

Halbjahres-
bericht

Assenagon Alpha

Halbjahresbericht zum 31. Juli 2018

Investmentfonds nach Luxemburger Recht
"Fonds Commun de Placement à Compartiments Multiples"

Inhalt

- 1. Verwaltung und Administration**
- 2. Halbjahresbericht Assenagon Alpha Volatility**
 - Wertpapierbestand und sonstige Vermögensgegenstände
 - Zusammensetzung des Nettoteilfondsvermögens
- 3. Erläuterungen zum Halbjahresbericht**
- 4. Sonstige Angaben**

Wichtige Hinweise

Auf der alleinigen Grundlage dieses Halbjahresberichts können keine Zeichnungen vorgenommen werden. Zeichnungen sind nur gültig, wenn sie auf der Grundlage der wesentlichen Anlegerinformationen und des aktuellen ausführlichen Verkaufsprospekts erfolgen, ergänzt durch den jeweiligen letzten geprüften Jahresbericht. Wenn der Stichtag des Jahresberichts länger als acht Monate zurückliegt, ist dem Erwerber auch ein Halbjahresbericht auszuhändigen.

Gemäß den gesetzlichen Bestimmungen in Luxemburg und in allen anderen maßgeblichen Rechtsgebieten sind die wesentlichen Anlegerinformationen und der ausführliche Verkaufsprospekt, die geprüften Jahresberichte (sofern zutreffend) sowie die ungeprüften Halbjahresberichte kostenfrei am eingetragenen Sitz der Verwaltungsgesellschaft des Fonds erhältlich.

Da sich die Geschäftstätigkeit des Fonds nur auf den Teilfonds Assenagon Alpha Volatility bezogen hat, dient dieser Bericht auch als Halbjahresbericht für den Fonds, es werden keine konsolidierten Zahlen ausgewiesen.

Verwaltung und Administration

VERWALTUNGSGESELLSCHAFT

Assenagon Asset Management S.A.
Aerogolf Center
1B Heienhaff
1736 Senningerberg
Luxemburg

GESCHÄFTSFÜHRER DER VERWALTUNGSGESELLSCHAFT

Hans Günther Bonk
Michael Hünseler
Vassilios Pappas
Dr. Dr. Heimo Plössnig
Dominik Reipen
Thomas Romig
Dr. Robert Wendt

SAMMEL-, ZAHL- UND INFORMATION- STELLE IN DEUTSCHLAND

Baader Bank AG
Weihenstephaner Straße 4
85716 Unterschleißheim
Deutschland

VERTRIEBSSTELLE IN DEUTSCHLAND

Assenagon Asset Management S.A.
Zweigniederlassung München
Prannerstraße 8
80333 München
Deutschland

AUFSICHTSBEHÖRDE

Commission de Surveillance du
Secteur Financier (CSSF)
283, Route d'Arlon
2991 Luxemburg
Luxemburg

VERWALTUNGSRAT DER VERWALTUNGSGESELLSCHAFT

Hans Günther Bonk (Vorsitzender)
Vassilios Pappas
Dr. Dr. Heimo Plössnig

VERWAHRSTELLE, ZENTRALVERWALTUNG, ZAHL-, REGISTER- UND TRANSFERSTELLE IN LUXEMBURG

Brown Brothers Harriman (Luxembourg) S.C.A.
80, Route d'Esch, BP.403
1470 Luxemburg
Luxemburg

ZAHL-, VERTRIEBS- UND INFORMATION- STELLE IN ÖSTERREICH

Erste Bank der oesterreichischen Sparkassen AG
Am Belvedere 1
1100 Wien
Österreich

ABSCHLUSSPRÜFER DES FONDS UND DER VERWALTUNGSGESELLSCHAFT

KPMG Luxembourg, Société coopérative
39, Avenue John F. Kennedy
1855 Luxemburg
Luxemburg

Halbjahresbericht

ASSENAGON ALPHA VOLATILITY

WERTPAPIERBESTAND UND SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE PER 31. JULI 2018

ISIN	Festverzinsliche Wertpapiere	Nennbetrag (000)	Währung	Marktwert (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
Wertpapiere, die an einer amtlichen Wertpapierbörse zugelassen sind.					
Deutschland					
DE0001141679	Bundesobligation 0,000% 12.10.2018	25.000	EUR	25.077,43	0,01
DE0001135374	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 3,750%, 04.01.2019	50.000	EUR	50.964,15	0,01
DE0001135382	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 3,500%, 04.07.2019	50.000	EUR	51.922,75	0,01
DE0001135408	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 3,000%, 04.07.2020	22.000.000	EUR	23.528.582,00	4,52
DE0001104651	Bundesschatzanweisungen 0,000% 14.09.2018	10.000.000	EUR	10.007.100,00	1,93
Summe Festverzinsliche Wertpapiere				33.663.646,33	6,48

Summe der Wertpapiere, die an einer amtlichen Wertpapierbörse zugelassen sind.	33.663.646,33	6,48
---	----------------------	-------------

Tagesgelder				
Kontrahent	Zinssatz	Währung	Nominale (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
Deutschland				
Bayerische Landesbank	-0,47 %	EUR	18.500.000,00	3,56
Bayerische Landesbank	1,20 %	USD	47.006.538,18	9,06
DZ Bank AG	-0,50 %	EUR	16.000.000,00	3,08
Landesbank Baden Württemberg	-0,60 %	EUR	65.000.000,00	12,53
DekaBank	-0,56 %	EUR	65.000.000,00	12,53
Summe Tagesgelder			211.506.538,18	40,76

Optionen

Aktienoptionen

Underlying		Kontrakte	Währung	Marktwert (EUR)	Nettoteilfonds- vermögen (%)
AFLAC Inc.	Jan 2019 (put, strike 37,50)	-5.000	USD	-146.882,18	-0,03
AFLAC Inc.	Jan 2019 (put, strike 38,00)	-500.000	USD	-159.079,10	-0,03
AFLAC Inc.	Jan 2019 (call, strike 38,75)	-200.000	USD	-1.400.349,22	-0,27
AFLAC Inc.	Jan 2019 (put, strike 38,75)	-200.000	USD	-71.789,41	-0,01
AFLAC Inc.	Jan 2019 (call, strike 40,00)	-250.000	USD	-1.507.253,96	-0,29
AFLAC Inc.	Jan 2019 (put, strike 40,00)	-250.000	USD	-111.596,94	-0,02
AFLAC Inc.	Jan 2019 (put, strike 75,00)	500.000	USD	146.882,18	0,03
AFLAC Inc.	Jan 2019 (put, strike 76,00)	500.000	USD	159.079,10	0,03
AFLAC Inc.	Jan 2019 (call, strike 77,50)	200.000	USD	1.400.349,22	0,27
AFLAC Inc.	Jan 2019 (put, strike 77,50)	200.000	USD	71.789,41	0,01

Aktienoptionen

Underlying		Kontrakte	Währung	Marktwert (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
AFLAC Inc.	Jan 2019 (call, strike 80,00)	250.000	USD	1.507.253,96	0,29
AFLAC Inc.	Jan 2019 (put, strike 80,00)	250.000	USD	111.596,94	0,02
Allianz SE	Dez 2019 (call, strike 170,00)	2.000	EUR	4.955.658,20	0,95
Allianz SE	Dez 2019 (put, strike 170,00)	2.900	EUR	3.194.447,15	0,62
Amazon.com Inc.	Jan 2019 (put, strike 870,00)	30.000	USD	7.619,16	0,00
Amazon.com Inc.	Jan 2019 (put, strike 870,00)	-30.000	USD	-7.619,16	0,00
American Express Co.	Jan 2019 (put, strike 77,50)	300.000	USD	161.520,53	0,03
American Express Co.	Jan 2019 (put, strike 77,50)	-300.000	USD	-161.520,53	-0,03
American International Group Inc.	Jan 2019 (put, strike 52,50)	410.000	USD	683.866,54	0,13
American International Group Inc.	Jan 2019 (put, strike 52,50)	-410.000	USD	-683.866,54	-0,13
American International Group Inc.	Jan 2019 (call, strike 55,00)	120.000	USD	317.733,09	0,06
American International Group Inc.	Jan 2019 (put, strike 55,00)	350.000	USD	887.865,09	0,17
American International Group Inc.	Jan 2019 (put, strike 55,00)	120.000	USD	304.410,89	0,06
American International Group Inc.	Jan 2019 (put, strike 55,00)	-350.000	USD	-887.865,09	-0,17
American International Group Inc.	Jan 2019 (call, strike 57,00)	120.000	USD	220.018,39	0,04
American International Group Inc.	Jan 2019 (put, strike 57,00)	120.000	USD	411.539,75	0,08
American International Group Inc.	Jan 2019 (call, strike 57,50)	300.000	USD	497.830,01	0,10
American International Group Inc.	Jan 2019 (call, strike 57,50)	300.000	USD	497.830,01	0,10
American International Group Inc.	Jan 2019 (call, strike 57,50)	190.000	USD	315.292,34	0,06
American International Group Inc.	Jan 2019 (call, strike 57,50)	-115.000	USD	-190.834,84	-0,04
American International Group Inc.	Jan 2019 (put, strike 57,50)	300.000	USD	1.104.646,38	0,21
American International Group Inc.	Jan 2019 (put, strike 57,50)	300.000	USD	1.104.646,38	0,21
American International Group Inc.	Jan 2019 (put, strike 57,50)	190.000	USD	699.609,38	0,14
American International Group Inc.	Jan 2019 (put, strike 57,50)	-115.000	USD	-423.447,78	-0,08
American International Group Inc.	Jan 2020 (put, strike 48,00)	410.000	USD	1.003.270,58	0,19
American International Group Inc.	Jan 2020 (call, strike 50,00)	180.000	USD	1.341.690,97	0,26
American International Group Inc.	Jan 2020 (call, strike 50,00)	115.000	USD	857.191,45	0,17
American International Group Inc.	Jan 2020 (put, strike 50,00)	300.000	USD	892.316,74	0,17
American International Group Inc.	Jan 2020 (put, strike 50,00)	180.000	USD	535.390,04	0,10
American International Group Inc.	Jan 2020 (put, strike 50,00)	115.000	USD	342.054,75	0,07
American International Group Inc.	Jan 2020 (call, strike 52,50)	175.000	USD	1.081.265,33	0,21
American International Group Inc.	Jan 2020 (put, strike 52,50)	175.000	USD	660.662,88	0,13
Apple Inc.	Jun 2019 (put, strike 160,00)	120.000	USD	533.739,96	0,10
Apple Inc.	Jun 2019 (put, strike 175,00)	110.000	USD	880.837,00	0,17
Apple Inc.	Jan 2020 (call, strike 160,00)	60.000	USD	2.080.116,95	0,40
Apple Inc.	Jan 2020 (put, strike 160,00)	100.000	USD	704.496,56	0,14
Apple Inc.	Jan 2020 (put, strike 160,00)	60.000	USD	422.697,94	0,08
Apple Inc.	Jan 2020 (call, strike 180,00)	70.000	USD	1.668.474,96	0,32
Apple Inc.	Jan 2020 (call, strike 180,00)	60.000	USD	1.430.121,40	0,28
Apple Inc.	Jan 2020 (call, strike 180,00)	50.000	USD	1.191.767,83	0,23
Apple Inc.	Jan 2020 (call, strike 180,00)	50.000	USD	1.191.767,83	0,23
Apple Inc.	Jan 2020 (put, strike 180,00)	70.000	USD	895.214,84	0,17
Apple Inc.	Jan 2020 (put, strike 180,00)	60.000	USD	767.327,00	0,15
Apple Inc.	Jan 2020 (put, strike 180,00)	50.000	USD	639.439,17	0,12

Aktienoptionen

Underlying		Kontrakte	Währung	Marktwert (EUR)	Nettoteilfonds- vermögen (%)
Apple Inc.	Jan 2020 (put, strike 180,00)	50.000	USD	639.439,17	0,12
Apple Inc.	Jan 2020 (call, strike 185,00)	60.000	USD	1.292.279,34	0,25
Apple Inc.	Jan 2020 (put, strike 185,00)	60.000	USD	879.367,24	0,17
Apple Inc.	Jan 2020 (call, strike 190,00)	60.000	USD	1.158.637,25	0,22
Apple Inc.	Jan 2020 (put, strike 190,00)	60.000	USD	996.059,43	0,19
AXA S.A.	Jun 2019 (put, strike 18,00)	23.000	EUR	1.239.012,30	0,24
AXA S.A.	Jun 2019 (put, strike 19,00)	17.500	EUR	1.424.018,75	0,27
AXA S.A.	Jun 2019 (put, strike 20,00)	13.000	EUR	1.536.020,20	0,30
AXA S.A.	Jun 2019 (call, strike 22,00)	10.500	EUR	1.092.723,45	0,21
AXA S.A.	Jun 2019 (put, strike 22,00)	10.500	EUR	2.409.521,10	0,46
AXA S.A.	Dez 2019 (put, strike 17,00)	24.000	EUR	1.417.648,80	0,27
AXA S.A.	Dez 2019 (put, strike 18,00)	54.000	EUR	4.519.719,00	0,87
AXA S.A.	Dez 2019 (put, strike 19,00)	12.000	EUR	1.381.963,20	0,27
AXA S.A.	Dez 2019 (put, strike 20,00)	13.000	EUR	2.000.815,70	0,38
AXA S.A.	Dez 2019 (call, strike 21,00)	2.500	EUR	425.656,75	0,08
AXA S.A.	Dez 2019 (put, strike 21,00)	2.500	EUR	508.372,00	0,10
AXA S.A.	Dez 2019 (call, strike 22,00)	17.750	EUR	2.127.280,70	0,41
AXA S.A.	Dez 2019 (put, strike 22,00)	17.750	EUR	4.650.155,65	0,90
AXA S.A.	Dez 2019 (call, strike 24,00)	32.000	EUR	1.645.619,20	0,32
AXA S.A.	Dez 2019 (put, strike 24,00)	-32.000	EUR	-13.116.060,80	-2,53
AXA S.A.	Dez 2019 (call, strike 28,00)	14.000	EUR	141.526,00	0,03
AXA S.A.	Dez 2019 (put, strike 28,00)	-14.000	EUR	-10.777.699,80	-2,08
Bank of America Corp.	Jun 2019 (put, strike 28,00)	670.000	USD	796.560,45	0,15
Bank of America Corp.	Jun 2019 (put, strike 28,00)	500.000	USD	594.448,10	0,11
Bank of America Corp.	Jun 2019 (call, strike 29,00)	300.000	USD	975.663,43	0,19
Bank of America Corp.	Jun 2019 (call, strike 29,00)	300.000	USD	975.663,43	0,19
Bank of America Corp.	Jun 2019 (put, strike 29,00)	300.000	USD	442.087,52	0,08
Bank of America Corp.	Jun 2019 (put, strike 29,00)	300.000	USD	442.087,52	0,08
Bank of America Corp.	Jun 2019 (call, strike 30,00)	250.000	USD	684.409,43	0,13
Bank of America Corp.	Jun 2019 (put, strike 30,00)	500.000	USD	902.343,92	0,17
Bank of America Corp.	Jun 2019 (put, strike 30,00)	250.000	USD	451.171,96	0,09
Bank of America Corp.	Jan 2020 (call, strike 27,00)	400.000	USD	1.996.996,71	0,38
Bank of America Corp.	Jan 2020 (call, strike 27,00)	250.000	USD	1.248.122,94	0,24
Bank of America Corp.	Jan 2020 (call, strike 27,00)	230.000	USD	1.148.273,11	0,22
Bank of America Corp.	Jan 2020 (put, strike 27,00)	500.000	USD	734.359,22	0,14
Bank of America Corp.	Jan 2020 (put, strike 27,00)	400.000	USD	587.487,37	0,11
Bank of America Corp.	Jan 2020 (put, strike 27,00)	400.000	USD	587.487,37	0,11
Bank of America Corp.	Jan 2020 (put, strike 27,00)	250.000	USD	367.179,61	0,07
Bank of America Corp.	Jan 2020 (put, strike 27,00)	230.000	USD	337.805,24	0,06
Bank of America Corp.	Jan 2020 (call, strike 30,00)	450.000	USD	1.557.300,76	0,30
Bank of America Corp.	Jan 2020 (put, strike 30,00)	450.000	USD	1.093.912,10	0,21
Bank of America Corp.	Jan 2020 (call, strike 31,00)	250.000	USD	755.340,80	0,15
Bank of America Corp.	Jan 2020 (put, strike 31,00)	250.000	USD	706.227,08	0,14
Bank of New York Mellon Corp.	Jan 2019 (put, strike 50,00)	400.000	USD	550.047,60	0,11

Aktienoptionen

Underlying		Kontrakte	Währung	Marktwert (EUR)	Nettoteilfonds- vermögen (%)
Bank of New York Mellon Corp.	Jan 2019 (put, strike 50,00)	-400.000	USD	-550.047,60	-0,11
BASF SE	Dez 2019 (put, strike 72,00)	3.000	EUR	1.224.214,80	0,24
Bayerische Motoren Werke AG	Jun 2019 (put, strike 71,00)	2.700	EUR	777.314,34	0,15
Bayerische Motoren Werke AG	Jun 2019 (put, strike 76,00)	3.700	EUR	1.704.789,80	0,33
Bayerische Motoren Werke AG	Dez 2019 (call, strike 74,00)	1.700	EUR	1.963.338,67	0,38
Bayerische Motoren Werke AG	Dez 2019 (put, strike 74,00)	5.200	EUR	2.803.241,48	0,54
Bayerische Motoren Werke AG	Dez 2019 (put, strike 76,00)	3.000	EUR	1.870.834,20	0,36
Bayerische Motoren Werke AG	Dez 2019 (call, strike 79,00)	2.000	EUR	1.677.527,60	0,32
Bayerische Motoren Werke AG	Dez 2019 (put, strike 79,00)	2.000	EUR	1.528.564,60	0,29
Bayerische Motoren Werke AG	Dez 2019 (call, strike 80,00)	2.000	EUR	1.422.452,40	0,27
Bayerische Motoren Werke AG	Dez 2019 (put, strike 80,00)	-2.000	EUR	-1.632.131,80	-0,31
Bayerische Motoren Werke AG	Dez 2019 (call, strike 82,00)	1.500	EUR	1.020.820,95	0,20
Bayerische Motoren Werke AG	Dez 2019 (put, strike 82,00)	1.500	EUR	1.390.224,45	0,27
Bayerische Motoren Werke AG	Dez 2019 (call, strike 84,00)	1.600	EUR	941.291,68	0,18
Bayerische Motoren Werke AG	Dez 2019 (put, strike 84,00)	1.600	EUR	1.674.298,88	0,32
BNP Paribas S.A.	Jun 2019 (put, strike 50,00)	2.600	EUR	628.258,80	0,12
BNP Paribas S.A.	Jun 2019 (call, strike 56,00)	3.200	EUR	1.178.940,16	0,23
BNP Paribas S.A.	Jun 2019 (put, strike 56,00)	3.200	EUR	1.661.631,36	0,32
BNP Paribas S.A.	Jun 2019 (call, strike 57,00)	2.100	EUR	674.697,24	0,13
BNP Paribas S.A.	Jun 2019 (put, strike 57,00)	2.100	EUR	1.214.306,94	0,23
BNP Paribas S.A.	Dez 2019 (put, strike 48,00)	2.700	EUR	748.430,55	0,14
BNP Paribas S.A.	Dez 2019 (put, strike 50,00)	5.500	EUR	1.863.814,15	0,36
BNP Paribas S.A.	Dez 2019 (call, strike 52,00)	1.500	EUR	942.013,80	0,18
BNP Paribas S.A.	Dez 2019 (put, strike 52,00)	4.300	EUR	1.813.433,84	0,35
BNP Paribas S.A.	Dez 2019 (call, strike 56,00)	7.500	EUR	2.769.258,00	0,53
BNP Paribas S.A.	Dez 2019 (call, strike 56,00)	4.100	EUR	1.665.036,24	0,32
BNP Paribas S.A.	Dez 2019 (put, strike 56,00)	5.800	EUR	3.632.186,78	0,70
BNP Paribas S.A.	Dez 2019 (put, strike 56,00)	-7.500	EUR	-4.696.743,75	-0,91
BNP Paribas S.A.	Dez 2019 (call, strike 60,00)	1.000	EUR	236.993,00	0,05
BNP Paribas S.A.	Dez 2019 (put, strike 60,00)	1.000	EUR	876.080,30	0,17
Citigroup Inc.	Jan 2019 (put, strike 60,00)	400.000	USD	283.128,76	0,05
Citigroup Inc.	Jan 2019 (put, strike 60,00)	370.000	USD	261.894,10	0,05
Citigroup Inc.	Jan 2019 (put, strike 60,00)	-370.000	USD	-261.894,10	-0,05
Citigroup Inc.	Jan 2019 (put, strike 60,00)	-400.000	USD	-283.128,76	-0,06
Citigroup Inc.	Jan 2019 (put, strike 65,00)	240.000	USD	351.805,48	0,07
Citigroup Inc.	Jan 2019 (put, strike 67,50)	270.000	USD	556.563,68	0,11
Citigroup Inc.	Jan 2019 (put, strike 67,50)	-270.000	USD	-556.563,68	-0,11
Citigroup Inc.	Jun 2019 (put, strike 65,00)	370.000	USD	1.028.065,26	0,20
Citigroup Inc.	Jun 2019 (call, strike 67,50)	170.000	USD	1.246.627,34	0,24
Citigroup Inc.	Jun 2019 (put, strike 67,50)	170.000	USD	591.922,55	0,11
Citigroup Inc.	Jun 2019 (call, strike 70,00)	165.000	USD	1.005.544,87	0,19
Citigroup Inc.	Jun 2019 (put, strike 70,00)	165.000	USD	718.183,56	0,14
Citigroup Inc	Jan 2020 (call, strike 65,00)	150.000	USD	1.532.171,45	0,30
Citigroup Inc	Jan 2020 (call, strike 65,00)	100.000	USD	1.021.447,63	0,20

Aktienoptionen

Underlying		Kontrakte	Währung	Marktwert (EUR)	Nettoteilfonds- vermögen (%)
Citigroup Inc	Jan 2020 (call, strike 67,50)	150.000	USD	1.344.112,17	0,26
Citigroup Inc	Jan 2020 (call, strike 67,50)	100.000	USD	896.074,78	0,17
Citigroup Inc.	Jan 2020 (put, strike 60,00)	400.000	USD	1.103.057,82	0,21
Citigroup Inc.	Jan 2020 (put, strike 60,00)	270.000	USD	744.564,03	0,14
Citigroup Inc.	Jan 2020 (put, strike 60,00)	220.000	USD	606.681,80	0,12
Citigroup Inc.	Jan 2020 (put, strike 65,00)	370.000	USD	1.504.922,07	0,29
Citigroup Inc.	Jan 2020 (put, strike 65,00)	150.000	USD	610.103,54	0,12
Citigroup Inc.	Jan 2020 (put, strike 65,00)	100.000	USD	406.735,70	0,08
Citigroup Inc.	Jan 2020 (put, strike 67,50)	150.000	USD	733.007,01	0,14
Citigroup Inc.	Jan 2020 (put, strike 67,50)	100.000	USD	488.671,34	0,10
Credit Agricole S.A.	Jun 2019 (call, strike 11,00)	12.500	EUR	1.846.381,25	0,36
Credit Agricole S.A.	Jun 2019 (put, strike 11,00)	12.500	EUR	789.738,75	0,15
Credit Agricole S.A.	Dez 2019 (put, strike 10,50)	8.000	EUR	540.000,00	0,10
Credit Agricole S.A.	Dez 2019 (put, strike 11,00)	22.200	EUR	1.905.841,14	0,37
Credit Agricole S.A.	Dez 2019 (call, strike 12,00)	11.000	EUR	1.137.837,80	0,22
Credit Agricole S.A.	Dez 2019 (put, strike 12,00)	11.000	EUR	1.500.015,00	0,29
Credit Agricole S.A.	Dez 2019 (put, strike 12,50)	6.000	EUR	975.654,00	0,19
Credit Suisse Group AG	Jun 2019 (call, strike 15,00)	5.300	CHF	825.073,07	0,16
Credit Suisse Group AG	Jun 2019 (put, strike 15,00)	17.300	CHF	1.651.112,27	0,32
Credit Suisse Group AG	Jun 2019 (put, strike 16,00)	9.500	CHF	1.302.228,36	0,25
Credit Suisse Group AG	Dez 2019 (put, strike 13,00)	14.000	CHF	934.285,67	0,18
Credit Suisse Group AG	Dez 2019 (call, strike 14,00)	8.000	CHF	1.873.631,31	0,36
Credit Suisse Group AG	Dez 2019 (put, strike 14,00)	8.000	CHF	752.228,89	0,14
Credit Suisse Group AG	Dez 2019 (call, strike 16,00)	8.000	CHF	1.071.258,66	0,21
Credit Suisse Group AG	Dez 2019 (put, strike 16,00)	8.000	CHF	1.376.347,91	0,26
Daimler AG	Dez 2019 (call, strike 17,00)	20.000	EUR	274.878,00	0,05
Daimler AG	Dez 2019 (put, strike 17,00)	-20.000	EUR	-9.748.094,00	-1,88
Daimler AG	Dez 2019 (call, strike 38,00)	10.000	EUR	2.734.451,00	0,53
Daimler AG	Dez 2019 (call, strike 60,00)	3.000	EUR	1.175.960,10	0,23
Daimler AG	Dez 2019 (put, strike 60,00)	-3.000	EUR	-2.374.432,20	-0,46
Facebook Inc.	Jan 2019 (call, strike 10,87)	-900.000	USD	-265.875,56	-0,05
Facebook Inc.	Jan 2019 (call, strike 10,87)	-1.000.000	USD	-295.417,29	-0,06
Facebook Inc.	Jan 2020 (call, strike 10,50)	900.000	USD	677.869,49	0,13
Facebook Inc.	Jan 2020 (call, strike 10,50)	800.000	USD	602.550,66	0,12
Ford Motor Co.	Jan 2019 (put, strike 9,87)	-15.000	USD	-753.808,81	-0,14
Ford Motor Co.	Jan 2019 (put, strike 10,00)	1.500.000	USD	753.808,81	0,15
Ford Motor Co.	Jan 2019 (call, strike 10,50)	1.200.000	USD	529.002,01	0,10
Ford Motor Co.	Jan 2019 (put, strike 10,50)	1.200.000	USD	883.894,53	0,17
Ford Motor Co.	Jan 2019 (put, strike 10,87)	-900.000	USD	-914.932,44	-0,18
Ford Motor Co.	Jan 2019 (put, strike 10,87)	-1.000.000	USD	-1.016.591,60	-0,20
Ford Motor Co.	Jan 2019 (call, strike 11,00)	1.000.000	USD	295.417,29	0,06
Ford Motor Co.	Jan 2019 (call, strike 11,00)	900.000	USD	265.875,56	0,05
Ford Motor Co.	Jan 2019 (put, strike 11,00)	1.000.000	USD	1.016.591,60	0,20
Ford Motor Co.	Jan 2019 (put, strike 11,00)	900.000	USD	914.932,44	0,18

Aktienoptionen

Underlying		Kontrakte	Währung	Marktwert (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
Ford Motor Co.	Jan 2020 (put, strike 10,00)	1.800.000	USD	2.011.235,59	0,39
Ford Motor Co.	Jan 2020 (put, strike 10,00)	1.500.000	USD	1.676.029,66	0,32
Ford Motor Co.	Jan 2020 (put, strike 10,50)	900.000	USD	1.234.034,96	0,24
Ford Motor Co.	Jan 2020 (put, strike 10,50)	800.000	USD	1.096.919,96	0,21
Goldman Sachs Group Inc.	Jan 2019 (call, strike 210,00)	100.000	USD	2.804.402,80	0,54
Goldman Sachs Group Inc.	Jan 2019 (call, strike 210,00)	40.000	USD	1.121.761,12	0,22
Goldman Sachs Group Inc.	Jan 2019 (call, strike 210,00)	-140.000	USD	-3.926.163,92	-0,76
Goldman Sachs Group Inc.	Jan 2019 (put, strike 210,00)	100.000	USD	345.618,99	0,07
Goldman Sachs Group Inc.	Jan 2019 (put, strike 210,00)	40.000	USD	138.247,60	0,03
Goldman Sachs Group Inc.	Jan 2019 (put, strike 210,00)	30.000	USD	103.685,70	0,02
Goldman Sachs Group Inc.	Jan 2019 (put, strike 220,00)	80.000	USD	427.174,36	0,08
Goldman Sachs Group Inc.	Dez 2019 (put, strike 10,00)	18.000	EUR	765.835,20	0,15
Goldman Sachs Group Inc.	Jan 2019 (put, strike 210,00)	80.000	USD	276.495,19	0,05
Goldman Sachs Group Inc.	Jan 2019 (put, strike 210,00)	30.000	USD	103.685,70	0,02
Goldman Sachs Group Inc.	Jan 2019 (put, strike 210,00)	-140.000	USD	-483.866,59	-0,09
ING Groep NV	Jun 2019 (call, strike 11,50)	6.000	EUR	1.055.048,40	0,20
ING Groep NV	Jun 2019 (put, strike 11,50)	6.000	EUR	337.272,60	0,06
ING Groep NV	Jun 2019 (put, strike 12,00)	54.000	EUR	4.003.905,60	0,77
ING Groep NV	Jun 2019 (call, strike 13,00)	21.000	EUR	1.732.909,50	0,33
ING Groep NV	Jun 2019 (put, strike 13,00)	21.000	EUR	2.572.678,50	0,50
ING Groep NV	Dez 2019 (put, strike 11,00)	40.000	EUR	2.864.076,00	0,55
ING Groep NV	Dez 2019 (call, strike 11,50)	11.000	EUR	2.047.672,00	0,39
ING Groep NV	Dez 2019 (put, strike 11,50)	11.000	EUR	982.702,60	0,19
ING Groep NV	Dez 2019 (call, strike 12,00)	14.000	EUR	2.139.968,60	0,41
ING Groep NV	Dez 2019 (put, strike 12,00)	14.000	EUR	1.542.892,40	0,30
ING Groep NV	Dez 2019 (call, strike 13,00)	5.000	EUR	488.143,00	0,09
ING Groep NV	Dez 2019 (put, strike 13,00)	5.000	EUR	809.151,50	0,16
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2019 (put, strike 80,00)	250.000	USD	73.459,89	0,01
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2019 (put, strike 80,00)	200.000	USD	58.767,92	0,01
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2019 (put, strike 80,00)	200.000	USD	58.767,92	0,01
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2019 (put, strike 80,00)	-200.000	USD	-58.767,92	-0,01
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2019 (put, strike 80,00)	-200.000	USD	-58.767,92	-0,01
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2019 (put, strike 82,50)	260.000	USD	92.420,49	0,02
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2019 (put, strike 82,50)	200.000	USD	71.092,69	0,01
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2019 (put, strike 82,50)	-200.000	USD	-71.092,69	-0,01
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2019 (put, strike 82,50)	-260.000	USD	-92.420,49	-0,02
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2019 (put, strike 85,00)	320.000	USD	140.138,97	0,03
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2019 (put, strike 85,00)	250.000	USD	109.483,57	0,02
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2019 (put, strike 88,00)	320.000	USD	179.134,64	0,03
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2019 (put, strike 90,00)	240.000	USD	157.986,89	0,03
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2019 (put, strike 90,00)	230.000	USD	151.404,10	0,03
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2019 (put, strike 90,00)	-240.000	USD	-157.986,89	-0,03
JPMorgan Chase & Co.	Jun 2019 (put, strike 85,00)	275.000	USD	313.113,14	0,06
JPMorgan Chase & Co.	Jun 2019 (call, strike 90,00)	135.000	USD	3.095.067,66	0,60

Aktienoptionen

Underlying		Kontrakte	Währung	Marktwert (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
JPMorgan Chase & Co.	Jun 2019 (put, strike 90,00)	135.000	USD	216.861,31	0,04
JPMorgan Chase & Co.	Jun 2019 (put, strike 91,00)	200.000	USD	343.301,57	0,07
JPMorgan Chase & Co.	Jun 2019 (put, strike 105,00)	170.000	USD	726.107,26	0,14
JPMorgan Chase & Co.	Jun 2019 (put, strike 105,00)	-170.000	USD	-726.107,26	-0,14
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2020 (put, strike 90,00)	240.000	USD	740.348,87	0,14
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2020 (call, strike 100,00)	135.000	USD	2.422.938,76	0,47
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2020 (call, strike 100,00)	110.000	USD	1.974.246,40	0,38
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2020 (put, strike 100,00)	200.000	USD	1.018.317,00	0,20
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2020 (put, strike 100,00)	150.000	USD	763.737,75	0,15
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2020 (put, strike 100,00)	135.000	USD	687.363,98	0,13
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2020 (put, strike 100,00)	110.000	USD	560.074,35	0,11
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2020 (call, strike 105,00)	110.000	USD	1.665.943,02	0,32
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2020 (put, strike 105,00)	110.000	USD	708.098,31	0,14
Renault S.A.	Dez 2019 (call, strike 66,00)	1.400	EUR	1.821.622,32	0,35
Renault S.A.	Dez 2019 (put, strike 66,00)	1.400	EUR	762.425,16	0,15
Renault S.A.	Dez 2019 (call, strike 70,00)	2.600	EUR	2.738.972,86	0,53
Renault S.A.	Dez 2019 (put, strike 70,00)	2.600	EUR	1.874.992,60	0,36
Sage Group Plc.	Jun 2019 (call, strike 33,00)	3.300	EUR	1.963.200,36	0,38
Sage Group Plc.	Jun 2019 (put, strike 33,00)	3.300	EUR	524.039,67	0,10
Sage Group Plc.	Dez 2019 (put, strike 30,00)	17.000	EUR	2.429.317,00	0,47
Sage Group Plc.	Dez 2019 (put, strike 33,00)	8.500	EUR	1.985.512,45	0,38
Sage Group Plc.	Dez 2019 (put, strike 34,00)	14.500	EUR	3.931.386,45	0,76
Schlumberger Ltd.	Jan 2019 (call, strike 65,00)	150.000	USD	690.739,71	0,13
Schlumberger Ltd.	Jan 2019 (call, strike 65,00)	-150.000	USD	-690.739,71	-0,13
Schlumberger Ltd.	Jan 2019 (put, strike 65,00)	150.000	USD	380.198,50	0,07
Schlumberger Ltd.	Jan 2019 (put, strike 65,00)	-150.000	USD	-380.198,50	-0,07
Schlumberger Ltd.	Jun 2019 (put, strike 55,00)	250.000	USD	320.349,77	0,06
Schlumberger Ltd.	Jan 2020 (call, strike 62,50)	180.000	USD	1.528.746,98	0,29
Schlumberger Ltd.	Jan 2020 (put, strike 62,50)	180.000	USD	755.318,34	0,15
Schlumberger Ltd.	Jan 2020 (call, strike 65,00)	150.000	USD	1.094.764,24	0,21
Schlumberger Ltd.	Jan 2020 (call, strike 65,00)	140.000	USD	1.021.779,96	0,20
Schlumberger Ltd.	Jan 2020 (put, strike 65,00)	150.000	USD	762.038,59	0,15
Schlumberger Ltd.	Jan 2020 (put, strike 65,00)	140.000	USD	711.236,02	0,14
Société Générale S.A.	Jun 2019 (put, strike 32,00)	13.500	EUR	1.745.614,80	0,34
Société Générale S.A.	Jun 2019 (call, strike 34,00)	3.200	EUR	1.658.563,20	0,32
Société Générale S.A.	Jun 2019 (put, strike 34,00)	3.200	EUR	615.738,88	0,12
Société Générale S.A.	Jun 2019 (put, strike 36,00)	12.000	EUR	3.319.922,40	0,64
Société Générale S.A.	Jun 2019 (call, strike 40,00)	3.500	EUR	639.263,45	0,12
Société Générale S.A.	Jun 2019 (put, strike 40,00)	3.500	EUR	1.819.308,75	0,35
Société Générale S.A.	Dez 2019 (call, strike 38,00)	7.800	EUR	2.400.041,28	0,46
Société Générale S.A.	Dez 2019 (put, strike 38,00)	7.800	EUR	3.626.288,64	0,70
Société Générale S.A.	Dez 2019 (call, strike 40,00)	1.500	EUR	335.872,50	0,06
Société Générale S.A.	Dez 2019 (put, strike 40,00)	1.500	EUR	891.049,50	0,17
Société Générale S.A.	Dez 2019 (call, strike 100,00)	9.500	EUR	5.213.386,25	1,00

Aktienoptionen

Underlying		Kontrakte	Währung	Marktwert (EUR)	Nettoteilfonds- vermögen (%)
Starbucks Corp.	Dez 2017 (call, strike 52,50)	230.000	USD	540.501,67	0,10
Starbucks Corp.	Jan 2019 (call, strike 52,50)	180.000	USD	423.001,31	0,08
Starbucks Corp.	Jan 2019 (call, strike 52,50)	170.000	USD	399.501,23	0,08
Starbucks Corp.	Jan 2019 (call, strike 52,50)	-180.000	USD	-423.001,31	-0,08
Starbucks Corp.	Jan 2019 (call, strike 52,50)	-400.000	USD	-940.002,91	-0,18
Starbucks Corp.	Jan 2019 (put, strike 52,50)	300.000	USD	749.183,62	0,15
Starbucks Corp.	Jan 2019 (put, strike 52,50)	230.000	USD	574.374,11	0,11
Starbucks Corp.	Jan 2019 (put, strike 52,50)	180.000	USD	449.510,17	0,09
Starbucks Corp.	Jan 2019 (put, strike 52,50)	170.000	USD	424.537,39	0,08
Starbucks Corp.	Jan 2019 (put, strike 52,50)	-180.000	USD	-449.510,17	-0,09
Starbucks Corp.	Jan 2019 (put, strike 52,50)	-300.000	USD	-749.183,62	-0,14
Starbucks Corp.	Jan 2019 (put, strike 52,50)	-400.000	USD	-998.911,50	-0,19
Starbucks Corp.	Jan 2019 (call, strike 57,50)	200.000	USD	169.774,45	0,03
Starbucks Corp.	Jan 2019 (call, strike 57,50)	-200.000	USD	-169.774,45	-0,03
Starbucks Corp.	Jan 2019 (put, strike 57,50)	200.000	USD	1.054.562,80	0,20
Starbucks Corp.	Jan 2019 (put, strike 57,50)	-200.000	USD	-1.054.562,80	-0,20
State Street Global Advisors	Dez 2019 (put, strike 38,00)	-10.000	EUR	-4.649.050,00	-0,90
U.S. Bancorp	Jan 2019 (put, strike 49,00)	400.000	USD	352.631,43	0,07
U.S. Bancorp	Jan 2019 (put, strike 49,00)	-400.000	USD	-352.631,43	-0,07
U.S. Bancorp	Jan 2019 (call, strike 50,00)	200.000	USD	746.987,22	0,14
U.S. Bancorp	Jan 2019 (put, strike 50,00)	200.000	USD	214.990,47	0,04
U.S. Bancorp	Jun 2019 (put, strike 12,50)	15.000	CHF	404.521,67	0,08
U.S. Bancorp	Jan 2020 (put, strike 45,00)	400.000	USD	647.869,41	0,13
U.S. Bancorp	Jan 2020 (call, strike 50,00)	210.000	USD	1.174.834,64	0,23
U.S. Bancorp	Jan 2020 (put, strike 50,00)	210.000	USD	585.365,24	0,11
UBS Group AG	Jun 2019 (call, strike 15,00)	4.750	CHF	766.873,41	0,15
UBS Group AG	Jun 2019 (put, strike 15,00)	4.750	CHF	393.910,00	0,08
UBS Group AG	Dez 2019 (put, strike 13,50)	22.000	CHF	1.428.742,29	0,27
UBS Group AG	Dez 2019 (call, strike 14,00)	22.000	CHF	5.186.361,19	1,00
UBS Group AG	Dez 2019 (put, strike 14,00)	35.000	CHF	2.738.585,23	0,53
UBS Group AG	Dez 2019 (put, strike 14,50)	10.000	CHF	935.160,71	0,18
UBS Group AG	Dez 2019 (call, strike 15,00)	8.000	CHF	1.396.073,91	0,27
UBS Group AG	Dez 2019 (put, strike 15,00)	8.000	CHF	884.685,62	0,17
Volkswagen AG	Dez 2019 (call, strike 10,50)	8.000	EUR	1.542.984,80	0,30
Volkswagen AG	Dez 2019 (call, strike 11,00)	22.200	EUR	3.511.527,18	0,68
Volkswagen AG	Dez 2019 (call, strike 12,50)	6.000	EUR	466.741,80	0,09
Wells Fargo & Co.	Jan 2019 (call, strike 50,00)	280.000	USD	1.908.907,93	0,37
Wells Fargo & Co.	Jan 2019 (call, strike 50,00)	180.000	USD	1.227.155,10	0,24
Wells Fargo & Co.	Jan 2019 (call, strike 50,00)	-460.000	USD	-3.136.063,02	-0,60
Wells Fargo & Co.	Jan 2019 (put, strike 50,00)	280.000	USD	218.702,96	0,04
Wells Fargo & Co.	Jan 2019 (put, strike 50,00)	180.000	USD	140.594,76	0,03
Wells Fargo & Co.	Jan 2019 (put, strike 50,00)	-460.000	USD	-359.297,72	-0,07
Summe Aktienoptionen				228.155.225,28	43,96
				228.155.225,28	43,96

Indexoptionen

Underlying		Kontrakte	Währung	Marktwert (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
DAX	Sep 2018 (call, strike 12.620,00)	504	EUR	187.811,26	0,04
DAX	Sep 2018 (put, strike 12.620,00)	-504	EUR	-93.339,26	-0,02
DAX	Sep 2018 (call, strike 12.715,00)	78	EUR	24.020,70	0,00
DAX	Sep 2018 (put, strike 12.715,00)	-78	EUR	-16.813,80	0,00
DAX	Sep 2018 (call, strike 12.746,00)	-480	EUR	-138.195,42	-0,03
DAX	Sep 2018 (put, strike 12.746,00)	480	EUR	108.732,79	0,02
DAX	Sep 2018 (call, strike 12.797,00)	1.025	EUR	262.550,42	0,05
DAX	Sep 2018 (put, strike 12.797,00)	-1.025	EUR	-251.936,96	-0,05
DAX	Dez 2018 (call, strike 11.200,00)	500	EUR	855.591,02	0,16
DAX	Dez 2018 (call, strike 11.200,00)	-500	EUR	-855.591,02	-0,16
DAX	Dez 2018 (put, strike 11.200,00)	500	EUR	58.919,48	0,01
DAX	Dez 2018 (put, strike 11.200,00)	-500	EUR	-58.919,48	-0,01
DAX	Dez 2018 (call, strike 11.600,00)	1.500	EUR	2.036.251,27	0,39
DAX	Dez 2018 (call, strike 11.600,00)	1.220	EUR	1.656.151,03	0,32
DAX	Dez 2018 (call, strike 11.600,00)	1.150	EUR	1.561.125,97	0,30
DAX	Dez 2018 (call, strike 11.600,00)	750	EUR	1.018.125,63	0,20
DAX	Dez 2018 (call, strike 11.600,00)	-450	EUR	-610.875,38	-0,12
DAX	Dez 2018 (call, strike 11.600,00)	-500	EUR	-678.750,42	-0,13
DAX	Dez 2018 (call, strike 11.600,00)	-650	EUR	-882.375,55	-0,17
DAX	Dez 2018 (call, strike 11.600,00)	-750	EUR	-1.018.125,63	-0,20
DAX	Dez 2018 (call, strike 11.600,00)	-770	EUR	-1.045.275,65	-0,20
DAX	Dez 2018 (call, strike 11.600,00)	-1.500	EUR	-2.036.251,27	-0,39
DAX	Dez 2018 (put, strike 11.600,00)	1.500	EUR	246.938,77	0,05
DAX	Dez 2018 (put, strike 11.600,00)	1.220	EUR	200.843,53	0,04
DAX	Dez 2018 (put, strike 11.600,00)	1.150	EUR	189.319,72	0,04
DAX	Dez 2018 (put, strike 11.600,00)	750	EUR	123.469,38	0,02
DAX	Dez 2018 (put, strike 11.600,00)	-450	EUR	-74.081,63	-0,01
DAX	Dez 2018 (put, strike 11.600,00)	-500	EUR	-82.312,92	-0,02
DAX	Dez 2018 (put, strike 11.600,00)	-650	EUR	-107.006,80	-0,02
DAX	Dez 2018 (put, strike 11.600,00)	-750	EUR	-123.469,38	-0,02
DAX	Dez 2018 (put, strike 11.600,00)	-770	EUR	-126.761,90	-0,02
DAX	Dez 2018 (put, strike 11.600,00)	-1.500	EUR	-246.938,77	-0,05
DAX	Dez 2018 (call, strike 11.800,00)	800	EUR	950.077,12	0,18
DAX	Dez 2018 (call, strike 11.800,00)	-800	EUR	-950.077,12	-0,18
DAX	Dez 2018 (put, strike 11.800,00)	1.650	EUR	321.676,47	0,06
DAX	Dez 2018 (put, strike 11.800,00)	800	EUR	155.964,35	0,03
DAX	Dez 2018 (put, strike 11.800,00)	-800	EUR	-155.964,35	-0,03
DAX	Dez 2018 (put, strike 11.800,00)	-1.650	EUR	-321.676,47	-0,06
DAX	Dez 2018 (call, strike 11.900,00)	500	EUR	552.329,45	0,11
DAX	Dez 2018 (call, strike 11.900,00)	-500	EUR	-552.329,45	-0,11
DAX	Dez 2018 (put, strike 11.900,00)	500	EUR	106.067,48	0,02
DAX	Dez 2018 (put, strike 11.900,00)	-500	EUR	-106.067,48	-0,02
DAX	Dez 2018 (call, strike 12.000,00)	900	EUR	920.981,26	0,18
DAX	Dez 2018 (call, strike 12.000,00)	-900	EUR	-920.981,26	-0,18

Indexoptionen

Underlying		Kontrakte	Währung	Marktwert (EUR)	Nettoteilfonds- vermögen (%)
DAX	Dez 2018 (put, strike 12.000,00)	1.600	EUR	369.448,95	0,07
DAX	Dez 2018 (put, strike 12.000,00)	900	EUR	207.815,04	0,04
DAX	Dez 2018 (put, strike 12.000,00)	-900	EUR	-207.815,04	-0,04
DAX	Dez 2018 (put, strike 12.000,00)	-1.600	EUR	-369.448,95	-0,07
DAX	Dez 2018 (call, strike 12.600,00)	600	EUR	348.194,58	0,07
DAX	Dez 2018 (call, strike 12.600,00)	-600	EUR	-348.194,58	-0,07
DAX	Dez 2018 (put, strike 12.600,00)	600	EUR	233.171,70	0,04
DAX	Dez 2018 (put, strike 12.600,00)	-600	EUR	-233.171,70	-0,04
DAX	Jun 2019 (put, strike 11.100,00)	-1.250	EUR	-352.721,63	-0,07
DAX	Jun 2019 (call, strike 11.500,00)	-700	EUR	-1.162.403,91	-0,22
DAX	Jun 2019 (put, strike 11.500,00)	-700	EUR	-247.604,81	-0,05
DAX	Jun 2019 (put, strike 11.500,00)	-2.200	EUR	-778.186,55	-0,15
DAX	Jun 2019 (put, strike 11.600,00)	1.275	EUR	477.197,01	0,09
DAX	Jun 2019 (put, strike 11.600,00)	-2.550	EUR	-954.394,02	-0,18
DAX	Jun 2019 (call, strike 11.800,00)	-800	EUR	-1.140.066,18	-0,22
DAX	Jun 2019 (call, strike 11.800,00)	-800	EUR	-1.140.066,18	-0,22
DAX	Jun 2019 (put, strike 11.800,00)	-800	EUR	-335.150,61	-0,06
DAX	Jun 2019 (put, strike 11.800,00)	-800	EUR	-335.150,61	-0,06
DAX	Jun 2019 (call, strike 12.100,00)	-700	EUR	-841.149,42	-0,16
DAX	Jun 2019 (put, strike 12.100,00)	-700	EUR	-347.346,28	-0,07
DAX	Jun 2019 (put, strike 12.300,00)	-1.650	EUR	-917.577,62	-0,18
DAX	Jun 2019 (call, strike 12.500,00)	200	EUR	185.714,68	0,04
DAX	Jun 2019 (call, strike 12.500,00)	-580	EUR	-538.572,56	-0,10
DAX	Jun 2019 (put, strike 12.500,00)	200	EUR	124.817,77	0,02
DAX	Jun 2019 (put, strike 12.500,00)	-580	EUR	-361.971,53	-0,07
DAX	Jun 2019 (call, strike 12.700,00)	-400	EUR	-321.802,56	-0,06
DAX	Jun 2019 (call, strike 12.700,00)	-550	EUR	-442.478,52	-0,09
DAX	Jun 2019 (put, strike 12.700,00)	-400	EUR	-280.198,45	-0,05
DAX	Jun 2019 (put, strike 12.700,00)	-550	EUR	-385.272,87	-0,07
DAX	Dez 2019 (put, strike 11.200,00)	-1.950	EUR	-879.905,40	-0,17
DAX	Dez 2019 (put, strike 11.500,00)	-1.600	EUR	-834.984,05	-0,16
DAX	Dez 2019 (put, strike 11.800,00)	-2.200	EUR	-1.326.094,18	-0,26
DAX	Dez 2019 (call, strike 12.000,00)	150	EUR	217.627,97	0,04
DAX	Dez 2019 (call, strike 12.000,00)	-1.100	EUR	-1.595.938,48	-0,31
DAX	Dez 2019 (call, strike 12.000,00)	-1.500	EUR	-2.176.279,74	-0,42
DAX	Dez 2019 (put, strike 12.000,00)	150	EUR	99.438,04	0,02
DAX	Dez 2019 (put, strike 12.000,00)	-1.100	EUR	-729.212,33	-0,14
DAX	Dez 2019 (put, strike 12.000,00)	-1.500	EUR	-994.380,44	-0,19
DAX	Dez 2019 (call, strike 12.200,00)	-500	EUR	-658.081,15	-0,13
DAX	Dez 2019 (call, strike 12.200,00)	-1.200	EUR	-1.579.394,76	-0,30
DAX	Dez 2019 (put, strike 12.200,00)	-500	EUR	-364.433,60	-0,07
DAX	Dez 2019 (put, strike 12.200,00)	-1.200	EUR	-874.640,63	-0,17
DAX	Dez 2019 (put, strike 12.300,00)	-1.200	EUR	-916.651,85	-0,18
DAX	Dez 2019 (call, strike 12.400,00)	-950	EUR	-1.128.121,07	-0,22

Indexoptionen

Underlying		Kontrakte	Währung	Marktwert (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
DAX	Dez 2019 (call, strike 12.400,00)	-1.100	EUR	-1.306.245,44	-0,25
DAX	Dez 2019 (put, strike 12.400,00)	-950	EUR	-760.796,58	-0,15
DAX	Dez 2019 (put, strike 12.400,00)	-1.100	EUR	-880.922,36	-0,17
DAX	Dez 2019 (call, strike 12.500,00)	-550	EUR	-619.068,18	-0,12
DAX	Dez 2019 (put, strike 12.500,00)	-550	EUR	-461.582,02	-0,09
DAX	Dez 2019 (put, strike 12.600,00)	2.400	EUR	2.110.615,29	0,41
DAX	Dez 2019 (put, strike 12.600,00)	-2.400	EUR	-2.110.615,29	-0,41
DAX	Dez 2019 (call, strike 12.700,00)	-950	EUR	-956.696,41	-0,18
DAX	Dez 2019 (put, strike 12.700,00)	-950	EUR	-875.280,73	-0,17
DAX	Dez 2019 (call, strike 12.800,00)	-850	EUR	-807.685,19	-0,16
DAX	Dez 2019 (put, strike 12.800,00)	-850	EUR	-820.110,63	-0,16
Euro Stoxx 50 [®]	Sep 2018 (call, strike 110,90)	-33.800	EUR	-228.783,01	-0,04
Euro Stoxx 50 [®]	Sep 2018 (call, strike 3.335,00)	1.440	EUR	294.093,84	0,06
Euro Stoxx 50 [®]	Sep 2018 (put, strike 3.335,00)	-1.440	EUR	-22.952,47	0,00
Euro Stoxx 50 [®]	Sep 2018 (call, strike 3.369,00)	-396	EUR	-68.830,09	-0,01
Euro Stoxx 50 [®]	Sep 2018 (put, strike 3.369,00)	396	EUR	7.737,05	0,00
Euro Stoxx 50 [®]	Sep 2018 (call, strike 3.378,00)	672	EUR	111.513,45	0,02
Euro Stoxx 50 [®]	Sep 2018 (put, strike 3.378,00)	-672	EUR	-13.891,48	0,00
Euro Stoxx 50 [®]	Sep 2018 (call, strike 3.397,00)	-4.090	EUR	-611.911,19	-0,12
Euro Stoxx 50 [®]	Sep 2018 (put, strike 3.397,00)	4.090	EUR	95.503,14	0,02
Euro Stoxx 50 [®]	Sep 2018 (call, strike 3.408,00)	-128	EUR	-17.963,29	0,00
Euro Stoxx 50 [®]	Sep 2018 (put, strike 3.408,00)	128	EUR	3.210,58	0,00
Euro Stoxx 50 [®]	Sep 2018 (call, strike 3.422,00)	-1.880	EUR	-242.053,82	-0,05
Euro Stoxx 50 [®]	Sep 2018 (put, strike 3.422,00)	1.880	EUR	51.706,73	0,01
Euro Stoxx 50 [®]	Sep 2018 (call, strike 3.511,00)	242	EUR	15.395,88	0,00
Euro Stoxx 50 [®]	Sep 2018 (put, strike 3.511,00)	-242	EUR	-12.442,69	0,00
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2018 (put, strike 3.000,00)	5.400	EUR	106.055,44	0,02
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2018 (put, strike 3.000,00)	5.300	EUR	104.091,45	0,02
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2018 (put, strike 3.000,00)	5.000	EUR	98.199,48	0,02
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2018 (put, strike 3.000,00)	3.400	EUR	66.775,65	0,01
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2018 (put, strike 3.000,00)	3.100	EUR	60.883,68	0,01
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2018 (put, strike 3.000,00)	-3.100	EUR	-60.883,68	-0,01
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2018 (put, strike 3.000,00)	-3.400	EUR	-66.775,65	-0,01
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2018 (put, strike 3.000,00)	-5.000	EUR	-98.199,48	-0,02
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2018 (put, strike 3.000,00)	-5.300	EUR	-104.091,45	-0,02
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2018 (put, strike 3.000,00)	-5.400	EUR	-106.055,44	-0,02
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2018 (call, strike 3.050,00)	4.000	EUR	1.915.401,26	0,37
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2018 (call, strike 3.050,00)	3.000	EUR	1.436.550,94	0,28
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2018 (call, strike 3.050,00)	-3.000	EUR	-1.436.550,94	-0,28
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2018 (call, strike 3.050,00)	-4.000	EUR	-1.915.401,26	-0,37
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2018 (put, strike 3.050,00)	4.000	EUR	91.713,79	0,02
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2018 (put, strike 3.050,00)	3.000	EUR	68.785,34	0,01
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2018 (put, strike 3.050,00)	-3.000	EUR	-68.785,34	-0,01
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2018 (put, strike 3.050,00)	-4.000	EUR	-91.713,79	-0,02

Indexoptionen

Underlying		Kontrakte	Währung	Marktwert (EUR)	Nettoteilfonds- vermögen (%)
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2018 (call, strike 3.100,00)	3.000	EUR	1.298.066,04	0,25
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2018 (call, strike 3.100,00)	500	EUR	216.344,34	0,04
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2018 (call, strike 3.100,00)	-500	EUR	-216.344,34	-0,04
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2018 (call, strike 3.100,00)	-3.000	EUR	-1.298.066,04	-0,25
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2018 (put, strike 3.100,00)	6.000	EUR	160.951,95	0,03
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2018 (put, strike 3.100,00)	3.000	EUR	80.475,98	0,02
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2018 (put, strike 3.100,00)	500	EUR	13.412,66	0,00
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2018 (put, strike 3.100,00)	-500	EUR	-13.412,66	0,00
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2018 (put, strike 3.100,00)	-3.000	EUR	-80.475,98	-0,02
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2018 (put, strike 3.100,00)	-6.000	EUR	-160.951,95	-0,03
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2018 (call, strike 3.200,00)	5.100	EUR	1.748.462,20	0,34
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2018 (call, strike 3.200,00)	3.200	EUR	1.097.074,32	0,21
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2018 (call, strike 3.200,00)	2.400	EUR	822.805,74	0,16
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2018 (call, strike 3.200,00)	2.000	EUR	685.671,45	0,13
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2018 (call, strike 3.200,00)	-2.000	EUR	-685.671,45	-0,13
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2018 (call, strike 3.200,00)	-2.200	EUR	-754.238,60	-0,15
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2018 (call, strike 3.200,00)	-2.400	EUR	-822.805,74	-0,16
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2018 (call, strike 3.200,00)	-2.900	EUR	-994.223,61	-0,19
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2018 (call, strike 3.200,00)	-3.200	EUR	-1.097.074,32	-0,21
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2018 (put, strike 3.200,00)	6.600	EUR	244.789,97	0,05
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2018 (put, strike 3.200,00)	5.100	EUR	189.155,89	0,04
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2018 (put, strike 3.200,00)	3.200	EUR	118.686,05	0,02
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2018 (put, strike 3.200,00)	2.400	EUR	89.014,54	0,02
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2018 (put, strike 3.200,00)	2.000	EUR	74.178,78	0,01
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2018 (put, strike 3.200,00)	-2.000	EUR	-74.178,78	-0,01
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2018 (put, strike 3.200,00)	-2.200	EUR	-81.596,66	-0,02
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2018 (put, strike 3.200,00)	-2.400	EUR	-89.014,54	-0,02
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2018 (put, strike 3.200,00)	-2.900	EUR	-107.559,23	-0,02
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2018 (put, strike 3.200,00)	-3.200	EUR	-118.686,05	-0,02
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2018 (put, strike 3.200,00)	-6.600	EUR	-244.789,97	-0,05
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2018 (call, strike 3.250,00)	1.300	EUR	389.489,10	0,08
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2018 (call, strike 3.250,00)	-1.300	EUR	-389.489,10	-0,07
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2018 (put, strike 3.250,00)	1.300	EUR	57.094,93	0,01
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2018 (put, strike 3.250,00)	-1.300	EUR	-57.094,93	-0,01
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2018 (call, strike 3.300,00)	3.000	EUR	773.578,55	0,15
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2018 (call, strike 3.300,00)	2.100	EUR	541.504,99	0,10
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2018 (call, strike 3.300,00)	2.000	EUR	515.719,04	0,10
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2018 (call, strike 3.300,00)	1.800	EUR	464.147,13	0,09
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2018 (call, strike 3.300,00)	-600	EUR	-154.715,71	-0,03
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2018 (call, strike 3.300,00)	-600	EUR	-154.715,71	-0,03
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2018 (call, strike 3.300,00)	-2.100	EUR	-541.504,99	-0,10
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2018 (call, strike 3.300,00)	-2.600	EUR	-670.434,75	-0,13
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2018 (call, strike 3.300,00)	-3.000	EUR	-773.578,55	-0,15
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2018 (put, strike 3.300,00)	3.000	EUR	156.690,61	0,03

Indexoptionen

Underlying		Kontrakte	Währung	Marktwert (EUR)	Nettoteilfonds- vermögen (%)
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2018 (put, strike 3.300,00)	2.100	EUR	109.683,42	0,02
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2018 (put, strike 3.300,00)	2.000	EUR	104.460,40	0,02
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2018 (put, strike 3.300,00)	1.800	EUR	94.014,36	0,02
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2018 (put, strike 3.300,00)	-600	EUR	-31.338,12	-0,01
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2018 (put, strike 3.300,00)	-600	EUR	-31.338,12	-0,01
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2018 (put, strike 3.300,00)	-2.100	EUR	-109.683,42	-0,02
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2018 (put, strike 3.300,00)	-2.600	EUR	-135.798,53	-0,03
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2018 (put, strike 3.300,00)	-3.000	EUR	-156.690,61	-0,03
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2018 (call, strike 3.350,00)	2.550	EUR	555.992,32	0,11
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2018 (call, strike 3.350,00)	-2.550	EUR	-555.992,32	-0,11
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2018 (put, strike 3.350,00)	2.550	EUR	159.286,77	0,03
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2018 (put, strike 3.350,00)	-2.550	EUR	-159.286,77	-0,03
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2018 (call, strike 3.400,00)	4.000	EUR	721.858,15	0,14
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2018 (call, strike 3.400,00)	2.700	EUR	487.254,25	0,09
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2018 (call, strike 3.400,00)	2.000	EUR	360.929,07	0,07
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2018 (call, strike 3.400,00)	1.200	EUR	216.557,44	0,04
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2018 (call, strike 3.400,00)	-2.000	EUR	-360.929,07	-0,07
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2018 (call, strike 3.400,00)	-2.300	EUR	-415.068,44	-0,08
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2018 (call, strike 3.400,00)	-2.800	EUR	-505.300,70	-0,10
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2018 (call, strike 3.400,00)	-2.800	EUR	-505.300,70	-0,10
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2018 (put, strike 3.400,00)	4.000	EUR	299.808,97	0,06
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2018 (put, strike 3.400,00)	2.700	EUR	202.371,05	0,04
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2018 (put, strike 3.400,00)	2.000	EUR	149.904,48	0,03
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2018 (put, strike 3.400,00)	1.200	EUR	89.942,69	0,02
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2018 (put, strike 3.400,00)	-2.000	EUR	-149.904,48	-0,03
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2018 (put, strike 3.400,00)	-2.300	EUR	-172.390,16	-0,03
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2018 (put, strike 3.400,00)	-2.800	EUR	-209.866,28	-0,04
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2018 (put, strike 3.400,00)	-2.800	EUR	-209.866,28	-0,04
Euro Stoxx 50 [®]	Jun 2019 (put, strike 2.700,00)	-7.000	EUR	-261.286,37	-0,05
Euro Stoxx 50 [®]	Jun 2019 (put, strike 2.700,00)	-11.000	EUR	-410.592,86	-0,08
Euro Stoxx 50 [®]	Jun 2019 (put, strike 2.750,00)	-5.000	EUR	-208.360,77	-0,04
Euro Stoxx 50 [®]	Jun 2019 (put, strike 2.750,00)	-5.200	EUR	-216.695,20	-0,04
Euro Stoxx 50 [®]	Jun 2019 (put, strike 2.750,00)	-10.500	EUR	-437.557,62	-0,08
Euro Stoxx 50 [®]	Jun 2019 (put, strike 2.800,00)	-5.000	EUR	-232.483,30	-0,04
Euro Stoxx 50 [®]	Jun 2019 (put, strike 2.900,00)	-9.500	EUR	-547.493,37	-0,11
Euro Stoxx 50 [®]	Jun 2019 (put, strike 3.000,00)	-4.500	EUR	-322.103,02	-0,06
Euro Stoxx 50 [®]	Jun 2019 (put, strike 3.000,00)	-11.000	EUR	-787.362,94	-0,15
Euro Stoxx 50 [®]	Jun 2019 (call, strike 3.100,00)	5.200	EUR	2.064.352,59	0,40
Euro Stoxx 50 [®]	Jun 2019 (call, strike 3.100,00)	-2.100	EUR	-833.680,85	-0,16
Euro Stoxx 50 [®]	Jun 2019 (call, strike 3.100,00)	-3.300	EUR	-1.310.069,91	-0,25
Euro Stoxx 50 [®]	Jun 2019 (call, strike 3.100,00)	-5.200	EUR	-2.064.352,59	-0,40
Euro Stoxx 50 [®]	Jun 2019 (put, strike 3.100,00)	5.200	EUR	468.871,79	0,09
Euro Stoxx 50 [®]	Jun 2019 (put, strike 3.100,00)	-2.100	EUR	-189.352,07	-0,04
Euro Stoxx 50 [®]	Jun 2019 (put, strike 3.100,00)	-3.300	EUR	-297.553,25	-0,06

Indexoptionen

Underlying		Kontrakte	Währung	Marktwert (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
Euro Stoxx 50 [®]	Jun 2019 (put, strike 3.100,00)	-3.600	EUR	-324.603,54	-0,06
Euro Stoxx 50 [®]	Jun 2019 (put, strike 3.100,00)	-4.900	EUR	-441.821,49	-0,09
Euro Stoxx 50 [®]	Jun 2019 (put, strike 3.100,00)	-5.200	EUR	-468.871,79	-0,09
Euro Stoxx 50 [®]	Jun 2019 (put, strike 3.100,00)	-10.000	EUR	-901.676,51	-0,17
Euro Stoxx 50 [®]	Jun 2019 (put, strike 3.150,00)	-4.600	EUR	-465.159,54	-0,09
Euro Stoxx 50 [®]	Jun 2019 (put, strike 3.150,00)	-4.800	EUR	-485.383,87	-0,09
Euro Stoxx 50 [®]	Jun 2019 (call, strike 3.200,00)	-2.000	EUR	-640.446,35	-0,12
Euro Stoxx 50 [®]	Jun 2019 (put, strike 3.200,00)	-2.000	EUR	-227.274,15	-0,04
Euro Stoxx 50 [®]	Jun 2019 (put, strike 3.200,00)	-3.800	EUR	-431.820,89	-0,08
Euro Stoxx 50 [®]	Jun 2019 (put, strike 3.200,00)	-4.000	EUR	-454.548,31	-0,09
Euro Stoxx 50 [®]	Jun 2019 (put, strike 3.200,00)	-4.800	EUR	-545.457,97	-0,11
Euro Stoxx 50 [®]	Jun 2019 (call, strike 3.300,00)	-1.950	EUR	-487.382,43	-0,09
Euro Stoxx 50 [®]	Jun 2019 (call, strike 3.300,00)	-3.100	EUR	-774.813,09	-0,15
Euro Stoxx 50 [®]	Jun 2019 (put, strike 3.300,00)	-1.950	EUR	-280.001,94	-0,05
Euro Stoxx 50 [®]	Jun 2019 (put, strike 3.300,00)	-3.100	EUR	-445.131,29	-0,09
Euro Stoxx 50 [®]	Jun 2019 (call, strike 3.350,00)	2.800	EUR	609.389,83	0,12
Euro Stoxx 50 [®]	Jun 2019 (call, strike 3.350,00)	-2.800	EUR	-609.389,83	-0,12
Euro Stoxx 50 [®]	Jun 2019 (put, strike 3.350,00)	2.800	EUR	451.944,71	0,09
Euro Stoxx 50 [®]	Jun 2019 (put, strike 3.350,00)	-2.800	EUR	-451.944,71	-0,09
Euro Stoxx 50 [®]	Jun 2019 (call, strike 3.450,00)	-2.000	EUR	-319.194,12	-0,06
Euro Stoxx 50 [®]	Jun 2019 (put, strike 3.450,00)	-2.000	EUR	-407.207,58	-0,08
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2019 (call, strike 100,00)	130.000	EUR	2.181.646,35	0,42
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2019 (put, strike 2.700,00)	-8.800	EUR	-583.349,18	-0,11
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2019 (put, strike 2.800,00)	-4.600	EUR	-368.387,47	-0,07
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2019 (put, strike 2.800,00)	-7.500	EUR	-600.631,75	-0,12
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2019 (put, strike 2.800,00)	-14.500	EUR	-1.161.221,38	-0,22
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2019 (put, strike 2.900,00)	-4.000	EUR	-387.279,80	-0,07
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2019 (put, strike 2.900,00)	-5.300	EUR	-513.145,74	-0,10
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2019 (put, strike 2.900,00)	-6.000	EUR	-580.919,71	-0,11
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2019 (call, strike 3.000,00)	-2.000	EUR	-1.004.580,32	-0,19
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2019 (call, strike 3.000,00)	-3.000	EUR	-1.506.870,48	-0,29
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2019 (put, strike 3.000,00)	-2.000	EUR	-233.600,09	-0,04
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2019 (put, strike 3.000,00)	-2.000	EUR	-233.600,09	-0,04
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2019 (put, strike 3.000,00)	-3.000	EUR	-350.400,14	-0,07
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2019 (put, strike 3.000,00)	-3.100	EUR	-362.080,14	-0,07
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2019 (put, strike 3.000,00)	-4.400	EUR	-513.920,20	-0,10
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2019 (put, strike 3.000,00)	-6.500	EUR	-759.200,30	-0,15
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2019 (put, strike 3.000,00)	-6.500	EUR	-759.200,30	-0,15
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2019 (put, strike 3.000,00)	-6.500	EUR	-759.200,30	-0,15
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2019 (put, strike 3.000,00)	-7.000	EUR	-817.600,32	-0,16
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2019 (put, strike 3.000,00)	-8.000	EUR	-934.400,37	-0,18
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2019 (call, strike 3.100,00)	-2.000	EUR	-852.806,03	-0,16
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2019 (call, strike 3.100,00)	-2.100	EUR	-895.446,33	-0,17
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2019 (call, strike 3.100,00)	-2.200	EUR	-938.086,63	-0,18

Indexoptionen

Underlying		Kontrakte	Währung	Marktwert (EUR)	Nettoteilfonds- vermögen (%)
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2019 (call, strike 3.100,00)	-2.300	EUR	-980.726,93	-0,19
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2019 (call, strike 3.100,00)	-2.800	EUR	-1.193.928,44	-0,23
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2019 (call, strike 3.100,00)	-5.100	EUR	-2.174.655,38	-0,42
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2019 (put, strike 3.100,00)	-2.000	EUR	-282.463,56	-0,05
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2019 (put, strike 3.100,00)	-2.100	EUR	-296.586,74	-0,06
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2019 (put, strike 3.100,00)	-2.200	EUR	-310.709,91	-0,06
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2019 (put, strike 3.100,00)	-2.300	EUR	-324.833,09	-0,06
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2019 (put, strike 3.100,00)	-2.800	EUR	-395.448,98	-0,08
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2019 (put, strike 3.100,00)	-4.900	EUR	-692.035,72	-0,13
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2019 (put, strike 3.100,00)	-5.100	EUR	-720.282,07	-0,14
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2019 (put, strike 3.100,00)	-7.200	EUR	-1.016.868,81	-0,20
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2019 (put, strike 3.150,00)	-4.300	EUR	-666.714,01	-0,13
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2019 (call, strike 3.200,00)	3.300	EUR	1.172.640,89	0,23
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2019 (call, strike 3.200,00)	-1.700	EUR	-604.087,73	-0,12
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2019 (call, strike 3.200,00)	-1.800	EUR	-639.622,30	-0,12
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2019 (call, strike 3.200,00)	-2.500	EUR	-888.364,31	-0,17
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2019 (call, strike 3.200,00)	-2.900	EUR	-1.030.502,60	-0,20
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2019 (call, strike 3.200,00)	-3.300	EUR	-1.172.640,89	-0,23
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2019 (call, strike 3.200,00)	-3.600	EUR	-1.279.244,61	-0,25
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2019 (call, strike 3.200,00)	-4.400	EUR	-1.563.521,19	-0,30
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2019 (call, strike 3.200,00)	-4.600	EUR	-1.634.590,33	-0,31
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2019 (put, strike 3.200,00)	3.300	EUR	562.628,11	0,11
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2019 (put, strike 3.200,00)	-1.700	EUR	-289.838,72	-0,06
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2019 (put, strike 3.200,00)	-1.800	EUR	-306.888,06	-0,06
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2019 (put, strike 3.200,00)	-2.500	EUR	-426.233,42	-0,08
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2019 (put, strike 3.200,00)	-2.900	EUR	-494.430,76	-0,10
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2019 (put, strike 3.200,00)	-3.300	EUR	-562.628,11	-0,11
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2019 (put, strike 3.200,00)	-3.600	EUR	-613.776,12	-0,12
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2019 (put, strike 3.200,00)	-4.400	EUR	-750.170,81	-0,14
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2019 (put, strike 3.200,00)	-4.600	EUR	-784.269,49	-0,15
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2019 (put, strike 3.200,00)	-4.600	EUR	-784.269,49	-0,15
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2019 (put, strike 3.200,00)	-5.000	EUR	-852.466,84	-0,16
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2019 (put, strike 3.200,00)	-5.600	EUR	-954.762,86	-0,18
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2019 (call, strike 3.250,00)	-2.200	EUR	-708.654,29	-0,14
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2019 (call, strike 3.250,00)	-3.700	EUR	-1.191.827,66	-0,23
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2019 (put, strike 3.250,00)	-2.200	EUR	-412.329,87	-0,08
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2019 (put, strike 3.250,00)	-3.700	EUR	-693.463,87	-0,13
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2019 (call, strike 3.300,00)	3.200	EUR	929.211,07	0,18
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2019 (call, strike 3.300,00)	-1.500	EUR	-435.567,69	-0,08
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2019 (call, strike 3.300,00)	-1.500	EUR	-435.567,69	-0,08
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2019 (call, strike 3.300,00)	-3.000	EUR	-871.135,37	-0,17
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2019 (call, strike 3.300,00)	-3.200	EUR	-929.211,07	-0,18
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2019 (call, strike 3.300,00)	-3.200	EUR	-929.211,07	-0,18
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2019 (call, strike 3.300,00)	-4.800	EUR	-1.393.816,60	-0,27

Indexoptionen

Underlying		Kontrakte	Währung	Marktwert (EUR)	Nettoteilfonds- vermögen (%)
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2019 (put, strike 3.300,00)	3.200	EUR	658.703,93	0,13
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2019 (put, strike 3.300,00)	-1.500	EUR	-308.767,47	-0,06
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2019 (put, strike 3.300,00)	-1.500	EUR	-308.767,47	-0,06
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2019 (put, strike 3.300,00)	-3.000	EUR	-617.534,94	-0,12
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2019 (put, strike 3.300,00)	-3.200	EUR	-658.703,93	-0,13
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2019 (put, strike 3.300,00)	-3.200	EUR	-658.703,93	-0,13
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2019 (put, strike 3.300,00)	-4.800	EUR	-988.055,90	-0,19
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2019 (call, strike 3.350,00)	-1.700	EUR	-442.650,81	-0,09
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2019 (call, strike 3.350,00)	-2.600	EUR	-676.995,36	-0,13
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2019 (put, strike 3.350,00)	-1.700	EUR	-384.214,94	-0,07
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2019 (put, strike 3.350,00)	-2.600	EUR	-587.622,86	-0,11
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2019 (call, strike 3.400,00)	9.000	EUR	2.089.545,71	0,40
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2019 (call, strike 3.400,00)	-1.800	EUR	-417.909,14	-0,08
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2019 (call, strike 3.400,00)	-2.100	EUR	-487.560,66	-0,09
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2019 (call, strike 3.400,00)	-2.200	EUR	-510.777,84	-0,10
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2019 (call, strike 3.400,00)	-2.200	EUR	-510.777,84	-0,10
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2019 (put, strike 3.400,00)	9.000	EUR	2.231.614,30	0,43
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2019 (put, strike 3.400,00)	-1.800	EUR	-446.322,86	-0,09
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2019 (put, strike 3.400,00)	-2.100	EUR	-520.710,00	-0,10
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2019 (put, strike 3.400,00)	-2.200	EUR	-545.505,72	-0,11
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2019 (put, strike 3.400,00)	-2.200	EUR	-545.505,72	-0,11
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2019 (call, strike 3.450,00)	-3.000	EUR	-617.047,11	-0,12
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2019 (put, strike 3.450,00)	-3.000	EUR	-814.881,62	-0,16
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2019 (call, strike 3.500,00)	4.500	EUR	814.719,60	0,16
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2019 (call, strike 3.500,00)	-4.500	EUR	-814.719,60	-0,16
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2019 (put, strike 3.500,00)	4.500	EUR	1.337.188,84	0,26
Euro Stoxx 50 [®]	Dez 2019 (put, strike 3.500,00)	-4.500	EUR	-1.337.188,84	-0,26
Euro Stoxx 600	Dez 2019 (call, strike 160,00)	2.000	EUR	1.212.092,40	0,23
FTSE 100	Sep 2018 (call, strike 7.649,00)	60	GBP	9.576,82	0,00
FTSE 100	Sep 2018 (put, strike 7.649,00)	-60	GBP	-6.567,82	0,00
FTSE 100	Dez 2018 (put, strike 6.800,00)	2.200	GBP	108.829,73	0,02
FTSE 100	Dez 2018 (put, strike 6.800,00)	-2.200	GBP	-108.829,73	-0,02
FTSE 100	Dez 2018 (call, strike 7.100,00)	2.250	GBP	1.581.734,25	0,30
FTSE 100	Dez 2018 (call, strike 7.100,00)	-1.000	GBP	-702.993,00	-0,14
FTSE 100	Dez 2018 (call, strike 7.100,00)	-1.250	GBP	-878.741,25	-0,17
FTSE 100	Dez 2018 (put, strike 7.100,00)	2.250	GBP	187.370,10	0,04
FTSE 100	Dez 2018 (put, strike 7.100,00)	-1.000	GBP	-83.275,60	-0,02
FTSE 100	Dez 2018 (put, strike 7.100,00)	-1.250	GBP	-104.094,50	-0,02
FTSE 100	Dez 2018 (call, strike 7.200,00)	1.150	GBP	699.910,96	0,13
FTSE 100	Dez 2018 (call, strike 7.200,00)	-1.150	GBP	-699.910,96	-0,13
FTSE 100	Dez 2018 (put, strike 7.200,00)	1.150	GBP	115.734,20	0,02
FTSE 100	Dez 2018 (put, strike 7.200,00)	-1.150	GBP	-115.734,20	-0,02
FTSE 100	Jun 2019 (call, strike 7.000,00)	-800	GBP	-630.761,91	-0,12
FTSE 100	Jun 2019 (put, strike 7.000,00)	-800	GBP	-171.985,16	-0,03

Indexoptionen

Underlying		Kontrakte	Währung	Marktwert (EUR)	Nettoteilfonds- vermögen (%)
FTSE 100	Dez 2019 (call, strike 7.400,00)	-1.000	GBP	-528.316,54	-0,10
FTSE 100	Dez 2019 (put, strike 7.400,00)	-1.000	GBP	-513.566,64	-0,10
Hang Seng China Enterprises Index	Dez 2018 (put, strike 9.400,00)	15.000	HKD	188.518,10	0,04
Hang Seng China Enterprises Index	Dez 2018 (put, strike 9.400,00)	-15.000	HKD	-188.518,10	-0,04
Hang Seng China Enterprises Index	Dez 2018 (put, strike 9.500,00)	16.000	HKD	221.937,38	0,04
Hang Seng China Enterprises Index	Dez 2018 (put, strike 9.500,00)	-16.000	HKD	-221.937,38	-0,04
Hang Seng China Enterprises Index	Dez 2018 (put, strike 9.600,00)	15.000	HKD	229.405,73	0,04
Hang Seng China Enterprises Index	Dez 2018 (put, strike 9.600,00)	-15.000	HKD	-229.405,73	-0,04
Hang Seng China Enterprises Index	Dez 2018 (put, strike 10.200,00)	20.000	HKD	542.350,89	0,10
Hang Seng China Enterprises Index	Dez 2018 (put, strike 10.200,00)	-20.000	HKD	-542.350,89	-0,10
iShares Euro Stoxx	Sep 2018 (put, strike 110,90)	33.800	EUR	45.595,73	0,01
iShares Euro Stoxx	Dez 2019 (put, strike 100,00)	130.000	EUR	767.614,77	0,15
Russell 2000	Jun 2019 (put, strike 1.250,00)	25.000	USD	337.266,95	0,07
Russell 2000	Jun 2019 (put, strike 1.350,00)	20.000	USD	415.941,58	0,08
Russell 2000	Jun 2019 (call, strike 1.400,00)	8.700	USD	2.321.314,47	0,45
Russell 2000	Jun 2019 (put, strike 1.400,00)	8.700	USD	222.899,63	0,04
Russell 2000	Dez 2019 (put, strike 1.400,00)	15.000	USD	594.813,65	0,11
S&P 500 Index	Jun 2018 (put, strike 2.500,00)	-7.000	USD	-379.060,68	-0,07
S&P 500 Index	Sep 2018 (call, strike 2.700,00)	-1.381	USD	-159.738,50	-0,03
S&P 500 Index	Sep 2018 (put, strike 2.700,00)	1.381	USD	21.052,52	0,00
S&P 500 Index	Sep 2018 (call, strike 2.706,00)	700	USD	77.801,39	0,02
S&P 500 Index	Sep 2018 (put, strike 2.706,00)	-700	USD	-11.083,06	0,00
S&P 500 Index	Sep 2018 (call, strike 2.713,00)	-1.598	USD	-169.241,07	-0,03
S&P 500 Index	Sep 2018 (put, strike 2.713,00)	1.598	USD	26.463,83	0,01
S&P 500 Index	Sep 2018 (call, strike 2.730,00)	-3.900	USD	-364.243,97	-0,07
S&P 500 Index	Sep 2018 (put, strike 2.730,00)	3.900	USD	72.280,88	0,01
S&P 500 Index	Sep 2018 (call, strike 2.732,00)	680	USD	62.522,58	0,01
S&P 500 Index	Sep 2018 (put, strike 2.732,00)	-680	USD	-12.775,01	0,00
S&P 500 Index	Sep 2018 (call, strike 2.736,00)	-1.944	USD	-173.128,11	-0,03
S&P 500 Index	Sep 2018 (put, strike 2.736,00)	1.944	USD	37.534,24	0,01
S&P 500 Index	Sep 2018 (call, strike 2.737,00)	-2.812	USD	-248.409,14	-0,05
S&P 500 Index	Sep 2018 (put, strike 2.737,00)	2.812	USD	54.668,32	0,01
S&P 500 Index	Sep 2018 (call, strike 2.740,00)	2.129	USD	183.499,51	0,04
S&P 500 Index	Sep 2018 (call, strike 2.740,00)	-1.800	USD	-155.142,85	-0,03
S&P 500 Index	Sep 2018 (put, strike 2.740,00)	1.800	USD	35.727,84	0,01
S&P 500 Index	Sep 2018 (put, strike 2.740,00)	-2.129	USD	-42.258,09	-0,01
S&P 500 Index	Sep 2018 (call, strike 2.750,00)	1.575	USD	124.621,09	0,02
S&P 500 Index	Sep 2018 (call, strike 2.750,00)	680	USD	53.804,67	0,01
S&P 500 Index	Sep 2018 (put, strike 2.750,00)	-680	USD	-14.486,37	0,00
S&P 500 Index	Sep 2018 (put, strike 2.750,00)	-1.575	USD	-33.553,00	-0,01
S&P 500 Index	Sep 2018 (call, strike 2.752,00)	1.716	USD	133.387,31	0,03
S&P 500 Index	Sep 2018 (call, strike 2.752,00)	-2.800	USD	-217.648,29	-0,04
S&P 500 Index	Sep 2018 (put, strike 2.752,00)	2.800	USD	60.521,03	0,01
S&P 500 Index	Sep 2018 (put, strike 2.752,00)	-1.716	USD	-37.090,75	-0,01

Indexoptionen

Underlying		Kontrakte	Währung	Marktwert (EUR)	Nettoteilfonds- vermögen (%)
S&P 500 Index	Sep 2018 (call, strike 2.758,00)	777	USD	57.179,22	0,01
S&P 500 Index	Sep 2018 (call, strike 2.758,00)	-2.880	USD	-211.938,42	-0,04
S&P 500 Index	Sep 2018 (put, strike 2.758,00)	2.880	USD	65.045,51	0,01
S&P 500 Index	Sep 2018 (put, strike 2.758,00)	-777	USD	-17.548,74	0,00
S&P 500 Index	Sep 2018 (call, strike 2.766,00)	1.015	USD	69.181,73	0,01
S&P 500 Index	Sep 2018 (call, strike 2.766,00)	880	USD	59.980,21	0,01
S&P 500 Index	Sep 2018 (call, strike 2.766,00)	-6.160	USD	-419.861,53	-0,08
S&P 500 Index	Sep 2018 (put, strike 2.766,00)	6.160	USD	147.663,73	0,03
S&P 500 Index	Sep 2018 (put, strike 2.766,00)	-880	USD	-21.094,82	0,00
S&P 500 Index	Sep 2018 (put, strike 2.766,00)	-1.015	USD	-24.330,95	0,00
S&P 500 Index	Sep 2018 (call, strike 2.769,00)	-6.200	USD	-410.141,40	-0,08
S&P 500 Index	Sep 2018 (put, strike 2.769,00)	6.200	USD	152.024,51	0,03
S&P 500 Index	Sep 2018 (call, strike 2.773,00)	920	USD	58.421,02	0,01
S&P 500 Index	Sep 2018 (put, strike 2.773,00)	-920	USD	-23.255,41	0,00
S&P 500 Index	Sep 2018 (call, strike 2.780,00)	935	USD	55.106,57	0,01
S&P 500 Index	Sep 2018 (call, strike 2.780,00)	600	USD	35.362,51	0,01
S&P 500 Index	Sep 2018 (call, strike 2.780,00)	495	USD	29.174,06	0,01
S&P 500 Index	Sep 2018 (put, strike 2.780,00)	-495	USD	-13.205,85	0,00
S&P 500 Index	Sep 2018 (put, strike 2.780,00)	-600	USD	-16.007,09	0,00
S&P 500 Index	Sep 2018 (put, strike 2.780,00)	-935	USD	-24.944,37	0,00
S&P 500 Index	Sep 2018 (call, strike 2.782,00)	-2.142	USD	-123.490,72	-0,02
S&P 500 Index	Sep 2018 (put, strike 2.782,00)	2.142	USD	58.042,13	0,01
S&P 500 Index	Sep 2018 (call, strike 2.786,00)	-110	USD	-6.061,77	0,00
S&P 500 Index	Sep 2018 (put, strike 2.786,00)	110	USD	3.075,64	0,00
S&P 500 Index	Sep 2018 (call, strike 2.788,00)	1.040	USD	56.001,68	0,01
S&P 500 Index	Sep 2018 (call, strike 2.788,00)	-864	USD	-46.524,47	-0,01
S&P 500 Index	Sep 2018 (put, strike 2.788,00)	864	USD	24.542,16	0,00
S&P 500 Index	Sep 2018 (put, strike 2.788,00)	-1.040	USD	-29.541,48	-0,01
S&P 500 Index	Sep 2018 (call, strike 2.789,00)	-3.024	USD	-160.942,02	-0,03
S&P 500 Index	Sep 2018 (put, strike 2.789,00)	3.024	USD	86.580,55	0,02
S&P 500 Index	Sep 2018 (call, strike 2.791,00)	910	USD	47.298,26	0,01
S&P 500 Index	Sep 2018 (call, strike 2.791,00)	-2.590	USD	-134.618,12	-0,03
S&P 500 Index	Sep 2018 (put, strike 2.791,00)	2.590	USD	75.342,60	0,01
S&P 500 Index	Sep 2018 (put, strike 2.791,00)	-910	USD	-26.471,72	-0,01
S&P 500 Index	Sep 2018 (call, strike 2.793,00)	-10.790	USD	-547.485,53	-0,11
S&P 500 Index	Sep 2018 (put, strike 2.793,00)	10.790	USD	318.929,92	0,06
S&P 500 Index	Sep 2018 (call, strike 2.800,00)	-1.179	USD	-54.813,37	-0,01
S&P 500 Index	Sep 2018 (put, strike 2.800,00)	1.179	USD	36.871,69	0,01
S&P 500 Index	Sep 2018 (call, strike 2.801,00)	800	USD	36.715,71	0,01
S&P 500 Index	Sep 2018 (put, strike 2.801,00)	-800	USD	-25.223,20	0,00
S&P 500 Index	Sep 2018 (call, strike 2.803,00)	-1.847	USD	-82.595,36	-0,02
S&P 500 Index	Sep 2018 (put, strike 2.803,00)	1.847	USD	59.209,56	0,01
S&P 500 Index	Sep 2018 (call, strike 2.807,00)	-3.034	USD	-128.874,19	-0,02
S&P 500 Index	Sep 2018 (put, strike 2.807,00)	3.034	USD	100.799,85	0,02

Indexoptionen

Underlying		Kontrakte	Währung	Marktwert (EUR)	Nettoteilfonds- vermögen (%)
S&P 500 Index	Sep 2018 (call, strike 2.808,00)	518	USD	21.716,23	0,00
S&P 500 Index	Sep 2018 (put, strike 2.808,00)	-518	USD	-17.364,42	0,00
S&P 500 Index	Sep 2018 (call, strike 2.812,00)	609	USD	24.200,72	0,00
S&P 500 Index	Sep 2018 (put, strike 2.812,00)	-609	USD	-21.160,04	0,00
S&P 500 Index	Sep 2018 (call, strike 2.828,00)	-3.612	USD	-113.744,73	-0,02
S&P 500 Index	Sep 2018 (put, strike 2.828,00)	3.612	USD	144.952,93	0,03
S&P 500 Index	Sep 2018 (call, strike 2.841,00)	798	USD	20.285,06	0,00
S&P 500 Index	Sep 2018 (put, strike 2.841,00)	-798	USD	-36.019,23	-0,01
S&P 500 Index	Sep 2018 (call, strike 2.843,00)	-3.555	USD	-87.239,03	-0,02
S&P 500 Index	Sep 2018 (put, strike 2.843,00)	3.555	USD	163.391,16	0,03
S&P 500 Index	Dez 2018 (put, strike 2.100,00)	10.800	USD	65.154,45	0,01
S&P 500 Index	Dez 2018 (put, strike 2.100,00)	-10.800	USD	-65.154,45	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2018 (put, strike 2.200,00)	21.500	USD	176.413,98	0,03
S&P 500 Index	Dez 2018 (put, strike 2.200,00)	12.000	USD	98.463,62	0,02
S&P 500 Index	Dez 2018 (put, strike 2.200,00)	-10.500	USD	-86.155,67	-0,02
S&P 500 Index	Dez 2018 (put, strike 2.200,00)	-11.000	USD	-90.258,31	-0,02
S&P 500 Index	Dez 2018 (put, strike 2.200,00)	-12.000	USD	-98.463,62	-0,02
S&P 500 Index	Dez 2018 (call, strike 2.300,00)	7.700	USD	3.492.094,86	0,67
S&P 500 Index	Dez 2018 (call, strike 2.300,00)	5.500	USD	2.494.353,47	0,48
S&P 500 Index	Dez 2018 (call, strike 2.300,00)	-3.000	USD	-1.360.556,44	-0,26
S&P 500 Index	Dez 2018 (call, strike 2.300,00)	-3.700	USD	-1.678.019,61	-0,32
S&P 500 Index	Dez 2018 (call, strike 2.300,00)	-3.800	USD	-1.723.371,49	-0,33
S&P 500 Index	Dez 2018 (call, strike 2.300,00)	-4.000	USD	-1.814.075,25	-0,35
S&P 500 Index	Dez 2018 (call, strike 2.300,00)	-5.400	USD	-2.449.001,59	-0,47
S&P 500 Index	Dez 2018 (call, strike 2.300,00)	-5.500	USD	-2.494.353,47	-0,48
S&P 500 Index	Dez 2018 (call, strike 2.300,00)	-7.700	USD	-3.492.094,86	-0,67
S&P 500 Index	Dez 2018 (put, strike 2.300,00)	10.000	USD	112.331,61	0,02
S&P 500 Index	Dez 2018 (put, strike 2.300,00)	8.500	USD	95.481,87	0,02
S&P 500 Index	Dez 2018 (put, strike 2.300,00)	7.700	USD	86.495,34	0,02
S&P 500 Index	Dez 2018 (put, strike 2.300,00)	5.500	USD	61.782,39	0,01
S&P 500 Index	Dez 2018 (put, strike 2.300,00)	5.500	USD	61.782,39	0,01
S&P 500 Index	Dez 2018 (put, strike 2.300,00)	-3.000	USD	-33.699,48	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2018 (put, strike 2.300,00)	-3.700	USD	-41.562,69	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2018 (put, strike 2.300,00)	-3.800	USD	-42.686,01	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2018 (put, strike 2.300,00)	-4.000	USD	-44.932,64	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2018 (put, strike 2.300,00)	-5.400	USD	-60.659,07	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2018 (put, strike 2.300,00)	-5.500	USD	-61.782,39	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2018 (put, strike 2.300,00)	-5.500	USD	-61.782,39	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2018 (put, strike 2.300,00)	-7.700	USD	-86.495,34	-0,02
S&P 500 Index	Dez 2018 (put, strike 2.300,00)	-7.900	USD	-88.741,97	-0,02
S&P 500 Index	Dez 2018 (put, strike 2.300,00)	-8.500	USD	-95.481,87	-0,02
S&P 500 Index	Dez 2018 (put, strike 2.300,00)	-20.000	USD	-224.663,22	-0,04
S&P 500 Index	Dez 2018 (call, strike 2.350,00)	4.600	USD	1.900.448,69	0,37
S&P 500 Index	Dez 2018 (call, strike 2.350,00)	4.500	USD	1.859.134,58	0,36

Indexoptionen

Underlying		Kontrakte	Währung	Marktwert (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
S&P 500 Index	Dez 2018 (call, strike 2.350,00)	4.300	USD	1.776.506,38	0,34
S&P 500 Index	Dez 2018 (call, strike 2.350,00)	4.000	USD	1.652.564,08	0,32
S&P 500 Index	Dez 2018 (call, strike 2.350,00)	4.000	USD	1.652.564,08	0,32
S&P 500 Index	Dez 2018 (call, strike 2.350,00)	-4.000	USD	-1.652.564,08	-0,32
S&P 500 Index	Dez 2018 (call, strike 2.350,00)	-4.000	USD	-1.652.564,08	-0,32
S&P 500 Index	Dez 2018 (call, strike 2.350,00)	-4.300	USD	-1.776.506,38	-0,34
S&P 500 Index	Dez 2018 (call, strike 2.350,00)	-4.500	USD	-1.859.134,58	-0,36
S&P 500 Index	Dez 2018 (call, strike 2.350,00)	-4.600	USD	-1.900.448,69	-0,37
S&P 500 Index	Dez 2018 (call, strike 2.350,00)	-5.200	USD	-2.148.333,29	-0,41
S&P 500 Index	Dez 2018 (put, strike 2.350,00)	4.600	USD	60.686,13	0,01
S&P 500 Index	Dez 2018 (put, strike 2.350,00)	4.500	USD	59.366,86	0,01
S&P 500 Index	Dez 2018 (put, strike 2.350,00)	4.300	USD	56.728,34	0,01
S&P 500 Index	Dez 2018 (put, strike 2.350,00)	4.000	USD	52.770,55	0,01
S&P 500 Index	Dez 2018 (put, strike 2.350,00)	4.000	USD	52.770,55	0,01
S&P 500 Index	Dez 2018 (put, strike 2.350,00)	-4.000	USD	-52.770,55	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2018 (put, strike 2.350,00)	-4.000	USD	-52.770,55	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2018 (put, strike 2.350,00)	-4.300	USD	-56.728,34	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2018 (put, strike 2.350,00)	-4.500	USD	-59.366,86	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2018 (put, strike 2.350,00)	-4.600	USD	-60.686,13	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2018 (put, strike 2.350,00)	-5.200	USD	-68.601,71	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2018 (put, strike 2.350,00)	-7.200	USD	-94.986,98	-0,02
S&P 500 Index	Dez 2018 (call, strike 2.400,00)	9.000	USD	3.358.339,87	0,65
S&P 500 Index	Dez 2018 (call, strike 2.400,00)	4.000	USD	1.492.595,50	0,29
S&P 500 Index	Dez 2018 (call, strike 2.400,00)	3.700	USD	1.380.650,84	0,27
S&P 500 Index	Dez 2018 (call, strike 2.400,00)	-700	USD	-261.204,21	-0,05
S&P 500 Index	Dez 2018 (call, strike 2.400,00)	-2.700	USD	-1.007.501,96	-0,19
S&P 500 Index	Dez 2018 (call, strike 2.400,00)	-2.900	USD	-1.082.131,74	-0,21
S&P 500 Index	Dez 2018 (call, strike 2.400,00)	-3.700	USD	-1.380.650,84	-0,27
S&P 500 Index	Dez 2018 (call, strike 2.400,00)	-3.800	USD	-1.417.965,73	-0,27
S&P 500 Index	Dez 2018 (call, strike 2.400,00)	-4.000	USD	-1.492.595,50	-0,29
S&P 500 Index	Dez 2018 (call, strike 2.400,00)	-4.200	USD	-1.567.225,27	-0,30
S&P 500 Index	Dez 2018 (call, strike 2.400,00)	-4.500	USD	-1.679.169,93	-0,32
S&P 500 Index	Dez 2018 (call, strike 2.400,00)	-5.200	USD	-1.940.374,15	-0,37
S&P 500 Index	Dez 2018 (call, strike 2.400,00)	-7.500	USD	-2.798.616,56	-0,54
S&P 500 Index	Dez 2018 (put, strike 2.400,00)	9.000	USD	139.839,86	0,03
S&P 500 Index	Dez 2018 (put, strike 2.400,00)	8.500	USD	132.070,98	0,03
S&P 500 Index	Dez 2018 (put, strike 2.400,00)	6.800	USD	105.656,78	0,02
S&P 500 Index	Dez 2018 (put, strike 2.400,00)	4.000	USD	62.151,05	0,01
S&P 500 Index	Dez 2018 (put, strike 2.400,00)	3.700	USD	57.489,72	0,01
S&P 500 Index	Dez 2018 (put, strike 2.400,00)	-700	USD	-10.876,43	0,00
S&P 500 Index	Dez 2018 (put, strike 2.400,00)	-2.700	USD	-41.951,96	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2018 (put, strike 2.400,00)	-2.900	USD	-45.059,51	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2018 (put, strike 2.400,00)	-3.700	USD	-57.489,72	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2018 (put, strike 2.400,00)	-3.800	USD	-59.043,49	-0,01

Indexoptionen

Underlying		Kontrakte	Währung	Marktwert (EUR)	Nettoteilfonds- vermögen (%)
S&P 500 Index	Dez 2018 (put, strike 2.400,00)	-4.000	USD	-62.151,05	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2018 (put, strike 2.400,00)	-4.200	USD	-65.258,60	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2018 (put, strike 2.400,00)	-4.500	USD	-69.919,94	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2018 (put, strike 2.400,00)	-5.200	USD	-80.796,37	-0,02
S&P 500 Index	Dez 2018 (put, strike 2.400,00)	-6.800	USD	-105.656,78	-0,02
S&P 500 Index	Dez 2018 (put, strike 2.400,00)	-7.500	USD	-116.533,22	-0,02
S&P 500 Index	Dez 2018 (put, strike 2.400,00)	-8.500	USD	-132.070,98	-0,03
S&P 500 Index	Dez 2018 (call, strike 2.450,00)	4.600	USD	1.534.753,09	0,30
S&P 500 Index	Dez 2018 (call, strike 2.450,00)	4.500	USD	1.501.388,89	0,29
S&P 500 Index	Dez 2018 (call, strike 2.450,00)	4.100	USD	1.367.932,10	0,26
S&P 500 Index	Dez 2018 (call, strike 2.450,00)	3.700	USD	1.234.475,30	0,24
S&P 500 Index	Dez 2018 (call, strike 2.450,00)	-3.700	USD	-1.234.475,30	-0,24
S&P 500 Index	Dez 2018 (call, strike 2.450,00)	-4.100	USD	-1.367.932,10	-0,26
S&P 500 Index	Dez 2018 (call, strike 2.450,00)	-4.500	USD	-1.501.388,89	-0,29
S&P 500 Index	Dez 2018 (call, strike 2.450,00)	-4.600	USD	-1.534.753,09	-0,30
S&P 500 Index	Dez 2018 (put, strike 2.450,00)	7.600	USD	139.597,79	0,03
S&P 500 Index	Dez 2018 (put, strike 2.450,00)	4.600	USD	84.493,41	0,02
S&P 500 Index	Dez 2018 (put, strike 2.450,00)	4.500	USD	82.656,59	0,02
S&P 500 Index	Dez 2018 (put, strike 2.450,00)	4.100	USD	75.309,34	0,01
S&P 500 Index	Dez 2018 (put, strike 2.450,00)	3.700	USD	67.962,09	0,01
S&P 500 Index	Dez 2018 (put, strike 2.450,00)	-3.700	USD	-67.962,09	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2018 (put, strike 2.450,00)	-4.100	USD	-75.309,34	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2018 (put, strike 2.450,00)	-4.500	USD	-82.656,59	-0,02
S&P 500 Index	Dez 2018 (put, strike 2.450,00)	-4.600	USD	-84.493,41	-0,02
S&P 500 Index	Dez 2018 (put, strike 2.450,00)	-6.000	USD	-110.208,79	-0,02
S&P 500 Index	Dez 2018 (call, strike 2.500,00)	5.000	USD	1.473.659,47	0,28
S&P 500 Index	Dez 2018 (call, strike 2.500,00)	-5.000	USD	-1.473.659,47	-0,28
S&P 500 Index	Dez 2018 (put, strike 2.500,00)	5.000	USD	108.976,60	0,02
S&P 500 Index	Dez 2018 (put, strike 2.500,00)	-5.000	USD	-108.976,60	-0,02
S&P 500 Index	Dez 2018 (call, strike 2.550,00)	-4.400	USD	-1.128.740,52	-0,22
S&P 500 Index	Dez 2018 (put, strike 2.550,00)	-4.400	USD	-114.103,58	-0,02
S&P 500 Index	Jun 2019 (put, strike 2.150,00)	-15.000	USD	-344.948,95	-0,07
S&P 500 Index	Jun 2019 (put, strike 2.200,00)	-11.000	USD	-286.458,81	-0,06
S&P 500 Index	Jun 2019 (call, strike 2.300,00)	-5.200	USD	-2.499.124,52	-0,48
S&P 500 Index	Jun 2019 (put, strike 2.300,00)	-5.200	USD	-173.177,45	-0,03
S&P 500 Index	Jun 2019 (put, strike 2.300,00)	-6.200	USD	-206.480,80	-0,04
S&P 500 Index	Jun 2019 (put, strike 2.300,00)	-12.200	USD	-406.300,93	-0,08
S&P 500 Index	Jun 2019 (call, strike 2.350,00)	-5.000	USD	-2.215.844,41	-0,43
S&P 500 Index	Jun 2019 (put, strike 2.350,00)	-5.000	USD	-188.138,80	-0,04
S&P 500 Index	Jun 2019 (call, strike 2.400,00)	-4.900	USD	-1.990.753,94	-0,38
S&P 500 Index	Jun 2019 (call, strike 2.400,00)	-5.000	USD	-2.031.381,58	-0,39
S&P 500 Index	Jun 2019 (put, strike 2.400,00)	-4.900	USD	-208.208,78	-0,04
S&P 500 Index	Jun 2019 (put, strike 2.400,00)	-5.000	USD	-212.457,94	-0,04
S&P 500 Index	Jun 2019 (put, strike 2.400,00)	-7.500	USD	-318.686,91	-0,06

Indexoptionen

Underlying		Kontrakte	Währung	Marktwert (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
S&P 500 Index	Jun 2019 (call, strike 2.450,00)	-5.000	USD	-1.849.962,94	-0,36
S&P 500 Index	Jun 2019 (put, strike 2.450,00)	-5.000	USD	-239.821,27	-0,05
S&P 500 Index	Jun 2019 (put, strike 2.500,00)	-6.000	USD	-324.909,16	-0,06
S&P 500 Index	Jun 2019 (put, strike 2.500,00)	-7.000	USD	-379.060,68	-0,07
S&P 500 Index	Jun 2019 (put, strike 2.500,00)	-8.000	USD	-433.212,20	-0,08
S&P 500 Index	Jun 2019 (call, strike 2.600,00)	-2.800	USD	-743.968,98	-0,14
S&P 500 Index	Jun 2019 (call, strike 2.600,00)	-3.300	USD	-876.820,60	-0,17
S&P 500 Index	Jun 2019 (put, strike 2.600,00)	-2.800	USD	-193.043,36	-0,04
S&P 500 Index	Jun 2019 (put, strike 2.600,00)	-3.300	USD	-227.515,39	-0,04
S&P 500 Index	Jun 2019 (put, strike 2.600,00)	-5.500	USD	-379.192,31	-0,07
S&P 500 Index	Jun 2019 (call, strike 2.650,00)	-3.200	USD	-745.136,55	-0,14
S&P 500 Index	Jun 2019 (put, strike 2.650,00)	-3.200	USD	-249.127,71	-0,05
S&P 500 Index	Dez 2019 (put, strike 2.300,00)	-9.500	USD	-503.080,21	-0,10
S&P 500 Index	Dez 2019 (put, strike 2.400,00)	-6.000	USD	-391.430,13	-0,08
S&P 500 Index	Dez 2019 (put, strike 2.400,00)	-9.000	USD	-587.145,19	-0,11
S&P 500 Index	Dez 2019 (put, strike 2.450,00)	-5.500	USD	-397.628,35	-0,08
S&P 500 Index	Dez 2019 (put, strike 2.450,00)	-6.400	USD	-462.694,81	-0,09
S&P 500 Index	Dez 2019 (put, strike 2.500,00)	-4.800	USD	-384.259,90	-0,07
S&P 500 Index	Dez 2019 (put, strike 2.500,00)	-6.000	USD	-480.324,88	-0,09
S&P 500 Index	Dez 2019 (put, strike 2.500,00)	-6.300	USD	-504.341,13	-0,10
S&P 500 Index	Dez 2019 (put, strike 2.500,00)	-7.000	USD	-560.379,04	-0,11
S&P 500 Index	Dez 2019 (put, strike 2.500,00)	-7.500	USD	-600.406,10	-0,12
S&P 500 Index	Dez 2019 (put, strike 2.500,00)	-7.500	USD	-600.406,10	-0,12
S&P 500 Index	Dez 2019 (put, strike 2.500,00)	-8.200	USD	-656.444,01	-0,13
S&P 500 Index	Dez 2019 (put, strike 2.500,00)	-10.000	USD	-800.541,47	-0,15
S&P 500 Index	Dez 2019 (put, strike 2.500,00)	-10.000	USD	-800.541,47	-0,15
S&P 500 Index	Dez 2019 (call, strike 2.550,00)	-3.400	USD	-1.146.242,69	-0,22
S&P 500 Index	Dez 2019 (call, strike 2.550,00)	-3.500	USD	-1.179.955,71	-0,23
S&P 500 Index	Dez 2019 (put, strike 2.550,00)	-3.400	USD	-301.282,18	-0,06
S&P 500 Index	Dez 2019 (put, strike 2.550,00)	-3.500	USD	-310.143,41	-0,06
S&P 500 Index	Dez 2019 (call, strike 2.600,00)	-2.200	USD	-671.888,47	-0,13
S&P 500 Index	Dez 2019 (call, strike 2.600,00)	-2.500	USD	-763.509,62	-0,15
S&P 500 Index	Dez 2019 (call, strike 2.600,00)	-2.500	USD	-763.509,62	-0,15
S&P 500 Index	Dez 2019 (call, strike 2.600,00)	-3.600	USD	-1.099.453,85	-0,21
S&P 500 Index	Dez 2019 (call, strike 2.600,00)	-4.200	USD	-1.282.696,17	-0,25
S&P 500 Index	Dez 2019 (call, strike 2.600,00)	-4.800	USD	-1.465.938,47	-0,28
S&P 500 Index	Dez 2019 (call, strike 2.600,00)	-5.000	USD	-1.527.019,25	-0,29
S&P 500 Index	Dez 2019 (call, strike 2.600,00)	-5.200	USD	-1.588.100,01	-0,31
S&P 500 Index	Dez 2019 (put, strike 2.600,00)	-2.200	USD	-215.676,93	-0,04
S&P 500 Index	Dez 2019 (put, strike 2.600,00)	-2.500	USD	-245.087,42	-0,05
S&P 500 Index	Dez 2019 (put, strike 2.600,00)	-2.500	USD	-245.087,42	-0,05
S&P 500 Index	Dez 2019 (put, strike 2.600,00)	-3.600	USD	-352.925,87	-0,07
S&P 500 Index	Dez 2019 (put, strike 2.600,00)	-4.200	USD	-411.746,86	-0,08
S&P 500 Index	Dez 2019 (put, strike 2.600,00)	-4.800	USD	-470.567,84	-0,09

Indexoptionen

Underlying		Kontrakte	Währung	Marktwert (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
S&P 500 Index	Dez 2019 (put, strike 2.600,00)	-5.000	USD	-490.174,83	-0,09
S&P 500 Index	Dez 2019 (put, strike 2.600,00)	-5.200	USD	-509.781,82	-0,10
S&P 500 Index	Dez 2019 (put, strike 2.600,00)	-5.600	USD	-548.995,81	-0,11
S&P 500 Index	Dez 2019 (put, strike 2.600,00)	-7.700	USD	-754.869,24	-0,15
S&P 500 Index	Dez 2019 (call, strike 2.650,00)	-3.500	USD	-961.023,70	-0,19
S&P 500 Index	Dez 2019 (call, strike 2.650,00)	-3.500	USD	-961.023,70	-0,19
S&P 500 Index	Dez 2019 (call, strike 2.650,00)	-3.800	USD	-1.043.397,15	-0,20
S&P 500 Index	Dez 2019 (call, strike 2.650,00)	-4.200	USD	-1.153.228,43	-0,22
S&P 500 Index	Dez 2019 (put, strike 2.650,00)	-3.500	USD	-379.253,82	-0,07
S&P 500 Index	Dez 2019 (put, strike 2.650,00)	-3.500	USD	-379.253,82	-0,07
S&P 500 Index	Dez 2019 (put, strike 2.650,00)	-3.800	USD	-411.761,28	-0,08
S&P 500 Index	Dez 2019 (put, strike 2.650,00)	-4.200	USD	-455.104,58	-0,09
S&P 500 Index	Dez 2019 (call, strike 2.700,00)	-2.100	USD	-513.933,31	-0,10
S&P 500 Index	Dez 2019 (call, strike 2.700,00)	-2.500	USD	-611.825,37	-0,12
S&P 500 Index	Dez 2019 (call, strike 2.700,00)	-2.900	USD	-709.717,43	-0,14
S&P 500 Index	Dez 2019 (call, strike 2.700,00)	-3.400	USD	-832.082,50	-0,16
S&P 500 Index	Dez 2019 (call, strike 2.700,00)	-3.500	USD	-856.555,52	-0,17
S&P 500 Index	Dez 2019 (call, strike 2.700,00)	-3.500	USD	-856.555,52	-0,17
S&P 500 Index	Dez 2019 (call, strike 2.700,00)	-3.700	USD	-905.501,55	-0,17
S&P 500 Index	Dez 2019 (call, strike 2.700,00)	-4.000	USD	-978.920,59	-0,19
S&P 500 Index	Dez 2019 (call, strike 2.700,00)	-4.000	USD	-978.920,59	-0,19
S&P 500 Index	Dez 2019 (call, strike 2.700,00)	-4.000	USD	-978.920,59	-0,19
S&P 500 Index	Dez 2019 (call, strike 2.700,00)	-4.200	USD	-1.027.866,62	-0,20
S&P 500 Index	Dez 2019 (put, strike 2.700,00)	-2.100	USD	-251.284,11	-0,05
S&P 500 Index	Dez 2019 (put, strike 2.700,00)	-2.500	USD	-299.147,75	-0,06
S&P 500 Index	Dez 2019 (put, strike 2.700,00)	-2.900	USD	-347.011,38	-0,07
S&P 500 Index	Dez 2019 (put, strike 2.700,00)	-3.400	USD	-406.840,94	-0,08
S&P 500 Index	Dez 2019 (put, strike 2.700,00)	-3.500	USD	-418.806,85	-0,08
S&P 500 Index	Dez 2019 (put, strike 2.700,00)	-3.500	USD	-418.806,85	-0,08
S&P 500 Index	Dez 2019 (put, strike 2.700,00)	-3.700	USD	-442.738,67	-0,09
S&P 500 Index	Dez 2019 (put, strike 2.700,00)	-4.000	USD	-478.636,40	-0,09
S&P 500 Index	Dez 2019 (put, strike 2.700,00)	-4.000	USD	-478.636,40	-0,09
S&P 500 Index	Dez 2019 (put, strike 2.700,00)	-4.000	USD	-478.636,40	-0,09
S&P 500 Index	Dez 2019 (put, strike 2.700,00)	-4.200	USD	-502.568,22	-0,10
S&P 500 Index	Dez 2019 (call, strike 2.750,00)	-4.000	USD	-864.321,23	-0,17
S&P 500 Index	Dez 2019 (put, strike 2.750,00)	-4.000	USD	-528.632,69	-0,10
S&P 500 Index	Dez 2019 (call, strike 2.800,00)	-3.700	USD	-697.835,95	-0,13
S&P 500 Index	Dez 2019 (call, strike 2.800,00)	-4.200	USD	-792.138,11	-0,15
S&P 500 Index	Dez 2019 (put, strike 2.800,00)	-3.700	USD	-539.575,05	-0,10
S&P 500 Index	Dez 2019 (put, strike 2.800,00)	-4.200	USD	-612.490,59	-0,12
STOXX Europe 600 Index	Jun 2019 (put, strike 160,00)	4.200	EUR	2.041.125,66	0,39
STOXX Europe 600 Index	Dez 2019 (put, strike 140,00)	2.800	EUR	878.276,98	0,17
STOXX Europe 600 Index	Dez 2019 (put, strike 160,00)	2.000	EUR	1.320.456,00	0,25
Swiss Market Index	Sep 2018 (call, strike 8.477,00)	848	CHF	515.969,70	0,10

Indexoptionen

Underlying		Kontrakte	Währung	Marktwert (EUR)	Nettoteilfonds- vermögen (%)
Swiss Market Index	Sep 2018 (call, strike 8.477,00)	-882	CHF	-536.657,16	-0,10
Swiss Market Index	Sep 2018 (put, strike 8.477,00)	882	CHF	18.246,06	0,00
Swiss Market Index	Sep 2018 (put, strike 8.477,00)	-848	CHF	-17.542,70	0,00
Swiss Market Index	Sep 2018 (call, strike 8.538,00)	-429	CHF	-239.713,38	-0,05
Swiss Market Index	Sep 2018 (call, strike 8.538,00)	-880	CHF	-491.719,76	-0,09
Swiss Market Index	Sep 2018 (put, strike 8.538,00)	880	CHF	20.876,83	0,00
Swiss Market Index	Sep 2018 (put, strike 8.538,00)	429	CHF	10.177,45	0,00
Swiss Market Index	Sep 2018 (call, strike 8.548,00)	614	CHF	338.115,68	0,07
Swiss Market Index	Sep 2018 (call, strike 8.548,00)	-605	CHF	-333.159,59	-0,06
Swiss Market Index	Sep 2018 (put, strike 8.548,00)	605	CHF	14.683,75	0,00
Swiss Market Index	Sep 2018 (put, strike 8.548,00)	-614	CHF	-14.902,19	0,00
Swiss Market Index	Sep 2018 (call, strike 8.553,00)	-196	CHF	-107.140,44	-0,02
Swiss Market Index	Sep 2018 (put, strike 8.553,00)	196	CHF	4.811,75	0,00
Swiss Market Index	Dez 2018 (call, strike 7.900,00)	1.100	CHF	1.220.046,39	0,24
Swiss Market Index	Dez 2018 (call, strike 7.900,00)	-1.100	CHF	-1.220.046,39	-0,24
Swiss Market Index	Dez 2018 (put, strike 7.900,00)	1.100	CHF	42.837,19	0,01
Swiss Market Index	Dez 2018 (put, strike 7.900,00)	-1.100	CHF	-42.837,19	-0,01
Swiss Market Index	Dez 2018 (call, strike 8.000,00)	1.500	CHF	1.542.183,31	0,30
Swiss Market Index	Dez 2018 (call, strike 8.000,00)	-500	CHF	-514.061,10	-0,10
Swiss Market Index	Dez 2018 (call, strike 8.000,00)	-1.000	CHF	-1.028.122,21	-0,20
Swiss Market Index	Dez 2018 (put, strike 8.000,00)	1.500	CHF	66.747,15	0,01
Swiss Market Index	Dez 2018 (put, strike 8.000,00)	-500	CHF	-22.249,05	0,00
Swiss Market Index	Dez 2018 (put, strike 8.000,00)	-1.000	CHF	-44.498,10	-0,01
Swiss Market Index	Dez 2018 (put, strike 8.100,00)	2.100	CHF	106.918,24	0,02
Swiss Market Index	Dez 2018 (put, strike 8.100,00)	-2.100	CHF	-106.918,24	-0,02
Swiss Market Index	Dez 2018 (call, strike 8.200,00)	1.100	CHF	955.713,20	0,18
Swiss Market Index	Dez 2018 (call, strike 8.200,00)	-1.100	CHF	-955.713,20	-0,18
Swiss Market Index	Dez 2018 (put, strike 8.200,00)	1.100	CHF	64.172,04	0,01
Swiss Market Index	Dez 2018 (put, strike 8.200,00)	-1.100	CHF	-64.172,04	-0,01
Swiss Market Index	Dez 2018 (put, strike 8.300,00)	2.100	CHF	140.578,33	0,03
Swiss Market Index	Dez 2018 (put, strike 8.300,00)	-2.100	CHF	-140.578,33	-0,03
Swiss Market Index	Dez 2018 (call, strike 8.500,00)	1.400	CHF	895.109,77	0,17
Swiss Market Index	Dez 2018 (call, strike 8.500,00)	1.350	CHF	863.141,56	0,17
Swiss Market Index	Dez 2018 (call, strike 8.500,00)	1.300	CHF	831.173,35	0,16
Swiss Market Index	Dez 2018 (call, strike 8.500,00)	-1.300	CHF	-831.173,35	-0,16
Swiss Market Index	Dez 2018 (call, strike 8.500,00)	-1.350	CHF	-863.141,56	-0,17
Swiss Market Index	Dez 2018 (call, strike 8.500,00)	-1.400	CHF	-895.109,77	-0,17
Swiss Market Index	Dez 2018 (put, strike 8.500,00)	2.300	CHF	203.711,86	0,04
Swiss Market Index	Dez 2018 (put, strike 8.500,00)	1.400	CHF	123.998,53	0,02
Swiss Market Index	Dez 2018 (put, strike 8.500,00)	1.350	CHF	119.570,00	0,02
Swiss Market Index	Dez 2018 (put, strike 8.500,00)	1.300	CHF	115.141,49	0,02
Swiss Market Index	Dez 2018 (put, strike 8.500,00)	-1.300	CHF	-115.141,49	-0,02
Swiss Market Index	Dez 2018 (put, strike 8.500,00)	-1.350	CHF	-119.570,00	-0,02
Swiss Market Index	Dez 2018 (put, strike 8.500,00)	-1.400	CHF	-123.998,53	-0,02

Indexoptionen

Underlying		Kontrakte	Währung	Marktwert (EUR)	Nettoteilfonds- vermögen (%)
Swiss Market Index	Dez 2018 (put, strike 8.500,00)	-2.300	CHF	-203.711,86	-0,04
Swiss Market Index	Dez 2018 (call, strike 8.700,00)	900	CHF	446.406,58	0,09
Swiss Market Index	Dez 2018 (call, strike 8.700,00)	-900	CHF	-446.406,58	-0,09
Swiss Market Index	Dez 2018 (put, strike 8.700,00)	900	CHF	106.511,14	0,02
Swiss Market Index	Dez 2018 (put, strike 8.700,00)	-900	CHF	-106.511,14	-0,02
Swiss Market Index	Jun 2019 (put, strike 7.200,00)	-2.800	CHF	-199.700,17	-0,04
Swiss Market Index	Jun 2019 (put, strike 8.000,00)	-1.750	CHF	-277.450,73	-0,05
Swiss Market Index	Jun 2019 (put, strike 8.100,00)	-2.300	CHF	-402.797,10	-0,08
Swiss Market Index	Jun 2019 (call, strike 8.200,00)	1.200	CHF	931.469,23	0,18
Swiss Market Index	Jun 2019 (call, strike 8.200,00)	-1.200	CHF	-931.469,23	-0,18
Swiss Market Index	Jun 2019 (put, strike 8.200,00)	1.200	CHF	232.041,28	0,04
Swiss Market Index	Jun 2019 (put, strike 8.200,00)	-1.200	CHF	-232.041,28	-0,04
Swiss Market Index	Jun 2019 (put, strike 8.200,00)	-1.900	CHF	-367.398,70	-0,07
Swiss Market Index	Jun 2019 (call, strike 8.500,00)	950	CHF	553.799,15	0,11
Swiss Market Index	Jun 2019 (call, strike 8.500,00)	-900	CHF	-524.651,82	-0,10
Swiss Market Index	Jun 2019 (call, strike 8.500,00)	-950	CHF	-553.799,15	-0,11
Swiss Market Index	Jun 2019 (put, strike 8.500,00)	950	CHF	247.575,07	0,05
Swiss Market Index	Jun 2019 (put, strike 8.500,00)	-900	CHF	-234.544,79	-0,05
Swiss Market Index	Jun 2019 (put, strike 8.500,00)	-950	CHF	-247.575,07	-0,05
Swiss Market Index	Dez 2019 (call, strike 8.000,00)	-1.600	CHF	-1.556.911,79	-0,30
Swiss Market Index	Dez 2019 (put, strike 8.000,00)	-1.600	CHF	-398.103,39	-0,08
Swiss Market Index	Dez 2019 (put, strike 8.000,00)	-1.800	CHF	-447.866,32	-0,09
Swiss Market Index	Dez 2019 (put, strike 8.000,00)	-2.100	CHF	-522.510,70	-0,10
Swiss Market Index	Dez 2019 (put, strike 8.000,00)	-2.200	CHF	-547.392,16	-0,11
Swiss Market Index	Dez 2019 (put, strike 8.000,00)	-3.600	CHF	-895.732,62	-0,17
Swiss Market Index	Dez 2019 (call, strike 8.200,00)	-1.350	CHF	-1.137.848,01	-0,22
Swiss Market Index	Dez 2019 (put, strike 8.200,00)	-1.350	CHF	-395.186,92	-0,08
Swiss Market Index	Dez 2019 (call, strike 8.400,00)	-1.300	CHF	-936.658,68	-0,18
Swiss Market Index	Dez 2019 (call, strike 8.400,00)	-1.450	CHF	-1.044.734,68	-0,20
Swiss Market Index	Dez 2019 (put, strike 8.400,00)	-1.300	CHF	-447.880,27	-0,09
Swiss Market Index	Dez 2019 (put, strike 8.400,00)	-1.450	CHF	-499.558,75	-0,10
Summe Indexoptionen				-186.896.387,57	-36,01
				-186.896.387,57	-36,01

Summe Optionen

41.258.837,71 7,95

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag (000)	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfonds- vermögen (%)
ABB Ltd. 21,28 %	20.12.2019	2.500	CHF	-56.200,65	-0,01
ABB Ltd. 21,05 %	21.06.2019	3.000	CHF	-19.942,17	0,00
ABB Ltd. 21,35 %	21.06.2019	3.460	CHF	-55.860,29	-0,01
ABB Ltd. 21,03 %	21.12.2018	4.000	CHF	-4.523,68	0,00
ABB Ltd. 20,80 %	20.12.2019	3.510	CHF	-37.971,32	-0,01
Adecco Group AG 22,19 %	20.12.2019	860	CHF	-6.815,56	0,00
Adecco Group AG 23,37 %	20.12.2019	2.500	CHF	-45.064,12	-0,01

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag (000)	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
AFLAC Inc. 18,18 %	21.06.2019	2.000	USD	17.982,14	0,00
AFLAC Inc. 16,36 %	18.01.2019	2.500	USD	39.357,29	0,01
AIA Group Ltd. 27,64 %	27.06.2019	30.420	HKD	-127.258,60	-0,02
AIA Group Ltd. 26,00 %	28.03.2019	11.753	HKD	-10.535,03	0,00
Akzo Nobel NV 21,92 %	20.12.2019	2.000	EUR	-39.560,00	-0,01
Amazon.com Inc. 29,60 %	17.01.2020	3.000	USD	15.614,72	0,00
Amazon.com Inc. 28,60 %	18.01.2019	2.500	USD	-14.614,76	0,00
Amazon.com Inc. 28,79 %	18.01.2019	2.000	USD	4.598,10	0,00
Amazon.com Inc. 30,69 %	17.01.2020	2.500	USD	-3.204,99	0,00
Amazon.com Inc. 28,33 %	18.01.2019	2.500	USD	15.640,35	0,00
Amazon.com Inc. 29,49 %	17.01.2020	2.500	USD	13.845,56	0,00
Amazon.com Inc. 27,40 %	21.06.2019	2.000	USD	39.656,43	0,01
Amazon.com Inc. 29,15 %	21.06.2019	1.390	USD	4.276,74	0,00
Amazon.com Inc. 29,18 %	21.06.2019	2.000	USD	13.196,02	0,00
Amazon.com Inc. 27,02 %	18.01.2019	3.000	USD	46.997,99	0,01
Amazon.com Inc. 27,70 %	18.01.2019	2.500	USD	23.695,57	0,00
America Airlines Group Inc. 31,75 %	18.01.2019	3.000	USD	77.304,39	0,01
America Airlines Group Inc. 34,80 %	18.01.2019	1.000	USD	-3.948,55	0,00
American Express Co. 24,40 %	21.06.2019	2.000	USD	-19.828,21	0,00
American Express Co. 22,20 %	18.01.2019	2.500	USD	19.422,24	0,00
American International Group Inc. 23,70 %	17.01.2020	1.000	USD	-10.948,25	0,00
American International Group Inc. 23,70 %	17.01.2020	3.000	USD	-32.844,75	-0,01
American International Group Inc. 21,49 %	18.01.2019	3.000	USD	-31.434,55	-0,01
American International Group Inc. 23,11 %	21.06.2019	2.000	USD	-20.306,82	0,00
American International Group Inc. 22,45 %	18.01.2019	2.500	USD	-50.382,47	-0,01
American International Group Inc. 23,50 %	21.06.2019	2.000	USD	-25.742,49	-0,01
American International Group Inc. 17,20 %	18.01.2019	2.500	USD	-46.621,94	-0,01
American International Group Inc. 23,72 %	17.01.2020	2.000	USD	-18.477,84	0,00
American International Group Inc. 24,76 %	17.01.2020	2.000	USD	-40.083,76	-0,01
Amgen Inc. 23,28 %	21.06.2019	1.390	USD	-24.900,13	0,00
Apple Inc. 28,18 %	18.01.2019	1.000	USD	-39.647,88	-0,01
Apple Inc. 23,40 %	17.01.2020	3.000	USD	-1.384,55	0,00
Apple Inc. 23,37 %	17.01.2020	4.000	USD	-6.187,77	0,00
Apple Inc. 27,23 %	17.01.2020	2.000	USD	-61.997,35	-0,01
Apple Inc. 24,00 %	17.01.2020	2.000	USD	-13.708,81	0,00
Apple Inc. 26,10 %	17.01.2020	3.500	USD	-69.069,70	-0,01
Apple Inc. 26,43 %	17.01.2020	3.000	USD	-72.330,24	-0,01
Apple Inc. 22,86 %	17.01.2020	2.500	USD	9.038,07	0,00
Apple Inc. 22,58 %	21.06.2019	1.390	USD	-534,59	0,00
Apple Inc. 26,26 %	17.01.2020	3.000	USD	-70.458,53	-0,01
Apple Inc. 25,70 %	17.01.2020	1.000	USD	-18.187,26	0,00
Apple Inc. 25,70 %	17.01.2020	3.000	USD	-54.561,77	-0,01
Apple Inc. 26,62 %	17.01.2020	2.500	USD	-62.711,00	-0,01
Apple Inc. 23,90 %	17.01.2020	3.000	USD	-24.588,69	0,00
Apple Inc. 23,54 %	17.01.2020	2.500	USD	1.111,06	0,00

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag (000)	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
Apple Inc. 24,13 %	17.01.2020	3.000	USD	-9.153,45	0,00
Apple Inc. 27,75 %	17.01.2020	3.000	USD	-106.354,43	-0,02
Archer-Daniels-Midland Co. 23,17 %	18.01.2019	2.000	USD	-74.800,22	-0,01
Autoliv Inc. 20,19 %	20.12.2019	2.000	EUR	-23.360,00	0,00
Autoliv Inc. 20,56 %	20.12.2019	2.500	EUR	-39.750,00	-0,01
AXA S.A. 24,34 %	20.12.2019	2.000	EUR	-100.740,00	-0,02
AXA S.A. 23,40 %	20.12.2019	7.500	EUR	-301.275,00	-0,06
AXA S.A. 23,68 %	20.12.2019	4.000	EUR	-174.840,00	-0,03
AXA S.A. 22,39 %	21.12.2018	2.000	EUR	-62.360,00	-0,01
AXA S.A. 23,28 %	20.12.2019	2.500	EUR	-98.325,00	-0,02
AXA S.A. 25,57 %	20.12.2019	3.500	EUR	-183.890,00	-0,04
AXA S.A. 23,69 %	21.12.2018	3.500	EUR	-163.275,00	-0,03
Baidu Inc. 31,30 %	17.01.2020	2.500	USD	19.935,04	0,00
Baidu Inc. 34,33 %	17.01.2020	2.000	USD	-13.811,37	0,00
Baidu Inc. 36,49 %	18.01.2019	1.000	USD	-20.682,88	0,00
Baidu Inc. 34,68 %	17.01.2020	3.000	USD	-41.767,44	-0,01
Baidu Inc. 31,54 %	17.01.2020	18.000	USD	83.227,22	0,02
Baidu Inc. 31,61 %	21.06.2019	1.390	USD	2.114,61	0,00
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. 26,75 %	21.06.2019	3.000	EUR	-126.090,00	-0,02
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. 26,30 %	21.06.2019	1.500	EUR	-61.275,00	-0,01
Bank of America 25,05 %	18.01.2019	2.000	USD	-14.375,45	0,00
Bank of America Corp. 28,42 %	17.01.2020	2.000	USD	-61.296,52	-0,01
Bank of America Corp. 24,18 %	17.01.2020	2.500	USD	-5.106,62	0,00
Bank of America Corp. 26,30 %	17.01.2020	3.000	USD	-52.972,09	-0,01
Bank of America Corp. 25,03 %	17.01.2020	4.000	USD	-42.083,67	-0,01
Bank of America Corp. 24,14 %	17.01.2020	2.500	USD	-7.350,12	0,00
Bank of America Corp. 28,75 %	17.01.2020	2.500	USD	-93.115,68	-0,02
Bank of America Corp. 26,30 %	17.01.2020	1.000	USD	-17.657,36	0,00
Bank of America Corp. 27,46 %	21.06.2019	2.000	USD	-57.296,70	-0,01
Bank of America Corp. 23,74 %	17.01.2020	5.000	USD	7.392,85	0,00
Bank of America Corp. 28,05 %	17.01.2020	3.500	USD	-104.726,30	-0,02
Bank of America Corp. 26,71 %	21.06.2019	2.000	USD	-41.417,03	-0,01
Bank of America Corp. 23,72 %	21.06.2019	1.390	USD	-11.499,68	0,00
Bank of America Corp. 28,41 %	17.01.2020	2.000	USD	-71.432,84	-0,01
Bank of America Corp. 26,75 %	18.01.2019	2.500	USD	-75.744,63	-0,01
Bank of China Ltd. 22,51 %	27.06.2019	10.800	HKD	-39.746,20	-0,01
Bank of China Ltd. 23,10 %	28.03.2019	24.000	HKD	-147.452,10	-0,03
Bank of China Ltd. 22,20 %	28.03.2019	25.000	HKD	-141.942,14	-0,03
Bank of Communications Co. Ltd. 22,00 %	28.12.2018	20.000	HKD	4.487,26	0,00
Bank of Communications Co. Ltd. 23,10 %	28.03.2019	24.000	HKD	-90.259,20	-0,02
Bank of New York Mellon Corp. 25,12 %	21.06.2019	2.000	USD	-31.742,23	-0,01
Bank of New York Mellon Corp. 23,04 %	18.01.2019	1.000	USD	2.880,22	0,00
Bank of New York Mellon Corp. 21,96 %	21.06.2019	2.000	USD	15.025,00	0,00
BASF SE 21,35 %	21.12.2018	3.500	EUR	-77.525,00	-0,01
BASF SE 21,46 %	20.12.2019	2.500	EUR	-48.275,00	-0,01

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag (000)	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfonds- vermögen (%)
BASF SE 22,98 %	20.12.2019	3.500	EUR	-116.585,00	-0,02
BASF SE 20,43 %	20.12.2019	2.000	EUR	-18.040,00	0,00
BASF SE 23,94 %	20.12.2019	3.000	EUR	-130.050,00	-0,03
BASF SE 22,39 %	21.06.2019	3.000	EUR	-90.420,00	-0,02
BASF SE 22,12 %	20.12.2019	2.500	EUR	-59.600,00	-0,01
Bayer AG 23,02 %	20.12.2019	2.500	EUR	-71.500,00	-0,01
Bayer AG 24,46 %	20.12.2019	3.500	EUR	-137.095,00	-0,03
Bayer AG 23,07 %	20.12.2019	2.500	EUR	-61.425,00	-0,01
Bayer AG 23,25 %	20.12.2019	3.500	EUR	-92.015,00	-0,02
Bayer AG 21,97 %	21.12.2018	3.500	EUR	-69.825,00	-0,01
Bayer AG 24,51 %	20.12.2019	3.000	EUR	-120.720,00	-0,02
Bayer AG 22,03 %	18.12.2020	3.000	EUR	-31.800,00	-0,01
Bayer AG 21,71 %	20.12.2019	2.000	EUR	-28.400,00	-0,01
Bayer AG 24,54 %	21.06.2019	3.000	EUR	-140.010,00	-0,03
Bayer AG 22,06 %	21.06.2019	1.500	EUR	-32.310,00	-0,01
Bayerische Motoren Werke AG 24,70 %	20.12.2019	3.000	EUR	-109.590,00	-0,02
Bayerische Motoren Werke AG 22,82 %	20.12.2019	4.000	EUR	-80.680,00	-0,02
Bayerische Motoren Werke AG 21,96 %	21.12.2018	2.000	EUR	-59.360,00	-0,01
Bayerische Motoren Werke AG 22,61 %	20.12.2019	2.000	EUR	-36.660,00	-0,01
Bayerische Motoren Werke AG 24,50 %	20.12.2019	3.500	EUR	-118.055,00	-0,02
Bayerische Motoren Werke AG 22,90 %	21.06.2019	1.500	EUR	-43.260,00	-0,01
Bayerische Motoren Werke AG 23,10 %	20.12.2019	2.500	EUR	-36.225,00	-0,01
Bayerische Motoren Werke AG 24,08 %	21.06.2019	3.000	EUR	-119.280,00	-0,02
Bayerische Motoren Werke AG 23,38 %	20.12.2019	6.000	EUR	-130.900,00	-0,03
Bayerische Motoren Werke AG 22,45 %	20.12.2019	2.000	EUR	-12.760,00	0,00
Bayerische Motoren Werke AG 22,48 %	21.12.2018	3.500	EUR	-133.070,00	-0,03
BHP Billiton Plc. 26,28 %	21.06.2019	2.000	USD	25.469,00	0,00
BHP Billiton Plc. 27,70 %	21.06.2019	2.000	USD	-735,01	0,00
BHP Billiton Plc. 27,70 %	17.01.2020	2.000	USD	10.187,60	0,00
BHP Billiton Plc. 30,08 %	17.01.2020	3.000	USD	-52.536,21	-0,01
BHP Billiton Plc. 29,36 %	17.01.2020	3.000	USD	-41.305,93	-0,01
BHP Billiton Plc. 27,39 %	18.01.2019	2.500	USD	18.781,25	0,00
BNP Paribas S.A. 25,65 %	20.12.2019	2.000	EUR	-116.740,00	-0,02
BNP Paribas S.A. 21,97 %	18.12.2020	3.000	EUR	-19.920,00	0,00
BNP Paribas S.A. 25,86 %	20.12.2019	2.000	EUR	-119.400,00	-0,02
BNP Paribas S.A. 26,61 %	20.12.2019	3.000	EUR	-198.810,00	-0,04
BNP Paribas S.A. 25,38 %	20.12.2019	3.500	EUR	-186.095,00	-0,04
BNP Paribas S.A. 25,83 %	21.12.2018	2.000	EUR	-169.300,00	-0,03
BNP Paribas S.A. 24,72 %	21.12.2018	3.500	EUR	-254.205,00	-0,05
BNP Paribas S.A. 26,66 %	20.12.2019	3.500	EUR	-239.995,00	-0,05
BNP Paribas S.A. 26,04 %	21.06.2019	3.000	EUR	-213.510,00	-0,04
BNP Paribas S.A. 25,44 %	20.12.2019	4.000	EUR	-225.600,00	-0,04
BNP Paribas S.A. 25,36 %	21.06.2019	1.500	EUR	-98.310,00	-0,02
Booking Holdings Inc. 25,30 %	17.01.2020	3.000	USD	-9.384,21	0,00
Booking Holdings Inc. 25,85 %	17.01.2020	3.000	USD	-10.204,69	0,00

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag (000)	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
Booking Holdings Inc. 26,25 %	17.01.2020	3.000	USD	-39.049,61	-0,01
Booking Holdings Inc. 24,90 %	17.01.2020	2.500	USD	-427,34	0,00
Booking Holdings Inc. 26,09 %	17.01.2020	3.000	USD	-40.280,33	-0,01
Booking Holdings Inc. 25,46 %	17.01.2020	2.500	USD	-4.850,22	0,00
BP Plc. 20,15 %	21.06.2019	2.000	USD	38.169,31	0,01
BP Plc. 19,55 %	18.01.2019	2.500	USD	45.275,84	0,01
Broadcom Inc. 31,52 %	17.01.2020	3.000	USD	-21.614,46	0,00
Broadcom Inc. 29,04 %	17.01.2020	2.500	USD	82.133,24	0,02
Broadcom Inc. 29,16 %	21.06.2019	1.390	USD	45.404,73	0,01
Broadcom Inc. 28,57 %	17.01.2020	2.500	USD	82.218,71	0,02
Cabot Oil & Gas Corp. 30,06 %	18.01.2019	3.000	USD	-2.051,19	0,00
Cabot Oil & Gas Corp. 31,00 %	18.01.2019	2.500	USD	-25.383,53	0,00
Cabot Oil & Gas Corp. 33,09 %	18.01.2019	1.000	USD	-27.015,94	-0,01
Capital One Financial Corp. 29,44 %	17.01.2020	2.000	USD	-56.749,71	-0,01
Charles Schwab Corp. 28,00 %	18.01.2019	2.500	USD	8.418,44	0,00
Chevron Corporation 19,87 %	18.01.2019	2.500	USD	37.925,73	0,01
China Construction Bank Corp. 23,35 %	27.06.2019	30.000	HKD	-32.282,11	-0,01
China Construction Bank Corp. 24,49 %	27.06.2019	25.380	HKD	-67.392,10	-0,01
China Life Insurance Co. Ltd. 24,60 %	28.03.2019	24.000	HKD	-67.779,35	-0,01
China Life Insurance Co. Ltd. 27,75 %	28.03.2019	11.753	HKD	-85.048,31	-0,02
China Life Insurance Co. Ltd. 27,70 %	28.03.2019	16.740	HKD	-119.238,13	-0,02
China Merchants Bank Co. Ltd. 31,80 %	27.06.2019	14.260	HKD	-16.198,97	0,00
China Minsheng Banking Corp. Ltd. 27,35 %	28.03.2019	24.000	HKD	-104.034,64	-0,02
China Mobile Ltd. 20,20 %	28.03.2019	5.877	HKD	-17.646,01	0,00
China Mobile Ltd. 19,12 %	27.06.2019	15.740	HKD	-27.086,03	-0,01
China Pacific Insurance Group Co. Ltd. 28,00 %	28.03.2019	20.000	HKD	-21.652,10	0,00
China Pacific Insurance Group Co. Ltd. 31,10 %	28.03.2019	11.186	HKD	-47.721,41	-0,01
China Pacific Insurance Group Co. Ltd. 27,10 %	28.03.2019	24.000	HKD	-4.443,69	0,00
China Unicom Hong Kong Ltd. 27,40 %	28.03.2019	11.186	HKD	-2.972,69	0,00
Chipotle Mexican Grill Inc. 32,32 %	21.06.2019	1.390	USD	-14.113,24	0,00
Cie de Saint-Gobain 26,10 %	21.06.2019	3.000	EUR	-144.540,00	-0,03
Cie de Saint-Gobain 25,25 %	20.12.2019	4.000	EUR	-115.640,00	-0,02
Cie de Saint-Gobain 25,78 %	20.12.2019	3.500	EUR	-117.740,00	-0,02
Cie de Saint-Gobain 24,09 %	21.06.2019	1.500	EUR	-42.210,00	-0,01
Cie de Saint-Gobain 24,94 %	18.12.2020	3.000	EUR	16.230,00	0,00
Cie de Saint-Gobain 23,67 %	20.12.2019	2.000	EUR	-27.020,00	-0,01
Cie Financiere Richemont S.A 25,49 %	21.12.2018	4.000	CHF	-197.867,74	-0,04
Cie Financiere Richemont S.A 23,50 %	21.06.2019	3.000	CHF	-66.249,43	-0,01
Cie Financiere Richemont S.A. 25,30 %	20.12.2019	3.510	CHF	-90.852,36	-0,02
Cie Financiere Richemont S.A. 24,23 %	20.12.2019	2.500	CHF	-38.395,15	-0,01
Cie Financiere Richemont S.A. 24,80 %	20.12.2019	4.096	CHF	-85.393,89	-0,02
Cie Financiere Richemont S.A. 20,99 %	20.12.2019	3.998	CHF	53.905,10	0,01
Cisco Systems Inc. 21,60 %	18.01.2019	2.500	USD	64.121,19	0,01
Cisco Systems Inc. 23,39 %	21.06.2019	2.000	USD	17.195,85	0,00
Citigroup Inc. 26,15 %	21.06.2019	2.000	USD	-47.297,12	-0,01

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag (000)	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfonds- vermögen (%)
Citigroup Inc. 28,60 %	17.01.2020	2.000	USD	-71.825,99	-0,01
Citigroup Inc. 24,40 %	17.01.2020	4.000	USD	-24.101,53	0,00
Citigroup Inc. 27,45 %	17.01.2020	3.000	USD	-90.329,47	-0,02
Citigroup Inc. 26,60 %	17.01.2020	2.000	USD	-45.912,57	-0,01
Citigroup Inc. 25,79 %	17.01.2020	3.000	USD	-55.638,65	-0,01
Citigroup Inc. 26,35 %	17.01.2020	2.500	USD	-50.617,50	-0,01
Citigroup Inc. 24,50 %	18.01.2019	2.500	USD	-35.724,97	-0,01
Citigroup Inc. 27,70 %	21.06.2019	2.000	USD	-67.176,62	-0,01
Citigroup Inc. 25,13 %	18.01.2019	2.500	USD	-60.339,31	-0,01
Citigroup Inc. 26,23 %	17.01.2020	3.500	USD	-65.031,41	-0,01
Citigroup Inc. 22,66 %	21.06.2019	1.390	USD	1.663,18	0,00
CNOOC Ltd. 29,60 %	28.03.2019	11.753	HKD	12.442,35	0,00
CNOOC Ltd. 29,29 %	27.06.2019	8.480	HKD	-5.439,95	0,00
CNOOC Ltd. 29,50 %	28.03.2019	16.740	HKD	21.659,77	0,00
Cognizant Technology Solutions Corp. 26,37 %	17.01.2020	3.000	USD	-27.075,76	-0,01
Cognizant Technology Solutions Corp. 24,81 %	18.01.2019	2.500	USD	-70.616,64	-0,01
Cognizant Technology Solutions Corp. 28,29 %	17.01.2020	2.000	USD	-56.031,79	-0,01
Commerzbank AG 32,29 %	20.12.2019	2.000	EUR	4.420,00	0,00
Commerzbank AG 31,49 %	21.06.2019	1.500	EUR	10.770,00	0,00
Consolidated Operations Group Ltd. 34,10 %	17.01.2020	2.000	USD	-35.554,03	-0,01
Continental AG 24,90 %	20.12.2019	2.000	EUR	-34.680,00	-0,01
Continental AG 26,19 %	20.12.2019	2.000	EUR	-66.120,00	-0,01
Continental AG 26,45 %	20.12.2019	3.000	EUR	-102.180,00	-0,02
Continental AG 26,00 %	20.12.2019	2.500	EUR	-78.875,00	-0,02
Continental AG 23,05 %	20.12.2019	4.000	EUR	-11.640,00	0,00
Continental AG 24,95 %	20.12.2019	2.000	EUR	-36.040,00	-0,01
Continental AG 23,77 %	21.06.2019	1.500	EUR	-24.960,00	0,00
Continental AG 24,42 %	20.12.2019	2.500	EUR	-34.325,00	-0,01
Corning Inc. 26,02 %	17.01.2020	3.000	USD	29.767,96	0,01
Credit Agricole S.A. 26,91 %	21.06.2019	1.500	EUR	-114.945,00	-0,02
Credit Agricole S.A. 27,54 %	20.12.2019	2.000	EUR	-147.560,00	-0,03
Credit Agricole S.A. 26,31 %	20.12.2019	4.000	EUR	-245.760,00	-0,05
Credit Agricole S.A. 27,47 %	20.12.2019	3.000	EUR	-217.320,00	-0,04
Credit Agricole S.A. 27,02 %	20.12.2019	3.500	EUR	-234.850,00	-0,05
Credit Agricole S.A. 29,48 %	21.06.2019	3.000	EUR	-309.810,00	-0,06
Credit Agricole S.A. 23,53 %	18.12.2020	3.000	EUR	-57.420,00	-0,01
Credit Suisse Group AG 24,62 %	20.12.2019	3.500	EUR	-236.915,00	-0,05
Credit Suisse Group AG 28,27 %	20.12.2019	2.303	CHF	-79.904,70	-0,02
Credit Suisse Group AG 26,37 %	21.06.2019	3.000	CHF	-58.635,15	-0,01
Credit Suisse Group AG 26,54 %	21.12.2018	4.000	CHF	-86.605,99	-0,02
Credit Suisse Group AG 26,42 %	21.06.2019	3.460	CHF	-83.431,98	-0,02
Credit Suisse Group AG 24,76 %	20.12.2019	3.255	CHF	-13.460,06	0,00
Credit Suisse Group AG 23,53 %	21.06.2019	1.500	EUR	-65.160,00	-0,01
Credit Suisse Group AG 24,18 %	21.06.2019	3.000	EUR	-145.830,00	-0,03
CRM US Equity Opportunities 27,15 %	18.01.2019	2.500	USD	-12.948,17	0,00

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag (000)	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
CRM US Equity Opportunities 26,13 %	18.01.2019	3.000	USD	26.178,37	0,01
CRM US Equity Opportunities 26,39 %	18.01.2019	2.500	USD	22.541,77	0,00
CRM US Equity Opportunities 29,28 %	18.01.2019	2.500	USD	-60.894,84	-0,01
Cummins Inc. 24,78 %	21.06.2019	2.000	USD	9.452,59	0,00
Cummins Inc. 24,20 %	18.01.2019	2.500	USD	2.841,76	0,00
Daimler AG 23,18 %	21.06.2019	3.000	EUR	-48.840,00	-0,01
Daimler AG 22,46 %	21.06.2019	1.500	EUR	-19.110,00	0,00
Daimler AG 22,42 %	20.12.2019	2.500	EUR	-15.775,00	0,00
Daimler AG 22,36 %	20.12.2019	4.000	EUR	-27.000,00	-0,01
Daimler AG 23,55 %	20.12.2019	3.500	EUR	-67.725,00	-0,01
Daimler AG 23,62 %	20.12.2019	2.000	EUR	-32.820,00	-0,01
Daimler AG 21,47 %	21.12.2018	2.000	EUR	-26.700,00	-0,01
Daimler AG 23,13 %	20.12.2019	2.000	EUR	-29.900,00	-0,01
DAX 17,74 %	20.12.2019	20.000	EUR	140.360,00	0,03
DAX 18,38 %	20.12.2019	22.500	EUR	318.442,50	0,06
Delta Air Lines Inc. 31,10 %	17.01.2020	3.000	USD	-72.432,80	-0,01
Delta Air Lines Inc. 30,75 %	17.01.2020	2.500	USD	-50.660,23	-0,01
Delta Air Lines Inc. 32,67 %	17.01.2020	2.000	USD	-74.150,68	-0,01
Delta Air Lines Inc. 28,53 %	17.01.2020	5.000	USD	9.059,44	0,00
Delta Air Lines Inc. 27,43 %	21.06.2019	1.390	USD	-4.835,09	0,00
Delta Air Lines Inc. 29,95 %	17.01.2020	3.000	USD	-42.921,24	-0,01
Delta Air Lines Inc. 30,28 %	17.01.2020	3.000	USD	-53.613,09	-0,01
Delta Air Lines Inc. 31,10 %	17.01.2020	1.000	USD	-24.144,27	0,00
Deutsche Lufthansa AG 29,22 %	20.12.2019	2.000	EUR	-41.500,00	-0,01
Deutsche Telekom AG 19,33 %	20.12.2019	2.500	EUR	-57.075,00	-0,01
Deutsche Telekom AG 19,37 %	20.12.2019	2.000	EUR	-42.460,00	-0,01
Deutsche Telekom AG 20,25 %	21.06.2019	1.500	EUR	-47.595,00	-0,01
DTE Energy Co. 20,28 %	20.12.2019	2.500	EUR	-72.000,00	-0,01
DTE Energy Co. 19,29 %	21.12.2018	3.500	EUR	-94.325,00	-0,02
DTE Energy Co. 20,45 %	20.12.2019	3.500	EUR	-108.500,00	-0,02
eBay Inc. 27,24 %	17.01.2020	5.000	USD	-37.776,16	-0,01
eBay Inc. 26,02 %	17.01.2020	2.500	USD	26.857,82	0,01
Engie S.A. 22,55 %	20.12.2019	2.000	EUR	-44.000,00	-0,01
EOG Resources Inc. 27,06 %	18.01.2019	2.500	USD	-14.379,73	0,00
EOG Resources Inc. 27,52 %	17.01.2020	3.000	USD	-31.690,95	-0,01
EOG Resources Inc. 27,32 %	21.06.2019	2.000	USD	-15.452,33	0,00
EOG Resources Inc. 29,72 %	17.01.2020	3.500	USD	-96.739,46	-0,02
EOG Resources Inc. 28,75 %	17.01.2020	2.500	USD	-49.036,37	-0,01
EOG Resources Inc. 29,90 %	17.01.2020	3.000	USD	-82.970,81	-0,02
EOG Resources Inc. 29,90 %	17.01.2020	1.000	USD	-27.656,94	-0,01
EOG Resources Inc. 26,12 %	18.01.2019	3.000	USD	4.051,11	0,00
EOG Resources Inc. 29,66 %	17.01.2020	3.000	USD	-76.919,79	-0,01
EOG Resources Inc. 29,33 %	18.01.2019	1.000	USD	-22.947,74	0,00
EOG Resources Inc. 30,04 %	17.01.2020	2.000	USD	-51.604,63	-0,01
Euro Stoxx 50 17,02 %	21.12.2018	24.500	EUR	922.425,00	0,18

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag (000)	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfonds- vermögen (%)
Euro Stoxx 50 17,95 %	20.12.2019	30.000	EUR	636.690,00	0,12
Euro Stoxx 50 17,56 %	21.06.2019	30.000	EUR	777.030,00	0,15
Euro Stoxx 50 17,06 %	21.12.2018	10.000	EUR	367.710,00	0,07
Euro Stoxx 50 16,22 %	18.12.2020	21.000	EUR	-290.913,00	-0,06
Euro Stoxx 50 18,64 %	21.06.2019	51.000	EUR	1.960.848,00	0,38
Euro Stoxx 50 18,15 %	20.12.2019	7.500	EUR	163.095,00	0,03
Euro Stoxx 50 18,22 %	20.12.2019	20.000	EUR	489.560,00	0,09
Euro Stoxx 50 18,55 %	21.06.2019	16.500	EUR	-565.059,00	-0,11
Euro Stoxx 50 17,20 %	21.12.2018	7.500	EUR	292.650,00	0,06
Euro Stoxx 50 18,04 %	20.12.2019	30.000	EUR	624.750,00	0,12
Euro Stoxx 50 18,79 %	20.12.2019	21.000	EUR	616.224,00	0,12
Euro Stoxx 50 19,28 %	20.12.2019	45.500	EUR	1.548.911,00	0,30
Euro Stoxx 50 19,00 %	20.12.2019	7.500	EUR	235.327,50	0,05
Euro Stoxx 50 16,75 %	20.12.2019	10.000	EUR	-45.560,00	-0,01
Euro Stoxx 50 17,84 %	20.12.2019	40.000	EUR	787.160,00	0,15
Euro Stoxx 50 19,50 %	20.12.2019	30.000	EUR	1.106.970,00	0,21
Euro Stoxx 600 22,00 %	21.06.2019	1.500	EUR	-31.902,00	-0,01
Euro Stoxx 600 22,46 %	21.06.2019	1.500	EUR	27.060,00	0,01
Exchanges & Clearing Ltd. 23,84 %	27.06.2019	10.300	HKD	-32.442,86	-0,01
Exchanges & Clearing Ltd. 32,00 %	28.03.2019	11.753	HKD	-138.158,70	-0,03
Exxon Mobil Corp. 20,49 %	17.01.2020	3.000	USD	-18.383,83	0,00
Exxon Mobil Corp. 26,20 %	18.01.2019	2.500	USD	49.891,03	0,01
Exxon Mobil Corp. 17,68 %	18.01.2019	2.500	USD	41.173,45	0,01
Exxon Mobil Corp. 17,07 %	18.01.2019	3.000	USD	69.176,53	0,01
Exxon Mobil Corp. 16,58 %	18.01.2019	2.000	USD	65.877,53	0,01
Facebook Inc. 30,03 %	17.01.2020	2.000	USD	72.304,60	0,01
Facebook Inc. 27,93 %	21.06.2019	1.390	USD	93.399,26	0,02
Facebook Inc. 29,08 %	17.01.2020	2.500	USD	113.456,69	0,02
Facebook Inc. 27,08 %	18.01.2019	3.000	USD	250.322,64	0,05
Facebook Inc. 28,39 %	17.01.2020	2.500	USD	120.208,53	0,02
Firstenergy Corp. 22,22 %	18.01.2019	2.000	USD	-53.501,99	-0,01
Ford Motor Co. 26,44 %	18.01.2019	1.000	USD	-18.794,07	0,00
Ford Motor Co. 28,86 %	17.01.2020	3.000	USD	-79.073,54	-0,02
Ford Motor Co. 23,55 %	21.06.2019	5.000	USD	85.380,97	0,02
Ford Motor Co. 29,80 %	17.01.2020	1.000	USD	-34.195,12	-0,01
Ford Motor Co. 22,61 %	18.01.2019	3.000	USD	67.971,46	0,01
Ford Motor Co. 23,42 %	18.01.2019	3.000	USD	33.972,91	0,01
Ford Motor Co. 29,80 %	17.01.2020	3.000	USD	-102.585,36	-0,02
Ford Motor Co. 24,56 %	21.06.2019	2.000	USD	15.725,82	0,00
Ford Motor Co. 26,20 %	17.01.2020	2.000	USD	-5.350,20	0,00
Ford Motor Co. 23,85 %	18.01.2019	2.500	USD	15.747,19	0,00
Ford Motor Co. 24,93 %	17.01.2020	2.500	USD	28.054,35	0,01
Ford Motor Co. 27,63 %	17.01.2020	3.000	USD	-48.690,23	-0,01
Ford Motor Co. 23,10 %	18.01.2019	5.000	USD	73.287,47	0,01
Freeport-McMoRan Inc. 37,84 %	21.06.2019	1.390	USD	1.294,90	0,00

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag (000)	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
General Motors Co. 25,77 %	17.01.2020	2.500	USD	23.631,47	0,00
General Motors Co. 27,62 %	21.06.2019	2.000	USD	15.862,57	0,00
General Motors Co. 30,02 %	17.01.2020	2.000	USD	-29.212,43	-0,01
General Motors Co. 25,00 %	21.06.2019	1.390	USD	13.150,98	0,00
Gilead Sciences Inc. 26,96 %	18.01.2019	2.000	USD	1.470,02	0,00
Gilead Sciences Inc. 26,30 %	21.06.2019	1.390	USD	-5.334,05	0,00
Gilead Sciences Inc. 30,27 %	18.01.2019	1.000	USD	-32.656,72	-0,01
Gilead Sciences Inc. 26,10 %	18.01.2019	2.500	USD	20.127,34	0,00
Halliburton Co. 27,33 %	18.01.2019	5.000	USD	-20.204,26	0,00
Halliburton Co. 28,14 %	17.01.2020	3.000	USD	-38.921,41	-0,01
Halliburton Co. 26,95 %	17.01.2020	8.000	USD	-50.254,26	-0,01
Halliburton Co. 28,90 %	17.01.2020	2.000	USD	-31.520,02	-0,01
Halliburton Co. 27,70 %	18.01.2019	2.500	USD	-10.149,14	0,00
Halliburton Co. 28,62 %	17.01.2020	3.000	USD	-49.356,86	-0,01
Halliburton Co. 28,60 %	18.01.2019	3.000	USD	-41.434,12	-0,01
Halliburton Co. 27,85 %	18.01.2019	2.500	USD	-21.558,91	0,00
Halliburton Co. 29,24 %	21.06.2019	2.000	USD	-35.964,27	-0,01
Halliburton Co. 29,00 %	17.01.2020	3.000	USD	-46.587,75	-0,01
Hang Seng Index 18,20 %	28.03.2019	25.000	HKD	27.479,00	0,01
Hang Seng Index 21,24 %	28.03.2019	117.531	HKD	462.030,95	0,09
Hang Seng Index 19,25 %	28.12.2018	20.000	HKD	5.977,20	0,00
Hang Seng Index 17,85 %	28.12.2018	20.000	HKD	-21.906,96	0,00
Hang Seng Index 18,30 %	28.03.2019	120.000	HKD	113.549,36	0,02
Hang Seng Index 20,13 %	28.03.2019	78.224	HKD	197.477,83	0,04
Hang Seng Index 18,48 %	27.06.2019	200.000	HKD	122.550,01	0,02
Hang Seng Index 21,75 %	30.12.2019	92.000	HKD	-82.625,63	-0,02
Hang Seng Index 18,00 %	28.03.2019	40.000	HKD	28.757,66	0,01
Hang Seng Index 21,20 %	28.03.2019	30.000	HKD	124.818,68	0,02
Hartford Financial Services Group Inc. 24,24 %	17.01.2020	2.000	USD	28.631,26	0,01
Hartford Financial Services Group Inc. 24,80 %	17.01.2020	2.500	USD	28.738,08	0,01
Hartford Financial Services Group Inc. 23,09 %	21.06.2019	2.000	USD	-512,80	0,00
Hartford Financial Services Group Inc. 25,86 %	17.01.2020	3.000	USD	-2.692,19	0,00
Hartford Financial Services Group Inc. 25,00 %	21.06.2019	2.000	USD	-32.579,80	-0,01
Hartford Financial Services Group Inc. 26,36 %	17.01.2020	3.000	USD	-13.435,32	0,00
HEICO Corp. 25,30 %	20.12.2019	2.000	EUR	-75.500,00	-0,01
HEICO Corp. 24,98 %	20.12.2019	2.500	EUR	-62.850,00	-0,01
HEICO Corp. 23,98 %	20.12.2019	2.000	EUR	-52.020,00	-0,01
HEICO Corp. 23,64 %	20.12.2019	2.000	EUR	-19.520,00	0,00
HEICO Corp. 25,75 %	20.12.2019	3.500	EUR	-139.895,00	-0,03
Henkel AG & Co. KGaA 21,58 %	20.12.2019	2.500	EUR	-66.725,00	-0,01
Hispania Activos Inmobiliarios SOCIMI S.A. 18,55 %	27.06.2019	30.000	HKD	25.940,04	0,00
Home Depot Inc. 21,19 %	17.01.2020	2.500	USD	-9.657,71	0,00
Home Depot Inc. 19,86 %	18.01.2019	2.500	USD	7.542,41	0,00
Honeywell International Inc. 21,29 %	18.01.2019	1.000	USD	-27.255,24	-0,01
HP Inc. 26,66 %	21.06.2019	1.390	USD	-13.970,69	0,00

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag (000)	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
HSBC Holdings Plc. 18,88 %	27.06.2019	35.140	HKD	-120.136,98	-0,02
HSBC Holdings Plc. 19,90 %	28.03.2019	5.877	HKD	-29.653,24	-0,01
Industrial & Commercial Bank of China Ltd. 24,57 %	27.06.2019	15.900	HKD	-39.050,56	-0,01
Infineon Technologies AG 27,66 %	20.12.2019	2.500	EUR	-11.775,00	0,00
ING Groep NV 23,85 %	21.12.2018	7.500	EUR	-401.775,00	-0,08
ING Groep NV 25,33 %	20.12.2019	2.000	EUR	-88.520,00	-0,02
ING Groep NV 26,40 %	20.12.2019	3.500	EUR	-182.805,00	-0,04
ING Groep NV 23,65 %	21.12.2018	2.000	EUR	-101.200,00	-0,02
ING Groep NV 25,54 %	20.12.2019	2.500	EUR	-114.725,00	-0,02
ING Groep NV 25,15 %	21.06.2019	1.500	EUR	-79.245,00	-0,02
ING Groep NV 27,16 %	20.12.2019	3.000	EUR	-181.560,00	-0,04
ING Groep NV 25,54 %	21.06.2019	3.000	EUR	-166.020,00	-0,03
International Paper Co. 23,93 %	21.06.2019	2.000	USD	11.606,34	0,00
Intesa Sanpaolo SpA 25,38 %	21.06.2019	1.500	EUR	30.645,00	0,01
Intesa Sanpaolo SpA 26,32 %	20.12.2019	2.000	EUR	40.860,00	0,01
Intesa Sanpaolo SpA 27,92 %	20.12.2019	3.500	EUR	29.960,00	0,01
Intesa Sanpaolo SpA 27,54 %	21.06.2019	3.000	EUR	14.370,00	0,00
Intesa Sanpaolo SpA 26,63 %	20.12.2019	4.000	EUR	53.360,00	0,01
iShares Euro Stoxx 24,76 %	21.06.2019	1.500	EUR	-77.157,00	-0,01
JPMorgan Chase & Co. 23,00 %	17.01.2020	2.000	USD	-7.572,32	0,00
JPMorgan Chase & Co. 23,07 %	17.01.2020	4.000	USD	-17.537,71	0,00
JPMorgan Chase & Co. 24,68 %	17.01.2020	3.500	USD	-48.130,42	-0,01
JPMorgan Chase & Co. 26,49 %	17.01.2020	3.000	USD	-88.355,20	-0,02
JPMorgan Chase & Co. 22,08 %	17.01.2020	2.500	USD	10.896,97	0,00
JPMorgan Chase & Co. 21,59 %	21.06.2019	1.390	USD	-4.074,78	0,00
JPMorgan Chase & Co. 23,05 %	17.01.2020	3.000	USD	-9.050,89	0,00
JPMorgan Chase & Co. 22,20 %	17.01.2020	3.000	USD	11.358,49	0,00
JPMorgan Chase & Co. 22,99 %	21.06.2019	2.000	USD	-5.059,61	0,00
JPMorgan Chase & Co. 21,72 %	18.01.2019	2.000	USD	12.990,90	0,00
JPMorgan Chase & Co. 23,14 %	18.01.2019	2.500	USD	-31.900,35	-0,01
Julius Baer Group Ltd. 23,02 %	20.12.2019	1.090	CHF	-1.270,34	0,00
Julius Baer Group Ltd. 23,91 %	20.12.2019	2.500	CHF	-21.496,10	0,00
Koninklijke Philips NV 24,74 %	20.12.2019	2.000	EUR	-61.580,00	-0,01
Koninklijke Philips NV 23,01 %	18.12.2020	3.000	EUR	-16.800,00	0,00
Koninklijke Philips NV 24,67 %	20.12.2019	2.500	EUR	-67.275,00	-0,01
LANXESS AG 26,50 %	20.12.2019	2.000	EUR	-13.900,00	0,00
LHN Ltd. 23,36 %	20.12.2019	2.500	CHF	-78.214,73	-0,02
LHN Ltd. 21,95 %	20.12.2019	2.055	CHF	-39.757,04	-0,01
Lonza Group AG 24,59 %	20.12.2019	1.665	CHF	-18.628,58	0,00
Lonza Group AG 25,70 %	20.12.2019	2.500	CHF	-49.294,28	-0,01
Marathon Petroleum Corp. 30,77 %	17.01.2020	3.000	USD	-17.281,31	0,00
Marathon Petroleum Corp. 29,86 %	18.01.2019	1.000	USD	-3.393,02	0,00
Marathon Petroleum Corp. 28,08 %	18.01.2019	2.500	USD	26.473,22	0,01
Merck & Co. Inc. 20,48 %	18.01.2019	2.000	USD	-28.238,11	-0,01
Merck & Co. Inc. 28,86 %	21.06.2019	2.000	USD	-50.544,85	-0,01

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag (000)	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfonds- vermögen (%)
Microsoft Corp. 22,58 %	21.06.2019	1.390	USD	13.186,62	0,00
Microsoft Corp. 24,40 %	17.01.2020	2.000	USD	-4.290,41	0,00
Microsoft Corp. 23,25 %	17.01.2020	2.500	USD	20.554,67	0,00
Morgan Stanley 25,02 %	17.01.2020	2.500	USD	-3.910,09	0,00
Morgan Stanley 28,43 %	17.01.2020	2.000	USD	-47.741,55	-0,01
Morgan Stanley 24,80 %	17.01.2020	3.000	USD	-743,56	0,00
Morgan Stanley 29,12 %	17.01.2020	3.000	USD	-89.252,59	-0,02
Morgan Stanley 25,60 %	17.01.2020	2.000	USD	-15.503,61	0,00
Morgan Stanley 24,26 %	21.06.2019	1.390	USD	-7.721,89	0,00
Morgan Stanley 28,22 %	17.01.2020	2.500	USD	-55.061,75	-0,01
Morgan Stanley 28,51 %	17.01.2020	2.000	USD	-39.194,91	-0,01
Morgan Stanley 25,34 %	17.01.2020	3.000	USD	-11.332,85	0,00
Münchener Rückversicherungs-Gesellschaft AG 20,57%	20.12.2019	2.000	EUR	-34.380,00	-0,01
NEM Insurance Plc. 27,28 %	17.01.2020	2.500	USD	-19.422,25	0,00
NEM Insurance Plc. 31,67 %	17.01.2020	2.000	USD	-97.517,20	-0,02
Nestle S.A. 17,18 %	20.12.2019	5.000	CHF	-72.991,78	-0,01
Newmont Mining Corp. 30,57 %	18.01.2019	1.000	USD	-58.595,79	-0,01
Occidental Petroleum Corp. 22,93 %	18.01.2019	2.500	USD	-11.644,81	0,00
Occidental Petroleum Corp. 24,53 %	21.06.2019	2.000	USD	-29.742,32	-0,01
Oracle Corp. 23,83 %	17.01.2020	2.500	USD	-11.687,54	0,00
Oracle Corp. 22,97 %	17.01.2020	2.500	USD	27.242,42	0,01
Oracle Corp. 21,80 %	18.01.2019	2.500	USD	73.458,40	0,01
Oracle Corp. 22,45 %	18.01.2019	2.500	USD	52.818,25	0,01
Oracle Corp. 22,98 %	18.01.2019	2.500	USD	41.152,08	0,01
Orange S.A. 21,71 %	20.12.2019	2.000	EUR	-57.200,00	-0,01
Orange S.A. 21,48 %	21.06.2019	1.500	EUR	-62.100,00	-0,01
Paccar Inc. 25,85 %	18.01.2019	2.500	USD	-14.956,63	0,00
Paccar Inc. 29,45 %	18.01.2019	1.000	USD	-30.733,73	-0,01
PetroChina Co. Ltd. 28,25 %	28.03.2019	11.753	HKD	11.482,29	0,00
PetroChina Co. Ltd. 28,40 %	28.03.2019	16.740	HKD	13.309,46	0,00
Peugeot S.A. 29,69 %	20.12.2019	4.000	EUR	-47.560,00	-0,01
Peugeot S.A. 29,33 %	20.12.2019	2.000	EUR	-17.740,00	0,00
Pfizer Inc. 19,30 %	17.01.2020	2.000	USD	-27.913,34	-0,01
PICC Property & Casualty Co. Ltd. 30,50 %	28.12.2018	20.000	HKD	-29.210,73	-0,01
Ping An Insurance Group Co. of China Ltd. 31,00 %	28.03.2019	41.136	HKD	-379.434,45	-0,07
Ping An Insurance Group Co. of China Ltd. 28,50 %	28.03.2019	30.000	HKD	-233.620,49	-0,05
Ping An Insurance Group Co. of China Ltd. 31,15 %	28.03.2019	5.632	HKD	-49.196,08	-0,01
Pioneer Natural Resources Co. 32,80 %	18.01.2019	2.500	USD	-54.677,15	-0,01
Pioneer Natural Resources Co. 35,31 %	18.01.2019	1.000	USD	-39.177,81	-0,01
Priceline Group Inc. 26,65 %	21.06.2019	2.000	USD	-40.288,88	-0,01
Priceline Group Inc. 25,80 %	18.01.2019	2.500	USD	-45.639,08	-0,01
Priceline Group Inc. 29,72 %	18.01.2019	1.000	USD	-48.356,91	-0,01
Priceline Group Inc. 27,37 %	18.01.2019	2.000	USD	-59.638,48	-0,01
Prudential Financial Inc. 25,71 %	21.06.2019	2.000	USD	22.870,82	0,00

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag (000)	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfonds- vermögen (%)
Prudential Financial Inc. 25,40 %	17.01.2020	2.500	USD	41.408,48	0,01
Prudential Financial Inc. 25,11 %	18.01.2019	2.500	USD	25.426,26	0,00
Prudential Financial Inc. 22,45 %	18.01.2019	2.500	USD	-21.772,58	0,00
Prudential Financial Inc. 26,03 %	17.01.2020	3.000	USD	37.767,62	0,01
Prudential Financial Inc. 26,49 %	18.01.2019	2.500	USD	-25.832,23	-0,01
Randgold Resources Ltd. 29,96 %	21.06.2019	2.000	USD	-11.196,10	0,00
Randgold Resources Ltd. 28,83 %	18.01.2019	3.000	USD	-43.408,40	-0,01
Renault S.A. 24,06 %	18.12.2020	3.000	EUR	65.490,00	0,01
Repsol S.A. 21,00 %	21.06.2019	1.500	EUR	4.920,00	0,00
Rio Tinto Plc. 29,11 %	17.01.2020	3.000	USD	-33.485,75	-0,01
Rio Tinto Plc. 30,71 %	17.01.2020	3.500	USD	-79.150,47	-0,02
Rio Tinto Plc. 30,35 %	18.01.2019	2.500	USD	-56.493,32	-0,01
Rio Tinto Plc. 31,92 %	17.01.2020	2.500	USD	-85.893,77	-0,02
Rio Tinto Plc. 28,56 %	17.01.2020	3.000	USD	-11.922,57	0,00
Rio Tinto Plc. 28,13 %	17.01.2020	3.000	USD	-1.922,99	0,00
Rio Tinto Plc. 30,94 %	17.01.2020	3.000	USD	-76.842,87	-0,01
Rio Tinto Plc. 30,35 %	17.01.2020	3.000	USD	-65.125,42	-0,01
Rio Tinto Plc. 29,57 %	17.01.2020	2.000	USD	-22.392,20	0,00
Rio Tinto Plc. 29,90 %	17.01.2020	3.000	USD	-51.510,62	-0,01
Rio Tinto Plc. 28,05 %	21.06.2019	2.000	USD	2.324,69	0,00
Rio Tinto Plc. 29,51 %	21.06.2019	2.000	USD	-20.614,50	0,00
Rio Tinto Plc. 29,87 %	17.01.2020	3.000	USD	-50.433,74	-0,01
Rio Tinto Plc. 28,63 %	18.01.2019	3.000	USD	-14.589,12	0,00
Rio Tinto Plc. 29,90 %	17.01.2020	1.000	USD	-17.170,21	0,00
Roche Holding AG 17,40 %	21.06.2019	3.000	CHF	-34.134,78	-0,01
Roche Holding AG 17,85 %	20.12.2019	2.500	CHF	-30.452,81	-0,01
Roche Holding AG 17,76 %	21.12.2018	4.000	CHF	-56.079,79	-0,01
S&P 500 Index 15,81 %	17.01.2020	30.000	USD	1.974,27	0,00
S&P 500 Index 14,66 %	18.01.2019	45.000	USD	-26.806,55	-0,01
S&P 500 Index 14,30 %	18.01.2019	5.000	USD	-25.721,12	0,00
S&P 500 Index 15,97 %	17.01.2020	35.000	USD	79.150,46	0,02
S&P 500 Index 14,22 %	18.01.2019	15.000	USD	-80.970,90	-0,02
S&P 500 Index 15,60 %	17.01.2020	21.000	USD	15.058,33	0,00
S&P 500 Index 15,40 %	17.01.2020	30.000	USD	-17.922,31	0,00
S&P 500 Index 15,70 %	21.06.2019	20.000	USD	-35.058,33	-0,01
S&P 500 Index 16,12 %	17.01.2020	30.000	USD	98.944,49	0,02
S&P 500 Index 16,12 %	17.01.2020	10.000	USD	32.981,49	0,01
S&P 500 Index 17,60 %	17.01.2020	18.000	USD	265.804,03	0,05
S&P 500 Index 17,12 %	17.01.2020	20.000	USD	222.024,70	0,04
S&P 500 Index 13,37 %	18.01.2019	30.000	USD	-467.672,32	-0,09
S&P 500 Index 16,15 %	17.01.2020	24.000	USD	142.352,89	0,03
S&P 500 Index 17,33 %	17.01.2020	25.000	USD	327.122,78	0,06
S&P 500 Index 13,30 %	18.01.2019	25.000	USD	-398.273,57	-0,08
S&P 500 Index 17,24 %	17.01.2020	24.500	USD	292.814,84	0,06
S&P 500 Index 14,70 %	21.06.2019	5.000	USD	-48.019,31	-0,01

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag (000)	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfonds- vermögen (%)
S&P 500 Index 15,62 %	17.01.2020	25.000	USD	-50.147,42	-0,01
S&P 500 Index 15,79 %	17.01.2020	15.000	USD	58.266,74	0,01
S&P 500 Index 16,66 %	17.01.2020	15.000	USD	174.364,34	0,03
S&P 500 Index 17,05 %	17.01.2020	30.000	USD	447.339,85	0,09
S&P 500 Index 13,65 %	18.01.2019	30.000	USD	-434.571,17	-0,08
S&P 500 Index 13,76 %	18.01.2019	22.000	USD	-309.754,28	-0,06
S&P 500 Index 15,60 %	21.06.2019	18.000	USD	-62.920,39	-0,01
S&P 500 Index 14,74 %	21.06.2019	25.020	USD	66.674,38	0,01
S&P 500 Index 15,35 %	18.01.2019	14.000	USD	-14.489,98	0,00
S&P 500 Index 16,50 %	17.01.2020	30.000	USD	36.767,66	0,01
S&P 500 Index 16,70 %	21.06.2019	20.000	USD	189.034,66	0,04
S&P 500 Index 15,48 %	21.06.2019	30.000	USD	-71.894,37	-0,01
S&P 500 Index 17,03 %	17.01.2020	27.000	USD	282.149,48	0,05
S&P 500 Index 16,07 %	17.01.2020	18.000	USD	96.795,86	0,02
salesforce.com Inc. 28,80 %	17.01.2020	1.000	USD	-3.367,38	0,00
salesforce.com Inc. 29,26 %	17.01.2020	2.000	USD	-15.554,89	0,00
salesforce.com Inc. 30,18 %	17.01.2020	3.000	USD	-46.203,15	-0,01
salesforce.com Inc. 30,03 %	17.01.2020	3.000	USD	-41.203,37	-0,01
salesforce.com Inc. 27,38 %	17.01.2020	2.500	USD	24.251,10	0,00
Sands China Ltd. 33,50 %	28.03.2019	5.877	HKD	-23.860,84	0,00
Sands China Ltd. 29,50 %	28.03.2019	20.000	HKD	-130,69	0,00
Sanofi 21,32 %	20.12.2019	2.500	EUR	-113.000,00	-0,02
SAP SE 22,31 %	20.12.2019	2.500	EUR	-40.400,00	-0,01
Schlumberger Ltd. 23,74 %	18.01.2019	2.500	USD	5.063,88	0,00
Schlumberger Ltd. 24,60 %	17.01.2020	2.000	USD	-29.622,66	-0,01
Schlumberger Ltd. 23,94 %	18.01.2019	2.000	USD	-7.418,49	0,00
Schlumberger Ltd. 23,50 %	17.01.2020	3.000	USD	-14.076,32	0,00
Schlumberger Ltd. 24,49 %	17.01.2020	3.000	USD	-41.844,36	-0,01
Schlumberger Ltd. 24,65 %	17.01.2020	4.000	USD	-61.740,95	-0,01
Siemens AG 21,01 %	20.12.2019	2.000	EUR	-19.600,00	0,00
Societe Generale S.A. 28,58 %	21.06.2019	3.000	EUR	-268.830,00	-0,05
Societe Generale S.A. 29,00 %	20.12.2019	3.000	EUR	-239.880,00	-0,05
Societe Generale S.A. 26,80 %	21.06.2019	1.500	EUR	-107.655,00	-0,02
Societe Generale S.A. 28,43 %	20.12.2019	2.000	EUR	-150.540,00	-0,03
Societe Generale S.A. 28,07 %	20.12.2019	3.500	EUR	-244.265,00	-0,05
Societe Generale S.A. 26,80 %	20.12.2019	7.500	EUR	-426.975,00	-0,08
Societe Generale S.A. 23,58 %	18.12.2020	3.000	EUR	-22.590,00	0,00
Société Générale S.A. 28,73 %	20.12.2019	3.500	EUR	-273.665,00	-0,05
Société Générale S.A. 26,57 %	21.12.2018	3.500	EUR	-272.895,00	-0,05
Société Générale S.A. 27,15 %	20.12.2019	4.000	EUR	-250.720,00	-0,05
Société Générale S.A. 30,23 %	20.12.2019	2.000	EUR	-187.300,00	-0,04
Starbucks Corp. 23,50 %	17.01.2020	1.000	USD	-2.546,90	0,00
Starbucks Corp. 23,50 %	17.01.2020	3.000	USD	-7.640,70	0,00
Starbucks Corp. 22,26 %	17.01.2020	4.000	USD	44.716,04	0,01
Starbucks Corp. 22,40 %	17.01.2020	2.000	USD	20.494,85	0,00

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag (000)	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfonds- vermögen (%)
Starbucks Corp. 24,06 %	17.01.2020	3.500	USD	-19.593,18	0,00
Starbucks Corp. 24,17 %	17.01.2020	2.500	USD	-18.952,19	0,00
Starbucks Corp. 23,90 %	17.01.2020	2.000	USD	-12.102,05	0,00
State Street Corp. 25,21 %	21.06.2019	2.000	USD	34.015,64	0,01
Swatch Group AG 22,50 %	20.12.2019	1.250	CHF	22.553,64	0,00
Swatch Group AG 25,20 %	20.12.2019	2.500	CHF	-22.467,31	0,00
Swiss Life Holding AG 18,57 %	20.12.2019	975	CHF	-9.688,14	0,00
Swiss Market Index 15,24 %	21.06.2019	21.000	CHF	203.863,33	0,04
Swiss Market Index 15,64 %	21.12.2018	28.000	CHF	501.358,16	0,10
Swiss Market Index 14,62 %	20.12.2019	25.000	CHF	93.926,74	0,02
Swiss Market Index 15,73 %	20.12.2019	27.500	CHF	392.195,94	0,08
Swiss Re AG 19,56 %	21.06.2019	3.000	CHF	-61.872,52	-0,01
Swiss Re AG 19,66 %	21.12.2018	4.000	CHF	-95.515,21	-0,02
Swiss Re AG 20,11 %	20.12.2019	2.500	CHF	-64.142,99	-0,01
Tencent Holdings Ltd. 28,51 %	27.06.2019	33.580	HKD	-110.049,10	-0,02
thyssenkrupp AG 28,97 %	20.12.2019	2.000	EUR	4.380,00	0,00
thyssenkrupp AG 29,93 %	21.06.2019	3.000	EUR	11.220,00	0,00
Total SA 20,93 %	20.12.2019	2.500	EUR	-42.325,00	-0,01
UBS Group AG 22,99 %	21.12.2018	4.000	CHF	-56.908,56	-0,01
UBS Group AG 24,50 %	21.06.2019	1.700	CHF	-40.887,48	-0,01
UBS Group AG 23,06 %	21.06.2019	3.460	CHF	-46.420,80	-0,01
UBS Group AG 23,25 %	21.06.2019	3.000	CHF	-43.302,99	-0,01
UBS Group AG 22,63 %	20.12.2019	4.853	CHF	-34.560,48	-0,01
UBS Group AG 23,33 %	20.12.2019	2.500	CHF	-40.100,16	-0,01
United Continental Holdings Inc. 31,82 %	21.06.2019	1.390	USD	-19.898,72	0,00
United Technologies Corp. 19,85 %	21.06.2019	2.000	USD	21.041,84	0,00
UnitedHealth Group Inc. 28,04 %	17.01.2020	2.500	USD	-100.230,76	-0,02
UnitedHealth Group Inc. 22,00 %	18.01.2019	2.500	USD	-876,03	0,00
UnitedHealth Group Inc. 23,89 %	17.01.2020	3.000	USD	-14.512,20	0,00
Valero Energy Corp 30,27 %	17.01.2020	2.500	USD	-65.339,09	-0,01
Valero Energy Corp 27,15 %	17.01.2020	5.000	USD	4.957,06	0,00
Vmware Inc. 28,46 %	18.01.2019	2.500	USD	210.461,09	0,04
Walt Disney 23,50 %	17.01.2020	3.000	USD	-87.662,92	-0,02
Walt Disney 23,50 %	17.01.2020	1.000	USD	-29.220,97	-0,01
Williams Cos Inc. 25,20 %	17.01.2020	2.000	USD	-410,24	0,00
Williams Cos Inc. 23,35 %	17.01.2020	3.000	USD	26.742,45	0,01
Williams Cos Inc. 24,01 %	18.01.2019	3.000	USD	-12.845,60	0,00
Yum! Brands Inc. 23,10 %	17.01.2020	2.000	USD	-2.478,53	0,00
Yum! Brands Inc. 21,13 %	18.01.2019	2.500	USD	-38.118,03	-0,01
Zurich Insurance Group AG 19,38 %	21.12.2018	4.000	CHF	-127.906,13	-0,02
Zurich Insurance Group AG 18,91 %	20.12.2019	2.500	CHF	-55.294,19	-0,01
Zurich Insurance Group AG 19,99 %	21.06.2019	3.460	CHF	-119.995,07	-0,02
Zurich Insurance Group AG 18,97 %	21.06.2019	3.000	CHF	-72.206,19	-0,01
Summe Volatility Swaps				-8.901.263,81	-1,72
				-8.901.263,81	-1,72

Differenzkontrakte	Nennbetrag	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
Deutschland				
Allianz SE	14.991.441,42	EUR	49.574,01	0,01
Allianz SE	-1.248.298,19	EUR	-477.188,64	-0,09
BASF SE	75.224	EUR	-45.334,48	-0,01
Bayerische Motoren Werke AG	4.380.983,71	EUR	76.892,33	0,01
Bayerische Motoren Werke AG	2.269.742,66	EUR	26.720,46	0,01
Daimler AG	-300.000	EUR	-581.256,43	-0,11
			-950.592,75	-0,18
Frankreich				
AXA S.A.	18.948.830,76	EUR	12.069,14	0,00
AXA S.A.	-1.289.043,51	EUR	-281.338,65	-0,05
BNP Paribas S.A.	20.737.497,55	EUR	111.117,51	0,02
BNP Paribas S.A.	-2.263.355,44	EUR	-635.124,04	-0,12
Credit Agricole S.A.	-1.970.427	EUR	-752.305,09	-0,14
Renault S.A.	-147.650	EUR	-167.111,43	-0,03
Société Générale S.A.	13.842.995,26	EUR	178.557,01	0,03
Société Générale S.A.	-4.682.831,40	EUR	-342.029,10	-0,07
			-1.876.164,65	-0,36
Niederlande				
ING Groep NV	11.738.721,27	EUR	110.931,37	0,02
ING Groep NV	-5.359.924,76	EUR	-113.473,81	-0,02
			-2.542,44	0,00
Schweiz				
Credit Suisse Group AG	463.496	CHF	329.705,79	0,06
Credit Suisse Group AG	-7.141.095,93	CHF	-11.723,40	0,00
UBS Group AG	19.131.370,53	CHF	501.573,07	0,10
UBS Group AG	9.755.325,44	CHF	-501.573,49	-0,10
			317.981,97	0,06
Vereinigte Staaten				
Amazon.com Inc.	27	USD	3.516,36	0,00
Amazon.com Inc.	-45.892,71	USD	-292,56	0,00
American International Group Inc.	25.545	USD	25.302,17	0,00
American International Group Inc.	-1.380.623,83	USD	4.537,98	0,00
Apple Inc.	18.541.657,17	USD	-17.809,94	0,00
Apple Inc.	-96.513	USD	48.827,49	0,01
Bank of America Corp.	21.157.842,87	USD	-15.022,91	0,00
Bank of America Corp.	-691.754	USD	-184.687,69	-0,04
Citigroup Inc.	905.330,80	USD	726,74	0,00
Citigroup Inc.	-12.525	USD	3.468,42	0,00
Ford Motor Co.	1.181.662	USD	-119.890,31	-0,02
Ford Motor Co.	-11.759.871,34	USD	23.968,61	0,00
Goldman Sachs Group Inc.	35.565	USD	287.252,79	0,06
Goldman Sachs Group Inc.	-8.114.451,02	USD	-8.151,82	0,00
JPMorgan Chase & Co.	24.190.429,99	USD	-18.448,86	0,00
JPMorgan Chase & Co.	-213.605	USD	-320.980,06	-0,06

Differenzkontrakte	Nennbetrag	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
Vereinigte Staaten				
Schlumberger Ltd	9.279.940,94	USD	-7.509,20	0,00
Schlumberger Ltd	-136.882	USD	-34.654,74	-0,01
U.S. Bancorp	8.250.831,36	USD	-10.738,47	0,00
U.S. Bancorp	-158.975	USD	-147.346,66	-0,03
			-487.932,66	-0,09
Summe Differenzkontrakte			-2.999.250,53	-0,57
Summe Festverzinsliche Wertpapiere, Festgelder, Optionen, Volatility Swaps und Differenzkontrakte (Anschaffungskosten EUR 272.624.012,01)			274.528.507,88	52,90
Bankguthaben			229.578.454,61	44,24
Sonstige Vermögenswerte			17.708.488,74	3,41
Sonstige Verbindlichkeiten			-2.859.535,00	-0,55
Summe Nettoteilfondsvermögen			518.955.916,23	100,00

ASSENAGON ALPHA VOLATILITY

ZUSAMMENSETZUNG DES NETTOTEILDONFDSVERMÖGENS PER 31. JULI 2018 IN EUR

Aktiva	
Wertpapiere zum Marktwert (Erl. 2)	33.663.646,33
Unrealisierte Gewinne aus Finanzterminkontrakten (Erl. 4)	4.998.165,39
Tagesgelder (Erl. 2)	211.506.538,18
Optionen (Erl. 2)	41.258.837,71
Bankguthaben (Erl. 2) *	229.578.454,61
Forderungen aus Wertpapiergeschäften und Derivaten	3.861.730,33
Forderungen aus Festgeldern	8.546.643,31
Forderungen aus Anteilscheingeschäften	1.273,86
Zinsforderungen	113.917,34
Erträge für Differenzkontrakte	73.751,85
Sonstige Forderungen	113.006,66
Summe Aktiva	533.715.965,57
Passiva	
Verbindlichkeiten aus Wertpapiergeschäften und Derivaten	299.926,59
Verbindlichkeiten aus Anteilscheingeschäften	632.991,56
Unrealisierte Verluste aus Devisentermingeschäften (Erl. 5)	1.375.562,31
Unrealisierte Verluste aus Volatility Swaps (Erl. 2)	8.901.263,81
Unrealisierte Verluste aus Differenzkontrakten	2.999.250,53
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren (Erl. 3)	367.306,72
Verbindlichkeiten aus Verwahrstelle- und Administrationsgebühren (Erl. 3)	179.117,93
Verbindlichkeiten aus Taxe d'Abonnement (Erl. 5)	4.629,89
Summe Passiva	14.760.049,34
Summe Nettoteilfondsvermögen	518.955.916,23
Nettoinventarwert pro Anteil	
Anteilklasse I	987,55
Anteilklasse I2R	834,45
Anteilklasse P	47,04
Umlaufende Anteile am Ende des Berichtszeitraumes	
Anteilklasse I	516.606,42
Anteilklasse I2R	2.900,00
Anteilklasse P	135.178,58

* Die Position kann Einlagen zur Besicherung von Derivaten beinhalten.

Die nachfolgenden Erläuterungen (ab Seite 47) sind wesentlicher Bestandteil des Halbjahresberichts.

Erläuterungen zum Halbjahresbericht

1. Der Fonds

Der Assenagon Alpha (der "Fonds") wurde am 25. Januar 2011 als ein "Fonds Commun de Placement à Compartiments Multiples" aufgelegt. Bei dem Fonds handelt es sich um ein Sondervermögen gemäß Teil I des Luxemburger Gesetzes vom 17. Dezember 2010, welcher die Voraussetzungen eines Organismus für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren (OGAW) erfüllt.

Gegenwärtig wird der Teilfonds Assenagon Alpha Volatility mit den Anteilklassen I und P (Auflagedatum: 25. Januar 2011) zum Kauf angeboten.

Anteile der Anteilklassen I2R des Teilfonds Assenagon Alpha Volatility werden seit dem 21. Dezember 2016 zum Kauf angeboten.

Das Rechnungsjahr des Fonds endet jährlich zum 31. Januar.

Da sich die Geschäftstätigkeit während des gesamten Geschäftsjahres nur auf den Teilfonds Assenagon Alpha Volatility bezogen hat, dient dieser Bericht auch als Halbjahresbericht für den Fonds, es werden keine konsolidierten Zahlen ausgewiesen.

Teilfonds Assenagon Alpha Volatility

Anlageziel

Der Assenagon Alpha Volatility strebt die Erwirtschaftung eines mittel- bis langfristigen Wertzuwachses in Euro an, wobei kurzfristige Wertschwankungen toleriert werden. Das Sondervermögen ist dabei an keine Benchmark gebunden.

Anlagestrategie

Zur Erreichung des Anlageziels setzt der Teilfonds auf eine Kombination von Derivate-Strategien zur Ausnutzung der Volatilität an den globalen Aktien-, Renten-, Zins-, Währungs- und Rohstoffmärkten (Volatilitätsstrategien) verbunden mit einem risikoarmen Liquiditäts-Management.

Je nach Marktgegebenheiten können die Volatilitätsstrategien ein unterschiedliches Gewicht bei der Zusammensetzung des Teilfonds einnehmen, wobei bei Derivaten das Nominal die relevante Bezugsgröße bildet. Der maximal mögliche Verlust einzelner Instrumente, Strategien und auch des Gesamtportfolios kann vom Fonds-Management begrenzt werden. In Marktphasen, in denen keine ausreichenden Chancen zur Ausnutzung der Volatilität identifiziert werden, kann der Teilfonds bis zu 100 % im risikoarmen Liquiditäts-Management investiert bleiben.

a) Implizite Volatilität

Als Maßstab der Schwankungsintensität von Preis- und Renditebewegungen hat sich die Kennzahl Volatilität nicht nur in der Performance- und Risikoanalyse etabliert, sondern bietet auch die Chance, kontinuierlich als Renditequelle genutzt zu werden. Neben der tatsächlich realisierten Volatilität kommt dabei insbesondere der impliziten Volatilität eine entscheidende Rolle zu. Die implizite Volatilität eines Finanzinstrumentes drückt die am Markt erwartete zukünftige Schwankungsbreite der Preise des zugrundeliegenden Finanzinstrumentes aus und kann aus den Preisen von Optionen abgeleitet werden, die auf das jeweilige Instrument verweisen. Implizite Volatilität ist vor allem auf drei Weisen handelbar: Da der Preis einer Option wesentlich von der impliziten Volatilität abhängt, kann durch Kauf bzw. Verkauf von Optionen unter Absicherung aller anderen Marktrisiken die implizite Volatilität eines Finanzinstrumentes investierbar gemacht werden. Des Weiteren existieren mit Varianz Swaps Derivate, die die Differenz aus impliziter und realisierter Varianz (dem Quadrat der Volatilität) abbilden. Zuletzt werden für viele Märkte sogenannte Volatilitätsindizes veröffentlicht, die die am Markt gemessene implizite Volatilität anzeigen. Auf diese Indizes hat sich ein aktiver Derivatemarkt entwickelt.

b) Volatilitätsstrategie

Die im Fonds-Management eingesetzten Volatilitätsstrategien nutzen systematisch relative Preisdifferenzen in unterschiedlichen Volatilitätssegmenten. Dafür stehen dem Fonds-Management unterschiedliche Umsetzungsmöglichkeiten zur Verfügung. Insbesondere können dafür Differenzen zwischen der impliziten und der realisierten Volatilität eines Basiswerts oder Mean-Reversion-Effekte (Rückkehr zum Durchschnittswert) durch Investition in die implizite Volatilität unterschiedlicher Basiswerte genutzt werden. Weitere mögliche Strategien können als Renditequelle z. B. die Veränderung der Volatilitätsstrukturkurven (Laufzeitenkurve oder Schiefe) nutzen. Die Volatilitätsstrategien werden wie oben unter a) beschrieben im Wesentlichen durch Derivate auf Finanzindizes und Einzeltitel umgesetzt, die sich auf die globalen Aktien-, Renten-, Zins-, Währungs- und Rohstoffmärkte bzw. entsprechende Teilmärkte (z. B. Länder, Regionen, Rohstoffgruppen) beziehen oder auf daraus abgeleitete Größen wie z. B. Volatilität oder Varianz referenzieren. Derivate dürfen sowohl zu Anlage- als auch zu Absicherungszwecken eingesetzt werden. Wertpapierleerverkäufe dürfen nicht getätigt werden.

Der verstärkte Einsatz von Derivaten bei der Umsetzung der Volatilitätsstrategien kann zu einer erhöhten Hebelwirkung im Fonds führen.

Bei der Umsetzung der Volatilitätsstrategien wird ein hohes Maß an Flexibilität durch optimierte Fälligkeitsstrukturen, Kostenoptimierung sowie minimiertes Kontrahentenrisiko angestrebt.

Mögliche Kurs- und Währungsrisiken können durch den Einsatz von Terminkontrakten abgesichert werden. Ausfall- oder Kontrahentenrisiken können durch die Hinterlegung von Wertpapieren als Sicherheiten zu Gunsten des Teilfonds minimiert werden.

c) Liquiditäts-Management

Ziel des Liquiditäts-Managements ist die Erzielung einer geldmarktnahen Rendite. Dafür kann der Teilfonds festverzinsliche Wertpapiere, variabel verzinsliche Wertpapiere, Sicht- und Termineinlagen aber auch in börsennotierte und liquide handelbare Wertpapiere, Anteile anderer OGA oder OGAW und Zertifikate erwerben. Dabei können je nach Marktlage Termingelder und Sichteinlagen auch längere Zeit bis zu 100 % des Nettoinventarwerts des Teilfonds ausmachen. Daneben können auch optionsbasierte Strategien zur Erzielung einer geldmarktnahen Rendite eingesetzt werden.

Mögliche Kurs- und Währungsrisiken können durch den Einsatz von Terminkontrakten abgesichert werden. Ausfall- oder Kontrahentenrisiken können durch die Hinterlegung von Wertpapieren als Sicherheiten zu Gunsten des Teilfonds minimiert werden.

d) Anlageinstrumente

Folgende Instrumente können zur Umsetzung der Anlagestrategie im Einzelnen erworben werden:

- Aktien, die zu den internationalen Standardwerten zählen als auch Nebenwerte
- Schuldverschreibungen, die zumindest ein Rating von B- nach Standard & Poor's und Fitch oder B3 nach Moody's aufweisen, wie z.B. fest- und variabel verzinsliche Wertpapiere, Staatsanleihen, Pfandbriefe, Genussscheine, Unternehmensanleihen, Anleihen von Finanzinstituten, Zero-Bonds, Wandel- und Optionsanleihen, Inflation Linked Bonds etc. Der Erwerb von Asset Backed Securities (ABS) ist jedoch ausgeschlossen
- Termingelder und Sichteinlagen mit einer Laufzeit von höchstens zwölf Monaten
- Währungskassa- und Währungstermingeschäfte
- Anteile anderer OGA und OGAW
- Zertifikate
- Optionen, sowohl börsengehandelte Optionen als auch OTC-Kontrakte (Over-the-Counter-Kontrakte) und Flex-Kontrakte (Flex-Produkte sind individuell vereinbarte Kontrakte, die über die Börse gehandelt werden, an der auch das Clearing erfolgt)
- Forwards, Futures und Flex-Futures
- Swaps (insbesondere Varianz-Swaps und Forward Starting Variance Swaps), Forward Swaps und Swaptions. Durch den Abschluss eines Varianz-Swaps wird zwischen den Kontrahenten ein auf der Varianz (Quadratzahl der Volatilität) des zugrunde liegenden Aktienindex basierender Austausch von Zahlungsströmen vereinbart. Mit Hilfe dieser Instrumente lassen sich Strategien bezüglich zukünftiger Volatilitätsentwicklung umsetzen oder aber langfristig Risikoprämien von impliziter gegenüber realisierter Volatilität verdienen.
- Mit dem Handel eines Forward Starting Variance Swap schließt man ein Termingeschäft ab, auf ein in der Zukunft startenden Varianz Swap. Dieses Instrument ermöglicht das Handeln von zukünftiger impliziter Volatilität
- Total Return Swaps

Je nach Einsatz innerhalb der Strategien können Kurs- und Zinsrisiken, Basiswertrisiken und Volatilitätsrisiken der vorstehenden Instrumente abgesichert werden. Zudem können Kreditrisiken durch den Einsatz von Kreditderivaten wie beispielsweise Credit Default Swaps abgesichert werden. Sofern es sich um Optionsanleihen oder Wandelschuldverschreibungen handelt, können auch die inhärenten Aktienrisiken abgesichert werden.

Derivative Instrumente (Optionen, Forwards, Futures, Swaps, Forward Swaps und Swaptions) dürfen im Teilfonds nur gehandelt werden, wenn die entsprechenden Basiswerte auf die globalen Aktien-, Renten-, Zins-, Währungs- und Rohstoffmärkte bzw. entsprechende Teilmärkte (z.B. Länder, Regionen, Rohstoffgruppen) oder daraus abgeleitete Größen (wie z.B. Volatilität, Varianz, Korrelation, Dividendenrendite, Inflation) sowie auf anerkannte Finanzindizes gemäß Artikel 44 des Gesetzes vom 17. Dezember 2010 und gemäß Artikel 9 der Großherzoglichen Verordnung vom 8. Februar 2008 lauten. Der Einsatz dieser Derivate erfolgt nur unter Einhaltung der im Verwaltungsreglement aufgeführten Anlagegrundsätze und -beschränkungen. Derivative Instrumente mit einzelnen Rohstoffen als Basiswert dürfen nicht im Teilfonds gehandelt werden. Die Verwaltungsgesellschaft kann Kontrahentenrisiken bei OTC-Derivatetransaktionen reduzieren, indem sie die OTC-Vertragsparteien verpflichtet, liquide Sicherheiten zu stellen. Darunter sind insbesondere Barmittel, Wertpapiere oder

erstklassige Staatsanleihen zu verstehen. Für diese Sicherheiten wird täglich ein Marktwert ermittelt. Die Höhe der zu stellenden Sicherheiten muss mindestens dem Wert entsprechen, um den die im Verwaltungsreglement ausgewiesenen Grenzwerte der aufgeführten Anlagegrundsätze und -beschränkungen überschritten werden, ggf. multipliziert mit einem Gewichtungsfaktor. Die Sicherheiten können von der Verwaltungsgesellschaft verwertet werden. Für die im Portfolio des Fonds befindlichen Swaps kann ein Barausgleich stattfinden, es kann jedoch auch zu einer effektiven Lieferung von Wertpapieren kommen.

Währungsrisiken von nicht in Euro denominierten Instrumenten können abgesichert werden. Hierzu kommen in der Regel Währungsswaps oder Devisentermingeschäfte zum Einsatz. Zur Erreichung des Anlageziels kann der Fonds unter den Bedingungen von Artikel 5 des Verwaltungsreglements als Darlehensgeber und Darlehensnehmer von Wertpapieren auftreten. Die Verwaltungsgesellschaft erwartet, dass normalerweise nicht mehr als 30 % des Bestands des Fonds Gegenstand von Wertpapierleih-, Pensions- und Rückkaufgeschäften sind; maximal sind 50 % des Bestands des Fonds Gegenstand von Wertpapierleih-, Pensions- und Rückkaufgeschäften.

Der Fonds darf Anteile anderer OGAW und anderer OGA nur in Höhe von insgesamt 10 % des Nettofondsvermögens erwerben.

Die maximale Hebelwirkung aus dem Einsatz von Total Return Swaps wird nicht mehr als das 19-fache des Fondsvermögens betragen. Die erwartete Hebelwirkung aus dem Einsatz von Total Return Swaps wird im Normalfall nicht mehr als das 6-fache des Fondsvermögens betragen.

Im Rahmen der im Verwaltungsreglement festgesetzten Anlagebeschränkungen kann der Fonds in sonstige zulässige Vermögenswerte investieren.

e) Eingeschränkte Risikostreuung

Die Verwaltungsgesellschaft darf nach dem Grundsatz der Risikostreuung bis zu 100 % des Nettofondsvermögens in Wertpapieren verschiedener Emissionen anlegen, die von einem EU-Mitgliedstaat oder seinen Gebietskörperschaften, von einem Drittstaat oder von internationalen Organismen öffentlich-rechtlichen Charakters, denen ein oder mehrere EU-Mitgliedstaaten angehören, oder von anderen von der CSSF anerkannten Staaten (wie z.B. Brasilien, Singapur, Russland, Indonesien oder Südafrika) begeben oder garantiert werden, sofern diese Wertpapiere im Rahmen von mindestens sechs verschiedenen Emissionen begeben worden sind, wobei die Wertpapiere aus ein und derselben Emission 30 % des Nettofondsvermögens des Fonds nicht überschreiten dürfen.

Anleger sollten beachten, dass die Anlagestrategie des Fonds im Falle einer negativen Marktentwicklung keinen Schutz vor Kursverlusten bietet.

Anleger werden ausdrücklich darauf hingewiesen, dass durch den zusätzlichen Einsatz von Derivaten die Risikostruktur des Fonds nachhaltig beeinflusst werden kann.

Es kann keine Zusicherung gegeben werden, dass die Ziele der Anlagepolitik tatsächlich erreicht werden.

Risikoprofil des Teilfonds

Der Teilfonds verfolgt eine wachstumsorientierte Anlagestrategie, die auf eine attraktive Wertsteigerung ausgerichtet ist. Hohe Chancen stehen höheren Risiken gegenüber.

Risikoprofil des Anlegerkreises

Der Teilfonds ist insbesondere für Anleger geeignet, die ein moderates Wachstum bzw. Erträge erwarten und die daher bereit sind, Verluste hinzunehmen. Die Anlagedauer sollte mindestens zwei bis drei Jahre betragen.

2. Wesentliche Bilanzierungs- und Bewertungsgrundsätze

Allgemeines

Die Erstellung der Finanzberichte erfolgt in Übereinstimmung mit den luxemburgischen Vorschriften in Bezug auf Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren (OGAW).

Bewertung der Anlagen

Das jeweilige Nettoteilfondsvermögen wird nach folgenden Grundsätzen berechnet:

- Vermögenswerte, die an einer Börse amtlich notiert sind, werden zum letzten verfügbaren Kurs bewertet. Wenn ein Vermögenswert an mehreren Börsen notiert ist, ist der letzte verfügbare Kurs an jener Börse maßgebend, die der Hauptmarkt für diesen Vermögenswert ist.
- Vermögenswerte, die nicht an einer Börse notiert sind, die aber an einem anderen geregelten, anerkannten, für das Publikum offenen und ordnungsgemäß funktionierenden Markt gehandelt werden, werden zu dem Kurs bewertet, der nicht

geringer als der Geldkurs und nicht höher als der Briefkurs zur Zeit der Bewertung sein darf und den die Verwaltungsgesellschaft für den bestmöglichen Kurs hält, zu dem die Vermögenswerte verkauft werden können.

- c) Nicht börsennotierte Derivate werden auf einer von der Verwaltungsgesellschaft festzulegenden und überprüfbaren Bewertung auf Tagesbasis bewertet. Die für die Preisfeststellung der Derivate bestimmten Kriterien erfolgen in üblicher, vom Wirtschaftsprüfer nachvollziehbaren, Weise.
- d) Falls die unter vorstehend a) und b) genannten Kurse nicht marktgerecht sind oder sofern ein Vermögenswert nicht an einer Börse oder auf einem anderen geregelten Markt notiert oder gehandelt wird oder sofern für Vermögenswerte, welche an einer Börse oder auf einem anderen Markt wie vorerwähnt notiert oder gehandelt werden, die Kurse entsprechend den Regelungen in a) oder b) den tatsächlichen Marktwert der entsprechenden Vermögenswerte nicht angemessen widerspiegeln, werden diese Vermögenswerte, ebenso wie alle anderen Vermögenswerte, zum jeweiligen Verkehrswert bewertet, wie ihn die Verwaltungsgesellschaft nach Treu und Glauben und allgemein anerkannten, von Wirtschaftsprüfern nachprüfbaren, Bewertungsregeln festlegt.
- e) Die auf Vermögenswerte entfallenden anteiligen Zinsen werden miteinbezogen, soweit sie sich nicht im Kurswert ausdrücken.
- f) Der Liquidationswert von Forwards oder Optionen, die nicht an Börsen oder anderen organisierten Märkten gehandelt werden, wird gemäß den Richtlinien der Verwaltungsgesellschaft auf einer konsistent für alle verschiedenen Arten von Verträgen angewandten Grundlage festgestellt. Der Liquidationswert von Futures oder Optionen, welche an Börsen oder anderen organisierten Märkten gehandelt werden, wird auf der Grundlage der letzten verfügbaren Abwicklungspreise solcher Verträge an den Börsen oder organisierten Märkten, auf welchen diese Futures oder Optionen vom jeweiligen Teilfonds gehandelt werden, berechnet; sofern ein Future, Forward oder eine Option an einem Tag, für welchen der Nettoinventarwert bestimmt wird, nicht liquidiert werden kann, wird die Bewertungsgrundlage für einen solchen Vertrag vom Verwaltungsrat in angemessener und vernünftiger Weise bestimmt.
- g) Swaps werden zum Barwert (Present Value) bewertet.
- h) Flüssige Mittel werden zu deren Nennwert zuzüglich anteiliger Zinsen bewertet. Festgelder können zum jeweiligen Renditekurs bewertet werden, vorausgesetzt, ein entsprechender Vertrag zwischen dem Finanzinstitut, welches die Festgelder verwahrt, und der Verwaltungsgesellschaft sieht vor, dass diese Festgelder zu jeder Zeit kündbar sind und dass im Falle einer Kündigung ihr Realisierungswert diesem Renditekurs entspricht.
- i) Zielfondsanteile werden zum letzten festgestellten und erhältlichen Nettoinventarwert bewertet. Falls für Investmentanteile die Rücknahme ausgesetzt ist oder keine Rücknahmepreise festgelegt werden, werden die Anteile ebenso wie alle anderen Vermögenswerte zum jeweiligen Veräußerungswert bewertet, wie ihn die Verwaltungsgesellschaft nach Treu und Glauben auf der Grundlage des wahrscheinlich errechenbaren Veräußerungswertes festlegt.
- j) Alle nicht auf die jeweilige Teilfondswährung lautenden Vermögenswerte werden zum letzten verfügbaren Devisenkurs in die betreffende Teilfondswährung umgerechnet. Gewinne oder Verluste aus Devisentransaktionen werden hinzugerechnet oder abgesetzt.
- k) Sämtliche sonstigen Wertpapiere oder sonstigen Vermögenswerte werden zu ihrem angemessenen Veräußerungswert bewertet, wie dieser nach Treu und Glauben von der Verwaltungsgesellschaft und nach einem von ihr festgelegten Verfahren bestimmt wird.

Die Verwaltungsgesellschaft kann nach eigenem Ermessen andere Bewertungsmethoden zulassen, wenn sie dieses im Interesse einer angemesseneren Bewertung eines Vermögenswertes des Teilfonds für angebracht hält.

Wenn die Verwaltungsgesellschaft der Ansicht ist, dass der ermittelte Nettoinventarwert an einem bestimmten Bewertungstag den tatsächlichen Wert der Anteile des Teilfonds nicht wiedergibt, oder wenn es seit der Ermittlung des Nettoinventarwertes beträchtliche Bewegungen an den betreffenden Börsen und/oder Märkten gegeben hat, kann die Verwaltungsgesellschaft beschließen, den Nettoinventarwert noch am selben Tag zu aktualisieren.

Unter diesen Umständen werden alle für diesen Bewertungstag eingegangenen Anträge auf Zeichnung und Rücknahme auf der Grundlage des Nettoinventarwertes eingelöst, der unter Berücksichtigung des Grundsatzes von Treu und Glauben aktualisiert worden ist.

Erträge

Dividenden werden an dem Datum, an dem die betreffenden Wertpapiere erstmals "Ex-Dividende" notiert werden, als Ertrag verbucht. Zinserträge laufen täglich auf.

Realisierte Gewinne oder Verluste aus dem Verkauf von Wertpapieren

Realisierte Gewinne oder Verluste aus dem Verkauf von Wertpapieren werden nach der Durchschnittskostenmethode ermittelt.

3. Kosten

Für die Verwaltung des Teilfonds Assenagon Alpha Volatility erhält die Verwaltungsgesellschaft eine Vergütung in Höhe von 0,8 % p.a. für die Anteilklasse I und I2R und 1,0 % p.a. für die Anteilklasse P.

Die Verwaltungsvergütung wird täglich berechnet und abgegrenzt und am Monatsultimo auf Basis des durchschnittlichen monatlichen Nettoteilfondsvermögens ausbezahlt. Die Vergütung versteht sich zuzüglich einer etwaigen Mehrwertsteuer. Die Verwahrstelle, die Zentralverwaltung, die Register- und Transferstelle und die Zahlstelle in Luxemburg sind berechtigt ein Entgelt von bis zu 0,15 % p.a., mindestens jedoch EUR 10.000 pro Monat, zu erhalten.

Zusätzliche fixe und transaktionsabhängige Gebühren werden von der Verwahrstelle entsprechend der erbrachten Dienstleistungen berechnet. Diese Vergütung wird täglich abgegrenzt und am Monatsultimo auf Basis des durchschnittlichen monatlichen Nettoteilfondsvermögens berechnet und ausbezahlt. Die Vergütung versteht sich zuzüglich einer etwaigen Mehrwertsteuer.

Die Kosten für die Gründung des Fonds und die Erstaussgabe von Anteilen können über einen Zeitraum von höchstens fünf Jahren abgeschrieben werden.

Sonstige Kosten im Sinne von Artikel 13 des Verwaltungsreglements können dem Nettoteilfondsvermögen nach ihrem tatsächlichen Anfall belastet werden.

Performance Fee für Anteilklassen I und P

Die Verwaltungsgesellschaft erhält aus dem Nettoteilfondsvermögen eine wertentwicklungsabhängige Vergütung (Performance Fee) von 15 % der Mehrperformance über einen Hurdle-Index. Die Performance Fee wird bewertungstäglich berechnet und zum Geschäftsjahresende ausbezahlt.

Bei Auflegung des Teilfonds liegt der Hurdle-Index auf dem Erstaussgabepreis des Teilfonds und entwickelt sich im Laufe des Geschäftsjahres mit einer kalkulatorischen Grundverzinsung von 3 % p.a. Nach Abschluss eines Geschäftsjahres wird der Hurdle-Index zum Geschäftsjahresende auf den höheren Wert von a) dem für das Geschäftsende errechneten Hurdle-Index-Wert und b) dem Anteilwert des Teilfonds nach Auszahlung der Performance Fee für das abgelaufene Geschäftsjahr (High Water Mark) angepasst.

Die Performance Fee ergibt sich aus der Differenz des Anteilwertes (vor Performance Fee) und dem Hurdle-Index, multipliziert mit der Anzahl der aktuell umlaufenden Anteile abzüglich der Korrekturposten für Zuflüsse. Dazu kommen in jedem Fall die auf Grund von Rückflüssen zurückgestellten Performance-Fee-Anteile. Am Geschäftsjahresende wird nach Auszahlung der so errechneten Performance Fee der Hurdle-Index angepasst und die Rückstellungen und Korrekturposten auf Null zurückgesetzt, unabhängig davon, ob eine Performance Fee ausbezahlt wurde oder nicht. Im abgelaufenen Geschäftsjahr wurde keine Performance Fee gezahlt.

4. Finanzterminkontrakte

Die am 31. Juli 2018 ausstehenden Finanzterminkontrakte werden in der nachfolgenden Tabelle dargestellt:

Underlying	Währung	Fälligkeit	Kontrakte	Unrealisierter Gewinn/Verlust (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
DAX Index	EUR	21.09.2018	18	-20.723,67	0,00
Russell 2000 Mini	USD	21.09.2018	-70	59.628,68	0,01
EUR/CHF Futures	CHF	17.09.2018	-74	-29.306,78	-0,01
EUR/GBP Futures	GBP	17.09.2018	4	7.539,44	0,00
Euro FX Future	USD	17.09.2018	-163	150.629,25	0,03
Euro-Schatz Futures	EUR	06.09.2018	-2.000	290.000,00	0,06
Euro Stoxx 50®	EUR	21.09.2018	-629	-293.535,97	-0,06
Euro Stoxx Bank	EUR	21.09.2018	-633	-145.955,98	-0,03
FTSE 100 Index	GBP	21.09.2018	51	47.792,74	0,01
Hang Seng Index	HKD	30.08.2018	-20	39.971,43	0,01
S&P 500 E-Mini	USD	21.09.2018	2.571	4.358.857,87	0,84
STOXX Europe 600 Index	EUR	21.09.2018	1.494	523.935,05	0,10
Swiss Market Index	CHF	21.09.2018	49	9.333,33	0,00
				4.998.165,39	0,96

5. Devisentermingeschäfte

Die am 31. Juli 2018 ausstehenden Devisentermingeschäfte werden in der nachfolgenden Tabelle dargestellt:

Kauf	Währung	Verkauf	Währung	Fälligkeit	Unrealisierte Gewinne/Verluste (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
2.142.127,02	EUR	2.473.514,07	CHF	21.09.2018	5.608,20	0,00
22.937,50	EUR	26.485,93	CHF	21.09.2018	60,05	0,00
1.707.765,17	EUR	1.971.956,44	CHF	21.09.2018	4.471,02	0,00
24.286,45	EUR	28.043,56	CHF	21.09.2018	63,59	0,00
2.592.912,71	EUR	3.000.000,00	CHF	21.09.2018	1.637,19	0,00
22.385.329,00	EUR	26.000.000,00	CHF	21.09.2018	-72.392,18	-0,01
113.640.189,91	EUR	135.000.000,00	USD	21.09.2018	-1.301.555,91	-0,26
1.290.045,15	EUR	12.000.000,00	HKD	21.09.2018	-13.454,27	0,00
					-1.375.562,31	-0,27

6. Besteuerung

Taxe d'Abonnement

Der jeweilige Teilfonds unterliegt einer Abonnementsteuer (Taxe d'Abonnement) in Höhe von 0,05 % p. a., welche vierteljährlich auf der Grundlage des Nettoteilfondsvermögens am Ende des jeweiligen Quartals berechnet wird. Für Anteilklassen, die ausschließlich institutionellen Anlegern zugänglich sind (Anteilklasse I und I2R), gilt ein ermäßigter Steuersatz von 0,01 % p. a.

7. Aufstellung über die Entwicklung des Wertpapierbestands

Auf Anfrage ist am eingetragenen Sitz der Verwaltungsgesellschaft sowie bei der Zahl- und Informationsstelle in Deutschland eine kostenfreie Aufstellung mit detaillierten Angaben über sämtliche während der Berichtsperiode getätigten Käufe und Verkäufe erhältlich.

8. Gewinnverwendung

Es werden ausschüttende (Anteilklassen I und P) und thesaurierende (Anteilklasse I2R) Anteile ausgegeben. Für den am 31. Juli 2018 endenden Berichtszeitraum erfolgte keine Ausschüttung.

9. Umrechnung von Fremdwährungen

Die Vermögenswerte des Sondervermögens sind auf der Grundlage der nachstehenden Kurse per 31. Juli 2018 umgerechnet:

Britische Pfund	0,891976	= 1 Euro
Hong Kong Dollar	9,181558	= 1 Euro
Japanische Yen	130,9754000	= 1 Euro
Schweizer Franken	1,158350	= 1 Euro
US-Dollar	1,170050	= 1 Euro

10. Risikomanagementverfahren

Die Verwaltungsgesellschaft ermittelt die Bestimmung des Gesamtrisikos auf der Grundlage des Ansatzes des absoluten Value-at-Risk (VaR).

Aufgrund der Anlagestrategie des Teilfonds wird erwartet, dass die Hebelwirkung aus dem Einsatz von Derivaten nach Summe der Nennwerte nicht mehr als das 19-fache des Nettoteilfondsvermögens beträgt. Die erwartete Hebelwirkung kann unter besonderen Umständen auch über der festgelegten Grenze liegen.

Auslastung des VaR Limits von 12,5 %*	
Maximum	76,82 % ⁽¹⁾
Minimum	34,38 % ⁽¹⁾
Durchschnitt	61,69 % ⁽¹⁾
Hebelwirkung (Leverage) – Summe der Nennwerte	
	1.636,22 % ⁽²⁾

* Das VaR Limit wird entsprechend des Risikoprofils und der Assenagon Risk Management Policy definiert.

⁽¹⁾ Das Risikomaß gibt an, welchen Wert der Verlust des Portfolios mit einer Wahrscheinlichkeit von 99 % bei einer Haltedauer von 20 Tagen nicht überschreitet.

⁽²⁾ Es handelt sich um die durchschnittliche Hebelwirkung im abgelaufenen Berichtszeitraum.

Das VaR wird mit dem Modell der historischen Simulation über einen Beobachtungszeitraum von einem Jahr, einem Konfidenzniveau von 99 % und einer Haltedauer von 20 Arbeitstagen berechnet.

11. Transaktionskosten

Die Transaktionskosten resultierend aus den Käufen und Verkäufen der Wertpapiere und Derivate für den am 31. Juli 2018 endenden Berichtszeitraum werden in der nachfolgenden Tabelle dargestellt:

Teilfonds	Transaktionskosten (EUR)
Assenagon Alpha Volatility	1.984.044,50
	1.984.044,50

12. Besicherung der Derivate

Zum Bewertungsstichtag stellte der Teilfonds folgende Sicherheiten ("Collateral") für die im Halbjahresbericht ausgewiesenen Derivate:

Kontrahent	Art der Sicherheit	Betrag (EUR)
BNP Paribas London	Barmittel	21.900.000,00
Citigroup Global Markets Limited	Barmittel	32.640.000,00
Commerzbank AG	Barmittel	3.210.000,00
Credit Suisse International	Barmittel	4.050.000,00
Deutsche Bank AG (Frankfurt)	Barmittel	4.660.000,00
Goldman Sachs International	Barmittel	20.390.000,00
JP Morgan Securities Plc	Barmittel	980.000,00
Merrill Lynch International	Barmittel	8.180.000,00
Morgan Stanley & Co. International Plc	Barmittel	8.509.000,00
UBS AG	Barmittel	20.090.000,00
		124.609.000,00

Zum Bewertungsstichtag wurden dem Teilfonds folgende Sicherheiten ("Collateral") für die im Halbjahresbericht ausgewiesenen Derivate zur Reduzierung des Kontrahentenrisikos gestellt:

Kontrahent	Art der Sicherheit	Betrag (EUR)
Natixis S.A. (Paris)	Barmittel	8.510.000,00
Société Générale (Paris)	Barmittel	11.520.000,00
		20.030.000,00

Das den Derivaten zu Grunde liegende Exposure beträgt zum 31. Juli 2018: 32.980.926,45 EUR.

13. Ausweis der Kontrahenten

Der Teilfonds hat im Berichtszeitraum Derivategeschäfte mit den folgenden Kontrahenten getätigt:

Kontrahent
Banco Bilbao Vizcaya Madrid S.A.
BNP Paribas S.A.
Brown Brothers Harriman
Citigroup Global Markets Limited
Commerzbank AG
Credit Suisse International
Deutsche Bank AG
Exane S.A.
Goldman Sachs International
JPMorgan Chase & Co.
Merrill Lynch International
Morgan Stanley International
Natixis S.A.
Société Générale (Paris)
UBS AG (London)

Sonstige Angaben

Pflichten im Hinblick auf Wertpapierfinanzierungsgeschäfte - Verordnung zur Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften (SFTR).

Am 23.12.2015 wurde die Verordnung (EU) 2015/2365 über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften und der Weiterverwendung sowie zur Änderung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 (SFTR) im Amtsblatt der Europäischen Union veröffentlicht.

Die SFTR regelt im Wesentlichen Verpflichtungen im Hinblick auf sogenannte „Wertpapierfinanzierungsgeschäfte“ (WFG). Durch die SFTR werden für den Abschluss, die Änderung oder Beendigung von WFG neben den nach EMIR bereits bestehenden Reportingverpflichtungen (die aber für WFG grundsätzlich nicht anwendbar sind) zusätzliche Meldepflichten begründet.

Der Assenagon Alpha Volatility unterhielt keine Wertpapierfinanzierungsgeschäfte oder Gesamttrendite-Swaps im Berichtszeitraum zum 31. Juli 2018. Die zusätzlichen Meldepflichten aus oben genannten Regulierung finden daher keine Anwendung.



Assenagon Asset Management S.A.
Aerogolf Center
1B Heienhaff
1736 Senningerberg
Luxemburg
Telefon +352 27049-100
Telefax +352 27049-111
www.assenagon.com
© 2018