HALBJAHRESBERICHT

DES INVESTMENTFONDS (FONDS COMMUN DE PLACEMENT – FCP) FRANZÖSISCHEN RECHTS CARMIGNAC SECURITE

(für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2021)

HALBJAHRESBERICHT 2021 VON CARMIGNAC SECURITE

Merkmale des OGA

Bestimmung und Verwendung der ausschüttungsfähigen Beträge

Ausschüttungsfähige Beträge	Anteile „Acc“	Anteile „Dis“
Verwendung der Nettoerträge	Thesaurierung (Verbuchung nach der Methode der angefallenen Erträge)	Ausschüttung oder Vortrag nach Ermessen der Verwaltungsgesellschaft
Verwendung der realisierten Nettogewinne oder -verluste	Thesaurierung (Verbuchung nach der Methode der angefallenen Erträge)	Ausschüttung oder Vortrag nach Ermessen der Verwaltungsgesellschaft

VERMÖGENSAUFSTELLUNG IN EUR VON CARMIGNAC SECURITE

Bestandteile der Vermögensaufstellung	Betrag zum Abschluss des Berichtszeitraums*
a) In Abschnitt I, Absatz 1 des Artikels L. 214-20 des französischen Währungs- und Finanzgesetzes (Code monétaire et financier) genannte zulässige Finanztitel	7.413.832.235,80
b) Bankguthaben	351.479.528,27
c) Sonstige Aktiva des OGA	464.834.655,12
d) Aktiva des OGA insgesamt (Zeilen a+b+c)	8.230.146.419,19
e) Passiva	-562.933.903,03
f) Nettoinventarwert (Zeilen d+e = Nettovermögen des OGA)	7.667.212.516,16

*** Negative Beträge sind mit einem Minuszeichen gekennzeichnet.**

ANZAHL DER ANTEILE IM UMLAUF UND NETTOINVENTARWERT PRO ANTEIL VON CARMIGNAC SECURITE

Anteil	Anteilstyp	Nettovermögen pro Anteil	Anzahl der Anteile im Umlauf	Nettoinventarwert pro Anteil
CARMIGNAC SECURITE A EUR Acc in EUR	C	7.408.370.617,03	4.103.668,427	1.805,30
CARMIGNAC SECURITE A EUR Ydis in EUR	D	225.190.529,37	2.248.504,243	100,15
CARMIGNAC SECURITE A USD Acc Hdg in USD	C	39.907.159,40	315.456,920	126,50

BESTANDTEILE DES WERTPAPIERBESTANDS VON CARMIGNAC SECURITE

Bestandteile des Wertpapierbestands	Prozentsatz Nettovermögen*	% des Gesamtvermögens**
A) Zulässige Finanztitel und Geldmarktinstrumente, die an einem organisierten Markt im Sinne von Artikel L. 422-1 des Währungs- und Finanzgesetzes (Code monétaire et financier) zum Handel zugelassen sind. B) Zulässige Finanztitel und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen organisierten, anerkannten, für das Publikum offenen und ordnungsgemäß funktionierenden Markt gehandelt werden, deren Sitz sich in einem Mitgliedstaat der Europäischen Union oder einem anderen Staat befindet, der dem Europäischen Wirtschaftsraum angehört.	78,99	73,59
C) Zulässige Finanztitel und Geldmarktinstrumente, die zum amtlichen Handel an einer Wertpapierbörse eines Drittstaats zugelassen sind oder an einem anderen organisierten, anerkannten, für das Publikum offenen und ordnungsgemäß funktionierenden Markt eines Drittstaats gehandelt werden, sofern diese Börse oder dieser Markt nicht auf einer von der AMF veröffentlichten Liste steht oder die Auswahl dieser Börse oder dieses Markts per Gesetz oder im Reglement oder in der Satzung des Organismus für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren vorgesehen ist.	17,70	16,49
D) Neu emittierte zulässige Finanztitel, die in Abschnitt I, Absatz 4 des Artikels R. 214-11 des französischen Währungs- und Finanzgesetzes (Code monétaire et financier) genannt sind.	-	-
E) Sonstige Aktiva.	-	-

* *Siehe f) der Vermögensaufstellung*
** *Siehe d) der Vermögensaufstellung*

VERMÖGENSALLOKATION VON A), B), C), D) DES WERTPAPIERBESTANDS VON CARMIGNAC SECURITE NACH WÄHRUNG

Titel	Währung	Betrag (EUR)	Prozentsatz Nettovermögen*	% des Gesamtvermögens**
Euro	EUR	7.124.972.636,62	92,93	86,57
US-Dollar	USD	270.910.241,45	3,53	3,29
Schweizer Franken	CHF	17.949.357,73	0,23	0,22
GESAMT		7.413.832.235,80	96,70	90,08

** Siehe f) der Vermögensaufstellung*
*** Siehe d) der Vermögensaufstellung*

VERMÖGENSALLOKATION VON A), B), C), D) DES WERTPAPIERBESTANDS VON CARMIGNAC SECURITE NACH SITZLAND DES EMITTENTEN

Land	Prozentsatz Nettovermögen*	% des Gesamtvermögens**
Italien	24,63	22,94
Niederlande	9,47	8,82
Griechenland	7,65	7,13
Irland	7,12	6,63
Frankreich	6,75	6,29
Vereinigte Staaten	6,28	5,85
Luxemburg	5,13	4,78
Belgien	5,08	4,73
Spanien	3,48	3,25
Vereinigtes Königreich	3,38	3,15
Schweden	2,68	2,49
Russland	2,24	2,09
Mexiko	2,22	2,07
Deutschland	1,47	1,37
Dänemark	1,40	1,30
Rumänien	1,14	1,07
Kanada	0,95	0,88
Österreich	0,84	0,78
Republik Korea	0,72	0,67
Japan	0,67	0,62
Finnland	0,54	0,51
Norwegen	0,47	0,44
Portugal	0,41	0,38
Panama	0,38	0,35
Türkei	0,36	0,34
Tschechische Republik	0,31	0,29
Ungarn	0,22	0,21
Island	0,20	0,18
Singapur	0,17	0,16
San Marino	0,11	0,11
Kasachstan	0,11	0,10

VERMÖGENSALLOKATION VON A), B), C), D) DES WERTPAPIERBESTANDS VON CARMIGNAC SECURITE NACH SITZLAND DES EMITTENTEN (Fortsetzung)

Land	% des Nettovermögens*	% des Gesamtvermögens**
Jersey	0,06	0,05
Schweiz	0,05	0,05
GESAMT	96,70	90,08

* *Siehe f) der Vermögensaufstellung*
** *Siehe d) der Vermögensaufstellung*

ALLOKATION DER ANDEREN VERMÖGENSWERTE VON E) DES WERTPAPIERBESTANDS VON CARMIGNAC SECURITE NACH IHRER ART

Art des Vermögenswertes	Prozentsatz Nettovermögen*	% des Gesamtvermögens**
Organismen für gemeinsame Anlagen		
OGAW und AIF, die für nicht professionelle Anleger und ähnliche Adressaten anderer Länder bestimmt sind	-	-
Andere Fonds, die für nicht professionelle Anleger und ähnliche Adressaten anderer Mitgliedstaaten der Europäischen Union bestimmt sind	-	-
Professionelle allgemeine Fonds und ähnliche anderer Mitgliedstaaten der Europäischen Union und notierte Verbriefungsorganismen	-	-
Andere professionelle und ähnliche Fonds aus anderen Mitgliedstaaten der EU und nicht notierte Verbriefungsorganismen	-	-
Andere nicht europäische Organismen	-	-
Sonstige Aktiva		
Sonstige	-	-
GESAMT	-	-

* *Siehe f) der Vermögensaufstellung*

** *Siehe d) der Vermögensaufstellung*

VERÄNDERUNG DES WERTPAPIERBESTANDS VON CARMIGNAC SECURITE IM BERICHTSZEITRAUM IN EUR

Bestandteile des Wertpapierbestands	Veränderung (Betrag)	
	Käufe	Verkäufe
A) Zulässige Finanztitel und Geldmarktinstrumente, die an einem organisierten Markt im Sinne von Artikel L. 422-1 des Währungs- und Finanzgesetzes (Code monétaire et financier) zum Handel zugelassen sind. B) Zulässige Finanztitel und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen organisierten, anerkannten, für das Publikum offenen und ordnungsgemäß funktionierenden Markt gehandelt werden, deren Sitz sich in einem Mitgliedstaat der Europäischen Union oder einem anderen Staat befindet, der dem Europäischen Wirtschaftsraum angehört.	5.242.045.228,46	4.875.908.232,80
C) Zulässige Finanztitel und Geldmarktinstrumente, die zum amtlichen Handel an einer Wertpapierbörse eines Drittstaats zugelassen sind oder an einem anderen organisierten, anerkannten, für das Publikum offenen und ordnungsgemäß funktionierenden Markt eines Drittstaats gehandelt werden, sofern diese Börse oder dieser Markt nicht auf einer von der AMF veröffentlichten Liste steht oder die Auswahl dieser Börse oder dieses Markts per Gesetz oder im Reglement oder in der Satzung des Organismus für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren vorgesehen ist.	904.790.033,21	780.691.727,89
D) Neu emittierte zulässige Finanztitel, die in Abschnitt I, Absatz 4 des Artikels R. 214-11 des französischen Währungs- und Finanzgesetzes (Code monétaire et financier) genannt sind.	-	-
E) Sonstige Aktiva.	-	79.962.806,05

Das Portfolio des OGA ist erhältlich bei:

CARMIGNAC GESTION, 24, Place Vendôme, 75001 Paris

AUSSCHÜTTUNGEN IM BERICHTSZEITRAUM FÜR DEN CARMIGNAC SECURITE

	Anteil	Nettobetrag pro Anteil EUR	Steuergutschrift (1) EUR	Bruttobetrag pro Anteil (2)
Ausgeschüttete Dividenden				
30.04.2021	CARMIGNAC SECURITE D EUR	0,90	-	-
Auszuschüttende Dividenden				
	CARMIGNAC SECURITE D EUR	-	-	-

(1) Gemäß den geltenden gesetzlichen Bestimmungen wird die Steuergutschrift pro Anteil erst am Datum der Ausschüttung festgelegt.
(2) Gemäß den geltenden gesetzlichen Bestimmungen wird der Bruttobetrag pro Anteil erst am Datum der Ausschüttung festgelegt.

HALBJAHRESBERICHT ZUM 30.06.2021 VON CARMIGNAC SECURITE

Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften und der Weiterverwendung von Finanzinstrumenten (SFTR-Verordnung) in der Währung der Buchführung des OGA (EUR)

Im Laufe des Geschäftsjahres wurden für den OGA keine Transaktionen ausgeführt, die unter die SFTR-Verordnung fallen.

AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS VON CARMIGNAC SECURITE ZUM 30.06.2021

Wertpapierbezeichnung	Währung	Anzahl/Nennwert	Aktueller Wert	% des Nettovermögens
Anleihen und ähnliche Wertpapiere				
An einem organisierten oder gleichwertigen Markt gehandelte Anleihen und ähnliche Wertpapiere				
DEUTSCHLAND				
BAYER 0.375% 06-07-24	EUR	19.400.000	19.696.895,74	0,25
DEUTSCHE PFANDBRIEFBANK AG 2.875% 28-06-27	EUR	10.000.000	10.216.300,68	0,14
MERCK KGAA 1.625% 09-09-80	EUR	7.400.000	7.732.652,81	0,10
MUNICH RE 1.25% 26-05-41	EUR	12.900.000	13.127.647,89	0,17
VANTAGE TOWERS AG 0.0% 31-03-25	EUR	18.900.000	18.843.867,00	0,25
VANTAGE TOWERS AG 0.375% 31-03-27	EUR	15.100.000	15.094.873,24	0,19
VOLKSWAGEN LEASING 0.0000010% 12-07-23	EUR	16.808.000	16.833.968,36	0,22
VOLKSWAGEN LEASING E3R+0.45% 06-07-21	EUR	11.400.000	11.400.798,00	0,15
DEUTSCHLAND INSGESAMT			**112.947.003,72**	**1,47**
ÖSTERREICH				
ERSTE GROUP BANK AG 6.5% PERP	EUR	9.400.000	10.698.492,11	0,14
ERST GROU BA 8.875% PERP EMTN	EUR	17.000.000	17.752.401,89	0,24
OMV AG 2.5% PERP	EUR	18.600.000	19.884.551,67	0,26
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG 6.125% PERP	EUR	14.800.000	15.705.093,19	0,20
ÖSTERREICH INSGESAMT			**64.040.538,86**	**0,84**
BELGIEN				
BELGIUM GOVERNMENT BOND 0.0% 22-10-31	EUR	365.000.000	361.242.325,00	4,71
COMMUNAUT FRANAISE DE BELGIUM 0.625% 11-06-35	EUR	18.400.000	18.554.460,44	0,24
KBC GROUPE 4.25% PERP	EUR	9.200.000	9.857.775,11	0,13
BELGIEN INSGESAMT			**389.654.560,55**	**5,08**
KANADA				
QUEBEC MONTREAL 0.0% 29-10-30	EUR	36.823.000	36.099.612,17	0,47
QUEBEC MONTREAL 0.25% 05-05-31	EUR	36.634.000	36.612.468,74	0,48
KANADA INSGESAMT			**72.712.080,91**	**0,95**
DÄNEMARK				
DANSKE BA 5.875% PERP EMTN	EUR	11.453.000	12.029.832,22	0,15
DANSKE BK 0.5% 27-08-25	EUR	29.093.000	29.526.133,00	0,39
DANSKE BK 1.375% 24-05-23	EUR	29.294.000	29.716.541,87	0,39
DANSKE BK 1.625% 15-03-24 EMTN	EUR	13.594.000	14.272.989,57	0,18
DANSKE BK 2.5% 21-06-29 EMTN	EUR	7.639.000	8.060.431,60	0,11
DANSKE BK 3,001% 20-09-22	USD	15.800.000	13.501.250,33	0,18
DÄNEMARK INSGESAMT			**107.107.178,59**	**1,40**
SPANIEN				
BANCO DE BADELL 1.75% 10-05-24	EUR	7.900.000	8.222.526,16	0,11
BANCO DE SABADELL SA 6.5% PERP	EUR	14.400.000	14.935.008,52	0,20
BANCO NTANDER E3R+0.68% 29-01-26	EUR	15.300.000	15.360.707,00	0,20
BANCO SANTANDER SA 5.25% PERP	EUR	7.400.000	7.852.421,12	0,10
BANKIA 0.875% 25-03-24	EUR	13.600.000	13.993.152,71	0,18
BANKIA 1.0% 25-06-24 EMTN	EUR	13.100.000	13.455.098,83	0,18
BANKIA 1.125% 12-11-26	EUR	25.000.000	26.004.267,12	0,34
BANKIA 6.375% PERP	EUR	3.600.000	3.943.933,34	0,05
BANKIA SA 3.75% 15-02-29 EMTN	EUR	8.200.000	8.960.183,81	0,11

AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS VON CARMIGNAC SECURITE ZUM 30.06.2021 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Währung	Anzahl/Nennwert	Aktueller Wert	% des Nettovermögens
BANKINTER 0.875% 08-07-26 EMTN	EUR	6.200.000	6.406.436,22	0,08
BANKINTERSA 2.5% 06-04-27	EUR	16.600.000	17.010.250,81	0,22
BBVA 5.875% PERP	EUR	7.800.000	8.449.912,96	0,11
CAIXABANK 0.375% 18-11-26 EMTN	EUR	18.700.000	18.778.014,86	0,24
CAIXABANK 0.625% 01-10-24 EMTN	EUR	7.600.000	7.761.779,53	0,10
CELLNEX FINANCE 1.25% 15-01-29	EUR	18.300.000	18.018.578,59	0,24
CELLNEX FINANCE 1.5% 08-06-28	EUR	22.900.000	22.975.828,80	0,30
CELLNEX TELECOM 1.0% 20-04-27	EUR	9.000.000	8.940.555,00	0,12
FERROVIAL EMISIONES 1,382% 14-05-26	EUR	21.100.000	22.364.212,57	0,29
INTL CONSOLIDATED AIRLINES GROU 0,5% 04-07-23	EUR	16.100.000	15.759.526,90	0,21
NT CONS FIN 0.375% 17-01-25	EUR	7.800.000	7.908.774,74	0,10
SPANIEN INSGESAMT			**267.101.169,59**	**3,48**
VEREINIGTE STAATEN				
AMERICAN TOWER 0.45% 15-01-27	EUR	22.940.000	22.976.997,82	0,30
ATHENE GLOBAL FUNDING 1.875% 23-06-23	EUR	31.257.000	32.472.032,38	0,42
BOOKING 0.1% 08-03-25	EUR	30.280.000	30.390.756,31	0,40
CYRUSONE LP 1.125% 26-05-28	EUR	11.904.000	11.858.114,97	0,15
EATON CAPITAL UN 0.128% 08-03-26	EUR	39.760.000	39.813.548,55	0,52
EXPEDIA GROUP 6,25% 01-05-25	USD	1.976.000	1.954.106,00	0,03
FIDELITY NATL INFORMATION SCES 0.75% 21-05-23	EUR	27.929.000	28.415.886,64	0,37
FORD MOTOR COMPANY 8.5% 21-04-23	USD	49.445.000	47.238.086,44	0,61
FORD MOTOR COMPANY 9.0% 22-04-25	USD	56.498.000	59.492.741,78	0,78
GOLDMAN SACHS 4,75% 10/21	EUR	10.980.000	11.504.361,18	0,15
GOLD SACH GR 0.125% 19-08-24	EUR	7.569.000	7.601.399,99	0,10
LIBERTY MUTUAL GROUP 3.625% 23-05-59	EUR	21.341.000	22.367.984,47	0,29
MORGAN STANLEY CAPITAL SERVICE 1.342% 23-10-26	EUR	22.419.000	23.774.796,09	0,31
NETFLIX 3.625% 15-06-30	EUR	33.283.000	39.717.496,07	0,52
STANDARD INDUSTRIES 2.25% 21-11-26	EUR	14.225.000	14.380.146,03	0,19
STRYKER CORP 0,25% 03-12-24	EUR	40.804.000	41.289.371,96	0,54
SYSCO 1.25% 23-06-23	EUR	37.011.000	37.964.522,50	0,50
THE PRIC GRP 2,15% 25-11-22	EUR	7.833.000	8.154.897,14	0,10
VEREINIGTE STAATEN VON AMERIKA INSGESAMT			**481.367.246,32**	**6,28**
FINNLAND				
NESTE OYJ 0.75% 25-03-28	EUR	17.100.000	17.064.419,12	0,23
NESTE OYJ 1.5% 07-06-24	EUR	16.500.000	17.096.349,55	0,22
NESTE OYJ 2,125% 17-03-22	EUR	7.400.000	7.519.690,95	0,10
FINNLAND INSGESAMT			**41.680.459,62**	**0,55**
FRANKREICH				
ACCOR 2.5% 25-01-24	EUR	7.600.000	8.050.960,58	0,10
ACCOR 3.625% 17-09-23	EUR	7.600.000	8.340.754,82	0,11
ACCOR 4.375% PERP	EUR	20.700.000	21.928.676,86	0,29
ALD 0.375% 18-07-23 EMTN	EUR	7.600.000	7.706.670,68	0,10
ALD 0.375% 19-10-23 EMTN	EUR	12.400.000	12.555.435,70	0,16
BNP PARIBAS FIX PERP	EUR	3.850.000	4.063.367,95	0,06
BQ POSTALE 0.875% 26-01-31	EUR	8.800.000	8.862.600,55	0,11
BURE VERI 1.25% 07-09-23	EUR	13.700.000	14.173.752,57	0,19

AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS VON CARMIGNAC SECURITE ZUM 30.06.2021 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Währung	Anzahl/Nennwert	Aktueller Wert	% des Nettovermögens
COVIVIO SA 1.625% 17-10-24	EUR	17.189.000	18.284.047,61	0,24
CREDIT LOGEMENT 1.35% 28-11-29	EUR	5.800.000	6.026.919,44	0,08
DANONE 0.0% 01-12-25 EMTN	EUR	14.100.000	14.168.173,50	0,18
DEXGRP 0.01 01/22/27	EUR	13.800.000	13.906.523,71	0,18
FIRMENICH PRODUCTIONS PARTICIPATIONS SAS 1.375% 30-10-26	EUR	13.302.000	14.324.783,49	0,19
FRAN 0.125% 16-03-26	EUR	18.900.000	18.952.255,91	0,25
FRAN 0.75% 17-03-31	EUR	15.900.000	16.203.915,43	0,21
IPNFP 1 7/8 06/16/23	EUR	7.600.000	7.822.732,58	0,10
IPSOS 2.875% 21-09-25	EUR	23.400.000	25.599.830,79	0,34
ORANGE 5.25% PERP	EUR	22.024.000	25.222.681,29	0,33
ORPEA 2.0% 01-04-28	EUR	23.600.000	24.027.067,86	0,32
ORPEA 2.625% 10-03-25 EMTN	EUR	6.600.000	7.018.892,96	0,09
RENAULT CREDIT INTL BANQUE 0.75% 10-04-23	EUR	30.034.000	30.484.374,23	0,39
RENAULT CREDIT INTL BANQUE 1.375% 08-03-24	EUR	21.880.000	22.706.732,80	0,29
SG 0.875% 01-07-26 EMTN	EUR	15.000.000	15.361.409,59	0,20
SOCIETE FONCIERE FINANCIERE ET DE PARTIC 1.875% 30-10-26	EUR	7.900.000	8.418.363,37	0,11
SOCI FONC LYO 1.875% 26-11-21	EUR	38.300.000	38.860.276,53	0,51
SOCI FONC LYO 2.25% 16-11-22	EUR	14.300.000	14.892.660,56	0,19
SOCI GENE 2.5% 16-09-26	EUR	3.800.000	3.895.739,18	0,05
SUEZ 0.0% 09-06-26 EMTN	EUR	18.900.000	18.856.057,50	0,25
TIKEHAU CAPITAL 1.625% 31-03-29	EUR	3.800.000	3.769.202,56	0,05
TIKEHAU CAPITAL 2.25% 14-10-26	EUR	5.600.000	5.953.886,63	0,07
TIKEHAU CAPITAL 3.0% 27-11-23	EUR	25.300.000	27.236.983,60	0,36
TOTALENERGIES SE 2.0% PERP	EUR	14.227.000	14.583.431,17	0,19
TOTALENERGIES SE 3.369% PERP	EUR	11.222.000	12.748.237,66	0,17
WORLDLINE 0.25% 18-09-24	EUR	22.500.000	22.732.216,95	0,29
FRANKREICH INSGESAMT			**517.739.616,61**	**6,75**
GRIECHENLAND				
GRECE 3% 24/02/2023	EUR	1.903.182	2.064.430,14	0,03
HELLENIC REPUBLIC GOVERNMENT BOND 0.0% 12-02-26	EUR	62.883.000	62.798.422,37	0,82
HELLENIC REPUBLIC GOVERNMENT BOND 0.75% 18-06-31	EUR	59.430.000	59.068.527,20	0,77
HELLENIC REPUBLIC GOVERNMENT BOND 3.375% 15-02-25	EUR	46.183.000	52.636.049,37	0,69
HELLENIC REPUBLIC GOVERNMENT BOND 3.45% 02-04-24	EUR	30.741.000	34.170.661,78	0,45
HELLENIC REPUBLIC GOVERNMENT BOND 3.5% 30-01-23	EUR	113.491.322	122.120.774,59	1,59
HELLENIC REPUBLIC GOVERNMENT BOND 4.375% 01-08-22	EUR	11.660.000	12.729.444,82	0,16
PUBLIC POWER CORPORATION OF GREECE 3.875% 30-03-26	EUR	21.328.000	22.597.324,07	0,29
GRIECHENLAND INSGESAMT			**368.185.634,34**	**4,80**
UNGARN				
OTP BANK PLC 2.875% 15-07-29	EUR	16.000.000	16.950.576,44	0,22
UNGARN INSGESAMT			**16.950.576,44**	**0,22**
IRLAND				
ADAGIO V CLO DAC E3R+0.0% 15-10-31	EUR	7.500.000	7.525.209,75	0,10
ADAGIO VI CLO DAC E3R+1.25% 30-04-31	EUR	10.355.000	10.347.583,93	0,13
AIB GROUP 1.875% 19-11-29 EMTN	EUR	15.137.000	15.705.821,50	0,21
AIB GROUP 4.263% 10-04-25 EMTN	USD	13.234.000	12.164.312,12	0,15
AIB GROUP 6.25% PERP	EUR	7.000.000	7.992.578,20	0,10

AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS VON CARMIGNAC SECURITE ZUM 30.06.2021 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Währung	Anzahl/Nennwert	Aktueller Wert	% des Nettovermögens
AURIUM CLO II DAC E3R+0.93% 22-06-34	EUR	20.000.000	20.000.000,00	0,26
AVOCA XIV E3R+0.81% 12-01-31	EUR	17.665.000	17.699.660,89	0,23
BLACK DIAMOND CLO E3R+0.86% 20-01-32	EUR	9.500.000	9.524.845,44	0,12
BLACK DIAMOND CLO E3R+1.4% 20-01-32	EUR	16.300.000	16.236.153,05	0,21
BLACK DIAMOND CLO E3R+1.95% 20-01-32	EUR	8.200.000	8.201.610,37	0,11
BLACKROCK EUROPEAN CLO IV DAC 2.05% 15-07-30	EUR	16.761.000	16.904.161,10	0,22
BLACKROCK EUROPEAN CLO IV DAC E3R+0.85% 15-07-30	EUR	20.730.000	20.771.109,42	0,27
CARLYLE EURO CLO 20171 DAC E3R+0.93% 15-07-34	EUR	29.162.000	29.162.000,00	0,38
CARLYLE GLOBAL MKT EURO CLO 20152 E3R+0.73% 21-09-29	EUR	23.235.000	13.863.432,92	0,18
FCA BANK SPA IRISH BRANCH 0.5% 13-09-24	EUR	6.782.000	6.905.703,68	0,09
FCA BANK SPA IRISH BRANCH 0.5% 18-09-23	EUR	15.374.000	15.604.402,56	0,21
FCA BANK SPA IRISH BRANCH 0.625% 24-11-22	EUR	24.413.000	24.757.519,27	0,32
GLG EURO CLO II DAC E3R+1.7% 15-01-30	EUR	7.707.000	7.748.442,50	0,10
HARVEST CLO XII E3R+0.87% 18-11-30	EUR	6.614.000	6.634.398,98	0,09
HARVEST CLO XII E3R+1.35% 18-11-30	EUR	5.446.000	5.437.408,46	0,07
HARVEST CLO XII E3R+1.85% 18-11-30	EUR	2.866.000	2.861.540,83	0,04
HARVEST CLO XV 1.7% 22-11-30	EUR	21.000.000	21.361.691,17	0,28
HARVEST CLO XXVI DAC E3R+0.94% 15-01-34	EUR	15.000.000	15.000.000,00	0,19
HARVT VIII E3R+1.15% 15-01-31	EUR	4.900.000	4.803.201,42	0,07
HARVT VIII E3R+1.65% 15-01-31	EUR	2.600.000	2.590.589,88	0,04
OAK HILL EUROPEAN CREDIT PARTN E3R+1.65% 20-10-31	EUR	9.378.000	9.403.206,81	0,12
OCP EURO CLO 20172 DAC E3R+0.82% 15-01-32	EUR	5.823.000	5.835.203,19	0,07
OCP EURO CLO 20172 DAC E3R+1.35% 15-01-32	EUR	8.627.000	8.665.574,09	0,11
OCP EURO CLO 20172 DAC E3R+1.8% 15-01-32	EUR	3.020.000	3.008.908,21	0,04
OCP EURO CLO 20172 DAC E3R+5.0% 15-01-32	EUR	5.176.000	5.101.199,84	0,06
PENTA CLO 3 DESIGNATED ACTIVIT E3R+0.85% 17-04-30	EUR	12.791.000	12.816.670,81	0,17
PENTA CLO 3 DESIGNATED ACTIVIT E3R+1.9% 17-04-30	EUR	4.411.000	4.411.107,52	0,05
RYANAIR 0.875% 25-05-26 EMTN	EUR	16.280.000	16.369.799,81	0,21
RYANAIR 2.875% 15-09-25 EMTN	EUR	18.170.000	20.318.829,00	0,27
ST PAULS CLO IV DAC 2.05% 25-04-30	EUR	7.400.000	7.507.805,26	0,10
ST PAULS CLO IV DAC E3R+0.85% 25-04-30	EUR	12.190.000	12.212.993,55	0,16
ST PAULS CLO IV DAC E3R+1.3% 25-04-30	EUR	7.000.000	6.958.177,54	0,10
ST PAULS CLO IV DAC E3R+1.85% 25-04-30	EUR	6.650.000	6.606.132,44	0,09
ST PAULS CLO IX DAC E3R+0.82% 15-11-30	EUR	24.000.000	24.041.423,77	0,31
TORO EUROPEAN CLO 2 E3R+1.65% 15-10-30	EUR	5.064.000	5.076.914,32	0,07
TYMON PARK CLO E3R+1.45% 21-01-29	EUR	4.500.000	4.482.104,04	0,06
VENDOME FUNDING CLO 20201 DAC E3R+0.95% 20-07-34	EUR	20.000.000	20.000.000,00	0,26
VOYA EURO CLO II DAC E3R+0.96% 15-07-35	EUR	25.000.000	25.000.000,00	0,33
WILLOW PARK CLO DAC E3R+0.84% 15-01-31	EUR	9.926.000	9.944.948,95	0,13
WILLOW PARK CLO DAC E3R+1.35% 15-01-31	EUR	12.274.000	12.259.907,26	0,16
WILLOW PARK CLO DAC E3R+1.8% 15-01-31	EUR	6.176.000	6.207.907,20	0,08
IRLAND INSGESAMT			**546.032.191,05**	**7,12**
ISLAND				
ARION BANK 0.625% 27-05-24	EUR	14.950.000	15.090.701,00	0,20
ISLAND INSGESAMT			**15.090.701,00**	**0,20**

AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS VON CARMIGNAC SECURITE ZUM 30.06.2021 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Währung	Anzahl/Nennwert	Aktueller Wert	% des Nettovermögens
ITALIEN				
AMCO AM COMPANY 0.75% 20-04-28	EUR	34.849.000	34.780.870,21	0,45
ATLANTIA EX AUTOSTRADE 1.875% 12-02-28	EUR	42.279.000	43.901.320,52	0,57
AUTOSTRADE PER L ITALILIA 2.0% 04-12-28	EUR	28.889.000	30.484.304,00	0,40
CASSA DEP 1.0% 11-02-30 EMTN	EUR	12.200.000	12.485.699,77	0,17
CASSA DEP 1.875% 07-02-26 EMTN	EUR	11.500.000	12.458.566,75	0,16
CASSA DEP 2.125% 21-03-26 EMTN	EUR	3.800.000	4.171.132,99	0,05
CASSA DEP 2.7% 28-06-26	EUR	36.214.000	38.347.728,88	0,51
CCTS 0 06/15/22	EUR	89.057.000	89.474.115,78	1,17
CDEP 1 09/21/28	EUR	39.700.000	41.247.141,63	0,54
DAVIDE CAMPARI MILANO 1.25% 06-10-27	EUR	23.040.000	23.789.084,05	0,31
ENEL 1.375% PERP	EUR	20.412.000	20.306.263,04	0,26
ENEL 2.25% PERP	EUR	7.378.000	7.787.939,37	0,10
ENELIM 8.75% 24/09/2073	USD	7.378.000	7.386.271,05	0,10
ENI 2.0% PERP	EUR	22.849.000	22.932.840,18	0,30
ENI 2.625% PERP	EUR	38.459.000	40.930.607,15	0,53
ENI 2.75% PERP	EUR	7.792.000	7.882.603,88	0,11
FINEBANK BANCA FINE 5.875% PERP	EUR	3.972.000	4.347.930,16	0,06
INTE 0.625% 24-02-26 EMTN	EUR	20.358.000	20.392.441,27	0,26
INTE 1.0% 04-07-24 EMTN	EUR	15.551.000	16.173.043,20	0,21
INTE 1.35% 24-02-31 EMTN	EUR	7.373.000	7.408.827,22	0,09
INTE E3R+1.61% 03-03-23 EMTN	EUR	13.500.000	13.777.261,88	0,18
ISPIM 2 1/8 08/30/23	EUR	3.733.000	3.982.457,98	0,05
ITALIE 6 7/8% 23	USD	69.650.000	67.607.154,23	0,88
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 0.95% 01-03-37	EUR	53.200.000	50.862.672,46	0,67
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 0.95% 01-12-31	EUR	221.745.000	223.885.249,33	2,92
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 0.95% 15-09-27	EUR	235.968.000	245.800.517,25	3,21
ITALY CERT DI CREDITO DEL TESOROCCT E6R+0.5% 15-04-26	EUR	190.523.000	191.642.322,63	2,49
ITALY CERT DI CREDITO DEL TESOROCCT E6R+0,55% 15-12-23	EUR	75.207.000	75.803.293,32	0,99
ITALY CERT DI CREDITO DEL TESOROCCT E6R+0.95% 15-04-25	EUR	74.960.000	76.784.913,69	1,00
ITALY CERT DI CREDITO DEL TESOROCCT E6R+1.85% 15-01-25	EUR	192.472.000	204.228.959,65	2,66
MEDIOBANCABCA CREDITO FINANZ 1.125% 15-07-25	EUR	7.644.000	8.011.327,18	0,11
MEDIOBANCABCA CREDITO FINANZ 1.625% 07-01-25	EUR	14.166.000	15.026.876,55	0,19
MEDIOBANCABCA CREDITO FINANZ L3RUSD+0.5% 04-03-22	USD	2.266.000	1.908.249,66	0,03
MONTE PASCHI 0.875% 08-10-26	EUR	14.920.000	15.628.934,02	0,20
POSTE ITALIANE 2.625% PERP	EUR	27.569.000	27.583.896,70	0,36
SOCIETA PER LA GESTIONE DI ATTIVITA 1.375% 27-01-25	EUR	31.178.000	32.687.380,37	0,43
SOCIETA PER LA GESTIONE DI ATTIVITA 1.5% 17-07-23	EUR	38.490.000	40.298.012,39	0,52
SOCIETA PER LA GESTIONE DI ATTIVITA 2.25% 17-07-27	EUR	68.551.000	76.503.624,99	1,00
UBI BANCA UNIONE DI BANCHE ITALIANE 4.375% 12-07-29	EUR	11.093.000	12.583.193,35	0,16
UNICREDIT 0.5% 09-04-25 EMTN	EUR	7.661.000	7.757.074,19	0,10
UNICREDIT 2.2% 22-07-27 EMTN	EUR	4.754.000	5.159.038,52	0,07
UNICREDIT SPA 6.625% PERP	EUR	3.632.000	3.936.159,36	0,05
ITALIEN INSGESAMT			**1.888.147.300,80**	**24,62**
JAPAN				
ASAHI BREWERIES 0.01% 19-04-24	EUR	10.500.000	10.529.035,38	0,14
ASAHI BREWERIES 0.155% 23-10-24	EUR	13.838.000	13.944.762,07	0,18

AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS VON CARMIGNAC SECURITE ZUM 30.06.2021 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Währung	Anzahl/Nennwert	Aktueller Wert	% des Nettovermögens
ASAHI BREWERIES 0.336% 19-04-27	EUR	11.250.000	11.300.863,56	0,15
NIDEC 0.046% 30-03-26	EUR	11.310.000	11.316.333,55	0,15
NIDEC 0.487% 27-09-21	EUR	3.896.000	3.916.937,90	0,05
JAPAN INSGESAMT			**51.007.932,46**	**0,67**
JERSEY				
HSBC CAPIT TF/TV PERP PF *EUR	USD	3.118.000	4.359.206,24	0,06
JERSEY INSGESAMT			**4.359.206,24**	**0,06**
KASACHSTAN				
EURASIA DEV BK 1.0% 17-03-26	EUR	8.480.000	8.500.619,18	0,11
KASACHSTAN INSGESAMT			**8.500.619,18**	**0,11**
LUXEMBURG				
ALTICE FIN 4.75% 15-01-28	EUR	16.277.000	16.299.864,66	0,21
ALTICE FRANCE 8.0% 15-05-27	EUR	22.151.000	24.168.279,26	0,31
ANDORRA INTL BOND 1.25% 06-05-31	EUR	20.000.000	20.449.741,10	0,27
BECTON DICKINSON EURO FINANCE SARL 1.208% 04-06-26	EUR	22.312.000	23.388.703,15	0,30
BLACKSTONE PROPERTY PARTNERS 0.5% 12-09-23	EUR	27.986.000	28.349.501,72	0,37
DANFOSS FINANCE I BV 0.125% 28-04-26	EUR	22.458.000	22.441.102,66	0,29
DANFOSS FINANCE I BV 0.375% 28-10-28	EUR	17.218.000	17.105.442,63	0,23
EUROFINS SCIENTIFIC 2.125% 25-07-24	EUR	6.253.000	6.751.495,16	0,09
EUROFINS SCIENTIFIC 2.875% PERP	EUR	18.735.000	19.629.456,38	0,26
EUROPEAN UNION 0.0% 04-07-31	EUR	25.417.000	25.377.476,57	0,33
EURO SCIE 4.875% PERP	EUR	6.039.000	6.547.380,81	0,08
GAZ CAPITAL 2.25% 19-07-22	CHF	18.925.000	17.949.357,73	0,23
GAZ CAPITAL 2.949% 24-01-24	EUR	24.319.000	25.923.964,72	0,34
GAZ CAPITAL 3.125% 17-11-23	EUR	13.527.000	14.550.181,35	0,19
MOHAWK CAPITAL FINANCE 1.75% 12-06-27	EUR	10.800.000	11.591.574,16	0,15
MOHAWK CAPITAL FINANCE SA E3R+0.2% 04-09-21	EUR	23.900.000	23.924.258,50	0,31
SBB TREASURY OYJ 1.125% 26-11-29	EUR	23.680.000	23.628.150,53	0,31
SBB TREASURY OYJ E3R+0.65% 01-02-23	EUR	24.448.000	24.502.763,52	0,32
SIX FINANCE LUXEMBOURG 0.0000010% 02-12-25	EUR	16.800.000	16.793.952,00	0,22
TRATON FINANCE LUXEMBOURG 0.125% 24-03-25	EUR	24.200.000	24.275.805,67	0,32
LUXEMBURG INSGESAMT			**393.648.452,28**	**5,13**
MEXIKO				
AMERICA MOVIL SAB DE CV 6.375/TV 06/09/2073	EUR	22.509.000	26.604.008,41	0,34
PEME PET 1.875% 21-04-22 EMTN	EUR	15.956.000	16.083.865,48	0,21
PEMEX PETROLEOS MEXICAN 3.75% 16/04/2026	EUR	1.589.000	1.617.833,93	0,02
PETROLEOS MEXICANOS 2.5% 21-08-21	EUR	60.743.000	62.199.334,23	0,81
PETROLEOS MEXICANOS 2.75% 21/04/27 EMTN	EUR	7.899.000	7.432.403,36	0,10
PETROLEOS MEXICANOS 3.625% 24-11-25	EUR	34.595.000	35.790.406,53	0,47
PETROLEOS MEXICANOS 3.75% 21-02-24	EUR	19.497.000	20.387.406,62	0,27
MEXIKO INSGESAMT			**170.115.258,56**	**2,22**
NORWEGEN				
ADEVINTA A 3.0% 15-11-27	EUR	2.394.000	2.490.278,70	0,04
AKER BP A 1.125% 12-05-29 EMTN	EUR	13.801.000	13.862.854,95	0,18
AKER BP A 2.875% 15-01-26	USD	9.858.000	8.892.165,43	0,12
SANTANDER CONSUMER BANK AS 0.125% 11-09-24	EUR	10.500.000	10.562.231,92	0,13
NORWEGEN INSGESAMT			**35.807.531,00**	**0,47**

AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS VON CARMIGNAC SECURITE ZUM 30.06.2021 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Währung	Anzahl/Nennwert	Aktueller Wert	% des Nettovermögens
PANAMA				
CARNIVAL CORP	EUR	6.981.000	7.932.127,78	0,10
CARNIVAL CORPORATION 11.5% 01-04-23	USD	21.546.000	21.042.005,36	0,27
PANAMA INSGESAMT			**28.974.133,14**	**0,37**
NIEDERLANDE				
CAIRN CLO VIII BV E3R+0.86% 30-10-30	EUR	7.400.000	7.411.786,11	0,09
CAIRN CLO VIII BV E3R+1.3% 30-10-30	EUR	9.525.000	9.534.528,02	0,13
CAIRN CLO VIII BV E3R+1.85% 30-10-30	EUR	4.000.000	4.004.492,07	0,05
CONTI GUMMI FINANCE BV 2.125% 27-11-23	EUR	10.741.000	11.420.836,15	0,15
DIGITAL DUTCH FINCO BV 0.625% 15-07-25	EUR	22.300.000	22.882.083,46	0,30
DRYDEN 39 EURO CLO 2015 BV 2.05% 15-10-31	EUR	10.635.000	10.750.127,30	0,14
DRYDEN 39 EURO CLO 2015 BV E3R+0.87% 15-10-31	EUR	13.329.000	13.369.613,75	0,18
DRYDEN 39 EURO CLO 2015 BV E3R+1.35% 15-10-31	EUR	3.545.000	3.550.104,17	0,05
DRYDEN 39 EURO CLO 2015 BV E3R+1.9% 15-10-31	EUR	9.749.000	9.806.221,64	0,12
DRYDEN 56 EURO CLO 2017 BV 2.1% 15-01-32	EUR	9.496.000	9.663.407,52	0,13
DRYDEN 56 EURO CLO 2017 BV E3R+0.81% 15-01-32	EUR	6.906.000	6.943.471,42	0,09
DRYDEN 56 EURO CLO 2017 BV E3R+1.75% 15-01-32	EUR	5.413.000	5.433.281,91	0,07
EURONEXT NV 0.125% 17-05-26	EUR	16.427.000	16.482.318,49	0,22
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV 3.875% 05-01-26	EUR	7.639.000	8.924.126,24	0,11
GROSVENOR PLACE CLO 20151 BV E3R+1.2% 30-10-29	EUR	6.200.000	6.198.243,03	0,08
IBERDROLA INTL BV 3.25% PERP	EUR	11.000.000	12.117.663,29	0,16
IMCD NV 2.5% 26-03-25	EUR	16.674.000	17.583.272,05	0,23
ING GROEP NV 1.625% 26-09-29	EUR	8.700.000	9.136.837,73	0,12
ING GROEP NV 6.875% PERP	USD	6.100.000	5.434.441,54	0,07
JDE PEET S BV 0.0% 16-01-26	EUR	40.162.000	39.946.129,25	0,52
JUBILEE CLO 2015XV BV E3R+1.35% 12-07-28	EUR	1.572.000	1.567.852,51	0,02
JUBILEE CLO 2017XIX BV E3R+0.8% 15-07-30	EUR	8.763.000	8.770.295,26	0,12
JUBILEE CLO 2017XIX BV E3R+1.25% 15-07-30	EUR	13.774.000	13.778.338,91	0,18
JUBILEE CLO 2017XIX BV E3R+1.75% 15-07-30	EUR	6.134.000	6.092.389,78	0,07
LSEG NETHERLANDS BV 0.0% 06-04-25	EUR	15.080.000	15.088.746,40	0,20
NE PROPERTY BV 2.625% 22-05-23	EUR	17.402.000	18.157.396,98	0,23
NEW EUROPE PROPERTY COOPERATIF 1.75% 23-11-24	EUR	32.986.000	34.314.375,59	0,45
PENTA CLO 2015 2X ANE E3R+0.79% 04-08-28	EUR	11.834.000	5.238.147,19	0,07
PROSUS NV 1.539% 03-08-28 EMTN	EUR	36.565.000	38.399.127,45	0,50
PROSUS NV 2.031% 03-08-32 EMTN	EUR	22.514.000	23.612.331,92	0,31
REPSOL INTL FINANCE BV 2.5% PERP	EUR	23.159.000	23.497.498,92	0,31
REPSOL INTL FINANCE BV 3.75% PERP	EUR	21.526.000	23.123.821,90	0,30
REPSOL INTL FINANCE BV 4.247% PERP	EUR	7.201.000	8.108.040,13	0,11
SGS NEDERLAND HOLDING BV 0.125% 21-04-27	EUR	9.400.000	9.388.875,81	0,12
STELLANTIS NV 3.75% 29-03-24	EUR	8.390.000	9.316.635,85	0,12
SYNGENTA FINANCE NV 3.375% 16-04-26	EUR	15.256.000	17.111.432,63	0,22
TEVA PHAR FIN 1.125% 15-10-24	EUR	5.536.000	5.243.913,44	0,07
TEVA PHAR FIN 1.25% 31-03-23	EUR	62.747.000	61.674.649,47	0,81
TEVA PHAR FIN 1.625% 15-10-28	EUR	3.919.000	3.516.324,09	0,05
TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE II BV 3.25% 15-04-22	EUR	1.040.000	1.058.253,44	0,01

AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS VON CARMIGNAC SECURITE ZUM 30.06.2021 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Währung	Anzahl/Nennwert	Aktueller Wert	% des Nettovermögens
TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE II BV 6.0% 31-01-25	EUR	21.472.000	23.724.949,60	0,31
TIKEHAU CLO III BV E3R+0.87% 01-12-30	EUR	11.573.000	11.577.190,30	0,15
TIKEHAU CLO III BV E3R+1.4% 01-12-30	EUR	13.252.000	13.217.667,57	0,17
TIKEHAU CLO III BV E3R+1.85% 01-12-30	EUR	7.951.000	7.886.288,91	0,10
UPJOHN FINANCE BV 1.023% 23-06-24	EUR	17.200.000	17.693.506,64	0,23
VOLKSWAGEN INTL FINANCE NV 3.375% PERP	EUR	37.300.000	39.923.768,86	0,52
WABTEC TRANSPORTATION NETHERLANDS BV 1.25% 03-12-27	EUR	9.569.000	9.671.801,21	0,13
WINTERSHALL DEA SCHWEIZ BV 0.452% 25-09-23	EUR	17.600.000	17.833.330,19	0,23
WINTERSHALL DEA SCHWEIZ BV 0.84% 25-09-25	EUR	13.900.000	14.267.152,32	0,19
WIZZ AIR FINANCE CO BV 1.35% 19-01-24	EUR	12.224.000	12.567.198,01	0,16
NIEDERLANDE INSGESAMT			**726.014.286,42**	**9,47**
PORTUGAL				
CAIXA GERAL DE DEPOSITOS 10,75% PERP	EUR	18.200.000	19.518.630,44	0,25
REGIAO AUTONOMA MADEIRA	EUR	12.200.000	11.905.060,82	0,16
PORTUGAL INSGESAMT			**31.423.691,26**	**0,41**
REPUBLIK KOREA				
LG CHEM 0.5% 15-04-23	EUR	31.069.000	31.406.362,52	0,41
POSCO REGS 0.5% 17-01-24	EUR	23.829.000	24.084.898,98	0,31
REPUBLIK KOREA INSGESAMT			**55.491.261,50**	**0,72**
TSCHECHISCHE REPUBLIK				
RAIFFEISENBANK AS 1.0% 09-06-28	EUR	12.000.000	12.017.761,64	0,16
SAZKA GROUP AS 3.875% 15-02-27	EUR	11.295.000	11.600.998,81	0,15
TSCHECHISCHE REPUBLIK INSGESAMT			**23.618.760,45**	**0,31**
RUMÄNIEN				
GLOBALWORTH REAL ESTATE INVESTMENTS 2.95% 29-07-26	EUR	15.175.000	16.872.973,36	0,22
GLOBALWORTH REAL ESTATE INVESTMENTS 3.0% 29-03-25	EUR	16.000.000	17.360.131,51	0,23
ROMANIAN GOVERNMENT INTL BOND 1.375% 02-12-29	EUR	8.054.000	8.112.885,22	0,11
ROMANIAN GOVERNMENT INTL BOND 2.75% 26-02-26	EUR	15.108.000	16.879.460,60	0,22
ROMANIAN GOVERNMENT INTL BOND 3,375% 28-01-50	EUR	8.864.000	9.616.971,91	0,13
ROU 3.875% 29-10-35 EMTN	EUR	15.648.000	18.829.808,59	0,24
RUMÄNIEN INSGESAMT			**87.672.231,19**	**1,15**
VEREINIGTES KÖNIGREICH				
BARCLAYS 3,375% 02-04-25 EMTN	EUR	11.341.000	12.456.266,95	0,16
BARCLAYS PLC 2.0% 07-02-28	EUR	3.744.000	3.869.892,77	0,06
CARNIVAL 1.0% 28-10-29	EUR	4.318.000	3.586.496,79	0,05
CHANEL CERES 0.5% 31-07-26	EUR	13.800.000	13.972.892,26	0,18
CHANNEL LINK ENTERPRISES FINANCE PLC 1.761% 30-06-50	EUR	21.600.000	21.568.947,34	0,28
CHANNEL LINK ENTERPRISES FINANCE PLC 2.706% 30-06-50	EUR	16.960.000	17.346.386,33	0,23
CRED SUI 1.5% 10-04-26 EMTN	EUR	22.431.000	23.910.009,49	0,31
FCE BANK 0.869% 13-09-21 EMTN	EUR	18.029.000	18.183.454,44	0,24
HSBC HOLDINGS PLC 5.25% PERP	EUR	11.190.000	11.901.265,59	0,15
INFORMA 1.25% 22-04-28 EMTN	EUR	3.814.000	3.896.159,31	0,05
INFORMA 2.125% 06-10-25 EMTN	EUR	11.756.000	12.713.243,57	0,16
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP 1.75% 02-03-26	EUR	36.912.000	39.139.983,04	0,51
SANTANDER UK GROUP E3R+0.78% 18-05-23	EUR	23.465.000	23.590.156,44	0,31
SCOTTISH AND SOUTHERN ENERGY PLC 4.75% 16-09-77	USD	18.869.000	16.745.439,73	0,21

AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS VON CARMIGNAC SECURITE ZUM 30.06.2021 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Währung	Anzahl/Nennwert	Aktueller Wert	% des Nettovermögens
SONGBIRD ESTATES 1.75% 07-04-26	EUR	15.750.000	15.937.535,59	0,21
STANDARD CHARTERED 1.2% 23-09-31	EUR	14.953.000	15.047.062,56	0,20
SWISS RE FINANCE UK 2.714% 04-06-52	EUR	4.900.000	5.414.558,67	0,07
VEREINIGTES KÖNIGREICH INSGESAMT			**259.279.750,87**	**3,38**
RUSSLAND				
GAZPROM 1.5% 17-02-27	EUR	30.079.000	30.238.206,50	0,39
GAZPROM 2.95% 15-04-25	EUR	28.000.000	29.992.455,07	0,40
RUSSIAN FOREIGN BOND EUROBOND 1.125% 20-11-27	EUR	59.900.000	60.088.479,86	0,78
RUSSIAN FOREIGN BOND EUROBOND 2.875% 04-12-25	EUR	46.300.000	51.430.553,74	0,67
RUSSLAND INSGESAMT			**171.749.695,17**	**2,24**
SAN MARINO				
SAN MARINO GOVERNMENT BOND 3.25% 24-02-24	EUR	8.359.000	8.723.722,06	0,12
SAN MARINO INSGESAMT			**8.723.722,06**	**0,12**
SINGAPUR				
ICBC SGP 0.25% 25-04-22 EMTN	EUR	13.134.000	13.191.405,48	0,17
SINGAPUR INSGESAMT			**13.191.405,48**	**0,17**
SCHWEDEN				
AB SAGAX 2.0% 17-01-24	EUR	35.600.000	37.475.439,70	0,49
CASTELLUM AB 0.75% 04-09-26	EUR	8.004.000	8.109.011,93	0,11
INTRUM JUSTITIA AB 2.75% 15-07-22	EUR	12.388.000	1.257.210,98	0,02
SAMHALLSBYGGNADSBOLAGET I NORDEN AB 1.0% 12-08-27	EUR	20.705.000	21.131.558,45	0,28
SAMHALLSBYGGNADSBOLAGET I NORDEN AB 1.125% 04-09-26	EUR	21.460.000	22.223.920,15	0,29
SAMHALLSBYGGNADSBOLAGET I NORDEN AB 2.624% PERP	EUR	10.219.000	10.314.845,14	0,13
SAMHALLSBYGGNADSBOLAGET I NORDEN AB 2.625% PERP	EUR	18.288.000	18.486.259,46	0,24
SCANIA CV AB 0.125% 13-02-23	EUR	15.555.000	15.621.591,38	0,20
SCANIA CV AB E3R+0.5% 10-12-21	EUR	33.416.000	33.467.961,88	0,43
SWEDBANK AB 6.0% PERP	USD	3.600.000	3.184.811,54	0,05
VOLVO TREASURY AB 0.0% 18-05-26	EUR	10.071.000	10.058.310,54	0,13
VOLVO TREASURY AB E3R+0.5% 09-08-21	EUR	23.900.000	23.909.082,00	0,31
SCHWEDEN INSGESAMT			**205.240.003,15**	**2,68**
SCHWEIZ				
UBS GROUP AG 5.75% PERP	EUR	3.801.000	4.006.242,81	0,05
SCHWEIZ INSGESAMT			**4.006.242,81**	**0,05**
TÜRKEI				
TURKEY 4,35 11/12/21	EUR	26.714.000	27.821.544,14	0,36
TÜRKEI INSGESAMT			**27.821.544,14**	**0,36**
An einem organisierten oder gleichwertigen Markt gehandelte Anleihen und ähnliche Wertpapiere INSGESAMT			**7.195.401.985,76**	**93,85**
Anleihen und ähnliche Wertpapiere INSGESAMT			**7.195.401.985,76**	**93,85**
Forderungspapiere				
An einem organisierten oder gleichwertigen Markt gehandelte Forderungspapiere				
GRIECHENLAND				
HELLENIC T-BILL ZCP 011021	EUR	17.563.000	17.577.194,56	0,23
HELLENIC T-BILL ZCP 060821	EUR	41.000.000	41.016.219,78	0,53
HELLENIC TBILL ZCP 10-12-21	EUR	68.889.000	68.982.436,71	0,90
HELLENIC TBILL ZCP 11-03-22	EUR	30.000.000	30.056.398,33	0,40

AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS VON CARMIGNAC SECURITE ZUM 30.06.2021 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Währung	Anzahl/Nennwert	Aktueller Wert	% des Nettovermögens
HELLENIC TBILL ZCP 29-10-21	EUR	60.737.000	60.798.000,66	0,79
GRIECHENLAND INSGESAMT			**218.430.250,04**	**2,85**
An einem organisierten oder gleichwertigen Markt gehandelte Forderungspapiere INSGESAMT			**218.430.250,04**	**2,85**
Forderungspapiere INSGESAMT			**218.430.250,04**	**2,85**
Organismen für gemeinsame Anlagen				
OGAW und AIF, die für nicht professionelle Anleger und ähnliche Adressaten anderer Länder bestimmt sind				
FRANKREICH				
CARMIGNAC COURT TERME CCT – A EUR ACC EUR	EUR	1,812	6.681,41	0,00
FRANKREICH INSGESAMT			**6.681,41**	**0,00**
OGAW und AIF, die für nicht professionelle Anleger und ähnliche Adressaten anderer Länder bestimmt sind, INSGESAMT			**6.681,41**	**0,00**
Organismen für gemeinsame Anlagen INSGESAMT			**6.681,41**	**0,00**
Terminfinanzinstrumente				
Verpflichtungen aus fixen Termingeschäften				
Verpflichtungen aus fixen Termingeschäften an organisierten oder gleichwertigen Märkten				
90DAY EURODLR 0323	USD	-3.634	-42.885,43	0,00
90DAY EURODLR 0622	USD	3.634	4.581,19	0,00
LIFFE LG GILT 0921	GBP	-1.739	-1.011.569,48	-0,01
US 10YR NOTE 0921	USD	-3.238	383.965,52	0,01
XEUR FOAT EUR 0921	EUR	-541	-299.360,70	-0,01
Verpflichtungen aus fixen Termingeschäften an organisierten oder gleichwertigen Märkten INSGESAMT			**-965.268,90**	**-0,01**
Verpflichtungen aus fixen Termingeschäften INSGESAMT			**-965.268,90**	**-0,01**
Verpflichtungen aus bedingten Termingeschäften				
Verpflichtungen aus bedingten Termingeschäften an organisierten Märkten				
CBOT US TRES NT 5A 08/2021 CALL 124.5	USD	-5.618	-407.116,69	-0,01
CBOT US TRES NT 5A 08/2021 PUT 123	USD	-5.618	-1.480.415,72	-0,02
Verpflichtungen aus bedingten Termingeschäften an organisierten Märkten INSGESAMT			**-1.887.532,41**	**-0,03**
Verpflichtungen aus bedingten Termingeschäften INSGESAMT			**-1.887.532,41**	**-0,03**
Sonstige Terminfinanzinstrumente				
Zinsswaps				
E6R/0.0/FIX/0.0262	EUR	295.100.000	1.469.006,16	0,01
E6R/0.0/FIX/0.0595	EUR	146.000.000	561.530,60	0,01
E6R/0.0/FIX/0.0627	EUR	73.000.000	257.170,07	0,01
E6R/0.0/FIX/0.0655	EUR	58.400.000	189.223,79	0,00
E6R/0.0/FIX/0.0657	EUR	146.000.000	470.111,89	0,00
E6R/0.0/FIX/0.0957	EUR	25.417.000	5.934,45	0,00
E6R/0.0/FIX/0.0997	EUR	67.300.000	-141.162,50	0,00
E6R/0.0/FIX/0.1045	EUR	145.092.000	-95.026,39	0,00
E6R/0.0/FIX/0.1116	EUR	228.100.000	-752.513,31	-0,01
E6R/0.0/FIX/0.1157	EUR	36.700.000	-125.328,97	0,00
E6R/0.0/FIX/0.1222	EUR	73.000.000	58.077,17	0,00
E6R/0.0/FIX/0.9077	EUR	105.400.000	-72.957,88	0,00
E6R/0.0/FIX/0.992	EUR	107.700.000	-512.555,07	-0,01
FIX/0.1045/E6R/0.0	EUR	145.092.000	95.026,39	0,00
FIX/-0.282/E6R/0.0	EUR	284.200.000	-75.052,48	0,00

AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS VON CARMIGNAC SECURITE ZUM 30.06.2021 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Währung	Anzahl/Nennwert	Aktueller Wert	% des Nettovermögens
FIX/-0.346/E6R/0.0	EUR	280.300.000	-940.340,32	-0,01
FIX/0.445/E6R/0.0	EUR	55.300.000	-424.088,02	0,00
FIX/0.4617/E6R	EUR	22.658,61	52,87	0,00
FIX/0.5135/E6R/0.0	EUR	56.100.000	654.110,42	0,01
FIX/0,542/FIX/3,001	EUR	14.344.030	14.398.468,59	0,19
FIX/0,542/FIX/3,001	USD	0,00	-13.517.455,94	-0,18
FIX 0.589 / SONIO	GBP	545.988.000	-457.613,56	-0,01
FIX 0.599 / SONIO	GBP	440.432.000	-420.243,29	0,00
L3MUSD/0.0/FIX/2.498	USD	150.500.000	-3.273.816,00	-0,04
NIBO6R/0.0/FIX/1.437	NOK	725.445.000	22.798,09	0,00
WIBO6M/0.0/FIX/1.39	PLN	362.722.000	96.679,50	0,00
Zinsswaps INSGESAMT			**-2.529.963,74**	**-0,03**
Inflationsswaps				
CPURNSA0./FIX 2.636	USD	145.800.000	457.929,70	0,01
FIX/1.375/CPTFEMU	EUR	44.000.000	716.189,66	0,01
FIX/1.377/CPTFEMU.0	EUR	36.500.000	585.792,51	0,01
FIX/1.3815/CPTFEMU	EUR	36.500.000	567.067,83	0,00
FIX/1.3815/CPTFEMU/0	EUR	183.000.000	2.843.107,21	0,03
FIX/1.502/CPTFEMU	EUR	44.000.000	-735.839,23	-0,01
FIX/1.504/CPTFEMU.0	EUR	36.500.000	-597.322,55	-0,01
FIX/1.507/CPTFEMU	EUR	36.500.000	-577.681,65	0,00
FIX/1.507/CPTFEMU.0	EUR	183.000.000	-2.896.321,68	-0,04
SONIO/FIC/ 0.589	GBP	108.357.000	90.818,17	0,00
Inflationsswaps INSGESAMT			**453.739,97**	**0,00**
Credit Default Swap				
BARC BK 2.65 01-21_2	EUR	212.000.000	895.864,89	0,02
EASYJET 1,75 02-23_2	EUR	11.700.000	-405.260,18	-0,01
EASYJET 1,75 02-23_2	EUR	2.925.000	-101.315,05	0,00
Credit Default Swap INSGESAMT			**389.289,66**	**0,01**
Sonstige Terminfinanzinstrumente INSGESAMT			**-1.686.934,11**	**-0,02**
Terminfinanzinstrumente INSGESAMT			**-4.539.735,42**	**-0,06**
Aufforderungen zur Nachschusszahlung				
APPEL MARGE B.P.S.S.	EUR	299.360,7	299.360,70	0,00
APPEL MARGE B.P.S.S.	GBP	868.381,83	1.011.569,49	0,02
APPEL MARGE B.P.S.S.	USD	-409.919,71	-345.661,28	-0,01
Aufforderungen zur Nachschusszahlung INSGESAMT			**965.268,91**	**0,01**
Forderungen			**452.210.992,79**	**5,90**
Verbindlichkeiten			**-516.272.207,90**	**-6,74**
Finanzkonten			**321.009.280,57**	**4,19**
Nettovermögen			**7.667.212.516,16**	**100,00**



CARMIGNAC GESTION
24, place Vendôme – 75001 Paris
Tel.: (+33) 01 42 86 53 35 – Fax: (+33) 01 42 86 52 10

Portfolioverwaltungsgesellschaft (AMF-Zulassung vom 13.03.1997 unter der Nummer GP 97-08)
Aktiengesellschaft mit einem Kapital von 15.000.000 EUR – Handelsregister Paris B 349 501 676

www.carmignac.com