

BayernInvest Alpha Opportunity Plus-Fonds
Halbjahresbericht zum 31. Dezember 2015
für das Geschäftsjahr
vom 01. Juli 2015 bis 30. Juni 2016

Halbjahresbericht zum 31. Dezember 2015
BayernInvest Alpha Opportunity Plus-Fonds
DE000A0M8G00

Vermögensübersicht zum 31.12.2015

Anlageschwerpunkte	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
--------------------	--------------------	-------------------------

Halbjahresbericht zum 31. Dezember 2015
BayernInvest Alpha Opportunity Plus-Fonds
 DE000A0M8G00

Vermögensaufstellung zum 31.12.2015

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.12.2015	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Fondsvermögen							EUR	0,00	100,00
Anteilwert							EUR	0,00	
Ausgabepreis							EUR	0,00	
Anteile im Umlauf							STK	0	

Halbjahresbericht zum 31. Dezember 2015
BayernInvest Alpha Opportunity Plus-Fonds
DE000A0M8G00

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Halbjahresbericht zum 31. Dezember 2015

BayernInvest Alpha Opportunity Plus-Fonds

DE000A0M8G00

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

Aktien

TAG Immobilien AG Inhaber-Aktien o.N.	DE0008303504	STK		701.000	
---------------------------------------	--------------	-----	--	---------	--

Verzinsliche Wertpapiere

0,3470 % Citigroup Inc. EO-FLR Med.-Term Nts 2008(18)	XS0343323985	EUR		11.000	
0,3220 % Credit Suisse (London Branch) EO-FLR Med.-Term Nts 2014(17)	XS1079975808	EUR	9.400	9.400	
0,1510 % European Investment Bank EO-FLR Med.-Term Nts 2013(21)	XS0907250509	EUR		13.000	
4,1250 % K+S Aktiengesellschaft Anleihe v.2013(2021)	XS0997941355	EUR		9.000	
0,0510 % Niedersachsen, Land FLR-Landessch.v.14(21) Aus.580	DE000A1YC5L8	EUR		5.400	
1,2500 % Nordrhein-Westfalen, Land Landessch.v.13(20) R.1244	DE000NRW21X4	EUR		12.000	
0,8750 % Nordrhein-Westfalen, Land Landessch.v.14(19) R.1309	DE000NRW0FC1	EUR		15.000	
5,5000 % UniCredit Bank AG Pfandbr.R.20 v.1962(1967/2019)	DE0002101292	DEM		2.480	

An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere

Verzinsliche Wertpapiere

0,0000 % DEPFA ACS BANK EO-FLR Med.-T.Notes 2006(16)	XS0255652074	EUR		11.500	
--	--------------	-----	--	--------	--

Investmentanteile

KVG - eigene Investmentanteile

BayernInvest Dynamic Light-Fonds Inhaber-Anteile	DE000A1JSTJ0	ANT		1.000	
--	--------------	-----	--	-------	--

Abwicklung von Transaktionen durch verbundene Unternehmen

Der Anteil der Transaktionen, die im Berichtszeitraum für Rechnung des Sondervermögens über Broker ausgeführt wurden, die eng verbundene Unternehmen und Personen sind, betrug 67,25 %. Ihr Umfang belief sich hierbei auf insgesamt 78.161.022,69 EUR.

Halbjahresbericht zum 31. Dezember 2015

BayernInvest Alpha Opportunity Plus-Fonds

DE000A0M8G00

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

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

Sonstige Angaben

Anteilwert	EUR	0,00
Ausgabepreis	EUR	0,00
Anteile im Umlauf	STK	0

Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände

- Aktien, börsengehandelte Derivate und Investmentfonds werden mit handelbaren Börsenkursen (auf Schlusskursbasis) bewertet (Quelle: Bloomberg/Heimatsbörse).
- Rentenpapiere werden mit handelbaren Kursen nach § 23 InvRBV (Quelle: IBOXX) bzw. mit Verkehrswerten nach § 24 InvRBV bewertet. Hierfür werden jeweils die Geldkurse bzw. Mittelkurse herangezogen. Quellen für diese Verkehrswertermittlungen der Bonds sind in erster Linie Bloomberg (validierte Kursstellungen diverser Broker) bzw. anerkannte externe Kursanbieter für Rentenpapiere mit geringerer Liquidität.
- Nicht börsengehandelte OTC-Derivate werden unter Einbeziehung der relevanten Marktinformationen im Rahmen von regelmäßig überprüften Modellen bewertet (Quellen: Bloomberg und externe Anbieter).
- Nicht börsennotierte Investmentfonds werden mit dem von der Investmentgesellschaft zuletzt veröffentlichten Rücknahmepreis (NAV) bewertet (Quelle: Bloomberg).
- Devisenkassamittelkurse werden börsentäglich um 17 Uhr aus Reuters entnommen. Sie dienen der Umrechnung von Vermögensgegenständen in Fremdwährung in die Berichtswährung des jeweiligen Investmentvermögens. Ist eine Ermittlung von Devisenkassamittelkursen nicht möglich, erfolgt die Bewertung zu Geldkursen.
- Devisenforwards werden auf Basis der von der BayernLB (Abteilung Marktdaten) gelieferten Kassakurse (17 Uhr Reuters) von unserem externen Kursprovider Value & Risk errechnet und an uns geliefert.
- Bankguthaben werden zum Nennwert, Festgelder zum Verkehrswert und Forderungen und Verbindlichkeiten zum Rückzahlungsbetrag bewertet.