

---

## Halbjahresbericht

30. Juni 2020

### **Amundi Weltportfolio**

Investmentfonds nach deutschem Recht

---

---

## Inhalt

|                                                                 |    |
|-----------------------------------------------------------------|----|
| <b>Amundi Weltportfolio im Überblick</b>                        | 2  |
| <b>Halbjahresbericht zum 30. Juni 2020 Amundi Weltportfolio</b> | 4  |
| Vermögensübersicht                                              | 4  |
| Vermögensaufstellung                                            | 5  |
| Anhang gem. §7 Nr. 9 KARBV                                      | 30 |
| <b>Verwaltung und Vertrieb</b>                                  | 31 |

## Amundi Weltportfolio im Überblick

**Allein verbindliche Grundlage des Kaufs ist der aktuelle Verkaufsprospekt einschließlich Anlagebedingungen sowie das Dokument „Wesentliche Anlegerinformationen“, die Sie bei Amundi Deutschland GmbH, den Geschäftsstellen der UniCredit Bank AG und weiteren Vertriebs- und Zahlstellen erhalten.**

### Fonds und Anteilpreise

Die Ausgabe- und Rücknahmepreise unserer Fonds werden börsentäglich berechnet und veröffentlicht. Die aktuellen Anteilpreise erhalten Sie bei der Verwahrstelle und der Vertriebsstelle des Fonds. Diese können Sie der Seite 31 entnehmen.

Weitere Angaben zu unseren Fonds sowie zu eventuellen Änderungen der Vertragsbedingungen finden Sie unter: [www.amundi.de](http://www.amundi.de)

Die Veröffentlichung der Kurse finden Sie unter: [www.amundi.de](http://www.amundi.de)

### Ziele und Anlagepolitik

Der Fonds ist ein Investmentvermögen gemäß der OGAW-Richtlinie. Ziel des Fonds ist es, mit einer wachstumsorientierten Anlagepolitik, neben einer Mindestausschüttung von 1,7% pro Fondsgeschäftsjahr, eine attraktive Wertsteigerung zu erzielen. Gleichzeitig strebt das Fondsmanagement an, die Wertschwankungen (Volatilität) des Fonds zu begrenzen. Der Fonds wird unabhängig von einem Vergleichsmaßstab gemanagt. Es wird ein aktives Management der Anlagen betrieben.

Um sein Ziel zu erreichen, kann der Fonds bis zu 70% seines Wertes in Aktien anlegen. Bis zu 20% des Wertes des Fonds dürfen in Wertpapiere, welche die Wertentwicklung von Rohstoffen und/oder Rohstoffindizes abbilden, angelegt werden. Bis zu 20% des Wertes des Fonds dürfen in verzinsliche Wertpapiere mit einem Mindestrating im Bereich von „BB+“ gemäß Standard & Poor's, „BB+“ gemäß Fitch oder „Ba1“ gemäß Moody's bis „CCC-“ gemäß Standard & Poor's, „CCC-“ gemäß Fitch oder „Caa3“ gemäß Moody's angelegt werden.

Der Fonds kann Derivategeschäfte zur Absicherung, zu spekulativen Zwecken und zur effizienten Portfoliosteuerung einsetzen. Daneben kann der Fonds gemäß den „Allgemeinen und Besonderen Anlagebedingungen“ anlegen.

Der Fonds bildet weder einen Wertpapierindex ab, noch orientiert sich die Gesellschaft für den Fonds an einem festgelegten Vergleichsmaßstab. Das Fondsmanagement entscheidet nach eigenem Ermessen aktiv über die Auswahl der Vermögensgegenstände unter Berücksichtigung von Analysen und Bewertungen von Ausstellern von Wertpapieren sowie volkswirtschaftlichen und politischen Entwicklungen. Es zielt darauf ab, eine positive Wertentwicklung zu erzielen.

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

### Aktuelle Branchenaufteilung

|                                     |        |
|-------------------------------------|--------|
| (Quasi-)Staatsanleihen              | 54,49% |
| Indexfonds                          | 28,70% |
| Technologie                         | 1,36%  |
| Industriegüter und Dienstleistungen | 1,03%  |
| Gesundheit                          | 0,90%  |
| Sonstige Branchen                   | 4,63%  |
| Bankguthaben und Sonstiges          | 8,89%  |

Quelle: Eigene Berechnung

### Aktuelle Länderaufteilung

|                            |        |
|----------------------------|--------|
| Frankreich                 | 25,13% |
| Irland                     | 17,49% |
| Deutschland                | 17,33% |
| USA                        | 12,44% |
| Luxemburg                  | 12,19% |
| Sonstige Länder            | 6,53%  |
| Bankguthaben und Sonstiges | 8,89%  |

Quelle: Eigene Berechnung

### Wertentwicklung verschiedener Zeiträume (in Währung)

|                                        |        |
|----------------------------------------|--------|
| Lfd. Jahr                              | -7,12% |
| 6 Monate                               | -7,12% |
| 1 Jahr                                 | -2,63% |
| Seit Auflage                           | +0,87% |
| Durchschnittliche Wertentwicklung p.a. | +0,34% |

Quelle: Eigene Berechnung nach BVI-Methode, d.h. ohne Berücksichtigung des Ausgabeaufschlages.  
Stand: 30.06.2020

**Fondsdaten**

|                                     |                                                                |
|-------------------------------------|----------------------------------------------------------------|
| Mindestanlagesumme                  | 100.000 EUR                                                    |
| Fondstyp                            | Gemischter Fonds                                               |
| Fondswährung                        | EUR                                                            |
| Fondsaufgabe <sup>1</sup>           | 01.12.2017                                                     |
| Ertragsverwendung                   | ausschüttend, vierteljährlich zum 15.02.; 15.05.; 15.08; 15.11 |
| Ausgabeaufschlag                    | bis zu 5,00%; derzeit 3,00%                                    |
| Verwaltungsvergütung 2019 p.a.      | bis zu 2,00%; derzeit 0,25%                                    |
| Verwahrstellenvergütung p.a.        | bis zu 0,20%; derzeit 0,02% <sup>2</sup>                       |
| Gesamtkostenquote p.a. <sup>3</sup> | 0,16%                                                          |
| Stückelung                          | Globalurkunde                                                  |
| Wertpapierkennnummer                | A2DW33                                                         |
| Orderannahmeschluss <sup>4</sup>    | 12:00 Uhr                                                      |
| ISIN                                | DE000A2DW335                                                   |

1 Bis zum 29.07.2019 inländischer Spezial-AIF.

2 Ab 01.09.2020: 0,03%

3 Berechnung nach §166 Abs. 5 KAGB, d.h. ohne Berücksichtigung von Transaktionskosten. Die hier angegebene Gesamtkostenquote fiel im Rumpfgeschäftsjahr vom 30.07.2019 bis 30.12.2019 an. Am 30. Juli 2019 erfolgte die Umwandlung in ein Investmentvermögen gemäß der OGAW-Richtlinie. Eine gegebenenfalls aktuellere Gesamtkostenquote können Sie den „Wesentlichen Anlegerinformationen“ unter „Kosten/Laufende Kosten“ entnehmen.

4 Aufträge, die bis zum Orderannahmeschluss eingehen, werden auf der Grundlage des Anteilwertes des nächsten Bewertungstages abgerechnet.

## Halbjahresbericht zum 30. Juni 2020

### Amundi Weltportfolio

## Vermögensübersicht

### Vermögensübersicht

|                                                                                             |            | Kurswert<br>in EUR    | % des<br>Fonds-<br>vermögens |
|---------------------------------------------------------------------------------------------|------------|-----------------------|------------------------------|
| <b>I. Vermögensgegenstände</b>                                                              | <b>EUR</b> | <b>173.821.345,09</b> | <b>104,90</b>                |
| 1. Aktien                                                                                   | EUR        | 11.904.209,31         | 7,18                         |
| – Deutschland                                                                               | EUR        | 902.879,94            | 0,54                         |
| – Euro-Länder                                                                               | EUR        | 2.959.636,38          | 1,79                         |
| – Sonstige EU/EWR-Länder                                                                    | EUR        | 1.375.983,34          | 0,83                         |
| – Nicht EU/EWR-Länder                                                                       | EUR        | 6.665.709,65          | 4,02                         |
| 2. Anleihen                                                                                 | EUR        | 90.292.156,26         | 54,49                        |
| – Schuldverschreibungen, die von öffentlichen Institutionen emittiert oder gesichert werden | EUR        | 90.292.156,26         | 54,49                        |
| 3. Zertifikate                                                                              | EUR        | 1.196.945,83          | 0,72                         |
| – Zertifikate                                                                               | EUR        | 1.196.945,83          | 0,72                         |
| 4. Investmentanteile                                                                        | EUR        | 47.548.276,67         | 28,70                        |
| – Indexfonds                                                                                | EUR        | 47.548.276,67         | 28,70                        |
| 5. Derivate                                                                                 | EUR        | 422.296,19            | 0,25                         |
| – Optionsrechte (Verkauf)                                                                   | EUR        | -875.833,53           | -0,53                        |
| – Optionsrechte (Kauf)                                                                      | EUR        | 1.416.753,49          | 0,86                         |
| – Optionsscheine                                                                            | EUR        | 25.899,75             | 0,02                         |
| – Futures (Verkauf)                                                                         | EUR        | -484.536,04           | -0,29                        |
| – Futures (Kauf)                                                                            | EUR        | 505.796,09            | 0,31                         |
| – Devisentermingeschäfte (Verkauf)                                                          | EUR        | 35.062,03             | 0,02                         |
| – Devisentermingeschäfte (Kauf)                                                             | EUR        | -200.845,60           | -0,12                        |
| 6. Bankguthaben                                                                             | EUR        | 18.435.368,22         | 11,13                        |
| – Bankguthaben in EUR                                                                       | EUR        | 16.362.482,04         | 9,88                         |
| – Bankguthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen                                                | EUR        | 862.537,70            | 0,52                         |
| – Bankguthaben in Nicht EU/EWR-Währungen                                                    | EUR        | 1.210.348,48          | 0,73                         |
| 7. Sonstige Vermögensgegenstände                                                            | EUR        | 4.022.092,61          | 2,43                         |
| <b>II. Verbindlichkeiten</b>                                                                | <b>EUR</b> | <b>-8.126.990,77</b>  | <b>-4,90</b>                 |
| 1. Sonstige Verbindlichkeiten                                                               | EUR        | -8.126.990,77         | -4,90                        |
| <b>III. Fondsvermögen</b>                                                                   | <b>EUR</b> | <b>165.694.354,32</b> | <b>100,00<sup>1</sup></b>    |

<sup>1</sup> Durch Rundung der Prozentanteile bei der Berechnung können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.

## Vermögensaufstellung

### Vermögensaufstellung zum 30.06.2020

| ISIN                                | Gattungsbezeichnung                  | Stück bzw.<br>Anteile bzw.<br>Whg. in 1.000 | Bestand<br>30.06.2020 | Käufe/<br>Zugänge<br>im Berichtszeitraum | Verkäufe/<br>Abgänge | Kurs           | Kurswert<br>in EUR    | % des<br>Fonds-<br>vermögens |
|-------------------------------------|--------------------------------------|---------------------------------------------|-----------------------|------------------------------------------|----------------------|----------------|-----------------------|------------------------------|
| <b>Börsengehandelte Wertpapiere</b> |                                      |                                             |                       |                                          |                      | <b>EUR</b>     | <b>102.932.685,64</b> | <b>62,12</b>                 |
| <b>Aktien</b>                       |                                      |                                             |                       |                                          |                      | <b>EUR</b>     | <b>11.551.145,60</b>  | <b>6,97</b>                  |
| CH0012221716                        | ABB Ltd.                             | STK                                         | 4.525                 | 4.525                                    | 0                    | CHF 21,2900    | 90.156,99             | 0,05                         |
| CH0210483332                        | Cie Financière Richemont AG          | STK                                         | 824                   | 7.835                                    | 11.172               | CHF 60,4400    | 46.607,61             | 0,03                         |
| CH0038863350                        | Nestlé S.A.                          | STK                                         | 1.977                 | 11.522                                   | 14.677               | CHF 105,2000   | 194.637,97            | 0,12                         |
| CH0244767585                        | UBS Group AG                         | STK                                         | 12.212                | 71.739                                   | 59.527               | CHF 10,8550    | 124.057,14            | 0,07                         |
| DK0060094928                        | Orsted A/S                           | STK                                         | 905                   | 905                                      | 0                    | DKK 766,8000   | 93.118,19             | 0,06                         |
| DK0010219153                        | Rockwool International A.S. B        | STK                                         | 281                   | 281                                      | 0                    | DKK 1.785,0000 | 67.305,16             | 0,04                         |
| FR0000120073                        | Air Liquide S.A. Ét. Expl. P. G. Cl. | STK                                         | 220                   | 573                                      | 574                  | EUR 127,6000   | 28.072,00             | 0,02                         |
| NL0000235190                        | Airbus SE                            | STK                                         | 1.014                 | 4.654                                    | 7.859                | EUR 64,0700    | 64.966,98             | 0,04                         |
| DE0008404005                        | Allianz SE                           | STK                                         | 462                   | 462                                      | 0                    | EUR 180,1800   | 83.243,16             | 0,05                         |
| BE0974293251                        | Anheuser-Busch InBev SA/NV           | STK                                         | 1.622                 | 2.500                                    | 4.176                | EUR 44,2200    | 71.724,84             | 0,04                         |
| NL0011872643                        | ASR Nederland N.V.                   | STK                                         | 2.092                 | 8.955                                    | 10.715               | EUR 27,1500    | 56.797,80             | 0,03                         |
| FR0000120628                        | AXA S.A.                             | STK                                         | 2.916                 | 20.848                                   | 34.991               | EUR 18,5040    | 53.957,66             | 0,03                         |
| DE000BAY0017                        | Bayer AG                             | STK                                         | 1.466                 | 10.077                                   | 8.611                | EUR 66,1200    | 96.931,92             | 0,06                         |
| FR0000131104                        | BNP Paribas S.A.                     | STK                                         | 4.020                 | 8.126                                    | 23.908               | EUR 35,1350    | 141.242,70            | 0,09                         |
| FR0000120503                        | Bouygues S.A.                        | STK                                         | 897                   | 2.859                                    | 8.885                | EUR 30,2500    | 27.134,25             | 0,02                         |
| NL0010545661                        | CNH Industrial N.V.                  | STK                                         | 8.862                 | 20.078                                   | 61.188               | EUR 6,1740     | 54.713,99             | 0,03                         |
| FR0000125007                        | Compagnie De Saint-Gobain S.A.       | STK                                         | 2.860                 | 7.270                                    | 19.135               | EUR 32,3300    | 92.463,80             | 0,06                         |
| DE0005439004                        | Continental AG                       | STK                                         | 578                   | 2.340                                    | 5.284                | EUR 87,1000    | 50.343,80             | 0,03                         |
| IE0001827041                        | CRH PLC                              | STK                                         | 3.028                 | 11.865                                   | 29.660               | EUR 30,5100    | 92.384,28             | 0,06                         |
| DE0007100000                        | Daimler AG                           | STK                                         | 1.861                 | 3.511                                    | 13.209               | EUR 35,7600    | 66.549,36             | 0,04                         |
| FR0000120644                        | Danone S.A.                          | STK                                         | 885                   | 6.704                                    | 11.217               | EUR 62,4400    | 55.259,40             | 0,03                         |
| DE0005552004                        | Deutsche Post AG                     | STK                                         | 2.129                 | 6.620                                    | 20.061               | EUR 32,5900    | 69.384,11             | 0,04                         |
| DE000DWS1007                        | DWS Group GmbH & Co. KGaA            | STK                                         | 1.687                 | 1.687                                    | 0                    | EUR 32,2300    | 54.372,01             | 0,03                         |
| IT0003128367                        | Enel S.p.A.                          | STK                                         | 7.753                 | 7.753                                    | 0                    | EUR 7,7850     | 60.357,11             | 0,04                         |
| IT0003132476                        | Eni S.p.A.                           | STK                                         | 7.636                 | 22.937                                   | 56.876               | EUR 8,5240     | 65.089,26             | 0,04                         |
| NL0011585146                        | Ferrari N.V.                         | STK                                         | 599                   | 1.191                                    | 2.354                | EUR 151,1500   | 90.538,85             | 0,05                         |
| IT0000072170                        | FincoBank S.p.A.                     | STK                                         | 5.997                 | 13.081                                   | 30.635               | EUR 11,9900    | 71.904,03             | 0,04                         |
| DE0005785604                        | Fresenius SE & Co. KGaA              | STK                                         | 1.399                 | 6.956                                    | 16.166               | EUR 43,8400    | 61.332,16             | 0,04                         |
| ES0144580Y14                        | Iberdrola S.A.                       | STK                                         | 11.091                | 81.403                                   | 116.590              | EUR 10,4300    | 115.679,13            | 0,07                         |
| DE0006231004                        | Infineon Technologies AG             | STK                                         | 7.398                 | 7.398                                    | 0                    | EUR 20,7500    | 153.508,50            | 0,09                         |
| NL0011821202                        | ING Groep N.V.                       | STK                                         | 13.898                | 30.374                                   | 70.774               | EUR 6,1920     | 86.056,42             | 0,05                         |
| BE0003565737                        | KBC Groep N.V.                       | STK                                         | 3.131                 | 7.013                                    | 11.797               | EUR 51,0800    | 159.931,48            | 0,10                         |
| NL0000009538                        | Koninklijke Philips N.V.             | STK                                         | 3.629                 | 18.163                                   | 21.356               | EUR 41,2450    | 149.678,11            | 0,09                         |
| IE00B212WP82                        | Linde PLC                            | STK                                         | 301                   | 3.813                                    | 3.512                | EUR 188,3000   | 56.678,30             | 0,03                         |
| FR0000120321                        | L'Oreal S. A.                        | STK                                         | 345                   | 2.838                                    | 3.601                | EUR 286,2000   | 98.739,00             | 0,06                         |
| FR0000121014                        | LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE  | STK                                         | 343                   | 735                                      | 1.301                | EUR 391,7500   | 134.370,25            | 0,08                         |
| IT0005366767                        | Nexi S.p.A.                          | STK                                         | 7.401                 | 22.936                                   | 45.127               | EUR 15,4800    | 114.567,48            | 0,07                         |
| FI0009000681                        | Nokia Corp.                          | STK                                         | 23.825                | 23.825                                   | 0                    | EUR 3,8400     | 91.488,00             | 0,06                         |
| NL0013654783                        | Prosus N.V.                          | STK                                         | 726                   | 1.424                                    | 698                  | EUR 82,4000    | 59.822,40             | 0,04                         |
| IT0004176001                        | Prysmian S.p.A.                      | STK                                         | 3.866                 | 11.142                                   | 22.264               | EUR 20,6200    | 79.716,92             | 0,05                         |
| FR0000120578                        | Sanofi S.A.                          | STK                                         | 607                   | 9.458                                    | 14.744               | EUR 90,5800    | 54.982,06             | 0,03                         |

## Vermögensaufstellung zum 30.06.2020

| ISIN         | Gattungsbezeichnung         | Stück bzw.<br>Anteile bzw.<br>Whg. in 1.000 | Bestand<br>30.06.2020 | Käufe/<br>Zugänge<br>im Berichtszeitraum | Verkäufe/<br>Abgänge | Kurs | Kurswert<br>in EUR | % des<br>Fonds-<br>vermögens |      |
|--------------|-----------------------------|---------------------------------------------|-----------------------|------------------------------------------|----------------------|------|--------------------|------------------------------|------|
| DE0007164600 | SAP SE                      | STK                                         | 576                   | 1.283                                    | 2.958                | EUR  | 123,1600           | 70.940,16                    | 0,04 |
| FR0000121972 | Schneider Electric SE       | STK                                         | 944                   | 3.586                                    | 7.416                | EUR  | 99,1000            | 93.550,40                    | 0,06 |
| DE0007236101 | Siemens AG                  | STK                                         | 1.166                 | 3.372                                    | 9.177                | EUR  | 103,8600           | 121.100,76                   | 0,07 |
| FR0000121329 | Thales S.A.                 | STK                                         | 783                   | 783                                      | 0                    | EUR  | 72,6800            | 56.908,44                    | 0,03 |
| FR0000120271 | Total S.A.                  | STK                                         | 4.125                 | 9.264                                    | 18.301               | EUR  | 34,0200            | 140.332,50                   | 0,08 |
| IT0005239360 | UniCredit S.p.A.            | STK                                         | 8.588                 | 37.129                                   | 80.667               | EUR  | 8,1580             | 70.060,90                    | 0,04 |
| FR0000127771 | Vivendi S.A.                | STK                                         | 3.931                 | 3.931                                    | 0                    | EUR  | 22,9800            | 90.334,38                    | 0,05 |
| DE0007664039 | VW AG VZ                    | STK                                         | 561                   | 2.413                                    | 5.255                | EUR  | 134,0000           | 75.174,00                    | 0,05 |
| GB00B1XZS820 | Anglo American PLC          | STK                                         | 8.499                 | 18.937                                   | 39.410               | GBP  | 18,5880            | 172.919,67                   | 0,10 |
| GB0009895292 | Astrazeneca PLC             | STK                                         | 1.890                 | 6.222                                    | 12.250               | GBP  | 84,6000            | 175.015,32                   | 0,11 |
| GB0031348658 | Barclays PLC                | STK                                         | 70.818                | 386.044                                  | 315.226              | GBP  | 1,1462             | 88.848,06                    | 0,05 |
| GB00BHOP3291 | BHP Group PLC               | STK                                         | 5.939                 | 9.316                                    | 24.220               | GBP  | 16,4220            | 106.753,79                   | 0,06 |
| GB0002374006 | Diageo PLC                  | STK                                         | 2.479                 | 3.314                                    | 835                  | GBP  | 26,9550            | 73.140,82                    | 0,04 |
| GB00B3MBS747 | Ocado Group PLC             | STK                                         | 1.427                 | 9.256                                    | 7.829                | GBP  | 20,4100            | 31.879,45                    | 0,02 |
| GB0007099541 | Prudential PLC              | STK                                         | 4.134                 | 28.109                                   | 64.112               | GBP  | 12,1974            | 55.192,81                    | 0,03 |
| GB00B24CGK77 | Reckitt Benckiser Group PLC | STK                                         | 956                   | 7.195                                    | 16.316               | GBP  | 74,2600            | 77.706,39                    | 0,05 |
| GB00B03MLX29 | Royal Dutch Shell PLC A     | STK                                         | 3.664                 | 16.049                                   | 39.867               | GBP  | 13,0720            | 52.425,36                    | 0,03 |
| GB00B1WY2338 | Smiths Group PLC            | STK                                         | 5.248                 | 21.318                                   | 40.909               | GBP  | 13,9750            | 80.276,71                    | 0,05 |
| GB0007908733 | SSE PLC                     | STK                                         | 5.034                 | 5.034                                    | 0                    | GBP  | 13,8350            | 76.231,82                    | 0,05 |
| GB0009465807 | The Weir Group PLC          | STK                                         | 5.122                 | 5.122                                    | 0                    | GBP  | 10,6700            | 59.820,21                    | 0,04 |
| GB00BH4HKS39 | Vodafone Group PLC          | STK                                         | 81.611                | 580.731                                  | 648.426              | GBP  | 1,2812             | 114.448,35                   | 0,07 |
| SE0000825820 | Lundin Energy A.B.          | STK                                         | 2.383                 | 5.093                                    | 12.150               | SEK  | 224,1000           | 50.901,23                    | 0,03 |
| US00287Y1091 | AbbVie Inc.                 | STK                                         | 1.114                 | 1.456                                    | 5.909                | USD  | 96,4400            | 95.718,25                    | 0,06 |
| US00724F1012 | Adobe Inc.                  | STK                                         | 325                   | 608                                      | 2.607                | USD  | 424,2000           | 122.830,54                   | 0,07 |
| CA0084741085 | Agnico Eagle Mines          | STK                                         | 1.848                 | 11.988                                   | 16.556               | USD  | 62,2500            | 102.492,87                   | 0,06 |
| US0162551016 | Align Technology Inc.       | STK                                         | 289                   | 289                                      | 1.448                | USD  | 266,4800           | 68.614,33                    | 0,04 |
| US02079K1079 | Alphabet Inc. Cl. C         | STK                                         | 191                   | 191                                      | 508                  | USD  | 1.394,9700         | 237.383,53                   | 0,14 |
| US0231351067 | Amazon.com Inc.             | STK                                         | 124                   | 505                                      | 1.003                | USD  | 2.680,3800         | 296.121,81                   | 0,18 |
| US0258161092 | American Express            | STK                                         | 1.137                 | 1.137                                    | 0                    | USD  | 94,5200            | 95.749,50                    | 0,06 |
| US0320951017 | Amphenol Corp. New A        | STK                                         | 1.539                 | 2.011                                    | 8.195                | USD  | 95,2300            | 130.576,42                   | 0,08 |
| US0367521038 | Anthem Inc.                 | STK                                         | 327                   | 327                                      | 0                    | USD  | 259,2700           | 75.535,72                    | 0,05 |
| US0378331005 | Apple Inc.                  | STK                                         | 614                   | 962                                      | 4.548                | USD  | 361,7800           | 197.908,87                   | 0,12 |
| JE00B783TY65 | Aptiv PLC                   | STK                                         | 1.468                 | 1.866                                    | 6.907                | USD  | 75,6700            | 98.969,67                    | 0,06 |
| US0404131064 | Arista Networks Inc.        | STK                                         | 287                   | 287                                      | 1.441                | USD  | 206,9100           | 52.907,31                    | 0,03 |
| US0605051046 | Bank of America Corp.       | STK                                         | 12.087                | 14.273                                   | 37.953               | USD  | 23,3900            | 251.884,29                   | 0,15 |
| US0846707026 | Berkshire Hathaway Inc. B   | STK                                         | 757                   | 1.518                                    | 5.515                | USD  | 177,1900           | 119.505,37                   | 0,07 |
| US09062X1037 | Biogen Inc.                 | STK                                         | 274                   | 358                                      | 1.459                | USD  | 260,3500           | 63.556,58                    | 0,04 |
| US09857L1089 | Booking Holdings Inc.       | STK                                         | 57                    | 57                                       | 0                    | USD  | 1.593,2200         | 80.910,14                    | 0,05 |
| US1491231015 | Caterpillar Inc.            | STK                                         | 925                   | 925                                      | 0                    | USD  | 125,2500           | 103.221,89                   | 0,06 |
| US8085131055 | Charles Schwab Corp.        | STK                                         | 2.805                 | 2.805                                    | 0                    | USD  | 32,7500            | 81.845,82                    | 0,05 |
| US20030N1019 | Comcast Corp. New A         | STK                                         | 4.387                 | 21.702                                   | 30.025               | USD  | 38,9400            | 152.200,45                   | 0,09 |
| US2547091080 | Discover Financial Services | STK                                         | 1.877                 | 1.877                                    | 0                    | USD  | 49,3200            | 82.478,30                    | 0,05 |
| US26614N1028 | DuPont de Nemours Inc.      | STK                                         | 1.467                 | 1.467                                    | 0                    | USD  | 52,4700            | 68.579,37                    | 0,04 |
| IE00B8KQN827 | Eaton Corporation PLC       | STK                                         | 1.064                 | 1.064                                    | 0                    | USD  | 86,9100            | 82.387,95                    | 0,05 |
| US28414H1032 | Elanco Animal Health Inc.   | STK                                         | 2.818                 | 14.820                                   | 26.922               | USD  | 21,0000            | 52.724,52                    | 0,03 |
| US2855121099 | Electronic Arts Inc.        | STK                                         | 1.196                 | 6.360                                    | 5.164                | USD  | 130,6900           | 139.259,84                   | 0,08 |
| US5324571083 | Eli Lilly & Co.             | STK                                         | 643                   | 1.741                                    | 7.966                | USD  | 162,7200           | 93.218,96                    | 0,06 |

## Vermögensaufstellung zum 30.06.2020

| ISIN                     | Gattungsbezeichnung            | Stück bzw.<br>Anteile bzw.<br>Whg. in 1.000 | Bestand<br>30.06.2020 | Käufe/<br>Zugänge<br>im Berichtszeitraum | Verkäufe/<br>Abgänge | Kurs | Kurswert<br>in EUR | % des<br>Fonds-<br>vermögens |      |
|--------------------------|--------------------------------|---------------------------------------------|-----------------------|------------------------------------------|----------------------|------|--------------------|------------------------------|------|
| US26875P1012             | EOG Resources Inc.             | STK                                         | 1.402                 | 1.402                                    | 6.241                | USD  | 49,6500            | 62.018,26                    | 0,04 |
| US30303M1027             | Facebook Inc.                  | STK                                         | 1.340                 | 1.340                                    | 0                    | USD  | 220,6400           | 263.415,54                   | 0,16 |
| US31428X1063             | Fedex Corp.                    | STK                                         | 864                   | 1.658                                    | 7.106                | USD  | 134,5500           | 103.573,77                   | 0,06 |
| US35671D8570             | Freeport-McMoRan Inc.          | STK                                         | 11.863                | 17.487                                   | 63.332               | USD  | 11,0400            | 116.685,25                   | 0,07 |
| US3842781078             | Graf Industrial Corp.          | STK                                         | 2.053                 | 2.053                                    | 10.842               | USD  | 16,7300            | 30.601,11                    | 0,02 |
| US42809H1077             | Hess Corp.                     | STK                                         | 1.237                 | 1.237                                    | 6.208                | USD  | 49,9400            | 55.039,01                    | 0,03 |
| US46625H1005             | JPMorgan Chase & Co.           | STK                                         | 2.062                 | 2.436                                    | 15.222               | USD  | 93,0000            | 170.853,53                   | 0,10 |
| US4851703029             | Kansas City Southern           | STK                                         | 476                   | 622                                      | 2.535                | USD  | 147,6400           | 62.612,83                    | 0,04 |
| IE00BTNIY115             | Medtronic PLC                  | STK                                         | 2.459                 | 2.981                                    | 9.065                | USD  | 90,2600            | 197.745,31                   | 0,12 |
| US58933Y1055             | Merck & Co. Inc. (New)         | STK                                         | 1.811                 | 3.125                                    | 10.153               | USD  | 76,1200            | 122.820,14                   | 0,07 |
| US5951121038             | Micron Technologies Inc.       | STK                                         | 2.217                 | 3.702                                    | 22.418               | USD  | 49,1450            | 97.072,76                    | 0,06 |
| US5949181045             | Microsoft Corp.                | STK                                         | 1.738                 | 1.947                                    | 13.315               | USD  | 198,4400           | 307.277,90                   | 0,19 |
| US6092071058             | Mondelez International Inc.    | STK                                         | 1.304                 | 7.020                                    | 12.486               | USD  | 50,5800            | 58.763,65                    | 0,04 |
| US6200763075             | Motorola Solutions Inc.        | STK                                         | 1.145                 | 1.145                                    | 0                    | USD  | 138,1400           | 140.921,51                   | 0,09 |
| US65339F1012             | Nextera Energy Inc.            | STK                                         | 279                   | 279                                      | 0                    | USD  | 238,2400           | 59.220,38                    | 0,04 |
| US67020Y1001             | Nuance Communications Inc.     | STK                                         | 4.307                 | 5.628                                    | 22.932               | USD  | 25,3500            | 97.275,88                    | 0,06 |
| US67066G1040             | Nvidia Corp.                   | STK                                         | 198                   | 371                                      | 173                  | USD  | 368,0000           | 64.918,03                    | 0,04 |
| US7134481081             | Pepsico Inc.                   | STK                                         | 487                   | 3.306                                    | 5.459                | USD  | 131,0800           | 56.874,52                    | 0,03 |
| US7237871071             | Pioneer Natural Resources Co.  | STK                                         | 1.412                 | 1.592                                    | 3.122                | USD  | 94,4400            | 118.807,27                   | 0,07 |
| US7433151039             | Progressive Corp.              | STK                                         | 907                   | 17.594                                   | 16.687               | USD  | 78,4000            | 63.354,24                    | 0,04 |
| US7739031091             | Rockwell Automation Inc.       | STK                                         | 612                   | 612                                      | 0                    | USD  | 208,6700           | 113.779,44                   | 0,07 |
| US79466L3024             | Salesforce.com Inc             | STK                                         | 777                   | 3.782                                    | 5.459                | USD  | 183,3300           | 126.913,23                   | 0,08 |
| US8545021011             | Stanley Black & Decker Inc.    | STK                                         | 561                   | 791                                      | 4.003                | USD  | 136,1200           | 68.035,74                    | 0,04 |
| US4370761029             | The Home Depot Inc.            | STK                                         | 571                   | 1.000                                    | 3.494                | USD  | 246,1200           | 125.208,95                   | 0,08 |
| US8725401090             | TJX Companies Inc.             | STK                                         | 1.786                 | 1.786                                    | 12.156               | USD  | 50,7700            | 80.786,90                    | 0,05 |
| US9113631090             | United Rentals Inc.            | STK                                         | 731                   | 731                                      | 5.000                | USD  | 147,7200           | 96.207,52                    | 0,06 |
| US9182041080             | V.F. Corp.                     | STK                                         | 1.185                 | 1.185                                    | 0                    | USD  | 60,3600            | 63.726,48                    | 0,04 |
| US92343V1044             | Verizon Communications Inc.    | STK                                         | 1.219                 | 30.282                                   | 29.063               | USD  | 54,6900            | 59.396,93                    | 0,04 |
| US92826C8394             | VISA Inc. A                    | STK                                         | 678                   | 956                                      | 4.707                | USD  | 191,3800           | 115.605,52                   | 0,07 |
| US9311421039             | Walmart Inc.                   | STK                                         | 860                   | 1.297                                    | 437                  | USD  | 119,0600           | 91.225,59                    | 0,06 |
| Verzinsliche Wertpapiere |                                |                                             |                       |                                          |                      | EUR  | 89.995.425,01      | 54,31                        |      |
| DE0001102499             | 0,000% BRD Anl. 15.02.30       | EUR                                         | 250                   | 250                                      | 0                    | %    | 105,0060           | 262.515,00                   | 0,16 |
| DE0001102481             | 0,000% BRD Anl. 15.08.50       | EUR                                         | 200                   | 200                                      | 0                    | %    | 100,6945           | 201.389,00                   | 0,12 |
| DE0001141794             | 0,000% BRD BO 05.04.24         | EUR                                         | 200                   | 200                                      | 0                    | %    | 102,7620           | 205.524,00                   | 0,12 |
| DE0001104735             | 0,000% BRD BSA 11.09.20        | EUR                                         | 10.000                | 23.775                                   | 13.775               | %    | 100,1230           | 10.012.300,00                | 6,04 |
| DE0001104743             | 0,000% BRD BSA 11.12.20        | EUR                                         | 10.650                | 13.650                                   | 3.000                | %    | 100,2955           | 10.681.470,75                | 6,45 |
| FR0013311016             | 0,000% Frankreich OAT 25.02.21 | EUR                                         | 9.250                 | 14.550                                   | 5.300                | %    | 100,3835           | 9.285.473,75                 | 5,60 |
| FR0012968337             | 0,250% Frankreich OAT 25.11.20 | EUR                                         | 13.600                | 23.650                                   | 10.050               | %    | 100,3210           | 13.643.656,00                | 8,23 |
| FR0013200813             | 0,250% Frankreich OAT 25.11.26 | EUR                                         | 400                   | 400                                      | 0                    | %    | 104,3800           | 417.520,00                   | 0,25 |
| DE0001102374             | 0,500% BRD Anl. 15.02.25       | EUR                                         | 6.100                 | 6.100                                    | 0                    | %    | 105,7630           | 6.451.543,00                 | 3,89 |
| FR0012993103             | 1,500% Frankreich OAT 25.05.31 | EUR                                         | 5.850                 | 5.850                                    | 0                    | %    | 117,7980           | 6.891.183,00                 | 4,16 |
| FR0010949651             | 2,500% Frankreich OAT 25.10.20 | EUR                                         | 9.800                 | 16.900                                   | 7.100                | %    | 100,9645           | 9.894.521,00                 | 5,97 |
| ES00000128E2             | 3,450% Spanien Bonos 30.07.66  | EUR                                         | 200                   | 200                                      | 400                  | %    | 164,9890           | 329.978,00                   | 0,20 |
| FR0010870956             | 4,000% Frankreich OAT 25.04.60 | EUR                                         | 200                   | 200                                      | 0                    | %    | 218,5130           | 437.026,00                   | 0,26 |
| IT0004923998             | 4,750% Italien B.T.P. 01.09.44 | EUR                                         | 850                   | 850                                      | 450                  | %    | 148,8835           | 1.265.509,75                 | 0,76 |
| ES00000123U9             | 5,400% Spanien Bos. 31.01.23   | EUR                                         | 150                   | 150                                      | 0                    | %    | 114,9385           | 172.407,75                   | 0,10 |
| IT0004848831             | 5,500% Italien B.T.P. 01.11.22 | EUR                                         | 400                   | 400                                      | 0                    | %    | 112,3770           | 449.508,00                   | 0,27 |

## Vermögensaufstellung zum 30.06.2020

| ISIN                                                                              | Gattungsbezeichnung                                 | Stück bzw.<br>Anteile bzw.<br>Whg. in 1.000 | Bestand<br>30.06.2020 | Käufe/<br>Zugänge<br>im Berichtszeitraum | Verkäufe/<br>Abgänge |     | Kurs       | Kurswert<br>in EUR    | % des<br>Fonds-<br>vermögens |
|-----------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------|---------------------------------------------|-----------------------|------------------------------------------|----------------------|-----|------------|-----------------------|------------------------------|
| ES00000123C7                                                                      | 5,900% Spanien Bos. 30.07.26                        | EUR                                         | 300                   | 300                                      | 500                  | %   | 135,8790   | 407.637,00            | 0,25                         |
| IT0001444378                                                                      | 6,000% Italien B.T.P. 01.05.31                      | EUR                                         | 450                   | 450                                      | 450                  | %   | 145,9780   | 656.901,00            | 0,40                         |
| ES0000011868                                                                      | 6,000% Spanien Bos. 31.01.29                        | EUR                                         | 250                   | 250                                      | 0                    | %   | 148,4145   | 371.036,25            | 0,22                         |
| IT0001086567                                                                      | 7,250% Italien B.T.P. 01.11.26                      | EUR                                         | 400                   | 400                                      | 450                  | %   | 138,9945   | 555.978,00            | 0,34                         |
| GB00BL68HG94                                                                      | 0,125% Großbritannien TSK 31.01.23                  | GBP                                         | 250                   | 250                                      | 0                    | %   | 100,4330   | 274.827,61            | 0,17                         |
| GB00BK5CVX03                                                                      | 0,625% Großbritannien TSK 07.06.25                  | GBP                                         | 350                   | 350                                      | 0                    | %   | 103,3540   | 395.948,99            | 0,24                         |
| GB00BJMHB534                                                                      | 0,875% Großbritannien TSK 22.10.29                  | GBP                                         | 300                   | 300                                      | 0                    | %   | 107,0190   | 351.419,66            | 0,21                         |
| GB00BFMCN652                                                                      | 1,625% Großbritannien TSK 22.10.71                  | GBP                                         | 500                   | 500                                      | 0                    | %   | 153,3685   | 839.363,51            | 0,51                         |
| GB00B39R3707                                                                      | 4,250% Großbritannien TSK 07.12.49                  | GBP                                         | 250                   | 250                                      | 0                    | %   | 197,9420   | 541.653,90            | 0,33                         |
| JP14000117B7                                                                      | 2,400% Japan Bds. 20.03.48                          | JPY                                         | 19.200                | 19.200                                   | 0                    | %   | 147,5605   | 234.319,87            | 0,14                         |
| US912828Z948                                                                      | 1,500% USA Nts. 15.02.30                            | USD                                         | 1.450                 | 1.450                                    | 0                    | %   | 108,3906   | 1.400.270,90          | 0,85                         |
| US912828P790                                                                      | 1,500% USA Nts. 28.02.23                            | USD                                         | 5.000                 | 5.000                                    | 0                    | %   | 103,5625   | 4.613.439,95          | 2,78                         |
| US912828U246                                                                      | 2,000% USA Nts. 15.11.26                            | USD                                         | 5.200                 | 5.200                                    | 0                    | %   | 109,9492   | 5.093.869,78          | 3,07                         |
| US912810SF66                                                                      | 3,000% USA Nts. 15.02.49                            | USD                                         | 2.950                 | 2.950                                    | 0                    | %   | 139,1484   | 3.657.233,59          | 2,21                         |
| <b>Zertifikate</b>                                                                |                                                     |                                             |                       |                                          |                      |     | <b>EUR</b> | <b>1.196.945,83</b>   | <b>0,72</b>                  |
| FR0013416716                                                                      | Amundi Physical Metals ETC Zt. 23.05.2118           | STK                                         | 19.000                | 19.000                                   | 76.185               | USD | 70,7080    | 1.196.945,83          | 0,72                         |
| <b>Sonstige Beteiligungswertpapiere</b>                                           |                                                     |                                             |                       |                                          |                      |     | <b>EUR</b> | <b>189.169,20</b>     | <b>0,11</b>                  |
| CH0012032048                                                                      | Roche Holding AG GEN                                | STK                                         | 613                   | 2.210                                    | 4.662                | CHF | 329,7500   | 189.169,20            | 0,11                         |
| <b>An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere</b> |                                                     |                                             |                       |                                          |                      |     | <b>EUR</b> | <b>163.894,51</b>     | <b>0,10</b>                  |
| <b>Aktien</b>                                                                     |                                                     |                                             |                       |                                          |                      |     | <b>EUR</b> | <b>163.894,51</b>     | <b>0,10</b>                  |
| US5128071082                                                                      | Lam Research Corp.                                  | STK                                         | 399                   | 399                                      | 2.598                | USD | 308,4600   | 109.653,90            | 0,07                         |
| US64110D1046                                                                      | NetApp Inc.                                         | STK                                         | 1.383                 | 1.383                                    | 6.939                | USD | 44,0200    | 54.240,61             | 0,03                         |
| <b>Nichtnotierte Wertpapiere</b>                                                  |                                                     |                                             |                       |                                          |                      |     | <b>EUR</b> | <b>296.731,25</b>     | <b>0,18</b>                  |
| <b>Verzinsliche Wertpapiere</b>                                                   |                                                     |                                             |                       |                                          |                      |     | <b>EUR</b> | <b>296.731,25</b>     | <b>0,18</b>                  |
| JP1120221H48                                                                      | 0,100% Japan ILB 10.03.27 <sup>2</sup>              | JPY                                         | 23.400                | 23.400                                   | 0                    | %   | 99,6225    | 196.413,33            | 0,12                         |
| JP1120241K56                                                                      | 0,100% Japan ILB 10.03.29 <sup>2</sup>              | JPY                                         | 11.900                | 11.900                                   | 0                    | %   | 100,0210   | 100.317,92            | 0,06                         |
| <b>Investmentanteile</b>                                                          |                                                     |                                             |                       |                                          |                      |     | <b>EUR</b> | <b>47.548.276,67</b>  | <b>28,70</b>                 |
| <b>Gruppeneigene Investmentanteile</b>                                            |                                                     |                                             |                       |                                          |                      |     | <b>EUR</b> | <b>11.300.525,28</b>  | <b>6,82</b>                  |
| LU1602144906                                                                      | AIS - Amundi ETF MSCI Pacific ex Japan UCITS ETF €  | ANT                                         | 2.600                 | 2.600                                    | 0                    | EUR | 493,9500   | 1.284.270,00          | 0,78                         |
| LU1681041205                                                                      | Amundi-Cpr Gbl G.M. Meac                            | ANT                                         | 81.624                | 101.624                                  | 20.000               | USD | 137,7321   | 10.016.255,28         | 6,05                         |
| <b>Gruppenfremde Investmentanteile</b>                                            |                                                     |                                             |                       |                                          |                      |     | <b>EUR</b> | <b>36.247.751,39</b>  | <b>21,88</b>                 |
| IE00B3F81R35                                                                      | iShares III PLC - iShares Core Euro Corp. Bond ETF  | ANT                                         | 116.728               | 190.728                                  | 74.000               | EUR | 131,6700   | 15.369.575,76         | 9,28                         |
| IE00B6YX5M31                                                                      | SPDR Bloomberg Barclays Euro High Yield Bond ETF    | ANT                                         | 142.000               | 242.000                                  | 100.000              | EUR | 54,1500    | 7.689.300,00          | 4,64                         |
| LU1048316647                                                                      | UBS ETF (LU) Bloomberg Barclays US Liquid Corp. A\$ | ANT                                         | 540.000               | 880.000                                  | 340.000              | USD | 18,4800    | 8.890.947,97          | 5,37                         |
| IE00BDR5HM97                                                                      | Xtrackers USD High Yield Corporate Bond UCITS ETF   | ANT                                         | 347.000               | 530.000                                  | 183.000              | USD | 13,9020    | 4.297.927,66          | 2,59                         |
| <b>Summe Wertpapiervermögen<sup>3</sup></b>                                       |                                                     |                                             |                       |                                          |                      |     | <b>EUR</b> | <b>150.941.588,07</b> | <b>91,10</b>                 |

## Vermögensaufstellung zum 30.06.2020

| ISIN                                                                                             | Gattungsbezeichnung                                   | Markt | Stück bzw.<br>Anteile bzw.<br>Whg. in 1.000 | Bestand<br>30.06.2020 | Käufe/<br>Zugänge<br>im Berichtszeitraum | Verkäufe/<br>Abgänge | Kurs       | Kurswert<br>in EUR | % des<br>Fonds-<br>vermögens |
|--------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------|-------|---------------------------------------------|-----------------------|------------------------------------------|----------------------|------------|--------------------|------------------------------|
| Derivate (Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.) |                                                       |       |                                             |                       |                                          |                      | EUR        | 422.296,19         | 0,25                         |
| Derivate auf einzelne Wertpapiere                                                                |                                                       |       |                                             |                       |                                          |                      | EUR        | 50.751,07          | 0,03                         |
| Wertpapier-Optionsrechte                                                                         |                                                       |       |                                             |                       |                                          |                      | EUR        | 50.751,07          | 0,03                         |
| Forderungen/Verbindlichkeiten                                                                    |                                                       |       |                                             |                       |                                          |                      | EUR        | 50.751,07          | 0,03                         |
| Optionsrechte auf Aktien                                                                         |                                                       |       |                                             |                       |                                          |                      | EUR        | 50.751,07          | 0,03                         |
| CALL Agnico Eagle Mines Ltd 60,00 01/21                                                          | NAQ                                                   | STK   | Anzahl                                      | 5.000                 |                                          |                      | USD 8,7500 | 38.978,97          | 0,02                         |
| CALL Wheaton Precious Metals Corp 42,00 01/21                                                    | NAQ                                                   | STK   | Anzahl                                      | 7.300                 |                                          |                      | USD 6,0100 | 39.088,56          | 0,02                         |
| PUT Wheaton Precious Metals Corp 39,00 01/21                                                     | NAQ                                                   | STK   | Anzahl                                      | -7.300                |                                          |                      | USD 4,2000 | -27.316,46         | -0,02                        |
| Wertpapier-Optionsscheine                                                                        |                                                       |       |                                             |                       |                                          |                      | EUR        | 25.899,75          | 0,02                         |
| Optionsscheine auf Aktien                                                                        |                                                       |       |                                             |                       |                                          |                      | EUR        | 25.899,75          | 0,02                         |
| US0042851107                                                                                     | Acamar Partners<br>Acquisition Call 26.02.26          | STK   | Anzahl                                      | 776                   | 313                                      | 33                   | USD 1,1100 | 767,43             | 0,00                         |
| US22564L1136                                                                                     | Crescent Acquisition<br>Call 07.03.24                 | STK   | Anzahl                                      | 874                   | 0                                        | 0                    | USD 1,5100 | 1.175,82           | 0,00                         |
| US3842781151                                                                                     | Graf Industrial Call 31.12.25                         | STK   | Anzahl                                      | 8.091                 | 0                                        | 7                    | USD 2,9200 | 21.049,29          | 0,01                         |
| US42589C1128                                                                                     | Hennessy Capital Acquisition<br>Call 01.10.25         | STK   | Anzahl                                      | 1.000                 | 773                                      | 999                  | USD 0,9000 | 801,85             | 0,00                         |
| US80821R1178                                                                                     | Schultze Special Purpose<br>Acquisition Call 31.12.23 | STK   | Anzahl                                      | 1.804                 | 0                                        | 0                    | USD 1,3099 | 2.105,36           | 0,00                         |
| Aktienindex-Derivate                                                                             |                                                       |       |                                             |                       |                                          |                      | EUR        | 35.919,47          | 0,02                         |
| Forderungen/Verbindlichkeiten                                                                    |                                                       |       |                                             |                       |                                          |                      | EUR        | 35.919,47          | 0,02                         |
| Aktienindex-Terminkontrakte                                                                      |                                                       |       |                                             |                       |                                          |                      | EUR        | 35.919,47          | 0,02                         |
| ASX SPI 200 Index Future 09/20                                                                   | SFE                                                   | AUD   | Anzahl                                      | -125                  |                                          |                      |            | -3.973,47          | 0,00                         |
| SMI Index Future 09/20                                                                           | EDT                                                   | CHF   | Anzahl                                      | -10                   |                                          |                      |            | 112,30             | 0,00                         |
| EURO STOXX 50 Index Future 09/20                                                                 | EDT                                                   | EUR   | Anzahl                                      | 900                   |                                          |                      |            | 116.550,00         | 0,07                         |
| MSCI Emerging Markets EUR NR Index Future 09/20                                                  | EDT                                                   | EUR   | Anzahl                                      | 5.200                 |                                          |                      |            | 38.896,00          | 0,02                         |
| Stoxx 600 Basic Ressources Future 09/20                                                          | EDT                                                   | EUR   | Anzahl                                      | 450                   |                                          |                      |            | -4.770,00          | 0,00                         |
| FTSE 100 Index Future 09/20                                                                      | EUT                                                   | GBP   | Anzahl                                      | 120                   |                                          |                      |            | 20.556,04          | 0,01                         |
| Nikkei 225 Stock Average Index Future 09/20                                                      | FJO                                                   | JPY   | Anzahl                                      | 14.000                |                                          |                      |            | -56.901,83         | -0,03                        |
| Tokyo Stock Price Index Future 09/20                                                             | FJO                                                   | JPY   | Anzahl                                      | 30.000                |                                          |                      |            | -11.909,68         | -0,01                        |
| E-Mini Energy Select Sector Future 09/20                                                         | NAR                                                   | USD   | Anzahl                                      | 900                   |                                          |                      |            | -11.386,32         | -0,01                        |
| E-mini Industrial Select Sector Future 09/20                                                     | NAR                                                   | USD   | Anzahl                                      | 600                   |                                          |                      |            | 0,00               | 0,00                         |
| E-Mini Materials Select Sector Future 09/20                                                      | NAR                                                   | USD   | Anzahl                                      | 800                   |                                          |                      |            | 13.186,03          | 0,01                         |
| E-Mini Nasdaq 100 Index Future 09/20                                                             | NAR                                                   | USD   | Anzahl                                      | 40                    |                                          |                      |            | 13.161,97          | 0,01                         |
| E-mini S & P Financial Select Sector Future 09/20                                                | NAR                                                   | USD   | Anzahl                                      | 1.250                 |                                          |                      |            | -2.839,90          | 0,00                         |
| E-Mini S&P 500 Index Future 09/20                                                                | NAR                                                   | USD   | Anzahl                                      | 1.800                 |                                          |                      |            | -74.761,67         | -0,05                        |

## Vermögensaufstellung zum 30.06.2020

| Gattungsbezeichnung                                  | Markt | Stück bzw.<br>Anteile bzw.<br>Whg. in 1.000 | Bestand<br>30.06.2020 | Käufe/<br>Zugänge<br>im Berichtszeitraum | Verkäufe/<br>Abgänge | Kurs         | Kurswert<br>in EUR | % des<br>Fonds-<br>vermögens |
|------------------------------------------------------|-------|---------------------------------------------|-----------------------|------------------------------------------|----------------------|--------------|--------------------|------------------------------|
| <b>Optionsrechte</b>                                 |       |                                             |                       |                                          |                      | <b>EUR</b>   | <b>490.168,89</b>  | <b>0,30</b>                  |
| <b>Optionsrechte auf Aktienindices</b>               |       |                                             |                       |                                          |                      | <b>EUR</b>   | <b>612.050,57</b>  | <b>0,37</b>                  |
| Call E-Mini Nasdaq 100 Index 10000,00 09/20          | NAR   | STK Anzahl                                  | 600                   |                                          |                      | USD 525,5000 | 280.915,89         | 0,17                         |
| Call E-Mini Nasdaq 100 Index 10200,00 09/20          | NAR   | STK Anzahl                                  | 200                   |                                          |                      | USD 414,0000 | 73.770,49          | 0,04                         |
| Call E-Mini Nasdaq 100 Index 10700,00 09/20          | NAR   | STK Anzahl                                  | -100                  |                                          |                      | USD 197,7500 | -17.618,50         | -0,01                        |
| CALL Euro Stoxx 50 Index 2950,00 07/20               | EDT   | STK Anzahl                                  | 640                   |                                          |                      | EUR 304,9000 | 195.136,00         | 0,12                         |
| CALL Euro Stoxx 50 Index 3075,00 07/20               | EDT   | STK Anzahl                                  | -650                  |                                          |                      | EUR 199,3000 | -129.545,00        | -0,08                        |
| CALL Euro Stoxx 50 Index 3075,00 09/20               | EDT   | STK Anzahl                                  | -240                  |                                          |                      | EUR 270,6000 | -64.944,00         | -0,04                        |
| CALL Euro Stoxx 50 Index 3200,00 09/20               | EDT   | STK Anzahl                                  | 650                   |                                          |                      | EUR 167,0000 | 108.550,00         | 0,07                         |
| CALL Euro Stoxx Banks Price Index 60,00 09/20        | EDT   | STK Anzahl                                  | 12.100                |                                          |                      | EUR 7,5000   | 90.750,00          | 0,05                         |
| CALL Euro Stoxx Banks Price Index 70,00 09/20        | EDT   | STK Anzahl                                  | 14.150                |                                          |                      | EUR 2,9000   | 41.035,00          | 0,02                         |
| CALL Euro Stoxx Banks Price Index 75,00 09/20        | EDT   | STK Anzahl                                  | -7.100                |                                          |                      | EUR 1,6500   | -11.715,00         | -0,01                        |
| CALL Russell 2000 Index 1490,00 09/20                | NAE   | STK Anzahl                                  | 3.400                 |                                          |                      | USD 47,7000  | 144.493,94         | 0,09                         |
| CALL S&P 500 Index 3010,00 07/ 20                    | NAE   | STK Anzahl                                  | 800                   |                                          |                      | USD 91,1000  | 64.932,29          | 0,04                         |
| CALL S&P 500 Index 3110,00 09/20                     | NAE   | STK Anzahl                                  | -1.700                |                                          |                      | USD 112,1000 | -169.787,95        | -0,10                        |
| CALL S&P 500 Index 3115,00 07/ 20                    | NAE   | STK Anzahl                                  | -800                  |                                          |                      | USD 33,0000  | -23.521,03         | -0,01                        |
| CALL S&P 500 Index 3200,00 09/20                     | NAE   | STK Anzahl                                  | 800                   |                                          |                      | USD 68,4600  | 48.795,44          | 0,03                         |
| PUT Euro Stoxx 50 Index 2700,00 07/ 20               | EDT   | STK Anzahl                                  | -650                  |                                          |                      | EUR 5,4000   | -3.510,00          | 0,00                         |
| PUT Euro Stoxx 50 Index 3025,00 09/20                | EDT   | STK Anzahl                                  | -900                  |                                          |                      | EUR 109,8000 | -98.820,00         | -0,06                        |
| PUT Euro Stoxx 50 Index 3150,00 09/20                | EDT   | STK Anzahl                                  | 900                   |                                          |                      | EUR 146,7000 | 132.030,00         | 0,08                         |
| PUT S&P 500 Index 2725,00 07/ 20                     | NAE   | STK Anzahl                                  | -800                  |                                          |                      | USD 12,6900  | -9.044,90          | -0,01                        |
| PUT S&P 500 Index 2870,00 09/20                      | NAE   | STK Anzahl                                  | -1.100                |                                          |                      | USD 101,8000 | -99.768,35         | -0,06                        |
| PUT S&P 500 Index 2990,00 09/20                      | NAE   | STK Anzahl                                  | 1.100                 |                                          |                      | USD 161,5000 | 158.276,91         | 0,10                         |
| PUT S&P 500 Index 3000,00 09/20                      | NAE   | STK Anzahl                                  | -800                  |                                          |                      | USD 138,0000 | -98.360,66         | -0,06                        |
| <b>Optionsrechte auf Aktienindex-Terminkontrakte</b> |       |                                             |                       |                                          |                      | <b>EUR</b>   | <b>-121.881,68</b> | <b>-0,07</b>                 |
| Call S&P 500 E-mini Index Future 3200,00 09/20       | NAE   | STK Anzahl                                  | -1.900                |                                          |                      | USD 72,0000  | -121.881,68        | -0,07                        |
| <b>Zins-Derivate</b>                                 |       |                                             |                       |                                          |                      | <b>EUR</b>   | <b>-14.659,42</b>  | <b>-0,01</b>                 |
| <b>Forderungen/Verbindlichkeiten</b>                 |       |                                             |                       |                                          |                      | <b>EUR</b>   | <b>-14.659,42</b>  | <b>-0,01</b>                 |
| <b>Zinsterminkontrakte</b>                           |       |                                             |                       |                                          |                      | <b>EUR</b>   | <b>-14.659,42</b>  | <b>-0,01</b>                 |
| 6,000% 10-Year Australien Bond Future 09/20          | SFE   | AUD                                         | 20.600.000            |                                          |                      |              | 183.465,12         | 0,11                         |
| 6,000% 10-Year Gov. of Canada Bond Future 09/20      | NCM   | CAD                                         | 9.600.000             |                                          |                      |              | 9.206,41           | 0,01                         |
| 4,000% Euro Buxl Future 09/20                        | EDT   | EUR                                         | -700.000              |                                          |                      |              | -43.380,00         | -0,03                        |
| 6,000% Euro Bobl Future 09/20                        | EDT   | EUR                                         | -21.300.000           |                                          |                      |              | -113.400,00        | -0,07                        |
| 6,000% Euro Bund Future 09/20                        | EDT   | EUR                                         | 9.400.000             |                                          |                      |              | 246.170,00         | 0,15                         |
| 6,000% Euro Schatz Future 09/20                      | EDT   | EUR                                         | -21.800.000           |                                          |                      |              | -25.900,00         | -0,02                        |
| 6,000% Euro-BTP Future 09/20                         | EDT   | EUR                                         | -3.500.000            |                                          |                      |              | -73.460,00         | -0,04                        |
| 6,000% Long Term Euro OAT Future 09/20               | EDT   | EUR                                         | -4.600.000            |                                          |                      |              | -132.940,00        | -0,08                        |
| 6,000% Long Gilt Future 09/20                        | EUT   | GBP                                         | -2.200.000            |                                          |                      |              | -11.077,06         | -0,01                        |
| 6,000% 10-Year Japanese Gov. Bond Future TSE 09/20   | FJO   | JPY                                         | -200.000.000          |                                          |                      |              | -165,41            | 0,00                         |
| 6,000% 2-Year U.S. Treasury Notes Future 09/20       | NAU   | USD                                         | 99.200.000            |                                          |                      |              | 27.173,92          | 0,02                         |
| 6,000% 30-Year U.S. Treasury Long Bond Fut. 09/20    | NAU   | USD                                         | -3.800.000            |                                          |                      |              | -62.004,41         | -0,04                        |
| 6,000% 5-Year U.S. Treasury Notes Future 09/20       | NAU   | USD                                         | -6.200.000            |                                          |                      |              | -16.830,60         | -0,01                        |
| 6,000% Ultra10-Year U.S. Treasury Notes Fut. 09/20   | NAU   | USD                                         | -200.000              |                                          |                      |              | -1.517,39          | 0,00                         |

## Vermögensaufstellung zum 30.06.2020

| Gattungsbezeichnung                     | Markt | Stück bzw.<br>Anteile bzw.<br>Whg. in 1.000 | Bestand<br>30.06.2020 | Käufe/<br>Zugänge<br>im Berichtszeitraum | Verkäufe/<br>Abgänge | Kurs | Kurswert<br>in EUR | % des<br>Fonds-<br>vermögens |
|-----------------------------------------|-------|---------------------------------------------|-----------------------|------------------------------------------|----------------------|------|--------------------|------------------------------|
| <b>Devisen-Derivate</b>                 |       |                                             |                       |                                          |                      | EUR  | -165.783,57        | -0,10                        |
| <b>Forderungen/Verbindlichkeiten</b>    |       |                                             |                       |                                          |                      | EUR  | -165.783,57        | -0,10                        |
| <b>Devisenterminkontrakte (Verkauf)</b> |       |                                             |                       |                                          |                      | EUR  | 35.062,03          | 0,02                         |
| <b>Offene Positionen</b>                |       |                                             |                       |                                          |                      | EUR  | 39.692,60          | 0,02                         |
| BRL/USD 6,0 Mio.                        | OTC   |                                             |                       |                                          |                      |      | -26.816,90         | -0,02                        |
| CAD/EUR 1,1 Mio.                        | OTC   |                                             |                       |                                          |                      |      | 5.657,50           | 0,00                         |
| CHF/EUR 1,1 Mio.                        | OTC   |                                             |                       |                                          |                      |      | -9.759,18          | -0,01                        |
| CLP/USD 0,9 Mio.                        | OTC   |                                             |                       |                                          |                      |      | -13,56             | 0,00                         |
| CNY/USD 9,6 Mio.                        | OTC   |                                             |                       |                                          |                      |      | -8.607,31          | -0,01                        |
| CZK/EUR 17,0 Mio.                       | OTC   |                                             |                       |                                          |                      |      | 5.311,91           | 0,00                         |
| DKK/EUR 2,3 Mio.                        | OTC   |                                             |                       |                                          |                      |      | -263,40            | 0,00                         |
| GBP/EUR 3,8 Mio.                        | OTC   |                                             |                       |                                          |                      |      | 129.407,45         | 0,08                         |
| HKD/EUR 5,8 Mio.                        | OTC   |                                             |                       |                                          |                      |      | 512,28             | 0,00                         |
| IDR/USD 1.600,0 Mio.                    | OTC   |                                             |                       |                                          |                      |      | -1.823,22          | 0,00                         |
| ILS/EUR 3,3 Mio.                        | OTC   |                                             |                       |                                          |                      |      | -4.077,69          | 0,00                         |
| KRW/USD 4.780,0 Mio.                    | OTC   |                                             |                       |                                          |                      |      | -48.491,54         | -0,03                        |
| NZD/EUR 3,1 Mio.                        | OTC   |                                             |                       |                                          |                      |      | 1.391,09           | 0,00                         |
| THB/EUR 59,6 Mio.                       | OTC   |                                             |                       |                                          |                      |      | -293,37            | 0,00                         |
| TWD/USD 35,0 Mio.                       | OTC   |                                             |                       |                                          |                      |      | -2.441,46          | 0,00                         |
| USD/EUR 4,9 Mio.                        | OTC   |                                             |                       |                                          |                      |      | 0,00               | 0,00                         |
| <b>Geschlossene Positionen</b>          |       |                                             |                       |                                          |                      | EUR  | -4.630,57          | 0,00                         |
| GBP/EUR 1,2 Mio.                        | OTC   |                                             |                       |                                          |                      |      | -20.910,66         | -0,01                        |
| USD/EUR 4,9 Mio.                        | OTC   |                                             |                       |                                          |                      |      | 16.280,09          | 0,01                         |
| <b>Devisenterminkontrakte (Kauf)</b>    |       |                                             |                       |                                          |                      | EUR  | -200.845,60        | -0,12                        |
| <b>Offene Positionen</b>                |       |                                             |                       |                                          |                      | EUR  | -148.294,96        | -0,09                        |
| BRL/USD 9,9 Mio.                        | OTC   |                                             |                       |                                          |                      |      | -21.609,00         | -0,01                        |
| CLP/USD 1.544,4 Mio.                    | OTC   |                                             |                       |                                          |                      |      | -7.378,19          | 0,00                         |
| CNY/USD 10,0 Mio.                       | OTC   |                                             |                       |                                          |                      |      | 6.489,53           | 0,00                         |
| COP/USD 7.259,4 Mio.                    | OTC   |                                             |                       |                                          |                      |      | 4.113,80           | 0,00                         |
| IDR/USD 57.200,0 Mio.                   | OTC   |                                             |                       |                                          |                      |      | 9.762,45           | 0,01                         |
| INR/USD 140,0 Mio.                      | OTC   |                                             |                       |                                          |                      |      | 11.691,66          | 0,01                         |
| JPY/EUR 631,0 Mio.                      | OTC   |                                             |                       |                                          |                      |      | -91.720,49         | -0,06                        |
| MXN/EUR 21,5 Mio.                       | OTC   |                                             |                       |                                          |                      |      | -37.766,75         | -0,02                        |
| NOK/EUR 28,3 Mio.                       | OTC   |                                             |                       |                                          |                      |      | -38.617,98         | -0,02                        |
| PHP/USD 143,2 Mio.                      | OTC   |                                             |                       |                                          |                      |      | 24.760,35          | 0,01                         |
| RUB/EUR 64,5 Mio.                       | OTC   |                                             |                       |                                          |                      |      | -12.011,53         | -0,01                        |
| USD/EUR 23,3 Mio.                       | OTC   |                                             |                       |                                          |                      |      | 11.007,17          | 0,01                         |
| ZAR/EUR 14,8 Mio.                       | OTC   |                                             |                       |                                          |                      |      | -7.015,98          | 0,00                         |
| <b>Geschlossene Positionen</b>          |       |                                             |                       |                                          |                      | EUR  | -52.550,64         | -0,03                        |
| JPY/EUR 252,0 Mio.                      | OTC   |                                             |                       |                                          |                      |      | 5.007,49           | 0,00                         |
| NOK/EUR 10,8 Mio.                       | OTC   |                                             |                       |                                          |                      |      | 5.258,90           | 0,00                         |
| RUB/EUR 39,0 Mio.                       | OTC   |                                             |                       |                                          |                      |      | 4.012,79           | 0,00                         |
| USD/EUR 31,0 Mio.                       | OTC   |                                             |                       |                                          |                      |      | -66.829,82         | -0,04                        |

## Vermögensaufstellung zum 30.06.2020

| Gattungsbezeichnung                                | Stück bzw.<br>Anteile bzw.<br>Whg. in 1.000 | Bestand<br>30.06.2020 | Käufe/<br>Zugänge<br>im Berichtszeitraum | Verkäufe/<br>Abgänge | Kurs       | Kurswert<br>in EUR    | % des<br>Fonds-<br>vermögens |
|----------------------------------------------------|---------------------------------------------|-----------------------|------------------------------------------|----------------------|------------|-----------------------|------------------------------|
| <b>Bankguthaben</b>                                |                                             |                       |                                          |                      | <b>EUR</b> | <b>18.435.368,22</b>  | <b>11,13</b>                 |
| <b>EUR-Guthaben bei:</b>                           |                                             |                       |                                          |                      | <b>EUR</b> | <b>16.362.482,04</b>  | <b>9,88</b>                  |
| CACEIS Bank S.A. [Germany Branch] (Verwahrstelle)  | EUR                                         | 16.362.482,04         |                                          |                      | 100,0000   | 16.362.482,04         | 9,88                         |
| <b>Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen</b>      |                                             |                       |                                          |                      | <b>EUR</b> | <b>862.537,70</b>     | <b>0,52</b>                  |
|                                                    | CZK                                         | 17.000.000,00         |                                          |                      | 100,0000   | 634.316,52            | 0,38                         |
|                                                    | DKK                                         | 465.085,89            |                                          |                      | 100,0000   | 62.407,53             | 0,04                         |
|                                                    | GBP                                         | 134.588,65            |                                          |                      | 100,0000   | 147.316,83            | 0,09                         |
|                                                    | NOK                                         | 31.131,66             |                                          |                      | 100,0000   | 2.850,70              | 0,00                         |
|                                                    | PLN                                         | 33.755,61             |                                          |                      | 100,0000   | 7.564,88              | 0,00                         |
|                                                    | SEK                                         | 84.784,34             |                                          |                      | 100,0000   | 8.081,24              | 0,00                         |
| <b>Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen</b>          |                                             |                       |                                          |                      | <b>EUR</b> | <b>1.210.348,48</b>   | <b>0,73</b>                  |
|                                                    | AUD                                         | 436.218,08            |                                          |                      | 100,0000   | 266.661,41            | 0,16                         |
|                                                    | CAD                                         | 134.247,75            |                                          |                      | 100,0000   | 87.469,22             | 0,05                         |
|                                                    | CHF                                         | 117.319,16            |                                          |                      | 100,0000   | 109.792,86            | 0,07                         |
|                                                    | HKD                                         | 63,73                 |                                          |                      | 100,0000   | 7,33                  | 0,00                         |
|                                                    | ILS                                         | 43,44                 |                                          |                      | 100,0000   | 11,19                 | 0,00                         |
|                                                    | JPY                                         | 33.186.866,00         |                                          |                      | 100,0000   | 274.475,78            | 0,17                         |
|                                                    | MXN                                         | 49.846,35             |                                          |                      | 100,0000   | 1.921,58              | 0,00                         |
|                                                    | RUB                                         | 90.055,66             |                                          |                      | 100,0000   | 1.138,77              | 0,00                         |
|                                                    | SGD                                         | 232,22                |                                          |                      | 100,0000   | 148,26                | 0,00                         |
|                                                    | THB                                         | 0,00                  |                                          |                      | 100,0000   | 0,00                  | 0,00                         |
|                                                    | USD                                         | 525.718,00            |                                          |                      | 100,0000   | 468.387,39            | 0,28                         |
|                                                    | ZAR                                         | 6.510,70              |                                          |                      | 100,0000   | 334,69                | 0,00                         |
| <b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>               |                                             |                       |                                          |                      | <b>EUR</b> | <b>4.022.092,61</b>   | <b>2,43</b>                  |
| <b>Zinsansprüche</b>                               |                                             |                       |                                          |                      | <b>EUR</b> | <b>344.290,43</b>     | <b>0,21</b>                  |
|                                                    | EUR                                         | 344.290,43            |                                          |                      |            | 344.290,43            | 0,21                         |
| <b>Dividendenansprüche</b>                         |                                             |                       |                                          |                      | <b>EUR</b> | <b>11.511,29</b>      | <b>0,01</b>                  |
|                                                    | EUR                                         | 11.511,29             |                                          |                      |            | 11.511,29             | 0,01                         |
| <b>Einschüsse (Initial Margins)</b>                |                                             |                       |                                          |                      | <b>EUR</b> | <b>3.650.978,49</b>   | <b>2,20</b>                  |
|                                                    | EUR                                         | 3.650.978,49          |                                          |                      |            | 3.650.978,49          | 2,20                         |
| <b>Quellensteueransprüche</b>                      |                                             |                       |                                          |                      | <b>EUR</b> | <b>5.632,54</b>       | <b>0,00</b>                  |
|                                                    | EUR                                         | 5.632,54              |                                          |                      |            | 5.632,54              | 0,00                         |
| <b>Variation Margin</b>                            |                                             |                       |                                          |                      | <b>EUR</b> | <b>9.679,86</b>       | <b>0,01</b>                  |
|                                                    | EUR                                         | 9.679,86              |                                          |                      |            | 9.679,86              | 0,01                         |
| <b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>                  |                                             |                       |                                          |                      | <b>EUR</b> | <b>-8.126.990,77</b>  | <b>-4,90</b>                 |
| <b>Verbindlichkeiten aus Anteilsceingeschäften</b> |                                             |                       |                                          |                      | <b>EUR</b> | <b>-7.992.247,50</b>  | <b>-4,82</b>                 |
|                                                    | EUR                                         | -7.992.247,50         |                                          |                      |            | -7.992.247,50         | -4,82                        |
| <b>Kostenabgrenzung</b>                            |                                             |                       |                                          |                      | <b>EUR</b> | <b>-64.872,91</b>     | <b>-0,04</b>                 |
|                                                    | EUR                                         | -64.872,91            |                                          |                      |            | -64.872,91            | -0,04                        |
| <b>Verbindlichkeiten aus Collateral</b>            |                                             |                       |                                          |                      | <b>EUR</b> | <b>-69.870,36</b>     | <b>-0,04</b>                 |
|                                                    | EUR                                         | -69.870,36            |                                          |                      |            | -69.870,36            | -0,04                        |
| <b>Fondsvermögen</b>                               |                                             |                       |                                          |                      | <b>EUR</b> | <b>165.694.354,32</b> | <b>100,00<sup>4</sup></b>    |
| <b>Anteilwert Amundi Weltportfolio</b>             |                                             |                       |                                          |                      | <b>EUR</b> | <b>97,530</b>         |                              |
| <b>Umlaufende Anteile Amundi Weltportfolio</b>     |                                             |                       |                                          |                      | <b>STK</b> | <b>1.698.960,000</b>  |                              |

2 Bei diesen Wertpapieren handelt es sich um inflationsindexierte Anleihen, wobei der variable Inflationsfaktor im jeweiligen Kurswert enthalten ist. Die Angabe des Kurses erfolgt dagegen ohne Berücksichtigung des Inflationsfaktors.

3 Die Wertpapiere und Schuldscheindarlehen des Sondervermögens sind teilweise durch Geschäfte mit Finanzinstrumenten abgesichert.

4 Durch Rundung der Prozentanteile bei der Berechnung können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.

**Wertpapierkurse bzw. Marktsätze****Devisenkurse (in Mengennote)**

|                              |       | per 30.06.2020 |   |              |
|------------------------------|-------|----------------|---|--------------|
| Australische Dollar          | (AUD) | 1,635850       | = | 1 Euro (EUR) |
| Baht (Thailand)              | (THB) | 34,663750      | = | 1 Euro (EUR) |
| Britische Pfund              | (GBP) | 0,913600       | = | 1 Euro (EUR) |
| Dänische Kronen              | (DKK) | 7,452400       | = | 1 Euro (EUR) |
| Hongkong Dollar              | (HKD) | 8,698900       | = | 1 Euro (EUR) |
| Israelische Schekel          | (ILS) | 3,881300       | = | 1 Euro (EUR) |
| Japanische Yen               | (JPY) | 120,910000     | = | 1 Euro (EUR) |
| Kanadischer Dollar           | (CAD) | 1,534800       | = | 1 Euro (EUR) |
| Mexikanische Peso            | (MXN) | 25,940350      | = | 1 Euro (EUR) |
| Norwegische Kronen           | (NOK) | 10,920700      | = | 1 Euro (EUR) |
| Rubel (Russische Föderation) | (RUB) | 79,081750      | = | 1 Euro (EUR) |
| Schwedische Kronen           | (SEK) | 10,491500      | = | 1 Euro (EUR) |
| Schweizer Franken            | (CHF) | 1,068550       | = | 1 Euro (EUR) |
| Singapur-Dollar              | (SGD) | 1,566350       | = | 1 Euro (EUR) |
| Südafrikanische Rand         | (ZAR) | 19,453150      | = | 1 Euro (EUR) |
| Tschechische Kronen          | (CZK) | 26,800500      | = | 1 Euro (EUR) |
| US-Dollar                    | (USD) | 1,122400       | = | 1 Euro (EUR) |
| Zloty                        | (PLN) | 4,462150       | = | 1 Euro (EUR) |

**Marktschlüssel****b) Terminbörse**

|               |                             |
|---------------|-----------------------------|
| <b>EDT</b>    | EUREX                       |
| <b>EUT</b>    | ICE Futures Europe          |
| <b>FJO</b>    | Osaka                       |
| <b>NAE</b>    | Chicago (CBOE)              |
| <b>NAQ</b>    | NYSE AMEX                   |
| <b>NAR</b>    | Chicago Mercantile Exchange |
| <b>NAU</b>    | Chicago (CBOT)              |
| <b>NCM</b>    | Montreal                    |
| <b>SFE</b>    | SYDNEY FUTURES EXCHANGE     |
| <b>c) OTC</b> | <b>Over the Counter</b>     |

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

| ISIN                                | Gattungsbezeichnung                    | Stück bzw.<br>Anteile bzw.<br>Whg. in 1.000 | Käufe/<br>Zugänge | Verkäufe/<br>Abgänge |
|-------------------------------------|----------------------------------------|---------------------------------------------|-------------------|----------------------|
| <b>Börsengehandelte Wertpapiere</b> |                                        |                                             |                   |                      |
| <b>Aktien</b>                       |                                        |                                             |                   |                      |
| FR0000120404                        | Accor S.A.                             | STK                                         | 0                 | 10.549               |
| US00507V1098                        | Activision Blizzard Inc.               | STK                                         | 0                 | 7.413                |
| DE000A1EWW00                        | adidas AG                              | STK                                         | 2.616             | 2.616                |
| IE00BF0L3536                        | AIB Group PLC                          | STK                                         | 0                 | 93.149               |
| US02079K3059                        | Alphabet Inc. Cl.A                     | STK                                         | 0                 | 909                  |
| FR0010220475                        | Alstom S.A.                            | STK                                         | 0                 | 7.046                |
| US0236081024                        | Ameren Corp.                           | STK                                         | 1.903             | 6.771                |
| US0268747849                        | American International Group Inc       | STK                                         | 956               | 16.599               |
| LU1598757687                        | ArcelorMittal S.A.                     | STK                                         | 21.593            | 48.827               |
| NL0010273215                        | ASML Holding N.V.                      | STK                                         | 343               | 2.206                |
| ES0113900J37                        | Banco Santander S.A.                   | STK                                         | 186.276           | 186.276              |
| US09247X1019                        | Blackrock Inc. A                       | STK                                         | 0                 | 889                  |
| US0997241064                        | Borgwarner Inc.                        | STK                                         | 0                 | 17.630               |
| FR0000125338                        | Capgemini SE                           | STK                                         | 3.434             | 3.434                |
| GB0031215220                        | Carnival PLC                           | STK                                         | 0                 | 5.248                |
| US1924461023                        | Cognizant Technology Solutions Corp. A | STK                                         | 1.534             | 7.425                |
| US2128962030                        | Conyers Park II Acq. Ut                | STK                                         | 178               | 178                  |
| US22564L1052                        | Crescent Acquisition Corp.             | STK                                         | 1.114             | 2.862                |
| US2605571031                        | Dow Inc.                               | STK                                         | 2.183             | 11.547               |
| US2910111044                        | Emerson Electric Co.                   | STK                                         | 0                 | 8.036                |
| SE0000108656                        | ERICSSON B                             | STK                                         | 0                 | 32.721               |
| US30231G1022                        | Exxon Mobil Corp.                      | STK                                         | 0                 | 5.167                |
| ES0171996087                        | Grifols S.A.                           | STK                                         | 7.087             | 16.612               |
| GB0005405286                        | HSBC Holdings PLC                      | STK                                         | 123.356           | 123.356              |
| US4448591028                        | Humana Inc.                            | STK                                         | 228               | 3.956                |
| US45866F1049                        | Intercontinental Exchange Inc.         | STK                                         | 0                 | 2.947                |
| NL0000009082                        | Koninklijke (Royal) KPN N.V.           | STK                                         | 0                 | 112.508              |
| NL0000009827                        | Koninklijke DSM N.V.                   | STK                                         | 550               | 2.554                |
| GB0008706128                        | Lloyds Banking Group PLC               | STK                                         | 0                 | 872.788              |
| CA5503721063                        | Lundin Mining Corp.                    | STK                                         | 0                 | 70.973               |
| GB00BKFBC65                         | M&G Prudential PLC                     | STK                                         | 0                 | 41.043               |
| GB0005758098                        | Meggitt PLC                            | STK                                         | 69.276            | 69.276               |
| US6174464486                        | Morgan Stanley                         | STK                                         | 0                 | 9.191                |
| GB00BDR05C01                        | National Grid PLC                      | STK                                         | 64.305            | 64.305               |
| US6516391066                        | Newmont Corp.                          | STK                                         | 1.832             | 1.832                |
| US6558441084                        | Norfolk Southern Corp.                 | STK                                         | 0                 | 2.469                |
| DK0060534915                        | Novo-Nordisk AS                        | STK                                         | 3.503             | 16.945               |
| FR0000133308                        | Orange S.A.                            | STK                                         | 50.251            | 50.251               |
| US69318G1067                        | PBF Energy Inc.                        | STK                                         | 16.828            | 16.828               |
| US7551115071                        | Raytheon Co.                           | STK                                         | 239               | 4.152                |
| US75513E1010                        | Raytheon Technologies Corp.            | STK                                         | 1.821             | 1.821                |
| LR0008862868                        | Royal Caribbean Cruises Ltd.           | STK                                         | 0                 | 3.330                |
| IE00BYTBXV33                        | Ryanair Holdings PLC                   | STK                                         | 2.805             | 26.859               |
| AN8068571086                        | Schlumberger N.V.                      | STK                                         | 0                 | 16.444               |
| FR0000130809                        | Société Générale S.A.                  | STK                                         | 18.929            | 33.308               |
| GB0004082847                        | Standard Chartered PLC                 | STK                                         | 44.454            | 77.889               |

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

| ISIN                            | Gattungsbezeichnung                                      | Stück bzw.<br>Anteile bzw.<br>Whg. in 1.000 | Käufe/<br>Zugänge | Verkäufe/<br>Abgänge |
|---------------------------------|----------------------------------------------------------|---------------------------------------------|-------------------|----------------------|
| NL0000226223                    | STMicroelectronics N.V.                                  | STK                                         | 5.193             | 22.387               |
| US8718291078                    | Sysco Corp.                                              | STK                                         | 5.259             | 10.497               |
| US8923561067                    | Tractor Supply Co.                                       | STK                                         | 5.474             | 5.474                |
| US9038453031                    | Ulta Beauty Inc.                                         | STK                                         | 381               | 1.840                |
| US2546871060                    | Walt Disney Co.                                          | STK                                         | 553               | 5.180                |
| US9497461015                    | Wells Fargo & Co.                                        | STK                                         | 3.590             | 13.880               |
| <b>Verzinsliche Wertpapiere</b> |                                                          |                                             |                   |                      |
| AU3CB0235612                    | 3,100% EIB MTN 17.08.26                                  | AUD                                         | 0                 | 400                  |
| AU3TB0000135                    | 4,750% Australien Loan 21.04.27                          | AUD                                         | 0                 | 1.800                |
| CA135087F825                    | 1,000% Canada Bds. 01.06.27                              | CAD                                         | 0                 | 400                  |
| CA459058HA44                    | 1,800% International Bank Rec. and Develop. MTN 26.07.24 | CAD                                         | 0                 | 800                  |
| DE0001141745                    | 0,000% BRD BO 08.10.21                                   | EUR                                         | 0                 | 450                  |
| FR0013415627                    | 0,000% Frankreich OAT 25.03.25                           | EUR                                         | 0                 | 1.000                |
| FR0012557957                    | 0,000% Frankreich OAT 25.05.20                           | EUR                                         | 9.200             | 9.200                |
| XS1664643746                    | 0,089% BAT Capital MTN 16.08.21V                         | EUR                                         | 0                 | 400                  |
| DE0001030567                    | 0,100% BRD ILB 15.04.26                                  | EUR                                         | 0                 | 500                  |
| DE0001030575                    | 0,100% BRD ILB 15.04.46                                  | EUR                                         | 300               | 300                  |
| FR0013209871                    | 0,100% Frankreich IL OAT 25.07.47                        | EUR                                         | 0                 | 750                  |
| FR0013410552                    | 0,100% Frankreich ILB 01.03.29                           | EUR                                         | 0                 | 400                  |
| XS1492834806                    | 0,125% ANZ New Zealand [London Branch] PF 22.09.23       | EUR                                         | 0                 | 300                  |
| XS1499574991                    | 0,125% Stadshypotek PF 05.10.26                          | EUR                                         | 0                 | 200                  |
| BE0002281500                    | 0,140% KBC Groep MTN 24.11.22V                           | EUR                                         | 0                 | 400                  |
| DE000LB1DRT9                    | 0,200% LBBW PF 10.01.24                                  | EUR                                         | 0                 | 400                  |
| IT0005216624                    | 0,250% Credit Agricole Italia PF 30.09.24                | EUR                                         | 0                 | 200                  |
| NL0011220108                    | 0,250% Niederlande Anl. 15.07.25                         | EUR                                         | 0                 | 250                  |
| FR0013447604                    | 0,375% La Poste MTN 17.09.27                             | EUR                                         | 0                 | 500                  |
| DE0001030559                    | 0,500% BRD ILB 15.04.30                                  | EUR                                         | 0                 | 450                  |
| ES0378641288                    | 0,625% Fondo Tituliza. Déficit Sist. Eléct Bds. 17.03.22 | EUR                                         | 0                 | 600                  |
| FR0011982776                    | 0,700% Frankreich IL OAT 25.07.30                        | EUR                                         | 0                 | 50                   |
| XS1599167589                    | 0,726% Intesa Sanpaolo MTN 19.04.22V                     | EUR                                         | 0                 | 400                  |
| XS2006277508                    | 0,750% America Movil Nts. 26.06.27                       | EUR                                         | 0                 | 300                  |
| DE000A194DD9                    | 0,875% Daimler International Finance MTN 09.04.24        | EUR                                         | 0                 | 500                  |
| XS1529838085                    | 1,000% Morgan Stanley MTN 02.12.22                       | EUR                                         | 0                 | 400                  |
| XS1486520403                    | 1,000% Nordea Bank MTN 07.09.26V                         | EUR                                         | 0                 | 400                  |
| FR0013299435                    | 1,000% Renault MTN 28.11.25                              | EUR                                         | 300               | 300                  |
| ES00000127C8                    | 1,000% Spanien ILB 30.11.30                              | EUR                                         | 0                 | 650                  |
| XS1907118894                    | 1,050% AT & T Nts. 05.09.23                              | EUR                                         | 0                 | 300                  |
| XS1750986744                    | 1,125% Enel Finance International MTN 16.09.26           | EUR                                         | 0                 | 300                  |
| XS1485533431                    | 1,125% Koninklijke KPN MTN 11.09.28                      | EUR                                         | 100               | 500                  |
| XS1888229249                    | 1,250% Bertelsmann Anl. 29.09.25                         | EUR                                         | 0                 | 400                  |
| XS1793252419                    | 1,250% BNP Paribas MTN 19.03.25                          | EUR                                         | 0                 | 400                  |
| CH0343366842                    | 1,250% Credit Suisse Group MTN 17.07.25V                 | EUR                                         | 0                 | 400                  |
| XS1396767854                    | 1,250% Naturgy Finance MTN 19.04.26                      | EUR                                         | 0                 | 200                  |
| XS1380334141                    | 1,300% Berkshire Hathaway Nts. 15.03.24                  | EUR                                         | 0                 | 100                  |
| ES0211845302                    | 1,375% Abertis Infraestructuras OBL 20.05.26             | EUR                                         | 100               | 500                  |
| XS1557268221                    | 1,375% Banco Santander Bds. 09.02.22                     | EUR                                         | 0                 | 400                  |
| XS1511589605                    | 1,375% SEB MTN 31.10.28V                                 | EUR                                         | 0                 | 200                  |
| XS1400169931                    | 1,375% Wells Fargo MTN 26.10.26                          | EUR                                         | 0                 | 300                  |

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

| ISIN         | Gattungsbezeichnung                               | Stück bzw.<br>Anteile bzw.<br>Whg. in 1.000 | Käufe/<br>Zugänge | Verkäufe/<br>Abgänge |
|--------------|---------------------------------------------------|---------------------------------------------|-------------------|----------------------|
| XS1651071877 | 1,400% Thermo Fisher Scientific Nts. 23.01.26     | EUR                                         | 100               | 500                  |
| XS1449707055 | 1,500% Aroundtown Nts. 15.07.24                   | EUR                                         | 0                 | 200                  |
| XS1840618059 | 1,500% Bayer Capital Nts. 26.06.26                | EUR                                         | 0                 | 400                  |
| DE000DL19TA6 | 1,500% Deutsche Bank MTN 20.01.22                 | EUR                                         | 0                 | 400                  |
| XS1937665955 | 1,500% Enel Finance International MTN 21.07.25    | EUR                                         | 100               | 300                  |
| XS1627782771 | 1,500% Leonardo MTN 07.06.24                      | EUR                                         | 0                 | 500                  |
| XS1485603747 | 1,600% Aptiv Nts. 15.09.28                        | EUR                                         | 0                 | 200                  |
| XS1686846061 | 1,625% Anglo American Capital MTN 18.09.25        | EUR                                         | 0                 | 400                  |
| XS1846632104 | 1,625% EDP Finance MTN 26.01.26                   | EUR                                         | 0                 | 300                  |
| XS1458408561 | 1,625% Goldman Sachs Group MTN 27.07.2026         | EUR                                         | 0                 | 400                  |
| BE0002290592 | 1,625% KBC Groep MTN 18.09.29V                    | EUR                                         | 0                 | 400                  |
| XS1973750869 | 1,625% Mediobanca MTN 07.01.25                    | EUR                                         | 0                 | 400                  |
| FR0013292828 | 1,750% Danone MTN 23.06.2166V                     | EUR                                         | 0                 | 400                  |
| XS1672151492 | 1,750% Holcim Finance Luxembourg MTN 29.08.29     | EUR                                         | 0                 | 200                  |
| FR0013447877 | 1,750% Orange MTN 19.03.99V                       | EUR                                         | 0                 | 400                  |
| DE000A2RWZZ6 | 1,800% Vonovia Finance MTN 29.06.25               | EUR                                         | 0                 | 400                  |
| XS1236685613 | 1,875% Chile Bds. 27.05.30                        | EUR                                         | 0                 | 700                  |
| XS1823623878 | 1,875% CNH Industrial Finance Europe MTN 19.01.26 | EUR                                         | 0                 | 400                  |
| FR0013291556 | 1,875% Crédit Mutuel Arkéa MTN 25.10.29V          | EUR                                         | 0                 | 400                  |
| DE000A2YB7A7 | 1,875% Schaeffler MTN 26.03.24                    | EUR                                         | 0                 | 200                  |
| DE000A2YN6V1 | 1,875% ThyssenKrupp MTN 06.03.23                  | EUR                                         | 200               | 490                  |
| BE6285455497 | 2,000% Anheuser-Busch InBev MTN 17.03.28          | EUR                                         | 100               | 600                  |
| FR0013323326 | 2,000% Peugeot MTN 20.03.25                       | EUR                                         | 0                 | 400                  |
| FR0013245586 | 2,000% Peugeot MTN 23.03.24                       | EUR                                         | 0                 | 300                  |
| XS1401125346 | 2,125% BUZZI UNICEM Nts. 28.04.23                 | EUR                                         | 0                 | 200                  |
| DE000A2GSFF1 | 2,125% Evonik Industries Anl. 07.07.77V           | EUR                                         | 0                 | 200                  |
| CH0314209351 | 2,125% UBS Group Nts. 04.03.24                    | EUR                                         | 0                 | 400                  |
| FR0013330529 | 2,125% Unibail-Rodamco-Westfield Nts. 25.10.66V   | EUR                                         | 200               | 600                  |
| XS1971935223 | 2,125% Volvo Car MTN 02.04.24                     | EUR                                         | 0                 | 500                  |
| DE0001135416 | 2,250% BRD Anl. 04.09.20                          | EUR                                         | 13.445            | 13.445               |
| XS1387174375 | 2,250% HeidelbergCement MTN 30.03.23              | EUR                                         | 0                 | 400                  |
| XS1420338102 | 2,250% Holcim Finance Luxembourg MTN 26.05.28     | EUR                                         | 0                 | 200                  |
| XS1040508167 | 2,250% Imperial Brands Finance MTN 26.02.21       | EUR                                         | 0                 | 200                  |
| XS1405784015 | 2,250% Kraft Heinz Foods Nts. 25.05.28            | EUR                                         | 200               | 500                  |
| XS1321424670 | 2,250% Sky MTN 17.11.25                           | EUR                                         | 0                 | 300                  |
| XS1079726334 | 2,375% Bank of America MTN 19.06.24               | EUR                                         | 0                 | 400                  |
| XS1190632999 | 2,375% BNP Paribas MTN 17.02.25                   | EUR                                         | 0                 | 300                  |
| XS1468525057 | 2,375% Cellnex Telecom MTN 16.01.24               | EUR                                         | 0                 | 500                  |
| XS1385395121 | 2,375% EDP Finance MTN 23.03.23                   | EUR                                         | 0                 | 200                  |
| XS1555147369 | 2,375% Smurfit Kappa Acquisitions Nts. 01.02.24   | EUR                                         | 0                 | 400                  |
| XS0937858271 | 2,500% ABN AMRO Bank MTN 29.11.23                 | EUR                                         | 0                 | 500                  |
| DE0001102341 | 2,500% BRD Anl. 15.08.46                          | EUR                                         | 0                 | 350                  |
| XS1713463716 | 2,500% ENEL Bds. 24.11.78V                        | EUR                                         | 0                 | 400                  |
| XS1119021357 | 2,500% EXOR Nts. 08.10.24                         | EUR                                         | 0                 | 200                  |
| XS1117297512 | 2,500% Expedia Group Nts. 03.06.22                | EUR                                         | 0                 | 200                  |
| NL0010071189 | 2,500% Niederlande Anl. 15.01.33                  | EUR                                         | 0                 | 200                  |
| IT0004545890 | 2,550% Italien Inflation-Linked B.T.P. 15.09.41   | EUR                                         | 0                 | 500                  |

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

| ISIN         | Gattungsbezeichnung                                       | Stück bzw.<br>Anteile bzw.<br>Whg. in 1.000 | Käufe/<br>Zugänge | Verkäufe/<br>Abgänge |
|--------------|-----------------------------------------------------------|---------------------------------------------|-------------------|----------------------|
| FR0013457157 | 2,625% Accor Bds. 30.04.2168V                             | EUR                                         | 0                 | 400                  |
| XS1120649584 | 2,625% BNP Paribas MTN 14.10.27V                          | EUR                                         | 0                 | 400                  |
| XS1204154410 | 2,625% Crédit Agricole Bds. 17.03.27                      | EUR                                         | 0                 | 400                  |
| XS0984367077 | 2,625% JPMorgan Chase MTN 23.04.21                        | EUR                                         | 0                 | 200                  |
| XS1152338072 | 2,625% Merck Nts. 12.12.74V                               | EUR                                         | 0                 | 200                  |
| XS1629658755 | 2,700% Volkswagen International Finance Nts. 14.12.2165V  | EUR                                         | 0                 | 400                  |
| XS1501167164 | 2,708% Total MTN 05.05.99V                                | EUR                                         | 100               | 500                  |
| XS1241701413 | 2,728% Inmobiliaria Colonial Socimi Nts. 05.06.23         | EUR                                         | 0                 | 400                  |
| XS1574148877 | 2,750% Ardagh Packaging Finance / Hlds. USA Nts. 15.03.24 | EUR                                         | 0                 | 500                  |
| XS1634531344 | 2,750% Intrum Nts. 15.07.22                               | EUR                                         | 100               | 400                  |
| XS1321920735 | 2,750% Nykredit Realkredit MTN 17.11.27                   | EUR                                         | 0                 | 400                  |
| DE000A2AAPF1 | 2,750% ThyssenKrupp 08.03.21                              | EUR                                         | 0                 | 300                  |
| DE000A14J7G6 | 2,750% ZF NA Capital Nts. 27.04.23                        | EUR                                         | 0                 | 500                  |
| IT0005217390 | 2,800% Italien B.T.P. 01.03.67                            | EUR                                         | 0                 | 300                  |
| XS1684387456 | 2,875% IQVIA Nts. 15.09.25                                | EUR                                         | 100               | 400                  |
| XS0935427970 | 2,875% JPMorgan Chase MTN 24.05.28                        | EUR                                         | 0                 | 400                  |
| XS1849518276 | 2,875% Smurfit Kappa Acquisitions Nts. 15.01.26           | EUR                                         | 100               | 600                  |
| XS0997775837 | 3,000% BFCM MTN 28.11.23                                  | EUR                                         | 0                 | 400                  |
| XS1497606365 | 3,000% Telecom Italia MTN 30.09.25                        | EUR                                         | 0                 | 500                  |
| XS1590787799 | 3,000% Telia Company Nts. 04.04.78                        | EUR                                         | 0                 | 400                  |
| XS1888179477 | 3,100% Vodafone Group Nts. 03.01.79                       | EUR                                         | 0                 | 600                  |
| XS1043097630 | 3,125% B.A.T. International Finance MTN 06.03.29          | EUR                                         | 0                 | 400                  |
| XS0909369489 | 3,125% CRH Finance MTN 03.04.23                           | EUR                                         | 0                 | 400                  |
| XS1963830002 | 3,125% Faurecia Nts. 15.06.26                             | EUR                                         | 0                 | 600                  |
| XS0985666436 | 3,125% SNCF Réseau MTN 25.10.28                           | EUR                                         | 0                 | 400                  |
| XS1684385161 | 3,125% Softbank Group Nts. 19.09.25                       | EUR                                         | 0                 | 600                  |
| XS1629866432 | 3,150% AT & T Nts. 04.09.36                               | EUR                                         | 200               | 400                  |
| XS1384064587 | 3,250% Banco Santander MTN 04.04.26                       | EUR                                         | 0                 | 400                  |
| FR0013398229 | 3,250% Engie Nts. 28.02.2167V                             | EUR                                         | 0                 | 300                  |
| XS0882849507 | 3,250% Goldman Sachs Group MTN 01.02.23                   | EUR                                         | 0                 | 400                  |
| XS1533922776 | 3,250% IQVIA Nts. 15.03.25                                | EUR                                         | 0                 | 300                  |
| XS1169832810 | 3,250% Telecom Italia MTN 16.01.23                        | EUR                                         | 100               | 400                  |
| XS1812903828 | 3,250% Teva Pharmaceutical Finance Neth. II Nts. 15.04.22 | EUR                                         | 0                 | 400                  |
| XS1629918415 | 3,250% Türkei Nts. 14.06.25                               | EUR                                         | 0                 | 600                  |
| XS1028954953 | 3,375% Bharti Airtel International [Neth.] Nts. 20.05.21  | EUR                                         | 0                 | 400                  |
| XS1799938995 | 3,375% Volkswagen International Finance Nts. 27.06.2168V  | EUR                                         | 100               | 400                  |
| XS1565131213 | 3,500% Caixabank MTN 15.02.27                             | EUR                                         | 0                 | 300                  |
| XS2034925375 | 3,500% Intrum Nts. 15.07.26                               | EUR                                         | 0                 | 400                  |
| XS1725580465 | 3,500% Nordea Bank MTN 12.03.99V                          | EUR                                         | 0                 | 400                  |
| XS1634252628 | 3,625% UPCB Finance VII Nts. 15.06.29                     | EUR                                         | 0                 | 400                  |
| XS1508392625 | 3,750% ATF Netherlands Nts. 20.01.99                      | EUR                                         | 0                 | 200                  |
| BE0000318270 | 3,750% Belgien OBL 28.09.20                               | EUR                                         | 2.200             | 2.200                |
| FR0010192997 | 3,750% Frankreich OAT 25.04.21                            | EUR                                         | 2.100             | 2.100                |
| XS1432493440 | 3,750% Indonesia MTN 14.06.28                             | EUR                                         | 0                 | 800                  |
| XS1490960942 | 3,750% Telefonica Europe Nts. 15.03.99V                   | EUR                                         | 100               | 500                  |
| PTBSSB0E0012 | 3,875% BRISA - Concessao Rodoviaria MTN 01.04.21          | EUR                                         | 0                 | 100                  |
| XS1109765005 | 3,928% Intesa Sanpaolo MTN 15.09.26                       | EUR                                         | 0                 | 400                  |

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

| ISIN         | Gattungsbezeichnung                               | Stück bzw.<br>Anteile bzw.<br>Whg. in 1.000 | Käufe/<br>Zugänge | Verkäufe/<br>Abgänge |
|--------------|---------------------------------------------------|---------------------------------------------|-------------------|----------------------|
| XS1084050316 | 4,000% Crown European Holdings Nts. 15.07.22      | EUR                                         | 0                 | 400                  |
| FR0013367612 | 4,000% E.D.F. MTN 04.10.2150V                     | EUR                                         | 100               | 500                  |
| XS1026109204 | 4,000% Fresenius Nts. 01.02.24                    | EUR                                         | 0                 | 300                  |
| XS1218289103 | 4,000% Mexiko MTN 15.03.15                        | EUR                                         | 550               | 550                  |
| XS0591428445 | 4,000% Nordea Mortgage Bank PF 10.02.21           | EUR                                         | 0                 | 300                  |
| XS1117297603 | 4,000% UPCB Finance IV Nts. 15.01.27              | EUR                                         | 0                 | 400                  |
| XS1117300837 | 4,000% Vonovia Finance Nts. 31.12.99V             | EUR                                         | 0                 | 300                  |
| XS0500187843 | 4,125% Intesa Sanpaolo MTN 14.04.20               | EUR                                         | 0                 | 400                  |
| XS1139494493 | 4,125% Naturgy Finance MTN 18.11.99V              | EUR                                         | 0                 | 500                  |
| XS0613145712 | 4,250% ABN AMRO Bank MTN 06.04.21                 | EUR                                         | 0                 | 300                  |
| XS1330978567 | 4,375% Ball Nts. 15.12.23                         | EUR                                         | 0                 | 400                  |
| FR0011765825 | 4,498% Casino, Guichard-Perrachon MTN 07.03.24    | EUR                                         | 0                 | 600                  |
| ES0414970303 | 4,500% Caixabank CEH 26.01.22                     | EUR                                         | 0                 | 400                  |
| IT0004644735 | 4,500% Italien B.T.P. 01.03.26                    | EUR                                         | 0                 | 650                  |
| XS0999654873 | 4,500% Leonardo MTN 19.01.21                      | EUR                                         | 0                 | 400                  |
| XS1140860534 | 4,596% Assicurazioni Generali Nts. 21.11.99V      | EUR                                         | 0                 | 500                  |
| FR0011538222 | 4,625% BPCE Nts. 18.07.23                         | EUR                                         | 0                 | 300                  |
| XS1433214449 | 4,625% Cemex Finance Nts. 15.06.24                | EUR                                         | 0                 | 600                  |
| XS0288429532 | 4,625% GE Capital European Funding MTN 22.02.27   | EUR                                         | 0                 | 200                  |
| XS1968706876 | 4,625% Rumänien MTN 03.04.49                      | EUR                                         | 500               | 500                  |
| XS1405777746 | 4,625% SES Nts. 29.12.49                          | EUR                                         | 0                 | 400                  |
| DE000A1YQ29  | 4,750% Allianz MTN 24.10.99V                      | EUR                                         | 0                 | 500                  |
| XS1309436753 | 4,750% BHP Billiton Finance MTN 22.04.76          | EUR                                         | 0                 | 400                  |
| XS1640903701 | 4,750% HSBC Holdings MTN 04.01.2164V              | EUR                                         | 0                 | 400                  |
| IT0004889033 | 4,750% Italien Bds. 01.09.28                      | EUR                                         | 0                 | 700                  |
| CH0236733827 | 4,750% UBS Bds. 12.02.26V                         | EUR                                         | 0                 | 400                  |
| XS1150695192 | 4,850% Volvo Treasury Nts. 10.03.78V              | EUR                                         | 100               | 400                  |
| IT0004759673 | 5,000% Italien B.T.P. 01.03.2022                  | EUR                                         | 0                 | 900                  |
| XS1323897485 | 5,118% Solvay Finance Nts. 02.06.99V              | EUR                                         | 0                 | 400                  |
| XS1294342792 | 5,250% OMV Nts. 09.12.99V                         | EUR                                         | 0                 | 400                  |
| PTEDPUOM0024 | 5,375% EDP - Energias de Portugal Sec. 16.09.75   | EUR                                         | 0                 | 400                  |
| XS1171914515 | 5,500% Rabobank Nederland Nts. 29.12.99V          | EUR                                         | 0                 | 400                  |
| XS0454773713 | 5,625% Koninklijke KPN MTN 30.09.24               | EUR                                         | 300               | 300                  |
| IT0003256820 | 5,750% Italien B.T.P. 01.02.33                    | EUR                                         | 0                 | 850                  |
| XS0986063864 | 5,750% UniCredit MTN 28.10.25V                    | EUR                                         | 0                 | 400                  |
| XS2010039118 | 5,875% Quatrim Nts. 15.01.24                      | EUR                                         | 100               | 320                  |
| XS1043545059 | 6,374% Lloyds Banking Group Nts. Coco 27.06.99V   | EUR                                         | 0                 | 400                  |
| XS0611398008 | 6,625% Barclays Bank MTN 30.03.22                 | EUR                                         | 0                 | 400                  |
| XS0971213201 | 6,625% Intesa Sanpaolo MTN 13.09.23               | EUR                                         | 0                 | 400                  |
| XS1619015719 | 6,625% UniCredit Bds. 03.12.2167V                 | EUR                                         | 200               | 600                  |
| XS1602466424 | 6,750% Banco Santander Nts. 25.11.49              | EUR                                         | 0                 | 400                  |
| XS0496281618 | 6,875% Rabobank Nederland MTN 19.03.20            | EUR                                         | 0                 | 200                  |
| XS0849517650 | 6,950% UniCredit MTN 31.10.22                     | EUR                                         | 0                 | 400                  |
| XS0161488498 | 7,500% Deutsche Telekom Intern. Fin. MTN 24.01.33 | EUR                                         | 100               | 400                  |
| FR0000471930 | 8,125% Orange MTN 28.01.33                        | EUR                                         | 100               | 300                  |
| GB00BZ1NTB69 | 0,125% Großbritannien TSK 10.08.2028              | GBP                                         | 450               | 450                  |
| GB00BD9MZZ71 | 0,125% Großbritannien TSK 22.11.2065              | GBP                                         | 400               | 400                  |
| GB00BL68HG94 | 0,125% Großbritannien TSK 31.01.23                | GBP                                         | 250               | 250                  |

### Während des Berichtszeitraums abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen:

#### – Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schuldscheindarlehen (Marktzuordnung zum Berichtsstichtag):

| ISIN         | Gattungsbezeichnung                                       | Stück bzw.<br>Anteile bzw.<br>Whg. in 1.000 | Käufe/<br>Zugänge | Verkäufe/<br>Abgänge |
|--------------|-----------------------------------------------------------|---------------------------------------------|-------------------|----------------------|
| GB00BD0PCK97 | 0,500% Großbritannien TSK 22.07.22                        | GBP                                         | 0                 | 300                  |
| XS2122575678 | 1,000% International Bank Rec. and Develop. MTN 21.12.29  | GBP                                         | 600               | 600                  |
| XS1863558810 | 1,125% Entwicklungsbank des Europarates MTN 15.12.21      | GBP                                         | 0                 | 250                  |
| XS1457522727 | 2,000% Wells Fargo MTN 28.07.25                           | GBP                                         | 0                 | 400                  |
| XS1716248197 | 2,256% HSBC Holdings MTN 13.11.26V                        | GBP                                         | 0                 | 400                  |
| XS0849420905 | 2,500% EIB MTN 31.10.22                                   | GBP                                         | 0                 | 500                  |
| GB0008983024 | 2,500% Großbritannien ILT 17.07.24                        | GBP                                         | 250               | 250                  |
| XS1237961369 | 3,000% Credit Suisse Group Fund. [Guernsey] MTN 27.05.22  | GBP                                         | 100               | 500                  |
| XS1472663670 | 3,250% Barclays MTN 12.02.27                              | GBP                                         | 0                 | 400                  |
| XS1347435577 | 3,250% Nationwide Building Society MTN 20.01.28           | GBP                                         | 400               | 400                  |
| XS0866588527 | 3,375% GlaxoSmithKline Capital MTN 20.12.27               | GBP                                         | 100               | 500                  |
| XS1023626671 | 4,250% Goldman Sachs MTN 29.01.26                         | GBP                                         | 0                 | 400                  |
| XS1488459485 | 4,375% Aviva Nts. 12.09.99V                               | GBP                                         | 0                 | 300                  |
| XS0415532273 | 4,500% EIB MTN 07.06.29                                   | GBP                                         | 0                 | 200                  |
| XS0202407093 | 4,625% EIB MTN 12.10.54                                   | GBP                                         | 150               | 1.600                |
| XS0717069073 | 4,625% Morrison Supermarkets Nts. 08.12.23                | GBP                                         | 0                 | 400                  |
| XS0254673964 | 5,125% GE Capital UK Funding MTN 24.05.23                 | GBP                                         | 0                 | 500                  |
| XS0168658853 | 5,150% Citigroup MTN 21.05.26                             | GBP                                         | 100               | 500                  |
| XS0618011463 | 5,375% ING Bank MTN 15.04.21                              | GBP                                         | 0                 | 400                  |
| XS0583495188 | 5,500% Credit Agricole (London Branch) MTN 17.12.21       | GBP                                         | 0                 | 400                  |
| XS0110373569 | 5,500% Europäische Investitionsbank Bds. 15.04.25         | GBP                                         | 700               | 700                  |
| XS0452188054 | 5,625% ENEL Finance International MTN 14.08.24            | GBP                                         | 100               | 600                  |
| XS0254907388 | 5,875% Telecom Italia MTN 19.05.23                        | GBP                                         | 0                 | 200                  |
| XS0085727559 | 6,000% European Investment Bank Nts. 07.12.28             | GBP                                         | 0                 | 200                  |
| XS0414345974 | 6,125% Tesco MTN 24.02.22                                 | GBP                                         | 0                 | 400                  |
| XS0367001061 | 6,250% Electricité de France MTN 30.05.28                 | GBP                                         | 100               | 500                  |
| XS0423048247 | 6,500% Deutsche Telekom Internation. Finance MTN 08.04.22 | GBP                                         | 0                 | 500                  |
| XS0429422271 | 6,500% HSBC Holdings MTN 20.05.24                         | GBP                                         | 0                 | 400                  |
| FR0010680041 | 7,000% Engie MTN 30.10.28                                 | GBP                                         | 100               | 500                  |
| FR0000483687 | 7,250% Orange MTN 10.11.20                                | GBP                                         | 100               | 500                  |
| XS0422704071 | 7,500% Lloyds Bank MTN 15.04.24                           | GBP                                         | 0                 | 500                  |
| XS0413493957 | 9,000% Imperial Brands Finance MTN 17.02.22               | GBP                                         | 0                 | 400                  |
| XS0070553820 | 0,000% Europäische Investitionsbank MTN 06.11.26          | USD                                         | 6.550             | 8.050                |
| XS1190655776 | 0,000% Swedbank Nts. 29.12.2165V                          | USD                                         | 0                 | 400                  |
| US912828TE09 | 0,125% USA IIN 15.07.22                                   | USD                                         | 0                 | 4.900                |
| US912828S505 | 0,125% USA IPS 15.07.26                                   | USD                                         | 0                 | 6.450                |
| US912810SG40 | 1,000% USA IPS 15.02.49                                   | USD                                         | 1.950             | 10.100               |
| US222213AT75 | 1,750% Entwicklungsbank des Europarates Nts. 26.09.22     | USD                                         | 0                 | 350                  |
| US912828WC06 | 1,750% USA Nts. 31.10.20                                  | USD                                         | 0                 | 700                  |
| US045167EN94 | 1,875% Asian Development Bank MTN 19.07.22                | USD                                         | 0                 | 300                  |
| US29874QCT94 | 1,875% European Bank for Recon. & Dev. MTN 23.02.22       | USD                                         | 0                 | 1.900                |
| US459200HG92 | 1,875% IBM Nts. 01.08.22                                  | USD                                         | 0                 | 400                  |
| US4581X0CU04 | 2,000% Inter-American Development Bank MTN 02.06.26       | USD                                         | 0                 | 650                  |
| USN6000LAC92 | 2,000% Mondelez Intern. Hold. Netherlands Nts. 28.10.21   | USD                                         | 0                 | 400                  |
| US949746SA05 | 2,100% Wells Fargo Nts. 26.07.21                          | USD                                         | 0                 | 400                  |
| US219868BX31 | 2,125% Corporación Andina de Fomento Nts. 27.09.21        | USD                                         | 0                 | 700                  |
| XS1704649158 | 2,125% Europäischer Stabilitätsmechanismus MTN 03.11.22   | USD                                         | 700               | 1.750                |
| US912828VV95 | 2,125% USA Nts. 31.08.20                                  | USD                                         | 0                 | 600                  |

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

| ISIN         | Gattungsbezeichnung                                      | Stück bzw.<br>Anteile bzw.<br>Whg. in 1.000 | Käufe/<br>Zugänge | Verkäufe/<br>Abgänge |
|--------------|----------------------------------------------------------|---------------------------------------------|-------------------|----------------------|
| US191216BZ21 | 2,250% Coca-Cola Nts. 01.09.26                           | USD                                         | 0                 | 400                  |
| US912828A834 | 2,375% USA Nts. 31.12.20                                 | USD                                         | 0                 | 700                  |
| US045167EE95 | 2,500% Asian Development Bank MTN 02.11.27               | USD                                         | 0                 | 3.200                |
| US459058DX80 | 2,500% International Bank Rec. and Develop. MTN 25.11.24 | USD                                         | 0                 | 3.800                |
| US68389XBM65 | 2,650% Oracle Nts. 15.07.26                              | USD                                         | 0                 | 400                  |
| US46625HRV41 | 2,950% JPMorgan Chase Nts. 01.10.26                      | USD                                         | 200               | 600                  |
| US037833CX61 | 3,000% Apple Nts. 20.06.27                               | USD                                         | 0                 | 400                  |
| US717081EA70 | 3,000% Pfizer Nts. 15.12.26                              | USD                                         | 200               | 400                  |
| US4581X0DC96 | 3,125% Inter-American Development Bank MTN 18.09.28      | USD                                         | 650               | 950                  |
| US61761J3R84 | 3,125% Morgan Stanley MTN 27.07.26                       | USD                                         | 0                 | 600                  |
| US912828QN35 | 3,125% USA Nts. 15.05.21                                 | USD                                         | 0                 | 1.700                |
| US191216AR14 | 3,150% The Coca-Cola Nts. 15.11.20                       | USD                                         | 0                 | 400                  |
| XS1382378690 | 3,161% BP Capital Markets MTN 17.03.21                   | USD                                         | 0                 | 400                  |
| US05526DAZ87 | 3,222% B.A.T. Capital Nts.15.08.24                       | USD                                         | 200               | 600                  |
| US298785GJ95 | 3,250% EIB Nts. 29.01.24                                 | USD                                         | 0                 | 500                  |
| US06051GEU94 | 3,300% Bank of America Nts. 11.01.23                     | USD                                         | 0                 | 500                  |
| US30216KAA07 | 3,375% Export-Import Bank of India MTN 05.08.26          | USD                                         | 0                 | 600                  |
| US225433AM38 | 3,450% Credit Suisse Group Funding Nts. 16.04.21         | USD                                         | 0                 | 500                  |
| US172967HT16 | 3,750% Citigroup Nts. 16.06.24                           | USD                                         | 0                 | 600                  |
| XS1485742438 | 3,875% Allianz MTN 07.03.99                              | USD                                         | 0                 | 600                  |
| US21685WDD65 | 3,875% Rabobank Nederland Nts. 08.02.22                  | USD                                         | 200               | 600                  |
| US80283LAJ26 | 4,000% Santander UK Nts. 13.03.24                        | USD                                         | 200               | 600                  |
| XS1140811750 | 4,125% EDP Finance Nts. 15.01.20                         | USD                                         | 0                 | 400                  |
| USG4639DVV48 | 4,125% HSBC Bank Nts. 12.08.20                           | USD                                         | 0                 | 400                  |
| US35177PAW77 | 4,125% Orange Nts. 14.09.21                              | USD                                         | 0                 | 400                  |
| USP8674JAE93 | 4,125% Sigma Alimentos Nts. 02.05.26                     | USD                                         | 0                 | 400                  |
| US02364WBE49 | 4,375% América Móvil Nts. 16.07.42                       | USD                                         | 0                 | 200                  |
| US36164QNA21 | 4,418% GE Capital International Funding MTN 15.11.35     | USD                                         | 0                 | 400                  |
| XS1489814340 | 4,500% AXA MTN 15.03.99V                                 | USD                                         | 200               | 600                  |
| US12594KAA07 | 4,500% CNH Industrial MTN 15.08.23                       | USD                                         | 0                 | 400                  |
| US31562QAC15 | 4,500% Fiat Chrysler Automobiles Nts. 15.04.20           | USD                                         | 0                 | 400                  |
| US00206RDK59 | 4,550% AT & T Nts. 09.03.49                              | USD                                         | 0                 | 400                  |
| XS1044540547 | 4,750% Aserbaidzhan Nts. 18.03.24                        | USD                                         | 0                 | 600                  |
| USY20721BN86 | 4,750% Indonesien MTN 08.01.26                           | USD                                         | 0                 | 800                  |
| XS1392917784 | 4,800% ABN AMRO Bank MTN 18.04.26                        | USD                                         | 0                 | 600                  |
| US05968LAK89 | 4,875% Bancolombia Nts. 18.10.27V                        | USD                                         | 0                 | 400                  |
| US900123CK49 | 4,875% Türkei Nts. 09.10.26                              | USD                                         | 0                 | 800                  |
| XS1263054519 | 5,125% Kasachstan Nts. 21.07.25                          | USD                                         | 0                 | 800                  |
| US857524AA08 | 5,125% Polen Nts. 21.04.21                               | USD                                         | 0                 | 1.000                |
| US31562QAF46 | 5,250% Fiat Chrysler Automobiles Nts. 15.04.23           | USD                                         | 0                 | 600                  |
| US831594AG10 | 5,250% Slowenien Nts. 18.02.24                           | USD                                         | 0                 | 1.000                |
| US35177PAX50 | 5,375% Orange Nts. 13.01.42                              | USD                                         | 200               | 400                  |
| US445545AH91 | 5,375% Ungarn Nts. 21.02.23                              | USD                                         | 0                 | 700                  |
| XS114333109  | 5,500% Erste Group Bank MTN 26.05.25V                    | USD                                         | 0                 | 400                  |
| XS0908769887 | 5,500% Kroatien Nts. 04.04.23                            | USD                                         | 0                 | 600                  |
| XS1567903627 | 5,500% MAF Global Securities Nts. 07.03.99               | USD                                         | 0                 | 400                  |
| XS1175223699 | 5,750% Banque Centrale de Tunisie Bds. 30.01.25          | USD                                         | 0                 | 1.050                |
| US91086QAZ19 | 5,750% Mexico MTN 12.10.2110                             | USD                                         | 0                 | 800                  |

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

| ISIN                                                                              | Gattungsbezeichnung                                 | Stück bzw.<br>Anteile bzw.<br>Whg. in 1.000 | Käufe/<br>Zugänge | Verkäufe/<br>Abgänge |
|-----------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------|---------------------------------------------|-------------------|----------------------|
| XS1110833123                                                                      | 6,000% Bahrain Bds. 19.09.44                        | USD                                         | 0                 | 800                  |
| USU12763AD75                                                                      | 6,000% Cemex Finance Nts. 01.04.24                  | USD                                         | 200               | 800                  |
| US780097AZ42                                                                      | 6,000% Royal Bank of Scotland Group Nts. 19.12.23   | USD                                         | 0                 | 500                  |
| US87927VAM00                                                                      | 6,000% Telecom Italia Capital Nts. 30.09.34         | USD                                         | 0                 | 400                  |
| US59022CAJ27                                                                      | 6,110% Bank of America Nts. 29.01.37                | USD                                         | 200               | 600                  |
| US77586TAE64                                                                      | 6,125% Rumänien MTN 22.01.44                        | USD                                         | 0                 | 600                  |
| XS1076957700                                                                      | 6,250% Credit Suisse Group 18.12.99V                | USD                                         | 0                 | 400                  |
| USL6401PAF01                                                                      | 6,500% Minerva Luxembourg Nts. 20.09.26             | USD                                         | 0                 | 400                  |
| USP16259AH99                                                                      | 6,750% Grupo Financiero BBVA Bancomer Nts. 30.09.22 | USD                                         | 0                 | 450                  |
| XS1750114396                                                                      | 6,750% Oman Nts. 17.01.48                           | USD                                         | 0                 | 400                  |
| XS1497755360                                                                      | 6,875% ING Groep Nts. 16.04.99                      | USD                                         | 200               | 600                  |
| US71645WAQ42                                                                      | 6,875% Petrobras Global Finance Nts. 20.01.40       | USD                                         | 400               | 400                  |
| USF2893TAC02                                                                      | 6,950% E.D.F. Nts. 26.01.39                         | USD                                         | 0                 | 200                  |
| USN4297BBC74                                                                      | 7,000% Koninklijke KPN Nts. 28.03.73V               | USD                                         | 0                 | 600                  |
| CH0331455318                                                                      | 7,125% UBS Group Bds. 10.08.99                      | USD                                         | 0                 | 400                  |
| US51808BAE20                                                                      | 7,300% Eni USA Nts. 15.11.27                        | USD                                         | 200               | 400                  |
| US715638AS19                                                                      | 7,350% Peru Bds. 21.07.25                           | USD                                         | 0                 | 1.000                |
| US195325BK01                                                                      | 7,375% Kolumbien Nts. 18.09.37                      | USD                                         | 0                 | 1.000                |
| US900123AW05                                                                      | 7,375% Türkei Nts. 05.02.25                         | USD                                         | 0                 | 700                  |
| XS1717013095                                                                      | 7,625% Nigeria MTN 28.11.47                         | USD                                         | 750               | 1.050                |
| XS1777972941                                                                      | 7,696% Nigeria MTN 23.02.38                         | USD                                         | 0                 | 900                  |
| USP2253TJK62                                                                      | 7,750% Cemex Nts. 16.04.26                          | USD                                         | 400               | 400                  |
| US105756BB58                                                                      | 8,250% Brasilien Bds. 20.01.34                      | USD                                         | 0                 | 1.500                |
| XS1781710626                                                                      | 8,250% Kenia Nts. 28.02.48                          | USD                                         | 0                 | 1.400                |
| US879385AD49                                                                      | 8,250% Telefonica Europe Nts. 15.09.30              | USD                                         | 0                 | 400                  |
| US91086QAG38                                                                      | 8,300% Mexiko Bds. 15.08.31                         | USD                                         | 0                 | 1.600                |
| USY20721AE96                                                                      | 8,500% Indonesien Bds. 12.10.35                     | USD                                         | 0                 | 525                  |
| XS1558078496                                                                      | 8,500% Ägypten MTN 31.01.47                         | USD                                         | 0                 | 1.550                |
| US25156PAC77                                                                      | 8,750% Deutsche Telekom Intern. Fin. Nts. 15.06.30  | USD                                         | 0                 | 400                  |
| XS1819680528                                                                      | 9,375% Angola Nts. 08.05.48                         | USD                                         | 0                 | 1.150                |
| US718286AY36                                                                      | 9,500% Philippinen Bds. 02.02.30                    | USD                                         | 0                 | 900                  |
| US900123AL40                                                                      | 11,875% Türkei Bds. 15.01.30                        | USD                                         | 0                 | 450                  |
| <b>Zertifikate</b>                                                                |                                                     |                                             |                   |                      |
| CH0328369118                                                                      | UBS (Ldn. Br.) ETC 31.12.99 BB CMCI Corn TR Index   | STK                                         | 0                 | 964                  |
| CH0328369191                                                                      | UBS (Ldn. Br.) ETC 31.12.99 CMCI Heating Oil Index  | STK                                         | 0                 | 1.147                |
| CH0328369282                                                                      | UBS (Ldn. Br.) ETC 31.12.99 CMCI Silver TR Index    | STK                                         | 0                 | 3.185                |
| CH0328369100                                                                      | UBS (Ldn. Br.) ETC 31.12.99 CMCI TR Copper Index    | STK                                         | 0                 | 595                  |
| CH0363893790                                                                      | UBS (Ldn.Br.) ETC 31.12.99 BB Brent Crude TR Index  | STK                                         | 0                 | 111                  |
| CH0328368995                                                                      | UBS (Ldn.Br.) ETC 31.12.99 CMCI Aluminium TR Index  | STK                                         | 0                 | 1.221                |
| <b>Andere Wertpapiere</b>                                                         |                                                     |                                             |                   |                      |
| NL0011540547                                                                      | ABN AMRO Group Deposit Receipts                     | STK                                         | 3.290             | 17.114               |
| ES06445809J6                                                                      | Iberdrola S.A. ANR                                  | STK                                         | 46.278            | 46.278               |
| <b>An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere</b> |                                                     |                                             |                   |                      |
| <b>Aktien</b>                                                                     |                                                     |                                             |                   |                      |
| US0042851024                                                                      | Acamar Partners Acquisition Corp.                   | STK                                         | 0                 | 3.172                |
| US42589C1045                                                                      | Hennessy Capital Acquisition Corp. IV               | STK                                         | 898               | 2.665                |
| US80821R1095                                                                      | Schultze Special Purpose Acquisition Corp.          | STK                                         | 1.136             | 2.940                |

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

| ISIN                            | Gattungsbezeichnung                                  | Stück bzw.<br>Anteile bzw.<br>Whg. in 1.000 | Käufe/<br>Zugänge | Verkäufe/<br>Abgänge |
|---------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------------------------|-------------------|----------------------|
| <b>Verzinsliche Wertpapiere</b> |                                                      |                                             |                   |                      |
| CA135087G732                    | 1,000% Canada Bds. 01.09.22                          | CAD                                         | 0                 | 900                  |
| CA135087XG49                    | 5,750% Canada Bds. 01.06.33                          | CAD                                         | 0                 | 500                  |
| XS2010039548                    | 1,600% Deutsche Bahn Finance Nts. 18.10.2169V        | EUR                                         | 0                 | 400                  |
| XS1716833352                    | 2,125% Rexel Nts. 15.06.25                           | EUR                                         | 0                 | 400                  |
| XS1511793124                    | 2,500% FIL Bds. 04.11.26                             | EUR                                         | 0                 | 200                  |
| XS1568875444                    | 2,500% Petróleos Mexicanos (PEMEX) MTN 21.08.21      | EUR                                         | 0                 | 400                  |
| XS1975699569                    | 2,875% Loxam Nts. 15.04.26                           | EUR                                         | 0                 | 400                  |
| XS1890845875                    | 3,250% Iberdrola International Nts. 12.02.2168V      | EUR                                         | 0                 | 300                  |
| XS1212470972                    | 3,250% Schaeffler Finance Nts. 15.05.25              | EUR                                         | 0                 | 200                  |
| XS1333193875                    | 3,750% Goodyear Dunlop Tires Europe Nts. 15.12.23    | EUR                                         | 0                 | 200                  |
| XS1383922876                    | 4,000% Sappi Papier Holding Nts. 01.04.23            | EUR                                         | 200               | 400                  |
| XS1577952440                    | 4,750% Altice Finco Nts. 15.01.28                    | EUR                                         | 0                 | 600                  |
| XS0969341147                    | 6,375% América Móvil Secs. 06.09.73V                 | EUR                                         | 0                 | 400                  |
| XS1959498244                    | 4,535% Ford Motor Credit MTN 06.03.25                | GBP                                         | 0                 | 300                  |
| US07274NAG88                    | 1,750% Bayer US Finance II FRN 15.12.23V             | USD                                         | 0                 | 200                  |
| US594918BQ69                    | 2,000% Microsoft Nts. 08.08.23                       | USD                                         | 0                 | 400                  |
| US83051GAD07                    | 2,450% SEB MTN 27.05.20                              | USD                                         | 0                 | 400                  |
| US084670BR84                    | 2,750% Berkshire Hathaway Finance Nts. 15.03.23      | USD                                         | 0                 | 200                  |
| US55608RAV24                    | 2,850% Macquarie Bank MTN 15.01.21                   | USD                                         | 0                 | 200                  |
| US713448DF24                    | 2,850% PepsiCo Nts. 24.02.26                         | USD                                         | 0                 | 400                  |
| US822582BT82                    | 2,875% Shell International Finance Nts. 10.05.26     | USD                                         | 0                 | 400                  |
| US58933YAU91                    | 2,900% Merck & Co. Nts. 07.03.24                     | USD                                         | 0                 | 400                  |
| US883556BN17                    | 3,000% Thermo Fisher Scientific Nts. 15.04.23        | USD                                         | 0                 | 300                  |
| US46625HKC33                    | 3,125% JPMorgan Chase Nts. 23.01.25                  | USD                                         | 200               | 600                  |
| US46625HJH49                    | 3,200% JPMorgan Chase Nts. 25.01.23                  | USD                                         | 0                 | 400                  |
| USU07264AG68                    | 3,375% Bayer US Finance Nts. 08.10.24                | USD                                         | 0                 | 400                  |
| USG5002FAE63                    | 3,500% Jaguar Land Rover Automotive Nts. 15.03.20    | USD                                         | 0                 | 600                  |
| US741503AZ91                    | 3,600% Booking Holdings Nts. 01.06.26                | USD                                         | 0                 | 400                  |
| US21684AAF30                    | 3,750% Rabobank Nederland Nts. 21.07.26              | USD                                         | 0                 | 500                  |
| US91087BAE02                    | 3,750% Vereinigte Mexikanische Staaten Nts. 11.01.28 | USD                                         | 0                 | 800                  |
| US05581LAB53                    | 3,800% BNP Paribas MTN 10.01.24                      | USD                                         | 0                 | 600                  |
| US22532MAM47                    | 3,875% Crédit Agricole (London Branch) MTN 15.04.24  | USD                                         | 0                 | 500                  |
| US698299BF03                    | 3,875% Panama Bds. 17.03.28                          | USD                                         | 0                 | 800                  |
| US92343VES97                    | 3,875% Verizon Communications Nts. 08.02.29          | USD                                         | 0                 | 400                  |
| US06051GHQ55                    | 3,974% Bank of America MTN 07.02.30V                 | USD                                         | 0                 | 400                  |
| US05578DAG79                    | 4,000% BPCE MTN 15.04.24                             | USD                                         | 0                 | 500                  |
| US37045XAS53                    | 4,000% General Motors Financial Nts. 15.01.25        | USD                                         | 0                 | 400                  |
| US06051GFH74                    | 4,200% Bank of America MTN 26.08.24                  | USD                                         | 200               | 600                  |
| XS2049422343                    | 4,250% Swiss Re Finance Lux Nts. 04.09.2164V         | USD                                         | 0                 | 600                  |
| US92343VER15                    | 4,329% Verizon Communications Nts. 21.09.28          | USD                                         | 0                 | 200                  |
| US30212PAJ49                    | 4,500% Expedia Group Nts.15.02.24                    | USD                                         | 200               | 400                  |
| USG5002FAM89                    | 4,500% Jaguar Land Rover Automotive Nts. 01.10.27    | USD                                         | 200               | 400                  |

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

| ISIN                                   | Gattungsbezeichnung                                       | Stück bzw.<br>Anteile bzw.<br>Whg. in 1.000 | Käufe/<br>Zugänge | Verkäufe/<br>Abgänge |
|----------------------------------------|-----------------------------------------------------------|---------------------------------------------|-------------------|----------------------|
| USP3772WAH53                           | 4,625% Banco do Brasil [Cayman Branch] Nts. 15.01.25      | USD                                         | 0                 | 200                  |
| US228187AB66                           | 4,750% Crown Americas / Crown Americas Cap. Nts. 01.02.26 | USD                                         | 400               | 400                  |
| XS1405777589                           | 4,750% Oman Nts. 15.06.26                                 | USD                                         | 0                 | 800                  |
| US87264AAV70                           | 4,750% T-Mobile USA Nts. 01.02.28                         | USD                                         | 0                 | 500                  |
| US98877DAC92                           | 4,750% ZF North America Capital Nts. 26.04.25             | USD                                         | 0                 | 350                  |
| US6174824M37                           | 4,875% Morgan Stanley MTN 01.11.22                        | USD                                         | 400               | 400                  |
| US03522AAJ97                           | 4,900% Anheuser-Busch InBev Worldwide Nts. 01.02.46       | USD                                         | 0                 | 400                  |
| USN4578BQA53                           | 5,000% ING Bank Nts. 09.06.21                             | USD                                         | 0                 | 400                  |
| US737446AK05                           | 5,000% Post Holdings Nts. 15.08.26                        | USD                                         | 200               | 600                  |
| USL6388GAB60                           | 5,125% Millicom International Cellular Nts. 15.01.28      | USD                                         | 200               | 500                  |
| US058498AT38                           | 5,250% Ball Nts. 01.07.25                                 | USD                                         | 200               | 600                  |
| USP16236AG98                           | 5,250% BBVA Banco Continental Nts. 22.09.29               | USD                                         | 0                 | 400                  |
| USP28768AA04                           | 5,375% Colombia Telecomunicaciones Nts. 27.09.22          | USD                                         | 0                 | 400                  |
| USF7061BAK64                           | 5,750% Pernod-Ricard Nts. 07.04.21                        | USD                                         | 0                 | 300                  |
| USN45780CT38                           | 5,800% ING Bank Nts. 25.09.23                             | USD                                         | 200               | 600                  |
| USP09646AE32                           | 6,125% Banco de Credito Peru [Panama Br.] Nts. 24.04.27   | USD                                         | 0                 | 400                  |
| USG8762IAL52                           | 6,150% Tesco Nts. 15.11.37                                | USD                                         | 0                 | 400                  |
| US46115HAD98                           | 6,500% Intesa Sanpaolo MTN 24.02.21                       | USD                                         | 600               | 1.200                |
| US46115HAE71                           | 6,500% Intesa Sanpaolo MTN 24.02.21                       | USD                                         | 600               | 600                  |
| USP13435AA33                           | 6,625% Banco Internacional del Peru Nts. 19.03.29V        | USD                                         | 0                 | 400                  |
| USG91237AA87                           | 7,000% Tullow Oil Nts. 01.03.25                           | USD                                         | 0                 | 600                  |
| USN8540WAC84                           | 7,125% Teva Pharmaceutical Finance Netherl. Nts. 31.01.25 | USD                                         | 0                 | 400                  |
| US85207UAE55                           | 7,250% Sprint Corp. Nts. 15.09.21                         | USD                                         | 0                 | 400                  |
| USF6628RAA17                           | 7,375% Altice France Nts. 01.05.26                        | USD                                         | 0                 | 400                  |
| US02154CAE30                           | 7,500% Altice Financing Nts. 15.05.26                     | USD                                         | 0                 | 400                  |
| US85207UAK16                           | 7,625% Sprint Corp. Nts. 01.03.26                         | USD                                         | 0                 | 600                  |
| USC10602BG11                           | 7,875% Bombardier Nts. 15.04.27                           | USD                                         | 400               | 400                  |
| US29265WAB46                           | 8,750% ENEL Nts. 24.09.73                                 | USD                                         | 0                 | 400                  |
| XS1929376710                           | 10,750% Ecuador Nts. 31.01.29                             | USD                                         | 0                 | 400                  |
| <b>Nichtnotierte Wertpapiere</b>       |                                                           |                                             |                   |                      |
| <b>Verzinsliche Wertpapiere</b>        |                                                           |                                             |                   |                      |
| JP1120211G41                           | 0,100% Japan ILB 10.03.26                                 | JPY                                         | 0                 | 102.400              |
| JP1120231J51                           | 0,100% Japan ILB 10.03.28                                 | JPY                                         | 0                 | 60.000               |
| <b>Investmentanteile</b>               |                                                           |                                             |                   |                      |
| <b>Gruppeneigene Investmentanteile</b> |                                                           |                                             |                   |                      |
| LU1681049018                           | AIS - Index S&P 500 ETF                                   | ANT                                         | 101.000           | 101.000              |
| LU1883867415                           | Amundi Funds II - Real Assets Target Income               | ANT                                         | 0                 | 8.900                |
| LU2052290199                           | Amundi Funds SICAV-Emerging Markets Corporate Bond        | ANT                                         | 0                 | 3.000                |
| LU0271695461                           | Amundi S.F. - EUR Commodities                             | ANT                                         | 0                 | 2.000                |
| <b>Gruppenfremde Investmentanteile</b> |                                                           |                                             |                   |                      |
| IE00B0M63391                           | iShares MSCI Korea UCITS ETF USD (Dist)                   | ANT                                         | 41.010            | 41.010               |

## Derivate

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

| Gattungsbezeichnung                         | Stück bzw.<br>Anteile bzw.<br>Whg. in 1.000 | Käufe/<br>Zugänge | Verkäufe/<br>Abgänge | Volumen in 1.000 |
|---------------------------------------------|---------------------------------------------|-------------------|----------------------|------------------|
| <b>Terminkontrakte</b>                      |                                             |                   |                      |                  |
| <b>Aktienindex-Terminkontrakte</b>          |                                             |                   |                      |                  |
| Gekaufte Kontrakte                          |                                             |                   |                      |                  |
| (Basiswerte:                                | EUR                                         |                   |                      | 87.207           |
| ASX SPI 200 Index Future                    |                                             |                   |                      |                  |
| E-Mini Energy Select Sector Future          |                                             |                   |                      |                  |
| E-mini Industrial Select Sector Future      |                                             |                   |                      |                  |
| E-Mini Materials Select Sector Future       |                                             |                   |                      |                  |
| E-Mini Nasdaq 100 Index Future              |                                             |                   |                      |                  |
| E-mini S & P Financial Select Sector Future |                                             |                   |                      |                  |
| E-Mini S&P 500 Index Future                 |                                             |                   |                      |                  |
| EURO STOXX 50 Index Future                  |                                             |                   |                      |                  |
| FTSE 100 Index Future                       |                                             |                   |                      |                  |
| FTSE 250 Index Future                       |                                             |                   |                      |                  |
| MSCI Emerging Markets EUR NR Index Future   |                                             |                   |                      |                  |
| Nikkei 225 Stock Average Index Future       |                                             |                   |                      |                  |
| SMI Index Future                            |                                             |                   |                      |                  |
| Stoxx 600 Basic Ressources Future           |                                             |                   |                      |                  |
| Tokyo Stock Price Index Future)             |                                             |                   |                      |                  |
| Verkaufte Kontrakte                         |                                             |                   |                      |                  |
| (Basiswerte:                                | EUR                                         |                   |                      | 91.940           |
| ASX SPI 200 Index Future                    |                                             |                   |                      |                  |
| E-Mini S&P 500 Index Future                 |                                             |                   |                      |                  |
| EURO STOXX 50 Index Future                  |                                             |                   |                      |                  |
| FTSE 100 Index Future                       |                                             |                   |                      |                  |
| SMI Index Future)                           |                                             |                   |                      |                  |
| <b>Zinsterminkontrakte</b>                  |                                             |                   |                      |                  |
| Gekaufte Kontrakte                          |                                             |                   |                      |                  |
| (Basiswerte:                                | EUR                                         |                   |                      | 692.883          |
| 10-Year Australien Bond Future              |                                             |                   |                      |                  |
| 10-Year Gov. of Canada Bond Future          |                                             |                   |                      |                  |
| 10-Year U.S. Treasury Notes Future          |                                             |                   |                      |                  |
| 2-Year U.S. Treasury Notes Future           |                                             |                   |                      |                  |
| 30-Year U.S. Treasury Long Bond Fut.        |                                             |                   |                      |                  |
| 5-Year U.S. Treasury Notes Future           |                                             |                   |                      |                  |
| Euro Bund Future                            |                                             |                   |                      |                  |
| Euro Buxl Future                            |                                             |                   |                      |                  |
| Euro-BTP Future                             |                                             |                   |                      |                  |
| Ultra10-Year U.S. Treasury Notes Fut.)      |                                             |                   |                      |                  |

## Derivate

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

| Gattungsbezeichnung                     | Stück bzw.<br>Anteile bzw.<br>Whg. in 1.000 | Käufe/<br>Zugänge | Verkäufe/<br>Abgänge | Volumen in 1.000 |
|-----------------------------------------|---------------------------------------------|-------------------|----------------------|------------------|
| <b>Verkaufte Kontrakte</b>              |                                             |                   |                      |                  |
| (Basiswerte:                            | EUR                                         |                   |                      | 245.092          |
| 10-Year Japanese Gov. Bond Future TSE   |                                             |                   |                      |                  |
| 30-Year U.S. Treasury Long Bond Fut.    |                                             |                   |                      |                  |
| 5-Year U.S. Treasury Notes Future       |                                             |                   |                      |                  |
| Euro Bobl Future                        |                                             |                   |                      |                  |
| Euro Buxl Future                        |                                             |                   |                      |                  |
| Euro Schatz Future                      |                                             |                   |                      |                  |
| Euro-BTP Future                         |                                             |                   |                      |                  |
| Long Gilt Future                        |                                             |                   |                      |                  |
| Long Term Euro OAT Future               |                                             |                   |                      |                  |
| Ultra10-Year U.S. Treasury Notes Fut.)  |                                             |                   |                      |                  |
| <b>Devisenterminkontrakte (Verkauf)</b> |                                             |                   |                      |                  |
| <b>Verkauf von Devisen auf Termin:</b>  |                                             |                   |                      |                  |
| AUD/EUR                                 | EUR                                         |                   |                      | 13.866           |
| BRL/USD                                 | EUR                                         |                   |                      | 7.304            |
| CAD/EUR                                 | EUR                                         |                   |                      | 14.740           |
| CHF/EUR                                 | EUR                                         |                   |                      | 18.264           |
| CLP/USD                                 | EUR                                         |                   |                      | 1.788            |
| CNY/USD                                 | EUR                                         |                   |                      | 4.054            |
| COP/USD                                 | EUR                                         |                   |                      | 1.325            |
| DKK/EUR                                 | EUR                                         |                   |                      | 2.411            |
| GBP/EUR                                 | EUR                                         |                   |                      | 61.678           |
| HKD/EUR                                 | EUR                                         |                   |                      | 9.993            |
| IDR/USD                                 | EUR                                         |                   |                      | 11.349           |
| ILS/EUR                                 | EUR                                         |                   |                      | 8.089            |
| INR/USD                                 | EUR                                         |                   |                      | 6.026            |
| JPY/EUR                                 | EUR                                         |                   |                      | 2.515            |
| KRW/USD                                 | EUR                                         |                   |                      | 4.042            |
| MXN/EUR                                 | EUR                                         |                   |                      | 1.961            |
| NOK/EUR                                 | EUR                                         |                   |                      | 790              |
| NZD/EUR                                 | EUR                                         |                   |                      | 5.596            |
| PLN/EUR                                 | EUR                                         |                   |                      | 578              |
| RUB/EUR                                 | EUR                                         |                   |                      | 2.585            |
| SEK/EUR                                 | EUR                                         |                   |                      | 2.812            |
| THB/EUR                                 | EUR                                         |                   |                      | 6.190            |
| TWD/USD                                 | EUR                                         |                   |                      | 4.301            |
| USD/EUR                                 | EUR                                         |                   |                      | 386.598          |
| ZAR/EUR                                 | EUR                                         |                   |                      | 1.147            |

## Derivate

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

| Gattungsbezeichnung                     | Stück bzw.<br>Anteile bzw.<br>Whg. in 1.000 | Käufe/<br>Zugänge | Verkäufe/<br>Abgänge | Volumen in 1.000 |
|-----------------------------------------|---------------------------------------------|-------------------|----------------------|------------------|
| <b>Devisenterminkontrakte (Kauf)</b>    |                                             |                   |                      |                  |
| <b>Kauf von Devisen auf Termin:</b>     |                                             |                   |                      |                  |
| AUD/EUR                                 | EUR                                         |                   |                      | 271              |
| BRL/USD                                 | EUR                                         |                   |                      | 3.749            |
| CAD/EUR                                 | EUR                                         |                   |                      | 897              |
| CHF/EUR                                 | EUR                                         |                   |                      | 1.279            |
| CLP/USD                                 | EUR                                         |                   |                      | 916              |
| CNY/USD                                 | EUR                                         |                   |                      | 3.505            |
| COP/USD                                 | EUR                                         |                   |                      | 1.303            |
| CZK/EUR                                 | EUR                                         |                   |                      | 1.242            |
| IDR/USD                                 | EUR                                         |                   |                      | 7.407            |
| INR/USD                                 | EUR                                         |                   |                      | 3.010            |
| JPY/EUR                                 | EUR                                         |                   |                      | 33.014           |
| KRW/USD                                 | EUR                                         |                   |                      | 5.088            |
| MXN/EUR                                 | EUR                                         |                   |                      | 3.377            |
| NOK/EUR                                 | EUR                                         |                   |                      | 20.757           |
| PLN/EUR                                 | EUR                                         |                   |                      | 5.722            |
| RUB/EUR                                 | EUR                                         |                   |                      | 6.771            |
| SEK/EUR                                 | EUR                                         |                   |                      | 7.753            |
| TWD/USD                                 | EUR                                         |                   |                      | 5.352            |
| USD/EUR                                 | EUR                                         |                   |                      | 35.915           |
| <b>Optionsrechte</b>                    |                                             |                   |                      |                  |
| <b>Wertpapier-Optionsrechte</b>         |                                             |                   |                      |                  |
| <b>Optionsrechte auf Aktien</b>         |                                             |                   |                      |                  |
| Gekaufte Kaufoptionen (Call)            |                                             |                   |                      |                  |
| (Basiswerte:                            | EUR                                         |                   |                      | 53               |
| CALL Anglogold Ashanti 20,00            |                                             |                   |                      |                  |
| CALL Barrick Gold Corp 22,00            |                                             |                   |                      |                  |
| CALL Gold Fields Ltd. 6,00)             |                                             |                   |                      |                  |
| Verkaufte Verkaufsoptionen (Put)        |                                             |                   |                      |                  |
| (Basiswerte:                            | EUR                                         |                   |                      | 0                |
| PUT Wheaton Precious Metals Corp 39,00) |                                             |                   |                      |                  |

## Derivate

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

| Gattungsbezeichnung                           | Stück bzw.<br>Anteile bzw.<br>Whg. in 1.000 | Käufe/<br>Zugänge | Verkäufe/<br>Abgänge | Volumen in 1.000 |
|-----------------------------------------------|---------------------------------------------|-------------------|----------------------|------------------|
| <b>Optionsrechte auf Aktienindex-Derivate</b> |                                             |                   |                      |                  |
| <b>Optionsrechte auf Aktienindices</b>        |                                             |                   |                      |                  |
| Gekaufte Kaufoptionen (Call)                  |                                             |                   |                      |                  |
| (Basiswerte:                                  | EUR                                         |                   |                      | 1.356            |
| Call E-Mini Nasdaq 100 Index 7450,00          |                                             |                   |                      |                  |
| Call E-Mini Nasdaq 100 Index 8420,00          |                                             |                   |                      |                  |
| CALL Euro Stoxx 50 Index 3450,00              |                                             |                   |                      |                  |
| CALL Euro Stoxx 50 Index 3775,00              |                                             |                   |                      |                  |
| CALL MSCI EM NR USD Index 535,00              |                                             |                   |                      |                  |
| CALL Nasdaq 100 Index 8875,00                 |                                             |                   |                      |                  |
| CALL Nikkei 225 Index 23750,00                |                                             |                   |                      |                  |
| CALL Russell 2000 Index 1680,00               |                                             |                   |                      |                  |
| CALL S&P 500 Index 2750,00                    |                                             |                   |                      |                  |
| CALL S&P 500 Index 3150,00)                   |                                             |                   |                      |                  |
| Gekaufte Verkaufsoptionen (Put)               |                                             |                   |                      |                  |
| (Basiswerte:                                  | EUR                                         |                   |                      | 335              |
| PUT Euro Stoxx 50 Index 3750,00               |                                             |                   |                      |                  |
| PUT S&P 500 Index 2470,00                     |                                             |                   |                      |                  |
| PUT S&P 500 Index 3250,00)                    |                                             |                   |                      |                  |
| Verkaufte Kaufoptionen (Call)                 |                                             |                   |                      |                  |
| (Basiswerte:                                  | EUR                                         |                   |                      | 697              |
| Call E-Mini Nasdaq 100 Index 10700,00         |                                             |                   |                      |                  |
| CALL Euro Stoxx 50 Index 3075,00              |                                             |                   |                      |                  |
| CALL Euro Stoxx 50 Index 3875,00              |                                             |                   |                      |                  |
| CALL Euro Stoxx Banks Price Index 75,00       |                                             |                   |                      |                  |
| CALL S&P 500 Index 3000,00                    |                                             |                   |                      |                  |
| CALL S&P 500 Index 3110,00                    |                                             |                   |                      |                  |
| CALL S&P 500 Index 3115,00                    |                                             |                   |                      |                  |
| CALL S&P 500 Index 3245,00                    |                                             |                   |                      |                  |
| CALL S&P 500 Index 3350,00)                   |                                             |                   |                      |                  |

## Derivate

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

| Gattungsbezeichnung                                  | Stück bzw.<br>Anteile bzw.<br>Whg. in 1.000 | Käufe/<br>Zugänge | Verkäufe/<br>Abgänge | Volumen in 1.000 |
|------------------------------------------------------|---------------------------------------------|-------------------|----------------------|------------------|
| Verkaufte Verkaufsoptionen (Put)                     |                                             |                   |                      |                  |
| (Basiswerte:                                         | EUR                                         |                   |                      | 1.880            |
| PUT Euro Stoxx 50 Index 2200,00                      |                                             |                   |                      |                  |
| PUT Euro Stoxx 50 Index 2700,00                      |                                             |                   |                      |                  |
| PUT Euro Stoxx 50 Index 3025,00                      |                                             |                   |                      |                  |
| PUT Euro Stoxx 50 Index 3100,00                      |                                             |                   |                      |                  |
| PUT Euro Stoxx 50 Index 3600,00                      |                                             |                   |                      |                  |
| PUT Nikkei 225 Index 22375,00                        |                                             |                   |                      |                  |
| PUT S&P 500 Index 2200,00                            |                                             |                   |                      |                  |
| PUT S&P 500 Index 2410,00                            |                                             |                   |                      |                  |
| PUT S&P 500 Index 2550,00                            |                                             |                   |                      |                  |
| PUT S&P 500 Index 2600,00                            |                                             |                   |                      |                  |
| PUT S&P 500 Index 2725,00                            |                                             |                   |                      |                  |
| PUT S&P 500 Index 2870,00                            |                                             |                   |                      |                  |
| PUT S&P 500 Index 2890,00                            |                                             |                   |                      |                  |
| PUT S&P 500 Index 3000,00                            |                                             |                   |                      |                  |
| PUT S&P 500 Index 3100,00)                           |                                             |                   |                      |                  |
| <b>Optionsrechte auf Aktienindex-Terminkontrakte</b> |                                             |                   |                      |                  |
| Verkaufte Kaufoptionen (Call)                        |                                             |                   |                      |                  |
| (Basiswerte:                                         | EUR                                         |                   |                      | 417              |
| Call S&P 500 E-mini Index Future 2400,00             |                                             |                   |                      |                  |
| Call S&P 500 E-mini Index Future 2730,00             |                                             |                   |                      |                  |
| Call S&P 500 E-mini Index Future 3200,00             |                                             |                   |                      |                  |
| Call S&P 500 E-mini Index Future 3350,00)            |                                             |                   |                      |                  |
| Verkaufte Verkaufsoptionen (Put)                     |                                             |                   |                      |                  |
| (Basiswerte:                                         | EUR                                         |                   |                      | 33               |
| PUT S&P 500 E-mini Index Future 3225,00)             |                                             |                   |                      |                  |
| <b>Optionsrechte auf Zins-Derivate</b>               |                                             |                   |                      |                  |
| <b>Optionsrechte auf Zinsterminkontrakte</b>         |                                             |                   |                      |                  |
| Gekaufte Verkaufsoptionen (Put)                      |                                             |                   |                      |                  |
| (Basiswerte:                                         | EUR                                         |                   |                      | 523              |
| PUT 30-Year US Treasury Notes Future 155,00          |                                             |                   |                      |                  |
| PUT 30-Year US Treasury Notes Future 158,00          |                                             |                   |                      |                  |
| PUT 30-Year US Treasury Notes Future 160,00          |                                             |                   |                      |                  |
| PUT 30-Year US Treasury Notes Future 174,00)         |                                             |                   |                      |                  |
| Verkaufte Kaufoptionen (Call)                        |                                             |                   |                      |                  |
| (Basiswerte:                                         | EUR                                         |                   |                      | 182              |
| CALL 30-Year US Treasury Notes Future 167,00         |                                             |                   |                      |                  |
| CALL 30-Year US Treasury Notes Future 183,00         |                                             |                   |                      |                  |
| CALL 30-Year US Treasury Notes Future 187,00)        |                                             |                   |                      |                  |

## Ertrags- und Aufwandsrechnung (inkl. Ertragsausgleich) Amundi Weltportfolio

für den Zeitraum vom 01.01.2020 bis 30.06.2020

|                                                                 | EUR                   |
|-----------------------------------------------------------------|-----------------------|
| <b>I. Erträge</b>                                               |                       |
| 1. Dividenden inländischer Aussteller                           | 18.419,37             |
| 2. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer)      | 55.872,20             |
| 3. Zinsen aus inländischen Wertpapieren                         | -87.356,84            |
| 4. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer)    | 1.276.313,73          |
| 5. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland                      | 2.715,14              |
| 6. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Ausland (vor Quellensteuer) | 245,78                |
| 7. Erträge aus Investmentanteilen                               | 418.489,94            |
| 8. Abzug ausländischer Quellensteuer                            | -30.262,29            |
| 9. Sonstige Erträge                                             | 1.014,54              |
| <b>Summe der Erträge</b>                                        | <b>1.655.451,57</b>   |
| <b>II. Aufwendungen</b>                                         |                       |
| 1. Zinsen aus Kreditaufnahmen                                   | -4.337,07             |
| 2. Verwaltungsvergütung                                         | -213.068,69           |
| 3. Verwahrstellenvergütung                                      | -20.284,16            |
| 4. Prüfungs- und Veröffentlichungskosten                        | -8.993,91             |
| 5. Sonstige Aufwendungen                                        | -18.580,01            |
| <b>Summe der Aufwendungen</b>                                   | <b>-265.263,84</b>    |
| <b>III. Ordentlicher Nettoertrag</b>                            | <b>1.390.187,73</b>   |
| <b>IV. Veräußerungsgeschäfte</b>                                |                       |
| 1. Realisierte Gewinne                                          | 76.305.650,57         |
| 2. Realisierte Verluste                                         | -92.130.280,03        |
| <b>Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften</b>                      | <b>-15.824.629,46</b> |
| <b>V. Realisiertes Ergebnis</b>                                 | <b>-14.434.441,73</b> |
| 1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne              | -150.562.847,50       |
| 2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste             | 144.352.102,44        |
| <b>VI. Nicht realisiertes Ergebnis</b>                          | <b>-6.210.745,06</b>  |
| <b>VII. Ergebnis</b>                                            | <b>-20.645.186,79</b> |

## Entwicklung des Sondervermögens Amundi Weltportfolio

|                                                                                | EUR             | EUR                   |
|--------------------------------------------------------------------------------|-----------------|-----------------------|
| <b>I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres</b>               |                 | <b>314.112.783,56</b> |
| 1. Ausschüttung für das Vorjahr/Steuerabschlag für das Vorjahr                 |                 | -1.421.842,50         |
| 2. Zwischenausschüttungen/Steuerabschlag für das laufende Jahr                 |                 | -577.710,50           |
| 3. Mittelzufluss/-abfluss (netto)                                              |                 | -129.672.344,60       |
| a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen                                   | 222.097.084,40  |                       |
| b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen                                  | -351.769.429,00 |                       |
| 4. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich                                          |                 | 3.898.655,15          |
| 5. Ergebnis des Geschäftsjahres                                                |                 | -20.645.186,79        |
| davon nicht realisierte Gewinne                                                | -150.562.847,50 |                       |
| davon nicht realisierte Verluste                                               | 144.352.102,44  |                       |
| <b>II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres zum 30.06.2020</b> |                 | <b>165.694.354,32</b> |

## Anhang gem. §7 Nr. 9 KARBV

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

Während des Berichtszeitraums wurden keine Transaktionen gemäß der Verordnung (EU) 2015/2365 über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte abgeschlossen.

#### Sonstige Angaben

|                                         |     |               |
|-----------------------------------------|-----|---------------|
| Anteilwert Amundi Weltportfolio         | EUR | 97,530        |
| Umlaufende Anteile Amundi Weltportfolio | STK | 1.698.960,000 |

#### Ausgestaltungsmerkmale der Anteilklassen

|                             |                             |
|-----------------------------|-----------------------------|
| Mindestanlagesumme          | 100.000 EUR                 |
| Fondsaufgabe                | 01.12.2017                  |
| Ausgabeaufschlag            | bis zu 5,00%; derzeit 3,00% |
| Rücknahmeabschlag           | 0,00%                       |
| Verwaltungsvergütung (p.a.) | bis zu 2,00%; derzeit 0,25% |
| Stückelung                  | Globalurkunde               |
| Ertragsverwendung           | Ausschüttend                |
| Währung                     | Euro                        |
| ISIN                        | DE000A2DW335                |

#### Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände

Die von der Verwahrstelle als verantwortliche Stelle für die Anteilpreisermittlung übermittelten Bewertungskurse für die einzelnen Wertpapiere bzw. Derivate werden von der Société Générale Securities Services GmbH als Insourcer der Fondsadministration mittels unabhängiger Referenzkurse von Informationsdienstleistern wie Bloomberg, Reuters oder Interactive Data geprüft.

Im Fall von handelbaren Wertpapieren erfolgt die Bewertung zum letzten verfügbaren handelbaren Kurs. Wertpapiere, für die kein handelbarer Kurs verfügbar ist, werden im Rahmen eines mehrstufigen Prozesses bei der Société Générale Securities Services GmbH einer detaillierten Kursprüfung unterzogen, wobei folgende Grundsätze gelten:

- Wertpapiere, für die in Bloomberg kein Kurs bereitgestellt wird, oder deren Kurs länger als 10 Bewertungstage konstant ist, werden als nicht mehr handelbar eingestuft. Die von der Verwahrstelle für diese Wertpapiere gelieferten Kurse werden mittels Quotierungen Dritter oder anhand von Preisen auf Basis von geeigneten Bewertungsmodellen plausibilisiert.
- Ein Wechsel der Kursquelle erfolgt nur bei dauerhafter Verfügbarkeit der neuen Quelle.
- Steht als Kursquelle ausschließlich ein mittels Bewertungsmodell errechneter Preis zur Verfügung, wird dieser Preis anhand einer weiteren unabhängigen Modellierung verifiziert (Einhaltung des Zwei-Quellen-Prinzips).

Für die im Sondervermögen Amundi Weltportfolio zum Stichtag enthaltenen Wertpapiere kamen, bezogen auf den Nettoinventarwert, nachfolgend dargestellte Bewertungsverfahren zum Ansatz:

91,11% Bewertung auf Basis handelbarer Kurse

0,00% Bewertung auf Basis nicht handelbarer Kurse (u.a. anhand der Quelle Interactive Data, indikativer Quotes bzw. Bewertungsmodellen).

Die Bewertung von Investmentanteilen erfolgt grundsätzlich auf Basis des Rücknahmepreises des Vortages oder – sofern kein Rücknahmepreis verfügbar ist – auf Basis von Börsenkursen. Exchange-Traded-Funds werden zum Börsenkurs bewertet.

Die Bewertung von Futures und Optionen, die an einer Börse oder an einem anderen organisierten Markt gehandelt werden, erfolgt grundsätzlich anhand des letzten verfügbaren handelbaren Kurses. Nicht börsengehandelte Derivate (wie z.B. Devisentermingeschäfte oder Swaps) werden mittels marktgängiger Verfahren unter Einbeziehung der relevanten Marktinformationen bewertet.

Bankguthaben und sonstige Vermögensgegenstände sind zum Nennwert bewertet. Verbindlichkeiten werden mit ihrem Rückzahlungsbetrag angesetzt.

München, Juli 2020

**Amundi Deutschland GmbH**

Die Geschäftsführung



Evi C. Vogl



Oliver Kratz



Thomas Kruse



Dr. Andreas Steinert

## Verwaltung und Vertrieb

### Kapitalverwaltungsgesellschaft

Amundi Deutschland GmbH  
 Arnulfstraße 124-126, D-80636 München  
 Telefon +49 (0) 89 / 9 92 26-0  
 Handelsregister München B 91483  
 Gezeichnetes Kapital: 7.312.500 EUR  
 Haftendes Eigenkapital: 35,565 Mio. EUR  
 (Stand 31.12.2019)

### Gesellschafter

Amundi Asset Management S.A.S., Paris, Frankreich

### Aufsichtsrat

Valérie Baudson, Vorsitzende  
 CEO of CPR Asset Management and Head of ETF,  
 Indexing and Smart Beta, Paris, Frankreich

Prof. Axel Börsch-Supan, stv. Vorsitzender  
 Direktor am Max-Planck-Institut für Sozialrecht und  
 Sozialpolitik – Münchener Zentrum für Ökonomie und  
 Demographischer Wandel

Francesco Sandrini<sup>1</sup>  
 Head of Multi Asset Securities Solutions  
 Amundi SGR S.p.A., Mailand, Italien

Günther H. Oettinger<sup>2</sup>  
 Gesellschafter der Oettinger Consulting,  
 Wirtschafts- und Politikberatung GmbH

### Geschäftsführung

Evi C. Vogl<sup>3</sup>  
 Oliver Kratz  
 Thomas Kruse  
 Dr. Andreas Steinert

### Verwahrstelle

CACEIS Bank S.A., Germany Branch  
 Lilienthalallee 36, D-80939 München  
 Gezeichnetes Kapital: 2.041,6 Mio. EUR  
 Haftendes Eigenkapital: 2.287,9 Mio. EUR  
 (Stand 31.12.2019)

### Abschlussprüfer

PricewaterhouseCoopers GmbH  
 Wirtschaftsprüfungsgesellschaft  
 Bernhard-Wicki-Straße 8, D-80636 München

### Vertriebsstelle

UniCredit Bank AG  
 Arabellastraße 12, D-81925 München

<sup>1</sup> Bis 21.07.2020

<sup>2</sup> Ab 22.07.2020

<sup>3</sup> Sprecherin der Geschäftsführung

Vermittelt durch



Amundi Deutschland GmbH  
Arnulfstraße 124-126  
D-80636 München

Gebührenfreie Telefonnummer für Anfragen  
aus Deutschland: 0800.888-1928

[www.amundi.de](http://www.amundi.de)