

BayernInvest Asset Light-Fonds
Halbjahresbericht zum 31. Dezember 2015
für das Geschäftsjahr
vom 01. Juli 2015 bis 30. Juni 2016

Halbjahresbericht zum 31. Dezember 2015
BayernInvest Asset Light-Fonds
DE000A1J17Z0

Vermögensübersicht zum 31.12.2015

Anlageschwerpunkte	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
I. Vermögensgegenstände	987.081,80	100,06
1. Forderungen	165,14	0,02
2. Bankguthaben	986.916,66	100,04
II. Verbindlichkeiten	-574,62	-0,06
III. Fondsvermögen	986.507,18	100,00

Halbjahresbericht zum 31. Dezember 2015
BayernInvest Asset Light-Fonds
DE000A1J17Z0

Vermögensaufstellung zum 31.12.2015

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.12.2015	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds							EUR	986.916,66	100,04
Bankguthaben							EUR	36.916,66	3,74
Guthaben bei Bayerische Landesbank Guthaben in Fondswährung			EUR	36.916,66	%	100,000	36.916,66	3,74	
Tagesgelder							EUR	950.000,00	96,30
Guthaben bei Dexia Kommunalbank Deutschland AG Vorzeitig kündbares Termingeld			EUR	190.000,00	%	100,000	190.000,00	19,26	
Guthaben bei Deka Bank Guthaben in Fondswährung			EUR	190.000,00	%	100,000	190.000,00	19,26	
Guthaben bei Landesbank Baden-Württemberg Guthaben in Fondswährung			EUR	190.000,00	%	100,000	190.000,00	19,26	
Guthaben bei Landesbank Berlin AG Guthaben in Fondswährung			EUR	190.000,00	%	100,000	190.000,00	19,26	
Guthaben bei Norddeutsche Landesbank Girozentrale Guthaben in Fondswährung			EUR	190.000,00	%	100,000	190.000,00	19,26	
Sonstige Vermögensgegenstände							EUR	165,14	0,02
Zinsansprüche			EUR	165,14			165,14	0,02	
Sonstige Verbindlichkeiten							EUR	-574,62	-0,06
Verwaltungsvergütung			EUR	-82,43			-82,43	-0,01	
Prüfungs- und Veröffentlichungskosten			EUR	-433,49			-433,49	-0,04	
Verwahrstellenvergütung			EUR	-58,70			-58,70	-0,01	
Fondsvermögen							EUR	986.507,18	100,00 ¹⁾
Anteilwert							EUR	9.865,07	
Ausgabepreis							EUR	10.358,33	
Anteile im Umlauf							STK	100	

Fußnoten:

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

Halbjahresbericht zum 31. Dezember 2015

BayernInvest Asset Light-Fonds

DE000A1J17Z0

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Halbjahresbericht zum 31. Dezember 2015

BayernInvest Asset Light-Fonds

DE000A1J17Z0

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

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. Dezember 2015

BayernInvest Asset Light-Fonds

DE000A1J17Z0

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

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

Sonstige Angaben

Anteilwert	EUR	9.865,07
Ausgabepreis	EUR	10.358,33
Anteile im Umlauf	STK	100

Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände

- Aktien, börsengehandelte Derivate und Investmentfonds werden mit handelbaren Börsenkursen (auf Schlusskursbasis) bewertet (Quelle: Bloomberg/Heimatsbörse).
- Rentenpapiere werden mit handelbaren Kursen nach § 23 InvRBV (Quelle: IBOXX) bzw. mit Verkehrswerten nach § 24 InvRBV bewertet. Hierfür werden jeweils die Geldkurse bzw. Mittelkurse herangezogen. Quellen für diese Verkehrswertermittlungen der Bonds sind in erster Linie 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: Bloomberg und externe Anbieter).
- Nicht börsennotierte Investmentfonds werden mit dem von der Investmentgesellschaft zuletzt veröffentlichten Rücknahmepreis (NAV) bewertet (Quelle: Bloomberg).
- Devisenkassamittelkurse werden börsentäglich um 17 Uhr aus Reuters entnommen. 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.
- Devisenforwards werden auf Basis der von der BayernLB (Abteilung Marktdaten) gelieferten Kassakurse (17 Uhr Reuters) von unserem externen Kursprovider Value & Risk errechnet und an uns geliefert.
- Bankguthaben werden zum Nennwert, Festgelder zum Verkehrswert und Forderungen und Verbindlichkeiten zum Rückzahlungsbetrag bewertet.