



Genossenschaftliche FinanzGruppe
Volksbanken Raiffeisenbanken



Jahresbericht zum 31. März 2019

UniAbsoluterErtrag

Verwaltungsgesellschaft:
Union Investment Luxembourg S.A.

Inhaltsverzeichnis

	Seite
Vorwort	3
UniAbsoluterErtrag	5
Anlagepolitik	5
Wertentwicklung des Fonds	5
Geografische Länderaufteilung	6
Wirtschaftliche Aufteilung	6
Entwicklung der letzten 3 Geschäftsjahre	7
Zusammensetzung des Fondsvermögens	7
Zurechnung auf die Anteilklassen	7
Veränderung des Fondsvermögens	8
Aufwands- und Ertragsrechnung	8
Entwicklung der Anzahl der Anteile im Umlauf	8
Vermögensaufstellung	9
Devisenkurse	16
Zu- und Abgänge im Berichtszeitraum	16
Erläuterungen zum Bericht	36
Bericht des Abschlussprüfers (Réviseur d'entreprises agréé)	38
Sonstige Informationen der Verwaltungsgesellschaft	40
Verwaltungsgesellschaft, Verwaltungsrat, Geschäftsführer, Gesellschafter, Portfoliomanagement, Abschlussprüfer (Réviseur d'entreprises agréé), Verwahrstelle, Zahl- und Vertriebsstellen	45

Hinweis

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

Vorwort

Union Investment – Ihrem Interesse verpflichtet

Mit einem verwalteten Vermögen von rund 337 Milliarden Euro zählt die Union Investment Gruppe zu den größten deutschen Fondsgesellschaften für private und institutionelle Anleger. Sie ist Experte für Fondsvermögensverwaltung in der genossenschaftlichen FinanzGruppe. Etwa 4,5 Millionen private und institutionelle Anleger vertrauen uns als Partner für fondsbasierte Vermögensanlagen.

Die Idee der Gründung 1956 ist heute aktueller denn je: Privatanleger sollten die Chance haben, an der wirtschaftlichen Entwicklung teilzuhaben – und das bereits mit kleinen monatlichen Sparbeiträgen. Die Interessen dieser Investoren sind bis heute zentrales Anliegen für uns, dem wir uns mit unseren rund 3.200 Mitarbeitern verpflichtet fühlen. Rund 1.250 Publikums- und Spezialfonds bieten privaten und institutionellen Anlegern Lösungen, die auf ihre individuellen Anforderungen zugeschnitten sind – von Aktien-, Renten- und Geldmarktfonds über Offene Immobilienfonds bis hin zu intelligenten Lösungen zur Vermögensbildung, zum Risikomanagement oder zur privaten und betrieblichen Altersvorsorge.

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

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

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

Globale Rentenmärkte mit freundlicher Tendenz

Zu Beginn des Berichtsjahres stand der US-Rentenmarkt unter Abgabedruck. Dabei kletterte die Rendite für zehnjährige Staatsanleihen über die Marke von 3,2 Prozent. Als belastend erwiesen sich gute Konjunkturdaten und die Angst vor höheren Inflationsraten. Vor allem die Energiepreise verteuerten sich im Jahresverlauf deutlich. Dazu trug auch die US-Administration selbst bei, indem sie das Atomabkommen mit dem Iran aufkündigte. Zudem sorgten sich die Anleger, ob sich die höheren Zölle aus dem hart geführten Handelsstreit zwischen China und den USA in steigenden Preisen niederschlagen könnten. Nach den US-Zwischenwahlen im November wendete sich jedoch das Blatt. Schwächere Wirtschaftsdaten ließen massive Konjunktursorgen aufkommen. Die Währungshüter ruderten zurück und deuteten eine mögliche Zinspause an. Dennoch erhöhten sie im Dezember zum dritten Mal nach Juni und September noch einmal den Leitzins. Angesichts weiterhin schwacher Konjunkturdaten sahen sie sich später jedoch zu einer kommunikativen Kehrtwende gezwungen. Im ersten Quartal 2019 kam es daher zu deutlichen Kursgewinnen. Zinserhöhungen dürften für das laufende Kalenderjahr weitgehend vom Tisch sein. Darüber hinaus soll die Notenbankbilanz perspektivisch nicht weiter abgebaut werden. In Summe konnten US-Schatzanweisungen, gemessen am JP Morgan Global Bond US-Index, im Berichtszeitraum 4,3 Prozent an Wert zulegen.

Euro-Staatsanleihen entwickelten sich zunächst noch freundlich, gerieten dann aber ebenfalls unter Druck. In den Fokus der Anleger gelangten dabei italienische Staatsanleihen. Ein Haushaltsstreit zwischen der Regierung und der Europäischen Union sorgte für Verunsicherung. Lange Zeit stand sogar ein mögliches Defizitverfahren gegen Italien im Raum. Letztlich konnte aber ein Kompromiss gefunden werden. Im weiteren Verlauf des Berichtszeitraums holten Peripherieanleihen ihre zuvor erlittenen Verluste fast wieder auf. Mit aufkommenden Konjunktursorgen standen dann auch Bundesanleihen in der Gunst der Anleger. Die Rendite zehnjähriger Papiere fiel letztlich sogar wieder in den negativen Bereich. Im März 2019 kündigte auch die Europäische Zentralbank (EZB) an, auf Zinserhöhungen im laufenden Jahr zu verzichten. Gemessen am iBoxx Euro Sovereign-Index verteuerten sich Euro-Staatsanleihen in den vergangenen zwölf Monaten um 2,1 Prozent. Staatsanleihen aus den Kernländern (+3,8 Prozent) entwickelten sich wesentlich besser als Titel aus den Peripherieländern (-0,1 Prozent).

Der Markt für europäische Unternehmensanleihen preiste zunächst das Ende des Ankaufprogramms der EZB ein und musste höhere Risikoaufschläge verkraften. Zwischenzeitlich sorgten gute Unternehmensergebnisse für eine Stabilisierung. Die Konjunktursorgen im Schlussquartal 2018 lösten starke Kursverluste an den Aktienmärkten aus. Diese wirkten sich auch negativ auf die Wertentwicklung von europäischen Unternehmensanleihen aus. Mit dem Jahreswechsel setzte jedoch eine deutliche Erholung ein. Gemessen am ICE BofA Merrill Lynch Euro Corporate-Index verteuerten sich Euro-Unternehmensanleihen um 2,3 Prozent.

Höhere US-Renditen, ein fester US-Dollar und die Sorge um den Welthandel führten bei Anleihen aus den Schwellenländern anfangs zu höheren Risikoaufschlägen und Kursverlusten. Die Kehrtwende der US-Notenbank und die damit verbundenen rückläufigen US-Renditen sorgten dann jedoch für Rückenwind. Darüber hinaus entspannte sich das Verhältnis zwischen China und den USA im Handelsstreit. Auch wenn die Gespräche keinen Durchbruch brachten, betonten beide Seiten die Bemühungen um eine Lösung. Anleihen aus den Schwellenländern legten daher im vergangenen Jahr, gemessen am J.P. Morgan Global Bond Emerging Market-Index um 4,2 Prozent zu.

Aktienbörsen im Plus, doch mit regionalen Unterschieden

Die globalen Aktienmärkte sind im Berichtszeitraum Achterbahn gefahren. Per saldo gewann der MSCI World-Index in lokaler Währung 4,6 Prozent. Zunächst konnten dank der US-Steuerreform und guter Konjunkturdaten erhebliche Kurszuwächse erzielt werden. Als marktstützend erwiesen sich positive US-Unternehmensergebnisse, Aktienrückkäufe und eine lebhaftere Fusions- und Übernahmeaktivität. Seit sich aber der US-Handelskonflikt deutlich verschärft hat, ist die Unsicherheit stark gestiegen. Belastend wirkte auch die restriktive Geldpolitik der US-Notenbank Federal Reserve (Fed). Nachdem diese im ersten Quartal 2019 jedoch ausdrücklich von ihrem straffen Zinserhöhungskurs abgekehrt ist, erholten sich die Börsen deutlich.

In den USA sorgten außergewöhnlich gute Wirtschafts- und Unternehmenszahlen sowie die Stärke der Technologiewerte lange Zeit für kräftige Zuwächse. Doch kamen wiederholt Inflations- und Zinssorgen auf. Die Fed hielt dabei 2018 unbeirrt an ihren Zinspfad fest. Zudem hinterließ der Handelsstreit zwischen den USA und China deutliche Spuren. Ab dem Herbst 2018 kam es daher zu einem kräftigen Kurseinbruch, auch aufgrund von wirtschaftspolitischen Unsicherheiten, die vom US-Präsidenten ausgingen. Seit dem Jahreswechsel sorgte die geldpolitische Kehrtwende der Fed für eine kräftige Erholung. Hinzu kam die Aussicht auf eine Entspannung im Handelskonflikt mit China. In den vergangenen zwölf Monaten stiegen der Dow Jones Industrial Average um 7,6 Prozent sowie der marktbreite S&P 500-Index per saldo um 7,3 Prozent. Der Technologie-Index NASDAQ gewann sogar 9,4 Prozent.

Die europäischen Börsen wurden während des gesamten Berichtszeitraums von den Unsicherheiten rund um den Brexit und der italienischen Haushaltspolitik belastet. Zuletzt folgten sie aber den positiven US-Vorgaben. Der EURO STOXX 50-Index trat mit minus 0,3 Prozent letztendlich auf der Stelle, während der STOXX Europe 600-Index um 2,2 Prozent zulegen konnte.

Japanische Aktien verbuchten angesichts einer robusten Konjunktur und der Yen-Abwertung zwischenzeitlich deutliche Kurszuwächse. Doch insgesamt konnten sie sich dem globalen Abwärtstrend nicht entziehen. Der NIKKEI 225-Index fiel per saldo um 1,2 Prozent. Die Schwellenländer schlossen, gemessen am MSCI Emerging Markets-Index in lokaler Währung, mit minus 4,3 Prozent negativ ab. Asien – vor allem China – litt stark unter der Verschärfung der US-Handelspolitik.

Wichtiger Hinweis:

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

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

Anlagepolitik

Anlageziel und Anlagepolitik sowie wesentliche Ereignisse

Der aus drei Anteilsklassen bestehende UniAbsoluterErtrag ist ein global ausgerichteter Mischfonds, welcher eine Multi-Asset-Strategie mit Absolute Return Charakter verfolgt. Dabei kombiniert das Fondsmanagement marktabhängige und eher marktneutrale Anlagestrategien aller Assetklassen (beispielsweise Aktien, Renten, Rohstoffe) flexibel miteinander. Marktneutrale Anlagestrategien können unter anderem aus einer Kombination von Long- und Shortpositionen bestehen. Ziel der Anlagepolitik des UniAbsoluterErtrag ist die Erwirtschaftung einer angemessenen Rendite des angelegten Kapitals bei gleichzeitiger Beachtung wirtschaftlicher und politischer Risiken.

Struktur des Portfolios und wesentliche Veränderungen

Der UniAbsoluterErtrag investierte sein Fondsvermögen im abgelaufenen Berichtszeitraum überwiegend in Investmentfonds mit einem Anteil von zuletzt 78 Prozent. Dieser teilte sich in jeweils 30 Prozent Aktienfonds und Rentenfonds und 19 Prozent Mischfonds auf. Kleinere Engagements in Liquidität, in Rentenanlagen und in Aktien ergänzten das Portfolio. Der Fonds war in Derivate investiert.

Bei der Auswahl der Aktienfonds favorisierte das Fondsmanagement globale und europäische Aktienfonds. Ergänzt wurde die Zusammensetzung durch Aktienfonds mit regionalem Schwerpunkt in Deutschland und im asiatisch-pazifischen Raum.

Bei der Auswahl der Rentenfonds favorisierte das Fondsmanagement globale Rentenfonds. Diverse Anlageregionen wie unter anderem in den aufstrebenden Volkswirtschaften (Emerging Markets), in Skandinavien sowie in den Euroländern ergänzten das Portfolio.

Die gehaltenen Mischfonds setzten sich ebenfalls überwiegend aus globalen Mischfonds zusammen. Ergänzt wurde diese Aufteilung durch kleinere Bestände an Mischfonds der Euroländer sowie der aufstrebenden Volkswirtschaften (Emerging Markets).

Der Fonds hielt zum Ende des Berichtszeitraums 17 Prozent des Fondsvermögens in Fremdwährungen. Die größte Position bildete hier der US-Dollar mit zuletzt 14 Prozent. Kleinere Engagements in diversen Fremdwährungen ergänzten das Portfolio.

Der Fonds nimmt in Bezug auf die Anteilklasse UniAbsoluterErtrag A für das Geschäftsjahr vom 1. April 2018 bis zum 31. März 2019 eine Ausschüttung in Höhe von 0,17 Euro pro Anteil vor.

Der Fonds nimmt in Bezug auf die Anteilklasse UniAbsoluterErtrag -net- A für das Geschäftsjahr vom 1. April 2018 bis zum 31. März 2019 eine Ausschüttung in Höhe von 0,17 Euro pro Anteil vor.

Der Fonds nimmt in Bezug auf die Anteilklasse UniAbsoluterErtrag I für das Geschäftsjahr vom 1. April 2018 bis zum 31. März 2019 eine Ausschüttung in Höhe von 0,34 Euro pro Anteil vor.

Hinweis: Aufgrund einer risikoorientierten Betrachtungsweise können die dargestellten Werte von der Vermögensaufstellung abweichen.

Wertentwicklung in Prozent ¹⁾

	6 Monate	1 Jahr	3 Jahre	10 Jahre
Klasse A	-2,75	-4,74	-6,25	-
Klasse -net- A	-2,89	-5,02	-7,06	-
Klasse I	-2,66	-4,57	-5,76	-

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

Geografische Länderaufteilung ¹⁾

Luxemburg	44,59 %
Irland	12,39 %
Großbritannien	9,69 %
Deutschland	5,72 %
Frankreich	3,83 %
Vereinigte Staaten von Amerika	3,17 %
Schweiz	2,72 %
Finnland	2,55 %
Australien	2,08 %
Italien	2,00 %
Ägypten	1,59 %
Mexiko	0,86 %
China	0,26 %
Wertpapiervermögen	91,45 %
Optionen	0,12 %
Terminkontrakte	-0,33 %
Credit Default Swaps	-0,27 %
Sonstige Finanzinstrumente	0,24 %
Bankguthaben	7,61 %
Sonstige Vermögensgegenstände/Sonstige Verbindlichkeiten	1,18 %
Fondsvermögen	100,00 %

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

Wirtschaftliche Aufteilung ¹⁾

Investmentfondsanteile	78,39 %
Diversifizierte Finanzdienste	6,12 %
Staatsanleihen	5,78 %
Energie	0,86 %
Banken	0,26 %
Versorgungsbetriebe	0,04 %
Wertpapiervermögen	91,45 %
Optionen	0,12 %
Terminkontrakte	-0,33 %
Credit Default Swaps	-0,27 %
Sonstige Finanzinstrumente	0,24 %
Bankguthaben	7,61 %
Sonstige Vermögensgegenstände/Sonstige Verbindlichkeiten	1,18 %
Fondsvermögen	100,00 %

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

Entwicklung der letzten 3 Geschäftsjahre

Klasse A

Datum	Fondsvermögen Mio. EUR	Anteilumlauf Tsd.	Mittelauf- kommen Mio. EUR	Anteilwert EUR
31.03.2017	726,00	15.483	210,37	46,89
31.03.2018	680,46	14.353	-53,57	47,41
31.03.2019	477,79	10.648	-168,25	44,87

Klasse -net- A

Datum	Fondsvermögen Mio. EUR	Anteilumlauf Tsd.	Mittelauf- kommen Mio. EUR	Anteilwert EUR
31.03.2017	1.411,38	29.674	452,80	47,56
31.03.2018	1.386,85	28.918	-36,10	47,96
31.03.2019	960,02	21.208	-352,33	45,27

Klasse I

Datum	Fondsvermögen Mio. EUR	Anteilumlauf Tsd.	Mittelauf- kommen Mio. EUR	Anteilwert EUR
31.03.2017	106,77	1.110	18,91	96,15
31.03.2018	100,34	1.033	-7,56	97,16
31.03.2019	66,48	721	-29,13	92,15

Zusammensetzung des Fondsvermögens zum 31. März 2019

	EUR
Wertpapiervermögen (Wertpapiereinstandskosten: EUR 1.355.227.234,76)	1.375.694.793,92
Optionen	1.552.685,65
Bankguthaben	114.541.603,30
Sonstige Bankguthaben	24.937.276,68
Nicht realisierte Gewinne aus Swapgeschäften	3.581.728,57
Nicht realisierte Gewinne aus Zinsswapgeschäften	6.390,54
Nicht realisierte Gewinne aus Devisentermingeschäften	498.911,43
Zinsforderungen aus Wertpapieren	754.681,05
Zinsforderungen aus Zinsswapgeschäften	20.355,12
Forderungen aus Wertpapiergeschäften	120.716,13
Sonstige Forderungen	4.421,27
	1.521.713.563,66
Verbindlichkeiten aus Anteilrücknahmen	-7.256.403,40
Nicht realisierte Verluste aus Terminkontrakten	-5.008.434,98
Nicht realisierte Verluste aus Credit Default Swaps	-3.884.182,21
Zinsverbindlichkeiten	-15.541,50
Verbindlichkeiten aus Wertpapiergeschäften	-56.729,98
Sonstige Passiva	-1.197.910,65
	-17.419.202,72

Fondsvermögen 1.504.294.360,94

Zurechnung auf die Anteilklassen

Klasse A

Anteiliges Fondsvermögen	477.792.792,03 EUR
Umlaufende Anteile	10.647.683,000
Anteilwert	44,87 EUR

Klasse -net- A

Anteiliges Fondsvermögen	960.019.783,86 EUR
Umlaufende Anteile	21.208.301,000
Anteilwert	45,27 EUR

Klasse I

Anteiliges Fondsvermögen	66.481.785,05 EUR
Umlaufende Anteile	721.486,000
Anteilwert	92,15 EUR

UniAbsoluterErtrag

Veränderung des Fondsvermögens

im Berichtszeitraum vom 1. April 2018 bis zum 31. März 2019

	Total EUR	Klasse A EUR	Klasse -net- A EUR	Klasse I EUR
Fondsvermögen zu Beginn des Berichtszeitraumes	2.167.658.076,60	680.463.380,41	1.386.850.886,65	100.343.809,54
Ordentlicher Nettoertrag	-6.529.214,18	-1.206.725,32	-5.277.191,27	-45.297,59
Ertrags- und Aufwandsausgleich	-1.891.528,69	-362.551,07	-1.505.314,31	-23.663,31
Mittelzuflüsse aus Anteilverkäufen	58.059.853,60	6.157.664,58	19.467.643,45	32.434.545,57
Mittelabflüsse aus Anteilrücknahmen	-607.764.897,04	-174.409.107,91	-371.796.231,73	-61.559.557,40
Realisierte Gewinne	396.136.396,32	124.489.473,67	254.974.792,88	16.672.129,77
Realisierte Verluste	-432.926.839,36	-136.191.303,90	-278.731.760,28	-18.003.775,18
Nettoveränderung nicht realisierter Gewinne	-1.296.235.967,39	-404.789.056,21	-829.314.430,67	-62.132.480,51
Nettoveränderung nicht realisierter Verluste	1.241.453.843,48	387.926.478,18	794.051.726,34	59.475.638,96
Ausschüttung	-13.665.362,40	-4.285.460,40	-8.700.337,20	-679.564,80
Fondsvermögen zum Ende des Berichtszeitraumes	1.504.294.360,94	477.792.792,03	960.019.783,86	66.481.785,05

Aufwands- und Ertragsrechnung

im Berichtszeitraum vom 1. April 2018 bis zum 31. März 2019

	Total EUR	Klasse A EUR	Klasse -net- A EUR	Klasse I EUR
Dividenden	265.228,85	82.691,42	169.831,45	12.705,98
Erträge aus Investmentanteilen	4.009.772,00	1.258.897,20	2.579.009,83	171.864,97
Zinsen auf Anleihen	1.810.830,24	576.662,48	1.168.607,80	65.559,96
Zinserträge aus Zinsswapgeschäften	813.598,14	253.406,62	520.222,88	39.968,64
Bankzinsen	-115.103,80	-36.170,22	-74.388,74	-4.544,84
Erträge aus Wertpapierleihe	3.580,24	1.143,69	2.305,48	131,07
Sonstige Erträge	2.628.664,96	822.990,92	1.686.446,79	119.227,25
Ertragsausgleich	-1.662.373,88	-498.681,75	-1.100.919,79	-62.772,34
Erträge insgesamt	7.754.196,75	2.460.940,36	4.951.115,70	342.140,69
Zinsaufwendungen	-418.779,61	-131.609,78	-269.686,67	-17.483,16
Zinsaufwendungen aus Zinsswapgeschäften	-1.263.858,46	-394.835,82	-808.652,33	-60.370,31
Verwaltungsvergütung	-13.617.078,83	-3.205.077,57	-10.123.708,88	-288.292,38
Pauschalgebühr	-1.910.404,10	-600.061,19	-1.228.907,89	-81.435,02
Veröffentlichungskosten	-11.910,44	-3.812,92	-7.718,29	-379,23
Taxe d'abonnement	-462.872,47	-145.504,17	-297.867,22	-19.501,08
Sonstige Aufwendungen	-152.409,59	-47.997,05	-97.999,79	-6.412,75
Aufwandsausgleich	3.553.902,57	861.232,82	2.606.234,10	86.435,65
Aufwendungen insgesamt	-14.283.410,93	-3.667.665,68	-10.228.306,97	-387.438,28
Ordentlicher Nettoertrag	-6.529.214,18	-1.206.725,32	-5.277.191,27	-45.297,59
Transaktionskosten im Geschäftsjahr gesamt ¹⁾	6.022.116,57			
Laufende Kosten in Prozent ^{1) 2)}		1,47	1,76	1,28

1) Siehe Erläuterungen zum Bericht.

2) Für den Fonds UniAbsoluterErtrag / Klasse -net- A und I wurde im Berichtszeitraum kein Ausgabeaufschlag erhoben. Die Vertriebskosten wurden aus der Verwaltungsvergütung entnommen.

Entwicklung der Anzahl der Anteile im Umlauf

	Klasse A Stück	Klasse -net- A Stück	Klasse I Stück
Umlaufende Anteile zu Beginn des Berichtszeitraumes	14.353.461,000	28.917.778,000	1.032.770,000
Ausgegebene Anteile	130.475,000	407.960,000	345.513,000
Zurückgenommene Anteile	-3.836.253,000	-8.117.437,000	-656.797,000
Umlaufende Anteile zum Ende des Berichtszeitraumes	10.647.683,000	21.208.301,000	721.486,000

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Berichtes.

Vermögensaufstellung zum 31. März 2019

ISIN	Wertpapiere		Zugänge	Abgänge	Bestand	Kurs	Kurswert EUR	Anteil am Fonds- vermögen % ¹⁾
Aktien, Anrechte und Genussscheine								
Börsengehandelte Wertpapiere								
Deutschland								
DE000A2LQ2L3	innogy SE	EUR	16.000	0	16.000	38,1500	610.400,00	0,04
							610.400,00	0,04
Börsengehandelte Wertpapiere							610.400,00	0,04
Aktien, Anrechte und Genussscheine							610.400,00	0,04
Anleihen								
Börsengehandelte Wertpapiere								
EGP								
EGT9980N4J15	0,000 % Ägypten v.18(2019)		270.000.000	0	270.000.000	99,1195	13.794.775,18	0,92
							13.794.775,18	0,92
EUR								
IT0004992308	2,500 % Italien v.14(2019)		30.000.000	0	30.000.000	100,1960	30.058.800,00	2,00
							30.058.800,00	2,00
USD								
XS1406670999	2,000 % Industrial & Commercial Bank of China Ltd/Singapore EMTN v.16 (2019)		4.400.000	0	4.400.000	99,8880	3.914.734,12	0,26
US912796RD34	0,000 % Vereinigte Staaten von Amerika v.18(2019)		37.000.000	0	37.000.000	100,0000	32.956.266,14	2,19
							36.871.000,26	2,45
Börsengehandelte Wertpapiere							80.724.575,44	5,37
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere								
USD								
US71654QAU67	8,000 % Petroleos Mexicanos v.09(2019)		14.457.000	0	14.457.000	100,3630	12.923.736,45	0,86
							12.923.736,45	0,86
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere							12.923.736,45	0,86
Nicht notierte Wertpapiere								
EGP								
EGT998039J10	0,000 % Ägypten v.18(2019)		209.000.000	0	209.000.000	93,3166	10.053.024,00	0,67
							10.053.024,00	0,67
Nicht notierte Wertpapiere							10.053.024,00	0,67
Anleihen							103.701.335,89	6,90
Investmentfondsanteile ²⁾								
Deutschland								
DE000A0M80M2	UniFavorit: Aktien -I-	EUR	171.582	0	499.173	161,0600	80.396.803,38	5,34
							80.396.803,38	5,34
Finnland								
FI0008812011	Evli Nordic Corporate Bond	EUR	262.000	0	262.000	146,5500	38.396.100,00	2,55
							38.396.100,00	2,55
Frankreich								
IE00BWFRC140	Lyxor / Chenavari Credit Fund	EUR	0	0	33.517	99,7588	3.343.615,70	0,22
IE00B844SH66	Lyxor/WNT Fund	EUR	0	18.893	68.758	109,7590	7.546.809,32	0,50
FR0013275070	OFI Risk Arb Absolu FCP	EUR	0	0	55.412	100,6600	5.577.771,92	0,37
FR0010757831	Syquant Capital - Helium Opportunités	EUR	0	9.359	30.216	1.362,2660	41.162.229,46	2,74
							57.630.426,40	3,83
Großbritannien								
IE00BKZGL097	Barings Emerging Markets Local Debt Fund	EUR	106.944	0	106.944	93,9800	10.050.597,12	0,67
IE00BFM6VK70	Coupland Cardiff Funds plc - CC Japan Alpha Fund	JPY	3.415.000	0	3.415.000	949,8920	26.107.863,71	1,74
IE00B8G2MF47	Insight LIBOR Plus Fund	EUR	0	47.180.692	14.550.297	1,1238	16.351.623,77	1,09
IE00BYQP5B29	Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund	USD	156.435	78.235	78.200	131,0800	9.130.182,60	0,61

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Berichtes.

UniAbsoluterErtrag

ISIN	Wertpapiere		Zugänge	Abgänge	Bestand	Kurs	Kurswert	Anteil am Fonds- vermögen % 1)
							EUR	
IE00BYW7BD64	Marshall Wace UCITS Funds PLC - MW Liquid Alpha Fund	EUR	0	30.390	94.903	106,9431	10.149.221,02	0,67
IE00BYW7B815	Marshall Wace UCITS Funds Plc. MW Liquid Alpha Fund - Klasse A Euro	EUR	0	18.030	204.139	111,6206	22.786.117,66	1,51
IE00BLP55791	Merian Global Investors Series PLC - Merian Global Equity Absolute Return Fund	EUR	0	4.979.981	4.412.596	1,5505	6.841.730,10	0,45
IE00BPT2B085	Neuberger Berman Global Bond Absolute Return Fund	EUR	0	0	700.000	9,3200	6.524.000,00	0,43
IE00BDZRX300	Neuberger Berman Short Duration Emerging Market Debt Fund	EUR	0	0	3.100.000	10,6300	32.953.000,00	2,19
IE00BZ1J0335	Odey Investments PLC - Odey European Focus Absolute Return Fund	EUR	0	0	49.595	99,3149	4.925.522,47	0,33
							145.819.858,45	9,69

Irland

IE00BZ005F46	Aegon European ABS Fund	EUR	1.000.000	0	1.000.000	10,4824	10.482.400,00	0,70
IE00BYZTN220	BLACKWALL EUROPE I/S FUND	EUR	0	239.016	1.031.804	9,9600	10.276.767,84	0,68
IE00BCZRQT02	Fort Global UCITS Funds PLC - Contrarian Fund	EUR	0	1.812	8.681	1.136,9600	9.869.949,76	0,66
IE00BTLWG59	GAM Star Fund Plc. - Cat Bond Fund	EUR	1.286.000	0	1.592.000	13,1451	20.926.999,20	1,39
IE00B59P9M57	GAM Star Fund Plc. - Global Rates	EUR	0	489.657	905.238	11,0744	10.024.967,71	0,67
IE00BYPJR538	GAM Star Fund plc - MBS Total Return	USD	0	0	2.000.000	11,2242	19.995.012,02	1,33
IE00B5429P46	GLG Investments VI Plc. - European Equity Alternative	EUR	41.200	51.191	200.110	113,4700	22.706.481,70	1,51
IE00BYW8Z598	Hedge I.I.Fds-HI Quantwave	EUR	46.498	0	46.498	95,5522	4.442.987,68	0,30
IE00BLG30Y36	Hedge Invest International Funds - HI Numen Credit Fund	EUR	0	72.270	195.585	95,1300	18.606.001,05	1,24
IE00BDFXQM87	IAM Investments ICAV - IAM EJF Alpha Opportunities	EUR	5.235	0	5.235	944,8600	4.946.342,10	0,33
IE00BGLSKM63	IPM UCITS Umbrella ICAV - IPM Systematic Macro UCITS Fund	EUR	7.273	0	7.273	1.001,0970	7.280.978,48	0,48
IE00B3LJVG97	MAN Funds VI PLC - Man GLG Alpha Select Alternative	EUR	94.709	17.103	77.606	132,8200	10.307.628,92	0,69
IE00BYVQYQ87	MAN Funds VI PLC - Man GLG European Alpha Alternative	EUR	100.000	31.590	68.410	95,0800	6.504.422,80	0,43
IE00BDRKT177	MAN Funds VI PLC - Man Gig Innovation Equity Alternative	EUR	107.873	16.586	91.287	104,1500	9.507.541,05	0,63
IE00BD38JM62	PIMCO GIS Mortgage Opportunities Fund	USD	0	0	1.961.592	10,6900	18.677.668,55	1,24
IE00BF0J8075	Trium Opportunistic Equity Fund	EUR	0	12.300	20.992	81,8000	1.717.145,60	0,11
							186.273.294,46	12,39

Luxemburg

LU1021293185	AB Mortgage Income Portfolio S1 USD Inc	USD	0	0	500.000	17,0300	7.584.394,76	0,50
LU1040796796	AGENDA SICAV - Liquid Premium	EUR	0	307.000	762.142	9,7900	7.461.370,18	0,50
LU1664206528	Allianz Discovery Germany Strategy	EUR	0	2.359	10.055	952,2400	9.574.773,20	0,64
LU1570265261	Alpha UCITS SICAV - Fair Oaks Dynamic Credit Fund	EUR	0	0	15.000	976,7800	14.651.700,00	0,97
LU0272941112	Amundi Funds - Absolute Volatility Euro Equities	EUR	0	2.293	15.793	1.139,0500	17.989.016,65	1,20
LU1103259088	AQR UCITS Funds - Style Premia UCITS Fund	EUR	0	14.462	71.599	102,4900	7.338.181,51	0,49
LU057525335	Assenagon Alpha Volatility	EUR	2.639	1.956	12.431	1.099,1800	13.663.906,58	0,91
LU1382784764	BlackRock Strategic Funds - Global Event Driven Fund	EUR	228.226	19.342	208.884	108,4600	22.655.558,64	1,51
LU1337225053	BlueBay Global Sovereign Opportunities Fund	EUR	0	25.316	101.679	108,9800	11.080.977,42	0,74
LU1063708694	Boussard & Gavaudan SICAV - Absolute Return	EUR	0	2.341	11.871	1.037,4100	12.315.094,11	0,82
LU0784437740	BPI Global Investments Fund - BPI Alternative Iberian Equities Long short Fund	EUR	0	204.927	1.064.618	12,2660	13.058.604,39	0,87
LU0501220262	CGS FMS SICAV - Global Evolution Frontier Markets (Sub - Fund 1)	EUR	25.000	0	158.146	158,0300	24.991.812,38	1,66
LU1047850851	DNB Fund - TMT Absolute Return	EUR	0	44.972	124.573	120,2408	14.978.757,18	1,00
LU1331972494	Eleva UCITS Fund - Eleva Absolute Return Europe Fund	EUR	13.628	0	13.628	1.032,3900	14.069.410,92	0,94
LU1155061614	Exane Funds 1 - Exane Archimedes Fund Cl. E	EUR	0	451	1.831	9.686,9200	17.736.750,52	1,18
LU1733196908	Exane Funds 1 - Exane Integrale Fund	EUR	935	0	935	10.097,4100	9.441.078,35	0,63
LU0961411492	Falcon - Twelve-Falcon Insurance Linked Strategy Fund	EUR	0	0	46.000	105,4100	4.848.860,00	0,32
LU1135780176	Goldman Sachs - SICAV I - GS Global Strategic Macro Bond Ptf	EUR	0	159.541	145.591	100,3500	14.610.056,85	0,97
LU0490769915	Janus Henderson Fund - Janus Henderson United Kingdom Absolute Return Fund	EUR	0	776.147	2.346.074	7,0775	16.604.338,74	1,10
LU1388736503	Jupiter Global Fund - Jupiter Global Absolute Return	EUR	0	0	960.000	9,2800	8.908.800,00	0,59
LU1602251818	Laffitte Risk Arbitrage UCITS/Luxembourg	EUR	0	731	1.490	11.323,0300	16.871.314,70	1,12
LU1162198839	LFIS Vision UCITS - Premia	EUR	0	5.022	17.654	1.165,9700	20.584.034,38	1,37
LU0476438642	Melchior European Absolute Return Fund	EUR	0	0	11.180	111,3236	1.244.597,85	0,08
LU1358059555	Melchior Selected Trust - Velox Fund	EUR	0	35.677	137.032	108,0669	14.808.623,44	0,98
LU0562189042	Merrill Lynch Investment Solutions - AQR Global Relative Value UCITS Fund	EUR	0	7.659	70.591	98,4500	6.949.683,95	0,46
LU1468410581	Merrill Lynch Investment Solutions - Enhanced Cross-Asset Volatility Premium Fd	EUR	0	100.000	240.000	99,9900	23.997.600,00	1,60
LU0994402526	Merrill Lynch Investment Solutions - Enhanced Volatility Premium Fund	EUR	40.000	0	231.385	121,7800	28.178.065,30	1,87
LU0333226826	Merrill Lynch Investment Solutions - Marshall Wace Tops UCITS Fund	EUR	0	0	121.009	139,3000	16.856.511,91	1,12

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Berichtes.

UniAbsoluterErtrag

ISIN	Wertpapiere		Zugänge	Abgänge	Bestand	Kurs	Kurswert	Anteil am Fondsvermögen % ¹⁾
							EUR	
LU1680845879	Merrill Lynch Investment Solutions - Ramius Merger Arbitrage UCITS Fund	EUR	0	0	50.000	104,7000	5.235.000,00	0,35
LU0980588775	Natixis International Funds Lux I-Loomis Sayles Short Term Emerging Markets Bond	EUR	230.000	0	230.000	103,5700	23.821.100,00	1,58
LU1732224917	Pareto SICAV - Pareto Nordic Corporate Bond	EUR	0	0	254.894	102,4149	26.104.943,52	1,74
LU1071462532	Pictet TR - Agora	EUR	0	59.047	160.760	124,3300	19.987.290,80	1,33
LU0635020901	Pictet TR - Kosmos	EUR	0	0	244.846	108,2800	26.511.924,88	1,76
LU1840469545	Privilege - Amber Event Europe	EUR	497.520	0	497.520	9,9308	4.940.771,62	0,33
LU1844121795	Quadriga Investors - Igneo Fund	USD	50.000	0	50.000	98,5700	4.389.863,72	0,29
LU1429039461	Schroder Gaia Two Sigma Diversified	EUR	0	0	139.165	115,2900	16.044.332,85	1,07
LU1923201351	SEB Prime Solutions - Bodenholm Absolute Return	EUR	74.294	0	74.294	101,6000	7.548.270,40	0,50
LU1469429549	Threadneedle Lux - Pan European Absolute Alpha	EUR	0	0	310.000	11,0800	3.434.800,00	0,23
LU1669793827	UI - Aktia EM Frontier Bond+	EUR	79.500	0	129.775	103,9500	13.490.111,25	0,90
LU1131313493	UnInstitutional European Equities Concentrated	EUR	340.776	0	340.776	141,3600	48.172.095,36	3,20
LU1756676109	UnInstitutional Risk Premia	EUR	50.000	0	150.000	89,3000	13.395.000,00	0,89
LU0175818722	UnInstitutional Short Term Credit	EUR	0	0	754.079	45,7300	34.484.032,67	2,29
LU1832180779	UnInstitutional Structured Credit	EUR	100.000	0	100.000	99,4000	9.940.000,00	0,66
LU1099836758	UnInstitutional Structured Credit High Yield	EUR	15.000	0	84.200	118,5300	9.980.226,00	0,66
LU1602255561	Vontobel Fund - Twentyfour Monument European Asset Backed Securities	EUR	0	0	100.000	101,5100	10.151.000,00	0,67

670.684.636,98
1.179.201.119,67

Investmentfondsanteile

Zertifikate

Börsengehandelte Wertpapiere

Australien

XS1590565625	Macquarie Bank Ltd. (London Branch)/Maquarie Commodity Product 233T Index Zert. v.17(2020)	USD	0	0	349.895	100,3600	31.277.689,68	2,08
--------------	--	-----	---	---	---------	----------	---------------	------

31.277.689,68
31.277.689,68

Börsengehandelte Wertpapiere

An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere

Deutschland

XS0461202136	Dte. Bank AG (London Branch)/DBLCI FLEX 40 USD TRAC Index Zert. v.14(2024)	USD	26.000	0	52.000	111,4000	5.159.704,28	0,34
--------------	--	-----	--------	---	--------	----------	--------------	------

5.159.704,28
0,34

Schweiz

XS1605262119	Credit Suisse AG/Credit Suisse Custom Commodity 109 Total Return Index Zert. v.17(2019)	USD	0	120	230	199.860,0000	40.943.974,35	2,72
--------------	---	-----	---	-----	-----	--------------	---------------	------

40.943.974,35
46.103.678,63

An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere

Nicht notierte Wertpapiere

Vereinigte Staaten von Amerika

XS1009877918	Credit Suisse AG/Credit Suisse Custom Commodity 140 Total Return Index Zert. v.17(2018)	USD	57	0	70	237.380,0000	14.800.570,05	0,98
--------------	---	-----	----	---	----	--------------	---------------	------

14.800.570,05
14.800.570,05

Nicht notierte Wertpapiere

Zertifikate

Wertpapiervermögen

92.181.938,36
1.375.694.793,92

Optionen

Long-Positionen

EUR

Call on Euro Stoxx 50 Price Index April 2019/3.425,00	5.000	0	5.000			390.000,00	0,03
Call on Swaption SLKK03Y6 November 2019/-0,19	500.000.000	0	500.000.000			90.500,00	0,01
Call on Swaption SLQK10YL Juni 2019/0,55	100.000.000	0	100.000.000			2.400,00	0,00
Put on Euro Stoxx 50 Price Index April 2019/3.250,00	2.000	0	2.000			328.000,00	0,02
Put on EUR/USD Januar 2020/1,1701	25.000.000	0	25.000.000			826.050,00	0,05
Put on 3MO Euribor Future Juni 2019/100,250	3.000	0	3.000			-300.000,00	-0,02
Put on 3MO Euribor Future Juni 2019/99,875	3.000	0	3.000			-75.000,00	0,00

1.261.950,00
0,09

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Berichtes.

ISIN	Wertpapiere	Zugänge	Abgänge	Bestand	Kurs	Kurswert EUR	Anteil am Fonds- vermögen % 1)
GBP							
	Put on GBP/JPY Mai 2019/142,000	42.000.000	0	42.000.000		733.317,85	0,05
	Put on LIF 3MO Sterling Future September 2019 September 2019/98,50	6.000	0	6.000		-210.484,96	-0,01
	Put on 3MO Libor Currency Future Juni 2019/98,750	4.500	0	4.500		-188.716,17	-0,01
						334.116,72	0,03
USD							
	Call on CBT 10YR US T-Bond Note Future April 2019/124,00	450	300	150		85.591,65	0,01
	Call on Swaption SLOX0364 Juli 2019/2,708	500.000.000	0	500.000.000		58.786,85	0,00
	Call on USD/ZAR Mai 2019/15,00	25.000.000	0	25.000.000		299.011,31	0,02
	Put on CME 3MO Euro-Dollar Future September 2019/97,125	3.000	0	3.000		16.700,81	0,00
	Put on Eurodollar Mid-curve Future Juni 2018/96,500	6.000	0	6.000		33.401,62	0,00
	Put on 3MO Eurodollar Future Juni 2019/96,875	4.000	0	7.000		38.968,56	0,00
	Put on 3MO Eurodollar Future September 2019/96,750	5.000	0	5.000		27.834,68	0,00
						560.295,48	0,03
Long-Positionen						2.156.362,20	0,15
Short-Positionen							
EUR							
	Call on Swaption SLKK03Y7 November 2019/-0,04	0	500.000.000	-500.000.000		-28.000,00	0,00
	Call on Swaption SLQK10YM Juni 2019/0,7	0	100.000.000	-100.000.000		-800,00	0,00
	Call on Swaption SLQK10YN Juni 2019/0,8	0	100.000.000	-100.000.000		-400,00	0,00
	Put on EUR/USD Januar 2020/1,1335	0	25.000.000	-25.000.000		-430.400,00	-0,03
	Put on 3MO Euribor Future Juni 2019/100,125	0	6.000	-6.000		262.500,00	0,02
						-197.100,00	-0,01
GBP							
	Put on GBP/JPY Mai 2019/136,000	0	42.000.000	-42.000.000		-290.694,22	-0,02
	Put on 3MO Libor Currency Future Juni 2019/98,625	0	4.500	-4.500		62.905,39	0,00
						-227.788,83	-0,02
USD							
	Call on CBT 10YR US T-Bond Note Future April 2019/125,00	300	450	-150		-33.401,62	0,00
	Call on Swaption SLOX0365 Juli 2019/2,908	0	500.000.000	-500.000.000		-7.571,03	0,00
	Call on USD/ZAR Mai 2019/17	0	25.000.000	-25.000.000		-20.909,41	0,00
	Put on CME 3MO Euro-Dollar Future Juni 2019 Juni 2019/96,625	0	2.000	-2.000		-11.133,87	0,00
	Put on CME 3MO Euro-Dollar Future September 2019/96,875	0	3.000	-3.000		-16.700,81	0,00
	Put on Eurodollar Mid-curve Future Juni 2018/96,250	0	6.000	-6.000		-33.401,62	0,00
	Put on 3MO Eurodollar Future Juni 2019/96,500	0	2.000	-5.000		-27.834,68	0,00
	Put on 3MO Eurodollar Future September 2019/96,625	0	5.000	-5.000		-27.834,68	0,00
						-178.787,72	0,00
Short-Positionen						-603.676,55	-0,03
Optionen						1.552.685,65	0,12
Terminkontrakte							
Long-Positionen							
JPY							
	Japanese Yen Currency Future Juni 2019	201	0	201		-220.413,89	-0,01
						-220.413,89	-0,01
USD							
	E-Mini S&P 500 Index Future Juni 2019	244	122	122		109.646,39	0,01
	US Dollar Currency Future Juni 2019	2.296	671	1.625		-1.456.449,85	-0,10
						-1.346.803,46	-0,09
Long-Positionen						-1.567.217,35	-0,10

ISIN	Wertpapiere	Zugänge	Abgänge	Bestand	Kurs	Kurswert	Anteil am Fonds- vermögen % 1)
						EUR	

Short-Positionen

EUR

DAX Performance-Index Future Juni 2019	0	105	-105			-87.812,50	-0,01
EUREX Dow Jones EURO STOXX 50 Index Future Juni 2019	3.110	4.034	-924			68.540,01	0,00
MSCI Europe Index Future Juni 2019	0	2.198	-2.198			-1.081.416,00	-0,07
MSCI World Net EUR Future Juni 2019	0	2.892	-2.892			-2.568.096,00	-0,17
						-3.668.784,49	-0,25

JPY

Tokyo Stock Price (TOPIX) Index Future Juni 2019	0	195	-195			227.566,86	0,02
						227.566,86	0,02

Short-Positionen

Terminkontrakte

						-3.441.217,63	-0,23
						-5.008.434,98	-0,33

Credit Default Swaps

Gekauft

EUR

Citigroup Global Markets Ltd./iTraxx Europe S31 5Yr Index CDS v.19(2024)	200.000.000	100.000.000	100.000.000			-1.808.362,00	-0,12
Société Générale S.A., Paris/Alstom S.A. CDS v.18(2023)	3.500.000	0	3.500.000			-77.088,31	-0,01
Société Générale S.A., Paris/Anglo American Capital Plc. CDS v.18(2023)	3.500.000	0	3.500.000			-644.438,73	-0,04
Société Générale S.A., Paris/Groupe Danone S.A. CDS v.18(2023)	3.500.000	0	3.500.000			-114.029,16	-0,01
Société Générale S.A., Paris/HeidelbergCement AG CDS v.18(2023)	3.500.000	0	3.500.000			-681.067,42	-0,05
Société Générale S.A., Paris/Heineken NV CDS v.18(2023)	3.500.000	0	3.500.000			-113.297,49	-0,01
Société Générale S.A., Paris/HSBC Holdings Plc. CDS v.18(2023)	3.500.000	0	3.500.000			-72.884,14	0,00
Société Générale S.A., Paris/iTraxx Europe Senior Financial S30 5Yr Index CDS v.18(2023)	16.500.000	0	16.500.000			-217.269,36	-0,01
Société Générale S.A., Paris/Kering S.A. CDS v.18(2023)	3.500.000	0	3.500.000			-118.947,75	-0,01
Société Générale S.A., Paris/LafargeHolcim Ltd. CDS v.18(2023)	3.500.000	0	3.500.000			-32.295,62	0,00
Société Générale S.A., Paris/Linde Finance BV CDS v.18(2023)	3.500.000	0	3.500.000			-138.158,23	-0,01
Société Générale S.A., Paris/Pernod Ricard S.A. CDS v.18(2023)	3.500.000	0	3.500.000			-102.206,58	-0,01
Société Générale S.A., Paris/Prudential Plc. CDS v.18(2023)	3.500.000	0	3.500.000			-57.911,77	0,00
Société Générale S.A., Paris/Shell International Finance BV CDS v.18(2023)	3.500.000	0	3.500.000			-118.159,69	-0,01
Société Générale S.A., Paris/Siemens Finanzierungsmaatschappij NV CDS v.18(2023)	3.500.000	0	3.500.000			-125.156,54	-0,01
Société Générale S.A., Paris/SSE Plc. CDS v.18(2023)	3.500.000	0	3.500.000			-81.050,13	-0,01
Société Générale S.A., Paris/Wendel S.A. CDS v.18(2023)	3.500.000	0	3.500.000			-684.161,84	-0,05
						-5.186.484,76	-0,36

Gekauft

						-5.186.484,76	-0,36
--	--	--	--	--	--	----------------------	--------------

Verkauft

EUR

Société Générale S.A., Paris/iTraxx Europe S30 5Yr Index CDS v.18(2023)	0	69.000.000	-69.000.000			1.302.302,55	0,09
						1.302.302,55	0,09

Verkauft

Credit Default Swaps

						1.302.302,55	0,09
						-3.884.182,21	-0,27

Sonstige Finanzinstrumente

AUD

SWAP Australian Bank Bill Swap Rate 3 Monate (BBSW)/1.7300% 15.03.2023	0	129.750.000	-129.750.000			-2.743.703,42	-0,18
SWAP Australian Bank Bill Swap Rate 3 Monate (BBSW)/1.7300% 15.03.2023	129.750.000	0	129.750.000			2.442.462,05	0,16
SWAP 2.5900%/Australian Bank Bill Swap Rate 6 Monate (BBSW) 15.03.2029	0	56.250.000	-56.250.000			-3.800.170,90	-0,25
SWAP 2.5900%/Australian Bank Bill Swap Rate 6 Monate (BBSW) 15.03.2029	56.250.000	0	56.250.000			4.128.890,25	0,27
						27.477,98	0,00

EUR

SWAP EURIBOR (EUR) 6 Monate/0.1505% 08.03.2024	40.000.000	0	40.000.000			19.936,80	0,00
SWAP EURIBOR (EUR) 6 Monate/0.1505% 08.03.2024	0	40.000.000	-40.000.000			-299.669,60	-0,02
Total Return SWAP Strategie JPM Mergers & Acquisitions/Strategie JPM Mergers & Acquisitions 15.08.19	21.298.468	179.968	21.118.500			-105.978,34	-0,01
Total Return SWAP Strategie Goldman Sachs European Equity L/S/Strategie Goldman Sachs European Equity L/S 10.09.19	20.000.000	0	20.000.000			-14.800,00	0,00
Total Return SWAP Strategie JP Morgan Call Overwriting SX5E/Strategie JP Morgan Call Overwriting SX5E 14.02.20	17.012.968	0	17.012.968			-196.100,15	-0,01
Total Return SWAP Strategie JPM Europe Quality Index/Strategie JPM Europe Quality Index 15.11.19	36.218.126	0	36.218.126			-305.132,28	-0,02

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Berichtes.

UniAbsoluterErtrag

ISIN	Wertpapiere	Zugänge	Abgänge	Bestand	Kurs	Kurswert EUR	Anteil am Fonds- vermögen % 1)
EUR							
Total Return SWAP STRATEGIE JPM European Equity L/S/STRATEGIE JPM European Equity L/S 15.08.19		100.000.000	0	100.000.000		800.000,00	0,05
Total Return SWAP Strategie JPM Morgan Quant Style/Strategie JPM Morgan Quant Style 14.02.20		48.638.784	0	48.638.784		-925.140,31	-0,06
Total Return SWAP STRATEGIE JPM UI Dynamic Themes Index/STRATEGIE JPM UI Dynamic Themes Index 15.08.19		38.836.120	19.394.120	19.442.000		323.999,96	0,02
Total Return SWAP Strategie Morgan Stanley European Equities MS L/S 1/Strategie Morgan Stanley European Equities MS L/S		40.005.159	18.898	39.986.261		-219.990,41	-0,01
Total Return SWAP Strategie zu MSVOL FIXED INCOME BUND/Strategie zu MSVOL FIXED INCOME BUND 20.06.19		17.805.200	0	17.805.200		136.302,55	0,01
						-786.571,78	-0,05
JPY							
Total Return SWAP STRATEGIE JPM JAPAN LABOUR SHORTAGE/STRATEGIE JPM JAPAN LABOUR SHORTAGE 15.08.19		2.619.750.000	0	2.619.750.000		858.101,32	0,06
Total Return SWAP STRATEGIE MS Japan Buyback/STRATEGIE MS Japan Buyback 23.12.19		2.504.500.000	0	2.504.500.000		-103.842,78	0,00
						754.258,54	0,06
SEK							
SWAP 0.4725%/STIBOR (SEK) 3 Monate 08.03.2024		0	425.000.000	-425.000.000		-717.567,51	-0,05
SWAP 0.4725%/STIBOR (SEK) 3 Monate 08.03.2024		425.000.000	0	425.000.000		950.432,10	0,06
						232.864,59	0,01
USD							
Excess Return SWAP/Morgan Stanley Anti Radar ex Agriculture & Livestock ER Index 16.12.19		130.000.000	0	130.000.000		2.274.004,19	0,15
Excess Return SWAP/MS Radar ex Agri & Lvstk Finl Index 16.12.19		130.000.000	0	130.000.000		-2.012.090,14	-0,13
SWAP LIBOR (USD) 3 Monate/2.5640% 26.02.2024		0	96.000.000	-96.000.000		-10.184.332,77	-0,68
SWAP LIBOR (USD) 3 Monate/2.5640% 26.02.2024		96.000.000	0	96.000.000		9.077.812,84	0,60
SWAP LIBOR (USD) 3 Monate/2.8210% 11.02.2049		0	7.140.000	-7.140.000		-3.760.794,64	-0,25
SWAP LIBOR (USD) 3 Monate/2.8210% 11.02.2049		7.140.000	0	7.140.000		3.446.079,57	0,23
SWAP LIBOR (USD) 3 Monate/2.8284% 08.02.2049		0	7.100.000	-7.100.000		-3.748.822,52	-0,25
SWAP LIBOR (USD) 3 Monate/2.8284% 08.02.2049		7.100.000	0	7.100.000		3.426.359,95	0,23
SWAP LIBOR (USD) 3 Monate/2.8960% 06.03.2049		0	9.600.000	-9.600.000		-5.198.949,39	-0,35
SWAP LIBOR (USD) 3 Monate/2.8960% 06.03.2049		9.600.000	0	9.600.000		4.637.819,52	0,31
SWAP 2.6200%/LIBOR (USD) 3 Monate 26.02.2021		116.000.000	0	116.000.000		5.030.322,90	0,33
SWAP 2.6200%/LIBOR (USD) 3 Monate 26.02.2021		0	116.000.000	-116.000.000		-4.625.744,62	-0,31
SWAP 2.6900%/LIBOR (USD) 3 Monate 11.02.2029		16.900.000	0	16.900.000		3.566.719,93	0,24
SWAP 2.6900%/LIBOR (USD) 3 Monate 11.02.2029		0	16.900.000	-16.900.000		-3.193.364,06	-0,21
SWAP 2.6920%/LIBOR (USD) 3 Monate 26.02.2029		26.000.000	0	26.000.000		5.511.725,11	0,37
SWAP 2.6920%/LIBOR (USD) 3 Monate 26.02.2029		0	26.000.000	-26.000.000		-4.932.094,40	-0,33
SWAP 2.7034%/LIBOR (USD) 3 Monate 08.02.2029		0	16.800.000	-16.800.000		-3.172.252,41	-0,21
SWAP 2.7034%/LIBOR (USD) 3 Monate 08.02.2029		16.800.000	0	16.800.000		3.560.553,42	0,24
SWAP 2.7350%/LIBOR (USD) 3 Monate 06.03.2029		22.600.000	0	22.600.000		4.879.570,09	0,32
SWAP 2.7350%/LIBOR (USD) 3 Monate 06.03.2029		0	22.600.000	-22.600.000		-4.294.827,75	-0,29
Total Return SWAP DB SPX Intraday Curve/DB SPX Intraday Curve 13.12.19		22.305.220	0	22.305.220		-298.102,80	-0,02
Total Return SWAP Strategie JP Morgan EM Select/Strategie JP Morgan EM Select 14.02.20		59.471.634	0	59.471.634		-74.544,80	0,00
Total Return SWAP Strategie JPM Call Overwriting SPX/Strategie JPM Call Overwriting SPX 14.02.20		19.743.354	0	19.743.354		-8.503,70	0,00
Total Return SWAP STRATEGIE JPM Financial Leverage/STRATEGIE JPM Financial Leverage 14.02.20		38.888.203	19.687.938	19.200.265		871.911,28	0,06
Total Return SWAP STRATEGIE JPM FSI EM/STRATEGIE JPM FSI EM 15.08.19		50.365.000	0	50.365.000		405.222,69	0,03
Total Return SWAP STRATEGIE JPM HCT Cyber Security/STRATEGIE JPM HCT Cyber Security 15.11.19		38.090.319	19.614.719	18.475.600		774.388,30	0,05
Total Return SWAP Strategie JPM Healthcare IT/Strategie JPM Healthcare IT 15.08.19		35.225.520	1.407.120	33.818.400		-331.666,42	-0,02
Total Return SWAP Strategie JPM ItalyHygiene/Strategie JPM ItalyHygiene 15.08.19		24.660.000	0	24.660.000		666.451,05	0,04

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Berichtes.

UniAbsoluterErtrag

ISIN	Wertpapiere	Zugänge	Abgänge	Bestand	Kurs	Kurswert EUR	Anteil am Fonds- vermögen % 1)
Total Return SWAP Strategie JPM Northamerica Quality/Strategie JPM Northamerica Quality 15.11.19		41.598.960	20.266.160	21.332.800		128.251,80	0,01
Total Return SWAP Strategie JPM UI Dynamic Hedge Index/Strategie JPM UI Dynamic Hedge Index 15.08.19		47.936.592	3.830.992	44.105.600		-97.977,92	-0,01
Total Return SWAP Strategie MS Vol Fixed Income TY Index/Strategie MS Vol Fixed Income TY Index 20.06.19		20.201.600	0	20.201.600		36.297,56	0,00
Total Return SWAP STRATEGIE UBS Long/Short Commodities UAE/STRATEGIE UBS Long/Short Commodities UAE 20.12.19		24.999.350	0	24.999.350		456.800,50	0,03
Total Return SWAP STRATEGIE zu MS Rates Carry 10-2 ExtUni ex Italy Strategy /STRATEGIE zu MS Rates Carry 10-2 ExtUni ex		69.690.100	700.900	68.989.200		543.867,42	0,04
						3.360.089,78	0,22
Sonstige Finanzinstrumente						3.588.119,11	0,24
Bankguthaben - Kontokorrent						114.541.603,30	7,61
Sonstige Vermögensgegenstände/Sonstige Verbindlichkeiten						17.809.776,15	1,18
Fondsvermögen in EUR						1.504.294.360,94	100,00

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

Devisentermingeschäfte

Zum 31.03.2019 standen folgende offene Devisentermingeschäfte aus:

Währung	Währungsbetrag	Kurswert EUR	Anteil am Fonds- vermögen %
NOK/EUR Währungskäufe	157.089.526,40	16.238.358,86	1,08
EUR/NOK Währungsverkäufe	158.097.814,40	16.342.585,69	1,09

Bilaterale Devisentermingeschäfte

Zum 31.03.2019 standen folgende offene bilaterale Devisentermingeschäfte aus:

Währung	Währungsbetrag in Kaufwährung	Währungsbetrag in Verkaufswährung	Kurswert EUR	Anteil am Fonds- vermögen %
CAD/USD Bilaterale Währungsgeschäfte	52.000.000,00	39.186.525,87	34.686.367,45	2,31
JPY/NZD Bilaterale Währungsgeschäfte	2.019.512.177,00	27.000.000,00	16.268.376,71	1,08
NOK/NZD Bilaterale Währungsgeschäfte	507.217.307,18	86.495.207,24	52.478.998,52	3,49
NZD/JPY Bilaterale Währungsgeschäfte	27.000.000,00	2.045.139.300,00	16.391.615,18	1,09
NZD/NOK Bilaterale Währungsgeschäfte	86.500.000,00	503.891.962,85	52.545.716,95	3,49
USD/CAD Bilaterale Währungsgeschäfte	39.396.685,22	52.000.000,00	35.078.102,39	2,33

Bilaterale Devisentermingeschäfte mit Barausgleich

Zum 31.03.2019 standen folgende offene bilaterale Devisentermingeschäfte mit Barausgleich aus:

Währung	Währungsbetrag in Kaufwährung	Währungsbetrag in Verkaufswährung	Kurswert EUR	Anteil am Fonds- vermögen %
KRW/USD Bilaterale Währungsgeschäfte	59.530.130.000,00	53.000.000,00	46.741.937,72	3,11
USD/KRW Bilaterale Währungsgeschäfte	53.000.000,00	59.179.270.000,00	47.183.079,76	3,14

Devisenkurse

Für die Bewertung von Vermögenswerten in fremder Währung wurde zum nachstehenden Devisenkurs zum 31. März 2019 in Euro umgerechnet.

Ägyptisches Pfund	EGP	1	19,4003
Australischer Dollar	AUD	1	1,5802
Britisches Pfund	GBP	1	0,8614
Dänische Krone	DKK	1	7,4653
Hongkong Dollar	HKD	1	8,8129
Japanischer Yen	JPY	1	124,2492
Kanadischer Dollar	CAD	1	1,4997
Mexikanischer Peso	MXN	1	21,7751
Neuseeländischer Dollar	NZD	1	1,6457
Norwegische Krone	NOK	1	9,6680
Polnischer Zloty	PLN	1	4,3043
Schwedische Krone	SEK	1	10,4137
Schweizer Franken	CHF	1	1,1181
Singapur Dollar	SGD	1	1,5204
Südafrikanischer Rand	ZAR	1	16,1868
Südkoreanischer Won	KRW	1	1.274,2645
Tschechische Krone	CZK	1	25,8260
Ungarischer Forint	HUF	1	321,5500
US Amerikanischer Dollar	USD	1	1,1227

Zu- und Abgänge vom 1. April 2018 bis 31. März 2019

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

ISIN	Wertpapiere	Zugänge	Abgänge
------	-------------	---------	---------

Aktien, Anrechte und Genussscheine

Börsengehandelte Wertpapiere

Belgien

BE0974293251	Anheuser-Busch InBev S.A./NV	24.000	30.900
BE0974268972	bpost S.A.	112.000	132.000
BE0974320526	Umicore S.A.	23.000	23.000

Cayman Inseln

US01609W1027	Alibaba Group Holding Ltd. ADR	7.795	7.795
US0567521085	Baidu Inc. ADR	6.160	6.160
US47215P1066	JD.com Inc. ADR	43.102	43.102
US6475811070	New Oriental Education & Technical Group ADR	18.326	18.326
KYG875721634	Tencent Holdings Ltd.	30.249	30.249

Dänemark

DK0010244508	A P Moller-Maersk AS	400	400
DK0060946788	Ambu A/S	26.000	26.000
DK0060079531	DSV A/S	13.500	18.000

Deutschland

DE000A1EWWW0	adidas AG	12.000	12.000
DE000BASF111	BASF SE	51.500	51.500
DE000BAY0017	Bayer AG	12.000	12.000
DE0005190003	Bayerische Motoren Werke AG	10.400	10.400
DE0005200000	Beiersdorf AG	26.000	26.000
DE0005439004	Continental AG	5.500	7.700
DE0006062144	Covestro AG	17.200	17.200
DE0007100000	Daimler AG	31.500	31.500
DE0005140008	Dte. Bank AG	18.000	18.000
DE0008232125	Dte. Lufthansa AG	84.000	84.000
DE0005552004	Dte. Post AG	99.000	99.000
DE0005557508	Dte. Telekom AG	47.000	94.000
DE000DWS1007	DWS Group GmbH & Co. KGaA	4.000	4.000
DE0005773303	Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide	26.000	26.000
DE0005785604	Fresenius SE & Co. KGaA	9.000	9.000
DE0006020006	Gea Group AG	27.500	27.500

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Berichtes.

UniAbsoluterErtrag

ISIN	Wertpapiere	Zugänge	Abgänge
DE0006047004	HeidelbergCement AG	10.500	10.500
DE0006048432	Henkel AG & Co. KGaA -VZ-	11.000	17.000
DE000A1PHFF7	Hugo Boss AG	35.500	35.500
DE0006231004	Infineon Technologies AG	84.000	97.000
DE000A2AADD2	innogy SE	16.000	16.000
DE0005408884	Leoni AG	6.000	6.000
DE0006483001	Linde AG	4.500	4.500
DE000A2E4L75	Linde AG - Zum Umtausch eingereichte Aktien-	3.000	3.000
DE0005937007	MAN SE	4.000	4.000
DE0006599905	Merck KGaA	21.242	24.242
DE000A0D9PT0	MTU Aero Engines AG	2.400	2.400
DE000LED4000	OSRAM Licht AG	12.500	12.500
DE000PSM7770	ProSiebenSat.1 Media SE	12.300	21.300
DE0006969603	PUMA SE	21	21
DE0007164600	SAP SE	10.000	10.000
DE0007236101	Siemens AG	22.835	29.835
DE000SHL1006	Siemens Healthineers AG	14.000	14.000
DE0007500001	thyssenkrupp AG	48.000	48.000
DE0007472060	Wirecard AG	2.700	7.700
DE0005545503	1&1 Drillisch AG	12.000	12.000
Finnland			
FI0009013403	Kone Corporation (New)	17.500	17.500
FI0009005318	Nokian Renkaat OYJ	36.500	46.880
FI0009003727	Wartsila Corporation	88.000	88.000
Frankreich			
FR0000120404	Accor S.A.	14.000	14.000
FR0000125338	Capgemini S.A.	4.500	4.500
FR0000120172	Carrefour S.A.	92.000	92.000
FR0000121261	Cie Generale des Etablissements Michelin	1.500	7.000
FR0000125007	Compagnie de Saint-Gobain S.A.	39.500	39.500
FR0000130650	Dassault Systemes S.A.	6.832	11.332
FR0000121667	EssilorLuxottica S.A.	4.700	8.300
FR0000052292	Hermes International S.C.A.	2.700	2.700
FR0000121485	Kering S.A.	6.334	6.884
FR0010307819	Legrand S.A.	5.000	5.000
FR0000121014	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	8.250	11.069
FR0000130577	Publicis Groupe S.A.	0	4.500
FR0000131906	Renault S.A.	19.000	19.000
FR0000121972	Schneider Electric SE	34.500	34.500
FR0000125486	Vinci S.A.	15.800	15.800
Großbritannien			
GB0006731235	Associated British Foods Plc.	15.000	15.000
GB0002875804	British American Tobacco Plc.	27.000	27.000
GB0031743007	Burberry Group Plc.	85.500	85.500
GB00B07KD360	Cobham Plc.	50.000	50.000
GB00B7KR2P84	EASYJET Plc.	18.000	18.000
GB0033195214	Kingfisher Plc.	300.000	300.000
GB0032089863	Next Group Plc.	6.500	6.500
GB00B24CGK77	Reckitt Benckiser Group Plc.	10.000	10.000
GB00BDVZY277	Royal Mail Plc.	50.000	50.000
GB0008847096	Tesco Plc.	665.000	665.000
GB00B10RZP78	Unilever Plc.	16.000	16.000
GB00BH4HKS39	Vodafone Group Plc.	1.298.905	1.298.905
Hongkong			
HK0000069689	AIA Group Ltd	163.869	163.869
Irland			
IE0001827041	CRH Plc.	53.000	53.000
IE0001827041	CRH Plc.	31.630	31.630
IE00BYTBXV33	Ryanair Holdings Plc.	178.474	193.474

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Berichtes.

UniAbsoluterErtrag

ISIN	Wertpapiere	Zugänge	Abgänge
Italien			
IT0003506190	Atlantia S.p.A.	38.000	38.000
IT0001347308	Buzzi Unicem S.p.A.	83.667	94.390
IT0003856405	Leonardo S.p.A.	65.000	65.000
IT0004965148	Moncler S.p.A.	48.500	63.000
IT0004712375	Salvatore Ferragamo S.p.A.	55.000	55.000
IT0005162406	Technogym S.p.A.	47.000	47.000
IT0003497168	Telecom Italia S.p.A.	2.050.000	2.050.000
IT0003497176	Telecom Italia S.p.A. -VZ-	1.950.000	1.950.000
Jersey			
JE00B8KF9B49	WPP Plc.	78.500	78.500
Niederlande			
NL0012969182	Adyen N.V.	30	30
NL0000235190	Airbus SE	8.500	11.000
NL0010273215	ASML Holding NV	2.000	2.000
NL0010877643	Fiat Chrysler Automobiles NV	13.000	13.000
NL0011794037	Koninklijke Ahold Delhaize NV	64.000	64.000
NL0000009538	Koninklijke Philips NV	16.000	16.000
NL0011821392	Signify N.V.	10.000	10.000
NL0000009355	Unilever NV	24.000	24.000
Österreich			
AT0000APOST4	Österreichische Post AG	7.000	7.000
Portugal			
PTCTT0AM0001	CTT-Correios de Portugal S.A.	223.000	323.000
Schweden			
SE0011337708	AAK AB	26.000	26.000
SE0011166610	Atlas Copco AB	83.000	83.000
SE0006886750	Atlas Copco AB	24.000	24.000
SE0011166636	Atlas Copco AB -Redemption shares-	24.000	24.000
SE0011166933	Epiroc AB	22.000	22.000
SE0000106270	Hennes & Mauritz AB	22.000	22.000
SE0000667891	Sandvik AB	50.000	50.000
SE0000108227	SKF AB -B-	25.000	25.000
SE0000115446	Volvo AB	32.000	32.000
Schweiz			
CH0012221716	ABB Ltd.	57.000	57.000
CH0210483332	Cie Financière Richemont AG	15.400	15.400
CH0012142631	Clariant AG	118.025	138.025
CH0319416936	Flughafen Zürich AG	3.100	3.100
CH0102659627	GAM Holding AG	75.500	75.500
CH0030170408	Geberit AG	4.219	4.719
CH0010645932	Givaudan S.A.	570	570
CH0025238863	Kühne + Nagel International AG	4.000	4.000
CH0012214059	LafargeHolcim Ltd.	17.000	17.000
CH0038863350	Nestle S.A.	28.500	28.500
CH0002168083	Panalpina Welttransport Holding AG	5.000	9.000
CH0012032113	Roche Holding AG	1.588	1.588
CH0012032048	Roche Holding AG Genussscheine	4.000	4.000
CH0418792922	Sika AG	9.500	9.500
CH0000587979	Sika AG	30	30
CH0012255151	Swatch Group	750	1.250
CH0012255144	Swatch Group AG	0	3.500
CH0012453913	Temenos AG	6.769	8.469
Spanien			
ES0109067019	Amadeus IT Group S.A.	5.000	5.000
ES0148396007	Industria de Diseño Textil S.A.	4.000	24.000
ES0177542018	International Consolidated Airlines Group S.A.	38.000	38.000
ES0177542018	International Consolidated Airlines Group S.A.	15.000	15.000
ES0178430E18	Telefonica S.A.	45.000	95.000

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Berichtes.

UniAbsoluterErtrag

ISIN	Wertpapiere	Zugänge	Abgänge
Vereinigte Staaten von Amerika			
US88160R1014	Tesla Inc.	2.700	2.700
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere			
Dänemark			
DK0060228559	TDC AS	0	35.000
Großbritannien			
GB00B1WY2338	Smiths Group Plc.	15.000	15.000
Anleihen			
Börsengehandelte Wertpapiere			
EGP			
EGT9980F1J14	0,000 % Ägypten v.18(2019)	265.000.000	265.000.000
EUR			
XS1807305328	5,625 % Ägypten Reg.S. v.18(2030)	400.000	400.000
XS1748389688	2,500 % Chengdu Xingcheng Investment Group Co. Ltd. v.18(2021)	0	100.000
XS0954025267	2,250 % GE Capital European Funding Unlimited Co. EMTN v.13(2020)	1.500.000	1.500.000
GR0114030555	3,500 % Griechenland v.17(2023)	0	10.000.000
XS1824424706	0,000 % Petróleos Mexicanos v.18(2029)	200.000	200.000
XS1810963147	1,375 % State Grid Overseas Investment (2016) Reg.S. v.18(2025)	300.000	300.000
USD			
XS1808738212	4,875 % Abu Dhabi National Energy Co. Reg.S. v.18(2030)	300.000	300.000
XS1772360803	6,797 % Akbank T.A.S. Reg.S. Fix-to-Float v.18(2028)	0	200.000
US01609WAV46	4,200 % Alibaba Group Holding Ltd. v.17(2047)	0	200.000
US03512TAB70	6,500 % AngloGold Ashanti Holdings Plc. v.10(2040)	0	500.000
XS1719264324	9,750 % Anton Oilfield Services Group/Hong Kong v.17(2020)	0	400.000
XS1627599654	8,750 % China Evergrande Group Reg.S. v.17(2025)	0	400.000
XS1956103805	3,516 % Emirates Development Bank PJSC v.19(2024)	8.100.000	8.100.000
US302154CU14	3,075 % Export-Import Bank of Korea FRN v.18(2023)	300.000	300.000
XS1756563919	7,250 % Fantasia Holdings Group Co. Ltd. v.18(2019)	0	400.000
XS1810806395	6,250 % Firstrand Ltd. Fix-to-Float v.18(2028)	300.000	300.000
USY39694AA51	5,875 % Indika Energy Capital III Pte. Ltd. Reg.S. v.17(2024)	0	200.000
USN4717BAD84	6,500 % Jababeka International BV Reg.S. v.16(2023)	0	200.000
XS1807299331	6,375 % KazMunaiGaz Finance Sub B.V. Reg.S. v.18(2048)	200.000	200.000
USY59505AA82	6,750 % Medco Platinum Road Pte. Ltd. Reg.S. v.18(2025)	0	200.000
US67778NAA63	7,500 % Oil & Gas Holding Company B.S.C. Reg.S. v.17(2027)	0	200.000
XS1750114396	6,750 % Oman Reg.S. v.18(2048)	0	200.000
XS1805474951	5,625 % Oztel Holdings SPC Ltd. Reg.S. v.18(2023)	200.000	200.000
XS1805359939	6,950 % Powerlong Real Estate Holdings Ltd. v.18(2021)	500.000	500.000
XS1791939736	5,000 % Saudi Arabien Reg.S. v.18(2049)	500.000	500.000
XS1759179002	5,200 % Shimao Property Holdings Ltd. v.18(2025)	0	300.000
XS1809230474	7,350 % Sunac China Holdings Ltd. v.18(2021)	300.000	300.000
XS1748392559	3,750 % Sunny Optical Technology Group Co. Ltd. v.18(2023)	0	200.000
US88032XAG97	3,595 % Tencent Holdings Ltd. Reg.S. v.18(2028)	300.000	300.000
XS1698689301	5,250 % Trillion Chance Ltd. v.17(2018)	0	200.000
XS1803215869	5,800 % Turkcell İletişim Hizmetleri AS Reg.S. v.18(2028)	300.000	300.000
XS1750996206	5,500 % Türkiye Sınai Kalkınma Bankası AS EMTN v.18(2023)	0	200.000
XS1823770828	3,880 % Vanke Real Estate (Hong Kong Branch) Co. Ltd. FRN EMTN v.18(2023)	200.000	200.000
USG9328DAP53	6,125 % Vedanta Resources Plc. Reg.S. v.17(2024)	0	200.000
US912796QP72	0,000 % Vereinigte Staaten von Amerika v.18(2018)	100.000.000	100.000.000
US912796UG28	0,000 % Vereinigte Staaten von Amerika v.18(2019)	115.000.000	115.000.000
US912796QW24	0,000 % Vereinigte Staaten von Amerika v.18(2019)	100.000.000	100.000.000
US912796UQ00	0,000 % Vereinigte Staaten von Amerika v.19(2019)	120.000.000	120.000.000
US912796RB77	0,000 % Vereinigte Staaten von Amerika v.19(2019)	85.000.000	85.000.000
XS0889401724	5,950 % VimpelCom Holdings BV Reg.S. v.13(2023)	200.000	200.000
XS1728036952	4,750 % Yankuang Group (Cayman) Ltd. Reg.S. v.17(2020)	200.000	200.000
XS1734639799	4,750 % Yankuang Group (Cayman) Ltd. v.17(2020)	0	200.000
XS1788516679	6,100 % Yapi Ve Kredi Bankası AS Reg.S. v.18(2023)	0	300.000
XS1619839779	7,375 % Zenith Bank Plc. Reg.S. v.17(2022)	0	200.000

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Berichtes.

ISIN	Wertpapiere	Zugänge	Abgänge
Neuemissionen, die zum Börsenhandel vorgesehen sind			
EUR			
GR0114031561	3,450 % Griechenland v.19(2024)	10.300.000	10.300.000
XS1955169104	1,000 % LeasePlan Corporation NV EMTN v.19(2022)	3.600.000	3.600.000
FR0013405032	1,000 % Unibail-Rodamco SE EMTN v.19(2027)	4.600.000	4.600.000
USD			
XS1958533470	0,000 % ICBCIL Finance Co. Ltd. EMTN v.19(2022)	11.900.000	11.900.000
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere			
EUR			
XS1242327168	2,750 % BRF S.A. Reg.S. v.15(2022)	0	200.000
XS1679505070	1,625 % Rail Transit International Development Co. Ltd. Greenbond v.18(2022)	0	200.000
USD			
USL0178WAG70	7,500 % Altice Financing S.A. Reg.S. v.16(2026)	0	400.000
USP20058AC08	6,875 % Capex S.A. Reg.S. v.17(2024)	0	200.000
USC3535CAJ74	6,875 % First Quantum Minerals Ltd. Reg.S. v.18(2026)	0	200.000
USG38327AA30	6,500 % GeoPark Ltd. Reg.S. v.17(2024)	0	200.000
US44891CAV54	3,261 % Hyundai Capital America FRN Reg.S. v.18(2021)	100.000	100.000
USP5R6DPAA84	6,125 % Itau Unibanco Holding (Cayman Islands Branch) S.A. Reg.S. Fix-to-Float Perp.	0	200.000
USP5R6DPAB67	6,500 % Itau Unibanco Holding (Cayman Islands Branch) S.A. Reg.S. Perp.	0	300.000
XS1533923238	8,750 % Kernel Holding S.A. Reg.S. v.17(2022)	0	400.000
USG5825AAB82	6,875 % MARB BondCo Plc. Reg.S. v.18(2025)	0	200.000
XS1713469911	6,950 % MHP Lux S.A. Reg.S. v.18(2026)	0	400.000
USL6366MAC75	8,250 % MHP S.A. Reg.S. v.13(2020)	0	200.000
XS1577965004	7,750 % MHP SE Reg.S. v.17(2024)	0	200.000
USL6388GAB60	5,125 % Millicom International Cellular S.A. Reg.S. v.17(2028)	0	300.000
USN6945AAK36	5,999 % Petrobras Global Finance BV Reg.S. v.17(2028)	0	200.000
USL79090AA13	7,375 % Rumo Luxembourg Sàrl Reg.S. v.17(2024)	200.000	200.000
XS1759468967	4,850 % Rusal Capital D.A.C. Reg.S. v.18(2023)	0	200.000
USA8372TAC20	7,000 % Suzano Austria GmbH Reg.S. v.17(2047)	200.000	200.000
USG91237AA87	7,000 % Tullow Oil Plc. Reg.S. v.18(2025)	0	400.000
USP94461AE36	7,375 % Unifin Financiera, S.A.B. de C.V., SOFOM, E.N.R. Reg.S. v.18(2026)	200.000	400.000
USG9844KAC39	6,250 % Yingde Gases Investment Ltd. Reg.S. v.18(2023)	0	200.000
USP989MJBNO3	7,000 % YPF S.A. Reg.S. v.17(2047)	200.000	400.000
Neuemissionen, die zum Handel an einem organisierten Markt vorgesehen sind			
EUR			
XS1956955980	0,625 % Coöperatieve Rabobank U.A.EMTN v.19(2024)	7.000.000	7.000.000
Nicht notierte Wertpapiere			
EGP			
EGT9980B9I16	0,000 % Ägypten v.17(2018)	0	235.000.000
USD			
XS1788498167	6,375 % Yuzhou Properties Co. Ltd. v.18(2021)	0	400.000
Credit Linked Notes			
Börsengehandelte Wertpapiere			
USD			
XS0805570354	4,950 % Gaz Capital S.A./Gazprom OAO CLN/LPN v.12(2022)	300.000	300.000
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere			
USD			
XS1772800204	5,075 % DME Airport DAC Ltd. LPN v.18(2023)	0	200.000

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Berichtes.

ISIN	Wertpapiere	Zugänge	Abgänge
Optionsscheine			
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere			
Deutschland			
CWN5647P3137	Merrill Lynch International & Co./MSCI Saudi Arabia Index (USD) WTS v.16(2019)	25.500	25.500
Investmentfondsanteile ¹⁾			
Deutschland			
DE0008490988	DWS Inter Genuss	0	284.032
DE000A1C81J5	UnilInstitutional Euro Reserve Plus	500.000	722.319
Frankreich			
FR0007078811	METROPOLE Funds SICAV - Metropole Selection	0	25.915
Großbritannien			
IE00BLD2FW69	Coupland Cardiff Funds Plc. - CC Japan Alpha Fund	1.698.915	1.698.915
IE0032904330	J O Hambro Capital Management Umbrella Fund Plc. - Euro A Shs Fund	0	13.744.537
IE00B7FN4C24	Neuberger Berman Short Duration High Yield Bond Fund	0	1.275.000
Irland			
IE00B762GJ90	BNY Mellon Global Funds PLC - Emerging Markets Debt Fund	0	53.244
IE00BX906V41	FundLogic Alternatives Plc. - IPM Systematic Macro UCITS Fund	0	9.355
IE00B50JD354	GAM Star Plc. - Credit Opportunities Fund	0	1.750.000
IE00B85RQ587	Muzinich Funds - Long Short Credit Yield	0	177.417
IE00BYQDQ804	Old Mutual Absolute Return Government Bond Fund	0	1.956.600
IE00B6VHBN16	PIMCO Funds Global Investors Series Plc. - Capital Securities Fund	0	3.272.461
IE00B80G9288	PIMCO Funds Global Investors Series Plc. - Income Fund	0	2.506.417
IE0003895277	PineBridge Asia ex Japan Small Cap Equity Fund	0	24.640
Luxemburg			
LU0476877054	Aberdeen Standard SICAV I - Japanese Smaller Companies Fund	250.000	1.499.874
LU1744899805	Amundi Funds II - European Equity Value J	16.087	16.087
LU0313648254	Amundi Funds II-European Equity Value	0	8.242
LU0493865678	Ashmore SICAV - Emerging Markets Local Currency Bond Fund	0	283.506
LU188167505	AXA IM FIIS - US Short Duration High Yield	0	70.000
LU0893376748	Cigogne UCITS - M&A Arbitrage	0	25.304
LU1572743505	DB Platinum Midocean Absolute Return Credit	0	2.000
LU0650958159	Fidelity Active Strategy - Emerging Markets Fund	0	387.680
LU0248049412	JPMorgan Funds - Europe Strategic Value Fund	0	144.942
LU0406668342	JPMorgan Funds - Systematic Alpha	0	112.627
LU0189453631	Julius Bär Multibond - ABS Fund	0	196.952
LU0522256634	Jupiter JGF - Global Convertibles	0	777.967
LU0394778749	LO Funds - Convertible Bond Asia USD	0	786.800
LU0834815101	LRI OptoFlex	7.000	48.318
LU0489687755	Mandarine Funds - Mandarine Unique Small & Mid Caps Europe	0	230
LU1067856788	Most Diversified Portfolio SICAV - TOBAM Anti-Benchmark US Equity Fund A1	0	1.731
LU0772928023	Nordea 1 SICAV - Emerging Market Bond Fund	103.640	103.640
LU0194438841	Parvest - Japan Small Cap	0	330.249
LU0823411292	Parvest Equity USA Small Cap	0	93.895
LU0273643493	RWC Funds SICAV - RWC Global Convertibles Fund	0	6.781
LU1125543352	Serviced Platform SICAV - MSK Equity UCITS Fund	0	101.293
LU0765416804	SKY Harbor Global Funds - US Short Duration High Yield Fund	0	103.242
LU0090772608	UniEuropa Mid&Small Caps	0	649.930
LU0006041197	UniFavorit: Renten	0	2.734.640
LU1088284630	UnilInstitutional CoCo Bonds	0	48.511
LU1545615871	UnilInstitutional EM Corporate Bonds Flexible	0	25.000
LU1589413688	UnilInstitutional EM High Yield Bonds	0	25.000
LU0482734919	UnilInstitutional EM Sovereign Bonds	0	112.078
LU0315299569	UnilInstitutional Global Convertibles	0	45.000
LU0247467987	UniReserve: Euro-Corporates	0	133.418
LU1577341644	Wellington Global Thematic Market Neutral Fund	0	510.000
Vereinigte Staaten von Amerika			
IE0031574977	Brandes Investment Funds PLC - Brandes European Value Fund	0	435.991

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Berichtes.

ISIN	Wertpapiere	Zugänge	Abgänge
Zertifikate			
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere			
Europäische Gemeinschaft			
DE000CS8B776	Credit Suisse [London Branch]/EURO STOXX 50 Index Zertifikat v. 18(2019)	4.500	4.500
DE000DDF52H8	DZ Bank AG Frankfurt am Main/Euro Stoxx 50 Zert. v. 18(2019)	580.000	580.000
DE000DD2JTX0	DZ Bank AG/Euro Stoxx 50 Index Zert. v. 17(2019)	315.000	630.000
DE000DD4VNX4	DZ BANK AG/Euro Stoxx 50 Index Zert. v. 18(2019)	580.000	580.000
Frankreich			
XS1673285638	BNP Paribas Arbitrage Issuance BV/BNP Paribas Strategy 3YCL Index Zert. v. 17(2020)	102	217
Optionen			
EUR			
Call on Bayer AG November 2018/76,00		20	20
Call on Continental AG Oktober 2018/155,00		20	20
Call on EUR/CHF Dezember 2018/1,145		50.000.000	50.000.000
Call on EUR/CHF Dezember 2018/1,17		66.000.000	66.000.000
Call on EUR/CHF Dezember 2018/1,175		50.000.000	50.000.000
Call on EUR/CHF Dezember 2018/1,20		66.000.000	66.000.000
Call on EUR/JPY Mai 2018/140,00		40.000.000	0
Call on Euro Bund 10 Year Future Juni 2018/160,50		2.800	2.800
Call on Euro Stoxx 50 Price Index Dezember 2018/3.400,00		2.000	2.000
Call on Euro Stoxx 50 Price Index Dezember 2018/3.475,00		2.000	2.000
Call on Euro Stoxx 50 Price Index Dezember 2018/3.625,00		20.000	20.000
Call on Euro Stoxx 50 Price Index Dezember 2018/3.700,00		16.000	16.000
Call on Euro Stoxx 50 Price Index Juni 2018/3.450,00		0	1.000
Call on Euro Stoxx 50 Price Index März 2019/3.350,00		2.100	2.100
Call on Euro Stoxx 50 Price Index November 2018/3.300,00		1.000	1.000
Call on Euro Stoxx 50 Price Index November 2018/3.325,00		1.000	1.000
Call on Euro Stoxx 50 Price Index Oktober 2018/3.500,00		2.900	2.900
Call on Euro Stoxx 50 Price Index September 2018/3.475,00		3.000	3.000
Call on Euro Stoxx 50 Price Index September 2018/3.600,00		6.000	6.000
Call on EUX 10YR Euro-Bund Future August 2018/163,50		740	740
Call on EUX 10YR Euro-Bund Future Februar 2019/166,50		1.300	1.300
Call on EUX 10YR Euro-Bund Future Februar 2019/168,00		1.300	1.300
Call on EUX 10YR Euro-Bund Future Juli 2018/163,00		600	600
Call on EUX 10YR Euro-Bund Future März 2019/165,00		1.350	1.350
Call on EUX 10YR Euro-Bund Future März 2019/166,00		1.350	1.350
Call on EUX 10YR Euro-Bund Future November 2018/161,50		330	330
Call on EUX 10YR Euro-Bund Future November 2018/162,00		1.300	1.300
Call on EUX 10YR Euro-Bund Future Oktober 2018/160,50		690	690
Call on EUX 10YR Euro-Bund Future September 2018/162,50		740	740
Call on Stoxx 600 Banks Index November 2018/162,50		600	600
Call on thyssenkrupp AG Februar 2019/17,00		100	100
Call on thyssenkrupp AG Februar 2019/17,50		350	350
Call on thyssenkrupp AG Februar 2019/19,00		250	250
Call on thyssenkrupp AG Oktober 2018/21,00		100	100
Call on thyssenkrupp AG September 2018/21,00		110	110
Call on thyssenkrupp AG September 2018/22,00		150	150
Call on 3MO Euribor Future März 2019/100,375		4.000	0
Call on 3MO Euribor Future März 2019/100,500		0	4.000
J.P. Morgan Securities Plc., London/iTraxx Europe Senior Financial S30 5Yr Index CDS November 2018/0,700		75.000.000	75.000.000
Put on Bayer AG Oktober 2018/64,00		25	25
Put on Continental AG Oktober 2018/145,00		25	25
Put on Dte. Bank AG August 2018/9,00		250	250
Put on Dte. Bank AG August 2018/9,50		400	400
Put on Dte. Bank AG, London (Morgan Grenfell) AG/iTraxx Europe S29 5Yr Index CDS Dezember 2018/0,650		53.600.000	53.600.000
Put on Dte. Bank AG, London (Morgan Grenfell) AG/iTraxx Europe S29 5Yr Index CDS Dezember 2018/0,800		53.600.000	53.600.000
Put on Dte. Börse AG Juni 2018/100,00		10	10
Put on Euribor 3M Mid-curve Future Juni 2018/100,000		0	2.000
Put on Euribor 3M Mid-curve Future Juni 2018/99,750		2.000	0
Put on EUR/JPY Mai 2018/120,00		40.000.000	0
Put on EUR/JPY Mai 2018/128,00		0	40.000.000

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Berichtes.

UniAbsoluterErtrag

ISIN	Wertpapiere	Zugänge	Abgänge
Put on Euro Stoxx 50 Price Index April 2019/3.150,00		2.000	2.000
Put on Euro Stoxx 50 Price Index August 2018/3.000,00		100	100
Put on Euro Stoxx 50 Price Index Dezember 2018/3.000,00		1.500	1.500
Put on Euro Stoxx 50 Price Index Dezember 2018/3.300,00		1.500	1.500
Put on Euro Stoxx 50 Price Index Dezember 2020/1.500,00		1.000	1.000
Put on Euro Stoxx 50 Price Index Dezember 2020/2.000,00		1.600	1.600
Put on Euro Stoxx 50 Price Index Dezember 2020/2.250,00		2.740	2.740
Put on Euro Stoxx 50 Price Index Dezember 2020/2.500,00		3.030	3.030
Put on Euro Stoxx 50 Price Index Dezember 2020/2.750,00		2.410	2.410
Put on Euro Stoxx 50 Price Index Dezember 2020/3.000,00		1.520	1.520
Put on Euro Stoxx 50 Price Index Dezember 2020/3.250,00		1.000	1.000
Put on Euro Stoxx 50 Price Index Dezember 2020/3.500,00		320	320
Put on Euro Stoxx 50 Price Index Dezember 2020/3.750,00		180	180
Put on Euro Stoxx 50 Price Index Dezember 2020/4.000,00		110	110
Put on Euro Stoxx 50 Price Index Dezember 2021/2.500,00		14.210	14.210
Put on Euro Stoxx 50 Price Index Juli 2018/3.000,00		10	10
Put on Euro Stoxx 50 Price Index Juni 2018/3.000,00		800	0
Put on Euro Stoxx 50 Price Index Juni 2018/3.100,00		1.000	0
Put on Euro Stoxx 50 Price Index März 2019/3.100,00		2.200	2.200
Put on Euro Stoxx 50 Price Index März 2019/3.125,00		10.000	10.000
Put on Euro Stoxx 50 Price Index März 2019/3.175,00		10.000	10.000
Put on Euro Stoxx 50 Price Index September 2018/3.125,00		25	25
Put on EUR/USD Dezember 2018/1,1400		30.000.000	30.000.000
Put on EUR/USD Januar 2019/1,1300		30.000.000	30.000.000
Put on EUR/USD Januar 2019/1,1300		30.000.000	30.000.000
Put on EUR/USD Oktober 2018/1,2376		100.000.000	100.000.000
Put on EUR/USD Oktober 2018/1,2554		100.000.000	100.000.000
Put on EUX 10YR Euro-Bund Future August 2018/161,50		740	740
Put on EUX 10YR Euro-Bund Future Juli 2018/157,00		600	600
Put on EUX 10YR Euro-Bund Future Juli 2018/157,50		1.200	1.200
Put on EUX 10YR Euro-Bund Future März 2019/160,00		1.350	1.350
Put on EUX 10YR Euro-Bund Future März 2019/160,50		1.350	1.350
Put on EUX 10YR Euro-Bund Future November 2018/158,00		330	330
Put on EUX 10YR Euro-Bund Future Oktober 2018/156,50		690	690
Put on EUX 10YR Euro-Bund Future September 2018/158,50		740	740
Put on EUX 5YR Euro-Bobl Future August 2018/131,00		2.000	2.000
Put on EUX 5YR Euro-Bobl Future Juli 2018/131,50		1.200	1.200
Put on EUX 5YR Euro-Bobl Future November 2018/130,25		900	900
Put on EUX 5YR Euro-Bobl Future Oktober 2018/130,50		1.700	1.700
Put on Gea Group AG Juli 2018/30,00		150	150
Put on Goldman Sachs International, London/iTraxx Europe Senior Financial S29 5Yr Index CDS Juni 2018/0,675		75.000.000	75.000.000
Put on J.P. Morgan Securities Plc., London/iTraxx Europe Crossover S29 5Yr Index CDS Dezember 2018/2,875		36.800.000	36.800.000
Put on J.P. Morgan Securities Plc., London/iTraxx Europe Crossover S29 5Yr Index CDS Dezember 2018/3,250		36.800.000	36.800.000
Put on Unilever NV August 2018/47,00		150	150
Put on Unilever NV August 2018/49,00		100	100
Put on 3MO Euribor Future März 2019/100,000		0	4.000
Put on 3MO Euribor Future März 2019/99,750		4.000	0
GBP			
Call on GBP/USD Dezember 2018/1,33		62.000.000	62.000.000
Call on GBP/USD Dezember 2018/1,38		62.000.000	62.000.000
Call on GBP/USD November 2018/1,35		30.000.000	30.000.000
Call on GBP/USD November 2018/1,40		30.000.000	30.000.000
Call on Royal Mail Plc. Juni 2018/5,80		110	110
Call on 3MO Libor Currency Future Juni 2018/99,375		0	7.000
Call on 3MO Libor Currency Future Juni 2018/99,500		14.000	0
Call on 3MO Libor Currency Future Juni 2018/99,625		0	7.000
Put on GBP/JPY April 2019/135,000		42.000.000	42.000.000
Put on GBP/JPY April 2019/140,000		42.000.000	42.000.000
Put on GBP/JPY Dezember 2018/138,5		52.000.000	52.000.000
Put on GBP/JPY Dezember 2018/143,5		52.000.000	52.000.000
Put on GBP/JPY Februar 2019/133,000		52.000.000	52.000.000
Put on GBP/JPY Februar 2019/138,000		52.000.000	52.000.000
Put on LIFFE Libor 3M Sterling Mid-curve Future September 2018/98,375		4.000	4.000
Put on LIFFE Libor 3M Sterling Mid-curve Future September 2018/98,500		8.000	8.000

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Berichtes.

ISIN	Wertpapiere	Zugänge	Abgänge
	Put on LIFFE Libor 3M Sterling Mid-curve Future September 2018/98,750	4.000	4.000
	Put on Royal Mail Plc. Juni 2018/6,10	20	20
HKD			
	Call on Hang Seng China Enterprises Index Dezember 2018/11.000,00	400	400
	Call on Hang Seng China Enterprises Index Dezember 2018/12.200,00	2.400	2.400
	Put on Hang Seng China Enterprises Index Dezember 2018/10.500,00	400	400
JPY			
	Call on JPY/KRW Januar 2019/10,60	3.375.000.000	3.375.000.000
	Call on Nikkei 225 Stock Average Index (JPY) Dezember 2018/22.500,00	130	130
	Call on Nikkei 225 Stock Average Index (JPY) Dezember 2018/24.000,00	130	130
	Call on Nikkei 225 Stock Average Index (JPY) Juni 2018/23.500,00	0	300
	Put on JPY/KRW Januar 2019/9,45	3.375.000.000	3.375.000.000
	Put on Nikkei 225 Stock Average Index (JPY) Dezember 2018/20.000,00	130	130
	Put on Nikkei 225 Stock Average Index (JPY) Juni 2018/21.750,00	300	0
	Putl on JPY/KRW Januar 2019/9,80	3.375.000.000	3.375.000.000
SEK			
	Call on Hennes & Mauritz AB Juli 2018/150,00	50	50
	Put on Hennes & Mauritz AB Juni 2018/120,00	250	250
USD			
	Call on CBT 10YR US T-Bond Note Future August 2018/120,50	1.340	1.340
	Call on CBT 10YR US T-Bond Note Future August 2018/121,50	2.500	2.500
	Call on CBT 10YR US T-Bond Note Future Juli 2018/121,00	2.500	2.500
	Call on CBT 10YR US T-Bond Note Future November 2018/119,50	890	890
	Call on CBT 10YR US T-Bond Note Future Oktober 2018/120,00	1.500	1.500
	Call on CBT 10YR US T-Bond Note Future Oktober 2018/122,00	3.000	3.000
	Call on CBT 10YR US T-Bond Note Future September 2018/121,50	1.500	1.500
	Call on Chicago Board Options Exchange SPX Volatility Index Oktober 2018/25,00	2.250	2.250
	Call on CME 3MO Euro-Dollar Future März 2019 Februar 2019/97,125	6.000	6.000
	Call on CME 3MO Euro-Dollar Future März 2019 Februar 2019/97,25	12.000	12.000
	Call on CME 3MO Euro-Dollar Future März 2019 Februar 2019/97,375	6.000	6.000
	Call on S&P 500 Index Februar 2019/2.680,00	225	225
	Call on S&P 500 Index Februar 2019/2.720,00	1.225	1.225
	Call on S&P 500 Index Februar 2019/2.740,00	1.225	1.225
	Call on USD/MXN Dezember 2018/20,25	25.000.000	25.000.000
	Call on USD/MXN Dezember 2018/21,25	25.000.000	25.000.000
	Call on 3MO Eurodollar Future Juni 2019/97,875	3.000	0
	Call on 3MO Eurodollar Future Juni 2019/98,125	0	3.000
	Call on 3MO Eurodollar Future März 2019/98,000	3.000	0
	Call on 3MO Eurodollar Future März 2019/98,125	0	3.000
	Call on 3MO Euro-Dollar Future November 2018/97,50	6.000	6.000
	Call on 3MO Euro-Dollar Future November 2018/97,625	6.000	6.000
	Call on 3MO Euro-Dollar Future Oktober 2018/97,50	6.000	6.000
	Call on 3MO Euro-Dollar Future Oktober 2018/97,625	6.000	6.000
	Call on 5YR Treasury 6% Future April 2018/114,25	1.850	0
	Call on 5YR Treasury 6% Future August 2018/114,25	2.000	2.000
	Put on CBT 10YR US T-Bond Note Future April 2019/120,00	450	450
	Put on CBT 10YR US T-Bond Note Future April 2019/120,50	450	450
	Put on CBT 10YR US T-Bond Note Future August 2018/118,00	2.500	2.500
	Put on CBT 10YR US T-Bond Note Future August 2018/119,00	1.340	1.340
	Put on CBT 10YR US T-Bond Note Future Juli 2018/118,50	2.500	2.500
	Put on CBT 10YR US T-Bond Note Future November 2018/117,00	890	890
	Put on CBT 10YR US T-Bond Note Future Oktober 2018/117,00	1.500	1.500
	Put on CBT 10YR US T-Bond Note Future Oktober 2018/118,00	3.000	3.000
	Put on CBT 10YR US T-Bond Note Future September 2018/119,50	1.500	1.500
	Put on Eurodollar Mid-curve Future Juni 2018/96,75	3.000	0
	Put on Eurodollar Mid-curve Future Juni 2018/97,00	0	3.000
	Put on S&P 500 Index März 2019/2.400,00	400	400
	Put on S&P 500 Index März 2019/2.550,00	400	400
	Put on S&P 500 Index März 2019/2.600,00	500	500
	Put on S&P 500 Index März 2019/2.700,00	250	250
	Put on S&P 500 Index März 2019/2.900,00	125	125
	Put on USD/TRY November 2018/4,30	17.500.000	17.500.000

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Berichtes.

ISIN	Wertpapiere	Zugänge	Abgänge
	Put on USD/TRY November 2018/4,599	17.500.000	17.500.000
	Put on 3MO Eurodollar Future März 2019/97,000	3.000	0
	Put on 3MO Eurodollar Future März 2019/97,250	0	3.000
	Put on 3MO Eurodollar Future September 2019/96,375	4.000	4.000
	Put on 3MO Eurodollar Future September 2019/96,625	4.000	4.000

Terminkontrakte

CHF

ABB Ltd. Future Dezember 2018	220	220
ABB Ltd. Future Juni 2018	300	300
ABB Ltd. Future September 2018	400	400
Flughafen Zuerich Future September 2018	40	40
Geberit AG Future Juni 2018	10	0
Kühne + Nagel International AG Future Dezember 2018	40	40
Kühne + Nagel International AG Future Juni 2018	50	50
Kühne + Nagel International AG Future September 2018	40	40
LafargeHolcim Ltd. Future Dezember 2018	150	150
LafargeHolcim Ltd. Future Juni 2018	260	260
LafargeHolcim Ltd. Future September 2018	240	240
Nestlé S.A. Future Dezember 2018	130	130
Nestlé S.A. Future Juni 2018	150	50
Nestlé S.A. Future September 2018	155	155
Panalpina Welttransport Holding AG Future Dezember 2018	50	50
Panalpina Welttransport Holding AG Future Juni 2018	30	20
Panalpina Welttransport Holding AG Future September 2018	60	60
Swatch Group Future September 2018	120	120
Swiss Market Index Future Juni 2018	300	300
Temenos Group AG Future Juni 2018	10	10

EUR

Accor S.A. Future Dezember 2018	90	90
Accor S.A. Future Juni 2018	125	75
Accor S.A. Future September 2018	120	120
Accor S.A. Future September 2018	50	50
adidas AG Future September 2018	15	15
Airbus SE Future Juni 2018	25	0
Anheuser-Busch InBev S.A./NV Future September 2018	75	75
Bayerische Motoren Werke AG Future Juni 2018	80	80
Bayerische Motoren Werke AG Future September 2018	65	65
CAC 40 Index Future Dezember 2018	9	9
CAC 40 Index Future November 2018	20	20
CAC 40 Index Future Oktober 2018	20	20
CAC 40 Index Future September 2018	12	12
CAC 40 Index Future September 2018	10	10
Carrefour S.A. Future Juni 2018	250	50
Carrefour S.A. Future September 2018	250	250
Cie de Saint-Gobain Future Juni 2018	150	100
Compagnie de Saint-Gobain S.A. Future Dezember 2018	100	100
Compagnie de Saint-Gobain S.A. Future September 2018	125	125
Continental AG Future Juni 2018	0	10
DAX Performance-Index Future Dezember 2018	25	25
DAX Performance-Index Future Dezember 2018	11	11
DAX Performance-Index Future Juni 2018	87	217
DAX Performance-Index Future März 2019	4	4
DAX Performance-Index Future September 2018	120	120
DAX Performance-Index Future September 2018	12	12
Dow Jones EURO STOXX 50 Dividend Index Future Dezember 2022	4.301	4.301
Dte. Lufthansa AG Future Dezember 2018	255	255
Dte. Lufthansa AG Future Juni 2018	175	175
Dte. Lufthansa AG Future Mai 2018	175	50
Dte. Lufthansa AG Future September 2018	255	255
Dte. Post AG Future Dezember 2018	120	120
Dte. Post AG Future Juni 2018	210	210
Dte. Post AG Future September 2018	220	220
Dte. Telekom AG Future Juni 2018	0	150

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Berichtes.

ISIN	Wertpapiere	Zugänge	Abgänge
DWS Group GmbH & Co. KGaA Future Dezember 2018		100	100
DWS Group GmbH & Co. KGaA Future September 2018		100	100
EUREX Dow Jones EURO STOXX 50 Dividend Index Future Dezember 2020		4.301	4.301
EUREX Dow Jones EURO STOXX 50 Dividend Index Future Dezember 2020		2.000	2.000
EUREX Dow Jones EURO STOXX 50 Index Future Dezember 2018		10.506	10.506
EUREX Dow Jones EURO STOXX 50 Index Future Dezember 2018		5.580	5.580
EUREX Dow Jones EURO STOXX 50 Index Future Juni 2018		3.170	3.170
EUREX Dow Jones EURO STOXX 50 Index Future Juni 2018		1.915	1.915
EUREX Dow Jones EURO STOXX 50 Index Future Juni 2019		690	690
EUREX Dow Jones EURO STOXX 50 Index Future März 2019		8.900	8.900
EUREX Dow Jones EURO STOXX 50 Index Future März 2019		1.050	1.050
EUREX Dow Jones EURO STOXX 50 Index Future September 2018		5.540	5.540
EUREX Dow Jones EURO STOXX 50 Index Future September 2018		1.922	1.922
EURO STOXX Automobiles&Parts Future Juni 2018		27	7
EURO STOXX Automobiles&Parts Future September 2018		1.137	1.137
EURO STOXX Automobiles&Parts Future September 2018		20	20
EURO STOXX Banks Future Dezember 2018		50	50
EURO STOXX Chemicals Future Juni 2018		0	190
EURO STOXX Chemicals Future September 2018		190	190
EURO STOXX Industrial Goods&Services Future Dezember 2018		18	18
EURO STOXX Industrial Goods&Services Future Juni 2018		30	0
EURO STOXX Industrial Goods&Services Future September 2018		41	41
EURO STOXX Oil&Gas Future Dezember 2018		10	10
EURO STOXX Technology Future Dezember 2018		35	35
EUX 10YR Euro-Bund Future Dezember 2018		605	605
EUX 10YR Euro-Bund Future Dezember 2018		365	365
EUX 10YR Euro-Bund Future Juni 2019		500	500
EUX 10YR Euro-Bund Future September 2018		410	410
EUX 30YR Bundesanleihe 4% Future Dezember 2018		100	100
EUX 30YR Bundesanleihe 4% Future Juni 2018		150	0
EUX 30YR Bundesanleihe 4% Future September 2018		100	100
EUX 5YR Euro-Bobl Future Dezember 2018		1.000	1.000
EUX 5YR Euro-Bobl Future Juni 2018		1.200	1.200
Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide Future Dezember 2018		60	60
Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide Future Juni 2018		90	10
Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide Future September 2018		60	60
Gea Group AG Future Dezember 2018		50	50
Gea Group AG Future September 2018		100	100
HeidelbergCement AG Future Dezember 2018		40	40
HeidelbergCement AG Future September 2018		125	125
Henkel AG & Co. KGaA Future Juni 2018		170	20
Henkel AG & Co. KGaA -VZ- Future Juni 2018		0	80
Henkel AG & Co. KGaA -VZ- Future September 2018		70	70
Hugo Boss AG Future Dezember 2018		100	100
Hugo Boss AG Future Juni 2018		135	80
Hugo Boss AG Future September 2018		100	100
Infineon Technologies AG Future Juni 2018		0	100
International Consolidated Airlines Future Juni 2018		750	750
International Consolidated Airlines Group S.A. Future September 2018		750	750
iSTOXX Europe Momentum Factor Net Return Index (EUR) Future Juni 2018		3.384	0
iSTOXX Europe Momentum Factor Net Return Index (EUR) Future September 2018		3.384	3.384
iSTOXX Europe Value Factor Index (Net Return) (EUR) Future Juni 2018		0	7.000
iSTX Europe Value Factor Index (Net Return) (EUR) Future September 2018		7.000	7.000
Kering S.A. Future Dezember 2018		20	20
Kering S.A. Future Juni 2018		10	10
Kering S.A. Future Juni 2018		10	10
Kering S.A. Future September 2018		20	20
Kone Corporation (New) Future Dezember 2018		50	50
Kone Corporation (New) Future September 2018		115	115
Koninklijke Philips NV Future Dezember 2018		280	280
Koninklijke Philips NV Future Juni 2018		275	200
Koninklijke Philips NV Future September 2018		280	280
LIF 3MO Euribor Future Dezember 2019		4.000	4.000
LIF 3MO Euribor Future Dezember 2019		3.000	3.000
LIF 3MO Euribor Future Juni 2019		2.000	2.000

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Berichtes.

ISIN	Wertpapiere	Zugänge	Abgänge
	LIF 3MO Euribor Future Juni 2019	2.000	2.000
	LIF 3MO Euribor Future Juni 2020	2.000	2.000
	LIF 3MO Euribor Future März 2020	4.000	4.000
	LIF 3MO Euribor Future September 2019	3.500	3.500
	LIF 3MO Euribor Future September 2021	300	300
	Merck KGaA Future Juni 2018	110	55
	Merck KGaA Future September 2018	40	40
	MSCI Europe Index Future Dezember 2018	3.673	3.673
	MSCI Europe Index Future März 2019	2.198	2.198
	MSCI Europe Index Future September 2018	3.789	3.789
	MSCI Europe Index (Net Return) (EUR) Future Juni 2018	2.439	0
	MSCI World Net EUR Future Dezember 2018	1.870	1.870
	MSCI World Net EUR Future März 2019	2.892	2.892
	MSCI World Net EUR Future September 2018	1.870	1.870
	MSCI World Net EUR Index Future Juni 2018	1.870	0
	MTU Aero Engines AG Future Juni 2018	30	10
	Österreichische Post AG Future Dezember 2018	100	100
	Österreichische Post AG Future September 2018	135	135
	Peugeot S.A. Future Dezember 2018	220	220
	Peugeot S.A. Future September 2018	320	320
	ProSiebenSat.1 Media SE Future September 2018	120	120
	Publicis Groupe S.A. Future Juni 2018	40	40
	Publicis Groupe S.A. Future September 2018	20	20
	Safran SA Future Juni 2018	50	50
	Salvatore Ferragamo S.p.A. Future Dezember 2018	30	30
	Salvatore Ferragamo S.p.A. Future Juni 2018	20	20
	Salvatore Ferragamo S.p.A. Future September 2018	30	30
	Siemens Healthineers Future September 2018	100	100
	SKF AB -B- Future Dezember 2018	300	300
	SKF AB -B- Future Juni 2018	360	360
	SKF AB -B- Future September 2018	760	760
	S&P-MIB Future Dezember 2018	63	63
	S&P-MIB Future September 2018	529	529
	S&P-MIB Index Future Juni 2018	497	497
	S&P-MIB Index Future Juni 2018	3	3
	STOXX Europe 600 Price Index (EUR) Future Dezember 2018	6.474	6.474
	STOXX Europe 600 Price Index (EUR) Future Juni 2018	7.649	0
	STOXX Europe 600 Price Index (EUR) Future Juni 2019	585	585
	STOXX Europe 600 Price Index (EUR) Future März 2019	1.883	1.883
	STOXX Europe 600 Price Index (EUR) Future September 2018	7.649	7.649
	Stoxx 600 Automobiles&Parts Future Dezember 2018	65	65
	Stoxx 600 Automobiles&Parts Future Juni 2018	15	0
	Stoxx 600 Automobiles&Parts Future März 2019	25	25
	Stoxx 600 Automobiles&Parts Future September 2018	53	53
	Stoxx 600 Automobiles&Parts Future September 2018	30	30
	Stoxx 600 Banks Future Dezember 2018	240	240
	Stoxx 600 Banks Future Dezember 2018	25	25
	Stoxx 600 Banks Future März 2019	75	75
	Stoxx 600 Banks Future September 2018	290	290
	Stoxx 600 Basic Resources Future Dezember 2018	79	79
	Stoxx 600 Basic Resources Future September 2018	65	65
	Stoxx 600 Chemicals Future Dezember 2018	46	46
	Stoxx 600 Chemicals Future Juni 2018	30	30
	Stoxx 600 Chemicals Future September 2018	40	40
	Stoxx 600 Construction&Materials Future Dezember 2018	75	75
	Stoxx 600 Construction&Materials Future Juni 2018	46	0
	Stoxx 600 Construction&Materials Future September 2018	101	101
	Stoxx 600 Financial Services Future Dezember 2018	32	32
	Stoxx 600 Financial Services Future September 2018	32	32
	STOXX 600 Food & Beverages Future Dezember 2018	17	17
	STOXX 600 Food & Beverages Future Juni 2018	30	10
	STOXX 600 Food & Beverages Future September 2018	30	30
	Stoxx 600 Health Care Future Dezember 2018	53	53
	Stoxx 600 Health Care Future September 2018	22	22
	Stoxx 600 Industrial Goods&Services Future Dezember 2018	40	40

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Berichtes.

ISIN	Wertpapiere	Zugänge	Abgänge
	Stoxx 600 Industrial Goods&Services Future Juni 2018	18	18
	Stoxx 600 Industrial Goods&Services Future September 2018	40	40
	Stoxx 600 Media Future Dezember 2018	53	53
	Stoxx 600 Oil&Gas Future Dezember 2018	50	50
	Stoxx 600 Oil&Gas Future Dezember 2018	15	15
	Stoxx 600 Oil&Gas Future September 2018	47	47
	Stoxx 600 Personal&Household Future Dezember 2018	14	14
	Stoxx 600 Personal&Household Future September 2018	15	15
	Stoxx 600 Retail Future Dezember 2018	130	130
	Stoxx 600 Retail Future September 2018	134	134
	STOXX 600 Technology Index (Price) (EUR) Future Dezember 2018	89	89
	STOXX 600 Technology Index (Price) (EUR) Future Dezember 2018	12	12
	STOXX 600 Technology Index (Price) (EUR) Future Juni 2018	55	0
	STOXX 600 Technology Index (Price) (EUR) Future September 2018	80	80
	STOXX 600 Technology Index (Price) (EUR) Future September 2018	45	45
	Stoxx 600 Telecommunications Future Dezember 2018	151	151
	Stoxx 600 Telecommunications Future Dezember 2018	86	86
	Stoxx 600 Telecommunications Future Juni 2018	196	150
	Stoxx 600 Telecommunications Future September 2018	351	351
	Stoxx 600 Telecommunications Future September 2018	30	30
	Stoxx 600 Travel&Leisure Future September 2018	66	66
	Stoxx 600 Utilities Future Dezember 2018	55	55
	Stoxx 600 Utilities Future Juni 2018	80	100
	Stoxx 600 Utilities Future September 2018	55	55
	thyssenkrupp AG Future Dezember 2018	150	150
	thyssenkrupp AG Future September 2018	250	250
	Valéo S.A. Future Juni 2018	60	30
	VSTOXX Index Future August 2018	1.170	1.170
	VSTOXX Index Future November 2018	1.290	1.290
	VSTOXX Index Future Oktober 2018	1.290	1.290
	VSTOXX Index Future September 2018	1.250	1.250
	Wartsila Corporation Future September 2018	70	70
GBP			
	Associated British Foods Plc. Future Juni 2018	10	10
	Associated British Foods Plc. Future September 2018	11	11
	Burberry Group Plc. Future Dezember 2018	20	20
	Burberry Group Plc. Future Juni 2018	40	40
	Burberry Group Plc. Future September 2018	30	30
	Cobham Plc. Future Dezember 2018	325	325
	Cobham Plc. Future September 2018	325	325
	FTSE 100 Index Future Dezember 2018	58	58
	FTSE 100 Index Future Juni 2018	136	123
	FTSE 100 Index Future März 2019	11	11
	FTSE 100 Index Future September 2018	151	151
	Kingfisher Plc. Future Juni 2018	75	75
	Kingfisher Plc. Future September 2018	100	100
	LIF 3MO Sterling Future Dezember 2018	4.000	0
	LIF 3MO Sterling Future Dezember 2019	0	4.000
	LIF 3MO Sterling Future Dezember 2020	450	450
	LIF 3MO Sterling Future März 2019	2.800	2.800
	LIF 3MO Sterling Future März 2020	2.800	2.800
	LIF 3MO Sterling Future September 2019	660	660
	Next Group Plc. Future Juni 2018	10	10
	Rolls Royce Holdings Plc. Future September 2018	60	60
	Smiths Group Plc. Future Dezember 2018	15	15
	Smiths Group Plc. Future September 2018	25	25
	Tesco Plc. Future Dezember 2018	75	75
	Tesco Plc. Future Juni 2018	200	200
	Tesco Plc. Future September 2018	200	200
	WPP Plc. Future Dezember 2018	38	38
	WPP Plc. Future Juni 2018	45	45
	WPP Plc. Future September 2018	60	60

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Berichtes.

ISIN	Wertpapiere	Zugänge	Abgänge
HKD			
	Hang Seng China Enterprises Index Future Dezember 2018	2.420	2.420
	Hang Seng China Enterprises Index Future Januar 2019	1.950	1.950
	Hang Seng China Enterprises Index Future November 2018	1.520	1.520
	Hang Seng China Enterprises Index Future Oktober 2018	700	700
	Hang Seng China Enterprises Index Future Oktober 2018	120	120
	Hang Seng China Enterprises Index Future September 2018	120	120
JPY			
	Japanese Yen Currency Future Dezember 2018	83	83
	Japanese Yen Currency Future März 2019	201	201
	Japanese Yen Currency Future September 2018	83	83
	Nikkei 225 Stock Average Index Future Juni 2019	450	450
	Tokyo Stock Price (TOPIX) Index Future Dezember 2018	77	77
	Tokyo Stock Price (TOPIX) Index Future März 2019	195	195
	Tokyo Stock Price (TOPIX) Index Future September 2018	77	77
	Yen Denominated Nikkei 225 Index Future Dezember 2018	1.126	1.126
	Yen Denominated Nikkei 225 Index Future Juni 2018	1.427	150
	Yen Denominated Nikkei 225 Index Future September 2018	1.537	1.537
USD			
	CBOE Volatility Index (VIX) Future Dezember 2018	373	373
	CBOE Volatility Index (VIX) Future November 2018	373	373
	CBOE Volatility Index (VIX) Future September 2018	370	370
	CBT 10YR US T-Bond Note Future Dezember 2018	1.450	1.450
	CBT 10YR US T-Bond Note Future Dezember 2018	280	280
	CBT 10YR US T-Bond Note Future Juni 2019	23	23
	CBT 10YR US T-Bond Note Future September 2018	1.457	1.457
	CBT 2YR US T-Bill 6% Future Dezember 2018	4.600	4.600
	CBT 2YR US T-Bill 6% Future Juni 2018	1.300	250
	CBT 2YR US T-Bill 6% Future März 2019	4.000	4.000
	CBT 2YR US T-Bill 6% Future September 2018	3.100	3.100
	CBT 5YR US T-Bond Note 6% Future Dezember 2018	4.150	4.150
	CBT 5YR US T-Bond Note 6% Future Juni 2018	1.850	450
	CBT 5YR US T-Bond Note 6% Future Juni 2019	1.700	1.700
	CBT 5YR US T-Bond Note 6% Future März 2019	1.200	1.200
	CBT 5YR US T-Bond Note 6% Future September 2018	2.950	2.950
	Chicago Board Options Exchange SPX Volatility Index Future Oktober 2018	517	517
	CME Nasdaq 100 E-Mini Index Future Dezember 2018	180	180
	CME Nasdaq 100 E-Mini Index Future März 2019	180	180
	CME Nasdaq 100 E-Mini Index Future September 2018	180	180
	CME 3MO Euro-Dollar Future Dezember 2018	1.200	4.000
	CME 3MO Euro-Dollar Future Dezember 2019	9.800	7.000
	CME 3MO Euro-Dollar Future Juni 2019	5.201	5.201
	CME 3MO Euro-Dollar Future Juni 2020	600	600
	CME 3MO Euro-Dollar Future März 2019	6.700	6.700
	CME 3MO Euro-Dollar Future März 2020	3.800	3.800
	CME 3MO Euro-Dollar Future September 2019	2.101	2.101
	CME 3MO Euro-Dollar Future September 2019	300	300
	E-Mini S&P 500 Index Future Dezember 2018	4.614	4.614
	E-Mini S&P 500 Index Future Dezember 2018	595	595
	E-Mini S&P 500 Index Future Juni 2018	1.962	1.705
	E-Mini S&P 500 Index Future März 2019	1.505	1.505
	E-Mini S&P 500 Index Future September 2018	1.939	1.939
	E-Mini S&P 500 Index Future September 2018	518	518
	E-mini Utilities Select Sector Index Future Dezember 2018	770	770
	EUREX MSCI World Index Future Dezember 2018	53	53
	IXM Financial Select Sector Index Future September 2018	150	150
	MINI MSCI EM INDEX FUTURE (NYSE) Future Juni 2018	1.375	200
	MSCI Asia Pacific ex Japan Future Dezember 2018	339	339
	MSCI Asia Pacific ex Japan Future September 2018	339	339
	MSCI Asia Pacific ex Japan Index Future Juni 2018	89	0
	MSCI EM INDEX FUTURE (NYSE) Future Dezember 2018	1.378	1.378
	MSCI EM INDEX FUTURE (NYSE) Future März 2019	1.200	1.200
	MSCI EM INDEX FUTURE (NYSE) Future September 2018	2.353	2.353

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Berichtes.

UniAbsoluterErtrag

ISIN	Wertpapiere	Zugänge	Abgänge
	MSCI USA Equal Weighted Net USD Index Future Juni 2018	117	117
	MSCI USA EQUAL WEIGHTED USD Net Total Return RT Index Future September 2018	110	110
	MSCI USA Index (Net Return) (USD) Future September 2018	1.290	1.290
	MSCI USA Index (Net Return) (USD) Index Future Juni 2018	1.296	72
	MSCI USA Momentum USD NTR Future September 2018	142	142
	MSCI USA Momentum USD NTR Index Future Juni 2018	142	142
	MSCI USA Quality Net USD Index Future September 2018	178	178
	MSCI USA Value Weight Capacity Index (Net Return) (USD) Future Juni 2018	0	3.436
	MSCI USA Value Weight Capacity Index (Net Return) (USD) Future September 2018	3.436	3.436
	MSCI World Index Future Dezember 2018	337	337
	MSCI World Index Future September 2018	444	444
	NYSE FANG+ Future Dezember 2018	11	11
	NYSE FANG+ Future März 2019	3	3
	NYSE FANG+ Future September 2018	5	5
	NYSE FANG+ Index Future Juni 2018	5	3
	Russell 2000 Future Dezember 2018	135	135
	Russell 2000 Future September 2018	442	442
	Russell 2000 Index Future Juni 2018	0	442
	Tesla Inc. Future Dezember 2018	10	10
	Tesla Inc. Future Juni 2018	10	10
	Tesla Inc. Future September 2018	20	20
	US Dollar Currency Future Dezember 2018	2.713	2.713
	US Dollar Currency Future Juni 2018	290	3.186
	US Dollar Currency Future Juni 2019	36	36
	US Dollar Currency Future März 2019	2.921	2.921
	US Dollar Currency Future März 2019	406	406
	US Dollar Currency Future September 2018	2.607	2.607

Credit Default Swaps

EUR

Barclays Bank Plc./iTraxx Europe S27 5Yr Index CDS v.17(2022)	0	75.000.000
Barclays Bank Plc./Vereinigte Staaten von Amerika CDS v.17(2021)	0	100.000.000
Deutsche Bank AG/iTraxx Europe S30 5Yr Index CDS v.19(2023)	200.000.000	200.000.000
Dte. Bank AG, Frankfurt/iTraxx Europe S27 10Yr Index CDS v.17(2027)	54.000.000	0
Dte. Bank AG, Frankfurt/iTraxx Europe S27 5Yr Index CDS v.17(2022)	0	100.000.000
Goldman Sachs International., London/iTraxx Europe Senior Financial S29 5Yr Index CDS v.18(2023)	75.000.000	75.000.000
Goldman Sachs International., London/iTraxx Europe S29 5Yr Index CDS v.18(2023)	75.000.000	75.000.000
J.P. Morgan Securities Plc., London/iTraxx Europe Senior Financial S29 5Yr Index CDS v.18(2023)	40.000.000	40.000.000
J.P. Morgan Securities Plc., London/iTraxx Europe S28 3Y Index CDS v.17(2020)	0	160.000.000
J.P. Morgan Securities Plc., London/iTraxx Europe S28 5Yr Index CDS v.17(2022)	100.000.000	0

USD

Barclays Bank Plc./CDX Emerging Markets S29 5Yr Index CDS v.18(2023)	75.000.000	75.000.000
Barclays Bank Plc./CDX Emerging Markets S29 5Yr Index CDS v.18(2023)	75.000.000	75.000.000
Barclays Bank Plc./CDX Emerging Markets S30 5Yr Index CDS v.18(2023)	80.000.000	80.000.000
Barclays Bank Plc./CDX Emerging Markets S30 5Yr Index CDS v.18(2023)	30.000.000	30.000.000
Barclays Bank Plc./CDX Emerging Markets S30 5Yr Index CDS v.19(2023)	25.000.000	25.000.000
Barclays Bank Plc./Spanien v.14(2044) CDS v.18(2023)	25.000.000	25.000.000
BNP Paribas S.A., Paris/CDX Emerging Markets S31 5Yr Index CDS v.19(2024)	25.000.000	25.000.000
BNP Paribas S.A., Paris/Großbritannien CDS v.18(2022)	50.000.000	50.000.000
BNP Paribas S.A., Paris/Großbritannien CDS v.18(2022)	50.000.000	50.000.000
BNP Paribas S.A., Paris/Korea CDS v.18(2023)	50.000.000	50.000.000
Goldman Sachs International., London/CDX Emerging Markets S30 5Yr Index CDS v.18(2023)	30.000.000	30.000.000
J.P. Morgan Securities Plc., London/CDX Emerging Markets S30 5Yr Index CDS v.19(2023)	50.000.000	50.000.000
J.P. Morgan Securities Plc., London/Großbritannien CDS v.17(2022)	0	50.000.000
J.P. Morgan Securities Plc., London/Korea CDS v.18(2023)	30.000.000	30.000.000
J.P. Morgan Securities Plc., London/Korea CDS v.18(2023)	20.000.000	20.000.000
J.P. Morgan Securities Plc., London/Spanien CDS v.18(2022)	50.000.000	0

Sonstige Finanzinstrumente

AUD

SWAP Australian Bank Bill Swap Rate 6 Monate (BBSW)/2.2190% 10.01.2024	166.700.000	166.700.000
SWAP Australian Bank Bill Swap Rate 6 Monate (BBSW)/2.2190% 10.01.2024	166.700.000	166.700.000
SWAP Australian Bank Bill Swap Rate 6 Monate (BBSW)/2.6150% 03.10.2023	34.000.000	0
SWAP Australian Bank Bill Swap Rate 6 Monate (BBSW)/2.6150% 03.10.2023	0	34.000.000

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Berichtes.

UniAbsoluterErtrag

ISIN	Wertpapiere	Zugänge	Abgänge
	SWAP Australian Bank Bill Swap Rate 6 Monate (BBSW)/2.6550% 29.09.2023	65.000.000	0
	SWAP Australian Bank Bill Swap Rate 6 Monate (BBSW)/2.6550% 29.09.2023	0	65.000.000
	SWAP 1.9285%/Australian Bank Bill Swap Rate 3 Monate (BBSW) 10.01.2022	136.400.000	136.400.000
	SWAP 1.9285%/Australian Bank Bill Swap Rate 3 Monate (BBSW) 10.01.2022	136.400.000	136.400.000
	SWAP 2.1725%/Australian Bank Bill Swap Rate 3 Monate (BBSW) 03.10.2020	82.000.000	0
	SWAP 2.1725%/Australian Bank Bill Swap Rate 3 Monate (BBSW) 03.10.2020	0	82.000.000
	SWAP 2.1875%/Australian Bank Bill Swap Rate 3 Monate (BBSW) 29.09.2020	150.000.000	0
	SWAP 2.1875%/Australian Bank Bill Swap Rate 3 Monate (BBSW) 29.09.2020	0	150.000.000
	SWAP 2.3820%/Australian Bank Bill Swap Rate 6 Monate (BBSW) 10.01.2026	60.600.000	60.600.000
	SWAP 2.3820%/Australian Bank Bill Swap Rate 6 Monate (BBSW) 10.01.2026	60.600.000	60.600.000
	Total Return SWAP STRATEGIE JPM AUSTRALIAN EXPORTERS/STRATEGIE JPM AUSTRALIAN EXPORTERS 15.08.19	16.858.815	16.858.815

CZK

	SWAP PRIBOR (CZK) 6 Monate/1.6170% 24.04.2023	1.020.000.000	1.020.000.000
	SWAP PRIBOR (CZK) 6 Monate/1.6170% 24.04.2023	1.020.000.000	1.020.000.000
	SWAP PRIBOR (CZK) 6 Monate/1.9550% 10.01.2024	1.000.000.000	1.000.000.000
	SWAP PRIBOR (CZK) 6 Monate/1.9550% 10.01.2024	1.000.000.000	1.000.000.000
	SWAP PRIBOR (CZK) 6 Monate/2.0575% 12.07.2024	1.050.000.000	1.050.000.000
	SWAP PRIBOR (CZK) 6 Monate/2.0575% 12.07.2024	1.050.000.000	1.050.000.000
	SWAP PRIBOR (CZK) 6 Monate/2.4720% 20.09.2024	535.000.000	535.000.000
	SWAP PRIBOR (CZK) 6 Monate/2.4720% 20.09.2024	535.000.000	535.000.000
	SWAP 2.0150%/PRIBOR (CZK) 6 Monate 12.07.2021	2.588.000.000	2.588.000.000
	SWAP 2.0150%/PRIBOR (CZK) 6 Monate 12.07.2021	2.588.000.000	2.588.000.000
	SWAP 2.1750%/PRIBOR (CZK) 6 Monate 10.01.2021	2.500.000.000	2.500.000.000
	SWAP 2.1750%/PRIBOR (CZK) 6 Monate 10.01.2021	2.500.000.000	2.500.000.000
	SWAP 2.4700%/PRIBOR (CZK) 6 Monate 20.09.2021	1.300.000.000	1.300.000.000
	SWAP 2.4700%/PRIBOR (CZK) 6 Monate 20.09.2021	1.300.000.000	1.300.000.000

EUR

	SWAP EURIBOR (EUR) 6 Monate/0.1000% 14.03.2024	40.000.000	40.000.000
	SWAP EURIBOR (EUR) 6 Monate/0.1000% 14.03.2024	40.000.000	40.000.000
	SWAP EURIBOR (EUR) 6 Monate/0.4870% 20.02.2023	90.000.000	0
	SWAP EURIBOR (EUR) 6 Monate/0.4870% 20.02.2023	0	90.000.000
	SWAP EURIBOR (EUR) 6 Monate/0.5300% 20.08.2024	121.000.000	121.000.000
	SWAP EURIBOR (EUR) 6 Monate/0.5300% 20.08.2024	121.000.000	121.000.000
	SWAP EURIBOR (EUR) 6 Monate/0.5440% 04.09.2024	60.000.000	60.000.000
	SWAP EURIBOR (EUR) 6 Monate/0.5440% 04.09.2024	60.000.000	60.000.000
	SWAP EURIBOR (EUR) 6 Monate/0.5510% 28.08.2024	60.000.000	60.000.000
	SWAP EURIBOR (EUR) 6 Monate/0.5510% 28.08.2024	60.000.000	60.000.000
	SWAP EURIBOR (EUR) 6 Monate/0.6500% 27.02.2029	40.000.000	40.000.000
	SWAP EURIBOR (EUR) 6 Monate/0.6500% 27.02.2029	40.000.000	40.000.000
	SWAP EURIBOR (EUR) 6 Monate/1.0050% 12.04.2023	400.000.000	400.000.000
	SWAP EURIBOR (EUR) 6 Monate/1.0050% 12.04.2023	400.000.000	400.000.000
	SWAP EURIBOR (EUR) 6 Monate/1.5190% 11.09.2028	52.500.000	52.500.000
	SWAP EURIBOR (EUR) 6 Monate/1.5190% 11.09.2028	52.500.000	52.500.000
	SWAP EURIBOR (EUR) 6 Monate/1.5385% 11.09.2028	20.300.000	20.300.000
	SWAP EURIBOR (EUR) 6 Monate/1.5385% 11.09.2028	20.300.000	20.300.000
	SWAP EURIBOR (EUR) 6 Monate/1.6645% 20.02.2048	16.750.000	0
	SWAP EURIBOR (EUR) 6 Monate/1.6645% 20.02.2048	0	16.750.000
	SWAP EUROZONE HICP EX TOBACCO/1.2675% 28.09.2022	130.000.000	0
	SWAP EUROZONE HICP EX TOBACCO/1.2675% 28.09.2022	0	130.000.000
	SWAP EUROZONE HICP EX TOBACCO/1.2940% 15.11.2022	65.000.000	0
	SWAP EUROZONE HICP EX TOBACCO/1.2940% 15.11.2022	0	65.000.000
	SWAP EUROZONE HICP EX TOBACCO/1.3490% 15.11.2022	65.000.000	0
	SWAP EUROZONE HICP EX TOBACCO/1.3490% 15.11.2022	0	65.000.000
	SWAP EUROZONE HICP EX TOBACCO/1.5425% 15.06.2025	3.000.000	0
	SWAP EUROZONE HICP EX TOBACCO/1.5425% 15.06.2025	0	3.000.000
	SWAP 0.0140%/EURIBOR (EUR) 6 Monate 29.01.2022	98.000.000	98.000.000
	SWAP 0.0140%/EURIBOR (EUR) 6 Monate 29.01.2022	98.000.000	98.000.000
	SWAP 0.0865%/EURIBOR (EUR) 6 Monate 20.08.2021	295.000.000	295.000.000
	SWAP 0.0865%/EURIBOR (EUR) 6 Monate 20.08.2021	295.000.000	295.000.000
	SWAP 0.1000%/EURIBOR (EUR) 6 Monate 04.09.2021	148.000.000	148.000.000
	SWAP 0.1000%/EURIBOR (EUR) 6 Monate 04.09.2021	148.000.000	148.000.000
	SWAP 0.1040%/EURIBOR (EUR) 6 Monate 28.08.2021	150.000.000	150.000.000
	SWAP 0.1040%/EURIBOR (EUR) 6 Monate 28.08.2021	150.000.000	150.000.000
	SWAP 0.1280%/EURIBOR (EUR) 6 Monate 27.02.2024	40.000.000	40.000.000

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Berichtes.

UniAbsoluterErtrag

ISIN	Wertpapiere	Zugänge	Abgänge
SWAP 0.1280%/EURIBOR (EUR) 6 Monate 27.02.2024		40.000.000	40.000.000
SWAP 0.3450%/ EURIBOR (EUR) 3 Monate 24.10.2023		40.000.000	40.000.000
SWAP 0.3450%/EURIBOR (EUR) 3 Monate 24.10.2023		40.000.000	40.000.000
SWAP 0.3650%/EURIBOR (EUR) 6 Monate 12.04.2021		400.000.000	400.000.000
SWAP 0.3650%/EURIBOR (EUR) 6 Monate 12.04.2021		400.000.000	400.000.000
SWAP 0.4088%/EURIBOR (EUR) 6 Monate 24.04.2023		40.000.000	40.000.000
SWAP 0.4088%/EURIBOR (EUR) 6 Monate 24.04.2023		40.000.000	40.000.000
SWAP 0.9590%/EURIBOR (EUR) 3 Monate 24.10.2028		10.000.000	10.000.000
SWAP 0.9590%/EURIBOR (EUR) 3 Monate 24.10.2028		10.000.000	10.000.000
SWAP 1.1470%/EURIBOR (EUR) 6 Monate 20.02.2028		88.000.000	0
SWAP 1.1470%/EURIBOR (EUR) 6 Monate 20.02.2028		0	88.000.000
SWAP 1.2400%/EURIBOR (EUR) 6 Monate 27.02.2049		7.600.000	7.600.000
SWAP 1.2400%/EURIBOR (EUR) 6 Monate 27.02.2049		7.600.000	7.600.000
SWAP 1.4425%/EUROZONE HICP EX TOBACCO 28.09.2027		130.000.000	0
SWAP 1.4425%/EUROZONE HICP EX TOBACCO 28.09.2027		0	130.000.000
SWAP 1.4730%/EUROZONE HICP EX TOBACCO 15.11.2027		65.000.000	0
SWAP 1.4730%/EUROZONE HICP EX TOBACCO 15.11.2027		0	65.000.000
SWAP 1.5125%/EUROZONE HICP EX TOBACCO 27.06.2020		122.500.000	122.500.000
SWAP 1.5125%/EUROZONE HICP EX TOBACCO 27.06.2020		122.500.000	122.500.000
SWAP 1.5220%/EUROZONE HICP EX TOBACCO 15.11.2027		65.000.000	0
SWAP 1.5220%/EUROZONE HICP EX TOBACCO 15.11.2027		0	65.000.000
SWAP 1.5325%/EUROZONE HICP EX TOBACCO 15.06.2020		120.000.000	120.000.000
SWAP 1.5325%/EUROZONE HICP EX TOBACCO 15.06.2020		120.000.000	120.000.000
SWAP 1.5425%/EURIBOR (EUR) 6 Monate 14.11.2027		63.000.000	0
SWAP 1.5425%/EURIBOR (EUR) 6 Monate 14.11.2027		0	63.000.000
Total Return SWAP iBoxx EUR Liquid High Yield Index (IBOXXMJA)/EURIBOR (EUR) 3 Monate 20.12.18		50.000.000	50.000.000
Total Return SWAP iBoxx Euro CORPORATES OVERALL Index (TOTAL RETURN)/EURIBOR (EUR) 3 Monate 20.12.18		50.000.000	50.000.000
Total Return SWAP Strategie GS UI ARP Swap/Strategie GS UI ARP Swap 18.01.19		0	29.939.430
Total Return SWAP Strategie JPM Mergers & Acquisitions/Strategie JPM Mergers & Acquisitions 15.02.19		1.232.320	41.141.920
Total Return SWAP STRATEGIE BARCLAYS WEEKLY VAR EU/STRATEGIE BARCLAYS WEEKLY VAR EU 19.07.19		5.062.811	5.062.811
Total Return SWAP STRATEGIE BARCLAYS WEEKLY VAR EU/STRATEGIE BARCLAYS WEEKLY VAR EU 20.01.20		10.661.116	10.661.116
Total Return SWAP STRATEGIE DB Tax Profiteure EU/STRATEGIE DB Tax Profiteure EU 14.12.18		469.840	20.845.400
Total Return SWAP Strategie European Equity MS L/S/Strategie European Equity MS L/S 14.10.19		20.007.799	20.007.799
Total Return SWAP STRATEGIE JPM Car of the Future/STRATEGIE JPM Car of the Future 15.08.19		14.666.685	14.666.685
Total Return SWAP Strategie JPM Europe Quality Index/Strategie JPM Europe Quality Index 15.08.19		20.106.060	20.106.060
Total Return SWAP STRATEGIE JPM Factor Hedge Europe/STRATEGIE JPM Factor Hedge Europe 07.12.18		0	19.568.000
Total Return SWAP STRATEGIE JPM HCT Capex/STRATEGIE JPM HCT Capex 15.02.19		15.100.500	15.100.500
Total Return SWAP STRATEGIE JPM HCT Robotics/STRATEGIE JPM HCT Robotics 15.08.19		9.548.400	9.548.400
Total Return SWAP Strategie JPM Italy/Strategie JPM Italy 15.08.19		22.335.918	22.335.918
Total Return SWAP Strategie JPM Morgan Quant Style/Strategie JPM Morgan Quant Style 14.02.20		16.212.928	16.212.928
Total Return SWAP STRATEGIE JPM SWISS EXPORTER/STRATEGIE JPM SWISS EXPORTER 15.05.19		20.735.560	20.735.560
Total Return SWAP STRATEGIE JPM SWISS EXPORTER/STRATEGIE JPM SWISS EXPORTER 15.05.19		19.979.980	19.979.980
Total Return SWAP STRATEGIE JPM UI Dynamic Themes Index/STRATEGIE JPM UI Dynamic Themes Index 15.08.19		9.816.000	9.816.000
Total Return SWAP STRATEGIE zu MS FSI Europe/STRATEGIE zu MS FSI Europe 01.06.19		0	65.000.000
Total Return SWAP Strategie zu MSVOL FIXED INCOME BUND/Strategie zu MSVOL FIXED INCOME BUND 18.03.19		19.987.200	19.987.200

GBP

Total Return SWAP LIBOR (GBP) 6 Monate/STRATEGIE JPM HCT UK Domestic Long 15.02.19	0	20.489.300
Total Return SWAP LIBOR (GBP) 6 Monate/STRATEGIE JPM HCT UK Domestic Long 15.08.19	37.396.368	37.396.368
Total Return SWAP LIBOR (GBP) 6 Monate/STRATEGIE JPM HCT UK Domestic Long 15.08.19	28.695.087	28.695.087
Total Return SWAP LIBOR (GBP) 6 Monate/STRATEGIE JPM HCT UK Domestic Long 15.08.19	19.248.822	19.248.822

HUF

SWAP BUBOR (HUF) 6 Monate/2.2300% 18.04.2024	31.900.000.000	31.900.000.000
SWAP BUBOR (HUF) 6 Monate/2.2300% 18.04.2024	31.900.000.000	31.900.000.000
SWAP 1.0000%/BUBOR (HUF) 6 Monate 23.01.2023	10.000.000.000	0
SWAP 1.0000%/BUBOR (HUF) 6 Monate 23.01.2023	0	10.000.000.000
SWAP 1.3000%/BUBOR (HUF) 6 Monate 18.04.2022	31.300.000.000	31.300.000.000
SWAP 1.3000%/BUBOR (HUF) 6 Monate 18.04.2022	31.300.000.000	31.300.000.000

JPY

SWAP LIBOR (JPY) 6 Monate/0.2900% 27.03.2028	5.350.000.000	0
SWAP LIBOR (JPY) 6 Monate/0.2900% 27.03.2028	0	5.350.000.000
SWAP LIBOR (JPY) 6 Monate/0.3250% 12.06.2028	2.600.000.000	0
SWAP LIBOR (JPY) 6 Monate/0.3250% 12.06.2028	0	2.600.000.000
SWAP LIBOR (JPY) 6 Monate/0.3850% 17.07.2028	5.400.000.000	0

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Berichtes.

UniAbsoluterErtrag

ISIN	Wertpapiere	Zugänge	Abgänge
	SWAP LIBOR (JPY) 6 Monate/0.3850% 17.07.2028	0	5.400.000.000
	SWAP 0.1130%/LIBOR (JPY) 6 Monate 27.03.2023	10.700.000.000	0
	SWAP 0.1130%/LIBOR (JPY) 6 Monate 27.03.2023	0	10.700.000.000
	SWAP 0.1225%/LIBOR (JPY) 6 Monate 12.06.2023	5.300.000.000	0
	SWAP 0.1225%/LIBOR (JPY) 6 Monate 12.06.2023	0	5.300.000.000
	SWAP 0.1620%/LIBOR (JPY) 6 Monate 17.07.2023	10.700.000.000	0
	SWAP 0.1620%/LIBOR (JPY) 6 Monate 17.07.2023	0	10.700.000.000
	Total Return SWAP STRATEGIE JPM Japan Financials/STRATEGIE JPM Japan Financials 15.08.19	4.050.028.000	4.050.028.000
	Total Return SWAP STRATEGIE JPM Japan Financials/STRATEGIE JPM Japan Financials 15.08.19	2.025.014.000	2.025.014.000
	Total Return SWAP STRATEGIE JPM Japan Financials/STRATEGIE JPM Japan Financials 20.09.18	0	2.115.200.000
	Total Return SWAP STRATEGIE JPM Japan Financials/STRATEGIE JPM Japan Financials 20.09.18	0	2.115.200.000
	Total Return SWAP STRATEGIE JPM JAPAN LABOUR SHORTAGE/STRATEGIE JPM JAPAN LABOUR SHORTAGE 15.08.19	1.291.273.750	1.291.273.750
	Total Return SWAP STRATEGIE JPM VOL EQUITY NKY/STRATEGIE JPM VOL EQUITY NKY 15.02.19	0	1.266.340.800
	Total Return SWAP STRATEGIE JPM VOL EQUITY NKY/STRATEGIE JPM VOL EQUITY NKY 15.08.19	516.328.400	516.328.400
	Total Return SWAP STRATEGIE MS Japan Buyback/STRATEGIE MS Japan Buyback 02.11.18	0	2.412.979.489
PLN			
	SWAP 2.1525%/WIBOR Warsaw Interbank 6 Months Offered Rate 04.10.2020	220.000.000	0
	SWAP 2.1525%/WIBOR Warsaw Interbank 6 Months Offered Rate 04.10.2020	0	220.000.000
SEK			
	SWAP STIBOR (SEK) 3 Monate/2.0350% 14.11.2027	626.000.000	0
	SWAP STIBOR (SEK) 3 Monate/2.0350% 14.11.2027	0	626.000.000
	SWAP 0.3975%/STIBOR (SEK) 3 Monate 14.03.2024	425.000.000	425.000.000
	SWAP 0.3975%/STIBOR (SEK) 3 Monate 14.03.2024	425.000.000	425.000.000
USD			
	Excess Return SWAP/Barclays Liquidity Nearby 1717 BCI Energy and Industrial Metals Capped Strategy 16.04.18	0	25.000.000
	Excess Return SWAP/Barclays Liquidity Nearby 1717 BCI Energy and Industrial Metals Capped Strategy 18.04.19	25.000.000	25.000.000
	Excess Return SWAP/Barclays Liquidity Nearby 1720 BCI Energy and Industrial Metals Capped Strategy 16.04.18	0	25.000.000
	Excess Return SWAP/Barclays Liquidity Nearby 1720 BCI Energy and Industrial Metals Capped Strategy 18.04.19	25.000.000	25.000.000
	Excess Return SWAP/DB Commodity Deferred 6 Index 11.10.18	0	27.000.000
	Excess Return SWAP/DB Commodity Nearby 6 Index 11.10.18	0	27.000.000
	Excess Return SWAP/DB Commodity Volatilit.Premium III Index (USD) 27.11.18	50.037.956	50.037.956
	Excess Return SWAP/DB Commodity Volatilit.Premium III Index (USD) 27.11.18	5.000.000	5.000.000
	Excess Return SWAP/DB Commodity Volatilit.Premium III Index (USD) 27.11.19	56.345.919	56.345.919
	Excess Return SWAP/DB Commodity Volatilit.Premium Index (USD) 08.02.19	87.543	15.072.164
	Excess Return SWAP/DB Commodity Volatilit.Premium Index (USD) 13.02.19	82.468	14.198.368
	Excess Return SWAP/DB Commodity Volatilit.Premium Index (USD) 27.11.18	3.900.000	3.900.000
	Excess Return SWAP/DB Commodity Volatilit.Premium Index (USD) 27.11.18	71.137	12.247.488
	Excess Return SWAP/DB Commodity Volatilit.Premium Index (USD) 27.11.18	70.507	12.139.103
	Excess Return SWAP/DB Commodity Volatilit.Premium Index (USD) 27.11.18	69.814	12.019.812
	Excess Return SWAP/Deutsche Bank AG Commodity Momentum Alpha Long Index 11.10.18	4.200.000	4.200.000
	Excess Return SWAP/Deutsche Bank AG Commodity Momentum Alpha Long Index 11.10.18	0	7.000.000
	Excess Return SWAP/Deutsche Bank AG Commodity Momentum Alpha Short Index 11.10.18	4.200.000	4.200.000
	Excess Return SWAP/Deutsche Bank AG Commodity Momentum Alpha Short Index 11.10.18	0	7.000.000
	Excess Return SWAP/J.P. Morgan Locator Strategy exAL 11.10.18	749.302	25.870.201
	Excess Return SWAP/J.P. Morgan Locator Strategy exAL 16.12.19	25.000.000	25.000.000
	Excess Return SWAP/Morgan Stanley Anti Radar ex Agriculture & Livestock ER Index 11.10.18	11.825.172	176.825.172
	Excess Return SWAP/Morgan Stanley Anti Radar ex Agriculture & Livestock ER Index 16.12.19	165.000.000	165.000.000
	Excess Return SWAP/Morgan Stanley Dynamic Weekly Backwardated Basket XAL (UCITS) Index 11.10.18	2.700.000	2.700.000
	Excess Return SWAP/Morgan Stanley Dynamic Weekly Backwardated Basket XAL (UCITS) Index 11.10.18	0	3.500.000
	Excess Return SWAP/Morgan Stanley Dynamic Weekly Contango Basket XAL (UCITS) Index 11.10.18	2.700.000	2.700.000
	Excess Return SWAP/Morgan Stanley Dynamic Weekly Contango Basket XAL (UCITS) Index 11.10.18	0	3.500.000
	Excess Return SWAP/MS Radar ex Agri & Lvstk Finl Index 11.10.18	16.854.942	181.854.942
	Excess Return SWAP/MS Radar ex Agri & Lvstk Finl Index 16.12.19	165.000.000	165.000.000
	SWAP Federal Funds Effective Rate US 1 Day USD/ 29.07.2020	160.000.000	160.000.000
	SWAP Federal Funds Effective Rate US 1 Day USD/ 29.07.2020	160.000.000	160.000.000
	SWAP LIBOR (USD) 3 Monate/2.2050% 20.11.2020	367.300.000	0
	SWAP LIBOR (USD) 3 Monate/2.2050% 20.11.2020	0	367.300.000
	SWAP LIBOR (USD) 3 Monate/2.4530% 13.01.2021	633.000.000	0
	SWAP LIBOR (USD) 3 Monate/2.4530% 13.01.2021	0	633.000.000
	SWAP LIBOR (USD) 3 Monate/2.5425% 11.05.2037	31.000.000	0
	SWAP LIBOR (USD) 3 Monate/2.5425% 11.05.2037	0	31.000.000
	SWAP LIBOR (USD) 3 Monate/2.7650% 29.07.2020	160.000.000	160.000.000
	SWAP LIBOR (USD) 3 Monate/2.7650% 29.07.2020	160.000.000	160.000.000

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Berichtes.

UniAbsoluterErtrag

ISIN	Wertpapiere	Zugänge	Abgänge
SWAP LIBOR (USD) 3 Monate/2.8220% 02.02.2038		24.000.000	0
SWAP LIBOR (USD) 3 Monate/2.8220% 02.02.2038		0	24.000.000
SWAP LIBOR (USD) 3 Monate/2.9270% 29.08.2028		137.000.000	137.000.000
SWAP LIBOR (USD) 3 Monate/2.9270% 29.08.2028		137.000.000	137.000.000
SWAP LIBOR (USD) 3 Monate/2.9485% 04.09.2028		68.500.000	68.500.000
SWAP LIBOR (USD) 3 Monate/2.9485% 04.09.2028		68.500.000	68.500.000
SWAP LIBOR (USD) 3 Monate/3.1100% 30.01.2024		100.000.000	100.000.000
SWAP LIBOR (USD) 3 Monate/3.1100% 30.01.2024		100.000.000	100.000.000
SWAP US CPI Urban Consumer Non Seasonal Adjusted Index/2.1437% 08.11.2027		90.000.000	0
SWAP US CPI Urban Consumer Non Seasonal Adjusted Index/2.1437% 08.11.2027		0	90.000.000
SWAP US CPI Urban Consumer Non Seasonal Adjusted Index/2.1645% 01.12.2027		90.000.000	0
SWAP US CPI Urban Consumer Non Seasonal Adjusted Index/2.1645% 01.12.2027		0	90.000.000
SWAP US CPI Urban Consumer Non Seasonal Adjusted Index/2.1662% 28.09.2027		180.000.000	0
SWAP US CPI Urban Consumer Non Seasonal Adjusted Index/2.1662% 28.09.2027		0	180.000.000
SWAP US CPI Urban Consumer Non Seasonal Adjusted Index/2.1700% 20.06.2020		146.000.000	146.000.000
SWAP US CPI Urban Consumer Non Seasonal Adjusted Index/2.1700% 20.06.2020		146.000.000	146.000.000
SWAP US CPI Urban Consumer Non Seasonal Adjusted Index/2.2025% 27.06.2020		150.000.000	150.000.000
SWAP US CPI Urban Consumer Non Seasonal Adjusted Index/2.2025% 27.06.2020		150.000.000	150.000.000
SWAP 2.0325%/US CPI Urban Consumer Non Seasonal Adjusted Index 01.12.2022		90.000.000	0
SWAP 2.0325%/US CPI Urban Consumer Non Seasonal Adjusted Index 01.12.2022		0	90.000.000
SWAP 2.0475%/US CPI Urban Consumer Non Seasonal Adjusted Index 08.11.2022		90.000.000	0
SWAP 2.0475%/US CPI Urban Consumer Non Seasonal Adjusted Index 08.11.2022		0	90.000.000
SWAP 2.0625%/LIBOR (USD) 3 Monate 20.11.2019		360.300.000	0
SWAP 2.0625%/LIBOR (USD) 3 Monate 20.11.2019		0	360.300.000
SWAP 2.0650%/US CPI Urban Consumer Non Seasonal Adjusted Index 28.09.2022		180.000.000	0
SWAP 2.0650%/US CPI Urban Consumer Non Seasonal Adjusted Index 28.09.2022		0	180.000.000
SWAP 2.3225%/LIBOR (USD) 3 Monate 11.05.2027		55.000.000	0
SWAP 2.3225%/LIBOR (USD) 3 Monate 11.05.2027		0	55.000.000
SWAP 2.3475%/LIBOR (USD) 3 Monate 11.01.2020		616.000.000	0
SWAP 2.3475%/LIBOR (USD) 3 Monate 11.01.2020		0	616.000.000
SWAP 2.7200%/LIBOR (USD) 3 Monate 02.02.2028		42.000.000	0
SWAP 2.7200%/LIBOR (USD) 3 Monate 02.02.2028		0	42.000.000
SWAP 2.8825%/LIBOR (USD) 3 Monate 29.08.2023		129.000.000	129.000.000
SWAP 2.8825%/LIBOR (USD) 3 Monate 29.08.2023		129.000.000	129.000.000
SWAP 2.9040%/LIBOR (USD) 3 Monate 04.09.2023		64.300.000	64.300.000
SWAP 2.9040%/LIBOR (USD) 3 Monate 04.09.2023		64.300.000	64.300.000
SWAP 2.9465%/LIBOR (USD) 3 Monate 29.08.2048		29.000.000	29.000.000
SWAP 2.9465%/LIBOR (USD) 3 Monate 29.08.2048		29.000.000	29.000.000
SWAP 2.9700%/LIBOR (USD) 3 Monate 04.09.2048		14.500.000	14.500.000
SWAP 2.9700%/LIBOR (USD) 3 Monate 04.09.2048		14.500.000	14.500.000
SWAP 3.0100%/LIBOR (USD) 3 Monate 11.09.2028		70.900.000	70.900.000
SWAP 3.0100%/LIBOR (USD) 3 Monate 11.09.2028		70.900.000	70.900.000
SWAP 3.0555%/LIBOR (USD) 3 Monate 11.09.2028		28.400.000	28.400.000
SWAP 3.0555%/LIBOR (USD) 3 Monate 11.09.2028		28.400.000	28.400.000
SWAP 3.1100%/LIBOR (USD) 3 Monate 30.01.2021		120.000.000	120.000.000
SWAP 3.1100%/LIBOR (USD) 3 Monate 30.01.2021		120.000.000	120.000.000
SWAP 3.1800%/LIBOR (USD) 3 Monate 30.01.2029		27.000.000	27.000.000
SWAP 3.1800%/LIBOR (USD) 3 Monate 30.01.2029		27.000.000	27.000.000
Total Return SWAP LIBOR (USD) 3 Monate/S&P 500 Index TR 21.01.19		459.147	12.959.147
Total Return SWAP S&P Regional Banks Select Industry Index/LIBOR (USD) 3 Monate 21.01.19		470.307	12.970.307
Total Return SWAP STRATEGIE MS UI CUBE RATES/STRATEGIE MS UI CUBE RATES 20.03.19		0	87.017.400
Total Return SWAP STRATEGIE BARC COMMODITY LIQUIDITY/STRATEGIE BARC COMMODITY LIQUIDITY 18.10.19		24.998.507	24.998.507
Total Return SWAP STRATEGIE Barclays FX Month End/STRATEGIE Barclays FX Month End 19.07.19		12.801.660	12.801.660
Total Return SWAP STRATEGIE Barclays FX Month End/STRATEGIE Barclays FX Month End 23.04.19		0	9.546.188
Total Return SWAP STRATEGIE BARCLAYS RATES CARRY/STRATEGIE BARCLAYS RATES CARRY 18.10.19		91.052.630	91.052.630
Total Return SWAP STRATEGIE BARCLAYS RATES CARRY/STRATEGIE BARCLAYS RATES CARRY 19.04.19		0	25.107.376
Total Return SWAP STRATEGIE BARCLAYS RATES CARRY/STRATEGIE BARCLAYS RATES CARRY 19.07.19		50.747.168	50.747.168
Total Return SWAP STRATEGIE BARCLAYS RATES MOMENTUM/STRATEGIE BARCLAYS RATES MOMENTUM 18.10.19		44.010.042	44.010.042
Total Return SWAP STRATEGIE BARCLAYS RATES MOMENTUM/STRATEGIE BARCLAYS RATES MOMENTUM 19.04.19		0	13.602.272
Total Return SWAP STRATEGIE BARCLAYS RATES MOMENTUM/STRATEGIE BARCLAYS RATES MOMENTUM 19.07.19		27.635.520	27.635.520
Total Return SWAP STRATEGIE BARCLAYS WEEKLY VAR US HOURLY/STRATEGIE BARCLAYS WEEKLY VAR US HOURLY 18.10.19		57.616.399	57.616.399
Total Return SWAP STRATEGIE BARCLAYS WEEKLY VAR US HOURLY/STRATEGIE BARCLAYS WEEKLY VAR US HOURLY 18.10.19		35.685.329	35.685.329
Total Return SWAP STRATEGIE BARCLAYS WEEKLY VAR US HOURLY/STRATEGIE BARCLAYS WEEKLY VAR US HOURLY 19.07.19		17.842.665	17.842.665
Total Return SWAP STRATEGIE BARCLAYS WEEKLY VAR US HOURLY/STRATEGIE BARCLAYS WEEKLY VAR US HOURLY 19.07.19		13.409.279	13.409.279
Total Return SWAP STRATEGIE Barclays Weekly Var US/STRATEGIE Barclays Weekly Var US 18.04.19		13.555.297	13.555.297

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Berichtes.

ISIN	Wertpapiere	Zugänge	Abgänge
	Total Return SWAP STRATEGIE DB Healthcare IT/STRATEGIE DB Healthcare IT 15.03.19	12.130.919	12.130.919
	Total Return SWAP Strategie DB VIX Intraday Curve/Strategie DB VIX Intraday Curve 13.12.19	22.116.800	22.116.800
	Total Return SWAP STRATEGIE Dte. Bank Commodity Curve Spread Long Short USD ER Index/STRATEGIE Dte. Bank Commodity Curve	17.472.429	17.472.429
	Total Return SWAP STRATEGIE Dte. Bank Commodity Momentum Alpha Long Short USD ER Index/STRATEGIE Dte. Bank Commodity Mom	4.228.808	4.228.808
	Total Return SWAP STRATEGIE GS INTRADAY TREND VIX ER STRATEGY/STRATEGIE GS INTRADAY TREND VIX ER STRATEGY 04.12.18	0	23.892.000
	Total Return SWAP Strategie JP Morgan EM Select/Strategie JP Morgan EM Select 14.02.20	41.014.920	41.014.920
	Total Return SWAP STRATEGIE JPM BuyBack US/STRATEGIE JPM BuyBack US 15.02.19	30.540.300	30.540.300
	Total Return SWAP STRATEGIE JPM BuyBack US/STRATEGIE JPM BuyBack US 15.05.19	40.170.040	40.170.040
	Total Return SWAP STRATEGIE JPM BuyBack US/STRATEGIE JPM BuyBack US 15.08.19	28.868.310	28.868.310
	Total Return SWAP STRATEGIE JPM Financial Leverage/STRATEGIE JPM Financial Leverage 15.02.19	0	25.060.025
	Total Return SWAP STRATEGIE JPM Financial Leverage/STRATEGIE JPM Financial Leverage 15.08.19	39.184.764	39.184.764
	Total Return SWAP STRATEGIE JPM FSI EM/STRATEGIE JPM FSI EM 15.02.19	0	25.318.325
	Total Return SWAP STRATEGIE JPM HCT Cyber Security/STRATEGIE JPM HCT Cyber Security 02.08.18	660.550	11.906.950
	Total Return SWAP STRATEGIE JPM HCT Cyber Security/STRATEGIE JPM HCT Cyber Security 15.08.19	35.214.514	35.214.514
	Total Return SWAP STRATEGIE JPM HCT Cyber Security/STRATEGIE JPM HCT Cyber Security 15.08.19	23.119.206	23.119.206
	Total Return SWAP STRATEGIE JPM HCT Cyber Security/STRATEGIE JPM HCT Cyber Security 31.07.18	728.200	11.974.600
	Total Return SWAP Strategie JPM Healthcare IT/Strategie JPM Healthcare IT 15.08.19	25.618.560	25.618.560
	Total Return SWAP Strategie JPM ItalyHygiene/Strategie JPM ItalyHygiene 15.08.19	11.925.552	11.925.552
	Total Return SWAP Strategie JPM Northamerica Quality/Strategie JPM Northamerica Quality 15.08.19	23.299.161	23.299.161
	Total Return SWAP STRATEGIE JPM Oil Services/STRATEGIE JPM Oil Services 15.02.19	0	12.440.662
	Total Return SWAP STRATEGIE JPM Oil Services/STRATEGIE JPM Oil Services 15.08.19	18.407.786	18.407.786
	Total Return SWAP STRATEGIE JPM PROFITEURE LNG LONG/LIBOR (USD) 6 Monate 15.02.19	0	12.725.063
	Total Return SWAP STRATEGIE JPM PROFITEURE LNG LONG/LIBOR (USD) 6 Monate 15.08.19	18.476.549	18.476.549
	Total Return SWAP STRATEGIE JPM SPX Intraday Trend/STRATEGIE JPM SPX Intraday Trend 15.05.19	24.688.800	24.688.800
	Total Return SWAP Strategie JPM UI Dynamic Hedge Index/Strategie JPM UI Dynamic Hedge Index 15.08.19	23.899.348	23.899.348
	Total Return SWAP STRATEGIE JPM US Regional Banks/STRATEGIE JPM US Regional Banks 15.05.19	12.685.200	12.685.200
	Total Return SWAP STRATEGIE JPM Value Sectorneutral/STRATEGIE JPM Value Sectorneutral 15.02.19	181.575	60.659.460
	Total Return SWAP STRATEGIE JPM Value Tax/STRATEGIE JPM Value Tax 15.02.19	0	51.715.500
	Total Return SWAP STRATEGIE JPM VIX INTRADAY CURVE STRATEGY/STRATEGIE JPM VIX INTRADAY CURVE STRATEGY 15.02.19	0	25.704.000
	Total Return SWAP STRATEGIE JPM VIX INTRADAY CURVE 2 STRATEGY/STRATEGIE JPM VIX INTRADAY CURVE 2 STRATEGY 15.05.19	23.794.500	23.794.500
	Total Return SWAP Strategie MS Global Equity Volatility/Strategie MS Global Equity Volatility 17.12.18	37.500	15.291.000
	Total Return SWAP Strategie MS Vol Fixed Income TY Index/Strategie MS Vol Fixed Income TY Index 18.03.19	12.545.000	12.545.000
	Total Return SWAP STRATEGIE US Equity Tail Hedge Index/STRATEGIE US Equity Tail Hedge Index 18.12.18	2.400	11.279.200
	Total Return SWAP STRATEGIE zu MS FX Carry DM/STRATEGIE zu MS FX Carry DM 22.03.19	5.725	218.975
	Total Return SWAP Strategie zu MS Global Rates Curve Carry/Strategie zu MS Global Rates Curve Carry 20.09.19	50.596.650	50.596.650
	Total Return SWAP STRATEGIE zu MS Rates Momentum ExtUni Strategy/STRATEGIE zu MS Rates Momentum ExtUni Strategy 20.09.19	20.129.600	20.129.600

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

Erläuterungen zum Bericht per Ende März 2019

Die Buchführung des Fonds erfolgt in Euro.

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

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

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

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

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

Das Bankguthaben wurde mit dem Nennwert angesetzt.

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

Die Zinsabgrenzung enthält die Stückzinsen zum Ende des Geschäftsjahres.

Die Position Zinsen auf Anleihen enthält, soweit zutreffend, auch anteilige Erträge aufgrund von Emissionsrenditen.

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

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

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

Einzelne Anteilklassen des Fonds unterliegen einer erfolgsabhängigen Vergütung, die auf der Grundlage der im Prospekt definierten Modalitäten von der Verwaltungsgesellschaft erhoben wird. Die erfolgsabhängige Verwaltungsvergütung für das zum 31. März 2019 endende Geschäftsjahr wird täglich abgegrenzt und erfolgswirksam erfasst. Die im Geschäftsjahr zahlungswirksamen Beträge werden in der Ertrags- und Aufwandsrechnung unter der Position „Erfolgsabhängige Verwaltungsvergütung“ ausgewiesen, die abgegrenzten Beträge sind in der Position „Nettoveränderung nicht realisierter Verluste“ enthalten.

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

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

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

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

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

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

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

Für die Berechnung der Kennzahl „Laufende Kosten“ wurde die Berechnungsmethode, die dem Committee of European Securities Regulators (Rundschreiben CESR/10-674 vom 1. Juli 2010) entspricht, angewandt.

Die laufenden Kosten geben an, wie stark das Fondsvermögen mit Kosten belastet wurde und können von Jahr zu Jahr schwanken. Berücksichtigt werden neben der Verwaltungsvergütung und Pauschalgebühr sowie der Taxe d'abonnement alle übrigen Kosten, die im Fonds angefallen sind. Bei Fonds mit wesentlichem Anteil an anderen Fonds werden die Kosten dieser Fonds mitberücksichtigt. Diese Kennzahl weist den Gesamtbetrag dieser Kosten als Prozentsatz des durchschnittlichen Fondsvolumens innerhalb eines Geschäftsjahres aus. Eine etwaige erfolgsabhängige Vergütung sowie die anfallenden Transaktionskosten - mit Ausnahme der Transaktionskosten der Verwahrstelle - sind in der Kennzahl „Laufende Kosten“ nicht berücksichtigt.

Die Transaktionskosten bezeichnen sämtliche Kosten, die im Geschäftsjahr für Rechnung des Fonds separat ausgewiesen bzw. abgerechnet wurden und in direktem Zusammenhang mit einem Kauf oder Verkauf von Vermögensgegenständen stehen.

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

Hinweis auf das Gesetz vom 17. Dezember 2010

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

Bericht des Réviseur d'entreprises agréé

An die Anteilscheininhaber des
UniAbsoluterErtrag

Bericht über die Jahresabschlussprüfung

Prüfungsurteil

Wir haben den Jahresabschluss des UniAbsoluterErtrag (der "Fonds") - bestehend aus der Zusammensetzung des Fondsvermögens und der Vermögensaufstellung zum 31. März 2019, der Aufwands- und Ertragsrechnung und der Veränderung des Fondsvermögens für das zu diesem Datum endende Geschäftsjahr sowie den Erläuterungen mit einer Zusammenfassung wesentlicher Rechnungslegungsmethoden - geprüft.

Nach unserer Beurteilung vermittelt der beigefügte Jahresabschluss des Fonds, in Übereinstimmung mit den in Luxemburg geltenden gesetzlichen Bestimmungen und Verordnungen betreffend die Aufstellung und Darstellung von Jahresabschlüssen, ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild der Vermögens- und Finanzlage zum 31. März 2019 sowie der Ertragslage und der Entwicklung des Nettovermögenswertes für das zu diesem Datum endende Geschäftsjahr.

Grundlage für das Prüfungsurteil

Wir führten unsere Abschlussprüfung in Übereinstimmung mit dem Gesetz über die Prüfungstätigkeit (das "Gesetz vom 23. Juli 2016") und nach den für Luxemburg von der Commission de Surveillance du Secteur Financier ("CSSF") angenommenen internationalen Prüfungsstandards ("ISA") durch. Unsere Verantwortung gemäß dieser Verordnung, dem Gesetz vom 23. Juli 2016 und diesen Standards wird im Abschnitt « Verantwortung des Réviseur d'entreprises agréé für die Jahresabschlussprüfung » weitergehend beschrieben. Wir sind in Bezug auf den Fonds unabhängig, in Übereinstimmung mit dem für Luxemburg von der CSSF angenommenen „International Ethics Standards Board for Accountants' Code of Ethics for Professional Accountants“ („IESBA Code“) sowie den beruflichen Verhaltensanforderungen, welche im Rahmen der Jahresabschlussprüfung einzuhalten sind und haben alle sonstigen Berufspflichten in Übereinstimmung mit diesen Verhaltensanforderungen erfüllt. Wir sind der Auffassung, dass die von uns erlangten Prüfungsnachweise ausreichend und geeignet sind, um als Grundlage für unser Prüfungsurteil zu dienen.

Sonstige Informationen

Der Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft ist verantwortlich für die sonstigen Informationen. Diese stellen Informationen dar, welche im Jahresbericht enthalten sind, jedoch nicht Teil des Jahresabschlusses oder unseres Berichts des Réviseur d'entreprises agréé zu diesem Jahresabschluss sind.

Unser Prüfungsurteil zum Jahresabschluss deckt nicht die sonstigen Informationen ab und wir geben keinerlei Sicherheit jedweder Art auf diese Informationen.

Im Zusammenhang mit der Prüfung des Jahresabschlusses besteht unsere Verantwortung darin, die sonstigen Informationen zu lesen und dabei zu beurteilen, ob eine wesentliche Unstimmigkeit zwischen diesen und dem Jahresabschluss oder mit den bei der Abschlussprüfung gewonnenen Erkenntnissen besteht oder die sonstigen Informationen auch ansonsten wesentlich falsch dargestellt erscheinen. Sollten wir auf Basis der von uns durchgeführten Tätigkeiten schlussfolgern, dass die sonstigen Informationen wesentliche falsche Darstellungen enthalten, sind wir verpflichtet, diesen Sachverhalt zu berichten. Wir haben diesbezüglich nichts zu berichten.

Verantwortung des Verwaltungsrats der Verwaltungsgesellschaft für den Jahresabschluss

Der Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft ist verantwortlich für die Aufstellung und sachgerechte Gesamtdarstellung des Jahresabschlusses in Übereinstimmung mit den in Luxemburg geltenden gesetzlichen Bestimmungen und Verordnungen zur Aufstellung und Darstellung des Jahresabschlusses und für die internen Kontrollen, die der Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft als notwendig erachtet, um eine Aufstellung des Jahresabschlusses zu ermöglichen, der frei von wesentlichen beabsichtigten oder unbeabsichtigten falschen Darstellungen ist.

Im Rahmen der Aufstellung des Jahresabschlusses liegt es im Verantwortungsbereich des Verwaltungsrates der Verwaltungsgesellschaft, die Fähigkeit des Fonds zur Fortführung der Geschäftstätigkeit zu beurteilen und, soweit zutreffend, Fragen in Bezug auf die Fortführung der Geschäftstätigkeit und Anwendung des Rechnungslegungsgrundsatzes der Geschäftsführung mitzuteilen, sofern der Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft nicht beabsichtigt, den Fonds zu liquidieren oder die Geschäftstätigkeit einzustellen oder ihm keine andere realistische Alternative zur Verfügung steht.

Verantwortung des Réviseur d'entreprises agréé für die Jahresabschlussprüfung

Zielsetzung unserer Prüfung ist die Erlangung einer hinreichenden Sicherheit, ob der Jahresabschluss als Ganzes frei von wesentlichen, beabsichtigten oder unbeabsichtigten falschen Darstellungen ist und hierzu einen Bericht des Réviseur d'entreprises agréé zu erstellen, der unser Prüfungsurteil enthält. Hinreichende Sicherheit entspricht einem hohen Grad an Sicherheit, ist jedoch keine Garantie dafür, dass eine in Übereinstimmung mit dem Gesetz vom 23. Juli 2016 und mit den für Luxemburg von der CSSF angenommenen ISAs durchgeführte Prüfung stets eine wesentliche falsche Darstellung, soweit vorhanden, aufdeckt. Falsche Darstellungen können entweder aus Unrichtigkeiten oder aus Verstößen resultieren und werden als wesentlich angesehen, wenn vernünftigerweise davon ausgegangen werden kann, dass diese individuell oder insgesamt die auf der Grundlage dieses Jahresabschlusses getroffenen wirtschaftlichen Entscheidungen von Adressaten beeinflussen.

Im Rahmen einer Abschlussprüfung in Übereinstimmung mit dem Gesetz vom 23. Juli 2016 und nach den für Luxemburg von der CSSF angenommenen ISAs üben wir unser pflichtgemäßes Ermessen aus und bewahren eine kritische Grundhaltung. Darüber hinaus:

- Identifizieren und beurteilen wir das Risiko wesentlicher Falschdarstellungen im Jahresabschluss infolge von Unrichtigkeiten oder Verstößen, planen und führen Prüfungshandlungen als Antwort auf diese Risiken durch und erlangen Prüfungsnachweise, die ausreichend und angemessen sind, um unser Prüfungsurteil herzuleiten. Das Risiko, dass wesentliche Falschdarstellungen nicht aufgedeckt werden, ist bei Verstößen höher als bei Unrichtigkeiten, da Verstöße betrügerisches Zusammenwirken, Fälschungen, beabsichtigte Unvollständigkeiten, irreführende Angaben bzw. das Außerkraftsetzen interner Kontrollen beinhalten können.
- Gewinnen wir ein Verständnis des für die Abschlussprüfung relevanten internen Kontrollsystems, um Prüfungshandlungen zu planen, die unter den gegebenen Umständen angemessen sind, nicht jedoch mit dem Ziel, ein Prüfungsurteil zur Wirksamkeit des internen Kontrollsystems des Fonds abzugeben.
- Beurteilen wir die Angemessenheit der vom Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft angewandten Bilanzierungsmethoden, der rechnungslegungsrelevanten Schätzungen und den entsprechenden Anhangangaben.

- Schlussfolgern wir über die Angemessenheit der Anwendung des Rechnungslegungsgrundsatzes der Fortführung der Geschäftstätigkeit durch den Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft sowie auf der Grundlage der erlangten Prüfungsnachweise, ob eine wesentliche Unsicherheit im Zusammenhang mit Ereignissen oder Gegebenheiten besteht, die wesentliche Zweifel an der Fähigkeit des Fonds zur Fortführung der Geschäftstätigkeit aufwerfen könnten. Sollten wir schlussfolgern, dass eine wesentliche Unsicherheit besteht, sind wir verpflichtet im Bericht des Réviseur d'entreprises agréé auf die dazugehörigen Anhangangaben im Jahresabschluss hinzuweisen, oder, falls die Angaben unangemessen sind, das Prüfungsurteil zu modifizieren. Diese Schlussfolgerungen basieren auf der Grundlage der bis zum Datum des Berichts des Réviseur d'entreprises agréé erlangten Prüfungsnachweise. Zukünftige Ereignisse oder Gegebenheiten können jedoch dazu führen, dass der Fonds seine Geschäftstätigkeit nicht mehr fortführen kann.
- Beurteilen wir die Gesamtdarstellung, den Aufbau und den Inhalt des Jahresabschlusses einschließlich der Anhangangaben und beurteilen, ob dieser die zugrundeliegenden Geschäftsvorfälle und Ereignisse sachgerecht darstellt.

Wir teilen den für die Überwachung Verantwortlichen unter anderem den geplanten Prüfungsumfang und -zeitraum sowie die wesentlichen Prüfungsfeststellungen einschließlich wesentlicher Schwächen im internen Kontrollsystem mit, die wir im Rahmen der Prüfung identifizieren.

ERNST & YOUNG
Société Anonyme
Cabinet de révision agréé

Dr. Christoph Haas

Luxemburg, 21. Juni 2019

Sonstige Informationen der Verwaltungsgesellschaft

Sonstige Angaben

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

Der Anteil der Wertpapiertransaktionen, die im Berichtszeitraum vom 1. April 2018 bis 31. März 2019 für Rechnung der von der Union Investment Luxembourg S.A. verwalteten Publikumsfonds mit im Konzernverbund stehenden oder über wesentliche Beteiligungen verbundene Unternehmen ausgeführt wurden, betrug 5,05 Prozent. Ihr Umfang belief sich hierbei auf insgesamt 2.753.739.430,89 Euro.

Informationen zum Risikomanagementverfahren

Die zur Überwachung des mit Derivaten verbundenen Gesamtrisikos herangezogene Methode ist der absolute VaR-Ansatz.

Das zur Ermittlung des absoluten VaR-Ansatzes verwendete Modell ist ein VaR (Value-at-Risk) Modell. Die Kennzahl Value-at-Risk (VaR) ist ein mathematisch statistisches Konzept und gibt den möglichen Verlust eines Portfolios während eines bestimmten Zeitraums, der mit einer bestimmten Wahrscheinlichkeit nicht überschritten wird, an.

Zur Ermittlung der VaR Kennzahl wird eine Monte Carlo Simulation herangezogen. Die verwendeten Parameter dazu sind:

- Haltedauer: 20 Tage
- Konfidenzniveau: 99%
- Historischer Beobachtungszeitraum: 1 Jahr (gleichgewichtet)

Die anhand des oben erläuterten Modells ermittelte Auslastung des mit Derivaten verbundenen Gesamtrisikos und entsprechender Limitauslastung bei einem aufsichtsrechtlichen Limit von 20% betrug für den minimalen, maximalen und durchschnittlich berechneten VaR Wert:

Minimum VaR 0,84%; Limitauslastung 4%,

Maximum VaR 4,08%; Limitauslastung 20%,

Durchschnittlicher VaR 1,41%; Limitauslastung 7%.

Hebelwirkung

Die ermittelte durchschnittliche Hebelwirkung nach der Bruttomethode betrug 742%.

Angaben zur Vergütungspolitik der Union Investment Luxembourg S.A.

Umfang der Vergütungspolitik

Die Vergütungspolitik und -praxis umfasst feste und variable Bestandteile der Gehälter und freiwillige Altersversorgungsleistungen. Die Berechnungsmethodik ist in der Vergütungspolitik sowie in den Ermessensleitlinien und internen Richtlinien der Gesellschaft festgelegt und unterliegt einer regelmäßigen Überprüfung. Die oben genannte Vergütung bezieht sich auf die Gesamtheit der OGAW's und alternativen Investmentfonds, die von der Union Investment Luxembourg S.A. verwaltet werden. Alle Mitarbeiter sind ganzheitlich mit der Verwaltung aller Fonds befasst, so dass eine Aufteilung pro Fonds nicht möglich ist. Bei der Berechnung der Vergütung für das Geschäftsjahr 2018 wurde nicht von der festgelegten Methodik gemäß der Vergütungspolitik sowie den Ermessensleitlinien und internen Richtlinien abgewichen.

Beschreibung der Berechnung der Vergütungselemente

Die Vergütung setzt sich aus folgenden Bestandteilen zusammen:

1) Fixe Vergütungen: Gesamtsumme der im abgelaufenen Geschäftsjahr gezahlten monatlichen Grundgehälter sowie des 13. Tarifgehaltes.

2) Variable Vergütungen: Gesamtsumme der im abgelaufenen Geschäftsjahr gezahlten variablen Vergütungsbestandteile. Hierunter fallen die variable Leistungsvergütung sowie Sonderzahlungen aufgrund des Geschäftsergebnisses.

Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr von der Verwaltungsgesellschaft gezahlten Mitarbeitervergütung (Stand: 31. Dezember 2018)

Personalbestand		67
Feste Vergütung	EUR	4.300.000,00
Variable Vergütung	EUR	1.100.000,00
Gesamtvergütung	EUR	5.400.000,00
Anzahl Mitarbeiter mit Führungsfunktion		12
Gesamtvergütung der Mitarbeiter mit Führungsfunktion	EUR	2.200.000,00

Anzahl der von der Verwaltungsgesellschaft verwalteten Fonds (Stand: 31. Dezember 2018): 167 UCITS und 13 AIF's

Ergänzende Angaben gemäß ESMA - Leitlinien für den UniAbsoluterErtrag

Derivate

Durch OTC und börsengehandelte Derivate erzielter zugrundeliegender Exposure:	EUR	4.542.291.711,31
---	-----	------------------

Identität der Gegenpartei(en) bei diesen Derivategeschäften:

Barclays Bank PLC, London
 BNP Paribas S.A., Paris
 Citigroup Global Markets Ltd., London
 Commerzbank AG, Frankfurt
 Deutsche Bank AG, Frankfurt
 Deutsche Bank AG, London
 DZ PRIVATBANK S.A., Luxemburg
 Goldman Sachs International, London
 J.P. Morgan Securities PLC, London
 Merrill Lynch Intl., London
 Morgan Stanley & Co. Intl. PLC, London
 Nomura International PLC, London
 Société Générale S.A., Paris
 UBS AG London Branch, Zürich

Art und Höhe der entgegengenommenen Sicherheiten (Collateral Received) für OTC Derivate, die auf das Kontrahentenrisiko des OGAW anrechenbar sind:	EUR	5.710.000,00
---	-----	--------------

Davon:

Bankguthaben	EUR	5.710.000,00
Schuldverschreibungen	EUR	0,00
Aktien	EUR	0,00

Techniken für eine effiziente Portfolioverwaltung

Exposure, das durch Techniken für eine effiziente Portfolioverwaltung erzielt wird	EUR	0,00
---	-----	------

Identität der Gegenpartei(en) bei diesen Techniken für eine effiziente Portfolioverwaltung:
 nicht zutreffend

Art und Höhe der entgegengenommenen Sicherheiten (Collateral Received), die auf das Kontrahentenrisiko des OGAW anrechenbar sind:	EUR	0,00
--	-----	------

Davon:

Bankguthaben	EUR	0,00
Schuldverschreibungen	EUR	0,00
Aktien	EUR	0,00

Erträge, die sich aus Wertpapierleihe für eine effiziente Portfolioverwaltung für den gesamten Berichtszeitraum ergeben, einschließlich der angefallenen direkten und indirekten Kosten und Gebühren Klasse A	EUR	1.143,69
---	-----	----------

Erträge, die sich aus Wertpapierleihe für eine effiziente Portfolioverwaltung für den gesamten Berichtszeitraum ergeben, einschließlich der angefallenen direkten und indirekten Kosten und Gebühren Klasse -net- A	EUR	2.305,48
---	-----	----------

Erträge, die sich aus Wertpapierleihe für eine effiziente Portfolioverwaltung für den gesamten Berichtszeitraum ergeben, einschließlich der angefallenen direkten und indirekten Kosten und Gebühren Klasse I	EUR	131,07
---	-----	--------

Die Erträge aus Wertpapierleihgeschäften werden nach Abzug der damit verbundenen Kosten zwischen dem Fonds und der Verwaltungsgesellschaft Union Investment Luxembourg S.A., für ihre Tätigkeit als Agent, aufgeteilt, wobei der mehrheitliche Teil dem Fondsvermögen gutgeschrieben wird.

ZUSÄTZLICHE ANGABEN ZU ENTGEGENGENOMMENEN SICHERHEITEN BEI OTC-DERIVATEN UND TECHNIKEN FÜR EINE EFFIZIENTE PORTFOLIOVERWALTUNG

Identität des Emittenten, wenn die von diesem Emittenten erhaltenen Sicherheiten 20% des Nettoinventarwerts des OGAW überschreiten
 nicht zutreffend

Besicherungen im Zusammenhang mit OTC Derivaten und Techniken für eine effiziente Portfolioverwaltung

Die Besicherung erfolgt nicht vollständig durch Wertpapiere, die von einem EU-Mitgliedstaat begeben oder garantiert werden.

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

	Wertpapierleihe	Pensionsgeschäfte	Total Return Swaps ⁴⁾
Verwendete Vermögensgegenstände			
absolut	nicht zutreffend	nicht zutreffend	3.581.728,57
in % des Fondsvermögens	nicht zutreffend	nicht zutreffend	0,24 %
Zehn größte Gegenparteien ¹⁾			
1. Name	nicht zutreffend	nicht zutreffend	J.P. Morgan Securities PLC, London
1. Bruttovolumen offene Geschäfte	nicht zutreffend	nicht zutreffend	2.783.282,48
1. Sitzstaat	nicht zutreffend	nicht zutreffend	Großbritannien
2. Name	nicht zutreffend	nicht zutreffend	Morgan Stanley & Co. Intl. PLC, London
2. Bruttovolumen offene Geschäfte	nicht zutreffend	nicht zutreffend	654.548,39
2. Sitzstaat	nicht zutreffend	nicht zutreffend	Großbritannien
3. Name	nicht zutreffend	nicht zutreffend	UBS AG London Branch, Zürich
3. Bruttovolumen offene Geschäfte	nicht zutreffend	nicht zutreffend	456.800,50
3. Sitzstaat	nicht zutreffend	nicht zutreffend	Schweiz
4. Name	nicht zutreffend	nicht zutreffend	Goldman Sachs International, London
4. Bruttovolumen offene Geschäfte	nicht zutreffend	nicht zutreffend	-14.800,00
4. Sitzstaat	nicht zutreffend	nicht zutreffend	Großbritannien
5. Name	nicht zutreffend	nicht zutreffend	Deutsche Bank AG, London
5. Bruttovolumen offene Geschäfte	nicht zutreffend	nicht zutreffend	-298.102,80
5. Sitzstaat	nicht zutreffend	nicht zutreffend	Großbritannien
Art(en) von Abwicklung und Clearing (z.B. zweiseitig, dreiseitig, Central Counterparty)			
	nicht zutreffend	nicht zutreffend	zweiseitig
Geschäfte gegliedert nach Restlaufzeiten (absolute Beträge)			
unter 1 Tag	nicht zutreffend	nicht zutreffend	nicht zutreffend
1 Tag bis 1 Woche (= 7 Tage)	nicht zutreffend	nicht zutreffend	nicht zutreffend
1 Woche bis 1 Monat (= 30 Tage)	nicht zutreffend	nicht zutreffend	nicht zutreffend
1 bis 3 Monate	nicht zutreffend	nicht zutreffend	172.600,11
3 Monate bis 1 Jahr (= 365 Tage)	nicht zutreffend	nicht zutreffend	3.409.128,46
über 1 Jahr	nicht zutreffend	nicht zutreffend	nicht zutreffend
unbefristet	nicht zutreffend	nicht zutreffend	nicht zutreffend
Art(en) und Qualität(en) der erhaltenen Sicherheiten			
Arten	nicht zutreffend	nicht zutreffend	Bankguthaben
Qualitäten ²⁾	nicht zutreffend	nicht zutreffend	EUR
Währung(en) der erhaltenen Sicherheiten			
	nicht zutreffend	nicht zutreffend	EUR
Sicherheiten gegliedert nach Restlaufzeiten (absolute Beträge)			
unter 1 Tag	nicht zutreffend	nicht zutreffend	nicht zutreffend
1 Tag bis 1 Woche (= 7 Tage)	nicht zutreffend	nicht zutreffend	nicht zutreffend
1 Woche bis 1 Monat (= 30 Tage)	nicht zutreffend	nicht zutreffend	nicht zutreffend
1 bis 3 Monate	nicht zutreffend	nicht zutreffend	nicht zutreffend
3 Monate bis 1 Jahr (= 365 Tage)	nicht zutreffend	nicht zutreffend	nicht zutreffend
über 1 Jahr	nicht zutreffend	nicht zutreffend	nicht zutreffend
unbefristet	nicht zutreffend	nicht zutreffend	4.610.000,00
Ertrags- und Kostenanteile			
Ertragsanteil des Fonds			
absolut	3.580,24	nicht zutreffend	-10.946.862,70
in % der Bruttoerträge	45,62 %	nicht zutreffend	134,23 %
Kostenanteil des Fonds	4.267,83	nicht zutreffend	2.791.660,92
davon Kosten an Verwaltungsgesellschaft / Ertragsanteil der Verwaltungsgesellschaft			
absolut	3.439,83	nicht zutreffend	nicht zutreffend
in % der Bruttoerträge	43,83 %	nicht zutreffend	nicht zutreffend
davon Kosten an Dritte / Ertragsanteil Dritter			
absolut	828,00	nicht zutreffend	2.791.660,92
in % der Bruttoerträge	10,55 %	nicht zutreffend	-34,23 %

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

nicht zutreffend

Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total Return Swaps**Verleihte Wertpapiere in % aller verleihbaren Vermögensgegenstände des Fonds**

nicht zutreffend

Zehn größte Sicherheitenaussteller, bezogen auf alle Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total Return Swaps ³⁾

1. Name	J.P. Morgan Securities PLC, London
1. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	3.930.000,00
2. Name	Morgan Stanley & Co. Intl. PLC, London
2. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	390.000,00
3. Name	Goldman Sachs International, London
3. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	290.000,00

Wiederangelegte Sicherheiten in % der empfangenen Sicherheiten, bezogen auf alle Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total Return Swapskeine wiederangelegten Sicherheiten;
gemäß Verkaufsprospekt ist bei Bankguthaben eine Wiederanlage zu 100% möglich**Verwahrer / Kontoführer von empfangenen Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps**

Gesamtzahl Verwahrer / Kontoführer	1
1. Name	DZ PRIVATBANK S.A.
1. Verwahrter Betrag absolut	4.610.000,00

Verwahrart begebener Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps

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

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

Verwaltungsgesellschaft und zugleich Hauptverwaltungsgesellschaft

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

Eigenkapital per 31.12.2018:
Euro 169,940 Millionen
nach Gewinnverwendung

Leitungsorgan der Union Investment Luxembourg S.A.:

Verwaltungsrat

Verwaltungsratsvorsitzender

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

Stv. Verwaltungsratsvorsitzender

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

Weitere Mitglieder des Verwaltungsrates

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

Nikolaus SILLEM
Mitglied der Geschäftsführung der
Union Investment Institutional GmbH
Frankfurt am Main

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

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

Karl-Heinz MOLL (bis zum 30.06.2018)
Mitglied des Verwaltungsrates

Karl-Heinz MOLL (ab dem 01.07.2018)
unabhängiges Mitglied des
Verwaltungsrates

Bernd SCHLICHTER
unabhängiges Mitglied des
Verwaltungsrates

Klaus Peter STRÄBER (bis zum 30.06.2018)
unabhängiges Mitglied des
Verwaltungsrates

Geschäftsführer der Union Investment Luxembourg S.A.

Maria LÖWENBRÜCK
Dr. Joachim VON CORNBERG

Gesellschafter der Union Investment Luxembourg S.A.

Union Asset Management Holding AG
Frankfurt am Main

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

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

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

Abschlussprüfer (Réviseur d'entreprises agréé)

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

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

Verwahrstelle und zugleich Hauptzahlstelle

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

Zahl- und Vertriebsstelle im Großherzogtum Luxemburg

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

Zahl- und Vertriebsstellen sowie Informationsstellen in der Bundesrepublik Deutschland

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

BBBank eG
Herrenstraße 2-10
76133 Karlsruhe
Sitz: Karlsruhe

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

Weitere Vertriebsstellen in der Bundesrepublik Deutschland

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

Zahl- und Vertriebsstelle in Österreich

VOLKSBANK WIEN AG
Kolingasse 14-16
A-1090 Wien

Weitere von der Verwaltungsgesellschaft verwaltete Fonds

BBBank Konzept Dividendenwerte Union
Commodities-Invest
FairWorldFonds
LIGA Portfolio Concept
LIGA-Pax-Cattolico-Union
LIGA-Pax-Corporates-Union
LIGA-Pax-Laurent-Union (2022)
PE-Invest SICAV
PrivatFonds: Konsequent
PrivatFonds: Konsequent pro
PrivatFonds: Nachhaltig
Quoniam Funds Selection SICAV
SpardaRentenPlus
UniAsia
UniAsiaPacific
UniAusschüttung
UniDividendenAss
UniDynamicFonds: Europa
UniDynamicFonds: Global
UniEM Fernost
UniEM Global
UniEM Osteuropa
UniEuroAnleihen
UniEuroAspirant
UniEuroKapital
UniEuroKapital Corporates
UniEuroKapital -net-
UniEuropa
UniEuropa Mid&Small Caps
UniEuropaRenta
UniEuroRenta Corporates
UniEuroRenta Corporates Deutschland 2019
UniEuroRenta EM 2021
UniEuroRenta EmergingMarkets
UniEuroRenta Real Zins
UniEuroRenta Unternehmensanleihen EM 2021
UniEuroRenta Unternehmensanleihen 2020
UniEuroRenta 5J
UniEuroSTOXX 50
UniExtra: EuroStoxx 50
UniFavorit: Aktien Europa
UniFavorit: Renten
UniGarant: Aktien Welt (2020)
UniGarant: ChancenVielfalt (2019) II
UniGarant: ChancenVielfalt (2020)
UniGarant: ChancenVielfalt (2020) II
UniGarant: ChancenVielfalt (2021)
UniGarant: Commodities (2019)
UniGarant: Deutschland (2019)
UniGarant: Deutschland (2019) II
UniGarant: Emerging Markets (2020)
UniGarant: Emerging Markets (2020) II
UniGarant: Nordamerika (2021)
UniGarant: Rohstoffe (2020)
UniGarantExtra: Deutschland (2019) II
UniGarantTop: Europa

UniGarantTop: Europa II
UniGarantTop: Europa III
UniGarantTop: Europa IV
UniGarantTop: Europa V
UniGarant80: Dynamik
UniGarant95: Aktien Welt (2020)
UniGarant95: ChancenVielfalt (2019)
UniGarant95: ChancenVielfalt (2019) II
UniGarant95: ChancenVielfalt (2020)
UniGlobal Dividende
UniGlobal II
UniIndustrie 4.0
UniInstitutional Asian Bond and Currency Fund
UniInstitutional Basic Emerging Markets
UniInstitutional Basic Global Corporates HY
UniInstitutional Basic Global Corporates IG
UniInstitutional CoCo Bonds
UniInstitutional Convertibles Protect
UniInstitutional Corporate Hybrid Bonds
UniInstitutional EM Corporate Bonds
UniInstitutional EM Corporate Bonds Flexible
UniInstitutional EM Corporate Bonds Low Duration Sustainable
UniInstitutional EM Corporate Bonds 2020
UniInstitutional EM Corporate Bonds 2022
UniInstitutional EM High Yield Bonds
UniInstitutional EM Sovereign Bonds
UniInstitutional Euro Corporate Bonds 2019
UniInstitutional Euro Subordinated Bonds
UniInstitutional European Bonds & Equities
UniInstitutional European Bonds: Diversified
UniInstitutional European Bonds: Governments Peripherie
UniInstitutional European Corporate Bonds +
UniInstitutional European Equities Concentrated
UniInstitutional Financial Bonds 2022
UniInstitutional German Corporate Bonds +
UniInstitutional Global Convertibles
UniInstitutional Global Convertibles Sustainable
UniInstitutional Global Corporate Bonds Short Duration
UniInstitutional Global Corporate Bonds Sustainable
UniInstitutional Global Corporate Bonds 2022
UniInstitutional Global Covered Bonds
UniInstitutional Global Credit
UniInstitutional Global High Dividend Equities Protect
UniInstitutional Global High Yield Bonds
UniInstitutional IMMUNO Nachhaltigkeit
UniInstitutional Local EM Bonds
UniInstitutional Multi Credit
UniInstitutional Risk Premia
UniInstitutional SDG Equities
UniInstitutional Short Term Credit
UniInstitutional Structured Credit
UniInstitutional Structured Credit High Yield
UniKonzept: Dividenden
UniKonzept: Portfolio
UniMarktführer
UnionProtect: Europa (CHF)

UniOptima
UniOptimus -net-
UniOpti4
UniPacific Aktien
UniPremium Evolution 100
UniPremium Evolution 25
UniProfiAnlage (2019/II)
UniProfiAnlage (2020)
UniProfiAnlage (2020/II)
UniProfiAnlage (2021)
UniProfiAnlage (2023)
UniProfiAnlage (2023/II)
UniProfiAnlage (2024)
UniProfiAnlage (2025)
UniProfiAnlage (2027)
UniRak Emerging Markets
UniRak Nachhaltig
UniRak Nachhaltig Konservativ
UniRak Nordamerika
UniRent Europa
UniRent Global
UniRent Kurz URA
UniRent Mündel
UniRent Mündel Flex
UniRenta Corporates
UniRentEuro Mix
UniRentEuro Staatsanleihen Flex
UniReserve
UniReserve: Euro-Corporates
UniSector
UniStruktur
UniValueFonds: Europa
UniValueFonds: Global
UniVorsorge 1
UniVorsorge 2
UniVorsorge 3
UniVorsorge 4
UniVorsorge 5
UniVorsorge 6
UniVorsorge 7
UniWirtschaftsAspirant
VBMH Vermögen

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

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