

IQAM BALANCED PROTECT 95

Miteigentumsfonds nach österreichischem Recht (OGAW gem. §§ 46 iVm 66ff Investmentfondsgesetz)
verwaltet durch die Spängler IQAM Invest GmbH

AT0000919394 / AT0000817994 / AT0000A28776

HALBJAHRESBERICHT

vom 1. August 2019 bis 31. Jänner 2020

INHALTSVERZEICHNIS

Angaben zur Spängler IQAM Invest GmbH.....	1
Angaben zum IQAM Balanced Protect 95	2
Fondsdetails in EUR.....	2
Wertpapiervermögen und derivative Produkte zum 31.01.2020.....	3
Aufgliederung des Fondsvermögens zum 31.01.2020 in EUR.....	5

ANGABEN ZUR SPÄNGLER IQAM INVEST GMBH

- Fondsverwaltung:** Spängler IQAM Invest GmbH
Franz-Josef-Straße 22, 5020 Salzburg
T +43 505 8686-0, F +43 505 8686-869
office@iqam.com, www.iqam.com
- Aufsichtsrat:** KR Heinrich Spängler, Vorsitzender
Vorsitzender des Aufsichtsrates, Bankhaus Carl Spängler & Co. AG
- Prof. Dr. Andreas Grünbichler, stv. Vorsitzender
Mitglied des Vorstandes, CFO
Wüstenrot Versicherungs-AG und Bausparkasse Wüstenrot AG
- Univ.-Prof. Dr. Dr.h.c. Josef Zechner, stv. Vorsitzender
Mitglied der Wissenschaftlichen Leitung, Spängler IQAM Invest
- Dr. Jochen Stich (bis 08.11.2019)
Innovations-und Projektportfolio Management
Porsche Holding Gesellschaft m.b.H.
- Dr. Werner G. Zenz
Sprecher des Vorstandes, Bankhaus Carl Spängler & Co. AG
- Dr. Hans Georg Mustafa
Vorsitzender des Verwaltungsausschusses, Ärztekammer für Salzburg
- Sylvia Peroutka
vom Betriebsrat entsandt
- Dr. Peter Pavlicek
vom Betriebsrat entsandt
- Tim Kottke, MA
vom Betriebsrat entsandt
- Geschäftsführung:** Mag. Werner Eder
- Dr. Markus Ploner, CFA, MBA
- Dr. Thomas Steinberger

ANGABEN ZUM IQAM BALANCED PROTECT 95

Fondsmanager:	Spängler IQAM Invest GmbH, Salzburg
Depotbank:	State Street Bank International GmbH Filiale Wien
Abschlussprüfer:	KPMG Austria GmbH, Wirtschaftsprüfungs- und Steuerberatungsgesellschaft, Linz
ISIN:	AT0000919394 Ausschüttende Tranche AT0000817994 Thesaurierende Tranche AT0000A28776 Ausschüttende Tranche

FONDSDETAILS IN EUR

	31.01.2020	31.07.2019
Fondsvermögen	41.558.769,85	20.826.534,87
Ausschüttende Tranche (ISIN AT0000919394)		
Rechenwert je Anteil	37,33	37,57
Anzahl der ausgegebenen Anteile	35.869,311	35.866,870
Thesaurierende Tranche (ISIN AT0000817994)		
Rechenwert je Anteil	55,43	55,41
Anzahl der ausgegebenen Anteile	324.637,265	330.380,581
Ausschüttende Tranche (ISIN AT0000A28776)		
Rechenwert je Anteil	101,94	101,79
Anzahl der ausgegebenen Anteile	217.997,907	11.504,000

WERTPAPIERVERMÖGEN UND DERIVATIVE PRODUKTE ZUM 31.01.2020

ISIN	Wertpapier-Bezeichnung	Zinssatz	Käufe / Zugänge Stück / Nominale (Nom. in 1.000, ger.)	Verkäufe / Abgänge	Bestand	Kurs in Wertpapier- währung	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
ZUM AMTLICHEN HANDEL ODER EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT ZUGELASSENE WERTPAPIERE								
ANLEIHEN auf EURO lautend								
XS1700578724	DEXIA CL 17/27 MTN	1,000	0	0	400	108,4195	433.678,00	1,04
XS1957425702	EX.IM.B.CHIN 19/22 MTN	0,300	0	0	400	100,6725	402.690,00	0,97
BE0001764183	FLAEMISCHE GEM. 16-26 MTN	0,375	300	0	300	103,6020	310.806,00	0,75
XS0863484035	HETA ASS.RES. 12/22	2,375	0	0	500	107,6890	538.445,00	1,30
XS1647481206	INDONESIA 17/24 MTN REGS	2,150	500	0	500	107,0855	535.427,50	1,29
IE00BDHDP444	IRLAND 2028	0,900	0	0	400	109,1775	436.710,00	1,05
XS1936100483	ISRAEL 19/29 MTN	1,500	0	0	300	109,7200	329.160,00	0,79
ES0001352550	JUNTA GALICI 19/29	1,450	0	0	300	109,7055	329.116,50	0,79
XS1766612672	POLEN 18/26 MTN	1,125	0	0	200	107,9890	215.978,00	0,52
SK4000016069	PRIMA BK.SL. 19/26 MTN	0,010	600	0	600	100,2725	601.635,00	1,45
SI0002103685	SLOWENIEN 17-27	1,250	0	0	400	109,6835	438.734,00	1,05
BE6313645127	WALLONNE,REG 19/26	0,250	0	0	400	102,6340	410.536,00	0,99
						Summe	4.982.916,00	11,99
SUMME DER ZUM AMTLICHEN HANDEL ODER EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT ZUGELASSENEN WERTPAPIERE							4.982.916,00	11,99
INVESTMENTZERTIFIKATE								
INVESTMENTZERTIFIKATE auf AMERIKANISCHE DOLLAR lautend								
AT0000A0XJG0	IQAM QUALITY EQUITY US (AT)		1.900	0	7.500	190,8100	1.296.850,93	3,12
						Summe	1.296.850,93	3,12
INVESTMENTZERTIFIKATE auf EURO lautend								
LU1681041031	AIS-AM.FL.RA.DL COR. EOC		15.000	0	15.000	50,2566	753.849,00	1,81
LU1681045370	AIS-AM.MSCI EM EOC		88.000	40.000	148.000	4,3172	638.945,60	1,54
LU1681042609	AIS-AM.MSCI EUROPE A		2.400	0	2.400	245,2680	588.643,20	1,42
FR0011550185	BNPPEFR-S+P 500 UETF EOC		140.000	0	140.000	13,8034	1.932.476,00	4,65
AT0000A0R2P9	IQAM BOND CORPORATE (AT)		1.500	0	2.630	1.297,4100	3.412.188,30	8,21
AT0000A0NVA9	IQAM BOND EUR FLEXD (AT)		12.700	0	23.000	127,2900	2.927.670,00	7,04
AT0000A189R7	IQAM BOND LC EMERGING MARKETS (AT)		8.300	2.000	15.300	122,9000	1.880.370,00	4,52
AT0000A1W491	IQAM MARKET TIMING EUROPE (AT)		4.000	0	4.000	116,5500	466.200,00	1,12
AT0000A0R2Q7	IQAM QUALITY EQUITY EUROPE (AT)		540	0	750	2.097,3700	1.573.027,50	3,79
AT0000A0XBW4	IQAM SHORTTERM EUR (AT)		24.000	0	55.500	105,4800	5.854.140,00	14,09
AT0000A0NVC5	IQAM SRI SPARTRUST M (AT)		15.000	0	23.500	124,9100	2.935.385,00	7,06
IE00B14X4Q57	IS EO G.B. 1-3YR U.ETF EOD		8.500	0	8.500	144,3050	1.226.592,50	2,95
DE000A0D8Q07	ISHARES EURO STOXX U.ETF		23.000	9.000	23.000	39,8500	916.550,00	2,21
IE00B3F81R35	ISHSIII-C.EO CORP.B.EODIS		17.100	6.500	26.300	134,6200	3.540.506,00	8,52
IE00B4WXJJ64	ISHSIII-C.EO GOV. B.EODIS		14.000	4.500	9.500	132,5550	1.259.272,50	3,03
LU1829218319	MUL-LYX.EO F.R.N.UETF ACC		14.000	13.000	7.500	100,5880	754.410,00	1,82
LU0496786574	MUL-LYX.S+P500UC.ETF DEO		25.000	12.000	37.000	30,1160	1.114.292,00	2,68
AT0000A0VPF3	STRATEGIC COMMODITY FUND (AT)		50	0	105	6.659,3400	699.230,70	1,68
IE00B53H0131	UBS ETFS-CMCI C.SF DLAACC		12.900	4.000	12.900	54,3100	700.599,00	1,69
						Summe	33.174.347,30	79,83
SUMME INVESTMENTZERTIFIKATE							34.471.198,23	82,95
SUMME WERTPAPIERVERMÖGEN							39.454.114,23	94,94

Bezeichnung / Underlying	Fälligkeit	Whg.	Anzahl / Betrag	Kontrakt- kurs	unrealisiertes Ergebnis in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
FINANZTERMINKONTRAKTE						
ZINSTERMINKONTRAKTE						
EURO BUND FUTURE (FGBL) MÄRZ 20	06.03.2020	EUR	-15	174,5700	-27.000,00	-0,06
				Summe	-27.000,00	-0,06
DEISENTERMINKONTRAKTE						
CROSS RATE EUR/USD FUTURE MÄRZ 20	16.03.2020	USD	7	1,1059	-7.493,20	-0,02
				Summe	-7.493,20	-0,02
SUMME FINANZTERMINKONTRAKTE					-34.493,20	-0,08

BANKGUTHABEN / BANKVERBINDLICHKEITEN

WÄHRUNG	FONDSWÄHRUNG	BETRAG FONDSWÄHRUNG
EURO	EUR	1.940.969,70
AMERIKANISCHE DOLLAR	EUR	76.183,52
AUSTRALISCHE DOLLAR	EUR	466,56
BRITISCHE PFUND	EUR	42.251,17
INITIAL MARGIN / VARIATION MARGIN	EUR	83.959,80
SUMME BANKGUTHABEN / BANKVERBINDLICHKEITEN		2.143.830,75

DEISENKURSE

WÄHRUNG	KURS		
AMERIKANISCHE DOLLAR	1 EUR =	1,10350	USD
AUSTRALISCHE DOLLAR	1 EUR =	1,64565	AUD
BRITISCHE PFUND	1 EUR =	0,84225	GBP

WÄHREND DES BERICHTSZEITRAUMES GETÄTIGTE KÄUFE UND VERKÄUFE, SOWEIT SIE NICHT IN DER VERMÖGENSAUFSTELLUNG GENANNT SIND

ISIN	Wertpapier-Bezeichnung	Zinssatz	Whg.	Käufe / Zugänge Lots / Stück / Nominale (Nom. in 1.000, ger.)	Verkäufe / Abgänge
WERTPAPIERE					
EU000A1G0DY0	EFSS 17/27 MTN	0,875	EUR	0	300
XS2063496546	MORE BOLIGKR 19/24	0,010	EUR	500	500
FI4000315841	SUOMEN HYPO. 18/23 MTN	0,375	EUR	0	200
AT0000A1XMJ6	IQAM QUALITY EQUITY MARKET NEUTRAL EU-		EUR	0	4.100
IE00B4L60045	ISHSIII-EO C.BD 1-5YR EOD		EUR	0	9.000
FINANZTERMINKONTRAKTE					
---	EURO BUND FUTURE (FGBL) DEZ. 19		EUR	15	15
---	EURO BUND FUTURE (FGBL) SEP. 19		EUR	15	0
---	CROSS RATE EUR/USD FUTURE DEZ. 19		USD	7	7
---	CROSS RATE EUR/USD FUTURE SEP. 19		USD	0	7

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

AUFGliederung DES FONDSVERMÖGENS ZUM 31.01.2020 IN EUR

	EUR	%
Wertpapiervermögen	39.454.114,23	94,94
Finanzterminkontrakte	-34.493,20	-0,08
Zinsenansprüche (inkl. negativer Habenzinsen)	22.525,43	0,05
Bankguthaben / Bankverbindlichkeiten	2.143.830,75	5,16
Gebührenverbindlichkeiten	-27.207,36	-0,07
FONDSVERMÖGEN	41.558.769,85	100,00

Salzburg, im Februar 2020

Spängler IQAM Invest GmbH

Mag. Werner Eder

Dr. Markus Ploner, CFA, MBA

Dr. Thomas Steinberger