



Halbjahresbericht zum 30. September 2019

UniAbsoluterErtrag

Verwaltungsgesellschaft:
Union Investment Luxembourg S.A.

Inhaltsverzeichnis

	Seite
Vorwort	3
UniAbsoluterErtrag	5
Wertentwicklung des Fonds	5
Geografische Länderaufteilung	5
Wirtschaftliche Aufteilung	5
Zusammensetzung des Fondsvermögens	6
Zurechnung auf die Anteilklassen	6
Vermögensaufstellung	7
Devisenkurse	13
Zu- und Abgänge im Berichtszeitraum	13
Erläuterungen zum Bericht	20
Sonstige Informationen der Verwaltungsgesellschaft	22
Verwaltungsgesellschaft, Verwaltungsrat, Geschäftsführer, Gesellschafter, Portfoliomanagement, Abschlussprüfer (Réviseur d'entreprises agréé), Verwahrstelle, Zahl- und Vertriebsstellen	25

Hinweis

Der Erwerb von Anteilen darf nur auf der Grundlage des aktuellen Verkaufsprospektes und den wesentlichen Anlegerinformationen, denen der letzte Jahresbericht und gegebenenfalls der letzte Halbjahresbericht beigelegt sind, erfolgen.

Vorwort

Union Investment – Ihrem Interesse verpflichtet

Mit einem verwalteten Vermögen von rund 357 Milliarden Euro zählt die Union Investment Gruppe zu den größten deutschen Fondsgesellschaften für private und institutionelle Anleger. Sie ist Experte für Fondsvermögensverwaltung in der genossenschaftlichen FinanzGruppe. Etwa 4,5 Millionen private und institutionelle Anleger vertrauen uns als Partner für fondsbasierte Vermögensanlagen.

Die Idee der Gründung 1956 ist heute aktueller denn je: Privatanleger sollten die Chance haben, an der wirtschaftlichen Entwicklung teilzuhaben - und das bereits mit kleinen monatlichen Sparbeiträgen. Die Interessen dieser Investoren sind bis heute zentrales Anliegen für uns, dem wir uns mit unseren rund 3.190 Mitarbeitern verpflichtet fühlen. Rund 1.230 Publikums- und Spezialfonds bieten privaten und institutionellen Anlegern Lösungen, die auf ihre individuellen Anforderungen zugeschnitten sind – von Aktien-, Renten- und Geldmarktfonds über Offene Immobilienfonds bis hin zu intelligenten Lösungen zur Vermögensbildung, zum Risikomanagement oder zur privaten und betrieblichen Altersvorsorge.

Die Basis der starken Anlegerorientierung von Union Investment bildet die partnerschaftliche Zusammenarbeit mit den Beratern der Volks- und Raiffeisenbanken. In rund 10.500 Bankstellen stehen sie den Anlegern für eine individuelle Beratung in allen Fragen der Vermögensanlage zur Seite.

Besten Beleg für die Qualität unseres Fondsmanagements: unsere Auszeichnungen für einzelne Fonds – und das gute Abschneiden in Branchenratings. So wurden mehrere Fonds von Union Investment im Januar bei den Euro Fund Awards 2019 vom Finanzen Verlag für ihre gute Wertentwicklung in verschiedenen Zeiträumen ausgezeichnet. Zudem hat das Fachmagazin Capital in seinem Fonds-Kompass Union Investment im Februar 2019 erneut mit der Höchstnote von fünf Sternen bedacht und als Top-Fondsgesellschaft ausgezeichnet. Damit sind wir die einzige Fondsgesellschaft, die diese renommierte Auszeichnung seit ihrer erstmaligen Vergabe im Jahr 2003 ohne Unterbrechung erhalten hat.

Darüber hinaus wurde Union Investment im November 2018 bei den Scope Awards 2019 zum fünften Mal in Folge als bester Asset Manager in der Kategorie „Socially Responsible Investing“ prämiert. Außerdem erhielten wir den Scope Alternative Investment Award 2019 in den Kategorien „Institutional Real Estate Germany“ sowie „Institutional Real Estate Operator-Run Properties“.

Rentenmärkte profitieren von Lockerung der Geldpolitik

Nach der im Frühjahr erfolgten geldpolitischen Wende der US-Notenbank Fed senkte diese Ende Juli erstmals seit zehn Jahren die Zinsen um 25 Basispunkte. Im September erfolgte dann im Rahmen einer nunmehr verstärkt datenabhängigen Bewertung der US-Wirtschaft eine erneute Leitzinssenkung um weitere 25 Basispunkte. Die US-Notenbanker waren sich im Gremium bezüglich der Zinspolitik aber sehr uneins. Die Rendite zehnjähriger US-Schatzanweisungen fiel im Berichtshalbjahr von 2,4 auf 1,67 Prozent. Die US-Zinskurve zeigte sich im Berichtszeitraum teilweise invers (zwei bis zehn Jahre). Gemessen am JP Morgan Global Bond US-Index gewannen US-Treasuries im Berichtszeitraum 5,8 Prozent hinzu.

Auch die Europäische Zentralbank (EZB) hat sich aufgrund schlechter Konjunkturdaten im Euroraum recht schnell von einem zunächst angedachten restriktiveren geldpolitischen Kurs verabschiedet – bevor sie diesen überhaupt eingeschlagen hatte. Im September wurden angesichts der schwachen Konjunktorentwicklung im Euroraum zahlreiche geldpolitische Maßnahmen beschlossen. Allerdings herrschte auch im EZB-Rat Uneinigkeit hinsichtlich der Geldpolitik. Kontrovers wurden vor allem die Anleihekäufe diskutiert. Der Einlagensatz der EZB lag zuletzt bei minus 0,5 Prozent. Die Rendite zehnjähriger Bundesanleihen fiel in den vergangenen sechs Monaten von minus sieben auf minus 58 Basispunkte. Die deutsche Zinskurve tendierte deutlich flacher. Auch an den Peripheriemärkten, wo der italienische Haushaltsstreit lange die Schlagzeilen beherrschte, war ein deutlicher Renditerückgang zu beobachten. Insgesamt gewannen europäische Staatsanleihen (iBoxx € Sovereigns-Index) im Berichtszeitraum 7,3 Prozent hinzu.

Europäische Unternehmenspapiere gerieten angesichts stark rückläufiger Renditen an den Staatsanleihemärkten verstärkt in den Blickpunkt der Anleger. Einhergehend mit dem allgemeinen Renditeverfall sowie weitgehend soliden Wirtschaftsdaten zeigten europäische Firmenanleihen aufwärts. Auch die Aussicht auf die dann auch zuletzt beschlossenen EZB-Ankäufe unterstützte. Auf Indexebene (ICE BofA Merrill Lynch Euro Corporate-Index) gewann der Gesamtmarkt rund 3,5 Prozent hinzu. Die Risikoprämien schwankten deutlich, lagen im Berichtshalbjahr aber letztlich nahezu unverändert.

Anleihen aus den Schwellenländern profitierten auf Gesamtmarktebene ebenfalls vom nach unten gerichteten Zinsumfeld. Im Rahmen nachgebender Renditen bei US-Staatsanleihen tendierten Staatsanleihen aus den Schwellenländern freundlich. Der repräsentative J.P. Morgan Global Bond Emerging Market-Index gewann im Berichtsjahr trotz des Handelsstreits zwischen den USA und China 5,6 Prozent hinzu. Die Risikoprämien schwankten deutlich und gaben per saldo letztlich um 14 auf zuletzt 337 Basispunkte nach.

Aktienmärkte größtenteils aufwärts mit deutlichen Schwankungen

Die globalen Aktienbörsen verbuchten im Berichtszeitraum Zuwächse, begleitet von deutlichen Schwankungen. Der MSCI-World-Index gewann dabei insgesamt 4,1 Prozent. Vor allem die Lockerung der Geldpolitik, zeitweise ermutigende Signale im Handelsstreit zwischen den USA und China sowie solide Unternehmensergebnisse unterstützten zunächst die Notierungen. Seit Mai verschärfte sich der Handelsstreit jedoch immer wieder, was zwischenzeitlich zu Kursrückschlägen führte. Ab Juni setzte sich der Aufwärtstrend zunächst fort, nachdem die US-Notenbank Federal Reserve erstmals seit zehn Jahren Leitzinssenkungen ins Gespräch brachte. Ende Juli ließ sie schließlich mit einem ersten Zinsschritt um 25 Basispunkte Taten folgen. Dabei gab sie zu verstehen, dass kein größerer Zinssenkungszyklus bevorstehe. Im September folgte dann doch eine weitere Zinssenkung, nicht zuletzt da sich die Konjunktur inzwischen weltweit abgekühlt hat. Die US-Börsen konnten im Berichtszeitraum per saldo zulegen. Der Dow Jones Industrial Average stieg um 3,8 Prozent, der marktweite S&P 500-Index schloss 5,0 Prozent fester.

Europa wurde neben der Handelsthematik von politischen Ereignissen bewegt. So herrschte auch nach dem Amtsantritt von Boris Johnson als britischer Premierminister weiter große Unsicherheit in der Brexit-Frage. Die italienische Schuldenproblematik blieb zunächst ebenfalls ungeklärt. Ende August wurde überraschend eine neue Regierungskoalition gebildet, was für Beruhigung an den Märkten sorgte. Die Europäische Zentralbank führte auf ihrer Sitzung im September weitere geldpolitische Lockerungsmaßnahmen durch. Der EURO STOXX 50-Index kletterte in den vergangenen sechs Monaten um 6,5 Prozent und der STOXX Europe 600-Index legte um 3,7 Prozent zu.

Japanische Aktien konnten mit den Kursgewinnen in den USA und Europa nicht mithalten. Im Mai und im August fielen dort die Rückschläge aufgrund schwacher Konjunkturdaten und der Yen-Stärke besonders hoch aus. Zudem eskalierte ein Streit mit Südkorea. Der Nikkei 225-Index stieg im Berichtszeitraum um 2,6 Prozent. Die Börsen der Schwellenländer mussten sogar Verluste hinnehmen, denn der Handelskonflikt hinterließ Spuren. Der MSCI Emerging Markets-Index sank in Lokalwährung um 3,6 Prozent.

Wichtiger Hinweis:

Die Datenquelle der genannten Finanzindizes ist, sofern nicht anders ausgewiesen, Datastream. Die Quelle für alle Angaben der Anteilwertentwicklung auf den nachfolgenden Seiten sind eigene Berechnungen von Union Investment nach der Methode des Bundesverbands Deutscher Investmentgesellschaften (BVI), sofern nicht anders ausgewiesen. Die Kennzahlen veranschaulichen die Wertentwicklung in der Vergangenheit. Zukünftige Ergebnisse können sowohl niedriger als auch höher ausfallen.

Detaillierte Angaben zur Verwaltungsgesellschaft und Verwahrstelle des Investmentvermögens (Fonds) finden Sie auf den letzten Seiten dieses Berichtes.

UniAbsoluterErtrag

Klasse A
WKN A14QFP
ISIN LU1206678580

Klasse -net- A
WKN A14QFQ
ISIN LU1206679554

Klasse I
WKN A14TBZ
ISIN LU1235247720

Halbjahresbericht
01.04.2019 - 30.09.2019

Wertentwicklung in Prozent ¹⁾

	6 Monate	1 Jahr	3 Jahre	10 Jahre
Klasse A	-0,35	-3,09	-5,59	-
Klasse -net- A	-0,49	-3,37	-6,41	-
Klasse I	-0,26	-2,92	-5,09	-

1) Auf Basis veröffentlichter Anteilwerte (BVI-Methode).

Geografische Länderaufteilung ¹⁾

Luxemburg	47,20 %
Irland	15,52 %
Deutschland	8,94 %
Großbritannien	6,94 %
Schweiz	5,45 %
Finnland	3,77 %
Frankreich	3,56 %
Australien	2,80 %
Vereinigte Staaten von Amerika	1,81 %
Vereinigte Arabische Emirate	1,52 %
Marokko	0,45 %
Wertpapiervermögen	97,96 %
Optionen	0,18 %
Terminkontrakte	-0,39 %
Credit Default Swaps	-0,09 %
Sonstige Finanzinstrumente	-0,08 %
Bankguthaben	0,34 %
Sonstige Vermögensgegenstände/Sonstige Verbindlichkeiten	2,08 %
Fondsvermögen	100,00 %

1) Aufgrund von Rundungsdifferenzen in den Einzelpositionen können die Summen vom tatsächlichen Wert abweichen.

Wirtschaftliche Aufteilung ¹⁾

Investmentfondsanteile	84,99 %
Diversifizierte Finanzdienste	9,35 %
Multisektor	1,65 %
Hardware & Ausrüstung	1,52 %
Staatsanleihen	0,45 %
Wertpapiervermögen	97,96 %
Optionen	0,18 %
Terminkontrakte	-0,39 %
Credit Default Swaps	-0,09 %
Sonstige Finanzinstrumente	-0,08 %
Bankguthaben	0,34 %
Sonstige Vermögensgegenstände/Sonstige Verbindlichkeiten	2,08 %
Fondsvermögen	100,00 %

1) Aufgrund von Rundungsdifferenzen in den Einzelpositionen können die Summen vom tatsächlichen Wert abweichen.

UniAbsoluterErtrag

Zusammensetzung des Fondsvermögens zum 30. September 2019

	EUR
Wertpapiervermögen (Wertpapiereinstandskosten: EUR 1.073.699.199,70)	1.124.972.981,16
Optionen	2.108.092,32
Bankguthaben	3.945.600,73
Sonstige Bankguthaben	28.409.909,03
Nicht realisierte Gewinne aus Zinsswapgeschäften	592.117,37
Nicht realisierte Gewinne aus Devisentermingeschäften	263.381,53
Zinsforderungen aus Wertpapieren	306.045,57
Forderungen aus Wertpapiergeschäften	325.000,00
	1.160.923.127,71
Verbindlichkeiten aus Anteilrücknahmen	-2.959.923,35
Nicht realisierte Verluste aus Terminkontrakten	-4.502.005,18
Nicht realisierte Verluste aus Swapgeschäften	-2.558.977,17
Nicht realisierte Verluste aus Credit Default Swaps	-977.430,51
Zinsverbindlichkeiten	-103.141,72
Zinsverbindlichkeiten aus Zinsswapgeschäften	-7.857,13
Verbindlichkeiten aus Wertpapiergeschäften	-430.000,00
Sonstige Passiva	-811.542,25
	-12.350.877,31
Fondsvermögen	1.148.572.250,40

Zurechnung auf die Anteilklassen

Klasse A

Anteiliges Fondsvermögen	362.088.967,96 EUR
Umlaufende Anteile	8.128.314,000
Anteilwert	44,55 EUR

Klasse -net- A

Anteiliges Fondsvermögen	732.688.707,73 EUR
Umlaufende Anteile	16.328.083,000
Anteilwert	44,87 EUR

Klasse I

Anteiliges Fondsvermögen	53.794.574,71 EUR
Umlaufende Anteile	587.500,000
Anteilwert	91,57 EUR

UniAbsoluterErtrag

Vermögensaufstellung zum 30. September 2019

ISIN	Wertpapiere	Zugänge	Abgänge	Bestand	Kurs	Kurswert	Anteil am Fondsvermögen % ¹⁾	
						EUR		
Anleihen								
Börsengehandelte Wertpapiere								
EUR								
XS1077882121	1,750 % Emirates Telecommunications Group Co. PJSC (Etisalat) Reg.S. GMTN v.14(2021)	16.918.000	0	16.918.000	103,1280	17.447.195,04	1,52	
XS0546649822	4,500 % Marokko v.10(2020)	5.000.000	0	5.000.000	104,4760	5.223.800,00	0,45	
						22.670.995,04	1,97	
						22.670.995,04	1,97	
						22.670.995,04	1,97	
Börsengehandelte Wertpapiere								
Anleihen								
Investmentfondsanteile²⁾								
Deutschland								
DE000A0M80M2	UniFavorit: Aktien -I-	EUR	41.381	0	540.554	170,0400	91.915.802,16	8,00
						91.915.802,16	8,00	
Finnland								
FI0008812011	Evlii Nordic Corporate Bond	EUR	100.000	73.000	289.000	149,7100	43.266.190,00	3,77
						43.266.190,00	3,77	
Frankreich								
IE00BWFRC140	Lyxor / Chenavari Credit Fund	EUR	0	11.240	22.277	103,0189	2.294.952,04	0,20
IE00B8445H66	Lyxor/WNT Fund	EUR	0	23.484	45.274	122,1380	5.529.675,81	0,48
FR0013275070	OFI Risk Arb Absolu FCP	EUR	0	0	55.412	100,6500	5.577.217,80	0,49
FR0010757831	Syquant Capital - Helium Opportunités	EUR	0	10.256	19.960	1.373,7300	27.419.650,80	2,39
						40.821.496,45	3,56	
Großbritannien								
IE00BFM6VK70	Coupland Cardiff Funds plc - CC Japan Alpha Fund	JPY	0	0	3.415.000	975,0090	28.266.240,63	2,46
IE00BYW7BD64	Marshall Wace UCITS Funds PLC - MW Liquid Alpha Fund	EUR	0	0	94.903	107,4734	10.199.548,08	0,89
IE00BYW7B815	Marshall Wace UCITS Funds Plc. MW Liquid Alpha Fund - Klasse A Euro	EUR	0	42.897	161.242	112,4154	18.126.083,93	1,58
IE00BLP55791	Merian Global Investors Series PLC - Merian Global Equity Absolute Return Fund	EUR	0	1.012.679	3.399.917	1,4360	4.882.280,81	0,43
IE00BPT2B085	Neuberger Berman Global Bond Absolute Return Fund	EUR	0	555.018	144.982	8,9400	1.296.139,08	0,11
IE00BDZRX300	Neuberger Berman Short Duration Emerging Market Debt Fund	EUR	0	2.250.000	850.000	10,7600	9.146.000,00	0,80
IE00B21J0335	Odey Investments PLC - Odey European Focus Absolute Return Fund	EUR	0	0	49.595	94,7671	4.699.974,32	0,41
IE00B4WC4097	Odey Swan Fund	EUR	63.578	0	63.578	46,5370	2.958.729,39	0,26
						79.574.996,24	6,94	
Irland								
IE00B2005F46	Aegon European ABS Fund	EUR	0	0	1.000.000	10,5664	10.566.400,00	0,92
IE00BYZTN220	BLACKWALL EUROPE L/S FUND	EUR	0	507.275	524.529	9,3400	4.899.100,86	0,43
IE00BFYGDH69	CZ Capital ICAV - CZ Absolute Alpha UCITS	EUR	9.025	0	9.025	983,7560	8.878.397,90	0,77
IE00BCZRQT02	Fort Global UCITS Funds PLC - Contrarian Fund	EUR	0	0	8.681	1.221,7400	10.605.924,94	0,92
IE00B6TLWG59	GAM Star Fund Plc. - Cat Bond Fund	EUR	0	0	1.592.000	13,2828	21.146.217,60	1,84
IE00B59P9M57	GAM Star Fund Plc. - Global Rates	EUR	0	434.295	470.943	10,8430	5.106.434,95	0,44
IE00BYPRJ538	GAM Star MBS Total Return	USD	0	900.000	1.100.000	11,4249	11.528.657,92	1,00
IE00B5429P46	GLG Investments VI Plc. - European Equity Alternative	EUR	0	50.639	149.471	111,6600	16.689.931,86	1,45
IE00BYW8Z598	Hedge I.I.Fds-HI Quantwave	EUR	0	26.554	19.944	87,3350	1.741.809,90	0,15
IE00BLG30Y36	Hedge Invest International Funds - HI Numen Credit Fund	EUR	0	69.510	126.075	91,0700	11.481.650,25	1,00
IE00BDFXQM87	IAM Investments ICAV - IAM EJF Alpha Opportunities	EUR	0	0	5.235	962,0400	5.036.279,40	0,44
IE00BG1V1C27	Lazard Global Investment Funds PLC - Lazard Rathmore Alternative Fund	EUR	33.827	0	33.827	101,4117	3.430.453,58	0,30
IE00BYQP5B29	Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund	USD	0	0	78.200	137,8000	9.885.294,93	0,86
IE00B3LJVG97	MAN Funds VI PLC - Man GLG Alpha Select Alternative	EUR	0	14.974	62.632	137,5000	8.611.900,00	0,75
IE00BYVQYQ87	MAN Funds VI PLC - Man GLG European Alpha Alternative	EUR	0	0	68.410	96,1700	6.578.989,70	0,57
IE00BJJH014	Man Funds VI plc - Man GLG Event Driven Alternative	EUR	48.289	0	48.289	100,6100	4.858.356,29	0,42
IE00BDRKT177	MAN Funds VI PLC - Man Glg Innovation Equity Alternative	EUR	0	9.377	81.910	105,2800	8.623.484,80	0,75
IE00BG08NY08	MontLake UCITS - Cooper Creek Partners North America Long Short Equity UCITS	EUR	42.575	0	42.575	101,5186	4.322.154,40	0,38

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Berichtes.

UniAbsoluterErtrag

ISIN	Wertpapiere		Zugänge	Abgänge	Bestand	Kurs	Kurswert	Anteil am Fondsvermögen % ¹⁾
							EUR	
IE00BD38JM62	PIMCO GIS Mortgage Opportunities Fund	USD	0	0	1.961.592	10,9300	19.668.104,36	1,71
IE00BD289D70	Twelve Cat Bond Fund	EUR	48.000	0	48.000	99,9900	4.799.520,00	0,42
							178.459.063,64	15,52
Luxemburg								
LU1021293185	AB Mortgage Income Portfolio S1 USD Inc	USD	0	0	500.000	17,6000	8.072.653,89	0,70
LU1664206528	Allianz Discovery Germany Strategy	EUR	0	2.706	7.349	925,2400	6.799.588,76	0,59
LU1979287940	Allianz Japan Equity Long Short Strategy I13 (H2-EUR)	EUR	4.250	0	4.250	1.030,4500	4.379.412,50	0,38
LU0487547167	Amundi Funds - Volatility World	EUR	17.802	0	17.802	670,8300	11.942.115,66	1,04
LU1103259088	AQR UCITS Funds - Style Premia UCITS Fund	EUR	0	0	71.599	97,9800	7.015.270,02	0,61
LU0575255335	Assenagon Alpha Volatility	EUR	0	1.755	10.676	1.070,8400	11.432.287,84	1,00
LU1382784764	BlackRock Strategic Funds - Global Event Driven Fund	EUR	0	21.484	187.400	111,0200	20.805.148,00	1,81
LU1861219290	BlackRock Strategic Funds - UK Emerging Companies Absolute Return Fund	EUR	58.312	0	58.312	106,4200	6.205.563,04	0,54
LU1337225053	BlueBay Global Sovereign Opportunities Fund	EUR	0	54.734	46.945	114,9300	5.395.388,85	0,47
LU1063708694	Boussard & Gavaudan SICAV - Absolute Return	EUR	0	3.685	8.186	1.077,2900	8.818.695,94	0,77
LU0784437740	BPI Global Investments Fund - BPI Alternative Iberian Equities Long short Fund	EUR	0	367.848	696.770	12,4760	8.692.902,52	0,76
LU0501220262	CGS FMS SICAV - Global Evolution Frontier Markets (Sub - Fund 1)	EUR	0	80.629	77.517	159,8000	12.387.216,60	1,08
LU1047850851	DNB Fund - TMT Absolute Return	EUR	0	22.668	101.905	118,9758	12.124.228,90	1,06
LU1303786096	DNB SICAV - High Yield	EUR	205.000	0	205.000	108,0275	22.145.637,50	1,93
LU0462973008	DNCA Invest - Miura	EUR	46.282	0	46.282	113,2600	5.241.899,32	0,46
LU1331972494	Eleva UCITS Fund - Eleva Absolute Return Europe Fund	EUR	0	3.741	9.887	1.052,5400	10.406.462,98	0,91
LU1733196908	Exane Funds 1 - Exane Integrale Fund	EUR	0	255	680	10.288,8000	6.996.384,00	0,61
LU1135780176	Goldman Sachs - SICAV I - GS Global Strategic Macro Bond Ptf	EUR	0	77.687	67.904	98,1400	6.664.098,56	0,58
LU0966752916	Janus Henderson United Kingdom Absolute Return Fund	EUR	2.122.559	0	2.122.559	5,6779	12.051.677,75	1,05
LU1602251818	Laffitte Risk Arbitrage UCITS/Luxembourg	EUR	0	736	754	11.336,6000	8.547.796,40	0,74
LU1162198839	LFIS Vision UCITS - Premia	EUR	0	5.948	11.706	1.172,8000	13.728.796,80	1,20
LU0333226826	Lumyna - Marshall Wace Tops Market Neutral UCITS Fund	EUR	0	0	121.009	136,7800	16.551.569,99	1,44
LU0994402526	Lumyna - Merrill Lynch Enhanced Equity Volatility Premium UCITS Fund	EUR	48.615	0	280.000	122,3900	34.269.200,00	2,98
LU0476438642	Melchior European Absolute Return Fund	EUR	0	0	11.180	111,2213	1.243.454,02	0,11
LU1358059555	Melchior Selected Trust - Velox Fund	EUR	0	42.019	95.013	104,6754	9.945.527,58	0,87
LU1680845879	Merrill Lynch Investment Solutions - Ramius Merger Arbitrage UCITS Fund	EUR	0	0	50.000	105,2200	5.261.000,00	0,46
LU1603878668	Multiflex SICAV - Lansdowne Insight Discovery Fund	EUR	35.000	0	35.000	98,5900	3.450.650,00	0,30
LU0980588775	Natixis International Funds Lux I-Loomis Sayles Short Term Emerging Markets Bond	EUR	0	115.000	115.000	105,4700	12.129.050,00	1,06
LU1071462532	Pictet TR - Agora	EUR	0	51.404	109.356	127,5800	13.951.638,48	1,21
LU0635020901	Pictet TR - Kosmos	EUR	0	134.895	109.951	109,4100	12.029.738,91	1,05
LU1840469545	Privilege - Amber Event Europe	EUR	0	0	497.520	10,1919	5.070.674,09	0,44
LU1844121795	Quadrige Investors - Igneo Fund	USD	0	0	50.000	108,5000	4.976.607,65	0,43
LU1040796796	RiverRock V - Liquid Premium	EUR	0	0	762.142	10,0500	7.659.527,10	0,67
LU1429039461	Schroder Gaia Two Sigma Diversified	EUR	0	0	139.165	119,7000	16.658.050,50	1,45
LU1923201351	SEB Prime Solutions - Bodenholm Absolute Return	EUR	0	0	74.294	108,1900	8.037.867,86	0,70
LU1469429549	Threadneedle Lux - Pan European Absolute Alpha	EUR	0	0	310.000	12,1162	3.756.022,00	0,33
LU1837064119	TRZ UCITS Fund - Global Arbitrage	EUR	45.000	0	45.000	99,4330	4.474.485,00	0,39
LU1669793827	UI - Aktia EM Frontier Bond+	EUR	0	0	129.775	107,9000	14.002.722,50	1,22
LU1669794478	UI - Aktia EM Local Currency Bond +	EUR	125.000	0	125.000	104,9200	13.115.000,00	1,14
LU1348768752	UnInstitutional Basic Emerging Markets	EUR	125.000	0	125.000	97,5200	12.190.000,00	1,06
LU1966110618	UnInstitutional Equities Market Neutral	EUR	100.000	0	100.000	96,1300	9.613.000,00	0,84
LU1131313493	UnInstitutional European Equities Concentrated	EUR	84.750	0	425.526	149,1800	63.479.968,68	5,53
LU1726239723	UnInstitutional Global Credit	EUR	50.000	0	50.000	103,8000	5.190.000,00	0,45
LU2035328066	UnInstitutional Interest Rates Market Neutral	EUR	120.000	0	120.000	99,8100	11.977.200,00	1,04
LU1756676109	UnInstitutional Risk Premia	EUR	0	0	150.000	82,3400	12.351.000,00	1,08
LU1832180779	UnInstitutional Structured Credit	EUR	0	0	100.000	100,7200	10.072.000,00	0,88
LU1099836758	UnInstitutional Structured Credit High Yield	EUR	0	0	84.200	121,8500	10.259.770,00	0,89
LU1602255561	Vontobel Fund - Twentyfour Monument European Asset Backed Securities	EUR	0	0	100.000	102,3400	10.234.000,00	0,89
							541.802.950,19	47,20
Investmentfondsanteile							975.840.498,68	84,99

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Berichtes.

UniAbsoluterErtrag

ISIN	Wertpapiere		Zugänge	Abgänge	Bestand	Kurs	Kurswert	Anteil am Fonds- vermögen % 1)
							EUR	
Zertifikate								
Börsengehandelte Wertpapiere								
Australien								
XS1590565625	Macquarie Bank Ltd. (London Branch)/Maquarie Commodity Product 233T Index Zert. v.17(2020)	USD	0	0	349.895	100,3100	32.197.016,28	2,80
							32.197.016,28	2,80
Schweiz								
CH0452875633	Credit Suisse AG, London/Credit Suisse Custom 142 Total Return Index Zert. v.19(2020)	USD	100	0	100	206.893,0000	18.979.267,96	1,65
							18.979.267,96	1,65
Börsengehandelte Wertpapiere								
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere								
Deutschland								
XS0461202136	Dte. Bank AG (London Branch)/DBLCI FLEX 40 USD TRAC Index Zert. v.14(2024)	USD	10.048.000	100.000	10.000.000	117,5400	10.782.497,02	0,94
							10.782.497,02	0,94
Schweiz								
XS1605262119	Credit Suisse AG/Credit Suisse Custom Commodity 109 Total Return Index Zert. v.17(2020)	USD	0	0	230	207.080,0000	43.691.771,40	3,80
							43.691.771,40	3,80
Vereinigte Staaten von Amerika								
XS1009877918	Credit Suisse AG/Credit Suisse Custom Commodity 140 Total Return Index Zert. v.17(2018)	USD	25	0	95	238.800,0000	20.810.934,78	1,81
							20.810.934,78	1,81
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere								
Zertifikate							75.285.203,20	6,55
Wertpapiervermögen							1.124.972.981,16	97,96
Optionen								
Long-Positionen								
EUR								
Call on Swaption SLKK03Y6 November 2019/-0,19			0	0	500.000.000		0,00	0,00
Call on Swaption SLRT068R Juli 2024/1,95			15.000.000	0	15.000.000		237.390,00	0,02
Call on 3MO Euribor Future März 2019/100,750			9.800	0	9.800		-445.704,00	-0,04
Put on Euro Stoxx 50 Price Index November 2019/3.450,00			1.000	0	1.000		380.000,00	0,03
Put on EUR/USD Januar 2020/1,1701			0	0	25.000.000		1.615.675,00	0,14
							1.787.361,00	0,15
GBP								
Call on GBP/JPY November 2019/138,000			40.000.000	0	40.000.000		275.002,83	0,02
Call on 3MO Libor Currency Future Juni 2020/100,000			17.400	0	17.400		99.585,58	0,01
Call on 3MO Libor Currency Future Juni 2020/99,625			17.400	0	17.400		549.594,20	0,05
Call on 3MO Libor Currency Future März 2020/99,625			2.000	0	2.000		-2.775,57	0,00
							921.407,04	0,08
USD								
Call on Eurodollar 1Y Mid-curve Juni 2020/99,25			1.300	0	1.300		201.243,01	0,02
Put on CBT 10YR US T-Bond Note Future Oktober 2019/128,00			3.000	0	3.000		215.003,21	0,02
Put on CBT 10YR US T-Bond Note Future Oktober 2019/129,00			2.100	1.100	1.000		200.669,66	0,02
Put on Eurodollar 1Y Mid-curve Juni 2020/98,00			1.300	0	1.300		119.255,11	0,01
Put on Swaption SLRA09LM September 2020/1,605			15.000.000	0	15.000.000		363.861,11	0,03
Put on Swaption SL604EB9 Juni 2022/1,827			100.000.000	0	100.000.000		2.785.340,79	0,24
Put on USD/CHF Oktober 2019/0,925			60.000.000	0	60.000.000		0,00	0,00
Put on USD/CHF Oktober 2019/0,975			60.000.000	0	60.000.000		43.317,13	0,00
Put on 3MO Euro-Dollar Future März 2020/98,000			3.000	0	3.000		258.003,85	0,02
							4.186.693,87	0,36
Long-Positionen								
							6.895.461,91	0,59

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Berichtes.

UniAbsoluterErtrag

ISIN	Wertpapiere	Zugänge	Abgänge	Bestand	Kurs	Kurswert EUR	Anteil am Fonds- vermögen % 1)
Short-Positionen							
EUR							
	Call on Swaption SLKK03Y7 November 2019/-0,04	0	0	-500.000.000		0,00	0,00
	Call on Swaption SLRT068S Juli 2024/1,7500	0	75.000.000	-75.000.000		-166.950,00	-0,01
	Call on 3MO Euribor Future März 2020/100,875	0	9.800	-9.800		183.750,00	0,02
	Put on EURO STOXX Oil&Gas Index November 2019/315,00	0	2.150	-2.150		-580.500,00	-0,05
	Put on EUR/USD Januar 2020/1,1335	0	0	-25.000.000		-852.425,00	-0,07
						-1.416.125,00	-0,11
GBP							
	Call on GBP/JPY November 2019/145,000	0	40.000.000	-40.000.000		-29.395,14	0,00
	Call on 3MO Libor Currency Future Juni 2020/99,875	0	34.800	-34.800		-423.813,97	-0,04
	Call on 3MO Libor Currency Future März 2020/99,750	0	2.000	-2.000		-2.032,37	0,00
						-455.241,48	-0,04
USD							
	Call on Euro/Dollar 1Y Mid-curve Juni 2020/99,50	0	1.300	-1.300		-96.894,78	-0,01
	Put on CBT 10YR US T-Bond Note Future Oktober 2019/126,50	0	3.000	-3.000		-86.001,28	-0,01
	Put on CBT 10YR US T-Bond Note Future Oktober 2019/127,50	1.100	2.100	-1.000		-43.000,64	0,00
	Put on CME 3MO Euro-Dollar Future März 2020/97,875	0	3.000	-3.000		-120.401,80	-0,01
	Put on Euro/Dollar 1Y Mid-curve Juni 2020/98,125	0	1.300	-1.300		-178.882,67	-0,02
	Put on Swaption SLRA09LO September 2020/1,305	0	15.000.000	-15.000.000		-210.985,23	-0,02
	Put on Swaption SL604EBA Juni 2022/1,627	0	100.000.000	-100.000.000		-2.176.314,10	-0,19
	Put on USD/CHF Oktober 2019/0,95	0	120.000.000	-120.000.000		-3.522,61	0,00
						-2.916.003,11	-0,26
						-4.787.369,59	-0,41
						2.108.092,32	0,18
Short-Positionen Optionen							
Terminkontrakte							
Long-Positionen							
EUR							
	EUREX Dow Jones EURO STOXX 50 Index Future Dezember 2019	1.000	0	1.000		414.500,00	0,04
	EUX 10 YR Euro-OAT Future Dezember 2019	156	0	156		15.990,00	0,00
						430.490,00	0,04
JPY							
	Japanese Yen Currency Future Dezember 2019	201	0	201		-119.443,58	-0,01
						-119.443,58	-0,01
USD							
	Russell 2000 Future Dezember 2019	390	0	390		-1.081.786,07	-0,09
	US Dollar Currency Future Dezember 2019	1.392	0	1.392		-2.560.278,87	-0,22
						-3.642.064,94	-0,31
						-3.331.018,52	-0,28
Long-Positionen							
Short-Positionen							
EUR							
	EURO STOXX Banks Future Dezember 2019	0	5.340	-5.340		349.695,24	0,03
	EUX 10YR Euro-Bund Future Dezember 2019	500	654	-154		-3.669,82	0,00
	MSCI Europe Index Future Dezember 2019	0	2.774	-2.774		-319.010,00	-0,03
	MSCI World Net EUR Future Dezember 2019	0	3.089	-3.089		-431.533,30	-0,04
						-404.517,88	-0,04
JPY							
	Tokyo Stock Price (TOPIX) Index Future Dezember 2019	0	195	-195		-1.111.602,07	-0,10
						-1.111.602,07	-0,10
USD							
	Dow Jones Industrial Average Future Dezember 2019	0	284	-284		350.165,12	0,03
	Tesla Inc. Future Dezember 2019	0	60	-60		-5.031,83	0,00
						345.133,29	0,03
						-1.170.986,66	-0,11
						-4.502.005,18	-0,39
Short-Positionen Terminkontrakte							

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Berichtes.

UniAbsoluterErtrag

ISIN	Wertpapiere	Zugänge	Abgänge	Bestand	Kurs	Kurswert	Anteil am Fondsvermögen % ¹⁾
						EUR	
Credit Default Swaps							
Gekauft							
USD							
	BNP Paribas S.A., Paris/iTraxx Asia ex-Japan Investment Grade S31 5Yr Index CDS v.19(2024)	50.000.000	0	50.000.000		-977.430,51	-0,09
						-977.430,51	-0,09
Gekauft							
Credit Default Swaps							
						-977.430,51	-0,09
Sonstige Finanzinstrumente							
AUD							
	SWAP Australian Bank Bill Swap Rate 3 Monate (BBSW)/0.7980% 23.03.2023	0	35.000.000	-35.000.000		-512.830,90	-0,04
	SWAP Australian Bank Bill Swap Rate 3 Monate (BBSW)/0.7980% 23.03.2023	35.000.000	0	35.000.000		482.915,09	0,04
	SWAP 1.2210%/Australian Bank Bill Swap Rate 6 Monate (BBSW) 23.03.2030	0	11.000.000	-11.000.000		-783.879,17	-0,07
	SWAP 1.2210%/Australian Bank Bill Swap Rate 6 Monate (BBSW) 23.03.2030	11.000.000	0	11.000.000		800.332,68	0,07
						-13.462,30	0,00
EUR							
	SWAP EURIBOR (EUR) 6 Monate/-0.3669% 17.09.2024	0	66.877.000	-66.877.000		1.241.857,74	0,11
	SWAP EURIBOR (EUR) 6 Monate/-0.3669% 17.09.2024	66.877.000	0	66.877.000		-1.384.539,15	-0,12
	SWAP -0.0635%/EURIBOR (EUR) 6 Monate 17.09.2029	16.631.000	0	16.631.000		-108.101,33	-0,01
	SWAP -0.0635%/EURIBOR (EUR) 6 Monate 17.09.2029	0	16.631.000	-16.631.000		258.051,25	0,03
	SWAP -0.4300%/EURIBOR (EUR) 6 Monate 17.09.2021	0	84.305.000	-84.305.000		763.858,10	0,07
	SWAP -0.4300%/EURIBOR (EUR) 6 Monate 17.09.2021	84.305.000	0	84.305.000		-721.155,09	-0,06
	Total Return SWAP Strategie Goldman Sachs European Equity L/S/Strategie Goldman Sachs European Equity L/S 15.04.20	24.892.750	413.000	24.479.750		-5.750,05	0,00
	Total Return SWAP Strategie JPM Europe Quality Index/Strategie JPM Europe Quality Index 15.06.20	19.981.711	0	19.981.711		219.697,12	0,02
	Total Return SWAP Strategie JPM Morgan Quant Style/Strategie JPM Morgan Quant Style 15.06.20	56.610.736	0	56.610.736		-3.025.708,54	-0,26
	Total Return SWAP Strategie JPM Pension Onligations/Strategie JPM Pension Onligations 15.07.20	51.796.250	0	51.796.250		-1.342.760,28	-0,11
	Total Return SWAP STRATEGIE JPM UI Dynamic Themes Index/STRATEGIE JPM UI Dynamic Themes Index 15.06.20	25.738.102	12.869.051	12.869.051		-226.551,02	-0,02
	Total Return SWAP Strategie ML Upside Vol/Strategie ML Upside Vol 10.07.20	11.912.800	0	11.912.800		-64.710,57	-0,01
	Total Return SWAP Strategie UBS Forward Vol/Strategie UBS Forward Vol 18.09.20	10.403.000	0	10.403.000		11.439,55	0,00
	Total Return SWAP UBS Put Write Strategie/UBS Put Write Strategie 19.06.20	20.274.000	0	20.274.000		182.650,69	0,02
						-4.201.721,58	-0,34
JPY							
	Total Return SWAP STRATEGIE JPM JAPAN LABOUR SHORTAGE/STRATEGIE JPM JAPAN LABOUR SHORTAGE 15.06.20	3.078.485.200	1.539.242.600	1.539.242.600		-390.007,92	-0,03
	Total Return SWAP STRATEGIE MS Japan Buyback/STRATEGIE MS Japan Buyback 17.06.20	4.671.000.000	0	4.671.000.000		1.297.802,29	0,12
						907.794,37	0,09
RUB							
	SWAP 7.7550%/MosPrime Offer Rate 3 Monate 09.07.2024	0	2.100.000.000	-2.100.000.000		-8.433.379,44	-0,73
	SWAP 7.7550%/MosPrime Offer Rate 3 Monate 09.07.2024	2.100.000.000	0	2.100.000.000		9.023.616,58	0,79
						590.237,14	0,06
USD							
	Excess Return SWAP/Morgan Stanley Anti Radar ex Agriculture & Livestock ER Index 16.12.19	0	60.000.000	70.000.000		349.763,69	0,03
	Excess Return SWAP/MS Radar ex Agri & Lvstk Finl Index 16.12.19	0	60.000.000	70.000.000		176.125,03	0,02
	SWAP LIBOR (USD) 3 Monate/1.5095% 05.09.2021	0	32.323.000	-32.323.000		-852.674,57	-0,07
	SWAP LIBOR (USD) 3 Monate/1.5095% 05.09.2021	32.323.000	0	32.323.000		935.007,64	0,08
	SWAP 1.3778%/LIBOR (USD) 3 Monate 05.09.2029	6.887.000	0	6.887.000		802.856,09	0,07
	SWAP 1.3778%/LIBOR (USD) 3 Monate 05.09.2029	0	6.887.000	-6.887.000		-919.818,15	-0,08
	Total Return SWAP Strategie JP Morgan EM Select/Strategie JP Morgan EM Select 15.06.20	66.216.806	0	66.216.806		-292.346,50	-0,02
	Total Return SWAP STRATEGIE JPM Financial Leverage/STRATEGIE JPM Financial Leverage 15.06.20	32.392.022	16.196.011	16.196.011		611.218,23	0,06
	Total Return SWAP STRATEGIE JPM FSI EM/STRATEGIE JPM FSI EM 15.06.20	59.865.732	0	59.865.732		-683.119,02	-0,05
	Total Return SWAP STRATEGIE JPM HCT Cyber Security/STRATEGIE JPM HCT Cyber Security 15.06.20	29.448.468	14.724.234	14.724.234		-699.376,26	-0,06
	Total Return SWAP Strategie JPM Healthcare IT/Strategie JPM Healthcare IT 15.06.20	36.089.130	0	36.089.130		243.264,77	0,02
	Total Return SWAP Strategie JPM Hygiene/Strategie JPM Hygiene 15.06.20	43.638.160	0	43.638.160		1.028.281,34	0,09
	Total Return SWAP Strategie JPM Northamerica Quality/Strategie JPM Northamerica Quality 15.06.20	14.615.622	0	14.615.622		-5.242,23	0,00

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Berichtes.

UniAbsoluterErtrag

ISIN	Wertpapiere	Zugänge	Abgänge	Bestand	Kurs	Kurswert	Anteil am Fondsvermögen % ¹⁾
						EUR	
	Total Return SWAP Strategie JPM UI Dynamic Hedge Index/Strategie JPM UI Dynamic Hedge Index 15.09.20	43.841.600	0	43.841.600		-92.835,52	-0,01
	Total Return SWAP Strategie JPM VIX vs. VStoxx/Strategie JPM VIX vs. VStoxx 15.09.20	5.770.743	0	5.770.743		-39.280,85	0,00
	Total Return SWAP STRATEGIE UBS Long/Short Commodities UAE/STRATEGIE UBS Long/Short Commodities UAE 20.12.19	533.825	0	25.533.175		257.269,98	0,03
	Total Return SWAP Strategie UBS Rates Carry/Strategie UBS Rates Carry 18.09.20	39.130.000	0	39.130.000		-68.801,10	0,00
						750.292,57	0,11
Sonstige Finanzinstrumente						-1.966.859,80	-0,08
Bankguthaben - Kontokorrent						3.945.600,73	0,34
Sonstige Vermögensgegenstände/Sonstige Verbindlichkeiten						24.991.871,68	2,08
Fondsvermögen in EUR						1.148.572.250,40	100,00

- 1) Aufgrund von Rundungsdifferenzen in den Einzelpositionen können die Summen vom tatsächlichen Wert abweichen.
 2) Angaben zu Ausgabeaufschlägen, Rücknahmeabschlägen sowie zur maximalen Höhe der Verwaltungsgebühr für Zielfondsanteile sind auf Anfrage am Sitz der Verwaltungsgesellschaft, bei der Verwahrstelle und bei den Zahlstellen kostenlos erhältlich. Von gehaltenen Anteilen eines Zielfonds, die unmittelbar oder aufgrund einer Übertragung von derselben Verwaltungsgesellschaft oder von einer Gesellschaft verwaltet werden, mit der die Verwaltungsgesellschaft durch eine gemeinsame Verwaltung oder Beherrschung oder eine wesentliche direkte oder indirekte Beteiligung verbunden ist, wird keine oder eine reduzierte Verwaltungsvergütung berechnet.

Devisentermingeschäfte

Zum 30.09.2019 standen folgende offene Devisentermingeschäfte aus:

Währung		Währungsbetrag	Kurswert	Anteil am Fondsvermögen %
			EUR	
NOK/EUR	Währungskäufe	323.176.934,90	32.587.209,26	2,84
EUR/NOK	Währungsverkäufe	321.991.167,00	32.467.643,59	2,83

Bilaterale Devisentermingeschäfte

Zum 30.09.2019 standen folgende offene bilaterale Devisentermingeschäfte aus:

Währung		Währungsbetrag in Kaufwährung	Währungsbetrag in Verkaufswährung	Kurswert	Anteil am Fondsvermögen %
				EUR	
AUD/CAD	Bilaterale Währungsgeschäfte	21.344.853,86	20.000.000,00	13.216.067,59	1,15
CAD/AUD	Bilaterale Währungsgeschäfte	20.000.000,00	21.664.012,83	13.851.921,53	1,21
CAD/USD	Bilaterale Währungsgeschäfte	30.116.283,75	22.500.000,00	20.876.799,92	1,82
CHF/USD	Bilaterale Währungsgeschäfte	14.739.195,00	15.000.000,00	13.587.520,47	1,18
USD/CAD	Bilaterale Währungsgeschäfte	22.500.000,00	30.285.922,50	20.632.769,73	1,80
USD/CHF	Bilaterale Währungsgeschäfte	15.000.000,00	14.474.700,00	13.733.095,87	1,20

Bilaterale Devisentermingeschäfte mit Barausgleich

Zum 30.09.2019 standen folgende offene bilaterale Devisentermingeschäfte mit Barausgleich aus:

Währung		Währungsbetrag in Kaufwährung	Währungsbetrag in Verkaufswährung	Kurswert	Anteil am Fondsvermögen %
				EUR	
KRW/USD	Bilaterale Währungsgeschäfte	17.569.407.600,00	15.000.000,00	13.485.343,82	1,17
TWD/USD	Bilaterale Währungsgeschäfte	462.900.000,00	15.000.000,00	13.707.935,88	1,19
USD/KRW	Bilaterale Währungsgeschäfte	15.000.000,00	17.295.889.650,00	13.750.964,27	1,20
USD/TWD	Bilaterale Währungsgeschäfte	15.000.000,00	462.703.390,50	13.740.173,99	1,20

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Berichtes.

UniAbsoluterErtrag

Devisenkurse

Für die Bewertung von Vermögenswerten in fremder Währung wurde zum nachstehenden Devisenkurs zum 30. September 2019 in Euro umgerechnet.

Australischer Dollar	AUD	1	1,6159
Britisches Pfund	GBP	1	0,8845
Dänische Krone	DKK	1	7,4659
Hongkong Dollar	HKD	1	8,5455
Japanischer Yen	JPY	1	117,7962
Kanadischer Dollar	CAD	1	1,4431
Mexikanischer Peso	MXN	1	21,5208
Neuseeländischer Dollar	NZD	1	1,7378
Norwegische Krone	NOK	1	9,9040
Polnischer Zloty	PLN	1	4,3702
Russischer Rubel	RUB	1	70,6972
Schwedische Krone	SEK	1	10,7181
Schweizer Franken	CHF	1	1,0869
Singapur Dollar	SGD	1	1,5072
Südafrikanischer Rand	ZAR	1	16,5248
Südkoreanischer Won	KRW	1	1.303,7596
Taiwan Dollar	TWD	1	33,8182
Tschechische Krone	CZK	1	25,8110
Ungarischer Forint	HUF	1	334,8900
US Amerikanischer Dollar	USD	1	1,0901

Zu- und Abgänge vom 1. April 2019 bis 30. September 2019

Während des Berichtszeitraumes getätigte Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Schuldscheindarlehen und Derivaten, einschließlich Änderungen ohne Geldbewegungen, soweit sie nicht in der Vermögensaufstellung genannt sind.

ISIN	Wertpapiere	Zugänge	Abgänge
Aktien, Anrechte und Genussscheine			
Nicht notierte Wertpapiere			
Deutschland			
DE000A2LQ2L3	innogy SE	0	16.000
Anleihen			
Börsengehandelte Wertpapiere			
EGP			
EGT9980N4J15	0,000 % Ägypten v.18(2019)	0	270.000.000
EGBGR02241F0	16,000 % Ägypten v.19(2022)	191.000.000	191.000.000
EUR			
IT0004992308	2,500 % Italien v.14(2019)	0	30.000.000
DE000A1R0410	3,125 % thyssenkrupp AG v.14(2019)	5.000.000	5.000.000
USD			
XS1406670999	2,000 % Industrial & Commercial Bank of China Ltd/Singapore EMTN v.16 (2019)	0	4.400.000
US912796RV32	0,000 % Vereinigte Staaten von Amerika v.18(2019)	32.000.000	32.000.000
US912796RD34	0,000 % Vereinigte Staaten von Amerika v.18(2019)	0	37.000.000
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere			
USD			
US71654QAU67	8,000 % Petroleos Mexicanos v.09(2019)	0	14.457.000
Nicht notierte Wertpapiere			
EGP			
EGT998039J10	0,000 % Ägypten v.18(2019)	0	209.000.000
Investmentfondsanteile ¹⁾			
Großbritannien			
IE00B8G2MF47	Insight LIBOR Plus Fund	0	14.550.297

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Berichtes.

UniAbsoluterErtrag

ISIN	Wertpapiere	Zugänge	Abgänge
Irland			
IE00BKZGL097	Barings Emerging Markets Local Debt Fund	0	106.944
IE00BGLSKM63	IPM UCITS Umbrella ICAV - IPM Systematic Macro UCITS Fund	0	7.273
IE00BF0J8075	Trium Opportunistic Equity Fund	0	20.992
Luxemburg			
LU1570265261	Alpha UCITS SICAV - Fair Oaks Dynamic Credit Fund	0	15.000
LU0272941112	Amundi FUNDS SICAV - Amundi Funds Volatility Euro	0	15.793
LU1155061614	Exane Funds 1 - Exane Archimedes Fund Cl. E	0	1.831
LU0961411492	Falcon - Twelve-Falcon Insurance Linked Strategy Fund	0	46.000
LU0490769915	Janus Henderson Fund - Janus Henderson United Kingdom Absolute Return Fund	0	2.346.074
LU1388736503	Jupiter Global Fund - Jupiter Global Absolute Return	0	960.000
LU0562189042	Lumyna - AQR Global Relative Value UCITS Fund	0	70.591
LU1468410581	Merrill Lynch Investment Solutions - Enhanced Cross-Asset Volatility Premium Fd	0	240.000
LU1732224917	Pareto SICAV - Pareto Nordic Corporate Bond	0	254.894
LU0175818722	UnilInstitutional Short Term Credit	0	754.079
Optionen			
EUR			
	Call on Euribor 3M Mid-curve 2 Year Future Dezember 2019/100,500	3.500	3.500
	Call on Euribor 3M Mid-curve 2 Year Future Dezember 2019/100,625	2.000	2.000
	Call on Euribor 3M Mid-curve 2 Year Future Dezember 2019/100,625	1.500	1.500
	Call on EUR/NOK Juli 2019/9,90	20.000.000	20.000.000
	Call on Euro Stoxx 50 Price Index April 2019/3.425,00	0	5.000
	Call on EUX 10YR Euro-Bund Future August 2019/175,00	300	300
	Call on EUX 10YR Euro-Bund Future August 2019/175,50	300	300
	Call on EUX 10YR Euro-Bund Future Juni 2019/170,50	1.300	1.300
	Call on EUX 10YR Euro-Bund Future Juni 2019/171,00	1.300	1.300
	Call on EUX 10YR Euro-Bund Future Mai 2019/167,50	1.300	1.300
	Call on EUX 10YR Euro-Bund Future Mai 2019/167,50	1.300	1.300
	Call on EUX 10YR Euro-Bund Future Mai 2019/168,00	1.300	1.300
	Call on EUX 10YR Euro-Bund Future Mai 2019/168,50	1.300	1.300
	Call on EUX 10YR Euro-Bund Future September 2019/178,50	1.050	1.050
	Call on EUX 10YR Euro-Bund Future September 2019/179,00	1.050	1.050
	Call on Swaption SLQK10YL Juni 2019/0,55	0	100.000.000
	Call on Swaption SLQK10YM Juni 2019/0,7	100.000.000	0
	Call on Swaption SLQK10YN Juni 2019/0,8	100.000.000	0
	Call on Swaption SL524L2H April 2022/0,97	100.000.000	100.000.000
	Put on Euribor 3M Mid-curve 2 Year Future Dezember 2019/100,00	3.500	3.500
	Put on Euribor 3M Mid-curve 2 Year Future Dezember 2019/100,125	3.500	3.500
	Put on Euro Stoxx 50 Price Index April 2019/3.250,00	0	2.000
	Put on Euro Stoxx 50 Price Index August 2019/3.450,00	1.500	1.500
	Put on Euro Stoxx 50 Price Index September 2019/3.150,00	8.000	8.000
	Put on Euro Stoxx 50 Price Index September 2019/3.275,00	4.000	4.000
	Put on EURO STOXX 50 Weekly Options Week 1 Index Juli 2019/3.400,00	2.000	2.000
	Put on EUR/TRY September 2019/6,3800	23.000.000	23.000.000
	Put on EUR/TRY September 2019/6,6210	23.000.000	23.000.000
	Put on EUX 10YR Euro-Bund Future August 2019/170,50	300	300
	Put on EUX 10YR Euro-Bund Future August 2019/171,50	300	300
	Put on EUX 10YR Euro-Bund Future Juni 2019/164,50	1.300	1.300
	Put on EUX 10YR Euro-Bund Future Juni 2019/165,50	1.300	1.300
	Put on EUX 10YR Euro-Bund Future Mai 2019/163,00	1.300	1.300
	Put on EUX 10YR Euro-Bund Future Mai 2019/164,00	1.300	1.300
	Put on EUX 10YR Euro-Bund Future September 2019/171,50	3.050	3.050
	Put on EUX 10YR Euro-Bund Future September 2019/172,50	1.050	1.050
	Put on EUX 10YR Euro-Bund Future September 2019/173,00	2.000	2.000
	Put on EUX 5YR Euro-Bobl Future Juli 2019/133,00	2.000	2.000
	Put on EUX 5YR Euro-Bobl Future Juli 2019/133,50	2.000	2.000
	Put on Swaption SLKY0532 Juni 2021/0,289	60.000.000	60.000.000
	Put on Swaption SLKY0534 Juni 2021/-0,011	60.000.000	60.000.000
	Put on Swaption SL524L2F April 2022/0,27	100.000.000	100.000.000
	Put on Swaption SL524L2G April 2022/-0,13	100.000.000	100.000.000
	Put on 3MO Euribor Future Juni 2019/100,125	6.000	0
	Put on 3MO Euribor Future Juni 2019/100,250	0	3.000

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Berichtes.

UniAbsoluterErtrag

ISIN	Wertpapiere	Zugänge	Abgänge
	Put on 3MO Euribor Future Juni 2019/99,875	0	3.000
GBP			
	Call on 3MO Libor Currency Future Dezember 2019/99,375	4.000	4.000
	Call on 3MO Libor Currency Future Dezember 2019/99,625	4.000	4.000
	Put on GBP/JPY Mai 2019/136,000	42.000.000	0
	Put on GBP/JPY Mai 2019/142,000	0	42.000.000
	Put on LIF 3MO Sterling Future September 2019 September 2019/98,50	0	6.000
	Put on 3MO Libor Currency Future Juni 2019/98,625	4.500	0
	Put on 3MO Libor Currency Future Juni 2019/98,750	0	4.500
USD			
	Call on CBT 10YR US T-Bond Note Future April 2019/124,00	0	150
	Call on CBT 10YR US T-Bond Note Future April 2019/125,00	150	0
	Call on CBT 10YR US T-Bond Note Future August 2019/129,00	1.100	1.100
	Call on CBT 10YR US T-Bond Note Future August 2019/129,50	1.100	1.100
	Call on CBT 10YR US T-Bond Note Future Mai 2019/125,00	500	500
	Call on CBT 10YR US T-Bond Note Future Mai 2019/125,50	500	500
	Call on CBT 10YR US T-Bond Note Future September 2019/133,50	1.050	1.050
	Call on CBT 10YR US T-Bond Note Future September 2019/134,00	1.050	1.050
	Call on S&P 500 Index Mai 2019/3.005,00	1.100	1.100
	Call on Swaption SLOX0364 Juli 2019/2,708	0	500.000.000
	Call on Swaption SLOX0365 Juli 2019/2,908	500.000.000	0
	Call on USD/ZAR Mai 2019/15,00	0	25.000.000
	Call on USD/ZAR Mai 2019/17	25.000.000	0
	Call on 3MO Eurodollar Future September 2019/98,250	1.200	1.200
	Call on 3MO Eurodollar Future September 2019/98,375	1.200	1.200
	Put on CBT 10YR US T-Bond Note Future August 2019/125,00	1.100	1.100
	Put on CBT 10YR US T-Bond Note Future August 2019/126,00	1.100	1.100
	Put on CBT 10YR US T-Bond Note Future September 2019/128,00	1.050	1.050
	Put on CBT 10YR US T-Bond Note Future September 2019/129,00	1.050	1.050
	Put on CME 3MO Euro-Dollar Future Juni 2019 Juni 2019/96,625	2.000	0
	Put on CME 3MO Euro-Dollar Future September 2019 September 2019/97,375	1.200	1.200
	Put on CME 3MO Euro-Dollar Future September 2019/96,875	3.000	0
	Put on CME 3MO Euro-Dollar Future September 2019/97,125	0	3.000
	Put on CME 3MO Euro-Dollar Future September 2019/97,625	1.200	1.200
	Put on Eurodollar Mid-curve Future Juni 2018/96,250	6.000	0
	Put on Eurodollar Mid-curve Future Juni 2018/96,500	0	6.000
	Put on S&P 500 Index August 2019/2.880,00	225	225
	Put on S&P 500 Index August 2019/2.980,00	225	225
	Put on 3MO Eurodollar Future Juni 2019/96,500	5.000	0
	Put on 3MO Eurodollar Future Juni 2019/96,875	0	7.000
	Put on 3MO Euro-Dollar Future Juni 2020/98,00	1.000	1.000
	Put on 3MO Euro-Dollar Future Juni 2020/98,25	1.000	1.000
	Put on 3MO Eurodollar Future September 2019/96,625	5.000	0
	Put on 3MO Eurodollar Future September 2019/96,750	0	5.000
Terminkontrakte			
EUR			
	DAX Performance-Index Future Juni 2019	275	170
	DAX Performance-Index Future September 2019	282	282
	Dow Jones EURO STOXX 50 Dividend Index Future Dezember 2022	2.000	2.000
	EUREX Dow Jones EURO STOXX 50 Dividend Index Future Dezember 2020	2.000	2.000
	EUREX Dow Jones EURO STOXX 50 Index Future Juni 2019	7.624	6.700
	EUREX Dow Jones EURO STOXX 50 Index Future September 2019	4.246	4.246
	EUREX Dow Jones EURO STOXX 50 Index Future September 2019	2.280	2.280
	EURO STOXX Banks Future September 2019	5.665	5.665
	EURO STOXX Banks Future September 2019	2.670	2.670
	EUX 10 YR Euro-OAT Future September 2019	652	652
	EUX 10YR Euro-Bund Future September 2019	1.085	1.085
	LIF 3MO Euribor Future Dezember 2021	330	330
	MSCI Europe Index Future Juni 2019	2.774	576
	MSCI Europe Index Future September 2019	2.774	2.774
	MSCI World Net EUR Future Juni 2019	3.089	197
	MSCI World Net EUR Future September 2019	3.089	3.089

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Berichtes.

UniAbsoluterErtrag

ISIN	Wertpapiere	Zugänge	Abgänge
HKD			
	Hang Seng China Enterprises Index Future April 2019	225	225
	Hang Seng China Enterprises Index Future Juni 2019	460	460
	Hang Seng China Enterprises Index Future Mai 2019	225	225
JPY			
	Japanese Yen Currency Future Juni 2019	0	201
	Japanese Yen Currency Future September 2019	201	201
	Tokyo Stock Price (TOPIX) Index Future Juni 2019	195	0
	Tokyo Stock Price (TOPIX) Index Future September 2019	195	195
USD			
	CBT 10YR US T-Bond Note Future Dezember 2019	325	325
	CBT 10YR US T-Bond Note Future Juni 2019	500	500
	CBT 10YR US T-Bond Note Future September 2019	500	500
	CBT 10YR US T-Bond Note Future September 2019	177	177
	CBT 5YR US T-Bond Note 6% Future Juni 2019	1.000	1.000
	CBT 5YR US T-Bond Note 6% Future September 2019	1.040	1.040
	CBT 5YR US T-Bond Note 6% Future September 2019	500	500
	CME Nasdaq 100 E-Mini Index Future September 2019	130	130
	CME 3MO Euro-Dollar Future Dezember 2019	700	700
	CME 3MO Euro-Dollar Future März 2020	1.000	1.000
	CME 3MO Euro-Dollar Future September 2019	720	720
	CME 3MO Euro-Dollar Future September 2020	2.300	2.300
	Dow Jones Industrial Average Future September 2019	189	189
	E-Mini S&P 500 Index Future Dezember 2019	85	85
	E-Mini S&P 500 Index Future Juni 2019	880	880
	E-Mini S&P 500 Index Future Juni 2019	110	232
	E-Mini S&P 500 Index Future September 2019	1.275	1.275
	E-Mini S&P 500 Index Future September 2019	488	488
	FTSE China A 50 Index Future April 2019	1.200	1.200
	FTSE China A 50 Index Future Mai 2019	1.200	1.200
	Russell 2000 Future September 2019	260	260
	Südafrikanische Rand Currency Future September 2019	430	430
	UltraTreasury 6% Future September 2019	158	158
	US Dollar Currency Future Juni 2019	153	1.778
	US Dollar Currency Future September 2019	1.520	1.520
Credit Default Swaps			
EUR			
	Citigroup Global Markets Ltd./iTraxx Europe S31 5Yr Index CDS v.19(2024)	0	100.000.000
	Société Générale S.A., Paris/Alstom S.A. CDS v.18(2023)	0	3.500.000
	Société Générale S.A., Paris/Anglo American Capital Plc. CDS v.18(2023)	0	3.500.000
	Société Générale S.A., Paris/Groupe Danone S.A. CDS v.18(2023)	0	3.500.000
	Société Générale S.A., Paris/HeidelbergCement AG CDS v.18(2023)	0	3.500.000
	Société Générale S.A., Paris/Heineken NV CDS v.18(2023)	0	3.500.000
	Société Générale S.A., Paris/HSBC Holdings Plc. CDS v.18(2023)	0	3.500.000
	Société Générale S.A., Paris/iTraxx Europe Senior Financial S30 5Yr Index CDS v.18(2023)	0	16.500.000
	Société Générale S.A., Paris/iTraxx Europe S30 5Yr Index CDS v.18(2023)	69.000.000	0
	Société Générale S.A., Paris/Kering S.A. CDS v.18(2023)	0	3.500.000
	Société Générale S.A., Paris/LafargeHolcim Ltd. CDS v.18(2023)	0	3.500.000
	Société Générale S.A., Paris/Linde Finance BV CDS v.18(2023)	0	3.500.000
	Société Générale S.A., Paris/Pernod Ricard S.A. CDS v.18(2023)	0	3.500.000
	Société Générale S.A., Paris/Prudential Plc. CDS v.18(2023)	0	3.500.000
	Société Générale S.A., Paris/Shell International Finance BV CDS v.18(2023)	0	3.500.000
	Société Générale S.A., Paris/Siemens Financieringsmaatschappij NV CDS v.18(2023)	0	3.500.000
	Société Générale S.A., Paris/SSE Plc. CDS v.18(2023)	0	3.500.000
	Société Générale S.A., Paris/Wendel S.A. CDS v.18(2023)	0	3.500.000
USD			
	J.P. Morgan AG, Frankfurt a.M./CDX Emerging Markets S31 5Yr Index CDS v.19(2024)	50.000.000	50.000.000

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Berichtes.

ISIN	Wertpapiere	Zugänge	Abgänge
Sonstige Finanzinstrumente			
AUD			
	SWAP Australian Bank Bill Swap Rate 3 Monate (BBSW)/0.8850% 26.06.2021	148.000.000	148.000.000
	SWAP Australian Bank Bill Swap Rate 3 Monate (BBSW)/0.8850% 26.06.2021	148.000.000	148.000.000
	SWAP Australian Bank Bill Swap Rate 3 Monate (BBSW)/1.7300% 15.03.2023	129.750.000	0
	SWAP Australian Bank Bill Swap Rate 3 Monate (BBSW)/1.7300% 15.03.2023	0	129.750.000
	SWAP 2.5900%/Australian Bank Bill Swap Rate 6 Monate (BBSW) 15.03.2029	56.250.000	0
	SWAP 2.5900%/Australian Bank Bill Swap Rate 6 Monate (BBSW) 15.03.2029	0	56.250.000
CZK			
	SWAP 1.7660%/PRIBOR (CZK) 6 Monate 23.08.2021	968.181.819	968.181.819
	SWAP 1.7660%/PRIBOR (CZK) 6 Monate 23.08.2021	968.181.819	968.181.819
EUR			
	SWAP EURIBOR (EUR) 6 Monate/0.0080% 14.05.2024	49.500.000	49.500.000
	SWAP EURIBOR (EUR) 6 Monate/0.0080% 14.05.2024	49.500.000	49.500.000
	SWAP EURIBOR (EUR) 6 Monate/0.0080% 15.04.2024	50.000.000	50.000.000
	SWAP EURIBOR (EUR) 6 Monate/0.0080% 15.04.2024	50.000.000	50.000.000
	SWAP EURIBOR (EUR) 6 Monate/0.0153% 25.05.2028	33.100.000	33.100.000
	SWAP EURIBOR (EUR) 6 Monate/0.0153% 25.05.2028	33.100.000	33.100.000
	SWAP EURIBOR (EUR) 6 Monate/-0.0274% 21.05.2024	118.964.000	118.964.000
	SWAP EURIBOR (EUR) 6 Monate/-0.0274% 21.05.2024	118.964.000	118.964.000
	SWAP EURIBOR (EUR) 6 Monate/0.0330% 02.05.2024	60.000.000	60.000.000
	SWAP EURIBOR (EUR) 6 Monate/0.0330% 02.05.2024	60.000.000	60.000.000
	SWAP EURIBOR (EUR) 6 Monate/0.1505% 08.03.2024	40.000.000	0
	SWAP EURIBOR (EUR) 6 Monate/0.1505% 08.03.2024	0	40.000.000
	SWAP EURIBOR (EUR) 6 Monate/0.2816% 11.06.2029	49.674.000	49.674.000
	SWAP EURIBOR (EUR) 6 Monate/0.2816% 11.06.2029	49.674.000	49.674.000
	SWAP EURIBOR (EUR) 6 Monate/-0.2950% 09.07.2024	59.100.000	59.100.000
	SWAP EURIBOR (EUR) 6 Monate/-0.2950% 09.07.2024	59.100.000	59.100.000
	SWAP EURIBOR (EUR) 6 Monate/0.5023% 04.04.2029	50.100.000	50.100.000
	SWAP EURIBOR (EUR) 6 Monate/0.5023% 04.04.2029	50.100.000	50.100.000
	SWAP EURIBOR (EUR) 6 Monate/0.7095% 15.07.2049	7.000.000	7.000.000
	SWAP EURIBOR (EUR) 6 Monate/0.7095% 15.07.2049	7.000.000	7.000.000
	SWAP 0.0295%/EURIBOR (EUR) 6 Monate 11.06.2026	35.334.000	35.334.000
	SWAP 0.0295%/EURIBOR (EUR) 6 Monate 11.06.2026	35.334.000	35.334.000
	SWAP 0.1730%/EURIBOR (EUR) 6 Monate 15.07.2029	19.500.000	19.500.000
	SWAP 0.1730%/EURIBOR (EUR) 6 Monate 15.07.2029	19.500.000	19.500.000
	SWAP -0.1945%/EURIBOR (EUR) 6 Monate 02.05.2021	150.000.000	150.000.000
	SWAP -0.1945%/EURIBOR (EUR) 6 Monate 02.05.2021	150.000.000	150.000.000
	SWAP -0.2090%/EURIBOR (EUR) 6 Monate 14.05.2021	124.000.000	124.000.000
	SWAP -0.2090%/EURIBOR (EUR) 6 Monate 14.05.2021	124.000.000	124.000.000
	SWAP -0.2140%/EURIBOR (EUR) 6 Monate 15.04.2021	125.000.000	125.000.000
	SWAP -0.2140%/EURIBOR (EUR) 6 Monate 15.04.2021	125.000.000	125.000.000
	SWAP 0.2152%/EURIBOR (EUR) 6 Monate 04.04.2026	35.500.000	35.500.000
	SWAP 0.2152%/EURIBOR (EUR) 6 Monate 04.04.2026	35.500.000	35.500.000
	SWAP -0.2365%/EURIBOR (EUR) 6 Monate 21.05.2021	149.129.000	149.129.000
	SWAP -0.2365%/EURIBOR (EUR) 6 Monate 21.05.2021	149.129.000	149.129.000
	SWAP 0.3096%/EURIBOR (EUR) 6 Monate 15.08.2028	11.130.000	11.130.000
	SWAP 0.3096%/EURIBOR (EUR) 6 Monate 15.08.2028	11.130.000	11.130.000
	SWAP 0.3542%/EURIBOR (EUR) 6 Monate 15.08.2028	33.500.000	33.500.000
	SWAP 0.3542%/EURIBOR (EUR) 6 Monate 15.08.2028	33.500.000	33.500.000
	SWAP 0.4265%/EURIBOR (EUR) 6 Monate 21.05.2029	29.984.000	29.984.000
	SWAP 0.4265%/EURIBOR (EUR) 6 Monate 21.05.2029	29.984.000	29.984.000
	SWAP 0.5950%/EURIBOR (EUR) 6 Monate 11.06.2034	16.835.000	16.835.000
	SWAP 0.5950%/EURIBOR (EUR) 6 Monate 11.06.2034	16.835.000	16.835.000
	SWAP 0.8505%/EURIBOR (EUR) 6 Monate 04.04.2034	17.100.000	17.100.000
	SWAP 0.8505%/EURIBOR (EUR) 6 Monate 04.04.2034	17.100.000	17.100.000
	Total Return SWAP DB Long Fixed Income Vol EU Strategie/DB Long Fixed Income Vol EU Strategie 13.03.20	30.997.350	30.997.350
	Total Return SWAP Strategie JPM Mergers & Acquisitions/Strategie JPM Mergers & Acquisitions 15.06.20	50.924.928	50.924.928
	Total Return SWAP Strategie JPM Mergers & Acquisitions/Strategie JPM Mergers & Acquisitions 15.08.19	0	21.118.500
	Total Return SWAP STRATEGIE BARCLAYS WEEKLY VAR EU/STRATEGIE BARCLAYS WEEKLY VAR EU 22.05.20	20.011.976	20.011.976
	Total Return SWAP Strategie Goldman Sachs European Equity L/S/Strategie Goldman Sachs European Equity L/S 10.09.19	11.888	20.011.888
	Total Return SWAP Strategie Goldman Sachs European Equity L/S/Strategie Goldman Sachs European Equity L/S 15.04.20	39.994.800	39.994.800

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Berichtes.

UniAbsoluterErtrag

ISIN	Wertpapiere	Zugänge	Abgänge
	Total Return SWAP Strategie JP Morgan Call Overwriting SX5E/Strategie JP Morgan Call Overwriting SX5E 14.02.20	33.417.440	33.417.440
	Total Return SWAP Strategie JP Morgan Call Overwriting SX5E/Strategie JP Morgan Call Overwriting SX5E 14.02.20	0	17.012.968
	Total Return SWAP Strategie JPM Europe Quality Index/Strategie JPM Europe Quality Index 15.11.19	0	36.218.126
	Total Return SWAP STRATEGIE JPM European Equity L/S/STRATEGIE JPM European Equity L/S 15.08.19	195.700	100.195.700
	Total Return SWAP Strategie JPM Morgan Quant Style/Strategie JPM Morgan Quant Style 14.02.20	0	48.638.784
	Total Return SWAP Strategie JPM Morgan Quant Style/Strategie JPM Morgan Quant Style 15.06.20	53.255.455	53.255.455
	Total Return SWAP Strategie JPM Pension Onligations/Strategie JPM Pension Onligations 15.07.20	24.917.425	24.917.425
	Total Return SWAP STRATEGIE JPM UI Dynamic Themes Index/STRATEGIE JPM UI Dynamic Themes Index 15.08.19	0	19.442.000
	Total Return SWAP Strategie Morgan Stanley European Equities MS L/S 1/Strategie Morgan Stanley European Equities MS L/S	0	39.986.261
	Total Return SWAP UBS Put Write Strategie/UBS Put Write Strategie 20.03.20	5.028.000	5.028.000
JPY			
	Total Return SWAP STRATEGIE JPM JAPAN LABOUR SHORTAGE/STRATEGIE JPM JAPAN LABOUR SHORTAGE 15.08.19	0	2.619.750.000
	Total Return SWAP STRATEGIE MS Japan Buyback/STRATEGIE MS Japan Buyback 23.12.19	73.000.000	2.577.500.000
NZD			
	SWAP 1.2200%/New Zealand Bank Bill 3 Month FRA Index 29.06.2021	155.000.000	155.000.000
	SWAP 1.2200%/New Zealand Bank Bill 3 Month FRA Index 29.06.2021	155.000.000	155.000.000
PLN			
	SWAP WIBOR Warsaw Interbank 6 Months Offered Rate/1.6300% 23.08.2021	164.545.454	164.545.454
	SWAP WIBOR Warsaw Interbank 6 Months Offered Rate/1.6300% 23.08.2021	164.545.454	164.545.454
	SWAP WIBOR Warsaw Interbank 6 Months Offered Rate/2.2200% 05.06.2029	48.000.000	48.000.000
	SWAP WIBOR Warsaw Interbank 6 Months Offered Rate/2.2200% 05.06.2029	48.000.000	48.000.000
	SWAP WIBOR Warsaw Interbank 6 Months Offered Rate/2.3700% 16.04.2029	70.000.000	70.000.000
	SWAP WIBOR Warsaw Interbank 6 Months Offered Rate/2.3700% 16.04.2029	70.000.000	70.000.000
	SWAP WIBOR Warsaw Interbank 6 Months Offered Rate/2.3800% 20.05.2029	47.500.000	47.500.000
	SWAP WIBOR Warsaw Interbank 6 Months Offered Rate/2.3800% 20.05.2029	47.500.000	47.500.000
	SWAP 1.9150%/WIBOR Warsaw Interbank 6 Months Offered Rate 05.06.2024	90.000.000	90.000.000
	SWAP 1.9150%/WIBOR Warsaw Interbank 6 Months Offered Rate 05.06.2024	90.000.000	90.000.000
	SWAP 2.0300%/WIBOR Warsaw Interbank 6 Months Offered Rate 16.04.2024	135.000.000	135.000.000
	SWAP 2.0300%/WIBOR Warsaw Interbank 6 Months Offered Rate 16.04.2024	135.000.000	135.000.000
	SWAP 2.0525%/WIBOR Warsaw Interbank 6 Months Offered Rate 20.05.2024	90.000.000	90.000.000
	SWAP 2.0525%/WIBOR Warsaw Interbank 6 Months Offered Rate 20.05.2024	90.000.000	90.000.000
SEK			
	SWAP 0.0810%/STIBOR (SEK) 3 Monate 09.07.2024	600.000.000	600.000.000
	SWAP 0.0810%/STIBOR (SEK) 3 Monate 09.07.2024	600.000.000	600.000.000
	SWAP 0.4725%/STIBOR (SEK) 3 Monate 08.03.2024	425.000.000	0
	SWAP 0.4725%/STIBOR (SEK) 3 Monate 08.03.2024	0	425.000.000
USD			
	Excess Return SWAP/DB Commodity Volatilit.Premium III Index (USD) 04.06.20	30.288.031	30.288.031
	Excess Return SWAP/Macquarie Short Vol Basket Index 24.06.20	15.000.000	15.000.000
	SWAP LIBOR (USD) 3 Monate/2.5640% 26.02.2024	96.000.000	0
	SWAP LIBOR (USD) 3 Monate/2.5640% 26.02.2024	0	96.000.000
	SWAP LIBOR (USD) 3 Monate/2.6490% 03.04.2049	11.600.000	11.600.000
	SWAP LIBOR (USD) 3 Monate/2.6490% 03.04.2049	11.600.000	11.600.000
	SWAP LIBOR (USD) 3 Monate/2.8210% 11.02.2049	7.140.000	0
	SWAP LIBOR (USD) 3 Monate/2.8210% 11.02.2049	0	7.140.000
	SWAP LIBOR (USD) 3 Monate/2.8284% 08.02.2049	7.100.000	0
	SWAP LIBOR (USD) 3 Monate/2.8284% 08.02.2049	0	7.100.000
	SWAP LIBOR (USD) 3 Monate/2.8960% 06.03.2049	9.600.000	0
	SWAP LIBOR (USD) 3 Monate/2.8960% 06.03.2049	0	9.600.000
	SWAP 2.4810%/LIBOR (USD) 3 Monate 03.04.2029	28.000.000	28.000.000
	SWAP 2.4810%/LIBOR (USD) 3 Monate 03.04.2029	28.000.000	28.000.000
	SWAP 2.6200%/LIBOR (USD) 3 Monate 26.02.2021	116.000.000	0
	SWAP 2.6200%/LIBOR (USD) 3 Monate 26.02.2021	0	116.000.000
	SWAP 2.6900%/LIBOR (USD) 3 Monate 11.02.2029	16.900.000	0
	SWAP 2.6900%/LIBOR (USD) 3 Monate 11.02.2029	0	16.900.000
	SWAP 2.6920%/LIBOR (USD) 3 Monate 26.02.2029	26.000.000	0
	SWAP 2.6920%/LIBOR (USD) 3 Monate 26.02.2029	0	26.000.000
	SWAP 2.7034%/LIBOR (USD) 3 Monate 08.02.2029	16.800.000	0
	SWAP 2.7034%/LIBOR (USD) 3 Monate 08.02.2029	0	16.800.000
	SWAP 2.7350%/LIBOR (USD) 3 Monate 06.03.2029	22.600.000	0
	SWAP 2.7350%/LIBOR (USD) 3 Monate 06.03.2029	0	22.600.000

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Berichtes.

UniAbsoluterErtrag

ISIN	Wertpapiere	Zugänge	Abgänge
	Total Return SWAP Barclays EM FX Carry Strategie/Barclays EM FX Carry Strategie 20.04.20	16.676.496	16.676.496
	Total Return SWAP DB SPX Intraday Curve/DB SPX Intraday Curve 13.12.19	0	22.305.220
	Total Return SWAP STRATEGIE BARCLAYS WEEKLY VAR US HOURLY/STRATEGIE BARCLAYS WEEKLY VAR US HOURLY 22.05.20	45.191.685	45.191.685
	Total Return SWAP Strategie JP Morgan EM Select/Strategie JP Morgan EM Select 14.02.20	0	59.471.634
	Total Return SWAP Strategie JPM Call Overwriting SPX/Strategie JPM Call Overwriting SPX 14.02.20	0	19.743.354
	Total Return SWAP STRATEGIE JPM Financial Leverage/STRATEGIE JPM Financial Leverage 14.02.20	0	19.200.265
	Total Return SWAP STRATEGIE JPM Financial Leverage/STRATEGIE JPM Financial Leverage 15.06.20	13.830.894	13.830.894
	Total Return SWAP STRATEGIE JPM FSI EM/STRATEGIE JPM FSI EM 15.08.19	0	50.365.000
	Total Return SWAP STRATEGIE JPM HCT Cyber Security/STRATEGIE JPM HCT Cyber Security 15.11.19	249.900	18.725.500
	Total Return SWAP Strategie JPM Healthcare IT/Strategie JPM Healthcare IT 15.08.19	0	33.818.400
	Total Return SWAP Strategie JPM ItalyHygiene/Strategie JPM ItalyHygiene 15.08.19	0	24.660.000
	Total Return SWAP Strategie JPM Northamerica Quality/Strategie JPM Northamerica Quality 15.11.19	0	21.332.800
	Total Return SWAP Strategie JPM UI Dynamic Hedge Index/Strategie JPM UI Dynamic Hedge Index 15.08.19	0	44.105.600
	Total Return SWAP Strategie MS Vol Fixed Income TY Index/Strategie MS Vol Fixed Income TY Index 17.06.20	68.882.000	68.882.000
	Total Return SWAP Strategie MS Vol Fixed Income TY Index/Strategie MS Vol Fixed Income TY Index 17.06.20	44.047.500	44.047.500
	Total Return SWAP Strategie MS Vol Fixed Income TY Index/Strategie MS Vol Fixed Income TY Index 20.06.19	0	20.201.600
	Total Return SWAP STRATEGIE zu MS Rates Carry 10-2 ExtUni ex Italy Strategy /STRATEGIE zu MS Rates Carry 10-2 ExtUni ex	2.726.200	71.715.400
	Total Return SWAP Strategie zu MSVOL FIXED INCOME BUND/Strategie zu MSVOL FIXED INCOME BUND 20.06.19	0	17.805.200

- 1) Angaben zu Ausgabeaufschlägen, Rücknahmeabschlägen sowie zur maximalen Höhe der Verwaltungsgebühr für Zielfondsanteile sind auf Anfrage am Sitz der Verwaltungsgesellschaft, bei der Verwahrstelle und bei den Zahlstellen kostenlos erhältlich. Von gehaltenen Anteilen eines Zielfonds, die unmittelbar oder aufgrund einer Übertragung von derselben Verwaltungsgesellschaft oder von einer Gesellschaft verwaltet werden, mit der die Verwaltungsgesellschaft durch eine gemeinsame Verwaltung oder Beherrschung oder eine wesentliche direkte oder indirekte Beteiligung verbunden ist, wird keine oder eine reduzierte Verwaltungsvergütung berechnet.

Erläuterungen zum Bericht per Ende September 2019

Die Buchführung des Fonds erfolgt in Euro.

Der Halbjahresabschluss des Fonds wurde auf der Grundlage der im Domizilland gültigen Gliederungs- und Bewertungsgrundsätze erstellt.

Der Kurswert der Wertpapiere und sonstigen börsennotierten Derivate entspricht dem jeweiligen Börsen- oder Marktwert per Ende September 2019. An einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere werden zu den an diesem Markt verzeichneten Marktpreisen bewertet. Investitionen in Zielfonds werden zu deren zuletzt veröffentlichten Kursen bewertet.

Soweit der Fonds zum Stichtag OTC-Derivate im Bestand hat, erfolgt die Bewertung auf Tagesbasis auf der Grundlage indikativer Broker-Quotierungen oder von finanzmathematischen Bewertungsmodellen.

Soweit der Fonds zum Stichtag schwebende Devisentermingeschäfte verzeichnet, werden diese auf der Grundlage der für die Restlaufzeit gültigen Terminkurse bewertet.

Wertpapiere, deren Kurse nicht marktgerecht sind, sowie alle Vermögenswerte für die keine repräsentativen Marktwerte erhältlich sind, werden zu einem Verkehrswert bewertet, den die Verwaltungsgesellschaft nach Treu und Glauben und anerkannten Bewertungsregeln hergeleitet hat.

Das Bankguthaben wurde mit dem Nennwert angesetzt.

Die auf andere als auf die Fondswährung lautenden Vermögensgegenstände und Verbindlichkeiten wurden zu den letzten verfügbaren Devisenmittelkursen in Euro umgerechnet. Geschäftsvorfälle in Fremdwährungen werden zum Zeitpunkt der buchhalterischen Erfassung in die Fondswährung umgerechnet. Realisierte und unrealisierte Währungsgewinne und -verluste werden erfolgswirksam erfasst.

Die Zinsabgrenzung enthält die Stückzinsen zum Ende der Berichtsperiode.

Sofern der Fonds die Position Zinsen auf Anleihen enthält, beinhaltet diese, soweit zutreffend, auch anteilige Erträge aufgrund von Emissionsrenditen.

Der Fonds weist unterschiedliche Anteilklassen aus, welche in ihrem Verhältnis zum Nettoinventarwert und nach Abzug zuzurechnender Aufwendungen an der Entwicklung des Fonds partizipieren.

Der Ausgabe- bzw. Rücknahmepreis der Fondsanteile wird vom Nettoinventarwert pro Anteil zu den jeweiligen gültigen Handelstagen und, soweit zutreffend, zuzüglich eines im Verkaufsprospekt definierten Ausgabeaufschlags und/oder Dispositionsausgleichs bestimmt. Der Ausgabeaufschlag wird zu Gunsten der Verwaltungsgesellschaft und der Vertriebsstelle erhoben und kann nach der Größenordnung des Kaufauftrages gestaffelt werden. Der Dispositionsausgleich wird dem Fonds gutgeschrieben.

Die Vergütung der Verwaltungsgesellschaft sowie die Pauschalgebühr werden auf Basis des kalendertäglichen Nettofondsvermögens erfasst und monatlich ausbezahlt. Die Pauschalgebühr deckt die Vergütung der Verwahrstelle, bankübliche Depot- und Lagerstellengebühren für die Verwahrung von Vermögensgegenständen, Honorare der Abschlussprüfer, Kosten für die Beauftragung von Stimmrechtsvertretungen und Kosten für Hauptverwaltungstätigkeiten, wie zum Beispiel die Fondsbuchhaltung sowie das Berichts- und Meldewesen, ab. Die Berechnung erfolgt auf der Grundlage vertraglicher Vereinbarungen.

Einzelne Anteilklassen des Fonds unterliegen einer erfolgsabhängigen Vergütung, die auf der Grundlage der im Prospekt definierten Modalitäten von der Verwaltungsgesellschaft erhoben wird.

Sofern die Aufwands- und Ertragsrechnung sonstige Aufwendungen enthält, bestehen diese aus den im Verkaufsprospekt genannten Kosten wie beispielsweise staatliche Gebühren, Kosten für die Verwaltung von Sicherheiten oder Kosten für Prospektänderungen.

In den ordentlichen Nettoerträgen sind ein Ertragsausgleich und ein Aufwandsausgleich verrechnet. Diese beinhalten während der Berichtsperiode angefallene Nettoerträge, die der Anteilerwerber im Ausgabepreis mitbezahlt und der Anteilverkäufer im Rücknahmepreis vergütet erhält.

Das Fondsvermögen unterliegt im Großherzogtum Luxemburg einer Steuer, der „Taxe d'abonnement“ von gegenwärtig 0,05 % per annum, zahlbar pro Quartal auf das jeweils am Quartalsende ausgewiesene Netto-Fondsvermögen. Soweit das Fondsvermögen in anderen Luxemburger Investmentfonds angelegt ist, die ihrerseits bereits der Taxe d'abonnement unterliegen, entfällt diese Steuer für den Teil des Fondsvermögens, welcher in solche Luxemburger Investmentfonds angelegt ist.

Die Einnahmen aus der Anlage des Fondsvermögens werden in Luxemburg nicht besteuert, sie können jedoch etwaigen Quellen- oder Abzugsteuern in Ländern unterliegen, in welchen das Fondsvermögen angelegt ist. Weder die Verwaltungsgesellschaft noch die Verwahrstelle werden Quittungen über solche Steuern für einzelne oder alle Anteilhaber einholen.

Im Zusammenhang mit dem Abschluss von börsennotierten und/oder OTC-Derivaten hat der Fonds Sicherheiten in Form von Bankguthaben oder Wertpapieren zu liefern oder zu erhalten.

Die Positionen „Sonstige Bankguthaben/Bankverbindlichkeiten“ enthalten die vom Fonds gestellten/erhaltenen Sicherheiten in Form von Bankguthaben für börsennotierte Derivate und/oder gestellte Sicherheiten für OTC-Derivate. Gestellte Sicherheiten in Form von Wertpapieren werden in der Vermögensaufstellung gekennzeichnet. Erhaltene Sicherheiten in Form von Wertpapieren sowie Sicherheiten für OTC-Derivate in Form von Bankguthaben werden in der Zusammensetzung des Fondsvermögens und der Vermögensaufstellung nicht erfasst.

Die Wertentwicklung der Fondsanteile ist auf Basis der jeweils an den Stichtagen veröffentlichten Anteilwerte gemäß der BVI-Formel ermittelt worden. Sie kann im Einzelfall von der Entwicklung der Anteilwerte, wie sie im Fondsbericht ermittelt wurden, geringfügig abweichen.

Es können der Verwaltungsgesellschaft in ihrer Funktion als Verwaltungsgesellschaft des Fonds im Zusammenhang mit Handelsgeschäften geldwerte Vorteile („soft commissions“, z. B. Broker-Research, Finanzanalysen, Markt- und Kursinformationssysteme) entstehen, die im Interesse der Anteilhaber bei den Anlageentscheidungen verwendet werden, wobei derartige Handelsgeschäfte nicht mit natürlichen Personen geschlossen werden, die betreffenden Dienstleister nicht gegen die Interessen des Fonds handeln dürfen und ihre Dienstleistungen im direkten Zusammenhang mit den Aktivitäten des Fonds erbringen.

Hinweis auf das Gesetz vom 17. Dezember 2010

Der Fonds wurde nach Teil I des Luxemburger Gesetzes vom 17. Dezember 2010 über Organismen für gemeinsame Anlagen („Gesetz vom 17. Dezember 2010“) aufgelegt und erfüllt die Anforderungen der Richtlinie 2009/65/EG des Europäischen Parlaments und des Rates vom 13. Juli 2009 zur Koordinierung der Rechts- und Verwaltungsvorschriften betreffend bestimmte Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren („Richtlinie 2009/65/EG“).

Sonstige Informationen der Verwaltungsgesellschaft

Sonstige Angaben

Wertpapiergeschäfte werden grundsätzlich nur mit Kontrahenten getätigt, die durch das Fondsmanagement in eine Liste genehmigter Parteien aufgenommen wurden, deren Zusammensetzung fortlaufend überprüft wird. Dabei stehen Kriterien wie die Ausführungsqualität, die Höhe der Transaktionskosten, die Researchqualität und die Zuverlässigkeit bei der Abwicklung von Wertpapierhandelsgeschäften im Vordergrund. Darüber hinaus werden die jährlichen Geschäftsberichte der Kontrahenten eingesehen.

Zusätzliche Anhangangaben gemäß der Verordnung (EU) 2015/2365 über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte für den UniAbsoluterErtrag

	Wertpapierleihe	Pensionsgeschäfte	Total Return Swaps ¹⁾
Verwendete Vermögensgegenstände			
absolut	nicht zutreffend	nicht zutreffend	-2.558.977,17
in % des Fondsvermögen	nicht zutreffend	nicht zutreffend	-0,22 %
Zehn größte Gegenparteien ²⁾			
1. Name	nicht zutreffend	nicht zutreffend	Morgan Stanley Europe SE, Frankfurt
1. Bruttovolumen offene Geschäfte	nicht zutreffend	nicht zutreffend	1.297.802,29
1. Sitzstaat	nicht zutreffend	nicht zutreffend	Deutschland
2. Name	nicht zutreffend	nicht zutreffend	Morgan Stanley & Co. Intl. PLC, London
2. Bruttovolumen offene Geschäfte	nicht zutreffend	nicht zutreffend	525.888,72
2. Sitzstaat	nicht zutreffend	nicht zutreffend	Großbritannien
3. Name	nicht zutreffend	nicht zutreffend	UBS AG London Branch, Zürich
3. Bruttovolumen offene Geschäfte	nicht zutreffend	nicht zutreffend	382.559,12
3. Sitzstaat	nicht zutreffend	nicht zutreffend	Schweiz
4. Name	nicht zutreffend	nicht zutreffend	Goldman Sachs Bank Europe SE, Frankfurt
4. Bruttovolumen offene Geschäfte	nicht zutreffend	nicht zutreffend	-5.750,05
4. Sitzstaat	nicht zutreffend	nicht zutreffend	Deutschland
5. Name	nicht zutreffend	nicht zutreffend	BofA Securities Europe S.A., Paris
5. Bruttovolumen offene Geschäfte	nicht zutreffend	nicht zutreffend	-64.710,57
5. Sitzstaat	nicht zutreffend	nicht zutreffend	Frankreich
6. Name	nicht zutreffend	nicht zutreffend	J.P. Morgan AG, Frankfurt
6. Bruttovolumen offene Geschäfte	nicht zutreffend	nicht zutreffend	-4.694.766,68
6. Sitzstaat	nicht zutreffend	nicht zutreffend	Deutschland
Art(en) von Abwicklung und Clearing (z.B. zweiseitig, dreiseitig, Central Counterparty)			
	nicht zutreffend	nicht zutreffend	zweiseitig
Geschäfte gegliedert nach Restlaufzeiten (absolute Beträge)			
unter 1 Tag	nicht zutreffend	nicht zutreffend	nicht zutreffend
1 Tag bis 1 Woche (= 7 Tage)	nicht zutreffend	nicht zutreffend	nicht zutreffend
1 Woche bis 1 Monat (= 30 Tage)	nicht zutreffend	nicht zutreffend	nicht zutreffend
1 bis 3 Monate	nicht zutreffend	nicht zutreffend	783.158,70
3 Monate bis 1 Jahr (= 365 Tage)	nicht zutreffend	nicht zutreffend	-3.342.135,87
über 1 Jahr	nicht zutreffend	nicht zutreffend	nicht zutreffend
unbefristet	nicht zutreffend	nicht zutreffend	nicht zutreffend
Art(en) und Qualität(en) der erhaltenen Sicherheiten			
Arten	nicht zutreffend	nicht zutreffend	Bankguthaben
Qualitäten ³⁾	nicht zutreffend	nicht zutreffend	EUR
Währung(en) der erhaltenen Sicherheiten			
	nicht zutreffend	nicht zutreffend	EUR
Sicherheiten gegliedert nach Restlaufzeiten (absolute Beträge)			
unter 1 Tag	nicht zutreffend	nicht zutreffend	nicht zutreffend
1 Tag bis 1 Woche (= 7 Tage)	nicht zutreffend	nicht zutreffend	nicht zutreffend
1 Woche bis 1 Monat (= 30 Tage)	nicht zutreffend	nicht zutreffend	nicht zutreffend
1 bis 3 Monate	nicht zutreffend	nicht zutreffend	nicht zutreffend
3 Monate bis 1 Jahr (= 365 Tage)	nicht zutreffend	nicht zutreffend	nicht zutreffend
über 1 Jahr	nicht zutreffend	nicht zutreffend	nicht zutreffend
unbefristet	nicht zutreffend	nicht zutreffend	3.550.000,00
Ertrags- und Kostenanteile			
Ertragsanteil des Fonds			
absolut	1.386,91	nicht zutreffend	4.282.287,03
in % der Bruttoerträge	41,56 %	nicht zutreffend	81,92 %
Kostenanteil des Fonds	1.950,53	nicht zutreffend	945.047,52
davon Kosten an Verwaltungsgesellschaft / Ertragsanteil der Verwaltungsgesellschaft			
absolut	1.332,53	nicht zutreffend	nicht zutreffend
in % der Bruttoerträge	39,93 %	nicht zutreffend	nicht zutreffend
davon Kosten an Dritte / Ertragsanteil Dritter			

	Wertpapierleihe	Pensionsgeschäfte	Total Return Swaps ¹⁾
absolut	618,00	nicht zutreffend	945.047,52
in % der Bruttoerträge	18,52 %	nicht zutreffend	18,08 %

Erträge für den Fonds aus Wiederanlage von Barsicherheiten, bezogen auf alle Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total Return Swaps (absoluter Betrag)

nicht zutreffend

Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total Return Swaps

Verliehene Wertpapiere in % aller verleihbaren Vermögensgegenstände des Fonds

nicht zutreffend

Zehn größte Sicherheitenaussteller, bezogen auf alle Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total Return Swaps ⁴⁾

1. Name	Morgan Stanley Europe SE
1. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	1.400.000,00
2. Name	J.P. Morgan Securities PLC, London
2. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	750.000,00
3. Name	Goldman Sachs Bank Europe SE
3. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	660.000,00
4. Name	UBS AG, Zürich
4. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	420.000,00
5. Name	BofA Securities Europe S.A.
5. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	290.000,00
6. Name	Morgan Stanley & Co. Intl. PLC, London
6. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	30.000,00

Wiederangelegte Sicherheiten in % der empfangenen Sicherheiten, bezogen auf alle Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total Return Swaps

keine wiederangelegten Sicherheiten;
gemäß Verkaufsprospekt ist bei Bankguthaben eine Wiederanlage zu 100% möglich

Verwahrer / Kontoführer von empfangenen Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps

Gesamtzahl Verwahrer / Kontoführer	1
1. Name	DZ PRIVATBANK S.A.
1. Verwahrter Betrag absolut	3.550.000,00

Verwahrart begebener Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps

In % aller begebenen Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps	
gesonderte Konten / Depots	nicht zutreffend
Sammelkonten / Depots	nicht zutreffend
andere Konten / Depots	nicht zutreffend
Verwahrart bestimmt Empfänger	100 %

- 1) Die Sicherheiten für Total Return Swaps befinden sich in einem Sicherheitenpool, so dass auch andere Derivate darunter besichert sind.
- 2) Es werden nur die tatsächlichen Gegenparteien des Fonds aufgelistet. Die Anzahl dieser Gegenparteien kann weniger als zehn betragen.
- 3) Es werden nur Vermögensgegenstände als Sicherheit genommen, die für den Fonds nach Maßgabe des Gesetzes vom 17. Dezember 2010 erworben werden dürfen und die Bestimmungen der entsprechenden CSSF-Rundschreiben erfüllen. Neben ggf. Bankguthaben handelt es sich um hochliquide Vermögensgegenstände, die an einem liquiden Markt mit transparenter Preisfeststellung gehandelt werden. Die gestellten Sicherheiten werden von Emittenten mit einer hohen Kreditqualität ausgegeben. Weitere Informationen zu Sicherheitenanforderungen befinden sich in dem Verkaufsprospekt des Fonds.
- 4) Es werden nur die tatsächlichen Sicherheitenaussteller des Fonds aufgelistet. Die Anzahl dieser Sicherheitenaussteller kann weniger als zehn betragen.

Verwaltungsgesellschaft und zugleich Hauptverwaltungsgesellschaft

Union Investment Luxembourg S.A.
308, route d'Esch
L-1471 Luxemburg
Großherzogtum Luxemburg
R.C.S.L. B 28679

Eigenkapital per 31.12.2018:
Euro 169,940 Millionen
nach Gewinnverwendung

Leitungsorgan der Union Investment Luxembourg S.A.:

Verwaltungsrat

Verwaltungsratsvorsitzender

Hans Joachim REINKE
Vorsitzender des Vorstandes der
Union Asset Management Holding AG
Frankfurt am Main

Stv. Verwaltungsratsvorsitzender

Giovanni GAY
Mitglied der Geschäftsführung der
Union Investment Privatfonds GmbH
Frankfurt am Main

Weitere Mitglieder des Verwaltungsrates

Dr. Frank ENGELS
Mitglied der Geschäftsführung der
Union Investment Privatfonds GmbH
Frankfurt am Main

Nikolaus SILLEM (bis zum 30.06.2019)
Mitglied der Geschäftsführung der
Union Investment Institutional GmbH
Frankfurt am Main

Maria LÖWENBRÜCK
Mitglied der Geschäftsführung der
Union Investment Luxembourg S.A.
Luxemburg

Dr. Joachim VON CORNBERG
Mitglied der Geschäftsführung der
Union Investment Luxembourg S.A.
Luxemburg

Karl-Heinz MOLL
unabhängiges Mitglied des
Verwaltungsrates

Bernd SCHLICHTER
unabhängiges Mitglied des
Verwaltungsrates

Geschäftsführer der Union Investment Luxembourg S.A.

Maria LÖWENBRÜCK
Dr. Joachim VON CORNBERG

Gesellschafter der Union Investment Luxembourg S.A.

Union Asset Management Holding AG
Frankfurt am Main

Auslagerung des Portfoliomanagements an folgende, der Union Investment Gruppe angehörende, Gesellschaften:

Union Investment Privatfonds GmbH
Weißfrauenstraße 7
D-60311 Frankfurt am Main

Union Investment Institutional GmbH
Weißfrauenstraße 7
D-60311 Frankfurt am Main

Abschlussprüfer (Réviseur d'entreprises agréé)

Ernst & Young S.A.
35E avenue John F. Kennedy
L-1855 Luxembourg

die zugleich Abschlussprüfer der
Union Investment Luxembourg S.A. ist.

Verwahrstelle und zugleich Hauptzahlstelle

DZ PRIVATBANK S.A.
4, rue Thomas Edison
L-1445 Luxemburg-Strassen

Zahl- und Vertriebsstelle im Großherzogtum Luxemburg

DZ PRIVATBANK S.A.
4, rue Thomas Edison
L-1445 Luxemburg-Strassen

Zahl- und Vertriebsstellen sowie Informationsstellen in der Bundesrepublik Deutschland

DZ BANK AG
Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank
Platz der Republik
60265 Frankfurt am Main
Sitz: Frankfurt am Main

BBBank eG
Herrenstraße 2-10
76133 Karlsruhe
Sitz: Karlsruhe

Deutsche Apotheker- und Ärztebank eG
Richard-Oskar-Mattern-Str. 6
40547 Düsseldorf
Sitz: Düsseldorf

Weitere Vertriebsstellen in der Bundesrepublik Deutschland

Die den vorgenannten Banken sowie den genossenschaftlichen Zentralbanken angeschlossenen Kreditinstitute sind weitere Vertriebsstellen in der Bundesrepublik Deutschland.

Zahl- und Vertriebsstelle in Österreich

VOLKSBANK WIEN AG
Kolingasse 14-16
A-1090 Wien

Weitere von der Verwaltungsgesellschaft verwaltete Fonds

BBBank Konzept Dividendenwerte Union
Commodities-Invest
FairWorldFonds
LIGA Portfolio Concept
LIGA-Pax-Cattolico-Union
LIGA-Pax-Corporates-Union
LIGA-Pax-Laurent-Union (2022)
PE-Invest SICAV
PrivatFonds: Konsequent
PrivatFonds: Konsequent pro
PrivatFonds: Nachhaltig
Quoniam Funds Selection SICAV
SpardaRentenPlus
UniAnlageMix: Konservativ
UniAsia
UniAsiaPacific
UniAusschüttung
UniDividendenAss
UniDynamicFonds: Europa
UniDynamicFonds: Global
UniEM Fernost
UniEM Global
UniEM Osteuropa
UniEuroAnleihen
UniEuroAspirant
UniEuroKapital
UniEuroKapital Corporates
UniEuroKapital -net-
UniEuropa
UniEuropa Mid&Small Caps
UniEuropaRenta
UniEuroRenta Corporates
UniEuroRenta EM 2021
UniEuroRenta EmergingMarkets
UniEuroRenta Real Zins
UniEuroRenta Unternehmensanleihen EM 2021
UniEuroRenta Unternehmensanleihen 2020
UniEuroRenta 5J
UniEuroSTOXX 50
UniExtra: EuroStoxx 50
UniFavorit: Aktien Europa
UniFavorit: Renten
UniGarant: Aktien Welt (2020)
UniGarant: ChancenVielfalt (2020)
UniGarant: ChancenVielfalt (2020) II
UniGarant: ChancenVielfalt (2021)
UniGarant: Emerging Markets (2020)
UniGarant: Emerging Markets (2020) II
UniGarant: Nordamerika (2021)
UniGarant: Rohstoffe (2020)
UniGarantTop: Europa
UniGarantTop: Europa II
UniGarantTop: Europa III
UniGarantTop: Europa IV
UniGarantTop: Europa V
UniGarant80: Dynamik

UniGarant95: Aktien Welt (2020)
UniGarant95: ChancenVielfalt (2020)
UniGlobal Dividende
UniGlobal II
UniIndustrie 4.0
UniInstitutional Asian Bond and Currency Fund
UniInstitutional Basic Emerging Markets
UniInstitutional Basic Global Corporates HY
UniInstitutional Basic Global Corporates IG
UniInstitutional CoCo Bonds
UniInstitutional Convertibles Protect
UniInstitutional Corporate Hybrid Bonds
UniInstitutional EM Corporate Bonds
UniInstitutional EM Corporate Bonds Flexible
UniInstitutional EM Corporate Bonds Low Duration Sustainable
UniInstitutional EM Corporate Bonds 2020
UniInstitutional EM Corporate Bonds 2022
UniInstitutional EM High Yield Bonds
UniInstitutional EM Sovereign Bonds
UniInstitutional Equities Market Neutral
UniInstitutional Euro Corporate Bonds 2019
UniInstitutional Euro Subordinated Bonds
UniInstitutional European Bonds & Equities
UniInstitutional European Bonds: Diversified
UniInstitutional European Bonds: Governments Peripherie
UniInstitutional European Corporate Bonds +
UniInstitutional European Equities Concentrated
UniInstitutional Financial Bonds 2022
UniInstitutional German Corporate Bonds +
UniInstitutional Global Convertibles
UniInstitutional Global Convertibles Sustainable
UniInstitutional Global Corporate Bonds Short Duration
UniInstitutional Global Corporate Bonds Sustainable
UniInstitutional Global Corporate Bonds 2022
UniInstitutional Global Covered Bonds
UniInstitutional Global Credit
UniInstitutional Global High Dividend Equities Protect (in Liquidation)
UniInstitutional Global High Yield Bonds
UniInstitutional IMMUNO Nachhaltigkeit
UniInstitutional Interest Rates Market Neutral
UniInstitutional Local EM Bonds
UniInstitutional Multi Credit
UniInstitutional Risk Premia
UniInstitutional SDG Equities
UniInstitutional Short Term Credit
UniInstitutional Structured Credit
UniInstitutional Structured Credit High Yield
UniKonzept: Dividenden
UniKonzept: Portfolio
UniMarktführer
UnionProtect: Europa (CHF) (in Liquidation)
UniOptima
UniOptimus -net-
UniOpti4
UniProfiAnlage (2020)
UniProfiAnlage (2020/II)

UniProfiAnlage (2021)
UniProfiAnlage (2023)
UniProfiAnlage (2023/II)
UniProfiAnlage (2024)
UniProfiAnlage (2025)
UniProfiAnlage (2027)
UniRak Emerging Markets
UniRak Nachhaltig
UniRak Nachhaltig Konservativ
UniRak Nordamerika
UniRent Kurz URA
UniRent Mündel
UniRenta Corporates
UniRentEuro Mix
UniReserve
UniReserve: Euro-Corporates
UniSector
UniStruktur
UniValueFonds: Europa
UniValueFonds: Global
UniVorsorge 1
UniVorsorge 2
UniVorsorge 3
UniVorsorge 4
UniVorsorge 5
UniVorsorge 6
UniVorsorge 7
UniWirtschaftsAspirant
VBMH Vermögen (in Liquidation)

Die Union Investment Luxembourg S.A. verwaltet ebenfalls Fonds nach dem Gesetz vom 13. Februar 2007 über spezialisierte Investmentfonds.

Union Investment Luxembourg S.A.
308, route d'Esch
L-1471 Luxembourg
service@union-investment.com
privatkunden.union-investment.de