Amundi
ASSET MANAGEMENT

Halbjahresbericht
30. Juni 2018 (ungeprüft)

Amundi S.F.

Investmentfonds nach luxemburgischen Recht
(Fonds Commun de Placement)

Amundi S.F.

Ungeprüfter Halbjahresbericht

Investmentfonds nach luxemburgischen Recht

Für den Zeitraum vom 01.01.2018 bis zum 30.06.2018

Für die folgenden Teilfonds wurde keine Vertriebsanzeige bei der BaFin eingereicht und folglich dürfen Anteile an den folgenden Teilfonds nicht öffentlich in Deutschland vertrieben werden :

1. Amundi S.F. - Euro Financials Recovery 05/2018
2. Amundi S.F. - Diversified Subordinated Bond 2018
3. Amundi S.F. - Emerging Markets Bond 2019
4. Amundi S.F. - CHF Aggregate Bond
5. Amundi S.F. - Target Eonia Plus
6. Amundi S.F. - Absolute Return Currencies

Auf Grundlage dieses Abschlusses kann keine Zeichnung erhalten werden. Zeichnungen sind nur gültig, wenn sie auf Grundlage des aktuellen Verkaufsprospekts und der wesentlichen Informationen für den Anleger, zusammen mit dem neuesten Jahresbericht und einer Kopie des neuesten halbjährlichen Berichtes, soweit danach veröffentlicht, getätigt werden.

Inhaltsverzeichnis

	Seite
Struktur	4
Angaben zu den Portfolios zum 30.06.2018:	
Anleihen-Teilfonds	
Amundi S.F. - Diversified Short-Term Bond	6
Amundi S.F. - Diversified Subordinated Bond 2018	10
Amundi S.F. - Emerging Markets Bond 2019	11
Amundi S.F. - Euro Curve 1-3year	13
Amundi S.F. - Euro Curve 3-5year	14
Amundi S.F. - Euro Curve 5-7year	15
Amundi S.F. - Euro Curve 7-10year	16
Amundi S.F. - Euro Curve 10+year	17
Amundi S.F. - High Yield & Emerging Markets Bond Opportunities 2021	18
Teilfonds auf Aktien	
Amundi S.F. - European Equity Market Plus	21
Absolute Return-Teilfonds	
Amundi S.F. - Absolute Return Multi-Strategy Control	25
Amundi S.F. - Saving Box I	36
Amundi S.F. - Saving Box II	42
Amundi S.F. - Saving Box III	48
Multi Asset-Teilfonds	
Amundi S.F. - Amundi Target Trend 2024 [(1)]	54
Amundi S.F. - Equity Plan 60	55
Amundi S.F. - Diversified Target Income 11/2021	58
Amundi S.F. - Diversified Target Income 11/2022	64
Rohstoff-Teilfonds	
Amundi S.F. - EUR Commodities	70
Capital Guaranteed-Teilfonds	
Amundi S.F. - SMBC Amundi Protect Fund USD Step 201803 [(2)]	71
Abschluss:	
Aufstellung des Nettovermögens	72
Statistische Angaben zu den Investmentanteilen	83
Anmerkungen zum Halbjahresbericht per 30.06.2018	93
Zusätzliche Informationen	125

[(1)] Dieser Teilfonds wurde am 16. Januar 2018 aufgelegt.
[(2)] Dieser Teilfonds wurde am 12. April 2018 aufgelegt.

VERWALTUNGSGESELLSCHAFT, DOMIZILSTELLE UND VERTRIEBSGESELLSCHAFT

Amundi Luxembourg S.A.
5, Allée Scheffer
L-2520 Luxemburg
Großherzogtum Luxemburg

CORPORATE GOVERNANCE

Die Verwaltungsgesellschaft unterliegt bezüglich ihrer Corporate Governance unter anderem den folgenden Vorschriften:

1. Dem geänderten Gesetz des Großherzogtums Luxemburg vom 17. Dezember 2010 zu Organismen für gemeinsame Anlagen und den Rundschreiben der *Commission de Surveillance du Secteur Financier* („CSSF"), welche die gesetzlichen Vorschriften ergänzen.

2. Ihrer Satzung, die am Sitz der Gesellschaft und im Luxemburger Gesellschafts- und Handelsregister, dem *Registre de Commerce et des Sociétés* („RCSL"), zur Einsichtnahme bereit steht.

VERWALTUNGSRAT DER VERWALTUNGSGESELLSCHAFT

Vorsitzender

Patrick ZURSTRASSEN *(bis zum 5. April 2018)*
Mitglied des Verwaltungsrats mehrerer Fondsverwaltungsgesellschaften,
wohnhaft in Luxemburg

David HARTE *(ab dem 6. April 2018)*
Deputy Head Operations, Geschäftsbereich Services & Technology,
Amundi Ireland Ltd,
wohnhaft in Irland

Mitglieder

Julien FAUCHER,
Managing Director der
Amundi Luxembourg S.A.,
wohnhaft in Luxemburg

David HARTE *(bis zum 5. April 2018)*
Deputy Head Operations, Geschäftsbereich Services & Technology,
Amundi Ireland Ltd,
wohnhaft in Irland

Claude KREMER
Partner von Arendt & Medernach S.A.,
wohnhaft in Luxemburg

John LI *(bis zum 5. April 2018)*
Unabhängiges Verwaltungsratmitglied bei mehreren Gesellschaften, darunter Fonds und andere Unternehmen im Finanzsektor,
wohnhaft in Luxemburg

Corinne MASSUYEAU *(bis zum 5. April 2018)*
Global Head der Institutional Client Services, Amundi Asset Management S.A.S,
wohnhaft in Frankreich

Enrico TURCHI
Deputy Chief Executive Officer und Managing Director von Amundi Luxembourg S.A.,
wohnhaft in Luxemburg

GESCHÄFTSFÜHRER DER VERWALTUNGSGESELLSCHAFT

Die Verwaltungsgesellschaft hat im Einklang mit Artikel 102 (1) c) des am 17. Dezember 2010 geänderten Gesetzes die folgenden Geschäftsführer ernannt:
Julien Faucher, Managing Director/Chief Executive Officer, Amundi Luxembourg S.A.
Enrico Turchi, Managing Director/Deputy Chief Executive Officer, Amundi Luxembourg S.A. Olivier Guilbaut, Chief Operating Officer, Amundi Luxembourg S.A.
Charles Giraldez, Deputy Chief Executive Officer, Amundi Luxembourg S.A.
François de la Villeon, Real Estate Portfolio Manager, Amundi Luxembourg S.A. Die Hauptaufgaben der Geschäftsführer bestehen darin,

- die Implementierung von Strategien und Leitlinien für die zentrale Administration und die interne Geschäftsordnung durch schriftliche Richtlinien und Handlungsanweisungen sicherzustellen,
- die Implementierung von angemessenen internen Kontrollfunktionen sicherzustellen,
- sicherzustellen, dass die Verwaltungsgesellschaft über eine angemessene technische Infrastruktur und Personalausstattung verfügt, um ihre Geschäftstätigkeit ausüben zu können.

ADMINISTRATOR, REGISTERFÜHRER UND TRANSFERAGENT

Société Générale Bank & Trust
(Operational center)
28-32, Place de la gare
L-1616 Luxemburg
Großherzogtum Luxemburg

DEPOTBANK UND ZAHLSTELLE	Société Générale Bank & Trust 11, Avenue Emile Reuter L-2420 Luxemburg Großherzogtum Luxemburg
INVESTMENTMANAGER	Amundi Ireland Ltd *(vormals bekannt als Pioneer Investment Management Limited)* 1, George's Quay Plaza George's Quay Dublin 2 Irland Amundi Deutschland GmbH Arnulfstraße 124 -126 D-80636 München Deutschland Amundi SGR S.p.A. Piazza Cavour 2 20121 Mailand, Italien Amundi Asset Management S.A.S, Paris 90, Boulevard Pasteur 75015 Paris, Frankreich
ABSCHLUSSPRÜFER / ***CABINET DE RÉVISION AGRÉÉ***	Deloitte Audit, *Société à responsabilité limitée* 560, rue de Neudorf L-2220 Luxemburg Großherzogtum Luxemburg
RECHTSBERATER	Arendt & Medernach S.A. 41A, avenue J.F. Kennedy L-2082 Luxemburg Großherzogtum Luxemburg

Wertpapierbestand zum 30.06.2018

Anzahl		Marktwert	% des NIW
		EUR	
Long-Positionen		**1.568.175.182**	**93,26**
Zur amtlichen Notierung an einer Wertpapierbörse zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte, übertragbare Wertpapiere		**1.567.009.154**	**93,19**
	Anleihen	**1.567.009.154**	**93,19**
	Österreich	*14.564.036*	*0,87*
2.000.000	ERSTE GROUP BANK AG VAR PERPETUAL	2.344.950	0,14
3.000.000	ERSTE GROUP BANK AG VAR 26/05/2025	2.625.446	0,16
3.000.000	OMV AG VAR PERPETUAL	3.334.200	0,20
6.000.000	RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG VAR 21/02/2025	6.259.440	0,37
	Belgien	*22.810.275*	*1,36*
6.407.000	ANHEUSER BUSCH INBEV SA FRN 17/03/2020	6.473.632	0,38
2.300.000	ANHEUSER BUSCH INBEV SA 0,625% 17/03/2020	2.327.577	0,14
2.750.000	DELHAIZE LE LION DE LEEUW COMM VA 4,25% 19/10/2018	2.786.039	0,17
5.000.000	KBC GROUP SA/NV FRN 24/11/2022	4.979.300	0,30
3.100.000	KBC GROUP SA/NV VAR 25/11/2024	3.186.847	0,19
3.000.000	KBC GROUP SA/NV VAR PERP	3.056.880	0,18
	Bermuda	*4.532.617*	*0,27*
4.000.000	HISCOX LTD 2,00% 14/12/2022	4.532.617	0,27
	Cayman Islands	*5.798.129*	*0,34*
5.000.000	PHOENIX GROUP HOLDINGS 4,125% 20/07/2022	5.798.129	0,34
	Dänemark	*26.641.274*	*1,58*
2.000.000	DANSKE BANK AS VAR PERPETUAL	2.102.940	0,13
4.009.000	DANSKE BANK AS VAR 04/10/2023	4.047.306	0,24
8.500.000	NYKREDIT REALKREDIT AS FRN 02/06/2022	8.515.300	0,50
4.000.000	NYKREDIT REALKREDIT AS VAR PERPETUAL	4.313.560	0,26
3.800.000	NYKREDIT REALKREDIT AS VAR 03/06/2036	4.063.796	0,24
3.000.000	TDC AS 5,625% 23/02/2023	3.598.372	0,21
	Finnland	*5.040.152*	*0,30*
2.640.000	SATO OYJ 2,25% 10/09/2020	2.744.121	0,16
2.185.000	SATO OYJ 2,375% 24/03/2021	2.296.031	0,14
	Frankreich	*274.825.475*	*16,34*
2.993.000	3AB OPTIQUE DEVELOPMENT VAR 01/10/2023	2.841.195	0,17
5.500.000	ACCOR SA VAR PERPETUAL	5.738.370	0,34
11.000.000	ALD INTERNATIONAL FRN 26/02/2021	10.981.245	0,64
4.900.000	ALD SA FRN 27/11/2020	4.903.822	0,29
4.000.000	ARKEMA SA VAR PERPETUAL	4.284.140	0,25
490.000	AXA SA VAR PERPETUAL	411.316	0,02
7.000.000	AXA SA VAR 16/04/2040	7.528.080	0,45
3.100.000	BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL FRN 03/06/2020	3.120.476	0,19
2.400.000	BANQUE PSA FINANCE 0,50% 17/01/2020	2.417.640	0,14
1.200.000	BISOHO SAS 5,875% 01/05/2023	614.798	0,04
8.000.000	BNP PARIBAS SA FRN 22/09/2022	8.052.440	0,48
3.000.000	BNP PARIBAS SA VAR PERPETUAL	3.272.490	0,19
7.500.000	BPCE SA FRN 09/03/2022	7.597.012	0,45
2.408.000	BPCE SA FRN 22/05/2022	2.090.488	0,12
5.000.000	BPCE SA FRN 23/03/2023	4.928.275	0,29
1.300.000	BPCE SA VAR PERPETUAL	1.492.153	0,09
2.000.000	CARREFOUR SA 0,875% 12/06/2023	2.006.580	0,12
1.300.000	CASINO GUICHARD PERRACHON SA VAR 09/03/2020	1.371.474	0,08
1.950.000	CASINO GUICHARD PERRACHON SA VAR 12/11/2018	1.987.235	0,12
4.700.000	CASINO GUICHARD PERRACHON SA 1,865% 13/06/2022	4.400.704	0,26
4.350.000	CNP ASSURANCES VAR 14/09/2040	4.792.439	0,29
2.000.000	CREDIT AGRICOLE SA VAR PERPETUAL	2.153.720	0,13
180.000	CREDIT AGRICOLE SA VAR PERP	161.773	0,01
1.151.000	CROWN EUROPEAN HOLDINGS 2,25% 01/02/2023	1.141.642	0,07
5.300.000	DANONE SA VAR PERPETUAL	5.103.132	0,30
1.100.000	DANONE SA VAR 03/11/2018	1.101.012	0,07
4.800.000	ELECTRICITE DE FRANCE SA VAR PERPETUAL	5.000.664	0,30
7.100.000	ELECTRICITE DE FRANCE SA VAR PERPETUAL	7.443.995	0,44
5.000.000	ENGIE SA VAR PERPETUAL	4.693.650	0,28
1.623.000	FAURECIA SA 3,625% 15/06/2023	1.683.019	0,10
1.600.000	KERING 1,875% 08/10/2018	1.608.680	0,10
325.000	LOXAM 3,50% 03/05/2023	332.157	0,02
1.702.000	LOXAM 3,50% 15/04/2022	1.747.205	0,10
2.905.000	MFINANCE FRANCE EURO MEDIUM TERM NORES 1,398% 26/09/2020	2.969.375	0,18
3.191.000	NOVAFIVES 5,00% 15/06/2025	3.040.098	0,18
6.722.000	ORANGE SA VAR PERPETUAL	8.221.385	0,49
2.630.000	ORANGE SA VAR PERP	2.761.947	0,16
10.000.000	PSA BANQUE FRANCE 0,75% 19/04/2023	9.902.750	0,59
7.814.000	RCI BANQUE SA FRN 05/12/2019	7.848.732	0,47
8.812.000	RCI BANQUE SA FRN 08/07/2020	8.828.081	0,53
3.400.000	RCI BANQUE SA FRN 12/04/2021	3.413.175	0,20
6.000.000	RCI BANQUE SA FRN 14/03/2022	5.999.370	0,36
6.000.000	RCI BANQUE SA 0,25% 12/07/2021	5.975.910	0,36
2.620.000	RCI BANQUE SA 0,75% 26/09/2022	2.628.292	0,16
8.500.000	SANOFI SA VAR 21/03/2020	8.537.230	0,51
3.500.000	SANOFI SA VAR 22/03/2019	3.506.510	0,21
5.000.000	SANOFI SA 0,50% 21/03/2023	5.058.675	0,30
5.000.000	SFR GROUP SA 5,375% 15/05/2022	5.134.000	0,31
10.000.000	SOCIETE GENERALE SA FRN 01/04/2022	10.050.750	0,60
350.000	SOCIETE GENERALE SA VAR PERPETUAL	384.430	0,02
5.600.000	SOCIETE GENERALE SA VAR 16/09/2026	5.796.364	0,34
2.900.000	SOCIETE GENERALE SA VAR 23/02/2028	2.798.167	0,17
7.050.000	SOLVAY FINANCE VAR PERPETUAL	7.213.771	0,43
5.000.000	SOLVAY FINANCE VAR PERPETUAL	5.420.250	0,32
14.400.000	THALES VAR 19/04/2020	14.433.264	0,85
5.400.000	TOTAL SA VAR PERPETUAL	5.814.882	0,35
1.800.000	UBISOFT ENTERTAINMENT 1,289% 30/01/2023	1.806.507	0,11
6.500.000	UNIBAIL-RODAMCO SE VAR PERPETUAL	6.370.617	0,38
7.800.000	UNIBAIL-RODAMCO SE 0,125% 14/05/2021	7.817.862	0,46
6.000.000	VEOLIA ENVIRONMENT SA 0,672% 30/03/2022	6.090.060	0,36
	Deutschland	*112.276.260*	*6,68*
13.083.000	ADLER REAL ESTATE AG 1,50% 06/12/2021	13.094.775	0,79
12.000.000	ADLER REAL ESTATE AG 1,875% 27/04/2023	11.660.160	0,69
2.512.000	ADLER REAL ESTATE AG 4,75% 08/04/2020	2.587.033	0,15

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses

Wertpapierbestand zum 30.06.2018

Anzahl		Marktwert	% des NIW
		EUR	
1.850.000	BASF SE VAR 15/11/2019	1.856.706	0,11
5.550.000	BAYER AG VAR 01/07/2075	5.715.002	0,34
3.000.000	BERTELSMANN SE & CO VAR 23/04/2075	3.015.765	0,18
6.000.000	COMMERZBANK AG 7,75% 16/03/2021	7.032.030	0,42
750.000	CONTINENTAL AG 0% 05/02/2020	750.975	0,04
2.400.000	DEUTSCHE BANK AG FRN 15/04/2019	2.394.000	0,14
5.000.000	DEUTSCHE BANK AG 0,375% 18/01/2021	4.873.775	0,29
5.000.000	DEUTSCHE BANK AG 5,00% 24/06/2020	5.263.100	0,31
5.000.000	ENBW ENERGIE BADEN-WUERTTEMBER VAR 02/04/2076	5.226.150	0,31
380.000	HENKEL AG & CO KGAA 0% 13/09/2018	380.070	0,02
6.000.000	IHO VERWALTUNGS GMBH 2,75% 15/09/2021	6.051.060	0,36
6.000.000	LANDESKREDITBANK BANK BADEN-WUERTTEMBERG FOERDERBANK 0,50% 07/06/2022	6.022.020	0,36
1.350.000	MERCK FINANCIAL SERVICE GMBH 0,75% 02/09/2019	1.360.490	0,08
4.959.000	PLATIN 1426 GMBH 5,375% 15/06/2023	4.735.349	0,28
2.200.000	RWE AG VAR PERPETUAL	2.549.298	0,15
4.900.000	VOLKSWAGEN BANK GMBH 0,625% 08/09/2021	4.909.310	0,29
14.500.000	VOLKSWAGEN FINANCIAL SERVICES AG FRN 11/10/2019	14.510.657	0,87
3.315.000	VOLKSWAGEN FINANCIAL SERVICES AG 0,375% 12/04/2021	3.313.260	0,20
5.000.000	VOLKSWAGEN LEASING GMBH FRN 06/07/2021	4.975.275	0,30
	Guernsey	*8.406.645*	*0,50*
3.000.000	GLOBALWORTH REAL ESTATE INVESTMENTS LIMITED 2,875% 20/06/2022	3.082.455	0,18
5.555.000	SUMMIT GERMANY LTD 2,00% 31/01/2025	5.324.190	0,32
	Island	*2.545.263*	*0,15*
2.500.000	LANDSBANKINN HF 1,375% 14/03/2022	2.545.263	0,15
	Irland	*79.670.459*	*4,74*
18.734.000	AIB GROUP PLC VAR 26/11/2025	19.674.071	1,17
9.800.000	AIB GROUP PLC 1,50% 29/03/2023	9.734.095	0,58
2.202.000	AIB GROUP PLC 2,75% 16/04/2019	2.251.116	0,13
3.600.000	ALLIED IRISH BANKS PLC VAR PERPETUAL	3.941.910	0,23
2.000.000	BANK OF IRELAND GROUP PLC VAR PERPETUAL	2.143.740	0,13
14.028.000	BANK OF IRELAND GROUP PLC VAR 11/06/2024	14.415.453	0,86
5.000.000	BANK OF IRELAND GROUP PLC VAR 19/09/2027	4.044.816	0,24
1.481.000	BANK OF IRELAND 1,25% 09/04/2020	1.512.953	0,09
5.000.000	CLOVERIE PLC VAR 24/07/2039	5.361.450	0,32
6.354.000	FCA BANK S.P.A IRISH BRANCH FRN 17/06/2021	6.278.864	0,37
1.000.000	FCA BANK S.P.A IRISH BRANCH 4,00% 17/10/2018	1.011.450	0,06
4.300.000	FCA CAPITAL IRELAND PLC 1,00% 15/11/2021	4.312.191	0,26
5.000.000	JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC 0% 04/12/2020	4.988.350	0,30
	Italien	*90.438.514*	*5,38*
1.750.000	AMPLIFON SPA 4,875% 16/07/2018	1.751.908	0,10
4.000.000	ASSICURAZIONI GENERALI SPA VAR PERPETUAL	4.666.410	0,28
4.800.000	ASSICURAZIONI GENERALI SPA VAR PERPETUAL	4.812.000	0,29
1.000.000	ASSICURAZIONI GENERALI SPA 2,875% 14/01/2020	1.040.420	0,06
6.313.000	AZIMUT HOLDING SPA 2,00% 28/03/2022	6.313.284	0,38
1.350.000	BANCA IMI SPA VAR 30/08/2019	1.401.287	0,08
687.000	ENEL - ENTE NAZIONALE PER L'ENERGIA ELETTRICA VAR 24/11/2078	645.993	0,04
3.000.000	INTESA SANPAOLO SPA FRN 15/06/2020	2.999.595	0,18
7.976.000	INTESA SANPAOLO SPA VAR 19/04/2022	7.811.256	0,46
1.760.000	INTESA SANPAOLO SPA 0,875% 27/06/2022	1.727.396	0,10
3.000.000	INTESA SANPAOLO SPA 5,00% 23/09/2019	3.124.170	0,19
4.000.000	LEONARDO SPA 5,25% 21/01/2022	4.515.380	0,27
11.600.000	MEDIOBANCA BANCA DI CREDITO FINANZIARIO S P A FRN 18/05/2022	11.246.606	0,66
6.100.000	MEDIOBANCA BANCA DI CREDITO FINANZIARIO S P A VAR 01/07/2019	6.082.219	0,36
3.350.000	MEDIOBANCA BANCA DI CREDITO FINANZIARIO S P A 0,75% 17/02/2020	3.352.948	0,20
5.000.000	PIRELLI C SPA FRN 26/09/2020	4.962.500	0,30
8.000.000	UNICREDIT SPA FRN 03/05/2025	7.846.560	0,47
7.908.000	UNICREDIT SPA FRN 19/02/2020	7.920.454	0,46
2.969.000	WIND TRE S P A VAR 20/01/2024	2.465.873	0,15
4.545.000	WIND TRE S P A 2,625% 20/01/2023	3.812.119	0,23
2.400.000	WIND TRE S P A 3,125% 20/01/2025	1.940.136	0,12
	Jersey	*20.447.914*	*1,22*
1.576.000	ASTON MARTIN CAPITAL HOLDINGS LIMITED 6,50% 15/04/2022	1.380.652	0,08
4.667.000	ASTON MARTIN CAPITAL 5,75% 15/04/2022	5.453.532	0,32
5.500.000	ATRIUM EUROPEAN REAL ESTATE LIMITED 3,625% 17/10/2022	5.971.625	0,37
5.218.000	ATRIUM EUROPEAN REAL ESTATE LIMITED 4,00% 20/04/2020	5.551.848	0,33
1.840.000	CPUK FINANCE LTD 4,25% 28/08/2022	2.090.257	0,12
	Luxemburg	*90.451.585*	*5,38*
7.750.000	ALLERGAN FUNDING SCS FRN 01/06/2019	7.759.416	0,46
5.500.000	ALLERGAN FUNDING SCS 0,50% 01/06/2021	5.506.765	0,33
5.577.000	ARCELORMITTAL SA 0,95% 17/01/2023	5.486.987	0,33
9.950.000	BEVCO LUX SARL 1,75% 09/02/2023	9.926.817	0,59
2.800.000	CNH INDUSTRIAL FINANCE EUROPE S A 1,375% 23/05/2022	2.827.902	0,17
6.500.000	CORESTATE CAPITAL HOLDINGS SA 3,50% 15/04/2023	6.408.090	0,38
6.738.000	CPI PROPERTY GROUP S.A. VAR PERPETUAL	6.318.223	0,38
2.000.000	GARFUNKELUX HOLDCO 3 SA 7,50% 01/08/2022	1.945.300	0,12
8.000.000	GELF BOND ISSUER I SA 1,75% 22/11/2021	8.335.520	0,50
1.440.000	GESTAMP FUNDING LUXEMBOURG SA 3,50% 15/05/2023	1.462.939	0,09
3.000.000	GRAND CITY PROPERTIES S A VAR PERPETUAL	3.062.340	0,18
3.000.000	HARMAN FINANCE INTERNATIONAL SCA 2,00% 27/05/2022	3.166.680	0,19
1.850.000	HEIDELBERGCEMENT FIN 7,50% 03/04/2020	2.089.686	0,12
1.929.000	LSF 10 WOLVERINE INVESTMENTS SCA 5,00% 15/03/2024	1.915.671	0,11
6.545.000	MORGAN STANLEY FRN 03/12/2019	6.554.621	0,39
10.524.000	MORGAN STANLEY FRN 08/11/2022	10.545.521	0,62
3.000.000	SES S.A. VAR PERPETUAL	3.089.670	0,18
3.103.000	TAKKO LUXEMBOURG 2 SCA VAR 15/11/2023	2.879.212	0,17
1.298.000	TAKKO LUXEMBOURG 2 SCA 5,375% 15/11/2023	1.170.225	0,07

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses

Wertpapierbestand zum 30.06.2018

Anzahl		Marktwert	% des NIW
		EUR	
	Niederlande	*300.708.180*	*17,88*
2.000.000	ABN AMRO BANK NV VAR PERPETUAL	2.120.650	0,13
7.000.000	ABN AMRO BANK NV VAR 30/06/2025	7.289.415	0,43
1.750.000	ABN AMRO BANK NV 6,375% 27/04/2021	2.028.819	0,12
6.000.000	ABN AMRO BANK NV 7,125% 06/07/2022	7.408.320	0,44
700.000	AKZO NOBEL NV VAR 08/11/2019	702.013	0,04
5.000.000	ATF NETHERLANDS BV VAR PERPETUAL	5.044.400	0,30
7.200.000	BAYER CAPITAL CORPORATION BV FRN 26/06/2022	7.232.076	0,43
3.211.000	BMW FINANCE NV FRN 15/07/2019	3.229.062	0,19
2.000.000	COOPERATIEVE RABOBANK UA VAR PERPETUAL	2.246.720	0,13
2.000.000	COOPERATIEVE RABOBANK UA VAR 26/05/2026	2.085.410	0,12
11.350.000	DEUTSCHE TELEKOM INTERNATIONAL FINANCE BV FRN 01/12/2022	11.316.233	0,67
2.705.000	DUFRY ONE BONDS 2,50% 15/10/2024	2.682.900	0,16
24.091.000	FE NEW NV 0,25% 16/01/2021	23.902.366	1,43
4.973.000	FERROVIAL NETHERLANDS BV VAR PERPETUAL	4.483.259	0,27
9.744.000	HEMA BONDCO I B.V. VAR 15/07/2022	9.338.650	0,56
5.000.000	IBERDROLA INTERNATIONAL BV VAR PERPETUAL	4.787.325	0,28
1.596.000	ING BANK NV VAR 21/11/2023	1.616.916	0,10
3.500.000	ING GROUP NV 0,75% 09/03/2022	3.527.230	0,21
9.980.000	INNOGY FINANCE BV 0,75% 30/11/2022	10.102.154	0,60
8.100.000	JAB HOLDINGS BV 1,50% 24/11/2021	8.412.458	0,50
6.000.000	KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV VAR 19/03/2021	6.006.240	0,36
1.267.000	KONINKLIJKE KPN NV VAR PERPETUAL	1.281.000	0,08
6.000.000	KONINKLIJKE KPN NV VAR 14/03/2073	7.191.282	0,43
3.500.000	LEASEPLAN CORPORATION NV FRN 25/01/2021	3.512.005	0,21
12.000.000	LEASEPLAN CORPORATION NV 0,75% 03/10/2022	11.938.200	0,71
11.000.000	LEASEPLAN CORPORATION NV 1,00% 02/05/2023	10.952.810	0,65
10.013.000	MYLAN NV FRN 22/11/2018	10.038.633	0,60
8.762.000	MYLAN NV VAR 24/05/2020	8.779.874	0,52
8.244.000	NE PROPERTY COOPERATIEF U.A. 3,75% 26/02/2021	8.715.887	0,52
19.559.000	NIBC BANK NV 1,125% 19/04/2023	19.585.697	1,17
4.850.000	NN GROUP NV 0,25% 01/06/2020	4.873.620	0,29
3.000.000	OCI N V 5,00% 15/04/2023	3.058.800	0,18
6.500.000	REPSOL INTERNATIONAL FINANCE BV FRN 06/07/2018	6.500.650	0,39
7.408.000	RWE FINANCE BV 1,875% 30/01/2020	7.622.795	0,45
3.000.000	TELEFONICA EUROPE BV VAR PERPETUAL	3.151.950	0,19
300.000	TELEFONICA EUROPE BV VAR PERPETUAL	309.210	0,02
8.000.000	TELEFONICA EUROPE BV VAR PERPETUAL	7.475.840	0,44
2.210.000	TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE NETHERLANDS II BV 3,25% 15/04/2022	2.245.913	0,13
1.600.000	UNITED GROUP B V VAR 01/07/2023	1.594.944	0,09
1.000.000	UNITED GROUP B V 4,375% 01/07/2022	1.018.520	0,06
1.400.000	VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV FRN 15/04/2019	1.403.745	0,08
4.050.000	VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV VAR PERP	4.073.328	0,24
12.000.000	VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV VAR PERP	12.407.940	0,74
8.900.000	VONOVIA FINANCE B.V FRN 20/11/2019	8.921.494	0,53
15.000.000	VONOVIA FINANCE B.V FRN 22/12/2022	14.944.500	0,89
5.000.000	VONOVIA FINANCE B.V VAR PERPETUAL	5.282.550	0,31
3.800.000	VONOVIA FINANCE B.V 0,75% 25/01/2022	3.843.035	0,23
1.800.000	VONOVIA FINANCE B.V 3,125% 25/07/2019	1.861.254	0,11
2.500.000	VONOVIA FINANCE B.V 4,625% 08/04/2074	2.560.088	0,15
	Norwegen	*4.197.261*	*0,25*
4.271.000	DNB BANK ASA VAR 20/03/2028	4.197.261	0,25
	Polen	*5.781.653*	*0,34*
5.751.000	PKO BANK POLSKI SA 0,75% 25/07/2021	5.781.653	0,34
	Spanien	*137.243.562*	*8,16*
5.200.000	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA FRN 09/03/2023	5.109.754	0,30
4.100.000	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA FRN 12/04/2022	4.111.542	0,24
2.000.000	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA VAR PERPETUAL	2.050.360	0,12
3.600.000	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA VAR PERPETUAL	4.041.072	0,24
5.800.000	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA 0,75% 11/09/2022	5.719.235	0,34
2.800.000	BANCO SABADELL SA VAR PERPETUAL	2.763.348	0,16
5.000.000	BANCO SABADELL SA 0,875% 05/03/2023	4.935.150	0,29
6.300.000	BANCO SANTANDER SA FRN 04/03/2020	6.336.131	0,38
4.000.000	BANCO SANTANDER SA VAR PERPETUAL	4.074.240	0,24
20.000.000	BANKIA S.A. VAR 22/05/2024	20.425.600	1,22
2.000.000	BANKINTER SA VAR PERPETUAL	2.262.080	0,13
6.700.000	BBVA SUBORDINATED CAPITAL SA VAR 11/04/2024	6.840.030	0,41
16.800.000	CAIXABANK S.A VAR 14/11/2023	17.070.312	1,03
7.000.000	CAIXABANK S.A 0,75% 18/04/2023	6.882.855	0,41
5.700.000	CAIXABANK S.A 1,125% 12/01/2023	5.614.500	0,33
6.486.000	FCC AQUALIA SA 1,413% 08/06/2022	6.611.795	0,39
1.926.000	GROUPO ANTOLIN IRAUSA 3,25% 30/04/2024	1.855.740	0,11
4.300.000	IMMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA 1,863% 05/06/2019	4.367.424	0,26
1.817.000	MASARIA INVESTMENTS SAU VAR 15/09/2024	1.715.720	0,10
1.000.000	MASARIA INVESTMENTS SAU 5,00% 15/09/2024	938.900	0,06
3.000.000	METROVACESA SA 2,375% 23/05/2022	3.173.610	0,19
4.868.000	NORTEGAS ENERGIA DISTRIBUTION SAU 0,918% 28/09/2022	4.887.083	0,29
9.500.000	PROSEGUR CASH SA 1,00% 08/02/2023	9.450.457	0,56
4.200.000	SANTANDER CONUMER FINANCE S.A FRN 23/12/2018	4.200.945	0,25
1.800.000	SANTANDER CONUMER FINANCE S.A 0,50% 04/10/2021	1.805.679	0,11
	Schweden	*36.570.712*	*2,17*
8.333.000	AKELIUS RESIDENTIAL PROPERTY VAR 05/10/2078	8.119.174	0,48
3.100.000	AKELIUS RESIDENTIAL PROPERTY 1,50% 23/01/2022	3.171.920	0,19
3.700.000	AKELIUS RESIDENTIAL PROPERTY 3,375% 23/09/2020	3.954.005	0,24
6.400.000	FASTIGHTS BALDER AB VAR 07/03/2078	6.118.208	0,36
3.000.000	FASTIGHTS BALDER AB 1,125% 14/03/2022	3.030.795	0,18
2.030.000	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN FRN 26/05/2020	2.047.235	0,12
1.528.000	SVENSKA HANDELSBANKEN AB VAR 15/01/2024	1.548.101	0,09
4.342.000	SWEDBANK AB VAR 26/02/2024	4.404.764	0,26

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses

Wertpapierbestand zum 30.06.2018

Anzahl		Marktwert	% des NIW
		EUR	
3.976.000	VOLVO TREASURY AB VAR 10/06/2075	4.176.510	0,25
	Schweiz	*10.912.290*	*0,65*
10.896.000	UBS GROUP AG FRN 20/09/2022	10.912.290	0,65
	Vereinigtes Königreich	*144.056.218*	*8,57*
2.000.000	BARCLAYS BANK PLC VAR PERPETUAL	2.214.600	0,13
13.550.000	BARCLAYS BANK PLC VAR 11/11/2025	13.817.815	0,83
80.000	BARCLAYS BANK PLC VAR PERP	100.144	0,01
3.000.000	BARCLAYS PLC VAR 07/02/2028	2.872.695	0,17
10.100.000	CREDIT AGRICOLE S A LONDON BRANCH FRN 06/03/2023	10.002.434	0,59
10.369.000	FCE BANK PLC FRN 26/08/2020	10.400.885	0,62
783.000	FCE BANK PLC 0,869% 13/09/2021	790.078	0,05
2.132.000	FCE BANK PLC 1,114% 13/05/2020	2.171.932	0,13
10.000.000	HSBC HOLDINGS PLC FRN 05/10/2023	9.941.100	0,59
7.822.000	HSBC HOLDINGS PLC FRN 27/09/2022	7.858.646	0,47
1.415.000	INTERNATIONAL GAME TECHNOLOGY PLC 4,125% 15/02/2020	1.474.770	0,09
8.299.000	LLYODS BANKING GRP PLC VAR 15/01/2024	8.093.102	0,48
2.500.000	MATALAN FINANCE PLC 6,75% 31/01/2023	2.582.433	0,15
4.500.000	NATIONAL EXPRESS GROUP PLC FRN 15/05/2020	4.495.545	0,27
1.850.000	NATIONWIDE BUILDING SOCIETY FRN 02/11/2018	1.852.951	0,11
7.000.000	NATIONWIDE BUILDING SOCIETY VAR 08/03/2024	5.876.361	0,35
1.000.000	NATIONWIDE BUILDING SOCIETY 6,75% 22/07/2020	1.130.755	0,07
4.898.000	NATWEST MARKETS PLC FRN 08/06/2020	4.899.127	0,29
3.000.000	NATWEST MARKETS PLC VAR 25/03/2024	3.058.020	0,18
8.500.000	NATWEST MARKETS PLC 0,625% 02/03/2022	8.423.330	0,50
6.560.000	NGG FINANCE PLC VAR 18/06/2076	6.958.094	0,41
1.849.000	NMG FINCO PLC 5,75% 01/08/2022	1.572.129	0,09
4.000.000	RBS GROUP PLC FRN 15/05/2023	3.449.411	0,21
25.000.000	RSA INSURANCE GROUP PLC VAR PERPETUAL	2.519.459	0,15
6.269.000	SANTANDER UK GROUP HOLDINGS PLC FRN 18/05/2023	6.247.999	0,37
8.400.000	SANTANDER UK GROUP HOLDINGS PLC FRN 27/03/2024	8.354.640	0,50
1.066.000	TESCO COROPORATE TREASURY SERVICES PLC 1,375% 01/07/2019	1.078.771	0,06
760.000	TESCO COROPORATE TREASURY SERVICES PLC 2,125% 12/11/2020	789.655	0,05
2.500.000	THOMAS COOK FINANCE 3,875% 15/07/2023	2.513.175	0,15
2.000.000	TITAN GLOBAL FINANCE PLC 3,50% 17/06/2021	2.075.320	0,12
1.120.000	VIRGIN MEDIA SECURED FINANCE PLC 5,50% 15/01/2025	1.158.570	0,07
5.300.000	WPP FINANCE 2013 FRN 20/03/2022	5.282.272	0,31
	Vereinigte Staaten von Amerika	*169.090.680*	*10,06*
1.928.000	ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP 4,50% 15/03/2022	1.975.496	0,12
2.750.000	AMGEN INC 4,375% 05/12/2018	2.804.216	0,17
4.100.000	AUTOLIV INC 0,75% 26/06/2023	4.095.777	0,24
8.104.000	BANK OF AMERICA CORP FRN 04/05/2023	8.132.364	0,48
10.100.000	BANK OF AMERICA CORP FRN 07/02/2022	10.172.821	0,61
2.125.000	BANK OF AMERICA CORP FRN 26/07/2019	2.134.286	0,13
1.850.000	BANK OF AMERICA CORP 1.875% 10/01/2019	1.870.147	0,11
8.000.000	BAT CAPITAL CORP FRN 16/08/2021	7.999.640	0,48
2.778.000	BAT CAPITAL CORP 2,764% 15/08/2022	2.286.428	0,14
7.911.000	BECTON DICKINSON & CO 0,368% 06/06/2019	7.936.829	0,47
16.445.000	CITIGROUP INC FRN 21/03/2023	16.400.106	0,98
7.500.000	COTY INC 4,00% 15/04/2023	7.405.950	0,44
5.000.000	CVS HEALTH CORP FRN 09/03/2020	4.299.216	0,26
2.182.000	CVS HEALTH CORP 3,70% 09/03/2023	1.857.256	0,11
5.000.000	ENTERPRISE PRODUCTS OPERATING LLC VAR 16/08/2077	4.046.572	0,24
6.250.000	FORD MOTOR CREDIT CO LLC FRN 01/12/2021	6.206.031	0,37
12.350.000	GENERAL MOTORS FINANCIAL CO FRN 10/05/2021	12.418.235	0,74
10.836.000	GOLDMAN SACHS GROUP INC. FRN 09/09/2022	10.827.548	0,64
14.000.000	GOLDMAN SACHS GROUP INC. FRN 26/09/2023	13.835.150	0,82
2.520.000	GOLDMAN SACHS GROUP INC. FRN 29/04/2019	2.530.370	0,15
3.061.000	GOLDMAN SACHS GROUP INC. FRN 29/05/2020	3.082.993	0,18
6.039.000	KENNEDY WILSON HOLDINGS INC 3,95% 30/06/2022	7.131.872	0,42
3.000.000	KINDER MORGAN INC 1,50% 16/03/2022	3.095.265	0,18
762.000	MERRILL LYNCH AND CO FRN 14/09/2018	762.354	0,05
2.000.000	MOHAWAK 2,00% 14/01/2022	2.105.690	0,13
4.247.000	MORGAN STANLEY FRN 19/11/2019	4.278.024	0,25
5.201.000	MPT OPERATING PARTNERSHIP LP / MPT FINANCE CORP 4,00% 19/08/2022	5.686.695	0,34
2.700.000	WELLS FARGO & CO FRN 02/06/2020	2.708.289	0,16
11.000.000	WELLS FARGO & CO VAR 31/01/2022	11.005.060	0,65
Derivative Instrumente		**1.166.028**	**0,07**
	Optionen	**1.166.028**	**0,07**
	Luxemburg	*1.166.028*	*0,07*
100.000.000	PUT CDX OPTION - ITRAXX EUROPE CROSSOVER SERIES 29 INDEX – 312,50 - 18.07.18	1.081.802	0,06
100.000.000	PUT CDX OPTION - ITRAXX EUROPE CROSSOVER SERIES 29 INDEX – 400,00 - 18.07.18	84.226	0,01
Short-Positionen		**-876.658**	**-0,05**
Derivative Instrumente		**-876.658**	**-0,05**
	Optionen	**-876.658**	**-0,05**
	Luxemburg	*-876.658*	*-0,05*
-100.000.000	PUT CDX OPTION - ITRAXX EUROPE CROSSOVER SERIES 29 INDEX – 337,50 - 18.07.18	-516.395	-0,03
-100.000.000	PUT CDX OPTION - ITRAXX EUROPE CROSSOVER SERIES 29 INDEX – 350,00 - 18.07.18	-360.263	-0,02
Gesamt-Wertpapierbestand		**1.567.298.524**	**93,21**

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses

Wertpapierbestand zum 30.06.2018

Anzahl		Marktwert	% des NIW
		EUR	
Long-Positionen		**29.077.675**	**88,02**
Zur amtlichen Notierung an einer Wertpapierbörse zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte, übertragbare Wertpapiere		**26.072.937**	**78,92**
	Anleihen	**26.072.937**	**78,92**
	Australien	*1.027.030*	*3,11*
1.000.000	ORIGIN ENERGY FINANCE LTD VAR 16/09/2074	1.027.030	3,11
	Österreich	*1.542.851*	*4,67*
1.247.000	ERSTE GROUP BANK AG 7,125% 10/10/2022	1.542.851	4,67
	Frankreich	*7.705.400*	*23,32*
1.100.000	ACCOR SA VAR PERPETUAL	1.147.674	3,47
1.339.000	BPCE SA VAR PERPETUAL	1.532.204	4,64
1.517.000	CREDIT AGRICOLE SA VAR PERP	1.358.680	4,11
2.100.000	ELECTRICITE DE FRANCE SA VAR PERPETUAL	2.184.042	6,61
1.350.000	SOCIETE GENERALE SA VAR PERPETUAL	1.482.800	4,49
	Deutschland	*3.377.683*	*10,22*
572.000	COMMERZBANK AG 6,375% 22/03/2019	596.630	1,81
2.400.000	RWE AG VAR PERPETUAL	2.781.053	8,41
	Irland	*1.017.308*	*3,08*
950.000	CLOVERIE PLC VAR 24/07/2039	1.017.308	3,08
	Italien	*3.898.012*	*11,80*
2.000.000	INTESA SANPAOLO SPA VAR PERPETUAL	2.121.900	6,42
1.600.000	UNICREDIT SPA VAR PERP	1.776.112	5,38
	Mexiko	*1.091.890*	*3,31*
1.085.000	AMERICA MOVIL SAB DE CV VAR 06/09/2073	1.091.890	3,31
	Niederlande	*3.600.512*	*10,90*
975.000	ABN AMRO BANK NV 6,375% 27/04/2021	1.129.177	3,42
900.000	COOPERATIEVE RABOBANK UA 6,875% 19/03/2020	996.678	3,02
1.467.000	VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV VAR PERP	1.474.657	4,46
	Vereinigtes Königreich	*1.587.030*	*4,80*
1.500.000	NGG FINANCE PLC VAR 18/06/2076	1.587.030	4,80
	Vereinigte Staaten von Amerika	*1.225.221*	*3,71*
1.300.000	UBS AG STAMFORD 7,625% 17/08/2022	1.225.221	3,71
Anteile/Aktien von OGAW/OGA		**3.004.738**	**9,10**
	Aktien/Anteile an Investmentfonds	**3.004.738**	**9,10**
	Frankreich	*3.004.738*	*9,10*
3	AMUNDI 3 M FCP IC	3.004.738	9,10
Gesamt-Wertpapierbestand		**29.077.675**	**88,02**

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses

Wertpapierbestand zum 30.06.2018

Anzahl		Marktwert	% des NIW
		EUR	
Long-Positionen		**269.095.248**	**96,12**
Zur amtlichen Notierung an einer Wertpapierbörse zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte, übertragbare Wertpapiere		**269.095.248**	**96,12**
	Anteile	**636.637**	**0,23**
	Kanada	*636.637*	*0,23*
50.926	FRONTERA ENERGY CORPORATION	636.637	0,23
	Anleihen	**268.458.611**	**95,89**
	Argentinien	*21.836.696*	*7,80*
1.357.000	ARGENTINA 5,375% 20/01/2023	1.289.204	0,46
3.907.000	ARGENTINA 5,75% 15/06/2019	3.303.658	1,18
2.375.000	ARGENTINA 6,25% 22/04/2019	2.047.498	0,73
3.500.000	BANCO HIPOTECARIO SA 9,75% 30/11/2020	3.112.993	1,11
1.040.000	CIA LATINOAMER INFRAESTRUCTURA 9,50% 20/07/2023	712.603	0,25
2.500.000	COMPANIA LATINOAMERICANA DE INFRAESTRUCTURA & SERVICIOS SA CLISA 11,50% 15/10/2019	2.177.401	0,78
2.400.000	EMPRESA DISTRIBUIDORA Y COMERC 9,75% 25/10/2022	2.128.683	0,76
1.820.000	GENNEIA SA 8,75% 20/01/2022	1.509.171	0,54
6.692.000	PROVINCIA DE BUENOS AIRES VAR 01/05/2020	4.352.479	1,56
1.385.000	YPF SOCIEDAD ANONIMA 8,50% 23/03/2021	1.203.006	0,43
	Bermuda	*8.168.879*	*2,92*
10.000.000	DIGICEL LIMITED 6,00% 15/04/2021	7.779.624	2,78
500.000	GCX LTD 7,00% 01/08/2019	389.255	0,14
	Brasilien	*16.250.608*	*5,80*
9.000.000	BANCO A BC BRASIL SA 7,875% 08/04/2020	8.019.717	2,86
1.000.000	BANCO BMG SA 9,95% 05/11/2019	863.363	0,31
4.000.000	BANCO VOTORANTIM 7,375% 21/01/2020	3.548.867	1,27
210.000	BRF SA 2,75% 03/06/2022	200.842	0,07
4.100.000	CHINA CONSTRUCTION BANK 8,50% 27/04/2020	3.617.819	1,29
	Cayman Islands	*12.855.847*	*4,59*
1.000.000	BANCO BTG PACTUAL LUX 4,00% 16/01/2020	830.902	0,30
950.000	BANTRAB SENIOR TRUST 9,00% 14/11/2020	827.714	0,30
2.100.000	CHIAN EVERGRANDE GROUP 7,00% 23/03/2020	1.776.227	0,62
1.371.000	CHINA AOYUAN PROPERTY GROUP 6,525% 25/04/2019	1.174.418	0,42
1.200.000	CHINA SHANSHUI 7,50% 10/03/2020	818.380	0,29
2.000.000	COMCEL TRUST 6,875% 06/02/2024	1.757.886	0,63
1.500.000	EZDAN SUKUK CO LTD 4,375% 18/05/2021	1.025.378	0,37
3.600.000	SABLE INTERNATIONAL FINANCE 6,875% 01/08/2022	3.207.333	1,14
1.042.000	YANKUANG GROUP CAYMAN LTD 4,75% 30/11/2020	855.108	0,31
700.000	YUZHOU PROPERITIES CO LTD 6,375% 06/03/2021	582.501	0,21
	Chile	*2.122.669*	*0,76*
2.000.000	AES GENER SA VAR 18/12/2073	1.756.961	0,63
450.000	NOVA AUSTRAL SA 8,25% 26/05/2021	365.708	0,13
	Zypern	*1.532.477*	*0,55*
4.150.000	MRIYA AGRO HOLDING COMPANY 0% 19/04/2018 DEFAULTED	291.749	0,10
2.200.000	O1 PROPERTIES FINANCE 8,25% 27/09/2021	1.240.728	0,45
	Ägypten	*4.761.030*	*1,70*
5.500.000	AFRICAN EXPORT IMPORT BANK AFREXIMBANK 4,75% 29/07/2019	4.761.030	1,70
	Frankreich	*3.697.199*	*1,32*
2.000.000	CMA CGM 6,50% 15/07/2022	1.855.920	0,66
1.000.000	CMA CGM 7,75% 15/01/2021	982.600	0,35
850.000	NOVAFIVES SAS 4,50% 30/06/2021	858.679	0,31
	Deutschland	*1.892.708*	*0,68*
285.000	ADLER REAL ESTATE AG 4,75% 08/04/2020	293.513	0,10
2.000.000	ESAL GMBH ELEKTROSCHALTANLAGEN 6,25% 05/02/2023	1.599.195	0,58
	Griechenland	*8.315.525*	*2,97*
3.500.000	GREECE 4,375% 01/08/2022	3.684.170	1,32
4.500.000	GREECE 4,75% 17/04/2019	4.631.355	1,65
	Hongkong (China)	*4.088.624*	*1,46*
3.200.000	CHINA CITIC BANK INTERNATIONAL LTD VAR 07/05/2024	2.779.948	0,99
1.500.000	CITIC BANK INTERNATIONAL LTD VAR PERP	1.308.676	0,47
	Indien	*4.257.377*	*1,52*
5.000.000	JSW STEEL LTD 4,75% 12/11/2019	4.257.377	1,52
	Irland	*5.728.762*	*2,05*
5.500.000	ALFA BOND ISSUANCE PLC 7,50% 26/09/2019	4.837.155	1,73
1.298.000	CREDIT BANK OF MOSCOW FINANCE VAR PERPETUAL	891.607	0,32
	Italien	*329.262*	*0,12*
311.000	SCHUMANN SPA 7,00% 31/07/2023	307.312	0,11
1.000.000	WASTE ITALIA SPA 0% 15/11/2019 DEFAULTED	21.950	0,01
	Jersey	*2.842.828*	*1,02*
2.000.000	POLYUS GOLD INTERNATIONAL LTD 5,625% 29/04/2020	1.728.851	0,62
1.300.000	WEST CHINA CEMENT 6,50% 11/09/2019	1.113.977	0,40
	Kasachstan	*5.024.669*	*1,79*
755.000	DEVELOPMENT BANK OF KAZAHKASTAN JSC 6,50% 03/06/2020	672.940	0,24
4.300.000	KAZAKHSTAN 3,255% 22/05/2019	4.351.729	1,55
	Kenia	*1.080.193*	*0,39*
1.265.000	EASTERN AND SOUTHERN 5,375% 14/03/2022	1.080.193	0,39
	Luxemburg	*18.411.556*	*6,58*
7.700.000	ALTICE FINCO S.A 8,125% 15/01/2024	6.576.212	2,36
1.000.000	GRAND CITY PROPERTIES S A VAR PERPETUAL	1.020.780	0,36

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses

Wertpapierbestand zum 30.06.2018

Anzahl		Marktwert	% des NIW
		EUR	
2.057.000	INTRALOT CAPITAL LUXEMBOURG SA 6,75% 15/09/2021	1.916.486	0,68
7.500.000	MINERVA LUXEMBOURG SA VAR PERPETUAL	6.488.652	2,33
600.000	OFFSHORE DRILLING HOLDINGS 8,375% 20/09/2020	259.569	0,09
633.000	QGOG CONSTELLATION SA 6,25% 09/11/2019	142.317	0,05
1.829.000	TOPAZ MARINE SA 9,125% 26/07/2022	1.578.402	0,56
500.000	TUPY SA 6,625% 17/07/2024	429.138	0,15
	Mexiko	*4.715.832*	*1,68*
3.000.000	CONTROLADORA MABE SA DE CV 7,875% 28/10/2019	2.672.622	0,95
1.800.000	GRUPO KALTEX SA DE CV 8,875% 11/04/2022	1.194.039	0,43
1.000.000	GRUPO POSADAS SAB DE CV 7,875% 30/06/2022	849.171	0,30
	Niederlande	*39.873.822*	*14,23*
5.000.000	ALTICE NV 7,25% 15/05/2022	5.021.850	1,79
1.000.000	CONSTELLIUM N.V 4,625% 15/05/2021	1.006.080	0,36
630.000	EBN BV VAR 14/08/2021	534.196	0,19
6.500.000	FBN CAPITAL FINANCE COMPANY VAR 07/08/2020	5.497.623	1,96
5.400.000	HELIOS TOWERS FINANCE NETHERLANDS 8,375% 15/07/2019	4.604.912	1,64
974.000	HEMA BONDCO I B.V. VAR 15/07/2022	933.482	0,33
200.000	HEMA BONDCO II BV 8,50% 15/01/2023	189.196	0,07
1.000.000	IHS NETHERLANDS HOLDCO BV 9,50% 27/10/2021	823.674	0,29
10.400.000	MARFRIG HOLDING EUROPE BV 6,875% 24/06/2019	9.031.444	3,23
4.000.000	MARFRIG HOLDING EUROPE BV 8,00% 08/06/2023	3.462.807	1,24
2.000.000	NORTHERN LIGHTS III BV 7,00% 16/08/2019	537.054	0,19
480.000	UNITED GROUP B V VAR 01/07/2023	478.483	0,17
1.000.000	VIMPELCOM HOLDINGS BV 5,20% 13/02/2019	859.338	0,31
8.000.000	VTR FINANCE BV 6,875% 15/01/2024	6.893.683	2,46
	Nigeria	*15.063.086*	*5,38*
5.550.000	ACCESS BANK NIGERIA VAR 24/06/2021	4.644.165	1,66
1.447.000	AFRICA FINANCE CORPORATION 4,375% 29/04/2020	1.242.136	0,44
3.000.000	UNITED BANK FOR AFRICA PLC 7,75% 08/06/2022	2.489.649	0,89
7.800.000	ZENITH BANK PLC 6,25% 22/04/2019	6.687.136	2,39
	Oman	*3.243.110*	*1,16*
3.698.000	NATIONAL BANK OF OMAN LIMITED SAOG VAR PERPETUAL	3.243.110	1,16
	Pakistan	*5.072.828*	*1,81*
6.000.000	PAKISTAN 7,25% 15/04/2019	5.072.828	1,81
	Panama	*5.179.770*	*1,85*
6.000.000	GLOBAL BANK CORPORATION 5,125% 30/10/2019	5.179.770	1,85
	Paraguay	*9.067.700*	*3,24*
7.300.000	BANCO REGIONAL SAECA 8,125% 24/01/2019	6.356.199	2,27
3.100.000	TELEFONICA CELULAR DEL PARAGUAY 6,75% 13/12/2022	2.711.501	0,97
	Russland	*1.287.556*	*0,46*
1.286.000	ABH FINANCIAL 2,626% 28/04/2020	1.287.556	0,46
	Singapur	*2.634.851*	*0,94*
3.400.000	ALAM SYNERGY PTE LTD 6,95% 27/03/2020	2.634.851	0,94
	Südafrika	*1.281.543*	*0,46*
1.500.000	FIRSTRAND BANK LTD 4,25% 30/04/2020	1.281.543	0,46
	Spanien	*2.044.360*	*0,73*
2.000.000	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA VAR PERPETUAL	2.044.360	0,73
	Sri Lanka	*1.711.036*	*0,61*
2.000.000	SRI LANKA 5,125% 11/04/2019	1.711.036	0,61
	Türkei	*28.223.175*	*10,08*
5.000.000	FINANSBANK AS 6,25% 30/04/2019	4.281.016	1,53
2.850.000	MERSIN ULUSLARARASI LIMANI ISLETMECILIGI A.S. 5,875% 12/08/2020	2.438.788	0,87
6.500.000	TURKIYE GARANIT BANKSAI 4,75% 17/10/2019	5.510.260	1,97
10.000.000	TURKIYE SINAI KALKINA BANKASI AS 5,375% 30/10/2019	8.374.887	2,99
4.000.000	TURKIYE VAKIFLAR BANKASI TAO 3,50% 17/06/2019	3.979.720	1,42
4.500.000	YAPI VE KREDIT BANKASI AS 4,00% 22/01/2020	3.638.504	1,30
	Ukraine	*1.708.706*	*0,61*
2.000.000	UKRAINE 7,75% 01/09/2019	1.708.706	0,61
	Vereinigte Arabische Emirate	*612.580*	*0,22*
700.000	EMIRATES NBD BANK PJSC VAR PERP	612.580	0,22
	Vereinigtes Königreich	*9.932.199*	*3,55*
2.000.000	BIZ FINANCE PLC 9,625% 27/04/2022	1.721.057	0,61
2.000.000	BOPARAN FINANCE PLC 5,25% 15/07/2019	2.190.174	0,78
2.000.000	HELLENIC PETROLEUM FINANCE PLC 5,25% 04/07/2019	2.040.300	0,73
2.500.000	ICBC STANDARD BANK PLC 8,125% 02/12/2019	2.250.310	0,81
2.000.000	SHORTLINE PLC 9,875% 15/09/2021	1.730.358	0,62
	Vereinigte Staaten von Amerika	*12.981.631*	*4,64*
3.500.000	CENTRAIS ELECTRICAS BRASILEIRAS S.A 6,875% 30/07/2019	3.065.329	1,09
1.000.000	NATIONSTAR HOME EQUITY LOAN TRUST 7,875% 01/10/2020	870.412	0,31
2.800.000	SUNAC CHINA HOLDINGS LTD 6,875% 08/08/2020	2.332.258	0,83
3.000.000	TURKIYE IS BANKASI A.S 5% 30/04/2020	2.467.475	0,88
5.000.000	TURKIYE IS BANKASI A.S 5,5% 21/04/2019	4.246.157	1,53
	Sambia	*627.917*	*0,22*
750.000	ZAMBIA 7,00% 14/03/2019	627.917	0,22
Gesamt-Wertpapierbestand		**269.095.248**	**96,12**

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses

Wertpapierbestand zum 30.06.2018

Anzahl		Marktwert	% des NIW
		EUR	
Long-Positionen		**720.167.317**	**98,63**
Zur amtlichen Notierung an einer Wertpapierbörse zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte, übertragbare Wertpapiere		**720.167.317**	**98,63**
	Anleihen	**720.167.317**	**98,63**
	Österreich	*18.617.880*	*2,55*
15.630.000	AUSTRIA 0,25% 18/10/2019	15.800.133	2,16
2.580.000	AUSTRIA 3,90% 15/07/2020	2.817.747	0,39
	Belgien	*27.849.585*	*3,81*
9.700.000	BELGIUM 0,80% 22/06/2028	9.805.827	1,34
16.450.000	BELGIUM 3,75% 28/09/2020	18.043.758	2,47
	Finnland	*14.781.432*	*2,02*
13.790.000	FINLAND 3,375% 15/04/2020	14.781.432	2,02
	Frankreich	*200.853.408*	*27,51*
41.210.000	FRANCE OAT 0% 25/02/2021	41.733.573	5,72
157.380.000	FRANCE OAT 0% 25/05/2020	159.119.835	21,79
	Deutschland	*111.195.802*	*15,23*
60.230.000	GERMANY BUND 0% 17/04/2020	60.988.597	8,35
37.500.000	GERMANY BUND 0,25% 11/10/2019	37.955.625	5,20
12.000.000	GERMANY BUND 0,25% 16/10/2020	12.251.580	1,68
	Irland	*13.137.414*	*1,80*
11.650.000	IRELAND 5,00% 18/10/2020	13.137.414	1,80
	Italien	*175.717.761*	*24,07*
60.110.000	ITALY BTP 0,45% 01/06/2021	59.150.043	8,10
31.290.000	ITALY BTP 1,50% 01/08/2019	31.685.662	4,34
80.150.000	ITALY BTP 4.,5% 01/03/2020	84.882.056	11,63
	Niederlande	*27.270.107*	*3,73*
16.460.000	NETHERLANDS 3,50% 15/07/2020	17.872.680	2,44
8.960.000	NETHERLANDS 4,00% 15/07/2019	9.397.427	1,29
	Portugal	*17.895.956*	*2,45*
7.600.000	PORTUGAL 3,85% 15/04/2021	8.404.194	1,15
1.020.000	PORTUGAL 4,75% 14/06/2019	1.068.991	0,15
7.680.000	PORTUGAL 4,80% 15/06/2020	8.422.771	1,15
	Spanien	*112.847.972*	*15,46*
44.720.000	SPAIN 4,30% 31/10/2019	47.516.342	6,51
58.500.000	SPAIN 4,85% 31/10/2020	65.331.630	8,95
Gesamt-Wertpapierbestand		**720.167.317**	**98,63**

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses

Wertpapierbestand zum 30.06.2018

Anzahl		Marktwert	% des NIW
		EUR	
Long-Positionen		**250.370.873**	**99,05**
Zur amtlichen Notierung an einer Wertpapierbörse zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte, übertragbare Wertpapiere		**250.370.873**	**99,05**
	Anleihen	**250.370.873**	**99,05**
	Österreich	*10.768.156*	*4,26*
5.480.000	AUSTRIA 0% 20/09/2022	5.554.336	2,20
4.614.000	AUSTRIA 3,50% 15/09/2021	5.213.820	2,06
	Belgien	*16.439.388*	*6,50*
3.400.000	BELGIUM 0,80% 22/06/2028	3.437.094	1,36
11.150.000	BELGIUM 4,00% 28/03/2022	13.002.294	5,14
	Finnland	*3.690.650*	*1,46*
1.240.000	FINLAND 1,50% 15/04/2023	1.341.872	0,53
2.150.000	FINLAND 1,625% 15/09/2022	2.326.526	0,92
20.000	FINLAND 3,50% 15/04/2021	22.252	0,01
	Frankreich	*58.010.872*	*22,95*
11.270.000	FRANCE OAT 0% 25/03/2023	11.361.625	4,49
41.320.000	FRANCE OAT 3,00% 25/04/2022	46.649.247	18,46
	Deutschland	*40.484.782*	*16,02*
29.200.000	GERMANY BUND 1,50% 15/02/2023	31.741.276	12,56
8.030.000	GERMANY BUND 2,00% 04/01/2022	8.743.506	3,46
	Irland	*5.258.706*	*2,08*
5.060.000	IRELAND 0,80% 15/03/2022	5.258.706	2,08
	Italien	*67.043.308*	*26,53*
30.710.000	ITALY BTP 5,00% 01/03/2022	34.613.394	13,70
27.990.000	ITALY BTP 5,50% 01/11/2022	32.429.914	12,83
	Niederlande	*16.785.728*	*6,64*
7.770.000	NETHERLANDS 2,25% 15/07/2022	8.611.374	3,41
7.320.000	NETHERLANDS 3,25% 15/07/2021	8.174.354	3,23
	Portugal	*2.686.200*	*1,06*
2.490.000	PORTUGAL 2,20% 17/10/2022	2.686.200	1,06
	Spanien	*29.203.083*	*11,55*
9.870.000	SPAIN 0,45% 31/10/2022	9.977.583	3,95
18.750.000	SPAIN 0,75% 30/07/2021	19.225.500	7,60
Gesamt-Wertpapierbestand		**250.370.873**	**99,05**

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses

Wertpapierbestand zum 30.06.2018

Anzahl		Marktwert	% des NIW
		EUR	
Long-Positionen		**11.316.454**	**99,13**
Zur amtlichen Notierung an einer Wertpapierbörse zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte, übertragbare Wertpapiere		**11.316.454**	**99,13**
	Anleihen	**11.316.454**	**99,13**
	Österreich	*385.322*	*3,38*
350.000	AUSTRIA 1,65% 21/10/2024	385.322	3,38
	Belgien	*668.571*	*5,86*
270.000	BELGIUM 0,50% 22/10/2024	276.214	2,42
350.000	BELGIUM 2,25% 22/06/2023	392.357	3,44
	Finnland	*145.340*	*1,27*
130.000	FINLAND 2,00% 15/04/2024	145.340	1,27
	Frankreich	*2.510.401*	*21,99*
150.000	FRANCE OAT 1,75% 25/05/2023	164.171	1,44
2.070.000	FRANCE OAT 2,25% 25/05/2024	2.346.230	20,55
	Deutschland	*1.347.671*	*11,81*
1.260.000	GERMANY BUND 1,00% 15/08/2024	1.347.671	11,81
	Irland	*380.179*	*3,33*
270.000	IRELAND 3,40% 18/03/2024	320.717	2,81
50.000	IRELAND 3,90% 20/03/2023	59.462	0,52
	Italien	*2.976.029*	*26,07*
2.350.000	ITALY BTP 3,75% 01/09/2024	2.565.764	22,48
350.000	ITALY BTP 5,00% 01/03/2025	410.265	3,59
	Niederlande	*645.339*	*5,65*
390.000	NETHERLANDS 0% 15/01/2024	392.180	3,43
230.000	NETHERLANDS 1,75% 15/07/2023	253.159	2,22
	Portugal	*380.273*	*3,33*
300.000	PORTUGAL 5,65% 15/02/2024	380.273	3,33
	Spanien	*1.877.329*	*16,44*
1.470.000	SPAIN 4,80% 31/01/2024	1.815.627	15,90
50.000	SPAIN 5,40% 31/01/2023	61.702	0,54
Gesamt-Wertpapierbestand		**11.316.454**	**99,13**

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses

Wertpapierbestand zum 30.06.2018

Anzahl		Marktwert	% des NIW
		EUR	
Long-Positionen		**165.680.936**	**99,21**
Zur amtlichen Notierung an einer Wertpapierbörse zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte, übertragbare Wertpapiere		**159.495.650**	**95,51**
	Anleihen	**159.495.650**	**95,51**
	Österreich	*9.995.034*	*5,99*
3.090.000	AUSTRIA 1,20% 20/10/2025	3.307.320	1,98
4.400.000	AUSTRIA 6,25% 15/07/2027	6.687.714	4,01
	Belgien	*15.485.180*	*9,27*
7.430.000	BELGIUM 0,80% 22/06/2025	7.724.377	4,62
5.420.000	BELGIUM 0,80% 22/06/2027	5.536.801	3,32
2.200.000	BELGIUM 0,80% 22/06/2028	2.224.002	1,33
	Finnland	*3.375.059*	*2,02*
3.220.000	FINLAND 0,875% 15/09/2025	3.375.059	2,02
	Frankreich	*43.263.502*	*25,91*
26.500.000	FRANCE OAT 0,25% 25/11/2026	26.199.225	15,69
7.730.000	FRANCE OAT 0,50% 25/05/2026	7.843.051	4,70
8.330.000	FRANCE OAT 1,75% 25/11/2024	9.221.226	5,52
	Deutschland	*13.983.355*	*8,37*
3.630.000	BUNDESLANDER BUNDESREP.DEUTSCH 0% 15/08/2026	3.594.716	2,15
1.210.000	GERMANY BUND 0,50% 15/02/2026	1.251.322	0,75
8.520.000	GERMANY BUND 1,00% 15/08/2025	9.137.317	5,47
	Irland	*2.813.942*	*1,69*
2.710.000	IRELAND 1,00% 15/05/2026	2.813.942	1,69
	Italien	*26.619.790*	*15,94*
13.500.000	ITALY BTP 1,25% 01/12/2026	12.338.528	7,39
12.430.000	ITALY BTP 4,50% 01/03/2026	14.281.262	8,55
	Niederlande	*10.116.717*	*6,06*
6.490.000	NETHERLANDS 0,25% 15/07/2025	6.562.980	3,93
3.430.000	NETHERLANDS 0,75% 15/07/2027	3.553.737	2,13
	Portugal	*5.234.155*	*3,13*
4.700.000	PORTUGAL 2,875% 15/10/2025	5.234.155	3,13
	Spanien	*28.608.916*	*17,13*
1.850.000	SPAIN 1,40% 30/04/2028	1.863.773	1,12
6.150.000	SPAIN 1,50% 30/04/2027	6.311.253	3,78
7.730.000	SPAIN 1,95% 30/04/2026	8.278.444	4,96
9.620.000	SPAIN 4,65% 30/07/2025	12.155.446	7,27
Anteile/Aktien von OGAW/OGA		**6.185.286**	**3,70**
	Aktien/Anteile an Investmentfonds	**6.185.286**	**3,70**
	Frankreich	*6.185.286*	*3,70*
330	AMUNDI TRESO COURT TERME PART I C	6.185.286	3,70
Gesamt-Wertpapierbestand		**165.680.936**	**99,21**

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses

Wertpapierbestand zum 30.06.2018

Anzahl		Marktwert	% des NIW
		EUR	
Long-Positionen		**108.407.278**	**97,22**
Zur amtlichen Notierung an einer Wertpapierbörse zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte, übertragbare Wertpapiere		**108.407.278**	**97,22**
	Anleihen	**108.407.278**	**97,22**
	Österreich	*3.886.418*	*3,49*
910.000	AUSTRIA 3,80% 26/01/2062	1.574.323	1,41
1.520.000	AUSTRIA 4,15% 15/03/2037	2.312.095	2,08
	Belgien	*10.946.176*	*9,82*
1.500.000	BELGIUM 0,80% 22/06/2028	1.516.365	1,36
2.240.000	BELGIUM 3,75% 22/06/2045	3.342.394	3,00
3.840.000	BELGIUM 5,00% 28/03/2035	6.087.417	5,46
	Finnland	*1.240.839*	*1,11*
470.000	FINLAND 0,75% 15/04/2031	468.494	0,42
580.000	FINLAND 2,625% 04/07/2042	772.345	0,69
	Frankreich	*29.363.495*	*26,33*
3.510.000	FRANCE OAT 4,00% 25/04/2055	5.817.544	5,22
9.320.000	FRANCE OAT 4,00% 25/10/2038	14.040.999	12,59
5.740.000	FRANCE OAT 5,75% 25/10/2032	9.504.952	8,52
	Deutschland	*9.655.226*	*8,66*
900.000	GERMANY BUND 1,25% 15/08/2048	954.257	0,86
3.550.000	GERMANY BUND 4,00% 04/01/2037	5.557.436	4,98
1.890.000	GERMANY BUND 6,25% 04/01/2030	3.143.533	2,82
	Irland	*2.077.422*	*1,86*
560.000	IRELAND 2,00% 18/02/2045	608.432	0,55
1.270.000	IRELAND 2,40% 15/05/2030	1.468.990	1,31
	Italien	*25.585.587*	*22,95*
3.800.000	ITALY BTP 2,95% 01/09/2038	3.669.679	3,29
8.970.000	ITALY BTP 4,75% 01/09/2028	10.520.241	9,44
7.430.000	ITALY BTP 4,75% 01/09/2044	9.111.929	8,17
1.730.000	ITALY BTP 5,75% 01/02/2033	2.283.738	2,05
	Niederlande	*6.148.628*	*5,51*
1.890.000	NETHERLANDS 2,50% 15/01/2033	2.363.010	2,12
860.000	NETHERLANDS 2,75% 15/01/2047	1.233.606	1,11
1.640.000	NETHERLANDS 4,00% 15/01/2037	2.552.012	2,28
	Portugal	*2.093.378*	*1,88*
870.000	PORTUGAL 3,875% 15/02/2030	1.035.183	0,93
860.000	PORTUGAL 4,10% 15/04/2037	1.058.195	0,95
	Spanien	*17.410.109*	*15,61*
2.860.000	SPAIN 4,20% 31/01/2037	3.833.558	3,44
5.050.000	SPAIN 5,15% 31/10/2028	6.876.459	6,16
4.340.000	SPAIN 5,15% 31/10/2044	6.700.092	6,01
Gesamt-Wertpapierbestand		**108.407.278**	**97,22**

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses

Wertpapierbestand zum 30.06.2018

Anzahl		Marktwert	% des NIW
		EUR	
Long-Positionen		**46.676.344**	**95,10**
Zur amtlichen Notierung an einer Wertpapierbörse zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte, übertragbare Wertpapiere		**46.676.344**	**95,10**
	Anleihen	**46.676.344**	**95,10**
	Argentinien	*3.884.027*	*7,91*
583.000	ARGENTINA 3,875% 15/01/2022	557.983	1,14
500.000	ARGENTINA 5,375% 20/01/2023	475.020	0,97
400.000	ARGENTINA 9,95% 09/06/2021	354.215	0,72
300.000	BANCO HIPOTECARIO SA 9,75% 30/11/2020	266.828	0,54
208.000	BANCO MARCO SA 6,75% 04/11/2026	166.815	0,34
320.000	CIA LATINOAMER INFRAESTRUCTURA 9,50% 20/07/2023	219.263	0,45
500.000	EMPRESA DISTRIBUIDORA Y COMERC 9,75% 25/10/2022	443.476	0,90
300.000	GENNEIA SA 8,75% 20/01/2022	248.765	0,51
400.000	PETROBAS ARGENTINA 7,375% 21/07/2023	326.496	0,67
950.000	YPF SOCIEDAD ANONIMA 8,50% 23/03/2021	825.166	1,67
	Österreich	*165.134*	*0,34*
200.000	JBS INVESTMENTS GMBH 7,25% 03/04/2024	165.134	0,34
	Bermuda	*538.033*	*1,10*
400.000	DIGICEL GROUP LIMITED 7,125% 01/04/2022	226.848	0,46
400.000	DIGICEL LIMITED 6,00% 15/04/2021	311.185	0,64
	Brasilien	*953.099*	*1,94*
325.000	BANCO A BC BRASIL SA 7,875% 08/04/2020	289.602	0,58
132.000	BRF SA 2,75% 03/06/2022	126.243	0,26
300.000	CHINA CONSTRUCTION BANK 8,50% 27/04/2020	264.718	0,54
338.000	LIGHT SERVICES DE ELECTRICIDADE SA 7,25% 03/05/2023	272.536	0,56
	Britische Jungferninseln	*187.729*	*0,38*
229.000	CHALCO HONG KONG INVESTMENT COMPANY INC VAR PERPETUAL	187.729	0,38
	Bulgarien	*107.888*	*0,22*
100.000	BULGARIAN ENERGY HOLDING 4,875% 02/08/2021	107.888	0,22
	Kanada	*170.021*	*0,35*
200.000	FRONTERA ENERGY CORPORATION 9,70% 25/06/2023	170.021	0,35
	Cayman Islands	*5.839.841*	*11,90*
500.000	ABQ FINANCE 3,50% 22/02/2022	410.248	0,84
400.000	BANCO BRADESCO SA 5,90% 16/01/2021	350.049	0,71
200.000	BANCO BTG PACTUAL LUX 5,50% 31/01/2023	159.269	0,32
300.000	BANCO DO BRASIL SA GRAND CAYMAN BRANCH 5,875% 26/01/2022	256.157	0,52
500.000	BRASKEM FINANCE 5,75% 15/04/2021	441.921	0,90
250.000	CHIAN EVERGRANDE GROUP 6,25% 28/06/2021	200.719	0,41
200.000	CHINA SCE PROPERTY HOLDINGS LTD 5,875% 10/03/2022	154.188	0,31
700.000	EZDAN SUKUK CO LTD 4,375% 18/05/2021	478.510	0,97
1.100.000	GRUPO AVAL LTD 4,75% 26/09/2022	933.382	1,91
336.000	INDUSTRIAL SENIOR TRUST 5,50% 01/11/2022	283.946	0,58
700.000	ITAU UNIBANCO HLDG SA KY 6,20% 21/12/2021	617.173	1,26
225.000	MIZZEN BONDCO 7,00% 01/05/2021	244.749	0,50
650.000	SABLE INTERNATIONAL FINANCE 6,875% 01/08/2022	579.102	1,18
200.000	SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LIMITED 8,375% 10/02/2022	180.184	0,37
417.000	YANKUANG GROUP CAYMAN LTD 4,75% 30/11/2020	342.208	0,70
250.000	YUZHOU PROPERITIES CO LTD 6,375% 06/03/2021	208.036	0,42
	Chile	*394.587*	*0,80*
97.000	AES GENER 5,25% 15/08/2021	85.709	0,17
215.000	EMPRESA NACLONAL DEL PETROLEO SA ENAP 4,75% 06/12/2021	186.975	0,38
150.000	NOVA AUSTRAL SA 8,25% 26/05/2021	121.903	0,25
	Kolumbien	*891.516*	*1,82*
1.000.000	BANCO DAVIVIENDA SA 5,875% 09/07/2022	891.516	1,82
	Costa Rica	*519.878*	*1,06*
600.000	BANCO NACIONAL DE COSTA RICA 5,875% 25/04/2021	519.878	1,06
	Zypern	*169.190*	*0,34*
300.000	O1 PROPERTIES FINANCE 8,25% 27/09/2021	169.190	0,34
	Frankreich	*936.493*	*1,91*
225.000	LOXAM 4,875% 23/07/2021	166.393	0,34
750.000	SFR GROUP SA 5,375% 15/05/2022	770.100	1,57
	Griechenland	*631.572*	*1,29*
600.000	GREECE 4,375% 01/08/2022	631.572	1,29
	Indien	*255.443*	*0,52*
300.000	JSW STEEL LTD 4,75% 12/11/2019	255.443	0,52
	Irland	*3.232.990*	*6,59*
200.000	ALFA BOND ISSUANCE PLC VAR PERPETUAL	168.030	0,34
200.000	BONITRON DESIGNATED ACTICITY COMPANY 8,75% 30/10/2022	169.762	0,35
209.000	CREDIT BANK OF MOSCOW FINANCE VAR PERPETUAL	143.564	0,29
300.000	DME AIRPORT LIMITED 5,875% 11/11/2021	259.860	0,53
500.000	GTLK EUROPE LTD 5,95% 19/07/2021	428.890	0,87
700.000	MMC FINANCE DAC 6,625% 14/10/2022	634.572	1,30
650.000	ROSNEFT INT FINANCE 4,199% 06/03/2022	542.035	1,10
268.000	RUSAL CAPITAL DESIGNATED ACTICITY COMPANY 5,125% 02/02/2022	95.259	0,19
900.000	VEB FINANCE PLC 6,025% 05/07/2022	791.018	1,62
	Italien	*197.628*	*0,40*
200.000	SCHUMANN SPA 7,00% 31/07/2023	197.628	0,40
	Jersey	*165.225*	*0,34*
200.000	POLYUS GOLD INTERNATIONAL LTD 4,699% 28/03/2022	165.225	0,34

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses

Wertpapierbestand zum 30.06.2018

Anzahl		Marktwert	% des NIW
		EUR	
	Kasachstan	*1.115.468*	*2,27*
500.000	DEVELOPMENT BANK OF KAZAHKASTAN JSC 4,125% 10/12/2022	418.539	0,85
300.000	DEVELOPMENT BANK OF KAZAHKASTAN JSC 6,50% 03/06/2020	267.393	0,54
500.000	EURASIAN DEVELOPMENT BANK 4,767% 20/09/2022	429.536	0,88
	Kenia	*1.024.689*	*2,09*
1.200.000	EASTERN AND SOUTHERN 5,375% 14/03/2022	1.024.689	2,09
	Luxemburg	*3.141.854*	*6,40*
700.000	ALTICE FINCO S.A 7,625% 15/02/2025	537.750	1,10
200.000	CABOT FINANCIAL (LUXEMBOURG) SA VAR 15/11/2021	202.044	0,41
200.000	CABOT FINANCIAL (LUXEMBOURG) SA 6,50% 01/04/2021	227.170	0,46
211.000	CPI PROPERTY GROUP S.A. VAR PERPETUAL	197.855	0,40
150.000	GARFUNKELUX HOLDCO 3 SA 7,50% 01/08/2022	145.898	0,30
150.000	GARFUNKELUX HOLDCO 3 SA 8,50% 01/11/2022	164.550	0,34
300.000	GAZ CAPITAL SA 6,51% 07/03/2022	272.255	0,55
199.000	INTRALOT CAPITAL LUXEMBOURG SA 6,75% 15/09/2021	185.406	0,38
350.000	ONEX WIZARD 7,75% 15/02/2023	362.096	0,74
350.000	PUMA INTL FINANCING 5,125% 06/10/2024	277.245	0,56
375.000	STEEL CAP 5,90% 17/10/2022	333.127	0,68
274.000	TOPAZ MARINE SA 9,125% 26/07/2022	236.458	0,48
	Malaysia	*158.678*	*0,32*
200.000	PRESS METAL LABUAN LTD 4,80% 30/10/2022	158.678	0,32
	Mauritius	*1.014.041*	*2,07*
1.200.000	MTN MAURITIUS INVESTMENTS 5,373% 13/02/2022	1.014.041	2,07
	Mexiko	*1.125.138*	*2,29*
250.000	FINANCIERA INDEPENDENCIA SAM DE CV SOFOM ENR 8,00% 19/07/2024	174.614	0,36
400.000	GRUPO KALTEX SA DE CV 8,875% 11/04/2022	265.342	0,54
300.000	GRUPO POSADAS SAB DE CV 7,875% 30/06/2022	254.751	0,52
500.000	PETROLEOS MEXICANOS PEMEX 4,875% 24/01/2022	430.431	0,87
	Namibia	*344.359*	*0,70*
400,000	NAMIBIA 5,50% 03/11/2021	344.359	0,70
	Niederlande	*2.586.605*	*5,27*
450.000	ALTICE NV 7,25% 15/05/2022	451.966	0,91
250.000	AT SECURITIES BV VAR PERPETUAL	195.713	0,40
250.000	FBN CAPITAL FINANCE COMPANY VAR 07/08/2020	211.447	0,43
195.000	HEMA BONDCO I B.V. VAR 15/07/2022	186.888	0,38
200.000	IHS NETHERLANDS HOLDCO BV 9,50% 27/10/2021	164.735	0,34
200.000	JABABEKA INTERNATIONAL B.V. 6,50% 05/10/2023	145.042	0,30
500.000	MARFRIG HOLDING EUROPE BV 8,00% 08/06/2023	432.851	0,88
200.000	NOSTRUM OIL&GAS FIN BV 8,00% 25/07/2022	162.614	0,33
450.000	PETROBRAS GLOBAL FINANCE BV 6,125% 17/01/2022	391.023	0,80
263.000	PETROBRAS GLOBAL FINANCE BV 8,375% 23/05/2021	244.326	0,50
	Nigeria	*1.176.117*	*2,40*
600.000	ACCESS BANK NIGERIA 10,50% 19/10/2021	533.538	1,09
569.000	UNITED BANK FOR AFRICA PLC 7,75% 08/06/2022	472.203	0,96
200.000	ZENITH BANK PLC 7,375% 30/05/2022	170.376	0,35
	Oman	*801.361*	*1,63*
225.000	BANK MUSCAT SAOG 3,75% 03/05/2021	187.468	0,38
700.000	NATIONAL BANK OF OMAN LIMITED SAOG VAR PERPETUAL	613.893	1,25
	Panama	*1.129.631*	*2,30*
927.000	GLOBAL BANK CORP 4,50% 20/10/2021	771.612	1,57
429.000	MULTIBANK INC 4,375% 09/11/2022	358.019	0,73
	Peru	*164.899*	*0,34*
200.000	SAN MIGUEL INDUSTRIAS PET SA 4,50% 18/09/2022	164.899	0,34
	Russland	*1.054.590*	*2,15*
300.000	EUROCHEM MINERAL & CHEMICAL COMPANY 3,80% 12/04/2020	253.798	0,52
250.000	KOKS OAO 7,50% 04/05/2022	213.261	0,43
700.000	SEVERSTAL 3,85% 27/08/2021	587.531	1,20
	Südafrika	*1.656.446*	*3,37*
400.000	ESKOM HOLDINGS SOC LIMITED 5,75% 26/01/2021	330.617	0,67
200.000	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD 5,872% 02/05/2023	173.527	0,35
200.000	SOUTH AFRICA 5,875% 30/05/2022	179.208	0,37
1.200.000	TRANSNET LTD 4,00% 26/07/2022	973.094	1,98
	Türkei	*3.557.691*	*7,25*
300.000	AKBANK TAS VAR 16/03/2027	231.857	0,47
200.000	FINANSBANK AS 4,875% 19/05/2022	159.618	0,33
200.000	RONESANS GAYIRMENKUL YATIRIM A S 7,25% 26.04.2023	160.337	0,33
450.000	TC ZIRAAT BANKASI AS 4,75% 29/04/2021	360.474	0,73
1.100.000	TURKIYE GARANIT BANKSAI 6,25% 20/04/2021	937.293	1,91
700.000	TURKIYE SINAI KALKINA BANKASI AS VAR 29/03/2027	518.170	1,06
240.000	TURKIYE VAKIFLAR BANKASI T A O 5,50% 27/10/2021	189.669	0,39
400.000	TURKIYE VAKIFLAR BANKASI T A O 6,00% 01/11/2022	295.223	0,60
500.000	YAPI VE KREDIT BANKASI AS 5,50% 06/12/2022	370.305	0,75
400.000	YAPI VE KREDIT BANKASI AS 8,50% 09/03/2026	334.745	0,68
	Ukraine	*631.932*	*1,29*
750.000	UKRAINE 7,75% 01/09/2021	631.932	1,29
	Vereinigte Arabische Emirate	*262.534*	*0,53*
300.000	EMIRATES NBD BANK PJSC VAR PERP	262.534	0,53
	Vereinigtes Königreich	*1.413.663*	*2,88*
300.000	BIZ FINANCE PLC 9,625% 27/04/2022	258.159	0,53

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses

Wertpapierbestand zum 30.06.2018

Anzahl		Marktwert	% des NIW
		EUR	
150.000	BOPARAN FINANCE PLC 5,50% 15/07/2021	146.638	0,30
200.000	LIQUID TELECOMMUNICATIONS FINANCING PLC 8,50% 13/07/2022	170.615	0,35
500.000	SHORTLINE PLC 9,875% 15/09/2021	432.590	0,87
500.000	VEDANTA RESOURCE PLC 6,375% 30/07/2022	405.661	0,83
	Vereinigte Staaten von Amerika	*5.076.354*	*10,34*
1.000.000	BBVA BANCOMER SA TEXAS AGENCY 6,50% 10/03/2021	893.530	1,82
650.000	CEMEX FINANCE LLC 6,00% 01/04/2024	563.680	1,15
500.000	CENTRAIS ELECTRICAS BRASILEIRAS S.A 5,75% 27/10/2021	418.038	0,85
400.000	FRONTIER COMMUNICATIONS CORPORATION 10,50% 15/09/2022	309.194	0,63
300.000	HCA HEALTHCAR INC 6,25% 15/02/2021	266.568	0,54
350.000	HEXION U S FINANCE CORP / HEXION NOVA SCOTIA FINANCE ULC 6,625% 15/04/2020	280.288	0,57
300.000	NATIONSTAR HOME EQUITY LOAN TRUST 7,875% 01/10/2020	261.124	0,53
400.000	NATIONSTAR MTG LLC/CAP CORP. 6,50% 01/07/2021	341.659	0,70
70.000	REVLON CONSUMER PRODUCTS VAR 15/02/2021	44.553	0,09
350.000	STILLWATER MINING CO 6,125% 27/06/2022	266.303	0,54
200.000	SUNAC CHINA HOLDINGS LTD 7,95% 08/08/2022	161.019	0,33
1.200.000	TWITTER 5,00% 25/06/2021	952.652	1,94
400.000	TWITTER 5,375% 06/10/2021	317.746	0,65
Gesamt-Wertpapierbestand		**46.676.344**	**95,10**

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses

Wertpapierbestand zum 30.06.2018

Anzahl		Marktwert	% des NIW
		EUR	
Long-Positionen		**228.276.093**	**99,67**
Zur amtlichen Notierung an einer Wertpapierbörse zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte, übertragbare Wertpapiere		**221.371.738**	**96,66**
	Anteile	**221.307.090**	**96,63**
	Australien	*111.841*	*0,05*
2.740	SOUTH32 LTD	6.260	0,00
45.860	SOUTH32 LTD GBP	105.581	0,05
	Österreich	*629.927*	*0,28*
1.643	ERSTE GROUP BANK	58.737	0,03
1.873	OMV AG	90.972	0,04
9.881	RAIFFEISEN INTL BANK HOLDING	259.771	0,11
5.588	VOESTALPINE AG	220.447	0,10
	Belgien	*3.829.336*	*1,67*
1.618	AGEAS NV	69.914	0,03
18.949	ANHEUSER BUSCH INBEV SA/NV	1.639.089	0,72
12.859	BPOST SA	173.982	0,08
1.506	COLRUYT	73.598	0,03
21.085	KBC GROUPE	1.394.140	0,61
2.559	PROXIMUS	49.414	0,02
2.821	SOLVAY	305.091	0,13
1.843	UCB SA	124.108	0,05
	Tschechische Republik	*236.653*	*0,10*
6.581	KOMERCNI BANKA AS	236.653	0,10
	Dänemark	*6.373.450*	*2,78*
220	A.P. MOELLER-MAERSK B	234.684	0,10
2.665	CARLSBERG B	268.836	0,12
11.408	COLOPLAST B	976.556	0,43
27.630	DANSKE BANK A/S	740.748	0,32
1.566	H. LUNDBECK	94.245	0,04
2.164	ISS	63.694	0,03
62.559	NOVO NORDISK	2.485.332	1,09
9.558	ORSTED SH	495.173	0,22
4.019	PANDORA AB	240.470	0,10
5.324	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	282.253	0,12
14.259	WILLIAM DEMANT HOLDING	491.459	0,21
	Finnland	*4.200.930*	*1,83*
1.905	ELISA OYJ	75.571	0,03
11.684	FORTUM OYJ	238.821	0,10
11.723	KONE B	511.826	0,22
2.609	NESTE CORPORATION	175.325	0,08
191.897	NOKIA OYJ	946.053	0,41
1.433	SAMPO A	59.899	0,03
56.248	STORA ENSO OYJ-R	942.716	0,41
38.937	UPM KYMMENE OYJ	1.192.252	0,52
3.474	WARTSILA OYJ	58.467	0,03
	Frankreich	*34.900.440*	*15,24*
6.895	AIR LIQUIDE	742.592	0,32
674	ARKEMA	68.344	0,03
4.613	ATOS SE	539.490	0,24
87.636	AXA	1.841.671	0,80
768	BIC	60.979	0,03
954	BIOMERIEUX SA	73.553	0,03
60.326	BNP PARIBAS	3.208.739	1,40
15.022	BOUYGUES	554.462	0,24
2.414	CAP GEMINI SE	278.093	0,12
2.531	CASINO GUICHARD	84.156	0,04
1.815	CHRISTIAN DIOR SE	650.133	0,28
24.102	COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN SA	922.384	0,40
4.812	COVIVIO SA REITS	428.749	0,19
4.706	CREDIT AGRICOLE SA	53.813	0,02
7.510	DANONE	472.154	0,21
97.221	ENGIE SA	1.276.512	0,56
2.786	ESSILOR INTERNATIONAL	336.827	0,15
3.907	EUTELSAT COMMUNICATIONS	69.408	0,03
801	ICADE REIT	64.320	0,03
826	IMERYS SA	57.201	0,02
2.312	KERING	1.118.083	0,49
37.539	KLEPIERRE REITS	1.210.633	0,53
2.705	LAGARDERE	61.160	0,03
1.070	LEGRAND	67.303	0,03
2.615	L'OREAL SA	553.073	0,24
7.540	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	2.150.408	0,94
83.619	NATIXIS	508.236	0,22
63.165	ORANGE	906.102	0,40
3.064	PERNOD RICARD	428.654	0,19
4.583	PUBLICIS GROUPE	270.122	0,12
18.079	RENAULT SA	1.316.694	0,57
19.593	SAFRAN	2.038.652	0,89
34.857	SANOFI	2.392.932	1,04
24.307	SCHNEIDER ELECTRIC SA	1.736.006	0,76
36.729	SOCIETE GENERALE A	1.326.468	0,58
660	SODEXO	56.509	0,02
2.269	THALES SA	250.384	0,11
74.294	TOTAL	3.878.889	1,70
5.130	UNIBAIL RODAMCO SE REITS	967.262	0,42
22.818	VINCI SA	1.879.290	0,82
	Deutschland	*32.553.446*	*14,21*
16.615	ALLIANZ SE-NOM	2.941.187	1,28
937	AXEL SPRINGER	58.047	0,03
41.088	BASF SE	3.365.518	1,47
23.823	BAYER AG	2.247.700	0,98
3.270	BAYERISCHE MOTORENWERKE	253.850	0,11
1.294	BRENNTAG AG	61.750	0,03
19.784	CECONOMY AG	141.218	0,06
11.297	COVESTRO AG	863.317	0,38
24.146	DAIMLER	1.331.169	0,58
30.379	DEUTSCHE BANK AG-NOM	280.155	0,12
3.815	DEUTSCHE BOERSE AG	435.482	0,19
21.655	DEUTSCHE LUFTHANSA NOM	446.093	0,19
54.896	DEUTSCHE POST AG-NOM	1.535.441	0,67
41.531	DEUTSCHE TELEKOM AG-NOM	551.116	0,24

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses

Wertpapierbestand zum 30.06.2018

Anzahl		Marktwert	% des NIW
		EUR	
14.780	EVONIK INDUSTRIES AG	433.497	0,19
4.351	FREENET	98.724	0,04
8.245	FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	712.203	0,31
8.167	FRESENIUS SE & CO KGAA	561.890	0,25
1.100	HANNOVER RUECK SE	117.480	0,05
8.998	HEIDELBERGCEMENT AG	648.576	0,28
6.885	HENKEL KGAA VZ PFD	753.908	0,33
24.100	INFINEON TECHNOLOGIES AG-NOM	526.103	0,23
2.133	INNOGY SE	78.260	0,03
4.409	LINDE AG	788.550	0,34
698	MAN AG	67.671	0,03
805	MERCK KGAA	67.314	0,03
3.794	METRO AG	40.159	0,02
4.242	MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS AG-NOM	768.014	0,34
983	OSRAM LICHT	34.405	0,02
14.787	PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	806.779	0,35
192	PUMA AG	96.192	0,04
34.296	SAP SE	3.393.589	1,48
29.139	SIEMENS AG-NOM	3.299.118	1,44
3.108	TUI	58.384	0,03
52.015	TUI GBP	977.836	0,43
27.774	UNIPER SE	709.348	0,31
6.046	UNITED INTERNET AG & CO KGAA	296.617	0,13
6.500	VOLKSWAGEN AG	919.750	0,40
9.538	VOLKSWAGEN AG-PFD	1.356.494	0,59
3.121	WIRECARD	430.542	0,19
	Irland	*2.143.418*	*0,94*
19.937	AIB GROUP PLC	92.707	0,04
23.127	DALATA HOTEL	161.426	0,07
7.978	KERRY GROUP A	714.829	0,32
5.083	PADDY POWER BETFAIR PLC	482.885	0,21
19.930	SMURFIT KAPPA	691.571	0,30
	Italien	*6.782.743*	*2,96*
75.367	ASSICURAZIONI GENERALI	1.083.024	0,47
30.280	ATLANTIA SPA	766.690	0,33
585.793	ENEL SPA	2.786.617	1,22
4.889	ENI SPA	77.764	0,03
7.126	FINECOBANK	68.923	0,03
3.080	GEDI GRUPPO EDITORIALE SPA	1.006	0,00
367.975	INTESA SANPAOLO RNC	955.999	0,42
7.629	LEONARDO AZIONE POST RAGGRUPPAMENTO	64.587	0,03
6.726	MEDIOBANCA SPA	53.552	0,02
18.296	POSTE ITALIANE SPA	131.182	0,06
7.407	PRYSMIAN SPA	157.991	0,07
18.137	SNAM RETE GAS	64.858	0,03
14.660	TERNA SPA	67.905	0,03
30.795	UNICREDIT SPA	440.245	0,19
32.972	UNIPOLSAI AZ	62.400	0,03
	Jersey	*2.909.725*	*1,27*
3.827	EXPERIAN PLC	81.118	0,04
8.213	FERGUSON PLC	571.153	0,25
25.485	PETROFAC LIMITED	168.411	0,07
23.827	SHIRE	1.149.118	0,50
69.675	WPP PLC	939.925	0,41
	Luxemburg	*1.828.679*	*0,80*
21.324	ARCELORMITTAL SA	535.445	0,23
1.980	MILLICOM INTL CELLULAR SDR	100.281	0,04
12.040	RTL GROUP	699.524	0,31
7.080	RTL GROUP	412.764	0,18
5.133	TENARIS SA	80.665	0,04
	Niederlande	*15.940.851*	*6,96*
2.666	ABN AMRO GROUP N.V.	59.239	0,03
20.658	AEGON NV	106.099	0,05
16.773	AIRBUS BR BEARER SHS	1.681.661	0,73
1.705	AKZO NOBEL NV-CVA	125.011	0,05
10.632	ASML HOLDING N.V.	1.804.250	0,79
8.347	ASR NEDERLAND N.V	291.978	0,13
8.294	EXOR HOLDINGS N.V	478.564	0,21
44.812	FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	731.959	0,32
102.498	ING GROUP NV	1.263.595	0,55
50.708	KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE	1.039.768	0,45
1.661	KONINKLIJKE DSM NV	143.045	0,06
27.605	KONINKLIJKE PHILIPS N.V.	1.005.512	0,44
1.827	NN GROUP NV	63.653	0,03
9.311	NXP SEMICONDUCTOR	876.592	0,38
6.804	RANDSTAD HOLDING NV	343.058	0,15
43.545	RELX NV	795.349	0,35
25.203	STMICROELECTRONICS NV	481.629	0,21
91.158	UNILEVER CVA	4.355.986	1,90
6.090	WOLTERS KLUWER CVA	293.903	0,13
	Norwegen	*2.124.548*	*0,93*
4.118	DNB NOR ASA	68.936	0,03
3.686	EQUINOR ASA	83.822	0,04
26.397	MARINE HARVEST	449.936	0,20
107.592	NORSK HYDRO ASA	551.641	0,24
7.524	ORKLA ASA	56.454	0,02
34.380	TELENOR	603.890	0,26
8.724	YARA INTERNATIONAL ASA	309.869	0,14
	Portugal	*304.976*	*0,13*
56.147	EDP - ENERGIAS DE PORTUGAL	190.900	0,08
9.222	JERONIMO MARTINS SGPS SA	114.076	0,05
	Südafrika	*153.444*	*0,07*
90.225	OLD MUTUAL LIMITED	153.444	0,07
	Spanien	*10.924.933*	*4,77*
4.849	ACS	168.260	0,07
16.714	AMADEUS IT GROUP SA	1.129.866	0,49
309.563	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	1.880.286	0,82
421.392	BANCO SANTANDER SA	1.935.032	0,84
226.660	CAIXABANK	840.002	0,37
16.919	DIA SA	42.213	0,02
6.410	ENDESA	121.117	0,05

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses

Wertpapierbestand zum 30.06.2018

Anzahl		Marktwert	% des NIW
		EUR	
296.010	IBERDROLA SA	1.960.771	0,86
23.198	INDITEX	678.773	0,30
16.236	INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP SA	122.127	0,05
24.126	MAFPRE SA	62.366	0,03
3.561	NATURGY ENERGY GROUP SA	80.763	0,04
4.091	RED ELECTRICA CORPORACION SA	71.347	0,03
37.491	REPSOL	628.537	0,27
165.335	TELEFONICA SA	1.203.473	0,53
	Schweden	*8.700.842*	*3,80*
3.853	ASSA ABLOY AB	70.421	0,03
37.705	ATLAS COPCO B	847.062	0,36
20.561	BOLIDEN AB	572.052	0,25
2.468	ELECTROLUX B	48.203	0,02
40.461	EPIROC AKTIEBOLAG	317.648	0,14
2.899	ESSITY AB	61.394	0,03
35.713	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	456.461	0,20
13.707	HEXAGON AB	655.501	0,29
16.366	ICA GRUPPEN AB	430.424	0,19
4.283	INVESTOR B	149.630	0,07
33.689	LUNDBERGFORETAGEN AB B	887.631	0,38
63.309	NORDEA BANK AB	522.963	0,23
37.449	SANDVIK	570.076	0,25
10.779	SEB A	87.884	0,04
4.788	SECURITAS AB	67.592	0,03
4.047	SKANSKA AB-B SHS	63.079	0,03
3.854	SKF AB-B SHS	61.510	0,03
8.507	SVENSKA CELLULOSA SCA AB	79.264	0,03
3.276	SWEDBANK A SHS A	60.157	0,03
12.625	TELE2 B	127.279	0,06
154.023	TELIA COMPANY SHS	604.006	0,26
3.284	TRELLEBORG AB	60.147	0,03
138.618	VOLVO AB-B SHS	1.900.458	0,82
	Schweiz	*22.805.572*	*9,96*
77.085	ABB LTD-NOM	1.443.495	0,63
21.143	ADECCO GROUP INC	1.071.603	0,47
42	BARRY CALLEBAUT N	64.484	0,03
6.569	CIE FINANCIERE RICHEMONT SA	476.633	0,21
2.630	COCA COLA HBC GBP	75.270	0,03
4.610	CREDIT SUISSE GROUP AG-NOM	59.447	0,03
782	DUFRY AG REG	85.259	0,04
119	EMS-CHEMIE HOLDING N	65.333	0,03
60	GEORG FISCHER AG NAMEN	65.778	0,03
36	GIVAUDAN N	69.929	0,03
141	HELVETIA HOLDING	68.898	0,03
2.041	KUEHNE UND NAGEL INTERNATIONAL AG-NOM	262.662	0,11
15.071	LAFARGEHOLCIM LTD	628.917	0,27
1	LINDT & SPRUENGLI AG-NOM	65.036	0,03
990	LONZA GROUP AG N	225.010	0,10
118.508	NESTLE SA	7.860.667	3,42
85.090	NOVARTIS AG-NOM	5.525.143	2,41
942	PARGESA HOLDING	68.333	0,03
112	PARTNERS GROUP HOLDING N	70.281	0,03
96	SGS SA-NOM	218.771	0,10
2.295	SIKA LTD	271.991	0,12
523	SONOVA HOLDING AG	80.231	0,04
432	STRAUMANN HOLDING (NAMEN)	281.330	0,12
229	SWISS LIFE HOLDING NOM	68.146	0,03
8.662	SWISS RE AG	640.301	0,28
1.365	SWISSCOM N	521.817	0,23
111.537	UBS GROUP INC NAMEN AKT	1.474.365	0,64
3.928	ZURICH INSURANCE GROUP AG	996.442	0,44
	Vereinigtes Königreich	*59.400.623*	*25,94*
131.645	3I GROUP	1.340.640	0,59
12.493	AERCAP HOLDINGS NV	580.164	0,25
26.082	ANGLO AMERICAN PLC	499.845	0,22
23.415	ASHTEAD GROUP	601.824	0,26
36.170	ASTRAZENECA PLC	2.148.482	0,94
130.607	AVIVA PLC	744.342	0,32
58.075	BABCOCK INTERNATIONAL GROUP PLC	537.047	0,23
363.712	BARCLAYS PLC	777.312	0,34
127.242	BARRATT DEVELOPMENTS	741.568	0,32
15.511	BERKELEY GROUP HOLDINGS UNITS	663.868	0,29
58.400	BHP BILLITON PLC	1.126.595	0,49
5.556	BOVIS HOMES GROUP	71.967	0,03
648.598	BP PLC	4.241.354	1,86
60.367	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	2.614.413	1,14
5.921	BRITISH LAND CO REIT	45.006	0,02
576.445	BT GROUP PLC	1.419.684	0,62
30.655	CAPITA	55.376	0,02
6.041	CARNIVAL PLC	296.944	0,13
8.702	COCA COLA EUROPEAN PARTNERS PLC	302.656	0,13
38.578	COMPASS GROUP PLC	706.038	0,31
1.355	CRODA INTERNATIONAL PLC	73.576	0,03
106.327	DIAGEO	3.272.709	1,44
30.647	DIXONS CARPHONE	64.666	0,03
104.262	GLAXOSMITHKLINE PLC	1.803.585	0,79
23.042	G4S SHS	69.750	0,03
642.689	HSBC HOLDINGS PLC	5.164.912	2,27
42.565	IMPERIAL BRAND SHS PLC	1.358.268	0,59
10.058	INMARSAT PLC	62.553	0,03
1.209	INTERTEK GROUP	78.144	0,03
16.391	INVESTEC	99.716	0,04
217.554	ITV	428.048	0,19
74.791	KINGFISHER	251.178	0,11
394.027	LEGAL & GENERAL GROUP	1.185.178	0,52
2.585.770	LLOYDS BANKING GROUP PLC	1.843.533	0,80
12.909	LONDON STOCK EXCHANGE	652.639	0,28
95.310	MARKS AND SPENCER GROUP	318.041	0,14
12.975	MEGGITT PLC	72.376	0,03
3.278	MONDI PLC	76.024	0,03
3.688	NEXT PLC	252.303	0,11
32.650	PEARSON	326.740	0,14
35.602	PERSIMMON PLC	1.019.730	0,45
73.807	PRUDENTIAL PLC	1.447.597	0,63
30.074	QUILTER PLC	49.283	0,02

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses

Wertpapierbestand zum 30.06.2018

Anzahl		Marktwert	% des NIW
		EUR	
9.763	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	688.770	0,30
60.669	RIO TINTO PLC	2.882.008	1,27
512.478	ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC PFD SHS	580	0,00
7.100	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	79.338	0,03
195.193	ROYAL DUTCH SHELL A SHARES	5.802.706	2,54
88.612	ROYAL DUTCH SHELL B SHARES	2.718.931	1,20
11.662	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A	347.178	0,15
29.317	ROYAL MAIL PLC-W/I	167.545	0,07
8.535	SAGE GRP	60.667	0,03
101.078	SAINSBURY(J)	367.120	0,16
11.104	SKY PLC	183.508	0,08
4.688	SMITH & NEPHEW	74.109	0,03
3.846	SMITHS GROUP	73.845	0,03
12.665	SPORTS DIRECT INTERNATIONAL WI	57.199	0,02
68.156	STANDARD CHARTERED	533.780	0,23
124.310	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	457.825	0,20
10.255	TATE & LYLE PLC	75.003	0,03
593.625	TAYLOR WINPEY PLC	1.200.877	0,52
155.012	TESCO PLC	449.953	0,20
37.238	UNILEVER	1.765.157	0,77
830.710	VODAFONE GROUP	1.726.704	0,75
3.083	WHITBREAD	138.018	0,06
18.692	WILLIAM HILL PLC	64.128	0,03
	Vereinigte Staaten von Amerika	*4.450.713*	*1,94*
4.551	BALL CORP	139.272	0,06
21.865	ROCHE HOLDING LTD	4.159.508	1,81
9.916	SSE PLC	151.933	0,07
	Optionsscheine, Bezugsrechte	**64.648**	**0,03**
	Deutschland	*40.503*	*0,02*
24.221	BAYER AG SUBSCRIPTION RIGHT	40.503	0,02
	Italien	-	*0,00*
394.874	INTESA SANPAOLO SPA RIGHTS 17/07/2018	-	0,00
	Spanien	*24.145*	*0,01*
5.203	ACS,ACTIVIDADES DE CONSTRUCCION Y SERVICISA RIGHT 06/07/2018	4.589	0,00
40.231	REPSOL SA RIGHT 06/07/2018	19.556	0,01
Anteile/Aktien von OGAW/OGA		**6.904.355**	**3,01**
	Aktien/Anteile an Investmentfonds	**6.904.355**	**3,01**
	Luxemburg	*6.904.355*	*3,01*
6.791	AMUNDI FUNDS II - ABSOLUTE RETURN CURRENCIES X ND	6.904.355	3,01
Gesamt-Wertpapierbestand		**228.276.093**	**99,67**

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses

Wertpapierbestand zum 30.06.2018

Anzahl		Marktwert	% des NIW
		EUR	
Long-Positionen		**155.105.363**	**87,20**
Zur amtlichen Notierung an einer Wertpapierbörse zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte, übertragbare Wertpapiere		**142.229.669**	**79,96**
	Anteile	**23.886.025**	**13,43**
	Australien	*135.240*	*0,08*
1.160	CATERPILLAR INC	135.240	0,08
	Österreich	*96.541*	*0,05*
1.517	AMS	96.541	0,05
	Belgien	*203.016*	*0,11*
2.347	ANHEUSER BUSCH INBEV SA/NV	203.016	0,11
	Kanada	*184.018*	*0,10*
16.326	BARRICK GOLD NYS (USD)	184.018	0,10
	Cayman Islands	*1.734.404*	*0,98*
2.081	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	331.252	0,18
647	BAIDU ADS	136.294	0,08
114.000	CHINA MAPLE LEAF EDUCATIONAL	175.979	0,10
4.355	CTRIP.COM INTERNATIONAL ADR	177.139	0,10
54.000	GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD	119.968	0,07
12.000	HENGAN INTERNATIONAL GROUP CO LTD	98.909	0,06
3.143	HUAZHU GROUP LTD ADR	112.470	0,06
1.311	NW ORIENTL ED & TECHNO GP ADR	105.347	0,06
6.221	TAL EDUCATION GROUP	195.494	0,11
3.000	TENCENT HOLDINGS LTD	128.975	0,07
16.000	WUXI BIOLOGICS INC	152.577	0,09
	China	*621.892*	*0,35*
23.500	BYD CO LTD-H	121.990	0,08
115.000	CHINA COMMUNICATIONS CONSTR - H	95.164	0,05
186.000	CHINA EASTERN AIRLINES CO-H	107.824	0,06
160.000	CHINA RAILWAY SIGNAL & COMMUNICATION CORPORATION LTD	97.293	0,05
158.000	GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	103.494	0,06
114.800	GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD	96.127	0,05
	Finnland	*183.335*	*0,10*
1.790	KESKO OYJ B	93.796	0,05
18.162	NOKIA OYJ	89.539	0,05
	Frankreich	*1.731.415*	*0,97*
7.274	ALSTOM	286.305	0,16
763	ATOS SE	89.233	0,05
1.861	CAP GEMINI SE	214.387	0,12
805	ILIAD	108.957	0,06
664	IPSEN	89.208	0,05
3.838	LAGARDERE	86.777	0,05
2.597	SCHNEIDER ELECTRIC SA	185.478	0,10
2.393	SOCIETE GENERALE A	86.423	0,05
1.825	THALES SA	201.389	0,11
2.287	VINCI SA	188.357	0,11
9.281	VIVENDI	194.901	0,11
	Deutschland	*2.324.733*	*1,31*
2.322	BASF SE	190.195	0,11
2.549	BAYER AG	240.498	0,14
8.625	DEUTSCHE WOHNEN AG REIT	357.075	0,19
21.309	E.ON SE	195.063	0,11
1.664	LEG IMMOBILIEN REIT	154.885	0,09
801	LINDE AG	143.259	0,08
3.650	ROCKET INTERNET SE AKT	100.375	0,06
12.875	RWE AG	251.384	0,14
1.816	SIEMENS AG-NOM	205.608	0,12
9.702	TAG IMMOBBILIEN AG	182.689	0,10
7.451	VONOVIA SE NAMEN AKT REIT	303.702	0,17
	Hongkong (China)	*126.609*	*0,07*
8.600	CHINA TAIPING INSURANCE HOLD SHS -H-	23.049	0,01
310.000	CHINA TRAVEL INT INV HK LTD	103.560	0,06
	Irland	*168.146*	*0,09*
485	MEDTRONIC PLC	35.870	0,02
609	NVENT ELECTRIC	13.027	0,01
905	PADDY POWER BET	85.552	0,04
929	PENTAIR PLC	33.697	0,02
	Japan	*3.239.808*	*1,83*
600	FANUC LTD	102.093	0,06
8.800	GMO INTERNET	179.574	0,10
2.700	HARMONIC DRIVE SYSTEMS	97.917	0,06
17.000	HITACHI LTD	102.744	0,06
300	KEYENCE CORP	145.124	0,08
5.600	MINEBEA MITSUMI INC	81.148	0,05
16.100	MITSUBISHI CHEMICAL HOLDINGS	115.456	0,06
4.300	NGK SPARK PLUG	105.070	0,06
1.400	NIDEC CORP	179.975	0,10
1.800	ORIENTAL LAND	161.803	0,09
11.800	PANASONIC CORP	136.273	0,08
9.700	RECRUIT HOLDING CO LTD	229.966	0,12
6.900	SBI HOLDINGS	152.274	0,09
3.100	SOFTBANK GROUP CORP	191.120	0,11
4.900	SONY CORP	214.606	0,12
6.800	SUMCO CORP	117.624	0,07
4.200	SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GRP	139.844	0,08
4.400	SUMITOMO MITSUI TRUST HLD	149.464	0,08
3.200	TERUMO CORP	157.125	0,09
2.900	TREND MICRO INC	141.722	0,08
5.500	UNI-CHARM CORP	141.749	0,08
3.300	YASKAWA ELECTRIC CORP	99.900	0,06
2.500	ZENKOKU HOSHO CO LTD	97.237	0,05
	Jersey	*308.643*	*0,17*
79.288	CENTAMIN	106.692	0,06
2.904	FERGUSON PLC	201.951	0,11
	Luxemburg	*252.732*	*0,14*
5.299	GRAND CITY PROPERTIES S.A.	117.850	0,07

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses

Wertpapierbestand zum 30.06.2018

Anzahl		Marktwert	% des NIW
		EUR	
8.583	TENARIS SA	134.882	0,07
	Niederlande	*953.054*	*0,54*
1.968	FERRARI NV	229.272	0,13
9.400	FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	153.540	0,09
10.854	KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE	222.561	0,13
2.341	KONINKLIJKE DSM NV	201.607	0,11
1.538	LYONDELLBASELL	146.074	0,08
	Singapur	*100.055*	*0,06*
18.800	BOC AVIATION LTD SHS UNITARY 144A REG S	100.055	0,06
	Südkorea	*515.788*	*0,29*
441	LG CHEM	113.026	0,06
4.000	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	143.402	0,08
955	SAMSUNG SDI	157.059	0,09
659	SK INNOVATION CO LTD	102.301	0,06
	Spanien	*309.904*	*0,17*
11.435	INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP SA	85.858	0,05
11.645	OBRASCON HUARTE LAIN SA	31.919	0,02
11.460	REPSOL	192.127	0,10
	Schweden	*92.070*	*0,05*
3.366	LUNDIN PETROLEUM	92.070	0,05
	Schweiz	*147.078*	*0,08*
5.139	COCA COLA HBC GBP	147.078	0,08
	Taiwan	*190.930*	*0,11*
7.000	GLOBALWAFERS CO LTD	99.700	0,06
15.000	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING CO LTD	91.230	0,05
	Vereinigtes Königreich	*1.098.410*	*0,62*
10.430	BHP BILLITON PLC	201.205	0,11
26.189	BP PLC	171.257	0,10
4.131	RIO TINTO PLC	196.238	0,11
7.795	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A	232.057	0,13
3.862	SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC	158.277	0,09
5.096	TECHNIPFMC PLC EUR	139.376	0,08
	Vereinigte Staaten von Amerika	*9.168.204*	*5,16*
308	3 M	52.312	0,03
933	ABBOTT LABORATORIES	49.297	0,03
731	ABBVIE INC	58.916	0,03
2.625	ACTIVISION BLIZZARD INC	171.568	0,10
1.020	AFLAC INC	37.776	0,02
439	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	58.980	0,03
2.167	AKAMAI TECHNOLOGIES INC	136.585	0,08
1.849	ALBEMARLE	151.730	0,09
3.262	ALCOA CORP	130.419	0,07
162	ALPHABET INC	157.346	0,09
105	AMAZON.COM	153.495	0,09
4.245	ANADARKO PETROLEUM CORP	267.704	0,16
956	ANTHEM INC	197.791	0,11
679	A.O.SMITH CORP	34.603	0,02
229	APERGY CORP	8.059	0,00
914	APPLE INC	145.709	0,08
1.045	ARCHER-DANIELS MIDLAND CO	41.288	0,02
1.316	AT&T INC	36.508	0,02
1.319	AUTODESK INC	148.558	0,08
346	AUTOMATIC DATA PROCESSING INC	39.968	0,02
289	BECTON DICKINSON & CO	59.867	0,03
977	BROWN-FORMAN CORP B	41.095	0,02
789	CARDINAL HEALTH INC	33.498	0,02
4.641	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	179.431	0,10
336	CHEVRON CORP	36.548	0,02
952	CINCINNATI FINANCIAL CORP	55.161	0,03
259	CINTAS CORP	41.432	0,02
400	CLOROX CO	46.415	0,03
1.154	COCA-COLA CO	43.430	0,02
735	COLGATE PALMOLIVE CO	40.995	0,02
3.992	CONOCOPHILLIPS	238.329	0,13
518	CONSOLIDATED EDISON INC	34.734	0,02
715	COOPER COMPANIES INC	144.770	0,08
3.996	CSX CORP	219.899	0,12
1.183	DEERE & CO	143.757	0,08
3.669	DEVON ENERGY CORPORATION	139.149	0,08
459	DOVER CORP	29.009	0,02
297	ECOLAB INC	35.837	0,02
1.321	ELECTRONIC ARTS INC	159.413	0,09
613	EMERSON ELECTRIC CO	36.537	0,02
493	EXXON MOBIL CORP	35.165	0,02
942	FACEBOOK A	158.104	0,09
2.522	FMC CORP	193.997	0,11
2.884	FORTIVE CORP - W/I	190.719	0,11
1.297	FRANKLIN RESOURCES INC	36.048	0,02
504	GENUINE PARTS CO	39.830	0,02
1.657	HOME DEPOT INC	278.590	0,17
1.312	HORMEL FOODS	41.791	0,02
1.012	IAC/INTERACTIVECOR	132.217	0,07
295	ILLINOIS TOOL WORKS INC	35.305	0,02
809	ILLUMINA	192.904	0,11
561	INTUITIVE SURGICAL	230.079	0,13
511	JOHNSON & JOHNSON	53.733	0,03
418	KIMBERLY-CLARK CORP	37.921	0,02
1.035	LEGGETT & PLATT INC	39.723	0,02
488	LOWE'S COMPANIES INC	40.284	0,02
3.498	MARATHON PETROLEUM	211.279	0,12
291	MC DONALD'S CORP	39.243	0,02
373	MCCORMICK NON VTG	37.120	0,02
9.588	NEWMONT MINING CORP	312.715	0,19
4.203	NOBLE ENERGY	127.543	0,07
614	NUCOR CORP	33.078	0,02
1.019	NVIDIA CORP	207.789	0,12
1.120	PALO ALTO NETWORKS INC	197.956	0,11
434	PEPSICO INC	40.588	0,02
373	PPG INDUSTRIES INC	33.401	0,02

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses

Wertpapierbestand zum 30.06.2018

Anzahl		Marktwert	% des NIW
		EUR	
286	PRAXAIR INC	38.934	0,02
595	PROCTER AND GAMBLE CO	39.956	0,02
1.500	PROOFPOINT INC	147.912	0,08
163	ROPER TECHNOLOGIES INC	38.612	0,02
1.765	SALESFORCE.COM	206.016	0,12
132	SHERWIN WILLIAMS CO	46.037	0,03
301	S&P GLOBAL INC	53.079	0,03
1.556	SPLUNK INC	131.591	0,07
439	STANLEY BLACK AND DECKER INC.	50.610	0,03
771	SYSCO CORP	45.182	0,03
382	T ROWE PRICE GROUP INC	38.509	0,02
1.724	TAKE TWO INTERACTIVE SOFTWARE	175.804	0,10
553	TARGET CORP	36.248	0,02
2.249	TIFFANY & CO	254.881	0,15
4.715	TRIMBLE NAVIGATION	134.114	0,08
1.437	UNITED PARCEL SERVICE-B	131.669	0,07
1.334	UNITED RENTALS INC	170.928	0,10
3.306	VERIZON COMMUNICATIONS INC	143.108	0,08
693	VF CORP	48.594	0,03
663	WALGREEN BOOTS	33.714	0,02
535	WALMART INC	39.380	0,02
1.781	WALT DISNEY COMPANY	160.611	0,09
141	WW GRAINGER INC	37.362	0,02
1.212	ZEBRA TECH -A-	150.313	0,08
	Anleihen	**117.026.394**	**65,79**
	Argentinien	*37.739*	*0,02*
75.000	YPF SOCIEDAD ANONIMA 0% 07/07/2020	37.739	0,02
	Australien	*2.169.801*	*1,22*
550.000	AUSTRALIA I %1,25 21/02/2022	404.446	0,23
700.000	AUSTRALIA 3,00% 21/03/2047	435.210	0,24
750.000	AUSTRALIAI 0,75% 21/11/2027	486.363	0,27
650.000	AUSTRALIAI 3,00% 20/09/2025	581.775	0,33
200.000	MACQUARIE GROUP LTD VAR 05/03/2025	195.458	0,11
90.000	WESTPAC BANKING CORP VAR PERPETUAL	66.549	0,04
	Österreich	*333.397*	*0,19*
167.000	AT &S AUSTRIA TECHNOLOGIE & SYSTEMTECHNIK AG VAR PERPETUAL	162.048	0,09
200.000	RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG VAR PERPETUAL	171.349	0,10
	Belgien	*914.759*	*0,51*
200.000	BELFIUS BANQUE SA/NV VAR PERPETUAL	171.352	0,10
200.000	BELFIUS BANQUE SA/NV VAR 15/03/2028	195.771	0,11
100.000	BELFIUS BANQUE SA/NV 1,00% 26/10/2024	97.747	0,05
200.000	BNP PARIBAS FORTIS SA VAR PERPETUAL	151.131	0,08
300.000	KBC GROUP SA/NV FRN 24/11/2022	298.758	0,17
	Bolivien	*149.989*	*0,08*
200.000	BOLIVIA 4,50% 20/03/2028	149.989	0,08
	Kanada	*9.305.374*	*5,23*
111.000	BANK OF MONTREAL 1,35% 28/08/2018	94.926	0,05
160.000	BANK OF NOVA SCOTIA VAR PERPETUAL	124.140	0,07
300.000	CANADAI 1,25% 01/12/2047	257.875	0,14
6.000.000	CANADAI 4,25% 01/12/2021	7.127.368	4,01
400.000	CANADAI 4,25% 01/12/2026	522.291	0,29
214.000	FIRST QUANTUM MINERALS LTD 6,50% 01/03/2024	174.950	0,10
200.000	FIRST QUANTUM MINERALS LTD 6,875% 01/03/2026	163.244	0,09
200.000	FIRST QUANTUM MINERALS LTD 7,25% 01/04/2023	170.749	0,10
200.000	FIRST QUANTUM MINERALS LTD 7,50% 01/04/2025	169.521	0,10
200.000	ITHACA ENERGY INC 8,125% 01/07/2019	170.802	0,10
200.000	ROYAL BANK OF CANADA FRN 06/08/2020	201.273	0,11
150.000	THE TORONTO DOMINION BANK 1,45% 06/09/2018	128.235	0,07
	Cayman Islands	*295.180*	*0,17*
200.000	CK HUTCHISON FINANCE 16 VAR PERPETUAL	165.019	0,10
124.000	VIRIDIAN GRP FUNDCO 2 4,75% 15/09/2024	130.161	0,07
	China	*157.677*	*0,09*
200.000	UNION LIFE INSURANCE CO LTD 3,00% 19/09/2021	157.677	0,09
	Tschechische Republik	*197.813*	*0,11*
193.000	CZECH EXPORT BANK 3,625% 15/03/2019	197.813	0,11
	Dänemark	*385.318*	*0,22*
100.000	JYSKE BANK A/S FRN 01/12/2022	100.881	0,06
200.000	NORICAN A/S 4,50% 15/05/2023	184.257	0,10
100.000	NYKREDIT REALKREDIT AS FRN 02/06/2022	100.180	0,06
	Finnland	*227.350*	*0,13*
240.000	STOCKMANN PIC 4,75% 11/01/2022	227.350	0,13
	Frankreich	*6.576.806*	*3,70*
100.000	3AB OPTIQUE DEVELOPMENT VAR 01/10/2023	94.928	0,05
100.000	3AB OPTIQUE DEVELOPMENT 4,00% 01/10/2023	94.231	0,05
100.000	ALD INTERNATIONAL FRN 26/02/2021	99.830	0,06
250.000	AXA SA VAR PERPETUAL	209.854	0,11
208.000	BNP PARIBAS SA FRN 22/09/2022	209.362	0,12
200.000	BNP PARIBAS SA VAR PERPETUAL	170.506	0,10
100.000	BNP PARIBAS SA 1,00% 27/06/2024	98.112	0,06
100.000	BURGER KNG FRANCE S.A.S VAR 01/05/2023	100.586	0,06
100.000	CARMILA SAS 2,125% 07/03/2028	99.391	0,06
700.000	CARREFOUR BANQUE VAR 20/03/2020	702.908	0,39
100.000	CASINO GUICHARD PERRACHON SA VAR PERPETUAL	84.773	0,05
200.000	CMA CGM 5,25% 15/01/2025	163.123	0,09
133.000	CMA CGM 6,50% 15/07/2022	123.419	0,07
100.000	CREDIT MUTUEL ARKEA 1,25% 31/05/2024	98.121	0,06
100.000	CROWN EUROPEAN HOLDINGS 2,875% 01/02/2026	94.533	0,05
200.000	ELECTRICITE DE FRANCE SA 1,00% 13/10/2026	195.366	0,11
100.000	ENGIE SA VAR PERPETUAL	93.873	0,05
100.000	GECINA FRN 30/06/2022	99.823	0,06
200.000	GECINA 1,625% 14/03/2030	193.879	0,11
250.000	HOLDIKKS SAS 6,75% 15/07/2021	117.168	0,07
100.000	HOLDING D'INFRASTRUCTURE DE TRANSPORT 0,625% 27/03/2023	98.244	0,06
100.000	HOLDING D'INFRASTRUCTURE DE TRANSPORT 1,625% 27/11/2027	95.527	0,05

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses

Wertpapierbestand zum 30.06.2018

Anzahl		Marktwert	% des NIW
		EUR	
100.000	ICADE SA 1,625% 28/02/2028	98.088	0,06
100.000	ILIAD SA 1,50% 14/10/2024	96.471	0,05
200.000	INFRA PARK 2,00% 06/07/2029	198.607	0,11
100.000	LEGRAND SA 0,75% 06/07/2024	99.993	0,06
104.000	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE VAR 26/11/2018	104.118	0,06
100.000	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE 0% 26/05/2020	100.251	0,06
250.000	MARCOLIN SPA VAR 15/02/2023	247.755	0,13
100.000	MERCIALYS 1,80% 27/02/2026	99.117	0,06
200.000	MERCIALYS 2,00% 03/11/2027	202.976	0,11
140.000	PICARD GROUPE VAR 30/11/2023	136.661	0,08
600.000	RCI BANQUE SA FRN 08/07/2020	601.095	0,33
100.000	RCI BANQUE SA 0,25% 12/07/2021	99.599	0,06
250.000	RCI BANQUE SA 0,625% 10/11/2021	251.760	0,13
200.000	SANOFI SA VAR 21/03/2020	200.876	0,11
200.000	SCOR SE VAR PERPETUAL	153.452	0,09
200.000	TEREOS FINANCE GROUPE I 4,125% 16/06/2023	188.216	0,11
100.000	TIKEHAU CAPITAL PARTNERS 3,00% 27/11/2023	97.261	0,05
200.000	VALLOUREC 2,25% 30/09/2024	160.509	0,09
100.000	VALLOUREC 3,25% 02/08/2019	102.444	0,06
	Deutschland	*17.058.175*	*9,58*
400.000	CBR FASHION HOLDING GMBH 5,125% 01/10/2022	343.878	0,19
100.000	DEUTSCHE BANK AG FRN 16/05/2022	96.272	0,05
150.000	DEUTSCHE BANK NY FRN 16/11/2022	124.471	0,07
200.000	DEUTSCHE PFANDBRIEFBANK AG VAR 28/06/2027	192.888	0,11
300.000	DEUTSCHE PFANDBRIEFBANK AG 4,60% 22/02/2027	306.573	0,17
5.500.000	GERMANY BUNDI 0,10% 15/04/2023	6.350.712	3,57
7.000.000	GERMANY BUNDI 1,75% 15/04/2020	8.362.003	4,70
150.000	HBO S STERLING FINANCE JERSEY LP VAR PERPETUAL	246.956	0,14
100.000	IKB DEUTSCHE INDUSTRIEBANK AG VAR 31/01/2028	97.531	0,05
100.000	KIRK BEAUTY ONE GMBH 8,75% 15/07/2023	93.375	0,05
100.000	NIDDA BONDCO GMBH 5,00% 30/09/2025	91.860	0,05
100.000	NIDDA HEALTHCARE HOLDING AG 3,50% 30/09/2024	94.638	0,05
100.000	SAP SE VAR 13/03/2021	100.559	0,06
100.000	SENVION HOLDING GMBH 3,875% 25/10/2022	85.699	0,05
300.000	TALANX AG VAR 05/12/2047	271.249	0,15
100.000	UNIPER SE 0,125% 08/12/2018	100.104	0,06
100.000	VOLKSWAGEN BANK GMBH FRN 15/06/2021	99.407	0,06
	Guernsey	*175.396*	*0,10*
183.000	SUMMIT GERMANY LTD 2,00% 31/01/2025	175.396	0,10
	Hongkong (China)	*159.281*	*0,09*
200.000	WELL HOPES DEVELOPMENT HOLDINGS LIMITED VAR PERPETUAL	159.281	0,09
	Island	*317.281*	*0,18*
100.000	ARION BANK 1,00% 20/03/2023	99.008	0,06
100.000	LANDSBANKINN HF 1,00% 30/05/2023	99.076	0,06
120.000	LSLANDSBANKI HF VAR 19/01/2024	119.197	0,06
	Irland	*933.952*	*0,53*
200.000	CREDIT BANK OF MOSCOW FINANCE VAR PERPETUAL	137.382	0,08
200.000	CREDIT BANK OF MOSCOW FINANCE VAR 05/10/2027	136.960	0,08
200.000	FCA CAPITAL IRELAND PLC FRN 12/02/2019	200.162	0,11
105.000	FCA CAPITAL IRELAND PLC 1,00% 15/11/2021	105.298	0,06
200.000	PERMANENT TSB PLC VAR PERPETUAL	187.160	0,11
150.000	VIRGIN MEDIA RECEIVABLES FINANCING NOTES I DESIGNATED 5,50% 15/09/2024	166.990	0,09
	Italien	*25.923.763*	*14,56*
200.000	ANSALDO ENERGIA S.P.A 2,75% 31/05/2024	181.625	0,10
122.000	BANCA FARMAFACTORING SPA FRN 05/06/2020	116.466	0,07
200.000	BANCA FARMAFACTORING SPA 2,00% 29/06/2022	196.008	0,11
300.000	BORMIOLI PHARMA BIDCO S P A VAR 15/11/2024	293.316	0,16
200.000	CMC RAVENNA 6,00% 15/02/2023	170.379	0,10
200.000	CMF 9,00% 15/06/2022	170.488	0,10
100.000	COOPERATIVA MURATORI & C 6,875% 01/08/2022	89.113	0,05
200.000	ERG SPA 2,175% 19/01/2023	189.588	0,11
100.000	ICCREA BANCA SPA FRN 18/06/2025	90.375	0,05
200.000	ICCREA BANCA SPA 1,875% 25/11/2019	200.262	0,11
100.000	INTER MEDIA COMMUNICATION S R L 4,875% 31/12/2022	99.861	0,06
300.000	INTESA SANPAOLO SPA 1,75% 20/03/2028	270.647	0,15
200.000	INTESA SANPAOLO SPA 5,017% 26/06/2024	154.777	0,09
1.000.000	ITALY BTP 0% 30/05/2019	998.300	0,56
1.600.000	ITALY BTP 0% 30/10/2019	1.591.072	0,89
550.000	ITALY BTP 0,05% 15/10/2019	547.016	0,31
250.000	ITALY BTP 1,50% 01/08/2019	253.161	0,14
3.000.000	ITALY BTPI 0,50% 20/04/2023	2.961.587	1,67
7.500.000	ITALY BTPI 1,25% 27/10/2020	7.719.251	4,33
3.500.000	ITALY BTPI 1,65% 23/04/2020	3.609.856	2,03
550.000	ITALY CCT FRN 15/11/2019	552.687	0,31
2.250.000	ITALY CCT FRN 15.12.2020	2.228.040	1,25
141.000	KEDRION SPA 3,00% 12/07/2022	135.652	0,08
100.000	LIMACORPORATE SPA VAR 15/08/2023	97.996	0,06
200.000	L'ISOLANTE K-FLEX SPA 4,25% 07/10/2023	203.178	0,11
100.000	MEDIOBANCA BANCA DI CREDITO FINANZIARIO S P A FRN 18/05/2022	96.954	0,05
200.000	MEDIOBANCA BANCA DI CREDITO FINANZIARIO S P A VAR 22/11/2019	203.419	0,11
100.000	MEDIOBANCA BANCA DI CREDITO FINANZIARIO S P A VAR 30/09/2018	100.939	0,06
100.000	MEDIOBANCA BANCA DI CREDITO FINANZIARIO S P A 0.625% 27/09/2022	95.872	0,05
200.000	MERCEDES BENZ FINANCIAL SERVICES ITALIA SPA FRN 22/06/2020	199.803	0,11
200.000	OFFICINE MACCAFERRI SPA 5,75% 01/06/2021	199.904	0,11
200.000	ONORATO ARMATORI S.P.A 7,75% 15/02/2023	151.594	0,09
100.000	PIRELLI C SPA FRN 26/09/2020	99.250	0,06
246.000	PIRELLI C SPA 1,375% 25/01/2023	238.722	0,13
110.000	PRO GEST SPA 3,25% 15/12/2024	104.377	0,06
100.000	SALINI IMPREGILO SPA 3,75% 24/06/2021	101.410	0,06
200.000	SALINI SPA 1,75% 26/10/2024	172.076	0,10

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses

Wertpapierbestand zum 30.06.2018

Anzahl		Marktwert	% des NIW
		EUR	
100.000	SNAI SPA VAR 07/11/2021	101.076	0,06
200.000	SNAM SPA FRN 02/08/2024	197.285	0,11
100.000	UNICREDIT SPA VAR 31/08/2024	94.235	0,05
160.000	UNIONE DI BANCHE ITALIAN 0,75% 17/10/2022	150.610	0,08
200.000	WIND TRE S P A VAR 20/01/2024	166.108	0,09
200.000	WIND TRE S P A 2,625% 20/01/2023	167.750	0,09
200.000	WIND TRE S P A 3,125% 20/01/2025	161.678	0,09
	Japan	*6.061.266*	*3,41*
200.000	CENTRAL NIPPON EXPRESSWAY CO LTD 2,091% 14/09/2021	164.144	0,09
400.000	JAPAN JGB 1,50% 21/07/2021	327.027	0,18
300.000.000	JAPAN JGBI 0,10% 10/03/2026	2.463.145	1,39
250.000.000	JAPAN JGBI 0,10% 10/03/2027	2.065.593	1,17
200.000	MITSUBISHI UFJ FIN GRP 3,287% 25/07/2027	163.099	0,09
200.000	MITSUBISHI UFJI LEASE & FINANCE CO LTD 2,25% 07/09/2021	164.177	0,09
250.000	SUMITOMO MITSUI BANKING CORP FRN 11/01/2019	214.488	0,12
114.000	SUMITOMO MITSUI FINANCIAL CORP INC 2,058% 14/07/2021	93.803	0,05
200.000	SUMITOMO MITSUI FINANCIAL CORP INC 2,632% 14/07/2026	156.276	0,09
311.000	SUMITOMO MITSUI FINANCIAL CORP INC 3,01% 19/10/2026	249.514	0,14
	Jersey	*522.792*	*0,29*
200.000	ADIENT GLOBAL HOLDINGS LTD 4,875% 15/08/2026	154.169	0,09
200.000	EURO DM SECURITIES 0% 08/04/2021	102.137	0,06
100.000	KENNEDY WILSON EUROPE REAL ESTATE 3,25% 12/11/2025	101.408	0,06
200.000	UBS GROUP FUNDING LTD 2,65% 01/02/2022	165.078	0,08
	Kasachstan	*170.982*	*0,10*
200.000	NATIONAL COMPANY KAZMUNAYGAZ JSC 5,375% 24/04/2030	170.982	0,10
	Kenia	*170.782*	*0,10*
200.000	EASTERN AND SOUTHERN 5,375% 14/03/2022	170.782	0,10
	Luxemburg	*3.102.085*	*1,74*
145.000	ALLERGAN FUNDING SCS FRN 01/06/2019	145.176	0,08
100.000	ALTICE FINCO S.A 4,75% 15/01/2028	85.504	0,05
100.000	ARCELORMITTAL SA 0,95% 17/01/2023	98.386	0,06
200.000	AROUNDTOWN SA VAR PERPETUAL	181.821	0,10
80.000	BC LUCXO 1 SA 6,125% 10/08/2022	66.053	0,04
203.000	CNH INDUSTRIAL FINANCE EUROPE S A 1,375% 23/05/2022	205.023	0,12
100.000	CNH INDUSTRIAL FINANCE EUROPE S A 1,75% 12/09/2025	97.080	0,05
150.000	CRYSTAL ALMOND S A R L 10,00% 01/11/2021	158.915	0,09
100.000	EDREAMS ODIGEO SA 8,50% 01/08/2021	101.662	0,06
100.000	GALAPAGOS HOLDING SA 7,00% 15/06/2022	57.525	0,03
237.000	GARFUNKELUX HOLDCO 3 SA VAR 01/09/2023	210.368	0,12
214.000	GELF BOND ISSUER I SA 1,625% 20/10/2026	214.067	0,12
200.000	JOHN DEERE CASH MANAGMENT SA VAR 15/09/2020	200.503	0,11
200.000	KLEOPATRA HOLDINGS 8,50% 30/06/2023	150.978	0,08
200.000	LECTA SA 6,50% 01/08/2023	197.048	0,11
100.000	MATTERHORN TELECOM S.A. VAR 01/02/2023	14.314	0,01
200.000	MATTERHORN TELECOM S.A. 4,00% 15/11/2027	187.250	0,11
150.000	MONITCHEM HOLDCO 3 SA 5,25% 15/06/2021	148.170	0,08
167.000	MORGAN STANLEY FRN 03/12/2019	167.245	0,09
121.000	PICARD BONDO 5,50% 30/11/2024	113.794	0,06
100.000	SES S.A. VAR PERPETUAL	105.426	0,06
100.000	SES S.A. VAR PERPETUAL	102.989	0,06
100.000	TAKKO LUXEMBOURG 2 SCA VAR 15/11/2023	92.788	0,05
	Malta	*191.300*	*0,11*
200.000	EVAN GROUP PLC 6,00% 31/07/2022	191.300	0,11
	Mexiko	*374.448*	*0,21*
200.000	ALPHA HOLDINGS SA DE CV 10,00% 19/12/2022	157.751	0,09
136.000	PETROLEOS MEXICANOS PEMEX 5,35% 12/02/2028	110.417	0,06
136.000	PETROLEOS MEXICANOS PEMEX 6,35% 12/02/2048	106.280	0,06
	Niederlande	*5.439.836*	*3,06*
200.000	ABN AMRO BANK NV FRN 18/01/2019	171.756	0,10
300.000	ABN AMRO BANK NV 1,80% 20/09/2019	253.107	0,14
300.000	ABN AMRO BANK NV 2,10% 18/01/2019	256.023	0,14
500.000	AKZO NOBEL NV VAR 08/11/2019	501.437	0,27
100.000	ALLIANZ FINANCE II BV FRN 07/12/2020	101.022	0,06
250.000	AT SECURITIES BV VAR PERPETUAL	195.713	0,11
300.000	BMW FINANCE NV VAR 06/02/2020	300.594	0,17
200.000	COOPERATIEVE RABOBANK UA VAR PERPETUAL	214.047	0,12
894.000	COOPERATIEVE RABOBANK UA 0% 28/10/2026	402.551	0,23
200.000	DEUTSCHE TELEKOM INTERNATIONAL FINANCE BV FRN 03/04/2020	200.671	0,11
143.000	DEUTSCHE TELEKOM INTERNATIONAL FINANCE BV 0,875% 30/01/2024	144.242	0,08
331.000	EXOR HOLDINGS N.V 3,125% 15/02/2038	328.791	0,18
100.000	FERROVIAL NETHERLANDS BV VAR PERPETUAL	90.152	0,05
138.000	IMCD NV 2,50% 26/03/2025	135.831	0,08
100.000	KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV VAR 19/03/2021	100.104	0,06
200.000	KONINKLIJKE KPN NV 0,625% 09/04/2025	192.427	0,11
146.000	LEASEPLAN CORPORATION NV FRN 25/01/2021	146.501	0,08
100.000	MYLAN NV FRN 22/11/2018	100.256	0,06
200.000	NOSTRUM OIL&GAS FIN BV 7,00% 16/02/2025	149.873	0,08
100.000	NYRSTAR NETHERLANDS 8,50% 15/09/2019	102.238	0,06
196.000	PETROBRAS GLOBAL FINANCE BV 5,75% 01/02/2029	147.714	0,08
500.000	REPSOL INTERNATIONAL FINANCE BV FRN 06/07/2018	500.050	0,28
150.000	SAMVARDHANA MOTHERSON AUTOMOTIVE SYSTEMS GROUP BV 1,80% 06/07/2024	137.798	0,08
100.000	STEDIN HOLDING NV VAR 24/10/2022	100.056	0,06
150.000	UPC HOLDINGS BV 3,875% 15/06/2029	139.372	0,08
113.000	VOLKSWAGEN FINANCIAL SERVICES NV 1,50% 12/04/2021	126.810	0,07
100.000	VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV 0,50% 30/03/2021	100.458	0,06
100.000	VONOVIA FINANCE B.V FRN 20/11/2019	100.242	0,06

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses

Wertpapierbestand zum 30.06.2018

Anzahl		Marktwert EUR	% des NIW
	Neuseeland	*880.631*	*0,50*
700.000	NEW ZEALANDI 2,00% 20/09/2025	455.087	0,26
600.000	NEW ZEALANDI 3,00% 20/09/2030	425.544	0,24
	Nigeria	*336.352*	*0,19*
200.000	UNITED BANK FOR AFRICA PLC 7,75% 08/06/2022	165.977	0,09
200.000	ZENITH BANK PLC 7,375% 30/05/2022	170.375	0,10
	Oman	*316.536*	*0,18*
200.000	OMAN 5,625% 17/01/2028	161.158	0,09
200.000	OMAN 6,75% 17/01/2048	155.378	0,09
	Polen	*1.728.320*	*0,97*
1.600.000	POLAND 4,20% 15/04/2020	1.728.320	0,97
	Slowenien	*1.000.570*	*0,56*
1.000.000	SLOVENE EXPORT AND DEVELOPMENT BANK INC 0,875% 04/08/2018	1.000.570	0,56
	Spanien	*1.969.136*	*1,11*
200.000	ACCIONA FINANCIACION FILALES UNIPERSONAL FRN 29/12/2019	202.634	0,11
300.000	BANCO DE CREDITO SOCIAL COOPERATIVO SA VAR 03/11/2026	301.341	0,18
200.000	BANCO DE CREDITO SOCIAL COOPERATIVO SA VAR 07/06/2027	194.954	0,11
200.000	BANCO SABADELL SA VAR PERP	199.738	0,11
500.000	BANCO SANTANDER SA FRN 04/03/2020	502.867	0,29
200.000	BANCO SANTANDER SA 4,25% 11/04/2027	163.379	0,09
167.000	HAYA FINANCE 2017 SA VAR 15/11/2022	148.822	0,08
167.000	HAYA FINANCE 2017 SA 5,25% 15/11/2022	148.308	0,08
100.000	LIBERBANK SA VAR 14/03/2027	107.093	0,06
	Schweden	*2.624.560*	*1,48*
200.000	NORDEA BANK AB VAR PERPETUAL	167.820	0,09
200.000	NORDEA BANK AB VAR PERPETUAL	163.834	0,09
200.000	NORDEA BANK AB VAR PERPETUAL	182.994	0,10
700.000	SCANIA CV AB FRN 20/04/2020	701.687	0,40
300.000	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN FRN 15/09/2020	302.212	0,17
200.000	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN VAR PERPETUAL	170.112	0,10
200.000	STENA AB 7,00% 01/02/2024	158.517	0,09
250.000	SVENSKA HANDELSBANKEN AB FRN 06/09/2019	214.877	0,12
200.000	SWEDBANK AB VAR PERPETUAL	171.122	0,10
200.000	TRANSCOM HOLDING AB 6,50% 22/03/2023	195.716	0,11
100.000	UNILABS SUBHOLDING AB 5,75% 15/05/2025	95.627	0,05
100.000	VOLVO TREASURY AB VAR 03/04/2019	100.042	0,06
	Schweiz	*959.019*	*0,54*
200.000	CREDIT SUISSE GRP AG VAR PERPETUAL	167.949	0,09
100.000	CREDIT SUISSE GRP AG VAR 12/09/2025	108.025	0,06
200.000	JULIUS BAER GROUP LTD VAR PERPETUAL	154.864	0,09
150.000	SWISS LIFE AG VAR PERP	128.995	0,07
228.000	UBS GROUP AG FRN 20/09/2022	228.340	0,13
200.000	UBS INC 5,125% 15/05/2024	170.846	0,10
	Tunesien	*195.132*	*0,11*
200.000	BANQUE CENTRALE DE TUNISIE 5,625% 17/02/2024	195.132	0,11
	Vereinigtes Königreich	*8.821.467*	*4,96*
140.000	ANGLIAN WATER FINANCING PLC 4,00% 08/03/2026	145.368	0,08
300.000	ARROW GLOBAL FINANCE PLC VAR 01/04/2025	286.323	0,16
100.000	ARROW GLOBAL FINANCE PLC 5,125% 15/09/2024	104.701	0,06
200.000	BARCLAYS BANK PLC VAR 31/12/2099	250.360	0,14
191.000	BARCLAYS PLC 1,375% 24/01/2026	181.879	0,10
245.000	BAT INTL FINANCE PLC 1,625% 09/09/2019	206.294	0,12
200.000	BOPARAN FINANCE PLC 5,50% 15/07/2021	195.518	0,11
100.000	CADENT FINANCE PLC 0,625% 22/09/2024	97.789	0,05
200.000	CREDIT AGRICOLE S A LONDON BRANCH FRN 06/03/2023	198.068	0,11
200.000	CYBG PLC VAR PERPETUAL	227.385	0,13
200.000	DEBENHAMS PLC 5,25% 15/07/2021	188.084	0,11
600.000	FCE BANK PLC FRN 17/09/2019	605.796	0,35
500.000	FCE BANK PLC FRN 26/08/2020	501.538	0,28
132.000	FCE BANK PLC 0,869% 13/09/2021	133.193	0,07
204.000	HSBC HOLDINGS PLC FRN 27/09/2022	204.956	0,12
200.000	HSBC HOLDINGS PLC VAR PERP	164.420	0,09
200.000	HSBC HOLDINGS PLC VAR PERPETUAL	168.261	0,09
200.000	HSBC HOLDINGS PLC VAR 13/03/2023	168.002	0,09
100.000	HSBC HOLDINGS PLC 0,875% 06/09/2024	98.953	0,06
100.000	IDH FINANCE PLC FRN 15/08/2022	103.883	0,06
156.000	IRON MOUNTAIN UK PLC 3,875% 15/11/2025	167.550	0,09
200.000	JAGUAR LAND ROVER PLC 4,50% 01/10/2027	152.350	0,09
100.000	LLOYDS BANKING GROUP PLC VAR PERP	199.838	0,11
200.000	MARB BONDCO PLC 6,875% 19/01/2025	163.347	0,09
100.000	MATALAN FINANCE PLC 9,50% 31/01/2024	102.174	0,06
200.000	NATIONWIDE BUILDING SOCIETY VAR 08/03/2024	167.896	0,09
216.000	NATWEST MARKETS PLC FRN 02/03/2020	216.018	0,12
237.000	NATWEST MARKETS PLC 0,625% 02/03/2022	234.862	0,13
250.000	PINEWOOD FINCO PLC 3,75% 01/12/2023	283.307	0,16
200.000	PRUDENTIAL PLC 4,875% PERPETUAL	147.627	0,08
100.000	RAC BOND CO 5,00% 06/11/2022	106.694	0,06
200.000	RBS GROUP PLC FRN 15/05/2023	172.471	0,10
150.000	RBS GROUP PLC VAR PERPETUAL	147.785	0,08
118.000	SANTANDER UK GROUP HOLDINGS PLC FRN 18/05/2023	117.605	0,07
200.000	SANTANDER UK GROUP HOLDINGS PLC 2,875% 05/08/2021	166.238	0,09
200.000	SHAWBROOK GROUP PLC VAR PERPETUAL	210.931	0,12
200.000	SKY PLC FRN 01/04/2020	201.617	0,11
100.000	STRETFORD 79 4,625% 15/03/2025	102.380	0,06
200.000	TRAVELEX FINANCING PLC 8,00% 15/05/2022	194.858	0,11
200.000	TWINKLE PIZZA PLC 6,625% 01/08/2021	210.564	0,12
200.000	TWINKLE PIZZA PLC 8,625% 01/08/2022	178.784	0,10
100.000	VIRGIN MEDIA FINANCE PLC 6,375% 15/10/2024	117.794	0,07
100.000	VIRIDIAN GROUP FINANCE CO PLC 4,00% 15/09/2025	92.960	0,05
500.000	VODAFONE GROUP PLC 1,00% 11/09/2020	509.947	0,30
100.000	VOYAGE CARE BONDCO PLC 5,875% 01/05/2023	112.477	0,06
113.000	WPP FINANCE 2013 FRN 20/03/2022	112.622	0,06

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses

Wertpapierbestand zum 30.06.2018

Anzahl		Marktwert EUR	% des NIW
	Vereinigte Staaten von Amerika	*16.806.268*	*9,44*
111.000	AMERICAN HONDA FINANCE CORP FRN 09/09/2021	95.858	0,05
300.000	AMERICAN HONDA FINANCE CORP FRN 11/03/2019	300.720	0,17
130.000	AT&T INC 5,15% 15/02/2050	107.291	0,06
200.000	BANK OF AMERICA CORP FRN 07/02/2022	201.442	0,11
119.000	BANK OF AMERICA CORP FRN 21/09/2021	118.782	0,07
60.000	BAT CAPITAL CORP 2,764% 15/08/2022	49.383	0,03
103.000	BECTON DICKINSON & CO 0,368% 06/06/2019	103.336	0,06
64.000	BECTON DICKINSON & CO 2,133% 06/06/2019	54.326	0,03
100.000	BELDEN INC 3,875% 15/03/2028	94.991	0,05
56.000	CARDTRONICS INC/USA 5,50% 01/05/2025	43.287	0,02
110.000	CELANESE US HOLDINGS LLC 1,25% 11/02/2025	108.535	0,06
247.000	CITIGROUP INC FRN 21/03/2023	246.326	0,14
200.000	CITIGROUP INC 2,70% 27/10/2022	164.767	0,09
56.000	CROWN AMERICA LLC / CAPITAL CORP V 4,25% 30/09/2026	43.793	0,02
40.000	DELTA AIR LINES INC DE 2,60% 04/12/2020	33.560	0,02
61.000	DISCOVERY COMMUNICATIONS LLC FRN 20/09/2019	52.519	0,03
100.000	FORD MOTOR CREDIT CO LLC FRN 01/12/2021	99.297	0,06
109.000	FORD MOTOR CREDIT CO LLC FRN 01/12/2024	107.237	0,06
146.000	FORD MOTOR CREDIT CO LLC FRN 07/12/2022	143.671	0,08
169.000	GENERAL MOTORS FINANCIAL CO FRN 26/03/2022	168.679	0,09
206.000	GOLDMAN SACHS GROUP INC. FRN 09/09/2022	205.839	0,12
141.000	GOLDMAN SACHS GROUP INC. FRN 27/07/2021	143.213	0,08
500.000	GOLDMAN SACHS GROUP INC. FRN 29/05/2020	503.593	0,28
130.000	GOLDMAN SACHS GROUP INC. VAR PERPETUAL	109.108	0,06
83.000	GOLDMAN SACHS GROUP INC. VAR PERPETUAL	67.001	0,04
168.000	GOLDMAN SACHS GROUP INC. 1,25% 01/05/2025	167.275	0,09
78.000	HYUNDAI CAPITAL AMERICA INC FRN 12/03/2021	66.888	0,04
1.000.000	INTERNATIONAL BANK FOR RECONSTRUCTION & DEVELOPMENT 0% 28/10/2024	488.933	0,27
200.000	KEYCORP VAR PERPETUAL	166.706	0,09
100.000	KRONOS INTL BONDS 3,75% 15/09/2025	96.123	0,05
126.000	MORGAN STANLEY BAML TRUST 2012-C6 FRN 09/11/2021	125.489	0,07
291.000	MORGAN STANLEY FRN 24/10/2023	254.856	0,14
86.000	NISSAN MOTOR ACCEPTANCE CORP FRN 13/01/2020	73.943	0,04
139.000	NISSAN MOTOR ACCEPTANCE CORP FRN 13/09/2019	119.406	0,07
139.000	NISSAN MOTOR ACCEPTANCE CORP 1,90% 14/09/2021	113.465	0,06
56.000	NVIDIA CORP 2,20% 16/09/2021	46.601	0,03
200.000	PRUDENTIAL FINANCIAL INC 4,375% PERPETUAL	134.337	0,08
100.000	UNITED TECHNOLOGIES GLOBAL VAR 13/11/2019	100.214	0,06
6.000.000	USA T-BONDS 2,00% 31/08/2021	5.038.796	2,84
700.000	USA T-BONDS 2,50% 15/02/2045	548.163	0,31
5.000.000	USA T-BONDSI 0,125% 15/04/2019	4.551.369	2,56
600.000	USA T-BONDSI 0,25% 15/01/2025	528.983	0,30
800.000	USA T-BONDSI 0,625% 15/01/2026	719.061	0,40
100.000	VERIZON COMMUNICATIONS INC 1,375% 27/10/2026	99.106	0,06
	Venezuela	*35.861*	*0,02*
200.000	PETROLEOS DE VENEZUELA SA PDVSA 0% 15/11/2026 DEFAULTED	35.861	0,02
	Konvertierbare Anleihen	**1.317.250**	**0,74**
	Frankreich	*279.817*	*0,16*
3.703	FIGEAC AERO SA 1,125% 18/10/2022 CV	90.919	0,05
406	MAISONS DU MONDE SA 0,125% 06/12/2023 CV	19.682	0,01
500	UNIBAIL-RODAMCO SE 0% 01/01/2022 CV	169.216	0,10
	Deutschland	*98.916*	*0,06*
100.000	HANIEL FINANCE DEUTSCHLAND GMBH 0% 12/05/2020 CV	98.916	0,06
	Italien	*375.836*	*0,21*
100.000	PRYSMIAN SPA 0% 17/01/2022 CV	99.253	0,06
200.000	SAFILO GROUP SPA 1,25% 22/05/2019 CV	181.554	0,10
100.000	TELECOM ITALIA SPA 1,125% 26/03/2022 CV	95.029	0,05
	Jersey	*112.502*	*0,06*
100.000	BALFOUR BEATTY FINNACE NO.2 LIMITED 1,875% 03/12/2018 CV	112.502	0,06
	Niederlande	*141.256*	*0,08*
200.000	AMERICA MOVIL B.V. 5,50% 17/09/2018 CV	141.256	0,08
	Vereinigte Arabische Emirate	*93.318*	*0,05*
100.000	ABAR INVESTMENTS PJSC 0,50% 27/03/2020 CV	93.318	0,05
	Vereinigtes Königreich	*215.605*	*0,12*
200.000	VODAFONE GROUP PLC 0% 26/11/2020 CV	215.605	0,12
Anteile/Aktien von OGAW/OGA		**10.401.402**	**5,85**
	Aktien/Anteile an Investmentfonds	**10.401.402**	**5,85**
	Frankreich	*717.363*	*0,40*
44.796	LYXOR ETF COMM CRB	717.363	0,40
	Italien	*490.696*	*0,28*
183	ATLANTIC 1	51.240	0,03
69	ALPHA IMMOBILIARE SGR	97.276	0,05
57	AMUNDI RE EUROPA (D)	56.829	0,03
57	AMUNDI RE ITALIA (D)	47.652	0,03
65	BENI STABILI GESTIONI - INVEST REAL SECURITY	26.650	0,01
196	BETA IMMOBILIARE	9.682	0,01
24	IMMOBILIUM 2001	35.760	0,02
60	INVESTIETICO	1.491	0,00
39	POLIS FUND	21.528	0,01
39	SECURFONDO FONDO COMMUNE DI INVESTMENTO IMMO CHIUSO FCP	10.998	0,01
159	SOCRATE - FONDO DI INVESTIMENTO IMMOBILIARE DI TIPO	44.838	0,03
80	UNICREDITO IMMOBILIARE UNO - A	61.920	0,03
15	VALORE IMMOBILIARE GLOBALE	9.287	0,01
36	VEGAGEST EUROPA IMMOBILIARE1	15.545	0,01

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses

Wertpapierbestand zum 30.06.2018

Anzahl		Marktwert	% des NIW
		EUR	
	Jersey	*4.721.547*	*2,65*
12.844	ETC COTTON	30.131	0,02
32.830	ETFS ALUMINIUM	94.760	0,05
5.179	ETFS COMDTY SEC USD	36.884	0,02
113.351	ETFS COMMODITY SECURITIES LTD	1.027.640	0,58
3.850	ETFS COMMODITY SECURITIES LTD	47.632	0,03
4.513	ETFS COMMODITY SECURITIES LTD	28.439	0,02
25.399	ETFS COMMODITY SECURITIES LTD CERTIFICATE	276.060	0,16
11.753	ETFS COMMODITY SECURITIES LTD ETF	5.974	0,00
4.681	ETFS COPPER COMMODITY INDEX	110.735	0,06
25.252	ETFS DJ-AIGCI AGRICULTURE	94.493	0,05
11.251	ETFS METAL SEC ETFS PHYSICAL GOLD	1.154.444	0,64
1.289	ETFS METAL SECURITIES LTD CERTIFICATE ON PALLADIUM COMMODITY	99.572	0,06
7.526	ETFS PHYSICAL GOLD	772.228	0,43
3.302	ETFS PHYSICAL PLATINIUM	228.033	0,13
23.544	ETFS PHYSICAL SILVER	307.672	0,17
10.538	ETFS SOYBEANS	162.508	0,09
444.364	ETFS WHEAT	244.342	0,14
	Luxemburg	*4.209.804*	*2,37*
347	AMUNDI INDEX SOLUTIONS SHS-IE- SICAV	4.209.804	2,37
	Vereinigte Staaten von Amerika	*261.992*	*0,15*
374.405	ETFS CORN COMMODITY SEC	261.992	0,15
Derivative Instrumente		**2.474.292**	**1,39**
	Optionen	**2.474.292**	**1,39**
	Australien	*221*	*0,00*
100	LENDLEASE CORP REIT – 13,75 - 20.12.18 PUT	221	0,00
	Deutschland	*413.191*	*0,23*
36	DJ EURO STOXX 50 EUR – 2.300 - 21.12.18 PUT	2.700	0,00
36	DJ EURO STOXX 50 EUR – 2.800 - 21.12.18 CALL	204.012	0,12
18	DJ EURO STOXX 50 EUR – 3.000 - 15.03.19 PUT	13.140	0,01
24	DJ EURO STOXX 50 EUR – 3.100 - 21.12.18 PUT	14.952	0,01
16	DJ EURO STOXX 50 EUR – 3.150 - 21.09.18 PUT	5.456	0,00
24	DJ EURO STOXX 50 EUR – 3.250 - 20.07.18 PUT	3.336	0,00
31	DJ EURO STOXX 50 EUR – 3.250 - 21.12.18 CALL	61.473	0,04
27	DJ EURO STOXX 50 EUR – 3.300 - 20.07.18 PUT	5.481	0,00
29	DJ EURO STOXX 50 EUR – 3.350 - 21.09.18 PUT	22.997	0,01
27	DJ EURO STOXX 50 EUR – 3.475 - 20.07.18 CALL	4.320	0,00
16	DJ EURO STOXX 50 EUR – 3.525 - 20.07.18 CALL	816	0,00
48	DJ EURO STOXX 50 EUR – 3.550 - 17.08.18 CALL	6.048	0,00
29	DJ EURO STOXX 50 EUR – 3.575 - 21.09.18 CALL	6.351	0,00
32	DJ EURO STOXX 50 EUR – 3.600 - 20.07.18 CALL	224	0,00
57	DJ EURO STOXX 50 EUR – 3.700 - 21.12.18 CALL	12.198	0,01
32	EURO STOXX BANKS - 140 - 21.12.18 CALL	320	0,00
168	EURO STOXX BANKS - 155 - 21.12.18 CALL	420	0,00
10	MSCI EM INDEX - 1,110 - 24.09.18 PUT	34.944	0,03
9	MSCI EM INDEX - 1,270 - 21.09.18 CALL	77	0,00
16	STOXX 600 UTILITIES (PRICE) INDEX - 280 - 21.09.18 PUT	4.320	0,00
16	STOXX 600 UTILITIES (PRICE) INDEX - 310 - 21.09.18 CALL	560	0,00
27	STXE 600 BANK EURO PRICE - 160 - 21.09.18 PUT	8.708	0,00
27	STXE 600 BANK EURO PRICE - 185 - 21.09.18 CALL	338	0,00
	Italien	*35*	*0,00*
14	MINI FTSE / MIB INDEX – 25.500 - 21.09.18 CALL	35	0,00
	Japan	*232.966*	*0,13*
5	NIKKEI 225 – 19.750 - 13.12.19 PUT	38.469	0,02
3	NIKKEI 225 – 20.000 - 13.12.18 PUT	8.351	0,00
6	NIKKEI 225 – 20.250 - 14.12.18 CALL	106.246	0,07
3	NIKKEI 225 – 21.000 - 13.12.18 PUT	12.875	0,01
2	NIKKEI 225 – 21.750 - 12.07.18 PUT	2.010	0,00
2	NIKKEI 225 – 22.000 - 09.08.18 PUT	5.413	0,00
6	NIKKEI 225 – 22.125 - 12.07.18 PUT	9.743	0,01
2	NIKKEI 225 – 22.250 - 09.08.18 PUT	6.727	0,00
2	NIKKEI 225 – 22.500 - 12.07.18 CALL	2.861	0,00
4	NIKKEI 225 – 23.000 - 09.08.18 CALL	5.103	0,00
1	NIKKEI 225 – 23.000 - 12.07.18 CALL	294	0,00
2	NIKKEI 225 – 23.375 - 09.08.18 CALL	1.237	0,00
5	NIKKEI 225 – 24.000 - 13.12.19 CALL	33.637	0,02
	Luxemburg	*1.569.409*	*0,88*
3.300.000	CALL CDX OPTION - ITRAXX EUROPE CROSSOVER SERIES 29 INDEX – 287,50 - 18.07.18	329	0,00
1.000.000	EXO FX OPTION - CALL EUR / PUT ILS – 4,18 - 04.07.18	9.478	0,01
500.000	EXO FX OPTION - CALL NZD / PUT USD – 0,75 - 12.10.18	12	0,00
1.345.000	EXO FX OPTION - CALL USD / PUT JPY – 120,00 - 27.04.20	6.150	0,00
1.500.000	EXO FX OPTION - PUT AUD / CALL USD – 0,75 - 13.12.18	163	0,00
1.030.000	EXO FX OPTION - PUT EUR / CALL GBP – 0,87 - 14.01.19	2.721	0,00
750.000	EXO FX OPTION - PUT EUR / CALL GBP – 0,87 - 27.12.18	4.823	0,00
1.000.000	EXO FX OPTION - PUT EUR / CALL HUF – 318,00 - 04.07.18	16	0,00
1.000.000	EXO FX OPTION - PUT EUR / CALL PLN – 4,29 - 04.07.18	238	0,00
1.000.000	EXO FX OPTION - PUT EUR / CALL USD – 1,20 - 13.12.18	673	0,00
1.250.000	EXO FX OPTION - PUT EUR / CALL USD – 1,25 - 15.01.19	195	0,00
500.000	EXO FX OPTION - PUT NZD / CALL USD – 0,725 - 12.10.18	13.805	0,01
1.570.000	FX OPTION - CALL AUD / PUT JPY – 90,00 - 11.01.19	2.171	0,00
800.000	FX OPTION - CALL AUD / PUT NZD – 1,10 - 10.08.18	2.053	0,00
750.000	FX OPTION - CALL EUR / PUT GBP – 0,89 - 27.07.18	3.405	0,00
1.000.000	FX OPTION - CALL EUR / PUT SEK – 10,60 - 12.11.18	10.916	0,01
1.000.000	FX OPTION - CALL EUR / PUT USD – 1,17 - 30.07.18	5.078	0,00
1.000.000	FX OPTION - CALL EUR / PUT USD – 1,195 - 30.07.18	919	0,00
1.000.000	FX OPTION - CALL EUR / PUT USD – 1,215 - 30.07.18	206	0,00
1.500.000	FX OPTION - CALL EUR / PUT USD – 1,23 - 07.09.18	1.005	0,00
900.000	FX OPTION - CALL GBP / PUT USD – 1,45 - 13.09.18	155	0,00

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses

Wertpapierbestand zum 30.06.2018

Anzahl		Marktwert	% des NIW
		EUR	
1.250.000	FX OPTION - CALL NZD / PUT USD – 0,72 - 02.08.18	104	0,00
1.000.000	FX OPTION - CALL NZD / PUT USD – 0,74 - 29.06.18	-	0,00
500.000	FX OPTION - CALL NZD / PUT USD – 0,75 - 12.07.18	-	0,00
900.000	FX OPTION - CALL TRY / PUT ILS – 0,9625 - 14.09.18	7	0,00
600.000	FX OPTION - CALL USD / PUT ZAR – 13,25 - 13.08.18	25.769	0,01
1.570.000	FX OPTION - PUT AUD / CALL JPY – 80,00 - 11.01.19	31.461	0,02
800.000	FX OPTION - PUT AUD / CALL NZD – 1,06 - 10.08.18	610	0,00
1.000.000	FX OPTION - PUT EUR / CALL AUD – 1,55 - 20.08.18	4.278	0,00
1.000.000	FX OPTION - PUT EUR / CALL GBP – 0,80 - 13.11.18	260	0,00
750.000	FX OPTION - PUT EUR / CALL GBP – 0,87 - 27.07.18	1.100	0,00
500.000	FX OPTION - PUT EUR / CALL INR – 81,00 - 25.01.19	7.448	0,00
550.000	FX OPTION - PUT EUR / CALL JPY – 130,00 - 11.10.18	15.560	0,01
700.000	FX OPTION - PUT EUR / CALL NZD – 1,70 - 21.08.18	5.306	0,00
510.000	FX OPTION - PUT EUR / CALL TRY – 4,45 - 02.08.18	-	0,00
500.000	FX OPTION - PUT EUR / CALL TRY – 5,00 - 21.01.19	1.405	0,00
1.000.000	FX OPTION - PUT EUR / CALL TRY – 5,25 - 09.07.18	5.733	0,00
1.000.000	FX OPTION - PUT EUR / CALL USD – 1,145 - 30.07.18	4.411	0,00
1.500.000	FX OPTION - PUT EUR / CALL USD – 1,15 - 07.09.18	13.259	0,01
1.250.000	FX OPTION - PUT EUR / CALL USD – 1,20 - 15.01.19	43.285	0,02
550.000	FX OPTION - PUT EUR / CALL USD – 1,23 - 11.10.18	31.256	0,02
1.000.000	FX OPTION - PUT EUR / CALL USD – 1,23 - 17.09.18	57.851	0,03
1.250.000	FX OPTION - PUT NZD / CALL USD – 0,68 - 02.08.18	10.257	0,01
1.000.000	FX OPTION - PUT NZD / CALL USD – 0,715 - 29.06.18	33.535	0,02
500.000	FX OPTION - PUT NZD / CALL USD – 0,725 - 12.07.18	21.021	0,01
695.000	FX OPTION - PUT SGD / CALL TRY – 2,70 - 13.09.18	1	0,00
800.000	FX OPTION - PUT SGD / CALL TRY – 2,74 - 10.08.18	-	0,00
700.000	FX OPTION - PUT USD / CALL CNH – 6,30 - 01.08.18	25	0,00
545.000	FX OPTION - PUT USD / CALL INR – 70,50 - 22.10.18	8.798	0,00
1.200.000	FX OPTION - PUT USD / CALL JPY – 108,00 - 05.07.18	189	0,00
8.500.000	SWAP OPTION - PAY EURIBOR 6M / REC 0,200% - 17.07.18	56.608	0,03
11.500.000	SWAP OPTION - PAY EURIBOR 6M / REC 0,270% - 01.10.18	84.387	0,05
8.300.000	SWAP OPTION - PAY EURIBOR 6M / REC 0,700% - 09.03.20	79.621	0,04
6.000.000	SWAP OPTION - PAY EURIBOR 6M / REC 2,000% - 12.04.28	89.853	0,06
12.500.000	SWAP OPTION - PAY LIBOR 3M / REC 2,000% - 11.12.18	855	0,00
14.000.000	SWAP OPTION - PAY LIBOR 3M / REC 2,500% - 10.09.18	1.358	0,00
3.000.000	SWAP OPTION - PAY LIBOR 3M / REC 2,700% - 19.07.18	1.170	0,00
325.000.000	SWAP OPTION - PAY LIBOR 6M / REC 0,840% - 12.04.28	41.569	0,02
17.000.000	SWAP OPTION - PAY SAIBOR 3M / REC 3,470% - 10.06.19	19.416	0,01
42.500.000	SWAP OPTION - PAY STIBOR 3M / REC 2,060% - 14.04.25	59.463	0,03
15.000.000	SWAP OPTION - PAY TELBOR 3M / REC 0,600% - 22.05.19	-	0,00
150.000.000	SWAP OPTION - PAY 0,350% / REC LIBOR 6M - 28.09.18	855	0,00
325.000.000	SWAP OPTION - PAY 0,840% / REC LIBOR 6M - 12.04.28	38.192	0,02
3.150.000	SWAP OPTION - PAY 1,000% / REC LIBOR 6M - 17.09.18	7.686	0,00
75.000.000	SWAP OPTION - PAY 1,050% / REC LIBOR 6M - 28.09.18	6	0,00
500.000	SWAP OPTION - PAY 1,500% / REC LIBOR 6M - 21.04.27	84.934	0,05
6.000.000	SWAP OPTION - PAY 2,000% / REC EURIBOR 6M - 12.04.28	89.153	0,06
750.000	SWAP OPTION - PAY 2,000% / REC EURIBOR 6M - 23.02.33	60.698	0,03
42.500.000	SWAP OPTION - PAY 2,060% / REC STIBOR 3M - 14.04.25	54.850	0,03
12.500.000	SWAP OPTION - PAY 2,150% / REC LIBOR 3M - 09.11.18	155.852	0,10
650.000	SWAP OPTION - PAY 2,150% / REC LIBOR 6M - 05.10.18	1.002	0,00
1.700.000	SWAP OPTION - PAY 2,500% / REC LIBOR 3M - 12.09.22	51.914	0,03
350.000	SWAP OPTION - PAY 2,690% / REC LIBOR 3M - 05.04.19	21.042	0,01
1.000.000	SWAP OPTION - PAY 3,050% / REC LIBOR 3M - 18.02.20	45.519	0,03
1.600.000	SWAP OPTION - PAY 3,060% / REC LIBOR 3M - 15.02.23	122.421	0,08
17.000.000	SWAP OPTION - PAY 3,470% / REC SAIBOR 3M - 10.06.19	13.545	0,01
	Niederlande	*19.310*	*0,01*
12	AMSTERDAM EXCHANGES INDEX - 510 - 21.09.18 PUT	4.740	0,00
12	AMSTERDAM EXCHANGES INDEX - 560 - 21.09.18 CALL	9.240	0,01
26	AMSTERDAM EXCHANGES INDEX - 580 - 21.09.18 CALL	5.330	0,00
	Singapur	*2.082*	*0,00*
11	SGX CNX NIFTY INDEX - 10,200 - 30.08.18 PUT	1.375	0,00
11	SGX CNX NIFTY INDEX - 10,300 - 26.07.18 PUT	707	0,00
	Südkorea	*19.966*	*0,01*
8	KOSPI 2000 - 305 - 13.09.18 PUT	19.674	0,01
8	KOSPI 2000 - 335 - 13.09.18 CALL	292	0,00
	Schweiz	*9.150*	*0,01*
8	SMI (ZURICH) - 8,850 - 20.12.18 CALL	9.150	0,01
	Vereinigtes Königreich	*36.434*	*0,02*
8	FOOTSIE 100 – 6.650 - 21.12.18 PUT	7.327	0,00
8	FOOTSIE 100 – 7.175 - 21.09.18 PUT	6.242	0,00
11	FOOTSIE 100 – 7.200 - 21.09.18 PUT	8.957	0,02
23	FOOTSIE 100 - 7.875 - 20.07.18 CALL	3.641	0,00
22	FOOTSIE 100 – 8.000 - 21.09.18 CALL	8.458	0,00
8	FOOTSIE 100 – 8.100 - 21.09.18 CALL	1.809	0,00
	Vereinigte Staaten von Amerika	*171.528*	*0,10*
20	10YR US TREASRY NOTE – 119,00 - 24.08.18 PUT	4.282	0,00
53	10YR US TREASRY NOTE – 119,50 - 24.08.18 PUT	17.732	0,02
20	10YR US TREASRY NOTE – 120,00 - 24.08.18 CALL	13.918	0,02
53	10YR US TREASRY NOTE – 120,50 - 24.08.18 CALL	24.824	0,02
7	10YR US TREASRY NOTE – 120,50 - 27.07.18 CALL	1.967	0,00

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses

Wertpapierbestand zum 30.06.2018

Anzahl		Marktwert	% des NIW
		EUR	
7	10YR US TREASRY NOTE – 121,00 - 27.07.18 CALL	1.031	0,00
36	ALLY FINANCIAL INC – 15,00 - 18.01.19 PUT	463	0,00
9	ANADARKO PETROLEUM CORP – 50,00 - 18.01.19 PUT	424	0,00
9	ANHEUSER-BUSCH – 105,00 - 18.01.19 PUT	7.169	0,00
11	APACHE CORP – 40,00 - 18.01.19 PUT	1.818	0,00
12	AVIS BUDGET GROUP – 33,00 - 17.01.20 PUT	7.297	0,00
48	DOW JONES INDUSTRIAL AVG - 280 - 21.09.18 CALL	1.028	0,00
48	DOW JONES INDUSTRIAL AVG - 290 - 21.12.18 CALL	1.850	0,00
33	GEN GROWTH PROP – 17,74 - 18.01.19 PUT	989	0,00
27	GOODYEAR TYRE & RUBBER CO – 23,00 - 18.01.19 PUT	3.006	0,00
16	INTERNATIONAL PAPER – 38,00 - 18.01.19 PUT	343	0,00
13	KRAFT HEINZ CO/THE – 70,00 - 17.01.20 PUT	12.025	0,02
1	NASDAQ 100 – 7.000 - 19.07.18 PUT	7.434	0,00
1	NASDAQ 100 – 7.300 - 19.07.18 CALL	2.557	0,00
3	NASDAQ 100 – 7.500 - 19.07.18 CALL	771	0,00
17	NEWFIELD EXPLORATN – 25,00 - 18.01.19 PUT	1.747	0,00
15	ONEOK INC – 40,00 - 18.01.19 PUT	437	0,00
17	RESTAURANT BRANDS USD – 50,00 - 19.10.18 PUT	990	0,00
4	RUSSELL 2000 MINI – 1,625 - 19.07.18 PUT	4.515	0,00
4	RUSSELL 2000 MINI - 1,705 - 19.07.18 CALL	1.576	0,00
4	S&P 500 INDEX – 2.400 - 21.12.18 PUT	11.474	0,01
4	S&P 500 INDEX – 2.700 - 31.07.18 PUT	8.222	0,00
5	S&P 500 INDEX – 2.730 - 29.06.18 PUT	835	0,00
4	S&P 500 INDEX – 2.800 - 31.07.18 CALL	3.392	0,00
4	S&P 500 INDEX – 2.840 - 29.06.18 CALL	10	0,00
8	S&P 500 INDEX – 2.850 - 19.07.18 CALL	480	0,00
16	S&P 500 INDEX – 2.850 - 29.06.18 CALL	69	0,00
4	S&P 500 INDEX – 2.900 - 21.12.18 CALL	10.278	0,01
4	S&P 500 INDEX – 2.900 - 28.09.18 CALL	2.117	0,00
13	SPI 200 INDEX – 5.650 - 20.09.18 PUT	2.641	0,00
13	SPI 200 INDEX – 5.875 - 19.07.18 PUT	823	0,00
13	SPI 200 INDEX – 6.150 - 19.07.18 CALL	7.947	0,00
11	US 5YR T-NOTES – 114,00 - 27.07.18 CALL	1.399	0,00
11	US 5YR T-NOTES – 114,25 - 27.07.18 CALL	957	0,00
28	WILLIAMS COMPANIES INC – 20,00 - 18.01.19 PUT	648	0,00
10	WYNN RESORTS – 60,00 - 18.01.19 PUT	43	0,00
Short-Positionen		**-1.074.844**	**-0,60**
Derivative Instrumente		**-1.074.844**	**-0,60**
	Optionen	**-1.074.844**	**-0,60**
	Deutschland	*-140.087*	*-0,08*
-29	DJ EURO STOXX 50 EUR – 3.075 - 21.09.18 PUT	-10.121	-0,01
-16	DJ EURO STOXX 50 EUR – 3.100 - 17.08.18 PUT	-2.560	0,00
-17	DJ EURO STOXX 50 EUR – 3.100 - 21.09.18 PUT	-4.794	0,00
-27	DJ EURO STOXX 50 EUR – 3.200 - 20.07.18 PUT	-2.187	0,00
-19	DJ EURO STOXX 50 EUR – 3.200 - 21.12.18 PUT	-16.359	-0,01
-16	DJ EURO STOXX 50 EUR – 3.275 - 20.07.18 PUT	-2.736	0,00
-18	DJ EURO STOXX 50 EUR – 3.550 - 15.03.19 CALL	-12.654	-0,01
-16	EURO STOXX BANKS - 105 - 21.12.18 PUT	-4.200	0,00
-56	EURO STOXX BANKS - 120 - 21.12.18 PUT	-38.500	-0,02
-16	EURO STOXX BANKS - 90 - 21.12.18 PUT	-1.400	0,00
-10	MSCI EM INDEX - 1,010 - 24.09.18 PUT	-12.248	-0,01
-6	MSCI EM INDEX - 1,090 - 21.09.18 PUT	-17.318	-0,01
-21	STOXX EUROPE 600 AUTOMOBILES & PARTS - 590 - 21.12.18 CALL	-13.650	-0,01
-16	STOXX 600 UTILITIES (PRICE) INDEX - 260 - 21.09.18 PUT	-1.360	0,00
	Italien	*-6.370*	*0,00*
-7	MINI FTSE / MIB INDEX – 20.000 - 21.09.18 PUT	-6.370	0,00
	Japan	*-28.842*	*-0,02*
-5	NIKKEI 225 – 20.250 - 14.12.18 PUT	-15.851	-0,02
-2	NIKKEI 225 – 21.000 - 09.08.18 PUT	-2.629	0,00
-6	NIKKEI 225 – 21.375 - 12.07.18 PUT	-4.176	0,00
-5	NIKKEI 225 – 24.500 - 14.12.18 CALL	-6.186	0,00
	Luxemburg	*-500.958*	*-0,28*
-1.000.000	FX OPTION - CALL EUR / PUT USD – 1,17 - 30.07.18	-5.078	0,00
-1.000.000	FX OPTION - CALL EUR / PUT USD – 1,195 - 30.07.18	-919	0,00
-1.000.000	FX OPTION - CALL EUR / PUT USD – 1,215 - 30.07.18	-206	0,00
-500.000	FX OPTION - CALL EUR / PUT USD – 1,30 - 17.09.18	-26	0,00
-900.000	FX OPTION - CALL GBP / PUT USD – 1,50 - 13.09.18	-38	0,00
-1.000.000	FX OPTION - PUT EUR / CALL AUD – 1,50 - 20.08.18	-579	0,00
-700.000	FX OPTION - PUT EUR / CALL NZD – 1,65 - 21.08.18	-1.047	0,00
-1.000.000	FX OPTION - PUT EUR / CALL TRY – 4,95 - 09.07.18	-106	0,00
-1.000.000	FX OPTION - PUT EUR / CALL USD – 1,145 - 30.07.18	-4.411	0,00
-500.000	FX OPTION - PUT NZD / CALL USD – 0,65 - 11.10.18	-2.027	0,00
-1.400.000	FX OPTION - PUT USD / CALL CNH – 6,20 - 01.08.18	-14	0,00
-545.000	FX OPTION - PUT USD / CALL INR – 70,50 - 22.10.18	-8.798	0,00
-3.300.000	PUT CDX OPTION - ITRAXX EUROPE CROSSOVER SERIES 29 INDEX – 337,50 - 18.07.18	-17.041	-0,01
-5.800.000	SWAP OPTION - PAY EURIBOR 6M / REC 0,500% - 01.10.18	-430	0,00
-1.700.000	SWAP OPTION - PAY EURIBOR 6M / REC 2,000% - 23.02.23	-26.716	-0,02
-12.500.000	SWAP OPTION - PAY LIBOR 3M / REC 2,500% - 11.12.18	-93.744	-0,05
-950.000	SWAP OPTION - PAY LIBOR 3M / REC 2,600% - 05.04.19	-31.533	-0,02
-2.400.000	SWAP OPTION - PAY LIBOR 3M / REC 3,130% - 18.02.20	-48.058	-0,03
-7.000.000	SWAP OPTION - PAY LIBOR 3M / REC 3,330% - 15.02.23	-117.402	-0,07
-75.000.000	SWAP OPTION - PAY LIBOR 6M / REC 0,750% - 28.09.18	-591	0,00
-1.000.000	SWAP OPTION - PAY LIBOR 6M / REC 1,750% - 05.10.18	-4.941	0,00
-8.500.000	SWAP OPTION - PAY 0,050% / REC EURIBOR 6M - 17.07.18	-19.203	-0,01
-11.500.000	SWAP OPTION - PAY 0,100% / REC EURIBOR 6M - 01.10.18	-32.131	-0,02
-12.500.000	SWAP OPTION - PAY 0,200% / REC EURIBOR 6M - 09.03.20	-37.097	-0,02
-500.000	SWAP OPTION - PAY 0,500% / REC LIBOR 6M - 21.04.21	-4.990	0,00
-3.150.000	SWAP OPTION - PAY 1,150% / REC LIBOR 6M - 17.09.18	-9.493	-0,01

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses

Wertpapierbestand zum 30.06.2018

Anzahl		Marktwert	% des NIW
		EUR	
-3.150.000	SWAP OPTION - PAY 1,300% / REC LIBOR 6M - 17.09.18	-18.056	-0,01
-1.700.000	SWAP OPTION - PAY 2,000% / REC LIBOR 3M - 12.09.22	-16.283	-0,01
	Schweiz	*-7.398*	*0,00*
-9	SMI (ZURICH) - 7,500 - 20.12.18 PUT	-7.398	0,00
	Vereinigtes Königreich	*-3.732*	*0,00*
-11	FOOTSIE 100 – 6.800 - 21.09.18 PUT	-3.732	0,00
	Vereinigte Staaten von Amerika	*-387.457*	*-0,22*
-27	10YR US TREASRY NOTE – 118,00 - 24.08.18 PUT	-2.529	0,00
-26	10YR US TREASRY NOTE – 122,00 - 24.08.18 CALL	-3.828	0,00
-1	NASDAQ 100 – 6.800 - 19.07.18 PUT	-3.990	0,00
-3	RUSSELL 2000 MINI - 1,410 - 21.09.18 PUT	-1.755	0,00
-3	S&P 500 INDEX – 2.300 - 21.09.18 PUT	-2.107	0,00
-4	S&P 500 INDEX – 2.325 - 21.12.18 PUT	-10.449	-0,01
-2	S&P 500 INDEX – 2.375 - 20.12.18 PUT	-6.095	0,00
-4	S&P 500 INDEX – 2.400 - 20.12.19 PUT	-38.320	-0,02
-9	S&P 500 INDEX – 2.425 - 21.12.18 CALL	-261.085	-0,16
-2	S&P 500 INDEX – 2.500 - 20.12.18 PUT	-8.068	0,00
-2	S&P 500 INDEX – 2.500 - 28.09.18 PUT	-4.008	0,00
-2	S&P 500 INDEX – 2.590 - 19.07.18 PUT	-942	0,00
-4	S&P 500 INDEX – 2.900 - 20.12.19 CALL	-44.034	-0,03
-13	SPI 200 INDEX – 5.425 - 19.07.18 PUT	-247	0,00
Gesamt-Wertpapierbestand		**154.030.519**	**86,60**

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses

Wertpapierbestand zum 30.06.2018

Anzahl		Marktwert	% des NIW
		EUR	
Long-Positionen		**106.910.832**	**92,81**
Zur amtlichen Notierung an einer Wertpapierbörse zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte, übertragbare Wertpapiere		**76.672.471**	**66,56**
	Anteile	**4.966.698**	**4,31**
	Österreich	*27.238*	*0,02*
428	AMS	27.238	0,02
	Belgien	*35.811*	*0,03*
414	ANHEUSER BUSCH INBEV SA/NV	35.811	0,03
	Kanada	*36.621*	*0,03*
3.249	BARRICK GOLD NYS (USD)	36.621	0,03
	Cayman Islands	*382.263*	*0,33*
444	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	70.676	0,06
141	BAIDU ADS	29.702	0,03
26.000	CHINA MAPLE LEAF EDUCATIONAL	40.136	0,03
850	CTRIP.COM INTERNATIONAL ADR	34.574	0,03
16.000	GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD	35.546	0,03
879	HUAZHU GROUP LTD ADR	31.454	0,03
541	NW ORIENTL ED & TECHNO GP ADR	43.473	0,04
1.846	TAL EDUCATION GROUP	58.010	0,05
900	TENCENT HOLDINGS LTD	38.692	0,03
	China	*175.279*	*0,15*
7.000	BYD CO LTD-H	36.338	0,03
49.000	CHINA COMMUNICATIONS CONSTR - H	40.548	0,04
72.000	CHINA RAILWAY SIGNAL & COMMUNICATION CORPORATION LTD	43.782	0,03
44.000	GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	28.821	0,03
30.800	GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD	25.790	0,02
	Frankreich	*272.331*	*0,24*
1.606	ALSTOM	63.212	0,06
501	CAP GEMINI SE	57.715	0,05
494	SCHNEIDER ELECTRIC SA	35.281	0,03
333	THALES SA	36.747	0,03
502	VINCI SA	41.345	0,04
1.811	VIVENDI	38.031	0,03
	Deutschland	*587.627*	*0,51*
417	BASF SE	34.156	0,03
364	BAYER AG	34.343	0,03
2.091	DEUTSCHE WOHNEN AG REIT	86.568	0,07
7.191	E.ON SE	65.826	0,06
478	LEG IMMOBILIEN REIT	44.492	0,04
198	LINDE AG	35.412	0,03
4.097	RWE AG	79.995	0,06
472	SIEMENS AG-NOM	53.440	0,05
4.053	TAG IMMOBBILIEN AG	76.318	0,07
1.891	VONOVIA SE NAMEN AKT REIT	77.077	0,07
	Hongkong (China)	*8.576*	*0,01*
3.200	CHINA TAIPING INSURANCE HOLD SHS -H-	8.576	0,01
	Japan	*960.946*	*0,83*
200	FANUC LTD	34.031	0,03
2.100	GMO INTERNET	42.853	0,04
900	HARMONIC DRIVE SYSTEMS	32.639	0,03
6.000	HITACHI LTD	36.262	0,03
100	KEYENCE CORP	48.375	0,04
1.900	MINEBEA MITSUMI INC	27.532	0,02
4.300	MITSUBISHI CHEMICAL HOLDINGS	30.836	0,03
1.100	NGK SPARK PLUG	26.878	0,02
300	NIDEC CORP	38.566	0,03
600	ORIENTAL LAND	53.934	0,05
3.500	PANASONIC CORP	40.420	0,04
3.500	RECRUIT HOLDING CO LTD	82.979	0,07
1.900	SBI HOLDINGS	41.930	0,04
1.100	SOFTBANK GROUP CORP	67.817	0,06
1.300	SONY CORP	56.936	0,05
1.800	SUMCO CORP	31.136	0,03
1.200	SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GRP	39.956	0,03
1.200	SUMITOMO MITSUI TRUST HLD	40.763	0,04
800	TERUMO CORP	39.281	0,03
800	TREND MICRO INC	39.096	0,03
1.300	UNI-CHARM CORP	33.504	0,03
1.200	YASKAWA ELECTRIC CORP	36.327	0,03
1.000	ZENKOKU HOSHO CO LTD	38.895	0,03
	Jersey	*77.650*	*0,07*
23.493	CENTAMIN	31.613	0,03
662	FERGUSON PLC	46.037	0,04
	Luxemburg	*87.236*	*0,08*
2.351	GRAND CITY PROPERTIES S.A.	52.286	0,05
2.224	TENARIS SA	34.950	0,03
	Niederlande	*290.924*	*0,25*
689	FERRARI NV	80.268	0,07
3.459	FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	56.499	0,05
2.968	KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE	60.859	0,05
640	KONINKLIJKE DSM NV	55.117	0,05
402	LYONDELLBASELL	38.181	0,03
	Spanien	*71.433*	*0,06*
5.822	OBRASCON HUARTE LAIN SA	15.958	0,01
3.309	REPSOL	55.475	0,05
	Schweiz	*40.469*	*0,04*
1.414	COCA COLA HBC GBP	40.469	0,04
	Vereinigtes Königreich	*291.799*	*0,25*
2.563	BHP BILLITON PLC	49.443	0,04
10.025	BP PLC	65.556	0,06
970	RIO TINTO PLC	46.079	0,04
2.105	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A	62.666	0,05
779	SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC	31.926	0,03
1.321	TECHNIPFMC PLC EUR	36.129	0,03

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses

Wertpapierbestand zum 30.06.2018

Anzahl		Marktwert EUR	% des NIW
	Vereinigte Staaten von Amerika	*1.620.495*	*1,41*
540	ACTIVISION BLIZZARD INC	35.294	0,03
879	ALCOA CORP	35.143	0,03
44	ALPHABET INC	42.736	0,04
28	AMAZON.COM	40.932	0,04
979	ANADARKO PETROLEUM CORP	61.740	0,05
284	ANTHEM INC	58.758	0,05
238	APPLE INC	37.942	0,03
355	AUTODESK INC	39.983	0,03
1.156	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	44.693	0,04
1.009	CONOCOPHILLIPS	60.240	0,05
175	COOPER COMPANIES INC	35.433	0,03
1.042	CSX CORP	57.341	0,05
308	DEERE & CO	37.428	0,03
1.097	DEVON ENERGY CORPORATION	41.604	0,04
287	ELECTRONIC ARTS INC	34.634	0,03
245	FACEBOOK A	41.120	0,04
474	FMC CORP	36.461	0,03
855	FORTIVE CORP - W/I	56.541	0,05
420	HOME DEPOT INC	70.616	0,06
322	IAC/INTERACTIVECOR	42.069	0,04
150	ILLUMINA	35.767	0,03
108	INTUITIVE SURGICAL	44.293	0,04
886	MARATHON PETROLEUM	53.514	0,05
1.817	NEWMONT MINING CORP	59.262	0,05
1.257	NOBLE ENERGY	38.144	0,03
160	NVIDIA CORP	32.626	0,03
199	PALO ALTO NETWORKS INC	35.172	0,03
345	PROOFPOINT INC	34.020	0,03
323	SALESFORCE.COM	37.702	0,03
358	SPLUNK INC	30.276	0,03
450	TAKE TWO INTERACTIVE SOFTWARE	45.888	0,04
428	TIFFANY & CO	48.506	0,04
1.269	TRIMBLE NAVIGATION	36.096	0,03
361	UNITED PARCEL SERVICE-B	33.078	0,03
253	UNITED RENTALS INC	32.417	0,03
807	VERIZON COMMUNICATIONS INC	34.933	0,03
386	WALT DISNEY COMPANY	34.810	0,03
349	ZEBRA TECH -A-	43.283	0,04
	Anleihen	**70.500.903**	**61,20**
	Argentinien	*36.733*	*0,03*
73.000	YPF SOCIEDAD ANONIMA 0% 07/07/2020	36.733	0,03
	Australien	*1.705.170*	*1,48*
1.000.000	AUSTRALIA I %1,25 21/02/2022	736.340	0,64
250.000	AUSTRALIAI 0,75% 21/11/2027	161.703	0,14
900.000	AUSTRALIAI 3,00% 20/09/2025	807.127	0,70
	Österreich	*160.821*	*0,14*
167.000	AT &S AUSTRIA TECHNOLOGIE & SYSTEMTECHNIK AG VAR PERPETUAL	160.821	0,14
	Belgien	*248.224*	*0,22*
100.000	BELFIUS BANQUE SA/NV 1,00% 26/10/2024	97.585	0,08
200.000	BNP PARIBAS FORTIS SA VAR PERPETUAL	150.639	0,14
	Kanada	*4.718.805*	*4,10*
500.000	CANADAI 1,25% 01/12/2047	429.193	0,37
3.000.000	CANADAI 4,25% 01/12/2021	3.561.599	3,09
350.000	CANADAI 4,25% 01/12/2026	456.630	0,40
200.000	ITHACA ENERGY INC 8,125% 01/07/2019	170.802	0,15
100.000	ROYAL BANK OF CANADA FRN 06/08/2020	100.581	0,09
	Cayman Islands	*293.889*	*0,26*
200.000	CK HUTCHISON FINANCE 16 VAR PERPETUAL	164.439	0,15
124.000	VIRIDIAN GRP FUNDCO 2 4,75% 15/09/2024	129.450	0,11
	China	*413.903*	*0,36*
525.000	UNION LIFE INSURANCE CO LTD 3,00% 19/09/2021	413.903	0,36
	Dänemark	*192.316*	*0,17*
100.000	JYSKE BANK A/S FRN 01/12/2022	100.776	0,09
100.000	NORICAN A/S 4,50% 15/05/2023	91.540	0,08
	Finnland	*131.775*	*0,11*
140.000	STOCKMANN PIC 4,75% 11/01/2022	131.775	0,11
	Frankreich	*2.843.081*	*2,47*
100.000	3AB OPTIQUE DEVELOPMENT VAR 01/10/2023	94.928	0,08
100.000	3AB OPTIQUE DEVELOPMENT 4,00% 01/10/2023	94.231	0,08
100.000	ALD INTERNATIONAL FRN 26/02/2021	99.708	0,09
208.000	BNP PARIBAS SA FRN 22/09/2022	209.145	0,18
200.000	BNP PARIBAS SA VAR PERPETUAL	178.682	0,16
200.000	BNP PARIBAS SA VAR PERPETUAL	170.047	0,15
200.000	CMA CGM 5,25% 15/01/2025	162.098	0,14
100.000	CROWN EUROPEAN HOLDINGS 2,875% 01/02/2026	94.533	0,08
100.000	ENGIE SA VAR PERPETUAL	93.609	0,08
300.000	HOLDIKKS SAS 6,75% 15/07/2021	140.601	0,12
100.000	ILIAD SA 1,50% 14/10/2024	96.225	0,08
200.000	INFRA PARK 2,00% 06/07/2029	198.046	0,17
104.000	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE VAR 26/11/2018	104.098	0,09
100.000	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE 0% 26/05/2020	100.169	0,09
250.000	MARCOLIN SPA VAR 15/02/2023	247.755	0,22
200.000	MERCIALYS 2,00% 03/11/2027	201.516	0,17
100.000	RCI BANQUE SA 0,25% 12/07/2021	99.515	0,09
100.000	SANOFI SA VAR 21/03/2020	100.408	0,09
100.000	TIKEHAU CAPITAL PARTNERS 3,00% 27/11/2023	96.788	0,08
200.000	VALLOUREC 2,25% 30/09/2024	159.690	0,14
100.000	VALLOUREC 6,625% 15/10/2022	101.289	0,09
	Deutschland	*14.243.581*	*12,37*
350.000	CBR FASHION HOLDING GMBH 5,125% 01/10/2022	298.599	0,26
100.000	DEUTSCHE BANK AG FRN 16/05.2022	96.024	0,08
300.000	DEUTSCHE PFANDBRIEFBANK AG 4,60% 22/02/2027	306.573	0,27

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses

Wertpapierbestand zum 30.06.2018

Anzahl		Marktwert	% des NIW
		EUR	
6.000.000	GERMANY BUNDI 0,10% 15/04/2023	6.925.845	6,01
5.000.000	GERMANY BUNDI 1,75% 15/04/2020	5.970.719	5,18
100.000	HBO S STERLING FINANCE JERSEY LP VAR PERPETUAL	164.637	0,14
100.000	NIDDA BONDCO GMBH 5,00% 30/09/2025	91.233	0,08
100.000	SAP SE VAR 13/03/2021	100.449	0,09
100.000	TALANX AG VAR 05/12/2047	90.037	0,08
100.000	UNIPER SE 0,125% 08/12/2018	100.084	0,09
100.000	VOLKSWAGEN BANK GMBH FRN 15/06/2021	99.381	0,09
	Griechenland	*147.402*	*0,13*
150.000	PIRAEUS BANK SA FRN 31/10/2022	147.402	0,13
	Guernsey	*95.352*	*0,08*
100.000	SUMMIT GERMANY LTD 2,00% 31/01/2025	95.352	0,08
	Hongkong (China)	*158.588*	*0,14*
200.000	WELL HOPES DEVELOPMENT HOLDINGS LIMITED VAR PERPETUAL	158.588	0,14
	Island	*198.053*	*0,17*
100.000	LANDSBANKINN HF 1,00% 30/05/2023	98.888	0,09
100.000	LSLANDSBANKI HF VAR 19/01/2024	99.165	0,08
	Irland	*367.152*	*0,32*
200.000	FCA CAPITAL IRELAND PLC FRN 12/02/2019	200.162	0,18
150.000	VIRGIN MEDIA RECEIVABLES FINANCING NOTES I DESIGNATED 5,50% 15/09/2024	166.990	0,14
	Italien	*19.446.746*	*16,87*
100.000	ANSALDO ENERGIA S.P.A 2,75% 31/05/2024	89.117	0,08
122.000	BANCA FARMAFACTORING SPA FRN 05/06/2020	116.466	0,10
250.000	BORMIOLI PHARMA BIDCO S P A VAR 15/11/2024	243.243	0,21
100.000	CMC RAVENNA 6,00% 15/02/2023	84.478	0,07
200.000	CMF 9,00% 15/06/2022	170.488	0,15
100.000	COOPERATIVA MURATORI & C 6,875% 01/08/2022	89.113	0,08
200.000	ERG SPA 2,175% 19/01/2023	188.804	0,16
100.000	ICCREA BANCA SPA FRN 18/06/2025	90.375	0,08
200.000	ICCREA BANCA SPA 1,875% 25/11/2019	200.262	0,17
200.000	INTESA SANPAOLO SPA 5,017% 26/06/2024	154.777	0,13
1.700.000	ITALY BTP 0% 30/05/2019	1.696.328	1,47
1.000.000	ITALY BTP 0% 30/10/2019	994.110	0,86
650.000	ITALY BTP 0,05% 15/10/2019	646.276	0,56
250.000	ITALY BTP 1,50% 01/08/2019	253.080	0,22
300.000	ITALY BTP 2,50% 01/05/2019	305.691	0,27
2.500.000	ITALY BTPI 0,50% 20/04/2023	2.463.544	2,14
6.000.000	ITALY BTPI 1,25% 27/10/2020	6.163.617	5,36
2.500.000	ITALY BTPI 1,65% 23/04/2020	2.574.261	2,23
600.000	ITALY CCT FRN 15/11/2019	602.616	0,52
141.000	KEDRION SPA 3,00% 12/07/2022	135.652	0,12
100.000	LIMACORPORATE SPA VAR 15/08/2023	97.509	0,08
200.000	L'ISOLANTE K-FLEX SPA 4,25% 07/10/2023	203.178	0,18
200.000	MEDIOBANCA BANCA DI CREDITO FINANZIARIO S P A VAR 30/09/2018	201.796	0,18
200.000	MERCEDES BENZ FINANCIAL SERVICES ITALIA SPA FRN 22/06/2020	199.696	0,17
200.000	OFFICINE MACCAFERRI SPA 5,75% 01/06/2021	199.904	0,17
200.000	PIRELLI C SPA 1,375% 25/01/2023	193.452	0,17
110.000	PRO GEST SPA 3,25% 15/12/2024	104.377	0,09
150.000	SALINI SPA 1,75% 26/10/2024	129.057	0,11
200.000	SNAM SPA FRN 02/08/2024	196.956	0,17
100.000	UNICREDIT SPA VAR 31.08.2024	93.679	0,08
160.000	UNIONE DI BANCHE ITALIAN 0,75% 17/10/2022	150.147	0,13
200.000	WIND TRE S P A VAR 20/01/2024	166.108	0,14
200.000	WIND TRE S P A 2,625% 20/01/2023	167.750	0,15
100.000	WIND TRE S P A 3,125% 20/01/2025	80.839	0,07
	Japan	*3.813.704*	*3,31*
424.000.000	JAPAN JGBI 0,10% 10/03/2026	3.481.247	3,02
234.000	MITSUBISHI UFJI LEASE & FINANCE CO LTD 2,25% 07/09/2021	191.886	0,17
171.000	SUMITOMO MITSUI FINANCIAL CORP INC 2,058% 14/07/2021	140.571	0,12
	Jersey	*205.172*	*0,18*
200.000	ADIENT GLOBAL HOLDINGS LTD 4,875% 15/08/2026	154.169	0,14
100.000	EURO DM SECURITIES 0% 08/04/2021	51.003	0,04
	Kenia	*170.782*	*0,15*
200.000	EASTERN AND SOUTHERN 5,375% 14/03/2022	170.782	0,15
	Luxemburg	*1.641.403*	*1,42*
145.000	ALLERGAN FUNDING SCS FRN 01/06/2019	145.094	0,13
100.000	ARCELORMITTAL SA 0,95% 17/01/2023	98.168	0,09
80.000	BC LUCXO 1 SA 6,125% 10/08/2022	65.795	0,06
100.000	CNH INDUSTRIAL FINANCE EUROPE S A 1,375% 23/05/2022	100.851	0,09
100.000	CNH INDUSTRIAL FINANCE EUROPE S A 1,75% 12/09/2025	96.845	0,08
150.000	CRYSTAL ALMOND S A R L 10,00% 01/11/2021	158.915	0,13
100.000	GALAPAGOS HOLDING SA 7,00% 15/06/2022	56.090	0,05
137.000	GARFUNKELUX HOLDCO 3 SA VAR 01/09/2023	121.044	0,11
100.000	KLEOPATRA HOLDINGS 8,50% 30/06/2023	74.785	0,06
300.000	LECTA SA 6,50% 01/08/2023	295.572	0,25
150.000	MONITCHEM HOLDCO 3 SA 5,25% 15/06/2021	148.170	0,13
167.000	MORGAN STANLEY FRN 03/12/2019	167.220	0,14
120.000	PICARD BONDO 5,50% 30/11/2024	112.854	0,10
	Malta	*95.150*	*0,08*
100.000	EVAN GROUP PLC 6,00% 31/07/2022	95.150	0,08
	Niederlande	*2.414.734*	*2,10*
300.000	ABN AMRO BANK NV 2,10% 18/01/2019	255.959	0,22
100.000	ALLIANZ FINANCE II BV FRN 07/12/2020	100.960	0,09
200.000	BMW FINANCE NV VAR 06/02/2020	200.396	0,17
1.100.000	COOPERATIEVE RABOBANK UA 0% 28/10/2026	493.113	0,42
200.000	EA PARTNERS I B.V. 6,75% 01/06/2021	118.707	0,10
189.000	EXOR HOLDINGS N.V 3,125% 15/02/2038	187.019	0,16
100.000	FERROVIAL NETHERLANDS BV VAR PERPETUAL	90.152	0,08
200.000	KONINKLIJKE KPN NV 0.625% 09/04/2025	192.092	0,17
110.000	LEASEPLAN CORPORATION NV FRN 25/01/2021	110.305	0,10
100.000	MYLAN NV FRN 22/11/2018	100.203	0,09

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses

Wertpapierbestand zum 30.06.2018

Anzahl		Marktwert	% des NIW
		EUR	
100.000	NYRSTAR NETHERLANDS 8,50% 15/09/2019	101.777	0,09
150.000	SAMVARDHANA MOTHERSON AUTOMOTIVE SYSTEMS GROUP BV 1,80% 06.07.2024	136.937	0,12
100.000	STEDIN HOLDING NV VAR 24/10/2022	99.934	0,09
113.000	VOLKSWAGEN FINANCIAL SERVICES NV 1,50% 12/04/2021	126.810	0,11
100.000	VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV 0,50% 30/03/2021	100.370	0,09
	Nigeria	*336.352*	*0,29*
200.000	UNITED BANK FOR AFRICA PLC 7,75% 08/06/2022	165.977	0,14
200.000	ZENITH BANK PLC 7,375% 30/05/2022	170.375	0,15
	Singapur	*215.705*	*0,19*
263.000	BOC AVIATION LTD 2,375% 15/09/2021	215.705	0,19
	Südkorea	*167.746*	*0,15*
200.000	HYUNDAI CAPITAL SERVICES 1,625% 30/08/2019	167.746	0,15
	Spanien	*450.681*	*0,39*
200.000	ACCIONA FINANCIACION FILALES UNIPERSONAL FRN 29/12/2019	202.634	0,17
100.000	BANCO DE CREDITO SOCIAL COOPERATIVO SA VAR 03/11/2026	99.739	0,09
167.000	HAYA FINANCE 2017 SA 5,25% 15/11/2022	148.308	0,13
	Schweden	*1.146.121*	*0,99*
200.000	NORDEA BANK AB VAR PERPETUAL	167.263	0,15
300.000	SCANIA CV AB FRN 20/04/2020	300.588	0,26
292.000	SVENSKA HANDELSBANKEN AB FRN 06/09/2019	250.839	0,22
287.000	SVENSKA HANDELSBANKEN AB 1,875% 07/09/2021	234.669	0,20
100.000	TRANSCOM HOLDING AB 6,50% 22/03/2023	97.608	0,08
100.000	UNILABS SUBHOLDING AB 5,75% 15/05/2025	95.154	0,08
	Schweiz	*154.100*	*0,13*
200.000	JULIUS BAER GROUP LTD VAR PERPETUAL	154.100	0,13
	Tunesien	*195.132*	*0,17*
200.000	BANQUE CENTRALE DE TUNISIE 5,625% 17/02/2024	195.132	0,17
	Vereinigtes Königreich	*3.064.730*	*2,66*
150.000	ARROW GLOBAL FINANCE PLC VAR 01/04/2025	142.452	0,12
100.000	ARROW GLOBAL FINANCE PLC 5,125% 15/09/2024	104.701	0,09
250.000	BARCLAYS BANK PLC VAR 31/12/2099	312.091	0,26
153.000	BARCLAYS PLC 1,375% 24/01/2026	145.382	0,13
200.000	BOPARAN FINANCE PLC 5,50% 15/07/2021	195.518	0,17
100.000	CREDIT AGRICOLE S A LONDON BRANCH FRN 06/03/2023	98.921	0,09
200.000	DEBENHAMS PLC 5,25% 15/07/2021	188.084	0,16
200.000	JAGUAR LAND ROVER PLC 4,50% 01/10/2027	152.350	0,13
100.000	MATALAN FINANCE PLC 9,50% 31/01/2024	102.174	0,09
130.000	NATWEST MARKETS PLC FRN 02/03/2020	129.956	0,11
142.000	NATWEST MARKETS PLC 0,625% 02/03/2022	140.567	0,12
150.000	PINEWOOD FINCO PLC 3,75% 01/12/2023	169.131	0,15
200.000	PRUDENTIAL PLC 4,875% PERPETUAL	146.923	0,13
100.000	RAC BOND CO 5,00% 06/11/2022	106.694	0,09
200.000	RBS GROUP PLC FRN 15/05/2023	172.123	0,15
117.000	SANTANDER UK GROUP HOLDINGS PLC FRN 18/05/2023	116.450	0,10
150.000	TWINKLE PIZZA PLC 6,625% 01/08/2021	157.923	0,14
200.000	TWINKLE PIZZA PLC 8,625% 01/08/2022	178.784	0,16
100.000	VIRIDIAN GROUP FINANCE CO PLC 4,00% 15/09/2025	92.470	0,08
100.000	VOYAGE CARE BONDCO PLC 5,875% 01/05/2023	112.477	0,10
100.000	WPP FINANCE 2013 FRN 20/03/2022	99.559	0,09
	Vereinigte Staaten von Amerika	*11.027.800*	*9,57*
130.000	AT&T INC 5,15% 15/02/2050	105.339	0,09
60.000	BAT CAPITAL CORP 2,764% 15/08/2022	49.272	0,04
103.000	BECTON DICKINSON & CO 0,368% 06/06/2019	103.291	0,09
64.000	BECTON DICKINSON & CO 2,133% 06/06/2019	54.326	0,05
56.000	CARDTRONICS INC/USA 5,50% 01/05/2025	43.287	0,04
165.000	CITIGROUP INC FRN 21/03/2023	164.320	0,14
200.000	CITIGROUP INC 2,70% 27/10/2022	164.455	0,14
133.000	CROWN AMERICA LLC / CAPITAL CORP V 4,25% 30/09/2026	103.450	0,09
40.000	DELTA AIR LINES INC DE 2,60% 04/12/2020	33.531	0,03
61.000	DISCOVERY COMMUNICATIONS LLC FRN 20/09/2019	52.504	0,05
100.000	FORD MOTOR CREDIT CO LLC FRN 01/12/2021	99.213	0,09
100.000	FORD MOTOR CREDIT CO LLC FRN 07/12/2022	98.282	0,09
206.000	GOLDMAN SACHS GROUP INC. FRN 09/09/2022	205.637	0,18
150.000	GOLDMAN SACHS GROUP INC. VAR PERPETUAL	125.473	0,11
83.000	GOLDMAN SACHS GROUP INC. VAR PERPETUAL	66.760	0,06
52.000	HYUNDAI CAPITAL AMERICA INC FRN 12/03/2021	44.557	0,04
1.000.000	INTERNATIONAL BANK FOR RECONSTRUCTION & DEVELOPMENT 0% 28/10/2024	487.706	0,42
200.000	KEYCORP VAR PERPETUAL	166.083	0,14
100.000	KRONOS INTL BONDS 3,75% 15.09.2025	96.123	0,08
126.000	MORGAN STANLEY BAML TRUST 2012-C6 FRN 09/11/2021	125.384	0,11
389.000	NISSAN MOTOR ACCEPTANCE CORP 1,90% 14/09/2021	317.111	0,28
133.000	NVIDIA CORP 2,20% 16/09/2021	110.496	0,10
228.000	PRUDENTIAL FINANCIAL INC 4,375% PERPETUAL	152.309	0,13
100.000	UNITED TECHNOLOGIES GLOBAL VAR 13/11/2019	100.166	0,09
5.000.000	USA T-BONDSI 0,125% 15/04/2019	4.550.654	3,94
3.000.000	USA T-BONDSI 0,25% 15/01/2025	2.644.279	2,29
850.000	USA T-BONDSI 0,625% 15/01/2026	763.792	0,66
	Konvertierbare Anleihen	**1.204.870**	**1,05**
	Frankreich	*278.909*	*0,24*
3.703	FIGEAC AERO SA 1,125% 18/10/2022 CV	90.171	0,08
406	MAISONS DU MONDE SA 0,125% 06/12/2023 CV	19.522	0,02
500	UNIBAIL-RODAMCO SE 0% 01/01/2022 CV	169.216	0,14
	Deutschland	*98.475*	*0,09*
100.000	HANIEL FINANCE DEUTSCHLAND GMBH 0% 12/05/2020 CV	98.475	0,09
	Italien	*373.436*	*0,33*
100.000	PRYSMIAN SPA 0% 17/01/2022 CV	98.893	0,09
200.000	SAFILO GROUP SPA 1,25% 22/05/2019 CV	179.514	0,16

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses

Wertpapierbestand zum 30.06.2018

Anzahl		Marktwert	% des NIW
		EUR	
100.000	TELECOM ITALIA SPA 1,125% 26/03/2022 CV	95.029	0,08
	Jersey	*112.502*	*0,10*
100.000	BALFOUR BEATTY FINNACE NO.2 LIMITED 1,875% 03/12/2018 CV	112.502	0,10
	Niederlande	*141.126*	*0,12*
200.000	AMERICA MOVIL B.V. 5,50% 17/09/2018 CV	141.126	0,12
	Vereinigte Arabische Emirate	*92.906*	*0,08*
100.000	ABAR INVESTMENTS PJSC 0,50% 27/03/2020 CV	92.906	0,08
	Vereinigtes Königreich	*107.516*	*0,09*
100.000	VODAFONE GROUP PLC 0% 26/11/2020 CV	107.516	0,09
Anteile/Aktien von OGAW/OGA		**29.628.757**	**25,72**
	Aktien/Anteile an Investmentfonds	**29.628.757**	**25,72**
	Frankreich	*114.203*	*0,10*
3.116	LYXOR ETF COMM CRB	49.900	0,04
2.018	LYXOR ETF RUS DJ AD	64.303	0,06
	Italien	*212.170*	*0,18*
105	ATLANTIC 1	29.400	0,03
25	ALPHA IMMOBILIARE SGR	35.245	0,02
24	AMUNDI RE EUROPA (D)	23.928	0,02
28	AMUNDI RE ITALIA (D)	23.408	0,02
45	BENI STABILI GESTIONI - INVEST REAL SECURITY	18.450	0,02
135	BETA IMMOBILIARE	6.669	0,01
15	IMMOBILIUM 2001	22.350	0,02
58	INVESTIETICO	1.441	0,00
19	POLIS FUND	10.488	0,01
19	SECURFONDO FONDO COMMUNE DI INVESTMENTO IMMO CHIUSO FCP	5.358	0,00
72	SOCRATE - FONDO DI INVESTIMENTO IMMOBILIARE DI TIPO	20.304	0,02
7	VALORE IMMOBILIARE GLOBALE	4.334	0,00
25	VEGAGEST EUROPA IMMOBILIARE1	10.795	0,01
	Jersey	*971.683*	*0,84*
4.636	ETC COTTON	10.876	0,01
29.072	ETFS COMMODITY SECURITIES LTD	263.567	0,23
2.150	ETFS COMMODITY SECURITIES LTD CERTIFICATE	23.368	0,02
8.335	ETFS COMMODITY SECURITIES LTD ETF	4.237	0,00
75	ETFS METAL SEC ETFS PHYSICAL GOLD	7.696	0,01
4.622	ETFS PHYSICAL GOLD	474.253	0,40
705	ETFS PHYSICAL PLATINIUM	48.687	0,04
5.782	ETFS PHYSICAL SILVER	75.559	0,07
115.373	ETFS WHEAT	63.440	0,06
	Luxemburg	*28.330.701*	*24,60*
3.049	PI INVESTMENT FUNDS - OPTIMISER EUR H ND	5.249.738	4,56
114	AMUNDI INDEX SOLUTIONS SHS-IE- SICAV	1.383.048	1,20
21.699	AMUNDI S.F. - ABSOLUTE RETURN MULTI-STRATERGY CONTROL H ND	21.697.915	18,84

Anzahl		Marktwert	% des NIW
		EUR	
Derivative Instrumente		**609.604**	**0,53**
	Optionen	**609.604**	**0,53**
	Deutschland	*247.249*	*0,21*
32	DJ EURO STOXX 50 EUR – 2.300 - 21.12.18 PUT	2.400	0,00
32	DJ EURO STOXX 50 EUR – 2.800 - 21.12.18 CALL	181.344	0,15
13	DJ EURO STOXX 50 EUR – 3.100 - 21.12.18 PUT	8.099	0,01
5	DJ EURO STOXX 50 EUR – 3.150 - 21.09.18 PUT	1.705	0,00
27	DJ EURO STOXX 50 EUR – 3.250 - 21.12.18 CALL	53.541	0,05
16	EURO STOXX BANKS - 140 - 21.12.18 CALL	160	0,00
	Japan	*88.538*	*0,08*
5	NIKKEI 225 - 20.250 - 14.12.18 CALL	88.538	0,08
	Luxemburg	*266.294*	*0,23*
1.000.000	CALL CDX OPTION - ITRAXX EUROPE CROSSOVER SERIES 29 INDEX – 287,50 - 18.07.18	100	0,00
475.000	FX OPTION - PUT USD / CALL INR – 70,50 - 22.10.18	7.668	0,01
4.000.000	SWAP OPTION - PAY EURIBOR 6M / REC 0,270% - 01.10.18	29.352	0,03
2.800.000	SWAP OPTION - PAY EURIBOR 6M / REC 0,700% - 09.03.20	26.860	0,02
7.000.000	SWAP OPTION - PAY LIBOR 3M / REC 2,000% - 11.12.18	479	0,00
7.000.000	SWAP OPTION - PAY LIBOR 3M / REC 2,500% - 10.09.18	679	0,00
10.500.000	SWAP OPTION - PAY SAIBOR 3M / REC 3,470% - 10.06.19	11.992	0,01
300.000	SWAP OPTION - PAY 1,500% / REC LIBOR 6M - 21.04.27	50.960	0,04
7.000.000	SWAP OPTION - PAY 2,150% / REC LIBOR 3M - 09.11.18	87.276	0,07
1.000.000	SWAP OPTION - PAY 2,500% / REC LIBOR 3M - 12.09.22	30.538	0,03
200.000	SWAP OPTION - PAY 2,690% / REC LIBOR 3M - 05.04.19	12.024	0,01
10.500.000	SWAP OPTION - PAY 3,470% / REC SAIBOR 3M - 10.06.19	8.366	0,01
	Vereinigte Staaten von Amerika	*7.523*	*0,01*
23	ALLY FINANCIAL INC – 15,00 - 18.01.19 PUT	295	0,00
6	ANADARKO PETROLEUM CORP – 50,00 - 18.01.19 PUT	283	0,00
6	APACHE CORP – 40,00 - 18.01.19 PUT	992	0,00
18	DOW JONES INDUSTRIAL AVG - 280 - 21.09.18 CALL	385	0,00
18	DOW JONES INDUSTRIAL AVG - 290 - 21.12.18 CALL	694	0,00
24	GEN GROWTH PROP – 17,74 - 18.01.19 PUT	719	0,00
19	GOODYEAR TYRE & RUBBER CO – 23,00 - 18.01.19 PUT	2.115	0,01
12	INTERNATIONAL PAPER – 38,00 - 18.01.19 PUT	257	0,00
10	NEWFIELD EXPLORATN – 25,00 - 18.01.19 PUT	1.028	0,00
9	ONEOK INC – 40,00 - 18.01.19 PUT	262	0,00
20	WILLIAMS COMPANIES INC – 20,00 - 18.01.19 PUT	463	0,00
7	WYNN RESORTS – 60,00 - 18.01.19 PUT	30	0,00

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses

Wertpapierbestand zum 30.06.2018

Anzahl		Marktwert	% des NIW
		EUR	
Short-Positionen		**-362.408**	**-0,31**
Derivative Instrumente		**-362.408**	**-0,31**
	Optionen	**-362.408**	**-0,31**
	Deutschland	*-2.800*	*0,00*
-8	EURO STOXX BANKS - 105 - 21.12.18 PUT	-2.100	0,00
-8	EURO STOXX BANKS - 90 - 21.12.18 PUT	-700	0,00
	Luxemburg	*-121.605*	*-0,11*
-475.000	FX OPTION - PUT USD / CALL INR – 70,50 - 22.10.18	-7.668	-0,01
-1.000.000	PUT CDX OPTION - ITRAXX EUROPE CROSSOVER SERIES 29 INDEX – 337,50 - 18.07.18	-5.164	0,00
-2.000.000	SWAP OPTION - PAY EURIBOR 6M / REC 0,500% - 01.10.18	-148	0,00
-7.000.000	SWAP OPTION - PAY LIBOR 3M / REC 2,500% - 11.12.18	-52.497	-0,05
-600.000	SWAP OPTION - PAY LIBOR 3M / REC 2,600% - 05.04.19	-19.915	-0,02
-4.000.000	SWAP OPTION - PAY 0,100% / REC EURIBOR 6M - 01.10.18	-11.176	-0,01
-4.200.000	SWAP OPTION - PAY 0,200% / REC EURIBOR 6M - 09.03.20	-12.465	-0,01
-300.000	SWAP OPTION - PAY 0,500% / REC LIBOR 6M - 21.04.21	-2.994	0,00
-1.000.000	SWAP OPTION - PAY 2,000% / REC LIBOR 3M - 12.09.22	-9.578	-0,01
	Vereinigte Staaten von Amerika	*-238.003*	*-0,20*
-1	S&P 500 INDEX – 2.300 - 21.09.18 PUT	-702	0,00
-2	S&P 500 INDEX – 2.325 - 21.12.18 PUT	-5.225	0,00
-8	S&P 500 INDEX – 2.425 - 21.12.18 CALL	-232.076	-0,20
Gesamt-Wertpapierbestand		**106.548.424**	**92,50**

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses

Wertpapierbestand zum 30.06.2018

Anzahl		Marktwert	% des NIW
		EUR	
Long-Positionen		**213.969.078**	**90,83**
Zur amtlichen Notierung an einer Wertpapierbörse zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte, übertragbare Wertpapiere		**152.363.930**	**64,68**
	Anteile	**10.211.489**	**4,33**
	Österreich	*56.321*	*0,02*
885	AMS	56.321	0,02
	Belgien	*73.266*	*0,03*
847	ANHEUSER BUSCH INBEV SA/NV	73.266	0,03
	Kanada	*75.000*	*0,03*
6.654	BARRICK GOLD NYS (USD)	75.000	0,03
	Cayman Islands	*791.226*	*0,34*
921	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	146.603	0,06
287	BAIDU ADS	60.458	0,03
54.000	CHINA MAPLE LEAF EDUCATIONAL	83.359	0,04
1.737	CTRIP.COM INTERNATIONAL ADR	70.652	0,03
33.000	GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD	73.314	0,03
1.796	HUAZHU GROUP LTD ADR	64.269	0,03
1.127	NW ORIENTL ED & TECHNO GP ADR	90.562	0,04
3.829	TAL EDUCATION GROUP	120.325	0,05
1.900	TENCENT HOLDINGS LTD	81.684	0,03
	China	*363.594*	*0,15*
14.500	BYD CO LTD-H	75.271	0,03
101.000	CHINA COMMUNICATIONS CONSTR - H	83.579	0,04
150.000	CHINA RAILWAY SIGNAL & COMMUNICATION CORPORATION LTD	91.212	0,03
91.000	GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	59.607	0,03
64.400	GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD	53.925	0,02
	Frankreich	*560.516*	*0,24*
3.331	ALSTOM	131.108	0,06
1.038	CAP GEMINI SE	119.578	0,05
1.005	SCHNEIDER ELECTRIC SA	71.777	0,03
683	THALES SA	75.369	0,03
1.039	VINCI SA	85.572	0,04
3.672	VIVENDI	77.112	0,03
	Deutschland	*1.213.502*	*0,52*
853	BASF SE	69.869	0,03
740	BAYER AG	69.819	0,03
4.353	DEUTSCHE WOHNEN AG REIT	180.215	0,07
14.899	E.ON SE	136.385	0,06
995	LEG IMMOBILIEN REIT	92.615	0,04
404	LINDE AG	72.255	0,03
8.488	RWE AG	165.728	0,07
958	SIEMENS AG-NOM	108.465	0,05
8.376	TAG IMMOBBILIEN AG	157.720	0,07
3.936	VONOVIA SE NAMEN AKT REIT	160.431	0,07
	Hongkong (China)	*17.689*	*0,01*
6.600	CHINA TAIPING INSURANCE HOLD SHS -H-	17.689	0,01
	Japan	*1.978.245*	*0,84*
400	FANUC LTD	68.062	0,03
4.300	GMO INTERNET	87.746	0,04
1.800	HARMONIC DRIVE SYSTEMS	65.278	0,03
12.000	HITACHI LTD	72.525	0,03
200	KEYENCE CORP	96.749	0,04
3.900	MINEBEA MITSUMI INC	56.514	0,02
8.900	MITSUBISHI CHEMICAL HOLDINGS	63.823	0,03
2.200	NGK SPARK PLUG	53.757	0,02
700	NIDEC CORP	89.987	0,04
1.300	ORIENTAL LAND	116.858	0,05
7.300	PANASONIC CORP	84.304	0,04
7.300	RECRUIT HOLDING CO LTD	173.069	0,06
3.800	SBI HOLDINGS	83.861	0,04
2.200	SOFTBANK GROUP CORP	135.633	0,06
2.700	SONY CORP	118.252	0,05
3.600	SUMCO CORP	62.272	0,03
2.400	SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GRP	79.911	0,03
2.500	SUMITOMO MITSUI TRUST HLD	84.923	0,04
1.700	TERUMO CORP	83.473	0,04
1.600	TREND MICRO INC	78.191	0,03
2.700	UNI-CHARM CORP	69.586	0,03
2.500	YASKAWA ELECTRIC CORP	75.682	0,03
2.000	ZENKOKU HOSHO CO LTD	77.789	0,03
	Jersey	*161.160*	*0,07*
48.912	CENTAMIN	65.817	0,03
1.371	FERGUSON PLC	95.343	0,04
	Luxemburg	*180.067*	*0,08*
4.897	GRAND CITY PROPERTIES S.A.	108.909	0,05
4.528	TENARIS SA	71.158	0,03
	Niederlande	*602.534*	*0,26*
1.434	FERRARI NV	167.061	0,08
7.204	FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	117.670	0,05
6.145	KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE	126.003	0,05
1.325	KONINKLIJKE DSM NV	114.109	0,05
818	LYONDELLBASELL	77.691	0,03
	Spanien	*146.843*	*0,06*
11.645	OBRASCON HUARTE LAIN SA	31.919	0,01
6.855	REPSOL	114.924	0,05
	Schweiz	*82.339*	*0,03*
2.877	COCA COLA HBC GBP	82.339	0,03
	Vereinigtes Königreich	*603.391*	*0,26*
5.317	BHP BILLITON PLC	102.570	0,04
20.880	BP PLC	136.541	0,06
2.011	RIO TINTO PLC	95.530	0,04
4.360	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A	129.797	0,06
1.596	SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC	65.409	0,03
2.689	TECHNIPFMC PLC EUR	73.544	0,03

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses

Wertpapierbestand zum 30.06.2018

Anzahl		Marktwert EUR	% des NIW
	Vereinigte Staaten von Amerika	*3.305.796*	*1,39*
1.102	ACTIVISION BLIZZARD INC	72.026	0,03
1.788	ALCOA CORP	71.486	0,03
88	ALPHABET INC	85.472	0,04
56	AMAZON.COM	81.864	0,03
2.004	ANADARKO PETROLEUM CORP	126.380	0,05
579	ANTHEM INC	119.792	0,05
483	APPLE INC	77.000	0,03
719	AUTODESK INC	80.980	0,03
2.398	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	92.712	0,04
2.067	CONOCOPHILLIPS	123.404	0,05
357	COOPER COMPANIES INC	72.284	0,03
2.111	CSX CORP	116.168	0,05
625	DEERE & CO	75.950	0,03
2.231	DEVON ENERGY CORPORATION	84.612	0,04
585	ELECTRONIC ARTS INC	70.595	0,03
498	FACEBOOK A	83.584	0,04
971	FMC CORP	74.691	0,03
1.748	FORTIVE CORP - W/I	115.595	0,05
854	HOME DEPOT INC	143.584	0,05
667	IAC/INTERACTIVECOR	87.143	0,04
307	ILLUMINA	73.204	0,03
219	INTUITIVE SURGICAL	89.817	0,04
1.815	MARATHON PETROLEUM	109.626	0,05
3.723	NEWMONT MINING CORP	121.427	0,05
2.555	NOBLE ENERGY	77.533	0,03
328	NVIDIA CORP	66.884	0,03
406	PALO ALTO NETWORKS INC	71.759	0,03
706	PROOFPOINT INC	69.617	0,03
660	SALESFORCE.COM	77.037	0,03
732	SPLUNK INC	61.905	0,03
920	TAKE TWO INTERACTIVE SOFTWARE	93.816	0,04
870	TIFFANY & CO	98.598	0,04
2.570	TRIMBLE NAVIGATION	73.102	0,03
738	UNITED PARCEL SERVICE-B	67.621	0,03
518	UNITED RENTALS INC	66.372	0,03
1.648	VERIZON COMMUNICATIONS INC	71.337	0,03
789	WALT DISNEY COMPANY	71.152	0,03
723	ZEBRA TECH -A-	89.667	0,04
	Anleihen	**140.100.580**	**59,48**
	Argentinien	*100.638*	*0,04*
200.000	YPF SOCIEDAD ANONIMA 0% 07/07/2020	100.638	0,04
	Australien	*3.701.180*	*1,57*
1.200.000	AUSTRALIA I %1,25 21/02/2022	883.608	0,38
2.000.000	AUSTRALIA 4,25% 21/04/2026	1.417.998	0,59
500.000	AUSTRALIAI 0,75% 21/11/2027	323.405	0,14
1.200.000	AUSTRALIAI 3,00% 20/09/2025	1.076.169	0,46
	Österreich	*320.679*	*0,14*
333.000	AT &S AUSTRIA TECHNOLOGIE & SYSTEMTECHNIK AG VAR PERPETUAL	320.679	0,14
	Belgien	*285.130*	*0,12*
100.000	BELFIUS BANQUE SA/NV 1,00% 26/10/2024	97.585	0,04
249.000	BNP PARIBAS FORTIS SA VAR PERPETUAL	187.545	0,08
	Kanada	*9.094.257*	*3,86*
600.000	CANADAI 1,25% 01/12/2047	515.031	0,22
6.000.000	CANADAI 4,25% 01/12/2021	7.123.201	3,01
700.000	CANADAI 4,25% 01/12/2026	913.259	0,39
400.000	ITHACA ENERGY INC 8,125% 01/07/2019	341.604	0,15
200.000	ROYAL BANK OF CANADA FRN 06/08/2020	201.162	0,09
	Cayman Islands	*443.293*	*0,19*
223.000	CK HUTCHISON FINANCE 16 VAR PERPETUAL	183.349	0,08
249.000	VIRIDIAN GRP FUNDCO 2 4,75% 15/09/2024	259.944	0,11
	China	*394.193*	*0,17*
500.000	UNION LIFE INSURANCE CO LTD 3,00% 19/09/2021	394.193	0,17
	Dänemark	*714.214*	*0,30*
138.000	JYSKE BANK A/S FRN 01/12/2022	139.071	0,06
200.000	NORICAN A/S 4,50% 15/05/2023	183.080	0,08
390.000	NYKREDIT REALKREDIT AS 0,375% 16/06/2020	392.063	0,16
	Finnland	*263.550*	*0,11*
280.000	STOCKMANN PIC 4,75% 11/01/2022	263.550	0,11
	Frankreich	*5.327.294*	*2,26*
113.000	3AB OPTIQUE DEVELOPMENT VAR 01/10/2023	107.269	0,05
113.000	3AB OPTIQUE DEVELOPMENT 4,00% 01/10/2023	106.481	0,05
100.000	ALD INTERNATIONAL FRN 26/02/2021	99.708	0,04
1.000.000	AXA SA 4,50% PERPETUAL	684.501	0,28
415.000	BNP PARIBAS SA FRN 22/09/2022	417.287	0,18
446.000	BNP PARIBAS SA VAR PERPETUAL	379.204	0,16
213.000	CMA CGM 5,25% 15/01/2025	172.634	0,07
119.000	CROWN EUROPEAN HOLDINGS 2,875% 01/02/2026	112.494	0,05
100.000	ENGIE SA VAR PERPETUAL	93.609	0,04
500.000	HOLDIKKS SAS 6,75% 15/07/2021	234.335	0,10
100.000	ILIAD SA 1,50% 14/10/2024	96.225	0,04
400.000	INFRA PARK 2,00% 06/07/2029	396.092	0,17
208.000	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE VAR 26/11/2018	208.196	0,09
200.000	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE 0% 26/05/2020	200.338	0,09
503.000	MARCOLIN SPA VAR 15/02/2023	498.483	0,20
400.000	MERCIALYS 2,00% 03/11/2027	403.032	0,17
200.000	RCI BANQUE SA 0,25% 12/07/2021	199.030	0,08
200.000	SANOFI SA VAR 21/03/2020	200.816	0,09
200.000	TIKEHAU CAPITAL PARTNERS 3,00% 27/11/2023	193.576	0,08
400.000	VALLOUREC 2,25% 30/09/2024	319.380	0,14
202.000	VALLOUREC 6,625% 15/10/2022	204.604	0,09
	Deutschland	*29.416.661*	*12,50*
560.000	CBR FASHION HOLDING GMBH 5,125% 01/10/2022	477.758	0,20
100.000	DEUTSCHE BANK AG FRN 16/05/2022	96.024	0,04

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses

Wertpapierbestand zum 30.06.2018

Anzahl		Marktwert	% des NIW
		EUR	
600.000	DEUTSCHE PFANDBRIEFBANK AG 4,60% 22/02/2027	613.146	0,26
13.000.000	GERMANY BUNDI 0,10% 15/04/2023	15.005.997	6,38
10.000.000	GERMANY BUNDI 1,75% 15/04/2020	11.941.437	5,08
200.000	HBO S STERLING FINANCE JERSEY LP VAR PERPETUAL	329.275	0,14
200.000	NIDDA BONDCO GMBH 5,00% 30/09/2025	182.466	0,08
200.000	SAP SE VAR 13/03/2021	200.898	0,09
300.000	TALANX AG VAR 05/12/2047	270.111	0,11
200.000	UNIPER SE 0,125% 08/12/2018	200.168	0,08
100.000	VOLKSWAGEN BANK GMBH FRN 15/06/2021	99.381	0,04
	Griechenland	*294.804*	*0,13*
300.000	PIRAEUS BANK SA FRN 31/10/2022	294.804	0,13
	Guernsey	*174.494*	*0,07*
183.000	SUMMIT GERMANY LTD 2,00% 31/01/2025	174.494	0,07
	Hongkong (China)	*176.033*	*0,07*
222.000	WELL HOPES DEVELOPMENT HOLDINGS LIMITED VAR PERPETUAL	176.033	0,07
	Island	*374.337*	*0,16*
183.000	LANDSBANKINN HF 1,00% 30/05/2023	180.965	0,08
195.000	LSLANDSBANKI HF VAR 19/01/2024	193.372	0,08
	Irland	*779.618*	*0,33*
400.000	FCA CAPITAL IRELAND PLC FRN 12/02/2019	400.324	0,17
212.000	FCA CAPITAL IRELAND PLC 1,00% 15/11/2021	212.304	0,09
150.000	VIRGIN MEDIA RECEIVABLES FINANCING NOTES I DESIGNATED 5,50% 15/09/2024	166.990	0,07
	Italien	*42.831.154*	*18,19*
200.000	ANSALDO ENERGIA S.P.A 2,75% 31/05/2024	178.234	0,08
243.000	BANCA FARMAFACTORING SPA FRN 05/06/2020	231.978	0,10
500.000	BANCO BPM SPA 3,50% 14/03/2019	506.175	0,21
400.000	BORMIOLI PHARMA BIDCO S P A VAR 15/11/2024	389.188	0,17
200.000	CMC RAVENNA 6,00% 15/02/2023	168.956	0,07
400.000	CMF 9,00% 15/06/2022	340.976	0,14
195.000	COOPERATIVA MURATORI & C 6,875% 01/08/2022	173.770	0,07
300.000	ERG SPA 2,175% 19/01/2023	283.206	0,12
200.000	ICCREA BANCA SPA FRN 18/06/2025	180.750	0,08
450.000	ICCREA BANCA SPA 1,875% 25/11/2019	450.590	0,19
200.000	INTESA SANPAOLO SPA 5,017% 26/06/2024	154.777	0,07
3.500.000	ITALY BTP 0% 30/05/2019	3.492.440	1,48
2.100.000	ITALY BTP 0% 30/10/2019	2.087.631	0,89
1.300.000	ITALY BTP 0,05% 15/10/2019	1.292.551	0,55
400.000	ITALY BTP 1,50% 01/08/2019	404.928	0,17
600.000	ITALY BTP 2,50% 01/05/2019	611.382	0,26
5.000.000	ITALY BTPI 0,50% 20/04/2023	4.927.087	2,09
12.000.000	ITALY BTPI 1,25% 27/10/2020	12.327.236	5,23
8.400.000	ITALY BTPI 1,65% 23/04/2020	8.649.518	3,67
1.300.000	ITALY CCT FRN 15/11/2019	1.305.668	0,55
130.000	ITALY CCT FRN 15/12/2020	128.701	0,05
282.000	KEDRION SPA 3,00% 12/07/2022	271.304	0,12
200.000	LIMACORPORATE SPA VAR 15/08/2023	195.018	0,08
300.000	L'ISOLANTE K-FLEX SPA 4,25% 07/10/2023	304.767	0,13
400.000	MERCEDES BENZ FINANCIAL SERVICES ITALIA SPA FRN 22/06/2020	399.392	0,17
500.000	OFFICINE MACCAFERRI SPA 5,75% 01/06/2021	499.760	0,21
300.000	ONORATO ARMATORI S.P.A 7,75% 15/02/2023	227.391	0,10
296.000	PIRELLI C SPA 1,375% 25/01/2023	286.309	0,12
222.000	PRO GEST SPA 3,25% 15/12/2024	210.651	0,09
300.000	SALINI SPA 1,75% 26/10/2024	258.114	0,11
400.000	SNAM SPA FRN 02/08/2024	393.912	0,17
200.000	UNICREDIT SPA VAR 31/08/2024	187.358	0,08
320.000	UNIONE DI BANCHE ITALIAN 0,75% 17/10/2022	300.294	0,13
368.000	WIND TRE S P A VAR 20/01/2024	305.639	0,13
301.000	WIND TRE S P A 2,625% 20/01/2023	252.464	0,11
367.000	WIND TRE S P A 3,125% 20/01/2025	296.679	0,13
232.000	WIND TRE S P A 5,00% 20/01/2026	156.360	0,07
	Japan	*11.027.293*	*4,68*
700.000.000	JAPAN JGB 0,20% 20/12/2018	5.420.623	2,30
600.000	JAPAN JGB 1,50% 21/07/2021	490.165	0,21
550.000.000	JAPAN JGBI 0,10% 10/03/2026	4.515.768	1,92
250.000	SUMITOMO MITSUI BANKING CORP FRN 19/10/2018	214.449	0,09
444.000	SUMITOMO MITSUI FINANCIAL CORP INC FRN 19/10/2021	386.288	0,16
	Jersey	*613.161*	*0,26*
400.000	ADIENT GLOBAL HOLDINGS LTD 4,875% 15/08/2026	308.338	0,13
200.000	EURO DM SECURITIES 0% 08/04/2021	102.007	0,04
200.000	KENNEDY WILSON EUROPE REAL ESTATE 3,25% 12/11/2025	202.816	0,09
	Kenia	*170.782*	*0,07*
200.000	EASTERN AND SOUTHERN 5,375% 14/03/2022	170.782	0,07
	Luxemburg	*2.768.705*	*1,18*
288.000	ALLERGAN FUNDING SCS FRN 01/06/2019	288.187	0,12
100.000	ARCELORMITTAL SA 0,95% 17/01/2023	98.168	0,04
160.000	BC LUCXO 1 SA 6,125% 10/08/2022	131.590	0,06
200.000	CNH INDUSTRIAL FINANCE EUROPE S A 1,375% 23/05/2022	201.702	0,09
137.000	CNH INDUSTRIAL FINANCE EUROPE S A 1,75% 12/09/2025	132.678	0,06
300.000	CRYSTAL ALMOND S A R L 10,00% 01/11/2021	317.829	0,13
100.000	GALAPAGOS HOLDING SA 7,00% 15/06/2022	56.090	0,02
274.000	GARFUNKELUX HOLDCO 3 SA VAR 01/09/2023	242.087	0,10
200.000	KLEOPATRA HOLDINGS 8,50% 30/06/2023	149.570	0,06
400.000	LECTA SA 6,50% 01/08/2023	394.096	0,18
200.000	MONITCHEM HOLDCO 3 SA 5,25% 15/06/2021	197.560	0,08
333.000	MORGAN STANLEY FRN 03/12/2019	333.440	0,14
240.000	PICARD BONDO 5,50% 30/11/2024	225.708	0,10
	Malta	*190.300*	*0,08*
200.000	EVAN GROUP PLC 6,00% 31/07/2022	190.300	0,08
	Niederlande	*4.908.129*	*2,08*
600.000	ABN AMRO BANK NV 2,10% 18/01/2019	511.918	0,22
100.000	AKZO NOBEL NV VAR 08/11/2019	100.233	0,04

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses

Wertpapierbestand zum 30.06.2018

Anzahl		Marktwert	% des NIW
		EUR	
100.000	ALLIANZ FINANCE II BV FRN 07/12/2020	100.960	0,04
400.000	BMW FINANCE NV VAR 06/02/2020	400.792	0,17
1.973.000	COOPERATIEVE RABOBANK UA 0% 28/10/2026	884.467	0,38
200.000	EA PARTNERS I B.V. 6,875% 28/09/2020	121.465	0,05
378.000	EXOR HOLDINGS N.V 3,125% 15/02/2038	374.039	0,16
100.000	FERROVIAL NETHERLANDS BV VAR PERPETUAL	90.152	0,04
200.000	IHS NETHERLANDS HOLDCO BV 9,50% 27/10/2021	164.735	0,07
400.000	KONINKLIJKE KPN NV 0,625% 09/04/2025	384.184	0,16
219.000	LEASEPLAN CORPORATION NV FRN 25/01/2021	219.607	0,09
208.000	MONDELEZ INTERNATIONAL HOLDINGS NETHERLANDS BV 1,625% 28/10/2019	175.170	0,07
146.000	MYLAN NV FRN 22/11/2018	146.296	0,06
200.000	NYRSTAR NETHERLANDS 8,50% 15/09/2019	203.554	0,09
300.000	SAMVARDHANA MOTHERSON AUTOMOTIVE SYSTEMS GROUP BV 1,80% 06/07/2024	273.873	0,12
103.000	STEDIN HOLDING NV VAR 24/10/2022	102.932	0,04
225.000	VOLKSWAGEN FINANCIAL SERVICES NV 1,50% 12/04/2021	252.498	0,11
300.000	VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV 0,50% 30/03/2021	301.110	0,13
100.000	VONOVIA FINANCE B.V FRN 20/11/2019	100.144	0,04
	Nigeria	*336.352*	*0,14*
200.000	UNITED BANK FOR AFRICA PLC 7,75% 08/06/2022	165.977	0,07
200.000	ZENITH BANK PLC 7,375% 30/05/2022	170.375	0,07
	Oman	*316.536*	*0,13*
200.000	OMAN 5,625% 17/01/2028	161.158	0,06
200.000	OMAN 6,75% 17/01/2048	155.378	0,07
	Portugal	*98.111*	*0,04*
100.000	GALP ENERGIA SGPS SA 1,00% 15/02/2023	98.111	0,04
	Spanien	*1.000.212*	*0,42*
400.000	ACCIONA FINANCIACION FILALES UNIPERSONAL FRN 29/12/2019	405.268	0,16
300.000	BANCO DE CREDITO SOCIAL COOPERATIVO SA VAR 03/11/2026	299.217	0,13
333.000	HAYA FINANCE 2017 SA 5,25% 15/11/2022	295.727	0,13
	Schweden	*1.551.285*	*0,66*
400.000	NORDEA BANK AB VAR PERPETUAL	334.526	0,14
400.000	NORDEA BANK AB VAR PERPETUAL	327.667	0,14
600.000	SCANIA CV AB FRN 20/04/2020	601.176	0,26
100.000	TRANSCOM HOLDING AB 6,50% 22/03/2023	97.608	0,04
200.000	UNILABS SUBHOLDING AB 5,75% 15/05/2025	190.308	0,08
	Schweiz	*231.151*	*0,10*
300.000	JULIUS BAER GROUP LTD VAR PERPETUAL	231.151	0,10
	Tunesien	*240.012*	*0,10*
246.000	BANQUE CENTRALE DE TUNISIE 5,625% 17/02/2024	240.012	0,10
	Vereinigtes Königreich	*5.566.834*	*2,36*
300.000	ARROW GLOBAL FINANCE PLC VAR 01/04/2025	284.904	0,12
100.000	ARROW GLOBAL FINANCE PLC 5,125% 15/09/2024	104.701	0,04
500.000	BARCLAYS BANK PLC VAR 31/12/2099	624.181	0,27
305.000	BARCLAYS PLC 1,375% 24/01/2026	289.814	0,12
400.000	BOPARAN FINANCE PLC 5,50% 15/07/2021	391.035	0,17
200.000	CREDIT AGRICOLE S A LONDON BRANCH FRN 06/03/2023	197.842	0,08
300.000	DEBENHAMS PLC 5,25% 15/07/2021	282.126	0,12
430.000	JAGUAR LAND ROVER PLC 4,50% 01/10/2027	327.552	0,14
125.000	MATALAN FINANCE PLC 9,50% 31/01/2024	127.718	0,05
259.000	NATWEST MARKETS PLC FRN 02/03/2020	258.912	0,11
284.000	NATWEST MARKETS PLC 0,625% 02/03/2022	281.134	0,12
366.000	PINEWOOD FINCO PLC 3,75% 01/12/2023	412.680	0,18
220.000	PRUDENTIAL PLC 4,875% PERPETUAL	161.615	0,07
190.000	RAC BOND CO 5,00% 06/11/2022	202.719	0,09
281.000	RBS GROUP PLC FRN 15/05/2023	241.833	0,10
237.000	SANTANDER UK GROUP HOLDINGS PLC FRN 18/05/2023	235.886	0,10
250.000	TWINKLE PIZZA PLC 6,625% 01/08/2021	263.205	0,11
250.000	TWINKLE PIZZA PLC 8,625% 01/08/2022	223.481	0,09
200.000	VIRGIN MEDIA FINANCE PLC 6,375% 15/10/2024	234.649	0,10
151.000	VIRIDIAN GROUP FINANCE CO PLC 4,00% 15/09/2025	139.630	0,06
150.000	VOYAGE CARE BONDCO PLC 5,875% 01/05/2023	168.715	0,07
113.000	WPP FINANCE 2013 FRN 20/03/2022	112.502	0,05
	Vereinigte Staaten von Amerika	*16.390.188*	*6,97*
261.000	AT&T INC 5,15% 15/02/2050	211.489	0,09
239.000	BANK OF AMERICA CORP FRN 21/09/2021	238.391	0,10
120.000	BAT CAPITAL CORP 2,764% 15/08/2022	98.544	0,04
209.000	BECTON DICKINSON & CO 0,368% 06/06/2019	209.591	0,09
128.000	BECTON DICKINSON & CO 2,133% 06/06/2019	108.652	0,05
111.000	CARDTRONICS INC/USA 5,50% 01/05/2025	85.801	0,04
247.000	CITIGROUP INC FRN 21/03/2023	245.982	0,10
400.000	CITIGROUP INC 2,70% 27/10/2022	328.911	0,14
80.000	DELTA AIR LINES INC DE 2,60% 04/12/2020	67.062	0,03
228.000	DEUTSCHE BANK AG NY VAR 01/12/2032	166.530	0,07
122.000	DISCOVERY COMMUNICATIONS LLC FRN 20/09/2019	105.007	0,04
133.000	DOMINION ENERGY INC VAR 01/07/2020	112.197	0,05
164.000	FORD MOTOR CREDIT CO LLC FRN 01/12/2021	162.709	0,07
195.000	FORD MOTOR CREDIT CO LLC FRN 07/12/2022	191.650	0,08
413.000	GOLDMAN SACHS GROUP INC. FRN 09/09/2022	412.273	0,18
300.000	GOLDMAN SACHS GROUP INC. VAR PERPETUAL	250.946	0,11
167.000	GOLDMAN SACHS GROUP INC. VAR PERPETUAL	134.324	0,06
78.000	HYUNDAI CAPITAL AMERICA INC FRN 12/03/2021	66.836	0,03
1.000.000	INTERNATIONAL BANK FOR RECONSTRUCTION & DEVELOPMENT 0% 28/10/2024	487.706	0,21
300.000	KEYCORP VAR PERPETUAL	249.124	0,11
100.000	KRONOS INTL BONDS 3,75% 15/09/2025	96.123	0,04
253.000	MORGAN STANLEY BAML TRUST 2012-C6 FRN 09/11/2021	251.763	0,11
350.000	NISSAN MOTOR ACCEPTANCE CORP 1,90% 14/09/2021	285.318	0,12
400.000	PRUDENTIAL FINANCIAL INC 4,375% PERPETUAL	267.209	0,11
108.000	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC VAR 24/07/2019	108.129	0,05
100.000	UNITED TECHNOLOGIES GLOBAL VAR 13/11/2019	100.166	0,04
10.000.000	USA T-BONDSI 0,125% 15/04/2019	9.101.307	3,86
2.500.000	USA T-BONDSI 0,625% 15/01/2026	2.246.448	0,95

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses

Wertpapierbestand zum 30.06.2018

Anzahl		Marktwert EUR	% des NIW
	Konvertierbare Anleihen	**2.051.861**	**0,87**
	Frankreich	*557.208*	*0,24*
7.381	FIGEAC AERO SA 1,125% 18/10/2022 CV	179.734	0,08
812	MAISONS DU MONDE SA 0,125% 06/12/2023 CV	39.043	0,02
1.000	UNIBAIL-RODAMCO SE 0% 01/01/2022 CV	338.431	0,14
	Italien	*657.115*	*0,27*
200.000	PRYSMIAN SPA 0% 17/01/2022 CV	197.786	0,08
300.000	SAFILO GROUP SPA 1,25% 22/05/2019 CV	269.271	0,11
200.000	TELECOM ITALIA SPA 1,125% 26/03/2022 CV	190.058	0,08
	Jersey	*225.004*	*0,10*
200.000	BALFOUR BEATTY FINNACE NO.2 LIMITED 1,875% 03/12/2018 CV	225.004	0,10
	Niederlande	*211.689*	*0,09*
300.000	AMERICA MOVIL B.V. 5,50% 17/09/2018 CV	211.689	0,09
	Vereinigte Arabische Emirate	*185.812*	*0,08*
200.000	ABAR INVESTMENTS PJSC 0,50% 27/03/2020 CV	185.812	0,08
	Vereinigtes Königreich	*215.033*	*0,09*
200.000	VODAFONE GROUP PLC 0% 26/11/2020 CV	215.033	0,09
Anteile/Aktien von OGAW/OGA		**60.398.539**	**25,64**
	Aktien/Anteile an Investmentfonds	**60.398.539**	**25,64**
	Frankreich	*233.937*	*0,10*
6.456	LYXOR ETF COMM CRB	103.386	0,04
4.097	LYXOR ETF RUS DJ AD	130.551	0,06
	Italien	*429.466*	*0,18*
195	ATLANTIC 1	54.600	0,02
54	ALPHA IMMOBILIARE SGR	76.129	0,03
49	AMUNDI RE EUROPA (D)	48.853	0,02
59	AMUNDI RE ITALIA (D)	49.324	0,02
90	BENI STABILI GESTIONI - INVEST REAL SECURITY	36.900	0,02
300	BETA IMMOBILIARE	14.820	0,01
24	IMMOBILIUM 2001	35.760	0,02
90	INVESTIETICO	2.237	0,00
40	POLIS FUND	22.080	0,01
37	SECURFONDO FONDO COMMUNE DI INVESTMENTO IMMO CHIUSO FCP	10.434	0,00
172	SOCRATE - FONDO DI INVESTIMENTO IMMOBILIARE DI TIPO	48.504	0,02
14	VALORE IMMOBILIARE GLOBALE	8.667	0,00
49	VEGAGEST EUROPA IMMOBILIARE1	21.158	0,01
	Jersey	*1.983.812*	*0,84*
9.566	ETC COTTON	22.441	0,01
59.209	ETFS COMMODITY SECURITIES LTD	536.788	0,23
4.377	ETFS COMMODITY SECURITIES LTD CERTIFICATE	47.573	0,02
16.165	ETFS COMMODITY SECURITIES LTD ETF	8.217	0,00
258	ETFS METAL SEC ETFS PHYSICAL GOLD	26.473	0,01
9.330	ETFS PHYSICAL GOLD	957.334	0,40
1.430	ETFS PHYSICAL PLATINIUM	98.755	0,04
11.804	ETFS PHYSICAL SILVER	154.254	0,07
240.016	ETFS WHEAT	131.977	0,06
	Luxemburg	*57.751.324*	*24,52*
6.193	PI INVESTMENT FUNDS - OPTIMISER H ND	10.663.045	4,53
231	AMUNDI INDEX SOLUTIONS SHS-IE- SICAV	2.802.492	1,19
44.288	AMUNDI S.F. - ABSOLUTE RETURN MULTI-STRATEGY CONTROL H ND	44.285.787	18,80
Derivative Instrumente		**1.206.609**	**0,51**
	Optionen	**1.206.609**	**0,51**
	Deutschland	*471.986*	*0,20*
61	DJ EURO STOXX 50 EUR – 2.300 - 21.12.18 PUT	4.575	0,00
61	DJ EURO STOXX 50 EUR – 2.800 - 21.12.18 CALL	345.687	0,15
27	DJ EURO STOXX 50 EUR – 3.100 - 21.12.18 PUT	16.821	0,01
10	DJ EURO STOXX 50 EUR – 3.150 - 21.09.18 PUT	3.410	0,00
51	DJ EURO STOXX 50 EUR – 3.250 - 21.12.18 CALL	101.133	0,04
36	EURO STOXX BANKS - 140 - 21.12.18 CALL	360	0,00
	Japan	*177.075*	*0,08*
10	NIKKEI 225 – 20.250 - 14.12.18 CALL	177.075	0,08
	Luxemburg	*542.343*	*0,22*
2.000.000	CALL CDX OPTION - ITRAXX EUROPE CROSSOVER SERIES 29 INDEX – 287,50 - 18.07.18	200	0,00
925.000	FX OPTION - PUT USD / CALL INR – 70,50 - 22.10.18	14.932	0,01
8.000.000	SWAP OPTION - PAY EURIBOR 6M / REC 0,270% - 01.10.18	58.704	0,02
5.800.000	SWAP OPTION - PAY EURIBOR 6M / REC 0,700% - 09.03.20	55.639	0,02
14.000.000	SWAP OPTION - PAY LIBOR 3M / REC 2,000% - 11.12.18	958	0,00
16.000.000	SWAP OPTION - PAY LIBOR 3M / REC 2,500% - 10.09.18	1.552	0,00
22.000.000	SWAP OPTION - PAY SAIBOR 3M / REC 3,470% - 10.06.19	25.127	0,01
600.000	SWAP OPTION - PAY 1,500% / REC LIBOR 6M - 21.04.27	101.920	0,04
14.000.000	SWAP OPTION - PAY 2,150% / REC LIBOR 3M - 09.11.18	174.552	0,07
2.200.000	SWAP OPTION - PAY 2,500% / REC LIBOR 3M - 12.09.22	67.182	0,03
400.000	SWAP OPTION - PAY 2,690% / REC LIBOR 3M - 05.04.19	24.048	0,01
22.000.000	SWAP OPTION - PAY 3,470% / REC SAIBOR 3M - 10.06.19	17.529	0,01
	Vereinigte Staaten von Amerika	*15.205*	*0,01*
47	ALLY FINANCIAL INC – 15,00 - 18.01.19 PUT	604	0,00
12	ANADARKO PETROLEUM CORP – 50,00 - 18.01.19 PUT	565	0,00
13	APACHE CORP – 40,00 - 18.01.19 PUT	2.149	0,00
37	DOW JONES INDUSTRIAL AVG - 280 - 21.09.18 CALL	792	0,00
37	DOW JONES INDUSTRIAL AVG - 290 - 21.12.18 CALL	1.426	0,00
46	GEN GROWTH PROP – 17,74 - 18.01.19 PUT	1.379	0,00

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses

Wertpapierbestand zum 30.06.2018

Anzahl		Marktwert	% des NIW
		EUR	
37	GOODYEAR TYRE & RUBBER CO – 23,00 - 18.01.19 PUT	4.121	0,01
22	INTERNATIONAL PAPER – 38,00 - 18.01.19 PUT	471	0,00
21	NEWFIELD EXPLORATN – 25,00 - 18.01.19 PUT	2.158	0,00
20	ONEOK INC – 40,00 - 18.01.19 PUT	582	0,00
39	WILLIAMS COMPANIES INC – 20,00 - 18.01.19 PUT	902	0,00
13	WYNN RESORTS – 60,00 - 18.01.19 PUT	56	0,00
Short-Positionen		**-698.908**	**-0,30**
Derivative Instrumente		**-698.908**	**-0,30**
	Optionen	**-698.908**	**-0,30**
	Deutschland	*-6.300*	*0,00*
-18	EURO STOXX BANKS - 105 - 21.12.18 PUT	-4.725	0,00
-18	EURO STOXX BANKS - 90 - 21.12.18 PUT	-1.575	0,00
	Luxemburg	*-245.613*	*-0,10*
-925.000	FX OPTION - PUT USD / CALL INR – 70,50 - 22.10.18	-14.932	-0,01
-2.000.000	PUT CDX OPTION - ITRAXX EUROPE CROSSOVER SERIES 29 INDEX – 337,50 - 18.07.18	-10.328	0,00
-4.000.000	SWAP OPTION - PAY EURIBOR 6M / REC 0,500% - 01.10.18	-296	0,00
-14.000.000	SWAP OPTION - PAY LIBOR 3M / REC 2,500% - 11.12.18	-104.994	-0,04
-1.200.000	SWAP OPTION - PAY LIBOR 3M / REC 2,600% - 05.04.19	-39.831	-0,02
-8.000.000	SWAP OPTION - PAY 0,100% / REC EURIBOR 6M - 01.10.18	-22.352	-0,01
-8.700.000	SWAP OPTION - PAY 0,200% / REC EURIBOR 6M - 09.03.20	-25.820	-0,01
-600.000	SWAP OPTION - PAY 0,500% / REC LIBOR 6M - 21.04.21	-5.988	0,00
-2.200.000	SWAP OPTION - PAY 2,000% / REC LIBOR 3M - 12.09.22	-21.072	-0,01
	Vereinigte Staaten von Amerika	*-446.995*	*-0,20*
-2	S&P 500 INDEX – 2.300 - 21.09.18 PUT	-1.405	0,00
-4	S&P 500 INDEX – 2.325 - 21.12.18 PUT	-10.449	-0,01
-15	S&P 500 INDEX – 2.425 - 21.12.18 CALL	-435.141	-0,19
Gesamt-Wertpapierbestand		**213.270.170**	**90,53**

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses

Wertpapierbestand zum 30.06.2018

Anzahl		Marktwert	% des NIW
		EUR	
Long-Positionen		**77.338.136**	**83,84**
Zur amtlichen Notierung an einer Wertpapierbörse zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte, übertragbare Wertpapiere		**53.379.302**	**57,86**
	Anteile	**3.897.861**	**4,23**
	Österreich	*21.065*	*0,02*
331	AMS	21.065	0,02
	Belgien	*28.632*	*0,03*
331	ANHEUSER BUSCH INBEV SA/NV	28.632	0,03
	Kanada	*29.272*	*0,03*
2.597	BARRICK GOLD NYS (USD)	29.272	0,03
	Cayman Islands	*296.992*	*0,32*
346	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	55.076	0,05
112	BAIDU ADS	23.593	0,03
20.000	CHINA MAPLE LEAF EDUCATIONAL	30.874	0,03
680	CTRIP.COM INTERNATIONAL ADR	27.659	0,03
12.000	GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD	26.660	0,03
699	HUAZHU GROUP LTD ADR	25.013	0,03
409	NW ORIENTL ED & TECHNO GP ADR	32.866	0,04
1.437	TAL EDUCATION GROUP	45.157	0,05
700	TENCENT HOLDINGS LTD	30.094	0,03
	China	*135.985*	*0,15*
5.500	BYD CO LTD-H	28.551	0,03
37.000	CHINA COMMUNICATIONS CONSTR - H	30.618	0,03
55.000	CHINA RAILWAY SIGNAL & COMMUNICATION CORPORATION LTD	33.444	0,05
34.000	GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	22.271	0,02
25.200	GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD	21.101	0,02
	Frankreich	*213.620*	*0,23*
1.249	ALSTOM	49.161	0,06
391	CAP GEMINI SE	45.043	0,05
391	SCHNEIDER ELECTRIC SA	27.925	0,03
267	THALES SA	29.463	0,03
388	VINCI SA	31.956	0,03
1.432	VIVENDI	30.072	0,03
	Deutschland	*452.096*	*0,49*
331	BASF SE	27.112	0,03
288	BAYER AG	27.173	0,03
1.578	DEUTSCHE WOHNEN AG REIT	65.329	0,06
5.601	E.ON SE	51.272	0,06
361	LEG IMMOBILIEN REIT	33.602	0,04
157	LINDE AG	28.079	0,03
3.191	RWE AG	62.304	0,07
373	SIEMENS AG-NOM	42.231	0,05
3.018	TAG IMMOBBILIEN AG	56.829	0,06
1.427	VONOVIA SE NAMEN AKT REIT	58.165	0,06
	Hongkong (China)	*6.432*	*0,01*
2.400	CHINA TAIPING INSURANCE HOLD SHS -H-	6.432	0,01
	Japan	*761.278*	*0,84*
200	FANUC LTD	34.031	0,04
1.700	GMO INTERNET	34.690	0,04
700	HARMONIC DRIVE SYSTEMS	25.386	0,03
4.000	HITACHI LTD	24.175	0,03
100	KEYENCE CORP	48.375	0,05
1.500	MINEBEA MITSUMI INC	21.736	0,02
3.300	MITSUBISHI CHEMICAL HOLDINGS	23.665	0,03
900	NGK SPARK PLUG	21.991	0,02
200	NIDEC CORP	25.711	0,03
500	ORIENTAL LAND	44.945	0,05
2.700	PANASONIC CORP	31.181	0,03
2.700	RECRUIT HOLDING CO LTD	64.010	0,08
1.500	SBI HOLDINGS	33.103	0,04
800	SOFTBANK GROUP CORP	49.321	0,05
1.000	SONY CORP	43.797	0,05
1.400	SUMCO CORP	24.217	0,03
900	SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GRP	29.967	0,03
900	SUMITOMO MITSUI TRUST HLD	30.572	0,03
700	TERUMO CORP	34.371	0,04
600	TREND MICRO INC	29.322	0,03
1.100	UNI-CHARM CORP	28.350	0,03
900	YASKAWA ELECTRIC CORP	27.246	0,03
800	ZENKOKU HOSHO CO LTD	31.116	0,03
	Jersey	*59.464*	*0,06*
17.730	CENTAMIN	23.858	0,03
512	FERGUSON PLC	35.606	0,03
	Luxemburg	*67.260*	*0,07*
1.775	GRAND CITY PROPERTIES S.A.	39.476	0,04
1.768	TENARIS SA	27.784	0,03
	Niederlande	*223.160*	*0,24*
520	FERRARI NV	60.580	0,06
2.611	FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	42.648	0,05
2.297	KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE	47.100	0,05
495	KONINKLIJKE DSM NV	42.629	0,05
318	LYONDELLBASELL	30.203	0,03
	Spanien	*59.162*	*0,06*
5.822	OBRASCON HUARTE LAIN SA	15.958	0,02
2.577	REPSOL	43.204	0,04
	Schweiz	*31.654*	*0,03*
1.106	COCA COLA HBC GBP	31.654	0,03
	Vereinigtes Königreich	*226.797*	*0,25*
1.993	BHP BILLITON PLC	38.447	0,04
7.568	BP PLC	49.488	0,06
754	RIO TINTO PLC	35.818	0,04
1.639	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A	48.793	0,05
623	SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC	25.533	0,03
1.050	TECHNIPFMC PLC EUR	28.718	0,03

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses

Wertpapierbestand zum 30.06.2018

Anzahl		Marktwert EUR	% des NIW
	Vereinigte Staaten von Amerika	*1.284.992*	*1,40*
432	ACTIVISION BLIZZARD INC	28.235	0,03
693	ALCOA CORP	27.707	0,03
34	ALPHABET INC	33.023	0,04
22	AMAZON.COM	32.161	0,03
782	ANADARKO PETROLEUM CORP	49.315	0,05
226	ANTHEM INC	46.758	0,05
188	APPLE INC	29.971	0,03
280	AUTODESK INC	31.536	0,03
900	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	34.796	0,04
807	CONOCOPHILLIPS	48.178	0,05
140	COOPER COMPANIES INC	28.347	0,03
823	CSX CORP	45.290	0,05
243	DEERE & CO	29.529	0,03
868	DEVON ENERGY CORPORATION	32.919	0,04
229	ELECTRONIC ARTS INC	27.635	0,03
194	FACEBOOK A	32.561	0,04
379	FMC CORP	29.153	0,03
683	FORTIVE CORP - W/I	45.167	0,05
332	HOME DEPOT INC	55.818	0,06
250	IAC/INTERACTIVECOR	32.662	0,04
120	ILLUMINA	28.614	0,03
85	INTUITIVE SURGICAL	34.861	0,04
708	MARATHON PETROLEUM	42.763	0,05
1.453	NEWMONT MINING CORP	47.389	0,05
994	NOBLE ENERGY	30.164	0,03
128	NVIDIA CORP	26.101	0,03
159	PALO ALTO NETWORKS INC	28.103	0,03
275	PROOFPOINT INC	27.117	0,03
258	SALESFORCE.COM	30.115	0,03
285	SPLUNK INC	24.103	0,03
359	TAKE TWO INTERACTIVE SOFTWARE	36.609	0,04
338	TIFFANY & CO	38.306	0,04
1.002	TRIMBLE NAVIGATION	28.501	0,03
286	UNITED PARCEL SERVICE-B	26.206	0,03
202	UNITED RENTALS INC	25.883	0,03
645	VERIZON COMMUNICATIONS INC	27.920	0,03
309	WALT DISNEY COMPANY	27.866	0,03
271	ZEBRA TECH -A-	33.610	0,04
	Anleihen	**48.564.406**	**52,64**
	Argentinien	*37.739*	*0,04*
75.000	YPF SOCIEDAD ANONIMA 0% 07/07/2020	37.739	0,04
	Australien	*1.489.810*	*1,62*
600.000	AUSTRALIA I %1,25 21/02/2022	441.804	0,48
600.000	AUSTRALIA 4,2% 21/04/2026	425.399	0,46
200.000	AUSTRALIAI 0,75% 21/11/2027	129.362	0,14
550.000	AUSTRALIAI 3,00% 20/09/2025	493.245	0,54
	Österreich	*120.375*	*0,13*
125.000	AT &S AUSTRIA TECHNOLOGIE & SYSTEMTECHNIK AG VAR PERPETUAL	120.375	0,13

Anzahl		Marktwert EUR	% des NIW
	Belgien	*400.454*	*0,43*
100.000	BELFIUS BANQUE SA/NV 1,00% 26/10/2024	97.585	0,11
100.000	BELFIUS BANQUE SA/NV 3,125% 11/05/2026	103.927	0,11
200.000	KBC GROUP SA/NV FRN 24/11/2022	198.942	0,21
	Kanada	*3.855.944*	*4,18*
200.000	CANADAI 1,25% 01/12/2047	171.677	0,19
2.600.000	CANADAI 4,25% 01/12/2021	3.086.720	3,34
250.000	CANADAI 4,25% 01/12/2026	326.164	0,35
200.000	ITHACA ENERGY INC 8,125% 01/07/2019	170.802	0,19
100.000	ROYAL BANK OF CANADA FRN 06/08/2020	100.581	0,11
	Cayman Islands	*104.395*	*0,11*
100.000	VIRIDIAN GRP FUNDCO 2 4,75% 15/09/2024	104.395	0,11
	China	*157.677*	*0,17*
200.000	UNION LIFE INSURANCE CO LTD 3,00% 19/09/2021	157.677	0,17
	Dänemark	*323.004*	*0,35*
100.000	JYSKE BANK A/S FRN 01/12/2022	100.776	0,11
100.000	NORICAN A/S 4,50% 15/05/2023	91.540	0,10
130.000	NYKREDIT REALKREDIT AS 0,375% 16/06/2020	130.688	0,14
	Finnland	*131.775*	*0,14*
140.000	STOCKMANN PIC 4,75% 11/01/2022	131.775	0,14
	Frankreich	*1.781.713*	*1,93*
100.000	ALD INTERNATIONAL FRN 26/02/2021	99.708	0,11
138.000	BNP PARIBAS SA FRN 22/09/2022	138.760	0,15
200.000	BNP PARIBAS SA VAR PERPETUAL	170.047	0,18
100.000	CROWN EUROPEAN HOLDINGS 2,875% 01/02/2026	94.533	0,10
100.000	ENGIE SA VAR PERPETUAL	93.609	0,10
200.000	HOLDIKKS SAS 6,75% 15/07/2021	93.734	0,10
100.000	INFRA PARK 2,00% 06/07/2029	99.023	0,11
69.000	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE VAR 26/11/2018	69.065	0,07
67.000	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE 0% 26/05/2020	67.113	0,07
200.000	MARCOLIN SPA VAR 15/02/2023	198.204	0,22
200.000	MERCIALYS 2,00% 03/11/2027	201.516	0,23
100.000	RCI BANQUE SA 0,25% 12/07/2021	99.515	0,11
100.000	SANOFI SA VAR 21/03/2020	100.408	0,11
100.000	TIKEHAU CAPITAL PARTNERS 3,00% 27/11/2023	96.788	0,10
200.000	VALLOUREC 2,25% 30/09/2024	159.690	0,17
	Deutschland	*5.506.708*	*5,97*
200.000	CBR FASHION HOLDING GMBH 5,125% 01/10/2022	170.628	0,18
200.000	DEUTSCHE PFANDBRIEFBANK AG 4,60% 22/02/2027	204.382	0,22
4.000.000	GERMANY BUNDI 1,75% 15/04/2020	4.776.575	5,18
100.000	HBO S STERLING FINANCE JERSEY LP VAR PERPETUAL	164.637	0,18
100.000	SAP SE VAR 13/03/2021	100.449	0,11
100.000	TALANX AG VAR 05/12/2047	90.037	0,10

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses

Wertpapierbestand zum 30.06.2018

Anzahl		Marktwert	% des NIW
		EUR	
	Griechenland	*98.268*	*0,11*
100.000	PIRAEUS BANK SA FRN 31/10/2022	98.268	0,11
	Guernsey	*95.352*	*0,10*
100.000	SUMMIT GERMANY LTD 2,00% 31/01/2025	95.352	0,10
	Hongkong (China)	*158.588*	*0,17*
200.000	WELL HOPES DEVELOPMENT HOLDINGS LIMITED VAR PERPETUAL	158.588	0,17
	Island	*198.053*	*0,21*
100.000	LANDSBANKINN HF 1,00% 30/05/2023	98.888	0,11
100.000	LSLANDSBANKI HF VAR 19/01/2024	99.165	0,10
	Irland	*211.470*	*0,23*
100.000	FCA CAPITAL IRELAND PLC 1,00% 15/11/2021	100.143	0,11
100.000	VIRGIN MEDIA RECEIVABLES FINANCING NOTES I DESIGNATED 5,50% 15/09/2024	111.327	0,12
	Italien	*15.383.661*	*16,67*
100.000	ANSALDO ENERGIA S.P.A 2,75% 31/05/2024	89.117	0,10
100.000	BANCA FARMAFACTORING SPA FRN 05/06/2020	95.464	0,10
100.000	BORMIOLI PHARMA BIDCO S P A VAR 15/11/2024	97.297	0,11
100.000	CMC RAVENNA 6,00% 15/02/2023	84.478	0,09
100.000	CMF 9,00% 15/06/2022	85.244	0,09
100.000	COOPERATIVA MURATORI & C 6,875% 01/08/2022	89.113	0,10
200.000	ERG SPA 2,175% 19/01/2023	188.804	0,20
100.000	ICCREA BANCA SPA FRN 18/06/2025	90.375	0,10
200.000	ICCREA BANCA SPA 1,875% 25/11/2019	200.262	0,22
1.000.000	ITALY BTP 0% 30/05/2019	997.840	1,08
800.000	ITALY BTP 0% 30/10/2019	795.288	0,86
500.000	ITALY BTP 0,05% 15/10/2019	497.135	0,54
250.000	ITALY BTP 1,50% 01/08/2019	253.080	0,27
250.000	ITALY BTP 2,50% 01/05/2019	254.743	0,28
2.000.000	ITALY BTPI 0,50% 20/04/2023	1.970.835	2,14
5.000.000	ITALY BTPI 1,25% 27/10/2020	5.136.350	5,57
2.500.000	ITALY BTPI 1,65% 23/04/2020	2.574.261	2,79
500.000	ITALY CCT FRN 15/11/2019	502.180	0,54
100.000	ITALY CCT FRN 15/12/2020	99.001	0,11
106.000	KEDRION SPA 3,00% 12/07/2022	101.979	0,11
100.000	L'ISOLANTE K-FLEX SPA 4,25% 07/10/2023	101.589	0,11
100.000	MERCEDES BENZ FINANCIAL SERVICES ITALIA SPA FRN 22/06/2020	99.848	0,11
100.000	OFFICINE MACCAFERRI SPA 5,75% 01/06/2021	99.952	0,11
100.000	PIRELLI C SPA 1,375% 25/01/2023	96.726	0,10
100.000	PRO GEST SPA 3,25% 15/12/2024	94.888	0,10
100.000	SALINI SPA 1,75% 26/10/2024	86.038	0,09
150.000	SNAM SPA FRN 02/08/2024	147.717	0,16
100.000	UNICREDIT SPA VAR 31/08/2024	93.679	0,10
120.000	UNIONE DI BANCHE ITALIAN 0,75% 17/10/2022	112.610	0,12
100.000	WIND TRE S P A VAR 20/01/2024	83.054	0,09
100.000	WIND TRE S P A 2,625% 20/01/2023	83.875	0,09
100.000	WIND TRE S P A 3,125% 20/01/2025	80.839	0,09
	Japan	*3.354.235*	*3,64*
200.000.000	JAPAN JGB 0,20% 20/12/2018	1.548.749	1,68
200.000	JAPAN JGB 1,50% 21/07/2021	163.388	0,18
200.000.000	JAPAN JGBI 0,10% 10/03/2026	1.642.098	1,78
	Jersey	*255.577*	*0,28*
200.000	ADIENT GLOBAL HOLDINGS LTD 4,875% 15/08/2026	154.169	0,17
100.000	KENNEDY WILSON EUROPE REAL ESTATE 3,25% 12/11/2025	101.408	0,11
	Kenia	*170.782*	*0,19*
200.000	EASTERN AND SOUTHERN 5,375% 14/03/2022	170.782	0,19
	Luxemburg	*1.067.925*	*1,16*
102.000	ALLERGAN FUNDING SCS FRN 01/06/2019	102.066	0,11
100.000	ALLERGAN FUNDING SCS 0,50% 01/06/2021	100.002	0,11
100.000	ARCELORMITTAL SA 0,95% 17/01/2023	98.168	0,11
60.000	BC LUCXO 1 SA 6,125% 10/08/2022	49.346	0,05
100.000	CNH INDUSTRIAL FINANCE EUROPE S A 1,375% 23/05/2022	100.851	0,11
100.000	CNH INDUSTRIAL FINANCE EUROPE S A 1,75% 12/09/2025	96.845	0,10
100.000	CRYSTAL ALMOND S A R L 10,00% 01/11/2021	105.943	0,12
100.000	GALAPAGOS HOLDING SA 7,00% 15/06/2022	56.090	0,06
103.000	GARFUNKELUX HOLDCO 3 SA VAR 01/09/2023	91.004	0,10
100.000	KLEOPATRA HOLDINGS 8,50% 30/06/2023	74.785	0,08
100.000	MONITCHEM HOLDCO 3 SA 5,25% 15/06/2021	98.780	0,11
100.000	PICARD BONDO 5,50% 30/11/2024	94.045	0,10
	Malta	*95.150*	*0,10*
100.000	EVAN GROUP PLC 6,00% 31/07/2022	95.150	0,10
	Niederlande	*1.884.326*	*2,04*
200.000	ABN AMRO BANK NV FRN 18/01/2019	171.731	0,19
200.000	ABN AMRO BANK NV 2,10% 18/01/2019	170.639	0,18
100.000	ALLIANZ FINANCE II BV FRN 07/12/2020	100.960	0,11
200.000	BMW FINANCE NV VAR 06/02/2020	200.396	0,22
600.000	COOPERATIEVE RABOBANK UA 0% 28/10/2026	268.970	0,29
111.000	ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 1,00% 16/09/2024	109.605	0,12
142.000	EXOR HOLDINGS N.V 3,125% 15/02/2038	140.512	0,15
100.000	KONINKLIJKE KPN NV 0,625% 09/04/2025	96.046	0,10
102.000	LEASEPLAN CORPORATION NV FRN 25/01/2021	102.283	0,11
100.000	NYRSTAR NETHERLANDS 8,50% 15/09/2019	101.777	0,11
150.000	SAMVARDHANA MOTHERSON AUTOMOTIVE SYSTEMS GROUP BV 1,80% 06/07/2024	136.937	0,15
100.000	STEDIN HOLDING NV VAR 24/10/2022	99.934	0,11
75.000	VOLKSWAGEN FINANCIAL SERVICES NV 1,50% 12/04/2021	84.166	0,09
100.000	VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV 0,50% 30/03/2021	100.370	0,11
	Nigeria	*336.352*	*0,36*
200.000	UNITED BANK FOR AFRICA PLC 7,75% 08/06/2022	165.977	0,18
200.000	ZENITH BANK PLC 7,375% 30/05/2022	170.375	0,18

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses

Wertpapierbestand zum 30.06.2018

Anzahl		Marktwert	% des NIW
		EUR	
	Oman	*155.378*	*0,17*
200.000	OMAN 6,75% 17/01/2048	155.378	0,17
	Spanien	*482.030*	*0,52*
100.000	ACCIONA FINANCIACION FILALES UNIPERSONAL FRN 29/12/2019	101.317	0,11
100.000	BANCO DE CREDITO SOCIAL COOPERATIVO SA VAR 03/11/2026	99.739	0,11
200.000	BANCO SANTANDER SA 4,25% 11/04/2027	162.861	0,17
133.000	HAYA FINANCE 2017 SA 5,25% 15/11/2022	118.113	0,13
	Schweden	*629.097*	*0,68*
200.000	NORDEA BANK AB VAR PERPETUAL	167.263	0,18
200.000	NORDEA BANK AB VAR PERPETUAL	163.834	0,18
200.000	SCANIA CV AB FRN 20/04/2020	200.392	0,21
100.000	TRANSCOM HOLDING AB 6,50% 22/03/2023	97.608	0,11
	Schweiz	*154.100*	*0,17*
200.000	JULIUS BAER GROUP LTD VAR PERPETUAL	154.100	0,17
	Tunesien	*107.323*	*0,12*
110.000	BANQUE CENTRALE DE TUNISIE 5,625% 17/02/2024	107.323	0,12
	Vereinigtes Königreich	*2.237.044*	*2,43*
100.000	ARROW GLOBAL FINANCE PLC VAR 01/04/2025	94.968	0,10
100.000	BARCLAYS BANK PLC VAR 31/12/2099	124.836	0,14
114.000	BARCLAYS PLC 1,375% 24/01/2026	108.324	0,12
100.000	BOPARAN FINANCE PLC 5,50% 15/07/2021	97.759	0,11
100.000	CREDIT AGRICOLE S A LONDON BRANCH FRN 06/03/2023	98.921	0,11
100.000	DEBENHAMS PLC 5,25% 15/07/2021	94.042	0,10
200.000	JAGUAR LAND ROVER PLC 4,50% 01/10/2027	152.350	0,17
100.000	MATALAN FINANCE PLC 9,50% 31/01/2024	102.174	0,11
130.000	NATWEST MARKETS PLC FRN 02/03/2020	129.956	0,14
142.000	NATWEST MARKETS PLC 0,625% 02/03/2022	140.567	0,15
150.000	PINEWOOD FINCO PLC 3,75% 01/12/2023	169.131	0,17
200.000	PRUDENTIAL PLC 4,875% PERPETUAL	146.923	0,16
100.000	RAC BOND CO 5,00% 06/11/2022	106.694	0,12
200.000	RBS GROUP PLC FRN 15/05/2023	172.123	0,18
100.000	SANTANDER UK GROUP HOLDINGS PLC FRN 18/05/2023	99.530	0,11
100.000	TWINKLE PIZZA PLC 8,625% 01/08/2022	89.392	0,10
100.000	VIRGIN MEDIA FINANCE PLC 6,375% 15/10/2024	117.325	0,13
100.000	VIRIDIAN GROUP FINANCE CO PLC 4,00% 15/09/2025	92.470	0,10
100.000	WPP FINANCE 2013 FRN 20/03/2022	99.559	0,11
	Vereinigte Staaten von Amerika	*7.580.101*	*8,22*
98.000	AT&T INC 5,15% 15/02/2050	79.410	0,09
134.000	BANK OF AMERICA CORP FRN 04/05/2023	134.344	0,15
150.000	BANK OF AMERICA CORP FRN 07/02/2022	150.975	0,16
100.000	BANK OF AMERICA CORP FRN 21/09/2021	99.745	0,11
150.000	BANK OF AMERICA CORP 0,75% 26/07/2023	149.339	0,16
60.000	BAT CAPITAL CORP 2,764% 15/08/2022	49.272	0,05
100.000	BECTON DICKINSON & CO 0,368% 06/06/2019	100.283	0,11
43.000	BECTON DICKINSON & CO 2,133% 06/06/2019	36.500	0,04
37.000	CARDTRONICS INC/USA 5,50% 01/05/2025	28.600	0,03
165.000	CITIGROUP INC FRN 21/03/2023	164.320	0,18
150.000	CITIGROUP INC 2,70% 27/10/2022	123.342	0,13
30.000	DELTA AIR LINES INC DE 2,60% 04/12/2020	25.148	0,03
41.000	DISCOVERY COMMUNICATIONS LLC FRN 20/09/2019	35.289	0,04
44.000	DOMINION ENERGY INC VAR 01/07/2020	37.118	0,04
100.000	FORD MOTOR CREDIT CO LLC FRN 01/12/2021	99.213	0,11
100.000	FORD MOTOR CREDIT CO LLC FRN 07/12/2022	98.282	0,11
102.000	GENERAL MOTORS FINANCIAL CO FRN 26/03/2022	101.722	0,11
138.000	GOLDMAN SACHS GROUP INC. FRN 09/09/2022	137.757	0,15
100.000	GOLDMAN SACHS GROUP INC. VAR PERPETUAL	83.649	0,09
63.000	GOLDMAN SACHS GROUP INC. VAR PERPETUAL	50.673	0,05
52.000	HYUNDAI CAPITAL AMERICA INC FRN 12/03/2021	44.557	0,05
1.000.000	INTERNATIONAL BANK FOR RECONSTRUCTION & DEVELOPMENT 0% 28/10/2024	487.706	0,53
150.000	KEYCORP VAR PERPETUAL	124.562	0,14
100.000	MORGAN STANLEY BAML TRUST 2012-C6 FRN 09/11/2021	99.511	0,11
100.000	NISSAN MOTOR ACCEPTANCE CORP 1,90% 14/09/2021	81.519	0,09
200.000	PRUDENTIAL FINANCIAL INC 4,375% PERPETUAL	133.605	0,14
600.000	USA T-BONDS 1,50% 15/08/2026	464.273	0,50
4.000.000	USA T-BONDSI 0,125% 15/04/2019	3.640.523	3,94
800.000	USA T-BONDSI 0,625% 15/01/2026	718.864	0,78
	Konvertierbare Anleihen	**917.035**	**0,99**
	Frankreich	*249.868*	*0,27*
2.777	FIGEAC AERO SA 1,125% 18/10/2022 CV	67.623	0,07
271	MAISONS DU MONDE SA 0,125% 06/12/2023 CV	13.030	0,01
500	UNIBAIL-RODAMCO SE 0% 01/01/2022 CV	169.215	0,19
	Italien	*283.680*	*0,30*
100.000	PRYSMIAN SPA 0% 17/01/2022 CV	98.894	0,10
100.000	SAFILO GROUP SPA 1,25% 22/05/2019 CV	89.757	0,10
100.000	TELECOM ITALIA SPA 1,125% 26/03/2022 CV	95.029	0,10
	Jersey	*112.502*	*0,12*
100.000	BALFOUR BEATTY FINNACE NO.2 LIMITED 1,875% 03/12/2018 CV	112.502	0,12
	Niederlande	*70.563*	*0,08*
100.000	AMERICA MOVIL B.V. 5,50% 17/09/2018 CV	70.563	0,08
	Vereinigte Arabische Emirate	*92.906*	*0,10*
100.000	ABAR INVESTMENTS PJSC 0,50% 27/03/2020 CV	92.906	0,10
	Vereinigtes Königreich	*107.516*	*0,12*
100.000	VODAFONE GROUP PLC 0% 26/11/2020 CV	107.516	0,12
Anteile/Aktien von OGAW/OGA		**23.575.040**	**25,56**
	Aktien/Anteile an Investmentfonds	**23.575.040**	**25,56**
	Frankreich	*86.632*	*0,09*
2.240	LYXOR ETF COMM CRB	35.871	0,04

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses

Wertpapierbestand zum 30.06.2018

Anzahl		Marktwert	% des NIW
		EUR	
1.593	LYXOR ETF RUS DJ AD	50.761	0,05
	Italien	*139.593*	*0,15*
59	ATLANTIC 1	16.520	0,02
19	ALPHA IMMOBILIARE SGR	26.787	0,03
17	AMUNDI RE EUROPA (D)	16.949	0,02
21	AMUNDI RE ITALIA (D)	17.556	0,02
27	BENI STABILI GESTIONI - INVEST REAL SECURITY	11.070	0,01
91	BETA IMMOBILIARE	4.495	0,00
8	IMMOBILIUM 2001	11.920	0,01
27	INVESTIETICO	671	0,00
12	POLIS FUND	6.624	0,01
12	SECURFONDO FONDO COMMUNE DI INVESTMENTO IMMO CHIUSO FCP	3.384	0,00
52	SOCRATE - FONDO DI INVESTIMENTO IMMOBILIARE DI TIPO	14.664	0,02
4	VALORE IMMOBILIARE GLOBALE	2.476	0,00
15	VEGAGEST EUROPA IMMOBILIARE1	6.477	0,01
	Jersey	*769.195*	*0,83*
3.466	ETC COTTON	8.131	0,01
23.049	ETFS COMMODITY SECURITIES LTD	208.962	0,23
1.701	ETFS COMMODITY SECURITIES LTD CERTIFICATE	18.488	0,02
4.945	ETFS COMMODITY SECURITIES LTD ETF	2.514	0,00
417	ETFS METAL SEC ETFS PHYSICAL GOLD	42.788	0,05
3.328	ETFS PHYSICAL GOLD	341.480	0,36
557	ETFS PHYSICAL PLATINIUM	38.466	0,04
4.610	ETFS PHYSICAL SILVER	60.243	0,07
87.518	ETFS WHEAT	48.123	0,05
	Luxemburg	*22.579.620*	*24,49*
2.409	PI INVESTMENT FUNDS - OPTIMISER H ND	4.147.792	4,50
2.826	AMUNDI INDEX SOL SICAV EQUITY GBL MULTI SMT ALL SCI BETA ETF	1.090.695	1,18
17.342	AMUNDI S.F. - ABSOLUTE RETURN MULTI-STRATEGY CONTROL H ND	17.341.133	18,81
Derivative Instrumente		**383.794**	**0,42**
	Optionen	**383.794**	**0,42**
	Deutschland	*140.815*	*0,15*
18	DJ EURO STOXX 50 EUR – 2.300 - 21.12.18 PUT	1.350	0,00
18	DJ EURO STOXX 50 EUR – 2.800 - 21.12.18 CALL	102.006	0,11
10	DJ EURO STOXX 50 EUR – 3.100 - 21.12.18 PUT	6.230	0,01
4	DJ EURO STOXX 50 EUR – 3.150 - 21.09.18 PUT	1.364	0,00
15	DJ EURO STOXX 50 EUR – 3.250 - 21.12.18 CALL	29.745	0,03
12	EURO STOXX BANKS - 140 - 21.12.18 CALL	120	0,00
	Japan	*53.123*	*0,06*
3	NIKKEI 225 – 20.250 - 14.12.18 CALL	53.123	0,06
	Luxemburg	*184.873*	*0,20*
800.000	CALL CDX OPTION - ITRAXX EUROPE CROSSOVER SERIES 29 INDEX – 287,50 - 18.07.18	80	0,00
3.000.000	SWAP OPTION - PAY EURIBOR 6M / REC 0,270% - 01.10.18	22.014	0,02
2.100.000	SWAP OPTION - PAY EURIBOR 6M / REC 0,700% - 09.03.20	20.145	0,02
5.000.000	SWAP OPTION - PAY LIBOR 3M / REC 2,000% - 11.12.18	342	0,00
5.000.000	SWAP OPTION - PAY LIBOR 3M / REC 2,500% - 10.09.18	485	0,00
7.000.000	SWAP OPTION - PAY SAIBOR 3M / REC 3,470% - 10.06.19	7.995	0,01
200.000	SWAP OPTION - PAY 1,500% / REC LIBOR 6M - 21.04.27	33.974	0,04
5.000.000	SWAP OPTION - PAY 2,150% / REC LIBOR 3M - 09.11.18	62.340	0,07
750.000	SWAP OPTION - PAY 2,500% / REC LIBOR 3M - 12.09.22	22.903	0,02
150.000	SWAP OPTION - PAY 2,690% / REC LIBOR 3M - 05.04.19	9.018	0,01
7.000.000	SWAP OPTION - PAY 3,470% / REC SAIBOR 3M - 10.06.19	5.577	0,01
	Vereinigte Staaten von Amerika	*4.983*	*0,01*
16	ALLY FINANCIAL INC – 15,00 - 18.01.19 PUT	206	0,00
4	ANADARKO PETROLEUM CORP – 50,00 - 18.01.19 PUT	188	0,00
5	APACHE CORP – 40,00 - 18.01.19 PUT	827	0,00
13	DOW JONES INDUSTRIAL AVG - 280 - 21.09.18 CALL	278	0,00
13	DOW JONES INDUSTRIAL AVG - 290 - 21.12.18 CALL	501	0,00
14	GEN GROWTH PROP – 17,74 - 18.01.19 PUT	420	0,00
11	GOODYEAR TYRE & RUBBER CO – 23,00 - 18.01.19 PUT	1.224	0,01
7	INTERNATIONAL PAPER – 38,00 - 18.01.19 PUT	150	0,00
7	NEWFIELD EXPLORATN – 25,00 - 18.01.19 PUT	719	0,00
6	ONEOK INC – 40,00 - 18.01.19 PUT	175	0,00
12	WILLIAMS COMPANIES INC – 20,00 - 18.01.19 PUT	278	0,00
4	WYNN RESORTS – 60,00 - 18.01.19 PUT	17	0,00
Short-Positionen		**-233.490**	**-0,25**
Derivative Instrumente		**-233.490**	**-0,25**
	Optionen	**-233.490**	**-0,25**
	Deutschland	*-2.100*	*0,00*
-6	EURO STOXX BANKS - 105 - 21.12.18 PUT	-1.575	0,00
-6	EURO STOXX BANKS - 90 - 21.12.18 PUT	-525	0,00
	Luxemburg	*-80.416*	*-0,09*
-800.000	PUT CDX OPTION - ITRAXX EUROPE CROSSOVER SERIES 29 INDEX – 337,50 - 18.07.18	-4.131	0,00
-1.500.000	SWAP OPTION - PAY EURIBOR 6M / REC 0,500% - 01.10.18	-111	0,00
-5.000.000	SWAP OPTION - PAY LIBOR 3M / REC 2,500% - 11.12.18	-37.498	-0,05
-350.000	SWAP OPTION - PAY LIBOR 3M / REC 2,600% - 05.04.19	-11.617	-0,01
-3.000.000	SWAP OPTION - PAY 0,100% / REC EURIBOR 6M - 01.10.18	-8.382	-0,01
-3.200.000	SWAP OPTION - PAY 0,200% / REC EURIBOR 6M - 09.03.20	-9.497	-0,01
-200.000	SWAP OPTION - PAY 0,500% / REC LIBOR 6M - 21.04.21	-1.996	0,00

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses

Wertpapierbestand zum 30.06.2018

Anzahl		Marktwert	% des NIW
		EUR	
-750.000	SWAP OPTION - PAY 2,000% / REC LIBOR 3M - 12.09.22	-7.184	-0,01
	Vereinigte Staaten von Amerika	*-150.974*	*-0,16*
-1	S&P 500 INDEX – 2.300 - 21.09.18 PUT	-702	0,00
-2	S&P 500 INDEX – 2.325 - 21.12.18 PUT	-5.225	-0,01
-5	S&P 500 INDEX – 2.425 - 21.12.18 CALL	-145.047	-0,15
Gesamt-Wertpapierbestand		**77.104.646**	**83,59**

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses

Wertpapierbestand zum 30.06.2018

Anzahl		Marktwert	% des NIW
		EUR	
Long-Positionen		**33.337.115**	**92,80**
Zur amtlichen Notierung an einer Wertpapierbörse zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte, übertragbare Wertpapiere		**180.235**	**0,50**
	Anleihen	**180.235**	**0,50**
	Spanien	*180.235*	*0,50*
150.000	SPAINI 1,80% 30/11/2024	180.235	0,50
Anteile/Aktien von OGAW/OGA		**33.156.880**	**92,30**
	Aktien/Anteile an Investmentfonds	**33.156.880**	**92,30**
	Irland	*8.510.662*	*23,69*
8.323	ALGEBRIS FINANC.CRD ACC.I EUR	1.243.173	3,46
25.000	ISHARES II DJ EURO STOXX 50	874.625	2,43
20.000	ISHARES MSCI EMERGING MARKETS	709.600	1,98
22.104	LEGG MASON BRANDYWINE GL FIXED INCOME FD ACC SHS PRE CL USD	2.236.012	6,22
17.165	MUZINICH SHORT DURATION HIGH YIELD FUND CLASS S	1.866.674	5,20
99.269	PIMCO GLOBAL INVESTMENT GRADE	1.580.578	4,40
	Luxemburg	*22.880.705*	*63,70*
1.293	ABERDEEN GLOBAL EMERGING MARKETS INFRASTRUCTURE EQUITY I2A	971.114	2,70
5.214	ABN AMRO MULTI MANAGER ARISTOTLE US CLASS I CAP USD	771.312	2,15
5.950	ALKEN FD ARE I CAP C	906.594	2,52
3.665	AMUNDI FUNDS BOND EURO CORPORATE SHORT TERM OR D	3.673.031	10,23
1.028	AMUNDI FUNDS BOND GLOBAL AGGREGATE OU C	1.186.087	3,30
0,093	AMUNDI FUNDS BOND GLOBAL EMERGING BLENDED OE- C	1.062.375	2,96
5.331	AMUNDI FUNDS CASH EUR OE C	5.422.752	15,11
10	CPR INVEST SHS-I-SICAV	1.189.481	3,31
6.419	DNCA INVEST SICAV EUROSE	1.099.964	3,06
155.473	JANUS HENDERSON FUND SICAV	1.123.492	3,13
6.973	JANUS HENDERSON HF EURO CORP BOND I2	1.118.484	3,11
11.862	JPMORGAN FUNDS EMERGING MARKETS EQUITY FUND SICAV	1.211.459	3,37
145.717	JUPITER DYNAMIC CLASS I	1.847.697	5,14
15.425	PFLUX CLEAN ENERG I USD	1.296.863	3,61
	Vereinigtes Königreich	*1.765.513*	*4,91*
259.837	FIRST STATE ASIA PACIFIC LEADERS B	574.942	1,60
704.813	FIRST STATE INVESTMENT SICAV FS GLOBAL PROP SECS SICAV	1.190.571	3,31
Gesamt-Wertpapierbestand		**33.337.115**	**92,80**

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses

Wertpapierbestand zum 30.06.2018

Anzahl		Marktwert	% des NIW
		EUR	
Long-Positionen		**144.300.813**	**100,23**
Zur amtlichen Notierung an einer Wertpapierbörse zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte, übertragbare Wertpapiere		**124.192.320**	**86,26**
	Anteile	**47.968.985**	**33,32**
	Belgien	*625.801*	*0,43*
3.746	ANHEUSER BUSCH INBEV SA/NV	324.029	0,22
4.564	KBC GROUPE	301.772	0,21
	Kanada	*833.423*	*0,58*
21.232	AGNICO EAGLE MINES USD	833.423	0,58
	Curacao	*815.247*	*0,57*
14.196	SCHLUMBERGER LTD	815.247	0,57
	Finnland	*250.617*	*0,17*
50.835	NOKIA OYJ	250.617	0,17
	Frankreich	*2.448.838*	*1,70*
2.417	ACCOR SA	101.562	0,07
2.002	AIR LIQUIDE	215.615	0,15
8.304	BNP PARIBAS	441.690	0,31
8.170	CARREFOUR SA	113.318	0,08
1.306	L'OREAL SA	276.219	0,19
18.520	ORANGE	265.669	0,18
4.653	SANOFI	319.428	0,22
1.256	SCHNEIDER ELECTRIC SA	89.704	0,06
11.983	TOTAL	625.633	0,44
	Deutschland	*2.377.392*	*1,65*
4.224	BAYER AG	398.534	0,28
4.338	DEUTSCHE POST AG-NOM	121.334	0,08
16.835	DEUTSCHE TELEKOM AG-NOM	223.400	0,16
34.873	E.ON SE	319.227	0,22
4.178	FRESENIUS SE & CO KGAA	287.446	0,20
445	MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS AG-NOM	80.567	0,06
238	PUMA AG	119.238	0,08
1.129	SAP SE	111.715	0,08
3.560	SIEMENS AG-NOM	403.064	0,27
4.166	SYMRISE	312.867	0,22
	Irland	*1.157.952*	*0,80*
8.638	CRH PLC	262.163	0,18
8.621	MEDTRONIC PLC	631.909	0,44
16.696	RYANAIR HLDS PLC LSE	263.880	0,18
	Italien	*592.908*	*0,41*
4.804	ENI SPA	76.412	0,05
178.854	INTESA SANPAOLO SPA	444.721	0,31
3.365	PRYSMIAN SPA	71.775	0,05
	Liberia	*648.867*	*0,45*
7.314	ROYAL CARIBBEAN CRUISES	648.867	0,45
	Niederlande	*2.009.708*	*1,40*
266	ASML HOLDING N.V.	45.140	0,03
9.228	ASR NEDERLAND N.V	322.795	0,22
1.799	FERRARI NV	209.584	0,15
6.159	FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	100.601	0,07
39.812	ING GROUP NV	490.803	0,35
17.672	KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE	362.364	0,25
80.079	KONINKLIJKE KPN NV	186.584	0,13
8.012	KONINKLIJKE PHILIPS N.V.	291.837	0,20
	Spanien	*365.115*	*0,25*
55.120	IBERDROLA SA	365.115	0,25
	Schweden	*177.392*	*0,12*
26.752	ERICSSON LM B	177.392	0,12
	Schweiz	*994.182*	*0,69*
1.524	CIE FINANCIERE RICHEMONT SA	110.578	0,08
9.384	NESTLE SA	622.444	0,43
4.022	NOVARTIS AG-NOM	261.160	0,18
	Vereinigtes Königreich	*5.004.307*	*3,48*
7.341	ANGLO AMERICAN PLC	140.686	0,10
6.324	ASTRAZENECA PLC	375.643	0,26
32.994	BAE SYSTEMS PLC	241.313	0,17
2.772	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	120.052	0,08
4.610	BURBERRY GROUP	112.598	0,08
5.710	CARNIVAL PLC	280.674	0,19
10.326	DIAGEO	317.831	0,22
14.733	GLAXOSMITHKLINE PLC	254.860	0,18
51.563	HSBC HOLDINGS PLC	414.380	0,29
11.561	IMPERIAL BRAND SHS PLC	368.917	0,26
97.704	ITV	192.237	0,13
3.457	LONDON STOCK EXCHANGE	174.775	0,12
34.963	NATIONAL GRID PLC	331.464	0,23
18.571	PRUDENTIAL PLC	364.238	0,25
3.588	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	253.130	0,18
13.832	ROYAL DUTCH SHELL A SHARES	411.198	0,29
7.711	SMITHS GROUP	148.055	0,10
175.536	VODAFONE GROUP	364.867	0,25
6.075	WEIR GROUP	137.389	0,10
	Vereinigte Staaten von Amerika	*29.667.236*	*20,62*
7.907	ACTIVISION BLIZZARD INC	516.862	0,36
3.721	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	395.668	0,27
515	ALPHABET INC	498.080	0,35
842	ALPHABET INC SHS C	804.571	0,56
9.490	AMEREN CORPORATION	494.353	0,34
11.303	AMERICAN ELECTRIC POWER INC	670.309	0,47
8.256	ANADARKO PETROLEUM CORP	517.967	0,36
5.841	APPLE INC	926.064	0,64
18.606	AT&T INC	512.101	0,36
10.530	BANK OF AMERICA CORP	254.242	0,18
315	BOOKING HOLDINGS INC	546.900	0,38

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses

Wertpapierbestand zum 30.06.2018

Anzahl		Marktwert	% des NIW
		EUR	
8.356	BRISTOL MYERS SQUIBB CO	396.276	0,28
2.399	BROADCOM INC	498.560	0,35
2.191	CARLISLE COS	203.309	0,14
4.854	CDW CORP	335.878	0,23
3.103	CENTENE	327.429	0,23
22.574	CENTURYTEL INC	360.589	0,25
1.792	CHIPOTLE MEXICAN GRILL CL A	662.052	0,46
12.464	COMCAST CLASS A	350.258	0,24
6.796	COMERICA INC	529.338	0,37
8.311	DOLLAR GENERAL	701.653	0,49
2.964	ECOLAB INC	356.173	0,25
16.319	EXXON MOBIL CORP	1.156.886	0,80
2.339	FEDEX CORP	454.778	0,32
13.383	GILEAD SCIENCES INC	812.001	0,56
2.230	GOLDMAN SACHS GROUP	421.170	0,29
9.850	HOLOGIC INC	335.350	0,23
3.403	HOME DEPOT INC	568.736	0,40
1.577	HUMANA	401.790	0,28
5.575	INTERCONTINENTALEXCHANGE GROUP	351.246	0,24
2.371	INTL BUSINESS MACHINES CORP	283.838	0,20
7.022	J.P.MORGAN CHASE & CO	626.871	0,44
6.178	KANSAS CITY SOUTHERN	560.415	0,39
5.356	KRAFT HEINZ CO/THE	288.179	0,20
11.706	KROGER CO	285.293	0,20
3.391	LABORATORY CORP	521.277	0,36
10.439	MASCO CORP	334.660	0,23
16.441	MERCK AND CO INC	854.473	0,59
11.268	MICRON TECHNOLOGY INC	506.097	0,35
16.975	MICROSOFT CORP	1.433.689	1,00
9.397	MONDELEZ INTERNATIONAL	329.988	0,23
20.802	MOSAIC CO THE -WI	499.761	0,35
15.235	NUANCE COMMUNICATIONS	181.181	0,13
13.093	ORACLE CORP	494.205	0,34
9.325	PEPSICO INC	869.524	0,60
12.586	PG&E CORP	458.574	0,32
13.430	PROCTER AND GAMBLE CO	898.017	0,62
2.860	RED HAT	329.517	0,23
2.907	ROCHE HOLDING LTD	553.016	0,38
2.210	SALESFORCE.COM	258.412	0,18
20.089	SYCHRONY FINANCIAL	574.340	0,40
4.451	TIFFANY & CO	501.807	0,35
9.018	TJX COMPANIES INC	735.467	0,51
7.825	T-MOBILE US INC	400.449	0,28
3.408	UNITED RENTALS INC	431.068	0,30
16.627	VERIZON COMMUNICATIONS INC	716.889	0,50
3.343	VISA INC-A	379.640	0,26
	Anleihen	**76.223.335**	**52,94**
	Belgien	*203.134*	*0,14*
200.000	KBC GROUP SA/NV 1,00% 26/04/2021	203.134	0,14
	Kanada	*1.205.520*	*0,84*
1.200.000	BANK OF MONTREAL FRN 28/09/2021	1.205.520	0,84
	Dänemark	*325.064*	*0,23*
321.000	DANSKE BANK AS 0,50% 06/05/2021	325.064	0,23
	Frankreich	*7.635.997*	*5,30*
2.100.000	BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL FRN 03/06/2020	2.112.747	1,47
800.000	CARREFOUR BANQUE FRN 20/04/2021	802.680	0,56
400.000	COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN SA 0% 27/03/2020	399.668	0,28
2.500.000	FRANCE OAT 0% 25/05/2022	2.531.250	1,75
237.000	PSA BANQUE FRANCE 0,625% 10/10/2022	234.931	0,16
722.000	RCI BANQUE SA FRN 08/07/2020	723.040	0,50
597.000	RCI BANQUE SA FRN 12.04.2021	598.779	0,42
232.000	RCI BANQUE SA 0,375% 10/07/2019	232.902	0,16
	Deutschland	*3.657.026*	*2,54*
552.000	BASF SE VAR 15/11/2019	553.766	0,38
327.000	CONTINENTAL AG 0% 05/02/2020	327.471	0,23
596.000	DAIMLER AG 0,25% 11/05/2020	598.569	0,42
2.000.000	GERMANY BUND 2,00% 04/01/2022	2.177.220	1,51
	Italien	*31.142.321*	*21,62*
270.000	ESSELUNGA SPA 0,875% 25/10/2023	267.883	0,19
335.000	FCA BANK SPA 0,25% 12/10/2020	332.461	0,23
1.032.000	INTESA SANPAOLO SPA VAR 19/04/2022	1.008.357	0,70
14.000.000	ITALY BTP 0,65% 01/11/2020	13.935.320	9,67
3.000.000	ITALY BTPI 0,50% 20/04/2023	2.959.559	2,06
7.000.000	ITALY BTPI 1,65% 23/04/2020	7.214.035	5,00
5.000.000	ITALY CCTS FRN 15/10/2024	4.796.950	3,33
625.000	SNAM SPA FRN 21/02/2022	627.756	0,44
	Luxemburg	*1.064.782*	*0,74*
1.062.000	MORGAN STANLEY FRN 08/11/2022	1.064.782	0,74
	Niederlande	*3.478.196*	*2,42*
500.000	ALLIANZ FINANCE II BV 0% 21/04/2020	501.135	0,35
793.000	BMW FINANCE NV 0,125% 03/07/2020	794.935	0,55
500.000	JAB HOLDINGS BV 1,50% 24/11/2021	518.575	0,36
400.000	LEASEPLAN CORPORATION NV 0,75% 03/10/2022	397.472	0,28
465.000	STEDIN HOLDING NV VAR 24/10/2022	464.623	0,32
800.000	VONOVIA FINANCE B.V FRN 20/11/2019	801.456	0,56
	Portugal	*6.317.000*	*4,39*
5.000.000	PORTUGAL 5,65% 15/02/2024	6.317.000	4,39
	Spanien	*9.885.461*	*6,86*
800.000	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA FRN 12/04/2022	801.824	0,56
400.000	METROVACESA SA 2,375% 23/05/2022	422.536	0,29
5.000.000	SPAIN 2,75% 31/10/2024	5.640.150	3,91
2.000.000	SPAIN 5,50% 30/04/2021	2.314.280	1,61
700.000	TELEFONICA EMISIONES SAU 0,75% 13/04/2022	706.671	0,49
	Schweden	*1.159.653*	*0,81*
1.153.000	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN FRN 26/05/2020	1.159.653	0,81

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses

Wertpapierbestand zum 30.06.2018

Anzahl		Marktwert	% des NIW
		EUR	
	Vereinigtes Königreich	*4.196.842*	*2,92*
767.000	COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS PLC VAR 16/11/2021	767.284	0,53
1.300.000	CREDIT SUISSE AG LONDON BRANCH 1,375% 29/11/2019	1.326.559	0,93
948.000	HSBC HOLDINGS PLC FRN 05/10/2023	942.472	0,66
891.000	HSBC HOLDINGS PLC FRN 27/09/2022	894.493	0,62
265.000	IMPERIAL BRANDS FINANCE PLC 0,50% 27/07/2021	266.034	0,18
	Vereinigte Staaten von Amerika	*5.952.339*	*4,13*
537.000	ABBVIE INC 0,375% 18/11/2019	539.647	0,37
1.168.000	BANK OF AMERICA CORP FRN 04/05/2023	1.171.387	0,81
1.500.000	BANK OF AMERICA CORP FRN 07/02/2022	1.509.795	1,05
638.000	GENERAL MOTORS FINANCIAL CO FRN 10/05/2021	640.871	0,45
300.000	MCDONALDS INC 0,50% 15/01/2021	302.997	0,21
355.000	MORGAN STANLEY BAML TRUST 2012-C6 FRN 09/11/2021	353.431	0,25
207.000	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC VAR 24/07/2019	207.257	0,14
1.220.000	WELLS FARGO & CO FRN 26/04/2021	1.226.954	0,85
Anteile/Aktien von OGAW/OGA		**18.558.898**	**12,89**
	Aktien/Anteile an Investmentfonds	**18.558.898**	**12,89**
	Frankreich	*10.178.065*	*7,07*
90.541	AMUNDI JAPAN TOPIX UCITS ETF - EUR (C)	7.002.042	4,87
750.492	AMUNDI MSCI EMERGING MARKETS UCITS ETF EUR C MILAN	2.986.583	2,07
1.149	LYXOR ETF CHINA ENTERPRISE PART C	157.758	0,11
2.020	LYXOR ETF INDIA A	31.682	0,02
	Irland	*1.928.416*	*1,34*
41.541	INVESCO MARKETS PLC-MORNINGSTAR US ENER INFRA MLP UCITS ETF	1.928.416	1,34
	Jersey	*6.452.417*	*4,48*
2.084	ETFS COMMODITY SECURITIES LTD	18.894	0,01
49.653	ETFS METAL SEC ETFS PHYSICAL GOLD	5.094.796	3,54
13.047	ETFS PHYSICAL GOLD	1.338.727	0,93
Derivative Instrumente		**1.549.595**	**1,08**
	Optionen	**1.549.595**	**1,08**
	Deutschland	*393.206*	*0,27*
293	DJ EURO STOXX 50 EUR – 3.400 - 16.11.18 PUT	393.206	0,27
	Luxemburg	*1.156.389*	*0,81*
7.300.000	FX OPTION - PUT EUR / CALL USD – 1,153 - 14.12.18	104.100	0,07
4.400.000	FX OPTION - PUT EUR / CALL USD – 1,206 - 14.12.18	168.667	0,12
17.600.000	FX OPTION - PUT EUR / CALL USD – 1,22 - 06.09.18	883.622	0,62

Anzahl		Marktwert	% des NIW
		EUR	
Short-Positionen		**-883.621**	**-0,61**
Derivative Instrumente		**-883.621**	**-0,61**
	Optionen	**-883.621**	**-0,61**
	Luxemburg	*-883.621*	*-0,61*
-4.400.000	FX OPTION - PUT EUR / CALL USD – 1,22 - 06.09.18	-220.905	-0,15
-13.200.000	FX OPTION - PUT EUR / CALL USD – 1,22 - 06.09.18	-662.716	-0,46
Gesamt-Wertpapierbestand		**143.417.192**	**99,62**

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses

Wertpapierbestand zum 30.06.2018

Anzahl		Marktwert	% des NIW
		EUR	
Long-Positionen		**42.416.885**	**92,89**
Zur amtlichen Notierung an einer Wertpapierbörse zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte, übertragbare Wertpapiere		**38.729.293**	**84,81**
	Anteile	**10.052.322**	**22,01**
	Belgien	*107.260*	*0,23*
1.240	ANHEUSER BUSCH INBEV SA/NV	107.260	0,23
	Kanada	*60.309*	*0,13*
1.530	AGNICO EAGLE MINES	60.309	0,13
	Curacao	*57.685*	*0,13*
1.000	SCHLUMBERGER LTD	57.685	0,13
	Frankreich	*1.285.125*	*2,81*
2.770	ALSTOM	109.027	0,24
7.920	AXA	166.438	0,35
3.050	BNP PARIBAS	162.230	0,36
2.150	COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN SA	82.281	0,18
1.880	DANONE	118.196	0,26
4.380	ORANGE	62.831	0,14
670	RENAULT SA	48.796	0,11
2.430	SANOFI	166.819	0,36
6.280	SUEZ SA ACT	69.739	0,15
3.050	TOTAL	159.241	0,35
740	UNIBAIL RODAMCO SE REITS	139.527	0,31
	Deutschland	*1.441.993*	*3,16*
850	ALLIANZ SE-NOM	150.467	0,33
1.170	BASF SE	95.835	0,21
1.500	BAYER AG	141.525	0,31
870	BAYERISCHE MOTORENWERKE	67.538	0,15
5.130	DEUTSCHE POST AG-NOM	143.486	0,31
6.540	DEUTSCHE TELEKOM AG-NOM	86.786	0,19
4.490	E.ON SE	41.101	0,09
2.810	EVONIK INDUSTRIES AG	82.417	0,18
770	HEIDELBERGCEMENT AG	55.502	0,12
4.600	INFINEON TECHNOLOGIES AG-NOM	100.418	0,22
370	LINDE AG	75.628	0,17
320	MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS AG-NOM	57.936	0,13
4.670	PROSIEBENSAT1 MEDIA SE	101.479	0,22
3.110	RWE AG	60.723	0,13
1.600	SIEMENS AG-NOM	181.152	0,40
	Irland	*44.375*	*0,10*
600	MEDTRONIC PLC	44.375	0,10
	Italien	*153.661*	*0,34*
19.830	ENEL SPA	94.332	0,21
3.730	ENI SPA	59.329	0,13
	Liberia	*44.778*	*0,10*
500	ROYAL CARIBBEAN CRUISES	44.778	0,10
	Niederlande	*698.157*	*1,53*
8.760	ABN AMRO GROUP N.V.	194.647	0,43
12.020	ING GROUP NV	148.183	0,32
27.070	KONINKLIJKE KPN NV	63.073	0,14
3.300	NN GROUP NV	114.972	0,25
3.710	UNILEVER CVA	177.282	0,39
	Spanien	*268.032*	*0,59*
19.040	IBERDROLA SA	126.121	0,28
4.850	INDITEX	141.911	0,31
	Schweden	*161.692*	*0,35*
7.770	NORDEA BANK AB	64.184	0,14
5.310	SWEDBANK A SHS A	97.508	0,21
	Schweiz	*83.763*	*0,18*
1.290	NOVARTIS AG-NOM	83.763	0,18
	Vereinigtes Königreich	*1.185.613*	*2,60*
32.690	BP PLC	213.769	0,47
3.600	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	155.911	0,34
6.890	GLAXOSMITHKLINE PLC	119.187	0,26
20.580	HSBC HOLDINGS PLC	165.389	0,36
1.660	RIO TINTO PLC	78.856	0,17
9.980	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A	297.106	0,66
74.760	VODAFONE GROUP	155.395	0,34
	Vereinigte Staaten von Amerika	*4.459.879*	*9,76*
700	ACTIVISION BLIZZARD INC	45.751	0,10
200	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	21.395	0,05
2.000	ALTRIA GROUP INC	97.906	0,21
2.600	AMERICAN ELECTRIC POWER INC	154.657	0,34
600	ANADARKO PETROLEUM CORP	37.838	0,08
1.300	APPLE INC	207.245	0,45
887	AT&T INC	24.607	0,05
1.900	BANK OF AMERICA CORP	46.932	0,10
600	BRISTOL MYERS SQUIBB CO	28.562	0,06
100	BROADCOM INC	21.016	0,05
200	CARLISLE COS	18.750	0,04
400	CDW CORP	27.977	0,06
1.600	CENTURYTEL INC	25.818	0,06
1.300	CHEVRON CORP	141.407	0,31
100	CHIPOTLE MEXICAN GRILL CL A	37.210	0,08
4.000	CISCO SYSTEMS INC	148.345	0,32
1.900	CITIGROUP INC	110.871	0,24
800	CME GROUP INC	113.126	0,25
800	COMCAST CLASS A	22.755	0,05
500	COMERICA INC	39.506	0,09
700	DISH NETWORK CORP	20.241	0,04
2.000	DOLLAR GENERAL	169.877	0,37
200	ECOLAB INC	24.133	0,05
3.300	EXXON MOBIL CORP	235.386	0,53
200	FEDEX CORP	39.183	0,09
1.000	GILEAD SCIENCES INC	61.017	0,13

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses

Wertpapierbestand zum 30.06.2018

Anzahl		Marktwert EUR	% des NIW
200	GOLDMAN SACHS GROUP	38.225	0,08
1.000	HESS CORP	57.651	0,13
700	HOLOGIC INC	24.066	0,05
200	HOME DEPOT INC	33.626	0,07
100	HUMANA	25.726	0,06
300	INTERCONTINENTALEXCHANGE GROUP	19.030	0,04
200	INTL BUSINESS MACHINES CORP	24.122	0,05
1.300	JOHNSON & JOHNSON	136.697	0,30
2.100	J.P.MORGAN CHASE & CO	190.674	0,42
400	KANSAS CITY SOUTHERN	36.559	0,08
300	KRAFT HEINZ CO/THE	16.183	0,04
800	KROGER CO	19.576	0,04
200	LABORATORY CORP	30.993	0,07
1.400	LAS VEGAS SANDS	91.946	0,20
700	MASCO CORP	22.480	0,05
3.500	MERCK AND CO INC	183.581	0,40
1.100	MICRON TECHNOLOGY INC	49.849	0,11
2.900	MICROSOFT CORP	246.596	0,55
600	MONDELEZ INTERNATIONAL	21.198	0,05
2.000	MOSAIC CO THE -WI	48.983	0,11
1.460	NOBLE ENERGY	44.305	0,10
1.000	NUANCE COMMUNICATIONS	11.802	0,03
1.500	ORACLE CORP	56.426	0,12
500	PEPSICO INC	46.760	0,10
4.600	PFIZER INC	143.825	0,31
900	PG&E CORP	32.992	0,07
400	PROCTER AND GAMBLE CO	26.861	0,06
200	RED HAT	23.172	0,05
580	ROCHE HOLDING LTD	110.337	0,24
300	SALESFORCE.COM	35.017	0,08
1.400	SYCHRONY FINANCIAL	40.337	0,09
800	TEREX	28.956	0,06
500	TIFFANY & CO	56.666	0,12
2.300	TJX COMPANIES INC	188.247	0,41
500	T-MOBILE US INC	25.592	0,06
1.200	UNITED PARCEL SERVICE-B	109.953	0,24
300	UNITED RENTALS INC	38.439	0,08
1.100	VERIZON COMMUNICATIONS INC	47.616	0,10
200	VISA INC-A	22.815	0,05
2.700	WELLS FARGO & CO	130.489	0,29
	Anleihen	**27.771.661**	**60,82**
	Angola	*186.539*	*0,41*
200.000	ANGOLA 9,50% 12/11/2025	186.539	0,41
	Argentinien	*279.532*	*0,61*
350.000	ARGENTINA 7,50% 22/04/2026	279.532	0,61
	Österreich	*234.865*	*0,51*
100.000	ERSTE GROUP BANK AG 7,125% 10/10/2022	123.725	0,27
100.000	OMV AG VAR PERPETUAL	111.140	0,24
	Belgien	*180.817*	*0,40*
50.000	BELGIUM 5,00% 28/03/2035	79.178	0,17
100.000	KBC GROUP SA/NV VAR PERP	101.639	0,23
	Bermuda	*101.582*	*0,22*
100.000	FIDELITY INTERNATIONAL LTD 2,50% 04/11/2026	101.582	0,22
	Brasilien	*278.393*	*0,61*
250.000	FEDERATIVE REPUBLIC OF BRAZIL 10,125% 15/05/2027	278.393	0,61
	Chile	*163.462*	*0,36*
200.000	CHILE 3,86% 21/06/2047	163.462	0,36
	China	*575.680*	*1,26*
450.000	CHINA DEVELOPMENT BANK 3,00% 01/06/2026	362.948	0,79
250.000	EXPORT IMPORT BANK OF CHINA 2,50% 31/07/2019	212.732	0,47
	Kolumbien	*427.478*	*0,94*
200.000	BANCOLOMBIA SA VAR 18/10/2027	162.686	0,36
44.000	BANCOLOMBIA SA 5,125% 11/09/2022	38.376	0,08
200.000	COLOMBIA 3,875% 22/03/2026	226.416	0,50
	Kroatien	*180.015*	*0,39*
200.000	CROATIA 5,50% 04/04/2023	180.015	0,39
	Dominikanische Republik	*90.100*	*0,20*
100.000	DOMINICAN REPUBLIC 7,45% 30/04/2044	90.100	0,20
	Ecuador	*159.882*	*0,35*
200.000	ECUADOR 9,65% 13/12/2026	159.882	0,35
	Frankreich	*3.058.205*	*6,70*
100.000	ACCOR SA VAR PERPETUAL	104.334	0,23
100.000	ARKEMA SA VAR PERPETUAL	106.841	0,23
200.000	AXA SA 4,50% PERPETUAL	136.900	0,30
100.000	BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL 3,00% 28/11/2023	112.770	0,25
100.000	BNP PARIBAS SA 2,375% 17/02/2025	102.403	0,22
50.000	BNP PARIBAS SA 2,375% 20/11/2019	57.387	0,13
200.000	BNP PARIBAS SA 3,80% 10/01/2024	167.258	0,37
250.000	BPCE SA 4,00% 15/04/2024	214.205	0,46
100.000	BPCE SA 4,625% 18/07/2023	115.253	0,25
100.000	CASINO GUICHARD PERRACHON SA VAR 07/03/2024	99.656	0,22
100.000	CASINO GUICHARD PERRACHON SA 1,865% 13/06/2022	93.632	0,21
150.000	CROWN EUROPEAN HOLDINGS 4,00% 15/07/2022	162.984	0,36
100.000	ELECTRICITE DE FRANCE SA 6,25% 30/05/2028	146.061	0,32
100.000	FAURECIA SA 3,625% 15/06/2023	103.698	0,23
100.000	FRANCE OAT 1,75% 25/05/2066	100.926	0,22
100.000	FRANCE OAT 6,00% 25/10/2025	142.526	0,31
100.000	FRANCE OAT 8,25% 25/04/2022	133.088	0,29
100.000	NEW AREVA HOLDING 3,25% 04/09/2020	103.303	0,23
50.000	ORANGE SA 4,125% 14/09/2021	43.796	0,10
200.000	PERNOD RICARD SA 5,75% 07/04/2021	181.674	0,39
100.000	PEUGEOT SA 2,00% 20/03/2025	97.397	0,21
50.000	PEUGEOT SA 2,00% 23/03/2024	50.271	0,11
100.000	PEUGEOT SA 6,50% 18/01/2019	103.412	0,23

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses

Wertpapierbestand zum 30.06.2018

Anzahl		Marktwert	% des NIW
		EUR	
200.000	SFR GROUP SA 7,375% 01/05/2026	167.873	0,37
100.000	SOLVAY FINANCE VAR PERPETUAL	108.405	0,24
100.000	TOTAL SA VAR PERPETUAL	102.152	0,22
	Deutschland	*928.286*	*2,03*
100.000	ALLIANZ SE VAR PERPETUAL	111.151	0,24
200.000	ALLIANZ SE 3,875% PERPETUAL	135.669	0,30
50.000	BAYER AG VAR 01/07/2075	51.377	0,11
100.000	DEUTSCHE BANK AG 0,375% 18/01/2021	97.356	0,21
50.000	FRESENIUS SE CO KGAA 4,00% 01/02/2024	57.711	0,13
100.000	GERMANY BUND 3,25% 04/01/2020	106.006	0,23
50.000	GERMANY BUND 6,25% 04/01/2024	67.916	0,15
50.000	GERMANY BUND 6,25% 04/01/2030	83.108	0,18
50.000	HEIDELBERGCEMENT AG 2,25% 30/03/2023	53.279	0,12
23.000	K+S AKTIENGESELLSCHAFT 2,625% 06/04/2023	23.843	0,05
40.000	THYSSENKRUPP AG 1,375% 03/03/2022	40.096	0,09
100.000	UNITYMEDIA HESSEN GMBH & CO KG 6,25% 15/01/2029	100.774	0,22
	Ungarn	*136.304*	*0,30*
50.000	HUNGARY 6,25% 29/01/2020	44.792	0,10
100.000	HUNGARY 6,375% 29/03/2021	91.512	0,20
	Indien	*169.733*	*0,37*
200.000	EXPORT IMPORT BANK OF INDIA 4,00% 14/01/2023	169.733	0,37
	Indonesien	*629.179*	*1,38*
150.000	INDONESIA 2,875% 08/07/2021	159.144	0,35
100.000	INDONESIA 3,75% 14/06/2028	110.367	0,24
200.000	INDONESIA 4,875% 05/05/2021	176.094	0,39
200.000	INDONESIA 5,875% 15/01/2024	183.574	0,40
	Irland	*430.708*	*0,94*
100.000	ARDAGH PACKAGING FIN PLC 2,75% 15/03/2024	98.768	0,22
100.000	ARDAGH PACKAGING FINANCE PLC 4,125% 15/05/2023	103.888	0,23
100.000	GE CAPITAL UK FUNDING UNLIMITD COMPANY 5,125% 24/05/2023	128.555	0,27
100.000	SMURFIT KAPPA ACQUISITIONS UNLIMITED COMPAGNY 2,875% 15/01/2026	99.497	0,22
	Israel	*69.808*	*0,15*
80.000	ISRAEL ELECTRIC CORP 7,25% 15/01/2019	69.808	0,15
	Italien	*932.516*	*2,04*
150.000	ENEL - ENTE NAZIONALE PER L'ENERGIA ELETTRICA 6,25% 20/06/2019	177.400	0,39
100.000	INTESA SANPAOLO SPA 3,928% 15/09/2026	101.146	0,22
50.000	INTESA SANPAOLO SPA 4,125% 14/04/2020	52.905	0,12
200.000	INTESA SANPAOLO SPA 6,50% 24/02/2021	177.035	0,39
50.000	ITALY BTP 4,75% 01/09/2044	61.255	0,13
100.000	ITALY BTP 5,50% 01/11/2022	115.825	0,25
100.000	ITALY BTP 6,50% 01/11/2027	131.572	0,29
100.000	UNICREDIT SPA 6,95% 31/10/2022	115.378	0,25
	Jamaika	*183.403*	*0,40*
200.000	JAMAICA 6,75% 28/04/2028	183.403	0,40
	Japan	*278.596*	*0,61*
8.100.000	JAPAN JGBI 0,10% 10/03/2026	66.505	0,15
14.600.000	JAPAN JGBI 0,10% 10/03/2027	120.620	0,26
100.000	SOFTBANK GROUP CORP 3,125% 19/09/2025	91.471	0,20
	Jersey	*114.879*	*0,25*
100.000	HBOS CAPITAL FUNDING LP VAR PERPETUAL	114.879	0,25
	Kasachstan	*164.402*	*0,36*
200.000	KAZAKHSTAN 4,625% 24/05/2023	164.402	0,36
	Litauen	*137.037*	*0,30*
150.000	LITHUANIA 7,375% 11/02/2020	137.037	0,30
	Luxemburg	*776.959*	*1,70*
100.000	ALTICE FINANCING SA 5,25% 15/02/2023	103.036	0,23
200.000	ALTICE FINANCING SA 7,50% 15/05/2026	164.709	0,36
100.000	ALTICE FINCO S.A 4,75% 15/01/2028	85.044	0,19
100.000	ARCELORMITTAL SA VAR 05/08/2020	88.171	0,19
100.000	ARCELORMITTAL SA 0,95% 17/01/2023	98.168	0,21
200.000	MINERVA LUXEMBOURG SA 6,50% 20/09/2026	156.774	0,34
100.000	TELECOM ITALIA CAPITAL SA 6,00% 30/09/2034	81.057	0,18
	Mexiko	*1.208.474*	*2,65*
100.000	CEMEX SAB DE CV 4.375% 05/03/2023	103.393	0,23
200.000	MEXICO 4,15% 28/03/2027	168.961	0,37
200.000	MEXICO 4,75% 08/03/2044	161.989	0,35
200.000	MEXICO 5,50% 17/02/2020	217.640	0,48
300.000	MEXICO 8,125% 30/12/2019	278.069	0,61
100.000	PETROLEOS MEXICANOS PEMEX 2,50% 21/08/2021	101.151	0,22
100.000	PETROLEOS MEXICANOS PEMEX 4,50% 23/01/2026	80.015	0,18
111.000	PETROLEOS MEXICANOS PEMEX 5,375% 13/03/2022	97.256	0,21
	Niederlande	*2.653.700*	*5,81*
100.000	ABN AMRO BANK NV 6,375% 27/04/2021	115.813	0,25
100.000	BHARTI AIRTEL INTERNATIONAL NETHERLANDS B.V. 3,375% 20/05/2021	105.627	0,23
100.000	CNH INDUSTRIAL NV 4,50% 15/08/2023	85.906	0,19
200.000	COOPERATIEVE RABOBANK UA 6,875% 19/03/2020	221.484	0,48
100.000	DEUTSCHE TELEKOM INTERNATIONAL FINANCE BV 6,50% 08/04/2022	132.768	0,29
100.000	DEUTSCHE TELEKOM INTERNATIONAL FINANCE BV 7,50% 24/01/2033	168.399	0,37
100.000	EDP FINANCE BV 2,375% 23/03/2023	107.021	0,23
200.000	EDP FINANCE BV 4,125% 15/01/2020	172.781	0,38
100.000	ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 1,125% 16/09/2026	94.626	0,21
50.000	ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 5,625% 14/08/2024	65.702	0,14
100.000	GAS NATURAL FENOSA FINANCE B.V VAR PERPETUAL	104.080	0,23
100.000	IBERDROLA INTERNATIONAL BV VAR PERPETUAL	95.500	0,21

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses

Wertpapierbestand zum 30.06.2018

Anzahl		Marktwert	% des NIW
		EUR	
200.000	ING BANK NV 5,80% 25/09/2023	181.051	0,40
200.000	ING GROUP NV VAR PERPETUAL	174.569	0,38
200.000	KONINKLIJKE KPN NV VAR 28/03/2073	175.962	0,39
100.000	NETHERLANDS 7,50% 15/01/2023	135.835	0,30
206.000	PETROBRAS GLOBAL FINANCE BV 5,299% 27/01/2025	163.374	0,36
100.000	SHELL INTERNATIONAL FINANCE BV 2,875% 10/05/2026	81.375	0,18
100.000	TELEFONICA EUROPE BV VAR PERPETUAL	100.302	0,22
100.000	TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE NETHERLANDS III BV 2,80% 21/07/2023	74.014	0,16
100.000	VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV VAR PERPETUAL	97.511	0,21
	Nigeria	*161.636*	*0,35*
200.000	NIGERIA 7,143% 23/02/2030	161.636	0,35
	Oman	*161.182*	*0,35*
200.000	OMAN 5,375% 08/03/2027	161.182	0,35
	Panama	*115.091*	*0,25*
100.000	PANAMA 8,875% 30/09/2027	115.091	0,25
	Peru	*131.731*	*0,29*
150.000	PERU 4,125% 25/08/2027	131.731	0,29
	Philippinen	*332.211*	*0,73*
50.000	PHILIPPINES 9,50% 02/02/2030	62.400	0,14
300.000	REPUBLIC OF PHILIPPINES 6,50% 20/01/2020	269.811	0,59
	Polen	*180.643*	*0,40*
200.000	POLAND 5,00% 23/03/2022	180.643	0,40
	Portugal	*109.755*	*0,24*
100.000	BRISA CONCESSAO RODOVIARIA SA 3,875% 01/04/2021	109.755	0,24
	Rumänien	*93.336*	*0,20*
100.000	ROMANIA 6,75% 07/02/2022	93.336	0,20
	Serbien	*186.867*	*0,41*
200.000	SERBIA 7,25% 28/09/2021	186.867	0,41
	Südafrika	*254.912*	*0,56*
200.000	ESKOM HOLDINGS SOC LIMITED 5,75% 26/01/2021	165.308	0,36
100.000	SOUTH AFRICA 5,875% 30/05/2022	89.604	0,20
	Spanien	*412.744*	*0,90*
100.000	CELLNEX TELECOM SA 2,375% 16/01/2024	100.252	0,22
100.000	IMMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA 2,728% 05/06/2023	107.853	0,23
50.000	SPAIN 3,45% 30/07/2066	58.763	0,13
50.000	SPAIN 5,15% 31/10/2044	77.105	0,17
50.000	SPAIN 5,90% 30/07/2026	68.771	0,15
	Sri Lanka	*165.697*	*0,36*
200.000	SRI LANKA 6,85% 03/11/2025	165.697	0,36
	Schweden	*365.190*	*0,80*
100.000	INTRUM JUSTITIA AB 2,75% 15/07/2022	94.761	0,21
200.000	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN 2,45% 27/05/2020	168.861	0,37
100.000	TELIA COMPANY AB VAR 04/04/2078	101.568	0,22
	Schweiz	*259.778*	*0,57*
100.000	CREDIT SUISSE GRP AG VAR 17/07/2025	98.646	0,22
150.000	UBS INC VAR 12/02/2026	161.132	0,35
	Türkei	*447.173*	*0,98*
300.000	TURKEY 4,875% 09/10/2026	225.726	0,50
250.000	TURKEY 7,375% 05/02/2025	221.447	0,48
	Vereinigtes Königreich	*3.069.124*	*6,73*
100.000	ANGLO AMERICAN CAPITAL PLC 1,625% 18/09/2025	98.822	0,22
100.000	AVIVA PLC VAR 05/07/2043	118.160	0,26
50.000	BARCLAYS BANK PLC VAR PERP	62.418	0,14
100.000	BARCLAYS BANK PLC 3,25% 12/02/2027	110.428	0,24
100.000	BARCLAYS PLC VAR 07/02/2028	95.596	0,21
100.000	BAT INTL FINANCE PLC 6,375% 12/12/2019	120.929	0,26
200.000	BP CAPITAL MARKETS PLC 3,161% 17/03/2021	171.142	0,37
100.000	HSBC HOLDINGS PLC VAR 13/11/2026	108.614	0,24
100.000	HSBC HOLDINGS PLC 6,50% 20/05/2024	137.131	0,30
100.000	ICBC STANDARD BANK PLC 8,125% 02/12/2019	90.012	0,20
50.000	IMPERIAL BRANDS FINANCE PLC 9,00% 17/02/2022	70.330	0,15
100.000	INEOS FINANCE PLC 2,125% 15/11/2025	95.059	0,21
100.000	JAGUAR LAND ROVER PLC 2,20% 15/01/2024	97.670	0,21
100.000	LLOYDS BANKING GROUP PLC 7,50% 15/04/2024	145.943	0,32
100.000	NATIONWIDE BUILDING SOCIETY 3,25% 20/01/2028	119.091	0,26
50.000	SANTANDER UK PLC 2,35% 10/09/2019	42.461	0,09
100.000	SANTANDER UK PLC 4,00% 13/03/2024	85.914	0,19
100.000	SKY PLC 2,25% 17/11/2025	106.884	0,23
50.000	TESCO PLC 6,125% 24/02/2022	64.121	0,14
100.000	TESCO PLC 6,15% 15/11/2037	91.455	0,20
100.000	UK GILT 4,75% 07/03/2020	120.797	0,26
300.000	UK GILT 4,75% 07/12/2030	464.257	1,03
100.000	UK GILT 6,00% 07/12/2028	163.988	0,36
150.000	UK GILT 8,00% 07/06/2021	205.350	0,46
100.000	VODAFONE GROUP PLC 2,95% 19/02/2023	82.552	0,18
	Vereinigte Staaten von Amerika	*6.594.057*	*14,45*
100.000	ANHUSER BUSCH INBEV FIN INC 2,50% 15/07/2022	82.677	0,18
100.000	ANHUSER BUSCH INBEV FIN INC 3,65% 01/02/2026	83.819	0,18
100.000	AT&T INC 3,15% 04/09/2036	100.201	0,22
100.000	BALL CORP 4,375% 15/12/2020	86.380	0,19
100.000	BALL CORP 5,25% 01/07/2025	87.144	0,19
100.000	BANK OF AMERICA CORP 3,30% 11/01/2023	84.263	0,18
100.000	BANK OF AMERICA CORP 4,20% 26/08/2024	85.898	0,19
200.000	BANK OF AMERICA CORP 5,50% 04/12/2019	239.342	0,53
200.000	BAYER US FINANCE LLC 3,375% 08/10/2024	165.082	0,36
200.000	BAYERS US FINANCE II LLC FRN 15/12/2023	171.201	0,37
50.000	BERKSHIRE HATHWAY INC 2,75% 15/03/2023	41.815	0,09
100.000	BLACKSTONE HDGS FINANCE 1,00% 05/10/2026	96.703	0,21

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses

Wertpapierbestand zum 30.06.2018

Anzahl		Marktwert EUR	% des NIW
20.000	CCO HLDGS LLC/CAP CORP 5,00% 01/02/2028	15.738	0,03
100.000	CEMEX FINANCE LLC 4,625% 15/06/2024	104.988	0,23
200.000	CEMEX FINANCE LLC 6,00% 01/04/2024	173.440	0,38
250.000	CITIGROUP INC 3,75% 16/06/2024	211.777	0,46
100.000	CITIGROUP INC 5,15% 21/05/2026	132.631	0,29
49.000	COCO COLA CO 2,25% 01/09/2026	37.995	0,08
100.000	EXPEDIA INC 2,50% 03/06/2022	105.526	0,23
200.000	FEDERAL NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION 7,25% 15/05/2030	239.894	0,54
250.000	FREDDIE MAC 6,75% 15/03/2031	293.105	0,65
100.000	FRONTIER COMMUNICATIONS CORPORATION 10,50% 15/09/2022	77.299	0,17
200.000	GENERAL ELECTRIC CO 2,70% 09/10/2022	165.339	0,36
20.000	GENERAL MOTORS FINANCIAL CO 2,40% 09/05/2019	17.041	0,04
100.000	GENERAL MOTORS FINANCIAL CO 4,00% 15/01/2025	83.354	0,18
57.000	GOLDMAN SACHS GROUP INC. 1,625% 27/07/2026	57.247	0,13
100.000	GOLDMAN SACHS GROUP INC. 3,25% 01/02/2023	110.902	0,24
40.000	GOODYEAR TIRE & RUBBER CO 5,00% 31/05/2026	32.044	0,07
100.000	JPMORGAN CHASE & CO 2,875% 24/05/2028	113.411	0,25
100.000	JPMORGAN CHASE & CO 2,95% 01/10/2026	79.319	0,17
100.000	JPMORGAN CHASE & CO 3,125% 23/01/2025	81.838	0,18
100.000	JPMORGAN CHASE & CO 3,20% 25/01/2023	84.158	0,18
100.000	LASMO (USA) INC 7,30% 15/11/2027	102.838	0,23
100.000	LENNAR CORP 4,125% 15/01/2022	84.839	0,19
25.000	MICROSOFT CORP 2,00% 08/08/2023	20.178	0,04
20.000	MORGAN STANLEY 3,125% 27/07/2026	15.923	0,03
100.000	MORGAN STANLEY 4,875% 01/11/2022	88.796	0,19
100.000	MORGAN STANLEY 5,375% 10/08/2020	111.054	0,24
14.000	PFIZER INC 3,00% 15/12/2026	11.517	0,03
50.000	POST HOLDINGS INC 5,00% 15/08/2026	39.934	0,09
100.000	QUINTILES IMS INC 2,875% 15/09/2025	93.269	0,20
100.000	REYNOLDS GROUP ISSUER INC 5,125% 15/07/2023	84.472	0,18
100.000	SPRINT CORPORATION 7,25% 15/09/2021	88.562	0,19
100.000	SPRINT CORPORATION 7,625% 01/03/2026	87.159	0,19
50.000	TENET HEALTHCARE CORP 4,50% 01/04/2021	42.419	0,09
100.000	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC 3,00% 15/04/2023	83.226	0,18
200.000	T-MOBILE USA INC 6,00% 15/04/2024	176.935	0,39
300.000	USA T-BONDS 8,125% 15/05/2021	295.752	0,66
800.000	USA T-BONDS 8,125% 15/08/2021	797.237	1,76
700.000	USA T-BONDS 8,75% 15/05/2020	667.955	1,47
100.000	WELLS FARGO & CO 2,00% 28/07/2025	108.622	0,24
63.000	WELLS FARGO & CO 2,10% 26/07/2021	51.799	0,11
	Optionsscheine, Bezugsrechte	**905.310**	**1,98**
	Deutschland	*10*	*0,00*
6	BAYER AG SUBSCRIPTION RIGHT	10	0,00
	Vereinigtes Königreich	*905.300*	*1,98*
41	UBS AG CERTIFICATE ETC	24.139	0,05
5.086	UBS AG ETC GOLD	761.887	1,68
183	UBS AG LONDON CERTIFICATE	22.962	0,05
921	UBS AG LONDON ETC ON CINCI NICKEL	33.904	0,07
436	UBS ETC ON CMCI ALU USD	22.972	0,05
315	UBS ETC ON CMCI HEAT OIL USD ETC	23.526	0,05
319	UBS ETC ON COMCI CORN USD	15.910	0,03
Anteile/Aktien von OGAW/OGA		**3.282.535**	**7,19**
	Aktien/Anteile an Investmentfonds	**3.282.535**	**7,19**
	Irland	*520.043*	*1,14*
999	INVESCO MARKETS PLC-MORNINGSTAR US ENER INFRA MLP UCITS ETF	46.376	0,10
12.204	ISHARES MSCI PACIFIC EX-JAPAN TRACKERS	473.667	1,04
	Luxemburg	*2.762.492*	*6,05*
40.272	AMUNDI FUNDS II - REAL ASSETS TARGET INCOME A DQ	1.489.414	3,26
1.161	PI INVESTMENT FUNDS - EMERGING MARKETS EQUITY INCOME H QD	1.091.620	2,39
376	AMUNDI S.F. - EUR COMMODITIES I ND	181.458	0,40
Derivative Instrumente		**405.057**	**0,89**
	Optionen	**405.057**	**0,89**
	Deutschland	*145.055*	*0,32*
14	DJ EURO STOXX 50 EUR – 3.350 - 21.12.18 PUT	18.046	0,04
26	DJ EURO STOXX 50 EUR – 3.400 - 21.12.18 PUT	39.572	0,09
25	DJ EURO STOXX 50 EUR – 3.450 - 21.09.18 PUT	30.025	0,07
82	EURO STOXX BANKS - 115 - 21.12.18 CALL	15.170	0,03
9	MSCI EMERGING MARKETS - 530 - 21.09.18 PUT	42.242	0,09
	Japan	*85.599*	*0,19*
6	NIKKEI 225 – 22.500 - 14.09.18 PUT	33.173	0,07
6	NIKKEI 225 – 22.500 - 14.12.18 PUT	52.426	0,12
	Luxemburg	*124.960*	*0,27*
1.700.000	PUT CDX OPTION - CDX NA HY 30 INDEX – 105,50 - 18.07.18	7.257	0,02
400.000	SWAP OPTION - PAY EURIBOR 6M / REC 1,860% - 19.05.27	41.291	0,09
750.000	SWAP OPTION - PAY 1,860% / REC EURIBOR 6M - 19.05.27	76.412	0,16
	Vereinigte Staaten von Amerika	*49.443*	*0,11*
98	10YR US TREASRY NOTE – 118,50 - 24.08.18 PUT	13.115	0,03
3	S&P 500 INDEX – 2.600 - 21.09.18 PUT	8.235	0,02
8	S&P 500 INDEX – 2.650 - 21.09.18 PUT	28.093	0,06
Short-Positionen		**-160.922**	**-0,35**
Derivative Instrumente		**-160.922**	**-0,35**
	Optionen	**-160.922**	**-0,35**
	Deutschland	*-49.913*	*-0,11*
-25	DJ EURO STOXX 50 EUR – 3.300 - 21.09.18 PUT	-16.375	-0,04
-15	DJ EURO STOXX 50 EUR – 3.450 - 21.12.18 CALL	-15.435	-0,03
-26	DJ EURO STOXX 50 EUR – 3.500 - 21.09.18 CALL	-11.128	-0,02
-25	DJ EURO STOXX 50 EUR – 3.550 - 21.09.18 CALL	-6.975	-0,02

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses

Wertpapierbestand zum 30.06.2018

Anzahl		Marktwert	% des NIW
		EUR	
	Italien	*-6.195*	*-0,01*
-13	MINI FTSE / MIB INDEX – 20.500 - 20.07.18 PUT	-3.315	0,00
-6	MINI FTSE / MIB INDEX – 21.000 - 20.07.18 PUT	-2.880	-0,01
	Japan	*-36.188*	*-0,08*
-6	NIKKEI 225 – 21.000 - 14.09.18 PUT	-13.222	-0,03
-3	NIKKEI 225 – 23.000 - 14.12.18 CALL	-12.527	-0,03
-6	NIKKEI 225 – 23.250 - 14.09.18 CALL	-10.439	-0,02
	Vereinigte Staaten von Amerika	*-68.626*	*-0,15*
-26	DOW JONES INDUSTRIAL AVG - 235 - 20.07.18 PUT	-1.871	0,00
-2	S&P 500 INDEX – 2.675 - 21.12.18 PUT	-17.293	-0,04
-3	S&P 500 INDEX – 2.700 - 21.09.18 CALL	-24.525	-0,06
-3	S&P 500 INDEX – 2.725 - 21.09.18 CALL	-19.284	-0,04
-2	S&P 500 INDEX – 2.800 - 21.09.18 CALL	-5.653	-0,01
Gesamt-Wertpapierbestand		**42.255.963**	**92,54**

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses

Wertpapierbestand zum 30.06.2018

Anzahl		Marktwert EUR	% des NIW
Long-Positionen		**48.459.476**	**93,81**
Zur amtlichen Notierung an einer Wertpapierbörse zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte, übertragbare Wertpapiere		**44.314.331**	**85,78**
	Anteile	**11.938.933**	**23,11**
	Belgien	*121.100*	*0,23*
1.400	ANHEUSER BUSCH INBEV SA/NV	121.100	0,23
	Kanada	*71.741*	*0,14*
1.820	AGNICO EAGLE MINES	71.741	0,14
	Curacao	*69.222*	*0,13*
1.200	SCHLUMBERGER LTD	69.222	0,13
	Frankreich	*1.447.969*	*2,80*
3.120	ALSTOM	122.803	0,24
8.920	AXA	187.453	0,36
3.430	BNP PARIBAS	182.442	0,35
2.430	COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN SA	92.996	0,18
2.120	DANONE	133.284	0,26
4.930	ORANGE	70.721	0,14
750	RENAULT SA	54.623	0,11
2.740	SANOFI	188.101	0,36
7.080	SUEZ SA ACT	78.623	0,15
3.440	TOTAL	179.602	0,35
830	UNIBAIL RODAMCO SE REITS	156.497	0,30
10	VINCI SA	824	0,00
	Deutschland	*1.626.911*	*3,16*
960	ALLIANZ SE-NOM	169.939	0,33
1.320	BASF SE	108.121	0,21
1.690	BAYER AG	159.452	0,31
980	BAYERISCHE MOTORENWERKE	76.077	0,15
5.780	DEUTSCHE POST AG-NOM	161.667	0,31
7.370	DEUTSCHE TELEKOM AG-NOM	97.800	0,19
5.060	E.ON SE	46.319	0,09
3.170	EVONIK INDUSTRIES AG	92.976	0,18
870	HEIDELBERGCEMENT AG	62.710	0,12
5.180	INFINEON TECHNOLOGIES AG-NOM	113.079	0,22
410	LINDE AG	83.804	0,16
370	MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS AG-NOM	66.989	0,13
5.270	PROSIEBENSAT1 MEDIA SE	114.517	0,22
3.510	RWE AG	68.533	0,13
1.810	SIEMENS AG-NOM	204.928	0,41
	Irland	*59.167*	*0,11*
800	MEDTRONIC PLC	59.167	0,11
	Italien	*173.283*	*0,34*
22.350	ENEL SPA	106.319	0,21
4.210	ENI SPA	66.964	0,13
	Liberia	*53.733*	*0,10*
600	ROYAL CARIBBEAN CRUISES	53.733	0,10
	Niederlande	*786.790*	*1,52*
9.870	ABN AMRO GROUP N.V.	219.312	0,42
13.550	ING GROUP NV	167.044	0,32
30.510	KONINKLIJKE KPN NV	71.088	0,14
3.720	NN GROUP NV	129.605	0,25
4.180	UNILEVER CVA	199.741	0,39
	Spanien	*302.137*	*0,58*
21.450	IBERDROLA SA	142.085	0,28
5.470	INDITEX	160.052	0,30
	Schweden	*182.173*	*0,35*
8.760	NORDEA BANK AB	72.362	0,14
5.980	SWEDBANK A SHS A	109.811	0,21
	Schweiz	*94.153*	*0,18*
1.450	NOVARTIS AG-NOM	94.153	0,18
	Vereinigtes Königreich	*1.335.774*	*2,59*
36.840	BP PLC	240.907	0,47
4.050	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	175.400	0,34
7.760	GLAXOSMITHKLINE PLC	134.237	0,26
23.190	HSBC HOLDINGS PLC	186.364	0,36
1.870	RIO TINTO PLC	88.832	0,17
11.250	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A	334.913	0,65
84.250	VODAFONE GROUP	175.121	0,34
	Vereinigte Staaten von Amerika	*5.614.780*	*10,88*
900	ACTIVISION BLIZZARD INC	58.823	0,11
300	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	32.093	0,06
100	ALPHABET INC	97.127	0,19
2.400	ALTRIA GROUP INC	117.487	0,23
3.200	AMERICAN ELECTRIC POWER INC	190.347	0,37
700	ANADARKO PETROLEUM CORP	44.145	0,09
1.600	APPLE INC	255.071	0,49
1.131	AT&T INC	31.376	0,06
2.400	BANK OF AMERICA CORP	59.283	0,11
700	BRISTOL MYERS SQUIBB CO	33.323	0,06
100	BROADCOM INC	21.016	0,04
200	CARLISLE COS	18.750	0,04
500	CDW CORP	34.971	0,07
2.000	CENTURYTEL INC	32.273	0,06
1.700	CHEVRON CORP	184.917	0,36
200	CHIPOTLE MEXICAN GRILL CL A	74.421	0,14
4.900	CISCO SYSTEMS INC	181.722	0,35
2.300	CITIGROUP INC	134.212	0,26
1.000	CME GROUP INC	141.407	0,27
800	COMCAST CLASS A	22.755	0,04
600	COMERICA INC	47.407	0,09
700	DISH NETWORK CORP	20.241	0,04
2.500	DOLLAR GENERAL	212.346	0,41
200	ECOLAB INC	24.133	0,05
4.000	EXXON MOBIL CORP	285.315	0,55
200	FEDEX CORP	39.183	0,08

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses

Wertpapierbestand zum 30.06.2018

Anzahl		Marktwert	% des NIW
		EUR	
1.200	GILEAD SCIENCES INC	73.220	0,14
200	GOLDMAN SACHS GROUP	38.225	0,07
1.100	HESS CORP	63.416	0,12
800	HOLOGIC INC	27.504	0,05
300	HOME DEPOT INC	50.439	0,10
100	HUMANA	25.726	0,05
500	INTERCONTINENTALEXCHANGE GROUP	31.716	0,06
200	INTL BUSINESS MACHINES CORP	24.122	0,05
1.600	JOHNSON & JOHNSON	168.243	0,33
2.600	J.P.MORGAN CHASE & CO	236.072	0,46
500	KANSAS CITY SOUTHERN	45.698	0,09
500	KRAFT HEINZ CO/THE	26.971	0,05
1.000	KROGER CO	24.470	0,05
300	LABORATORY CORP	46.490	0,09
1.800	LAS VEGAS SANDS	118.217	0,23
900	MASCO CORP	28.903	0,06
4.300	MERCK AND CO INC	225.542	0,44
1.400	MICRON TECHNOLOGY INC	63.444	0,12
3.500	MICROSOFT CORP	297.616	0,57
600	MONDELEZ INTERNATIONAL	21.198	0,04
2.500	MOSAIC CO THE -WI	61.229	0,12
1.650	NOBLE ENERGY	50.070	0,10
1.000	NUANCE COMMUNICATIONS	11.802	0,02
1.900	ORACLE CORP	71.473	0,14
700	PEPSICO INC	65.464	0,13
5.700	PFIZER INC	178.218	0,35
1.100	PG&E CORP	40.324	0,08
600	PROCTER AND GAMBLE CO	40.292	0,08
300	RED HAT	34.757	0,07
650	ROCHE HOLDING LTD	123.653	0,24
400	SALESFORCE.COM	46.689	0,09
1.800	SYCHRONY FINANCIAL	51.862	0,10
1.000	TEREX	36.195	0,07
600	TIFFANY & CO	67.999	0,13
2.900	TJX COMPANIES INC	237.355	0,46
700	T-MOBILE US INC	35.829	0,07
1.500	UNITED PARCEL SERVICE-B	137.442	0,27
300	UNITED RENTALS INC	38.439	0,07
1.400	VERIZON COMMUNICATIONS INC	60.602	0,12
300	VISA INC-A	34.223	0,07
3.300	WELLS FARGO & CO	159.487	0,31
	Anleihen	**31.366.080**	**60,72**
	Argentinien	*279.532*	*0,54*
350.000	ARGENTINA 7,50% 22/04/2026	279.532	0,54
	Österreich	*281.635*	*0,55*
50.000	AUSTRIA 3,90% 15/07/2020	54.564	0,11
100.000	ERSTE GROUP BANK AG 7,125% 10/10/2022	123.725	0,24
100.000	SAPPI PAPIER HOLDING GMBH 4,00% 01/04/2023	103.346	0,20
	Bahrain	*153.148*	*0,30*
200.000	BAHRAIN 7,00% 12/10/2028	153.148	0,30
	Belgien	*273.411*	*0,53*
50.000	ANHEUSER BUSCH INBEV SA 2,00% 17/03/2028	52.255	0,10
100.000	BELGIUM 4,25% 28/09/2022	119.517	0,23
100.000	KBC GROUP SA/NV VAR PERP	101.639	0,20
	Brasilien	*239.225*	*0,46*
200.000	BRAZIL 8,875% 14/10/2019	183.546	0,35
50.000	FEDERATIVE REPUBLIC OF BRAZIL 10,125% 15/05/2027	55.679	0,11
	Kanada	*94.243*	*0,18*
100.000	BOMBARDIER INC 8,75% 01/12/2021	94.243	0,18
	Chile	*189.818*	*0,37*
100.000	CHILE 1,75% 20/01/2026	104.237	0,20
100.000	CHILE 3,25% 14/09/2021	85.581	0,17
	China	*565.897*	*1,10*
100.000	CHINA DEVELOPMENT BANK 0,50% 01/06/2021	100.330	0,19
200.000	EXPORT IMPORT BANK OF CHINA 2,50% 31/07/2019	170.185	0,33
350.000	EXPORT IMPORT BANK OF CHINA 3,625% 31/07/2024	295.382	0,58
	Kolumbien	*685.831*	*1,33*
200.000	BANCOLOMBIA SA VAR 18/10/2027	162.686	0,31
44.000	BANCOLOMBIA SA 5,125% 11/09/2022	38.376	0,07
200.000	COLOMBIA TELECOMUNICACIONES SA 5,375% 27/09/2022	169.380	0,33
100.000	COLOMBIA 11,75% 25/02/2020	97.229	0,19
250.000	COLOMBIA 4,50% 28/01/2026	218.160	0,43
	Kroatien	*110.577*	*0,21*
100.000	CROATIA 3,875% 30/05/2022	110.577	0,21
	Dänemark	*104.775*	*0,20*
100.000	NYKREDIT REALKREDIT AS VAR 17/11/2027	104.775	0,20
	Dominikanische Republik	*96.340*	*0,19*
100.000	DOMINICAN REPUBLIC 8,625% 20/04/2027	96.340	0,19
	Ecuador	*159.882*	*0,31*
200.000	ECUADOR 9,65% 13/12/2026	159.882	0,31
	Ägypten	*210.743*	*0,41*
250.000	EGYPT 7,50% 31/01/2027	210.743	0,41
	Frankreich	*3.057.082*	*5,92*
100.000	ACCOR SA VAR PERPETUAL	104.334	0,20
100.000	BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL 3,00% 28/11/2023	112.770	0,22
100.000	BNP PARIBAS SA VAR 14/10/2027	104.401	0,20
100.000	BNP PARIBAS SA 2,375% 17/02/2025	102.403	0,20
50.000	BNP PARIBAS SA 2,375% 20/11/2019	57.387	0,11
400.000	BNP PARIBAS SA 3,80% 10/01/2024	334.515	0,66
100.000	BPCE SA 4,625% 18/07/2023	115.253	0,22

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses

Wertpapierbestand zum 30.06.2018

Anzahl		Marktwert	% des NIW
		EUR	
100.000	CASINO GUICHARD PERRACHON SA VAR 07/03/2024	99.656	0,19
100.000	CASINO GUICHARD PERRACHON SA 1,865% 13/06/2022	93.632	0,18
100.000	CROWN EUROPEAN HOLDINGS 4,00% 15/07/2022	108.656	0,21
100.000	ELECTRICITE DE FRANCE SA VAR PERPETUAL	104.002	0,20
100.000	ELECTRICITE DE FRANCE SA 6,25% 30/05/2028	146.061	0,28
100.000	FAURECIA SA 3,625% 15/06/2023	103.698	0,20
50.000	FRANCE OAT 5,50% 25/04/2029	75.406	0,15
50.000	FRANCE OAT 6,00% 25/10/2025	71.263	0,14
100.000	FRANCE OAT 8,25% 25/04/2022	133.088	0,26
100.000	FRANCE OAT 8,50% 25/10/2019	111.939	0,22
100.000	LOXAM 3,50% 03/05/2023	102.202	0,20
100.000	NEW AREVA HOLDING 3,25% 04/09/2020	103.303	0,20
50.000	ORANGE SA 4,125% 14/09/2021	43.796	0,08
50.000	ORANGE SA 5,375% 13/01/2042	46.583	0,09
50.000	ORANGE SA 7,25% 10/11/2020	64.026	0,12
150.000	PERNOD RICARD SA 5,75% 07/04/2021	136.256	0,26
100.000	PEUGEOT SA 2,00% 20/03/2025	97.397	0,19
50.000	PEUGEOT SA 6,50% 18/01/2019	51.706	0,10
200.000	SFR GROUP SA 7,375% 01/05/2026	167.873	0,32
50.000	SOCIETE GENERALE SA VAR PERPETUAL	54.919	0,11
100.000	SOLVAY FINANCE VAR PERPETUAL	108.405	0,21
100.000	TOTAL SA VAR PERPETUAL	102.152	0,20
	Deutschland	*1.131.916*	*2,19*
100.000	ADLER REAL ESTATE AG 1,50% 06/12/2021	100.090	0,19
100.000	ALLIANZ SE VAR PERPETUAL	111.151	0,22
200.000	ALLIANZ SE 3,875% PERPETUAL	135.669	0,25
50.000	BAYER AG VAR 01/07/2075	51.377	0,10
100.000	DEUTSCHE BANK AG 0,375% 18/01/2021	97.356	0,19
50.000	FRESENIUS SE CO KGAA 4,00% 01/02/2024	57.711	0,11
100.000	GERMANY BUND 3,25% 04/01/2020	106.006	0,21
50.000	GERMANY BUND 6,25% 04/01/2024	67.916	0,13
50.000	GERMANY BUND 6,25% 04/01/2030	83.108	0,16
50.000	HEIDELBERGCEMENT AG 2,25% 30/03/2023	53.279	0,10
23.000	K+S AKTIENGESELLSCHAFT 2,625% 06/04/2023	23.843	0,05
50.000	MERCK KGAA VAR 12/12/2074	51.294	0,10
40.000	THYSSENKRUPP AG 1,375% 03/03/2022	40.096	0,08
50.000	THYSSENKRUPP AG 2,75% 08/03/2021	52.247	0,10
100.000	UNITYMEDIA HESSEN GMBH & CO KG 6,25% 15/01/2029	100.773	0,20
	Ungarn	*181.311*	*0,35*
200.000	HUNGARY 5,375% 21/02/2023	181.311	0,35
	Indien	*169.733*	*0,33*
200.000	EXPORT IMPORT BANK OF INDIA 4,00% 14/01/2023	169.733	0,33
	Indonesien	*557.724*	*1,08*
100.000	INDONESIA 3,375% 30/07/2025	107.522	0,21
200.000	INDONESIA 3,75% 14/06/2028	220.734	0,43
250.000	INDONESIA 5,875% 15/01/2024	229.468	0,44
	Irland	*531.857*	*1,03*
100.000	ARDAGH PACKAGING FIN PLC 2,75% 15/03/2024	98.768	0,19
100.000	ARDAGH PACKAGING FINANCE PLC 4,125% 15/05/2023	103.888	0,20
100.000	GE CAPITAL UK FUNDING UNLIMITD COMPANY 5,125% 24/05/2023	128.555	0,25
100.000	SMURFIT KAPPA ACQUISITIONS UNLIMITED COMPAGNY 2,375% 01/02/2024	101.149	0,20
100.000	SMURFIT KAPPA ACQUISITIONS UNLIMITED COMPAGNY 2,875% 15/01/2026	99.497	0,19
	Israel	*69.808*	*0,14*
80.000	ISRAEL ELECTRIC CORP 7,25% 15/01/2019	69.808	0,14
	Italien	*1.149.932*	*2,23*
50.000	ENEL - ENTE NAZIONALE PER L'ENERGIA ELETTRICA 6,25% 20/06/2019	59.133	0,11
100.000	INTESA SANPAOLO SPA 3,928% 15/09/2026	101.146	0,20
50.000	INTESA SANPAOLO SPA 4,125% 14/04/2020	52.905	0,10
200.000	INTESA SANPAOLO SPA 6,50% 24/02/2021	177.035	0,35
50.000	ITALY BTP 4,50% 01/02/2020	52.996	0,10
50.000	ITALY BTP 5,50% 01/09/2022	57.766	0,11
50.000	ITALY BTP 6,00% 01/05/2031	65.977	0,13
50.000	ITALY BTP 7,25% 01/11/2026	67.885	0,13
50.000	ITALY BTP 9,00% 01/11/2023	67.834	0,13
100.000	TELECOM ITALIA SPA 3,00% 30/09/2025	101.509	0,20
100.000	TELECOM ITALIA SPA 3,25% 16/01/2023	105.892	0,21
100.000	TELECOM ITALIA SPA 5,875% 19/05/2023	124.476	0,24
100.000	UNICREDIT SPA 6,95% 31/10/2022	115.378	0,22
	Japan	*407.086*	*0,79*
12.700.000	JAPAN JGBI 0,10% 10/03/2025	103.785	0,20
25.800.000	JAPAN JGBI 0,10% 10/03/2026	211.830	0,41
100.000	SOFTBANK GROUP CORP 3,125% 19/09/2025	91.471	0,18
	Jersey	*154.798*	*0,30*
100.000	APTIVE PLC 1,60% 15/09/2028	97.359	0,19
50.000	HBOS CAPITAL FUNDING LP VAR PERPETUAL	57.439	0,11
	Kasachstan	*164.402*	*0,32*
200.000	KAZAKHSTAN 4,625% 24/05/2023	164.402	0,32
	Luxemburg	*825.106*	*1,60*
100.000	ALTICE FINANCING SA 5,25% 15/02/2023	103.036	0,20
200.000	ALTICE FINANCING SA 7,50% 15.05.2026	164.709	0,32
100.000	ALTICE FINCO S.A 4,75% 15/01/2028	85.044	0,16
100.000	ARCELORMITTAL SA VAR 05/08/2020	88.171	0,17
100.000	ARCELORMITTAL SA 0,95% 17/01/2023	98.168	0,19
100.000	EUROPEAN INVESTMENT BANK (EIB) 5,50% 15/04/2025	142.461	0,28
100.000	SES S.A. VAR PERPETUAL	102.989	0,20
50.000	TELECOM ITALIA CAPITAL SA 6,00% 30/09/2034	40.528	0,08
	Mexiko	*1.409.856*	*2,73*
100.000	CEMEX SAB DE CV 4,375% 05/03/2023	103.393	0,20
200.000	MEXICO 2,375% 09/04/2021	212.090	0,40
450.000	MEXICO 3,75% 11/01/2028	365.225	0,70
200.000	MEXICO 4,15% 28/03/2027	168.961	0,33

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses

Wertpapierbestand zum 30.06.2018

Anzahl		Marktwert	% des NIW
		EUR	
150.000	MEXICO 4,75% 08/03/2044	121.492	0,24
150.000	MEXICO 5,50% 17/02/2020	163.230	0,32
50.000	MEXICO 8,125% 30/12/2019	46.345	0,09
100.000	PETROLEOS MEXICANOS PEMEX 2,50% 21/08/2021	101.151	0,20
50.000	PETROLEOS MEXICANOS PEMEX 3,50% 30/01/2023	40.351	0,08
100.000	PETROLEOS MEXICANOS PEMEX 5,375% 13/03/2022	87.618	0,17
	Mongolei	*160.319*	*0,31*
200.000	MONGOLIA 5,125% 05/12/2022	160.319	0,31
	Marokko	*54.398*	*0,11*
50.000	MOROCCO 4,50% 05/10/2020	54.398	0,11
	Niederlande	*2.869.113*	*5,55*
100.000	ABN AMRO BANK NV 2,50% 29/11/2023	110.303	0,21
100.000	ABN AMRO BANK NV 6,375% 27/04/2021	115.813	0,22
100.000	ATF NETHERLANDS BV VAR PERPETUAL	100.594	0,19
100.000	BHARTI AIRTEL INTERNATIONAL NETHERLANDS B.V. 3,375% 20/05/2021	105.627	0,20
200.000	CNH INDUSTRIAL NV 4,50% 15/08/2023	171.813	0,33
100.000	COOPERATIEVE RABOBANK UA 3,875% 08/02/2022	86.710	0,17
100.000	COOPERATIEVE RABOBANK UA 6,875% 19/03/2020	110.742	0,21
100.000	DEUTSCHE TELEKOM INTERNATIONAL FINANCE BV 6,50% 08/04/2022	132.768	0,26
150.000	DEUTSCHE TELEKOM INTERNATIONAL FINANCE BV 7,50% 24/01/2033	252.598	0,50
100.000	EDP FINANCE BV 2,375% 23/03/2023	107.021	0,21
200.000	EDP FINANCE BV 4,125% 15/01/2020	172.781	0,33
50.000	ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 5,625% 14/08/2024	65.702	0,13
100.000	GAS NATURAL FENOSA FINANCE B.V VAR PERPETUAL	104.080	0,20
100.000	GAS NATURAL FENOSA FINANCE B.V 1,25% 19/04/2026	98.078	0,19
100.000	IBERDROLA INTERNATIONAL BV VAR PERPETUAL	95.500	0,18
200.000	ING BANK NV 5,80% 25/09/2023	181.051	0,36
200.000	ING GROUP NV VAR PERPETUAL	174.569	0,34
50.000	INNOGY FINANCE BV 6,50% 10/08/2021	59.391	0,11
50.000	NETHERLANDS 4,00% 15/01/2037	77.733	0,15
206.000	PETROBRAS GLOBAL FINANCE BV 5,299% 27/01/2025	163.374	0,32
100.000	SCHAEFFLER FINANCE BV 3,25% 15/05/2025	105.404	0,20
50.000	SHELL INTERNATIONAL FINANCE BV 2,875% 10/05/2026	40.687	0,08
50.000	TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE NETHERLANDS III BV 2,80% 21/07/2023	37.007	0,07
100.000	VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV VAR PERPETUAL	97.511	0,19
100.000	VONOVIA FINANCE B.V 4,625% 08/04/2074	102.256	0,20
	Nigeria	*161.636*	*0,31*
200.000	NIGERIA 7.143% 23/02/2030	161.636	0,31
	Oman	*161.182*	*0,31*
200.000	OMAN 5,375% 08/03/2027	161.182	0,31
	Panama	*177.652*	*0,34*
50.000	PANAMA 8,875% 30/09/2027	57.546	0,11
100.000	PANAMA 9,375% 01/04/2029	120.106	0,23
	Peru	*447.327*	*0,87*
50.000	BANCO DE CREDITO DEL CREDITO VAR 24/04/2027	44.954	0,09
100.000	BANCO INTERNATIONAL DEL PERU VAR 19/03/2029	90.443	0,18
50.000	BBVA BANCO CONTIENTAL VAR 22/09/2029	43.897	0,08
100.000	PERU 3,75% 01/03/2030	119.485	0,23
50.000	PERU 4,125% 25/08/2027	43.910	0,09
100.000	PERU 7,35% 21/07/2025	104.638	0,20
	Philippinen	*208.801*	*0,40*
50.000	PHILIPPINES 9,50% 02/02/2030	62.400	0,12
50.000	PHILIPPINES 9,50% 21/10/2024	56.464	0,11
100.000	REPUBLIC OF PHILIPPINES 6,50% 20/01/2020	89.937	0,17
	Polen	*224.819*	*0,44*
250.000	POLAND 5,125% 21/04/2021	224.819	0,44
	Rumänien	*93.336*	*0,18*
100.000	ROMANIA 6,75% 07/02/2022	93.336	0,18
	Serbien	*186.867*	*0,36*
200.000	SERBIA 7,25% 28/09/2021	186.867	0,36
	Südafrika	*175.539*	*0,34*
200.000	SOUTH AFRICA 5,875% 16/09/2025	175.539	0,34
	Spanien	*363.956*	*0,70*
100.000	CELLNEX TELECOM SA 2,375% 16/01/2024	100.252	0,19
50.000	SPAIN 4,85% 17/03/2020	54.082	0,10
50.000	SPAIN 5,40% 31/01/2023	61.688	0,12
50.000	SPAIN 5,75% 30/07/2032	75.305	0,15
50.000	SPAIN 6,00% 31/01/2029	72.629	0,14
	Sri Lanka	*165.697*	*0,32*
200.000	SRI LANKA 6,85% 03/11/2025	165.697	0,32
	Schweden	*196.329*	*0,38*
100.000	INTRUM JUSTITIA AB 2,75% 15/07/2022	94.761	0,18
100.000	TELIA COMPANY AB VAR 04/04/2078	101.568	0,20
	Schweiz	*382.382*	*0,74*
100.000	CREDIT SUISSE GRP AG VAR 17/07/2025	98.646	0,19
200.000	UBS GROUP AG VAR PERPETUAL	176.315	0,34
100.000	UBS INC VAR 12/02/2026	107.421	0,21
	Trinidad und Tobago	*164.411*	*0,32*
200.000	TRINIDAD AND TOBAGO 4,50% 04/08/2026	164.411	0,32
	Türkei	*527.237*	*1,02*
300.000	TURKEY 11,875% 15/01/2030	350.080	0,68
200.000	TURKEY 7,375% 05/02/2025	177.157	0,34

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses

Wertpapierbestand zum 30.06.2018

Anzahl		Marktwert	% des NIW
		EUR	
	Vereinigtes Königreich	*3.666.347*	*7,09*
200.000	ANGLO AMERICAN CAPITAL PLC 1,625% 18/09/2025	197.644	0,38
100.000	AVIVA PLC VAR 05/07/2043	118.160	0,23
50.000	BARCLAYS BANK PLC VAR PERP	62.418	0,12
100.000	BARCLAYS BANK PLC 3,25% 12/02/2027	110.428	0,21
100.000	BARCLAYS PLC VAR 07/02/2028	95.596	0,19
150.000	BAT INTL FINANCE PLC 6,375% 12/12/2019	181.394	0,35
200.000	BP CAPITAL MARKETS PLC 3,161% 17/03/2021	171.141	0,33
100.000	HSBC BANK PLC 4,125% 12/08/2020	87.083	0,17
100.000	HSBC HOLDINGS PLC VAR 13/11/2026	108.614	0,21
50.000	HSBC HOLDINGS PLC 6,50% 20/05/2024	68.566	0,13
100.000	ICBC STANDARD BANK PLC 8,125% 02/12/2019	90.012	0,17
50.000	IMPERIAL BRANDS FINANCE PLC 7,75% 24/06/2019	60.018	0,12
50.000	IMPERIAL BRANDS FINANCE PLC 9,00% 17/02/2022	70.330	0,14
100.000	INEOS FINANCE PLC 2,125% 15/11/2025	95.059	0,18
200.000	JAGUAR LAND ROVER PLC 4,50% 01/10/2027	152.350	0,29
100.000	LLOYDS BANKING GROUP PLC 7,50% 15/04/2024	145.943	0,28
100.000	NATIONWIDE BUILDING SOCIETY 3,25% 20/01/2028	119.091	0,23
50.000	NATIONWIDE BUILDING SOCIETY 5,625% 09/09/2019	59.478	0,12
150.000	RBS GROUP PLC 6,00% 19/12/2023	134.922	0,26
50.000	SANTANDER UK PLC 2,35% 10/09/2019	42.461	0,08
100.000	SANTANDER UK PLC 4,00% 13/03/2024	85.914	0,17
100.000	SKY PLC 2,25% 17/11/2025	106.884	0,21
50.000	TESCO PLC 6,125% 24/02/2022	64.121	0,12
200.000	TULLOW OIL PLC 7,00% 01/03/2025	161.859	0,31
100.000	UK GILT 4,75% 07/03/2020	120.797	0,23
350.000	UK GILT 4,75% 07/12/2030	541.632	1,06
200.000	UK GILT 8,00% 07/06/2021	273.799	0,53
100.000	VODAFONE GROUP PLC 2,95% 19/02/2023	82.552	0,16
50.000	VODAFONE GROUP PLC 8,125% 26/11/2018	58.081	0,11
	Vereinigte Staaten von Amerika	*7.474.493*	*14,46*
50.000	ALLY FINANCIAL INC 4,25% 15/04/2021	42.770	0,08
50.000	AMERICAN AIRLINES 2013-2 CI A PASS THRU TRUST 4,625% 01/03/2020	42.559	0,08
50.000	ANHUSER BUSCH INBEV FIN INC 2,50% 15/07/2022	41.339	0,08
100.000	ANHUSER BUSCH INBEV FIN INC 3,65% 01/02/2026	83.819	0,16
50.000	ANHUSER BUSCH INBEV FIN INC 4,90% 01/02/2046	43.996	0,09
50.000	APPLE INC 4,65% 23/02/2046	45.849	0,09
100.000	AT&T INC 3,15% 04/09/2036	100.201	0,19
50.000	BALL CORP 4,375% 15/12/2020	43.190	0,08
50.000	BALL CORP 5,25% 01/07/2025	43.572	0,08
100.000	BANK OF AMERICA CORP 3,30% 11/01/2023	84.263	0,16
100.000	BANK OF AMERICA CORP 4,20% 26/08/2024	85.898	0,17
150.000	BANK OF AMERICA CORP 5,50% 04/12/2019	179.506	0,35
100.000	BANK OF AMERICA CORP 6,11% 29/01/2037	98.603	0,19
100.000	BAT CAPITAL CORP 3,222% 15/08/2024	81.027	0,16
150.000	BBVA BANCOMER SA TEXAS AGENCY 6,75% 30/09/2022	137.147	0,27
100.000	BERKSHIRE HATHWAY INC 2,75% 15/03/2023	83.631	0,16
20.000	CCO HLDGS LLC/CAP CORP 5,00% 01/02/2028	15.738	0,03
100.000	CEMEX FINANCE LLC 4,625% 15/06/2024	104.988	0,20
200.000	CEMEX FINANCE LLC 6,00% 01/04/2024	173.440	0,34
50.000	CITIGROUP INC 3,75% 16/06/2024	42.355	0,08
100.000	CITIGROUP INC 5,15% 21/05/2026	132.631	0,26
50.000	COCO COLA CO 3,15% 15/11/2020	43.029	0,08
50.000	CVS HEALTH CORP 2,125% 01/06/2021	41.192	0,08
50.000	EXPEDIA INC 4,50% 15/08/2024	42.813	0,08
50.000	FEDERAL NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION 6,625% 15/11/2030	57.792	0,11
250.000	FEDERAL NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION 7,125% 15/01/2030	294.559	0,57
50.000	FEDERAL NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION 7,25% 15/05/2030	59.974	0,12
50.000	FREDDIE MAC 6,75% 15/03/2031	58.621	0,11
50.000	FRONTIER COMMUNICATIONS CORPORATION 10,50% 15/09/2022	38.649	0,07
200.000	GENERAL ELECTRIC CO 2,70% 09/10/2022	165.339	0,32
50.000	GENERAL MOTORS FINANCIAL CO 2,40% 09/05/2019	42.603	0,08
100.000	GENERAL MOTORS FINANCIAL CO 4,00% 15/01/2025	83.354	0,16
100.000	GOLDMAN SACHS GROUP INC. 1,625% 27/07/2026	100.434	0,19
50.000	GOLDMAN SACHS GROUP INC. 2,55% 23/10/2019	42.557	0,08
100.000	GOLDMAN SACHS GROUP INC. 3,25% 01/02/2023	110.902	0,21
700.000	INTERNATIONAL BANK FOR RECONSTRUCTION & DEVELOPMENT 7,625% 19/01/2023	718.286	1,39
50.000	IRON MOUNTAIN INC 5,75% 15/08/2024	41.972	0,08
50.000	JPMORGAN CHASE & CO 2,25% 23/01/2020	42.252	0,08
100.000	JPMORGAN CHASE & CO 2,625% 23/04/2021	106.819	0,21
100.000	JPMORGAN CHASE & CO 2,875% 24/05/2028	113.411	0,22
150.000	JPMORGAN CHASE & CO 2,95% 01/10/2026	118.979	0,23
100.000	JPMORGAN CHASE & CO 3,125% 23/01/2025	81.838	0,16
100.000	JPMORGAN CHASE & CO 3,20% 25/01/2023	84.158	0,16
100.000	LASMO (USA) INC 7,30% 15/11/2027	102.838	0,20
100.000	LENNAR CORP 4,125% 15/01/2022	84.839	0,16
100.000	MICROSOFT CORP 2,00% 08/08/2023	80.711	0,16
100.000	MORGAN STANLEY 3,125% 27/07/2026	79.615	0,15
100.000	MORGAN STANLEY 4,875% 01/11/2022	88.796	0,17
100.000	MORGAN STANLEY 5,375% 10/08/2020	111.054	0,21
50.000	ORACLE CORP 5,00% 08/07/2019	43.784	0,08
50.000	PEPSICO INC 4,50% 15/01/2020	43.926	0,09
50.000	PHILLIP MORRIS INTERNATIONAL INC 2,125% 10/05/2023	40.100	0,08
50.000	POST HOLDINGS INC 5,00% 15/08/2026	39.934	0,08
100.000	QUINTILES IMS INC 3,25% 15/03/2025	97.076	0,19
50.000	QWEST CORP 6,75% 01/12/2021	45.338	0,09
150.000	REYNOLDS GROUP ISSUER INC 5,125% 15/07/2023	126.708	0,25
50.000	SPRINT CORPORATION 7,25% 15/09/2021	44.281	0,09
100.000	SPRINT CORPORATION 7,625% 01/03/2026	87.159	0,17
50.000	TENET HEALTHCARE CORP 4,50% 01/04/2021	42.419	0,08
100.000	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC 1,40% 23/01/2026	100.043	0,19
100.000	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC 3,00% 15/04/2023	83.226	0,16
150.000	T-MOBILE USA INC 6,00% 15/04/2024	132.701	0,26
200.000	USA T-BONDS 5,50% 15/07/2036	224.719	0,44
100.000	USA T-BONDS 7,625% 15/02/2025	110.501	0,21
250.000	USA T-BONDS 8,125% 15/05/2021	246.460	0,48
850.000	USA T-BONDS 8,75% 15/05/2020	811.088	1,58

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses

Wertpapierbestand zum 30.06.2018

Anzahl		Marktwert	% des NIW
		EUR	
100.000	VERIZON COMMUNICATIONS INC 2,625% 15/08/2026	76.109	0,15
53.000	VERIZON COMMUNICATIONS INC 4,329% 21/09/2028	44.843	0,09
100.000	WELLS FARGO & CO 1,375% 26/10/2026	99.328	0,19
100.000	WELLS FARGO & CO 2,00% 28/07/2025	108.622	0,21
100.000	WELLS FARGO & CO 2,10% 26/07/2021	82.220	0,16
	Uruguay	*97.071*	*0,19*
100.000	URUGUAY 8,00% 18/11/2022	97.071	0,19
	Sambia	*151.500*	*0,29*
200.000	ZAMBIA 8,97% 30/07/2027	151.500	0,29
	Optionsscheine, Bezugsrechte	**1.009.318**	**1,95**
	Deutschland	*5*	*0,00*
3	BAYER AG SUBSCRIPTION RIGHT	5	0,00
	Vereinigtes Königreich	*1.009.313*	*1,95*
46	UBS AG CERTIFICATE ETC	27.083	0,05
5.662	UBS AG ETC GOLD	848.172	1,65
206	UBS AG LONDON CERTIFICATE	25.848	0,05
1.037	UBS AG LONDON ETC ON CINCI NICKEL	38.174	0,07
490	UBS ETC ON CMCI ALU USD	25.817	0,05
353	UBS ETC ON CMCI HEAT OIL USD ETC	26.364	0,05
358	UBS ETC ON COMCI CORN USD	17.855	0,03
Anteile/Aktien von OGAW/OGA		**3.692.695**	**7,15**
	Aktien/Anteile an Investmentfonds	**3.692.695**	**7,15**
	Irland	*584.046*	*1,13*
1.103	INVESCO MARKETS PLC-MORNINGSTAR US ENER INFRA MLP UCITS ETF	51.203	0,10
12.561	ISHARES MSCI PACIFIC EX-JAPAN TRACKERS	487.524	0,94
1.167	ISHARES MSCI PACIFIC EX-JAPAN UCITS ETF	45.319	0,09
	Luxemburg	*3.108.649*	*6,02*
45.336	AMUNDI FUNDS II - REAL ASSETS TARGET INCOME A DQ	1.676.677	3,24
1.305	PI INVESTMENT FUNDS - EMERGING MARKETS EQUITY INCOME H QD	1.227.832	2,38
423	AMUNDI S.F. - EUR COMMODITIES I ND	204.140	0,40
Derivative Instrumente		**452.450**	**0,88**
	Optionen	**452.450**	**0,88**
	Deutschland	*162.160*	*0,32*
16	DJ EURO STOXX 50 EUR – 3.350 - 21.12.18 PUT	20.624	0,04
29	DJ EURO STOXX 50 EUR – 3.400 - 21.12.18 PUT	44.138	0,09
28	DJ EURO STOXX 50 EUR – 3.450 - 21.09.18 PUT	33.628	0,07
91	EURO STOXX BANKS - 115 - 21.12.18 CALL	16.835	0,03
10	MSCI EMERGING MARKETS - 530 - 21.09.18 PUT	46.935	0,09
	Japan	*99.866*	*0,19*
7	NIKKEI 225 – 22.500 - 14.09.18 PUT	38.701	0,07
7	NIKKEI 225 – 22.500 - 14.12.18 PUT	61.165	0,12
	Luxemburg	*136.496*	*0,27*
2.000.000	PUT CDX OPTION - CDX NA HY 30 INDEX – 105,50 - 18.07.18	8.537	0,02
450.000	SWAP OPTION - PAY EURIBOR 6M / REC 1,860% - 19.05.27	46.453	0,09
800.000	SWAP OPTION - PAY 1,860% / REC EURIBOR 6M - 19.05.27	81.506	0,16
	Vereinigte Staaten von Amerika	*53.928*	*0,10*
111	10YR US TREASRY NOTE – 118,50 - 24.08.18 PUT	14.855	0,03
4	S&P 500 INDEX – 2.600 - 21.09.18 PUT	10.980	0,02
8	S&P 500 INDEX – 2.650 - 21.09.18 PUT	28.093	0,05
Short-Positionen		**-176.819**	**-0,34**
Derivative Instrumente		**-176.819**	**-0,34**
	Optionen	**-176.819**	**-0,34**
	Deutschland	*-56.485*	*-0,11*
-28	DJ EURO STOXX 50 EUR – 3.300 - 21.09.18 PUT	-18.340	-0,04
-17	DJ EURO STOXX 50 EUR – 3.450 - 21.12.18 CALL	-17.493	-0,03
-30	DJ EURO STOXX 50 EUR – 3.500 - 21.09.18 CALL	-12.840	-0,02
-28	DJ EURO STOXX 50 EUR – 3.550 - 21.09.18 CALL	-7.812	-0,02
	Italien	*-7.185*	*-0,01*
-15	MINI FTSE / MIB INDEX – 20.500 - 20.07.18 PUT	-3.825	0,00
-7	MINI FTSE / MIB INDEX – 21.000 - 20.07.18 PUT	-3.360	-0,01
	Japan	*-44.307*	*-0,09*
-7	NIKKEI 225 – 21.000 - 14.09.18 PUT	-15.426	-0,03
-4	NIKKEI 225 – 23.000 - 14.12.18 CALL	-16.702	-0,04
-7	NIKKEI 225 – 23.250 - 14.09.18 CALL	-12.179	-0,02
	Vereinigte Staaten von Amerika	*-68.842*	*-0,13*
-29	DOW JONES INDUSTRIAL AVG - 235 - 20.07.18 PUT	-2.086	0,00
-2	S&P 500 INDEX – 2.675 - 21.12.18 PUT	-17.293	-0,03
-3	S&P 500 INDEX – 2.700 - 21.09.18 CALL	-24.526	-0,05
-3	S&P 500 INDEX – 2.725 - 21.09.18 CALL	-19.284	-0,04
-2	S&P 500 INDEX – 2.800 - 21.09.18 CALL	-5.653	-0,01
Gesamt-Wertpapierbestand		**48.282.657**	**93,47**

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses

Wertpapierbestand zum 30.06.2018

Anzahl		Marktwert	% des NIW
		EUR	
Long-Positionen		**187.588.079**	**85,73**
Zur amtlichen Notierung an einer Wertpapierbörse zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte, übertragbare Wertpapiere		**29.926.504**	**13,68**
	Anleihen	**29.926.504**	**13,68**
	Regierungen	*29.926.504*	*13,68*
8.700.000	BUNDESLANDER BUNDESREP.DEUTSCH 2,375% 21/09/2018	8.755.027	4,01
4.650.000	FRANCE OAT 4,25% 25/10/2018	4.721.145	2,16
2.300.000	GERMANY BUND 0,05% 20/07/2018	2.300.633	1,05
5.600.000	NIEDERSASEN LAND 2,50% 18/10/2018	5.650.120	2,58
500.000	RHEINLAND PFALZ 0% 16/07/2018	500.110	0,23
3.620.000	STATE OF HESSEN 2,875% 03/08/2018	3.630.498	1,66
600.000	STATE OF LOWER SAXONY 0,075% 20/07/2018	600.165	0,27
3.750.000	STATE OF NORTH RHINE WESTPHALIA 2,00% 13/09/2018	3.768.806	1,72
Geldmarktinstrument		**157.661.575**	**72,05**
	Anleihen	**157.661.575**	**72,05**
	Regierungen	*157.661.575*	*72,05*
11.450.000	BELGIUM 0% 08/11/2018	11.474.193	5,24
8.750.000	BELGIUM 0% 09/08/2018	8.755.731	4,00
10.400.000	BELGIUM 0% 11/10/2018	10.417.597	4,76
10.900.000	BELGIUM 0% 12/07/2018	10.901.581	4,98
11.350.000	BELGIUM 0% 13/09/2018	11.363.983	5,19
10.950.000	BELGIUM 0% 13/12/2018	10.979.784	5,02
9.950.000	FRANCE BTF 0% 01/08/2018	9.955.025	4,55
5.850.000	FRANCE BTF 0% 04/07/2018	5.850.088	2,67
4.700.000	FRANCE BTF 0% 05/12/2018	4.712.385	2,15
11.550.000	FRANCE BTF 0% 07/11/2018	11.575.294	5,30
10.850.000	FRANCE BTF 0% 10/10/2018	10.868.337	4,97
8.350.000	FRANCE BTF 0% 15/08/2018	8.356.179	3,82
12.850.000	FRANCE BTF 0% 18/07/2018	12.853.533	5,88
9.300.000	FRANCE BTF 0% 21/11/2018	9.321.995	4,26
1.200.000	FRANCE BTF 0% 24/10/2018	1.202.364	0,55
6.450.000	FRANCE BTF 0% 29/08/2018	6.456.450	2,95
3.700.000	GERMANY BUBILLS 0% 15/08/2018	3.702.905	1,69
8.900.000	NETHERLANDS 0% 27/09/2018	8.914.151	4,07
Gesamt-Wertpapierbestand		**187.588.079**	**85,73**

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses

Wertpapierbestand zum 30.06.2018

Anzahl		Marktwert	% des NIW
		USD	
Long-Positionen		**507.862.774**	**98,69**
Zur amtlichen Notierung an einer Wertpapierbörse zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte, übertragbare Wertpapiere		**259.710.146**	**50,46**
	Anleihen	**259.710.146**	**50,46**
	Vereinigte Staaten von Amerika	*259.710.146*	*50,46*
152.000.000	USA T-BONDS 0% 15/02/2024	129.936.258	25,24
152.000.000	USA T-BONDS 0% 15/02/2024	129.770.000	25,22
1.000	USA T-BONDS 2,00% 30/04/2024	958	0,00
1.000	USA T-BONDS 2,125% 29/02/2024	966	0,00
1.000	USA T-BONDS 2,125% 31/03/2024	965	0,00
1.000	USA T-BONDS 2,75% 15/02/2024	999	0,00
Anteile/Aktien von OGAW/OGA		**247.970.348**	**48,19**
	Aktien/Anteile an Investmentfonds	**247.970.348**	**48,19**
	Frankreich	*63.597.460*	*12,36*
87	AMUNDI ABS CAP 3 DEC	24.802.124	4,82
144.860	AMUNDI GOVT BOND LOWEST RATE EUROMTS INV GRADE UCITS -EUR C	38.795.336	7,54
	Irland	*15.405.879*	*2,99*
52.330	NOMURA FUNDS IRELAND PLC US HIGH YIELD BOND FUND USD I AC	15.405.879	2,99
	Luxemburg	*168.967.009*	*32,84*
54.220	AMUNDI FUNDS BOND US CORPORATE IU C	59.659.892	11,58
12.943	AMUNDI FUNDS CPR GLOBAL GOLD MINES IU C	4.432.978	0,86
3.235	AMUNDI FUNDS BOND EURO HIGH YIELD IE C	9.656.340	1,88
9.042	AMUNDI FUNDS BOND GLOBAL EMERGING HARD CURRENCY IU C	9.355.667	1,82
12.569	AMUNDI FUNDS BOND EURO CORPORATE IE C	29.887.708	5,81
2.679	AMUNDI FUNDS BOND GLOBAL EMERGING LOCAL CURRENCY - IU (C)	4.632.741	0,90
54.700	AMUNDI INDEX SOLUTIONS JPX NIKKEI 400 SICAV ETF USD	8.980.099	1,75
62.204	AMUNDI INDEX SOLUTIONS SICAV MSCA EMU ETF	14.539.781	2,83
571.583	ETF AMUNDI SP 500 PART B	27.821.803	5,41
Derivative Instrumente		**182.280**	**0,04**
	Optionen	**182.280**	**0,04**
	Vereinigte Staaten von Amerika	*182.280*	*0,04*
93	S&P 500 INDEX – 2.700 - 20.07.18 PUT	182.280	0,04
Gesamt-Wertpapierbestand		**507.862.774**	**98,69**

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses

	Anmerkung	Amundi S.F. - Diversified Short-Term Bond		Amundi S.F. - Diversified Subordinated Bond 2018	
		30/06/2018 EUR	30/06/2017 EUR	30/06/2018 EUR	30/06/2017 EUR
Aktiva					
Wertpapiere zum Anschaffungspreis		1.586.929.342	803.010.640	29.786.327	35.345.225
Unrealisierte Nettogewinne.(-verluste) aus Wertpapieren		-19.920.188	3.136.301	-708.652	-70.788
Anlagen in Wertpapieren zum Marktwert	2	1.567.009.154	806.146.941	29.077.675	35.274.437
Zum Marktpreis erworbene und im Voraus bezahlte Agio-Optionsgeschäfte	2	1.166.028	517.302	-	-
Nicht realisierter Gewinn aus Future-Style Optionskontrakte, netto	2, 11	-	-	-	-
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten, netto	2, 8	640.001	1.525.698	28.651	298.158
Nicht realisierter Gewinn aus Finanzterminkontrakten, netto	2, 7	-	1.294.414	-	-
Nicht realisierter Gewinn aus Swap-Kontrakten, netto	2, 12	-	1.759	-	-
Guthaben bei Banken und Brokern		109.361.029	104.301.095	3.015.172	2.655.070
Zinsforderung		11.473.723	5.540.212	949.284	992.643
Dividendenforderungen		-	-	-	-
Forderungen aus Zeichnungen		10.312.083	5.820.824	-	-
Forderungen aus dem Verkauf von Wertpapieren		1.029.100	-	-	-
Sonstige Forderungen		-	-	-	-
Summe Aktiva		**1.700.991.118**	**925.148.245**	**33.070.782**	**39.220.308**
Passiva					
Banküberziehung		2.987	5.082.153	-	-
Zum Marktpreis gezeichnete und im Voraus bezahlte Agio-Optionsgeschäfte	2	876.658	445.706	-	-
Unrealisierter Nettoverlust aus Future-ähnlichen Optionsgeschäften	2, 11	-	-	-	-
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten, netto	2, 8	-	-	-	-
Nicht realisierter Verlust aus Finanzterminkontrakten, netto	2, 7	3.579.218	-	-	-
Nicht realisierter Verlust aus Swap-Kontrakten, netto	2, 12	3.979.635	-	-	-
Zahlbare Dividenden		-	-	-	-
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		8.665.067	2.274.733	-	-
Verbindlichkeiten aus dem Erwerb von Wertpapieren		1.066.455	123.600	-	-
Antizipative Passiva		1.354.359	1.038.377	34.480	39.681
Sonstige Verbindlichkeiten		17.977	42	-	-
Summe Passiva		**19.542.356**	**8.964.611**	**34.480**	**39.681**
Summe		**1.681.448.762**	**916.183.634**	**33.036.302**	**39.180.627**

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses

	Anmerkung	Amundi S.F. - Emerging Markets Bond 2019		Amundi S.F. - Euro Curve 1-3year	
		30/06/2018 EUR	30/06/2017 EUR	30/06/2018 EUR	30/06/2017 EUR
Aktiva					
Wertpapiere zum Anschaffungspreis		267.952.171	301.302.120	727.779.117	1.122.688.839
Unrealisierte Nettogewinne.(-verluste) aus Wertpapieren		1.143.077	23.833.524	-7.611.800	-24.082.163
Anlagen in Wertpapieren zum Marktwert	2	269.095.248	325.135.644	720.167.317	1.098.606.676
Zum Marktpreis erworbene und im Voraus bezahlte Agio-Optionsgeschäfte	2	-	-	-	-
Nicht realisierter Gewinn aus Future-Style Optionskontrakte, netto	2, 11	-	-	-	-
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten, netto	2, 8	130.613	-	-	-
Nicht realisierter Gewinn aus Finanzterminkontrakten, netto	2, 7	-	-	80	272.985
Nicht realisierter Gewinn aus Swap-Kontrakten, netto	2, 12	-	-	-	1.031.878
Guthaben bei Banken und Brokern		6.873.516	23.844.387	5.346.629	8.586.121
Zinsforderung		4.543.176	5.107.693	6.614.727	23.709.575
Dividendenforderungen		-	-	-	-
Forderungen aus Zeichnungen		-	-	2.224.692	1.413.342
Forderungen aus dem Verkauf von Wertpapieren		-	-	-	-
Sonstige Forderungen		-	833	-	-
Summe Aktiva		**280.642.553**	**354.088.557**	**734.353.445**	**1.133.620.577**
Passiva					
Banküberziehung		-	-	72	-
Zum Marktpreis gezeichnete und im Voraus bezahlte Agio-Optionsgeschäfte	2	-	-	-	-
Unrealisierter Nettoverlust aus Future-ähnlichen Optionsgeschäften	2, 11	-	-	-	65.950
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten, netto	2, 8	-	1.575.894	-	760
Nicht realisierter Verlust aus Finanzterminkontrakten, netto	2, 7	-	-	-	-
Nicht realisierter Verlust aus Swap-Kontrakten, netto	2, 12	8.290	129.094	-	-
Zahlbare Dividenden		-	-	-	-
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		-	-	3.635.333	1.473.657
Verbindlichkeiten aus dem Erwerb von Wertpapieren		-	-	-	-
Antizipative Passiva		672.709	1.221.941	565.469	781.749
Sonstige Verbindlichkeiten		-	-	-	-
Summe Passiva		**680.999**	**2.926.929**	**4.200.874**	**2.322.116**
Summe		**279.961.554**	**351.161.628**	**730.152.571**	**1.131.298.461**

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses

	Anmerkung	Amundi S.F. - Euro Curve 3-5year		Amundi S.F. - Euro Curve 5-7year	
		30/06/2018 EUR	30/06/2017 EUR	30/06/2018 EUR	30/06/2017 EUR
Aktiva					
Wertpapiere zum Anschaffungspreis		255.438.987	366.588.162	11.456.094	16.728.314
Unrealisierte Nettogewinne.(-verluste) aus Wertpapieren		-5.068.114	-3.999.377	-139.640	-196.767
Anlagen in Wertpapieren zum Marktwert	2	250.370.873	362.588.785	11.316.454	16.531.547
Zum Marktpreis erworbene und im Voraus bezahlte Agio-Optionsgeschäfte	2	-	-	-	-
Nicht realisierter Gewinn aus Future-Style Optionskontrakte, netto	2, 11	-	-	-	-
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten, netto	2, 8	-	156	-	-
Nicht realisierter Gewinn aus Finanzterminkontrakten, netto	2, 7	19.940	50.637	1.190	-
Nicht realisierter Gewinn aus Swap-Kontrakten, netto	2, 12	-	310.674	-	-
Guthaben bei Banken und Brokern		1.193.759	2.122.914	97.069	415.018
Zinsforderung		2.082.074	3.764.878	98.832	135.859
Dividendenforderungen		-	-	-	-
Forderungen aus Zeichnungen		532.402	374.037	1	1
Forderungen aus dem Verkauf von Wertpapieren		-	-	-	-
Sonstige Forderungen		-	-	-	-
Summe Aktiva		**254.199.048**	**369.212.081**	**11.513.546**	**17.082.425**
Passiva					
Banküberziehung		17	-	-	-
Zum Marktpreis gezeichnete und im Voraus bezahlte Agio-Optionsgeschäfte	2	-	-	-	-
Unrealisierter Nettoverlust aus Future-ähnlichen Optionsgeschäften	2, 11	-	20.937	-	-
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten, netto	2, 8	-	-	-	-
Nicht realisierter Verlust aus Finanzterminkontrakten, netto	2, 7	-	-	-	5.720
Nicht realisierter Verlust aus Swap-Kontrakten, netto	2, 12	-	-	-	-
Zahlbare Dividenden		-	-	-	-
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		1.150.960	807.707	82.128	77.244
Verbindlichkeiten aus dem Erwerb von Wertpapieren		-	-	-	-
Antizipative Passiva		268.370	387.586	15.337	23.150
Sonstige Verbindlichkeiten		-	-	-	-
Summe Passiva		**1.419.347**	**1.216.230**	**97.465**	**106.114**
Summe		**252.779.701**	**367.995.851**	**11.416.081**	**16.976.311**

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses

	Anmerkung	Amundi S.F. - Euro Curve 7-10year		Amundi S.F. - Euro Curve 10+year	
		30/06/2018 EUR	30/06/2017 EUR	30/06/2018 EUR	30/06/2017 EUR
Aktiva					
Wertpapiere zum Anschaffungspreis		165.281.393	215.646.382	109.768.190	164.668.973
Unrealisierte Nettogewinne.(-verluste) aus Wertpapieren		399.543	-1.564.194	-1.360.912	-5.733.862
Anlagen in Wertpapieren zum Marktwert	2	165.680.936	214.082.188	108.407.278	158.935.111
Zum Marktpreis erworbene und im Voraus bezahlte Agio-Optionsgeschäfte	2	-	-	-	-
Nicht realisierter Gewinn aus Future-Style Optionskontrakte, netto	2, 11	-	-	-	-
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten, netto	2, 8	-	-	1.175	17.734
Nicht realisierter Gewinn aus Finanzterminkontrakten, netto	2, 7	104.060	-	96.690	-
Nicht realisierter Gewinn aus Swap-Kontrakten, netto	2, 12	-	200.709	-	142.345
Guthaben bei Banken und Brokern		846.791	5.533.113	2.973.020	2.630.179
Zinsforderung		1.306.384	1.734.066	1.524.221	2.361.910
Dividendenforderungen		-	-	-	-
Forderungen aus Zeichnungen		476.330	4.078	13.337	2.759.349
Forderungen aus dem Verkauf von Wertpapieren		-	-	-	3.939.583
Sonstige Forderungen		-	-	-	-
Summe Aktiva		**168.414.501**	**221.554.154**	**113.015.721**	**170.786.211**
Passiva					
Banküberziehung		340.393	-	7	-
Zum Marktpreis gezeichnete und im Voraus bezahlte Agio-Optionsgeschäfte	2	-	-	-	-
Unrealisierter Nettoverlust aus Future-ähnlichen Optionsgeschäften	2, 11	-	14.388	-	9.475
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten, netto	2, 8	-	1.778	-	-
Nicht realisierter Verlust aus Finanzterminkontrakten, netto	2, 7	-	52.956	-	115.816
Nicht realisierter Verlust aus Swap-Kontrakten, netto	2, 12	-	-	-	-
Zahlbare Dividenden		5	8	-	-
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		886.676	411.065	1.361.579	7.668.680
Verbindlichkeiten aus dem Erwerb von Wertpapieren		-	-	-	-
Antizipative Passiva		189.929	236.291	146.216	192.775
Sonstige Verbindlichkeiten		-	-	-	-
Summe Passiva		**1.417.003**	**716.486**	**1.507.802**	**7.986.746**
Summe		**166.997.498**	**220.837.668**	**111.507.919**	**162.799.465**

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses

	Anmerkung	Amundi S.F. – High Yield & Emerging Markets Bond Opportunities 2021		Amundi S.F. - European Equity Market Plus	
		30/06/2018 EUR	30/06/2017 EUR	30/06/2018 EUR	30/06/2017 EUR
Aktiva					
Wertpapiere zum Anschaffungspreis		50.380.240	55.322.886	207.300.727	213.731.422
Unrealisierte Nettogewinne.(-verluste) aus Wertpapieren		-3.703.896	-191.860	20.975.366	31.108.685
Anlagen in Wertpapieren zum Marktwert	2	46.676.344	55.131.026	228.276.093	244.840.107
Zum Marktpreis erworbene und im Voraus bezahlte Agio-Optionsgeschäfte	2	-	-	-	-
Nicht realisierter Gewinn aus Future-Style Optionskontrakte, netto	2, 11	-	-	-	-
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten, netto	2, 8	-	-	-	-
Nicht realisierter Gewinn aus Finanzterminkontrakten, netto	2, 7	-	-	101.246	-
Nicht realisierter Gewinn aus Swap-Kontrakten, netto	2, 12	-	-	-	-
Guthaben bei Banken und Brokern		1.836.293	3.602.327	5.682.364	11.626.602
Zinsforderung		810.023	860.939	-	-
Dividendenforderungen		-	-	551.368	618.759
Forderungen aus Zeichnungen		-	-	5.847	272.896
Forderungen aus dem Verkauf von Wertpapieren		-	-	1.420	7.880
Sonstige Forderungen		-	-	-	-
Summe Aktiva		**49.322.660**	**59.594.292**	**234.618.338**	**257.366.244**
Passiva					
Banküberziehung		-	-	3.988.977	308.577
Zum Marktpreis gezeichnete und im Voraus bezahlte Agio-Optionsgeschäfte	2	-	-	-	-
Unrealisierter Nettoverlust aus Future-ähnlichen Optionsgeschäften	2, 11	-	-	-	-
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten, netto	2, 8	182.478	1.189.363	-	-
Nicht realisierter Verlust aus Finanzterminkontrakten, netto	2, 7	-	-	-	420.339
Nicht realisierter Verlust aus Swap-Kontrakten, netto	2, 12	15	1.282	-	-
Zahlbare Dividenden		-	-	-	-
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		-	-	1.424.042	296.258
Verbindlichkeiten aus dem Erwerb von Wertpapieren		-	-	-	-
Antizipative Passiva		59.775	323.631	171.405	184.489
Sonstige Verbindlichkeiten		-	-	409	-
Summe Passiva		**242.268**	**1.514.276**	**5.584.833**	**1.209.663**
Summe		**49.080.392**	**58.080.016**	**229.033.505**	**256.156.581**

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses

	Anmerkung	Amundi S.F. – Absolute Return Multi-Strategy Control		Amundi S.F. - Saving Box I	
		30/06/2018 EUR	30/06/2017 EUR	30/06/2018 EUR	30/06/2017 EUR
Aktiva					
Wertpapiere zum Anschaffungspreis		154.357.331	168.779.681	107.844.368	187.893.981
Unrealisierte Nettogewinne.(-verluste) aus Wertpapieren		-1.726.260	-968.757	-1.543.140	-1.084.342
Anlagen in Wertpapieren zum Marktwert	2	152.631.071	167.810.924	106.301.228	186.809.639
Zum Marktpreis erworbene und im Voraus bezahlte Agio-Optionsgeschäfte	2	2.474.292	2.178.490	609.604	1.405.000
Nicht realisierter Gewinn aus Future-Style Optionskontrakte, netto	2, 11	-	-	-	-
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten, netto	2, 8	-	902.022	-	1.051.922
Nicht realisierter Gewinn aus Finanzterminkontrakten, netto	2, 7	339.749	623.348	-	694.168
Nicht realisierter Gewinn aus Swap-Kontrakten, netto	2, 12	-	-	-	-
Guthaben bei Banken und Brokern		28.788.641	10.133.299	8.379.220	9.839.415
Zinsforderung		688.743	1.035.002	372.620	1.026.704
Dividendenforderungen		33.762	67.482	8.148	16.667
Forderungen aus Zeichnungen		214	479.025	-	-
Forderungen aus dem Verkauf von Wertpapieren		3.347.625	189.090	2.833.673	382.987
Sonstige Forderungen		1.809	-	16.489	28.952
Summe Aktiva		**188.305.906**	**183.418.682**	**118.520.982**	**201.255.454**
Passiva					
Banküberziehung		398.134	132.411	98.978	264.726
Zum Marktpreis gezeichnete und im Voraus bezahlte Agio-Optionsgeschäfte	2	1.074.844	1.317.306	362.408	787.896
Unrealisierter Nettoverlust aus Future-ähnlichen Optionsgeschäften	2, 11	39.701	69.273	17.021	76.817
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten, netto	2, 8	125.522	-	57.136	-
Nicht realisierter Verlust aus Finanzterminkontrakten, netto	2, 7	-	-	24.227	-
Nicht realisierter Verlust aus Swap-Kontrakten, netto	2, 12	2.022.981	6.594.321	771.627	6.460.117
Zahlbare Dividenden		-	-	-	-
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		1.308.479	-	305.805	577.416
Verbindlichkeiten aus dem Erwerb von Wertpapieren		5.290.542	1.899.699	1.540.053	1.308.380
Antizipative Passiva		178.360	147.841	155.102	197.829
Sonstige Verbindlichkeiten		-	58.918	-	49.933
Summe Passiva		**10.438.563**	**10.219.769**	**3.332.357**	**9.723.114**
Summe		**177.867.343**	**173.198.913**	**115.188.625**	**191.532.340**

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses

	Anmerkung	Amundi S.F. - Saving Box II		Amundi S.F. - Saving Box III	
		30/06/2018 EUR	30/06/2017 EUR	30/06/2018 EUR	30/06/2017 EUR
Aktiva					
Wertpapiere zum Anschaffungspreis		215.114.093	391.380.857	77.863.671	121.496.846
Unrealisierte Nettogewinne.(-verluste) aus Wertpapieren		-2.351.624	-1.891.797	-909.329	-627.424
Anlagen in Wertpapieren zum Marktwert	2	212.762.469	389.489.060	76.954.342	120.869.422
Zum Marktpreis erworbene und im Voraus bezahlte Agio-Optionsgeschäfte	2	1.206.609	2.624.656	383.794	769.886
Nicht realisierter Gewinn aus Future-Style Optionskontrakte, netto	2, 11	-	-	-	-
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten, netto	2, 8	-	1.215.328	-	532.593
Nicht realisierter Gewinn aus Finanzterminkontrakten, netto	2, 7	-	1.232.461	-	516.282
Nicht realisierter Gewinn aus Swap-Kontrakten, netto	2, 12	-	-	-	-
Guthaben bei Banken und Brokern		23.309.395	20.994.770	15.485.349	15.654.303
Zinsforderung		640.918	2.158.555	247.023	551.206
Dividendenforderungen		16.890	33.917	6.194	10.902
Forderungen aus Zeichnungen		-	-	-	-
Forderungen aus dem Verkauf von Wertpapieren		4.541.033	363.053	2.012.742	343.864
Sonstige Forderungen		29.674	57.950	12.292	19.306
Summe Aktiva		**242.506.988**	**418.169.750**	**95.101.736**	**139.267.764**
Passiva					
Banküberziehung		207.750	198.203	60.927	60.767
Zum Marktpreis gezeichnete und im Voraus bezahlte Agio-Optionsgeschäfte	2	698.908	1.427.077	233.490	395.816
Unrealisierter Nettoverlust aus Future-ähnlichen Optionsgeschäften	2, 11	34.042	82.088	11.966	22.778
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten, netto	2, 8	86.312	-	75.447	-
Nicht realisierter Verlust aus Finanzterminkontrakten, netto	2, 7	135.393	-	68.173	-
Nicht realisierter Verlust aus Swap-Kontrakten, netto	2, 12	2.077.121	11.793.849	746.668	3.333.148
Zahlbare Dividenden		-	-	-	-
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		585.301	2.698.326	178.305	127.495
Verbindlichkeiten aus dem Erwerb von Wertpapieren		2.887.792	2.721.872	1.391.206	1.242.971
Antizipative Passiva		226.766	318.967	94.121	100.257
Sonstige Verbindlichkeiten		364	112.362	4.104	30.998
Summe Passiva		**6.939.749**	**19.352.744**	**2.864.407**	**5.314.230**
Summe		**235.567.239**	**398.817.006**	**92.237.329**	**133.953.534**

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses

	Anmerkung	Amundi S.F. - Amundi Target Trend 2024		Amundi S.F. - Equity Plan 60	
		30/06/2018 EUR	30/06/2017 EUR	30/06/2018 EUR	30/06/2017 EUR
Aktiva					
Wertpapiere zum Anschaffungspreis		33.634.305	-	140.990.918	242.952.173
Unrealisierte Nettogewinne.(-verluste) aus Wertpapieren		-297.190	-	1.760.300	3.442.592
Anlagen in Wertpapieren zum Marktwert	2	33.337.115	-	142.751.218	246.394.765
Zum Marktpreis erworbene und im Voraus bezahlte Agio-Optionsgeschäfte	2	-	-	1.549.595	-
Nicht realisierter Gewinn aus Future-Style Optionskontrakte, netto	2, 11	-	-	-	-
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten, netto	2, 8	-	-	-	239.151
Nicht realisierter Gewinn aus Finanzterminkontrakten, netto	2, 7	-	-	-	-
Nicht realisierter Gewinn aus Swap-Kontrakten, netto	2, 12	-	-	-	-
Guthaben bei Banken und Brokern		2.671.587	-	1.950.687	5.286.639
Zinsforderung		1.931	-	315.130	236.324
Dividendenforderungen		-	-	67.921	90.028
Forderungen aus Zeichnungen		-	-	-	-
Forderungen aus dem Verkauf von Wertpapieren		-	-	3.159.919	-
Sonstige Forderungen		-	-	-	-
Summe Aktiva		**36.010.633**	**-**	**149.794.470**	**252.246.907**
Passiva					
Banküberziehung		-	-	83.018	6.095
Zum Marktpreis gezeichnete und im Voraus bezahlte Agio-Optionsgeschäfte	2	-	-	883.621	-
Unrealisierter Nettoverlust aus Future-ähnlichen Optionsgeschäften	2, 11	-	-	-	-
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten, netto	2, 8	21.327	-	322.015	-
Nicht realisierter Verlust aus Finanzterminkontrakten, netto	2, 7	-	-	-	6.337
Nicht realisierter Verlust aus Swap-Kontrakten, netto	2, 12	-	-	-	-
Zahlbare Dividenden		-	-	-	-
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		29.238	-	518.104	700.818
Verbindlichkeiten aus dem Erwerb von Wertpapieren		-	-	3.750.132	-
Antizipative Passiva		37.108	-	259.958	394.500
Sonstige Verbindlichkeiten		-	-	12.058	-
Summe Passiva		**87.673**	**-**	**5.828.906**	**1.107.750**
Summe		**35.922.960**	**-**	**143.965.564**	**251.139.157**

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses

	Anmerkung	Amundi S.F. - Diversified Target Income 11/2021		Amundi S.F. - Diversified Target Income 11/2022	
		30/06/2018 EUR	30/06/2017 EUR	30/06/2018 EUR	30/06/2017 EUR
Aktiva					
Wertpapiere zum Anschaffungspreis		44.114.185	46.118.214	50.264.029	49.319.858
Unrealisierte Nettogewinne.(-verluste) aus Wertpapieren		-2.102.357	-784.330	-2.257.003	-1.414.915
Anlagen in Wertpapieren zum Marktwert	2	42.011.828	45.333.884	48.007.026	47.904.943
Zum Marktpreis erworbene und im Voraus bezahlte Agio-Optionsgeschäfte	2	405.057	420.257	452.450	460.829
Nicht realisierter Gewinn aus Future-Style Optionskontrakte, netto	2, 11	-	18.432	-	-
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten, netto	2, 8	473.924	253.304	431.655	561.200
Nicht realisierter Gewinn aus Finanzterminkontrakten, netto	2, 7	-	136.153	-	119.482
Nicht realisierter Gewinn aus Swap-Kontrakten, netto	2, 12	-	32.859	-	-
Guthaben bei Banken und Brokern		2.656.907	5.901.290	2.915.392	6.986.760
Zinsforderung		398.421	382.949	495.800	456.188
Dividendenforderungen		20.094	30.208	22.838	32.027
Forderungen aus Zeichnungen		-	-	-	-
Forderungen aus dem Verkauf von Wertpapieren		272.830	109.800	92	109.800
Sonstige Forderungen		6.395	3.998	7.214	4.138
Summe Aktiva		**46.245.456**	**52.623.134**	**52.332.467**	**56.635.367**
Passiva					
Banküberziehung		191	-	191	-
Zum Marktpreis gezeichnete und im Voraus bezahlte Agio-Optionsgeschäfte	2	160.922	224.183	176.819	235.029
Unrealisierter Nettoverlust aus Future-ähnlichen Optionsgeschäften	2, 11	2.460	-	2.770	-
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten, netto	2, 8	-	-	-	-
Nicht realisierter Verlust aus Finanzterminkontrakten, netto	2, 7	65.462	-	59.700	-
Nicht realisierter Verlust aus Swap-Kontrakten, netto	2, 12	42.788	-	100.573	5.658
Zahlbare Dividenden		-	-	-	-
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		-	6.040	-	10.139
Verbindlichkeiten aus dem Erwerb von Wertpapieren		231.096	248.031	243.446	457.124
Antizipative Passiva		48.740	53.272	57.712	62.065
Sonstige Verbindlichkeiten		31.839	548	36.815	8.107
Summe Passiva		**583.498**	**532.074**	**678.026**	**778.122**
Summe		**45.661.958**	**52.091.060**	**51.654.441**	**55.857.245**

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses

	Anmerkung	Amundi S.F. - EUR Commodities		Amundi S.F. - SMBC Amundi Protect Fund USD Step 201803	
		30/06/2018 EUR	30/06/2017 EUR	30/06/2018 USD	30/06/2017 USD
Aktiva					
Wertpapiere zum Anschaffungspreis		187.984.559	81.162.497	514.710.676	-
Unrealisierte Nettogewinne.(-verluste) aus Wertpapieren		-396.480	-347.064	-7.030.182	-
Anlagen in Wertpapieren zum Marktwert	2	187.588.079	80.815.433	507.680.494	-
Zum Marktpreis erworbene und im Voraus bezahlte Agio-Optionsgeschäfte	2	-	-	182.280	-
Nicht realisierter Gewinn aus Future-Style Optionskontrakte, netto	2, 11	-	-	-	-
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten, netto	2, 8	-	-	-	-
Nicht realisierter Gewinn aus Finanzterminkontrakten, netto	2, 7	-	-	-	-
Nicht realisierter Gewinn aus Swap-Kontrakten, netto	2, 12	-	-	-	-
Guthaben bei Banken und Brokern		39.664.444	16.074.909	9.795.268	-
Zinsforderungen		546.019	239.282	7.082	-
Dividendenforderungen		-	-	-	-
Forderungen aus Zeichnungen		400.531	118.306	-	-
Forderungen aus dem Verkauf von Wertpapieren		-	-	-	-
Sonstige Forderungen		-	-	306.017	-
Summe Aktiva		**228.199.073**	**97.247.930**	**517.971.141**	**-**
Passiva					
Banküberziehung		-	280.000	175.200	-
Zum Marktpreis gezeichnete und im Voraus bezahlte Agio-Optionsgeschäfte	2	-	-	-	-
Unrealisierter Nettoverlust aus Future-ähnlichen Optionsgeschäften	2, 11	-	-	-	-
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten, netto	2, 8	181.797	78.224	1.001.995	-
Nicht realisierter Verlust aus Finanzterminkontrakten, netto	2, 7	-	-	680.193	-
Nicht realisierter Verlust aus Swap-Kontrakten, netto	2, 12	8.597.027	1.207.126	-	-
Zahlbare Dividenden		-	-	-	-
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		413.404	369.911	760.450	-
Verbindlichkeiten aus dem Erwerb von Wertpapieren		-	-	-	-
Antizipative Passiva		174.854	82.122	768.663	-
Sonstige Verbindlichkeiten		11.361	4.487	-	-
Summe Passiva		**9.378.443**	**2.021.870**	**3.386.501**	**-**
Summe		**218.820.630**	**95.226.060**	**514.584.640**	**-**

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses

	Anmerkung	Gesamt	
		30/06/2018 EUR	30/06/2017 EUR
Aktiva			
Wertpapiere zum Anschaffungspreis		4.865.084.594	4.871.361.296
Unrealisierte Nettogewinne.(-verluste) aus Wertpapieren		-31.839.580	29.291.588
Anlagen in Wertpapieren zum Marktwert	2	4.833.245.014	4.900.652.884
Zum Marktpreis erworbene und im Voraus bezahlte Agio-Optionsgeschäfte	2	8.403.550	8.384.666
Nicht realisierter Gewinn aus Future-Style Optionskontrakte, netto	2, 11	-	18.432
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten, netto	2, 8	1.706.019	8.766.628
Nicht realisierter Gewinn aus Finanzterminkontrakten, netto	2, 7	662.955	4.963.918
Nicht realisierter Gewinn aus Swap-Kontrakten, netto	2, 12	-	1.772.263
Guthaben bei Banken und Brokern		271.436.813	272.598.353
Zinsforderung		33.115.115	55.055.204
Dividendenforderungen		727.215	1.515.771
Forderungen aus Zeichnungen		13.965.437	11.542.142
Forderungen aus dem Verkauf von Wertpapieren		17.198.434	5.768.089
Sonstige Forderungen		335.974	117.960
Summe Aktiva		**5.180.796.526**	**5.271.156.310**
Passiva			
Banküberziehung		5.331.699	8.272.445
Zum Marktpreis gezeichnete und im Voraus bezahlte Agio-Optionsgeschäfte	2	4.467.670	4.838.246
Unrealisierter Nettoverlust aus Future-ähnlichen Optionsgeschäften	2, 11	107.960	363.844
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten, netto	2, 8	1.910.233	3.144.122
Nicht realisierter Verlust aus Finanzterminkontrakten, netto	2, 7	4.514.752	643.912
Nicht realisierter Verlust aus Swap-Kontrakten, netto	2, 12	18.346.725	29.622.443
Zahlbare Dividenden		5	2.595
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		21.195.739	17.705.646
Verbindlichkeiten aus dem Erwerb von Wertpapieren		16.400.722	8.101.457
Antizipative Passiva		5.369.122	6.195.451
Sonstige Verbindlichkeiten		114.927	278.220
Summe Passiva		**77.759.554**	**79.168.381**
Summe		**5.103.036.972**	**5.191.987.929**

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses

Amundi S.F. - Diversified Short-Term Bond

Zeitraum/Jahre endend am:		30/06/18	31/12/17	31/12/16
Nettovermögen	EUR	1.681.448.762	1.187.906.964	298.719.117
Anteilsklasse A thesaurierend				
Anzahl der Anteile		65.470,32	-	-
Nettoinventarwert pro Anteil	EUR	49,41	-	-
Anteilsklasse E thesaurierend				
Anzahl der Anteile		304.058.037,22	210.550.248,84	57.972.954,85
Nettoinventarwert pro Anteil	EUR	5,001	5,090	5,014
Nettoinventarwert pro Anteil	USD	5,838	-	-
Anteilsklasse H thesaurierend				
Anzahl der Anteile		119.632,97	113.745,21	8.000,00
Nettoinventarwert pro Anteil	EUR	1.006,02	1.022,51	1.003,44
Anteilsklasse I thesaurierend				
Anzahl der Anteile		37.819,84	-	-
Nettoinventarwert pro Anteil	EUR	989,21	-	-

Amundi S.F. - Diversified Subordinated Bond 2018

Zeitraum/Jahre endend am:		30/06/18	31/12/17	31/12/16
Nettovermögen	EUR	33.036.302	36.910.701	42.506.791
Anteilsklasse E jährlich ausschüttend				
Anzahl der Anteile		6.095.722,95	6.606.316,57	7.713.717,27
Nettoinventarwert pro Anteil	EUR	5,420	5,587	5,511

Amundi S.F. - Emerging Markets Bond 2019

Zeitraum/Jahre endend am:		30/06/18	31/12/17	31/12/16
Nettovermögen	EUR	279.961.554	308.880.024	396.857.437
Anteilsklasse A abgesichert jährlich ausschüttend				
Anzahl der Anteile		108.025,33	112.372,51	121.583,78
Nettoinventarwert pro Anteil	EUR	50,55	51,43	50,32
Anteilsklasse A abgesichert jährlich ausschüttend				
Anzahl der Anteile		213.858,42	216.374,61	219.943,45
Nettoinventarwert pro Anteil	CZK	1.372,81	1.393,72	1.372,26
Anteilsklasse E jährlich ausschüttend				
Anzahl der Anteile		1.700.793,15	1.890.097,11	3.287.698,34
Nettoinventarwert pro Anteil	EUR	6,189	6,051	6,449
Anteilsklasse E abgesichert jährlich ausschüttend				
Anzahl der Anteile		49.831.578,77	54.265.461,18	71.181.967,35
Nettoinventarwert pro Anteil	EUR	5,071	5,157	5,035

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses

Amundi S.F. - Ethical Euro Corporate Bond

Zeitraum/Jahre endend am:		30/06/18	31/12/17	31/12/16
Nettovermögen	EUR	-	21.555.661	20.085.553
Anteilsklasse A thesaurierend				
Anzahl der Anteile		-	-	100,00
Nettoinventarwert pro Anteil	EUR	-	-	51,73
Anteilsklasse H thesaurierend				
Anzahl der Anteile		-	3.803,17	6.362,87
Nettoinventarwert pro Anteil	EUR	-	1.053,60	1.041,15
Anteilsklasse I ausschüttend				
Anzahl der Anteile		-	2.899,76	4.042,93
Nettoinventarwert pro Anteil	EUR	-	1.033,24	1.031,23
Anteilsklasse I thesaurierend				
Anzahl der Anteile		-	13.842,21	6.675,03
Nettoinventarwert pro Anteil	EUR	-	1.051,31	1.040,08
Anteilsklasse R ausschüttend				
Anzahl der Anteile		-	-	100,00
Nettoinventarwert pro Anteil	EUR	-	-	51,56
Anteilsklasse R thesaurierend				
Anzahl der Anteile		-	-	100,00
Nettoinventarwert pro Anteil	EUR	-	-	52,02
Anteilsklasse X quartalsweise ausschüttend mit Zielrendite				
Anzahl der Anteile		-	-	2.255,50
Nettoinventarwert pro Anteil	EUR	-	-	1.034,60

Amundi S.F. - Euro Curve 1-3year

Zeitraum/Jahre endend am:		30/06/18	31/12/17	31/12/16
Nettovermögen	EUR	730.152.571	954.553.346	1.471.221.098
Anteilsklasse A jährlich ausschüttend				
Anzahl der Anteile		11.446,54	12.089,19	17.535,34
Nettoinventarwert pro Anteil	EUR	474,35	478,79	485,04
Anteilsklasse A thesaurierend				
Anzahl der Anteile		48.885,96	66.042,88	325.857,68
Nettoinventarwert pro Anteil	EUR	61,83	62,23	63,04
Anteilsklasse E thesaurierend				
Anzahl der Anteile		61.209.693,91	59.063.398,16	77.342.420,48
Nettoinventarwert pro Anteil	EUR	5,829	5,872	5,959
Anteilsklasse F thesaurierend				
Anzahl der Anteile		1.380.990,30	2.210.784,78	6.036.600,36
Nettoinventarwert pro Anteil	EUR	5,595	5,645	5,749
Anteilsklasse H jährlich ausschüttend				
Anzahl der Anteile		85,96	85,96	85,96
Nettoinventarwert pro Anteil	EUR	1.039,67	1.050,18	1.062,30

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses

Amundi S.F. - Euro Curve 1-3year

Zeitraum/Jahre endend am:		30/06/18	31/12/17	31/12/16
Anteilsklasse H thesaurierend				
Anzahl der Anteile		223.821,77	333.331,38	655.112,69
Nettoinventarwert pro Anteil	EUR	1.187,38	1.194,16	1.207,90
Anteilsklasse I thesaurierend				
Anzahl der Anteile		82.366,10	168.125,64	138.114,76
Nettoinventarwert pro Anteil	EUR	1.108,36	1.113,35	1.123,53
Anteilsklasse R jährlich ausschüttend				
Anzahl der Anteile		100,00	100,00	-
Nettoinventarwert pro Anteil	EUR	49,59	49,86	-
Anteilsklasse R thesaurierend				
Anzahl der Anteile		614,37	614,37	-
Nettoinventarwert pro Anteil	EUR	49,63	49,88	-

Amundi S.F. - Euro Curve 3-5year

Zeitraum/Jahre endend am:		30/06/18	31/12/17	31/12/16
Nettovermögen	EUR	252.779.701	282.291.781	434.958.734
Anteilsklasse A jährlich ausschüttend				
Anzahl der Anteile		80.221,38	143.091,60	158.844,20
Nettoinventarwert pro Anteil	EUR	65,59	66,10	66,63
Anteilsklasse A thesaurierend				
Anzahl der Anteile		83.052,68	165.483,88	294.179,76
Nettoinventarwert pro Anteil	EUR	68,96	69,51	70,06
Anteilsklasse E thesaurierend				
Anzahl der Anteile		20.903.420,53	22.378.548,68	34.493.445,39
Nettoinventarwert pro Anteil	EUR	6,608	6,676	6,761
Anteilsklasse F thesaurierend				
Anzahl der Anteile		2.437.965,85	3.216.678,74	5.435.157,30
Nettoinventarwert pro Anteil	EUR	6,311	6,393	6,511
Anteilsklasse H thesaurierend				
Anzahl der Anteile		55.339,13	59.651,98	91.720,85
Nettoinventarwert pro Anteil	EUR	1.388,33	1.398,95	1.409,40
Anteilsklasse I thesaurierend				
Anzahl der Anteile		4.219,55	4.635,39	4.441,48
Nettoinventarwert pro Anteil	EUR	1.311,73	1.320,52	1.327,89
Anteilsklasse R thesaurierend				
Anzahl der Anteile		119.816,46	36.261,17	-
Nettoinventarwert pro Anteil	EUR	49,40	49,75	-

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses

Amundi S.F. - Euro Curve 5-7year

Zeitraum/Jahre endend am:		30/06/18	31/12/17	31/12/16
Nettovermögen	EUR	11.416.081	13.210.588	32.353.969
Anteilsklasse E quartalsweise ausschüttend mit Zielrendite		695.539,60	788.548,60	1.801.990,81
Anzahl der Anteile	EUR	5,359	5,414	5,478
Nettoinventarwert pro Anteil				
Anteilsklasse E thesaurierend		1.166.739,42	1.347.430,46	2.447.800,37
Anzahl der Anteile	EUR	6,585	6,628	6,646
Nettoinventarwert pro Anteil				
Anteilsklasse H thesaurierend		4,21	7,55	4.562,32
Anzahl der Anteile	EUR	1.360,48	1.365,68	1.362,00
Nettoinventarwert pro Anteil				

Amundi S.F. - Euro Curve 7-10year

Zeitraum/Jahre endend am:		30/06/18	31/12/17	31/12/16
Nettovermögen	EUR	166.997.498	200.246.263	345.740.656
Anteilsklasse A ausschüttend		540,00	525,00	551,67
Anzahl der Anteile	EUR	71,04	70,89	70,65
Nettoinventarwert pro Anteil				
Anteilsklasse A jährlich ausschüttend		207.844,93	214.793,83	248.632,00
Anzahl der Anteile	EUR	75,02	74,96	74,66
Nettoinventarwert pro Anteil				
Anteilsklasse A thesaurierend		370.019,68	186.630,06	17.822,81
Anzahl der Anteile	EUR	85,35	85,07	84,59
Nettoinventarwert pro Anteil				
Anteilsklasse C thesaurierend		156,57	1.459,93	2.067,34
Anzahl der Anteile	EUR	70,02	70,22	70,72
Nettoinventarwert pro Anteil				
Anteilsklasse E quartalsweise ausschüttend mit Zielrendite		519.534,91	635.701,71	1.577.665,25
Anzahl der Anteile	EUR	5,619	5,639	5,693
Nettoinventarwert pro Anteil				
Anteilsklasse E thesaurierend		12.353.043,87	14.390.698,29	22.767.339,30
Anzahl der Anteile	EUR	8,165	8,157	8,148
Nettoinventarwert pro Anteil				
Anteilsklasse F thesaurierend		631.889,74	929.750,95	1.391.779,02
Anzahl der Anteile	EUR	7,616	7,629	7,662
Nettoinventarwert pro Anteil				
Anteilsklasse H thesaurierend		4.683,53	11.391,27	41.050,19
Anzahl der Anteile	EUR	1.707,15	1.700,86	1.689,91
Nettoinventarwert pro Anteil				
Anteilsklasse I thesaurierend		2.042,00	13.357,78	33.197,08
Anzahl der Anteile	EUR	1.554,83	1.547,93	1.535,16
Nettoinventarwert pro Anteil				

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses

Amundi S.F. - Euro Curve 7-10year

Zeitraum/Jahre endend am:		30/06/18	31/12/17	31/12/16
Anteilsklasse R ausschüttend				
Anzahl der Anteile		100,03	100,00	-
Nettoinventarwert pro Anteil	EUR	49,76	49,65	-
Anteilsklasse R thesaurierend				
Anzahl der Anteile		100,00	100,00	-
Nettoinventarwert pro Anteil	EUR	50,02	49,80	-

Amundi S.F. - Euro Curve 10+year

Zeitraum/Jahre endend am:		30/06/18	31/12/17	31/12/16
Nettovermögen	EUR	111.507.919	194.391.092	233.354.033
Anteilsklasse A jährlich ausschüttend				
Anzahl der Anteile		6.530,21	4.954,26	5.713,21
Nettoinventarwert pro Anteil	EUR	93,37	92,34	93,27
Anteilsklasse E quartalsweise ausschüttend mit Zielrendite		467.673,32	702.141,69	1.620.224,32
Anzahl der Anteile	EUR	6,154	6,107	6,297
Nettoinventarwert pro Anteil				
Anteilsklasse E thesaurierend				
Anzahl der Anteile		10.241.679,19	11.834.329,47	18.925.410,26
Nettoinventarwert pro Anteil	EUR	8,822	8,688	8,817
Anteilsklasse F thesaurierend				
Anzahl der Anteile		215.162,85	452.926,35	342.825,55
Nettoinventarwert pro Anteil	EUR	8,229	8,124	8,291
Anteilsklasse H thesaurierend				
Anzahl der Anteile		8.075,32	36.869,30	27.117,83
Nettoinventarwert pro Anteil	EUR	1.966,65	1.931,39	1.950,05
Anteilsklasse I thesaurierend				
Anzahl der Anteile		6,00	6.536,00	11,50
Nettoinventarwert pro Anteil	EUR	1.862,59	1.827,15	1.841,11

Amundi S.F. - Euro Financials Recovery 2018

Zeitraum/Jahre endend am:		30/06/18	31/12/17	31/12/16
Nettovermögen	EUR	-	99.628.986	117.087.679
Anteilsklasse A halbjährlich ausschüttend				
Anzahl der Anteile		-	104.929,94	107.315,22
Nettoinventarwert pro Anteil	EUR	-	56,83	56,73
Anteilsklasse A abgesichert thesaurierend				
Anzahl der Anteile		-	112.879,91	117.871,30
Nettoinventarwert pro Anteil	CZK	-	1.583,93	1.561,32
Anteilsklasse E halbjährlich ausschüttend				
Anzahl der Anteile		-	15.021.989,69	18.170.772,46
Nettoinventarwert pro Anteil	EUR	-	5,769	5,734

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses

Amundi S.F. - Euro Financials Recovery 05/2018

Zeitraum/Jahre endend am:		30/06/18	31/12/17	31/12/16
Nettovermögen	EUR	-	26.381.521	30.448.570
Anteilsklasse A halbjährlich ausschüttend				
Anzahl der Anteile		-	15.950,00	18.750,00
Nettoinventarwert pro Anteil	EUR	-	54,39	54,20
Anteilsklasse E halbjährlich ausschüttend				
Anzahl der Anteile		-	4.664.527,45	5.395.000,46
Nettoinventarwert pro Anteil	EUR	-	5,470	5,455

Amundi S.F. - High Yield & Emerging Markets Bond Opportunities 2021

Zeitraum/Jahre endend am:		30/06/18	31/12/17	31/12/16
Nettovermögen	EUR	49.080.392	51.561.333	75.007.213
Anteilsklasse E jährlich ausschüttend				
Anzahl der Anteile		9.716.387,47	10.242.670,79	13.974.421,49
Nettoinventarwert pro Anteil	EUR	5,051	5,034	5,367

Amundi S.F. - European Equity Market Plus

Zeitraum/Jahre endend am:		30/06/18	31/12/17	31/12/16
Nettovermögen	EUR	229.033.505	262.341.536	278.711.891
Anteilsklasse A thesaurierend				
Anzahl der Anteile		129.777,89	130.892,19	139.736,06
Nettoinventarwert pro Anteil	CHF	130,36	133,13	110,49
Nettoinventarwert pro Anteil	EUR	112,44	113,77	103,07
Anteilsklasse E thesaurierend				
Anzahl der Anteile		12.103.240,72	15.080.773,69	17.021.691,48
Nettoinventarwert pro Anteil	EUR	12,376	12,531	11,369
Anteilsklasse H thesaurierend				
Anzahl der Anteile		28.481,29	25.472,12	34.093,52
Nettoinventarwert pro Anteil	EUR	2.269,96	2.295,16	2.076,11
Anteilsklasse I thesaurierend				
Anzahl der Anteile		5,00	5,00	-
Nettoinventarwert pro Anteil	EUR	1.002,80	1.013,07	-

Amundi S.F. - Pacific (Ex-Japan) Equity Market Plus

Zeitraum/Jahre endend am:		30/06/18	31/12/17	31/12/16
Nettovermögen	EUR	-	60.338.618	94.496.817
Anteilsklasse A thesaurierend				
Anzahl der Anteile		-	29.716,14	32.040,00
Nettoinventarwert pro Anteil	EUR	-	87,86	81,21

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses

Amundi S.F. - Pacific (Ex-Japan) Equity Market Plus

Zeitraum/Jahre endend am:		30/06/18	31/12/17	31/12/16
Anteilsklasse E thesaurierend				
Anzahl der Anteile		-	5.996.204,81	8.605.739,86
Nettoinventarwert pro Anteil	EUR	-	9,198	8,514
Anteilsklasse H thesaurierend				
Anzahl der Anteile		-	1.351,38	10.583,61
Nettoinventarwert pro Anteil	EUR	-	1.906,52	1.759,45

Amundi S.F. - Absolute Return Multi-Strategy Control

Zeitraum/Jahre endend am:		30/06/18	31/12/17	31/12/16
Nettovermögen	EUR	177.867.343	152.496.059	213.535.453
Anteilsklasse A thesaurierend				
Anzahl der Anteile		400,15	577,90	100,00
Nettoinventarwert pro Anteil	EUR	49,62	50,16	49,90
Anteilsklasse E thesaurierend				
Anzahl der Anteile		4.601.685,23	5.380.555,07	3.620.780,10
Nettoinventarwert pro Anteil	EUR	4,959	5,013	4,988
Anteilsklasse H thesaurierend				
Anzahl der Anteile		154.930,02	124.322,00	195.531,00
Nettoinventarwert pro Anteil	EUR	1.000,59	1.009,40	999,69
Anteilsklasse R thesaurierend				
Anzahl der Anteile		100,00	100,00	-
Nettoinventarwert pro Anteil	EUR	49,64	50,10	-

Amundi S.F. - Saving Box I

Zeitraum/Jahre endend am:		30/06/18	31/12/17	31/12/16
Nettovermögen	EUR	115.188.625	148.477.850	280.945.927
Anteilsklasse E thesaurierend				
Anzahl der Anteile		2.829.015,48	3.424.630,17	6.969.771,52
Nettoinventarwert pro Anteil	EUR	5,012	5,056	5,002
Anteilsklasse U thesaurierend				
Anzahl der Anteile		2.019.541,63	2.597.564,58	4.922.326,61
Nettoinventarwert pro Anteil	EUR	50,02	50,49	49,99

Amundi S.F. - Saving Box II

Zeitraum/Jahre endend am:		30/06/18	31/12/17	31/12/16
Nettovermögen	EUR	235.567.239	308.630.761	538.891.771
Anteilsklasse E thesaurierend				
Anzahl der Anteile		8.129.372,54	10.170.066,94	16.743.852,21
Nettoinventarwert pro Anteil	EUR	4,984	5,041	4,993

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses

Amundi S.F. - Saving Box II

Zeitraum/Jahre endend am:		30/06/18	31/12/17	31/12/16
Anteilsklasse U thesaurierend				
Anzahl der Anteile		3.917.115,59	5.108.397,00	9.119.160,62
Nettoinventarwert pro Anteil	EUR	49,79	50,38	49,93

Amundi S.F. - Saving Box III

Zeitraum/Jahre endend am:		30/06/18	31/12/17	31/12/16
Nettovermögen	EUR	92.237.329	112.229.933	162.450.723
Anteilsklasse E thesaurierend				
Anzahl der Anteile		1.520.598,19	1.847.234,13	2.361.401,15
Nettoinventarwert pro Anteil	EUR	4,971	5,029	4,994
Anteilsklasse F thesaurierend				
Anzahl der Anteile		17.048.583,33	20.478.619,61	30.167.436,38
Nettoinventarwert pro Anteil	EUR	4,967	5,027	4,994

Amundi S.F. - Amundi Target Trend 2024

Zeitraum/Jahre endend am:		30/06/18	31/12/17	31/12/16
Nettovermögen	EUR	35.922.960	-	-
Anteilsklasse A jährlich ausschüttend				
Anzahl der Anteile		95.799,00	-	-
Nettoinventarwert pro Anteil	EUR	48,62	-	-
Anteilsklasse W jährlich ausschüttend				
Anzahl der Anteile		643.175,22	-	-
Nettoinventarwert pro Anteil	EUR	48,61	-	-

Amundi S.F. - Equity Plan 60

Zeitraum/Jahre endend am:		30/06/18	31/12/17	31/12/16
Nettovermögen	EUR	143.965.564	195.984.380	330.122.553
Anteilsklasse E thesaurierend				
Anzahl der Anteile		27.186.729,37	36.254.821,67	63.171.430,84
Nettoinventarwert pro Anteil	EUR	5,295	5,406	5,226

Amundi S.F. - Diversified Target Income 11/2021

Zeitraum/Jahre endend am:		30/06/18	31/12/17	31/12/16
Nettovermögen	EUR	45.661.958	49.680.633	54.014.421
Anteilsklasse U jährlich ausschüttend				
Anzahl der Anteile		950.855,80	995.655,16	1.089.017,88
Nettoinventarwert pro Anteil	EUR	48,02	49,90	49,60

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses

Amundi S.F. - Diversified Target Income 11/2022

Zeitraum/Jahre endend am:		30/06/18	31/12/17	31/12/16
Nettovermögen	EUR	51.654.441	54.787.955	55.457.070
Anteilsklasse W jährlich ausschüttend				
Anzahl der Anteile		1.065.312,79	1.087.048,68	1.112.418,66
Nettoinventarwert pro Anteil	EUR	48,49	50,40	49,85

Amundi S.F. - Commodity Alpha ex-Agriculture

Zeitraum/Jahre endend am:		30/06/18	31/12/17	31/12/16
Nettovermögen	EUR	-	32.157.980	26.658.244
Anteilsklasse A jährlich ausschüttend				
Anzahl der Anteile		-	9.421,50	9.546,50
Nettoinventarwert pro Anteil	EUR	-	38,51	39,79
Anteilsklasse A thesaurierend				
Anzahl der Anteile		-	1.573,00	1.179,00
Nettoinventarwert pro Anteil	USD	-	46,28	42,01
Anteilsklasse A abgesichert jährlich ausschüttend				
Anzahl der Anteile		-	24.961,00	7.407,00
Nettoinventarwert pro Anteil	EUR	-	33,67	31,19
Anteilsklasse I abgesichert thesaurierend				
Anzahl der Anteile		-	44.657,29	40.889,00
Nettoinventarwert pro Anteil	EUR	-	691,81	635,88

Amundi S.F. - EUR Commodities

Zeitraum/Jahre endend am:		30/06/18	31/12/17	31/12/16
Nettovermögen	EUR	218.820.630	116.566.924	112.871.933
Anteilsklasse A thesaurierend				
Anzahl der Anteile		1.911.285,33	1.079.220,10	1.523.226,46
Nettoinventarwert pro Anteil	EUR	24,90	25,38	25,75
Anteilsklasse A abgesichert thesaurierend				
Anzahl der Anteile		8.844,26	-	-
Nettoinventarwert pro Anteil	CHF	33,46	-	-
Anteilsklasse A abgesichert thesaurierend				
Anzahl der Anteile		160.459,64	-	-
Nettoinventarwert pro Anteil	USD	33,09	-	-
Anteilsklasse B abgesichert thesaurierend				
Anzahl der Anteile		7.871,91	-	-
Nettoinventarwert pro Anteil	USD	31,88	-	-
Anteilsklasse C thesaurierend				
Anzahl der Anteile		24.888,25	9.266,73	13.107,71
Nettoinventarwert pro Anteil	EUR	14,75	15,11	15,48

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses

Amundi S.F. - EUR Commodities

Zeitraum/Jahre endend am:		30/06/18	31/12/17	31/12/16
Anteilsklasse C absichernd thesaurierend				
Anzahl der Anteile		16.608,53	-	-
Nettoinventarwert pro Anteil	USD	37,72	-	-
Anteilsklasse E thesaurierend				
Anzahl der Anteile		5.888.242,21	3.260.873,29	3.449.403,92
Nettoinventarwert pro Anteil	EUR	2,234	2,277	2,311
Anteilsklasse F thesaurierend				
Anzahl der Anteile		3.625.458,90	2.197.854,60	2.686.630,09
Nettoinventarwert pro Anteil	EUR	2,051	2,099	2,146
Anteilsklasse H jährlich ausschüttend				
Anzahl der Anteile		313,00	313,00	313,00
Nettoinventarwert pro Anteil	EUR	648,93	659,92	666,54
Anteilsklasse H thesaurierend				
Anzahl der Anteile		15.173,59	93.389,98	76.149,16
Nettoinventarwert pro Anteil	EUR	470,32	478,24	483,04
Anteilsklasse H abgesichert thesaurierend				
Anzahl der Anteile		7.784,35	-	-
Nettoinventarwert pro Anteil	USD	983,52	-	-
Anteilsklasse I jährlich ausschüttend				
Anzahl der Anteile		5.270,00	-	-
Nettoinventarwert pro Anteil	EUR	449,41	-	-
Anteilsklasse I thesaurierend				
Anzahl der Anteile		235.565,85	39.816,05	22.217,33
Nettoinventarwert pro Anteil	EUR	480,62	488,31	492,27
Anteilsklasse I abgesichert thesaurierend				
Anzahl der Anteile		23.230,77	20.412,91	16.839,58
Nettoinventarwert pro Anteil	USD	743,76	746,01	738,10
Anteilsklasse R thesaurierend				
Anzahl der Anteile		4.254,23	100,00	-
Nettoinventarwert pro Anteil	EUR	50,05	50,90	-
Anteilsklasse R abgesichert thesaurierend				
Anzahl der Anteile		5.917,31	-	-
Nettoinventarwert pro Anteil	USD	43,76	-	-

Amundi S.F. - SMBC Amundi Protect Fund USD Step 201803

Zeitraum/Jahre endend am:		30/06/18	31/12/17	31/12/16
Nettovermögen	USD	514.584.640	-	-
Anteilsklasse W1 thesaurierend				
Anzahl der Anteile		5.167.760,00	-	-
Nettoinventarwert pro Anteil	USD	99,58	-	-

Die beigefügten Anmerkungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses

1 EINFÜHRUNG

Amundi S.F. (vormals: Pioneer S.F.) (der „Fonds“) ist als *Fonds Commun de Placement* (FCP) mit mehreren einzelnen Teilfonds (einzeln „der Teilfonds“ und gemeinsam „die Teilfonds“ genannt) aufgebaut. Der Fonds wurde am 6. Juni 2003 als Organismus für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren („OGAW“) gegründet und erfüllt die Voraussetzungen gemäß Teil I des geänderten luxemburgischen Gesetzes vom 17. Dezember 2010 zu Organismen für gemeinsame Anlagen. Er unterliegt dem am Jahresende in Kraft getretenen und zuletzt am 29. Juni 2018 aktualisierten und am 16. Juli 2018 auf der Plattform Recueil Electronique des Sociétés et Associations („RESA“) veröffentlichten Verwaltungsreglement.

Die SICAV wird von Amundi Luxembourg S.A. (die „Verwaltungsgesellschaft“) verwaltet, einer Gesellschaft, die als Aktiengesellschaft („société anonyme“) im Sinne von Paragraph 15 des Gesetzes vom 17. Dezember 2010 in seiner geänderten Fassung gegründet wurde und eine hundertprozentige Tochtergesellschaft der Amundi Asset Management S.A.S. ist; sie ist im Luxemburger Handels- und Firmenregister unter der Nummer B 57.255 eingetragen und hat ihren Geschäftssitz in Luxemburg. Sie wurde am 20. Dezember 1996 auf unbestimmte Dauer gegründet. Ihre Satzung wurde am 28. Januar 1997 im Mémorial veröffentlicht und zuletzt am 1. Januar 2018 geändert.

Die Vermögenswerte der einzelnen Teilfonds werden jeweils separat entsprechend ihrer Anlagepolitik und Anlageziele angelegt. Alle Teilfonds lauten auf EUR oder USD (die „Basiswährung“), und alle Aktiva und Passiva des jeweiligen Teilfonds werden in der Basiswährung dieses Teilfonds bewertet.
Die Anteilsinhaber sind berechtigt, in Euro, US-Dollar und in Schweizer Franken sowie auf Beschluss des Verwaltungsrats der Verwaltungsgesellschaft in jeder anderen frei konvertierbaren Währung zu zeichnen. Der Nettoinventarwert (der „NIW“) pro Anteil in einer anderen Währung als dem Euro ergibt sich aus der täglichen Umrechnung des NIW je Anteil in Euro.

Mit dem 1. Januar 2018 wurde die Pioneer Asset Management S.A. („PAMSA“) in Amundi Luxembourg S.A. umbenannt.

Pioneer S.F. wurde am 16. Februar 2018 in Amundi S.F. umbenannt.

Die „Klasse N“ wurde am 17. Februar 2018 in „Klasse R“ umbenannt.

Die folgenden Teilfonds wurden aufgelöst:

Pioneer S.F. - Ethical Euro Corporate Bond am 8. Februar 2018;
Amundi S.F. - Commodity Alpha ex-Agriculture am 2. März 2018;
Amundi S.F. - Pacific (Ex-Japan) Equity Market Plus am 2. März 2018;
Amundi S.F. - Euro Financials Recovery 2018 am 22. März 2018;
Amundi S.F. - Euro Financials Recovery 05/2018 am 14. Mai 2018.

Die folgenden Teilfonds wurden aufgelegt:

Amundi S.F. - Amundi Target Trend 2024 am 16. Januar 2018;
Amundi S.F. - SMBC Amundi Protect Fund USD Step 201803 am 12. April 2018.

Veränderung der Risikoparameter Referenzportfolio:

	Alt	Neu	Inkrafttreten
Amundi S.F. - Equity Plan 60	60% MSCI World Index	60% MSCI World Index	01.01.2018
	40% Barclays Euro-Aggregate 1-3 Yrs Index	40% Barclays Euro-Aggregate Index	01.01.2018

Mit Stand vom 30. Juni 2018 waren die folgenden 20 Teilfonds aktiv:

Anleihen-Teilfonds
Amundi S.F. - Diversified Short-Term Bond
Amundi S.F. - Diversified Subordinated Bond 2018
Amundi S.F. - Emerging Markets Bond 2019
Amundi S.F. - Euro Curve 1-3year
Amundi S.F. - Euro Curve 3-5year
Amundi S.F. - Euro Curve 5-7year
Amundi S.F. - Euro Curve 7-10year
Amundi S.F. - Euro Curve 10+year
Amundi S.F. - High Yield & Emerging Markets Bond Opportunities 2021

Teilfonds auf Aktien
Amundi S.F. - European Equity Market Plus

Absolute Return-Teilfonds
Amundi S.F. - Absolute Return Multi-Strategy Control
Amundi S.F. - Saving Box I
Amundi S.F. - Saving Box II
Amundi S.F. - Saving Box III

Multi Asset-Teilfonds
Amundi S.F. - Amundi Target Trend 2024 (aufgelegt am 16. Januar 2018)
Amundi S.F. - Equity Plan 60
Amundi S.F. - Diversified Target Income 11/2021
Amundi S.F. - Diversified Target Income 11/2022

Commodities-Teilfonds
Amundi S.F. - EUR Commodities

Capital Guaranteed-Teilfonds
Amundi S.F. - SMBC Amundi Protect Fund USD Step 201803 (aufgelegt am 12. April 2018)

Die Anteilsklassen, die zum 30. Juni 2018 aktiv waren, sind in den „Statistischen Angaben zu den Investmentanteilen“ aufgeführt. Eine detaillierte Beschreibung der Anteilsklassen findet sich im aktuellen Verkaufsprospekt.

2 WESENTLICHE RECHNUNGSLEGUNGSGRUNDSÄTZE

- **VORLAGE DES JAHRESABSCHLUSSES**

Dieser Jahresabschluss wurde in Übereinstimmung mit den in Luxemburg geltenden gesetzlichen und regulatorischen Anforderungen in Bezug auf Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren sowie allgemein anerkannten Grundsätzen der Rechnungslegung erstellt.
Der Jahresbericht gibt den Nettoinventarwert („NIW"), der am 30. Juni 2018 auf der Grundlage der letztverfügbaren Marktkurse der Anlagen berechnet wurde, wieder.

Bewertung der Anlagen und anderer Anlagen
Es gilt die folgende Preispolitik:

- **Bewertung der Anlagen** - Anlagen, die an einer Börse oder an einem geregelten Markt notiert oder gehandelt werden, werden mit ihrem letzten Kurs bewertet, der um 18:00 Uhr Luxemburger Zeit am jeweiligen Bewertungstag verfügbar ist; dies gilt nicht für den Teilfonds Amundi S.F.- Equity Plan 60, bei dem die Anlagen zum letzten verfügbaren Kurs um 22:00 Uhr Ortszeit Luxemburg bewertet werden.
  Falls einzelne der in dem Portfolio eines Teilfonds gehaltenen Vermögenswerte an dem betreffenden Tag nicht an einer Börse, einem geregelten Markt oder einem anderen geregelten Markt notiert oder gehandelt werden, oder wenn in Bezug auf börsennotierte oder -gehandelte oder an einem solchen Markt gehandelte Vermögenswerte der gemäß dem vorangegangenen Absatz bestimmte zuletzt verfügbare Kurs nicht dem fairen Marktwert der betreffenden Vermögenswerte entspricht, wird der Wert dieser Vermögenswerte vom Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft sorgfältig nach Treu und Glauben auf Basis des angemessen vorhersehbaren Verkaufspreises bestimmt.
- **Offene und geschlossene OGA** - Anteile von offenen OGA werden zu ihrem zuletzt ermittelten und verfügbaren Nettoinventarwert bewertet; sollte ein solcher Preis nicht repräsentativ für den fairen Marktwert dieser Vermögenswerte sein, so wird der Preis umsichtig und in Treu und Glauben durch den Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft bestimmt. Anteile von geschlossenen OGA werden zu ihrem zuletzt erhältlichen Marktwert bewertet.
- **Devisenterminkontrakte** – Der Wert von Devisenterminkontrakten wird nach dem am Datum der „Aufstellung des Nettovermögens" für den Zeitraum bis zu ihrer jeweiligen Fälligkeit gültigen Terminkurs ermittelt. Netto nicht realisierte Gewinne und Verluste aus Devisentermingeschäften werden in der „Aufstellung des Nettovermögens" erfasst. Der Fonds bietet auch abgesicherte Anteilsklassen an. Alle Gewinne.(Verluste) aus Devisenterminkontrakten, die für abgesicherte Anteilsklassen eingesetzt werden, werden ausschließlich der betreffenden Anteilsklasse zugeteilt.
- **Finanzterminkontrakte** – Der Wert von Finanzterminkontrakten wird auf Grundlage des jeweiligen Börsenwerts (gemäß der oben unter „Bewertung der Anlagen" genannten Preispolitik) ermittelt. Die Einschusszahlungen werden jeweils bei Abschluss des Terminkontraktes aus Barmitteln vorgenommen. Folgezahlungen, die als Nachschusszahlungen bezeichnet werden, werden von dem Teilfonds periodisch geleistet oder empfangen und basieren auf den Veränderungen der Marktwerte von offenen Terminkontrakten. Netto nicht realisierte Gewinne und Verluste aus Finanzterminkontrakten werden in der „Aufstellung des Nettovermögens" erfasst. Bei Ablauf des Kontraktes weist der betreffende Teilfonds die Differenz zwischen dem Erlös (bzw. den Kosten) des Glattstellungsgeschäftes und des Eröffnungsgeschäftes als realisierten Gewinn oder Verlust aus.
- **Optionskontrakte mit Abschlussprämien** – Erwirbt der Teilfonds einen Optionskontrakt mit einer Abschlussprämie, entrichtet er die Prämie und verbucht einen Betrag in Höhe der Prämie als Vermögenswert. Verkauft der Teilfonds eine Option mit einer Abschlussprämie, erhält er die Prämie und verbucht einen Betrag in Höhe der Prämie als Verbindlichkeit.
  Der Vermögenswert oder die Verbindlichkeit wird täglich angepasst, um den aktuellen Marktwert der Optionskontrakte widerzuspiegeln.
  Optionskontrakte, die an einer amtlichen Börse oder an einem geregelten Markt oder an einem anderen geregelten Markt notiert oder gehandelt werden, werden mit ihrem Börsenkurs bewertet (gemäß der oben unter „Bewertung der Anlagen" genannte Preispolitik). Die auf Marktkursen beruhenden OTC-Optionen werden täglich von Dritten berechnet und mit dem vom Kontrahenten empfangenen Wert abgeglichen.
  Wenn die letzten bekannten Kurse nicht repräsentativ sind, erfolgt die Bewertung auf der Basis eines potenziellen Veräußerungswertes, der vom Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft mit Umsicht und in gutem Glauben geschätzt wird.
  Verfällt eine Option, ohne ausgeübt worden zu sein, so realisiert der Teilfonds einen Gewinn oder einen Verlust in Höhe der erhaltenen bzw. gezahlten Optionsprämie. Erhaltene oder gezahlte Prämien und netto nicht realisierte Gewinne und Verluste aus Optionsgeschäften werden in der „Aufstellung des Nettovermögens" unter den Positionen „Gekaufte Optionskontrakte mit Abschlussprämie zum Marktwert" oder „Verkaufte Optionskontrakte mit Abschlussprämie zum Marktwert" erfasst.
- **Futures-Style-Optionskontrakte** – Futures-Style-Optionskontrakte werden mit dem an einer amtlichen Börse ermittelten Kurs bewertet (gemäß der oben unter „Bewertung der Anlagen" genannten Preispolitik). Die Einschusszahlungen werden jeweils bei Abschluss des Terminkontraktes aus Barmitteln vorgenommen. Spätere positive oder negative Cashflows, die auch als Nachschüsse bezeichnet werden, werden von dem Teilfonds periodisch geleistet oder empfangen und basieren auf den Veränderungen des Marktwertes offener Optionskontrakte. Bei Ablauf des Kontraktes weist der betreffende Teilfonds die Differenz zwischen dem Erlös (bzw. den Kosten) des Glattstellungsgeschäftes und des Eröffnungsgeschäftes als realisierten Gewinn oder Verlust aus.
  Netto nicht realisierte Gewinne und Verluste aus Geschäften mit Futures-Style Optionskontrakten werden in der „Aufstellung des Nettovermögens" erfasst.
- **Swapkontrakte** –Teilfonds können verschiedene Typen von Swapkontrakten eingehen, wie Zinsswaps, Swaptions, inflationsgebundene Swaps, Credit Default Swaps und Total Return Swaps. Netto nicht realisierte Gewinne und Verluste aus Swapkontrakten werden in der „Aufstellung des Nettovermögens" erfasst. Swapkontrakte werden zu ihrem angemessenen Marktwert, der umsichtig und nach Treu und Glauben gemäß der vom Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft festgelegten Verfahrensweise bestimmt wird, bewertet.
  Swapkontrakte sind zum Zeitpunkt der Berechnung des Nettoinventarwerts zum Marktkurs zu bewerten. Der Marktwert beruht auf der Bewertung von Kaufpreiselementen, die im Vertrag festgelegt sind, und wird von Dritten, Market Makern oder aus internen Modellen gemäß einem vom Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft festgelegten Verfahren ermittelt.
- **Zusammengefasster Jahresabschluss** – Die Zahlen der einzelnen Teilfonds sind in der jeweiligen Basiswährung angegeben. Der zusammengefasste Jahresabschluss wird in Euro dargestellt, und die Summe der Nettovermögen der Teilfonds in anderen Währungen wird zu den am Ende des Berichtszeitraums geltenden Wechselkursen in Euro umgerechnet. Der zusammengefasste Jahresabschluss dient lediglich der Information.
  Zum Jahresende lag der Gesamtbetrag der von einem Teilfonds in einen anderen Teilfonds desselben Dachfonds getätigten Investitionen bei 83.710.430,95 EUR, was einem Anteil von 1,64 % des kombinierten Nettovermögens entspricht. Damit belief sich das kombinierte Nettovermögen ohne Kreuzinvestitionen der Teilfonds auf 5.019.326.541,05 EUR.
- **Wertpapierleihe -** Teilfonds können Wertpapiere ihres Portfolios an Entleiher verleihen. Um diese Transaktion abzusichern, erhält der Teilfonds Sicherheiten. Verliehene Wertpapiere werden an den Broker einer dritten Partei geliefert, allerdings werden diese Vermögensgegenstände weiterhin als Bestandteile des Portfolios des Teilfonds bewertet. Endet ein Wertpapierleihvertrag, ist der Teilfonds verpflichtet, dem Entleiher die erhaltenen Sicherheiten zurückzugeben. Die Wertpapierleihe kann von den Parteien jederzeit gekündigt werden. Die Wertpapierleihe generiert entsprechend den vertraglichen Vereinbarungen zusätzliche Erträge für den Teilfonds.

3 WECHSELKURSE PER 30. JUNI 2018

Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, die auf eine andere Währung als die Basiswährung des jeweiligen Teilfonds lauten, werden zum Wechselkurs vom 30. Juni 2018 umgerechnet. In Fremdwährungen getätigte Transaktionen werden zum am jeweiligen Transaktionszeitpunkt geltenden Wechselkurs in die Basiswährung des betreffenden Teilfonds umgerechnet.

Per 30. Juni 2018 wurden die folgenden Wechselkurse verwendet:

1 EUR =		1 EUR =	
33,68380	ARS	1.301,23450	KRW
1,58020	AUD	22,94905	MXN
4,49205	BRL	4,71635	MYR
1,53585	CAD	9,51600	NOK
1,15935	CHF	1,72445	NZD
760,12760	CLP	3,82315	PEN
7,73830	CNH	62,30925	PHP
7,73540	CNY	4,37125	PLN
3.429,08295	COP	4,66365	RON
26,01500	CZK	73,20830	RUB
1,95583	DEM	4,37870	SAR
7,45070	DKK	10,44490	SEK
0,88435	GBP	1,59195	SGD
9,15995	HKD	38,68095	THB
329,12500	HUF	5,34875	TRY
16.730,99225	IDR	35,59685	TWD
4,27390	ILS	1,16755	USD
79,99470	INR	16,00270	ZAR
129,32370	JPY		

4 VERWALTUNGS, ANLAGEVERWALTUNGS- UND VERTRIEBSGEBÜHREN

Die Verwaltungsgebühr errechnet sich als Prozentsatz vom Nettoinventarwert des jeweiligen Teilfonds und beträgt, wie im Verkaufsprospekt dargestellt, je nach Teilfonds und Anteilsklasse zwischen 0,25 % und 2,25 % p.a.
Für Klasse X-Einheiten werden die Verwaltungsgebühren direkt von dem Anteilseigner durch die Verwaltungsgesellschaft erhoben und eingefordert und werden nicht dem Teilfonds in Rechnung gestellt oder im Nettovermögen aufgeführt.

Mit Stand vom 30. Juni 2018 gelten die folgenden Verwaltungsgebührensätze:

Teilfonds	Klasse A	Klasse B	Klasse C	Klasse E	Klasse F	Klasse H	Klasse I	Klasse R	Klasse U	Klasse W
Amundi S.F. - Diversified Short-Term Bond	0,60%	*	*	0,60%	*	0,35%	0,30%	*	*	*
Amundi S.F. - Diversified Subordinated Bond 2018	*	*	*	0,80%	*	*	*	*	*	*
Amundi S.F. - Emerging Markets Bond 2019	1,00%	*	*	1,00%	*	*	*	*	*	*
Amundi S.F. - Euro Curve 1-3year	0,60%	*	*	0,75%	1,10%	0,45%	0,25%	0,30%	*	*
Amundi S.F. - Euro Curve 3-5year	0,60%	*	*	1,05%	1,60%	0,55%	0,40%	0,40%	*	*
Amundi S.F. - Euro Curve 5-7year		*	*	1,05%	*	0,55%	*	*	*	*
Amundi S.F. - Euro Curve 7-10year	0,60%	*	0,90%	1,05%	1,60%	0,55%	0,40%	0,40%	*	*
Amundi S.F. - Euro Curve 10+year	0,60%	*	*	1,05%	1,60%	0,55%	0,40%	*	*	*
Amundi S.F. - High Yield & Emerging Markets Bond Opportunities 2021		*	*	1,00%	*	*	*	*	*	*
Amundi S.F. - European Equity Market Plus	0,50%	*	*	0,65%	*	0,35%	0,25%	*	*	*
Amundi S.F. - Absolute Return Multi-Strategy Control	0,90%	*	*	0,90%	*	0,50%	*	0,60%	*	*
Amundi S.F. - Saving Box I	*	*	*	0,50%	*	*	*	*	0,60%	*
Amundi S.F. - Saving Box II	*	*	*	0,45%	*	*	*	*	0,50%	*
Amundi S.F. - Saving Box III	*	*	*	0,45%	0,50%	*	*	*	*	*
Amundi S.F. - Amundi Target Trend 2024	1,00%	*	*	*	*	*	*	*	*	1,00%
Amundi S.F. - Equity Plan 60	*	*	*	1,70%	*	*	*	*	*	*
Amundi S.F. - Diversified target Income 11/2021	*	*	*	*	*	*	*	*	1,00%	*
Amundi S.F. - Diversified target Income 11/2022	*	*	*	*	*	*	*	*	*	1,00%
Amundi S.F. - EUR Commodities	1,00%	1,00%	1,00%	1,00%	1,75%	0,55%	0,40%	0,55%	*	*
Amundi S.F. - SMBC Amundi Protect Fund USD Step 201803	*	*	*	*	*	*	*	*	*	0,26%

* Nicht aufgelegt und/oder nicht zutreffend

Die Vertriebsgebühr ist, sofern sie erhoben wird, ein Prozentsatz des Nettoinventarwerts eines Teilfonds und beträgt, wie im Prospekt dargelegt, je nach Anteilsklasse zwischen 0,00 % und 1,50 % p.a.

Mit Stand vom 30. Juni 2018 gelten effektiv die folgenden Vertriebsgebührensätze:

Teilfonds	Klasse A	Klasse B	Klasse C	Klasse E	Klasse F	Klasse H	Klasse I	Klasse R	Klasse U	Klasse W
Amundi S.F. - Diversified Short-Term Bond	0,00%	*	*	0,00%	*	0,00%	0,00%	*	*	*
Amundi S.F. - Diversified Subordinated Bond 2018	*	*	*	0,00%	*	*	*	*	*	*
Amundi S.F. - Emerging Markets Bond 2019	0,00%	*	*	0,00%	*	*	*	*	*	*
Amundi S.F. - Euro Curve 1-3year	0,00%	*	*	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	*	*
Amundi S.F. - Euro Curve 3-5year	0,00%	*	*	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	*	*
Amundi S.F. - Euro Curve 5-7year	*	*	*	0,00%	*	0,00%	*	*	*	*
Amundi S.F. - Euro Curve 7-10year	0,00%	*	1,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	*	*
Amundi S.F. - Euro Curve 10+year	0,00%	*	*	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	*	*	*
Amundi S.F. - High Yield & Emerging Markets Bond Opportunities 2021	*	*	*	0,00%	*	*	*	*	*	*
Amundi S.F. - European Equity Market Plus	0,00%	*	*	0,00%	*	0,00%	0,00%	*	*	*
Amundi S.F. - Absolute Return Multi-Strategy Control	0,00%	*	*	0,00%	*	0,00%	*	0,00%	*	*
Amundi S.F. - Saving Box I	*	*	*	0,00%	*	*	*	*	0,00%	*
Amundi S.F. - Saving Box II	*	*	*	0,00%	*	*	*	*	0,00%	*
Amundi S.F. - Saving Box III	*	*	*	0,00%	0,00%	*	*	*	*	*
Amundi S.F. - Amundi Target Trend 2024	0,00%	*	*	*	*	*	*	*	*	0,00%
Amundi S.F. - Equity Plan 60	*	*	*	0,00%	*	*	*	*	*	*
Amundi S.F. - Diversified target Income 11/2021	*	*	*	*	*	*	*	*	0,00%	*
Amundi S.F. - Diversified target Income 11/2022	*	*	*	*	*	*	*	*	*	0,00%
Amundi S.F. - EUR Commodities	0,00%	1,50%	1,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	*	*
Amundi S.F. - SMBC Amundi Protect Fund USD Step 201803	*	*	*	*	*	*	*	*	*	0,75%

* Nicht aufgelegt und/oder nicht zutreffend

Sowohl die Verwaltungsgebühr als auch die Vertriebsgebühr werden an jedem Bewertungstag auf Basis des Nettoinventarwerts des Teilfonds und der Anteilsklasse berechnet und monatlich rückwirkend gezahlt.
Die Investmentmanager werden von der Verwaltungsgesellschaft aus der ihr nach dem Verwaltungsreglement des Fonds zu zahlenden Verwaltungsgebühr bezahlt. Wenn in einem Leistungszeitraum der Nettoinventarwert je Anteilsklasse die Benchmark oder Erfolgshürde übertrifft, kann der Verwaltungsgesellschaft für bestimmte Anteilsklassen innerhalb bestimmter Teilfonds, wie im Prospekt aufgeführt, eine Erfolgsgebühr zustehen.
Der Leistungszeitraum entspricht dem Kalenderjahr außer bei den Teilfonds Euro Financials Recovery 2018, Euro Financials Recovery 05/2018, Diversified Subordinated Bond 2018, Emerging Markets Bond 2019, Saving Box I, Saving Box II, Saving Box III und High Yield & Emerging Markets Bond Opportunities 2021, bei denen der Leistungszeitraum jeweils mit dem Auflagedatum beginnt und mit dem Datum der Fälligkeit endet.
Die Erfolgsgebühr beträgt höchstens 20 % (falls anwendbar und je nach Anteilsklasse) und wird unter Bezugnahme auf die über den Anstieg der Benchmark oder die Erfolgsschwelle hinausgehende Vermögenszunahme der Anteilsklasse, berichtigt um Zeichnungen und Rücknahmen von Anteilen der betreffenden Anteilsklassen während des Leistungszeitraums, berechnet. Die Berechnung wird wie folgt vorgenommen:
1) Sind Benchmark oder Leistungsrendite positiv, so erhält die Verwaltungsgesellschaft eine Erfolgsgebühr in Höhe des in Anhang I des aktuellen Prospekts angegebenen Prozentsatzes der Outperformance, um die die betreffenden Anteilsklassen ihre jeweilige Benchmark im Leistungszeitraum übertroffen haben, gegebenenfalls unter Beachtung des (nachstehend definierten) High-Watermark-Prinzips.
2) Sind Benchmark oder Erfolgsschwelle des Teilfonds im Leistungszeitraum zurückgegangen, so erhält die Verwaltungsgesellschaft eine Erfolgsgebühr in Höhe des in Anhang I des Prospekts angegebenen Prozentsatzes der Wertsteigerung, die die betreffenden Anteilsklassen erreicht haben, gegebenenfalls unter Beachtung des High-Watermark-Prinzips.
3) Übersteigt die Wertentwicklung einer Klasse den High-Watermark und die Bewertungs- oder Erfolgsschwelle, ist aber die Überperformance gegenüber dem High Watermark niedriger als die Überperformance gegenüber der Bewertungs- oder Erfolgsschwelle, wird die Erfolgsgebühr unter Bezugnahme auf die den High-Watermark berechnet, und nicht gemäß der Bewertungs- oder Erfolgsschwelle.
Wie im Verkaufsprospekt definiert, legt das High-Watermark-Prinzip einen Nettoinventarwert pro Anteil fest, unter dem keine Erfolgsgebühren gezahlt werden.
Er wird auf den Nettoinventarwert je Anteil der betreffenden Klasse festgelegt, bei dem die letzte Erfolgsgebühr gezahlt wurde, oder auf den Nettoinventarwert je Anteil, mit dem die Klasse aufgelegt wurde, wenn für diese Klasse noch keine Erfolgsgebühr gezahlt wurde, oder auf den Nettoinventarwert je Anteil der Klasse an dem Geschäftstag, der dem Datum der Einführung der Erfolgsgebühr für diese Klasse unmittelbar vorausgeht, wenn für diese Klasse erstmals eine Erfolgsgebühr eingeführt wird.
Die Benchmarks oder Erfolgsschwellen werden einschließlich Verwaltungsgebühren und anderer Gebühren und Aufschläge auf der Grundlage eines Gesamtertragsindex berechnet, wenn nichts anderes angegeben ist. Bezüglich der Anteile der Klasse F (ausgenommen Renten-Teilfonds) erfolgt die Berechnung der Wertentwicklung auf Basis eines „Kursindex“, d. h. die Berechnung der Wertentwicklung der Bewertungs- oder Erfolgsschwelle erfolgt gekürzt, ohne Dividenden.
Für Anteile der Klasse X werden die Erfolgsgebühren, falls vorhanden, von der Verwaltungsgesellschaft berechnet und direkt bei den Anteilsinhabern erhoben und fließen daher nicht in den Nettoinventarwert ein.

5 DEPOTBANK UND ZAHLSTELLE, ADMINISTRATOR, REGISTERSTELLE UND TRANSFERAGENT

Die Depotbank und Zahlstelle, der Administrator und die als Registerstelle und Transferagent fungierende Stelle erhalten aus dem Vermögen des jeweiligen Teilfonds für ihre Dienstleistungen die nachfolgend angegebenen Gebühren.

- **Depotbank und Zahlstelle:** Die Gebühr ist ein Prozentsatz des Portfoliowerts jedes Teilfonds an jedem Monatsende. Sie beträgt je nach Verwahrort der Vermögenswerte des betreffenden Teilfonds zwischen 0,003 % und 0,50 % p.a. Die Gebühr wird an jedem Bewertungstag berechnet und abgegrenzt und ist monatlich nachträglich zu zahlen.
- **Administrator:** Die Gebühr für die wichtigsten Dienste beträgt jährlich 0,01 % und wird an jedem Bewertungstag auf Basis des Nettoinventarwerts des jeweiligen Teilfonds berechnet und abgegrenzt. Sie ist monatlich nachträglich zu zahlen.
- **Registerstelle und Transferagent:** Die Hauptkomponenten der Vergütung für die Dienstleistungen sind die Anzahl der aktiven Anteilsklassen, die Anzahl der Kundenkonten und die Anzahl der durchgeführten Transaktionen.

6 BESTEUERUNG DES FONDS - ZEICHNUNGSSTEUER

Im Einklang mit geltendem Luxemburger Recht unterliegt der Fonds keiner Besteuerung auf Einkommen oder Kapitalertrag. Der Fonds unterliegt einer Zeichnungssteuer („*taxe d'abonnement*"), die basierend auf dem Nettoinventarwert jedes Teilfonds zum Ende eines jeden Kalenderquartals einer jährlichen Steuerrate von 0,05 % entspricht, die pro Quartal berechnet und bezahlt wird. Diese Steuer beträgt jedoch lediglich 0,01 % für den Nettoinventarwert in Bezug auf Anteilsklassen, die zeichnungsberechtigten institutionellen Anlegern vorbehalten sind, und für Teilfonds, deren ausschließliches Ziel in der gemeinsamen Anlage in Geldmarktinstrumenten und Einlagen bei Kreditinstituten besteht.
Gemäß Artikel 175 (a) des geänderten Gesetzes vom 17. Dezember 2010 ist das in OGA investierte Nettovermögen, das bereits der *Taxe d'abonnement* unterliegt, von dieser Steuer ausgenommen. Zins- und Dividendenerträge des Fonds können im Ursprungsland einer nicht erstattungsfähigen Quellensteuer unterliegen.

Rückforderung von Quellensteuern
Im Berichtszeitraum wurden in bestimmten europäischen Ländern Anträge auf die Rückerstattung von Quellensteuern gestellt, die auf Dividenden erhoben wurden, die in den letzten Jahren gezahlt wurden.
Die Entscheidung, einen Antrag zu stellen, wird vom Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft getroffen, der ihr eine Analyse der anfallenden Kosten und der maximal zu erwartenden Rückzahlungen zugrunde legt. Die Kosten der Geltendmachung von Rückzahlungen werden ausschließlich von den Teilfonds getragen, denen die potenziellen Rückzahlungen zustehen.
Es ist gegenwärtig nicht möglich, die Erfolgsaussichten bei solchen Rückforderungen einzuschätzen. Daher wurden im Abschluss keine Forderungen im Zusammenhang mit den möglicherweise zurückerstatteten Beträgen verbucht. Erträge aus diesen Rückforderungen werden als Nettoinventarwerte des entsprechenden Teilfonds gebucht.

7 OFFENE POSITIONEN BEI TERMINKONTRAKTEN

Mit Stand vom 30. Juni 2018 hatten bestimmte Teilfonds folgende Positionen bei Terminkontrakten:

Amundi S.F. - Diversified Short-Term Bond

Anzahl Verträge Kauf/Verkauf	Beschreibung	Fälligkeit	Währung	Nicht realisierter Gewinn/Verlust in EUR
-134	EURO BUND	09-2018	EUR	-168.840,00
-68	EURO SCHATZ	09-2018	EUR	-6.980,00
-151	LONG GILT	09-2018	GBP	-203.188,78
-41	US 2 YR NOTE FUTURE	09-2018	USD	2.194,77
29	US 5 YR NOTE FUTURE	09-2018	USD	3.492,77
-180	USD IRS SWAP 5YR	09-2018	USD	-59.018,20
-6	USD IRS 10YR PRIM	09-2018	USD	-4.898,10
-3.690	2YR EUR SWAPNOTE	09-2018	EUR	-551.730,00
-3.168	5YR EUR SWAPNOTE	09-2018	EUR	-2.590.250,00
			Summe:	**-3.579.217,54**

Amundi S.F. - Euro Curve 1-3year

Anzahl Verträge Kauf/Verkauf	Beschreibung	Fälligkeit	Währung	Nicht realisierter Gewinn/Verlust in EUR
-109	EURO BOBL	09-2018	EUR	-94.390,00
34	EURO BUND	09-2018	EUR	12.580,00
29	EURO BUXL	09-2018	EUR	94.860,00
328	EURO SCHATZ	09-2018	EUR	26.240,00
-72	EURO-OAT FUTURES	09-2018	EUR	-39.210,00
			Summe:	**80,00**

Amundi S.F. - Euro Curve 3-5year

Anzahl Verträge Kauf/Verkauf	Beschreibung	Fälligkeit	Währung	Nicht realisierter Gewinn/Verlust in EUR
-3	EURO BOBL	09-2018	EUR	-2.520,00
11	EURO BUND	09-2018	EUR	4.070,00
10	EURO BUXL	09-2018	EUR	32.000,00
-25	EURO-OAT FUTURES	09-2018	EUR	-13.610,00
			Summe:	**19.940,00**

Amundi S.F. - Euro Curve 5-7year

Anzahl Verträge Kauf/Verkauf	Beschreibung	Fälligkeit	Währung	Nicht realisierter Gewinn/Verlust in EUR
2	EURO BOBL	09-2018	EUR	1.190,00
			Summe:	**1.190,00**

Amundi S.F. - Euro Curve 7-10year

Anzahl Verträge Kauf/Verkauf	Beschreibung	Fälligkeit	Währung	Nicht realisierter Gewinn/Verlust in EUR
-24	EURO BOBL	09-2018	EUR	-20.430,00
95	EURO BUND	09-2018	EUR	110.710,00
7	EURO BUXL	09-2018	EUR	22.500,00
-16	EURO-OAT FUTURES	09-2018	EUR	-8.720,00
			Summe:	**104.060,00**

Amundi S.F. - Euro Curve 10+year

Anzahl Verträge Kauf/Verkauf	Beschreibung	Fälligkeit	Währung	Nicht realisierter Gewinn/Verlust in EUR
-24	EURO BOBL	09-2018	EUR	-19.930,00
5	EURO BUND	09-2018	EUR	1.850,00
42	EURO BUXL	09-2018	EUR	120.760,00
-11	EURO-OAT FUTURES	09-2018	EUR	-5.990,00
			Summe:	**96.690,00**

Amundi S.F. - European Equity Market Plus

Anzahl Verträge Kauf/Verkauf	Beschreibung	Fälligkeit	Währung	Nicht realisierter Gewinn/Verlust in EUR
92	EURO STOXX 50	09-2018	EUR	24.840,00
37	FTSE 100 INDEX	09-2018	GBP	55.877,20
17	SWISS MKT INDEX	09-2018	CHF	20.528,74
			Summe:	**101.245,94**

Amundi S.F. - Absolute Return Multi-Strategy Control

Anzahl Verträge Kauf/Verkauf	Beschreibung	Fälligkeit	Währung	Nicht realisierter Gewinn/Verlust in EUR
-7	AMSTERDAM INDEX	07-2018	EUR	15.610,00
21	AUST 3YR BOND FUT	09-2018	AUD	5.732,81
7	CAC 40	07-2018	EUR	-1.073,30
-26	CAN 10YR BOND FUT	09-2018	CAD	-26.370,80
-33	DJ STOXX 600 AUTO .	09-2018	EUR	85.221,35
-20	DJ STOXX 600 TELECOM	09-2018	EUR	6.300,00
1	DOW JONES MINI	09-2018	USD	-3.871,35
5	E-MINI CONSUM DISC S	09-2018	USD	-2.612,31
4	EMINI RUSS 1000 VALU	09-2018	USD	-3.391,72
-4	EMINI RUSSELL 1000	09-2018	USD	4.984,80
5	EMINI RUSSELL 2000	09-2018	USD	-5.941,93
-17	EMINI S&P REESTATE	09-2018	USD	-15.288,42
-3	E-MINI XAI INDUSTRIA	09-2018	USD	10.727,59
-4	E-MINI XAK TECHNO	09-2018	USD	4.996,53
5	E-MINI XAU UTILITIES	09-2018	USD	17.129,89
-50	EURO BOBL	09-2018	EUR	-31.500,00
13	EURO BUND	09-2018	EUR	20.670,00
-8	EURO BUXL	09-2018	EUR	-23.840,00
-81	EURO SCHATZ	09-2018	EUR	-7.290,00
-175	EURO STOXX BANKS	09-2018	EUR	31.937,50
-17	EURO STOXX UTILITIES	09-2018	EUR	-1.741,94
-175	EURO STOXX 50	09-2018	EUR	106.137,50
8	EURO STOXX 50 DIV	12-2019	EUR	-1.760,00
8	EURO STOXX 50 DIV	12-2018	EUR	2.200,00
-4	EURO STOXX 50 DIV	12-2022	EUR	1.419,92
-19	EURO-BTP FUTURE	09-2018	EUR	4.085,00
-19	EURO-OAT FUTURES	09-2018	EUR	-31.920,00
1	FTSE CHINA A50	07-2018	USD	-184,15
-17	FTSE 100 INDEX	09-2018	GBP	17.732,65
18	FTSE/ATHENS 25 Q2	07-2018	EUR	-113,72
-10	FTSE/JSE TOP 40	09-2018	ZAR	-4.057,20
-7	FTSE/MIB IDX FUT	09-2018	EUR	4.287,50
-2	HANG SENG INDEX	07-2018	HKD	129,16
10	HSCEI FUTURES	07-2018	HKD	-7.751,13
-3	JAPANESE 10Y BOND	09-2018	JPY	-4.871,50
44	JPX-NIKKEI IND 400	09-2018	JPY	-12.044,20
5	KOSPI 200 INDEX	09-2018	KRW	-16.739,01
4	LONG GILT	09-2018	GBP	-63,87
-14	MEXICAN BOLSA	09-2018	MXN	-4.788,87

Anzahl Verträge Kauf/Verkauf	Beschreibung	Fälligkeit	Währung	Nicht realisierter Gewinn/Verlust in EUR
-30	MINI MSCI EMG MKT	09-2018	USD	85.782,53
-2	MSCI SING IX ET	07-2018	SGD	238,70
-6	MSCI TAIWAN INDEX	07-2018	USD	-1.233,35
-10	NASDAQ 100 E-MINI	09-2018	USD	15.147,87
-50	NIKKEI 225 (SGX)	09-2018	JPY	48.448,39
9	OMXS30 INDEX FUTURE	07-2018	SEK	43,08
229	RTS INDEX FUTURE	09-2018	USD	29.345,90
-27	SHORT EURO BTP	09-2018	EUR	-14.310,00
-40	S&P 500 EMINI	09-2018	USD	76.998,84
-1	SPI 200 FUTURES	09-2018	AUD	-1.439,69
26	STOXX EURO LARGE 200	09-2018	EUR	-11.361,91
-33	STOXX EURO SMALL 200	09-2018	EUR	10.065,00
-48	STOXX EUROP 600 FUT	09-2018	EUR	18.552,00
10	STOXX 600 BASIC RES	09-2018	EUR	-16.850,00
5	STOXX 600 CHEM	09-2018	EUR	-7.350,00
16	STOXX 600 FOOD BEV	09-2018	EUR	6.400,00
21	STOXX 600 HEALTH	09-2018	EUR	12.158,97
-52	STOXX 600 INSURAN	09-2018	EUR	20.617,90
43	STOXX 600 OIL & GAS	09-2018	EUR	-4.968,59
11	STOXX 600 TECHNO	09-2018	EUR	-8.222,70
1	SWISS MKT INDEX FUT	09-2018	CHF	172,51
4	TOPIX INDEX	09-2018	JPY	-13.346,35
17	TPX BANKS INDEX	09-2018	JPY	-15.353,72
7	US LONG BOND	09-2018	USD	16.510,36
2	US ULTRA BOND CBT	09-2018	USD	7.119,61
-5	US 10 YR NOTE FUTURE	09-2018	USD	-4.014,82
-8	US 10YR ULTRA T NOTE	09-2018	USD	-10.063,81
60	US 2 YR NOTE FUTURE	09-2018	USD	5.619,97
-52	US 5 YR NOTE FUTURE	09-2018	USD	-7.606,70
-4	XAB MATERIALS	09-2018	USD	7.742,71
15	XAE ENERGY	09-2018	USD	-7.001,84
-2	XAF FINANCIAL	09-2018	USD	5.524,39
-11	XAP CONS STAPLES	09-2018	USD	-7.254,51
2	XAV HEALTH CARE	09-2018	USD	290,32
-25	10Y AUSTRALIAN BOND	09-2018	AUD	-28.738,82
			Summe:	**339.749,02**

Amundi S.F. - Saving Box I

Anzahl Verträge Kauf/Verkauf	Beschreibung	Fälligkeit	Währung	Nicht realisierter Gewinn/Verlust in EUR
-3	AMSTERDAM INDEX	07-2018	EUR	6.690,00
-5	CAC 40	07-2018	EUR	6.625,00
-12	CAN 10YR BOND FUT	09-2018	CAD	-24.689,91
-5	DJ STOXX 600 AUTO .	09-2018	EUR	12.912,33
-5	EMINI S&P REESTATE	09-2018	USD	-4.496,60
-53	EURO BOBL	09-2018	EUR	-33.390,00
-11	EURO BUND	09-2018	EUR	-17.490,00
-3	EURO BUXL	09-2018	EUR	-8.940,00
-62	EURO SCHATZ	09-2018	EUR	-5.580,00
-64	EURO STOXX 50	09-2018	EUR	39.951,00
-11	EURO-BTP FUTURE	09-2018	EUR	2.365,00
-3	FTSE 100 INDEX	09-2018	GBP	3.129,29
-2	FTSE/JSE TOP 40	09-2018	ZAR	-811,44
-2	FTSE/MIB IDX FUT	09-2018	EUR	1.225,00
3	HSCEI FUTURES	07-2018	HKD	-2.325,34
1	IBEX 35 INDEX FUTURE	07-2018	EUR	-1.280,00
-1	JAPANESE 10Y BOND	09-2018	JPY	-1.623,83
17	LONG GILT	09-2018	GBP	22.106,63
-4	MEXICAN BOLSA IDX	09-2018	MXN	-1.368,25
-2	MINI MSCI EMG MKT	09-2018	USD	6.081,11
-2	MSCI SING IX ET	07-2018	SGD	238,70
1	MSCI TAIWAN INDEX	07-2018	USD	424,57
-18	NIKKEI 225 (SGX)	09-2018	JPY	17.784,58
-39	SHORT EURO BTP	09-2018	EUR	-20.670,00
-1	S&P 500 EMINI	09-2018	USD	1.830,76

Anzahl Verträge Kauf/Verkauf	Beschreibung	Fälligkeit	Währung	Nicht realisierter Gewinn/Verlust in EUR
5	US LONG BOND	09-2018	USD	11.793,11
7	US ULTRA BOND CBT	09-2018	USD	24.918,63
-24	US 10 YR NOTE FUTURE	09-2018	USD	-19.271,12
-3	US 10YR ULTRA T NOTE	09-2018	USD	-3.773,93
3	US 2 YR NOTE FUTURE	09-2018	USD	281,00
-119	US 5 YR NOTE FUTURE	09-2018	USD	-30.639,60
-5	10Y AUSTRALIAN BOND	09-2018	AUD	-6.233,55
			Summe:	**-24.226,86**

Amundi S.F. - Saving Box II

Anzahl Verträge Kauf/Verkauf	Beschreibung	Fälligkeit	Währung	Nicht realisierter Gewinn/Verlust in EUR
-7	AMSTERDAM INDEX	07-2018	EUR	15.610,00
-11	CAC 40	07-2018	EUR	14.575,00
-25	CAN 10YR BOND FUT	09-2018	CAD	-51.437,31
-11	DJ STOXX 600 AUTO .	09-2018	EUR	28.407,12
-10	EMINI S&P REESTATE	09-2018	USD	-8.993,19
-154	EURO BOBL	09-2018	EUR	-97.020,00
-40	EURO BUND	09-2018	EUR	-63.600,00
2	EURO BUXL	09-2018	EUR	6.000,00
-100	EURO SCHATZ	09-2018	EUR	-9.000,00
-115	EURO STOXX 50	09-2018	EUR	72.131,00
-12	EURO-BTP FUTURE	09-2018	EUR	2.580,00
1	FTSE CHINA A50	07-2018	USD	-184,15
-8	FTSE 100 INDEX	09-2018	GBP	8.344,77
-5	FTSE/JSE TOP 40	09-2018	ZAR	-2.028,60
-5	FTSE/MIB IDX FUT	09-2018	EUR	3.062,50
6	HSCEI FUTURES	07-2018	HKD	-4.650,68
2	IBEX 35 INDEX FUTURE	07-2018	EUR	-2.560,00
-2	JAPANESE 10Y BOND	09-2018	JPY	-3.247,66
11	LONG GILT	09-2018	GBP	14.304,29
-9	MEXICAN BOLSA IDX	09-2018	MXN	-3.078,56
-4	MINI MSCI EMG MKT	09-2018	USD	12.162,22
-3	MSCI SING IX ET	07-2018	SGD	358,05
2	MSCI TAIWAN INDEX	07-2018	USD	849,15
-36	NIKKEI 225 (SGX)	09-2018	JPY	35.397,59
1	OMXS30 INDEX FUTURE	07-2018	SEK	4,79
-76	SHORT EURO BTP	09-2018	EUR	-40.280,00
-4	S&P 500 EMINI	09-2018	USD	7.323,03
-12	US LONG BOND	09-2018	USD	-31.556,46
-3	US ULTRA BOND CBT US	09-2018	USD	-10.699,48
27	10 YR NOTE FUTURE US	09-2018	USD	15.877,36
-6	10YR ULTRA T NOTE US 2	09-2018	USD	-7.547,86
2	YR NOTE FUTURE US 5	09-2018	USD	187,33
-65	YR NOTE FUTURE 10Y	09-2018	USD	-16.735,91
-16	AUSTRALIAN BOND	09-2018	AUD	-19.947,35
			Summe:	**-135.393,01**

Amundi S.F. - Saving Box III

Anzahl Verträge Kauf/Verkauf	Beschreibung	Fälligkeit	Währung	Nicht realisierter Gewinn/Verlust in EUR
-2	AMSTERDAM INDEX	07-2018	EUR	4.460,00
-5	CAC 40	07-2018	EUR	6.625,00
-9	CAN 10YR BOND FUT	09-2018	CAD	-18.517,43
-3	DJ STOXX 600 AUTO	09-2018	EUR	7.747,40
-4	.EMINI S&P REESTATE	09-2018	USD	-3.597,28
-33	EURO BOBL	09-2018	EUR	-20.790,00
-20	EURO BUND	09-2018	EUR	-31.800,00
-47	EURO SCHATZ	09-2018	EUR	-4.230,00
-38	EURO STOXX 50	09-2018	EUR	23.841,50
-1	EURO-BTP FUTURE	09-2018	EUR	215,00

Anzahl Verträge Kauf/Verkauf	Beschreibung	Fälligkeit	Währung	Nicht realisierter Gewinn/Verlust in EUR
-3	FTSE 100 INDEX	09-2018	GBP	3.129,29
-2	FTSE/JSE TOP 40	09-2018	ZAR	-811,44
-1	FTSE/MIB IDX FUT	09-2018	EUR	612,50
3	HSCEI FUTURES	07-2018	HKD	-2.325,34
1	IBEX 35 INDEX FUTURE	07-2018	EUR	-1.280,00
-5	LONG GILT	09-2018	GBP	-6.558,49
-3	MEXICAN BOLSA IDX	09-2018	MXN	-1.026,19
-4	MINI MSCI EMG MKT	09-2018	USD	12.162,22
-1	MSCI SING IX ET	07-2018	SGD	119,35
1	MSCI TAIWAN INDEX	07-2018	USD	424,57
-13	NIKKEI 225 (SGX)	09-2018	JPY	12.939,75
-20	SHORT EURO BTP	09-2018	EUR	-10.600,00
-3	S&P 500 EMINI	09-2018	USD	5.680,70
-4	US LONG BOND	09-2018	USD	-10.518,82
-4	US ULTRA BOND CBT	09-2018	USD	-14.265,98
21	US 10 YR NOTE FUTURE	09-2018	USD	9.265,12
-2	US 10YR ULTRA T NOTE	09-2018	USD	-2.515,95
10	US 2 YR NOTE FUTURE	09-2018	USD	936,66
-39	US 5 YR NOTE FUTURE	09-2018	USD	-10.041,55
-14	10Y AUSTRALIAN BOND	09-2018	AUD	-17.453,93
			Summe:	**-68.173,34**

Amundi S.F. - Diversified Target Income 11/2021

Anzahl Verträge Kauf/Verkauf	Beschreibung	Fälligkeit	Währung	Nicht realisierter Gewinn/Verlust in EUR
-5	CAN 10YR BOND FUT	09-2018	CAD	-5.501,84
-2	EMINI S&P REESTATE	09-2018	USD	-1.648,75
-57	EURO BOBL	09-2018	EUR	-23.370,00
15	EURO BUND	09-2018	EUR	16.800,00
-4	EURO BUXL	09-2018	EUR	-9.680,00
-44	EURO SCHATZ	09-2018	EUR	-2.200,00
-44	EURO STOXX 50	09-2018	EUR	20.120,00
1	EURO-BTP FUTURE	09-2018	EUR	1.040,00
-1	FTSE 100 INDEX	09-2018	GBP	305,87
3	HSCEI FUTURES	07-2018	HKD	-1.151,75
-2	JAPANESE 10Y BOND	09-2018	JPY	-3.556,97
16	LONG GILT	09-2018	GBP	21.959,63
6	MINI MSCI EMG MKT	09-2018	USD	-13.656,80
-6	MSCI EMG MKT NT	09-2018	EUR	16.606,80
16	NIKKEI 225 OSE	09-2018	JPY	-22.269,70
-18	SHORT EURO BTP	09-2018	EUR	-17.830,00
15	S&P 500 EMINI	09-2018	USD	-20.309,62
-3	SPI 200 FUTURES	09-2018	AUD	-965,07
-12	STOXX EUROP 600 FUT	09-2018	EUR	4.860,00
9	STOXX 600 BASIC RES	09-2018	EUR	-14.200,00
-2	SWISS MKT INDEX FUT	09-2018	CHF	-1.258,29
-5	US LONG BOND	09-2018	USD	-10.237,76
15	US 10YR ULTRA T NOTE	09-2018	USD	7.628,15
57	US 2 YR NOTE FUTURE	09-2018	USD	-3.051,55
-21	US 5 YR NOTE FUTURE	09-2018	USD	-3.894,39
			Summe:	**-65.462,04**

Amundi S.F. - Diversified Target Income 11/2022

Anzahl Verträge Kauf/Verkauf	Beschreibung	Fälligkeit	Währung	Nicht realisierter Gewinn/Verlust in EUR
-2	EMINI S&P REESTATE	09-2018	USD	-1.648,75
-53	EURO BOBL	09-2018	EUR	-21.730,00
19	EURO BUND	09-2018	EUR	21.280,00
-2	EURO BUXL	09-2018	EUR	-4.840,00
-71	EURO SCHATZ	09-2018	EUR	-3.550,00
-50	EURO STOXX 50	09-2018	EUR	23.030,00

Anzahl Verträge Kauf/Verkauf	Beschreibung	Fälligkeit	Währung	Nicht realisierter Gewinn/Verlust in EUR
-1	FTSE 100 INDEX	09-2018	GBP	305,87
3	HSCEI FUTURES	07-2018	HKD	-1.151,75
-2	JAPANESE 10Y BOND	09-2018	JPY	-3.556,97
11	LONG GILT	09-2018	GBP	15.141,06
7	MINI MSCI EMG MKT	09-2018	USD	-19.455,27
-6	MSCI EMG MKT NT	09-2018	EUR	16.606,80
18	NIKKEI 225 OSE	09-2018	JPY	-25.053,41
-18	SHORT EURO BTP	09-2018	EUR	-17.850,00
11	S&P 500 EMINI	09-2018	USD	-18.553,81
-3	SPI 200 FUTURES	09-2018	AUD	-965,07
-14	STOXX EUROP 600 FUT	09-2018	EUR	5.670,00
10	STOXX 600 BASIC RES	09-2018	EUR	-15.775,00
-2	SWISS MKT INDEX FUT	09-2018	CHF	-1.258,29
-5	US LONG BOND	09-2018	USD	-10.237,76
10	US 10YR ULTRA T NOTE	09-2018	USD	5.085,44
66	US 2 YR NOTE FUTURE	09-2018	USD	-3.533,38
-17	US 5 YR NOTE FUTURE	09-2018	USD	-3.339,00
5	10Y AUSTRALIAN BOND	09-2018	AUD	5.678,84
			Summe:	**-59.700,45**

Amundi S.F. - SMBC Amundi Protect Fund USD Step 201803

Anzahl Verträge Kauf/Verkauf	Beschreibung	Fälligkeit	Währung	Nicht realisierter Gewinn/Verlust in USD
310	EURO STOXX 50	09-2018	EUR	-289.552,40
35	FTSE 100 INDEX	09-2018	GBP	-32.213,74
273	JAPANESE YEN	09-2018	USD	-85.812,50
161	MINI MSCI EMG MKT	09-2018	USD	-522.445,00
15	S&P 500	09-2018	USD	-144.562,50
587	US 10 YR NOTE FUTURE	09-2018	USD	394.393,56
			Summe:	**-680.192,58**

8 OFFENE POSITIONEN BEI DEVISENTERMINKONTRAKTEN

Mit Stand vom 30. Juni 2018 hatten bestimmte Teilfonds folgende offene Positionen bei Devisenterminkontrakten:

Amundi S.F. - Diversified Short-Term Bond

	Währung		Betrag in EUR
Währungsforderung	EUR		104.551.459,06
		Summe:	**104.551.459,06**
Währungsverbindlichkeit	GBP		60.337.778,19
	SEK		2.297.952,14
	USD		41.275.727,51
		Summe:	**103.911.457,84**
		Summe:	**640.001,22**

Das Datum der Fälligkeit aller offenen Kontrakte wird der 26. September 2018 sein.

Amundi S.F. - Diversified Subordinated Bond 2018

	Währung		Betrag in EUR
Währungsforderung	EUR		4.607.292,49
		Summe:	**4.607.292,49**
Währungsverbindlichkeit	GBP		2.864.634,70
	USD		1.714.006,50
		Summe:	**4.578.641,20**
		Summe:	**28.651,29**

Das Datum der Fälligkeit aller offenen Kontrakte wird der 26. September 2018 sein.

Amundi S.F. - Emerging Markets Bond 2019

	Währung		Betrag in EUR
Währungsforderung	CZK		11.304.269,12
	EUR		313.665.069,76
	GBP		1.216.430,70
	USD		109.483.810,04
		Summe:	**435.669.579,62**
Währungsverbindlichkeit	EUR		111.965.585,22
	GBP		2.594.409,70
	USD		320.978.971,79
		Summe:	**435.538.966,71**
		Summe:	**130.612,91**

Das Datum der Fälligkeit der offenen Kontrakte wird der 21. September 2018 sein.

Amundi S.F. - Euro Curve 10+year

	Währung		Betrag in EUR
Währungsforderung	EUR		107.062,12
		Summe:	**107.062,12**
Währungsverbindlichkeit	JPY		105.887,05
		Summe:	**105.887,05**
		Summe:	**1.175,07**

Das Datum der Fälligkeit aller offenen Kontrakte wird der 26. September 2018 sein.

Amundi S.F. - High Yield & Emerging Markets Bond Opportunities 2021

	Währung		Betrag in EUR
Währungsforderung	EUR		15.570.342,16
	GBP		1.890.823,89
	USD		20.262.956,93
		Summe:	**37.724.122,98**
Währungsverbindlichkeit	EUR		20.487.915,40
	GBP		2.819.339,64
	USD		14.599.345,80
		Summe:	**37.906.600,84**
		Summe:	**-182.477,86**

Das Datum der Fälligkeit aller offenen Kontrakte wird der 21. September 2018 sein.

Amundi S.F. - Absolute Return Multi-Strategy Control

	Währung		Betrag in EUR
Währungsforderung	ARS		97.612,54
	AUD		862.310,15
	BRL		383.608,77
	CAD		2.209.830,34
	CHF		504.969,79
	CLP		1.021.994,73
	CNH		930.436,92
	COP		746.441,80
	EUR		60.548.136,49
	GBP		2.013.925,44
	IDR		2.275.558,03
	ILS		338.895,44
	INR		1.486.354,20
	JPY		959.052,26
	KRW		1.204.573,61
	MXN		331.940,43
	MYR		192.714,60
	NOK		36.692,47
	NZD		1.127.500,75
	PEN		796.942,57
	PHP		184.504,18
	PLN		227,84
	RUB		1.194.515,68
	SEK		531.398,90
	THB		2.590,18
	TRY		52.655,17
	TWD		1.424.269,50
	USD		18.682.629,00
	ZAR		3.096,98
		Summe:	**100.145.378,76**
Währungsverbindlichkeit	ARS		114.120,14
	AUD		3.903.844,28
	BRL		529.507,67
	CAD		5.698.853,26
	CHF		1.308.673,23
	CLP		1.499.187,96
	COP		553.097,81
	EUR		3.960.226,36
	GBP		7.158.859,23
	HKD		2.623.083,82
	HUF		303.540,79
	IDR		1.472.107,98
	ILS		343.191,21
	INR		1.245.575,93
	JPY		4.419.724,42
	KRW		2.392.413,03
	MXN		299.860,99
	MYR		197.796,92
	NOK		340.715,76
	NZD		1.825.453,14
	PEN		491.355,82
	PHP		90.560,64
	PLN		194.804,37
	RUB		845.008,57
	SEK		460.392,48
	SGD		918.442,84
	THB		425.177,29
	TRY		73.761,18
	TWD		2.334.693,52
	USD		54.105.338,10
	ZAR		141.532,14
		Summe:	**100.270.900,88**
		Summe:	**-125.522,12**

Das Datum der Fälligkeit der offenen Kontrakte wird der 05. Oktober 2018 sein.

Amundi S.F. - Saving Box I

	Währung		Betrag in EUR
Währungsforderung	AUD		196.830,02
	BRL		103.483,87
	CAD		244.913,21
	CHF		159.691,30
	CLP		95.606,98
	COP		122.713,57
	EUR		33.566.678,52
	GBP		261.210,53
	IDR		76.153,12
	INR		724.972,41
	JPY		58.267,00
	KRW		65.821,56
	MYR		57.404,35
	NZD		46.384,13
	PEN		46.688,46
	RUB		156.257,56
	SEK		67.023,28
	TWD		181.015,01
	USD		2.500.422,40
		Summe:	**38.731.537,28**
Währungsverbindlichkeit	AUD		2.081.843,25
	BRL		105.179,48
	CAD		3.557.561,43
	CHF		358.378,60
	CLP		87.278,38
	COP		125.839,42
	EUR		451.712,91
	GBP		4.592.725,70
	HKD		655.770,96
	IDR		76.358,29
	INR		732.943,31
	JPY		4.062.172,01
	KRW		119.089,70
	MYR		63.126,68
	NOK		73.384,93
	NZD		119.190,36
	PEN		51.687,74
	RUB		224.938,08
	SEK		139.002,74
	SGD		84.924,51
	TWD		176.531,07
	USD		20.814.656,95
	ZAR		34.376,51
		Summe:	**38.788.673,01**
		Summe:	**-57.135,73**

Das Datum der Fälligkeit der offenen Kontrakte wird der 10. September 2018

Amundi S.F. - Saving Box II

	Währung	Betrag in EUR
Währungsforderung	ARS	50.375,79
	AUD	405.239,62
	BRL	209.989,16
	CAD	515.894,55
	CHF	323.698,59
	CLP	191.213,97
	COP	256.062,31
	EUR	60.576.196,88
	GBP	531.475,84
	IDR	146.511,97
	INR	1.471.490,61
	JPY	124.302,92
	KRW	120.187,71
	MYR	110.708,39
	NZD	95.667,26
	PEN	123.087,77
	RUB	312.515,12
	SEK	119.684,44
	TWD	322.891,63
	USD	5.006.282,60

	Währung		Betrag in EUR
		Summe:	**71.013.477,13**
Währungsverbindlichkeit	ARS		58.900,72
	AUD		4.456.850,32
	BRL		210.358,97
	CAD		6.807.224,10
	CHF		690.861,33
	CLP		178.523,96
	COP		259.797,51
	EUR		832.854,06
	GBP		9.055.681,53
	HKD		1.344.330,45
	IDR		152.716,59
	INR		1.483.793,30
	JPY		11.169.703,80
	KRW		176.616,08
	MYR		101.002,68
	NOK		146.769,87
	NZD		238.449,96
	PEN		129.219,36
	RUB		441.696,59
	SEK		263.653,27
	SGD		144.686,20
	TWD		322.842,89
	USD		32.433.255,84
		Summe:	**71.099.789,38**
		Summe:	**-86.312,25**

Das Datum der Fälligkeit der offenen Kontrakte wird der 10. September 2018 sein.

Amundi S.F. - Saving Box III

	Währung		Betrag in EUR
Währungsforderung	ARS		53.524,28
	AUD		140.721,18
	BRL		83.089,24
	CAD		191.767,24
	CHF		133.795,41
	CLP		71.705,24
	COP		94.080,40
	EUR		22.859.785,65
	GBP		192.090,60
	IDR		62.081,34
	INR		452.827,50
	JPY		38.844,67
	KRW		210.190,64
	MYR		41.003,11
	NZD		28.990,08
	PEN		46.688,46
	RUB		122.466,97
	SEK		67.023,29
	TWD		122.307,45
	USD		1.851.096,40
		Summe:	**26.864.079,15**
Währungsverbindlichkeit	ARS		62.582,01
	AUD		1.764.223,25
	BRL		77.886,16
	CAD		2.568.481,47
	CHF		315.182,99
	CLP		67.442,39
	COP		101.483,40
	EUR		221.000,41
	GBP		3.046.771,35
	HKD		546.475,79
	IDR		59.389,78
	INR		456.953,52
	JPY		3.540.394,76
	KRW		225.059,35
	MYR		37.876,01
	NOK		57.659,59
	NZD		92.518,33
	PEN		51.687,74
	RUB		171.770,90
	SEK		115.036,06
	SGD		62.907,04
	TWD		123.078,17

	Währung		Betrag in EUR
	USD		13.173.665,50
		Summe:	**26.939.525,97**
		Summe:	**-75.446,82**

Das Datum der Fälligkeit der offenen Kontrakte wird der 10. September 2018 sein.

Amundi S.F. - Amundi Target Trend 2024

	Währung		Betrag in EUR
Währungsforderung	EUR		8.755.613,16
		Summe:	**8.755.613,16**
Währungsverbindlichkeit	USD		8.776.940,47
		Summe:	**8.776.940,47**
		Summe:	**-21.327,31**

Das Datum der Fälligkeit aller offenen Kontrakte wird der 10. September 2018 sein.

Amundi S.F. - Equity Plan 60

	Währung		Betrag in EUR
Währungsforderung	ARS		527.808,62
	BRL		989.017,26
	CHF		1.467.433,57
	COP		698.136,80
	EUR		21.857.030,94
	GBP		2.369.711,05
	IDR		1.021.532,36
	INR		678.123,80
	PHP		707.007,07
	RUB		678.904,01
	SEK		1.053.223,06
	USD		8.313.206,95
		Summe:	**40.361.135,49**
Währungsverbindlichkeit	ARS		566.230,65
	BRL		981.050,75
	CHF		215.799,05
	COP		695.555,47
	EUR		7.579.593,42
	GBP		1.105.865,17
	IDR		1.027.459,38
	INR		684.979,09
	KRW		1.211.081,72
	PHP		701.696,45
	RUB		705.646,76
	USD		25.208.192,78
		Summe:	**40.683.150,69**
		Summe:	**-322.015,20**

Das Datum der Fälligkeit der offenen Kontrakte wird der 18. Dezember 2018 sein.

Amundi S.F. - Diversified Target Income 11/2021

	Währung		Betrag in EUR
Währungsforderung	AUD		439.414,83
	CHF		86.334,37
	EUR		45.803.975,06
	GBP		2.535.229,33
	IDR		223.949,01
	INR		248.137,79
	JPY		3.982.201,34
	NOK		428.360,46
	NZD		345.531,79
	PLN		228.684,29
	RUB		231.520,12
	SEK		210.663,24
	SGD		501.999,59
	TRY		313.020,17
	USD		11.586.292,69
	ZAR		212.279,88
		Summe:	**67.377.593,96**
Währungsverbindlichkeit	AUD		880.920,64
	CAD		65.089,34

	Währung		Betrag in EUR
	CHF		949.103,27
	DKK		53.728,01
	EUR		20.666.017,56
	GBP		7.283.880,11
	JPY		2.402.097,11
	NZD		403.531,86
	SEK		124.480,07
	SGD		501.355,66
	TRY		313.174,99
	USD		33.042.312,50
	ZAR		217.978,68
		Summe:	**66.903.669,80**
		Summe:	**473.924,16**

Das Datum der Fälligkeit offener Kontrakte wird der 02. Januar 2019 sein.

Amundi S.F. - Diversified Target Income 11/2022

	Währung		Betrag in EUR
Währungsforderung	AUD		564.961,92
	CHF		345.337,49
	EUR		44.257.129,67
	GBP		1.577.739,73
	HKD		152.593,25
	IDR		251.202,07
	INR		248.137,79
	JPY		4.666.316,51
	NOK		522.390,81
	PLN		251.552,72
	RUB		258.757,79
	SEK		296.838,75
	SGD		501.999,59
	USD		7.738.158,85
	ZAR		237.253,98
		Summe:	**61.870.370,92**
Währungsverbindlichkeit	AUD		1.257.853,97
	CHF		949.253,61
	EUR		16.861.699,32
	GBP		6.662.368,52
	HKD		87.306,96
	JPY		2.885.111,81
	SEK		210.650,96
	SGD		501.355,66
	USD		31.780.224,69
	ZAR		242.890,52
		Summe:	**61.438.716,02**
		Summe:	**431.654,90**

Das Datum der Fälligkeit offener Kontrakte wird der 02. Januar 2019 sein.

Amundi S.F. - EUR Commodities

	Währung		Betrag in EUR
Währungsforderung	CHF		253.834,04
	USD		31.265.926,68
		Summe:	**31.519.760,72**
Währungsverbindlichkeit	EUR		31.701.557,83
		Summe:	**31.701.557,83**
		Summe:	**-181.797,11**

Das Datum der Fälligkeit offener Kontrakte wird der 31. Juli 2018 sein.

Amundi S.F. - SMBC Amundi Protect Fund USD Step 201803

	Währung		Betrag in USD
Währungsforderung	USD		239.152.035,04
		Summe:	**239.152.035,04**
Währungsverbindlichkeit	EUR		240.154.029,88
		Summe:	**240.154.029,88**
		Summe:	**-1.001.994,84**

Das Datum der Fälligkeit offener Kontrakte wird der 31. Juli 2018 sein.

9 AUFSTELLUNG DER PORTFOLIOBEWEGUNGEN

Eine Liste der Veränderungen im Wertpapierbestand für den am 30. Juni 2018 abgelaufenen Berichtszeitraum steht am eingetragenen Sitz der Verwaltungsgesellschaft des Fonds kostenlos zur Verfügung. Sämtliche Einzelheiten zu den mit Stand vom 30. Juni 2018 ausstehenden Derivatkontrakten sind den Anmerkungen zum Jahresabschluss zu entnehmen.

10 DIVIDENDEN

- **Ausschüttende Anteilsklassen:** Diese Anteilsklassen schütten auf täglicher Basis einen Betrag aus, der auf den generierten Nettoerträgen basiert; Die täglichen Beträge werden kumuliert und monatlich ausgezahlt.
- **Jährlich ausschüttend Anteilsklassen:** Diese Klassen schütten auf jährlicher Basis einen Betrag, der auf den Nettoerträgen des Vorjahres basiert, oder eine Dividende, die auf einer bei Auflage.zu Beginn des Jahres festgelegten Zielrendite basiert, aus. Je nach Art des Teilfonds kann die Ausschüttung inklusive oder exklusive Gebühren erfolgen.
- **Halbjährlich ausschüttende Anteilsklassen:** Diese Klassen zielen darauf ab, auf halbjährlicher Basis einen Betrag, der auf einer bei Auflage.zu Beginn des Jahres festgelegten Zielrendite basiert, auszuschütten.
- **Quartalsweise ausschüttende Anteilsklassen mit Zielrendite:** Diese Klassen zielen darauf ab, quartalsweise eine Dividende auszuschütten, die auf einer zu Beginn des Jahres festgelegten jährlichen Zielrendite basiert.
- **Quartalsweise ausschüttende Anteilsklassen:** Diese Klassen schütten quartalsweise einen Betrag aus, der auf den im selben Quartal generierten Nettoerträgen basiert.

Die weiteren Details der Dividendenausschüttungspolitik werden im Prospekt des Fonds beschrieben. Im Laufe des Berichtszeitraums wurde keine andere Ausschüttung als die im Prospekt beschriebene durchgeführt.

11 OPTIONEN

Mit Stand vom 30. Juni 2018 hatten bestimmte Teilfonds folgende offene Positionen:

OPTIONSKONTRAKTE MIT ABSCHLUSSPRÄMIEN

Siehe Wertpapierbestand.

FUTURES-STYLE OPTIONSKONTRAKTE

Amundi S.F. - Absolute Return Multi-Strategy Control

Kontrakt	Streik	Fälligkeit	Währung	Anzahl Optionen
EURO BUND FUTURE /CALL	161,50	27.07.18	EUR	-18
EURO BUND FUTURE /CALL	162,00	27.07.18	EUR	-12
EURO BUND FUTURE /CALL	162,50	24.08.18	EUR	9
EURO BUND FUTURE /PUT	158,50	27.07.18	EUR	18
EURO BUND FUTURE /PUT	157,50	27.07.18	EUR	18
EURO BUND FUTURE /PUT	160,00	24.08.18	EUR	9
HANG SENG CHINA ENT INDEX /CALL	12.700	30.08.18	HKD	8
HANG SENG CHINA ENT INDEX /CALL	11.600	27.09.18	HKD	-11
HANG SENG CHINA ENT INDEX /CALL	11.800	27.09.18	HKD	-11
HANG SENG CHINA ENT INDEX /CALL	12.200	27.09.18	HKD	-7
HANG SENG CHINA ENT INDEX /PUT	11.500	30.08.18	HKD	8
HANG SENG CHINA ENT INDEX /PUT	9.600	27.09.18	HKD	11
HANG SENG CHINA ENT INDEX /PUT	9.800	27.09.18	HKD	11
HANG SENG CHINA ENT INDEX /PUT	10.000	27.09.18	HKD	7

Mit Stand vom 30. Juni 2018 betrug die nicht realisierte Nettoabwertung bei Futures-Style Optionskontrakten 39.701,44 EUR.

Amundi S.F. - Saving Box I

Kontrakt	Streik	Fälligkeit	Währung	Anzahl Optionen
EURO BUND FUTURE /CALL	161,50	27.07.18	EUR	-6
EURO BUND FUTURE /CALL	162,00	27.07.18	EUR	-4
EURO BUND FUTURE /PUT	158,50	27.07.18	EUR	6
EURO BUND FUTURE /PUT	157,50	27.07.18	EUR	5
HANG SENG CHINA ENT INDEX /CALL	11.600	27.09.18	HKD	-7
HANG SENG CHINA ENT INDEX /CALL	11.800	27.09.18	HKD	-7
HANG SENG CHINA ENT INDEX /CALL	12.200	27.09.18	HKD	-4
HANG SENG CHINA ENT INDEX /PUT	9.600	27.09.18	HKD	7
HANG SENG CHINA ENT INDEX /PUT	9.800	27.09.18	HKD	7
HANG SENG CHINA ENT INDEX /PUT	10.000	27.09.18	HKD	4

Per 30. Juni 2018 betrug die nicht realisierte Nettoabwertung bei Futures-Style Optionskontrakten 17.021,07 EUR.

Amundi S.F. - Saving Box II

Kontrakt	Streik	Fälligkeit	Währung	Anzahl Optionen
EURO BUND FUTURE /CALL	161,50	27.07.18	EUR	-12
EURO BUND FUTURE /CALL	162,00	27.07.18	EUR	-8
EURO BUND FUTURE /PUT	158,50	27.07.18	EUR	12
EURO BUND FUTURE /PUT	157,50	27.07.18	EUR	10
HANG SENG CHINA ENT INDEX /CALL	11.600	27.09.18	HKD	-14
HANG SENG CHINA ENT INDEX /CALL	11.800	27.09.18	HKD	-14
HANG SENG CHINA ENT INDEX /CALL	12.200	27.09.18	HKD	-8
HANG SENG CHINA ENT INDEX /PUT	9.600	27.09.18	HKD	14
HANG SENG CHINA ENT INDEX /PUT	9.800	27.09.18	HKD	14
HANG SENG CHINA ENT INDEX /PUT	10.000	27.09.18	HKD	8

Per 30. Juni 2018 betrug die nicht realisierte Nettowertminderung bei Futures-Style Optionskontrakten 34.042,13 EUR.

Amundi S.F. - Saving Box III

Kontrakt	Streik	Fälligkeit	Währung	Anzahl Optionen
EURO BUND FUTURE /CALL	161,50	27.07.18	EUR	-4
EURO BUND FUTURE /CALL	162,00	27.07.18	EUR	-3
EURO BUND FUTURE /PUT	158,50	27.07.18	EUR	4
EURO BUND FUTURE /PUT	157,50	27.07.18	EUR	4
HANG SENG CHINA ENT INDEX /CALL	11.600	27.09.18	HKD	-5
HANG SENG CHINA ENT INDEX /CALL	11.800	27.09.18	HKD	-5
HANG SENG CHINA ENT INDEX /CALL	12.200	27.09.18	HKD	-3
HANG SENG CHINA ENT INDEX /PUT	9.600	27.09.18	HKD	5
HANG SENG CHINA ENT INDEX /PUT	9.800	27.09.18	HKD	5
HANG SENG CHINA ENT INDEX /PUT	10.000	27.09.18	HKD	3

Per 30. Juni 2018 betrug die nicht realisierte Nettowertminderung bei Futures-Style Optionskontrakten 11.965,57 EUR.

Amundi S.F. - Diversified Target Income 11/2021

Kontrakt	Streik	Fälligkeit	Währung	Anzahl Optionen
BOBL EUREX /PUT	131,25	27.07.18	EUR	59

Per 30. Juni 2018 betrug die nicht realisierte Nettowertminderung bei Futures-Style Optionskontrakten 2.460,00 EUR.

Amundi S.F. - Diversified Target Income 11/2022

Kontrakt	Streik	Fälligkeit	Währung	Anzahl Optionen
BOBL EUREX /PUT	131,25	27.07.18	EUR	66

Per 30. Juni 2018 betrug die nicht realisierte Nettowertminderung bei Futures-Style Optionskontrakten 2.770,00 EUR.

12 SWAPS

Amundi S.F. - Diversified Short-Term Bond

Fälligkeit	Kontrakt	Basiswert	Erhaltener Zinssatz	Gezahlter Zinssatz	Währung	Nominal	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (in Teilfonds-Währung)
20-Jun-23	Credit Default Swap Buyer	Allianz	-	1,000%	EUR	9.720.000	-289.069,17
20-Jun-23	Credit Default Swap Buyer	iTraxx Europe Crossover Series 29 Index	-	5,000%	EUR	50.000.000	-3.785.430,21
20-Jun-23	Credit Default Swap Buyer	iTraxx Europe Series 29 Index	-	1,000%	EUR	300.000.000	-3.582.525,76
20-Jun-23	Credit Default Swap Buyer	Peugeot SA	-	5,000%	EUR	4.875.000	-838.481,32
20-Jun-23	Credit Default Swap Seller	Axa SA	1,000%	-	EUR	7.200.000	134.590,49
20-Dez-22	Credit Default Swap Seller	Banco Santander SA	1,000%	-	EUR	5.000.000	-200.647,25
20-Dez-22	Credit Default Swap Seller	BBV Intl Finance Cayman	1,000%	-	EUR	5.000.000	-283.293,59
20-Dez-22	Credit Default Swap Seller	Casino Guichard Perrach	1,000%	-	EUR	6.000.000	-660.523,26
20-Dez-18	Credit Default Swap Seller	Casino Guichard Perrach	1,000%	-	EUR	7.500.000	-4.640,51
20-Dez-22	Credit Default Swap Seller	Fcc Aqualia SA	5,000%	-	EUR	5.000.000	843.722,75
20-Dez-22	Credit Default Swap Seller	Garfunkelux	5,000%	-	EUR	2.000.000	-35.302,70
20-Dez-22	Credit Default Swap Seller	iTraxx Europe Senior Fin. Series 28 Index	1,000%	-	EUR	100.000.000	716.290,97
20-Jun-23	Credit Default Swap Seller	iTraxx Europe Series 29 Index	1,000%	-	EUR	300.000.000	3.582.525,76
20-Jun-23	Credit Default Swap Seller	Jaguar Land Rover PLC	5,000%	-	EUR	6.500.000	541.722,30
20-Dez-22	Credit Default Swap Seller	Société Générale	1,000%	-	EUR	5.000.000	-118.573,44
						Summe:	**-3.979.634,94**

Amundi S.F. - Emerging Markets Bond 2019

Fälligkeit	Kontrakt	Basiswert	Erhaltener Zinssatz	Gezahlter Zinssatz	Währung	Nominal	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (in Teilfonds-Währung)
20-Dez-18	Credit Default Swap Seller	Joint Stock Company Alfa Bank	1,000%	-	USD	3.000.000	-8.853,67
20-Sep-19	Credit Default Swap Seller	Petrobras	1,000%	-	USD	1.000.000	-5.423,87
20-Dez-18	Credit Default Swap Seller	Vimpel Communications	1,000%	-	USD	3.000.000	5.987,30
						Summe::	**-8.290,24**

Amundi S.F. - High Yield & Emerging Markets Bond Opportunities 2021

Fälligkeit	Kontrakt	Basiswert	Erhaltener Zinssatz	Gezahlter Zinssatz	Währung	Nominal	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (in Teilfonds-Währung)
20-Dez-19	Credit Default Swap Seller	Vale Overseas Ltd	1,000%	-	USD	300.000	-15,24
						Summe:	**-15,24**

Amundi S.F. - Absolute Return Multi-Strategy Control

Fälligkeit	Kontrakt	Basiswert	Erhaltener Zinssatz	Gezahlter Zinssatz	Währung	Nominal	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (in Teilfonds-Währung)
20-Dez-21	Credit Default Swap Buyer	Anadarko Petroleum Corp	-	1,000%	USD	90.000	-1.593,09
20-Dez-21	Credit Default Swap Buyer	Apache Corp	-	1,000%	USD	90.000	-1.430,00
20-Jun-22	Credit Default Swap Buyer	Arcoinc	-	1,000%	USD	100.000	1.142,76
20-Jun-22	Credit Default Swap Buyer	Aust & NZ Banking Group	-	1,000%	USD	350.000	-5.762,84
20-Dez-21	Credit Default Swap Buyer	Canadian Natural Ressources	-	1,000%	USD	85.000	-1.718,05
20-Dez-21	Credit Default Swap Buyer	CDX NA HY 27 Index	-	5,000%	USD	1.862.000	-111.546,22
20-Jun-22	Credit Default Swap Buyer	Commonwealth Bank Aust.	-	1,000%	USD	350.000	-6.156,39
20-Dez-21	Credit Default Swap Buyer	Developers Diversified Realty Corp	-	1,000%	USD	85.000	-1.045,97
20-Dez-21	Credit Default Swap Buyer	Enbridge Inc	-	1,000%	USD	90.000	-1.174,40
20-Jun-22	Credit Default Swap Buyer	Firstenergy Corp	-	1,000%	USD	100.000	-1.844,56
20-Jun-22	Credit Default Swap Buyer	Halliburton	-	1,000%	USD	100.000	-2.184,82
20-Jun-23	Credit Default Swap Buyer	iTraxx Europe Crossover Series 29 Index	-	5,000%	EUR	7.000.000	-529.960,23

Fälligkeit	Kontrakt	Basiswert	Erhaltener Zinssatz	Gezahlter Zinssatz	Währung	Nominal	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (in Teilfonds-Währung)
20-Jun-23	Credit Default Swap Buyer	iTraxx Europe Crossover Series 29 Index	-	5,000%	EUR	4.500.000	-340.688,72
20-Jun-23	Credit Default Swap Buyer	iTraxx Europe Crossover Series 29 Index	-	5,000%	EUR	700.000	-52.996,02
20-Jun-23	Credit Default Swap Buyer	iTraxx Europe Crossover Series 29 Index	-	5,000%	EUR	1.400.000	-105.992,05
20-Jun-23	Credit Default Swap Buyer	iTraxx Europe Crossover Series 29 Index	-	5,000%	EUR	6.000.000	-454.251,63
20-Jun-23	Credit Default Swap Buyer	iTraxx Europe Series 29 Index	-	1,000%	EUR	4.000.000	-47.767,01
20-Jun-23	Credit Default Swap Buyer	iTraxx Europe Series 29 Index	-	1,000%	EUR	13.000.000	-155.242,78
20-Jun-23	Credit Default Swap Buyer	iTraxx Europe Series 29 Index	-	1,000%	EUR	5.000.000	-59.708,76
20-Jun-22	Credit Default Swap Buyer	Kinder Morgan Inc	-	1,000%	USD	100.000	-1.202,48
20-Jun-22	Credit Default Swap Buyer	Macquarie Bank Ltd	-	1,000%	USD	350.000	-4.534,89
20-Jun-22	Credit Default Swap Buyer	Michigan ST	-	1,000%	USD	800.000	-17.136,71
20-Jun-22	Credit Default Swap Buyer	National Australia Bank	-	1,000%	USD	350.000	-5.831,41
20-Jun-22	Credit Default Swap Buyer	Newmont Mining Corp	-	1,000%	USD	100.000	-1.851,13
20-Dez-21	Credit Default Swap Buyer	Ryder System Inc	-	1,000%	USD	85.000	-1.289,28
20-Jun-22	Credit Default Swap Buyer	Westpac Bank	-	1,000%	USD	350.000	-5.787,91
16-Okt-18	Equity Swap	Egypt Treasury Bill	-	Libor 3M +0,75%	USD	72.631	26.894,63
26-Jun-19	Index Equity Swap	SPJPX DVD Arist NTR	-	Libor 3M -0,08%	JPY	127.922.023	-8.028,00
06-Sep-26	Inflation Swap	-	1M CPTFEMU Index	1,028%	EUR	950.000	41.711,46
11-Jan-22	Inflation Swap	-	1M TCPI Index	1,100%	EUR	3.000.000	10.296,20
08-Feb-22	Inflation Swap	-	1M FRCPXTOB Index	1,364%	EUR	2.900.000	-1.625,00
15-Mär-20	Inflation Swap	-	1M TCPI Index	0,870%	EUR	3.000.000	13.705,54
22-Aug-26	Inflation Swap	-	3,078%	1M UKRPI Index	GBP	270.000	-5.578,67
22-Aug-56	Inflation Swap	-	1M UKRPI Index	2,985%	GBP	70.000	14.550,77
01-Sep-21	Inflation Swap	-	3,025%	1M UKRPI Index	GBP	550.000	-4.597,00
16-Jan-27	Inflation Swap	-	3,633%	1M UKRPI Index	GBP	900.000	36.251,62
25-Jan-27	Inflation Swap	-	1M JCPNGENF Index	0,620%	JPY	40.600.000	-1.699,41
26-Jan-27	Inflation Swap	-	1M JCPNGENF Index	0,620%	JPY	79.400.000	-3.328,18
01-Sep-21	Inflation Swap	-	1M CPURNSA Index	1,531%	USD	750.000	14.280,31
23-Jan-47	Inflation Swap	-	1M CPURNSA Index	2,338%	USD	550.000	-3.697,81
16-Oct-19	Inflation Swap	-	2,070%	1D CPURNSA Index	USD	8.400.000	-44.327,59
16-Oct-27	Inflation Swap	-	1M CPURNSA Index	2,168%	USD	1.800.000	30.825,60
16-Dez-26	Interest Rate Swap	-	BBSW 6M	3,071%	AUD	1.850.000	-29.279,63
20-Dez-27	Interest Rate Swap	-	2,755%	BBSW 6M	AUD	1.200.000	-2.976,81
07-Jul-46	Interest Rate Swap	-	Cdor 3M	1,604%	CAD	150.000	19.798,41
30-Sep-46	Interest Rate Swap	-	Cdor 3M	1,550%	CAD	300.000	41.893,21
15-Okt-23	Interest Rate Swap	-	Cdor 3M	2,245%	CAD	2.200.000	14.099,11
15-Okt-20	Interest Rate Swap	-	2,113%	Cdor 3M	CAD	5.200.000	-11.765,73
21-Dez-27	Interest Rate Swap	-	Libor 6M	0,236%	CHF	800.000	8.178,38
12-Sep-22	Interest Rate Swap	-	3,315%	Clibo 1D	CLP	305.000.000	-6.875,70
20-Okt-27	Interest Rate Swap	-	0,000%	Clibo 1D	CLP	300.000.000	-1.754,14
09-Jan-23	Interest Rate Swap	-	3,963%	China IRS 1W	CNY	7.500.000	25.702,89
16-Apr-23	Interest Rate Swap	-	3,683%	China IRS 1W	CNY	13.750.000	26.880,57
07-Jun-23	Interest Rate Swap	-	5,365%	Eonia 1D	COP	3.250.000.000	-5.864,35
06-Nov-19	Interest Rate Swap	-	1,340%	Pribor 6M	CZK	155.000.000	-15.983,52
01-Jun-28	Interest Rate Swap	-	Pribor 6M	1,869%	CZK	23.000.000	12.786,95
01-Jun-23	Interest Rate Swap	-	1,680%	Pribor 6M	CZK	43.500.000	-16.261,45
24-Nov-19	Interest Rate Swap	-	0,144%	Cibor 6M	DKK	41.500.000	20.562,71
19-Jul-30	Interest Rate Swap	-	0,906%	Euribor 6M	EUR	300.000	-12.082,41
19-Jul-50	Interest Rate Swap	-	Euribor 6M	0,930%	EUR	150.000	25.009,37
20-Jul-31	Interest Rate Swap	-	1,320%	Euribor 6M	EUR	700.000	-18.890,47
24-Nov-19	Interest Rate Swap	-	Euribor 6M	-0,074%	EUR	5.600.000	-12.601,67

Fälligkeit	Kontrakt	Basiswert	Erhaltener Zinssatz	Gezahlter Zinssatz	Währung	Nominal	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (in Teilfonds-Währung)
29-Nov-26	Interest Rate Swap	-	Euribor 6M	1,211%	EUR	1.700.000	-1.172,68
10-Dez-56	Interest Rate Swap	-	1,263%	Euribor 6M	EUR	1.500.000	-20.262,11
10-Dez-66	Interest Rate Swap	-	Euribor 6M	0,925%	EUR	1.500.000	30.226,70
23-Jan-22	Interest Rate Swap	-	Euribor 6M	0,330%	EUR	3.200.000	-21.238,71
23-Jan-27	Interest Rate Swap	-	1,363%	Euribor 6M	EUR	2.000.000	12.786,17
19-Jun-22	Interest Rate Swap	-	Euribor 6M	0,147%	EUR	4.700.000	-6.792,42
23-Jun-27	Interest Rate Swap	-	1,354%	Euribor 6M	EUR	2.300.000	3.143,94
29- Jun-19	Interest Rate Swap	-	Euribor 6M	-0,162%	EUR	7.500.000	-6.959,65
30- Jun-22	Interest Rate Swap	-	Euribor 6M	0,223%	EUR	5.300.000	-23.223,96
18-Okt-28	Interest Rate Swap	-	1,066%	Euribor 6M	EUR	1.050.000	12.127,33
18-Okt-23	Interest Rate Swap	-	Euribor 6M	0,455%	EUR	2.100.000	-11.561,08
18-Jul-56	Interest Rate Swap	-	Libor 6M	1,007%	GBP	350.000	17.160,09
29-Jul-21	Interest Rate Swap	-	Libor 6M	0,550%	GBP	550.000	10.856,35
29- Jul-26	Interest Rate Swap	-	Libor 6M	1,105%	GBP	550.000	15.492,70
30- Jul-21	Interest Rate Swap	-	0,591%	Libor 6M	GBP	850.000	-15.594,38
29-Jul-46	Interest Rate Swap	-	Libor 6M	1,053%	GBP	100.000	14.881,29
01-Sep-21	Interest Rate Swap	-	Libor 6M	0,486%	GBP	550.000	12.602,27
13-Sep-21	Interest Rate Swap	-	Libor 6M	0,566%	GBP	600.000	12.243,44
24-Okt-19	Interest Rate Swap	-	0,660%	Libor 6M	GBP	5.600.000	-23.488,02
22-Okt-20	Interest Rate Swap	-	Libor 6M	0,772%	GBP	5.600.000	39.150,94
03-Nov-18	Interest Rate Swap	-	Libor 6M	0,622%	GBP	3.200.000	2.180,34
10-Nov-21	Interest Rate Swap	-	Libor 6M	0,926%	GBP	1.600.000	13.851,77
16-Jan-27	Interest Rate Swap	-	Libor 6M	1,296%	GBP	900.000	13.031,05
23-Jan-21	Interest Rate Swap	-	Libor 6M	1,116%	GBP	4.500.000	3.098,52
21-Jun-27	Interest Rate Swap	-	Libor 6M	1,464%	GBP	2.200.000	25.380,57
18-Apr-28	Interest Rate Swap	-	Libor 6M	1,543%	GBP	750.000	-3.376,99
23-Feb-21	Interest Rate Swap	-	1,148%	Bubor 6M	HUF	2.600.000.000	-59.086,31
01-Dez-26	Interest Rate Swap	-	2,025%	Telbor 3M	ILS	800.000	3.196,14
08-Jan-23	Interest Rate Swap	-	6,638%	Indian OIS 1D	INR	65.000.000	-18.138,37
21-Sep-26	Interest Rate Swap	-	Libor 6M	0,100%	JPY	36.200.000	2.117,52
13- Okt-26	Interest Rate Swap	-	Libor 6M	0,080%	JPY	65.000.000	4.743,46
14- Nov-46	Interest Rate Swap	-	Libor 6M	0,595%	JPY	33.000.000	10.275,36
07-Feb-27	Interest Rate Swap	-	Libor 6M	0,460%	JPY	232.000.000	-14.190,71
07-Feb-52	Interest Rate Swap	-	1,278%	Libor 6M	JPY	232.000.000	11.259,03
09-Nov-21	Interest Rate Swap	-	7,250%	TIIE 1M	MXN	12.050.000	-10.259,72
08- Dez-21	Interest Rate Swap	-	7,190%	TIIE 1M	MXN	10.000.000	-9.411,08
09- Dez-21	Interest Rate Swap	-	7,240%	TIIE 1M	MXN	3.250.000	-2.851,14
02-Jan-20	Interest Rate Swap	-	7,560%	TIIE 1M	MXN	20.000.000	-7.195,14
04- Jan-22	Interest Rate Swap	-	7,837%	TIIE 1M	MXN	16.000.000	-1.251,06
05- Mrz-19	Interest Rate Swap	-	7,260%	TIIE 1M	MXN	50.000.000	-14.067,93
04-Apr-19	Interest Rate Swap	-	7,185%	TIIE 1M	MXN	97.500.000	-33.004,85
16- Jun-27	Interest Rate Swap	-	Nibor 6M	1,860%	NOK	8.000.000	17.986,24
17- Jun-21	Interest Rate Swap	-	1,500%	Nibor 6M	NOK	39.000.000	-17.924,11
21-Okt-21	Interest Rate Swap	-	1,620%	Nibor 6M	NOK	50.000.000	-19.839,99
19-Okt-27	Interest Rate Swap	-	Nibor 6M	2,400%	NOK	22.500.000	11.837,22
01-Jun-28	Interest Rate Swap	-	2,153%	Nibor 6M	NOK	8.500.000	-1.385,66
20-Feb-22	Interest Rate Swap	-	3,695%	BKBM 3M	NZD	7.300.000	87.644,87
29-Nov-18	Interest Rate Swap	-	Stibor 3M	-0,419%	SEK	40.600.000	876,04
23-Jan-20	Interest Rate Swap	-	Stibor 3M	-0,100%	SEK	30.500.000	-6.446,76
21-Feb-28	Interest Rate Swap	-	1,453%	Stibor 3M	SEK	17.500.000	55.912,54
21-Feb-20	Interest Rate Swap	-	Stibor 3M	-0,090%	SEK	85.000.000	-18.247,09
03-Mär-27	Interest Rate Swap	-	2,590%	Sibor 6M	SGD	1.600.000	4.597,82
30-Jan-28	Interest Rate Swap	-	2,280%	Sibor 6M	SGD	1.510.000	-23.631,46
20-Jul-31	Interest Rate Swap	-	Libor 3M	2,079%	USD	850.000	26.315,45
20-Jul-26	Interest Rate Swap	-	Libor 3M	1,773%	USD	850.000	36.198,30
20-Jul-31	Interest Rate Swap	-	Libor 3M	2,095%	USD	400.000	12.168,49
20-Jul-23	Interest Rate Swap	-	1,403%	Libor 3M	USD	400.000	-23.517,79
02-Aug-21	Interest Rate Swap	-	1,068%	Libor 3M	USD	700.000	-31.530,61
01-Sep-21	Interest Rate Swap	-	1,195%	Libor 3M	USD	750.000	-32.187,85

Fälligkeit	Kontrakt	Basiswert	Erhaltener Zinssatz	Gezahlter Zinssatz	Währung	Nominal	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (in Teilfonds-Währung)
24-Sep-48	Interest Rate Swap	-	Libor 3M	1,965%	USD	200.000	34.003,84
24-Sep-23	Interest Rate Swap	-	1,520%	Libor 3M	USD	800.000	-43.730,44
14-Jan-21	Interest Rate Swap	-	2,180%	Libor 3M	USD	5.500.000	-65.906,47
14-Jan-49	Interest Rate Swap	-	Libor 3M	2,570%	USD	550.000	34.180,71
13-Jan-32	Interest Rate Swap	-	Libor 3M	2,680%	USD	1.400.000	28.617,72
13-Jan-24	Interest Rate Swap	-	2,525%	Libor 3M	USD	5.800.000	-34.084,95
23-Jan-27	Interest Rate Swap	-	Libor 3M	2,753%	USD	2.400.000	15.536,56
23-Jan-22	Interest Rate Swap	-	2,377%	Libor 3M	USD	3.600.000	-47.576,83
07-Feb-27	Interest Rate Swap	-	2,827%	Libor 3M	USD	2.400.000	-9.071,14
07-Feb-52	Interest Rate Swap	-	Libor 3M	2,655%	USD	2.400.000	2.224,06
21-Feb-22	Interest Rate Swap	-	Libor 3M	2,502%	USD	5.200.000	36.558,97
21-Feb-20	Interest Rate Swap	-	2,030%	Libor 3M	USD	5.200.000	-51.759,72
13-Jun-22	Interest Rate Swap	-	Libor 3M	1,862%	USD	2.900.000	92.824,70
13-Jun-19	Interest Rate Swap	-	1,550%	Libor 3M	USD	7.000.000	-59.220,14
18-Okt-28	Interest Rate Swap	-	Libor 3M	2,371%	USD	1.400.000	58.743,93
18-Okt-23	Interest Rate Swap	-	2,165%	Libor 3M	USD	2.600.000	-75.802,30
21-Dez-27	Interest Rate Swap	-	Libor 3M	2,412%	USD	900.000	31.792,83
12-Mär-22	Interest Rate Swap	-	2,893%	Libor 3M	USD	6.300.000	-4.379,98
14-Mär-24	Interest Rate Swap	-	Libor 3M	2,930%	USD	6.300.000	-1.824,26
21-Feb-28	Interest Rate Swap	-	7,545%	Jibar 3M	ZAR	17.000.000	-56.636,58
05-Jun-23	Interest Rate Swap	-	7,485%	Jibar 3M	ZAR	14.500.000	-13.645,96
21-Dez-18	Variance Swap	Euro Stoxx 50 PR - Strike 0,183	-	-	EUR	1.092.896	-7.141,57
20-Dez-19	Variance Swap	Euro Stoxx 50 PR - Strike 0,217	-	-	EUR	8.545.035	-142.786,86
21-Dez-18	Variance Swap	FTSE 100 Index - Strike 0,200	-	-	GBP	2.500.000	-72.246,19
21-Dez-18	Variance Swap	FTSE 100 Index - Strike 0,201	-	-	GBP	2.487.562	-72.927,94
13-Dez-18	Variance Swap	Kospi 200 Index - Strike 0,190	-	-	KRW	1.500.000.000	-20.245,47
21-Dez-18	Variance Swap	SP 500 Index - Strike 0,159	-	-	USD	1.572.327	-7.116,75
21-Dez-18	Variance Swap	SP 500 Index - Strike 0,186	-	-	USD	1.344.086	17.826,91
21-Dez-18	Variance Swap	SP 500 Index - Strike 0,200	-	-	USD	2.500.000	47.789,98
21-Dez-18	Variance Swap	SP 500 Index - Strike 0,201	-	-	USD	2.487.562	48.321,80
20-Dez-19	Variance Swap	SP 500 Index - Strike 0,203	-	-	USD	1.234.568	10.540,17
						Summe:	**-2.022.981,45**

Amundi S.F. - Saving Box I

Fälligkeit	Kontrakt	Basiswert	Erhaltener Zinssatz	Gezahlter Zinssatz	Währung	Nominal	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (in Teilfonds-Währung)
20-Dez-21	Credit Default Swap Buyer	Anadarko Petroleum Corp	-	1,000%	USD	60.000	-1.062,05
20-Dez-21	Credit Default Swap Buyer	Apache Corp	-	1,000%	USD	60.000	-953,33
20-Jun-22	Credit Default Swap Buyer	Aust & NZ Banking Group	-	1,000%	USD	200.000	-3.293,06
20-Dez-21	Credit Default Swap Buyer	Canadian Natural Ressources	-	1,000%	USD	60.000	-1.212,72
20-Dez-21	Credit Default Swap Buyer	CDX NA HY 27 Index	-	5,000%	USD	1.274.000	-76.321,10
20-Jun-22	Credit Default Swap Buyer	Commonwealth Bank Aust.	-	1,000%	USD	200.000	-3.517,94
20-Dez-21	Credit Default Swap Buyer	Developers Diversified Realty Corp	-	1,000%	USD	60.000	-738,32
20-Dez-21	Credit Default Swap Buyer	Enbridge Inc	-	1,000%	USD	60.000	-782,92
20-Jun-23	Credit Default Swap Buyer	iTraxx Europe Crossover Series 29 Index	-	5,000%	EUR	7.500.000	-567.814,53
20-Jun-23	Credit Default Swap Buyer	iTraxx Europe Crossover Series 29 Index	-	5,000%	EUR	3.500.000	-264.980,11
20-Jun-23	Credit Default Swap Buyer	iTraxx Europe Series 29 Index	-	1,000%	EUR	6.000.000	-71.650,52
20-Jun-23	Credit Default Swap Buyer	iTraxx Europe Series 29 Index	-	1,000%	EUR	3.500.000	-41.796,13
20-Jun-23	Credit Default Swap Buyer	iTraxx Europe Series 29 Index	-	1,000%	EUR	3.500.000	-41.796,13
20-Jun-22	Credit Default Swap Buyer	Macquarie Bank Ltd	-	1,000%	USD	200.000	-2.591,37
20-Jun-22	Credit Default Swap Buyer	National Australia Bank	-	1,000%	USD	200.000	-3.332,24
20-Dez-21	Credit Default Swap Buyer	Ryder System Inc	-	1,000%	USD	60.000	-910,06
20-Jun-22	Credit Default Swap Buyer	Westpac Bank	-	1,000%	USD	200.000	-3.307,38

Fälligkeit	Kontrakt	Basiswert	Erhaltener Zinssatz	Gezahlter Zinssatz	Währung	Nominal	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (in Teilfonds-Währung)
06-Sep-26	Inflation Swap	-	1M CPTFEMU Index	1,028%	EUR	2.200.000	96.594,98
11-Jan-22	Inflation Swap	-	1M TCPI Index	1,100%	EUR	1.800.000	6.177,72
08-Feb-22	Inflation Swap	-	1M FRCPXTOB Index	1,364%	EUR	1.900.000	-1.064,66
15-Mär-20	Inflation Swap	-	1M TCPI Index	0,870%	EUR	1.900.000	8.680,18
22-Aug-56	Inflation Swap	-	1M UKRPI Index	2,985%	GBP	160.000	33.121,99
22-Aug-26	Inflation Swap	-	3,078%	1M UKRPI Index	GBP	650.000	-13.446,06
01-Sep-21	Inflation Swap	-	3,025%	1M UKRPI Index	GBP	1.300.000	-10.865,60
16-Jan-27	Inflation Swap	-	3,633%	1M UKRPI Index	GBP	600.000	24.167,73
25-Jan-27	Inflation Swap	-	1M JCPNGENF Index	0,620%	JPY	25.400.000	-1.063,19
26-Jan-27	Inflation Swap	-	1M JCPNGENF Index	0,620%	JPY	49.600.000	-2.079,07
01-Sep-21	Inflation Swap	-	1M CPURNSA Index	1,531%	USD	1.700.000	32.368,70
23-Jan-47	Inflation Swap	-	1M CPURNSA Index	2,338%	USD	400.000	-2.689,30
16-Oct-19	Inflation Swap	-	2,070%	1D CPURNSA Index	USD	5.000.000	-26.385,48
16-Oct-27	Inflation Swap	-	1M CPURNSA Index	2,168%	USD	1.100.000	18.837,87
20-Dez-27	Interest Rate Swap	-	2,755%	BBSW 6M	AUD	600.000	-1.488,39
16-Dez-26	Interest Rate Swap	-	BBSW 6M	3,071%	AUD	1.100.000	-17.437,49
30-Jun-46	Interest Rate Swap	-	Cdor 3M	1,710%	CAD	800.000	94.562,13
15-Okt-23	Interest Rate Swap	-	Cdor 3M	2,245%	CAD	1.200.000	7.690,42
15-Okt-20	Interest Rate Swap	-	2,113%	Cdor 3M	CAD	3.000.000	-6.787,90
21-Dez-27	Interest Rate Swap	-	Libor 6M	0,236%	CHF	400.000	4.089,17
12-Sep-22	Interest Rate Swap	-	3,315%	Clibo 1D	CLP	190.000.000	-4.283,22
09-Jan-23	Interest Rate Swap	-	3,963%	China IRS 1W	CNY	3.000.000	10.281,14
24-Nov-19	Interest Rate Swap	-	0,144%	Cibor 6M	DKK	35.000.000	17.342,04
18-Okt-28	Interest Rate Swap	-	1,066%	Euribor 6M	EUR	600.000	6.929,92
18- Okt-23	Interest Rate Swap	-	Euribor 6M	0,455%	EUR	1.200.000	-6.606,32
19- Jul-30	Interest Rate Swap	-	0,906%	Euribor 6M	EUR	750.000	-30.206,04
19- Jul-50	Interest Rate Swap	-	Euribor 6M	0,930%	EUR	300.000	50.018,72
20- Jul-31	Interest Rate Swap	-	1,320%	Euribor 6M	EUR	1.700.000	-45.876,82
24-Nov-19	Interest Rate Swap	-	Euribor 6M	-0,074%	EUR	4.600.000	-10.351,38
29-Nov-26	Interest Rate Swap	-	Euribor 6M	1,211%	EUR	1.450.000	-1.000,23
10-Dez-56	Interest Rate Swap	-	1,263%	Euribor 6M	EUR	1.100.000	-14.858,91
10-Dez-66	Interest Rate Swap	-	Euribor 6M	0,925%	EUR	1.100.000	22.166,23
23-Jan-22	Interest Rate Swap	-	Euribor 6M	0,330%	EUR	2.200.000	-14.601,60
23-Jan-27	Interest Rate Swap	-	1,363%	Euribor 6M	EUR	1.300.000	8.311,00
19-Jun-22	Interest Rate Swap	-	Euribor 6M	0,147%	EUR	3.500.000	-5.058,18
23-Jun-27	Interest Rate Swap	-	1,354%	Euribor 6M	EUR	1.400.000	1.913,70
30-Jun-22	Interest Rate Swap	-	Euribor 6M	0,223%	EUR	4.000.000	-17.527,51
18-Jul-56	Interest Rate Swap	-	Libor 6M	1,007%	GBP	850.000	41.674,51
29- Jul-26	Interest Rate Swap	-	Libor 6M	1,105%	GBP	1.300.000	36.619,10
30- Jul-21	Interest Rate Swap	-	0,591%	Libor 6M	GBP	2.100.000	-38.527,29
29-Jul-46	Interest Rate Swap	-	Libor 6M	1,053%	GBP	250.000	37.203,40
29-Jul-21	Interest Rate Swap	-	Libor 6M	0,550%	GBP	1.300.000	25.660,49
01-Sep-21	Interest Rate Swap	-	Libor 6M	0,486%	GBP	1.300.000	29.787,21
13-Sep-21	Interest Rate Swap	-	Libor 6M	0,566%	GBP	2.500.000	51.014,42
22-Okt-20	Interest Rate Swap	-	Libor 6M	0,772%	GBP	4.800.000	33.557,95
24-Okt-19	Interest Rate Swap	-	0,660%	Libor 6M	GBP	4.800.000	-20.132,56
03-Nov-18	Interest Rate Swap	-	Libor 6M	0,622%	GBP	600.000	408,81
13-Jan-22	Interest Rate Swap	-	0,915%	Libor 6M	GBP	4.000.000	-40.420,15
16-Jan-27	Interest Rate Swap	-	Libor 6M	1,296%	GBP	600.000	8.687,40
23-Jan-21	Interest Rate Swap	-	Libor 6M	1,116%	GBP	3.000.000	2.065,69
21-Jun-27	Interest Rate Swap	-	Libor 6M	1,464%	GBP	1.300.000	14.997,59
01-Dez-26	Interest Rate Swap	-	2,025%	Telbor 3M	ILS	700.000	2.796,63
21-Sep-26	Interest Rate Swap	-	Libor 6M	0,100%	JPY	84.000.000	4.913,57

Fälligkeit	Kontrakt	Basiswert	Erhaltener Zinssatz	Gezahlter Zinssatz	Währung	Nominal	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (in Teilfonds-Währung)
14-Nov-46	Interest Rate Swap	-	Libor 6M	0,595%	JPY	28.000.000	8.718,50
07-Feb-27	Interest Rate Swap	-	Libor 6M	0,460%	JPY	159.000.000	-9.725,51
07-Feb-52	Interest Rate Swap	-	1,278%	Libor 6M	JPY	159.000.000	7.716,34
09-Nov-21	Interest Rate Swap	-	7,250%	TIIE 1M	MXN	9.400.000	-8.003,44
08-Dez-21	Interest Rate Swap	-	7,190%	TIIE 1M	MXN	9.300.000	-8.752,29
02-Jan-20	Interest Rate Swap	-	7,560%	TIIE 1M	MXN	14.500.000	-5.216,48
04- Jan-22	Interest Rate Swap	-	7,837%	TIIE 1M	MXN	11.000.000	-860,10
05- Mrz-19	Interest Rate Swap	-	7,260%	TIIE 1M	MXN	33.000.000	-9.284,83
04-Apr-19	Interest Rate Swap	-	7,185%	TIIE 1M	MXN	63.000.000	-21.326,21
19-Okt-27	Interest Rate Swap	-	Nibor 6M	2,400%	NOK	12.800.000	6.734,06
21-Okt-21	Interest Rate Swap	-	1,620%	Nibor 6M	NOK	28.000.000	-11.110,39
16- Jun-27	Interest Rate Swap	-	Nibor 6M	1,860%	NOK	5.000.000	11.241,41
17- Jun-21	Interest Rate Swap	-	1,500%	Nibor 6M	NOK	24.000.000	-11.030,22
20- Feb-22	Interest Rate Swap	-	3,695%	BKBM 3M	NZD	4.900.000	58.830,13
21- Feb-28	Interest Rate Swap	-	1,453%	Stibor 3M	SEK	6.000.000	19.170,02
21-Feb-20	Interest Rate Swap	-	Stibor 3M	-0,090%	SEK	28.000.000	-6.010,80
29-Nov-18	Interest Rate Swap	-	Stibor 3M	-0,419%	SEK	34.600.000	746,57
23-Jan-20	Interest Rate Swap	-	Stibor 3M	-0,100%	SEK	21.000.000	-4.438,76
30-Jan-28	Interest Rate Swap	-	2,280%	Sibor 6M	SGD	550.000	-8.607,49
03-Mär-27	Interest Rate Swap	-	2,590%	Sibor 6M	SGD	1.000.000	2.873,62
18-Okt-23	Interest Rate Swap	-	2,165%	Libor 3M	USD	1.500.000	-43.732,11
18-Okt-28	Interest Rate Swap	-	Libor 3M	2,371%	USD	800.000	33.567,98
21-Dez-27	Interest Rate Swap	-	Libor 3M	2,412%	USD	500.000	17.662,69
12-Mär-22	Interest Rate Swap	-	2,893%	Libor 3M	USD	2.000.000	-1.390,48
14-Mär-24	Interest Rate Swap	-	Libor 3M	2,930%	USD	2.000.000	-579,13
20-Jul-31	Interest Rate Swap	-	Libor 3M	2,079%	USD	2.000.000	61.918,74
20-Jul-26	Interest Rate Swap	-	Libor 3M	1,773%	USD	2.000.000	85.172,46
20-Jul-31	Interest Rate Swap	-	Libor 3M	2,095%	USD	1.200.000	36.505,45
20-Jul-23	Interest Rate Swap	-	1,403%	Libor 3M	USD	1.200.000	-70.553,41
02-Aug-21	Interest Rate Swap	-	1,068%	Libor 3M	USD	1.700.000	-76.574,31
01-Sep-21	Interest Rate Swap	-	1,195%	Libor 3M	USD	1.700.000	-72.959,14
24-Sep-48	Interest Rate Swap	-	Libor 3M	1,965%	USD	400.000	68.007,75
24-Sep-23	Interest Rate Swap	-	1,520%	Libor 3M	USD	1.700.000	-92.927,17
14-Jan-21	Interest Rate Swap	-	2,180%	Libor 3M	USD	3.800.000	-45.535,39
14-Jan-49	Interest Rate Swap	-	Libor 3M	2,570%	USD	400.000	24.858,72
13-Jan-32	Interest Rate Swap	-	Libor 3M	2,680%	USD	1.000.000	20.441,22
13-Jan-24	Interest Rate Swap	-	2,525%	Libor 3M	USD	4.100.000	-24.094,54
23-Jan-27	Interest Rate Swap	-	Libor 3M	2,753%	USD	1.600.000	10.357,70
23-Jan-22	Interest Rate Swap	-	2,377%	Libor 3M	USD	2.500.000	-33.039,47
07-Feb-27	Interest Rate Swap	-	2,827%	Libor 3M	USD	1.600.000	-6.047,42
07-Feb-52	Interest Rate Swap	-	Libor 3M	2,655%	USD	1.600.000	1.482,70
21-Feb-22	Interest Rate Swap	-	Libor 3M	2,502%	USD	3.500.000	24.606,99
21-Feb-20	Interest Rate Swap	-	2,030%	Libor 3M	USD	3.500.000	-34.838,27
13-Jun-19	Interest Rate Swap	-	1,550%	Libor 3M	USD	4.000.000	-33.840,08
13-Jun-22	Interest Rate Swap	-	Libor 3M	1,862%	USD	1.700.000	54.414,48
						Gesamt:	**-771.626,76**

Amundi S.F. - Saving Box II

Fälligkeit	Kontrakt	Basiswert	Erhaltener Zinssatz	Gezahlter Zinssatz	Währung	Nominal	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (in Teilfonds-Währung)
20-Dez-21	Credit Default Swap Buyer	Anadarko Petroleum Corp	-	1,000%	USD	120.000	-2.124,12
20-Dez-21	Credit Default Swap Buyer	Apache Corp	-	1,000%	USD	120.000	-1.906,66
20-Jun-22	Credit Default Swap Buyer	Aust & NZ Banking Group	-	1,000%	USD	450.000	-7.409,36
20-Dez-21	Credit Default Swap Buyer	Canadian Natural Ressources	-	1,000%	USD	115.000	-2.324,41
20-Dez-21	Credit Default Swap Buyer	CDX NA HY 27 Index	-	5,000%	USD	2.450.000	-146.771,34
20-Jun-22	Credit Default Swap Buyer	Commonwealth Bank Aust.	-	1,000%	USD	450.000	-7.915,36

Fälligkeit	Kontrakt	Basiswert	Erhaltener Zinssatz	Gezahlter Zinssatz	Währung	Nominal	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (in Teilfonds-Währung)
20-Dez-21	Credit Default Swap Buyer	Developers Diversified Realty Corp	-	1,000%	USD	115.000	-1.415,13
20-Dez-21	Credit Default Swap Buyer	Enbridge Inc	-	1,000%	USD	120.000	-1.565,85
20-Jun-23	Credit Default Swap Buyer	iTraxx Europe Crossover Series 29 Index	-	5,000%	EUR	15.000.000	-1.135.629,06
20-Jun-23	Credit Default Swap Buyer	iTraxx Europe Crossover Series 29 Index	-	5,000%	EUR	9.000.000	-681.377,44
20-Jun-23	Credit Default Swap Buyer	iTraxx Europe Series 29 Index	-	1,000%	EUR	22.000.000	-262.718,56
20-Jun-23	Credit Default Swap Buyer	iTraxx Europe Series 29 Index	-	1,000%	EUR	2.500.000	-29.854,38
20-Jun-22	Credit Default Swap Buyer	Macquarie Bank Ltd	-	1,000%	USD	450.000	-5.830,57
20-Jun-22	Credit Default Swap Buyer	National Australia Bank	-	1,000%	USD	450.000	-7.497,53
20-Dez-21	Credit Default Swap Buyer	Ryder System Inc	-	1,000%	USD	115.000	-1.744,31
20-Jun-22	Credit Default Swap Buyer	Westpac Bank	-	1,000%	USD	450.000	-7.441,60
11-Jan-22	Inflation Swap	-	1M TCPI Index	1,100%	EUR	3.400.000	11.669,02
08-Feb-22	Inflation Swap	-	1M FRCPXTOB Index	1,364%	EUR	3.800.000	-2.129,30
15- Mrz-20	Inflation Swap	-	1M TCPI Index	0,870%	EUR	3.800.000	17.360,36
16- Jan-27	Inflation Swap	-	3,633%	1M UKRPI Index	GBP	1.100.000	44.307,53
25-Jan-27	Inflation Swap	-	1M JCPNGENF Index	0,620%	JPY	52.500.000	-2.197,51
26-Jan-27	Inflation Swap	-	1M JCPNGENF Index	0,620%	JPY	102.500.000	-4.296,45
23-Jan-47	Inflation Swap	-	1M CPURNSA Index	2,338%	USD	750.000	-5.042,43
16-Oct-19	Inflation Swap	-	2,070%	1D CPURNSA Index	USD	10.000.000	-52.770,95
16-Oct-27	Inflation Swap	-	1M CPURNSA Index	2,168%	USD	2.200.000	37.675,74
16-Dez-26	Interest Rate Swap	-	BBSW 6M	3,071%	AUD	2.100.000	-33.289,78
20-Dez-27	Interest Rate Swap	-	2,755%	BBSW 6M	AUD	1.300.000	-3.224,87
30-Sep-46	Interest Rate Swap	-	Cdor 3M	1,550%	CAD	900.000	125.679,57
15-Okt-20	Interest Rate Swap	-	2,113%	Cdor 3M	CAD	6.300.000	-14.254,66
15-Okt-23	Interest Rate Swap	-	Cdor 3M	2,245%	CAD	2.600.000	16.662,60
21-Dez-27	Interest Rate Swap	-	Libor 6M	0,236%	CHF	900.000	9.200,67
12-Sep-22	Interest Rate Swap	-	3,315%	Clibo 1D	CLP	390.000.000	-8.791,87
09-Jan-23	Interest Rate Swap	-	3,963%	China IRS 1W	CNY	7.000.000	23.989,38
24-Nov-19	Interest Rate Swap	-	0,144%	Cibor 6M	DKK	68.000.000	33.693,13
24-Nov-19	Interest Rate Swap	-	Euribor 6M	-0,074%	EUR	9.000.000	-20.252,68
29-Nov-26	Interest Rate Swap	-	Euribor 6M	1,211%	EUR	2.750.000	-1.896,98
10-Dez-66	Interest Rate Swap	-	Euribor 6M	0,925%	EUR	2.200.000	44.332,51
10-Dez-56	Interest Rate Swap	-	1,263%	Euribor 6M	EUR	2.200.000	-29.717,77
23-Jan-22	Interest Rate Swap	-	Euribor 6M	0,330%	EUR	4.300.000	-28.539,50
23-Jan-27	Interest Rate Swap	-	1,363%	Euribor 6M	EUR	2.700.000	17.261,31
19-Jun-22	Interest Rate Swap	-	Euribor 6M	0,147%	EUR	7.300.000	-10.549,91
23-Jun-27	Interest Rate Swap	-	1,354%	Euribor 6M	EUR	3.000.000	4.100,80
30-Jun-22	Interest Rate Swap	-	Euribor 6M	0,223%	EUR	8.000.000	-35.055,04
18-Okt-23	Interest Rate Swap	-	Euribor 6M	0,455%	EUR	2.500.000	-13.763,19
18-Okt-28	Interest Rate Swap	-	1,066%	Euribor 6M	EUR	1.250.000	14.437,31
24-Okt-19	Interest Rate Swap	-	0,660%	Libor 6M	GBP	9.300.000	-39.006,87
22-Okt-20	Interest Rate Swap	-	Libor 6M	0,772%	GBP	9.300.000	65.018,51
03-Nov-18	Interest Rate Swap	-	Libor 6M	0,622%	GBP	6.400.000	4.360,70
10-Nov-21	Interest Rate Swap	-	Libor 6M	0,926%	GBP	4.900.000	42.421,07
16-Jan-27	Interest Rate Swap	-	Libor 6M	1,296%	GBP	1.100.000	15.926,85
23-Jan-21	Interest Rate Swap	-	Libor 6M	1,116%	GBP	5.500.000	3.787,09
21-Jun-27	Interest Rate Swap	-	Libor 6M	1,464%	GBP	2.800.000	32.302,48
01-Dez-26	Interest Rate Swap	-	2,025%	Telbor 3M	ILS	1.350.000	5.393,49
13- Okt-26	Interest Rate Swap	-	Libor 6M	0,080%	JPY	165.000.000	12.041,17
14- Nov-46	Interest Rate Swap	-	Libor 6M	0,595%	JPY	55.000.000	17.125,55
07-Feb-27	Interest Rate Swap	-	Libor 6M	0,460%	JPY	313.000.000	-19.145,21
07-Feb-52	Interest Rate Swap	-	1,278%	Libor 6M	JPY	313.000.000	15.190,01
09-Nov-21	Interest Rate Swap	-	7,250%	TIIE 1M	MXN	18.350.000	-15.623,73
08-Dez-21	Interest Rate Swap	-	7,190%	TIIE 1M	MXN	18.000.000	-16.939,93

Fälligkeit	Kontrakt	Basiswert	Erhaltener Zinssatz	Gezahlter Zinssatz	Währung	Nominal	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (in Teilfonds-Währung)
02-Jan-20	Interest Rate Swap	-	7,560%	TIIE 1M	MXN	27.500.000	-9.893,32
04- Jan-22	Interest Rate Swap	-	7,837%	TIIE 1M	MXN	20.500.000	-1.602,92
05- Mrz-19	Interest Rate Swap	-	7,260%	TIIE 1M	MXN	66.500.000	-18.710,35
04-Apr-19	Interest Rate Swap	-	7,185%	TIIE 1M	MXN	126.000.000	-42.652,43
16- Jun-27	Interest Rate Swap	-	Nibor 6M	1,860%	NOK	10.000.000	22.482,81
17- Jun-21	Interest Rate Swap	-	1,500%	Nibor 6M	NOK	50.000.000	-22.979,63
21-Okt-21	Interest Rate Swap	-	1,620%	Nibor 6M	NOK	60.000.000	-23.807,98
19- Okt-27	Interest Rate Swap	-	Nibor 6M	2,400%	NOK	27.000.000	14.204,66
20- Feb-22	Interest Rate Swap	-	3,695%	BKBM 3M	NZD	9.700.000	116.459,63
29-Nov-18	Interest Rate Swap	-	Stibor 3M	-0,419%	SEK	67.200.000	1.450,01
23-Jan-20	Interest Rate Swap	-	Stibor 3M	-0,100%	SEK	41.800.000	-8.835,23
21-Feb-28	Interest Rate Swap	-	1,453%	Stibor 3M	SEK	12.500.000	39.937,54
21-Feb-20	Interest Rate Swap	-	Stibor 3M	-0,090%	SEK	60.000.000	-12.880,30
03-Mär-27	Interest Rate Swap	-	2,590%	Sibor 6M	SGD	2.000.000	5.747,26
30-Jan-28	Interest Rate Swap	-	2,280%	Sibor 6M	SGD	1.140.000	-17.840,96
14-Jan-21	Interest Rate Swap	-	2,180%	Libor 3M	USD	7.300.000	-87.475,86
14-Jan-49	Interest Rate Swap	-	Libor 3M	2,570%	USD	750.000	46.610,08
13-Jan-32	Interest Rate Swap	-	Libor 3M	2,680%	USD	1.800.000	36.794,20
13-Jan-24	Interest Rate Swap	-	2,525%	Libor 3M	USD	7.800.000	-45.838,38
23-Jan-27	Interest Rate Swap	-	Libor 3M	2,753%	USD	3.200.000	20.715,40
23-Jan-22	Interest Rate Swap	-	2,377%	Libor 3M	USD	5.000.000	-66.078,92
07-Feb-27	Interest Rate Swap	-	2,827%	Libor 3M	USD	3.200.000	-12.094,85
07-Feb-52	Interest Rate Swap	-	Libor 3M	2,655%	USD	3.200.000	2.965,41
21-Feb-22	Interest Rate Swap	-	Libor 3M	2,502%	USD	7.000.000	49.213,99
21-Feb-20	Interest Rate Swap	-	2,030%	Libor 3M	USD	7.000.000	-69.676,54
13-Jun-19	Interest Rate Swap	-	1,550%	Libor 3M	USD	8.500.000	-71.910,18
13-Jun-22	Interest Rate Swap	-	Libor 3M	1,862%	USD	3.600.000	115.230,68
18-Okt-23	Interest Rate Swap	-	2,165%	Libor 3M	USD	3.200.000	-93.295,15
18-Okt-28	Interest Rate Swap	-	Libor 3M	2,371%	USD	1.700.000	71.331,92
21-Dez-27	Interest Rate Swap	-	Libor 3M	2,412%	USD	1.000.000	35.325,40
12-Mär-22	Interest Rate Swap	-	2,893%	Libor 3M	USD	4.000.000	-2.780,94
14-Mär-24	Interest Rate Swap	-	Libor 3M	2,930%	USD	4.000.000	-1.158,27
						Summe:	**-2.077.120,68**

Amundi S.F. - Saving Box III

Fälligkeit	Kontrakt	Basiswert	Erhaltener Zinssatz	Gezahlter Zinssatz	Währung	Nominal	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (in Teilfonds-Währung)
20-Dez-21	Credit Default Swap Buyer	Anadarko Petroleum Corp	-	1,000%	USD	35.000	-619,53
20-Dez-21	Credit Default Swap Buyer	Apache Corp	-	1,000%	USD	35.000	-556,11
20-Jun-22	Credit Default Swap Buyer	Aust & NZ Banking Group	-	1,000%	USD	150.000	-2.469,78
20-Dez-21	Credit Default Swap Buyer	Canadian Natural Ressources	-	1,000%	USD	35.000	-707,42
20-Dez-21	Credit Default Swap Buyer	CDX NA HY 27 Index	-	5,000%	USD	784.000	-46.966,83
20-Jun-22	Credit Default Swap Buyer	Commonwealth Bank Aust.	-	1,000%	USD	150.000	-2.638,45
20-Dez-21	Credit Default Swap Buyer	Developers Diversified Realty Corp	-	1,000%	USD	35.000	-430,68
20-Dez-21	Credit Default Swap Buyer	Enbridge Inc	-	1,000%	USD	35.000	-456,70
20-Jun-23	Credit Default Swap Buyer	iTraxx Europe Crossover Series 29 Index	-	5,000%	EUR	1.000.000	-75.708,60
20-Jun-23	Credit Default Swap Buyer	iTraxx Europe Crossover Series 29 Index	-	5,000%	EUR	3.000.000	-227.125,81
20-Jun-23	Credit Default Swap Buyer	iTraxx Europe Crossover Series 29 Index	-	5,000%	EUR	3.700.000	-280.121,84
20-Jun-23	Credit Default Swap Buyer	iTraxx Europe Series 29 Index	-	1,000%	EUR	8.500.000	-101.504,90
20-Jun-23	Credit Default Swap Buyer	iTraxx Europe Series 29 Index	-	1,000%	EUR	2.200.000	-26.271,86
20-Jun-22	Credit Default Swap Buyer	Macquarie Bank Ltd	-	1,000%	USD	150.000	-1.943,52
20-Jun-22	Credit Default Swap Buyer	National Australia Bank	-	1,000%	USD	150.000	-2.499,18
20-Dez-21	Credit Default Swap Buyer	Ryder System Inc	-	1,000%	USD	35.000	-530,87
20-Jun-22	Credit Default Swap Buyer	Westpac Bank	-	1,000%	USD	150.000	-2.480,53

Fälligkeit	Kontrakt	Basiswert	Erhaltener Zinssatz	Gezahlter Zinssatz	Währung	Nominal	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (in Teilfonds-Währung)
11-Jan-22	Inflation Swap	-	1M TCPI Index	1,100%	EUR	1.100.000	3.775,28
08-Feb-22	Inflation Swap	-	1M FRCPXTOB Index	1,364%	EUR	1.150.000	-644,40
15- Mrz-20	Inflation Swap	-	1M TCPI Index	0,870%	EUR	1.200.000	5.482,22
16- Jan-27	Inflation Swap	-	3,633%	1M UKRPI Index	GBP	350.000	14.097,85
23-Jan-47	Inflation Swap	-	1M CPURNSA Index	2,338%	USD	250.000	-1.680,81
16-Oct-19	Inflation Swap	-	2,070%	1D CPURNSA Index	USD	3.500.000	-18.469,82
16-Oct-27	Inflation Swap	-	1M CPURNSA Index	2,168%	USD	750.000	12.844,02
20-Dez-27	Interest Rate Swap	-	2,755%	BBSW 6M	AUD	450.000	-1.116,29
16-Dez-26	Interest Rate Swap	-	BBSW 6M	3,071%	AUD	650.000	-10.287,46
15-Okt-23	Interest Rate Swap	-	Cdor 3M	2,245%	CAD	900.000	5.767,83
15-Okt-20	Interest Rate Swap	-	2,113%	Cdor 3M	CAD	2.200.000	-4.977,81
15-Dez-46	Interest Rate Swap	-	Cdor 3M	2,460%	CAD	250.000	5.264,83
21-Dez-27	Interest Rate Swap	-	Libor 6M	0,236%	CHF	300.000	3.066,88
12-Sep-22	Interest Rate Swap	-	3,315%	Clibo 1D	CLP	135.000.000	-3.043,35
09-Jan-23	Interest Rate Swap	-	3,963%	China IRS 1W	CNY	2.500.000	8.567,61
16-Dez-19	Interest Rate Swap	-	0,125%	Cibor 6M	DKK	16.000.000	8.114,04
21-Dez-26	Interest Rate Swap	-	Euribor 6M	0,757%	EUR	400.000	-1.223,76
23-Jan-22	Interest Rate Swap	-	Euribor 6M	0,330%	EUR	1.300.000	-8.628,23
23-Jan-27	Interest Rate Swap	-	1,363%	Euribor 6M	EUR	850.000	5.434,12
19-Jun-22	Interest Rate Swap	-	Euribor 6M	0,147%	EUR	2.300.000	-3.323,96
23-Jun-27	Interest Rate Swap	-	1,354%	Euribor 6M	EUR	850.000	1.161,89
30-Jun-22	Interest Rate Swap	-	Euribor 6M	0,223%	EUR	2.800.000	-12.269,26
18-Okt-23	Interest Rate Swap	-	Euribor 6M	0,455%	EUR	900.000	-4.954,75
18-Okt-28	Interest Rate Swap	-	1,066%	Euribor 6M	EUR	450.000	5.197,45
16-Dez-19	Interest Rate Swap	-	Euribor 6M	-0,096%	EUR	2.000.000	-3.875,74
16-Jan-27	Interest Rate Swap	-	Libor 6M	1,296%	GBP	350.000	5.067,58
23-Jan-21	Interest Rate Swap	-	Libor 6M	1,116%	GBP	1.800.000	1.239,42
21-Jun-27	Interest Rate Swap	-	Libor 6M	1,464%	GBP	900.000	10.382,94
20- Dez-26	Interest Rate Swap	-	2,135%	Telbor 3M	ILS	400.000	2.341,77
21- Dez-26	Interest Rate Swap	-	Libor 6M	0,275%	JPY	51.000.000	-2.501,04
07-Feb-27	Interest Rate Swap	-	Libor 6M	0,460%	JPY	97.000.000	-5.933,18
07-Feb-52	Interest Rate Swap	-	1,278%	Libor 6M	JPY	97.000.000	4.707,44
02-Jan-20	Interest Rate Swap	-	7,560%	TIIE 1M	MXN	8.250.000	-2.967,99
04- Jan-22	Interest Rate Swap	-	7,837%	TIIE 1M	MXN	6.250.000	-488,69
05- Mrz-19	Interest Rate Swap	-	7,260%	TIIE 1M	MXN	20.500.000	-5.767,85
04-Apr-19	Interest Rate Swap	-	7,185%	TIIE 1M	MXN	41.000.000	-13.878,96
09-Dez-21	Interest Rate Swap	-	7,240%	TIIE 1M	MXN	10.800.000	-9.474,54
17-Jun-21	Interest Rate Swap	-	1,500%	Nibor 6M	NOK	14.000.000	-6.434,30
16-Jun-27	Interest Rate Swap	-	Nibor 6M	1,860%	NOK	3.000.000	6.744,85
19-Okt-27	Interest Rate Swap	-	Nibor 6M	2,400%	NOK	9.500.000	4.997,94
21-Okt-21	Interest Rate Swap	-	1,620%	Nibor 6M	NOK	20.000.000	-7.935,99
21-Dez-26	Interest Rate Swap	-	3,604%	BKBM 3M	NZD	650.000	19.591,84
20-Feb-22	Interest Rate Swap	-	3,695%	BKBM 3M	NZD	3.000.000	36.018,45
23-Jan-20	Interest Rate Swap	-	Stibor 3M	-0,100%	SEK	12.700.000	-2.684,40
21-Feb-20	Interest Rate Swap	-	Stibor 3M	-0,090%	SEK	22.000.000	-4.722,77
21-Feb-28	Interest Rate Swap	-	1,453%	Stibor 3M	SEK	4.600.000	14.697,01
16-Dez-18	Interest Rate Swap	-	Stibor 3M	-0,420%	SEK	20.000.000	408,11
03-Mär-27	Interest Rate Swap	-	2,590%	Sibor 6M	SGD	600.000	1.724,17
30-Jan-28	Interest Rate Swap	-	2,280%	Sibor 6M	SGD	415.000	-6.494,73
14-Jan-21	Interest Rate Swap	-	2,180%	Libor 3M	USD	2.200.000	-26.362,60
14-Jan-49	Interest Rate Swap	-	Libor 3M	2,570%	USD	250.000	15.536,69
13-Jan-32	Interest Rate Swap	-	Libor 3M	2,680%	USD	600.000	12.264,73
13-Jan-24	Interest Rate Swap	-	2,525%	Libor 3M	USD	2.300.000	-13.516,43
23-Jan-27	Interest Rate Swap	-	Libor 3M	2,753%	USD	1.000.000	6.473,55
23-Jan-22	Interest Rate Swap	-	2,377%	Libor 3M	USD	1.500.000	-19.823,67
07-Feb-27	Interest Rate Swap	-	2,827%	Libor 3M	USD	1.000.000	-3.779,64

Fälligkeit	Kontrakt	Basiswert	Erhaltener Zinssatz	Gezahlter Zinssatz	Währung	Nominal	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (in Teilfonds-Währung)
07-Feb-52	Interest Rate Swap	-	Libor 3M	2,655%	USD	1.000.000	926,68
21-Feb-22	Interest Rate Swap	-	Libor 3M	2,502%	USD	2.100.000	14.764,20
21-Feb-20	Interest Rate Swap	-	2,030%	Libor 3M	USD	2.100.000	-20.902,96
13-Jun-22	Interest Rate Swap	-	Libor 3M	1,862%	USD	1.200.000	38.410,24
13-Jun-19	Interest Rate Swap	-	1,550%	Libor 3M	USD	2.900.000	-24.534,05
18-Okt-28	Interest Rate Swap	-	Libor 3M	2,371%	USD	600.000	25.175,97
18-Okt-23	Interest Rate Swap	-	2,165%	Libor 3M	USD	1.100.000	-32.070,21
21-Dez-27	Interest Rate Swap	-	Libor 3M	2,412%	USD	350.000	12.363,82
12-Mär-22	Interest Rate Swap	-	2,893%	Libor 3M	USD	1.500.000	-1.042,86
14-Mär-24	Interest Rate Swap	-	Libor 3M	2,930%	USD	1.500.000	-434,35
						Summe	**-746.668,04**

Amundi S.F. - Diversified Target Income 11/2021

Fälligkeit	Kontrakt	Basiswert	Erhaltener Zinssatz	Gezahlter Zinssatz	Währung	Nominal	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (in Teilfonds-Währung)
20-Jun-23	Credit Default Swap Buyer	Cdx EM 29 Index	-	1,000%	USD	1.500.000	51.248,32
20-Jun-23	Credit Default Swap Buyer	CDX NA HY 30 Index	-	5,000%	USD	300.000	-15.063,85
20-Jun-23	Credit Default Swap Buyer	CDX NA IG 30 Index	-	1,000%	USD	800.000	-10.128,10
20-Jun-23	Credit Default Swap Buyer	CDX NA IG 30 Index	-	1,000%	USD	1.200.000	-15.192,16
20-Jun-23	Credit Default Swap Buyer	iTraxx Europe Crossover Series 29 Index	-	5,000%	EUR	1.000.000	-75.708,60
20-Jun-23	Credit Default Swap Buyer	iTraxx Europe Senior Fin. Series 29 Index	-	1,000%	EUR	300.000	-863,01
20-Jun-23	Credit Default Swap Buyer	iTraxx Europe Senior Fin. Series 29 Index	-	1,000%	EUR	400.000	-1.150,69
20-Jun-23	Credit Default Swap Buyer	iTraxx Europe Series 29 Index	-	1,000%	EUR	600.000	-7.165,05
20-Jun-23	Credit Default Swap Buyer	iTraxx Europe Series 29 Index	-	1,000%	EUR	200.000	-2.388,35
07-Nov-26	Inflation Swap	-	1M CPTFEMU Index	1,150%	EUR	450.000	16.069,26
19- Jan-27	Inflation Swap	-	3,596%	1M UKRPI Index	GBP	650.000	23.260,67
20- Jul-27	Inflation Swap	-	1M CPURNSA Index	2,120%	USD	1.200.000	20.710,55
14-Sep-27	Inflation Swap	-	1M CPURNSA Index	2,149%	USD	100.000	1.897,08
18-Okt-19	Inflation Swap	-	1,991%	1D CPURNSA Index	USD	6.250.000	-38.025,46
13-Feb-27	Interest Rate Swap	-	BBSW 6M	2,934%	AUD	850.000	-7.391,20
01-Nov-26	Interest Rate Swap	-	Libor 6M	1,000%	GBP	550.000	22.205,13
01-Nov-18	Interest Rate Swap	-	0,630%	Libor 6M	GBP	2.500.000	-1.721,12
19-Jan-27	Interest Rate Swap	-	Libor 6M	1,383%	GBP	700.000	4.496,37
03-Mai-19	Interest Rate Swap	-	0,560%	Libor 6M	GBP	900.000	-2.619,76
24-Jul-47	Interest Rate Swap	-	Libor 6M	1,536%	GBP	550.000	10.675,17
24- Apr-48	Interest Rate Swap	-	Libor 6M	1,708%	GBP	150.000	-4.313,61
25- Mai-20	Interest Rate Swap	-	1,031%	Libor 6M	GBP	1.000.000	1.068,92
14-Feb-27	Interest Rate Swap	-	3,435%	BKBM 3M	NZD	900.000	20.179,65
18-Jan-28	Interest Rate Swap	-	BKBM 3M	3,208%	NZD	900.000	-9.187,15
12-Dez-26	Interest Rate Swap	-	Stibor 3M	1,189%	SEK	5.050.000	-9.440,78
02-Feb-27	Interest Rate Swap	-	Stibor 3M	1,299%	SEK	5.400.000	-14.240,33
						Summe:	**-42.788,10**

Amundi S.F. - Diversified Target Income 11/2022

Fälligkeit	Kontrakt	Basiswert	Erhaltener Zinssatz	Gezahlter Zinssatz	Währung	Nominal	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (in Teilfonds-Währung)
20-Jun-23	Credit Default Swap Buyer	Cdx EM 29 Index	-	1,000%	USD	1.000.000	34.165,54
20-Jun-23	Credit Default Swap Buyer	CDX NA HY 30 Index	-	5,000%	USD	400.000	-20.085,15
20-Jun-23	Credit Default Swap Buyer	CDX NA IG 30 Index	-	1,000%	USD	2.250.000	-28.485,27
20-Jun-23	Credit Default Swap Buyer	iTraxx Europe Crossover Series 29 Index	-	5,000%	EUR	1.000.000	-75.708,60

Fälligkeit	Kontrakt	Basiswert	Erhaltener Zinssatz	Gezahlter Zinssatz	Währung	Nominal	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (in Teilfonds-Währung)
20-Jun-23	Credit Default Swap Buyer	iTraxx Europe Senior Fin. Series 29 Index	-	1,000%	EUR	800.000	-2.301,37
20-Jun-23	Credit Default Swap Buyer	iTraxx Europe Series 29 Index	-	1,000%	EUR	700.000	-8.359,23
20-Jun-23	Credit Default Swap Buyer	iTraxx Europe Series 29 Index	-	1,000%	EUR	200.000	-2.388,35
17-Jan-27	Inflation Swap	-	1M CPTFEMU Index	1,473%	EUR	450.000	3.153,70
19-Jan-27	Inflation Swap	-	3,596%	1M UKRPI Index	GBP	650.000	23.260,67
21-Jul-27	Inflation Swap	-	1M UKRPI Index	3,330%	GBP	50.000	-276,26
20-Jul-27	Inflation Swap	-	1M CPURNSA Index	2,120%	USD	1.400.000	24.162,33
14-Sep-27	Inflation Swap	-	1M CPURNSA Index	2,149%	USD	100.000	1.897,08
18-Okt-19	Inflation Swap	-	1,991%	1D CPURNSA Index	USD	7.000.000	-42.588,54
30-Nov-19	Inflation Swap	-	1,920%	1D CPURNSA Index	USD	100.000	-495,91
13-Feb-27	Interest Rate Swap	-	BBSW 6M	2,934%	AUD	900.000	-7.825,96
12-Jan-27	Interest Rate Swap	-	Libor 6M	1,269%	GBP	500.000	8.456,56
12-Jan-19	Interest Rate Swap	-	0,610%	Libor 6M	GBP	2.450.000	-2.702,19
19-Jan-27	Interest Rate Swap	-	Libor 6M	1,383%	GBP	750.000	4.817,57
03-Mai-19	Interest Rate Swap	-	0,560%	Libor 6M	GBP	500.000	-1.455,44
13-Jul-19	Interest Rate Swap	-	0,652%	Libor 6M	GBP	1.000.000	-2.518,90
25-Jul-47	Interest Rate Swap	-	Libor 6M	1,549%	GBP	600.000	9.499,65
24-Apr-48	Interest Rate Swap	-	Libor 6M	1,708%	GBP	200.000	-5.751,45
25-Mai-20	Interest Rate Swap	-	1,031%	Libor 6M	GBP	650.000	694,81
14-Feb-27	Interest Rate Swap	-	3,435%	BKBM 3M	NZD	950.000	21.300,74
18-Jan-28	Interest Rate Swap	-	BKBM 3M	3,208%	NZD	1.000.000	-10.207,91
20-Jan-27	Interest Rate Swap	-	Stibor 3M	1,105%	SEK	5.600.000	-6.195,24
02-Feb-27	Interest Rate Swap	-	Stibor 3M	1,299%	SEK	5.550.000	-14.635,90
						Summe:	**-100.573,02**

Amundi S.F. - EUR Commodities

Fälligkeit	Kontrakt	Basiswert	Erhaltener Zinssatz	Gezahlter Zinssatz	Währung	Nominal	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (in Teilfonds-Währung)
10-Jul-18	Commodity Index Swap	BBG Cmdty 2M Fwd	-	0,10%	USD	16.000.000	-550.638,09
10-Jul-18	Commodity Index Swap	BBG Commodity	-	0,07%	USD	66.500.000	-2.059.783,14
10-Jul-18	Commodity Index Swap	BBG Commodity	-	0,07%	USD	85.000.000	-2.632.805,50
10-Jul-18	Commodity Index Swap	BBG Commodity	-	0,09%	USD	44.000.000	-1.362.946,53
10-Jul-18	Commodity Index Swap	BBG Commodity	0,07%	-	USD	5.000.000	44.614,13
10-Jul-18	Commodity Index Swap	BBG Comodity 3M Fwd	-	0,11%	USD	22.000.000	-753.890,70
10-Jul-18	Commodity Index Swap	BBG Comodity 6M Fwd	-	0,13%	USD	36.000.000	-1.281.577,33
						Summe:	**-8.597.027,16**

13 SICHERHEITEN

Per 30. Juni 2018 stellten sich die von Brokern und Gegenparteien zum Zwecke von Transaktionen in OTC-Derivate erhaltenen oder gezahlten Sicherheiten wie folgt dar:

Teilfonds	Teilfonds währung	Gegenpartei	Art der Sicherheit	Höhe der erhaltenen Sicherheit (in Teilfondswährung)	Höhe der gezahlten Sicherheit (in der Teilfondswährung)
Amundi S.F. - Diversified Short-Term Bond	EUR	JP Morgan, Barclays, Société Générale, Morgan Stanley, Citibank, Goldman Sachs	Bargeld	1.340.000,00	3.060.000,00
Amundi S.F. - Emerging Markets Bond 2019	EUR	JP Morgan	Bargeld	-	780.000,00
Amundi S.F. - Absolute Return Multi-Strategy Control	EUR	Morgan Stanley, Goldman Sachs, Merrill Lynch, JP Morgan, BNP Paribas, Citibank	Bargeld	-	2.290.000,00
Amundi S.F. - Saving Box I	EUR	Merrill Lynch, JP Morgan, Nomura	Bargeld	1.450.000,00	-
Amundi S.F. - Saving Box II	EUR	Morgan Stanley, Merrill Lynch, Nomura, Citibank, JP Morgan	Bargeld	1.150.000,00	1.390.000,00
Amundi S.F. - Saving Box III	EUR	Merrill Lynch, Nomura, Citibank	Bargeld	-	1.110.000,00
Amundi S.F. - Equity Plan 60	EUR	Merrill Lynch	Bargeld	-	260.000,00
Amundi S.F. - Diversified Target Income 11/2022	EUR	Goldman Sachs	Bargeld	-	260.000,00
Amundi S.F. - EUR Commodities	EUR	Macquarie, Société Générale, UBS	Bargeld	-	9.700.000,00

14 RICHTLINIEN FÜR DIE STIMMRECHTSVERTRETUNG

Die Verwaltungsgesellschaft hat Richtlinien für die Stimmrechtsvertretung eingeführt, um die Ausübung von mit Portfoliowertpapieren verbundenen Stimmrechten zu ermöglichen. Die Verwaltungsgesellschaft beabsichtigt, die Stimmrechte im besten Interesse des Fonds auszuüben. Mit Stimmrechtsvollmachten werden die wirtschaftlichen Auswirkungen der Vorschläge auf den Wert des Portfolios sowohl auf kurze als auch auf lange Sicht berücksichtigt. Amundi geht davon aus, dass die Unterstützung der Unternehmensstrategie durch ein Votum „für“ die Vorschläge des Managements im Allgemeinen den Wert eines Portfolios steigert. Allerdings können in einigen Fällen die Vorschläge des Managements diesen Wert auch negativ beeinflussen, was sich auf die Stimmabgabe durch die Verwaltungsgesellschaft auswirken kann.
Die Verwaltungsgesellschaft übt Stimmrechte nur im Einklang mit den Richtlinien für die Stimmrechtsvertretung aus und verlangt, sofern sie die Ausübung von Stimmrechten für Portfoliowertpapiere auf einen Investmentmanager übertragen hat, auch von diesem die Einhaltung dieser oder anderer genehmigter Richtlinien. Die Verwaltungsgesellschaft und/oder die Investmentmanager können zusammen die Dienste eines unabhängigen Dritten bei der Analyse von Stimmrechtsvollmachten,

15 SAMMELKLAGEN

Sammelklagen sind Klageverfahren, die es einer Gruppe von Anlegern ermöglichen, von einer Gesellschaft oder einer öffentlichen Stelle im Fall von Verlusten Schadenersatz in Geld zu verlangen. Die Verwaltungsgesellschaft nimmt im Zusammenhang mit Sammelklagen die Dienste von zwei unabhängigen Unternehmen in Anspruch, um eine weltweite Abdeckung sicherzustellen.

VERORDNUNG ÜBER DIE TRANSPARENZ VON WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN

Gemäß der Verordnung (EU) 2015/2365 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 25. November 2015 über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften und der Weiterverwendung fielen die Total-Return-Swap-Geschäfte mit Wirkung zum 30. Juni 2018 unter diese Verordnung.

Total Return Swaps

	Amundi S.F. - Absolute Return Multi-Strategy Control	Amundi S.F. - EUR Commodities
Betrag des Total Return Swaps ausgedrückt in absoluten Werten (in der Teilfondswährung)	34.922,63	8.686.255,42
Anteil des verwalteten Vermögenswertes	0,02%	3,97%
Laufzeit der Total Return Swaps aufgeschlüsselt nach folgenden Laufzeitbändern		
weniger als ein Tag	-	-
ein Tag bis eine Woche	-	-
eine Woche bis ein Monat	-	8.686.255,42
ein Monat bis drei Monate	-	-
drei Monate bis ein Jahr	34.922,63	-
mehr als ein Jahr	-	-
offene Fälligkeit	-	-
Summe	34.922,63	8.686.255,42
Gegenpartei		
Name der Gegenpartei, Sitzland der Gegenpartei und Bruttovolumen ausstehender Geschäfte	GOLDMAN SACHS (GB) EUR 26.894,63	SOCIETE GENERALE (FR) EUR 3.386.696,20
	MERRILL LYNCH (GB) EUR 8.028,00	MACQUARIE GROUP (AU) EUR 3.385.974,60
		UBS (CH) EUR 1.913.584,62
Angaben über die Sicherheiten		
Art der Sicherheit		
Barsicherheiten	siehe Anmerkung 13	siehe Anmerkung 13
Qualität der Sicherheit:	-	-
Rating		
	-	-
Laufzeit der Sicherheit aufgeschlüsselt nach den folgenden Laufzeitbändern (in der Teilfondswährung)		
weniger als ein Tag	siehe Anmerkung 13	siehe Anmerkung 13
ein Tag bis eine Woche	-	-
eine Woche bis ein Monat	-	-
ein Monat bis drei Monate	-	-
drei Monate bis ein Jahr	-	-
mehr als ein Jahr	-	-
offene Fälligkeit	-	-
Summe	siehe Anmerkung 13	siehe Anmerkung 13
Verwahrung der von dem Teilfonds im Rahmen von Gesamtrendite-Swaps erhaltenen Sicherheiten		
Name der Verwahrstelle	SOCIETE GENERALE	SOCIETE GENERALE
Bargeld	siehe Anmerkung 13	siehe Anmerkung 13
Sicherheiten	-	-
Verwahrung der von dem Teilfonds im Rahmen von Gesamtrendite-Swaps gewährten Sicherheiten		
Anteil der gehaltenen Sicherheiten	1,29%	4,43%
Angaben zu Rendite und Kosten der Gesamtrendite-Swaps		
Rendite und Kosten aus Gesamtrendite-Swaps während des Berichtszeitraums (in der Teilfondswährung)	50.209,33	- 2.406.051,00

Angaben zu Rendite und Kosten der Gesamtrendite-Swaps für Teilfonds, die mit Stand vom 30. Juni 2018 keine Total Return Swaps gehalten haben (in der Teilfondswährung):

Amundi S.F. - Commodity Alpha ex-Agriculture*: 1.194.007,64

Sämtliche Geschäfte sind bilaterale Geschäfte.
ISDA Master Agreements sind auf alle OTC-Derivattransaktionen, darunter Total-Return-Swap-Transaktionen, die der Teilfonds eingeht, anwendbar. Ein ISDA Master Agreement ist eine bilaterale Vereinbarung zwischen dem Teilfonds und ihrem Gegenüber, die OTC-Derivativtransaktionen behandelt, einschließlich Total Return Swaps. Die Risiken der OTC-Derivate werden unter dem ISDA Master Agreement verrechnet und zusammen besichert. Aus diesem Grund verweisen wir für Sicherheiteninformationen zu Total Return Swaps auf die Anmerkung 13 zum Jahresabschluss, die die von dem Teilfonds abgeschlossenen OTC-Derivativtransaktionen insgesamt umfasst und berücksichtigt. Die erhaltenen Sicherheiten sind verwahrt und werden nicht wieder verwertet.

*Der Teilfonds wurde am 2. März 2018 aufgelöst

Auflegende Investmentgesellschaft
Amundi S.F.
Amundi Luxembourg S.A.
5, Allée Scheffer,
L-2520 Luxemburg

Tel.: 352 2686 8080

www.amundi.lu.amundi-funds

Amundi
ASSET MANAGEMENT