

Infinigon Investmentgrade Collateralized Loan Fund BI
Halbjahresbericht zum 30. September 2016
für das Geschäftsjahr
vom 01. April 2016 bis 31. März 2017

Halbjahresbericht zum 30. September 2016

Infinigon Investmentgrade Collateralized Loan Fund BI

DE000A1T6FY8

Vermögensübersicht zum 30.09.2016

Anlageschwerpunkte	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
I. Vermögensgegenstände	42.105.617,02	100,13
1. Anleihen	40.071.697,98	95,29
CDO	1.500.950,00	3,57
CLO	38.570.747,98	91,72
2. Derivate	-36.968,73	-0,09
3. Forderungen	499.073,16	1,19
4. Bankguthaben	1.571.814,61	3,74
II. Verbindlichkeiten	-53.549,96	-0,13
III. Fondsvermögen	42.052.067,06	100,00

Halbjahresbericht zum 30. September 2016
Infinigon Investmentgrade Collateralized Loan Fund BI
DE000A1T6FY8

Vermögensaufstellung zum 30.09.2016

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.09.2016	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens	
Bestandspositionen							EUR	40.071.697,98	95,29	
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere							EUR	40.071.697,98	95,29	
Verzinsliche Wertpapiere							EUR	40.071.697,98	95,29	
1,2300 % Adagio V CLO D.A.C. EO-FLR Nts 16(29)Cl.A Reg.S	XS1405774560		EUR	1.000	1.000	%	99,890	998.900,00	2,38	
3,0500 % Adagio V CLO D.A.C. EO-FLR Nts 16(29)Cl.C Reg.S	XS1405771970		EUR	500	500	%	99,990	499.950,00	1,19	
0,0500 % Aquilae CLO II PLC EO-FLR Nts 2006(10/23) A Reg.S ³⁾	XS0272301218		EUR	7.000		%	99,750	291.399,68	0,69	
4,0000 % Arbour CLO II Ltd. EO-FLR Nts 2015(28)Cl.D Reg.S	XS1148172288		EUR	500	500	%	99,080	495.400,00	1,18	
3,6500 % Aurium CLO I Ltd. EO-FLR Nts 2015(29) Cl.D Reg.S	XS1200238613		EUR	750	750	%	99,350	745.125,00	1,77	
2,1500 % Aurium CLO II D.A.C. EO-FLR Nts 2016(18/29) B Reg.S	XS14133379550		EUR	500	1.000	500	%	100,970	504.850,00	1,20
3,1000 % Aurium CLO II D.A.C. EO-FLR Nts 2016(18/29) C Reg.S	XS14133380210		EUR	500	500	%	99,920	499.600,00	1,19	
4,0000 % Aurium CLO II D.A.C. EO-FLR Nts 2016(18/29) D Reg.S	XS14133380640		EUR	500	500	%	98,010	490.050,00	1,17	
4,3000 % Avoca CLO XVI DAC EO-FLR Nts 2016(29)Cl.D Reg.S	XS1427880122		EUR	1.000	2.000	1.000	%	99,200	992.000,00	2,36
1,1050 % Babson Euro CLO 2014-1 B.V. EO-FLR Nts 2014(27) A-1 Reg.S	XS1043497657		EUR	1.000		%	100,110	1.001.100,00	2,38	
4,0000 % Babson Euro CLO 2016-1 B.V. EO-FLR Nts 16(30)Cl.D Reg.S	XS1405782076		EUR	800	800	%	99,840	798.720,00	1,90	
0,2320 % BACCHUS 2007-1 PLC EO-FLR Notes 2007(23) Cl.B ³⁾	XS0294989628		EUR	750		%	99,890	110.326,91	0,26	
3,7000 % Black Diamond CLO 15-1 EO-FLR Nts 2015(29) Cl.D Reg.S	XS1238906801		EUR	1.000		%	90,510	905.100,00	2,15	
2,1000 % BlueMountain EUR CLO 16-1 DAC EO-FLR Nts 2016(30) B1 Reg.S	XS1319816432		EUR	1.000		%	100,610	1.006.100,00	2,39	
0,0740 % Cadogan Square CLO B.V. EO-FLR Nts 05(10/22) A-1 Reg.S ³⁾	XS0236024153		EUR	2.500		%	99,840	87.827,89	0,21	
2,5050 % Cadogan Square CLO VI B.V. EO-FLR Nts 2015(29) C-1 Reg.S	XS1234952841		EUR	500		%	98,740	493.700,00	1,17	
2,9050 % Cadogan Square CLO VI B.V. EO-FLR Nts 2015(29) D-1 Reg.S	XS1234957642		EUR	500		%	95,700	478.500,00	1,14	
2,1000 % Cadogan Square CLO VII B.V. EO-FLR Nts 16(18/29) B Reg.S	XS1391550099		EUR	500	1.000	500	%	100,440	502.200,00	1,19
3,0000 % Cadogan Square CLO VII B.V. EO-FLR Nts 16(18/29) C Reg.S	XS1391550842		EUR	500	500	%	100,900	504.500,00	1,20	
2,4550 % Cairn CLO V B.V. EO-FLR Nts 2015(28) Cl.C Reg.S	XS1235782791		EUR	1.000		%	99,740	997.400,00	2,37	
4,0500 % Cairn CLO VI B.V. EO-FLR Nts 2016(29) Cl.D Reg.S	XS1432576657		EUR	750	750	%	99,520	746.400,00	1,77	
1,1050 % Carlyle GI.M.S.E.CLO 14-1 DAC EO-FLR Nts 2014(27) Cl.A Reg.S	XS1032519313		EUR	1.000		%	100,210	1.002.100,00	2,38	
3,2610 % Carlyle GI.M.S.E.CLO 14-2 DAC EO-FLR Nts 2014(27) Cl.C Reg.S	XS1075041506		EUR	1.500		%	98,680	1.480.200,00	3,52	
3,6000 % Carlyle GI.M.S.E.CLO 15-2 DAC EO-FLR Nts 2015(29) Cl.C Reg.S	XS1257958543		EUR	1.000	1.000	%	99,050	990.500,00	2,36	
4,0000 % Carlyle GI.M.S.E.CLO 15-3 DAC EO-FLR Nts 2015(29) Cl.C Reg.S	XS1331812708		EUR	500		%	100,230	501.150,00	1,19	
3,3000 % Carlyle GI.M.S.E.CLO 16-1 DAC EO-FLR Nts 2016(29) Cl.B Reg.S	XS1388788058		EUR	1.000	1.000	%	100,320	1.003.200,00	2,39	
2,2000 % Carlyle GI.M.S.E.CLO 16-1 DAC EO-FLR Nts 2016(29)Cl.A2 Reg.S	XS1388787753		EUR	500	500	%	101,280	506.400,00	1,20	
2,1500 % CVC Cordatus Loan Fund VI DAC EO-FLR Nts 16(18/29)Cl.B Reg.S	XS1317360532		EUR	1.000		%	100,940	1.009.400,00	2,40	
3,5000 % CVC Cordatus Loan Fund VI DAC EO-FLR Nts 16(18/29)Cl.C Reg.S	XS1317359526		EUR	500		%	100,230	501.150,00	1,19	
3,2000 % CVC Cordatus Loan Fund VII DAC EO-FLR Nts 2016(29) Cl.C Reg.S	XS1439445146		EUR	400	400	%	100,690	402.760,00	0,96	
4,4000 % CVC Cordatus Loan Fund VII DAC EO-FLR Nts 2016(29) D Reg.S	XS1439445815		EUR	500	500	%	100,490	502.450,00	1,19	
2,4990 % Harvest CLO XI DAC EO-FLR Nts 2015(29) Cl.C Reg.S	XS1181540615		EUR	1.000	1.000	%	99,770	997.700,00	2,37	
3,9000 % Harvest CLO XIV Desig.Act. Co. EO-FLR Nts 15(29)Cl.D Reg.S	XS1299719325		EUR	1.000	1.000	%	100,500	1.005.000,00	2,39	
2,2500 % Harvest CLO XV Desig.Act. Co. EO-FLR Nts 2016(29) Cl.B Reg.S	XS1364810967		EUR	500		%	100,520	502.600,00	1,20	
3,3500 % Harvest CLO XV Desig.Act. Co. EO-FLR Nts 2016(29) Cl.C Reg.S	XS1364811007		EUR	500		%	100,460	502.300,00	1,19	

Halbjahresbericht zum 30. September 2016
Infinigon Investmentgrade Collateralized Loan Fund BI
DE000A1T6FY8

Vermögensaufstellung zum 30.09.2016

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.09.2016	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
3,0500 % Harvest CLO XVI DAC EO-FLR Nts 2016(29) Cl.C Reg.S	XS1455038338		EUR	500	500	%	99,990	499.950,00	1,19
4,2000 % Harvest CLO XVI DAC EO-FLR Nts 2016(29) Cl.D Reg.S	XS1455038684		EUR	500	500	%	98,640	493.200,00	1,17
2,4510 % Jubilee CLO 2013-X B.V. EO-FLR Nts 2013(25) Cl.C Reg.S	XS0921329198		EUR	500		%	99,770	498.850,00	1,19
3,1000 % Jubilee CLO 2016-XVII B.V. EO-FLR Nts 2016(29) Cl.C Reg.S	XS1449963997		EUR	500	500	%	98,620	493.100,00	1,17
4,1000 % Jubilee CLO 2016-XVII B.V. EO-FLR Nts 2016(29) Cl.D Reg.S	XS1449964375		EUR	500	500	%	100,250	501.250,00	1,19
4,1000 % Laurelin 2016-1 DAC EO-FLR Nts 2016(29) Cl.D Reg.S	XS1432497276		EUR	1.000	1.000	%	100,000	1.000.000,00	2,38
3,3000 % Newhaven CLO Ltd. EO-FLR Nts 2014(28) Cl.D Reg.S	XS1108790160		EUR	500	500	%	97,500	487.500,00	1,16
2,8550 % Oak Hill Europ.Credit Part.III EO-FLR Nts 2015(28) Cl.D Reg.S	XS1227780704		EUR	500		%	96,500	482.500,00	1,15
3,3500 % Penta CLO 2 B.V. EO-FLR Nts 15(17/28)Cl.D Reg.S	XS1225774907		EUR	1.000		%	97,750	977.500,00	2,32
3,0000 % Toro European CLO 2 DAC EO-FLR Nts 2016(28) Cl.C Reg.S	XS1471717659		EUR	1.000	1.000	%	100,050	1.000.500,00	2,38
0,0920 % Queen Street CLO I B.V. EO-FLR Notes 2007(10/23) Cl.A1 ³⁾	XS0278960066		EUR	3.000		%	99,950	75.280,59	0,18
0,1070 % Wood Street CLO 1 B.V. EO-FLR Nts 2005(21) Cl.A Reg.S ³⁾	XS0229677546		EUR	5.500		%	99,500	218.447,50	0,52
3,9660 % Cerberus Ln Fd XV LP/C.Iss.LLC DL-FLR Nts 16(18/26) B Reg.S	USG2029CAF61		USD	500	500	%	99,690	444.132,58	1,06
4,6660 % Cerberus Ln Fd XV LP/C.Iss.LLC DL-FLR Nts 16(18/26) C Reg.S	USG2029CAG45		USD	500	500	%	97,980	436.514,30	1,04
2,6715 % Fifth Str.Sen.Ln Fd II Ltd/LLC DL-FLR Nts 2015(27) A-1T Reg.S	USG3416EAB05		USD	1.000		%	99,280	884.611,96	2,10
3,5615 % Fifth Str.Sen.Ln Fd II Ltd/LLC DL-FLR Nts 2015(27) A-2 Reg.S	USG3416EAD60		USD	500		%	99,280	442.305,98	1,05
2,4691 % FS Senior Funding Ltd./LLC DL-FLR Nts 2015(25) A-T Reg.S	USG36847AB00		USD	1.000		%	98,930	881.493,36	2,10
2,5776 % Golub Cap.Part.CLO 25M Ltd/LLC DL-FLR Nts 2015(27) A-1 Reg.S	USG2623PAA87		USD	800		%	98,860	704.695,71	1,68
0,0000 % ICG US CLO 2014-2 Ltd. DL-FLR Nts 2014(26) SUB Reg.S	USG47075AC33		USD	1.500		%	47,870	639.802,19	1,52
2,1956 % JFIN Revolver CLO 2015 Ltd/LLC DL-FLR Nts 15(23) Cl.A-1 Reg.S ³⁾	USG5137VAA73		USD	1.500		%	100,110	1.016.171,31	2,42
2,7956 % JFIN Revolver CLO 2015 Ltd/LLC DL-FLR Nts 15(23) Cl.B-1 Reg.S	USG5137VAC30		USD	1.000		%	100,000	891.027,35	2,12
5,0645 % NewStar Clarendon Fd CLO LLC DL-FLR Nts 15(15/27)Cl.D Reg.S	USU6526RAD18		USD	1.500		%	95,650	1.278.401,50	3,04
2,8254 % NewStar Coml Ln Fdg 2015-2 LLC DL-FLR Nts 2015(27) A-1 Reg.S	USU65267AA10		USD	500		%	99,920	445.157,27	1,06
3,7254 % NewStar Coml Ln Fdg 2015-2 LLC DL-FLR Nts 2015(27) Cl.B Reg.S	USU65267AB92		USD	500		%	98,770	440.033,86	1,05
0,0000 % WhiteHorse X Ltd. DL-FLR Nts 15(16/27) SUB Reg.S	USG96184AC38		USD	1.500		%	58,600	783.213,04	1,86

Summe Wertpapiervermögen²⁾

EUR 40.071.697,98 95,29

Derivate

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

EUR -36.968,73 -0,09

Devisen-Derivate

Forderungen/Verbindlichkeiten

EUR -36.968,73 -0,09

Finanzterminkontrakte auf Devisen

EUR -36.968,73 -0,09

FUTURE EUR/USD 19.12.16

Chicago - CME Globex

STK

Anzahl 80

-36.968,73

-0,09

Halbjahresbericht zum 30. September 2016
Infinigon Investmentgrade Collateralized Loan Fund BI
DE000A1T6FY8

Vermögensaufstellung zum 30.09.2016

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.09.2016	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds							EUR	1.571.814,61	3,74
Bankguthaben							EUR	1.571.814,61	3,74
Guthaben bei State Street Bank GmbH									
Guthaben in Fondswährung			EUR	1.035.964,77		%	100,000	1.035.964,77	2,46
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen			USD	601.384,28		%	100,000	535.849,84	1,28
Sonstige Vermögensgegenstände							EUR	499.073,16	1,19
Zinsansprüche			EUR	223.309,11				223.309,11	0,53
Forderungen aus geleisteten Sicherheitsleistungen in Nicht-EU/EWR-Währung			USD	41.490,00				36.968,72	0,09
Einschüsse (Initial Margin)			USD	268.000,00				238.795,33	0,57
Sonstige Verbindlichkeiten							EUR	-53.549,96	-0,13
Verwaltungsvergütung			EUR	-9.609,05				-9.609,05	-0,02
Prüfungs- und Veröffentlichungskosten			EUR	-13.819,98				-13.819,98	-0,03
Verwahrstellenvergütung			EUR	-4.375,98				-4.375,98	-0,01
Asset Management Vergütung			EUR	-25.744,95				-25.744,95	-0,07
Fondsvermögen							EUR	42.052.067,06	100,00 ¹⁾
Anteilwert							EUR	95,62	
Ausgabepreis							EUR	95,62	
Anteile im Umlauf							STK	439.805	

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.
- 3) Poolfaktoranleihe

Halbjahresbericht zum 30. September 2016

Infinigon Investmentgrade Collateralized Loan Fund BI

DE000A1T6FY8

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Devisenkurse (in Mengennotiz)

US-Dollar	(USD)	per 29.09.2016 1,1223000	= 1 EUR (EUR)
-----------	-------	-----------------------------	---------------

Marktschlüssel

Terminbörsen

Chicago - CME Globex

Halbjahresbericht zum 30. September 2016

Infinigon Investmentgrade Collateralized Loan Fund BI

DE000A1T6FY8

**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
---------------------	------	-------------------------------------	--------------------------	-----------------------------	---------------------

An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere

Verzinsliche Wertpapiere

0,0000 % Adagio IV CLO Ltd. EO-FLR Nts 2015(29) SUB Reg.S	XS1117289253	EUR		1.000	
0,0000 % Allegro CLO III Ltd. DL-FLR Nts 2015(27) SUB Reg.S	USG0177KAC92	USD		1.500	
2,1845 % Allegro CLO III Ltd./LLC DL-FLR Nts 2015(27) Cl.A Reg.S	USG01761AB48	USD		1.500	
2,1565 % Black Diam. CLO 12-1 Ltd./LLC DL-FLR Nts 2013(23) A-1 Reg.S ³⁾	USG1310HAB45	USD		1.000	
4,2791 % Black Diam.CLO 2013-1 Ltd./LLC DL-FLR Nts 2014(26) Cl.C Reg.S	USG1147PAE90	USD		1.500	
2,5020 % Cairn CLO IV B.V. EO-FLR Nts 2014(28) Cl.C Reg.S	XS1138678419	EUR		1.000	
0,0000 % Cairn CLO IV B.V. EO-FLR Nts 2014(28) SUB Reg.S	XS1138676983	EUR		1.500	
2,6801 % Cerberus Onshore II CLO LLC DL-FLR Nts 2014(23) A-1 Reg.S ³⁾	USU15688AA99	USD		2.500	
4,0301 % Cerberus Onshore II CLO-2 LLC DL-FLR Nts 2014(23) Cl.C Reg.S	USU15689AC39	USD		750	
3,6090 % Dryden 29 Euro CLO 2013 B.V. EO-FLR Nts 2013(26) Cl.D Reg.S	XS0995504577	EUR		1.000	
3,7110 % Herbert Park B.V. EO-FLR Nts 2013(26) Cl.C Reg.S	XS0962737895	EUR		1.000	
0,9510 % Jubilee CLO 2013-X B.V. EO-FLR Nts 2013(25) Cl.A Reg.S	XS0921330105	EUR		1.000	
3,8000 % Jubilee CLO 2015-XVI B.V. EO-FLR Nts 15(29) Cl.D Reg.S	XS1117282167	EUR		750	
2,1691 % Mountain View CLO X Ltd./LLC DL-FLR Nts 2015(27) A-1 Reg.S	USG6300VAB48	USD		1.000	
1,3000 % Oak Hill Europ.Credit Part.III EO-FLR Nts 2015(28)C.A-1 Reg.S	XS1227736805	EUR		1.500	
0,0880 % Queen Street CLO II B.V. EO-FLR Notes 07(24)Cl.A1 Reg.S	XS0302039416	EUR		107	
1,1030 % St. Paul's CLO IV Ltd. EO-FLR Nts 2014(28) A-1 Reg.S	XS1043108262	EUR		1.500	
3,7500 % Tymon Park CLO Ltd. EO-FLR Nts 2015(29) C Reg.S	XS1280876217	EUR		750	
4,4791 % WhiteHorse X Ltd./LLC DL-FLR Nts 2015(16/27) D Reg.S	USG9618HAE02	USD		1.000	

Nichtnotierte Wertpapiere

Verzinsliche Wertpapiere

0,0000 % KKR CLO 12 Ltd. DL-FLR Nts 2015(27) SUB Reg.S	USG5277UAB73	USD		1.000	
3,2500 % Orwell Park CLO Ltd. EO-FLR Nts 2015(29) C Reg.S	XS1229265241	EUR		750	

Halbjahresbericht zum 30. September 2016

Infinigon Investmentgrade Collateralized Loan Fund BI

DE000A1T6FY8

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
---------------------	------	-------------------------------------	--------------------------	-----------------------------	---------------------

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

Terminkontrakte

Finanzterminkontrakte auf Devisen

Gekaufte Kontrakte:

(Basiswert(e): EUR/USD FUTURES (EURO FX))

EUR

16.357,28

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 0,00 %.
 Ihr Umfang belief sich hierbei auf insgesamt 0,00 EUR.

3) Poolfaktoranleihe

Halbjahresbericht zum 30. September 2016

Infinigon Investmentgrade Collateralized Loan Fund BI

DE000A1T6FY8

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)	95,29
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)	-0,09

Sonstige Angaben

Anteilwert	EUR	95,62
Ausgabepreis	EUR	95,62
Anteile im Umlauf	STK	439.805

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 § 27 KARBV (Quelle: IBOXX) bzw. mit Verkehrswerten nach § 28 KARBV 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.