



Wien 1, Schwarzenbergplatz 3

## **KONZEPT : ERTRAG dynamisch**

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

### **Halbjahresbericht**

vom 16. Oktober 2022 bis 15. April 2023

# Vermögensaufstellung zum 15. 04. 2023

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
<b>INVESTMENTZERTIFIKATE</b>								
<b>INVESTMENTZERTIFIKATE auf AMERIKANISCHE DOLLAR lautend</b>								
LU2304587079	AAF A.US EQ. X1DLA		0	0	31.500	99,6510	2.851.697,93	2,55
LU0683601610	AB S.I-SEL.US EQU.P.S1ADL		0	0	53.000	58,1800	2.801.308,20	2,51
LU0823411292	BNPP US SMALL CAP I CAP		0	0	3.000	371,5700	1.012.682,26	0,91
LU2423583090	F.C.I.P-F.L S.U Z(C)DLA		0	0	2.400	1.272,3300	2.774.101,29	2,48
LU2423587752	F.C.I.P-F.N.B.U Z(C)DLA		0	0	2.980	1.071,2000	2.900.000,91	2,60
LU2351337501	FCH JPM.US E.F. ZDLA		0	0	6.800	960,8400	5.935.691,12	5,32
LU0742536872	FIDELITY FDS-EM.MKTS IADL		0	0	16.000	14,6400	212.800,36	0,19
LU0360484686	MSI-US ADVANTAGE FD Z DL		0	0	17.000	95,3800	1.473.050,19	1,32
LU0181496059	SISF EMERG.ASIA C ACC		0	0	5.000	54,7247	248.579,15	0,22
LU0640477955	THREA.L-US CO.CORE EQ.IU		0	0	20.500	76,4971	1.424.656,42	1,28
						Summe	21.634.567,83	19,38
<b>INVESTMENTZERTIFIKATE auf EURO lautend</b>								
FR0014003FW1	A.MW CPAP U.E. EOD		0	0	42.000	39,9650	1.678.530,00	1,50
LU1955039661	AAF PARN.US ESG EQ X1EO		0	0	19.600	151,7960	2.975.201,60	2,66
LU2070304063	AF-A.F.E.C.B Z UNHEOA		400	0	1.600	882,8300	1.412.528,00	1,27
LU2085674971	AF-A.F.E.G.B Z UHEOA		0	0	1.600	845,5500	1.352.880,00	1,21
LU1050468989	AIS-A.IDX EO CORP.SRI IEC		18.900	0	21.000	102,7700	2.158.170,00	1,93
LU1050469953	AIS-A.IN.JPM EMU G.IG IED		0	910	590	855,6600	504.839,40	0,45
LU1437018598	AIS-A.IN.JPM EMU G.IGUETF		0	0	78.000	45,9150	3.581.370,00	3,21
LU1861137484	AIS-AIME SRIPAB UETFDREOA		1.500	11.000	57.000	73,4930	4.189.101,00	3,75
LU2233156749	AIS-AIMJNSRIPAB UETFDRYNA		0	0	29.000	42,8050	1.241.345,00	1,11
LU1861136247	AIS-AIMU SRIPAB UETFDREOA		0	0	83.000	85,7190	7.114.677,00	6,37
LU0996179858	AIS-AISMJESGCNZACTB IEEOA		4.995	1	5.000	107,8900	539.450,00	0,48
LU1681045370	AIS-AM.ID.MSCI EM.MA.EOC		0	45.800	199.200	4,3489	866.300,88	0,78
LU1861138961	AIS-AMMSRIPAB UETFDR DLA		2.710	0	66.710	47,8960	3.195.142,16	2,86
LU1437016543	AIS-M.NA ESG B.CTB UETFEA		17.500	0	67.500	100,4790	6.782.332,50	6,07
LU0390718863	AIS-MSCI PXJSRIPAB IECEOA		35	135	650	2.692,2400	1.749.956,00	1,57
AT0000A28YU4	AM. CPR CLIM.ACTION T		6.300	0	6.300	114,3400	720.342,00	0,65
FR0013016607	AM. EO L.RAT.SRII2C3D		0	0	190	9.916,0230	1.884.044,37	1,69
AT0000A0XD86	AM. EUR.CORP.BD SVTA		0	100	750	1.031,0300	773.272,50	0,69
AT0000A13YU6	AM. GBL H.Y.BD L.D. T		0	0	4.000	99,2200	396.880,00	0,36
AT0000822762	AM. SEL.EUR.STOCK T		0	0	3.550	192,3100	682.700,50	0,61
LU1931975079	AM.I.S.-A.P.EO CO.UEDREOD		0	0	108.000	17,5975	1.900.530,00	1,70
AT0000706734	AM.OE.SO.EO CO.BD		0	0	23.000	111,0800	2.554.840,00	2,29
AT0000822671	AM.OE.SO.EO GO.BD T		0	0	798.000	12,8000	10.214.400,00	9,15
AT0000A05TK3	AM.OE.SO.EO ST BD T		0	0	11.750	114,4400	1.344.670,00	1,20
AT0000A0FM79	AM.OEK.SOZ.EURO AGG.BD T		0	0	28.600	107,7100	3.080.506,00	2,76
LU2085674625	AMF-EME.MKTS BD Z HDGEOD		0	0	500	720,5300	360.265,00	0,32
LU1931975152	AMUN.I.S.-A.P.E.G.UEDREOD		0	0	243.000	16,7630	4.073.409,00	3,65
LU1931974858	AMUN.I.S.-A.P.USA UEDRDLD		0	47.050	11.950	28,2050	337.049,75	0,30
AT0000A0G4E2	BD STRAT.EURO S.T.3Y A		0	0	106.000	10,0200	1.062.120,00	0,95
AT0000A08ZU3	C 70 T		0	0	13.400	248,0400	3.323.736,00	2,98
LU1140883403	ELEVA-EL.EUR.SEL.I2EOACC		1.560	0	1.560	1.850,8300	2.887.294,80	2,59
LU2351333773	FCH FID.EU EQ. ZEOA		0	0	1.370	907,6800	1.243.521,60	1,11
LU2351330167	FCH UBS EU.OP.SUS.EQ.ZEOA		0	0	730	979,1400	714.772,20	0,64
DE0006289499	I.EB.R.G.G.5.5-10.5 U.ETF		0	0	15.100	116,1850	1.754.393,50	1,57
LU1900234946	INV.-JAP.E.AD. SEOA		0	0	53.000	11,8700	629.110,00	0,56
IE00BYPC1H27	ISHSIV - ISH.CHIN.BD.U.ET		0	0	78.000	4,7850	373.230,00	0,33
IE00B7LW6Y90	ISHSV-ITAL.GOV BD EO D		0	0	8.000	142,4800	1.139.840,00	1,02
IE00B7LGZ558	ISV FRAN.GOV.BD U.ETF EOD		0	0	8.500	128,3000	1.090.550,00	0,98
LU0802113760	JPM-EM.MK.OP. JPMEMO IAE0		0	0	8.000	142,0600	1.136.480,00	1,02
LU1878180014	MEMNON-M.EURO.P. I2EOA		900	0	900	328,5200	295.668,00	0,26
LU0219424131	MFS M.-EUR.RESEARCH I1 EO		0	0	1.000	318,5200	318.520,00	0,29
LU0255979238	PICTET-JAP.EQ.OPPO.I EO		0	0	5.300	108,2800	573.884,00	0,51
LU0279459969	SISF GL.EM.MKT.OPP. CA EO		0	0	24.000	23,9438	574.651,20	0,51
IE00BFWFPX50	SPDR S+P US CO.S.S.S.UETF		15.500	0	15.500	26,0534	403.827,70	0,36
LU0579408591	STATE STR.E.M.ESG S.EE.IE		0	0	74.000	14,7256	1.089.694,40	0,98

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
LU0446734872	UBSLFS-MSCI CANADA CDAD		0	0	10.000	35,5050	355.050,00	0,32
IE00BGCZ0719	VANG.I.S.EURO.I.L.BIPLEOA		0	0	3.000	123,4225	370.267,50	0,33
Summe							87.001.343,56	77,90

#### INVESTMENTZERTIFIKATE auf JAPANISCHE YEN lautend

IE00BF2S5G73	MAN F.-M.GLG J.CA.E.IXXYN		0	0	8.500	12.052,0000	697.329,79	0,62
Summe							697.329,79	0,62

#### SUMME INVESTMENTZERTIFIKATE

109.333.241,18 97,90

#### SUMME WERTPAPIERVERMÖGEN

109.333.241,18 97,90

### OPTIONEN

Call / Put	Bezeichnung / Underlying	Fälligkeit	Whg.	Anzahl / Betrag	Kontrakt-kurs	aktueller Optionspreis in EUR	%-Anteil am Fonds-vermögen
------------	--------------------------	------------	------	-----------------	---------------	-------------------------------	----------------------------

#### OPTIONEN

##### GEKAUFTE OPTIONEN(LONG)

Put	S & P 500 INX (S500) PUT SEP. 23 3930	15.09.2023	USD	4	102,9500	37.410,86	0,03
Summe						37.410,86	0,03

##### VERKAUFTE OPTIONEN(SHORT)

Put	S & P 500 INX (S500) PUT SEP. 23 3275	15.09.2023	USD	-5	26,5200	-12.046,33	-0,01
Summe						-12.046,33	-0,01

#### SUMME OPTIONEN

25.364,53 0,02

### FINANZTERMINKONTRAKTE

Bezeichnung / Underlying	Fälligkeit	Whg.	Anzahl / Betrag	Kontrakt-kurs	unrealisiertes Ergebnis in EUR	%-Anteil am Fonds-vermögen
--------------------------	------------	------	-----------------	---------------	--------------------------------	----------------------------

#### FINANZTERMINKONTRAKTE

##### AKTIENINDEXKONTRAKTE

DJ EURO STOXX 50 FUT (STXE) JUNI 23	16.06.2023	EUR	-34	4.331,0000	-81.992,50	-0,07
E-MINI S&P 500 INX FUT (ES) JUNI 23	16.06.2023	USD	-3	4.163,7500	-37.324,55	-0,04
MSCI CHINA INX FUT (FMCH) JUNI 23	16.06.2023	USD	18	493,4000	9.729,73	0,01
MSCI EMERG. MKTS. INX FUT (MEM) JUNI 23	16.06.2023	USD	4	1.000,3000	2.162,16	0,00
NIKKEI 225 INX FUT (NIY) JUNI 23	08.06.2023	JPY	-8	28.490,0000	-14.975,55	-0,01
Summe					-122.400,71	-0,11

##### ZINSTERMINKONTRAKTE

EURO BUND FUT (FGBL) JUNI 23	08.06.2023	EUR	-4	134,3900	-14.400,00	-0,01
FIVE-YEAR US TREASURY NOTE FUT (FV) JUNI 23	30.06.2023	USD	20	109,4688	-9.084,71	-0,01
TEN-YEAR US TREASURY NOTE FUT (TY) JUNI 23	21.06.2023	USD	-14	114,8594	8.744,04	0,01
ULTRA TEN-YEAR US TREAS.NOTE FUT (UXY) JUNI 23	21.06.2023	USD	28	120,8438	94.026,80	0,08
Summe					79.286,13	0,07

#### SUMME FINANZTERMINKONTRAKTE

-43.114,58 -0,04

## BANKGUTHABEN / BANKVERBINDLICHKEITEN

### BANKGUTHABEN / BANKVERBINDLICHKEITEN

WÄHRUNG	FONDSWÄHRUNG	BETRAG FONDSWÄHRUNG
EURO	EUR	655.076,91
AMERIKANISCHE DOLLAR	EUR	864.171,44
BRITISCHE PFUND	EUR	22.902,67
HONGKONG DOLLAR	EUR	128.010,29
JAPANISCHE YEN	EUR	222.034,55
KANADISCHE DOLLAR	EUR	21.074,48
SCHWEIZER FRANKEN	EUR	132.662,24
INITIAL MARGIN / VARIATION MARGIN	EUR	367.456,27
<b>SUMME BANKGUTHABEN / BANKVERBINDLICHKEITEN</b>		<b>2.413.388,85</b>

	EUR	%
<b>Wertpapiervermögen</b>	<b>109.333.241,18</b>	<b>97,90</b>
Finanzterminkontrakte	-43.114,58	-0,04
Optionen	25.364,53	0,02
Zinsenerträge (inkl. negativer Habenzinsen)	558,73	0,00
Bankguthaben / Bankverbindlichkeiten	2.413.388,85	2,17
Gebührenverbindlichkeiten	-53.128,17	-0,05
<b>FONDSVERMÖGEN</b>	<b>111.676.310,54</b>	<b>100,00</b>

15.04.2023

#### Ausschüttungsanteile AT0000811351

Anzahl der ausgegebenen Anteile	STK	331.686
Anteilswert	EUR	89,72

#### Thesaurierungsanteile mit KEST-Abzug AT0000811369

Anzahl der ausgegebenen Anteile	STK	546.843
Anteilswert	EUR	149,79

#### Erläuterungen zur Vermögensaufstellung:

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

## DEISENKURSE

### DEISENKURSE

WÄHRUNG	EINHEITEN	KURS
AMERIKANISCHE DOLLAR	1 EUR =	1,10075 USD
BRITISCHE PFUND	1 EUR =	0,88455 GBP
HONGKONG DOLLAR	1 EUR =	8,64085 HKD
JAPANISCHE YEN	1 EUR =	146,90610 JPY
KANADISCHE DOLLAR	1 EUR =	1,47110 CAD
SCHWEIZER FRANKEN	1 EUR =	0,98390 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 (Marktzunordnung zum Berichtsstichtag)

ISIN	Wertpapier-Bezeichnung	Zins- satz	Whg.	Käufe / Zugänge Lots / Stück /	Verkäufe / Abgänge Nominale (Nom. in 1.000, ger.)
<b>WERTPAPIERE</b>					
LU1681048804	AIS-AM. S+P500UETF EOC		EUR	0	19.700
LU1111643042	ELEVA-EL.EUR.SEL.I EO ACC		EUR	0	1.620
IE00BYYPQZ50	RUSS.INV.-ACA.EUR.EQ.BEOA		EUR	0	21.000
IE00BLNMYC90	X(IE)-S+P 500 E.WGHT 1CDL		EUR	0	10.000
LU1880399362	AMF-PIO.GL.EQ. I UH.DLA		USD	0	530
<b>OPTIONEN</b>					
---	S & P 500 INX (S500) PUT FEB. 23 3400		USD	700	700
---	S & P 500 INX (S500) PUT FEB. 23 3800		USD	700	700
---	S & P 500 INX (S500) PUT NOV. 22 4000		USD	0	200
<b>FINANZTERMINKONTRAKTE</b>					
---	SWISS MARKET INX FUT (S30) DEZ. 22		CHF	0	6
---	DAX-INX FUT (FDAX) DEZ. 22		EUR	2	0
---	DJ EURO STOXX 50 FUT (STXE) DEZ. 22		EUR	58	7
---	DJ EURO STOXX 50 FUT (STXE) MÄR. 23		EUR	55	55
---	DJ EURO STOXX BKS FUT (FESB) JUN. 23		EUR	66	66
---	EURO BUND FUT (FGBL) DEZ. 22		EUR	2	12
---	EURO BUND FUT (FGBL) MÄR. 23		EUR	16	16
---	NIKKEI 225 INX FUT (NIY) DEZ. 22		JPY	4	0
---	NIKKEI 225 INX FUT (NIY) MÄR. 23		JPY	8	8
---	E-MINI NASDAQ-100 INX FUT (NQ) DEZ. 22		USD	0	2
---	E-MINI RUSSELL 2000 INX FUT (RTY) DEZ. 22		USD	6	6
---	E-MINI RUSSELL 2000 INX FUT (RTY) JUN. 23		USD	6	6
---	E-MINI RUSSELL 2000 INX FUT (RTY) MÄR. 23		USD	6	6
---	E-MINI S&P 500 INX FUT (ES) DEZ. 22		USD	8	2

ISIN	Wertpapier-Bezeichnung	Zins- satz	Whg.	Käufe / Zugänge Lots / Stück / Nominale	Verkäufe / Abgänge (Nom. in 1.000, ger.)
---	E-MINI S&P 500 INX FUT (ES) MÄR. 23		USD	8	8
---	MSCI CHINA INX FUT (FMCH) MÄR. 23		USD	18	18
---	MSCI EMERG. MKTS. INX FUT (MEM) DEZ. 22		USD	6	18
---	MSCI EMERG. MKTS. INX FUT (MEM) MÄR. 23		USD	2	2
---	SGX NIFTY INX FUT (SIN) NOV. 22		USD	19	19
---	SGX NIFTY INX FUT (SIN) OKT. 22		USD	19	0
---	ULTRA TEN-YEAR US TREAS.NOTE FUT (UXY) DEZ. 22		USD	9	20
---	ULTRA TEN-YEAR US TREAS.NOTE FUT (UXY) MÄR. 23		USD	20	20

Wien, im April 2023

**Amundi Austria GmbH**

**Franck Jochaud du Plessix**

**Christian Mathern**

**Hannes Roubik**

**Alois Steinböck**