



Wien 1, Schwarzenbergplatz 3

## **KONZEPT : ERTRAG konservativ**

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

### **Halbjahresbericht**

vom 16. Oktober 2019 bis 15. April 2020

# Vermögensaufstellung zum 15. 04. 2020

ISIN	Wertpapier-Bezeichnung	Zinssatz	Käufe / Zugänge Stück / Nominale	Verkäufe / Abgänge (Nom. in 1.000, ger.)	Bestand	Kurs in Wertpapierwährung	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fondsvermögen
<b>INVESTMENTZERTIFIKATE</b>								
<b>INVESTMENTZERTIFIKATE auf AMERIKANISCHE DOLLAR lautend</b>								
LU0849851471	AAF ARIST.US EQU. I		0	1.200	11.800	171,9040	1.860.125,81	1,14
LU0683601610	AB S.I-SEL.US EQU.P.S1ADL		0	11.600	31.400	37,0900	1.067.974,32	0,65
LU0823411292	BNPP US SMALL CAP I CAP		0	1.600	1.600	245,0500	359.541,49	0,22
LU0248041781	JPM-AMERICA EQ.JPMAE IADL		700	2.420	11.500	218,0200	2.299.156,35	1,41
LU1670627170	M+G(L)11-NAVL DLAC		5.000	53.900	36.900	15,3079	517.983,96	0,32
LU0360484686	MSI-US ADVANTAGE FD Z DL		3.900	0	3.900	102,7800	367.576,34	0,23
LU2031322808	SISF GL.EM.MKT.OPP. AZDLA		116.000	0	116.000	15,8471	1.685.707,11	1,03
LU0640477955	THREA.L-US CO.CORE EQ.IU		0	0	54.300	51,8992	2.584.251,77	1,58
LU0353189763	WEL.FA.(LUX)W.-US A.C.IDL		600	400	4.100	359,2000	1.350.499,77	0,83
Summe							12.092.816,92	7,41
<b>INVESTMENTZERTIFIKATE auf EURO lautend</b>								
AT0000706734	A 115 INH.		7.200	0	76.200	128,5700	9.797.034,00	6,00
LU0568620131	AF AM.F.CASH EUR I2EOC		3.000	0	3.000	1.001,7900	3.005.370,00	1,84
LU2085674898	AF-A.F.E.A.B Z UHEOA		2.800	700	2.100	955,0600	2.005.626,00	1,23
LU2085674971	AF-A.F.E.G.B Z UHEOA		3.550	2.670	880	973,5900	856.759,20	0,52
LU0920783023	AGIF-A.EUR.EQ.GR.SEL.WTEO		180	0	550	1.638,7100	901.290,50	0,55
LU1437015735	AIS-A.I.MSCI EUR.UC.ETFDR		0	14.500	28.500	52,0650	1.483.852,50	0,91
LU1437016543	AIS-A.I.MSCI N.AM.UCETFDR		5.700	3.400	66.900	66,1050	4.422.424,50	2,71
LU1050468989	AIS-A.IN.EU.AG.CO.SRI IEC		1.030	330	3.700	1.118,4600	4.138.302,00	2,53
LU1050469953	AIS-A.IN.JPM EMU G.IG IED		1.020	1.590	11.400	1.067,2300	12.166.422,00	7,45
LU1437018598	AIS-A.IN.JPM EMU G.IGUETF		16.500	18.500	307.000	54,2200	16.645.540,00	10,20
LU1437017350	AIS-A.IN.MSCI E.M.UCETFDR		0	3.100	19.400	47,5800	923.052,00	0,57
LU1861137484	AIS-A.M.EU.SRI DR AOEA		12.000	0	12.000	48,9950	587.940,00	0,36
LU0390718863	AIS-A.M.MSCI PAC.XJP IE C		0	27	413	2.105,0700	869.393,91	0,53
FR0013016607	AM. 3 M I2 CAP. 3D.		470	422	298	9.918,7510	2.955.787,80	1,81
AT0000A0XD86	AM. EUR.CORP.BD SVTA		700	460	5.540	1.128,7500	6.253.275,00	3,83
AT0000947643	AM. EURO RENT		3.899	132.980	83.920	92,8900	7.795.328,80	4,78
AT0000A13YU6	AM. GBL H.Y.BD L.D. T		0	2.000	4.800	91,9400	441.312,00	0,27
LU1931975079	AM. I.S.-A.P.EO COR.DR		46.700	0	119.700	19,9120	2.383.466,40	1,46
LU1931975152	AM. I.S.-A.PR.E.G.DREO		274.300	0	825.300	20,9200	17.265.276,00	10,58
LU1931974858	AM. I.S.-A.PR.USA DRDL		14.000	18.000	154.000	19,1740	2.952.796,00	1,81
AT0000856505	AM. MUENDEL RENT A		28.200	14.000	63.400	76,9100	4.876.094,00	2,99
AT0000A0FM79	AM. OEKO SOZIAL RENT T		0	19.000	149.500	124,4900	18.611.255,00	11,40
AT0000A06Q31	AM. OEKO SOZIAL ST. T		400	1.040	10.860	178,1300	1.934.491,80	1,19
AT0000822762	AM. SEL.EUR.STOCK T		0	956	3.900	120,2900	469.131,00	0,29
LU2085674625	AMF-EME.MKTS BD Z HDGEOD		1.650	1.460	190	840,9500	159.780,50	0,10
LU1883315480	AMF-EUR.EQ.VAL.I2 UNH.EOA		0	117	273	1.394,5300	380.706,69	0,23
AT0000A0G4E2	BD STRAT.EURO S.T.3Y A		18.000	183.000	379.000	10,2700	3.892.330,00	2,38
LU0297941469	BGF-EURO BOND FD D2 EO		0	22.850	72.450	31,1700	2.258.266,50	1,38
LU0131211178	BNPP EURO CORP BD CI		4.800	0	4.800	207,2100	994.608,00	0,61
AT0000A08ZU3	C 70 T		1.275	1.005	8.695	188,6500	1.640.311,75	1,00
LU1111643042	ELEVA-EL.EUR.SEL.I EO ACC		0	130	670	1.148,4500	769.461,50	0,47
DE0006289499	I.EB.R.G.G.5.5-10.5 U.ETF		11.926	0	11.926	146,4500	1.746.562,70	1,07
IE00B7LGZ558	ISV FRAN.GOV.BD U.ETF EOD		6.200	3.700	20.500	158,4300	3.247.815,00	1,99
LU0451950314	JHH-JHH EU.CO.BD A2AEO		0	8.500	6.300	157,7800	994.014,00	0,61
LU0853555893	JUPITER GL.FD-J.DY.B.IEOA		0	13.000	47.000	13,5800	638.260,00	0,39
LU0579408591	STA.STR.EN.EM.MA.EQ. IEO		36.800	14.800	140.400	12,3909	1.739.682,36	1,07
Summe							142.203.019,41	87,11
<b>INVESTMENTZERTIFIKATE auf JAPANISCHE YEN lautend</b>								
LU0607514808	INV.FDS-JAP.EQ.ADV.C YN C		0	4.800	24.300	4.678,0000	970.455,73	0,59
IE00BF2S5G73	MAN F.-M.GLG J.CA.E.IXXYN		19.100	0	19.100	6.376,0000	1.039.658,99	0,64
Summe							2.010.114,72	1,23
<b>SUMME INVESTMENTZERTIFIKATE</b>							<u>156.305.951,05</u>	95,75
<b>SUMME WERTPAPIERVERMÖGEN</b>							<u>156.305.951,05</u>	95,75

## FINANZTERMINKONTRAKTE

Bezeichnung / Underlying	Fälligkeit	Whg.	Anzahl / Betrag	Kontrakt- kurs	unrealisiertes Ergebnis in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
<b>FINANZTERMINKONTRAKTE</b>						
<b>AKTIENINDEXKONTRAKTE</b>						
DJ STOXX 600 FUTURE (FXXP) JUNI 20	19.06.2020	EUR	-157	320,0000	-287.310,00	-0,17
E-MINI S&P 500 INDEX FUTURE (ES) JUNI 20	19.06.2020	USD	-20	2.775,1000	-316.403,03	-0,19
MSCI EMERG. MKTS. MINI INDEX FUTURE (MEM) JUNI 20	19.06.2020	USD	-9	872,3000	-13.548,83	-0,01
				Summe	<u>-617.261,86</u>	<u>-0,37</u>
<b>WÄHRUNGSTERMINKONTRAKTE</b>						
CROSS RATE EUR/USD FUTURE JUNI 20	15.06.2020	USD	15	1,0939	-59.737,51	-0,04
				Summe	<u>-59.737,51</u>	<u>-0,04</u>
<b>ZINSTERMINKONTRAKTE</b>						
EURO BUND FUTURE (FGBL) JUNI 20	08.06.2020	EUR	3	172,6800	2.490,00	0,00
EURO-BTP FUTURE (FBTP) JUNI 20	08.06.2020	EUR	-8	136,8800	52.780,00	0,03
TEN-YEAR US TREASURY NOTE FUTURE (TY) JUNI 20	19.06.2020	USD	13	139,1563	11.964,12	0,01
				Summe	<u>67.234,12</u>	<u>0,04</u>
<b>SUMME FINANZTERMINKONTRAKTE</b>					<u><u>-609.765,25</u></u>	<u>-0,37</u>

## BANKGUTHABEN / BANKVERBINDLICHKEITEN

### BANKGUTHABEN / BANKVERBINDLICHKEITEN

WÄHRUNG	FONDSWÄHRUNG	BETRAG FONDSWÄHRUNG
EURO	EUR	3.467.362,53
AMERIKANISCHE DOLLAR	EUR	2.135.823,23
BRITISCHE PFUND	EUR	105.947,20
JAPANISCHE YEN	EUR	161.047,49
SCHWEIZER FRANKEN	EUR	361.344,54
INITIAL MARGIN / VARIATION MARGIN	EUR	1.291.453,65
<b>SUMME BANKGUTHABEN / BANKVERBINDLICHKEITEN</b>		<u><u>7.522.978,64</u></u>

	EUR	%
<b>Wertpapiervermögen</b>	<b>156.305.951,05</b>	<b>95,75</b>
Finanzterminkontrakte	-609.765,25	-0,37
Zinsenerträge (inkl. negativer Habenzinsen)	-1.454,23	0,00
Dividendenansprüche	100.704,00	0,06
Bankguthaben / Bankverbindlichkeiten	7.522.978,64	4,60
Gebührenverbindlichkeiten	-71.130,07	-0,04
<b>FONDSVERMÖGEN</b>	<b><u><u>163.247.284,14</u></u></b>	<b><u><u>100,00</u></u></b>

15.04.2020

---

#### Ausschüttungsanteile AT0000761655

Anzahl der ausgegebenen Anteile	STK	771.662
Anteilswert	EUR	97,24

---

#### Thesaurierungsanteile mit KEST-Abzug AT0000761663

Anzahl der ausgegebenen Anteile	STK	572.603
Anteilswert	EUR	154,04

#### 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.

## DEWISENKURSE

### DEWISENKURSE

#### WÄHRUNG

AMERIKANISCHE DOLLAR  
BRITISCHE PFUND  
JAPANISCHE YEN  
SCHWEIZER FRANKEN

#### EINHEITEN

1 EUR =  
1 EUR =  
1 EUR =  
1 EUR =

#### KURS

1,09050 USD  
0,87255 GBP  
117,13610 JPY  
1,05280 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  
(Marktzuordnung zum Berichtsstichtag)**

ISIN	Wertpapier-Bezeichnung	Zins- satz	Whg.	Käufe / Zugänge Lots / Stück / Nominale (Nom. in 1.000, ger.)	Verkäufe / Abgänge Lots / Stück / Nominale (Nom. in 1.000, ger.)
<b>WERTPAPIERE</b>					
LU0616240585	AF-AMU.F.EO AG.BD IEOC		EUR	0	1.900
LU0518422273	AF-AMU.F.EU.GO.BD IEOC		EUR	0	2.390
AT0000A05TK3	AM. OPTIRENDITE T		EUR	0	20.300
LU1882453233	AMF-EME.MKTS BD I2 HGDEOA		EUR	220	1.308
LU0438336421	BLACK.ST.-FIX.INC.STR.DEO		EUR	0	15.500
LU1170327958	BLUEB.F.-I.G.EUR.G.B.QEO		EUR	6.500	6.500
LU0404498767	HSBC GIF-EURO H.Y.BD XCEO		EUR	2.200	21.700
IE00B0M63391	ISHS-MSCI KOREA DL D		EUR	0	19.500
IE00B7LW6Y90	ISHSV-ITAL.GOVTD EO D		EUR	0	30.200
FR0010251108	ODDO BHF AV.EUR.CI-EO		EUR	0	2
IE00B5649G90	MAN F.-M.GLG J.CA.E. IJPY		JPY	0	7.600
LU0073232471	MSI-US GROWTH FD A		USD	0	10.000
LU0269905302	SISF GL.EM.MKT.OPP. CA DL		USD	5.000	104.000
<b>OPTIONEN</b>					
---	DJ EURO STOXX50 INX (SX5E) PUT MÄR. 20 3500		EUR	1.000	1.000
---	S & P 500 INX (S500) CALL MÄR. 20 3250		USD	500	500
<b>FINANZTERMINKONTRAKTE</b>					
---	SWISS MARKET INDEX FUTURE (S30) MÄR. 20		CHF	9	9
---	CAC 40-INDEX FUTURE (FCE) FEB. 20		EUR	15	15
---	CAC 40-INDEX FUTURE (FCE) MÄR. 20		EUR	15	15
---	DJ STOXX 600 FUTURE (FXXP) DEZ. 19		EUR	119	0
---	DJ STOXX 600 FUTURE (FXXP) MÄR. 20		EUR	232	267
---	EURO BUND FUTURE (FGBL) DEZ. 19		EUR	17	3
---	EURO BUND FUTURE (FGBL) MÄR. 20		EUR	17	17
---	FTSE 100 INDEX FUTURE (FFI) DEZ. 19		GBP	1	8
---	FTSE 100 INDEX FUTURE (FFI) JUN. 20		GBP	4	4
---	FTSE 100 INDEX FUTURE (FFI) MÄR. 20		GBP	4	4
---	FTSE 250 INDEX FUTURE (FMCS) DEZ. 19		GBP	7	7
---	FTSE 250 INDEX FUTURE (FMCS) JUN. 20		GBP	3	3
---	FTSE 250 INDEX FUTURE (FMCS) MÄR. 20		GBP	7	7
---	CROSS RATE EUR/USD FUTURE DEZ. 19		USD	7	20
---	CROSS RATE EUR/USD FUTURE MÄR. 20		USD	30	30
---	E-MINI S&P 500 INDEX FUTURE (ES) DEZ. 19		USD	26	0
---	E-MINI S&P 500 INDEX FUTURE (ES) MÄR. 20		USD	27	27
---	FTSE/XINHUA CHINA A 50 FUTURE (SFC) DEZ. 19		USD	77	77
---	FTSE/XINHUA CHINA A 50 FUTURE (SFC) FEB. 20		USD	77	77
---	FTSE/XINHUA CHINA A 50 FUTURE (SFC) JAN. 20		USD	77	77
---	FTSE/XINHUA CHINA A 50 FUTURE (SFC) NOV. 19		USD	77	77
---	FTSE/XINHUA CHINA A 50 FUTURE (SFC) OKT. 19		USD	0	77
---	MSCI EMERG. MKTS. MINI INDEX FUTURE (MEM) DEZ. 19		USD	41	2
---	MSCI EMERG. MKTS. MINI INDEX FUTURE (MEM) MÄR. 20		USD	44	44
---	TEN-YEAR US TREASURY NOTE FUTURE (TY) DEZ. 19		USD	6	20
---	TEN-YEAR US TREASURY NOTE FUTURE (TY) MÄR. 20		USD	16	16

Wien, im April 2020

Amundi Austria GmbH

DDr. Werner Kretschmer

Gabriele Tavazzani

Mag. Hannes Roubik

Alois Steinböck