AT0000A2STV4	EUR		200	0	0	%	85,643	171.286,00	0,77
0,8150 % FCC Serv.Medio Ambiente Hld.SA EO-Notes 2019(23/23)	XS2081491727	EUR		100	0	0	%	99,445	99.445,00	0,44
0,9560 % Mizuho Financial Group Inc. EO-Medium-Term Notes 2017(24)	XS1691909920	EUR		200	0	0	%	98,812	197.624,00	0,88
1,7500 % ProLogis Intl Funding II S.A. EO-Med.-Term Nts 2018(18/28)	XS1789176846	EUR		125	0	0	%	95,143	118.928,75	0,53
0,5000 % SEGRO Capital S.a r.l. EO-Notes 2021(21/31)	XS2360041474	EUR		100	0	0	%	80,468	80.468,00	0,36
0,5000 % Smurfit Kappa Treasury PUC EO-Notes 2021(21/29)	XS2388182573	EUR		130	0	0	%	84,488	109.834,40	0,49
0,9340 % Sumitomo Mitsui Financ. Group EO-Medium-Term Notes 2017(24)	XS1694219780	EUR		200	0	0	%	98,775	197.550,00	0,88
0,0100 % Svenska Handelsbanken AB EO-Non-Preferred MTN 2020(27)	XS2265968284	EUR		200	0	0	%	88,735	177.470,00	0,79
0,9500 % Can. Imp. Bk of Comm.(Tor.Br.) DL-Notes 2020(25)	US13607GRR73	USD		200	0	0	%	91,671	171.171,69	0,77
4,6250 % ING Groep N.V. DL-Med.-Term Nts 2018(26)Reg.S	USN4580HAA51	USD		200	0	0	%	101,556	189.629,35	0,85

Halbjahresbericht

BfS Nachhaltigkeitsfonds Green Bonds

Vermögensaufstellung zum 31.05.2022

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.05.2022	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
3,8750 % Verizon Communications Inc. DL-Notes 2019(19/29)	US92343VES97		USD	200	0	0 %	99,775	186.303,80	0,83
Summe Wertpapiervermögen 2)							EUR	21.621.519,36	96,70
Derivate							EUR	20.944,65	0,09
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)									
Zins-Derivate							EUR	165.540,00	0,74
Forderungen/Verbindlichkeiten									
Zinsterminkontrakte							EUR	165.540,00	0,74
FUTURE EURO-BUND 06.22 EUREX		185	EUR	-1.400.000				165.540,00	0,74
Devisen-Derivate							EUR	-144.595,35	-0,65
Forderungen/Verbindlichkeiten									
Währungsterminkontrakte							EUR	-144.595,35	-0,65
FUTURE CROSS RATE EUR/AUD 06.22 CME		352	AUD	500.000			AUD 1,497	-1.507,24	-0,01
FUTURE CROSS RATE EUR/CAD 06.22 CME		352	CAD	500.000			CAD 1,359	-19.968,99	-0,09
FUTURE CROSS RATE EUR/GBP 06.22 CME		352	GBP	500.000			GBP 0,852	8.591,27	0,04
FUTURE CROSS RATE EUR/USD 06.22 CME		352	USD	4.750.000			USD 1,072	-131.710,39	-0,59
Bankguthaben, nicht verbrieft Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds							EUR	664.300,35	2,97
Bankguthaben							EUR	664.300,35	2,97
EUR - Guthaben bei:									
Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG			EUR	42.072,47		%	100,000	42.072,47	0,19

Halbjahresbericht

BfS Nachhaltigkeitsfonds Green Bonds

Vermögensaufstellung zum 31.05.2022

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.05.2022	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen bei:									
Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG			SEK	187.933,00			% 100,000	17.933,22	0,08
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen bei:									
Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG			AUD	127.596,50			% 100,000	85.474,61	0,38
Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG			CAD	127.083,87			% 100,000	93.816,52	0,42
Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG			GBP	52.973,95			% 100,000	62.344,30	0,28
Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG			USD	388.444,30			% 100,000	362.659,23	1,62
Sonstige Vermögensgegenstände							EUR	98.808,46	0,44
Zinsansprüche			EUR	98.650,13				98.650,13	0,44
Quellensteueransprüche			EUR	158,33				158,33	0,00
Sonstige Verbindlichkeiten							EUR	-45.124,00	-0,20
Zinsverbindlichkeiten			EUR	-114,83				-114,83	0,00
Verwaltungsvergütung			EUR	-33.969,69				-33.969,69	-0,15
Verwahrstellenvergütung			EUR	-889,48				-889,48	0,00
Prüfungskosten			EUR	-9.150,00				-9.150,00	-0,04
Veröffentlichungskosten			EUR	-1.000,00				-1.000,00	0,00
Fondsvermögen							EUR	22.360.448,82	100,00 1)
Anteilwert							EUR	45,30	
Ausgabepreis							EUR	46,66	
Anteile im Umlauf							STK	493.599	

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 31.05.2022	
AUD	(AUD)	1,4928000	= 1 EUR (EUR)
CAD	(CAD)	1,3546000	= 1 EUR (EUR)
GBP	(GBP)	0,8497000	= 1 EUR (EUR)
SEK	(SEK)	10,4796000	= 1 EUR (EUR)
USD	(USD)	1,0711000	= 1 EUR (EUR)

Marktschlüssel

b) Terminbörsen

185	Eurex Deutschland
352	Chicago - CME Globex

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

0,2000 % Landesbank Baden-Württemberg MTN Serie 790 v.17(21)	DE000LB1M214	EUR	0	200	
0,3750 % Raiffeisen Bank Intl AG EO-Med.-Term Nts 2019(26)S.194	XS2055627538	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): EURO-BOBL, EURO-BUND)		EUR			7.534,73
--	--	-----	--	--	----------

Währungsterminkontrakte

Gekaufte Kontrakte: (Basiswert(e): CROSS RATE EO/AD, CROSS RATE EO/CD, CROSS RATE EO/DL, CROSS RATE EO/LS)		EUR			6.279,54
---	--	-----	--	--	----------

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 %)	96,70
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)	0,09

Sonstige Angaben

Anteilwert	EUR	45,30
Ausgabepreis	EUR	46,66
Anteile im Umlauf	STK	493.599

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 2022

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

DZ BANK AG

Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank

Hausanschrift:

Platz der Republik
60325 Frankfurt am Main

Telefon: 069 / 7447-01

Telefax: 069 / 7447-1685

www.dzbank.de

Rechtsform: Aktiengesellschaft

Haftendes Eigenkapital: € 4.926 Mio. (Stand: 31. Dezember 2020)

3. Anlageberatungsgesellschaft

GLS Investment Management GmbH

Postanschrift:

Christstraße 9

44789 Bochum

Telefon +49 234 6220 2000

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