

Halbjahresbericht

Infinigon Investment Grade CLO Fonds

zum 30. September 2024

Halbjahresbericht des Infinigon Investment Grade CLO Fonds

ZUM 30. SEPTEMBER 2024

■ Vermögensübersicht	2
■ Vermögensaufstellung	3
■ Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit diese nicht mehr Gegenstand der Vermögensaufstellung sind	7
■ Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV	8

■ Vermögensübersicht

	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
I. Vermögensgegenstände	110.848.497,05	100,38
1. Aktien	0,00	0,00
2. Anleihen	109.126.004,69	98,82
Asset Backed	109.126.004,69	98,82
3. Derivate	0,00	0,00
4. Forderungen	1.262.289,96	1,14
5. Kurzfristig liquidierbare Anlagen	0,00	0,00
6. Bankguthaben	460.202,40	0,42
7. Sonstige Vermögensgegenstände	0,00	0,00
II. Verbindlichkeiten	-424.288,27	-0,38
Sonstige Verbindlichkeiten	-424.288,27	-0,38
III. Fondsvermögen	110.424.208,78	100,00*)

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

Vermögensaufstellung

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.09.2024	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
Börsengehandelte Wertpapiere									3.648.606,42	3,30
Andere Wertpapiere										
Euro									3.648.606,42	3,30
2,1000 % CVC CORD.L.FD.VI 18-32 CDO ¹⁾	XS1803163291		EUR	1.500.000	-	-	%	94,220	1.413.300,00	1,28
3,0000 % DRY.32 EUR.CLO14 FRN 18-31 CDO ¹⁾	XS1864912461		EUR	500.000	-	-	%	96,882	484.412,00	0,44
5,4350 % AVOCA CLO XVIII FRN 18-31 CDO ¹⁾	XS1813264766		EUR	750.000	-	-	%	100,100	750.752,47	0,68
5,5740 % HALCYON LAEF18-1 FRN 18-21 CDO ¹⁾	XS1840845462		EUR	1.000.000	-	-	%	100,014	1.000.141,95	0,91
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere									104.813.811,74	94,92
Andere Wertpapiere										
Euro									104.813.811,74	94,92
2,0000 % CVC CORD.L.FD.XV FRN 21-32 CDO ¹⁾	XS2382263171		EUR	1.000.000	1.000.000	-	%	93,001	930.014,00	0,84
2,0000 % PENTA CLO 8 V.21-34 CDO ¹⁾	XS2413885570		EUR	500.000	-	-	%	93,529	467.642,50	0,42
2,2000 % ADAGIO CLO VIII V.19-32 CDO ¹⁾	XS2054620666		EUR	3.000.000	3.000.000	-	%	93,973	2.819.200,88	2,55
5,5220 % SIGN.HAR.III 24/38 FLR B ¹⁾	XS2870215345		EUR	3.500.000	3.500.000	-	%	99,998	3.499.937,00	3,17
5,5410 % CVC CORD.L.FD.XV FRN 21-32 CLO ¹⁾	XS2382263338		EUR	1.000.000	-	-	%	100,163	1.001.629,00	0,91
5,7850 % HENLEY CLO IV FRN V.21-34 CDO ¹⁾	XS2291283021		EUR	2.850.000	-	-	%	99,870	2.846.303,55	2,58
5,7880 % NTHW.CAP.21 EURO FRN 21-34 CDO ¹⁾	XS2345834092		EUR	2.200.000	-	-	%	98,540	2.167.877,80	1,96
5,8810 % NORTHW.CAP.23A FRN 21-34 CLO ¹⁾	XS2319555004		EUR	895.000	-	-	%	98,338	880.124,66	0,80
5,9420 % CLARINDA P.CLO FRN 21-34 CDO ¹⁾	XS2296466050		EUR	2.500.000	-	-	%	100,087	2.502.174,74	2,27
5,9850 % HAYFIN EM.CLO IV FRN 21-34 CLO ¹⁾	XS2369676114		EUR	900.000	-	-	%	98,353	885.175,20	0,80
6,0350 % NORTHW.C.24 EURO FRN 21-35 CDO ¹⁾	XS2402464221		EUR	1.500.000	-	-	%	99,431	1.491.471,00	1,35
6,0410 % NORTHW.CAP.19 E. FRN 19-33 CDO ¹⁾	XS2056564722		EUR	1.250.000	-	-	%	100,032	1.250.395,54	1,13
6,0850 % TIKEHAU CLO VI FRN 21-35 CDO ¹⁾	XS2417096984		EUR	750.000	-	-	%	100,053	750.393,75	0,68
6,1350 % ST.PAUL'S CLO II FRN 21-35 CDO ¹⁾	XS2402449263		EUR	2.000.000	-	-	%	99,998	1.999.968,00	1,81
6,1350 % TORO EUR.CLO 2 FRN V.21-34 CDO ¹⁾	XS2366421787		EUR	1.000.000	-	-	%	100,229	1.002.286,00	0,91
6,1810 % NASSAU E.CLO I FRN 21-34 CDO ¹⁾	XS2400033929		EUR	2.400.000	-	-	%	100,179	2.404.298,40	2,18
6,1850 % CFC EU.F.CLO FRN 21-34 CLO ¹⁾	XS2274530877		EUR	1.000.000	-	-	%	100,070	1.000.700,00	0,91
6,1850 % SEG.EUR.CLO 1-14 FRN 21-35 CDO ¹⁾	XS2366386931		EUR	2.000.000	-	-	%	100,794	2.015.870,00	1,83
6,2880 % MACKAY S.E.CLO-1 FRN 19-32 CDO ¹⁾	XS2010042849		EUR	1.000.000	-	-	%	100,244	1.002.438,35	0,91

Vermögensaufstellung

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.09.2024	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
6,3220 % NASS.EUR.IV 24/38 FLR C ¹⁾	XS2798985169		EUR	2.300.000	2.300.000	-	%	100,146	2.303.353,40	2,09
6,3850 % ACCUN.EUR.CLO I FRN 19-30 CDO ¹⁾	XS1966595958		EUR	250.000	-	-	%	100,246	250.615,48	0,23
6,5350 % FID.G.H.CLO 22-1 FRN 24-37 CLO ¹⁾	XS2778277199		EUR	2.000.000	-	-	%	100,455	2.009.094,00	1,82
6,5490 % HAYFIN EM.CLO V V.20-32 CDO ¹⁾	XS2247711851		EUR	400.000	-	-	%	100,225	400.899,67	0,36
6,5850 % SOUND P.E.IV F. FRN 20-35 CDO ¹⁾	XS2249773529		EUR	400.000	-	-	%	100,246	400.983,25	0,36
6,7850 % ARBOUR CLO IV FRN V.21-34 CDO ¹⁾	XS2309834963		EUR	1.500.000	-	-	%	99,104	1.486.556,09	1,35
6,8350 % PALMER SELF 21-1 FRN 21-34 CDO ¹⁾	XS2298991550		EUR	500.000	-	-	%	99,068	495.340,16	0,45
6,8850 % ADAGIO V CLO FRN V.18-31 ¹⁾	XS1879605928		EUR	1.500.000	-	-	%	99,459	1.491.881,97	1,35
6,8850 % JUB.CLO 21-XXV FRN 21-35 CDO ¹⁾	XS2402443571		EUR	1.000.000	-	-	%	100,098	1.000.977,76	0,91
6,9850 % ARMA.EUR.CLO III FRN 21-31 CDO ¹⁾	XS2320738458		EUR	1.000.000	-	-	%	100,049	1.000.485,96	0,91
6,9850 % HAYFIN E.CLO VII FRN 21-34 CLO ¹⁾	XS2362676012		EUR	3.400.000	-	-	%	95,769	3.256.147,71	2,95
7,0410 % HAYFIN EM.CLO II FRN 21-34 CDO ¹⁾	XS2331207154		EUR	3.750.000	-	-	%	96,675	3.625.313,73	3,28
7,0850 % DRYD.27 RE CLO17 FRN 21-33 CDO ¹⁾	XS2305386208		EUR	2.000.000	-	-	%	97,764	1.955.280,27	1,77
7,1050 % ARM.EURO CLO I FRN 21-34 CLO ¹⁾	XS2333786072		EUR	1.125.000	-	-	%	100,137	1.126.537,88	1,02
7,1350 % HAYFIN EM.CLO IV FRN 21-34 CLO ¹⁾	XS2369676387		EUR	2.200.000	-	-	%	95,224	2.094.928,00	1,90
7,1620 % AURIUM CLO V FRN V.21-34 CDO ¹⁾	XS2310114710		EUR	1.000.000	-	-	%	100,667	1.006.665,28	0,91
7,1620 % HAYF.E.CLO VIII FRN 21-35 CLO ¹⁾	XS2415433668		EUR	4.500.000	-	-	%	96,261	4.331.733,04	3,92
7,1740 % ST.PAUL'S CLOVII FRN 21-34 CDO ¹⁾	XS2345330299		EUR	2.000.000	-	1.000.000	%	99,320	1.986.401,93	1,80
7,1850 % FAIR OAKS L.F.IV FRN 22-35 CDO ¹⁾	XS2417188591		EUR	3.000.000	-	-	%	100,069	3.002.059,27	2,72
7,1850 % SEG.EUR.CLO 1-14 FRN 21-35 CDO ¹⁾	XS2366387665		EUR	2.000.000	-	-	%	100,098	2.001.959,20	1,81
7,2810 % NASSAU E.CLO I FRN 21-34 CDO ¹⁾	XS2400034141		EUR	3.000.000	-	-	%	100,314	3.009.411,00	2,73
7,2850 % CAIRN CLO XII FRN V.21-34 CDO ¹⁾	XS2417415168		EUR	2.100.000	-	2.500.000	%	100,033	2.100.699,30	1,90
7,2850 % CIFC EU.F.CLO FRN 21-34 CLO ¹⁾	XS2274531412		EUR	1.250.000	-	-	%	100,019	1.250.233,75	1,13
7,2880 % OAK HILL E.C.P.V FRN 21-35 CDO ¹⁾	XS2411139814		EUR	600.000	-	-	%	99,503	597.017,63	0,54
7,3550 % AURIUM CLO I FRN V.19-32 CDO ¹⁾	XS2041078317		EUR	4.000.000	-	-	%	100,665	4.026.586,89	3,65
7,3850 % ST.PAUL'S CLO II FRN 21-35 CDO ¹⁾	XS2402449420		EUR	1.000.000	-	-	%	98,903	989.032,00	0,90

Vermögensaufstellung

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.09.2024	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
7,4380 % SEAP.PARK CLO FRN V.19-32 CDO ¹⁾	XS2066779294		EUR	500.000	-	-	%	100,554	502.772,17	0,46
7,4550 % BAR.EUR.CLO 21-1 FRN 21-34 CDO ¹⁾	XS2322244794		EUR	3.000.000	-	-	%	99,119	2.973.577,55	2,69
7,5410 % NORTHW.CAP.19 E. FRN 19-33 CDO ¹⁾	XS2056565372		EUR	3.000.000	-	-	%	97,996	2.939.880,47	2,66
7,5810 % F.GR.HA.CLO2019-1 19/32 D ¹⁾	XS2020630393		EUR	2.300.000	-	-	%	100,334	2.307.691,70	2,09
7,6480 % CONTEGO CLO VII FRN 19-32 CDO ¹⁾	XS2053879354		EUR	1.000.000	-	-	%	100,371	1.003.712,28	0,91
7,7380 % MACKAY S.E.CLO-1 FRN 19-32 CDO ¹⁾	XS2010042252		EUR	500.000	-	-	%	100,138	500.690,66	0,45
7,7880 % ARES E.CLO XIII FRN 20-32 CDO ¹⁾	XS2084074900		EUR	3.000.000	2.000.000	-	%	100,334	3.010.012,04	2,73
7,7880 % PURPLE FIN.CLO FRN 19-32 CDO ¹⁾	XS2052406084		EUR	3.000.000	-	-	%	100,334	3.010.012,04	2,73
7,8850 % MADISON P.E.F.XX FRN 24-38 CDO ¹⁾	XS2783649846		EUR	2.000.000	-	-	%	100,684	2.013.682,00	1,82
7,9350 % DRYD.48 E.CLO 16 FRN 19-32 CDO ¹⁾	XS2044129109		EUR	3.500.000	-	-	%	100,114	3.504.000,50	3,17
8,0490 % HAYFIN EM.CLO FRN V.20-32 CDO ¹⁾	XS2247712404		EUR	1.000.000	-	-	%	99,816	998.157,84	0,90
8,1850 % SOUND P.E.IV F. FRN 20-35 CDO ¹⁾	XS2249773958		EUR	925.000	-	-	%	100,140	926.297,50	0,84
8,9350 % NORTHW.C.26 EURO FRN 22-26 CDO ¹⁾	XS2437417004		EUR	1.000.000	-	-	%	100,523	1.005.230,00	0,91
9,6380 % TIKEHAU CLO VII FRN 22-35 CLO ¹⁾	XS2513944236		EUR	2.000.000	-	-	%	100,000	2.000.000,00	1,81
Nicht notierte Wertpapiere									663.586,53	0,60
Andere Wertpapiere										
US-Dollar									663.586,53	0,60
9,3130 % NASSAU 21-I FRN V.21-34 CLO ¹⁾	USG63854AF34		USD	750.000	-	-	%	98,746	663.586,53	0,60
Summe Wertpapiervermögen									109.126.004,69	98,82
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds									460.202,40	0,42
Bankguthaben									460.202,40	0,42
EUR-Guthaben bei:										
Verwahrstelle										
DZ BANK AG DEUTSCHE ZENTRAL-GENOSSENSCHAFTSBANK, FRANKFURT AM MAIN			EUR	395.138,89			%	100,000	395.138,89	0,36
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen										
DZ BANK AG DEUTSCHE ZENTRAL-GENOSSENSCHAFTSBANK, FRANKFURT AM MAIN			USD	72.614,13			%	100,000	65.063,51	0,06
Sonstige Vermögensgegenstände									1.262.289,96	1,14
ZINSANSPRÜCHE			EUR	1.262.027,62					1.262.027,62	1,14
FORDERUNGEN AUS SCHWEBENDEN GESCHÄFTEN			EUR	262,34					262,34	0,00

■ Vermögensaufstellung

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.09.2024	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
Sonstige Verbindlichkeiten								-424.288,27	-0,38
KOSTENABGRENZUNGEN			EUR	-424.288,27				-424.288,27	-0,38
Fondsvermögen						EUR		110.424.208,78	100,00^{*)}
Anteilwert							EUR	103,70	
Umlaufende Anteile							STK	1.064.890,9580	

^{*)} Durch Rundung der Prozent-Anteile bei der Berechnung können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.

¹⁾ Bei diesen Wertpapieren handelt es sich um Poolfaktoranleihen, deren Kurswert auch durch Teilrückzahlung oder Teilzinskaptalisierung beeinflusst wird.

■ Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

Die Vermögensgegenstände des Sondervermögens sind auf der Grundlage nachstehender Kurse/Marktsätze bewertet:

Alle Vermögenswerte: Kurse bzw. Marktsätze per 30.09.2024 oder letztbekannte.

Devisenkurs(e) bzw. Konversionsfaktor(en) (in Mengennotiz) per 30.09.2024

US-Dollar	(USD)	1,11605 = 1 (EUR)
-----------	-------	-------------------

Im Berichtszeitraum haben gegebenenfalls Kapitalmaßnahmen und eventuelle unterjährige Änderungen der Stammdaten eines Wertpapiers stattgefunden. Diese Kapitalmaßnahmen und die Umbuchungen aufgrund von Stammdatenänderungen sind ohne Umsatzzahlen in der „Vermögensaufstellung“ und in den „Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen“ enthalten.

■ Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit diese nicht mehr Gegenstand der Vermögensaufstellung sind

Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schuldscheindarlehen (Marktzuordnung zum Berichtsstichtag):

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
---------------------	------	------------------------------------	-------------------	----------------------

An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere

Verzinsliche Wertpapiere

Euro

5,1420 % EURO-GALAXY V FRN V.21-34 'B'	XS2290520803	EUR	-	4.000.000
--	--------------	-----	---	-----------

Andere Wertpapiere

Euro

7,1740 % OAK HILL ECP 8 FRN V.21-35 CDO	XS2296337673	EUR	-	1.000.000
---	--------------	-----	---	-----------

■ Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben nach der Derivateverordnung

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

Sonstige Angaben

Anteilwert (EUR)	103,70
Umlaufende Anteile (STK)	1.064.890,9580

Angaben zum Bewertungsverfahren gemäß §§ 26-31 und 34 KARBV

Alle Vermögensgegenstände, die zum Handel an einer Börse oder einem anderem organisierten Markt zugelassen oder in diesen einbezogen sind, werden mit dem zuletzt verfügbaren Preis bewertet, der aufgrund von fest definierten Kriterien als handelbar eingestuft werden kann und der eine verlässliche Bewertung sicherstellt (§§ 27, 34 KARBV).

Die verwendeten Preise sind Börsenpreise, Notierungen auf anerkannten Informationssystemen oder Kurse aus emittentenunabhängigen Bewertungssystemen (§§ 28, 34 KARBV).

Anteile an Investmentvermögen werden mit ihrem zuletzt verfügbaren veröffentlichten Rücknahmekurs der jeweiligen Kapitalverwaltungsgesellschaft bewertet.

Bankguthaben werden zum Nennwert zuzüglich zugeflossener Zinsen, kündbare Festgelder zum Verkehrswert und Verbindlichkeiten zum Rückzahlungsbetrag bewertet (§§ 29, 34 KARBV).

Die Bewertung erfolgt grundsätzlich zum letzten gehandelten Preis gemäß festgelegtem Bewertungszeitpunkt (Vortag oder gleichtäglich).

Vermögensgegenstände, die nicht zum Handel an einem organisierten Markt zugelassen sind oder für die keine handelbaren Kurse festgestellt werden können, werden mit Hilfe von anerkannten Bewertungsmodellen auf Basis beobachtbarer Marktdaten bewertet. Ist keine Bewertung auf Basis von Modellen möglich, erfolgt eine Bewertung durch andere geeignete Verfahren zur Preisfeststellung (§§ 28, 34 KARBV). Andere geeignete Verfahren kann die Verwendung eines von einem Dritten ermittelten Preises sein und unterliegt einer Plausibilitätsprüfung durch die KVG.

Optionen und Futures, die zum Handel an einer Börse zugelassen oder in einem organisierten Markt einbezogen sind, werden zu dem jeweils verfügbaren handelbaren Kurs (Settlementpreis der jeweiligen Börse), der eine verlässliche Bewertung gewährleistet, bewertet.

