



MPF Abakus

Halbjahresbericht für die Zeit vom:
01. Juli 2021 bis 31. Dezember 2021

Herausgeber dieses Halbjahresberichtes:

Warburg Invest AG
An der Börse 7, 30159 Hannover
Postanschrift: 30045 Hannover
Postfach 4505
Telefon +49 511 12354-0; Telefax: +49 511 12354-333
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 das Geschäftsjahr
01.07.2021 - 31.12.2021

Halbjahresbericht für MPF Abakus

Vermögensübersicht zum 31.12.2021

Anlageschwerpunkte	Tageswert	
	in EUR	% Anteil am Fondsvermögen
I. Vermögensgegenstände	41.911.677,25	100,07
1. Verzinsliche Wertpapiere	25.299.877,04	60,40
2. Zertifikate	6.805.729,86	16,25
3. Investmentanteile	9.284.680,00	22,17
4. Forderungen	255.184,84	0,61
5. Bankguthaben	266.205,51	0,64
II. Verbindlichkeiten	-27.414,45	-0,07
III. Fondsvermögen	41.884.262,80	100,00

Halbjahresbericht für MPF Abakus

Vermögensaufstellung zum 31.12.2021

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.12.2021	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens	
Bestandspositionen										
Börsengehandelte Wertpapiere										
								EUR	25.759.509,95	61,50
Verzinsliche Wertpapiere										
0,3750 % Bank of Ireland Group PLC EO-FLR Med.-T. Nts 2021(26/27)	XS2311407352		EUR	500	500	0 %	98,7234	493.617,15	1,18	
2,3750 % Bayer AG FLR-Sub.Anl.v.2015(2022/2075)	DE000A14J611		EUR	2.500	2.500	0 %	101,0112	2.525.279,60	6,03	
2,3750 % Bayer AG FLR-Sub.Anl.v.2019(2025/2079)	XS2077670003		EUR	1.300	0	0 %	100,1996	1.302.594,50	3,11	
3,1250 % Bayer AG FLR-Sub.Anl.v.2019(2027/2079)	XS2077670342		EUR	500	0	0 %	101,7921	508.960,32	1,22	
0,0000 % Bundesrep.Deutschland Bundesobl.Ser.175 v.2017(22)	DE0001141752		EUR	4.000	4.500	500 %	100,2001	4.008.003,08	9,57	
1,3750 % Commerzbank AG Sub.Fix to Reset MTN 21(26/31)	DE000CZ45WP5		EUR	500	500	0 %	98,1209	490.604,57	1,17	
0,2500 % Corporación Andina de Fomento EO-Medium-Term Notes 2021(26)	XS2296027217		EUR	800	0	0 %	99,6227	796.981,52	1,90	
5,6250 % Deutsche Bank AG Sub.FLR-MTN v20(26/31)	DE000DL19VB0		EUR	1.000	0	0 %	117,3587	1.173.586,52	2,80	
0,4120 % Goldman Sachs Group Inc., The EO-FLR Med.-T. Nts 2021(26/27)	XS2389353181		EUR	1.000	1.000	0 %	101,7910	1.017.909,54	2,43	
0,2500 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2021(28)	IT0005433690		EUR	500	0	0 %	97,6348	488.173,95	1,17	
0,0000 % LANXESS AG Medium-Term Nts 2021(27/27)	XS2383886947		EUR	400	400	0 %	97,2846	389.138,40	0,93	
0,2500 % LeasePlan Corporation N.V. EO-Medium-Term Notes 2021(26)	XS2305244241		EUR	500	0	0 %	99,2215	496.107,70	1,18	
5,7500 % Main Capital Funding II L.P. EO-Capital Sec. 06(12/Und.)	DE000A0G18M4		EUR	1.250	0	0 %	102,9486	1.286.857,79	3,07	
5,5000 % Main Capital Funding L.P. EO-Capital Sec. 05(11/Und.)	DE000A0E4657		EUR	2.000	0	0 %	102,7177	2.054.354,24	4,90	
3,5000 % RWE AG FLR-Sub.Anl. v.2015(2025/2075)	XS1219499032		EUR	500	0	0 %	106,6163	533.081,56	1,27	
4,6250 % Volkswagen Intl Finance N.V. EO-FLR Notes 2014(26/Und.)	XS1048428442		EUR	750	0	0 %	112,0690	840.517,28	2,01	
2,7000 % Volkswagen Intl Finance N.V. EO-FLR Notes 2017(22/Und.)	XS1629658755		EUR	500	0	0 %	102,0685	510.342,37	1,22	
3,8750 % Volkswagen Intl Finance N.V. EO-FLR Notes 2020(29/Und.)	XS2187689380		EUR	2.000	2.000	0 %	108,5000	2.170.000,00	5,18	
Zertifikate										
BNP Paribas Issuance B.V. Athena WOF Z.09.02.26 Basket	XS1996447774		STK	2	0	0	EUR	111.674,9300	223.349,86	0,53
Deut. Börse Commodities GmbH Xetra-Gold IHS 2007(09/Und)	DE000A0S9GB0		STK	87.000	0	0	EUR	51,1500	4.450.050,00	10,62
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere										
								EUR	6.346.096,95	15,15
Verzinsliche Wertpapiere										
0,0000 % Credit Suisse AG (Ldn Br.) EURO STOXX Exp.-Zt. 21/21.7.27	DE000CS8DAS4		STK	5.000	5.000	0	EUR	98,4800	492.400,00	1,18
0,0000 % Credit Suisse AG (Ldn Br.) EURO STOXX Exp.-Zt. 21/26.1.28	DE000CS8DAX4		STK	5.000	5.000	0	EUR	99,2800	496.400,00	1,19
0,0000 % Credit Suisse AG (Ldn Br.) EURO STOXX Exp.-Zt. 21/7.9.27	DE000CS8DCK7		STK	5.000	5.000	0	EUR	97,7800	488.900,00	1,17
0,0000 % Credit Suisse AG (Ldn Br.) EURO STOXX Exp.-Zt.21/18.11.27	DE000CS8DFX3		STK	5.000	5.000	0	EUR	97,6900	488.450,00	1,17
0,2500 % McDonald's Corp. EO-Medium-Term Nts 2021(21/28)	XS2393236000		EUR	500	500	0 %	98,2984	491.491,95	1,17	
0,0000 % Raiffeisen Switzerland B.V. EO-Anl. 2018(24) SX5E/SX7E	CH0399606430		EUR	750	0	0 %	101,0500	757.875,00	1,81	
0,0000 % Raiffeisen Switzerland B.V. EO-Anl. 2018(24) SX5E/SX7E	CH0413404010		EUR	500	0	0 %	100,1900	500.950,00	1,20	
1,7000 % UniCredit Bank AG HVB Worst of v.21(27) BSKT	DE000HVB5BG7		EUR	500	0	0 %	99,4600	497.300,00	1,19	
Zertifikate										
Credit Agricole CIB AUTOCALL Z 07.07.25 Basket	XS1784706043		STK	500	0	0	EUR	1.203,4100	601.705,00	1,44
J.P. Morgan Struct. Prod. B.V. Autoc.Zert. 29.03.28 Basket	XS2168930852		STK	1.000	1.000	0	EUR	1.009,9700	1.009.970,00	2,41
UniCredit Bank AG HVB EXP.PL Z11.08.28 Basket	DE000HVB5533		STK	500	0	0	EUR	1.041,3100	520.655,00	1,24

Halbjahresbericht für MPF Abakus

Vermögensaufstellung zum 31.12.2021

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.12.2021	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens	
Investmentanteile							EUR	9.284.680,00	22,17	
Gruppenfremde Investmentanteile										
iShsIII-Core MSCI World U.ETF Registered Shs USD (Acc) o.N.	IE00B4L5Y983		ANT	31.000	0	0	EUR	78,9600	2.447.760,00	5,84
MPF Aktien Strat.Total Return Inhaber-Anteile o.N.	LU0330557819		ANT	12.500	0	0	EUR	155,5500	1.944.375,00	4,64
MPF Renten Strategie Chance Inhaber-Anteile o.N.	LU0330568691		ANT	17.500	0	0	EUR	126,5700	2.214.975,00	5,29
MUL-LYX.iBoxx EO Liq.H.Y.BB U. Namens-Anteile Acc o.N.	LU1215415214		ANT	2.500	0	0	EUR	120,9400	302.350,00	0,72
MUL-Lyx.MSCI All C.Worl.UC.ETF Namens-Anteile Acc.EUR o.N	LU1829220216		ANT	6.200	0	0	EUR	383,1000	2.375.220,00	5,67
Summe Wertpapiervermögen							EUR	41.390.286,90	98,82	
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrument und Geldmarktfonds							EUR	266.205,51	0,64	
Bankguthaben							EUR	266.205,51	0,64	
EUR - Guthaben bei:										
M.M.Warburg & CO [AG & Co.] KGaA			EUR	266.205,51			%	100,0000	266.205,51	0,64
Sonstige Vermögensgegenstände							EUR	255.184,84	0,61	
Zinsansprüche			EUR	255.517,90					255.517,90	0,61
Forderungen Sonstige			EUR	-333,06					-333,06	0,00
Sonstige Verbindlichkeiten							EUR	-27.414,45	-0,07	
Verwaltungsvergütung			EUR	-16.669,99					-16.669,99	-0,04
Verwahrstellenvergütung			EUR	-685,30					-685,30	0,00
Externe Management-/Beratungsvergütung			EUR	-7.409,74					-7.409,74	-0,02
Prüfungskosten			EUR	-946,30					-946,30	0,00
Veröffentlichungskosten			EUR	-749,70					-749,70	0,00
Sonstige Kosten			EUR	-953,42					-953,42	0,00
Fondsvermögen							EUR	41.884.262,80	100,00 1)	
MPF Abakus - Anteilklasse 1										
Anteilwert							EUR	145,10		
Anzahl Anteile							STK	288.650,000		

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
Börsengehandelte Wertpapiere					
Verzinsliche Wertpapiere					
0% Deutschland 2016/08.10.2021	DE0001141745	EUR	0	300,00	
2,5% AA Raiffeisen Swit UL SX5E 2017/06.09.2023 FL	CH0379754242	EUR	0	500,00	
0,01% Dt Kreditbank 2021/23.02.2026	DE000GRN0024	EUR	0	500,00	
0,125% Bco Bilbao VRN 2021/24.03.2027	XS2322289385	EUR	0	500,00	
0% Deutschland 2016/08.10.2021	DE0001141745	EUR	0	1.000,00	
0% Deutschland 2016/08.10.2021	DE0001141745	EUR	0	4.700,00	
3,75% Dt PB Trust II TPS VRN 2004/23.12.2099	DE000A0DHUM0	EUR	0	1.250,00	
1,85% WA Credit Agricole UL Dax Kursindex 2017/24.	XS1630608179	EUR	0	300,00	
Zertifikate					
UNICREDIT EXPRESSZTF Dax Kursindex 21.07.2027 BV:1	DE000HVB44B0	STK	0	1.000,00	
AXA Immoselect Inhaber-Anteile	DE0009846451	STK	0	9.000,00	
KanAm grundinvest Fonds Inhaber-Anteile	DE0006791809	STK	0	6.000,00	
Cs Euroreal Inhaber-Anteile	DE0009805002	STK	0	6.000,00	
SEB ImmoInvest Inhaber-Anteile P	DE0009802306	STK	0	7.000,00	
Cs Euroreal Inhaber-Anteile	DE0009805002	STK	0	6.000,00	

Das Transaktionsvolumen im Konzernverbund beläuft sich auf 1.491.687,50 EUR (100,00%).

Halbjahresbericht für MPF Abakus

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)	98,82
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)	0,00

Sonstige Angaben

MPF Abakus - Anteilklasse 1

Anteilwert	EUR	145,10
Anzahl Anteile	STK	288.650,000

Angewandte Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände (§§ 26 bis 29 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.

weitere zum Verständnis des Berichts erforderliche Angaben

Für den vorliegenden Zeitraum sind keine weiteren Angaben erforderlich.

**Halbjahresbericht
für MPF Abakus**

Hannover, den 28. Februar 2022

Warburg Invest AG

Caroline Specht

Dr. Dirk Rogowski