

**BayernInvest ESG Global Bond Opportunities**  
**Halbjahresbericht zum 31. August 2022**  
**für das Rumpfgeschäftsjahr**  
**vom 04. April 2022 bis 28. Februar 2023**

# Halbjahresbericht zum 31. August 2022

## BayernInvest ESG Global Bond Opportunities

### Vermögensübersicht zum 31.08.2022

Anlageschwerpunkte	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
<b>I. Vermögensgegenstände</b>	<b>32.592.612,20</b>	<b>100,90</b>
1. Anleihen	29.852.846,16	92,42
Corporates (inkl. Financials)	1.377.782,47	4,27
nicht zugeordnet	198.459,83	0,61
öffentliche Anleihen	26.245.443,76	81,25
Pfandbriefe, Kommunalobligationen	623.560,63	1,93
Sonderkreditinstitute, Supra-Nationale	1.407.599,47	4,36
2. Derivate	376.915,04	1,17
3. Forderungen	367.914,03	1,14
4. Bankguthaben	1.994.936,97	6,17
<b>II. Verbindlichkeiten</b>	<b>-291.005,59</b>	<b>-0,90</b>
<b>III. Fondsvermögen</b>	<b>32.301.606,61</b>	<b>100,00</b>

# Halbjahresbericht zum 31. August 2022

## BayernInvest ESG Global Bond Opportunities

### Vermögensaufstellung zum 31.08.2022

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.08.2022	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
<b>Bestandspositionen</b>							<b>EUR</b>	<b>29.852.846,16</b>	<b>92,42</b>
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>							<b>EUR</b>	<b>14.356.218,51</b>	<b>44,44</b>
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>							<b>EUR</b>	<b>14.356.218,51</b>	<b>44,44</b>
4,7500 % Australia, Commonwealth of... AD-Loans 2011(27) Ser.136	AU3TB0000135		AUD	680	680	%	106,030	491.578,27	1,52
2,1250 % Bpifrance SACA EO-Medium-Term Notes 2022(27)	FR001400BB83		EUR	500	500	%	100,316	501.581,90	1,55
1,2500 % Europäische Union EO-Medium-Term Notes 2022(43)	EU000A3K4DG1		EUR	240	240	%	79,955	191.892,67	0,59
0,2500 % European Investment Bank EO-Medium-Term Notes 2020(40)	XS2189259018		EUR	350	350	%	67,810	237.333,25	0,73
4,0000 % Fluvius System Operator CVBA EO-Med.-Term Notes 2022(22/32)	BE0002871524		EUR	100	100	%	103,719	103.719,40	0,32
4,7500 % Frankreich EO-OAT 2004(35)	FR0010070060		EUR	120	120	%	126,925	152.309,90	0,47
1,2500 % Frankreich EO-OAT 2016(36)	FR0013154044		EUR	180	180	%	87,101	156.782,25	0,49
2,0000 % Frankreich EO-OAT 2017(48)	FR0013257524		EUR	280	280	%	90,513	253.435,00	0,78
1,2500 % Frankreich EO-OAT 2018(34)	FR0013313582		EUR	170	170	%	89,349	151.893,93	0,47
2,8750 % Fresenius SE & Co. KGaA MTN v.2022(2030/2030)	XS2482872251		EUR	200	200	%	94,155	188.309,78	0,58
2,7500 % Investor AB EO-Med.-Term Notes 2022(22/32)	XS2481287634		EUR	140	140	%	96,977	135.767,66	0,42
3,0000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2019(29)	IT0005365165		EUR	905	905	%	97,842	885.470,10	2,74
0,0000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2021(24)	IT0005452989		EUR	1.505	1.505	%	95,826	1.442.180,10	4,46
2,6250 % Koninklijke Philips N.V. EO-Medium-Term Nts 2022(22/33)	XS2475955543		EUR	290	290	%	90,802	263.326,61	0,82
0,7500 % Kreditanst.f.Wiederaufbau Med.Term Nts. v.19(29)	DE000A2LQSN2		EUR	270	270	%	92,631	250.102,35	0,77
0,0000 % Kreditanst.f.Wiederaufbau Med.Term Nts. v.21(31)	DE000A3H2ZF6		EUR	270	270	%	83,959	226.689,30	0,70
3,3750 % Nederlandse Gasunie, N.V. EO-Medium-Term Nts 2022(22/34)	XS2498042584		EUR	200	200	%	99,519	199.037,84	0,62
4,0000 % Niederlande EO-Anl. 2005(37)	NL0000102234		EUR	290	290	%	124,401	360.762,90	1,12
2,7500 % Polen, Republik EO-Medium-Term Notes 2022(32)	XS2447602793		EUR	630	630	%	94,875	597.712,50	1,85
4,7000 % Spanien EO-Bonos 2009(41)	ES00000121S7		EUR	215	215	%	124,205	267.040,75	0,83
0,0000 % Spanien EO-Bonos 2020(25)	ES0000012F92		EUR	400	400	%	96,246	384.984,00	1,19
0,0000 % Spanien EO-Bonos 2021(27)	ES0000012J15		EUR	965	965	%	91,711	885.015,40	2,74
1,7070 % Toronto-Dominion Bank, The EO-Med.-Term Cov.Bds 2022(25)	XS2508690612		EUR	440	440	%	98,358	432.773,57	1,34
1,5000 % UniCredit Bank Austria AG EO-Med.-T.Hyp.Pf.-Br. 2022(28)	AT000B049911		EUR	200	200	%	95,394	190.787,06	0,59
2,0200 % Zürcher Kantonalbank EO-FLR Notes 2022(27/28)	CH1170565753		EUR	200	200	%	94,922	189.843,54	0,59
4,2500 % Großbritannien LS-Treasury Stock 2000(32)	GB0004893086		GBP	810	810	%	112,187	1.051.686,97	3,26
1,6250 % Großbritannien LS-Treasury Stock 2018(71)	GB00BFMCN652		GBP	240	240	%	67,995	188.863,12	0,58
1,2500 % Großbritannien LS-Treasury Stock 2020(41)	GB00BJQWYH73		GBP	170	170	%	72,202	142.055,18	0,44
2,5000 % Ungarn UF-Notes 2018(24) Ser.2024/C	HU0000403571		HUF	400.000	400.000	%	84,438	839.724,81	2,60
8,0000 % Mexiko MN-Bonos 2003(23)	MX0MGO000003		STK	50.000	50.000	MXN	99,539	245.954,01	0,76
2,5000 % Polen, Republik ZY-Bonds 2018(24) Ser.0424	PL0000111191		PLN	500	500	%	93,712	99.285,61	0,31
1,0000 % Schweden, Königreich SK-Loan 2015(26) Nr. 1059	SE0007125927		SEK	2.000	2.000	%	95,206	178.082,59	0,55
2,1250 % Singapur, Republik SD-Bonds 2016(26)	SG31A8000003		SGD	800	800	%	97,630	556.723,00	1,72
6,8750 % United States of America DL-Bonds 1995(25)	US912810EV62		USD	1.760	1.760	%	109,320	1.913.513,19	5,92

# Halbjahresbericht zum 31. August 2022

## BayernInvest ESG Global Bond Opportunities

### Vermögensaufstellung zum 31.08.2022

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.08.2022	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
<b>An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere</b>							<b>EUR</b>	<b>15.496.627,65</b>	<b>47,97</b>
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>							<b>EUR</b>	<b>15.496.627,65</b>	<b>47,97</b>
1,2500 % Canada CD-Bonds 2021(27)	CA135087M847		CAD	760	760	%	91,580	528.535,95	1,64
1,5000 % Canada CD-Bonds 2022(25)	CA135087N340		CAD	455	455	%	94,874	327.809,31	1,01
2,3750 % Alcon Finance B.V. EO-Notes 2022(22/28)	XS2486839298		EUR	210	210	%	94,505	198.459,83	0,61
1,8750 % Deutsche Bahn Finance GmbH Medium-Term Notes 2022(30)	XS2484327999		EUR	210	210	%	95,375	200.286,64	0,62
1,8750 % PPG Industries Inc. EO-Notes 2022(22/25)	XS2484339499		EUR	100	100	%	97,491	97.491,00	0,30
0,5000 % New Zealand, Government of... ND-Bonds 2021(26)	NZGOVDT526C0		NZD	540	540	%	88,524	291.475,14	0,90
3,7500 % Polen, Republik ZY-Bonds 2021(27) Ser. PS0527	PL0000114393		PLN	700	700	%	88,046	130.594,92	0,40
2,8750 % Canada DL-Bonds 2022(25)	US135087N757		USD	1.260	1.260	%	98,309	1.231.917,85	3,81
4,2500 % United States of America DL-Bonds 2010(40)	US912810QL52		USD	1.560	1.560	%	111,836	1.735.098,56	5,37
1,2500 % United States of America DL-Bonds 2021(31)	US91282CCS89		USD	1.510	1.510	%	84,926	1.275.364,79	3,95
2,3750 % United States of America DL-Bonds 2021(51)	US912810SX72		USD	1.100	1.100	%	82,000	897.066,14	2,78
1,5000 % United States of America DL-Notes 2016(26)	US9128282A70		USD	2.550	2.550	%	92,762	2.352.485,14	7,28
2,3750 % United States of America DL-Notes 2019(29)	US9128286T26		USD	600	600	%	94,145	561.777,41	1,74
0,1250 % United States of America DL-Notes 2020(22)	US91282CBD20		USD	1.200	1.200	%	99,023	1.181.781,46	3,66
0,1250 % United States of America DL-Notes 2020(23)	US91282CAP68		USD	3.710	3.710	%	96,361	3.555.450,29	11,01
1,2500 % United States of America DL-Notes 2021(28)	US91282CCY57		USD	1.060	1.060	%	88,316	931.033,22	2,88
<b>Summe Wertpapiervermögen<sup>2)</sup></b>							<b>EUR</b>	<b>29.852.846,16</b>	<b>92,42</b>
<b>Derivate</b>							<b>EUR</b>	<b>376.915,04</b>	<b>1,17</b>
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)									
<b>Zins-Derivate</b>							<b>EUR</b>	<b>249.650,00</b>	<b>0,77</b>
Forderungen/Verbindlichkeiten									
<b>Zinsterminkontrakte</b>							<b>EUR</b>	<b>249.650,00</b>	<b>0,77</b>
FUTURE 8,5-10Yr. Ita. Rep. Government Bonds 08.09.22	Eurex Deutschland		EUR	-2.500.000				24.750,00	0,08
FUTURE Bundesrep. Deutschland Euro-BUXL 08.09.22	Eurex Deutschland		EUR	-1.000.000				224.900,00	0,70

# Halbjahresbericht zum 31. August 2022

## BayernInvest ESG Global Bond Opportunities

### Vermögensaufstellung zum 31.08.2022

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.08.2022	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
<b>Devisen-Derivate</b>							<b>EUR</b>	<b>127.265,04</b>	<b>0,39</b>
Forderungen/Verbindlichkeiten									
<b>Devisenterminkontrakte (Verkauf)</b>							<b>EUR</b>	<b>374.196,20</b>	<b>1,16</b>
<b>Offene Positionen</b>									
CAD/USD	3,0 Mio.		OTC					51.727,29	0,16
HUF/EUR	450,0 Mio.		OTC					16.965,21	0,05
JPY/AUD	200,0 Mio.		OTC					69.966,21	0,22
JPY/EUR	1.490,0 Mio.		OTC					289.889,76	0,90
MXN/USD	40,0 Mio.		OTC					-37.688,62	-0,12
NOK/USD	20,0 Mio.		OTC					40.803,88	0,13
USD/EUR	5,0 Mio.		OTC					-81.662,19	-0,25
ZAR/USD	30,0 Mio.		OTC					24.194,66	0,07
<b>Devisenterminkontrakte (Kauf)</b>							<b>EUR</b>	<b>-246.931,16</b>	<b>-0,76</b>
<b>Offene Positionen</b>									
CNH/EUR	2,2 Mio.		OTC					-1.913,73	-0,01
HUF/EUR	450,0 Mio.		OTC					24.713,81	0,08
JPY/AUD	400,0 Mio.		OTC					-31.290,73	-0,10
JPY/EUR	1.890,0 Mio.		OTC					-222.043,10	-0,69
NOK/USD	20,0 Mio.		OTC					-16.397,41	-0,05

# Halbjahresbericht zum 31. August 2022

## BayernInvest ESG Global Bond Opportunities

### Vermögensaufstellung zum 31.08.2022

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.08.2022	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
<b>Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds</b>							<b>EUR</b>	<b>1.994.936,97</b>	<b>6,17</b>
<b>Bankguthaben</b>							<b>EUR</b>	<b>1.994.936,97</b>	<b>6,17</b>
Guthaben bei State Street Bank International GmbH									
Guthaben in Fondswährung			EUR	1.408.197,09			EUR	1.408.197,09	4,36
Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen			HUF	452.400,00			EUR	1.124,77	0,00
			PLN	36.681,00			EUR	7.772,53	0,02
			SEK	11.005,62			EUR	1.029,30	0,00
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen			AUD	66.015,21			EUR	45.009,18	0,14
			CAD	4.519,10			EUR	3.431,74	0,01
			GBP	16.633,65			EUR	19.250,70	0,06
			JPY	825,00			EUR	5,92	0,00
			MXN	203.232,43			EUR	10.043,52	0,03
			NZD	231.036,33			EUR	140.873,55	0,44
			SGD	15.263,95			EUR	10.880,10	0,03
			USD	348.973,67			EUR	347.064,81	1,07
			ZAR	4.349,04			EUR	253,76	0,00
<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>							<b>EUR</b>	<b>367.914,03</b>	<b>1,14</b>
Zinsansprüche			EUR	155.368,03			EUR	155.368,03	0,48
Quellensteuerforderungen			EUR	397,30			EUR	397,30	0,00
Einschüsse (Initial Margin)			EUR	212.148,70			EUR	212.148,70	0,66
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>							<b>EUR</b>	<b>-291.005,59</b>	<b>-0,90</b>
Verwaltungsvergütung			EUR	-14.017,19			EUR	-14.017,19	-0,04
Zinsverbindlichkeiten			EUR	-0,10			EUR	-0,10	0,00
Prüfungs- und Veröffentlichungskosten			EUR	-3.039,94			EUR	-3.039,94	-0,01
Verwahrstellenvergütung			EUR	-24.298,36			EUR	-24.298,36	-0,08
Verbindlichkeiten aus erhaltenen Sicherheitsleistungen in Fondswährung			EUR	-249.650,00			EUR	-249.650,00	-0,77
<b>Fondsvermögen</b>							<b>EUR</b>	<b>32.301.606,61</b>	<b>100,00</b> <sup>1)</sup>

# Halbjahresbericht zum 31. August 2022

## BayernInvest ESG Global Bond Opportunities

### Vermögensaufstellung zum 31.08.2022

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.08.2022	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
<b>BayernInvest ESG Global Bond Opportunities AK A</b>									
Anzahl Anteile							STK	4.000	
Ausgabepreis							EUR	101,48	
Rücknahmepreis							EUR	98,05	
Inventarwert							EUR	392.183,03	
Anteilwert							EUR	98,05	
<b>BayernInvest ESG Global Bond Opportunities AK I</b>									
Anzahl Anteile							STK	32.350	
Ausgabepreis							EUR	986,38	
Rücknahmepreis							EUR	986,38	
Inventarwert							EUR	31.909.423,58	
Anteilwert							EUR	986,38	

#### 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 zum 31. August 2022

## BayernInvest ESG Global Bond Opportunities

### Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

### Devisenkurse (in Mengennotiz)

		per 31.08.2022	
Australische Dollar	(AUD)	1,4667056	= 1 EUR (EUR)
Kanadische Dollar	(CAD)	1,3168531	= 1 EUR (EUR)
Englische Pfund	(GBP)	0,8640543	= 1 EUR (EUR)
Ungarische Forint	(HUF)	402,2151030	= 1 EUR (EUR)
Japanische Yen	(JPY)	139,3974950	= 1 EUR (EUR)
Mexikanische Pesos	(MXN)	20,2351853	= 1 EUR (EUR)
Neuseeland-Dollar	(NZD)	1,6400263	= 1 EUR (EUR)
Zloty (Polen)	(PLN)	4,7193143	= 1 EUR (EUR)
Schwedische Kronen	(SEK)	10,6922861	= 1 EUR (EUR)
Singapur-Dollar	(SGD)	1,4029239	= 1 EUR (EUR)
US-Dollar	(USD)	1,0055000	= 1 EUR (EUR)
Südafrikanische Rand	(ZAR)	17,1383958	= 1 EUR (EUR)

### Marktschlüssel

#### Terminbörsen

Eurex Deutschland

Frankfurt am Main - Eurex Deutschland

OTC

Over-the-Counter



# Halbjahresbericht zum 31. August 2022

## BayernInvest ESG Global Bond Opportunities

**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

#### Zinsterminkontrakte

Gekaufte Kontrakte:

(Basiswert(e): 10Y.US TRE.NT., 30Y.US TRE.BD., 5Y.US TRE.NT., 8,5-10Y.ITA.GOV.BD., EURO-BUND, EURO-BUXL)

EUR

63.385,77

Verkaufte Kontrakte:

(Basiswert(e): 10Y.US TRE.NT., 30Y.US TRE.BD., 5Y.US TRE.NT., 8,5-10Y.ITA.GOV.BD., EURO-BOBL, EURO-BUND, EURO-BUXL)

EUR

56.610,86

#### Devisenterminkontrakte (Verkauf)

Verkauf von Devisen auf Termin:

AUD/EUR	EUR	1.015
CAD/USD	EUR	8.895
GBP/EUR	EUR	4.689
JPY/AUD	EUR	2.148
JPY/EUR	EUR	8.904
MXN/USD	EUR	16.299
MXN/ZAR	EUR	1.835
NOK/EUR	EUR	5.913
NZD/AUD	EUR	1.519
NZD/EUR	EUR	1.200
PLN/USD	EUR	1.715
SEK/EUR	EUR	3.800
USD/AUD	EUR	872
USD/EUR	EUR	9.276
USD/NZD	EUR	8.806
ZAR/USD	EUR	15.717

## Halbjahresbericht zum 31. August 2022

### BayernInvest ESG Global Bond Opportunities

**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
<b>Devisenterminkontrakte (Kauf)</b>					
Kauf von Devisen auf Termin:					
AUD/EUR		EUR			1.013
AUD/USD		EUR			1.985
CAD/USD		EUR			6.649
CNH/EUR		EUR			624
GBP/EUR		EUR			2.366
HUF/EUR		EUR			2.254
JPY/AUD		EUR			3.528
JPY/EUR		EUR			19.402
MXN/USD		EUR			14.408
NOK/EUR		EUR			5.871
NZD/AUD		EUR			1.523
NZD/EUR		EUR			1.212
PLN/USD		EUR			1.681
SEK/EUR		EUR			3.762
USD/AUD		EUR			2.872
USD/NZD		EUR			2.848
ZAR/USD		EUR			9.999

### 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.

# Halbjahresbericht zum 31. August 2022

## BayernInvest ESG Global Bond Opportunities

### Informationen zu den Anteilklassen

	Anteilklasse I	Anteilklasse A
ISIN	DE000A2QMKE6	DE000A2QMKF3
Auflegungsdatum	04.04.2022	04.04.2022
Erstausgabepreis	1.000,00	100,00
Mindestanlage	10.000,00	keine
Währung	EUR	EUR
Fondsvermögen	31.909.423,58	392.183,03
Umlaufende Anteile	32.350	4.000
Anteilwert	986,38	98,05
Ertragsverwendung	ausschüttend	ausschüttend
Verwaltungsvergütung	0,50%	1,10%
Ausgabeaufschlag	0,00%	3,50%

# Halbjahresbericht zum 31. August 2022

## BayernInvest ESG Global Bond Opportunities

### Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)	92,42
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)	1,17

### Sonstige Angaben

#### BayernInvest ESG Global Bond Opportunities AK A

Anzahl Anteile	STK	4.000
Ausgabepreis	EUR	101,48
Rücknahmepreis	EUR	98,05
Inventarwert	EUR	392.183,03
Anteilwert	EUR	98,05

#### BayernInvest ESG Global Bond Opportunities AK I

Anzahl Anteile	STK	32.350
Ausgabepreis	EUR	986,38
Rücknahmepreis	EUR	986,38
Inventarwert	EUR	31.909.423,58
Anteilwert	EUR	986,38

# Halbjahresbericht zum 31. August 2022

## BayernInvest ESG Global Bond Opportunities

### Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

#### Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände

- Aktien, börsengehandelte Derivate und Investmentfonds werden mit handelbaren Börsenkursen (auf Schlusskursbasis) bewertet (Quelle: Refinitiv, Bloomberg, Heimatbörse).
- 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 Refinitiv, 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: Value&Risk, Bloomberg).
- Nicht börsennotierte Investmentfonds werden mit dem von der Investmentgesellschaft zuletzt veröffentlichten Rücknahmepreis (NAV) bewertet (Quelle: Refinitiv, Investmentgesellschaften, Bloomberg).
- Devisenkassamittelkurse werden börsentäglich um 17 Uhr von Refinitiv bereitgestellt. 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.
- Bankguthaben werden zum Nennwert, Festgelder zum Verkehrswert und Forderungen und Verbindlichkeiten zum Rückzahlungsbetrag bewertet.

Der BayernInvest ESG Global Bond Opportunities hat im Berichtszeitraum 04.04.2022 bis 31.08.2022 keine Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Gesamtrendite-Swaps gem. Artikel 3 der Verordnung (EU) 2015/2365 getätigt. Aufgrund dessen entfallen die Angaben zu den Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Gesamtrendite-Swaps, die im Anhang Abschnitt A der Verordnung (EU) 2015/2365 (SFT-VO) vorgegeben sind.

München, im September 2022

#### BayernInvest Kapitalverwaltungsgesellschaft mbH

Alexander Mertz, Sprecher

Marjan Galun