



MPF Protection

**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 Protection

Vermögensübersicht zum 31.12.2023

Anlageschwerpunkte	Tageswert in EUR	% Anteil am Fondsvermögen
I. Vermögensgegenstände	21.520.107,66	100,06
1. Verzinsliche Wertpapiere	12.536.545,89	58,29
2. Zertifikate	6.370.515,88	29,62
3. Investmentanteile	2.298.184,00	10,69
4. Forderungen	189.558,61	0,88
5. Bankguthaben	125.303,28	0,58
II. Verbindlichkeiten	-13.327,27	-0,06
III. Fondsvermögen	21.506.780,39	100,00 ¹⁾

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

Halbjahresbericht für MPF Protection

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	13.596.272,53	63,22
Verzinsliche Wertpapiere										
3,1250 % Bayer AG FLR-Sub.Anl.v.2019(2027/2079)	XS2077670342		EUR	1.500	0	0	%	90,5353	1.358.030,09	6,31
6,6250 % Bayer AG FLR-Sub.Anl.v.2023(2028/2083)	XS2684826014		EUR	1.000	1.000	0	%	101,9909	1.019.909,44	4,74
7,0000 % Bayer AG FLR-Sub.Anl.v.2023(2031/2083)	XS2684846806		EUR	800	800	0	%	103,4368	827.494,35	3,85
1,7500 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.2014 (2024)	DE0001102333		EUR	2.500	2.500	0	%	99,7753	2.494.382,55	11,60
1,3750 % Commerzbank AG Sub.Fix to Reset MTN 21(26/31)	DE000CZ45WV5		EUR	400	0	0	%	89,7406	358.962,42	1,67
0,2500 % Corporación Andina de Fomento EO-Medium-Term Notes 2021(26)	XS2296027217		EUR	500	0	0	%	93,4191	467.095,40	2,17
5,6250 % Deutsche Bank AG Sub.FLR-MTN v20(26/31)	DE000DL19VB0		EUR	500	0	0	%	101,2024	506.012,15	2,35
4,6790 % Deutsche Pfandbriefbank AG Nachr.FLR-MTN R35281 17(22/27)	XS1637926137		EUR	200	0	0	%	73,8023	147.604,52	0,69
4,5000 % Lb.Hessen-Thüringen GZ FLR-MTN S.H354 v.22(27/32)	XS2489772991		EUR	1.000	0	0	%	95,5719	955.719,40	4,44
0,2500 % UBS Group AG EO-FLR Med.Trm.Nts.2021(25/26)	CH1142231682		EUR	400	400	0	%	93,7493	374.997,04	1,74
4,6250 % Volkswagen Intl Finance N.V. EO-FLR Notes 2014(26/Und.)	XS1048428442		EUR	1.000	0	0	%	99,4787	994.786,95	4,63
4,6250 % Volkswagen Intl Finance N.V. EO-FLR Notes 2018(28/Und.)	XS1799939027		EUR	1.200	0	0	%	97,1573	1.165.887,34	5,42
3,8750 % Volkswagen Intl Finance N.V. EO-FLR Notes 2020(29/Und.)	XS2187689380		EUR	1.500	0	0	%	91,5000	1.372.500,00	6,38
Zertifikate										
Bqe International à Luxembourg EXPRESS Z.08.12.27 Basket	CH0585068981		STK	1.000	0	0	EUR	1.065,5800	1.065.580,00	4,95
BNP Paribas Issuance B.V. ATHENA Z 16.03.29 S&P 500	XS2426370115		STK	5	0	0	USD	108.095,3000	487.310,88	2,27
								EUR	5.310.789,24	24,69
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere										
Verzinsliche Wertpapiere										
2,6000 % Allianz SE FLR-Sub.Ter.Nts.v.21(31/Unb.)	DE000A3E5TR0		EUR	400	0	0	%	72,5611	290.244,24	1,35
0,0000 % Credit Suisse AG EURO STOXX Exp.-Zt. 22/12.1.28	DE000CS8DHM2		STK	2.000	0	0	EUR	101,4600	202.920,00	0,94
Zertifikate										
J.P. Morgan Struct. Prod. B.V. AUTOC.Z 23.08.29 Basket	XS2487078870		STK	500	0	0	EUR	1.033,8700	516.935,00	2,40
J.P. Morgan Struct. Prod. B.V. Autoc.Z 25.09.27 Basket	XS2487080777		STK	500	0	0	EUR	1.084,3100	542.155,00	2,52
Nordea Bank Abp NOTES 22.11.27 Index-Basket	XS2334471880		EUR	500	0	0	%	111,0350	555.175,00	2,58
Nordea Bank Abp NOTES 29.11.27 Index-Basket	XS2334472342		EUR	500	0	0	%	107,8100	539.050,00	2,51
UniCredit Bank GmbH HVB EXP.PL 29.09.28 Basket	DE000HVB5B15		STK	500	0	0	EUR	1.089,3100	544.655,00	2,53
UniCredit Bank GmbH HVB EXP.PL.Z13.03.30 Basket	DE000HVB8875		STK	550	550	0	EUR	1.017,1000	559.405,00	2,60
UniCredit Bank GmbH HVB EXP.PL.Z21.01.30 Basket	DE000HVB82J3		STK	250	250	0	EUR	1.017,6100	254.402,50	1,18
UniCredit Bank GmbH HVB EXP.PL.Z21.01.30 Basket	DE000HVB82H7		STK	250	250	0	EUR	1.019,7500	254.937,50	1,19
UniCredit Bank GmbH HVB Expr.Z11.06.30 BSKT	DE000HVB8G58		STK	1.000	1.000	0	EUR	1.050,9100	1.050.910,00	4,89

Halbjahresbericht für MPF Protection

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	2.298.184,00	10,69	
Gruppenfremde Investmentanteile										
iShsIII-Core MSCI World U.ETF Registered Shs USD (Acc) o.N.	IE00B4L5Y983		ANT	28.000	0	0	EUR	82,0780	2.298.184,00	10,69
Summe Wertpapiervermögen							EUR	21.205.245,77	98,60	
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrument und Geldmarktfonds							EUR	125.303,28	0,58	
Bankguthaben							EUR	125.303,28	0,58	
EUR - Guthaben bei:										
M.M.Warburg & CO [AG & Co.] KGaA				EUR	125.209,96		%	100,0000	125.209,96	0,58
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen										
				USD	103,50		%	100,0000	93,32	0,00
Sonstige Vermögensgegenstände							EUR	189.558,61	0,88	
Zinsansprüche				EUR	189.558,61				189.558,61	0,88
Sonstige Verbindlichkeiten							EUR	-13.327,27	-0,06	
Verwaltungsvergütung				EUR	-2.509,14				-2.509,14	-0,01
Verwahrstellenvergütung				EUR	-471,44				-471,44	0,00
Externe Management-/Beratungsvergütung				EUR	-4.212,77				-4.212,77	-0,02
Prüfungskosten				EUR	-4.200,86				-4.200,86	-0,02
Veröffentlichungskosten				EUR	-1.933,06				-1.933,06	-0,01
Fondsvermögen							EUR	21.506.780,39	100,00 1)	
MPF Protection										
Anteilwert							EUR	142,15		
Anzahl Anteile							STK	151.300,000		

Fußnoten:

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

Halbjahresbericht für MPF Protection

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Devisenkurse (in Mengennotiz)

US-Dollar	(USD)	per 28.12.2023 1,1091000	= 1 Euro (EUR)
-----------	-------	-----------------------------	----------------

Halbjahresbericht für MPF Protection

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	800	
2,3750 % Bayer AG FLR-Sub.Anl.v.2019(2025/2079)	XS2077670003	EUR	0	1.500	
Nichtnotierte Wertpapiere					
Verzinsliche Wertpapiere					
3,7500 % Bayer AG z.Verkauf eing.Anl(2024/2074)	DE000A351397	EUR	800	800	
0,0000 % Bundesrep.Deutschland Bundesobl.Ser.178 v.2018(23)	DE0001141786	EUR	2.100	3.700	
0,0000 % Bundesrep.Deutschland Bundesschatzanw. v.21(23)	DE0001104867	EUR	2.900	2.900	
0,0000 % Credit Suisse AG EURO STOXX Exp.-Zt.21/18.11.27	DE000CS8DFX3	STK	0	4.000	
Zertifikate					
J.P. Morgan Struct. Prod. B.V. Autoc.Z 13.09.27 Basket	XS2487080850	STK	0	500	
UniCredit Bank AG HVB EXP.PL 24.07.28 Basket	DE000HVB5319	STK	0	500	
UniCredit Bank GmbH HVB EXP.PL 06.12.28 Basket	DE000HVB5JS5	STK	0	1.000	
Investmentanteile					
Gruppenfremde Investmentanteile					
AIS-Am.EO H.Y.Co.Bd ESG UC.ETF Namens-Anteile Acc o.N.	LU1215415214	ANT	0	1.500	

Halbjahresbericht für MPF Protection

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)	98,60
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)	0,00

Sonstige Angaben

MPF Protection

Anteilwert	EUR	142,15
Anzahl Anteile	STK	151.300,000

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 Protection**

Hannover, den 13. Februar 2024

BANTLEON Invest AG
(vormals Warburg Invest AG)

Caroline Specht

Gerd Lückel