



MPF Herkules

Halbjahresbericht für die Zeit vom:
01.07.2023 - 31.12.2023

Herausgeber dieses Jahresberichtes:

BANTLEON Invest AG

An der Börse 7, 30159 Hannover

Postanschrift: Postfach 4505

30045 Hannover

Telefon +49 511 12354-0; Telefax: +49 511 12354-333

<https://www.bantleon-invest-ag.de/>

Hinweis:

Allein verbindliche Grundlage für den Erwerb von Fondsanteilen der hier aufgeführten Fonds ist der jeweils gültige Verkaufsprospekt mit den Vertragsbedingungen.

Halbjahresbericht für MPF Herkules

Vermögensübersicht zum 31.12.2023

Anlageschwerpunkte	Tageswert in EUR	% Anteil am Fondsvermögen
I. Vermögensgegenstände	256.959.960,14	100,03
1. Verzinsliche Wertpapiere	50.957.633,44	19,84
2. Zertifikate	140.949.395,00	54,87
3. Investmentanteile	63.254.777,04	24,63
4. Forderungen	1.172.913,72	0,46
5. Bankguthaben	625.240,94	0,24
II. Verbindlichkeiten	-88.710,86	-0,03
III. Fondsvermögen	256.871.249,28	100,00 ¹⁾

1) Auf Grund von Rundung bei der Berechnung % Anteil am Fondsvermögen, kann es zu geringfügigen Rundungsdifferenzen kommen.

Halbjahresbericht für MPF Herkules

Vermögensaufstellung zum 31.12.2023

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.12.2023	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens	
Bestandspositionen										
Börsengehandelte Wertpapiere							EUR	63.803.049,73	24,84	
Verzinsliche Wertpapiere										
3,1250 % Bayer AG FLR-Sub.Anl.v.2019(2027/2079)	XS2077670342		EUR	6.000	0	0	%	90,5353	5.432.120,34	2,11
6,6250 % Bayer AG FLR-Sub.Anl.v.2023(2028/2083)	XS2684826014		EUR	5.500	5.500	0	%	101,9909	5.609.501,92	2,18
1,7500 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.2014 (2024)	DE0001102333		EUR	1.000	1.000	0	%	99,7753	997.753,02	0,39
5,6250 % Deutsche Bank AG Sub.FLR-MTN v20(26/31)	DE000DL19VB0		EUR	11.000	0	1.000	%	101,2024	11.132.267,30	4,33
4,6790 % Deutsche Pfandbriefbank AG Nachr.FLR-MTN R35281 17(22/27)	XS1637926137		EUR	6.000	0	0	%	73,8023	4.428.135,72	1,72
4,6250 % Volkswagen Intl Finance N.V. EO-FLR Notes 2014(26/Und.)	XS1048428442		EUR	5.000	0	0	%	99,4787	4.973.934,75	1,94
4,6250 % Volkswagen Intl Finance N.V. EO-FLR Notes 2018(28/Und.)	XS1799939027		EUR	6.000	0	0	%	97,1573	5.829.436,68	2,27
3,8750 % Volkswagen Intl Finance N.V. EO-FLR Notes 2020(29/Und.)	XS2187689380		EUR	10.000	0	0	%	91,5000	9.150.000,00	3,56
Zertifikate										
Bqe International à Luxembourg EXPRESS Z.10.12.27 Basket	CH0585068999		STK	10.000	0	0	EUR	1.089,4400	10.894.400,00	4,24
Bqe International à Luxembourg EXPRESS Z.29.03.28 BSKT	CH0585070987		EUR	5.000	0	0	%	107,1100	5.355.500,00	2,08
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere							EUR	128.103.978,71	49,87	
Verzinsliche Wertpapiere										
2,6000 % Allianz SE FLR-Sub.Ter.Nts.v.21(31/unb.)	DE000A3E5TR0		EUR	4.600	0	0	%	72,5611	3.337.808,71	1,30
5,5000 % SIGNA Development Fin.S.C.S. EO-Notes 2021(21/26) Reg.S	DE000A3KS5R1		EUR	700	0	0	%	9,5250	66.675,00	0,03
Zertifikate										
Credit Suisse AG EXPR. Z23.07.29 SX5E	DE000CS8DR68		STK	50.000	0	0	EUR	108,0500	5.402.500,00	2,10
J.P. Morgan Struct. Prod. B.V. AUTOC.Z 07.03.30 Basket	XS2487076403		STK	8.000	8.000	0	EUR	1.005,6200	8.044.960,00	3,13
J.P. Morgan Struct. Prod. B.V. Autoc.Z 11.06.29 Basket	XS2487079506		STK	7.500	0	0	EUR	1.151,4200	8.635.650,00	3,36
J.P. Morgan Struct. Prod. B.V. AUTOC.Z 13.05.30 Basket	XS2487075348		STK	15.000	15.000	0	EUR	1.024,4900	15.367.350,00	5,98
J.P. Morgan Struct. Prod. B.V. Autoc.Z 24.01.28 Basket	XS2487081668		STK	5.000	0	0	EUR	1.075,8600	5.379.300,00	2,09
J.P. Morgan Struct. Prod. B.V. Autoc.Z 25.01.29 Basket	XS2487080934		STK	9.000	0	0	EUR	1.204,2000	10.837.800,00	4,22
Nordea Bank Abp NOTES 09.12.29 Index-Basket	XS2631815813		EUR	8.500	0	0	%	106,0800	9.016.800,00	3,51
Nordea Bank Abp NOTES 17.01.30 Index-Basket	XS2631820060		EUR	8.500	0	0	%	105,8900	9.000.650,00	3,50
UniCredit Bank GmbH HVB EXP.PL 29.09.28 Basket	DE000HVB5B15		STK	10.000	0	0	EUR	1.089,3100	10.893.100,00	4,24
UniCredit Bank GmbH HVB EXP.PL.Z03.05.30 Basket	DE000HVB8D44		STK	10.000	10.000	0	EUR	1.047,6900	10.476.900,00	4,08
UniCredit Bank GmbH HVB EXP.PL.Z05.03.30 Basket	DE000HVB87F0		STK	8.000	8.000	0	EUR	1.024,6200	8.196.960,00	3,19
UniCredit Bank GmbH HVB EXP.PL.Z15.02.30 Basket	DE000HVB8560		STK	7.500	7.500	0	EUR	1.021,8900	7.664.175,00	2,98
UniCredit Bank GmbH HVB EXP.PL.Z17.01.30 Basket	DE000HVB81U2		STK	10.000	10.000	0	EUR	1.053,3050	10.533.050,00	4,10
UniCredit Bank GmbH HVB EXP.PL.Z17.01.30 Basket	DE000HVB81V0		STK	5.000	5.000	0	EUR	1.050,0600	5.250.300,00	2,04

Halbjahresbericht für MPF Herkules

Vermögensaufstellung zum 31.12.2023

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.12.2023	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens	
Investmentanteile							EUR	63.254.777,04	24,63	
Gruppenfremde Investmentanteile										
AIS-Amundi S&P Global Luxury Namens-Anteile C Cap.EUR o.N.	LU1681048630		ANT	13.000	0	0	EUR	202,2498	2.629.247,40	1,02
DJE - Dividende & Substanz Inhaber-Anteile XP (EUR) o.N.	LU0229080733		ANT	12.000	0	5.000	EUR	306,1500	3.673.800,00	1,43
DJE-Asien Inhaber-Anteile XP (EUR) o.N.	LU0374457033		ANT	11.500	0	0	EUR	192,1400	2.209.610,00	0,86
DJE-Mittelstand + Innovation Namens-Anteile XP (EUR) o.N.	LU1227571020		ANT	21.000	0	11.860	EUR	192,8800	4.050.480,00	1,58
DWS Concept - Platow Inhaber-Anteile IC5 o.N.	LU1865032871		ANT	50.000	0	11.500	EUR	134,2800	6.714.000,00	2,61
iShsIII-Core MSCI World U.ETF Registered Shs USD (Acc) o.N.	IE00B4L5Y983		ANT	443.000	0	0	EUR	82,0780	36.360.554,00	14,16
MUL Amundi M AC Asia-ex-Japan UCITS ETF Inh.Anteile Acc	LU1900068161		ANT	35.000	0	25.000	EUR	113,2800	3.964.800,00	1,54
VE MST US Sust. MOAT UC.ETF Registered Shares A o.N.	IE00BQQP9H09		ANT	75.000	0	25.000	EUR	48,6971	3.652.285,64	1,42
Summe Wertpapiervermögen							EUR	255.161.805,48	99,33	
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrument und Geldmarktfonds							EUR	625.240,94	0,24	
Bankguthaben							EUR	625.240,94	0,24	
EUR - Guthaben bei:										
M.M.Warburg & CO [AG & Co.] KGaA			EUR	625.240,94			%	100,0000	625.240,94	0,24
Sonstige Vermögensgegenstände							EUR	1.172.913,72	0,46	
Zinsansprüche			EUR	1.172.913,72					1.172.913,72	0,46
Sonstige Verbindlichkeiten							EUR	-88.710,86	-0,03	
Verwaltungsvergütung			EUR	-28.611,17					-28.611,17	-0,01
Verwahrstellenvergütung			EUR	-4.838,39					-4.838,39	0,00
Externe Management-/Beratungsvergütung			EUR	-48.790,58					-48.790,58	-0,02
Prüfungskosten			EUR	-4.688,41					-4.688,41	0,00
Veröffentlichungskosten			EUR	-1.782,31					-1.782,31	0,00
Fondsvermögen							EUR	256.871.249,28	100,00 1)	
MPF Herkules										
Anteilwert							EUR	177,02		
Anzahl Anteile							STK	1.451.091,000		

Fußnoten:

1) Auf Grund von Rundung bei der Berechnung % Anteil am Fondsvermögen, kann es zu geringfügigen Rundungsdifferenzen kommen.

Halbjahresbericht für MPF Herkules

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Halbjahresbericht für MPF Herkules

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

3,7500 % Bayer AG FLR-Sub.Anl.v.2014(2024/2074)	DE000A11QR73	EUR	0	5.500	
---	--------------	-----	---	-------	--

An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere

Zertifikate

J.P. Morgan Struct. Prod. B.V. Autoc.Z 10.11.27 Basket	XS2487081403	STK	0	5.000	
--	--------------	-----	---	-------	--

Nichtnotierte Wertpapiere

Verzinsliche Wertpapiere

3,7500 % Bayer AG z.Verkauf eing.Anl(2024/2074)	DE000A351397	EUR	5.500	5.500	
0,0000 % Bundesrep.Deutschland Bundesobl.Ser.178 v.2018(23)	DE0001141786	EUR	3.800	9.300	
0,0000 % Bundesrep.Deutschland Bundesschatzanw. v.21(23)	DE0001104867	EUR	7.900	7.900	

Zertifikate

BNP Paribas Issuance B.V. Athena W.of Z.04.09.28 Basket	XS2355880720	STK	0	75	
BNP Paribas Issuance B.V. Athena W.of Z.16.07.24 Basket	XS1686394062	STK	0	10.000	
Credit Suisse AG Expr.Z.04.09.28 SX5E	DE000CS8DKW5	STK	0	75.000	
UniCredit Bank AG HVB EXP.PL Z11.08.28 Basket	DE000HVB5533	STK	0	6.500	

Halbjahresbericht für MPF Herkules

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

Investmentanteile

Gruppenfremde Investmentanteile

Baillie Gif.W.Fds-Pos.Change F Reg. Shares B EUR Acc. o.N.	IE00BDCY2C68	ANT	0	300.000	
CHOM CAPITAL Act.Ret.Europe UI Inhaber-Anteile AK I	DE000A1JCWS9	ANT	0	30.000	

Derivate

Optionsrechte

Optionsrechte auf Aktienindex-Derivate

Optionsrechte auf Aktienindices

Verkaufte Verkaufsoptionen (Put): (Basiswert(e): ESTX 50 PR.EUR)			EUR		151,01
---	--	--	-----	--	--------

Halbjahresbericht für MPF Herkules

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)	99,33
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)	0,00

Sonstige Angaben

MPF Herkules

Anteilwert	EUR	177,02
Anzahl Anteile	STK	1.451.091,000

Angewandte Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände (§§ 26 bis 29 und 34 KARBV)

Das im Folgenden dargestellte Vorgehen bei der Bewertung der Vermögensgegenstände des Sondervermögens findet auch in Zeiten höherer Marktvolatilitäten oder auftretender Marktverwerfungen im Zusammenhang mit den Auswirkungen der Coronavirus-Pandemie Anwendung. Darüber hinausgehende Bewertungsanpassungen waren nicht erforderlich.

Der Anteilwert wird gem. § 169 KAGB von der Bantleon Invest AG ermittelt.

Die der Anteilwertermittlung im Falle von handelbaren Kursen zugrunde liegenden Wertpapierkurse bzw. Marktsätze werden von der Gesellschaft täglich selbst über verschiedene Datenanbieter bezogen. Dabei erfolgt die Bewertung für Rentenpapiere mit Kursen per 17:15 Uhr des Börsenvortages und die Bewertung von Aktien und börsengehandelten Aktienderivaten mit Schlusskursen des Börsenvortages. Die Einspielung von Zinskurven sowie Kassa- und Terminkursen für die Bewertung von Devisentermingeschäften und Rentenderivaten erfolgt parallel zu den Rentenpapieren mit Kursen per 17:15 Uhr.

Für Vermögensgegenstände, die weder zum Handel an einer Börse noch an einem organisierten Markt zugelassen sind oder für die kein handelbarer Kurs verfügbar ist, werden gem. § 168 Abs. 3 KAGB die Verkehrswerte zugrunde gelegt, die sich bei sorgfältiger Einschätzung auf Basis geeigneter Bewertungsmodelle unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten ergeben (§ 28 Abs. 1 KARBV). Die Verkehrswerte werden in einem mehrstufigen Bewertungsverfahren ermittelt. Die der Anteilwertermittlung im Falle von nicht handelbaren Kursen zugrunde liegenden Wertpapierkurse bzw. Marktsätze werden soweit möglich aus Kursen vergleichbarer Wertpapiere bzw. Renditekursen abgeleitet.

Die bezogenen Kurse werden täglich auf Vollständigkeit und Plausibilität geprüft. Hierzu prüft die Gesellschaft in Abhängigkeit von der Assetklasse die Kursbewegungen zum Vortag, die Kursaktualität, die Abweichungen gegen weitere Kursquellen sowie die Inputparameter für Modellbewertungen.

Investmentanteile werden mit ihrem letzten festgestellten und erhältlichen Net Asset Value bewertet.

Die Bankguthaben und übrigen Forderungen werden mit dem Nominalbetrag, die übrigen Verbindlichkeiten mit dem Rückzahlungsbetrag angesetzt. Festgelder werden - sofern sie kündbar sind und die Rückzahlung bei der Kündigung nicht zum Nennwert zuzüglich Zinsen erfolgt - mit dem Verkehrswert bewertet.

Weitere zum Verständnis des Berichts erforderliche Angaben

Für den vorliegenden Zeitraum sind keine weiteren Angaben erforderlich.

**Halbjahresbericht
für MPF Herkules**

Hannover, den 13. Februar 2024

BANTLEON Invest AG
(vormals Warburg Invest AG)

Caroline Specht

Gerd Lückel