



RP Global Diversified Portfolio



Inhaltsverzeichnis

	Seite
Management und Verwaltung	2
Vermögensübersicht zum 30. Juni 2022	3
Vermögensaufstellung im Detail	4
Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen	6
Anhang zum Halbjahresbericht per 30. Juni 2022	8

Kapitalverwaltungsgesellschaft

WARBURG INVEST
KAPITALANLAGEGESELLSCHAFT MBH
Ferdinandstraße 75
D-20095 Hamburg
(im Folgenden: WARBURG INVEST)

Gezeichnetes und eingezahltes Kapital:
EUR 5.600.000,00
(Stand: 31. Dezember 2021)

Aufsichtsrat

Manuela Better
M.M.Warburg & CO (AG & Co.)
Kommanditgesellschaft auf Aktien, Hamburg
- Vorsitzende -

Thomas Fischer
Sprecher des Vorstandes
MARCARD, STEIN & CO AG, Hamburg
- stellv. Vorsitzender -

sowie

Dipl.-Kfm. Uwe Wilhelm Kruschinski
Hamburg

Geschäftsführung

Christian Schmaal

Matthias Mansel

Verwahrstelle

Kreissparkasse Köln
Neumarkt 18-24
50667 Köln

Abschlussprüfer

BDO AG
Wirtschaftsprüfungsgesellschaft
Fuhrentwiete 12
D-20355 Hamburg
DEUTSCHLAND
www.bdo.de

RP Global Diversified Portfolio

Vermögensübersicht zum 30. Juni 2022

	Wirtschaftliche Gewichtung	Geographische Gewichtung
I. Vermögensgegenstände	100,20 %	100,20 %
1. sonstige Wertpapiere		
	Indezertifikate auf Fonds	Luxemburg
	14,40 %	9,47 %
	Indezertifikate auf Edelmetalle /-Indizes	Jersey
	5,60 %	5,60 %
		Frankreich
		4,93 %
	gesamt	gesamt
	20,00 %	20,00 %
2. Wertpapier-Investmentanteile	79,55 %	79,55 %
3. Bankguthaben/Geldmarktfonds	0,65 %	0,65 %
II. Verbindlichkeiten	-0,20 %	-0,20 %
III. Fondsvermögen	100,00 %	100,00 %

Die Angabe der wirtschaftlichen und geographischen Gewichtung entfällt, sofern nicht angegeben.

Durch Rundungen bei der Berechnung des Prozentanteils am Nettoinventarwert können geringe Rundungsdifferenzen entstanden sein.

RP Global Diversified Portfolio

Vermögensaufstellung im Detail

Gattungsbezeichnung ISIN / VWG	Stück, Anteile bzw. Währung	Bestand 30.06.2022	Käufe / Zugänge Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs in Währung	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens	
Wertpapiervermögen						22.853.795,69	99,55
Börsengehandelte Wertpapiere						4.591.269,64	20,00
Zertifikate							
ETFS Metal INDEX-ZTF Gold Unze 999.9 o.E. DE000A1DCTL3	STK	7.700	950 1.650	EUR	166,8500	1.284.745,00	5,60
Guardian Segur INDEX-ZTF RP Immobilienanlagen Spez XS1489809266	STK	1.500	0 75	EUR	1.449,3400	2.174.010,00	9,47
SG Options EU INDEX-ZTF 30.06.2027 XS0356365527	USD	1.981.000	0 0	USD	59,7300	1.132.514,64	4,93
Investmentanteile						18.262.526,05	79,55
Gruppenfremde Investmentanteile							
AI Leaders Inhaber-Anteile C DE000A2PF0M4 / 1,23 %	STK	3.500	0 0	EUR	108,9200	381.220,00	1,66
AIS-Amundi MSCI EM LAT.AMERICA LU1681045024 / 0,20 %	STK	57.000	57.000 0	EUR	12,4260	708.282,00	3,09
Alturis Volatility Inhaber-Anteile S DE000A3C91U7 / 0,64 %	STK	5.000	5.000 0	EUR	92,5000	462.500,00	2,01
Assenagon Alpha Volatility Inhaber-Anteile I o.N. LU0575255335 / 0,80 %	STK	800	0 200	EUR	1.151,0200	920.816,00	4,01
CIM Dividend Income Fund Registered Shares B USD o IE00BYXW4535 / 1,59 %	STK	333.333	0 0	USD	1,8969	605.177,42	2,64
CONVERTINVEST Gl.Conv.Propert. Inhaber-Anteile I AT000A14J30 / 0,80 %	STK	2.600	0 2.150	EUR	105,8400	275.184,00	1,20
Csif(Ie)Etf-Ftse Epra Ndbg Etf Registered Shs A US IE00BMDX0K95 / 0,25 %	STK	7.800	7.800 0	EUR	110,5800	862.524,00	3,76
FAM Prämienstrategie FCP Act. au Port. I EUR Dis. LU2012959396 / 0,60 %	STK	1.150	1.150 0	EUR	864,0500	993.657,50	4,33
FAM Renten Spezial Inhaber-Anteile I DE000A14N878 / 0,60 %	STK	11.000	1.000 0	EUR	99,7600	1.097.360,00	4,78
Helium Fd-Helium Selection Actions-Nom. S Cap. EUR LU1112771768 / 1,00 %	STK	500	0 0	EUR	1.532,3090	766.154,50	3,34
Invescomi Us Real Estate IE00BYM8JD58 / 0,14 %	STK	42.000	10.000 13.000	USD	22,0900	887.997,70	3,87
iShs VII-MSCI EM Canada U.ETF Reg. Shares USD IE00B52SF786 / 0,48 %	STK	4.700	4.700 0	EUR	156,6800	736.396,00	3,21
Natixis AM Fds-Bd Alt.Risk Pr. Act. Nom. S1 EUR Ac LU2373384994 / 1,50 %	STK	11.000	11.000 0	EUR	110,1800	1.211.980,00	5,28
OptoFlex Inhaber-Anteile I o. N. LU0834815101 / 0,70 %	STK	1.240	830 340	EUR	1.413,9000	1.753.236,00	7,64
Quantex Fds-Quan.Global Val.Fd Inhaber-Anteile I E LI0399611685 / 1,05 %	STK	5.000	5.000 0	EUR	238,9500	1.194.750,00	5,20
Schroder ISF Asian Total Ret. Namens-Anteile C LU0326949186 / 1,00 %	STK	2.500	0 500	USD	328,2452	785.425,92	3,42
Storm Fund II-Storm Bond Fund Inhaber-Anteile IC LU0840158900 / 0,50 %	STK	10.000	10.000 0	EUR	117,8000	1.178.000,00	5,13
T. Rowe Price-US Small. Cos Eq Namens-Anteile Q Ac LU0929966207 / 0,95 %	STK	23.000	0 0	USD	28,0800	618.147,01	2,69
Twelve Cat Bond Ieoa IE00BD2B9827 / 0,90 %	STK	11.000	1.000 0	EUR	108,1500	1.189.650,00	5,18
Vontobel-Eu.Markets Corp.Bond Actions Nom. I USD LU1305089796 / 0,55 %	STK	8.000	0 0	USD	150,1900	1.150.000,00	5,01
Xtr.S&P Select Frontier Swap Inhaber-Anteile 1C o. LU0328476410 / 0,95 %	STK	39.000	39.000 0	EUR	12,4120	484.068,00	2,11

RP Global Diversified Portfolio

Gattungsbezeichnung ISIN / VWG	Stück, Anteile bzw. Währung	Bestand 30.06.2022	Käufe / Zugänge Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs in Währung	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Andere Vermögensgegenstände						
Bankguthaben					149.222,14	0,65
EUR-Guthaben bei: Verwahrstelle	EUR	131.757,63			131.757,63	0,57
Guthaben in nicht EU/EWR-Währungen Verwahrstelle	USD	18.246,92			17.464,51	0,08
Sonstige Verbindlichkeiten					-44.876,29	-0,20
Rückstellungen aus Kostenabgrenzung	EUR	-44.876,29			-44.876,29	-0,20
Fondsvermögen				EUR	22.958.141,54	100,00
Anteilswert				EUR	93,12	
Umlaufende Anteile				STK	246.538	

RP Global Diversified Portfolio

Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen

Gattungsbezeichnung ISIN / VWG	Stück, Anteile bzw. Währung	Käufe Zugänge	Verkäufe Abgänge
Investmentanteile			
KVG-eigene Investmentanteile			
RP Global Absolute Return Bond Inhaber-Anteile DE000A0MS7N7 / 1,00 %	STK	0	15.900
Gruppenfremde Investmentanteile			
Berenberg European Micro Cap Namens-Anteile M o.N. LU1637618825 / 0,11 %	STK	0	4.000
Greiff Systematic Allocation F Inhaber-Anteile I DE000A2JN5B4 / 1,00 %	STK	0	5.000
iShsII-Asia Property Yld U.ETF Registered Shs USD IE00B1FZS244 / 0,59 %	STK	32.000	32.000
Ishsvii-Core S+P500 Dlacc IE00B5BMR087 / 0,07 %	STK	0	4.000
Jan.Hend.Hor.-JHH P.Eur.Pr.Eq. Actions Nom. I2 LU0196034317 / 0,19 %	STK	0	10.000
MUL-L.EO 2-10Y Inf.Expect.U.E. Inhaber-Anteile LU1390062245 / 0,25 %	STK	12.500	12.500
Top Global Brands Inhaber-Anteile C DE000A2PEMK8 / 1,05 %	STK	0	10.000

RP Global Diversified Portfolio

Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen

Derivate

Gattungsbezeichnung

Volumen in 1.000

Terminkontrakte

Wertpapier-Terminkontrakte

Devisenterminkontrakte (Kauf)

Kauf von Devisen auf Termin DTG USD/EUR VERFALL 21.04.2022 Kreissparkasse Köln	EUR	2.035
---	-----	-------

Devisenterminkontrakte (Verkauf)

Verkauf von Devisen auf Termin DTG USD/EUR VERFALL 21.04.2022 Kreissparkasse Köln	EUR	2.287
--	-----	-------

DTG USD/EUR VERFALL 24.06.2022 Kreissparkasse Köln	EUR	2.323
--	-----	-------

Optionsrechte

Optionsrechte auf Aktienindex Derivate

Optionsrechte auf Aktienindizes

Gekaufte Verkaufsoptionen (Put) Put Dax 12000 14.04.2022 XEUR	EUR	13.500
--	-----	--------

Put Dax 12500 20.05.2022 XEUR	EUR	4.688
-------------------------------	-----	-------

Put Dax 13500 15.07.2022 XEUR	EUR	3.375
-------------------------------	-----	-------

Verkaufte Verkaufsoptionen (Put) Put Dax 12500 15.07.2022 XEUR	EUR	3.125
---	-----	-------

Anhang zum Halbjahresbericht per 30. Juni 2022

Bilanzierungs- und Bewertungsmethoden

Angaben zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände

- Die Bewertung erfolgt durch die Kapitalverwaltungsgesellschaft.
- Wertpapiere und Derivate, die zum Handel an einer Börse oder an einem anderen organisierten Markt zugelassen oder in den regulierten Markt oder Freiverkehr einer Börse einbezogen sind, werden, sofern vorhanden, grundsätzlich mit handelbaren Kursen bewertet.
- Die Bewertung von verzinslichen Wertpapieren, rentenähnlichen Genussscheinen und Zertifikaten, welche nicht an einer Börse oder an einem anderen organisierten Markt notiert oder gehandelt werden oder deren Börsenkurs den tatsächlichen Marktwert nicht angemessen widerspiegelt, werden mittels externer Modellkurse, z.B. Broker Quotes, bewertet. In begründeten Ausnahmefällen werden interne Modellkurse verwendet, die auf einer anerkannten und geeigneten Methodik beruhen.
- Sonstige Wertpapiere und Derivate, für die keine handelbaren Börsenkurse vorliegen, werden nach geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten bewertet.
- Anteile an Investmentvermögen werden mit ihrem letzten festgestellten Rücknahmepreis bewertet, sofern keine anderen Angaben unterhalb der Vermögensaufstellung erfolgen.
- Bankguthaben werden zum Nennwert zuzüglich aufgelaufener Zinsen bewertet.
- Sonstige Vermögensgegenstände werden zum Nennwert und Verbindlichkeiten werden zum Rückzahlungsbetrag bewertet.

Erläuterungen zur Vermögensaufstellung

- Die Anzahl der umlaufenden Anteile zum Ende des Berichtszeitraumes und der Anteilswert sind unterhalb der Vermögensaufstellung angegeben.
- Die Vermögensgegenstände des Sondervermögens sind auf der Grundlage nachstehender Kurse/Marktsätze bewertet:

Inländische Vermögenswerte	Kurse per 29. Juni 2022
Alle anderen Vermögenswerte	Kurse per 29. Juni 2022
Devisen	Kurse per 30. Juni 2022

- Auf von der Fondswährung abweichend lautende Vermögensgegenstände werden zu dem unter Zugrundelegung des Morning-Fixings der Reuters AG um 10.00 Uhr ermittelten Devisenkurses der Währung in EUR taggleich umgerechnet.

US-Dollar 1 EUR = USD 1,044800

- Kapitalmaßnahmen:

Alle Umsätze, die aus Kapitalmaßnahmen hervorgehen (technische Umsätze), werden als Zu- oder Abgang ausgewiesen.

Angaben zur Transparenz

- Die Beträge der Ausgabeaufschläge und Rücknahmeaufschläge im Zeitraum vom 01.01.2022 bis 30.06.2022 für den Erwerb und die Rücknahme von Anteilen an Zielfonds betragen:

Ausgabeaufschläge	0,00 EUR
Rücknahmeaufschläge	0,00 EUR

- Die Verwaltungsvergütungssätze für die am Berichtstag im Bestand befindlichen Sondervermögen und die Sondervermögen, die im Berichtszeitraum ge- und verkauft wurden, sind in der Vermögensaufstellung bzw. der Auflistung der während des Berichtszeitraumes abgeschlossenen Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen, aufgeführt. Das Zeichen „+“ bedeutet, dass ggf. eine erfolgsabhängige Vergütung berechnet werden kann. Die Angaben zu den Vergütungssätzen wurden Wertpapierinformationssystemen wie WM Datenservice und anderen Wertpapierinformationssystemen wie Morning Star und Onvista entnommen.
- Anteile von Investmentfonds der WARBURG INVEST werden i.d.R. unter Einschaltung Dritter, d.h. von Banken, Finanzdienstleistern, Maklern und anderen befugten dritten Personen erworben. Der Zusammenarbeit mit diesen Dritten liegt zumeist eine vertragliche Vereinbarung zugrunde, die festlegt, dass die WARBURG INVEST den Dritten für die Vermittlung der Fondsanteile eine bestandsabhängige Vergütung zahlt und den Dritten der Ausgabeaufschlag ganz oder teilweise zusteht. Die bestandsabhängige Vergütung zahlt die WARBURG INVEST aus den ihr zustehenden Verwaltungsvergütungen, d.h. aus ihrem eigenen Vermögen.
- Im Berichtszeitraum vom 01.01.2022 bis 30.06.2022 erhielt die Kapitalverwaltungsgesellschaft WARBURG INVEST für das Sondervermögen keine Rückvergütung der aus dem Sondervermögen an die Verwahrstelle oder an Dritte geleisteten Vergütungen und Aufwendererstattungen.

Angaben zur SFTR Verordnung 2015/2365

Die Angaben gem. SFTR Verordnung 2015/2365 entfallen, da im Berichtszeitraum keine Geschäfte im Sinne dieser Verordnung getätigt wurden.

Hinweis an die Anleger

Die diesem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Hamburg, den 26. Juli 2022

WARBURG INVEST
KAPITALANLAGEGESELLSCHAFT MBH
Die Geschäftsführung



Ferdinandstraße 75 • 20095 Hamburg • Tel. +49 40 3282 - 5100
Internet: www.warburg-fonds.com • E-Mail: info@warburg-invest.com