



MPF Abakus

Halbjahresbericht für die Zeit vom:
01.07.2022 - 31.12.2022

Herausgeber dieses Jahresberichtes:

Warburg 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.warburg-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
MPF Abakus
für den Zeitraum
01.07.2022 - 31.12.2022

Halbjahresbericht für MPF Abakus

Vermögensübersicht zum 31.12.2022

Anlageschwerpunkte	Tageswert	
	in EUR	% Anteil am Fondsvermögen
I. Vermögensgegenstände	39.061.905,47	100,06
1. Verzinsliche Wertpapiere	23.691.878,41	60,69
2. Zertifikate	7.323.445,00	18,76
3. Investmentanteile	7.307.665,00	18,72
4. Forderungen	363.270,46	0,93
5. Bankguthaben	375.646,60	0,96
II. Verbindlichkeiten	-23.295,49	-0,06
III. Fondsvermögen	39.038.609,98	100,00 ¹⁾

1) Durch Rundung der Prozent-Anteile bei der Berechnung können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.

Halbjahresbericht für MPF Abakus

Vermögensaufstellung zum 31.12.2022

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.12.2022	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens	
Bestandspositionen										
Börsengehandelte Wertpapiere										
								EUR	25.384.119,71	65,02
Verzinsliche Wertpapiere										
2,8420 % AXA S.A. EO-FLR Med.-T. Nts 03(08/Und.)	XS0181369454		EUR	300	300	0 %	79,6274	238.882,29	0,61	
0,3750 % Bank of Ireland Group PLC EO-FLR Med.-T. Nts 2021(26/27)	XS2311407352		EUR	500	0	0 %	85,7486	428.743,20	1,10	
3,7500 % Bayer AG FLR-Sub.Anl.v.2014(2024/2074)	DE000A11QR73		EUR	1.000	0	0 %	96,2534	962.533,50	2,47	
2,3750 % Bayer AG FLR-Sub.Anl.v.2019(2025/2079)	XS2077670003		EUR	3.000	0	0 %	90,1221	2.703.663,57	6,93	
3,1250 % Bayer AG FLR-Sub.Anl.v.2019(2027/2079)	XS2077670342		EUR	3.000	0	0 %	85,2814	2.558.440,92	6,55	
0,0000 % Bundesrep.Deutschland Bundesobl.Ser.177 v.2018(23)	DE0001141778		EUR	1.000	1.000	0 %	99,5199	995.198,76	2,55	
1,3750 % Commerzbank AG Sub.Fix to Reset MTN 21(26/31)	DE000CZ45WP5		EUR	500	0	0 %	81,0497	405.248,48	1,04	
0,2500 % Corporación Andina de Fomento EO-Medium-Term Notes 2021(26)	XS2296027217		EUR	800	0	0 %	88,9050	711.240,00	1,82	
5,6250 % Deutsche Bank AG Sub.FLR-MTN v20(26/31)	DE000DL19VB0		EUR	2.000	0	0 %	97,6323	1.952.646,00	5,00	
4,6790 % Deutsche Pfandbriefbank AG Nachr.FLR-MTN R35281 17(22/27)	XS1637926137		EUR	1.000	0	0 %	85,9606	859.605,62	2,20	
3,1020 % Goldman Sachs Group Inc., The EO-FLR Med.-T. Nts 2021(26/27)	XS2389353181		EUR	1.000	0	0 %	98,1457	981.456,64	2,51	
0,2500 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2021(28)	IT0005433690		EUR	500	0	0 %	82,8555	414.277,50	1,06	
0,0000 % LANXESS AG Medium-Term Nts 2021(27/27)	XS2383886947		EUR	400	0	0 %	83,9514	335.805,76	0,86	
4,5000 % Lb.Hessen-Thüringen GZ FLR-MTN S.H354 v.22(27/32)	XS2489772991		EUR	1.000	500	0 %	95,0516	950.515,90	2,43	
0,2500 % LeasePlan Corporation N.V. EO-Medium-Term Notes 2021(26)	XS2305244241		EUR	500	0	0 %	87,0450	435.224,75	1,11	
3,5000 % RWE AG FLR-Sub.Anl. v.2015(2025/2075)	XS1219499032		EUR	500	0	0 %	96,4183	482.091,52	1,23	
4,6250 % Volkswagen Intl Finance N.V. EO-FLR Notes 2014(26/Und.)	XS1048428442		EUR	2.000	0	0 %	95,1518	1.903.035,22	4,87	
3,8750 % Volkswagen Intl Finance N.V. EO-FLR Notes 2020(29/Und.)	XS2187689380		EUR	4.000	0	0 %	82,7740	3.310.960,08	8,48	
Zertifikate										
Deut. Börse Commodities GmbH Xetra-Gold IHS 2007(09/Und)	DE000A0S9GB0		STK	87.000	0	0 EUR	54,6500	4.754.550,00	12,18	
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere										
								EUR	5.631.203,70	14,42
Verzinsliche Wertpapiere										
0,0000 % Credit Suisse AG (Ldn Br.) EURO STOXX Exp.-Zt. 21/21.7.27	DE000CS8DAS4		STK	5.000	0	0 EUR	88,5800	442.900,00	1,13	
0,0000 % Credit Suisse AG (Ldn Br.) EURO STOXX Exp.-Zt. 21/26.1.28	DE000CS8DAX4		STK	5.000	0	0 EUR	94,5200	472.600,00	1,21	
0,0000 % Credit Suisse AG (Ldn Br.) EURO STOXX Exp.-Zt. 21/7.9.27	DE000CS8DCK7		STK	5.000	0	0 EUR	86,5500	432.750,00	1,11	
0,0000 % Credit Suisse AG (Ldn Br.) EURO STOXX Exp.-Zt. 22/12.1.28	DE000CS8DHM2		STK	5.000	0	0 EUR	85,7800	428.900,00	1,10	
0,0000 % Credit Suisse AG (Ldn Br.) EURO STOXX Exp.-Zt.21/18.11.27	DE000CS8DFX3		STK	5.000	0	0 EUR	84,0500	420.250,00	1,08	
0,2500 % McDonald's Corp. EO-Medium-Term Nts 2021(21/28)	XS2393236000		EUR	500	0	0 %	82,7017	413.508,70	1,06	
1,7000 % UniCredit Bank AG HVB Worst of v.21(27) BSKT	DE000HVB5BG7		EUR	500	0	0 %	90,2800	451.400,00	1,16	
Zertifikate										
BNP Paribas Em.-u.Handelsg.mbH DISC 27.10.22 MSCI World Price	DE000PF99NB5		STK	47.500	0	0 EUR	24,4700	1.162.325,00	2,98	
J.P. Morgan Struct. Prod. B.V. Autoc.Z 29.03.28 Basket	XS2487080421		STK	1.000	1.000	0 EUR	896,3500	896.350,00	2,30	
UniCredit Bank AG HVB EXP.PL Z11.08.28 Basket	DE000HVB5533		STK	500	0	0 EUR	1.020,4400	510.220,00	1,31	

Halbjahresbericht für MPF Abakus

Vermögensaufstellung zum 31.12.2022

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.12.2022	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Investmentanteile							EUR	7.307.665,00	18,72
Gruppenfremde Investmentanteile									
iShsIII-Core MSCI World U.ETF Registered Shs USD (Acc) o.N.	IE00B4L5Y983		ANT	15.000	0	0	EUR 68,9820	1.034.730,00	2,65
MPF Aktien Strat.Total Return Inhaber-Anteile o.N.	LU0330557819		ANT	12.500	0	0	EUR 148,5200	1.856.500,00	4,76
MPF Renten Strategie Chance Inhaber-Anteile o.N.	LU0330568691		ANT	17.500	0	0	EUR 118,6100	2.075.675,00	5,32
MUL-LYX.iBoxx EO Liq.H.Y.BB U. Namens-Anteile Acc o.N.	LU1215415214		ANT	2.500	0	0	EUR 110,3400	275.850,00	0,71
MUL-Lyx.MSCI All C.Worl.UC.ETF Namens-Anteile Acc.EUR o.N	LU1829220216		ANT	6.200	0	0	EUR 333,0500	2.064.910,00	5,29
Summe Wertpapiervermögen							EUR	38.322.988,41	98,17
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrument und Geldmarktfonds							EUR	375.646,60	0,96
Bankguthaben							EUR	375.646,60	0,96
EUR - Guthaben bei:									
M.M.Warburg & CO [AG & Co.] KGaA			EUR	375.646,60		%	100,0000	375.646,60	0,96
Sonstige Vermögensgegenstände							EUR	363.270,46	0,93
Zinsansprüche			EUR	363.270,46				363.270,46	0,93
Sonstige Verbindlichkeiten							EUR	-23.295,49	-0,06
Verwaltungsvergütung			EUR	-7.262,62				-7.262,62	-0,02
Verwahrstellenvergütung			EUR	-646,62				-646,62	0,00
Externe Management-/Beratungsvergütung			EUR	-6.984,50				-6.984,50	-0,02
Prüfungskosten			EUR	-7.140,26				-7.140,26	-0,02
Veröffentlichungskosten			EUR	-1.261,49				-1.261,49	0,00
Fondsvermögen							EUR	39.038.609,98	100,00 1)
MPF Abakus - Anteilklasse 1									
Anteilwert							EUR	135,22	
Anzahl Anteile							STK	288.700,000	

Fußnoten:

1) Durch Rundung der Prozent-Anteile bei der Berechnung können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.

Halbjahresbericht für MPF Abakus

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Halbjahresbericht für MPF Abakus

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

Zertifikate

J.P. Morgan Struct. Prod. B.V. Autoc.Zert. 29.03.28 Basket	XS2168930852	STK	0	1.000	
--	--------------	-----	---	-------	--

Nichtnotierte Wertpapiere

Verzinsliche Wertpapiere

5,7500 % Main Capital Funding II L.P. EO-Capital Sec. 06(12/Und.)	DE000A0G18M4	EUR	0	1.250	
5,5000 % Main Capital Funding L.P. EO-Capital Sec. 05(11/Und.)	DE000A0E4657	EUR	0	2.000	
2,7000 % Volkswagen Intl Finance N.V. EO-FLR Notes 2017(22/Und.)	XS1629658755	EUR	0	1.000	

Das Transaktionsvolumen im Konzernverbund beläuft sich auf 8.971.965,00 EUR (67,86%).

Halbjahresbericht für MPF Abakus

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)	98,17
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)	0,00

Sonstige Angaben

MPF Abakus - Anteilklasse 1

Anteilwert	EUR	135,22
Anzahl Anteile	STK	288.700,000

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 Warburg 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.

Die Bewertung des Wertpapiervermögens erfolgte zu 100,00% auf Basis von handelbaren Kursen.

weitere zum Verständnis des Berichts erforderliche Angaben

Für den vorliegenden Zeitraum sind keine weiteren Angaben erforderlich.

**Halbjahresbericht
für MPF Abakus**

Hannover, den 16. Januar 2022

Warburg Invest AG

Caroline Specht

Dr. Dirk Rogowski