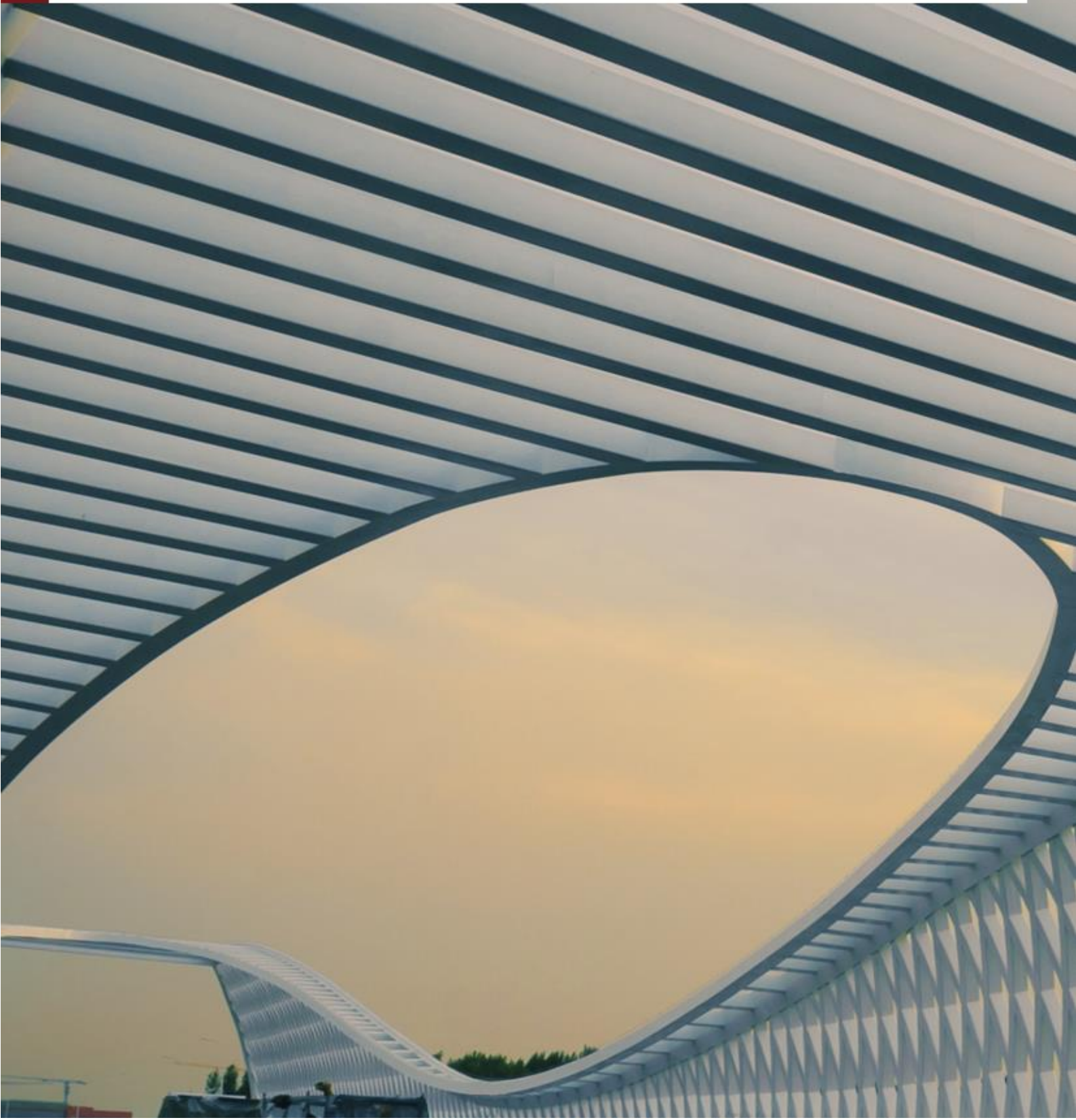


GENERALI SMART FUNDS

Ungeprüfter Halbjahresbericht
zum 30.06.2021

RCS Luxembourg N B208009



GENERALI SMART FUNDS

Für die folgenden Teilfonds ist keine Anzeige nach § 310 Kapitalanlagegesetzbuch erstattet worden und Anteile dieser Teilfonds dürfen in der Bundesrepublik Deutschland nicht vertrieben werden:

- GENERALI SMART FUNDS - GENERAtion Plus Protect I
- GENERALI SMART FUNDS - PIR Valore Italia
- GENERALI SMART FUNDS - PIR Evoluzione Italia
- GENERALI SMART FUNDS - Prisma CONSERVADOR
- GENERALI SMART FUNDS - Prisma MODERADO
- GENERALI SMART FUNDS - Prisma DECIDIDO

Unberührt bleibt eine etwaige im Rahmen des § 355 Absatz 4 Kapitalanlagegesetzbuch fortbestehende Berechtigung zu Tätigkeiten, die nach dem Investmentgesetz nicht als öffentlicher Vertrieb galten.

Inhaltsübersicht

4	Management und Verwaltung
6	Nettovermögensaufstellung zum 30.06.2021
10	Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderung des Nettovermögens vom 01.01.2021 bis 30.06.2021
14	Kennzahlen
16	Veränderungen im Anteilumlauf
	Wertpapierbestand
18	GENERATION Next Protect
19	GENERATION Plus Euro Equity
20	GENERATION Plus Protect I
21	GENERATION Plus Protect II
22	Fidelity World Fund
24	JP Morgan Global Macro Opportunities
25	Premium Flexible Bond
29	JP Morgan Global Income Conservative
30	Serenity
32	Best Managers Conservative
33	Best Selection
34	PIR Valore Italia
36	PIR Evoluzione Italia
38	Prisma CONSERVADOR
39	Prisma MODERADO
40	Prisma DECIDIDO
41	Responsible Protect 90
42	JP Morgan Global Equity Fund
44	Allgemeine Informationen
46	Zusätzliche Informationen

Wichtiger Hinweis: Die verbindliche Fassung ist die englische Version des Berichtes. Andere Sprachversionen wurden gewissenhaft und unter Verantwortung des Verwaltungsrates übersetzt. Im Falle von Abweichungen der englischen Originalversion und der Übersetzung ist die englische Originalversion maßgeblich.

Der Kauf von Anteilen eines Teilfonds erfolgt auf der Basis der wesentlichen Anlegerinformationen sowie des Verkaufsprospektes einschließlich des Verwaltungs- und Sonderreglements. Der jeweils aktuelle Verkaufsprospekt und die wesentlichen Anlegerinformationen, das Verwaltungsreglement sowie die Jahres- und Halbjahresberichte sind kostenlos in Papierform bei der deutschen Informationsstelle Generali Investments Partners S.p.A. Società di Gestione del Risparmio, Zweigniederlassung Deutschland, Tunisstraße 19-23, D-50667 Köln erhältlich. Ebenfalls kostenlos bei der deutschen Informationsstelle erhältlich ist eine Übersicht über die Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestandes.

Management and Verwaltung

Anlageverwalter

DWS International GmbH
Mainzer Landstraße 11-17
60329 Frankfurt am Main
Deutschland

FIL Pensions Management
Oakhill House, 130 Tonbridge Road
Hildenborough, Kent TN11 9DZ
Großbritannien

JPMorgan Asset Management (UK) Limited
60 Victoria Embankment
London, EC4Y 0JP
Großbritannien

Amundi Asset Management (bis 17.01.2021)
90 boulevard Pasteur
F - 75015 Paris
Frankreich

Generali Investments Partners S.p.A.
Società di Gestione del Risparmio
Via Machiavelli, 4
34132 Trieste
Italien

3 Banken-Generali Investment GmbH
Untere Donaulände 36
4020 Linz
Österreich

Unteranlagerverwalter

FIL Investments International
Oakhill House, 130 Tonbridge Road
Hildenborough, Kent TN11 9DZ
Großbritannien

J.P. Morgan Asset Management (Japan) Limited
Tokyo Building, 7-3
Marunouchi 2-chome Chiyoda-ku
Tokyo 100-6432
Japan

J.P. Morgan Investment Management Inc
383 Madison Avenue
New York, NY 10 179
Vereinigte Staaten

Verwaltungsgesellschaft

Generali Investments Luxembourg S.A.
4, rue Jean Monnet
L - 2180 Luxembourg

Eingetragener Sitz

60, avenue J.F. Kennedy
L - 1855 Luxembourg

Depotbank, Zahlstelle

BNP Paribas Securities Services, Luxembourg Branch
60, avenue J.F. Kennedy
L - 1855 Luxembourg

Zentralverwaltung, Registerstelle, Transferstelle und Domizilstelle

BNP Paribas Securities Services, Luxembourg Branch
60, avenue J.F. Kennedy
L - 1855 Luxembourg

Zahlstelle in Deutschland

BNP Paribas Securities Services S.C.A. Zweigniederlassung
Frankfurt am Main
Europa-Allee 12
D - 60327 Frankfurt am Main

Vertriebs- und Informationsstelle in Deutschland

Generali Investments Partners S.p.A.
Società di Gestione del Risparmio Zweigniederlassung
Deutschland
Tunisstraße 19-23
D - 50667 Köln

Rechtsberater

Arendt & Medernach S.A.
41 A, avenue J.F. Kennedy
L - 2082 Luxembourg

Réviseur d'entreprises agréé

KPMG Luxembourg, *Société coopérative*
39, Avenue J.F. Kennedy
L - 1855 Luxembourg

Verwaltungsrat

Vorsitzender

Mr Moritz Gribat (seit 04.03.2021)
Head of Generali Individual Savings Solutions
Assicurazioni Generali S.p.A

Mr Bruno Guiot (bis 04.03.2021)
Head of Generali Individual Savings Solutions
Assicurazioni Generali S.p.A

GENERALI SMART FUNDS

Verwaltungsratsmitglieder

Mr Mike Althaus
Legal Representative
Generali Investments Partners S.p.A.
Società di Gestione del Risparmio - Zweigniederlassung
Deutschland

Mr Pierre Bouchoms
General Manager
Generali Investments Luxembourg S.A.

Nettovermögensaufstellung zum 30.06.2021

	Konsolidiert	GENERATION Next Protect	GENERATION Plus Euro Equity	GENERATION Plus Protect I	GENERATION Plus Protect II
	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Aktiva	1.519.858.016,54	230.746.275,00	8.961.000,59	10.660.883,37	12.490.356,22
Wertpapierbestand zum Marktwert	1.465.848.847,43	211.535.756,00	8.884.716,74	10.660.883,37	12.490.356,22
<i>Einstandpreis</i>	1.358.820.340,63	204.432.156,79	7.767.577,65	12.714.990,00	15.353.107,90
<i>Nicht realisierter Gewinn / (Verlust) auf das Anlagevermögen</i>	107.028.506,80	7.103.599,21	1.117.139,09	(2.054.106,63)	(2.862.751,68)
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisentermingeschäften	3,43	-	-	-	-
Nicht realisierter Nettogewinn aus Terminkontrakten	1.365,19	-	-	-	-
Bareinlagen bei Banken und Barmittel	32.535.875,89	5.812.565,12	72.593,63	-	-
Forderungen aus Broker	18.230.622,78	13.130.408,90	-	-	-
Forderungen aus Zeichnungen	963.311,94	-	-	-	-
Forderungen aus Dividenden	106.448,84	-	-	-	-
Forderungen aus Quellensteuerrückforderungen	25.583,92	-	-	-	-
Forderungen aus Zeichnungen	2.050.576,94	267.544,98	3.690,22	-	-
Gründungskosten	95.380,18	-	-	-	-
Passiva	37.623.888,06	19.741.341,32	36.727,34	4,63	4,68
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisentermingeschäften	1.509.695,73	-	-	-	-
Nicht realisierter Nettoverlust aus Terminkontrakten	39.560,00	-	-	-	-
Nicht realisierter Nettoverlust aus Swapgeschäften	778.305,74	-	-	-	-
Bankverbindlichkeiten	4.189.387,44	4,63	-	-	-
Verbindlichkeiten aus Broker	24.487.723,40	18.822.794,91	-	-	-
Zins und Dividendenverbindlichkeiten	9.116,44	-	-	4,63	4,68
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen	2.861.145,03	417.186,27	22.710,42	-	-
Verwaltungsvergütung	3.307.560,51	413.842,28	11.601,71	-	-
Verwahrstelle und Verwaltung	223.063,69	32.505,71	1.298,27	-	-
Sonstige Verbindlichkeiten	218.330,08	55.007,52	1.116,94	-	-
Nettovermögen	1.482.234.128,48	211.004.933,68	8.924.273,25	10.660.878,74	12.490.351,54

Nettovermögensaufstellung zum 30.06.2021

	Fidelity World Fund	JP Morgan Global Macro Opportunities	Premium Flexible Bond	JP Morgan Global Income Conservative	Serenity
	USD	EUR	EUR	EUR	EUR
Aktiva	28.720.555,03	114.779.763,64	71.695.381,25	95.687.620,75	78.790.434,63
Wertpapierbestand zum Marktwert	27.450.518,12	113.469.397,84	65.754.499,48	94.608.675,03	72.774.485,92
<i>Einstandpreis</i>	21.246.077,92	99.529.363,89	65.574.892,33	84.956.820,02	70.193.670,24
<i>Nicht realisierter Gewinn / (Verlust) auf das Anlagevermögen</i>	6.204.440,20	13.940.033,95	179.607,15	9.651.855,01	2.580.815,68
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisentermingeschäften	4,07	-	-	-	-
Nicht realisierter Nettogewinn aus Terminkontrakten	-	-	1.365,19	-	-
Bareinlagen bei Banken und Barmittel	1.139.158,77	220.985,47	5.378.800,64	51.159,99	5.826.962,77
Forderungen aus Broker	70.978,38	-	-	909.542,80	-
Forderungen aus Zeichnungen	-	-	552.407,20	-	168.892,91
Forderungen aus Dividenden	16.656,59	-	-	-	-
Forderungen aus Quellensteuerrückforderungen	16.262,10	-	-	4.250,57	-
Forderungen aus Zeichnungen	26.977,00	1.084.969,10	8.308,74	113.992,36	8.858,55
Gründungskosten	-	4.411,23	-	-	11.234,48
Passiva	380.671,43	1.461.364,53	1.486.264,69	1.270.539,70	364.680,77
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisentermingeschäften	-	-	409.593,61	-	64.252,70
Nicht realisierter Nettoverlust aus Terminkontrakten	-	-	-	-	39.560,00
Nicht realisierter Nettoverlust aus Swapgeschäften	-	-	778.305,74	-	-
Bankverbindlichkeiten	0,77	-	-	778.246,65	-
Verbindlichkeiten aus Broker	88.205,42	1.111.402,00	-	15.902,16	-
Zins und Dividendenverbindlichkeiten	-	-	9.107,13	-	-
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen	193.680,53	95.412,17	87.017,26	230.387,74	94.142,89
Verwaltungsvergütung	69.052,43	235.820,72	174.917,98	222.405,97	142.189,24
Verwahrstelle und Verwaltung	4.023,24	15.854,28	10.825,87	15.641,68	12.180,47
Sonstige Verbindlichkeiten	25.709,04	2.875,36	16.497,10	7.955,50	12.355,47
Nettovermögen	28.339.883,60	113.318.399,11	70.209.116,56	94.417.081,05	78.425.753,86

Nettovermögensaufstellung zum 30.06.2021

	Best Managers Conservative	Best Selection	PIR Valore Italia	PIR Evoluzione Italia	Prisma CONSERVADOR
	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Aktiva	452.838.360,56	121.644.591,05	41.890.205,75	32.217.162,04	24.420.406,91
Wertpapierbestand zum Marktwert	451.239.273,22	119.044.248,61	40.012.857,77	29.460.587,96	22.180.593,42
<i>Einstandpreis</i>	438.764.598,92	95.775.683,41	35.665.696,44	24.597.380,97	21.558.545,69
<i>Nicht realisierter Gewinn / (Verlust) auf das Anlagevermögen</i>	12.474.674,30	23.268.565,20	4.347.161,33	4.863.206,99	622.047,73
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisentermingeschäften	-	-	-	-	-
Nicht realisierter Nettogewinn aus Terminkontrakten	-	-	-	-	-
Bareinlagen bei Banken und Barmittel	1.599.087,34	2.600.342,44	325.994,16	973.978,18	1.976.575,39
Forderungen aus Broker	-	-	1.356.893,74	1.735.044,15	-
Forderungen aus Zeichnungen	-	-	194.460,08	47.551,75	-
Forderungen aus Dividenden	-	-	-	-	-
Forderungen aus Quellensteuerrückforderungen	-	-	-	-	-
Forderungen aus Zeichnungen	-	-	-	-	263.238,10
Gründungskosten	-	-	-	-	-
Passiva	2.786.615,43	670.967,93	1.371.072,28	1.790.849,45	76.336,87
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisentermingeschäften	-	-	-	-	-
Nicht realisierter Nettoverlust aus Terminkontrakten	-	-	-	-	-
Nicht realisierter Nettoverlust aus Swapgeschäften	-	-	-	-	-
Bankverbindlichkeiten	-	-	-	-	-
Verbindlichkeiten aus Broker	-	-	1.281.810,89	1.732.800,21	-
Zins und Dividendenverbindlichkeiten	-	-	-	-	-
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen	1.387.293,19	314.144,94	22.507,67	10.836,89	12.044,91
Verwaltungsvergütung	1.262.659,75	328.938,96	56.085,25	39.252,93	59.806,85
Verwahrstelle und Verwaltung	69.859,37	17.846,97	6.282,46	4.585,44	3.541,07
Sonstige Verbindlichkeiten	66.803,12	10.037,06	4.386,01	3.373,98	944,04
Nettovermögen	450.051.745,13	120.973.623,12	40.519.133,47	30.426.312,59	24.344.070,04

Nettovermögensaufstellung zum 30.06.2021

	Prisma MODERADO	Prisma DECIDIDO	Responsible Protect 90	JP Morgan Global Equity Fund
	EUR	EUR	EUR	USD
Aktiva	17.404.319,01	7.538.210,10	20.002.444,50	182.477.088,90
Wertpapierbestand zum Marktwert	15.743.310,82	6.572.605,77	19.414.394,88	176.526.896,05
<i>Einstandpreis</i>	14.881.782,96	5.975.813,46	17.580.449,33	148.927.975,70
<i>Nicht realisierter Gewinn / (Verlust) auf das Anlagevermögen</i>	861.527,86	596.792,31	1.833.945,55	27.598.920,35
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisentermingeschäften	-	-	-	-
Nicht realisierter Nettogewinn aus Terminkontrakten	-	-	-	-
Bareinlagen bei Banken und Barmittel	1.426.323,45	923.062,30	541.444,54	4.560.277,19
Forderungen aus Broker	-	-	-	1.232.009,31
Forderungen aus Zeichnungen	-	-	-	-
Forderungen aus Dividenden	-	-	-	109.581,09
Forderungen aus Quellensteuerrückforderungen	-	-	-	9.037,12
Forderungen aus Zeichnungen	234.684,74	42.542,03	-	-
Gründungskosten	-	-	46.605,08	39.288,14
Passiva	56.771,38	27.949,25	26.569,98	7.275.294,78
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisentermingeschäften	-	-	-	1.228.413,83
Nicht realisierter Nettoverlust aus Terminkontrakten	-	-	-	-
Nicht realisierter Nettoverlust aus Swapgeschäften	-	-	-	-
Bankverbindlichkeiten	-	-	-	4.045.265,60
Verbindlichkeiten aus Broker	-	-	-	1.717.935,97
Zins und Dividendenverbindlichkeiten	-	-	-	-
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen	3.363,22	778,01	-	-
Verwaltungsvergütung	50.256,51	25.617,48	22.701,68	241.016,78
Verwahrstelle und Verwaltung	2.487,38	1.069,87	2.902,84	27.026,00
Sonstige Verbindlichkeiten	664,27	483,89	965,46	15.636,60
Nettovermögen	17.347.547,63	7.510.260,85	19.975.874,52	175.201.794,12

Ertrags-und Aufwandsrechnung und Veränderung des Nettovermögens vom 01.01.2021 bis 30.06.2021

	Konsolidiert	GENERATION Next Protect	GENERATION Plus Euro Equity	GENERATION Plus Protect I	GENERATION Plus Protect II
	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Erträge	4.553.620,58	794.767,52	168.660,53	-	-
Nettodividenden	3.035.384,04	785.168,84	168.660,53	-	-
Nettozinsen auf Renten	1.494.829,13	-	-	-	-
Banzinsen bei Sicht	16.936,40	9.598,68	-	-	-
Erträge von Wertpapierleihgeschäften	6.180,78	-	-	-	-
Sonstige Erträge aus Finanzgeschäften	290,23	-	-	-	-
Ausgaben	8.372.430,72	1.354.156,70	34.072,09	3,43	4,06
Verwaltungsvergütung	6.991.773,36	888.414,45	24.851,25	-	-
Taxe d'abonnement / Abonnementssteuer	118.042,47	15.986,21	431,66	-	-
Verwahrstelle- und Verwaltungsgebühren	296.252,95	49.003,08	1.513,11	-	-
Prüfungs- und Rechtsberatungskosten	628.841,95	385.081,56	1.947,62	-	-
Abschreibung der Gründungskosten	13.816,73	-	-	-	-
Bankzinsen	86.055,83	14.666,45	451,39	3,43	4,06
Transaktionsgebühren	78.607,21	97,47	1.941,10	-	-
Zinsen aus Swapgeschäften / Differenzgeschäfte	106.206,55	-	-	-	-
Sonstige Ausgaben	52.833,67	907,48	2.935,96	-	-
Nettoerträge/(Nettoverluste) aus Anlagen	(3.818.810,14)	(559.389,18)	134.588,44	(3,43)	(4,06)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus:					
- Verkäufen von Wertpapieren	37.589.288,18	2.578.852,62	202.329,10	-	(4.038,35)
- Optionen	8.540,00	-	-	-	-
- Devisentermingeschäften	(3.880.257,26)	-	-	-	-
- Terminkontrakten	116.340,56	-	-	-	-
- Swapgeschäften	816.175,52	-	-	-	-
- Devisen	104.587,34	(1.652,38)	16,26	-	-
Realisierter Nettogewinn/(-verlust)	30.935.864,20	2.017.811,06	336.933,80	(3,43)	(4.042,41)
Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlustes) aus :					
- Wertpapieranlagen	30.003.118,40	3.212.674,50	795.873,90	1.652,95	(172.103,17)
- Devisentermingeschäften	(2.384.368,14)	-	-	-	-
- Terminkontrakte	(23.804,81)	-	-	-	-
- Swapgeschäften	(778.305,74)	-	-	-	-
Nettovermögensabnahme / (-zunahme) durch Geschäftstätigkeit	57.752.503,91	5.230.485,56	1.132.807,70	1.649,52	(176.145,58)
Zeichnungen von Anteilen mit Thesaurierung	116.718.123,97	11.743.008,33	107.968,47	-	11.251,21
Rücknahmen von Anteilen mit Thesaurierung	(102.259.742,08)	(10.692.013,30)	(119.080,11)	-	(17.902,48)
Erhöhung/(Verminderung) des Nettovermögens	72.210.885,80	6.281.480,59	1.121.696,06	1.649,52	(182.796,85)
Neubewertung des kombinierten NIW zu Geschäftsperiodebeginn	4.617.810,17	-	-	-	-
Nettovermögen zu Beginn der Periode	1.405.405.432,51	204.723.453,09	7.802.577,19	10.659.229,22	12.673.148,39
Nettovermögen am Ende der Periode	1.482.234.128,48	211.004.933,68	8.924.273,25	10.660.878,74	12.490.351,54

Ertrags-und Aufwandsrechnung und Veränderung des Nettovermögens vom 01.01.2021 bis 30.06.2021

	Fidelity World Fund	JP Morgan Global Macro Opportunities	Premium Flexible Bond	JP Morgan Global Income Conservative	Serenity
	USD	EUR	EUR	EUR	EUR
Erträge	216.538,32	117,46	1.001.054,85	610,16	332.007,36
Nett dividenden	216.457,77	-	39.963,16	-	76.313,85
Nettozinsen auf Renten	-	-	954.751,35	-	253.568,21
Banzinsen bei Sicht	63,49	117,46	2.284,58	334,32	0,28
Erträge von Wertpapierleihgeschäften	-	-	4.055,76	-	2.125,02
Sonstige Erträge aus Finanzgeschäften	17,06	-	-	275,84	-
Ausgaben	165.514,76	535.704,42	571.426,44	516.399,46	362.184,90
Verwaltungsvergütung	135.727,86	490.850,07	380.634,73	473.766,81	307.625,79
Taxe d'abonnement / Abonnementssteuer	3.831,50	3,98	17.243,03	-	6.741,31
Verwahrstelle- und Verwaltungsgebühren	4.610,84	21.202,73	14.805,19	20.375,32	19.001,21
Prüfungs- und Rechtsberatungskosten	5.905,95	19.446,40	24.305,26	19.658,76	15.919,72
Abschreibung der Gründungskosten	-	2.479,65	-	-	2.479,67
Bankzinsen	6,09	1.162,95	20.707,69	954,97	9.636,23
Transaktionsgebühren	1.955,92	1,79	1.043,83	1,44	300,59
Zinsen aus Swapgeschäften / Differenzgeschäfte	164,14	-	106.068,14	-	-
Sonstige Ausgaben	13.312,46	556,85	6.618,57	1.642,16	480,38
Nettoerträge/(Nettoverluste) aus Anlagen	51.023,56	(535.586,96)	429.628,41	(515.789,30)	(30.177,54)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus:					
- Verkäufen von Wertpapieren	987.424,90	689.775,93	(161.912,89)	1.156.438,43	49.437,70
- Optionen	-	-	8.540,00	-	-
- Devisentermingeschäften	201,46	-	(296.906,60)	-	(314.667,90)
- Terminkontrakten	-	-	(24.369,44)	-	140.710,00
- Swapgeschäften	-	-	816.175,52	-	-
- Devisen	(1.187,64)	-	(26.250,90)	1.601,80	143.499,84
Realisierter Nettogewinn/(-verlust)	1.037.462,28	154.188,97	744.904,10	642.250,93	(11.197,90)
Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlustes) aus :					
- Wertpapieranlagen	1.108.524,87	3.702.251,97	190.047,77	1.529.303,63	1.160.086,81
- Devisentermingeschäften	4,07	-	(483.291,69)	-	(87.138,61)
- Terminkontrakte	-	-	1.365,19	-	(25.170,00)
- Swapgeschäften	-	-	(778.305,74)	-	-
Nettovermögensabnahme / (-zunahme) durch Geschäftstätigkeit	2.145.991,22	3.856.440,94	(325.280,37)	2.171.554,56	1.036.580,30
Zeichnungen von Anteilen mit Thesaurierung	10.497.957,36	27.073.345,96	5.457.359,72	8.603.698,06	1.203.262,62
Rücknahmen von Anteilen mit Thesaurierung	(7.193.657,85)	(12.478.224,73)	(2.827.968,28)	(16.685.867,53)	(1.472.063,74)
Erhöhung/(Verminderung) des Nettovermögens	5.450.290,73	18.451.562,17	2.304.111,07	(5.910.614,91)	767.779,18
Neubewertung des kombinierten NIW zu Geschäftsperiodebeginn	-	-	-	-	-
Nettovermögen zu Beginn der Periode	22.889.592,87	94.866.836,94	67.905.005,49	100.327.695,96	77.657.974,68
Nettovermögen am Ende der Periode	28.339.883,60	113.318.399,11	70.209.116,56	94.417.081,05	78.425.753,86

Ertrags-und Aufwandsrechnung und Veränderung des Nettovermögens vom 01.01.2021 bis 30.06.2021

	Best Managers Conservative	Best Selection	PIR Valore Italia	PIR Evoluzione Italia	Prisma CONSERVADOR
	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Erträge	0,36	0,17	474.042,14	433.089,49	16.104,19
Nett dividenden	-	-	257.604,37	363.016,39	16.030,76
Nettozinsen auf Renten	-	-	216.436,49	70.073,08	-
Banzinsen bei Sicht	0,36	0,17	1,28	0,02	73,43
Erträge von Wertpapierleihgeschäften	-	-	-	-	-
Sonstige Erträge aus Finanzgeschäften	-	-	-	-	-
Ausgaben	2.901.538,02	734.394,82	148.160,46	104.977,30	137.185,86
Verwaltungsvergütung	2.660.809,33	678.638,80	124.812,87	86.717,23	123.657,29
Taxe d'abonnement / Abonnementssteuer	56.150,53	6.046,77	2.026,16	1.499,47	378,72
Verwahrstelle- und Verwaltungsgebühren	82.002,21	20.785,36	7.380,18	5.368,80	4.065,04
Prüfungs- und Rechtsberatungskosten	83.160,43	21.141,82	7.896,79	5.838,72	4.373,92
Abschreibung der Gründungskosten	-	-	-	-	-
Bankzinsen	13.276,71	3.829,65	923,10	867,73	3.599,10
Transaktionsgebühren	80,00	-	3.843,57	3.476,16	989,87
Zinsen aus Swapgeschäften / Differenzgeschäfte	-	-	-	-	-
Sonstige Ausgaben	6.058,81	3.952,42	1.277,79	1.209,19	121,92
Nettoerträge/(Nettoverluste) aus Anlagen	(2.901.537,66)	(734.394,65)	325.881,68	328.112,19	(121.081,67)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus:					
- Verkäufen von Wertpapieren	14.846.213,85	3.909.019,84	(77.523,86)	(29.632,29)	229.457,91
- Optionen	-	-	-	-	-
- Devisentermingeschäften	-	-	-	-	-
- Terminkontrakten	-	-	-	-	-
- Swapgeschäften	-	-	-	-	-
- Devisen	0,71	7.605,22	2.204,63	476,76	-
Realisierter Nettogewinn/(-verlust)	11.944.676,90	3.182.230,41	250.562,45	298.956,66	108.376,24
Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlustes) aus :					
- Wertpapieranlagen	(1.294.704,42)	5.506.412,74	3.065.977,40	4.218.248,82	(119.073,81)
- Devisentermingeschäften	-	-	-	-	-
- Terminkontrakte	-	-	-	-	-
- Swapgeschäften	-	-	-	-	-
Nettovermögensabnahme / (-zunahme) durch Geschäftstätigkeit	10.649.972,48	8.688.643,15	3.316.539,85	4.517.205,48	(10.697,57)
Zeichnungen von Anteilen mit Thesaurierung	2.084.846,16	4.454.096,02	583.028,00	308.986,23	5.371.961,70
Rücknahmen von Anteilen mit Thesaurierung	(8.053.287,14)	(1.823.698,29)	(3.300.905,21)	(2.994.959,73)	(2.143.072,36)
Erhöhung/(Verminderung) des Nettovermögens	4.681.531,50	11.319.040,88	598.662,64	1.831.231,98	3.218.191,77
Neubewertung des kombinierten NIW zu Geschäftsperiodebeginn	-	-	-	-	-
Nettovermögen zu Beginn der Periode	445.370.213,63	109.654.582,24	39.920.470,83	28.595.080,61	21.125.878,27
Nettovermögen am Ende der Periode	450.051.745,13	120.973.623,12	40.519.133,47	30.426.312,59	24.344.070,04

Ertrags-und Aufwandsrechnung und Veränderung des Nettovermögens vom 01.01.2021 bis 30.06.2021

	Prisma MODERADO	Prisma DECIDIDO	Responsible Protect 90	JP Morgan Global Equity Fund
	EUR	EUR	EUR	USD
Erträge	8.905,68	2.389,47	9.463,35	1.339.846,14
Nett dividenden	8.813,55	2.389,42	9.463,33	1.334.651,80
Nettozinsen auf Renten	-	-	-	-
Banzinsen bei Sicht	92,13	0,05	0,02	5.194,34
Erträge von Wertpapierleihgeschäften	-	-	-	-
Sonstige Erträge aus Finanzgeschäften	-	-	-	-
Ausgaben	112.131,98	55.855,37	76.841,74	697.101,41
Verwaltungsvergütung	102.654,76	50.945,92	49.072,21	514.527,02
Taxe d'abonnement / Abonnementssteuer	280,62	131,89	775,99	8.437,98
Verwahrstelle- und Verwaltungsgebühren	2.847,66	1.226,96	8.226,63	40.986,39
Prüfungs- und Rechtsberatungskosten	3.189,59	1.574,98	5.001,45	30.032,67
Abschreibung der Gründungskosten	-	-	5.114,77	4.438,40
Bankzinsen	2.473,86	1.709,70	4.989,18	8.057,59
Transaktionsgebühren	601,35	230,08	3.269,77	72.435,81
Zinsen aus Swapgeschäften / Differenzgeschäfte	-	-	-	-
Sonstige Ausgaben	84,14	35,84	391,74	18.185,55
Nettoerträge/(Nettoverluste) aus Anlagen	(103.226,30)	(53.465,90)	(67.378,39)	642.744,73
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus:				
- Verkäufen von Wertpapieren	186.008,97	59.070,64	276.013,56	15.235.422,67
- Optionen	-	-	-	-
- Devisentermingeschäften	-	-	-	(3.876.532,34)
- Terminkontrakten	-	-	-	-
- Swapgeschäften	-	-	-	-
- Devisen	0,02	-	-	(25.986,81)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust)	82.782,69	5.604,74	208.635,17	11.975.648,25
Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlustes) aus :				
- Wertpapieranlagen	306.064,44	311.954,82	882.583,95	6.843.961,73
- Devisentermingeschäften	-	-	-	(2.151.152,96)
- Terminkontrakte	-	-	-	-
- Swapgeschäften	-	-	-	-
Nettovermögensabnahme/(-zunahme) durch Geschäftstätigkeit	388.847,13	317.559,56	1.091.219,12	16.668.457,02
Zeichnungen von Anteilen mit Thesaurierung	3.685.560,80	1.559.039,75	1.571.087,61	40.376.705,95
Rücknahmen von Anteilen mit Thesaurierung	(1.733.306,55)	(626.640,44)	(91.145,39)	(36.921.355,86)
Erhöhung/(Verminderung) des Nettovermögens	2.341.101,38	1.249.958,87	2.571.161,34	20.123.807,11
Neubewertung des kombinierten NIW zu Geschäftsperiodebeginn	-	-	-	-
Nettovermögen zu Beginn der Periode	15.006.446,25	6.260.301,98	17.404.713,18	155.077.987,01
Nettovermögen am Ende der Periode	17.347.547,63	7.510.260,85	19.975.874,52	175.201.794,12

Kennzahlen

	Währung	30.06.2021	31.12.2020	31.12.2019
GENERATION Next				
Gesamtvermögen	EUR	0,00	0,00	6.513.409,27
Nettoinventarwert je Anteil				
Klasse A Thesaurierende Anteile	EUR	0,00	0,00	104,77
Klasse D Thesaurierende Anteile	EUR	0,00	0,00	102,79
Klasse F Thesaurierende Anteile	EUR	0,00	0,00	0,00
Klasse I Thesaurierende Anteile	EUR	0,00	0,00	104,51
GENERATION Next Protect				
Gesamtvermögen	EUR	211.004.933,68	204.723.453,09	191.269.120,63
Nettoinventarwert je Anteil				
Klasse A Thesaurierende Anteile	EUR	99,54	96,87	101,52
Klasse D Thesaurierende Anteile	EUR	96,99	94,68	99,84
Klasse F Thesaurierende Anteile	EUR	93,12	90,90	95,84
Klasse I Thesaurierende Anteile	EUR	99,02	96,36	100,98
GENERATION Plus Euro Equity				
Gesamtvermögen	EUR	8.924.273,25	7.802.577,19	8.487.301,56
Nettoinventarwert je Anteil				
Klasse A Thesaurierende Anteile	EUR	117,54	102,64	100,70
Klasse D Thesaurierende Anteile	EUR	120,83	105,90	104,68
Klasse G Thesaurierende Anteile	EUR	123,61	108,10	106,38
Klasse I Thesaurierende Anteile	EUR	123,21	107,46	105,39
GENERATION Plus Protect I				
Gesamtvermögen	EUR	10.660.878,74	10.659.229,22	11.637.774,63
Nettoinventarwert je Anteil				
Klasse A Thesaurierende Anteile	EUR	83,85	83,83	91,53
GENERATION Plus Protect II				
Gesamtvermögen	EUR	12.490.351,54	12.673.148,39	13.881.320,31
Nettoinventarwert je Anteil				
Klasse D Thesaurierende Anteile	EUR	81,13	82,28	90,18
Fidelity World Fund				
Gesamtvermögen	USD	28.339.883,60	22.889.592,87	166.519.461,06
Nettoinventarwert je Anteil				
Klasse A Thesaurierende Anteile	EUR	148,38	131,72	118,29
Klasse D Thesaurierende Anteile	EUR	155,73	138,82	125,74
Klasse F Thesaurierende Anteile	EUR	140,88	126,08	115,10
Klasse G Thesaurierende Anteile	EUR	118,37	105,28	0,00
Klasse I Thesaurierende Anteile	EUR	156,94	139,31	125,09
JP Morgan Global Macro Opportunities				
Gesamtvermögen	EUR	113.318.399,11	94.866.836,94	34.361.234,61
Nettoinventarwert je Anteil				
Klasse A Thesaurierende Anteile	EUR	125,36	120,54	107,55
Klasse D Thesaurierende Anteile	EUR	118,27	114,40	103,30
Klasse F Thesaurierende Anteile	EUR	118,23	114,36	103,27
Klasse G Thesaurierende Anteile	EUR	113,35	109,26	97,98
Klasse I Thesaurierende Anteile	EUR	117,38	112,93	100,86
Premium Flexible Bond				
Gesamtvermögen	EUR	70.209.116,56	67.905.005,49	99.464.370,82
Nettoinventarwert je Anteil				
Klasse A Thesaurierende Anteile	EUR	108,20	108,42	105,83
Klasse D Thesaurierende Anteile	EUR	102,17	102,68	101,47
Klasse F Thesaurierende Anteile	EUR	102,17	102,68	101,47
Klasse G Thesaurierende Anteile	EUR	100,69	101,09	99,08
Klasse I Thesaurierende Anteile	EUR	100,63	100,84	98,82

GENERALI SMART FUNDS

	Währung	30.06.2021	31.12.2020	31.12.2019
JP Morgan Global Income Conservative				
Gesamtvermögen	EUR	94.417.081,05	100.327.695,96	44.754.171,33
Nettoinventarwert je Anteil				
Klasse A Thesaurierende Anteile	EUR	109,91	107,50	103,20
Klasse D Thesaurierende Anteile	EUR	105,06	103,23	99,99
Klasse F Thesaurierende Anteile	EUR	105,07	103,24	100,00
Klasse G Thesaurierende Anteile	EUR	109,22	107,05	103,18
Klasse I Thesaurierende Anteile	EUR	106,86	104,54	0,00
Serenity				
Gesamtvermögen	EUR	78.425.753,86	77.657.974,68	75.136.456,30
Nettoinventarwert je Anteil				
Klasse A Thesaurierende Anteile	EUR	105,87	104,36	102,50
Klasse D Thesaurierende Anteile	EUR	101,72	100,68	99,72
Klasse E Thesaurierende Anteile	EUR	105,26	103,96	102,50
Klasse F Thesaurierende Anteile	EUR	101,73	100,70	99,73
Klasse G Thesaurierende Anteile	EUR	103,43	102,11	100,59
Klasse I Thesaurierende Anteile	EUR	101,82	100,35	0,00
Best Managers Conservative				
Gesamtvermögen	EUR	450.051.745,13	445.370.213,63	469.763.673,41
Nettoinventarwert je Anteil				
Klasse A Thesaurierende Anteile	EUR	106,11	103,35	102,90
Klasse E Thesaurierende Anteile	EUR	102,04	99,64	99,71
Best Selection				
Gesamtvermögen	EUR	120.973.623,12	109.654.582,24	96.784.232,32
Nettoinventarwert je Anteil				
Klasse A Thesaurierende Anteile	EUR	127,52	117,98	111,74
Klasse E Thesaurierende Anteile	EUR	173,57	160,99	153,25
PIR Valore Italia				
Gesamtvermögen	EUR	40.519.133,47	39.920.470,83	40.200.451,72
Nettoinventarwert je Anteil				
Klasse I Thesaurierende Anteile	EUR	113,83	104,86	0,00
Klasse Z Thesaurierende Anteile	EUR	115,38	105,98	106,30
PIR Evoluzione Italia				
Gesamtvermögen	EUR	30.426.312,59	28.595.080,61	33.258.825,21
Nettoinventarwert je Anteil				
Klasse I Thesaurierende Anteile	EUR	121,65	104,37	0,00
Klasse Z Thesaurierende Anteile	EUR	122,53	104,81	108,79
Prisma CONSERVADOR				
Gesamtvermögen	EUR	24.344.070,04	21.125.878,27	11.750.721,76
Nettoinventarwert je Anteil				
Klasse I Thesaurierende Anteile	EUR	105,94	106,01	107,00
Prisma MODERADO				
Gesamtvermögen	EUR	17.347.547,63	15.006.446,25	8.706.515,87
Nettoinventarwert je Anteil				
Klasse I Thesaurierende Anteile	EUR	104,38	101,86	108,54
Prisma DECIDIDO				
Gesamtvermögen	EUR	7.510.260,85	6.260.301,98	4.456.196,77
Nettoinventarwert je Anteil				
Klasse I Thesaurierende Anteile	EUR	100,65	96,10	110,26
Responsible Protect 90				
Gesamtvermögen	EUR	19.975.874,52	17.404.713,18	0.00
Net Asset Value per				
Klasse A Thesaurierende Anteile	EUR	114,00	107,48	0.00
Klasse D Thesaurierende Anteile	EUR	112,46	106,37	0.00
JP Morgan Global Equity Fund				
Gesamtvermögen	USD	175.201.794,12	155.077.987,01	0.00
Net Asset Value per				
Klasse IH EUR Thesaurierende Anteile	EUR	134,18	117,83	0.00

Veränderungen im Anteilumlauf

	Anteile im Umlauf am 01.01.2021	Ausgegebene Anteile	Zurückgenommene Anteile	Anteile im Umlauf am 30.06.2021
GENERATION Next Protect				
Klasse A Thesaurierende Anteile	100,000	0,000	0,000	100,000
Klasse D Thesaurierende Anteile	100,000	0,000	0,000	100,000
Klasse F Thesaurierende Anteile	1.505.931,363	43.856,005	40.700,778	1.509.086,590
Klasse I Thesaurierende Anteile	703.792,752	79.169,053	71.330,228	711.631,577
GENERATION Plus Euro Equity				
Klasse A Thesaurierende Anteile	75.000,000	0,000	0,000	75.000,000
Klasse D Thesaurierende Anteile	100,000	0,000	0,000	100,000
Klasse G Thesaurierende Anteile	519,000	0,000	1,000	518,000
Klasse I Thesaurierende Anteile	353,022	952,790	1.040,290	265,522
GENERATION Plus Protect I				
Klasse A Thesaurierende Anteile	127.149,900	0,000	0,000	127.149,900
GENERATION Plus Protect II				
Klasse D Thesaurierende Anteile	154.032,148	137,000	220,000	153.949,148
Fidelity World Fund				
Klasse A Thesaurierende Anteile	49.629,000	15.250,000	0,000	64.879,000
Klasse D Thesaurierende Anteile	34.090,506	9.365,000	2.090,000	41.365,506
Klasse F Thesaurierende Anteile	26.160,000	9.364,000	2.122,000	33.402,000
Klasse G Thesaurierende Anteile	197,000	0,000	0,000	197,000
Klasse I Thesaurierende Anteile	29.567,869	26.430,988	36.245,878	19.752,979
JP Morgan Global Macro Opportunities				
Klasse A Thesaurierende Anteile	200.000,000	0,000	0,000	200.000,000
Klasse D Thesaurierende Anteile	25.016,167	827,000	155,000	25.688,167
Klasse F Thesaurierende Anteile	50.537,000	10.442,000	5.514,000	55.465,000
Klasse G Thesaurierende Anteile	1.522,000	0,000	0,000	1.522,000
Klasse I Thesaurierende Anteile	548.605,991	221.848,590	101.895,814	668.558,767
Premium Flexible Bond				
Klasse A Thesaurierende Anteile	2.556,000	950,000	1.581,000	1.925,000
Klasse D Thesaurierende Anteile	79.917,248	260,000	3.588,000	76.589,248
Klasse F Thesaurierende Anteile	573.541,000	49.840,000	19.042,000	604.339,000
Klasse G Thesaurierende Anteile	3.278,834	7,000	125,000	3.160,834
Klasse I Thesaurierende Anteile	2.006,614	2.531,247	3.426,452	1.111,409
JP Morgan Global Income Conservative				
Klasse A Thesaurierende Anteile	308.260,000	9.424,000	0,000	317.684,000
Klasse D Thesaurierende Anteile	67.913,515	159,000	1.634,000	66.438,515
Klasse F Thesaurierende Anteile	85.550,000	6.453,000	3.120,000	88.883,000
Klasse G Thesaurierende Anteile	100,000	0,000	0,000	100,000
Klasse I Thesaurierende Anteile	491.060,258	65.922,896	152.993,814	403.989,340
Serenity				
Klasse A Thesaurierende Anteile	516.987,060	0,000	0,000	516.987,060
Klasse D Thesaurierende Anteile	94.502,480	5.449,528	4.979,000	94.973,008
Klasse E Thesaurierende Anteile	4.690,000	13,000	1,000	4.702,000
Klasse F Thesaurierende Anteile	111.619,000	4.878,000	2.773,000	113.724,000
Klasse G Thesaurierende Anteile	18.255,000	0,000	5,000	18.250,000
Klasse I Thesaurierende Anteile	5.974,375	1.601,731	6.797,268	778,838
Best Managers Conservative				
Klasse A Thesaurierende Anteile	2.398,000	0,000	935,000	1.463,000
Klasse E Thesaurierende Anteile	4.467.438,793	20.741,483	79.019,526	4.409.160,750
Best Selection				
Klasse A Thesaurierende Anteile	4.137,000	0,000	0,000	4.137,000
Klasse E Thesaurierende Anteile	678.113,209	26.800,452	10.968,775	693.944,886
PIR Valore Italia				
Klasse I Thesaurierende Anteile	335.215,069	5.377,138	30.247,972	310.344,235
Klasse Z Thesaurierende Anteile	45.000,000	0,000	0,000	45.000,000

GENERALI SMART FUNDS

	Anteile im Umlauf am 01.01.2021	Ausgegebene Anteile	Zurückgenommene Anteile	Anteile im Umlauf am 30.06.2021
PIR Evoluzione Italia				
Klasse I Thesaurierende Anteile	228.791,154	2.777,513	26.784,000	204.784,667
Klasse Z Thesaurierende Anteile	45.000,000	0,000	0,000	45.000,000
Prisma CONSERVADOR				
Klasse I Thesaurierende Anteile	199.285,800	50.774,614	20.264,531	229.795,883
Prisma MODERADO				
Klasse I Thesaurierende Anteile	147.321,552	35.692,250	16.822,717	166.191,085
Prisma DECIDIDO				
Klasse I Thesaurierende Anteile	65.146,721	15.825,436	6.356,247	74.615,910
Responsible Protect 90				
Klasse A Thesaurierende Anteile	158.460,403	2.025,000	0,000	160.485,403
Klasse D Thesaurierende Anteile	3.505,000	12.263,000	819,000	14.949,000
JP Morgan Global Equity Fund				
Klasse IH EUR Thesaurierende Anteile	1.075.618,929	266.182,254	240.798,068	1.101.003,115

Wertpapierbestand

GENERATION Next Protect

Wertpapierbestand zum 30.06.2021

Bezeichnung	Währung	Anzahl	Marktwert in EUR	% des Nettovermögen
Aktien/Anteile aus OGAW/OGA				
Aktien/Anteile aus Investmentfonds				
Luxemburg				
AMUNDI MONEY MARKET FD SHORT TERM EUR IV C	EUR	11.408,00	11.287.347,99	5,35
BNP PARIBAS INSTICASH EUR 1D SHORT TERM VNAV I C	EUR	82.280,07	11.326.378,65	5,37
DWS ESG EURO MONEY MARKET FD D	EUR	109.691,00	10.971.293,82	5,20
X EUR CORPORATE BOND 1 C	EUR	67.652,00	11.023.216,88	5,22
X EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND 1 C	EUR	99.876,00	2.115.773,18	1,00
X EUR OVERNIGHT RATE SWAP 1 C	EUR	18.734,00	2.539.112,69	1,20
X EUROZONE GOVERNMENT BOND 1 C	EUR	44.108,00	11.047.730,76	5,24
X EUROZONE GOVERNMENT BOND 3-5 1 C	EUR	20.242,00	4.235.840,92	2,01
X MSCI EUROPE INDEX 1 C	EUR	207.226,00	14.930.633,30	7,08
X MSCI WORLD SWAP 4C - EUR HEDGED C	EUR	425.634,00	13.513.879,50	6,40
X NIKKEI 225 1 D	EUR	265.031,00	5.971.148,43	2,83
X S&P 500 SWAP 1 C	EUR	175.943,00	12.077.783,18	5,72
X US TREASURIES UCITS 2D - EUR HEDGED D	EUR	47.105,00	5.522.590,20	2,62
X USD EMERGING MARKETS BOND 1C - EUR H C	EUR	8.857,00	2.973.914,89	1,41
X USD EMERGING MARKETS BOND ETF 2 D	EUR	239.194,00	2.988.011,45	1,42
			122.524.655,84	58,07
Irland				
DEUTSCHE MANAGED EURO FD PLATINUM ACCUMULATE C	EUR	1.159,05	11.322.985,45	5,37
GOLDMAN SACHS EURO LIQUID RESERVES FD I C	EUR	919,00	11.107.723,25	5,26
STATE STREET EUR LIQUIDITY LVNAV FD INSTIT ACC	EUR	11.467,79	11.314.745,46	5,36
X IBOXX EUR CORP BOND Y UCITS 1 D	EUR	632.723,00	10.577.546,75	5,01
X MSCI EMERGING MARKETS 1 C	EUR	188.208,00	10.549.058,40	5,00
X MSCI USA 1 C	EUR	116.990,00	12.074.537,90	5,72
X S&P 500 EUR HEDGED	EUR	211.957,00	13.556.345,81	6,42
X USD CORPORATE BOND 1 D	EUR	124.194,00	1.705.183,62	0,81
X USD CORPORATE BOND 2 D - EUR HEDGED	EUR	319.503,00	4.679.121,44	2,22
X USD HIGH YIELD CORP BOND 1 D	EUR	168.553,00	2.123.852,08	1,01
			89.011.100,16	42,18
Summe Aktien/Anteile aus Investmentfonds			211.535.756,00	100,25
Summe Aktien/Anteile aus OGAW/OGA			211.535.756,00	100,25
Gesamtwertpapierbestand			211.535.756,00	100,25

GENERATION Plus Euro Equity

Wertpapierbestand zum 30.06.2021

Bezeichnung	Währung	Anzahl	Marktwert in EUR	% des Nettovermögen
An einer amtlichen Wertpapierbörse notierte übertragbare Wertpapiere				
Aktien				
Deutschland				
BAYER AG-REG	EUR	5.093,00	260.812,53	2,92
BEIERSDORF AG	EUR	3.011,00	306.369,25	3,43
BRENTAG AG	EUR	3.846,00	301.603,32	3,38
DEUTSCHE POST AG-REG	EUR	5.689,00	326.321,04	3,66
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	EUR	4.349,00	304.603,96	3,41
FRESENIUS SE & CO KGAA	EUR	6.471,00	284.691,65	3,19
HEIDELBERGCEMENT AG	EUR	3.880,00	280.679,20	3,15
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	EUR	3.038,00	270.503,52	3,03
MERCK KGAA	EUR	2.070,00	334.719,00	3,76
SAP SE	EUR	2.548,00	302.804,32	3,39
			2.973.107,79	33,32
Frankreich				
CAPGEMINI SE	EUR	1.886,00	305.532,00	3,42
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	EUR	5.295,00	294.084,30	3,30
DANONE	EUR	5.001,00	296.909,37	3,33
ENGIE SA	EUR	22.910,00	264.702,14	2,97
KERING	EUR	411,00	302.907,00	3,39
SANOFI	EUR	3.351,00	296.094,36	3,31
			1.760.229,17	19,72
Niederlande				
AKZO NOBEL NV	EUR	2.834,00	295.302,80	3,31
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	EUR	12.162,00	304.901,34	3,42
KONINKLIJKE KPN NV	EUR	103.775,00	273.343,35	3,06
QIAGEN NV	EUR	7.555,00	307.941,80	3,45
			1.181.489,29	13,24
Finnland				
FORTUM OYJ	EUR	12.758,00	296.751,08	3,32
NOKIA OYJ	EUR	71.277,00	321.851,29	3,61
			618.602,37	6,93
Belgien				
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	EUR	4.668,00	283.861,08	3,18
UCB SA	EUR	3.676,00	324.076,16	3,63
			607.937,24	6,81
Irland				
CRH PLC	EUR	6.946,00	295.205,00	3,31
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	EUR	6.653,00	304.374,75	3,41
			599.579,75	6,72
Spanien				
GRIFOLS SA	EUR	12.147,00	277.437,48	3,11
IBERDROLA SA	EUR	25.776,00	264.977,28	2,97
			542.414,76	6,08
Schweiz				
STMICROELECTRONICS NV	EUR	9.988,00	305.682,74	3,43
			305.682,74	3,43
Italien				
SNAM SPA	EUR	60.651,00	295.673,63	3,31
			295.673,63	3,31
Summe Aktien			8.884.716,74	99,56
Summe an einer amtlichen Wertpapierbörse notierte übertragbare Wertpapiere			8.884.716,74	99,56
Gesamtwertpapierbestand			8.884.716,74	99,56

GENERATION Plus Protect I

Wertpapierbestand zum 30.06.2021

Bezeichnung	Währung	Anzahl	Marktwert in EUR	% des Nettovermögen
Aktien/Anteile aus OGAW/OGA				
Aktien/Anteile aus Investmentfonds				
Irland				
GENERALI 80% PROTECTED FUND A-A EUR	EUR	127.149,90	10.660.883,37	100,00
			10.660.883,37	100,00
Summe Aktien/Anteile aus Investmentfonds			10.660.883,37	100,00
Summe Aktien/Anteile aus OGAW/OGA			10.660.883,37	100,00
Gesamtwertpapierbestand			10.660.883,37	100,00

GENERATION Plus Protect II

Wertpapierbestand zum 30.06.2021

Bezeichnung	Währung	Anzahl	Marktwert in EUR	% des Nettovermögen
Aktien/Anteile aus OGAW/OGA				
Aktien/Anteile aus Investmentfonds				
Irland				
GENERALI 80% PROTECTED FUND D-A EUR	EUR	153.949,15	12.490.356,22	100,00
			12.490.356,22	100,00
Summe Aktien/Anteile aus Investmentfonds			12.490.356,22	100,00
Summe Aktien/Anteile aus OGAW/OGA			12.490.356,22	100,00
Gesamtwertpapierbestand			12.490.356,22	100,00

Fidelity World Fund

Wertpapierbestand zum 30.06.2021

Bezeichnung	Währung	Anzahl	Marktwert in USD	% des Nettovermögen
An einer amtlichen Wertpapierbörse notierte übertragbare Wertpapiere				
Aktien				
Vereinigte Staaten				
ADOBE INC	USD	320,00	187.404,80	0,66
ALPHABET INC-CL A	USD	395,00	964.507,05	3,40
ALTICE USA INC- A	USD	6.200,00	211.668,00	0,75
AMAZON.COM INC	USD	215,00	739.634,40	2,61
AMERISOURCEBERGEN CORP	USD	3.500,00	400.715,00	1,41
APPLE INC	USD	6.000,00	821.760,00	2,90
ARRAY TECHNOLOGIES INC	USD	4.000,00	62.400,00	0,22
BAXTER INTERNATIONAL INC	USD	2.100,00	169.050,00	0,60
BOOKING HOLDINGS INC	USD	60,00	131.285,40	0,46
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	USD	6.300,00	420.966,00	1,49
CENTENE CORP	USD	4.500,00	328.185,00	1,16
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	USD	540,00	389.583,00	1,37
CIENA CORP	USD	4.100,00	233.249,00	0,82
CIGNA CORP	USD	1.100,00	260.777,00	0,92
CITIGROUP INC	USD	2.800,00	198.100,00	0,70
CONCENTRIX CORP	USD	528,00	84.902,40	0,30
COOPER COS INC/THE	USD	590,00	233.799,30	0,82
DARLING INGREDIENTS INC	USD	2.100,00	141.750,00	0,50
DELL TECHNOLOGIES -C	USD	2.800,00	279.076,00	0,98
DOLLAR TREE INC	USD	2.900,00	288.550,00	1,02
DOXIMITY INC-CLASS A	USD	193,00	11.232,60	0,04
EBAY INC	USD	5.800,00	407.218,00	1,44
EQUITABLE HOLDINGS INC	USD	6.000,00	182.700,00	0,64
EXELON CORP	USD	6.700,00	296.877,00	1,05
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	USD	2.400,00	340.008,00	1,20
FLEX LTD	USD	7.400,00	132.238,00	0,47
GLOBAL PAYMENTS INC	USD	1.700,00	318.818,00	1,12
HCA HEALTHCARE INC	USD	2.300,00	475.502,00	1,68
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	USD	3.400,00	403.580,00	1,42
IQVIA HOLDINGS INC	USD	700,00	169.624,00	0,60
JPMORGAN CHASE & CO	USD	2.900,00	451.066,00	1,59
LOWES COS INC	USD	800,00	155.176,00	0,55
MARATHON PETROLEUM CORP	USD	3.700,00	223.554,00	0,79
MICRON TECHNOLOGY INC	USD	4.100,00	348.418,00	1,23
MICROSOFT CORP	USD	3.700,00	1.002.330,00	3,55
MORGAN STANLEY	USD	4.400,00	403.436,00	1,42
NORFOLK SOUTHERN CORP	USD	1.350,00	358.303,50	1,26
NVR INC	USD	55,00	273.531,50	0,97
PAYPAL HOLDINGS INC	USD	950,00	276.906,00	0,98
PTC INC	USD	1.600,00	226.016,00	0,80
PVH CORP	USD	1.550,00	166.764,50	0,59
REGENERON PHARMACEUTICALS	USD	440,00	245.757,60	0,87
S&P GLOBAL INC	USD	760,00	311.942,00	1,10
TERADYNE INC	USD	1.800,00	241.128,00	0,85
T-MOBILE US INC	USD	2.400,00	347.592,00	1,23
UBER TECHNOLOGIES INC	USD	4.400,00	220.528,00	0,78
UNITEDHEALTH GROUP INC	USD	1.020,00	408.448,80	1,44
VISA INC-CLASS A SHARES	USD	1.500,00	350.730,00	1,24
VOYA FINANCIAL INC	USD	4.000,00	246.000,00	0,87
WESTERN DIGITAL CORP	USD	3.500,00	249.095,00	0,88
WW GRAINGER INC	USD	650,00	284.700,00	1,00
			16.076.582,85	56,74
Japan				
FUJITSU LTD	JPY	1.900,00	356.068,09	1,26
KUBOTA CORP	JPY	12.000,00	242.940,79	0,86
MURATA MANUFACTURING CO LTD	JPY	3.600,00	275.116,66	0,97
ORIX CORP	JPY	9.600,00	162.133,51	0,57
SANTEN PHARMACEUTICAL CO LTD	JPY	6.600,00	90.981,16	0,32
SOMPO HOLDINGS INC	JPY	3.500,00	129.480,12	0,46
SONY CORP	JPY	4.000,00	389.764,82	1,38
TDK CORP	JPY	3.000,00	364.627,42	1,29
THK CO LTD	JPY	4.000,00	119.470,21	0,42
TOYOTA INDUSTRIES CORP	JPY	2.100,00	181.827,18	0,64
Z HOLDINGS CORP	JPY	38.000,00	190.633,38	0,66
			2.503.043,34	8,83
Großbritannien				
ASTRAZENECA PLC	GBP	1.950,00	233.903,91	0,83
AVIVA PLC	GBP	51.000,00	285.971,20	1,01
M&G PLC	GBP	45.000,00	142.295,57	0,50
MEGGITT PLC	GBP	24.000,00	152.909,20	0,54
PEARSON PLC	GBP	15.000,00	171.989,69	0,61
PRUDENTIAL PLC	GBP	12.000,00	227.689,48	0,80
TESCO PLC	GBP	53.684,00	165.342,85	0,58
VODAFONE GROUP PLC	GBP	175.000,00	293.342,58	1,04
WILLIS TOWERS WATSON PLC	USD	670,00	154.113,40	0,54
			1.827.557,88	6,45
Deutschland				
DEUTSCHE BOERSE AG	EUR	2.000,00	349.128,96	1,23

GENERALI SMART FUNDS

Wertpapierbestand zum 30.06.2021

Bezeichnung	Währung	Anzahl	Marktwert in USD	% des Nettovermögens
E.ON SE	EUR	29.000,00	335.450,79	1,18
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	EUR	900,00	96.442,13	0,34
RWE AG	EUR	5.300,00	192.077,85	0,68
SIEMENS AG-REG	EUR	1.600,00	253.535,93	0,89
SIEMENS ENERGY AG	EUR	4.000,00	120.582,31	0,43
VOLKSWAGEN AG-PREF	EUR	800,00	200.369,66	0,71
VONOVIA SE	EUR	4.000,00	258.621,07	0,91
			1.806.208,70	6,37
Niederlande				
ABN AMRO BANK NV-CVA	EUR	14.000,00	169.213,70	0,60
ASML HOLDING NV	EUR	640,00	439.750,69	1,55
JDE PEETS BV	EUR	3.200,00	116.123,33	0,41
KONINKLIJKE PHILIPS NV	EUR	5.703,00	282.633,61	1,00
NN GROUP NV	EUR	4.970,00	234.460,26	0,83
NXP SEMICONDUCTORS NV	USD	1.800,00	370.296,00	1,31
PROSUS NV	EUR	1.300,00	127.141,52	0,44
			1.739.619,11	6,14
Irland				
CRH PLC	GBP	7.000,00	353.635,67	1,25
ICON PLC	USD	1.650,00	341.071,50	1,20
			694.707,17	2,45
Spanien				
CAIXABANK SA	EUR	55.000,00	169.192,35	0,60
CELLNEX TELECOM SA	EUR	6.200,00	394.980,60	1,39
GRIFOLS SA-ADR	USD	7.500,00	130.125,00	0,46
			694.297,95	2,45
Dänemark				
GENMAB A/S	DKK	400,00	163.685,70	0,57
GN STORE NORD A/S	DKK	2.200,00	192.193,54	0,68
ORSTED A/S	DKK	1.950,00	273.660,03	0,97
			629.539,27	2,22
Frankreich				
ATOS SE	EUR	1.750,00	106.464,17	0,37
CAPGEMINI SE	EUR	1.500,00	288.173,70	1,02
SOCIETE GENERALE SA	EUR	7.000,00	206.370,32	0,73
			601.008,19	2,12
Schweden				
AUTOLIV INC	USD	1.600,00	156.416,00	0,55
ERICSSON LM-B SHS	SEK	28.000,00	352.154,54	1,24
			508.570,54	1,79
Hongkong				
AIA GROUP LTD	HKD	17.000,00	211.245,88	0,75
			211.245,88	0,75
Schweiz				
WIZZ AIR HOLDINGS PLC	GBP	1.863,00	120.162,73	0,42
			120.162,73	0,42
Israel				
CHECK POINT SOFTWARE TECH	USD	327,00	37.974,51	0,13
			37.974,51	0,13
Summe Aktien			27.450.518,12	96,86
Summe an einer amtlichen Wertpapierbörse notierte übertragbare Wertpapiere			27.450.518,12	96,86
Gesamtwertpapierbestand			27.450.518,12	96,86

JP Morgan Global Macro Opportunities

Wertpapierbestand zum 30.06.2021

Bezeichnung	Währung	Anzahl	Marktwert in EUR	% des Nettovermögen
Aktien/Anteile aus OGAW/OGA				
Aktien/Anteile aus Investmentfonds				
Luxemburg				
JPMORGAN INVEST FD GLOBAL MACRO OPPORT FD X EUR C	EUR	866.244,74	113.469.397,84	100,13
			113.469.397,84	100,13
Summe Aktien/Anteile aus Investmentfonds			113.469.397,84	100,13
Summe Aktien/Anteile aus OGAW/OGA			113.469.397,84	100,13
Gesamtwertpapierbestand			113.469.397,84	100,13

Premium Flexible Bond

Wertpapierbestand zum 30.06.2021

Bezeichnung	Währung	Anzahl	Marktwert in EUR	% des Nettovermögen
An einer amtlichen Wertpapierbörse notierte übertragbare Wertpapiere				
Renten und andere Schuldtitel				
Frankreich				
ALTICE FRANCE SA 2,5% 19-15/01/2025	EUR	600.000,00	592.283,57	0,84
AXA SA 21-07/10/2041 FRN	EUR	400.000,00	400.131,04	0,57
BPCE SA 15-30/11/2027 FRN	EUR	300.000,00	311.517,72	0,44
CRED AGRICOLE SA 0,125% 20-09/12/2027	EUR	200.000,00	196.516,65	0,28
ELIS SA 1,625% 19-03/04/2028	EUR	300.000,00	297.739,53	0,42
FAURECIA 3,75% 20-15/06/2028	EUR	300.000,00	316.498,19	0,45
LA BANQUE POSTAL 20-26/01/2031 FRN	EUR	300.000,00	300.988,54	0,43
LOXAM SAS 3,25% 19-14/01/2025	EUR	300.000,00	303.041,63	0,43
QUATRIM SAS 5,875% 19-15/01/2024	EUR	500.000,00	520.579,40	0,74
RCI BANQUE SA 0,25% 19-08/03/2023	EUR	400.000,00	402.283,22	0,57
RCI BANQUE SA 19-18/02/2030 FRN	EUR	700.000,00	706.695,00	1,01
SOCIETE GENERALE 20-24/11/2030 FRN	EUR	200.000,00	199.974,20	0,28
SPIE SA 3,125% 17-22/03/2024	EUR	800.000,00	839.457,09	1,21
UNIBAIL-RODAMCO 18-31/12/2049 FRN	EUR	200.000,00	202.000,29	0,29
URW 1,375% 20-04/12/2031	EUR	100.000,00	102.895,04	0,15
			5.692.601,11	8,11
Niederlande				
ABERTIS FINANCE 20-31/12/2060 FRN	EUR	200.000,00	207.325,85	0,30
ABERTIS FINANCE 21-31/12/2061 FRN	EUR	100.000,00	99.292,95	0,14
ELM FOR FIRMENIC 20-31/12/2060 FRN	EUR	200.000,00	216.174,32	0,31
KONINKLIJKE KPN NV 19-08/02/2168 FRN	EUR	400.000,00	406.849,94	0,58
LEASEPLAN CORP 0,125% 19-13/09/2023	EUR	600.000,00	603.591,74	0,86
NATURGY FINANCE BV F 14-29/11/2049 FRN	EUR	300.000,00	315.476,81	0,45
NATURGY FINANCE BV F 15-29/12/2049 FRN	EUR	200.000,00	212.627,33	0,30
REPSOL INTL FIN 15-25/03/2075 FRN	EUR	300.000,00	328.249,43	0,47
REPSOL INTL FIN 20-31/12/2060 FRN	EUR	200.000,00	214.366,06	0,31
SAGAX EURO MTN 0,75% 21-26/01/2028	EUR	117.000,00	116.218,97	0,17
SAIPEM FIN INTL 3,375% 20-15/07/2026	EUR	150.000,00	156.477,94	0,22
TELEFONICA EUROPE BV 18-31/12/2049 FRN	EUR	200.000,00	215.625,77	0,31
TENNET HLDG BV 17-31/12/2049 FRN	EUR	500.000,00	525.939,95	0,75
UPC HOLDING BV 3,875% 17-15/06/2029	EUR	100.000,00	101.558,74	0,14
ZIGGO BV 4,25% 16-15/01/2027	EUR	150.000,00	124.591,77	0,17
			3.844.367,57	5,48
Indonesien				
INDONESIA (REP) 4,1% 18-24/04/2028	USD	675.000,00	644.587,66	0,92
INDONESIA (REP) 4,125% 15-15/01/2025	USD	1.000.000,00	932.721,10	1,33
INDONESIA 5,25% 12-17/01/2042	USD	975.000,00	1.027.126,49	1,46
			2.604.435,25	3,71
Italien				
AUTOSTRADA PER L 1,875% 17-26/09/2029	EUR	400.000,00	412.858,44	0,59
BANCO BPM SPA 19-31/12/2049 FRN	EUR	200.000,00	228.744,45	0,33
BANCO POPOLARE 07-29/06/2049 FRN	EUR	100.000,00	97.824,45	0,14
INFRASTRUTTURE W 1,75% 21-19/04/2031	EUR	300.000,00	299.754,65	0,43
SANPAOLO VITA 14-29/12/2049 FRN	EUR	200.000,00	220.400,32	0,31
UNICREDIT SPA 16-29/12/2049 FRN	EUR	340.000,00	364.851,91	0,52
UNICREDIT SPA 19-23/09/2029 FRN	EUR	200.000,00	201.680,41	0,29
UNIONE DI BANCHE 1,625% 19-21/04/2025	EUR	300.000,00	313.585,89	0,44
UNIPOLSAI 14-30/06/2049 FRN	EUR	400.000,00	441.222,40	0,63
			2.580.922,92	3,68
Mexiko				
MEXICAN BONOS 6,5% 12-09/06/2022	MXN	35.000.000,00	1.497.559,49	2,13
PETROLEOS MEXICANOS 4,75% 18-26/02/2029	EUR	800.000,00	794.796,56	1,13
UNITED MEXICAN 1,375% 16-15/01/2025	EUR	275.000,00	287.146,37	0,41
			2.579.502,42	3,67
Saudi Arabien				
SAUDI INT BOND 3,625% 17-04/03/2028	USD	1.175.000,00	1.096.280,12	1,57
SAUDI INT BOND 4% 18-17/04/2025	USD	900.000,00	838.897,51	1,19
SAUDI INT BOND 5% 18-17/04/2049	USD	550.000,00	586.077,00	0,83
			2.521.254,63	3,59
Luxemburg				
ALTICE FINANCING SA 3% 20-15/01/2028	EUR	200.000,00	190.757,59	0,27
AROUNDTOWN SA 1,625% 18-31/01/2028	EUR	500.000,00	528.211,54	0,75
CNH IND FIN 0% 20-01/04/2024	EUR	300.000,00	299.967,40	0,43
MEDTRONIC GLOBAL 0,75% 20-15/10/2032	EUR	300.000,00	302.225,26	0,43
NESTLE FIN INTL 0% 20-03/03/2033	EUR	200.000,00	189.047,62	0,27
PLT VII FINANCE 4,625% 20-05/01/2026	EUR	400.000,00	414.238,71	0,59
SIG COMBIBLOC PU 2,125% 20-18/06/2025	EUR	500.000,00	529.324,30	0,75
			2.453.772,42	3,49
Supranational - Multinational				
AFRICA FINANCE 2,875% 21-28/04/2028	USD	500.000,00	423.668,23	0,60
ARDAGH PKG FIN 2,125% 20-15/08/2026	EUR	250.000,00	250.339,95	0,36
INTL FIN CORP 5,85% 17-25/11/2022	INR	88.900.000,00	1.021.351,43	1,46
INTL FIN CORP 6,3% 14-25/11/2024	INR	60.000.000,00	702.687,43	1,00
			2.398.047,04	3,42
Deutschland				
COMMERZBANK AG 20-05/12/2030 FRN	EUR	500.000,00	554.995,73	0,79
DEUTSCHE BANK AG 20-19/11/2025 FRN	EUR	300.000,00	306.379,02	0,44
DT PFANDBRIEFBANK AG 17-28/06/2027 FRN	EUR	300.000,00	306.432,63	0,44

GENERALI SMART FUNDS

Wertpapierbestand zum 30.06.2021

Bezeichnung	Währung	Anzahl	Marktwert in EUR	% des Nettovermögen
INFINEON TECH 19-01/04/2168 FRN	EUR	400.000,00	440.618,93	0,63
NIDDA HEALTHCARE HOLDING 3,5% 19-30/09/2024	EUR	200.000,00	199.681,18	0,28
TECHEM VERWALTUN 2% 20-15/07/2025	EUR	200.000,00	198.404,18	0,28
THYSSENKRUPP AG 2,875% 19-22/02/2024	EUR	300.000,00	304.774,69	0,43
			2.311.286,36	3,29
Spanien				
BANCO DE SABADELL SA 17-31/12/2049 FRN	EUR	200.000,00	206.412,48	0,28
BANCO SANTANDER 1,375% 20-05/01/2026	EUR	300.000,00	314.670,91	0,45
BANCO SANTANDER SA 17-31/12/2049 FRN	EUR	250.000,00	238.784,99	0,34
BANKIA 19-15/02/2029 FRN	EUR	300.000,00	323.558,51	0,46
BANKINTER SA 21-23/12/2032 FRN	EUR	300.000,00	300.839,81	0,43
CAIXABANK SA 18-31/12/2049 FRN	EUR	200.000,00	215.243,38	0,31
CELLNEX TELECOM 1,75% 20-23/10/2030	EUR	300.000,00	298.951,63	0,43
GRIFOLS SA 3,2% 17-01/05/2025	EUR	200.000,00	202.001,28	0,29
			2.100.462,99	2,99
Vereinigte Arabische Emirate				
ABU DHABI GOVT 0,75% 20-02/09/2023	USD	875.000,00	743.170,28	1,06
ABU DHABI GOVT 3,125% 17-11/10/2027	USD	700.000,00	648.948,23	0,92
ABU DHABI GOVT 4,125% 17-11/10/2047	USD	650.000,00	654.095,62	0,93
			2.046.214,13	2,91
Vereinigte Staaten				
ABBVIE INC 2,625% 20-15/11/2028	EUR	200.000,00	231.027,54	0,33
AT&T INC 20-31/12/2060 FRN	EUR	500.000,00	510.029,42	0,73
BALL CORP 1,5% 19-15/03/2027	EUR	200.000,00	203.032,49	0,29
PEPSICO INC 0,4% 20-09/10/2032	EUR	150.000,00	148.141,80	0,21
SCIENTIFIC GAMES 3,375% 18-15/02/2026	EUR	400.000,00	402.636,81	0,57
ZF NA CAPITAL 2,75% 15-27/04/2023	EUR	300.000,00	313.336,72	0,45
			1.808.204,78	2,58
Rumänien				
RCS & RDS SA 2,5% 20-05/02/2025	EUR	200.000,00	200.501,56	0,28
ROMANIA 2% 21-14/04/2033	EUR	1.000.000,00	995.809,68	1,42
ROMANIA 3,624% 20-26/05/2030	EUR	525.000,00	608.406,63	0,87
			1.804.717,87	2,57
Türkei				
TURKEY REP OF 3,25% 13-23/03/2023	USD	1.025.000,00	864.493,60	1,23
TURKEY REP OF 6,125% 18-24/10/2028	USD	575.000,00	493.604,92	0,70
TURKEY REP OF 6,75% 10-30/05/2040	USD	525.000,00	434.628,12	0,62
			1.792.726,64	2,55
Großbritannien				
BP CAPITAL MKT PLC 20-22/06/2169 FRN	EUR	200.000,00	217.976,57	0,31
LLOYDS BANKING GROUP PLC 14-27/06/2049 FRN	EUR	600.000,00	663.571,50	0,95
NGG FINANCE 19-05/12/2079 FRN	EUR	350.000,00	354.219,93	0,50
VIRGIN MEDIA SEC FIN 3,75% 20-15/07/2030	EUR	100.000,00	100.154,73	0,14
VODAFONE GROUP PLC 18-03/01/2079 FRN	EUR	200.000,00	208.534,49	0,30
			1.544.457,22	2,20
Schweden				
AKELIUS RESIDENT 20-17/05/2081 FRN	EUR	300.000,00	301.315,57	0,43
BALDER 17-07/03/2078 FRN	EUR	200.000,00	204.005,24	0,29
INTRUM AB 4,875% 20-15/08/2025	EUR	300.000,00	315.899,75	0,46
SAMHALLSBYGG 20-31/12/2060 FRN	EUR	150.000,00	150.665,13	0,21
VERISURE HOLDING 3,5% 18-15/05/2023	EUR	300.000,00	302.868,27	0,43
			1.274.753,96	1,82
Südafrika				
REP SOUTH AFRICA 10,5% 98-21/12/2026	ZAR	10.000.000,00	671.211,49	0,96
SOUTH AFRICA 4,875% 16-14/04/2026	USD	225.000,00	206.160,64	0,29
SOUTH AFRICA 6,3% 18-22/06/2048	USD	300.000,00	276.649,25	0,39
			1.154.021,38	1,64
Katar				
QATAR STATE OF 3,4% 20-16/04/2025	USD	650.000,00	597.458,54	0,85
QATAR STATE OF 4% 19-14/03/2029	USD	550.000,00	534.284,68	0,76
			1.131.743,22	1,61
Oman				
OMAN INTL BOND 4,875% 19-01/02/2025	USD	475.000,00	420.442,40	0,60
OMAN INTRNL BOND 6,75% 20-28/10/2027	USD	750.000,00	709.817,47	1,01
			1.130.259,87	1,61
Kolumbien				
COLOMBIA REP OF 4,5% 18-15/03/2029	USD	300.000,00	276.288,89	0,39
COLOMBIA REP OF 6,125% 09-18/01/2041	USD	600.000,00	599.980,69	0,86
COLOMBIA REP OF 8,125% 04-21/05/2024	USD	225.000,00	224.902,11	0,32
			1.101.171,69	1,57
Brasilien				
BRAZIL REP OF 3,875% 20-12/06/2030	USD	325.000,00	276.739,24	0,39
BRAZIL REP OF 5,625% 09-07/01/2041	USD	375.000,00	344.877,38	0,49
BRAZIL REP OF 8,75% 05-04/02/2025	USD	300.000,00	314.826,65	0,45
			936.443,27	1,33
Ägypten				
ARAB REP EGYPT 3,875% 21-16/02/2026	USD	500.000,00	415.393,86	0,59
ARAB REP EGYPT 6,375% 19-11/04/2031	EUR	275.000,00	287.469,25	0,41
ARAB REP EGYPT 7,903% 18-21/02/2048	USD	250.000,00	209.274,39	0,30
			912.137,50	1,30
Finnland				
OP CORPORATE BK 0,1% 20-16/11/2027	EUR	500.000,00	498.414,20	0,71
SBB TREASURY OYJ 0,75% 20-14/12/2028	EUR	300.000,00	294.266,24	0,42
			792.680,44	1,13
Dominikanische Republik				
DOMINICAN REPUBL 5,5% 15-27/01/2025	USD	200.000,00	185.718,46	0,26
DOMINICAN REPUBL 6% 18-19/07/2028	USD	275.000,00	264.043,17	0,38

GENERALI SMART FUNDS

Wertpapierbestand zum 30.06.2021

Bezeichnung	Währung	Anzahl	Marktwert in EUR	% des Nettovermögen
DOMINICAN REPUBL 6,85% 15-27/01/2045	USD	325.000,00	310.683,81	0,44
			760.445,44	1,08
Ukraine				
UKRAINE GOVT 4,375% 20-27/01/2030	EUR	375.000,00	351.006,71	0,50
UKRAINE GOVT 6,75% 19-20/06/2026	EUR	275.000,00	300.765,65	0,43
			651.772,36	0,93
Argentinien				
ARGENTINA 20-09/07/2035 SR	USD	2.150.000,00	577.469,47	0,82
			577.469,47	0,82
Irland				
AIB GROUP PLC 19-19/11/2029 FRN	EUR	300.000,00	307.816,47	0,44
EIRCOM FINANCE 3,5% 19-15/05/2026	EUR	200.000,00	205.224,82	0,29
			513.041,29	0,73
Bahrain				
BAHRAIN 7,375% 20-14/05/2030	USD	475.000,00	453.628,41	0,65
			453.628,41	0,65
Österreich				
ERSTE GROUP BANK AG 19-31/12/2049 FRN	EUR	400.000,00	442.864,18	0,63
			442.864,18	0,63
Belgien				
BELFIUS BANK SA/NV 18-31/12/2049 FRN	EUR	200.000,00	198.284,33	0,28
KBC GROUP NV 18-31/12/2049 FRN	EUR	200.000,00	212.628,43	0,31
			410.912,76	0,59
Uruguay				
URUGUAY 7,625% 06-21/03/2036	USD	300.000,00	386.899,71	0,55
			386.899,71	0,55
Panama				
PANAMA 3,875% 16-17/03/2028	USD	400.000,00	371.394,88	0,53
			371.394,88	0,53
China				
CHINA (PEOPLES) 3,5% 18-19/10/2028	USD	375.000,00	357.309,33	0,51
			357.309,33	0,51
Chile				
CHILE 2,55% 20-27/01/2032	USD	400.000,00	345.266,73	0,49
			345.266,73	0,49
Norwegen				
STOREBRAND LIVSF 21-30/09/2051 FRN	EUR	333.000,00	328.098,63	0,47
			328.098,63	0,47
Portugal				
ENERGIAS DE PORTUGAL SA 19-30/04/2079 FRN	EUR	300.000,00	327.231,29	0,47
			327.231,29	0,47
Ecuador				
REPUBLIC OF ECUA 20-31/07/2040 SR	USD	575.000,00	300.779,92	0,43
			300.779,92	0,43
Ghana				
GHANA REP OF 7,625% 18-16/05/2029	USD	325.000,00	277.878,64	0,40
			277.878,64	0,40
Marokko				
MOROCCO KINGDOM 2% 20-30/09/2030	EUR	275.000,00	272.909,04	0,39
			272.909,04	0,39
Aserbaidshjan				
REP OF AZERBAIJAN 4,75% 14-18/03/2024	USD	275.000,00	251.836,46	0,36
			251.836,46	0,36
Elfenbeinküste				
IVORY COAST-PDI 4,875% 20-30/01/2032	EUR	250.000,00	250.455,28	0,36
			250.455,28	0,36
Nigeria				
REP OF NIGERIA 7,875% 17-16/02/2032	USD	250.000,00	227.476,29	0,32
			227.476,29	0,32
Jersey				
AVIS BUDGET FINA 4,75% 18-30/01/2026	EUR	200.000,00	204.844,89	0,29
			204.844,89	0,29
Paraguay				
PARAGUAY 4,95% 20-28/04/2031	USD	200.000,00	194.288,81	0,27
			194.288,81	0,27
Summe Renten und andere Schuldtitel			54.422.988,49	77,52
Aktien/Anteile aus Investmentfonds				
Schweden				
SWEDBANK AB 17-22/11/2027 FRN	EUR	400.000,00	404.918,72	0,57
			404.918,72	0,57
Summe Aktien/Anteile aus Investmentfonds			404.918,72	0,57
Summe an einer amtlichen Wertpapierbörse notierte übertragbare Wertpapiere			54.827.907,21	78,09
An einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere				
Renten und andere Schuldtitel				
Italien				
ACEA SPA 0,25% 21-28/07/2030	EUR	275.000,00	268.305,80	0,38
INTESA SANPAOLO 0,75% 21-16/03/2028	EUR	163.000,00	164.036,53	0,23
ITALY BTPS I/L 0,55% 18-21/05/2026	EUR	1.406.692,00	1.478.357,22	2,12
NEXI 2,125% 21-30/04/2029	EUR	200.000,00	198.350,96	0,28
REP OF ITALY 2,875% 19-17/10/2029	USD	1.500.000,00	1.318.141,64	1,88
			3.427.192,15	4,89
Mexiko				
UNITED MEXICAN 4,5% 19-22/04/2029	USD	700.000,00	668.772,57	0,95

GENERALI SMART FUNDS

Wertpapierbestand zum 30.06.2021

Bezeichnung	Währung	Anzahl	Marktwert in EUR	% des Nettovermögen
UNITED MEXICAN 4,6% 17-10/02/2048	USD	975.000,00	885.323,45	1,26
			1.554.096,02	2,21
Philippinen				
PHILIPPINES(REP) 3,7% 16-01/03/2041	USD	325.000,00	296.403,52	0,42
PHILIPPINES(REP) 3,75% 19-14/01/2029	USD	475.000,00	455.149,57	0,65
			751.553,09	1,07
Deutschland				
DEUTSCHE BANK AG 2,75% 15-17/02/2025	EUR	600.000,00	635.477,72	0,91
			635.477,72	0,91
Peru				
REPUBLIC OF PERU 1,862% 20-01/12/2032	USD	450.000,00	353.702,04	0,50
REPUBLIC OF PERU 2,392% 20-23/01/2026	USD	200.000,00	174.279,14	0,25
			527.981,18	0,75
Vereinigte Staaten				
ENCORE CAPITAL 4,875% 20-15/10/2025	EUR	400.000,00	423.906,03	0,60
			423.906,03	0,60
Frankreich				
CROWN EUROPEAN 3,375% 15-15/05/2025	EUR	300.000,00	322.302,29	0,46
			322.302,29	0,46
Panama				
PANAMA 4,5% 20-01/04/2056	USD	325.000,00	311.662,63	0,44
			311.662,63	0,44
Niederlande				
SAIPEM FIN INTL 3,75% 16-08/09/2023	EUR	150.000,00	159.310,86	0,23
			159.310,86	0,23
Summe Renten und andere Schuldtitel			8.113.481,97	11,56
Summe an einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere			8.113.481,97	11,56
Aktien/Anteile aus OGAW/OGA				
Aktien/Anteile aus Investmentfonds				
Irland				
ISHARES IV PLC ISHARES CHINA CNY BD UCITS ETF D	USD	615.000,00	2.813.110,30	4,01
			2.813.110,30	4,01
Summe Aktien/Anteile aus Investmentfonds			2.813.110,30	4,01
Summe Aktien/Anteile aus OGAW/OGA			2.813.110,30	4,01
Gesamtwertpapierbestand			65.754.499,48	93,66

JP Morgan Global Income Conservative

Wertpapierbestand zum 30.06.2021

Bezeichnung	Währung	Anzahl	Marktwert in EUR	% des Nettovermögen
Aktien/Anteile aus OGAW/OGA				
Aktien/Anteile aus Investmentfonds				
Luxemburg				
JPMORGAN INVEST FD GLOBAL INCOME CONSERV FD X EUR C	EUR	872.934,81	94.608.675,03	100,20
			94.608.675,03	100,20
Summe Aktien/Anteile aus Investmentfonds			94.608.675,03	100,20
Summe Aktien/Anteile aus OGAW/OGA			94.608.675,03	100,20
Gesamtwertpapierbestand			94.608.675,03	100,20

Serenity

Wertpapierbestand zum 30.06.2021

Bezeichnung	Währung	Anzahl	Marktwert in EUR	% des Nettovermögen
An einer amtlichen Wertpapierbörse notierte übertragbare Wertpapiere				
Renten und andere Schuldtitel				
Frankreich				
BANQ FED CRD MUT 0,25% 21-19/07/2028	EUR	700.000,00	686.331,53	0,88
BNP PARIBAS 1% 17-27/06/2024	EUR	560.000,00	577.508,50	0,74
FRANCE O.A.T. 0% 19-25/11/2029	EUR	3.450.000,00	3.470.379,84	4,44
FRANCE O.A.T. 0,75% 17-25/05/2028	EUR	1.530.000,00	1.634.078,33	2,08
FRANCE O.A.T. 1,5% 15-25/05/2031	EUR	490.000,00	559.818,69	0,71
HSBC FRANCE 0,2% 18-04/09/2021	EUR	500.000,00	500.637,59	0,64
ORANGE SA 1,125% 19-15/07/2024	EUR	300.000,00	311.251,19	0,40
PSA BANQUE FRANCE 0,5% 19-12/04/2022	EUR	140.000,00	140.859,65	0,18
PSA BANQUE FRANCE 0,625% 19-21/06/2024	EUR	230.000,00	234.050,74	0,30
RCI BANQUE SA 0,75% 17-12/01/2022	EUR	510.000,00	511.544,77	0,65
SOCIETE GENERALE SA 0,125% 20-24/02/2026	EUR	800.000,00	803.594,34	1,02
TELEPERFORMANCE 1,5% 17-03/04/2024	EUR	200.000,00	207.464,86	0,26
			9.637.520,03	12,30
Vereinigte Staaten				
ABBVIE INC 1,375% 16-17/05/2024	EUR	490.000,00	508.910,57	0,65
AMER INTL GROUP 1,5% 16-08/06/2023	EUR	540.000,00	555.214,60	0,71
BANK OF AMER CORP 4,2% 14-26/08/2024	USD	410.000,00	379.522,08	0,48
BAT CAPITAL CORP 1,125% 17-16/11/2023	EUR	180.000,00	184.242,16	0,23
CELANESE US HLDS 1,125% 16-26/09/2023	EUR	510.000,00	522.365,24	0,67
CVS HEALTH CORP 3% 19-15/08/2026	USD	180.000,00	163.814,19	0,21
GOLDMAN SACHS GP 0,25% 21-26/01/2028	EUR	550.000,00	540.744,25	0,69
GOLDMAN SACHS GRP INC 0,125% 19-19/08/2024	EUR	590.000,00	591.927,45	0,75
GOLDMAN SACHS GRP INC 3,85% 14-08/07/2024	USD	310.000,00	282.824,62	0,36
MORGAN STANLEY 4,1% 13-22/05/2023	USD	310.000,00	278.376,61	0,35
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC 0,125% 19-01/03/2025	EUR	230.000,00	231.270,54	0,29
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC 0,5% 19-01/03/2028	EUR	570.000,00	576.583,72	0,74
US TREASURY N/B 0,625% 20-31/03/2027	USD	1.690.000,00	1.394.405,42	1,78
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC 2,125% 14-20/11/2026	EUR	515.000,00	561.704,74	0,72
			6.771.906,19	8,63
Deutschland				
DAIMLER AG 0,375% 19-08/11/2026	EUR	520.000,00	528.650,64	0,67
DEUTSCHE BANK AG 1,875% 19-14/02/2022	EUR	600.000,00	607.850,97	0,78
DEUTSCHE BANK AG 17-16/05/2022 FRN	EUR	600.000,00	602.693,23	0,77
DEUTSCHE BANK AG 21-17/02/2032 FRN	EUR	400.000,00	406.245,98	0,52
DEUTSCHLAND REP 0,25% 18-15/08/2028	EUR	1.280.000,00	1.345.051,56	1,72
DEUTSCHLAND REP 0,5% 18-15/02/2028	EUR	785.000,00	837.003,24	1,07
HAPAG-LLOYD AG 2,5% 21-15/04/2028	EUR	190.000,00	194.930,03	0,25
KFW 1% 16-12/10/2021	NOK	15.510.000,00	1.523.283,29	1,94
VONOVIA SE 0,375% 21-16/06/2027	EUR	400.000,00	400.726,67	0,50
			6.446.435,61	8,22
Niederlande				
ABN AMRO BANK NV 0,6% 20-15/01/2027	EUR	400.000,00	406.338,24	0,52
ABN AMRO BANK NV 1% 16-13/04/2031	EUR	700.000,00	762.575,34	0,98
BMW FINANCE NV 0,125% 19-13/07/2022	EUR	500.000,00	502.836,68	0,64
DAIMLER INTL FIN BV 1,375% 19-26/06/2026	EUR	590.000,00	630.505,95	0,80
EURONEXT NV 0,75% 21-17/05/2031	EUR	460.000,00	465.185,49	0,59
ISS FINANCE BV 1,25% 20-07/07/2025	EUR	240.000,00	248.669,46	0,32
NATURGY FINANCE BV F 1,5% 18-29/01/2028	EUR	400.000,00	431.604,00	0,55
RELX FINANCE 0,5% 20-10/03/2028	EUR	180.000,00	182.403,08	0,23
TEVA PHARMACEUTICALS FIN NE 1,125% 16-15/10/2024	EUR	530.000,00	497.804,15	0,63
TEVA PHARMACEUTICALS FIN NE 2,8% 16-21/07/2023	USD	520.000,00	436.974,93	0,56
VONOVIA FINANCE BV 0,75% 18-15/01/2024	EUR	300.000,00	306.498,79	0,39
WINTERSHALL FIN 1,332% 19-25/09/2028	EUR	500.000,00	513.566,36	0,65
ZF EUROPE 2% 19-23/02/2026	EUR	400.000,00	405.074,60	0,52
			5.790.037,07	7,38
Irland				
IRISH GOVT 0,9% 18-15/05/2028	EUR	985.000,00	1.058.704,07	1,35
IRISH GOVT 1,1% 19-15/05/2029	EUR	985.000,00	1.076.192,32	1,37
IRISH GOVT 2,4% 14-15/05/2030	EUR	490.000,00	594.866,99	0,76
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL 3,625% 16-02/07/2024	USD	300.000,00	271.980,84	0,35
RYANAIR 1,125% 17-15/08/2023	EUR	510.000,00	521.781,04	0,66
			3.523.525,26	4,49
Spanien				
BANKINTER SA 1% 15-05/02/2025	EUR	700.000,00	731.687,19	0,93
SANTANDER CONSUMER FIN 1% 19-27/02/2024	EUR	200.000,00	205.852,81	0,26
SPANISH GOVT 1,25% 20-31/10/2030	EUR	1.030.000,00	1.115.846,02	1,42
SPANISH GOVT 1,4% 18-30/04/2028	EUR	1.080.000,00	1.180.527,87	1,51
			3.233.913,89	4,12
Portugal				
PORTUGUESE OTS 0,475% 20-18/10/2030	EUR	1.115.000,00	1.137.057,44	1,45
PORTUGUESE OTS 1,95% 19-15/06/2029	EUR	1.350.000,00	1.551.411,32	1,98
			2.688.468,76	3,43
Großbritannien				
BABCOCK INTL GRP 1,375% 19-13/09/2027	EUR	380.000,00	386.916,13	0,49
BRITISH TELECOMM 0,5% 19-12/09/2025	EUR	410.000,00	415.890,11	0,53
LLOYDS BANKING GROUP PLC 0,75% 16-09/11/2021	EUR	510.000,00	512.175,37	0,65
LLOYDS BANKING GROUP PLC 20-01/04/2026 FRN	EUR	110.000,00	123.846,19	0,16

GENERALI SMART FUNDS

Wertpapierbestand zum 30.06.2021

Bezeichnung	Währung	Anzahl t	Marktwert in EUR	% des Nettovermögen
MARKS & SPENCER 6% 12-12/06/2025	GBP	280.000,00	367.420,20	0,47
Norwegen			1.806.248,00	2,30
NORSK HYDRO ASA 1,125% 19-11/04/2025	EUR	490.000,00	506.795,31	0,64
SPAREBANK1BOKR 0,25% 16-30/08/2026	EUR	610.000,00	625.617,38	0,80
			1.132.412,69	1,44
Luxemburg				
AROUNDTOWN SA 0,625% 19-09/07/2025	EUR	300.000,00	304.874,11	0,39
GAZPROM 2,25% 17-22/11/2024	EUR	535.000,00	555.904,37	0,71
			860.778,48	1,10
Indonesien				
INDONESIA (REP) 1,75% 18-24/04/2025	EUR	510.000,00	536.788,01	0,69
INDONESIA (REP) 2,625% 16-14/06/2023	EUR	240.000,00	252.383,66	0,32
			789.171,67	1,01
Österreich				
REP OF AUSTRIA 0,5% 19-20/02/2029	EUR	690.000,00	726.884,15	0,93
			726.884,15	0,93
Supranational - Multinational				
EUROPEAN UNION 0% 21-04/07/2031	EUR	610.000,00	608.959,74	0,78
			608.959,74	0,78
Schweden				
HEIMSTADEN BOSTA 2,125% 19-05/09/2023	EUR	237.000,00	247.559,09	0,32
INTRUM AB 2,75% 17-15/07/2022	EUR	410.000,00	41.094,54	0,05
VOLVO CAR AB 2,125% 19-02/04/2024	EUR	190.000,00	198.787,92	0,25
			487.441,55	0,62
Mexiko				
CEMEX SAB 2,75% 17-05/12/2024	EUR	180.000,00	182.545,28	0,23
SIGMA ALIMENTOS 2,625% 17-07/02/2024	EUR	230.000,00	243.264,93	0,31
			425.810,21	0,54
Rumänien				
ROMANIA 3,5% 19-03/04/2034	EUR	290.000,00	331.517,48	0,42
			331.517,48	0,42
Montenegro				
MONTENEGRO REP 3,375% 18-21/04/2025	EUR	230.000,00	232.423,44	0,30
			232.423,44	0,30
Dänemark				
CARLSBERG BREW 0,625% 20-09/03/2030	EUR	170.000,00	171.622,73	0,22
			171.622,73	0,22
Summe Renten und andere Schuldtitel			45.665.076,95	58,23
Summe an einer amtlichen Wertpapierbörse notierte übertragbare Wertpapiere			45.665.076,95	58,23
An einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere				
Renten und andere Schuldtitel				
Deutschland				
KFW 0,375% 16-09/03/2026	EUR	1.230.000,00	1.276.273,02	1,63
KFW 0,75% 18-28/06/2028	EUR	695.000,00	742.125,69	0,94
			2.018.398,71	2,57
Kroatien				
CROATIA 2,75% 17-27/01/2030	EUR	330.000,00	381.685,15	0,49
			381.685,15	0,49
Summe Renten und andere Schuldtitel			2.400.083,86	3,06
Summe an einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere			2.400.083,86	3,06
Aktien/Anteile aus OGAW/OGA				
Aktien/Anteile aus Investmentfonds				
Luxemburg				
DWS ESG EURO MONEY MARKET FD D	EUR	3.831,00	383.176,62	0,49
DWS FLOATING RATE NOTES F C	EUR	8.892,00	747.728,28	0,95
DWS INVEST EURO CORPORATE BONDS F C	EUR	5.162,00	930.605,36	1,19
DWS INVEST EURO HIGH YIELD CORPORATES F C	EUR	13.938,00	2.422.703,16	3,09
X EURO STOXX 50 1 D	EUR	61.572,00	2.636.820,90	3,36
X MSCI EM ASIA SWAP 1 C	EUR	26.175,00	1.589.084,25	2,03
X MSCI EUROPE SMALL C INDEX 1 C	EUR	10.565,00	620.271,15	0,79
X MSCI JAPAN INDEX 1 C	EUR	14.992,00	936.280,38	1,19
X S&P 500 SWAP 1 C	USD	60.980,00	4.180.516,06	5,33
			14.447.186,16	18,42
Irland				
BARINGS EMERGING MARKETS SOVEREIGN DEBT FD A USD C	USD	10.824,00	1.516.583,05	1,93
INVESCO PHYSICAL GOLD ETC	USD	18.307,00	2.636.908,85	3,37
ISHARES AUTOMATION & ROBOTICS UCITS ETF USD C	USD	60.339,00	661.698,88	0,84
ISHARES EDGE MSCI WORLD QUALITYFACTOR UCITS ETF USD C	USD	11.619,00	527.797,90	0,67
SPDR BBG BARCLAYS EMERG MKTS LOCAL BOND UCITS ETF D	USD	28.175,00	1.643.601,06	2,11
X ARTIFICIAL INT & BIG DATA UCITS 1 C	EUR	10.142,00	842.495,94	1,07
X MSCI EUROPE ESG 1 C	EUR	18.133,00	453.959,66	0,58
X MSCI USA ESG 1 C	USD	13.223,00	493.953,03	0,63
X MSCI WRLD INDUSTRIALS 1 C	USD	6.942,00	285.108,45	0,36
			9.062.106,82	11,56
Deutschland				
DWS ESG CONVERTIBLES F C	EUR	7.359,00	1.200.032,13	1,52
			1.200.032,13	1,52
Summe Aktien/Anteile aus Investmentfonds			24.709.325,11	31,50
Summe Aktien/Anteile aus OGAW/OGA			24.709.325,11	31,50
Gesamtwertpapierbestand			72.774.485,92	92,79

Best Managers Conservative

Wertpapierbestand zum 30.06.2021

Bezeichnung	Währung	Anzahl	Marktwert in EUR	% des Nettovermögen
Aktien/Anteile aus OGAW/OGA				
Aktien/Anteile aus Investmentfonds				
Luxemburg				
AVIVA INVESTORS GLOBAL CONVERT ABSOL RETURN FD I EUR H C	EUR	291.959,00	42.281.794,34	9,39
CARMIGNAC PTF PATRIMOINE EUROPE F EUR C	EUR	336.113,00	47.307.904,75	10,51
ELEVA UCITS FD ABSOLUTE RETURN EUROPE I2 EUR C	EUR	38.313,00	44.627.748,66	9,92
HGIF MULTI-ASSET STYLE FACTORS X C	EUR	4.033.282,00	44.027.306,31	9,78
JPMORGAN INVEST FD GLOBAL MACRO FD I EUR HEDGED C	EUR	401.819,00	44.999.709,81	10,00
			223.244.463,87	49,60
Deutschland				
4Q-SPECIAL INCOME I EUR D	EUR	345.023,00	44.225.048,14	9,83
ACATIS GANÉ VALUE EVENT FONDS D	EUR	32.671,00	47.447.439,88	10,54
ODDO BHF POLARIS MODERATE CI-EUR D	EUR	39.661,00	45.181.811,20	10,04
			136.854.299,22	30,41
Irland				
MAN FD VI PLC MAN AHL TARGETRISK I H EUR C	EUR	305.013,19	46.651.767,10	10,37
PIMCO GIS DYNAMIC MULTI-ASSET FD INST EUR C	EUR	3.148.531,00	44.488.743,03	9,88
			91.140.510,13	20,25
Summe Aktien/Anteile aus Investmentfonds			451.239.273,22	100,26
Summe Aktien/Anteile aus OGAW/OGA			451.239.273,22	100,26
Gesamtwertpapierbestand			451.239.273,22	100,26

Best Selection

Wertpapierbestand zum 30.06.2021

Bezeichnung	Währung	Anzahl	Marktwert in EUR	% des Nettovermögen
Aktien/Anteile aus OGAW/OGA				
Aktien/Anteile aus Investmentfonds				
Luxemburg				
CARMIGNAC PTF GRANDE EUROPE W EUR C	EUR	75.000,00	12.850.500,00	10,62
EDGEWOOD L SELECT US SELECT GROWTH I USD Z C	USD	34.487,00	13.683.420,28	11,31
GOLDMAN SACHS GLOBAL CREDIT PTF HEDGED I C	USD	819.405,00	11.165.852,77	9,23
JPMORGAN FD EMERGING MARKETS EQUITY FD I USD C	USD	416.595,00	11.704.988,11	9,68
LUPUS ALPHA FD LUPUS ALPHA SMALLER GERM CHAMPIONS D	EUR	20.314,00	12.671.263,78	10,47
NINETY ONE GSF EMERGING MARKETS CORPORA	USD	380.014,00	11.394.972,46	9,42
NINETY ONE GSF GLOBAL GOLD FD I ACC USD CAP	USD	528.565,00	10.037.341,93	8,30
ROBECO GLOBAL CONSUMER TRENDS I EUR C	EUR	20.938,00	12.046.468,92	9,96
			95.554.808,25	78,99
Irland				
COMGEST GROWTH PLC EUROPE SMALLER CO EUR I ACC CLASS C	EUR	235.410,00	12.069.470,70	9,98
NOMURA GLOBAL DYNAMIC BOND FD I USD C	USD	92.173,00	11.419.969,66	9,44
			23.489.440,36	19,42
Summe Aktien/Anteile aus Investmentfonds			119.044.248,61	98,41
Summe Aktien/Anteile aus OGAW/OGA			119.044.248,61	98,41
Gesamtwertpapierbestand			119.044.248,61	98,41

PIR Valore Italia

Wertpapierbestand zum 30.06.2021

Bezeichnung	Währung	Anzahl	Marktwert in EUR	% des Nettovermögen
An einer amtlichen Wertpapierbörse notierte übertragbare Wertpapiere				
Renten und andere Schuldtitel				
Italien				
2I RETE GAS SPA 1,608% 17-31/10/2027	EUR	300.000,00	321.457,69	0,79
2I RETE GAS SPA 3% 14-16/07/2024	EUR	200.000,00	218.344,33	0,54
A2A SPA 3,625% 13-13/01/2022	EUR	400.000,00	408.550,61	1,01
ACEA SPA 2,625% 14-15/07/2024	EUR	300.000,00	322.730,94	0,80
ACQUIRENTE UNI 2,8% 19-20/02/2026	EUR	600.000,00	663.997,48	1,64
BANCA FARMAFACTORING SPA 2% 17-29/06/2022	EUR	400.000,00	407.637,13	1,01
BANCA IFIS SPA 1,75% 20-25/06/2024	EUR	373.000,00	376.335,86	0,93
BANCO DESIO BRIA 0,875% 17-12/09/2024	EUR	900.000,00	932.195,97	2,30
CASS RISP PARMA 0,875% 15-16/06/2023	EUR	600.000,00	614.913,52	1,52
CATTOLICA ASSICURAZIONI SC 17-14/12/2047 FRN	EUR	600.000,00	678.430,62	1,67
CREDITO EMILIANO 1,125% 19-17/01/2024	EUR	600.000,00	622.024,88	1,54
CREDITO EMILIANO 19-25/10/2025 FRN	EUR	500.000,00	515.714,71	1,27
ENEL SPA 18-24/11/2078 FRN	EUR	800.000,00	839.563,73	2,07
ENI SPA 20-31/12/2060 FRN	EUR	281.000,00	295.627,88	0,73
ENI SPA 21-31/12/2061 FRN	EUR	316.000,00	316.078,81	0,78
FERROVIE DEL 1,5% 17-27/06/2025	EUR	400.000,00	423.474,20	1,05
HERA SPA 0,875% 16-14/10/2026	EUR	500.000,00	517.545,27	1,28
HERA SPA 0,875% 19-05/07/2027	EUR	100.000,00	104.154,18	0,26
ICCREA BANCA SPA 1,5% 17-11/10/2022	EUR	700.000,00	710.806,38	1,75
IGD 2,125% 19-28/11/2024	EUR	300.000,00	301.226,03	0,74
INTESA SANPAOLO SPA 1% 19-19/11/2026	EUR	600.000,00	618.808,13	1,53
IREN SPA 0,875% 19-14/10/2029	EUR	102.000,00	104.156,59	0,26
IREN SPA 1,95% 18-19/09/2025	EUR	200.000,00	214.372,10	0,53
ITALGAS SPA 0,25% 20-24/06/2025	EUR	733.000,00	737.803,74	1,82
ITALGAS SPA 0,5% 17-19/01/2022	EUR	400.000,00	401.953,92	0,99
PIRELLI & C SPA 1,375% 18-25/01/2023	EUR	800.000,00	813.536,25	2,01
SACE SPA 15-10/02/2049 FRN	EUR	1.100.000,00	1.141.327,80	2,82
SALINI IMPREGILO SPA 1,75% 17-26/10/2024	EUR	300.000,00	297.952,49	0,73
SNAM SPA 1,25% 19-28/08/2025	EUR	800.000,00	840.279,97	2,07
TERNA SPA 1% 18-23/07/2023	EUR	600.000,00	616.099,28	1,52
UNICREDIT SPA 2% 16-04/03/2023	EUR	200.000,00	207.118,33	0,50
UNIPOL GRUPPO SPA 3% 15-18/03/2025	EUR	700.000,00	760.540,82	1,88
UNIPOLSAI 14-30/06/2049 FRN	EUR	300.000,00	330.916,80	0,82
			16.675.676,44	41,16
Niederlande				
EXOR NV 2,25% 20-29/04/2030	EUR	400.000,00	444.656,37	1,09
FERRARI NV 1,5% 16-16/03/2023	EUR	600.000,00	615.010,54	1,52
FERRARI NV 1,5% 20-27/05/2025	EUR	436.000,00	453.326,67	1,12
			1.512.993,58	3,73
Luxemburg				
CNH INDUSTRIAL FIN 1,875% 18-19/01/2026	EUR	736.000,00	788.602,74	1,95
			788.602,74	1,95
Rumänien				
UNICREDIT LEASING 0,502% 19-18/10/2022	EUR	200.000,00	201.507,83	0,49
			201.507,83	0,49
Summe Renten und andere Schuldtitel			19.178.780,59	47,33
Aktien				
Italien				
A2A SPA	EUR	302.689,00	521.835,84	1,29
AVIO SPA	EUR	8.899,00	110.703,56	0,27
BANCA FARMAFACTORING SPA	EUR	73.352,00	619.824,40	1,53
BANCA IFIS SPA	EUR	12.525,00	167.835,00	0,41
BANCO BPM SPA	EUR	41.542,00	112.703,45	0,28
BUZZI UNICEM SPA	EUR	11.056,00	247.322,72	0,61
CATTOLICA ASSICURAZIONI SC	EUR	29.147,00	204.174,74	0,50
CERVED GROUP SPA	EUR	52.520,00	514.696,00	1,27
CY4GATE SPA	EUR	8.461,00	79.110,35	0,20
DANIELI & CO-RSP	EUR	26.430,00	384.292,20	0,95
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	EUR	12.971,00	146.507,45	0,36
DELONGHI SPA	EUR	6.224,00	228.669,76	0,56
ENAV SPA	EUR	125.274,00	476.041,20	1,17
ENEL SPA	EUR	80.000,00	626.560,00	1,55
ENI SPA	EUR	50.000,00	513.500,00	1,27
ERG SPA	EUR	13.507,00	337.675,00	0,83
FINECOBANK SPA	EUR	41.689,00	612.828,30	1,51
GAROFALO HEALTH CARE SPA	EUR	19.431,00	109.590,84	0,27
ILLIMITY BANK SPA	EUR	20.740,00	243.902,40	0,60
INDEL B SPA	EUR	3.612,00	96.440,40	0,24
INTESA SANPAOLO SPA	EUR	320.061,00	745.582,10	1,84
IREN SPA	EUR	177.788,00	427.757,93	1,06
LEONARDO SPA	EUR	52.889,00	360.279,87	0,89
LU-VE SPA	EUR	4.722,00	80.274,00	0,20
MONCLER SPA	EUR	6.468,00	369.064,08	0,91
NEWLAT FOOD SPA	EUR	14.221,00	96.987,22	0,24
NEXI SPA	EUR	34.727,00	642.796,77	1,59
OPENJOBMETIS SPA AGENZIA PER	EUR	17.013,00	166.727,40	0,41
PIOVAN SPA	EUR	43.226,00	348.401,56	0,86

GENERALI SMART FUNDS

Wertpapierbestand zum 30.06.2021

Bezeichnung	Währung	Anzahl	Marktwert in EUR	% des Nettovermögens
POSTE ITALIANE SPA	EUR	45.476,00	507.057,40	1,25
PRYSMIAN SPA	EUR	20.000,00	604.600,00	1,49
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	EUR	5.436,00	262.015,20	0,65
SESA SPA	EUR	5.474,00	771.834,00	1,91
TAMBURI INVESTMENT PARTNERS	EUR	50.000,00	413.500,00	1,02
TECHNOGYM SPA	EUR	34.742,00	373.823,92	0,92
TELECOM ITALIA-RSP	EUR	306.384,00	136.892,37	0,34
TINEXTA SPA	EUR	17.439,00	572.347,98	1,41
UNIPOL GRUPPO SPA	EUR	110.107,00	505.611,34	1,25
ZIGNAGO VETRO SPA	EUR	25.000,00	420.000,00	1,04
			14.159.766,75	34,95
Frankreich				
ARKEMA	EUR	1.109,00	117.332,20	0,29
ELIS SA	EUR	11.558,00	183.656,62	0,45
ESSILORLUXOTTICA	EUR	3.126,00	486.530,64	1,21
SCHNEIDER ELECTRIC SE	EUR	625,00	82.925,00	0,20
			870.444,46	2,15
Deutschland				
SAP SE	EUR	5.000,00	594.200,00	1,47
			594.200,00	1,47
Spanien				
ALMIRALL SA	EUR	20.615,00	303.246,65	0,75
ARIMA REAL ESTATE SOCIMI SA	EUR	9.113,00	83.110,56	0,21
LIBERBANK SA	EUR	371.744,00	115.091,94	0,28
			501.449,15	1,24
Niederlande				
EXOR NV	EUR	6.000,00	405.360,00	1,00
			405.360,00	1,00
Luxemburg				
SES	EUR	20.000,00	128.400,00	0,32
TENARIS SA	EUR	30.000,00	275.760,00	0,68
			404.160,00	1,00
Schweiz				
STMICROELECTRONICS NV	EUR	9.360,00	286.462,80	0,71
			286.462,80	0,71
Großbritannien				
CNH INDUSTRIAL NV	EUR	13.931,00	193.989,18	0,47
			193.989,18	0,47
Belgien				
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	EUR	1.658,00	100.822,98	0,24
			100.822,98	0,24
Summe Aktien			17.516.655,32	43,23
Summe an einer amtlichen Wertpapierbörse notierte übertragbare Wertpapiere			36.695.435,91	90,56
An einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere				
Renten und andere Schuldtitel				
Italien				
BPER BANCA 1,875% 20-07/07/2025	EUR	600.000,00	624.922,75	1,54
CASSA DEPOSITI E 2,125% 18-27/09/2023	EUR	400.000,00	420.803,42	1,04
CREDITO EMILIANO 0,875% 14-05/11/2021	EUR	600.000,00	602.745,05	1,49
ESSELUNGA SPA 0,875% 17-25/10/2023	EUR	600.000,00	609.777,38	1,50
ITALGAS SPA 1,625% 17-19/01/2027	EUR	100.000,00	107.899,84	0,27
PIAGGIO & C 3,625% 18-30/04/2025	EUR	125.000,00	127.425,30	0,31
SIAS 3,375% 14-13/02/2024	EUR	500.000,00	542.034,68	1,34
UNIPOL GRUPPO SPA 3,25% 20-23/09/2030	EUR	250.000,00	281.813,44	0,70
			3.317.421,86	8,19
Summe Renten und andere Schuldtitel			3.317.421,86	8,19
Summe an einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere			3.317.421,86	8,19
Gesamtwertpapierbestand			40.012.857,77	98,75

PIR Evoluzione Italia

Wertpapierbestand zum 30.06.2021

Bezeichnung	Währung	Anzahl	Marktwert in EUR	% des Nettovermögen
An einer amtlichen Wertpapierbörse notierte übertragbare Wertpapiere				
Aktien				
Italien				
A2A SPA	EUR	428.466,00	738.675,38	2,43
AVIO SPA	EUR	30.000,00	373.200,00	1,23
BANCA FARMAFACTORING SPA	EUR	105.225,00	889.151,25	2,92
BANCA IFIS SPA	EUR	17.268,00	231.391,20	0,76
BANCO BPM SPA	EUR	56.998,00	154.635,57	0,51
BUZZI UNICEM SPA	EUR	20.000,00	447.400,00	1,47
CATTOLICA ASSICURAZIONI SC	EUR	40.328,00	282.497,64	0,93
CERVED GROUP SPA	EUR	74.133,00	726.503,40	2,39
CY4GATE SPA	EUR	11.665,00	109.067,75	0,36
DANIELI & CO-RSP	EUR	35.176,00	511.459,04	1,68
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	EUR	17.863,00	201.762,59	0,66
DELONGHI SPA	EUR	8.617,00	316.588,58	1,04
ENAV SPA	EUR	172.716,00	656.320,80	2,16
ENEL SPA	EUR	120.000,00	939.840,00	3,09
ENI SPA	EUR	50.000,00	513.500,00	1,69
ERG SPA	EUR	18.604,00	465.100,00	1,53
FINECOBANK SPA	EUR	58.049,00	853.320,30	2,80
GAROFALO HEALTH CARE SPA	EUR	26.790,00	151.095,60	0,50
ILLIMITY BANK SPA	EUR	27.313,00	321.200,88	1,06
INDEL B SPA	EUR	4.905,00	130.963,50	0,43
INTESA SANPAOLO SPA	EUR	437.515,00	1.019.191,19	3,35
IREN SPA	EUR	243.985,00	587.027,91	1,93
LEONARDO SPA	EUR	72.919,00	496.724,23	1,63
LU-VE SPA	EUR	6.540,00	111.180,00	0,37
MONCLER SPA	EUR	8.945,00	510.401,70	1,68
NEWLAT FOOD SPA	EUR	19.644,00	133.972,08	0,44
NEXI SPA	EUR	48.168,00	891.589,68	2,93
OPENJOBMETIS SPA AGENZIA PER	EUR	24.068,00	235.866,40	0,78
PIOVAN SPA	EUR	59.884,00	482.665,04	1,59
POSTE ITALIANE SPA	EUR	62.987,00	702.305,05	2,31
PRYSMIAN SPA	EUR	20.000,00	604.600,00	1,99
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	EUR	7.431,00	358.174,20	1,18
SESA SPA	EUR	7.622,00	1.074.702,00	3,53
TAMBURI INVESTMENT PARTNERS	EUR	50.000,00	413.500,00	1,36
TECHNOGYM SPA	EUR	48.051,00	517.028,76	1,69
TELECOM ITALIA-RSP	EUR	549.478,00	245.506,77	0,80
TINEXTA SPA	EUR	23.838,00	782.363,16	2,57
UNIPOL GRUPPO SPA	EUR	160.832,00	738.540,54	2,43
ZIGNAGO VETRO SPA	EUR	30.924,00	519.523,20	1,70
			19.438.535,39	63,90
Frankreich				
ELIS SA	EUR	16.173,00	256.988,97	0,84
ESSILORLUXOTTICA	EUR	5.042,00	784.736,88	2,59
SCHNEIDER ELECTRIC SE	EUR	848,00	112.512,64	0,37
			1.154.238,49	3,80
Spanien				
ALMIRALL SA	EUR	28.705,00	422.250,55	1,39
ARIMA REAL ESTATE SOCIMI SA	EUR	12.753,00	116.307,36	0,38
LIBERBANK SA	EUR	513.069,00	158.846,16	0,52
			697.404,07	2,29
Deutschland				
SAP SE	EUR	5.000,00	594.200,00	1,95
			594.200,00	1,95
Luxemburg				
SES	EUR	20.000,00	128.400,00	0,42
TENARIS SA	EUR	50.000,00	459.600,00	1,51
			588.000,00	1,93
Niederlande				
EXOR NV	EUR	6.484,00	438.059,04	1,44
			438.059,04	1,44
Schweiz				
STMICROELECTRONICS NV	EUR	12.905,00	394.957,53	1,30
			394.957,53	1,30
Großbritannien				
CNH INDUSTRIAL NV	EUR	25.000,00	348.125,00	1,14
			348.125,00	1,14
Belgien				
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	EUR	2.368,00	143.998,08	0,47
			143.998,08	0,47
Summe Aktien			23.797.517,60	78,22

GENERALI SMART FUNDS

Wertpapierbestand zum 30.06.2021

Bezeichnung	Währung	Anzahl	Marktwert in EUR	% des Nettovermögen
Renten und andere Schuldtitel				
Italien				
ACQUIRENTE UNI 2,8% 19-20/02/2026	EUR	400.000,00	442.664,99	1,45
BANCA FARMAFACTORING SPA 2% 17-29/06/2022	EUR	300.000,00	305.727,85	1,00
BANCA IFIS SPA 1,75% 20-25/06/2024	EUR	149.000,00	150.332,55	0,49
BANCO DESIO BRIA 0,875% 17-12/09/2024	EUR	300.000,00	310.731,99	1,02
CATTOLICA ASSICURAZIONI SC 17-14/12/2047 FRN	EUR	300.000,00	339.215,31	1,11
CREDITO EMILIANO 1,125% 19-17/01/2024	EUR	200.000,00	207.341,63	0,68
CREDITO EMILIANO 19-25/10/2025 FRN	EUR	450.000,00	464.143,23	1,53
ENI SPA 21-31/12/2061 FRN	EUR	198.000,00	198.049,38	0,65
PIRELLI & C SPA 1,375% 18-25/01/2023	EUR	300.000,00	305.076,09	1,00
SACE SPA 15-10/02/2049 FRN	EUR	500.000,00	518.785,37	1,72
SALINI IMPREGILO SPA 1,75% 17-26/10/2024	EUR	250.000,00	248.293,74	0,82
UNICREDIT SPA 21-05/07/2029 FRN	EUR	279.000,00	279.718,36	0,92
UNIPOLSAI 14-30/06/2049 FRN	EUR	300.000,00	330.916,80	1,09
			4.100.997,29	13,48
Niederlande				
EXOR NV 2,25% 20-29/04/2030	EUR	200.000,00	222.328,18	0,73
FERRARI NV 1,5% 20-27/05/2025	EUR	291.000,00	302.564,36	0,99
			524.892,54	1,72
Summe Renten und andere Schuldtitel			4.625.889,83	15,20
Summe an einer amtlichen Wertpapierbörse notierte übertragbare Wertpapiere			28.423.407,43	93,42
An einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere				
Renten und andere Schuldtitel				
Italien				
BPER BANCA 1,875% 20-07/07/2025	EUR	400.000,00	416.615,16	1,37
ESSELUNGA SPA 0,875% 17-25/10/2023	EUR	300.000,00	304.888,69	1,00
PIAGGIO & C 3,625% 18-30/04/2025	EUR	125.000,00	127.425,30	0,42
UNIPOL GRUPPO SPA 3,25% 20-23/09/2030	EUR	167.000,00	188.251,38	0,62
			1.037.180,53	3,41
Summe Renten und andere Schuldtitel			1.037.180,53	3,41
Summe an einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere			1.037.180,53	3,41
Gesamtwertpapierbestand			29.460.587,96	96,83

Prisma CONSERVADOR

Wertpapierbestand zum 30.06.2021

Bezeichnung	Währung	Anzahl	Marktwert in EUR	% des Nettovermögen
Aktien/Anteile aus OGAW/OGA				
Aktien/Anteile aus Investmentfonds				
Luxemburg				
AIS AMUNDI MSCI EM ETF EUR C	EUR	22.100,00	117.295,75	0,48
ALPHA UCITS SICAV FAIR OAKS DYNAMIC CREDIT FD L EUR C	EUR	805,00	830.582,90	3,41
AMUNDI EUROPEAN EQUITY VALUE I2 EUR C	EUR	105,00	236.284,65	0,97
AXA WORLD FD EURO INFLATION BDS I EUR C	EUR	9.095,00	1.343.513,40	5,52
BGF-EUROPEAN VALUE FD D2 EUR C	EUR	2.782,00	240.058,78	0,99
BNP PARIBAS EUROPE SMALL CAP I C	EUR	512,00	163.292,16	0,67
BSF-FIXED INCOME STRATEGIES FD I2 EUR C	EUR	5.043,00	660.683,43	2,71
DWS INVEST EURO-GOV BONDS TFC	EUR	8.065,60	868.906,98	3,57
ELEVA UCITS FD EUROPEAN SELECTION FD I EUR C	EUR	123,00	210.638,73	0,87
ESI FDS M&G EUROPEAN CR INVT FD F EUR C	EUR	10.919,00	1.168.660,57	4,80
GENERALI INVESTMENTS SICAV - EURO BOND-A	EUR	12.321,00	1.697.722,91	6,97
GENERALI INVESTMENTS SICAV - EURO CORPORATE BOND-A	EUR	6.677,00	1.544.356,72	6,34
GENERALI INVESTMENTS SICAV - EURO SHORT TERM BOND-A	EUR	23.730,00	3.278.536,80	13,48
GENERALI INVESTMENTS SICAV - SRI EUROPEAN EQUITY-A	EUR	921,00	192.999,23	0,79
JPMORGAN FD EUROPE STRATEGIC GROWTH FD C EUR C	EUR	4.508,00	207.683,56	0,85
LFIS VISION UCITS PREMIA IS EUR C	EUR	530,00	565.881,00	2,32
NINETY ONE GSF EUROPEAN EQUITY FD A A	EUR	1.914,00	114.093,54	0,47
X IBOXX EUROZONE GOV BD YIELD PLUS 1-3 U 1 C	EUR	16.902,00	2.433.549,96	10,00
			15.874.741,07	65,21
Irland				
ISHARES II MSCI EUROPE SRI UCITS ETF EUR C	EUR	4.200,00	247.086,00	1,01
ISHARES III CORE CORP BD UCITS ETF EUR D	EUR	10.918,00	1.474.585,08	6,06
ISHARES V SPAIN GOVT BD UCITS ETF EUR D	EUR	3.712,00	653.998,72	2,69
METZLER EUROPEAN SM COMP SUSTNBY B	EUR	0,01	3,53	0,00
NOMURA GLOBAL DYNAMIC BOND FD I EUR HGD C	EUR	10.704,00	1.448.357,17	5,95
			3.824.030,50	15,71
Frankreich				
GENERALI TRESORERIE C	EUR	668,00	2.337.565,80	9,60
LYXOR IBEX35 (DR) UCITS ETF EUR CAP AND/OR DIS	EUR	1.635,00	144.256,05	0,59
			2.481.821,85	10,19
Summe Aktien/Anteile aus Investmentfonds			22.180.593,42	91,11
Summe Aktien/Anteile aus OGAW/OGA			22.180.593,42	91,11
Gesamtwertpapierbestand			22.180.593,42	91,11

Prisma MODERADO

Wertpapierbestand zum 30.06.2021

Bezeichnung	Währung	Anzahl	Marktwert in EUR	% des Nettovermögens
Aktien/Anteile aus OGAW/OGA				
Aktien/Anteile aus Investmentfonds				
Luxemburg				
AIS AMUNDI MSCI EM ETF EUR C	EUR	37.076,00	196.780,87	1,13
ALPHA UCITS SICAV FAIR OAKS DYNAMIC CREDIT FD L EUR C	EUR	414,00	427.156,92	2,46
AMUNDI EUROPEAN EQUITY VALUE I2 EUR C	EUR	217,00	488.321,61	2,81
AXA WORLD FD EURO INFLATION BDS I EUR C	EUR	5.238,00	773.757,36	4,46
BGF-EUROPEAN VALUE FD D2 EUR C	EUR	3.754,00	323.932,66	1,87
BNP PARIBAS EUROPE SMALL CAP I C	EUR	1.083,00	345.401,19	1,99
BSF-FIXED INCOME STRATEGIES FD I2 EUR C	EUR	2.363,00	309.576,63	1,78
DWS INVEST EURO-GOV BONDS TFC	EUR	4.940,00	532.186,20	3,07
ELEVA UCITS FD EUROPEAN SELECTION FD I EUR C	EUR	292,00	500.052,92	2,88
ESI FDS M&G EUROPEAN CR INVT FD F EUR C	EUR	6.357,00	680.389,71	3,92
GENERALI INVESTMENTS SICAV - EURO BOND-A	EUR	6.456,00	889.578,70	5,13
GENERALI INVESTMENTS SICAV - EURO CORPORATE BOND-A	EUR	3.633,00	840.294,74	4,84
GENERALI INVESTMENTS SICAV - EURO SHORT TERM BOND-A	EUR	11.051,00	1.526.806,16	8,81
GENERALI INVESTMENTS SICAV - SRI EUROPEAN EQUITY-A	EUR	3.178,00	665.962,61	3,84
JPMORGAN FD EUROPE STRATEGIC GROWTH FD C EUR C	EUR	9.813,00	452.084,91	2,61
LFIS VISION UCITS PREMIA IS EUR C	EUR	310,00	330.987,00	1,91
NINETY ONE GSF EUROPEAN EQUITY FD A A	EUR	7.955,00	474.197,55	2,73
X IBOXX EUROZONE GOV BD YIELD PLUS 1-3 U 1 C	EUR	8.638,00	1.243.699,24	7,18
			11.001.166,98	63,42
Irland				
ISHARES II MSCI EUROPE SRI UCITS ETF EUR C	EUR	14.554,00	856.211,82	4,94
ISHARES III CORE CORP BD UCITS ETF EUR D	EUR	6.630,00	895.447,80	5,16
ISHARES V SPAIN GOVT BD UCITS ETF EUR D	EUR	1.739,00	306.385,72	1,77
NOMURA GLOBAL DYNAMIC BOND FD I EUR HGD C	EUR	5.700,00	771.266,43	4,44
			2.829.311,77	16,31
Frankreich				
GENERALI TRESORERIE C	EUR	455,00	1.592.204,25	9,18
LYXOR IBEX35 (DR) UCITS ETF EUR CAP AND/OR DIS	EUR	3.634,00	320.627,82	1,84
			1.912.832,07	11,02
Summe Aktien/Anteile aus Investmentfonds			15.743.310,82	90,75
Summe Aktien/Anteile aus OGAW/OGA			15.743.310,82	90,75
Gesamtwertpapierbestand			15.743.310,82	90,75

Prisma DECIDIDO

Wertpapierbestand zum 30.06.2021

Bezeichnung	Währung	Anzahl	Marktwert in EUR	% des Nettovermögen
Aktien/Anteile aus OGAW/OGA				
Aktien/Anteile aus Investmentfonds				
Luxemburg				
AIS AMUNDI MSCI EM ETF EUR C	EUR	32.249,00	171.161,57	2,28
ALPHA UCITS SICAV FAIR OAKS DYNAMIC CREDIT FD L EUR C	EUR	125,00	128.972,50	1,72
AMUNDI EUROPEAN EQUITY VALUE I2 EUR C	EUR	156,00	351.051,48	4,67
AXA WORLD FD EURO INFLATION BDS I EUR C	EUR	1.522,00	224.829,84	2,99
BGF-EUROPEAN VALUE FD D2 EUR C	EUR	2.583,00	222.887,07	2,97
BNP PARIBAS EUROPE SMALL CAP I C	EUR	1.026,00	327.222,18	4,36
BSF-FIXED INCOME STRATEGIES FD I2 EUR C	EUR	986,00	129.175,86	1,72
DWS INVEST EURO-GOV BONDS TFC	EUR	2.145,00	231.080,85	3,08
ELEVA UCITS FD EUROPEAN SELECTION FD I EUR C	EUR	278,00	476.077,78	6,34
ESI FDS M&G EUROPEAN CR INVT FD F EUR C	EUR	2.292,00	245.312,76	3,27
GENERALI INVESTMENTS SICAV - EURO BOND-A	EUR	1.350,00	186.017,85	2,48
GENERALI INVESTMENTS SICAV - EURO CORPORATE BOND-A	EUR	640,00	148.028,80	1,97
GENERALI INVESTMENTS SICAV - EURO SHORT TERM BOND-A	EUR	2.312,00	319.425,92	4,25
GENERALI INVESTMENTS SICAV - SRI EUROPEAN EQUITY-A	EUR	2.299,00	481.764,65	6,41
JPMORGAN FD EUROPE STRATEGIC GROWTH FD C EUR C	EUR	5.873,00	270.569,11	3,60
LFIS VISION UCITS PREMIA IS EUR C	EUR	40,00	42.708,00	0,57
NINETY ONE GSF EUROPEAN EQUITY FD A A	EUR	6.323,00	376.914,03	5,02
X IBOXX EUROZONE GOV BD YIELD PLUS 1-3 U 1 C	EUR	2.253,00	324.386,94	4,32
			4.657.587,19	62,02
Irland				
ISHARES II MSCI EUROPE SRI UCITS ETF EUR C	EUR	8.245,00	485.053,35	6,46
ISHARES III CORE CORP BD UCITS ETF EUR D	EUR	2.138,00	288.758,28	3,84
ISHARES V SPAIN GOVT BD UCITS ETF EUR D	EUR	544,00	95.844,64	1,28
METZLER EUROPEAN SM COMP SUSTNBY B	EUR	0,00	0,12	0,00
NOMURA GLOBAL DYNAMIC BOND FD I EUR HGD C	EUR	1.656,00	224.073,19	2,98
			1.093.729,58	14,56
Frankreich				
GENERALI TRESORERIE C	EUR	167,00	584.391,45	7,79
LYXOR IBEX35 (DR) UCITS ETF EUR CAP AND/OR DIS	EUR	2.685,00	236.897,55	3,15
			821.289,00	10,94
Summe Aktien/Anteile aus Investmentfonds			6.572.605,77	87,52
Summe Aktien/Anteile aus OGAW/OGA			6.572.605,77	87,52
Gesamtwertpapierbestand			6.572.605,77	87,52

Responsible Protect 90

Wertpapierbestand zum 30.06.2021

Bezeichnung	Währung	Anzahl	Marktwert in EUR	% des Nettovermögen
Aktien/Anteile aus OGAW/OGA				
Aktien/Anteile aus Investmentfonds				
Luxemburg				
DPAM L-BONDS EMERGING MARKETS SUSTAINABLE F C	EUR	7.145,00	971.720,00	4,86
DPAM L-BONDS EUR QUALITY SUSTAINABLE F C	EUR	3.135,00	1.956.835,65	9,80
DPAM L-BONDS GOVERNMENT SUSTAINABLE HEDGED F C	EUR	1.193,00	1.955.732,62	9,79
FISCH UMBRELLA FD FISCH CONVERT GLOBAL SUST FD BEU C	EUR	3.717,00	492.651,18	2,47
GENERALI INVESTMENTS SICAV - SRI AGEING POPULATION-B	EUR	3.151,00	496.140,71	2,48
NORDEA 1 EMERGING STARS EQUITY FD BI EUR C	EUR	2.637,00	490.719,33	2,46
SISF GLOBAL SUST. GROWTH C EUR HGD C	EUR	6.397,00	1.980.042,94	9,91
UBS ETF MSCI WORLD SOCIALLY RESPU, A D	EUR	8.612,00	1.004.159,20	5,03
VARIOPARTNER SICAV TARENO GLOBAL WATER SOL FD W EUR C	EUR	1.640,00	510.958,40	2,55
			9.858.960,03	49,35
Frankreich				
GEMCHINA I C	EUR	6.152,00	1.002.222,32	5,02
GEMEQUITY I C	EUR	1.926,00	501.511,14	2,51
LA FRANÇAISE TRÉSORERIE ISR I C	EUR	12,00	1.288.785,60	6,45
MANDARINE ACTIVE F C	EUR	716,00	509.820,64	2,55
SYCOMORE SELECTION CREDIT I C	EUR	13.026,00	1.748.089,20	8,75
SYCOMORE SHARED GROWTH A C	EUR	958,00	470.799,52	2,36
			5.521.228,42	27,64
Irland				
ISHARES II MSCI EUROPE SRI UCITS ETF EUR C	EUR	8.650,00	508.879,50	2,55
ISHARES IV MSCI USA SRI UCITS ETF USD C	EUR	293.404,00	3.040.252,25	15,22
			3.549.131,75	17,77
Österreich				
CONVERTINVEST FAIR & SUSTAINABLE FD I	EUR	4.079,00	485.074,68	2,43
			485.074,68	2,43
Summe Aktien/Anteile aus Investmentfonds			19.414.394,88	97,19
Summe Aktien/Anteile aus OGAW/OGA			19.414.394,88	97,19
Gesamtwertpapierbestand			19.414.394,88	97,19

JP Morgan Global Equity Fund

Wertpapierbestand zum 30.06.2021

Bezeichnung	Währung	Anzahl	Marktwert in EUR	% des Nettovermögen
An einer amtlichen Wertpapierbörse notierte übertragbare Wertpapiere				
Aktien				
Vereinigte Staaten				
ABBVIE INC	USD	24.429,00	2.751.682,56	1,57
ADVANCED MICRO DEVICES	USD	14.451,00	1.357.382,43	0,77
ALPHABET INC-CL C	USD	2.867,00	7.185.619,44	4,11
AMAZON.COM INC	USD	1.948,00	6.701.431,68	3,82
ANALOG DEVICES INC	USD	21.017,00	3.618.286,72	2,07
APPLE INC	USD	25.473,00	3.488.782,08	1,99
APPLIED MATERIALS INC	USD	7.971,00	1.135.070,40	0,65
BOOKING HOLDINGS INC	USD	972,00	2.126.823,48	1,21
BOSTON SCIENTIFIC CORP	USD	65.557,00	2.803.217,32	1,60
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	USD	37.003,00	2.472.540,46	1,41
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	USD	4.039,00	624.792,91	0,36
CERIDIAN HCM HOLDING INC	USD	6.449,00	618.588,08	0,35
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	USD	3.184,00	2.297.096,80	1,31
CIGNA CORP	USD	6.702,00	1.588.843,14	0,91
COCA-COLA CO/THE	USD	59.378,00	3.212.943,58	1,83
COMCAST CORP-CLASS A	USD	39.483,00	2.251.320,66	1,28
CONOCOPHILLIPS	USD	53.454,00	3.255.348,60	1,86
CONSTELLATION BRANDS INC-A	USD	4.986,00	1.166.175,54	0,67
EASTMAN CHEMICAL CO	USD	17.719,00	2.068.693,25	1,18
EATON CORP PLC	USD	15.899,00	2.355.913,82	1,34
ELI LILLY & CO	USD	4.631,00	1.062.907,12	0,61
FEDEX CORP	USD	4.111,00	1.226.434,63	0,70
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	USD	4.834,00	1.237.794,04	0,71
INGERSOLL-RAND INC	USD	45.540,00	2.222.807,40	1,27
INTUIT INC	USD	3.016,00	1.478.352,72	0,84
LOWES COS INC	USD	6.533,00	1.267.206,01	0,72
LYFT INC-A	USD	50.620,00	3.061.497,60	1,75
MASTERCARD INC - A	USD	11.054,00	4.035.704,86	2,30
MICROSOFT CORP	USD	26.361,00	7.141.194,90	4,08
MORGAN STANLEY	USD	7.901,00	724.442,69	0,41
NETFLIX INC	USD	2.507,00	1.324.222,47	0,76
NEXTERA ENERGY INC	USD	23.997,00	1.758.500,16	1,00
NORFOLK SOUTHERN CORP	USD	6.487,00	1.721.714,67	0,98
OREILLY AUTOMOTIVE INC	USD	4.803,00	2.719.506,63	1,55
PROGRESSIVE CORP	USD	9.287,00	912.076,27	0,52
PROLOGIS INC	USD	14.302,00	1.709.518,06	0,98
REGENERON PHARMACEUTICALS	USD	2.465,00	1.376.801,10	0,79
SOUTHWEST AIRLINES CO	USD	15.083,00	800.756,47	0,46
STANLEY BLACK & DECKER INC	USD	4.937,00	1.012.035,63	0,58
STATE STREET CORP	USD	33.618,00	2.766.089,04	1,58
SUN COMMUNITIES INC	USD	5.599,00	959.668,60	0,55
TESLA INC	USD	1.003,00	681.739,10	0,39
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	USD	2.489,00	1.255.625,83	0,72
T-MOBILE US INC	USD	10.206,00	1.478.134,98	0,84
TRUIST FINANCIAL CORP	USD	25.964,00	1.441.002,00	0,82
UNITEDHEALTH GROUP INC	USD	5.426,00	2.172.787,44	1,24
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	USD	4.536,00	914.593,68	0,52
WELLS FARGO & CO	USD	70.197,00	3.179.222,13	1,81
WORKDAY INC-CLASS A	USD	3.897,00	930.369,78	0,53
XCEL ENERGY INC	USD	9.424,00	620.853,12	0,35
YUM! BRANDS INC	USD	22.202,00	2.553.896,06	1,46
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	USD	10.974,00	1.764.838,68	1,01
			110.592.846,82	63,12
Frankreich				
CAPGEMINI SE	EUR	10.976,00	2.108.663,02	1,20
SCHNEIDER ELECTRIC SE	EUR	19.901,00	3.131.327,06	1,79
SOCIETE GENERALE SA	EUR	61.802,00	1.822.014,06	1,04
VINCI SA	EUR	31.118,00	3.320.886,23	1,90
			10.382.890,37	5,93
Deutschland				
ADIDAS AG	EUR	8.805,00	3.277.696,56	1,88
ALLIANZ SE-REG	EUR	8.661,00	2.160.008,10	1,23
DEUTSCHE POST AG-REG	EUR	12.979,00	882.873,42	0,50
RWE AG	EUR	19.002,00	688.653,46	0,39
VOLKSWAGEN AG-PREF	EUR	10.181,00	2.549.954,44	1,46
			9.559.185,98	5,46
Niederlande				
AKZO NOBEL NV	EUR	6.923,00	855.480,51	0,49
ASML HOLDING NV	EUR	2.832,00	1.945.896,82	1,11
HEINEKEN NV	EUR	11.626,00	1.409.059,34	0,80
NXP SEMICONDUCTORS NV	USD	13.901,00	2.859.713,72	1,64
			7.070.150,39	4,04
Irland				
RYANAIR HOLDINGS PLC	EUR	100.926,00	1.910.222,77	1,09
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	USD	16.571,00	1.457.088,03	0,83
TRANE TECHNOLOGIES PLC	USD	16.799,00	3.093.367,86	1,77
			6.460.678,66	3,69

GENERALI SMART FUNDS

Wertpapierbestand zum 30.06.2021

Bezeichnung	Währung	Anzahl	Marktwert in EUR	% des Nettovermögens
Dänemark				
CARLSBERG AS-B	DKK	10.168,00	1.895.588,81	1,08
NOVO NORDISK A/S-B	DKK	37.766,00	3.164.354,60	1,81
ORSTED A/S	DKK	2.774,00	389.298,94	0,22
			5.449.242,35	3,11
Großbritannien				
BP PLC	GBP	249.772,00	1.086.894,45	0,62
DIAGEO PLC	GBP	22.988,00	1.099.096,57	0,63
RIO TINTO PLC	GBP	11.755,00	966.050,14	0,55
TAYLOR WIMPEY PLC	GBP	460.219,00	1.010.550,78	0,58
			4.162.591,94	2,38
Japan				
TOYOTA MOTOR CORP	JPY	25.400,00	2.222.127,97	1,27
			2.222.127,97	1,27
Italien				
UNICREDIT SPA	EUR	154.538,00	1.823.502,81	1,04
			1.823.502,81	1,04
Südkorea				
SAMSUNG ELECTR-GDR REG S	USD	986,00	1.758.531,00	1,00
			1.758.531,00	1,00
Schweiz				
ZURICH INSURANCE GROUP AG	CHF	4.344,00	1.744.440,08	1,00
			1.744.440,08	1,00
Finnland				
NORDEA BANK ABP	SEK	150.720,00	1.678.826,92	0,96
			1.678.826,92	0,96
Taiwan				
TAIWAN SEMICONDUCTOR-SP ADR	USD	11.060,00	1.328.969,60	0,76
			1.328.969,60	0,76
Spanien				
ENDESA SA	EUR	18.529,00	449.578,65	0,26
IBERDROLA SA	EUR	69.553,00	847.924,24	0,48
			1.297.502,89	0,74
Mexiko				
WALMART DE MEXICO SAB DE CV	MXN	379.453,00	1.240.100,41	0,71
			1.240.100,41	0,71
Kanada				
TC ENERGY CORP	CAD	19.100,00	946.130,97	0,54
			946.130,97	0,54
Österreich				
ERSTE GROUP BANK AG	EUR	17.424,00	639.316,98	0,36
			639.316,98	0,36
Indien				
HDFC BANK LTD-ADR	USD	8.617,00	630.075,04	0,36
			630.075,04	0,36
Peru				
CREDICORP LTD	USD	3.454,00	418.313,94	0,23
			418.313,94	0,23
Summe Aktien			169.405.425,12	96,70
Summe an einer amtlichen Wertpapierbörse notierte übertragbare Wertpapiere			169.405.425,12	96,70
Aktien/Anteile aus OGAW/OGA				
Aktien/Anteile aus Investmentfonds				
Luxemburg				
JPMORGAN LIQUIDITY FD USD LIQ LVNAV FD X USD D	USD	7.121.470,93	7.121.470,93	4,06
			7.121.470,93	4,06
Summe Aktien/Anteile aus Investmentfonds			7.121.470,93	4,06
Summe Aktien/Anteile aus OGAW/OGA			7.121.470,93	4,06
Gesamtwertpapierbestand			176.526.896,05	100,76

Allgemeine Informationene

1. Änderung der Portfoliozusammensetzung

Einzelheiten zu den Änderungen in der Portfoliozusammensetzung während des am 30. Juni 2021 endenden Berichtszeitraumes stehen den Anteilshabern am eingetragenen Sitz der SICAV sowie bei der deutschen Informationsstelle zur Verfügung und können auf Anfrage kostenfrei bezogen werden.

2. Devisentermingeschäfte

Zum 30. Juni 2021 hatte der Teilfonds GENERALI SMART FUNDS - Fidelity World Fund Devisentermingeschäfte mit ROYAL BANK OF CANADA abgeschlossen.

Zu kaufen		Zu verkaufen		Fälligkeitsdatum	Verpflichtung in USD	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in USD
14.951,27	USD	116.076,56	HKD	02/07/2021	14.947,09	4,07
						4,07

Zum 30. Juni 2021 hatte der Teilfonds GENERALI SMART FUNDS - Premium Flexible Bond Devisentermingeschäfte mit BOFA SECURITIES EUROPE S.A, CREDIT AGRICOLE CORPORATE AND INVESTMENT BANK, JP MORGAN LONDON, BNP PARIBAS SECURITIES SERVICES and CITIGROUP GLOBAL MARKETS EUROPE AG abgeschlossen.

Zu kaufen		Zu verkaufen		Fälligkeitsdatum	Verpflichtung in EUR	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in EUR
1.450.650,14	EUR	2.300.000,00	AUD	17/09/2021	1.456.018,74	(3.680,70)
190.000.000,00	JPY	1.447.192,33	EUR	17/09/2021	1.447.192,33	(4.947,83)
175.000.000,00	RUB	1.925.621,84	EUR	20/09/2021	1.925.621,84	63.187,39
1.688.213,45	USD	35.000.000,00	MXN	17/09/2021	2.905.878,06	(45.009,75)
1.632.150,00	USD	45.000.000,00	TWD	17/09/2021	2.738.193,33	15.192,66
28.417.563,89	EUR	34.150.000,00	USD	17/09/2021	28.796.694,49	(335.973,47)
30.000.000,00	ZAR	2.136.338,11	USD	17/09/2021	3.573.121,51	(47.435,62)
643.312,01	EUR	12.000.000,00	ZAR	17/09/2021	708.669,09	(57.893,24)
2.088.263,96	USD	30.000.000,00	ZAR	17/09/2021	3.532.583,39	6.966,95
						(409.593,61)

Zum 30. Juni 2021 hatte der Teilfonds GENERALI SMART FUNDS - Serenity Devisentermingeschäfte mit DEUTSCHE BANK AG abgeschlossen.

Zu kaufen		Zu verkaufen		Fälligkeitsdatum	Verpflichtung in EUR	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in EUR
9.282.955,90	EUR	11.091.000,00	USD	30/07/2021	9.352.390,59	(64.252,70)
						(64.252,70)

Zum 30. Juni 2021 hatte der Teilfonds GENERALI SMART FUNDS – JPM Morgan Global Equity Devisentermingeschäfte mit BNP PARIBAS SECURITIES SERVICES abgeschlossen.

Zu kaufen		Zu verkaufen		Fälligkeitsdatum	Verpflichtung in EUR	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in EUR
218.309,39	USD	182.615,18	EUR	30/07/2021	216.563,45	1.624,25
148.676.612,83	EUR	177.644.057,15	USD	30/07/2021	177.644.057,15	(1.230.038,08)
						(1.228.413,83)

3. Offene Positionen bei Terminkontrakten

Zum 30. Juni 2021 hatte der Teilfonds GENERALI SMART FUNDS - Premium Flexible Bond Positionen in Terminkontrakten mit JP MORGAN LONDON abgeschlossen.

Bezeichnung	Währung	Anzahl Nennwert	Verpflichtung in EUR	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in EUR
EURO-BOBL FUTURE 08/09/2021	EUR	5,143,000.00	50.00	(6.000,00)
US 5YR NOTE FUTURE (CBT) 30/09/2021	USD	3,562,767.47	43.00	7.365,19
				1.365,19

Zum 30. Juni 2021 hatte der Teilfonds GENERALI SMART FUNDS - Serenity Positionen in Terminkontrakten mit JP MORGAN LONDON abgeschlossen.

Bezeichnung	Währung	Anzahl Nennwert	Verpflichtung in EUR	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in EUR
EURO OAT FUTU FR GOVT 10YR 6% 08/09/2021	EUR	3.191.344,00	26,00	(11.960,00)
EURO-BOBL FUTURE 08/09/2021	EUR	1.234.320,00	12,00	(1.560,00)
EURO-BUND FUTURE 08/09/2021	EUR	2.466.000,00	24,00	(26.040,00)
				(39.560,00)

4. Swapgeschäften

4.1 Credit Default Swaps

Zum 30. Juni 2021 hatte der Teilfonds GENERALI SMART FUNDS - Premium Flexible Bond Credit Default Swap-Kontrakte mit BOFA SECURITIES EUROPE S.A. abgeschlossen.

Nennwert	Kauf-Verkauf	Ausfalldeckung	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierte Gewinn/(Verlust) in EUR
3.500.000,00	Kauf	ITRX XOVER CDSI S35 5Y CORP 20/06/2026	EUR	20/06/2026	(866.549,68)
4.000.000,00	Kauf	CDX EM CDSI S35 5Y PRC CORP 20/06/2026	USD	20/06/2026	88.243,94
					(778.305,74)

5. Optionskontrakte

Zum 30. Juni 2020 war der Teilfonds GENERALI SMART FUNDS - GENERATION Next Protect in dem folgenden Optionskontrakt engagiert:

Bezeichnung	Fälligkeitsdatum	Nominal	Währung	Käufer / Verkäufer	Basispreis	Prämie	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in EUR
Gap Put Option	15.01.2025	Abgesicherter Fonds-NIW: bezüglich eines Fondsbewertungstags der offizielle aggregierte Nettoinventarwert des abgesicherten Fonds über alle seine abgesicherten Fondsanteilsklassen, wie vom Fonds vom Fondsverwalter gemäß den Regeln des abgesicherten Fonds und des Prospekts des abgesicherten Fonds berechnet und veröffentlicht	EUR	K	Bezüglich der jeweiligen abgesicherten Fondsanteilsklasse der abgesicherte Betrag per abgesichertem Fondsanteil dieser jeweiligen abgesicherten Fondsanteilsklasse am finalen Bewertungstag, wie von der Berechnungsstelle ermittelt	0,29% des vierteljährlichen Nominalbetrags	0,00

6. Nachfolgende Ereignisse

Der Verwaltungsrat hat beschlossen, die Teilfonds GENERATION Plus Protect I und GENERATION Plus Protect II mit Wirkung zum 8. Juli 2021 aufzulösen.

Zusätzliche Informationen

1. Verordnung über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und der Weiterverwendung („SFTR“)

Die Verordnung (EU) 2015/2365 über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften und der Weiterverwendung, „SFTR“, („Verordnung“) wurde am 23. Dezember 2015 im Amtsblatt der Europäischen Union veröffentlicht und trat am 12. Januar 2016 in Kraft.

Ihr Zweck besteht darin, die Transparenz am Markt für (i) Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (d. h. hauptsächlich Wertpapierleihen, Pensionsgeschäfte und umgekehrte Pensionsgeschäfte sowie Lombardgeschäfte) („SFT“) und (ii) die Weiterverwendung von Finanzinstrumenten zu verbessern.

a) Globale Daten

Zum 30. Juni 2020 belief sich der Marktwert von Vermögenswerten, die in Wertpapierleihen eingesetzt wurden, ausgedrückt als Anteil am NIW und als Anteil der insgesamt verleihbaren Vermögenswerte auf:

GENERALI SMART FUNDS	Leihgeschäfte auf Wertpapiere (% des NIW)	Leihgeschäfte auf Wertpapiere (Insgesamt verleihbare Vermögenswerte - % des Portfolios zum Marktwert)
Premium Flexible Bond	19,71%	21,04%
Serenity	34,69%	37,39%

b) Konzentrationsdaten

Zum 30. Juni 2020 waren die Emittenten von Sicherheiten im Rahmen von Wertpapierleihen folgende:

GENERALI SMART FUNDS	Währung des Teilfonds	Erhaltener Sicherheitsbetrag (in der Währung des Teilfonds)*
Premium Flexible Bond	EUR	
Buoni ordinari del Tesoro		4.380.301,80
Orange SA		2.434.645,45
AstraZeneca PLC		2.395.806,08
Diageo PLC		1.962.055,21
Barclays Bank PLC		1.876.030,75
SSE PLC		1.650.733,75
Bonos and Obligaciones del Estado		1.157.440,57
Italien		975.305,51
Schindler Holding AG		962.145,01
Großbritannien		718.635,44
Serenity	EUR	
United Kingdom		8.660.781,42
British American Tobacco PLC		5.208.314,12
Buoni ordinari del Tesoro		4.001.730,60
Prudential PLC		2.967.210,98
Enel SpA		2.466.862,20
Frankreich		1.601.954,86
Spanien		1.434.337,97
Ferguson PLC		900.624,74
Deutschland		879.470,10
Rio Tinto PLC		734.086,98

* Währung der Sicherheit ist dieselbe Währung wie die des Teilfonds, nämlich EUR.

GENERALI SMART FUNDS

c) Vollständige Transaktionsdaten

Zum 30. Juni 2021 belief sich die Laufzeit der für Wertpapierleihen erhaltenen Sicherheiten in der Währung des Teilfonds auf:

GENERALI SMART FUNDS	Währung des Teilfonds	Ein Monat bis Drei Monate	Drei Monate bis ein Jahr	Mehr als ein Jahr	Offene Laufzeit	Gesamt
Premium Flexible Bond	EUR	975.305,51	6.814.947,25	1.876.076,01	8.846.770,80	18.513.099,57
Serenity	EUR	-	4.001.730,60	12.576.544,35	12.277.099,02	28.855.373,97

Zum 30. Juni 2021 bestehen die für Wertpapierleihaktivitäten erhaltenen Sicherheiten aus Staatsanleihen. Die Qualität der erhaltenen Sicherheiten wird als „Investment Grade“ eingestuft.

Zum 30. Juni 2021, lauteten die für Wertpapierleihen erhaltenen Sicherheiten auf Euro.

Die Laufzeiten aller Wertpapierleihgeschäfte sind in der nachstehenden Tabelle angegeben:

GENERALI SMART FUNDS	Währung des Teilfonds	Mehr als ein Jahr	Offene Laufzeit	Gesamt
Premium Flexible Bond	EUR	12.436.505,91	1.399.238,88	13.835.744,79
Serenity	EUR	17.578.581,36	9.629.641,17	27.208.222,53

Unabhängig von der Laufzeit können alle Wertpapierleihgeschäfte von der Verwaltungsgesellschaft, Generali Investments Luxembourg S.A., jederzeit gekündigt werden.

d) Daten zur Weiterverwendung von Sicherheiten

Es wurden keine Barsicherheiten im Rahmen der Wertpapierleihen reinvestiert, ausgenommen der Reinvestitionen von BNP Paribas Securities Services.

Aus reinvestierten Barsicherheiten entstandene Renditen sind Teil der Erträge aus Wertpapierleihe, wie in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens auf dem Konto „Erträge von Wertpapierleihgeschäften“ ausgewiesen.

e) Verwahrung der erhaltenen Sicherheiten

Die im Rahmen von Wertpapierleihen erhaltenen Sicherheiten werden zum 30. Juni 2021 von der Verwalhrstelle BNP Paribas Securities Services verwahrt.

f) Verwahrung gestellter Sicherheiten

Zum 30. Juni 2021 stellte der Teilfonds keine Sicherheiten für Wertpapierleihen.

g) Daten zu Renditen und Kosten der jeweiligen SFTs

Die Gesamrenditen der Wertpapierleihen werden zwischen Generali Smart Fund und der Verwaltungsgesellschaft Generali Investments Luxembourg S.A. aufgeteilt.

Für das zum 30. Juni 2021 endende Periode belief sich die Summe der Renditen in EUR und ausgedrückt als Anteil der Gesamrendite auf:

	Betrag (in EUR)	% der Gesamrenditen*
GENERALI SMART FUNDS	6.180,78	84,20%
Generali Investments Luxembourg S.A.	1.159,41	15,80%

* 85,00% und 15,00% entsprechen den vertraglich vereinbarten Sätzen.

Die oben aufgeführten Renditen, die der Verwaltungsgesellschaft zugutekommen, werden als Kosten für den Fund betrachtet.