

KAPITALVERWALTUNGSGESELLSCHAFT:



Amfileon Short Term Alpha

HALBJAHRESBERICHT

ZUM 30. JUNI 2024

VERWAHRSTELLE:



BNP PARIBAS

ASSET MANAGEMENT UND VERTRIEB:



A M F I L E O N

Halbjahresbericht Amfileon Short Term Alpha

Vermögensübersicht zum 30.06.2024

Anlageschwerpunkte	Tageswert in EUR	% Anteil am Fondsvermögen
I. Vermögensgegenstände	29.585.889,71	100,55
1. Anleihen < 1 Jahr	28.111.570,70 28.111.570,70	95,54 95,54
2. Derivate	87.005,69	0,30
3. Bankguthaben	1.216.232,63	4,13
4. Sonstige Vermögensgegenstände	171.080,69	0,58
II. Verbindlichkeiten	-161.858,38	-0,55
III. Fondsvermögen	29.424.031,33	100,00

Halbjahresbericht Amfileon Short Term Alpha

Vermögensaufstellung zum 30.06.2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2024	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Bestandspositionen							EUR	28.111.570,70	95,54
Börsengehandelte Wertpapiere							EUR	28.111.570,70	95,54
Verzinsliche Wertpapiere							EUR	28.111.570,70	95,54
1,0000 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.2014 (2024)	DE0001102366		EUR	4.160	0	0 %	99,705	4.147.728,00	14,10
0,4000 % Bundesrep.Deutschland Bundesschatzanw. v.22(24)	DE0001104891		EUR	2.160	0	0 %	99,392	2.146.867,20	7,30
2,5000 % Bundesrep.Deutschland Bundesschatzanw. v.23(25)	DE000BU22007		EUR	5.500	5.500	0 %	99,440	5.469.200,00	18,59
1,7500 % Frankreich EO-OAT 2014(24)	FR0011962398		EUR	5.160	3.000	0 %	99,280	5.122.848,00	17,41
0,0000 % Frankreich EO-OAT 2019(25)	FR0013415627		EUR	7.750	6.000	0 %	97,521	7.557.877,50	25,69
0,0000 % Frankreich EO-OAT 2021(25)	FR0014007TY9		EUR	3.750	2.500	0 %	97,788	3.667.050,00	12,46
Summe Wertpapiervermögen							EUR	28.111.570,70	95,54

Vermögensaufstellung zum 30.06.2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2024	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Derivate							EUR	87.005,69	0,30
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)									
Aktienindex-Derivate							EUR	-29.714,60	-0,10
Forderungen/Verbindlichkeiten									
Aktienindex-Terminkontrakte							EUR	-29.714,60	-0,10
FUTURE NIKKEI 225 INDEX JPY 12.09.24 OSE									
		969	JPY	Anzahl	1			-232,08	0,00
FUTURE TOKYO STK.PR.(TOPIX) IND. 12.09.24 OSE		969	JPY	Anzahl	4			-1.160,39	0,00
FUTURE E-MINI S+P 500 INDEX 20.09.24 CME		352	USD	Anzahl	22			-28.322,13	-0,10
Swaps							EUR	116.720,29	0,40
Forderungen/Verbindlichkeiten									
Total Return Swaps							EUR	116.720,29	0,40
Long Swap auf Aktienbasket 22.02.24/20.02.26									
		OTC	EUR		23.367.931			112.532,96	0,38
Short Swap auf Aktienbasket 22.02.24/20.02.26									
		OTC	EUR		11.222.983			4.187,33	0,01

Halbjahresbericht Amfileon Short Term Alpha

Vermögensaufstellung zum 30.06.2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2024	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds							EUR	1.216.232,63	4,13
Bankguthaben							EUR	1.216.232,63	4,13
EUR - Guthaben bei:									
BNP Paribas S.A., Niederlassung Deutschland			EUR	819.069,86			% 100,000	819.069,86	2,78
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen bei:									
BNP Paribas S.A., Niederlassung Deutschland			CHF	51.436,79			% 100,000	53.429,72	0,18
BNP Paribas S.A., Niederlassung Deutschland			GBP	71.748,31			% 100,000	84.648,78	0,29
BNP Paribas S.A., Niederlassung Deutschland			JPY	25.396.443,00			% 100,000	147.348,68	0,50
BNP Paribas S.A., Niederlassung Deutschland			USD	119.735,86			% 100,000	111.735,59	0,38
Sonstige Vermögensgegenstände							EUR	171.080,69	0,58
Zinsansprüche			EUR	141.361,13				141.361,13	0,48
Variation Margin			EUR	29.714,61				29.714,61	0,10
Sonstige Forderungen			EUR	4,95				4,95	0,00
Sonstige Verbindlichkeiten							EUR	-161.858,38	-0,55
Zinsverbindlichkeiten			EUR	63,76				63,76	0,00
Verwaltungsvergütung			EUR	-149.713,59				-149.713,59	-0,51
Verwahrstellenvergütung			EUR	-4.241,89				-4.241,89	-0,01
Prüfungskosten			EUR	-7.472,22				-7.472,22	-0,03
Veröffentlichungskosten			EUR	-494,44				-494,44	0,00
Fondsvermögen							EUR	29.424.031,33	100,00 1)

Halbjahresbericht
Amfileon Short Term Alpha

Vermögensaufstellung zum 30.06.2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2024	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Anteilwert							EUR	99,15	
Ausgabepreis							EUR	99,15	
Anteile im Umlauf							STK	296.760	

Fußnoten:

1) Durch Rundung der Prozent-Anteile bei der Berechnung können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.

Halbjahresbericht

Amfileon Short Term Alpha

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

Die Vermögensgegenstände des Sondervermögens sind auf Grundlage der zuletzt festgestellten Kurse/Marktsätze bewertet.

Devisenkurse (in Mengennotiz)

		per 28.06.2024	
CHF	(CHF)	0,9627000	= 1 EUR (EUR)
GBP	(GBP)	0,8476000	= 1 EUR (EUR)
JPY	(JPY)	172,3561000	= 1 EUR (EUR)
USD	(USD)	1,0716000	= 1 EUR (EUR)

Marktschlüssel

Terminbörsen

352	Chicago - CME Globex
969	Osaka Exchange F.+O.

OTC

Over-the-Counter

Halbjahresbericht Amfileon Short Term Alpha

Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen: - Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schuldscheindarlehen (Marktzuordnung zum Berichtsstichtag):

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile Whg. in 1.000	Käufe bzw. Zugänge	Verkäufe bzw. Abgänge	Volumen in 1.000
Börsengehandelte Wertpapiere					
Verzinsliche Wertpapiere					
0,0000 % Frankreich EO-OAT 2018(24)	FR0013344751	EUR	0	2.160	
Nichtnotierte Wertpapiere *)					
Verzinsliche Wertpapiere					
1,5000 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.2014 (2024)	DE0001102358	EUR	0	2.160	
1,7500 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.2014 (2024)	DE0001102333	EUR	0	2.000	
0,0000 % Bundesrep.Deutschland Bundesobl.Ser.179 v.2019(24)	DE0001141794	EUR	0	2.160	
0,2000 % Bundesrep.Deutschland Bundesschatzanw. v.22(24)	DE0001104883	EUR	0	2.160	
0,0000 % Bundesrep.Deutschland Bundesschatzanw. v.22(24)	DE0001104875	EUR	0	2.160	
2,2500 % Frankreich EO-OAT 2013(24)	FR0011619436	EUR	0	3.160	
0,0000 % Frankreich EO-OAT 2020(24)	FR0014001N46	EUR	0	1.910	

Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen:
- Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schuldscheindarlehen (Marktzuordnung zum Berichtsstichtag):

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile Whg. in 1.000	Käufe bzw. Zugänge	Verkäufe bzw. Abgänge	Volumen in 1.000
---------------------	------	-------------------------------------	--------------------------	-----------------------------	---------------------

Derivate

(In Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe)

Terminkontrakte

Aktienindex-Terminkontrakte

Verkaufte Kontrakte:

(Basiswert(e): AEX, CAC 40, DAX PERFORMANCE-INDEX, ESTX 50 PR.EUR, FTSE 100, FTSE MIB, NIKKEI 225 ST.AVERAGE JPY, RUSSELL 2000, S+P 500, SMI PR CHF, STXE 600 PR.EUR, TOPIX PR JPY)

EUR

256.882,44

Gekaufte Kontrakte:

(Basiswert(e): AEX, CAC 40, DAX PERFORMANCE-INDEX, ESTX 50 PR.EUR, FTSE 100, FTSE MIB, NIKKEI 225 ST.AVERAGE JPY, RUSSELL 2000, S+P 500, SMI PR CHF, STXE 600 PR.EUR, TOPIX PR JPY)

EUR

491.819,73

Die Gesellschaft sorgt dafür, dass eine unangemessene Beeinträchtigung von Anlegerinteressen durch Transaktionskosten vermieden wird, indem unter Berücksichtigung der Anlageziele dieses Sondervermögens ein Schwellenwert für die Transaktionskosten bezogen auf das durchschnittliche Fondsvolumen sowie für eine Portfolioumschlagsrate festgelegt wurde. Die Gesellschaft überwacht die Einhaltung der Schwellenwerte und ergreift im Falle des Überschreitens weitere Maßnahmen.

*) Bei den nichtnotierten Wertpapieren können technisch bedingt auch endfällige Wertpapiere ausgewiesen werden.

Halbjahresbericht Amfileon Short Term Alpha

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)	95,54
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)	0,30

Sonstige Angaben

Anteilwert	EUR	99,15
Ausgabepreis	EUR	99,15
Anteile im Umlauf	STK	296.760

Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände

Bewertung

Für Devisen, Aktien, Anleihen und Derivate, die zum Handel an einer Börse oder an einem anderen organisierten Markt zugelassen oder in diesen einbezogen sind, wird der letzte verfügbare handelbare Kurs gemäß § 27 KARBV zugrunde gelegt.

Für Investmentanteile werden die aktuellen Werte, für Bankguthaben und Verbindlichkeiten der Nennwert bzw. Rückzahlungsbetrag gemäß § 29 KARBV zugrunde gelegt.

Für Vermögensgegenstände, die weder zum Handel an einer Börse noch an einem anderen organisierten Markt zugelassen oder in den regulierten Markt oder Freiverkehr einer Börse einbezogen sind oder für die kein handelbarer Kurs verfügbar ist, werden gemäß § 28 KARBV i.V.m. § 168 Absatz 3 KAGB die Verkehrswerte zugrunde gelegt, die sich bei sorgfältiger Einschätzung nach geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten ergeben.

Unter dem Verkehrswert ist der Betrag zu verstehen, zu dem der jeweilige Vermögensgegenstand in einem Geschäft zwischen sachverständigen, vertragswilligen und unabhängigen Geschäftspartnern ausgetauscht werden könnte.

Zusätzliche Anhangsangaben gemäß der Verordnung (EU) 2015/2365 betreffend Wertpapierfinanzierungsgeschäfte

Angaben zu Wertpapierfinanzierungsgeschäften

Total Return Swaps

Marktwert der Total Return Swaps

absolut	EUR	116.720,29
in % des Fondsvermögens		0,40

Größte Gegenpartei(en) von Total Return Swaps

Rang	Name	Bruttovolumen der offenen Geschäfte in EUR	Sitzstaat
1	Goldman Sachs Bank Europe SE (G) (V) - Frankfurt	34.590.913,92	Bundesrep. Deutschland

Total Return Swaps gegliedert nach Restlaufzeit

Laufzeitband	Bruttovolumen in EUR
< 1 Tag	0,00
>= 1 Tag bis < 1 Woche	0,00
>= 1 Woche bis < 1 Monat	0,00
>= 1 Monat bis < 3 Monate	0,00
>= 3 Monate bis < 1 Jahr	0,00
>= 1 Jahr	0,00
unbefristet	34.590.913,92

Sicherheiten in Zusammenhang mit Total Return Swaps

Der Transfer von Sicherheiten zwischen dem Fonds und den Kontrahenten der Total Return Swaps basiert auf den im Besicherungsanhang zur Mantelvereinbarung für Finanzgeschäfte getroffenen Vereinbarungen mit dem jeweiligen Kontrahenten. Die Besicherung erfolgt genetett für alle OTC-Derivate des Fonds/Segments gegenüber einem Kontrahenten und nicht nur für Total Return Swaps. Die erforderliche Besicherung wird laufend auf Grundlage der Marktwerte der offenen Geschäfte überwacht.

Die Total Return Swaps im Bestand zum Stichtag wurden mit den Kontrahenten Goldman Sachs Bank Europe SE (G) (V) - Frankfurt abgeschlossen.

Mit dem Kontrahenten Goldman Sachs Bank Europe SE (G) (V) - Frankfurt wurde ein Minimumtransferbetrag in Höhe von € 250.000 sowie eine Rundung der Sicherheiten auf € 10.000 vereinbart.

Folgende Instrumente können als Sicherheit dienen:

- EUR-Cash zu einem Anrechnungssatz von 100%

Zusätzliche Anhangsangaben gemäß der Verordnung (EU) 2015/2365 betreffend Wertpapierfinanzierungsgeschäfte

Angaben zur Weiterverwendung von Sicherheiten

Die durch den Fonds erhaltenen Sicherheiten werden nicht wiederangelegt.

Frankfurt am Main, den 1. Juli 2024

Universal-Investment-Gesellschaft mbH
Die Geschäftsführung

Halbjahresbericht

Amfileon Short Term Alpha

Kurzübersicht über die Partner

1. Kapitalverwaltungsgesellschaft

Universal-Investment-Gesellschaft mbH

Hausanschrift:

Theodor-Heuss-Allee 70
60486 Frankfurt am Main

Postanschrift:

Postfach 17 05 48
60079 Frankfurt am Main

Telefon: 069 / 710 43-0
Telefax: 069 / 710 43-700
www.universal-investment.com

Gründung: 1968

Rechtsform: Gesellschaft mit beschränkter Haftung
Gezeichnetes und eingezahltes Kapital: EUR 10.400.000,–
Eigenmittel: EUR 71.352.000,00 (Stand: Oktober 2022)

Geschäftsführer:

David Blumer, Schaan
Mathias Heiß, Langen
Dr. André Jäger, Witten
Corinna Jäger, Nidderau
Katja Müller, Bad Homburg v. d. Höhe
Axel Vespermann, Dreieich

Aufsichtsrat:

Prof. Dr. Harald Wiedmann (Vorsitzender), Berlin
Dr. Axel Eckhardt, Düsseldorf
Ellen Engelhardt, Glauburg
Daniel Fischer, Bad Vilbel
Janet Zirlewagen, Wehrheim

2. Verwahrstelle

BNP Paribas S.A. Niederlassung Deutschland

Hausanschrift:

Senckenberganlage 19
60325 Frankfurt am Main

Telefon: 069 / 15205-0
Telefax: 069 / 15205-550
www.bnpparibas.de

Rechtsform: Zweigniederlassung einer Aktiengesellschaft nach französischem Recht
Haftendes Eigenkapital: Mio. € 122.507 (Stand: 31.12.2021)

3. Asset Management-Gesellschaft und Vertrieb

Amfileon AG

Postanschrift:

Elsenheimerstr. 47a
80687 München

Telefon +49 (0) 89 693 132 479

WKN / ISIN: A3DQ2L / DE000A3DQ2L2