



Wien 1, Schwarzenbergplatz 3

## **KONZEPT : ERTRAG dynamisch**

**Miteigentumsfonds gemäß Investmentfondsgesetz 2011 idgF (InvFG)**

### **Halbjahresbericht**

vom 16. Oktober 2021 bis 15. April 2022

# Vermögensaufstellung zum 15. 04. 2022

ISIN	Wertpapier-Bezeichnung	Zins- satz	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge	Bestand	Kurs in Wertpapier- währung	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
<b>INVESTMENTZERTIFIKATE</b>								
<b>INVESTMENTZERTIFIKATE auf AMERIKANISCHE DOLLAR lautend</b>								
LU2304587079	AAF A.US EQ. X1DLA		6.500	0	31.500	104,2300	3.041.872,42	2,47
LU0683601610	AB S.I-SEL.US EQU.P.S1ADL		9.000	0	53.000	60,6200	2.976.661,88	2,41
LU1880399362	AMF-PIO.GL.EQ. I UH.DLA		0	0	530	1.482,7600	728.088,94	0,59
LU0823411292	BNPP US SMALL CAP I CAP		0	0	3.000	405,7900	1.127.873,26	0,91
LU2351337501	FCH JPM.US E.F. ZDLA		0	0	6.800	1.043,3600	6.573.259,83	5,33
LU0742536872	FIDELITY FDS-EM.MKTS IADL		0	0	16.000	16,5600	245.481,08	0,20
LU0360484686	MSI-US ADVANTAGE FD Z DL		0	0	17.000	126,4800	1.992.087,83	1,61
LU0226954369	ROB.CGF-R.BP US PR.EQ.IDL		1.200	0	7.400	426,5400	2.924.348,91	2,37
LU0181496059	SISF EMERG.ASIA C ACC		0	0	5.000	56,3047	260.826,89	0,21
LU0640477955	THREA.L-US CO.CORE EQ.IU		0	0	20.500	82,0940	1.559.204,15	1,26
						Summe	21.429.705,19	17,36
<b>INVESTMENTZERTIFIKATE auf EURO lautend</b>								
FR0014003FW1	A.MW CPAP U.E. EOD		0	0	42.000	43,1500	1.812.300,00	1,47
LU1955039661	AAF PARN.US SUST.EQ. X1EO		3.000	0	14.200	163,1040	2.316.076,80	1,88
LU2070304063	AF-A.F.E.C.B Z UNHEOA		0	0	1.200	951,8900	1.142.268,00	0,93
LU2085674971	AF-A.F.E.G.B Z UHEOA		0	0	1.600	933,1100	1.492.976,00	1,21
LU0568619042	AF-AF.ABS.RET.FO.IEOC		0	0	200	996,6900	199.338,00	0,16
LU0996179858	AIS-A.I.MSCI JP IECAPEO		0	0	6	108.154,8000	648.928,80	0,52
LU1437016543	AIS-A.I.MSCI N.AM.UCETFDR		0	0	50.000	109,7920	5.489.600,00	4,45
LU1050468989	AIS-A.IDX EO CORP.SRI IEC		200	0	2.100	1.103,9000	2.318.190,00	1,88
LU1050469953	AIS-A.IN.JPM EMU G.IG IED		0	0	1.500	973,6900	1.460.535,00	1,18
LU1437018598	AIS-A.IN.JPM EMU G.IGUETF		0	0	78.000	51,0070	3.978.546,00	3,22
LU1681048804	AIS-AM. S+P500UETF EOC		0	23.300	19.700	77,7206	1.531.095,82	1,24
LU1681045370	AIS-AM.ID.MSCI EM.MA.EOC		0	0	245.000	4,7947	1.174.701,50	0,95
LU1861137484	AIS-AM.MSCI EUR.SRI AOE A		12.500	11.000	66.500	71,4300	4.750.095,00	3,85
LU1861138961	AIS-AMEMSRIPAB UETFDR DLA		15.500	0	61.000	55,3650	3.377.265,00	2,73
LU2233156749	AIS-I.M.JAP.SRI UC.E.DRYN		0	0	29.000	44,2400	1.282.960,00	1,04
LU1861136247	AIS-IX MSCI US SRI AHEOA		8.000	0	83.000	93,1930	7.735.019,00	6,27
LU0390718863	AIS-MSCI PXJSRIPAB IECEO A		50	50	700	2.953,1100	2.067.177,00	1,67
FR0013016607	AM. EO L.RAT.SRII2C3D		55	153	190	9.825,9610	1.866.932,59	1,51
AT0000A0XD86	AM. EUR.CORP.BD SVTA		0	0	850	1.108,2100	941.978,50	0,76
AT0000A13YU6	AM. GBL H.Y.BD L.D. T		2.000	0	4.000	101,9800	407.920,00	0,33
AT0000822762	AM. SEL.EUR.STOCK T		1.244	0	3.550	177,4600	629.983,00	0,51
LU1931975079	AM.I.S.-A.P.EO CO.UEDREOD		12.000	0	108.000	19,0685	2.059.398,00	1,67
AT0000706734	AM.OE.SO.EO CO.BD		4.000	0	23.000	120,6000	2.773.800,00	2,25
AT0000822671	AM.OE.SO.EO GO.BD T		123.000	0	798.000	14,2200	11.347.560,00	9,19
AT0000A05TK3	AM.OE.SO.EO ST BD T		0	0	11.750	115,9400	1.362.295,00	1,10
AT0000A0FM79	AM.OEK.SOZ.EURO AGG.BD T		2.900	0	24.900	118,3700	2.947.413,00	2,39
LU2085674625	AMF-EME.MKTS BD Z HDGEOD		250	630	740	832,7200	616.212,80	0,50
LU1931975152	AMUN.I.S.-A.P.E.G.UEDREOD		18.500	0	220.000	18,9970	4.179.340,00	3,38
LU1931974858	AMUN.I.S.-A.P.USA UEDRDLD		0	0	59.000	31,0100	1.829.590,00	1,48
AT0000A0G4E2	BD STRAT.EURO S.T.3Y A		33.000	0	83.000	10,2100	847.430,00	0,69
AT0000A08ZU3	C 70 T		0	0	13.400	267,3200	3.582.088,00	2,90
LU1111643042	ELEVA-EL.EUR.SEL.I EO ACC		0	0	1.620	1.780,1500	2.883.843,00	2,34
LU2351330167	FCH UBS EU.OP.SUS.EQ.ZEOA		240	0	730	985,5900	719.480,70	0,58
DE0006289499	I.EB.R.G.G.5.5-10.5 U.ETF		8.600	2.000	15.100	130,0050	1.963.075,50	1,59
LU1900234946	INV.-JAP.E.AD. SEOA		0	0	53.000	11,7700	623.810,00	0,51
IE00BYPC1H27	ISHSIV - ISH.CHIN.BD.U.ET		60.000	44.000	78.000	5,2200	407.160,00	0,33
IE00B7LW6Y90	ISHSV-ITAL.GOV T BD EO D		4.200	0	7.200	157,3000	1.132.560,00	0,92
IE00B7LGZ558	ISV FRAN.GOV.BD U.ETF EOD		0	0	6.000	144,1900	865.140,00	0,70
LU0802113760	JPM-EM.MK.OP. JPMEMO I AEO		1.000	0	8.000	157,8400	1.262.720,00	1,02
LU0219424131	MFS M.-EUR.RESEARCH I1 EO		0	0	1.700	311,2700	529.159,00	0,43
LU1435387458	NIF(L)I-LSUSGEQ HFAEOA		0	0	12.500	229,9300	2.874.125,00	2,33
FR0010251108	ODDO BHF AV.EUR.CI-EO		0	0	1	407.280,3000	407.280,30	0,33
LU0255979238	PICTET-JAP.EQ.OPPO.I EO		0	0	5.300	109,0700	578.071,00	0,47
IE00BYYPQZ50	RUSS.INV.-ACA.EUR.EQ.BEOA		0	0	91.000	14,3900	1.309.490,00	1,06
LU0279459969	SISF GL-EM.MKT.OPP. CA EO		0	0	24.000	25,6374	615.297,60	0,50
LU0579408591	STATE STR.E.M.ESG S.EE.IE		0	0	74.000	16,6492	1.232.040,80	1,00
LU0446734872	UBSFLS-MSCI CANADA CDAD		0	0	10.000	40,5550	405.550,00	0,33

ISIN	Wertpapier-Bezeichnung	Zins-satz	Käufe / Zugänge Stück / Nominale	Verkäufe / Abgänge (Nom. in 1.000, ger.)	Bestand	Kurs in Wertpapier-währung	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds-vermögen
IE00BGCZ0719	VANG.I.S.EURO.I.L.BIPLEOA		3.000	0	3.000	134,9815	404.944,50	0,33
IE00BLNMYC90	X(IE)-S+P 500 E.WGHT 1CDL		10.000	0	10.000	76,0500	760.500,00	0,62
Summe							97.143.260,21	78,70
<b>INVESTMENTZERTIFIKATE auf JAPANISCHE YEN lautend</b>								
IE00BF2S5G73	MAN F.-M.GLG J.CA.E.IXXYN		0	0	8.500	10.213,0000	635.020,20	0,51
Summe							635.020,20	0,51
<b>SUMME INVESTMENTZERTIFIKATE</b>							<u>119.207.985,60</u>	96,57
<b>SUMME WERTPAPIERVERMÖGEN</b>							<u>119.207.985,60</u>	96,57

## OPTIONEN

Call / Put	Bezeichnung / Underlying	Fälligkeit	Whg.	Anzahl / Betrag	Kontrakt-kurs	aktueller Optionspreis in EUR	%-Anteil am Fonds-vermögen
<b>OPTIONEN</b>							
<b>GEKAUFTE OPTIONEN(LONG)</b>							
Put	DJ EURO STOXX50 INX (SX5E) PUT APR. 22 3650	14.04.2022	EUR	24	0,0100	2,40	0,00
Put	S & P 500 INX (S500) PUT APR. 22 4260	14.04.2022	USD	3	0,2500	69,49	0,00
Put	S & P 500 INX (S500) PUT JUL. 22 4410	15.07.2022	USD	1	177,9000	16.482,14	0,01
Summe						<u>16.554,03</u>	0,01
<b>SUMME OPTIONEN</b>						<u>16.554,03</u>	0,01

## FINANZTERMINKONTRAKTE

Bezeichnung / Underlying	Fälligkeit	Whg.	Anzahl / Betrag	Kontrakt-kurs	unrealisiertes Ergebnis in EUR	%-Anteil am Fonds-vermögen
<b>FINANZTERMINKONTRAKTE</b>						
<b>AKTIENINDEXKONTRAKTE</b>						
DJ EURO STOXX 50 FUT (STXE) JUNI 22	17.06.2022	EUR	-44	3.777,0000	-40.110,00	-0,03
DJ EURO STOXX BKS FUT (FESB) JUNI 22	17.06.2022	EUR	111	85,9000	5.720,00	0,00
E-MINI S&P 500 INX FUT (ES) JUNI 22	17.06.2022	USD	-4	4.386,7500	25.154,03	0,02
E-MINI S&P HEALTH C.SECT.IDX FUT (XAV) JUNI 22	17.06.2022	USD	6	1.383,8000	-900,54	0,00
MSCI EMERG. MKTS. INX FUT (MEM) JUNI 22	17.06.2022	USD	8	1.099,1000	2.742,39	0,00
NIKKEI 225 INX FUT (NIY) JUNI 22	09.06.2022	JPY	-3	26.845,0000	-22.658,26	-0,02
Summe					<u>-30.052,38</u>	-0,03
<b>ZINSTERMINKONTRAKTE</b>						
EURO BUND FUT (FGBL) JUNI 22	08.06.2022	EUR	12	154,9500	-79.500,00	-0,06
EURO-BTP FUT (FBTP) JUNI 22	08.06.2022	EUR	3	133,5000	-13.590,00	-0,01
ULTRA TEN-YEAR US TREAS.NOTE FUT (UXY) JUNI 22	21.06.2022	USD	-4	129,1094	45.252,93	0,04
Summe					<u>-47.837,07</u>	-0,03
<b>SUMME FINANZTERMINKONTRAKTE</b>					<u>-77.889,45</u>	-0,06

## BANKGUTHABEN / BANKVERBINDLICHKEITEN

### BANKGUTHABEN / BANKVERBINDLICHKEITEN

WÄHRUNG	FONDSWÄHRUNG	BETRAG FONDSWÄHRUNG
EURO	EUR	723.043,50
AMERIKANISCHE DOLLAR	EUR	2.251.710,90
BRITISCHE PFUND	EUR	24.394,45
HONGKONG DOLLAR	EUR	130.664,91
JAPANISCHE YEN	EUR	313.693,73
KANADISCHE DOLLAR	EUR	14.195,96
SCHWEIZER FRANKEN	EUR	609.461,43
INITIAL MARGIN / VARIATION MARGIN	EUR	291.840,36
<b>SUMME BANKGUTHABEN / BANKVERBINDLICHKEITEN</b>		<b>4.359.005,24</b>

	EUR	%
<b>Wertpapiervermögen</b>	<b>119.207.985,60</b>	<b>96,57</b>
Finanzterminkontrakte	-77.889,45	-0,06
Optionen	16.554,03	0,01
Zinsenerträge (inkl. negativer Habenzinsen)	-684,10	0,00
Bankguthaben / Bankverbindlichkeiten	4.359.005,24	3,53
Sollzinsen	-39,59	0,00
Gebührenverbindlichkeiten	-65.872,10	-0,05
<b>FONDSVERMÖGEN</b>	<b>123.439.059,63</b>	<b>100,00</b>

15.04.2022

#### Ausschüttungsanteile AT0000811351

Anzahl der ausgegebenen Anteile	STK	356.498
Anteilswert	EUR	100,10

#### Thesaurierungsanteile mit KEST-Abzug AT0000811369

Anzahl der ausgegebenen Anteile	STK	532.345
Anteilswert	EUR	164,83

#### Erläuterungen zur Vermögensaufstellung:

Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Gesamttrendite-Swaps im Sinne der Verordnung (EU) 2015/2365 wurden, insoweit sie laut Fondsbestimmungen zulässig sind, im Berichtszeitraum nicht eingesetzt.

## DEVISENKURSE

### DEVISENKURSE

WÄHRUNG	EINHEITEN	KURS
AMERIKANISCHE DOLLAR	1 EUR =	1,07935 USD
BRITISCHE PFUND	1 EUR =	0,82910 GBP
HONGKONG DOLLAR	1 EUR =	8,46530 HKD
JAPANISCHE YEN	1 EUR =	136,70510 JPY
KANADISCHE DOLLAR	1 EUR =	1,36250 CAD
SCHWEIZER FRANKEN	1 EUR =	1,01830 CHF

### Risikohinweis:

Es besteht das Risiko, dass aufgrund von Kursbildungen auf illiquiden Märkten die Bewertungskurse bestimmter Wertpapiere von ihren tatsächlichen Veräußerungen abweichen können (Bewertungsrisiko).

Der Wert eines Anteiles ergibt sich aus der Teilung des Gesamtwertes des Kapitalanlagefonds einschließlich der Erträge durch die Zahl der Anteile. Der Gesamtwert des Kapitalanlagefonds ist aufgrund der jeweiligen Kurswerte der zu ihm gehörigen Wertpapiere, Geldmarktinstrumente und Bezugsrechte zuzüglich des Wertes der zum Fonds gehörenden Finanzanlagen, Geldbeträge, Guthaben, Forderungen und sonstigen Rechte abzüglich Verbindlichkeiten, von der Depotbank zu ermitteln.

Das Nettovermögen wird nach folgenden Grundsätzen ermittelt:

- Der Wert von Vermögenswerten, welche an einer Börse oder an einem anderen geregelten Markt notiert oder gehandelt werden, wird grundsätzlich auf der Grundlage des letzten verfügbaren Kurses ermittelt.
- Sofern ein Vermögenswert nicht an einer Börse oder an einem anderen geregelten Markt notiert oder gehandelt wird oder sofern für einen Vermögenswert, welcher an einer Börse oder an einem anderen geregelten Markt notiert oder gehandelt wird, der Kurs den tatsächlichen Marktwert nicht angemessen widerspiegelt, wird auf die Kurse zuverlässiger Datenprovider oder alternativ auf Marktpreise gleichartiger Wertpapiere oder andere anerkannte Bewertungsmethoden zurückgegriffen.

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

ISIN	Wertpapier-Bezeichnung	Zins- satz	Whg.	Käufe / Zugänge Lots / Stück / Nominale (Nom. in 1.000, ger.)	Verkäufe / Abgänge
<b>WERTPAPIERE</b>					
LU0404498767	HSBC GIF-EURO H.Y.BD XCEO		EUR	0	17.100
<b>OPTIONEN</b>					
---	DJ EURO STOXX50 INX (SX5E) PUT APR. 22 3900		EUR	300	300
---	DJ EURO STOXX50 INX (SX5E) PUT MÄR. 22 3650		EUR	380	380
---	DJ EURO STOXX50 INX (SX5E) PUT MÄR. 22 3900		EUR	670	670
---	10-YEAR TREAS.NOTE FUT (TYA) CALL APR. 22		USD	3.000.000	3.000.000
---	S & P 500 INX (\$500) PUT OKT. 21 4220		USD	0	500
---	S & P 500 INX (\$500) PUT OKT. 21 3820		USD	700	0
---	S & P 500 INX (\$500) CALL JAN. 22 4700		USD	300	300
---	S & P 500 INX (\$500) PUT JAN. 22 3900		USD	600	600
---	S & P 500 INX (\$500) PUT JAN. 22 4250		USD	500	500
<b>FINANZTERMINKONTRAKTE</b>					
---	DJ EURO STOXX 50 FUT (STXE) DEZ. 21		EUR	8	0
---	DJ EURO STOXX 50 FUT (STXE) MÄR. 22		EUR	46	46
---	DJ STOXX 600 FUT (FXXP) DEZ. 21		EUR	22	0
---	EURO BOBL FUT (FGBM) DEZ. 21		EUR	2	2
---	EURO BOBL FUT (FGBM) MÄR. 22		EUR	2	2

ISIN	Wertpapier-Bezeichnung	Zins- satz	Whg.	Käufe / Zugänge Lots / Stück / Nominale (Nom. in 1.000, ger.)	Verkäufe / Abgänge Nominale (Nom. in 1.000, ger.)
---	EURO BUND FUT (FGBL) DEZ. 21		EUR	4	8
---	EURO BUND FUT (FGBL) MÄR. 22		EUR	18	18
---	EURO SCHATZ FUT (FGBS) JUN. 22		EUR	3	3
---	EURO SCHATZ FUT (FGBS) MÄR. 22		EUR	3	3
---	EURO-BTP FUT (FBTP) DEZ. 21		EUR	0	8
---	EURO-BTP FUT (FBTP) MÄR. 22		EUR	8	8
---	SHORT EURO-BTP FUT (FBTS) JUN. 22		EUR	3	3
---	SHORT EURO-BTP FUT (FBTS) MÄR. 22		EUR	3	3
---	STXE 600 BASIC RES. INX FUT (FSTS) DEZ. 21		EUR	0	18
---	FTSE 100 INX FUT (FFI) DEZ. 21		GBP	8	8
---	FTSE 100 INX FUT (FFI) JUN. 22		GBP	5	5
---	FTSE 100 INX FUT (FFI) MÄR. 22		GBP	8	8
---	FTSE 250 INX FUT (FMCS) DEZ. 21		GBP	13	13
---	FTSE 250 INX FUT (FMCS) JUN. 22		GBP	8	8
---	FTSE 250 INX FUT (FMCS) MÄR. 22		GBP	13	13
---	H-SHARES INX FUT (HSE) FEB. 22		HKD	8	8
---	H-SHARES INX FUT (HSE) JAN. 22		HKD	8	8
---	H-SHARES INX FUT (HSE) MÄR. 22		HKD	8	8
---	NIKKEI 225 INX FUT (NIY) MÄR. 22		JPY	3	3
---	E-MINI S&P 500 INX FUT (ES) DEZ. 21		USD	3	4
---	E-MINI S&P 500 INX FUT (ES) MÄR. 22		USD	5	5
---	E-MINI S&P HEALTH C.S.SEC.IDX FUT (XAV) DEZ.		USD	0	5
---	MSCI EMERG. MKTS. INX FUT (MEM) MÄR. 22		USD	12	12
---	MSCI EMERG. MKTS. MINI INX FUT (MEM) DEZ. 21		USD	0	12
---	ULTRA TEN-YEAR US TREAS.NOTE FUT (UXY) MÄR.		USD	2	2

Wien, im April 2022

Amundi Austria GmbH

Gabriele Tavazzani

Christian Mathern

Mag. Hannes Roubik

Alois Steinböck