
Halbjahresbericht
30. Juni 2022 (ungeprüft)

Amundi S.F.

Ein Luxemburgischer Investmentfonds
(Fonds Commun de Placement)

Amundi S.F.

Ungeprüfter Halbjahresbericht

R.C.S. Luxemburg K 651

für den Zeitraum vom 01/01/22 bis zum 30/06/22

Auf alleiniger Grundlage dieses Finanzberichts kann keine Zeichnung entgegengenommen werden. Zeichnungen sind nur auf der Grundlage des aktuellen Verkaufsprospekts und der Wesentlichen Anlegerinformationen (Key Investor Information Document, KIID) gültig, begleitet vom letzten Jahresbericht und einer Kopie des letzten Halbjahresberichts, falls danach veröffentlicht.

| | <u>Seite</u> |
|--|--------------|
| Organisation | 4 |
| Portfolioangaben zum 30/06/22: | |
| Anleiheteilfonds | |
| Amundi S.F. - Diversified Short-Term Bond | 6 |
| Amundi S.F. - Euro Curve 7-10year | 9 |
| Amundi S.F. - Euro Curve 10+year | 10 |
| Amundi S.F. - SBI FM India Bond | 12 |
| Aktienteilfonds | |
| Amundi S.F. - European Equity Optimal Volatility | 13 |
| Commodities-Teilfonds | |
| Amundi S.F. - EUR Commodities | 14 |
| Konten: | |
| Nettovermögensaufstellung | 15 |
| Statistische Aufstellung zu den Einheiten | 19 |
| Aufwands- und Ertragsrechnung für das Nettovermögen | 21 |
| Anmerkungen zum Geschäftsbericht zum 30/06/22 | 25 |
| 1 Einleitung | 25 |
| 2 Grundsätze der Rechnungslegung | 25 |
| 3 Verwendete Wechselkurse zum 30. Juni 2022 | 26 |
| 4 Management-, Anlageverwaltungs- und Vertriebsgebühren | 26 |
| 5 Performancegebühr | 27 |
| 6 Depot- und Zahlstelle, Verwaltungs-, Register- und Transferstelle | 27 |
| 7 Besteuerung des Fonds - <i>Taxe d'abonnement</i> | 28 |
| 8 Offene Positionen aus Termingeschäften | 28 |
| 9 Offene Positionen aus Devisenterminkontrakten | 29 |
| 10 Sonstige Erträge | 30 |
| 11 Sonstige Ausgaben | 30 |
| 12 Optionen | 30 |
| 13 Swappeschäfte | 31 |
| 14 Wertpapierbeleihungen | 31 |
| 15 Sicherheiten | 32 |
| 16 Kontoauszug der Portfoliobewegungen | 32 |
| 17 Dividenden | 32 |
| Zusätzliche Informationen über den Vertreter und den Vertrieb des Fonds in der Schweiz | 33 |
| Zusätzliche Informationen | 35 |

**VERWALTUNGSGESELLSCHAFT,
DOMIZIL- UND VERTRIEBSSTELLE**

Amundi Luxembourg S.A.
5, Allée Scheffer
L-2520 Luxemburg
Großherzogtum Luxemburg

**VERWALTUNGSRAT DER
VERWALTUNGSGESELLSCHAFT**

Vorsitzender

David Joseph HARTE
Chief Executive Officer, Head of Ireland,
Amundi Ireland Limited,
in Irland ansässig

Mitglieder

Jeanne DUVOUX
Chief Executive Officer und Managing Director,
Amundi Luxembourg S.A.,
in Luxemburg ansässig

Claude KREMER
Partner und Independent Director,
Arendt & Medernach S.A.,
in Luxemburg ansässig

Enrico TURCHI
Deputy Chief Executive Officer und Managing Director,
Amundi Luxembourg S.A.,
in Luxemburg ansässig

Pascal BIVILLE
Independent Director,
in Frankreich ansässig

François MARION
Independent Director,
in Frankreich ansässig

**GESCHÄFTSLEITER DER
VERWALTUNGSGESELLSCHAFT**

Jeanne DUVOUX
Chief Executive Officer und Managing Director,
Amundi Luxembourg S.A.,
in Luxemburg ansässig

Enrico TURCHI
Deputy Chief Executive Officer und Managing Director,
Amundi Luxembourg S.A.,
in Luxemburg ansässig

Pierre BOSIO
Chief Operating Officer,
Amundi Luxembourg S.A.,
in Luxemburg ansässig

Charles GIRALDEZ
Deputy Chief Executive Officer,
Amundi Luxembourg S.A.,
in Luxemburg ansässig

Benjamin LAUNAY
Real Estate Portfolio Manager,
Amundi Luxembourg S.A.,
in Luxemburg ansässig

Hervé LECLERCQ (*bis 28. Februar 2022*)
Head of Amundi real Assets,
Amundi Luxembourg S.A.,
in Luxemburg ansässig

**VERWALTUNGS-, REGISTER-
UND TRANSFERSTELLE**

Société Générale Luxembourg
(Operational center)
28-32, Place de la gare
L-1616 Luxemburg
Großherzogtum Luxemburg

DEPOT- UND ZAHLSTELLE

Société Générale Luxembourg
11, Avenue Emile Reuter
L-2420 Luxemburg
Großherzogtum Luxemburg

ANLAGEVERWALTER

Amundi (UK) Limited
77, Coleman Street
London, EC2R 5BJ
Großbritannien

Amundi Deutschland GmbH
Arnulfstraße 124 -126
D-80636 Munich
Deutschland

Amundi SGR S.p.A.
Via Cernaia 8/10
20121 Milano
Italien

Amundi Asset Management
90, Boulevard Pasteur
75015 Paris
Frankreich

Amundi Asset Management US, Inc.
60, State Street
Boston, MA 02109-1820
Vereinigte Staaten von Amerika

Amundi Singapore Limited
168, Robinson Road #24-01, Capital Tower
Singapore 068912, Singapur

Amundi Ireland Limited
1, George's Quay Plaza
George's Quay
Dublin 2
Irland

**WIRTSCHAFTSPRÜFER /
CABINET DE RÉVISION AGRÉÉ**

PricewaterhouseCoopers, *Société coopérative*
2, rue Gerhard Mercator
B.P. 1443, L-1014 Luxemburg
Großherzogtum Luxemburg

RECHTSBERATER

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

Wertpapierbestand zum 30/06/22

| Anzahl Nennwert | Marktwert | % des NIW | Anzahl Nennwert | Marktwert | % des NIW |
|--|---|-----------------|-----------------------|--|-----------------|
| | EUR | | | EUR | |
| Positive Positionen | 1,281,080,881 | 94.73 | 10,000,000 | GROUPAMA ASSURANCES MUTUELLES SA VAR PERPETUAL | 10,099,500 0.75 |
| Übertragbare und amtlich notierte Wertpapiere und/oder auf anderen Märkten gehandelte Wertpapiere | 1,140,478,388 | 84.33 | 15,000,000 | HOLDING DINFRASTRUCTURES ET DES METIERS DE ENVIRONMENT 0.125% 16/09/2025 | 13,396,500 0.99 |
| Anleihen | 1,140,478,388 | 84.33 | 10,000,000 | LA MONDIALE SOCIETE D ASSURANCE A FORME MUTUELLE VAR PERPETUAL | 9,960,200 0.74 |
| <i>Belgien</i> | 4,879,750 | 0.36 | 7,500,000 | MUTUELLE ASSURANCE DES COMMERCANTS ET INDUSTRIELS DE FRANCE 5.50% 08/03/2023 | 7,547,250 0.56 |
| 5,000,000 | ELIA GROUP SA VAR 05/09/2023 | 4,879,750 0.36 | 15,000,000 | ORANGE SA VAR PERPETUAL EUR (ISIN FR0013413887) | 14,037,750 1.04 |
| <i>Dänemark</i> | 14,607,600 | 1.08 | 15,000,000 | ORANGE SA VAR PERPETUAL EUR (ISIN XS1028599287) | 15,142,050 1.11 |
| 15,000,000 | DANSKE BANK AS VAR 21/06/2029 | 14,607,600 1.08 | 10,000,000 | PSA BANQUE FRANCE 0.625% 21/06/2024 | 9,716,600 0.72 |
| <i>Deutschland</i> | 96,980,700 | 7.17 | 10,000,000 | RCI BANQUE SA 0.50% 14/07/2025 | 9,019,100 0.67 |
| 10,000,000 | ALLIANZ SE VAR PERPETUAL EUR (ISIN DE000A1YQC29) | 10,050,100 0.74 | 5,000,000 | SOCIETE GENERALE PARIS VAR REGS PERPETUAL USD (ISIN USF43628B413) | 4,699,842 0.35 |
| 10,000,000 | ALLIANZ SE VAR REGS PERPETUAL USD (ISIN USX10001AA78) | 7,916,400 0.59 | 15,000,000 | SOCIETE GENERALE PARIS VAR REGS 21/01/2026 | 13,388,731 0.99 |
| 15,000,000 | ALLIANZ SE VAR 07/07/2045 | 14,502,900 1.06 | 15,000,000 | SOCIETE GENERALE PARIS VAR 30/05/2025 | 14,813,550 1.09 |
| 10,000,000 | BERTELSMANN SE & CO VAR 23/04/2075 | 9,593,500 0.71 | 10,000,000 | SOCIETE GENERALE PARIS 2.625% 27/02/2025 | 9,747,700 0.72 |
| 5,000,000 | COMMERZBANK AG VAR 05/12/2030 | 4,758,650 0.35 | 5,000,000 | SOGECAP SA VAR PERPETUAL | 4,790,300 0.35 |
| 15,000,000 | DEUTSCHE BAHN FINANCE GMBH VAR PERPETUAL | 13,333,350 0.99 | 15,000,000 | TOTAL ENERGIES SE VAR PERPETUAL EUR (ISIN XS1195202822) | 14,012,250 1.04 |
| 10,000,000 | EVONIK INDUSTRIES AG 0.625% 18/09/2025 | 9,296,500 0.69 | 10,000,000 | TOTAL ENERGIES SE VAR PERPETUAL EUR (ISIN XS1501167164) | 9,786,300 0.72 |
| 10,000,000 | INFINEON TECHNOLOGIES AG VAR PERPETUAL | 9,134,300 0.68 | 15,000,000 | TOTAL ENERGIES SE VAR PERPETUAL EUR (ISIN XS1974787480) | 14,120,700 1.04 |
| 10,000,000 | KREDITANSTALT FUR WIEDERAUFBAU 0% 09/11/2028 | 8,998,200 0.67 | 10,000,000 | UNIBAIL-RODAMCO SE VAR PERPETUAL EUR (ISIN FR0013330529) | 7,439,300 0.55 |
| 10,000,000 | MERCK KGAA VAR 25/06/2079 | 9,396,800 0.69 | 10,000,000 | UNIBAIL-RODAMCO SE VAR PERPETUAL EUR (ISIN FR0013330537) | 7,020,600 0.52 |
| <i>Finnland</i> | 30,123,600 | 2.23 | 3,000,000 | VALEO SA 1.50% 18/06/2025 | 2,762,550 0.20 |
| 30,000,000 | FINLAND 1.625% 15/09/2022 | 30,123,600 2.23 | <i>Großbritannien</i> | 80,412,314 | 5.95 |
| <i>Frankreich</i> | 347,355,010 | 25.68 | 15,000,000 | BARCLAYS PLC VAR 02/04/2025 | 15,122,550 1.13 |
| 5,000,000 | ALD SA 4.00% 05/07/2027 | 5,050,750 0.37 | 10,000,000 | BARCLAYS PLC VAR 07/02/2028 | 9,886,900 0.73 |
| 10,000,000 | ARVAL SERVICE LEASE SA 0.875% 17/02/2025 | 9,446,200 0.70 | 15,000,000 | EASYJET PLC 0.875% 11/06/2025 | 13,693,350 1.01 |
| 5,000,000 | ATOS SE 1.75% 07/05/2025 | 3,872,150 0.29 | 10,000,000 | HSBC HOLDINGS PLC VAR PERPETUAL USD (ISIN US404280AT69) | 9,292,936 0.69 |
| 5,000,000 | AXA SA VAR PERPETUAL | 4,883,200 0.36 | 10,000,000 | PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC VAR PERPETUAL | 8,857,430 0.65 |
| 5,000,000 | AXA SA VAR PERPETUAL EUR (ISIN XS1134541306) | 4,929,100 0.36 | 15,000,000 | SANTANDER UK GROUP HOLDINGS PLC VAR 28/02/2025 | 14,477,700 1.07 |
| 10,000,000 | BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL 0.01% 07/03/2025 | 9,422,400 0.70 | 10,000,000 | STANDARD CHARTERED PLC VAR REGS 30/01/2026 | 9,081,448 0.67 |
| 15,000,000 | BNP PARIBAS CARDIF VAR PERPETUAL | 14,428,050 1.07 | <i>Irland</i> | 31,876,084 | 2.36 |
| 10,000,000 | BNP PARIBAS SA VAR REGS PERPETUAL USD (ISIN USF1R15XK938) | 9,206,562 0.68 | 10,000,000 | AIB GROUP PLC VAR 04/07/2026 | 9,996,600 0.74 |
| 10,000,000 | BNP PARIBAS SA VAR REGS 10/01/2025 | 9,581,711 0.71 | 10,000,000 | AQUARIUS + INVESTMENTS PLC VAR 02/10/2043 | 10,183,300 0.75 |
| 10,000,000 | BNP PARIBAS SA VAR 20/11/2030 | 9,376,700 0.69 | 10,000,000 | FCA BANK S.P.A IRISH BRANCH 0.50% 13/09/2024 | 9,670,300 0.72 |
| 10,000,000 | COVIVIO HOTELS SCA 1.875% 24/09/2025 | 9,622,000 0.71 | 2,109,000 | JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC 1.375% 25/02/2025 | 2,025,884 0.15 |
| 15,000,000 | CREDIT AGRICOLE ASSURANCES SA VAR PERPETUAL EUR (ISIN FR0012444750) | 14,638,200 1.08 | <i>Italien</i> | 41,143,604 | 3.04 |
| 5,000,000 | CREDIT AGRICOLE SA VAR REGS PERPETUAL | 4,729,638 0.35 | 10,000,000 | ASSICURAZIONI GENERALI SPA VAR PERPETUAL | 9,673,700 0.72 |
| 5,000,000 | CREDIT AGRICOLE SA VAR REGS PERPETUAL GBP | 5,657,354 0.42 | 10,000,000 | ENEL SPA VAR 24/11/2078 | 9,649,400 0.71 |
| 15,000,000 | CREDIT AGRICOLE SA VAR 05/06/2030 | 14,008,800 1.04 | 10,000,000 | ENI S P A VAR PERPETUAL EUR (ISIN XS2242929532) | 8,939,400 0.66 |
| 10,000,000 | ELECTRICITE DE FRANCE VAR PERPETUAL EUR (ISIN FR0013367612) | 9,190,500 0.68 | | | |
| 10,000,000 | ELECTRICITE DE FRANCE VAR REGS PERPETUAL | 9,031,422 0.67 | | | |
| 10,000,000 | ENGIE SA VAR PERPETUAL EUR (ISIN FR0013431244) | 8,779,500 0.65 | | | |

Die beigefügten Anmerkungen sind integraler Bestandteil dieses Geschäftsberichts.

Wertpapierbestand zum 30/06/22

| Anzahl Nennwert | | Marktwert | % des NIW | Anzahl Nennwert | | Marktwert | % des NIW |
|--------------------|--|-------------|--------------|--------------------|---|--------------------|--------------|
| | | EUR | | | | EUR | |
| 15,000,000 | UNICREDIT SPA 2.569% REGS 22/09/2026 | 12,881,104 | 0.95 | | <i>Schweden</i> | 10,069,800 | 0.74 |
| | <i>Japan</i> | 24,252,950 | 1.79 | 10,000,000 | VOLVO TREASURY AB VAR 10/03/2078 | 10,069,800 | 0.74 |
| 15,000,000 | MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC VAR 14/06/2025 | 14,949,450 | 1.10 | | <i>Schweiz</i> | 9,766,600 | 0.72 |
| 10,000,000 | NTT FINANCE CORP 0.082% 13/12/2025 | 9,303,500 | 0.69 | 10,000,000 | UBS GROUP INC VAR 21/03/2025 | 9,766,600 | 0.72 |
| | <i>Jersey Inseln</i> | 27,700,735 | 2.05 | | <i>Spanien</i> | 81,089,857 | 6.00 |
| 10,000,000 | HEATHROW FUNDING LTD 1.50% 12/10/2025 | 9,550,700 | 0.71 | 5,000,000 | ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA 0.625% 15/07/2025 | 4,678,750 | 0.35 |
| 15,000,000 | HEATHROW FUNDING LTD 7.125% 14/02/2024 | 18,150,035 | 1.34 | 5,000,000 | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA VAR PERPETUAL EUR (ISIN ES0813211028) | 4,563,650 | 0.34 |
| | <i>Luxemburg</i> | 30,294,800 | 2.24 | 10,000,000 | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA VAR 22/02/2029 | 9,778,900 | 0.72 |
| 10,000,000 | ARCELORMITTAL SA 1.75% 19/11/2025 | 9,411,700 | 0.69 | 10,000,000 | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA 1.75% 26/11/2025 | 9,710,900 | 0.72 |
| 5,000,000 | AROUNDTOWN SA VAR PERPETUAL EUR (ISIN XS2027946610) | 3,469,350 | 0.26 | 5,000,000 | BANCO SANTANDER SA VAR PERPETUAL EUR (ISIN XS2102912966) | 4,220,900 | 0.31 |
| 5,000,000 | AROUNDTOWN SA 0% 16/07/2026 | 4,065,600 | 0.30 | 10,000,000 | BANCO SANTANDER SA 5.179% 19/11/2025 | 9,597,207 | 0.71 |
| 10,000,000 | CPI PROPERTY GROUP S.A. 2.75% 12/05/2026 | 8,889,900 | 0.66 | 10,000,000 | CAIXABANK SA VAR 13/04/2026 | 9,535,400 | 0.71 |
| 5,000,000 | EUROFINS SCIENTIFIC BONDS VAR PERPETUAL | 4,458,250 | 0.33 | 15,000,000 | CAIXABANK SA VAR 15/02/2029 | 14,838,600 | 1.09 |
| | <i>Niederlande</i> | 248,158,117 | 18.35 | 15,000,000 | INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA 1.625% 28/11/2025 | 14,165,550 | 1.05 |
| 10,000,000 | ABN AMRO BANK NV VAR PERPETUAL | 8,869,700 | 0.66 | | <i>Südkorea</i> | 9,037,735 | 0.67 |
| 10,000,000 | ABN AMRO BANK NV 4.75% 144A 28/07/2025 | 9,526,137 | 0.70 | 10,000,000 | HYUNDAI CAPITAL SERVICES 2.125% REGS 24/04/2025 | 9,037,735 | 0.67 |
| 15,000,000 | AEGON NV 4.00% 25/04/2044 | 14,900,400 | 1.10 | | <i>Vereinigte Staaten von Amerika</i> | 43,181,432 | 3.19 |
| 10,000,000 | ARGENTUM NETHERLAND BV VAR PERPETUAL | 9,745,900 | 0.72 | 10,000,000 | CITIGROUP INC USA VAR 24/07/2026 | 9,588,800 | 0.71 |
| 5,000,000 | COOPERATIEVE RABOBANK UA VAR PERPETUAL EUR (ISIN XS1877860533) | 4,613,100 | 0.34 | 10,000,000 | MMS USA HOLDINGS INC 0.625% 13/06/2025 | 9,423,300 | 0.70 |
| 15,000,000 | ELM BV VAR PERPETUAL EUR (ISIN XS1209031019) | 13,944,300 | 1.03 | 10,000,000 | MORGAN STANLEY VAR 08/05/2026 | 9,812,100 | 0.73 |
| 15,000,000 | HEIMSTADEN BOSTAD TREASURY BV 0.625% 24/07/2025 | 13,188,750 | 0.98 | 10,000,000 | PVH CORP 3.625% REGS 15/07/2024 | 10,107,100 | 0.74 |
| 10,000,000 | IBERDROLA INTERNATIONAL BV VAR PERPETUAL EUR (ISIN XS1797138960) | 9,674,100 | 0.72 | 5,000,000 | WEA FINANCE LLC 2.875% REGS 15/01/2027 | 4,250,132 | 0.31 |
| 25,000,000 | ING GROUP NV VAR 15/02/2029 | 24,579,500 | 1.81 | | Aktien/Anteile aus OGAW/OGA | 122,203,902 | 9.04 |
| 15,000,000 | ING GROUP NV VAR 29/11/2025 | 14,041,200 | 1.04 | | Aktien/Anteile aus Investmentfonds | 122,203,902 | 9.04 |
| 4,000,000 | LEASEPLAN CORPORATION NV 2.125% 06/05/2025 | 3,883,560 | 0.29 | | <i>Frankreich</i> | 77,574,303 | 5.74 |
| 10,000,000 | LOUIS DREYFUS COMPANY FINANCE B V 2.375% 27/11/2025 | 9,684,600 | 0.72 | 67 | AMUNDI EURO LIQUIDITY | 66,775,960 | 4.94 |
| 15,000,000 | NN GROUP NV VAR PERPETUAL | 14,711,550 | 1.09 | 5,000 | AMUNDI FRN CREDIT EURO VALUE FACTOR FCP | 4,821,505 | 0.36 |
| 6,000,000 | STELLANTIS NV 3.875% 05/01/2026 | 6,060,120 | 0.45 | 450 | AMUNDI MULTI FACTOR OPPORTUNITY CREDIT FCP EUR | 4,078,581 | 0.30 |
| 10,000,000 | TELEFONICA EUROPE BV VAR PERPETUAL | 9,560,800 | 0.71 | 2,000 | EUROPEAN HIGH YIELD SRI SICAV | 1,898,257 | 0.14 |
| 10,000,000 | TENNET HOLDING BV VAR PERPETUAL | 9,279,500 | 0.69 | | <i>Irland</i> | 1,713,900 | 0.13 |
| 10,000,000 | TENNET HOLDING BV VAR PERPETUAL EUR (ISIN XS1591694481) | 9,656,700 | 0.71 | 2,000 | SELECT INVESTMENT GRADE B PART A4 | 1,713,900 | 0.13 |
| 10,000,000 | UP JOHN FINANCE BV 1.023% 23/06/2024 | 9,603,100 | 0.71 | | <i>Luxemburg</i> | 42,915,699 | 3.17 |
| 10,000,000 | VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV VAR PERPETUAL EUR (ISIN XS179938995) | 9,251,800 | 0.68 | 1,000 | AMUNDI FUNDS ABSOLUTE RETURN CREDIT - I EUR (C) | 1,079,790 | 0.08 |
| 15,000,000 | VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV VAR PERPETUAL EUR (ISIN XS2187689034) | 13,624,650 | 1.01 | 505 | AMUNDI FUNDS EURO CORPORATE SHORT TERM GREEN BOND | 15,283,249 | 1.13 |
| 10,000,000 | VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV VAR 31/12/2099 EUR (ISIN XS0968913342) | 10,002,400 | 0.74 | 2,000 | AMUNDI FUNDS EURO HIGH YIELD SHORT TERM BOND - O EUR (C) | 2,237,860 | 0.17 |
| 15,000,000 | VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV 3.125% 28/03/2025 | 15,162,750 | 1.11 | 20,000 | AMUNDI FUNDS EUROPEAN SUBORDINATED BOND ESG Z EUR (C) | 19,239,000 | 1.41 |
| 5,000,000 | WINTERSHALL DEA FINANCE BV 0.84% 25/09/2025 | 4,593,500 | 0.34 | | | | |
| | <i>Österreich</i> | 9,547,700 | 0.71 | | | | |
| 10,000,000 | OMV AG VAR PERPETUAL | 9,547,700 | 0.71 | | | | |

Die beigefügten Anmerkungen sind integraler Bestandteil dieses Geschäftsberichts.

Wertpapierbestand zum 30/06/22

| Anzahl Nennwert | Marktwert | % des NIW |
|--|----------------------|--------------|
| | EUR | |
| 1,000 PI SOLUTIONS EUROPEAN CREDIT CONTINUUM J2 EUR FCP | 5,075,800 | 0.38 |
| Derivative Instrumente | 18,398,591 | 1.36 |
| Optionen | 18,398,591 | 1.36 |
| <i>Luxemburg</i> | 18,398,591 | 1.36 |
| 250,000,000 CALL CDX OPTION - ITRAXX EUROPE CROSSOVER SERIES 37 INDEX - 412.50 - 17.08.22 | 124,613 | 0.01 |
| 350,000,000 CALL CDX OPTION - ITRAXX EUROPE CROSSOVER SERIES 37 INDEX - 425.00 - 20.07.22 | 98,634 | 0.01 |
| 350,000,000 PUT CDX OPTION - ITRAXX EUROPE CROSSOVER SERIES 37 INDEX - 512.50 - 20.07.22 | 10,984,970 | 0.81 |
| 250,000,000 PUT CDX OPTION - ITRAXX EUROPE CROSSOVER SERIES 37 INDEX - 575.00 - 17.08.22 | 6,214,287 | 0.46 |
| 250,000,000 PUT CDX OPTION - ITRAXX EUROPE CROSSOVER SERIES 37 INDEX - 875.00 - 17.08.22 | 841,270 | 0.06 |
| 350,000,000 PUT CDX OPTION - ITRAXX EUROPE CROSSOVER SERIES 37 INDEX - 900.00 - 20.07.22 | 134,817 | 0.01 |
| Negative Positionen | -13,335,033 | -0.99 |
| Derivative Instrumente | -13,335,033 | -0.99 |
| Optionen | -13,335,033 | -0.99 |
| <i>Luxemburg</i> | -13,335,033 | -0.99 |
| -350,000,000 CALL CDX OPTION - ITRAXX EUROPE CROSSOVER SERIES 37 INDEX - 450.00 - 20.07.22 | -111,307 | -0.01 |
| -250,000,000 CALL CDX OPTION - ITRAXX EUROPE CROSSOVER SERIES 37 INDEX - 462.50 - 17.08.22 | -382,035 | -0.03 |
| -350,000,000 PUT CDX OPTION - ITRAXX EUROPE CROSSOVER SERIES 37 INDEX - 600.00 - 20.07.22 | -4,053,084 | -0.30 |
| -350,000,000 PUT CDX OPTION - ITRAXX EUROPE CROSSOVER SERIES 37 INDEX - 625.00 - 20.07.22 | -2,974,202 | -0.22 |
| -250,000,000 PUT CDX OPTION - ITRAXX EUROPE CROSSOVER SERIES 37 INDEX - 650.00 - 17.08.22 | -3,641,880 | -0.27 |
| -250,000,000 PUT CDX OPTION - ITRAXX EUROPE CROSSOVER SERIES 37 INDEX - 725.00 - 17.08.22 | -2,172,525 | -0.16 |
| Gesamtwertpapierbestand | 1,267,745,848 | 93.74 |

Die beigegeführten Anmerkungen sind integraler Bestandteil dieses Geschäftsberichts.

Wertpapierbestand zum 30/06/22

| Anzahl Nennwert | Marktwert | % des NIW | Anzahl Nennwert | Marktwert | % des NIW |
|--|-------------------|--------------|---|-------------------|--------------|
| | EUR | | | EUR | |
| Positive Positionen | 72,965,010 | 98.12 | | | |
| Übertragbare und amtlich notierte Wertpapiere und/oder auf anderen Märkten gehandelte Wertpapiere | 69,862,538 | 93.95 | | | |
| Anleihen | 69,862,538 | 93.95 | | | |
| <i>Belgien</i> | <i>11,886,044</i> | <i>15.98</i> | | | |
| 4,400,000 BELGIUM 0% 22/10/2031 | 3,695,912 | 4.96 | | | |
| 3,500,000 BELGIUM 0.90% 22/06/2029 | 3,346,805 | 4.50 | | | |
| 1,190,000 EUROPEAN UNION 0% 04/07/2035 | 883,682 | 1.19 | | | |
| 4,050,000 EUROPEAN UNION 1.00% 06/07/2032 | 3,656,948 | 4.92 | | | |
| 300,000 FLUVIUS SYSTEM OPERATOR 4.00% 06/07/2032 | 302,697 | 0.41 | | | |
| <i>Deutschland</i> | <i>17,631,509</i> | <i>23.72</i> | | | |
| 900,000 BASF SE 1.50% 17/03/2031 | 758,043 | 1.02 | | | |
| 400,000 E ON SE 1.625% 29/03/2031 | 350,596 | 0.47 | | | |
| 8,238,000 FEDERAL REPUBLIC OF GERMANY 0% 15/08/2030 | 7,474,666 | 10.06 | | | |
| 4,220,000 GERMANY BUND 0% 15/08/2029 | 3,890,967 | 5.23 | | | |
| 900,000 KREDITANSTALT FUR WIEDERAUFBAU 0% 09/11/2028 | 809,838 | 1.09 | | | |
| 2,360,000 KREDITANSTALT FUR WIEDERAUFBAU 1.375% 07/06/2032 | 2,223,828 | 2.99 | | | |
| 900,000 NRW BANK 0.25% 16/03/2027 | 844,191 | 1.14 | | | |
| 650,000 STATE OF LOWER SAXONY 0.01% 25/11/2027 | 594,815 | 0.80 | | | |
| 700,000 STATE OF LOWER SAXONY 1.50% 17/10/2029 | 684,565 | 0.92 | | | |
| <i>Finnland</i> | <i>3,312,102</i> | <i>4.45</i> | | | |
| 1,630,000 FINLAND 0.50% 15/09/2029 | 1,514,009 | 2.03 | | | |
| 550,000 NORDIC INVESTMENT BANK 0.25% 09/03/2029 | 497,651 | 0.67 | | | |
| 1,350,000 REPUBLIC OF FINLAND 1.50% 15/09/2032 | 1,300,442 | 1.75 | | | |
| <i>Frankreich</i> | <i>7,429,663</i> | <i>9.99</i> | | | |
| 600,000 ACTION LOGEMENT SERVICES 1.375% 13/04/2032 | 551,304 | 0.74 | | | |
| 100,000 AGENCE FRANCAISE DE DEVELOPPEMENT SA 1.375% 05/07/2032 | 92,474 | 0.12 | | | |
| 800,000 AGENCE FRANCAISE DE DEVELOPPEMENT SA 1.625% 25/05/2032 | 758,608 | 1.02 | | | |
| 900,000 BNP PARIBAS SA VAR 31/03/2032 | 819,936 | 1.10 | | | |
| 1,400,000 CAISSE D AMORTISSEMENT DE LA DETTE SOCIALE 0.60% 25/11/2029 | 1,276,534 | 1.72 | | | |
| 500,000 CARREFOUR SA 2.375% 30/10/2029 | 455,410 | 0.61 | | | |
| 2,282,000 FRANCE OAT 0% 25/11/2029 | 2,027,671 | 2.74 | | | |
| 1,510,000 FRANCE (REPUBLIQUE) 0% 25/05/2032 | 1,251,835 | 1.68 | | | |
| 230,000 TOTAL ENERGIES SE VAR PERPETUAL EUR (ISIN XS2432130610) | 195,891 | 0.26 | | | |
| <i>Irland</i> | <i>3,150,293</i> | <i>4.24</i> | | | |
| 3,580,000 IRELAND 0.20% 18/10/2030 | 3,150,293 | 4.24 | | | |
| <i>Italien</i> | <i>1,987,636</i> | <i>2.67</i> | | | |
| 1,850,000 ITALY BTP 3.00% 01/08/2029 | 1,871,220 | 2.51 | | | |
| 100,000 ITALY BTP 5.25% 01/11/2029 | 116,416 | 0.16 | | | |
| <i>Kanada</i> | <i>868,980</i> | <i>1.17</i> | | | |
| 1,000,000 BANK OF NOVA SCOTIA 0.375% 26/03/2030 | 868,980 | 1.17 | | | |
| | | | <i>Niederlande</i> | <i>6,402,738</i> | <i>8.61</i> |
| | | | 2,620,000 BNG BANK NV 0.25% 12/01/2032 | 2,202,582 | 2.96 |
| | | | 400,000 DSV FINANCE BV 1.375% 16/03/2030 | 352,352 | 0.47 |
| | | | 1,190,000 NETHERLANDS 0% 15/07/2030 | 1,054,816 | 1.42 |
| | | | 1,000,000 NETHERLANDS 0% 15/07/2031 | 868,300 | 1.17 |
| | | | 1,990,000 NETHERLANDS 0.75% 15/07/2028 | 1,924,688 | 2.59 |
| | | | <i>Österreich</i> | <i>2,091,836</i> | <i>2.81</i> |
| | | | 2,440,000 AUSTRIA 0% 20/02/2031 | 2,091,836 | 2.81 |
| | | | <i>Portugal</i> | <i>2,313,989</i> | <i>3.11</i> |
| | | | 2,480,000 REPUBLIC OF PORTUGAL 1.65% 16/07/2032 | 2,313,989 | 3.11 |
| | | | <i>Schweden</i> | <i>467,823</i> | <i>0.63</i> |
| | | | 504,000 KOMMUNINVEST I SVERIGE AB 0.875% 01/09/2029 | 467,823 | 0.63 |
| | | | <i>Spanien</i> | <i>12,319,925</i> | <i>16.57</i> |
| | | | 2,300,000 KINGDOM OF SPAIN 0.50% 31/10/2031 | 1,947,318 | 2.62 |
| | | | 11,255,000 KINGDOM OF SPAIN 0.80% 30/07/2029 | 10,372,607 | 13.95 |
| | | | Aktien/Anteile aus OGAW/OGA | 3,102,472 | 4.17 |
| | | | Aktien/Anteile aus Investmentfonds | 3,102,472 | 4.17 |
| | | | <i>Frankreich</i> | <i>3,102,472</i> | <i>4.17</i> |
| | | | 3 AMUNDI EUR LIQUIDITY SRI FCP | 3,102,472 | 4.17 |
| | | | Gesamtwertpapierbestand | 72,965,010 | 98.12 |

Die beigefügten Anmerkungen sind integraler Bestandteil dieses Geschäftsberichts.

Wertpapierbestand zum 30/06/22

| Anzahl Nennwert | Marktwert | % des NIW | Anzahl Nennwert | Marktwert | % des NIW |
|--|-------------------|--------------|---|----------------|-------------|
| | EUR | | | EUR | |
| Positive Positionen | 36,642,519 | 96.99 | | | |
| Übertragbare und amtlich notierte Wertpapiere und/oder auf anderen Märkten gehandelte Wertpapiere | 35,727,215 | 94.57 | | | |
| Anleihen | 35,727,215 | 94.57 | | | |
| <i>Belgien</i> | 5,802,793 | 15.36 | | | |
| 530,000 BELGIUM 0.40% 22/06/2040 | 373,056 | 0.99 | | | |
| 350,000 BELGIUM 0.65% 22/06/2071 | 165,211 | 0.44 | | | |
| 170,000 BELGIUM 1.70% 22/06/2050 | 139,907 | 0.37 | | | |
| 300,000 BELGIUM 1.90% 22/06/2038 | 282,180 | 0.75 | | | |
| 138,000 BELGIUM 2.15% 22/06/2066 | 121,810 | 0.32 | | | |
| 220,000 BELGIUM 2.25% 22/06/2057 | 202,642 | 0.54 | | | |
| 120,000 BELGIUM 3.75% 22/06/2045 | 144,692 | 0.38 | | | |
| 320,000 BELGIUM 4.25% 28/03/2041 | 402,573 | 1.07 | | | |
| 1,000,000 BELGIUM 5.00% 28/03/2035 | 1,312,570 | 3.47 | | | |
| 1,200,000 EUROPEAN UNION 0% 04/07/2035 | 891,108 | 2.36 | | | |
| 340,000 EUROPEAN UNION 0.30% 04/11/2050 | 195,007 | 0.52 | | | |
| 370,000 EUROPEAN UNION 0.45% 02/05/2046 | 241,543 | 0.64 | | | |
| 700,000 EUROPEAN UNION 1.00% 06/07/2032 | 632,065 | 1.67 | | | |
| 200,000 FLUVIUS SYSTEM OPERATOR 4.00% 06/07/2032 | 201,798 | 0.53 | | | |
| 670,000 KINGDOM OF BELGIUM 1.40% 22/06/2053 | 496,631 | 1.31 | | | |
| <i>Deutschland</i> | 2,183,214 | 5.78 | | | |
| 230,000 E ON SE 1.625% 29/03/2031 | 201,593 | 0.53 | | | |
| 1,138,000 GERMANY BUND 3.25% 04/07/2042 | 1,460,600 | 3.87 | | | |
| 500,000 KREDITANSTALT FÜR WIEDERAUFBAU 1.125% 31/03/2037 | 424,025 | 1.12 | | | |
| 220,000 STATE OF NORTH RHINE WESTPHALIA 0.95% 10/01/2121 | 96,996 | 0.26 | | | |
| <i>Finnland</i> | 1,164,087 | 3.08 | | | |
| 200,000 FINLAND 1.125% 15/04/2034 | 181,970 | 0.48 | | | |
| 360,000 FINLAND 1.375% 15/04/2047 | 307,814 | 0.81 | | | |
| 700,000 REPUBLIC OF FINLAND 1.50% 15/09/2032 | 674,303 | 1.79 | | | |
| <i>Frankreich</i> | 7,103,277 | 18.80 | | | |
| 100,000 AGENCE FRANCAISE DE DEVELOPPEMENT SA 1.375% 05/07/2032 | 92,474 | 0.24 | | | |
| 400,000 AGENCE FRANCAISE DE DEVELOPPEMENT SA 1.625% 25/05/2032 | 379,304 | 1.00 | | | |
| 400,000 BNP PARIBAS SA VAR 31/03/2032 | 364,416 | 0.96 | | | |
| 300,000 CARREFOUR SA 2.375% 30/10/2029 | 273,246 | 0.72 | | | |
| 1,170,000 FRANCE OAT 0.50% 25/05/2040 | 859,564 | 2.28 | | | |
| 1,800,000 FRANCE OAT 0.50% 25/06/2044 | 1,227,564 | 3.25 | | | |
| 231,000 FRANCE OAT 0.75% 25/05/2052 | 147,956 | 0.39 | | | |
| 290,000 FRANCE OAT 0.75% 25/05/2053 | 181,328 | 0.48 | | | |
| 765,000 FRANCE OAT 1.50% 25/05/2050 | 621,700 | 1.65 | | | |
| 740,000 FRANCE OAT 1.75% 25/05/2066 | 591,874 | 1.57 | | | |
| 360,000 FRANCE OAT 1.75% 25/06/2039 | 336,780 | 0.89 | | | |
| 343,000 FRANCE OAT 2.00% 25/05/2048 | 315,759 | 0.84 | | | |
| 310,000 FRANCE OAT 4.00% 25/04/2060 | 416,792 | 1.10 | | | |
| 940,000 FRANCE OAT 4.00% 25/10/2038 | 1,166,765 | 3.09 | | | |
| 150,000 TOTAL ENERGIES SE VAR PERPETUAL EUR (ISIN XS2432130610) | 127,755 | 0.34 | | | |
| | | | <i>Irland</i> | 815,065 | 2.16 |
| | | | 230,000 IRELAND 1.50% 15/05/2050 | 185,185 | 0.49 |
| | | | 670,000 IRELAND 1.70% 15/05/2037 | 629,880 | 1.67 |
| | | | <i>Italien</i> | 6,998,892 | 18.53 |
| | | | 1,040,000 ITALIAN REPUBLIC 2.15% 01/09/2052 | 761,176 | 2.01 |
| | | | 620,000 ITALIAN REPUBLIC 2.50% 01/12/2032 | 574,802 | 1.52 |
| | | | 2,100,000 ITALIAN REPUBLIC 3.25% 01/03/2038 | 2,036,391 | 5.40 |
| | | | 625,000 ITALY BTP 0.95% 01/03/2037 | 449,100 | 1.19 |
| | | | 780,000 ITALY BTP 3.10% 01/03/2040 | 740,126 | 1.96 |
| | | | 1,081,000 ITALY BTP 3.45% 01/03/2048 | 1,065,055 | 2.82 |
| | | | 1,158,000 ITALY BTP 4.75% 01/09/2044 | 1,372,242 | 3.63 |
| | | | <i>Niederlande</i> | 3,063,954 | 8.11 |
| | | | 240,000 BNG BANK NV 1.25% 30/03/2037 | 205,075 | 0.54 |
| | | | 200,000 NETHERLANDS 0.50% 15/01/2040 | 157,264 | 0.42 |
| | | | 930,000 NETHERLANDS 2.50% 15/01/2033 | 1,000,634 | 2.65 |
| | | | 755,000 NETHERLANDS 2.75% 15/01/2047 | 884,928 | 2.34 |
| | | | 200,000 NETHERLANDS 3.75% 15/01/2042 | 258,164 | 0.68 |
| | | | 440,000 NETHERLANDS 4.00% 15/01/2037 | 557,889 | 1.48 |
| | | | <i>Österreich</i> | 1,946,623 | 5.15 |
| | | | 149,000 AUSTRIA 0.85% 30/06/2120 | 68,798 | 0.18 |
| | | | 118,000 AUSTRIA 1.50% 20/02/2047 | 102,738 | 0.27 |
| | | | 147,000 AUSTRIA 2.10% 20/09/2117 | 127,202 | 0.34 |
| | | | 520,000 AUSTRIA 2.40% 23/05/2034 | 542,880 | 1.44 |
| | | | 227,000 AUSTRIA 3.15% 20/06/2044 | 265,515 | 0.70 |
| | | | 161,000 AUSTRIA 3.80% 26/01/2062 | 220,396 | 0.58 |
| | | | 217,000 AUSTRIA 4.15% 15/03/2037 | 272,513 | 0.72 |
| | | | 450,000 REPUBLIC OF AUSTRIA 0.25% 20/10/2036 | 346,581 | 0.92 |
| | | | <i>Portugal</i> | 687,323 | 1.82 |
| | | | 549,000 PORTUGAL 0.90% 12/10/2035 | 447,517 | 1.19 |
| | | | 200,000 PORTUGAL 4.10% 15/02/2045 | 239,806 | 0.63 |
| | | | <i>Schweden</i> | 277,538 | 0.73 |
| | | | 299,000 KOMMUNINVEST I SVERIGE AB 0.875% 01/09/2029 | 277,538 | 0.73 |
| | | | <i>Spanien</i> | 5,684,449 | 15.05 |
| | | | 800,000 KINGDOM OF SPAIN 1.90% 31/10/2052 | 608,080 | 1.61 |
| | | | 310,000 KINGDOM OF SPAIN 2.70% 31/10/2048 | 294,841 | 0.78 |
| | | | 330,000 SPAIN 1.00% 31/10/2050 | 204,702 | 0.54 |
| | | | 550,000 SPAIN 1.20% 31/10/2040 | 419,606 | 1.11 |
| | | | 1,950,000 SPAIN 1.85% 30/07/2035 | 1,780,370 | 4.71 |
| | | | 10,000 SPAIN 2.90% 31/10/2046 | 9,949 | 0.03 |
| | | | 541,000 SPAIN 4.20% 31/01/2037 | 641,534 | 1.70 |
| | | | 768,000 SPAIN 4.70% 30/07/2041 | 982,986 | 2.60 |
| | | | 540,000 SPAIN 5.15% 31/10/2044 | 742,381 | 1.97 |
| | | | Aktien/Anteile aus OGAW/OGA | 915,304 | 2.42 |
| | | | Aktien/Anteile aus Investmentfonds | 915,304 | 2.42 |
| | | | <i>Frankreich</i> | 915,304 | 2.42 |
| | | | 0.919 AMUNDI EUR LIQUIDITY SRI FCP | 915,304 | 2.42 |

Die beigefügten Anmerkungen sind integraler Bestandteil dieses Geschäftsberichts.

Wertpapierbestand zum 30/06/22

| Anzahl | Nennwert | Marktwert | % des NIW |
|--------|--------------------------------|-------------------|--------------|
| | | EUR | |
| | Gesamtwertpapierbestand | 36,642,519 | 96.99 |

Die beigefügten Anmerkungen sind integraler Bestandteil dieses Geschäftsberichts.

Wertpapierbestand zum 30/06/22

| Anzahl Nennwert | Marktwert | % des NIW |
|--|-------------------|--------------|
| | USD | |
| Positive Positionen | 21,270,892 | 90.44 |
| Übertragbare und amtlich notierte Wertpapiere und/oder auf anderen Märkten gehandelte Wertpapiere | 21,270,892 | 90.44 |
| Anleihen | 21,270,892 | 90.44 |
| <i>Finanz- und Kreditdienstleistungen</i> | 622,824 | 2.65 |
| 600,000 POWER FINANCE CORPORATION 6.15% 06/12/2028 | 622,824 | 2.65 |
| <i>Gouvernements</i> | 18,022,389 | 76.63 |
| 50,000,000 GOVERNMENT OF GUJARAT 8.57% 06/11/2028 | 660,596 | 2.81 |
| 50,000,000 GOVERNMENT OF WEST BENGAL 6.79% 30/06/2028 | 606,427 | 2.58 |
| 68,000,000 INDIA 5.15% 09/11/2025 | 811,703 | 3.45 |
| 52,000,000 INDIA 5.22% 15/06/2025 | 628,672 | 2.67 |
| 68,000,000 INDIA 5.63% 12/04/2026 | 819,212 | 3.48 |
| 37,000,000 INDIA 5.77% 03/08/2030 | 423,552 | 1.80 |
| 47,000,000 INDIA 5.79% 11/05/2030 | 539,492 | 2.29 |
| 37,000,000 INDIA 5.85% 01/12/2030 | 426,014 | 1.81 |
| 76,000,000 INDIA 6.19% 16/09/2034 | 859,123 | 3.65 |
| 76,000,000 INDIA 6.22% 16/03/2035 | 858,762 | 3.65 |
| 120,000,000 INDIA 6.64% 16/06/2035 | 1,405,362 | 5.97 |
| 38,000,000 INDIA 6.67% 17/12/2050 | 424,685 | 1.81 |
| 46,000,000 INDIA 6.68% 17/09/2031 | 554,248 | 2.36 |
| 68,000,000 INDIA 6.79% 26/12/2029 | 834,151 | 3.55 |
| 68,000,000 INDIA 7.26% 14/01/2029 | 856,810 | 3.64 |
| 25,500,000 INDIA 7.27% 08/04/2026 | 323,406 | 1.38 |
| 51,000,000 INDIA 7.57% 17/06/2033 | 648,307 | 2.76 |
| 42,000,000 INDIA 7.59% 20/03/2029 | 537,968 | 2.29 |
| 42,000,000 INDIA 7.61% 09/05/2030 | 537,452 | 2.29 |
| 39,000,000 INDIA 7.72% 25/05/2025 | 503,209 | 2.14 |
| 34,000,000 INDIA 7.73% 19/12/2034 | 436,581 | 1.86 |
| 67,000,000 INDIA 8.15% 24/11/2026 | 877,521 | 3.72 |
| 48,000,000 INDIA 8.24% 10/11/2033 | 641,291 | 2.73 |
| 35,000,000 REPUBLIC OF INDIA 6.79% 15/05/2027 | 434,814 | 1.85 |
| 86,000,000 REPUBLIC OF INDIA 7.17% 08/01/2028 | 1,083,677 | 4.60 |
| 67,000,000 REPUBLIC OF INDIA 7.59% 11/01/2026 | 860,028 | 3.66 |
| 32,000,000 REPUBLIC OF INDIA 8.60% 02/06/2028 | 429,326 | 1.83 |
| <i>Investmentbanking und Maklerdienste</i> | 1,998,952 | 8.50 |
| 1,150,000 MUTHOOT FINANCE 4.40% REGS 02/09/2023 | 1,118,985 | 4.76 |
| 400,000 REC LTD 3.375% 25/07/2024 | 391,432 | 1.66 |
| 500,000 REC LTD 3.50% 12/12/2024 | 488,535 | 2.08 |
| <i>Öl, Gas und Kohle</i> | 626,727 | 2.66 |
| 650,000 ONGC VIDESH VANKORNEFT PTE LTD 3.75% 27/07/2026 | 626,727 | 2.66 |
| Gesamtwertpapierbestand | 21,270,892 | 90.44 |

Die beigefügten Anmerkungen sind integraler Bestandteil dieses Geschäftsberichts.

Wertpapierbestand zum 30/06/22

| Anzahl Nennwert | Marktwert | % des NIW | Anzahl Nennwert | Marktwert | % des NIW |
|--|-------------------|--------------|-----------------------------------|-------------------|--------------|
| | EUR | | | EUR | |
| Positive Positionen | 41,479,575 | 84.15 | | | |
| Übertragbare und amtlich notierte Wertpapiere und/oder auf anderen Märkten gehandelte Wertpapiere | 41,479,575 | 84.15 | | | |
| Aktien | 41,479,575 | 84.15 | | | |
| <i>Belgien</i> | 1,302,128 | 2.64 | | | |
| 7,544 KBC GROUPE | 403,906 | 0.82 | | | |
| 3,627 SOLVAY | 280,440 | 0.57 | | | |
| 7,661 UCB SA | 617,782 | 1.25 | | | |
| <i>Dänemark</i> | 2,094,263 | 4.25 | | | |
| 18,784 GN GREAT NORDIC | 628,184 | 1.27 | | | |
| 13,850 NOVO NORDISK | 1,466,079 | 2.98 | | | |
| <i>Deutschland</i> | 8,857,922 | 17.97 | | | |
| 3,302 ADIDAS NOM | 557,246 | 1.13 | | | |
| 4,195 ALLIANZ SE-NOM | 763,993 | 1.55 | | | |
| 15,131 BAYER AG | 858,230 | 1.74 | | | |
| 10,201 BAYERISCHE MOTORENWERKE | 749,365 | 1.52 | | | |
| 13,085 DAIMLER TRUCK HOLDING AG | 325,947 | 0.66 | | | |
| 3,070 DEUTSCHE BOERSE AG | 489,972 | 0.99 | | | |
| 18,646 DEUTSCHE POST AG-NOM | 666,408 | 1.35 | | | |
| 7,712 FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO | 367,323 | 0.75 | | | |
| 3,541 HANNOVER RUECK SE | 490,429 | 0.99 | | | |
| 24,683 INFINEON TECHNOLOGIES AG-NOM | 569,930 | 1.16 | | | |
| 11,017 KION GROUP | 436,163 | 0.88 | | | |
| 7,379 MERCK KGAA | 1,188,019 | 2.42 | | | |
| 10,485 SIEMENS AG-NOM | 1,017,989 | 2.07 | | | |
| 12,820 VONOVIA SE NAMEN AKT REIT | 376,908 | 0.76 | | | |
| <i>Finnland</i> | 461,725 | 0.94 | | | |
| 10,931 NESTE CORPORATION | 461,725 | 0.94 | | | |
| <i>Frankreich</i> | 6,112,694 | 12.40 | | | |
| 7,705 AIR LIQUIDE | 987,164 | 2.00 | | | |
| 16,196 BNP PARIBAS | 734,732 | 1.49 | | | |
| 13,271 BOUYGUES | 389,637 | 0.79 | | | |
| 6,480 CAP GEMINI SE | 1,059,156 | 2.15 | | | |
| 14,174 EDENRED | 637,405 | 1.29 | | | |
| 2,406 LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE | 1,399,569 | 2.84 | | | |
| 7,732 THALES SA | 905,031 | 1.84 | | | |
| <i>Großbritannien</i> | 7,070,177 | 14.34 | | | |
| 25,396 ANGLO AMERICAN PLC | 866,497 | 1.76 | | | |
| 81,322 INFORMA PLC | 499,571 | 1.01 | | | |
| 67,564 PRUDENTIAL PLC | 797,456 | 1.62 | | | |
| 16,030 RECKITT BENCKISER GROUP PLC | 1,148,991 | 2.32 | | | |
| 121,225 RENTOKIL INITIAL | 668,371 | 1.36 | | | |
| 41,999 SHELL PLC | 1,041,193 | 2.11 | | | |
| 34,397 SHELL PLC | 852,732 | 1.73 | | | |
| 45,988 SMITHS GROUP | 747,679 | 1.52 | | | |
| 62,297 STANDARD CHARTERED | 447,687 | 0.91 | | | |
| | | | <i>Irland</i> | 2,329,832 | 4.73 |
| | | | 29,651 CRH PLC | 978,483 | 1.99 |
| | | | 6,872 FLUTTER ENTMT RG | 663,011 | 1.34 |
| | | | 7,536 KERRY GROUP A | 688,338 | 1.40 |
| | | | <i>Italien</i> | 2,914,200 | 5.91 |
| | | | 128,494 ENEL SPA | 670,739 | 1.36 |
| | | | 41,036 MEDIOBANCA SPA | 338,875 | 0.69 |
| | | | 95,010 NEXI SPA | 750,959 | 1.52 |
| | | | 109,929 SNAM RETE GAS | 549,535 | 1.11 |
| | | | 66,640 UNICREDIT SPA | 604,092 | 1.23 |
| | | | <i>Niederlande</i> | 3,988,366 | 8.09 |
| | | | 12,479 AIRBUS BR BEARER SHS | 1,153,683 | 2.35 |
| | | | 1,248 EURONEXT | 97,219 | 0.20 |
| | | | 81,709 ING GROUP NV | 770,598 | 1.56 |
| | | | 29,616 KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE | 736,254 | 1.49 |
| | | | 221,012 KONINKLIJKE KPN NV | 751,662 | 1.52 |
| | | | 40,651 STELLANTIS NV | 478,950 | 0.97 |
| | | | <i>Portugal</i> | 624,638 | 1.27 |
| | | | 55,846 GALP ENERGIA SGPS SA-B | 624,638 | 1.27 |
| | | | <i>Schweiz</i> | 5,074,181 | 10.29 |
| | | | 2,151 LONZA GROUP AG N | 1,093,875 | 2.22 |
| | | | 22,320 NESTLE SA | 2,485,104 | 5.04 |
| | | | 4,698 ROCHE HOLDING LTD | 1,495,202 | 3.03 |
| | | | <i>Spanien</i> | 649,449 | 1.32 |
| | | | 30,081 INDITEX | 649,449 | 1.32 |
| | | | Gesamtwertpapierbestand | 41,479,575 | 84.15 |

Die beigegeführten Anmerkungen sind integraler Bestandteil dieses Geschäftsberichts.

Wertpapierbestand zum 30/06/22

| Anzahl Nennwert | Marktwert | % des NIW | Anzahl Nennwert | Marktwert | % des NIW |
|--|--------------------|--------------|---|--------------------|--------------|
| | EUR | | | EUR | |
| Positive Positionen | 206,200,743 | 91.31 | 8,600,000 GERMANY BUBILLS 0% 24/08/2022 | 8,607,310 | 3.81 |
| <i>Übertragbare und amtlich notierte Wertpapiere und/oder auf anderen Märkten gehandelte Wertpapiere</i> | 104,679,991 | 46.36 | 4,000,000 NETHERLANDS 0% 28/10/2022 | 4,003,760 | 1.77 |
| Anleihen | 104,679,991 | 46.36 | 8,750,000 NETHERLANDS 0% 30/08/2022 | 8,757,175 | 3.88 |
| <i>Gouvernements</i> | <i>104,679,991</i> | <i>46.36</i> | Gesamtwertpapierbestand | 206,200,743 | 91.31 |
| 9,460,000 AUSTRIA 0% 20/09/2022 | 9,469,460 | 4.19 | | | |
| 11,500,000 AUSTRIA 3.40% 22/11/2022 | 11,660,310 | 5.17 | | | |
| 2,900,000 FINLAND 1.625% 15/09/2022 | 2,911,948 | 1.29 | | | |
| 14,000,000 FRANCE OAT 2.25% 25/10/2022 | 14,109,760 | 6.26 | | | |
| 1,000,000 FREE HANSEATIC CITY OF BREMEN 0% 06/09/2022 | 1,000,460 | 0.44 | | | |
| 6,850,000 FREE HANSEATIC CITY OF BREMEN 0% 12/07/2022 | 6,849,863 | 3.03 | | | |
| 1,050,000 FREE HANSEATIC CITY OF BREMEN 0% 20/09/2022 | 1,050,452 | 0.47 | | | |
| 2,500,000 FREE HANSEATIC CITY OF BREMEN 0.50% 07/10/2022 | 2,504,875 | 1.11 | | | |
| 2,800,000 FREE HANSEATIC CITY OF HAMBURG 1.875% 26/09/2022 | 2,813,832 | 1.25 | | | |
| 800,000 GERMANY BUND 0% 07/10/2022 | 800,880 | 0.35 | | | |
| 9,300,000 GERMANY BUND 0% 15/12/2022 | 9,304,836 | 4.12 | | | |
| 10,230,000 GERMANY BUND 0% 16/09/2022 | 10,240,843 | 4.53 | | | |
| 6,400,000 GERMANY BUND 1.50% 04/09/2022 | 6,422,656 | 2.84 | | | |
| 2,750,000 LAND BERLIN 0.75% 11/11/2022 | 2,758,195 | 1.22 | | | |
| 3,650,000 LAND SCHLESWIG-HOLSTEIN 1.125% 29/07/2022 | 3,653,613 | 1.62 | | | |
| 1,300,000 STATE OF BADEN-WUERTTEMBERG 1.00% 18/07/2022 | 1,300,676 | 0.58 | | | |
| 3,600,000 STATE OF HESSE 0.375% 04/07/2022 | 3,600,000 | 1.59 | | | |
| 600,000 STATE OF HESSE 1.40% 12/12/2022 | 603,522 | 0.27 | | | |
| 200,000 STATE OF LOWER SAXONY 0.05% 10/11/2022 | 200,058 | 0.09 | | | |
| 5,800,000 STATE OF LOWER SAXONY 1.00% 18/08/2022 | 5,809,802 | 2.57 | | | |
| 4,000,000 STATE OF NORTH RHINE WESTPHALIA 0% 05/12/2022 | 4,000,000 | 1.77 | | | |
| 1,000,000 STATE OF NORTH RHINE WESTPHALIA 1.875% 15/09/2022 | 1,004,330 | 0.44 | | | |
| 2,600,000 STATE OF RHINELAND PALATINATE 1.75% 05/09/2022 | 2,609,620 | 1.16 | | | |
| Geldmarktinstrumente | 101,520,752 | 44.95 | | | |
| <i>Gouvernements</i> | <i>101,520,752</i> | <i>44.95</i> | | | |
| 9,000,000 BELGIUM 0% 08/09/2022 | 9,007,830 | 3.99 | | | |
| 9,450,000 BELGIUM 0% 10/11/2022 | 9,455,859 | 4.19 | | | |
| 7,350,000 BELGIUM 0% 14/07/2022 | 7,351,543 | 3.26 | | | |
| 500,000 FRANCE BTF 0% 03/08/2022 | 500,240 | 0.22 | | | |
| 12,100,000 FRANCE BTF 0% 05/10/2022 | 12,111,737 | 5.36 | | | |
| 8,650,000 FRANCE BTF 0% 10/08/2022 | 8,655,622 | 3.83 | | | |
| 6,150,000 FRANCE BTF 0% 13/07/2022 | 6,151,046 | 2.72 | | | |
| 1,450,000 FRANCE BTF 0% 17/08/2022 | 1,451,088 | 0.64 | | | |
| 2,850,000 FRANCE BTF 0% 19/10/2022 | 2,852,565 | 1.26 | | | |
| 700,000 FRANCE BTF 0% 21/09/2022 | 700,784 | 0.31 | | | |
| 2,700,000 FRANCE BTF 0% 24/08/2022 | 2,702,079 | 1.20 | | | |
| 9,750,000 FRANCE BTF 0% 30/11/2022 | 9,758,190 | 4.32 | | | |
| 7,000,000 GERMANY BUBILLS 0% 20/07/2022 | 7,002,380 | 3.10 | | | |
| 2,450,000 GERMANY BUBILLS 0% 23/11/2022 | 2,451,544 | 1.09 | | | |

Die beigegeführten Anmerkungen sind integraler Bestandteil dieses Geschäftsberichts.

| | | Erläut. Amundi S.F. - Diversified Short-Term Bond | | Amundi S.F. - Euro Curve 7-10year | |
|--|-------|---|-------------------|-----------------------------------|--------------------|
| | | 30/06/2022 EUR | 30/06/2021 EUR | 30/06/2022 EUR | 30/06/2021 EUR |
| Aktiva | | | | | |
| Wertpapiere zu Einstandspreisen | | 1,334,296,993 | - | 78,249,008 | 102,137,739 |
| Realisierte Nettogewinne/(-verluste) aus Wertpapieren | | -71,614,703 | - | -5,283,998 | -935,852 |
| Anlagen in Wertpapieren zum Marktwert | 2 | 1,262,682,290 | - | 72,965,010 | 101,201,887 |
| Zum Marktwert erworbene Optionskontrakte mit Vorabprämie | 2, 12 | 18,398,591 | - | - | - |
| Nicht realisierter Nettogewinn aus termingeschäftartigen Optionen | 2, 12 | - | - | 62,440 | 3,000 |
| Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisentermingeschäften | 2, 9 | - | - | - | - |
| Nicht realisierter Nettogewinn aus Finanztermingeschäften | 2, 8 | - | - | - | 106,603 |
| Bareinlagen bei Banken und Maklern | | 79,037,943 | - | 2,073,096 | 7,004,053 |
| Zinsguthaben | | 11,711,432 | - | 156,595 | 471,448 |
| Guthaben aus Dividenden | | - | - | - | - |
| Forderungen aus Zeichnungen | | 2,497,700 | - | 172 | 175 |
| Forderungen aus Wertpapierverkäufen | | 65,318,153 | - | - | 496,957 |
| Sonstige Forderungen | | 1,608 | - | - | - |
| Gesamtsumme der Aktiva | | 1,439,647,717 | - | 75,257,313 | 109,284,123 |
| Passiva | | | | | |
| Banküberziehung/Maklerverbindlichkeiten | | 146,865 | - | - | - |
| Zum Marktwert ausgefertigte Optionskontrakte mit Vorabprämie | 2, 12 | 13,335,033 | - | - | - |
| Nicht realisierter Nettoverlust aus termingeschäftartigen Optionen | 2, 12 | 36,750 | - | - | - |
| Nicht realisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften | 2, 9 | 770,966 | - | - | - |
| Nicht realisierter Nettoverlust aus Finanztermingeschäften | 2, 8 | 2,696,990 | - | 161,070 | - |
| Nicht realisierter Nettoverlust aus Swapgeschäften | 2, 13 | - | - | 384,580 | 267,565 |
| Verbindlichkeiten aus Rücknahmen | | 7,233,191 | - | 44,770 | 305,603 |
| Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen | | 57,993,636 | - | 298,014 | 644,417 |
| Angefallene Kosten | | 5,019,152 | - | 8,650 | 328,655 |
| Sonstige Verbindlichkeiten | | - | - | - | 43,624 |
| Gesamtsumme der Passiva | | 87,232,583 | - | 897,084 | 1,589,864 |
| Nettovermögen | | 1,352,415,134 | - | 74,360,229 | 107,694,259 |

Die beigegeführten Anmerkungen sind integraler Bestandteil dieses Geschäftsberichts.

| | Erläut | Amundi S.F. - Euro Curve 10+year | | Amundi S.F. - SBI FM India Bond | |
|--|--------|----------------------------------|-------------------|---------------------------------|-------------------|
| | | 30/06/2022 EUR | 30/06/2021 EUR | 30/06/2022 USD | 30/06/2021 USD |
| Aktiva | | | | | |
| Wertpapiere zu Einstandspreisen | | 46,180,690 | 68,139,815 | 23,822,769 | 20,559,737 |
| Realisierte Nettogewinne/(-verluste) aus Wertpapieren | | -9,538,171 | -2,827,598 | -2,551,877 | -20,157 |
| Anlagen in Wertpapieren zum Marktwert | 2 | 36,642,519 | 65,312,217 | 21,270,892 | 20,539,580 |
| Zum Marktwert erworbene Optionskontrakte mit Vorabprämie | 2, 12 | - | - | - | - |
| Nicht realisierter Nettogewinn aus termingeschäftartigen Optionen | 2, 12 | 31,080 | 2,100 | - | - |
| Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisentermingeschäften | 2, 9 | - | - | - | 12,425 |
| Nicht realisierter Nettogewinn aus Finanztermingeschäften | 2, 8 | - | 82,480 | - | - |
| Bareinlagen bei Banken und Maklern | | 1,745,658 | 3,576,438 | 2,093,419 | 24,370,000 |
| Zinsguthaben | | 354,815 | 505,377 | 278,476 | 263,534 |
| Guthaben aus Dividenden | | - | - | - | - |
| Forderungen aus Zeichnungen | | 23,992 | 592,061 | - | - |
| Forderungen aus Wertpapierverkäufen | | - | 298,174 | - | - |
| Sonstige Forderungen | | - | - | - | - |
| Gesamtsumme der Aktiva | | 38,798,064 | 70,368,847 | 23,642,787 | 45,185,539 |
| Passiva | | | | | |
| Banküberziehung/Maklerverbindlichkeiten | | - | - | - | 18,503,701 |
| Zum Marktwert ausgefertigte Optionskontrakte mit Vorabprämie | 2, 12 | - | - | - | - |
| Nicht realisierter Nettoverlust aus termingeschäftartigen Optionen | 2, 12 | - | - | - | - |
| Nicht realisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften | 2, 9 | - | 7,499 | 63,932 | - |
| Nicht realisierter Nettoverlust aus Finanztermingeschäften | 2, 8 | 144,190 | - | - | - |
| Nicht realisierter Nettoverlust aus Swapgeschäften | 2,13 | 547,585 | 229,341 | - | - |
| Verbindlichkeiten aus Rücknahmen | | 11,244 | 290,803 | - | - |
| Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen | | 198,676 | 396,564 | - | 1,657,628 |
| Angefallene Kosten | | 118,510 | 236,320 | 59,666 | 10,392 |
| Sonstige Verbindlichkeiten | | - | 37,392 | - | - |
| Gesamtsumme der Passiva | | 1,020,205 | 1,197,919 | 123,598 | 20,171,721 |
| Nettovermögen | | 37,777,859 | 69,170,928 | 23,519,189 | 25,013,818 |

Die beigegeführten Anmerkungen sind integraler Bestandteil dieses Geschäftsberichts.

| | Erläut | Amundi S.F. - European Equity Optimal Volatility | | Amundi S.F. - EUR Commodities | |
|--|--------|---|-------------------|-------------------------------|--------------------|
| | | 30/06/2022 EUR | 30/06/2021 EUR | 30/06/2022 EUR | 30/06/2021 EUR |
| Aktiva | | | | | |
| Wertpapiere zu Einstandspreisen | | 43,498,869 | 49,646,060 | 206,869,073 | 125,662,703 |
| Realisierte Nettogewinne/(-verluste) aus Wertpapieren | | -2,019,294 | 8,002,042 | -668,330 | -522,016 |
| Anlagen in Wertpapieren zum Marktwert | 2 | 41,479,575 | 57,648,102 | 206,200,743 | 125,140,687 |
| Zum Marktwert erworbene Optionskontrakte mit Vorabprämie | 2, 12 | - | - | - | - |
| Nicht realisierter Nettogewinn aus termingeschäftartigen Optionen | 2, 12 | - | - | - | - |
| Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisentermingeschäften | 2, 9 | - | - | 563,535 | 330,241 |
| Nicht realisierter Nettogewinn aus Finanztermingeschäften | 2, 8 | 39,270 | 460,950 | - | - |
| Bareinlagen bei Banken und Maklern | | 8,040,942 | 3,864,798 | 39,700,604 | 29,958,090 |
| Zinsguthaben | | - | - | 797,862 | 803,558 |
| Guthaben aus Dividenden | | 6,702 | 88,215 | - | - |
| Forderungen aus Zeichnungen | | 5,025 | 1,178 | 342,648 | 112,810 |
| Forderungen aus Wertpapierverkäufen | | - | 63,007 | - | - |
| Sonstige Forderungen | | - | 10 | - | - |
| Gesamtsumme der Aktiva | | 49,571,514 | 62,126,260 | 247,605,392 | 156,345,386 |
| Passiva | | | | | |
| Banküberziehung/Maklerverbindlichkeiten | | - | - | - | - |
| Zum Marktwert ausgefertigte Optionskontrakte mit Vorabprämie | 2, 12 | - | - | - | - |
| Nicht realisierter Nettoverlust aus termingeschäftartigen Optionen | 2, 12 | - | - | - | - |
| Nicht realisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften | 2, 9 | - | - | - | - |
| Nicht realisierter Nettoverlust aus Finanztermingeschäften | 2, 8 | - | - | - | - |
| Nicht realisierter Nettoverlust aus Swapgeschäften | 2, 13 | - | - | 20,238,237 | 1,505,409 |
| Verbindlichkeiten aus Rücknahmen | | 32,689 | 159,693 | 974,370 | 148,021 |
| Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen | | - | 76,916 | - | - |
| Angefallene Kosten | | 243,941 | 390,192 | 559,985 | 476,870 |
| Sonstige Verbindlichkeiten | | - | - | - | 6,983 |
| Gesamtsumme der Passiva | | 276,630 | 626,801 | 21,772,592 | 2,137,283 |
| Nettovermögen | | 49,294,884 | 61,499,459 | 225,832,800 | 154,208,103 |

Die beigegeführten Anmerkungen sind integraler Bestandteil dieses Geschäftsberichts.

| | Erläut | Konsolidiert | |
|--|--------|----------------------|--------------------|
| | | 30/06/2022 EUR | 30/06/2021 EUR |
| Aktiva | | | |
| Wertpapiere zu Einstandspreisen | | 1,731,881,826 | 553,869,569 |
| Realisierte Nettogewinne/(-verluste) aus Wertpapieren | | -91,565,443 | 35,095,392 |
| Anlagen in Wertpapieren zum Marktwert | 2 | 1,640,316,383 | 588,964,961 |
| Zum Marktwert erworbene Optionskontrakte mit Vorabprämie | 2, 12 | 18,398,591 | - |
| Nicht realisierter Nettogewinn aus termingeschäftartigen Optionen | 2, 12 | 93,520 | 5,100 |
| Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisentermingeschäften | 2, 9 | 563,535 | 340,718 |
| Nicht realisierter Nettogewinn aus Finanztermingeschäften | 2, 8 | 39,270 | 681,548 |
| Bareinlagen bei Banken und Maklern | | 132,600,661 | 71,131,702 |
| Zinsguthaben | | 13,287,075 | 2,367,411 |
| Guthaben aus Dividenden | | 6,702 | 302,785 |
| Forderungen aus Zeichnungen | | 2,869,537 | 831,077 |
| Forderungen aus Wertpapierverkäufen | | 65,318,153 | 1,156,312 |
| Sonstige Forderungen | | 1,608 | 10 |
| Gesamtsumme der Aktiva | | 1,873,495,035 | 665,781,624 |
| Passiva | | | |
| Banküberziehung/Maklerverbindlichkeiten | | 146,865 | 18,244,393 |
| Zum Marktwert ausgefertigte Optionskontrakte mit Vorabprämie | 2, 12 | 13,335,033 | - |
| Nicht realisierter Nettoverlust aus termingeschäftartigen Optionen | 2, 12 | 36,750 | - |
| Nicht realisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften | 2, 9 | 832,119 | 7,499 |
| Nicht realisierter Nettoverlust aus Finanztermingeschäften | 2, 8 | 3,002,250 | 17,711 |
| Nicht realisierter Nettoverlust aus Swapgeschäften | 2, 13 | 21,170,402 | 2,162,854 |
| Verbindlichkeiten aus Rücknahmen | | 8,296,264 | 1,100,414 |
| Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen | | 58,490,326 | 3,024,135 |
| Angefallene Kosten | | 6,007,310 | 2,225,795 |
| Sonstige Verbindlichkeiten | | - | 114,173 |
| Gesamtsumme der Passiva | | 111,317,319 | 26,896,974 |
| Nettovermögen | | 1,762,177,716 | 638,884,650 |

Die beigegeführten Anmerkungen sind integraler Bestandteil dieses Geschäftsberichts.

Amundi S.F. - Diversified Short-Term Bond

| | ISIN | Anzahl der Einheiten | | Währung | NIW je Einheit | | NIW je Einheit 31/12/20 |
|--|--------------|----------------------|--|------------|----------------------|----------------------|----------------------------|
| | | 30/06/22 | | | 30/06/22 | 31/12/21 | |
| Klasse A jährliche Ausschüttung | LU2357810188 | 57,084.211 | | EUR | 47.17 | 49.83 | - |
| Klasse A keine Ausschüttung | LU1706854152 | 3,327,225.714 | | EUR | 48.02 | 50.55 | 50.29 |
| Klasse E Vierteljährliche Ausschüttung | LU1706854236 | 1,018.275 | | EUR | 4.779 | 5.041 | 5.035 |
| Klasse E keine Ausschüttung | LU1499628912 | 163,430,949.618 | | EUR | 4.860 | 5.116 | 5.089 |
| Klasse E keine Ausschüttung | LU1706854319 | 163,430,949.618 | | USD | 5.080 | 5.817 | 6.226 |
| Klasse F keine Ausschüttung | LU2357810428 | 439,743.528 | | EUR | 4.712 | 4.973 | - |
| Klasse H jährliche Ausschüttung | LU2357810691 | 7,547.885 | | EUR | 944.51 | 997.50 | - |
| Klasse H Vierteljährliche Ausschüttung | LU1889052269 | 3,518.527 | | EUR | 962.12 | 1,013.56 | 1,009.73 |
| Klasse H keine Ausschüttung | LU1503126044 | 129,224.547 | | EUR | 988.76 | 1,039.28 | 1,030.87 |
| Klasse I keine Ausschüttung | LU1706854400 | 251,570.117 | | EUR | 975.53 | 1,024.92 | 1,015.73 |
| Klasse R jährliche Ausschüttung | LU2357810931 | 199.479 | | EUR | 47.24 | 49.87 | - |
| Klasse R keine Ausschüttung | LU2357810774 | 209,244.055 | | EUR | 47.48 | 49.90 | - |
| Gesamtvermögen | | | | EUR | 1,352,415,134 | 1,377,781,723 | 1,071,962,165 |

Amundi S.F. - Euro Curve 7-10year

| | ISIN | Anzahl der Einheiten | | Währung | NIW je Einheit | | NIW je Einheit 31/12/20 |
|--|--------------|----------------------|--|------------|-------------------|--------------------|----------------------------|
| | | 30/06/22 | | | 30/06/22 | 31/12/21 | |
| Klasse A Ausschüttung | LU0536711285 | 2,176.259 | | EUR | 67.28 | 76.92 | 79.50 |
| Klasse A jährliche Ausschüttung | LU0536711103 | 197,668.587 | | EUR | 71.03 | 81.19 | 83.92 |
| Klasse A keine Ausschüttung | LU0367810172 | 43,347.895 | | EUR | 80.97 | 92.55 | 95.66 |
| Klasse C keine Ausschüttung | LU0536711442 | 77.007 | | EUR | 63.11 | 72.59 | 75.98 |
| Klasse E vierteljährliche Zielausschüttung | LU0857391824 | 138,744.793 | | EUR | 5.179 | 5.938 | 6.173 |
| Klasse E keine Ausschüttung | LU0271693920 | 2,188,902.264 | | EUR | 7.600 | 8.709 | 9.045 |
| Klasse F keine Ausschüttung | LU0271694654 | 278,241.090 | | EUR | 6.933 | 7.966 | 8.320 |
| Klasse H keine Ausschüttung | LU0332132041 | 19,128.553 | | EUR | 1,622.43 | 1,854.12 | 1,915.42 |
| Klasse I keine Ausschüttung | LU0433266433 | 4,225.380 | | EUR | 1,489.15 | 1,700.22 | 1,753.15 |
| Klasse R Ausschüttung | LU1706854665 | 100.444 | | EUR | 47.45 | 54.18 | 55.86 |
| Klasse R keine Ausschüttung | LU1706853857 | 909.617 | | EUR | 47.96 | 54.77 | 56.49 |
| Gesamtvermögen | | | | EUR | 74,360,229 | 101,266,287 | 126,648,491 |

Amundi S.F. - Euro Curve 10+year

| | ISIN | Anzahl der Einheiten | | Währung | NIW je Einheit | | NIW je Einheit 31/12/20 |
|--|--------------|----------------------|--|------------|-------------------|-------------------|----------------------------|
| | | 30/06/22 | | | 30/06/22 | 31/12/21 | |
| Klasse A jährliche Ausschüttung | LU0281585215 | 2,162.397 | | EUR | 86.21 | 111.50 | 120.50 |
| Klasse E vierteljährliche Zielausschüttung | LU0857391741 | 65,095.833 | | EUR | 5.439 | 7.056 | 7.671 |
| Klasse E keine Ausschüttung | LU0271691981 | 191,524.652 | | EUR | 8.016 | 10.394 | 11.288 |
| Klasse F keine Ausschüttung | LU0271692013 | 139,301.028 | | EUR | 7.315 | 9.511 | 10.386 |
| Klasse H keine Ausschüttung | LU0332132397 | 18,843.844 | | EUR | 1,825.24 | 2,360.06 | 2,549.43 |
| Klasse I keine Ausschüttung | LU0433266516 | 165.359 | | EUR | 1,744.65 | 2,253.71 | 2,429.39 |
| Gesamtvermögen | | | | EUR | 37,777,859 | 54,360,751 | 113,852,545 |

Amundi S.F. - SBI FM India Bond

| | ISIN | Anzahl der Einheiten | | Währung | NIW je Einheit | | |
|------------------------------|--------------|----------------------|--|------------|-------------------|-------------------|----------|
| | | 30/06/22 | | | 30/06/22 | 31/12/21 | |
| Klasse A keine Ausschüttung | LU2251232760 | 500.000 | | USD | 9.34 | 10.15 | - |
| Klasse A2 keine Ausschüttung | LU2251232844 | 500.000 | | USD | 9.32 | 10.13 | - |
| Klasse H keine Ausschüttung | LU2338645448 | 25,000.000 | | USD | 940.02 | 1,018.14 | - |
| Klasse I keine Ausschüttung | LU2251232927 | 0.500 | | USD | 9,390.20 | 10,173.66 | - |
| Klasse I2 keine Ausschüttung | LU2251233065 | 0.500 | | USD | 9,388.62 | 10,176.06 | - |
| Gesamtvermögen | | | | USD | 23,519,189 | 25,473,917 | - |

Amundi S.F. - European Equity Optimal Volatility

| | ISIN | Anzahl der Einheiten | | Währung | NIW je Einheit | | |
|-----------------------------|--------------|----------------------|--|------------|-------------------|-------------------|-------------------|
| | | 30/06/22 | | | 30/06/22 | 31/12/21 | |
| Klasse A keine Ausschüttung | LU1920531883 | 1,102,206.778 | | EUR | 34.05 | 34.73 | 37.57 |
| Klasse A keine Ausschüttung | LU1920531966 | 1,102,206.778 | | USD | 35.60 | 39.49 | 45.97 |
| Klasse C keine Ausschüttung | LU1920532345 | 2,699.879 | | EUR | 34.96 | 35.83 | 39.15 |
| Klasse C keine Ausschüttung | LU1920532261 | 2,699.879 | | USD | 36.55 | 40.75 | 47.90 |
| Klasse E keine Ausschüttung | LU1920532428 | 3,013,716.258 | | EUR | 3.400 | 3.468 | 3.753 |
| Klasse F keine Ausschüttung | LU1920532691 | 381,474.206 | | EUR | 3.539 | 3.623 | 3.950 |
| Klasse G keine Ausschüttung | LU1920532774 | 6,791.925 | | EUR | 3.507 | 3.586 | 3.900 |
| Klasse H keine Ausschüttung | LU1920532857 | 56.315 | | EUR | 711.03 | 722.98 | 776.63 |
| Klasse I keine Ausschüttung | LU1920533079 | 5.000 | | EUR | 725.27 | 736.06 | 788.37 |
| Klasse I keine Ausschüttung | LU1920532931 | 5.000 | | USD | 758.23 | 837.05 | 964.62 |
| Klasse R keine Ausschüttung | LU1920533152 | 100.000 | | EUR | 37.72 | 38.31 | 41.12 |
| Gesamtvermögen | | | | EUR | 49,294,884 | 54,290,723 | 70,937,457 |

Amundi S.F. - EUR Commodities

| | ISIN | Anzahl der Einheiten | | Währung | NIW je Einheit | | |
|---|--------------|----------------------|--|------------|--------------------|--------------------|-------------------|
| | | 30/06/22 | | | 30/06/22 | 31/12/21 | |
| Klasse A abgesichert keine Ausschüttung | LU1694769693 | 5,137.130 | | CHF | 43.45 | 35.96 | 28.77 |
| Klasse A abgesichert keine Ausschüttung | LU1694769859 | 269,191.676 | | USD | 46.65 | 38.39 | 30.41 |
| Klasse A keine Ausschüttung | LU0271695388 | 2,036,673.787 | | EUR | 32.76 | 27.11 | 21.62 |
| Klasse B Abgesichert Keine Ausschüttung | LU1694769933 | - | | USD | - | - | 28.25 |
| Klasse C abgesichert keine Ausschüttung | LU1694770196 | 9,607.569 | | USD | 51.09 | 42.28 | 33.83 |
| Klasse C keine Ausschüttung | LU0372625102 | 84,833.823 | | EUR | 18.64 | 15.50 | 12.49 |
| Klasse E keine Ausschüttung | LU0273973874 | 2,319,456.821 | | EUR | 2.935 | 2.429 | 1.938 |
| Klasse F keine Ausschüttung | LU0273974336 | 1,868,468.159 | | EUR | 2.616 | 2.173 | 1.747 |
| Klasse H jährliche Ausschüttung | LU0484923635 | 7.000 | | EUR | 870.20 | 718.28 | 570.12 |
| Klasse H abgesichert keine Ausschüttung | LU1772191695 | 904.309 | | USD | 1,409.79 | 1,158.36 | 913.48 |
| Klasse H keine Ausschüttung | LU0271872185 | 60,430.724 | | EUR | 629.90 | 520.01 | 412.97 |
| Klasse I jährliche Ausschüttung | LU1694770352 | 4,906.000 | | EUR | 606.55 | 500.26 | 396.48 |
| Klasse I abgesichert keine Ausschüttung | LU0419230916 | 7,589.760 | | USD | 1,076.00 | 882.96 | 694.70 |
| Klasse I keine Ausschüttung | LU0271695461 | 119,804.814 | | EUR | 648.65 | 534.98 | 424.00 |
| Klasse R abgesichert keine Ausschüttung | LU1706854582 | 3,661.438 | | USD | 62.79 | 51.58 | 40.67 |
| Klasse R keine Ausschüttung | LU1706853931 | 76,338.715 | | EUR | 67.09 | 55.38 | 43.98 |
| Gesamtvermögen | | | | EUR | 225,832,800 | 162,547,628 | 96,476,837 |

| | Erläut | Amundi S.F. - Diversified Short-Term Bond | | Amundi S.F. - Euro Curve 7-10year | |
|---|--------|---|-------------------|-----------------------------------|--------------------|
| | | 30/06/2022 EUR | 30/06/2021 EUR | 30/06/2022 EUR | 30/06/2021 EUR |
| Erträge | | | | | |
| Nettodividenden | 2 | - | - | - | - |
| Zinsen auf Wertpapiere | 2 | 14,073,288 | - | 319,668 | 786,899 |
| Zinsen auf Bankkonten | 2 | 6,166 | - | 814 | - |
| Zinsen auf Swapgeschäfte | 2 | 2,339,258 | - | 20,722 | 11 |
| Sonstige Erträge | 10 | 76,925 | - | 1,420 | - |
| Gesamtsumme der Erträge | | 16,495,637 | - | 342,624 | 786,910 |
| Ausgaben | | | | | |
| Managementgebühren | 4 | 3,586,222 | - | 300,852 | 408,624 |
| Vertriebsgebühren | 4 | - | - | 26 | 51 |
| Depot- und Verwaltungsgebühren | 6 | 441,311 | - | 35,665 | 33,730 |
| „Taxe d'abonnement“ | 7 | 282,647 | - | 19,135 | 26,744 |
| Honorare | | 24,296 | - | 1,517 | 2,565 |
| Druck- und Veröffentlichungskosten | | - | - | - | 1,140 |
| Performancegebühr | 5 | 992 | - | - | - |
| Transaktionskosten | | 1,716,409 | - | 20,719 | 62,001 |
| Gebühren für Annahme und Übermittlung von Aufträgen | | 770,551 | - | 68,708 | 53,724 |
| Zinsen auf Swapgeschäfte | 2 | 2,996,744 | - | 19,482 | 63,481 |
| Sonstige Kosten | 11 | 749,331 | - | 24,549 | 28,344 |
| Gesamtsumme der Ausgaben | | 10,568,503 | - | 490,653 | 680,404 |
| Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums (01/01/22) | | 1,377,781,723 | - | 101,266,287 | 126,648,491 |
| Operativer Nettoertrag/(-verlust) | | 5,927,134 | - | -148,029 | 106,506 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Wertpapierverkäufen | | -52,494,860 | - | -8,155,315 | -292,806 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Devisen | | 486,214 | - | 15,761 | -1,146 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Devisentermingeschäften | | -15,888,810 | - | - | 1,687 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Finanztermingeschäften | | 55,913,274 | - | 932,185 | 601,622 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Optionskontrakten | | 8,670,745 | - | -182,110 | -117,793 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Swapgeschäften | | -1,821,017 | - | -865,712 | -191,124 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | | -5,134,454 | - | -8,255,191 | 440 |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus Wertpapieren | | -69,288,330 | - | -3,281,744 | -2,744,718 |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus Devisentermingeschäften | | 2,097,685 | - | - | - |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus Finanztermingeschäften | | -7,209,347 | - | -334,619 | 126,643 |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus Optionskontrakten | | 2,821,372 | - | 79,570 | 3,000 |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus Swapgeschäften | | - | - | 207,328 | -196,052 |
| Veränderung des nicht realisierten Nettojahresgewinns/(-verlusts) | | -71,578,620 | - | -3,329,465 | -2,811,127 |
| Nettoanstieg/(-rückgang) des Nettovermögens durch das operative Geschäft | | -70,785,940 | - | -11,732,685 | -2,704,181 |
| Nettozeichnungen/(-rücknahmen) | | 45,439,027 | - | -15,172,889 | -16,249,087 |
| Dividendenausschüttungen | 17 | -19,676 | - | -484 | -964 |
| Neubewertung des konsolidierten Nettovermögens | | - | - | - | - |
| Nettovermögen am Ende des Zeitraums | | 1,352,415,134 | - | 74,360,229 | 107,694,259 |

Die beigegefügt Anmerkungen sind integraler Bestandteil dieses Geschäftsberichts.

Erläut Amundi S.F. - Euro Curve 10+year

Amundi S.F. - SBI FM India Bond

| | | 30/06/2022 EUR | 30/06/2021 EUR | 30/06/2022 USD | 30/06/2021 USD |
|---|----|--------------------|--------------------|-------------------|-------------------|
| Erträge | | | | | |
| Nettodividenden | 2 | - | - | - | - |
| Zinsen auf Wertpapiere | 2 | 410,951 | 742,947 | 689,347 | 3,188 |
| Zinsen auf Bankkonten | 2 | 175 | 112 | 1,893 | - |
| Zinsen auf Swapgeschäfte | 2 | 29,221 | 39 | - | - |
| Sonstige Erträge | 10 | 1,305 | 7,429 | 23,044 | - |
| Gesamtsumme der Erträge | | 441,652 | 750,527 | 714,284 | 3,188 |
| Ausgaben | | | | | |
| Managementgebühren | 4 | 139,201 | 242,705 | 48,809 | 3,564 |
| Vertriebsgebühren | 4 | - | - | - | - |
| Depot- und Verwaltungsgebühren | 6 | 19,576 | 23,266 | 44,354 | 2,951 |
| „Taxe d'abonnement“ | 7 | 10,664 | 16,817 | 5,972 | 3,126 |
| Honorare | | 809 | 1,948 | 6,523 | 485 |
| Druck- und Veröffentlichungskosten | | - | 866 | 12 | 18 |
| Performancegebühr | 5 | - | - | - | - |
| Transaktionskosten | | 21,160 | 18,401 | - | - |
| Gebühren für Annahme und Übermittlung von Aufträgen | | 28,278 | 56,757 | 357 | - |
| Zinsen auf Swapgeschäfte | 2 | 16,699 | 57,644 | - | - |
| Sonstige Kosten | 11 | 11,692 | 22,159 | 2,902 | 249 |
| Gesamtsumme der Ausgaben | | 248,079 | 440,563 | 108,929 | 10,393 |
| Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums (01/01/22) | | 54,360,751 | 113,852,545 | 25,473,917 | - |
| Operativer Nettoertrag/(-verlust) | | 193,573 | 309,964 | 605,355 | -7,205 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Wertpapierverkäufen | | -5,357,702 | -664,981 | -20,021 | - |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Devisen | | 31,631 | -9,632 | -22,013 | 8,755 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Devisentermingeschäften | | -8,983 | -11,521 | -87,053 | - |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Finanztermingeschäften | | 1,377,604 | 538,471 | - | - |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Optionskontrakten | | -103,565 | -62,282 | - | - |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Swapgeschäften | | -852,299 | -191,124 | - | - |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | | -4,913,314 | -401,069 | -129,087 | 8,755 |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus Wertpapieren | | -6,825,984 | -6,671,156 | -2,354,012 | -20,157 |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus Devisentermingeschäften | | 7,390 | -7,499 | -76,984 | 12,425 |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus Finanztermingeschäften | | -304,402 | 71,855 | - | - |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus Optionskontrakten | | 40,320 | 2,100 | - | - |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus Swapgeschäften | | -69,595 | -166,693 | - | - |
| Veränderung des nicht realisierten Nettojahresgewinns/(-verlusts) | | -7,152,271 | -6,771,393 | -2,430,996 | -7,732 |
| Nettoanstieg/(-rückgang) des Nettovermögens durch das operative Geschäft | | -11,872,012 | -6,862,498 | -1,954,728 | -6,182 |
| Nettozeichnungen/(-rücknahmen) | | -4,710,589 | -37,818,466 | - | 25,020,000 |
| Dividendenausschüttungen | 17 | -291 | -653 | - | - |
| Neubewertung des konsolidierten Nettovermögens | | - | - | - | - |
| Nettovermögen am Ende des Zeitraums | | 37,777,859 | 69,170,928 | 23,519,189 | 25,013,818 |

Die beigefügten Anmerkungen sind integraler Bestandteil dieses Geschäftsberichts.

| | Erläut | Amundi S.F. - European Equity Optimal Volatility | | Amundi S.F. - EUR Commodities | |
|---|--------|---|-------------------|-------------------------------|--------------------|
| | | 30/06/2022 EUR | 30/06/2021 EUR | 30/06/2022 EUR | 30/06/2021 EUR |
| Erträge | | | | | |
| Nettodividenden | 2 | 932,265 | 1,280,770 | - | - |
| Zinsen auf Wertpapiere | 2 | - | 6,036 | 432,636 | 435,737 |
| Zinsen auf Bankkonten | 2 | 129 | - | 7,884 | 4,218 |
| Zinsen auf Swapgeschäfte | 2 | - | - | - | 142 |
| Sonstige Erträge | 10 | 504 | - | 9,301 | 52 |
| Gesamtsumme der Erträge | | 932,898 | 1,286,806 | 449,821 | 440,149 |
| Ausgaben | | | | | |
| Managementgebühren | 4 | 389,404 | 496,682 | 754,423 | 432,606 |
| Vertriebsgebühren | 4 | 512 | 821 | 8,361 | 3,293 |
| Depot- und Verwaltungsgebühren | 6 | 15,637 | 42,226 | 78,900 | 45,930 |
| „Taxe d'abonnement“ | 7 | 12,543 | 15,834 | 37,919 | 20,405 |
| Honorare | | 896 | 1,469 | 3,809 | 2,678 |
| Druck- und Veröffentlichungskosten | | - | 653 | 108 | 1,190 |
| Performancegebühr | 5 | - | - | - | - |
| Transaktionskosten | | 22,038 | 96,296 | - | 96,907 |
| Gebühren für Annahme und Übermittlung von Aufträgen | | 18,604 | 50,931 | 70,778 | 45,372 |
| Zinsen auf Swapgeschäfte | 2 | - | - | - | 33,426 |
| Sonstige Kosten | 11 | 26,981 | 35,145 | 91,682 | 52,723 |
| Gesamtsumme der Ausgaben | | 486,615 | 740,057 | 1,045,980 | 734,530 |
| Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums (01/01/22) | | 54,290,723 | 70,937,457 | 162,547,628 | 96,476,837 |
| Operativer Nettoertrag/(-verlust) | | 446,283 | 546,749 | -596,159 | -294,381 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Wertpapierverkäufen | | 271,110 | 4,046,277 | -870,500 | -529,731 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Devisen | | -5,427 | 6,638 | 261,883 | 114,597 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Devisentermingeschäften | | - | - | 430,962 | -142,235 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Finanztermingeschäften | | 5,236,209 | -10,469,915 | - | - |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Optionskontrakten | | - | -657,330 | - | - |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Swapgeschäften | | - | - | 63,278,741 | 26,313,009 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | | 5,501,892 | -7,074,330 | 63,101,086 | 25,755,640 |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus Wertpapieren | | -8,447,463 | 3,536,389 | -306,747 | -110,495 |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus Devisentermingeschäften | | - | - | 664,088 | 393,284 |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus Finanztermingeschäften | | 1,489,290 | 1,264,632 | - | - |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus Optionskontrakten | | - | -833,186 | - | - |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus Swapgeschäften | | - | - | -24,692,190 | -5,219,798 |
| Veränderung des nicht realisierten Nettojahresgewinns/(-verlusts) | | -6,958,173 | 3,967,835 | -24,334,849 | -4,937,009 |
| Nettoanstieg/(-rückgang) des Nettovermögens durch das operative Geschäft | | -1,009,998 | -2,559,746 | 38,170,078 | 20,524,250 |
| Nettozeichnungen/(-rücknahmen) | | -3,985,841 | -6,878,252 | 25,115,094 | 37,207,016 |
| Dividendenausschüttungen | 17 | - | - | - | - |
| Neubewertung des konsolidierten Nettovermögens | | - | - | - | - |
| Nettovermögen am Ende des Zeitraums | | 49,294,884 | 61,499,459 | 225,832,800 | 154,208,103 |

Die beigegeführten Anmerkungen sind integraler Bestandteil dieses Geschäftsberichts.

| | Erläut | Konsolidiert | |
|---|--------|----------------------|--------------------|
| | | 30/06/2022 EUR | 30/06/2021 EUR |
| Erträge | | | |
| Nettodividenden | 2 | 932,265 | 4,113,028 |
| Zinsen auf Wertpapiere | 2 | 15,895,924 | 2,556,517 |
| Zinsen auf Bankkonten | 2 | 16,979 | 4,330 |
| Zinsen auf Swapgeschäfte | 2 | 2,389,201 | 192 |
| Sonstige Erträge | 10 | 111,497 | 30,466 |
| Gesamtsumme der Erträge | | 19,345,866 | 6,704,533 |
| Ausgaben | | | |
| Managementgebühren | 4 | 5,216,789 | 2,418,973 |
| Vertriebsgebühren | 4 | 8,899 | 6,019 |
| Depot- und Verwaltungsgebühren | 6 | 633,515 | 222,569 |
| „Taxe d'abonnement“ | 7 | 368,620 | 136,340 |
| Honorare | | 37,566 | 14,120 |
| Druck- und Veröffentlichungskosten | | 119 | 6,109 |
| Performancegebühr | 5 | 992 | 9,305 |
| Transaktionskosten | | 1,780,326 | 322,550 |
| Gebühren für Annahme und Übermittlung von Aufträgen | | 957,260 | 256,223 |
| Zinsen auf Swapgeschäfte | 2 | 3,032,925 | 194,902 |
| Sonstige Kosten | 11 | 907,011 | 191,553 |
| Gesamtsumme der Ausgaben | | 12,944,022 | 3,778,663 |
| Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums (01/01/22) | | 1,772,647,601 | 633,188,017 |
| Operativer Nettoertrag/(-verlust) | | 6,401,844 | 2,925,870 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Wertpapierverkäufen | | -66,626,418 | 4,293,237 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Devisen | | 769,006 | 208,659 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Devisentermingeschäften | | -15,550,100 | -151,436 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Finanztermingeschäften | | 63,459,272 | -8,321,710 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Optionskontrakten | | 8,385,070 | -914,132 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Swapgeschäften | | 59,739,713 | 25,796,974 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | | 50,176,543 | 20,911,592 |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus Wertpapieren | | -90,401,951 | 11,186,496 |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus Devisentermingeschäften | | 2,695,525 | 396,262 |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus Finanztermingeschäften | | -6,359,078 | 1,445,899 |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus Optionskontrakten | | 2,941,262 | -828,086 |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus Swapgeschäften | | -24,554,457 | -5,699,229 |
| Veränderung des nicht realisierten Nettojahresgewinns/(-verlusts) | | -115,678,699 | 6,501,342 |
| Nettoanstieg/(-rückgang) des Nettovermögens durch das operative Geschäft | | -59,100,312 | 30,338,804 |
| Nettozeichnungen/(-rücknahmen) | | 33,361,037 | -24,640,554 |
| Dividendenausschüttungen | 17 | -20,451 | -1,617 |
| Neubewertung des konsolidierten Nettovermögens | | 15,289,841 | - |
| Nettovermögen am Ende des Zeitraums | | 1,775,501,481 | 638,884,650 |

Die beigegeführten Anmerkungen sind integraler Bestandteil dieses Geschäftsberichts.

1 EINLEITUNG

Amundi S.F. (der „Fonds“) ist organisiert als *Fonds Commun de Placement* (FCP) mit mehreren separaten Teilfonds (jeweils ein „Teilfonds“ und zusammen die „Teilfonds“). Der Fonds ist ein am 6. Juni 2003 gegründeter Organismus für gemeinsame Anlagen in Wertpapiere (OGAW) und fällt unter Teil I des geänderten Luxemburger Gesetzes vom 17. Dezember 2010 über Organismen für gemeinsame Anlagen. Er unterliegt den zum Zeitraum wirksamen Verwaltungsvorschriften, die letztmals am 29. Juni 2018 aktualisiert und am 16. Juli 2018 im Recueil Electronique des Sociétés et Associations (RESA, elektronisches Verzeichnis der Gesellschaften und Vereine) veröffentlicht wurden.

Der Fonds stellt ein gemeinsames Eigentum ohne Rechtspersönlichkeit an Wertpapieren und anderen Vermögenswerten dar. Er wird verwaltet von Amundi Luxembourg S.A. (die „Verwaltungsgesellschaft“), eine als Aktiengesellschaft („société anonyme“) gemäß Kapitel 15 des Gesetzes vom 17. Dezember 2010 in seiner jeweils gültigen Fassung organisierte hundertprozentige Tochtergesellschaft von Amundi Asset Management S.A.S, eingetragen im Handels- und Firmenregister unter der Nummer B 57.255 mit eingetragenem Sitz in Luxemburg. Er wurde am 20. Dezember 1996 auf unbestimmte Zeit gegründet. Seine Satzung wurde am 28. Januar 1997 im Mémorial veröffentlicht und letztmals am 1. Januar 2018 geändert.

Die Vermögenswerte der verschiedenen Teilfonds werden separat im Einklang mit ihrer jeweiligen Anlagepolitik und ihren Anlagezielen angelegt. Alle Teilfonds lauten in EUR oder USD (die „Basiswährung“) und alle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten der einzelnen Teilfonds werden in der Basiswährung dieses Teilfonds bewertet. Der Nettoinventarwert („NIW“) in einer anderen Währung als die Basiswährung ist die tägliche Umrechnung des in der Basiswährung berechneten NIW Einheit.

Zum 30. Juni 2022 gab es die nachstehend aufgeführten 6 aktiven Teilfonds:

Anleiheiteilfonds

Amundi S.F. - Diversified Short-Term Bond
 Amundi S.F. - Euro Curve 7-10year
 Amundi S.F. - Euro Curve 10+year
 Amundi S.F. - SBI FM India Bond

Aktienteilfonds

Amundi S.F. - European Equity Optimal Volatility

Rohstoffteilfonds

Amundi S.F. - EUR Commodities

Unter „Finanzielle Angaben zu den vergangenen drei Jahren“ sind die einzelnen, zum 30. Juni 2022 aktiven Anteilklassen aufgelistet, die im aktuellen Prospekt beschrieben werden.

2 GRUNDSÄTZE DER RECHNUNGSLEGUNG

■ PRÄSENTATION DES GESCHÄFTSBERICHTS

Dieser Geschäftsbericht wird erstellt in Übereinstimmung mit den in Luxemburg geltenden gesetzlichen und behördlichen Vorschriften für Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapiere sowie den in Luxemburg allgemein anerkannten Grundsätzen der Rechnungslegung.

Der Finanzbericht gibt die am letzten Geschäftstag des Zeitraums auf Grundlage der letzten verfügbaren Marktpreise der Anlagen berechneten Nettoinventarwerte („NIW“) wieder.

Bewertung von Anlagen und andere Anlagen

Es gilt folgende Preispolitik:

- **Bewertung von Anlagen** - An Börsen oder regulierten Märkten oder anderen regulierten Märkten notierte oder gehandelte Anlagen werden am jeweiligen Bewertungstag um 18:00 Uhr Luxemburger Zeit bewertet. Hiervon ausgenommen ist der Teilfonds Amundi S.F. - European Equity Optimal Volatility, dessen Anlagen zu den letzten verfügbaren Kursen um 22:00 Uhr Luxemburger Zeit bewertet werden. Der Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft des Fonds überprüft regelmäßig die Preisfindungsregeln (Bid/Mid/Ask) der einzelnen Teilfonds, und sie können an den Anlagezyklus und/oder das Anlageziel des jeweiligen Teilfonds angepasst werden. Falls gehaltene Vermögenswerte des Portfolios eines Teilfonds am entsprechenden Tag nicht an einer Börse oder an einem regulierten Markt oder einem anderen regulierten Markt notiert oder gehandelt werden oder falls der letzte verfügbare Kurs (der gemäß vorstehendem Absatz ermittelt wurde) von Vermögenswerten, die an einer Börse notiert oder gehandelt oder an so einem Markt gehandelt werden, den Marktwert des entsprechenden Vermögenswerts nicht angemessen wiedergibt, basiert der Wert dieser Vermögenswerte auf dem vernünftigerweise vorhersehbaren Kurs, den der Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft umsichtig und in gutem Glauben ermittelt.
- **Offene und geschlossene OGA** - Einheiten oder Anteile offener OGA werden zu ihrem letzten ermittelten und verfügbaren Nettoinventarwert bewertet. Falls dieser Preis den Marktwert dieser Vermögenswerte nicht angemessen wiedergibt, ermittelt der Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft den Preis umsichtig und in gutem Glauben. Einheiten oder Anteile geschlossener OGA werden zu ihrem letzten verfügbaren Marktwert bewertet.
- **Devisentermingeschäfte** - Devisentermingeschäfte werden bewertet zum am Datum der „Nettovermögensaufstellung“ geltenden Terminkurs für den Zeitraum bis zu ihrer Fälligkeit. Nicht realisierte Nettogewinne und -verluste aus Devisentermingeschäften werden in der „Nettovermögensaufstellung“ verbucht; Realisierte Nettogewinne/(-verluste) bzw. Veränderungen nicht realisierter Nettogewinne/(-verluste) aus Devisentermingeschäften werden unter „Aufwands- und Ertragsrechnung und Veränderungen des Nettovermögens“ verbucht. Der Fonds bietet auch abgesicherte Anteilklassen an. Alle Gewinne/(Verluste) aus in abgesicherten Anteilklassen verwendeten Devisentermingeschäften werden ausschließlich der entsprechenden Anteilklasse zugeteilt.
- **Finanztermingeschäfte** - Finanztermingeschäfte werden zum verfügbaren offiziellen Börsenpreis bewertet (gemäß der vorstehend unter „Bewertung von Anlagen“ beschriebenen Preispolitik). Ersteinschusszahlungen erfolgen bei Abschluss der Termingeschäfte in bar. Der Teilfonds zahlt oder erhält regelmäßig nachfolgende Zahlungen, die Schwankungsmargen genannt werden. Sie basieren auf Änderungen des Marktwerts offener Termingeschäfte. Nicht realisierte Nettogewinne und -verluste aus Finanztermingeschäften werden in der „Nettovermögensaufstellung“ verbucht; Realisierte Nettogewinne/(-verluste) bzw. Veränderungen nicht realisierter Nettogewinne/(-verluste) aus Finanztermingeschäften werden unter „Aufwands- und Ertragsrechnung und Veränderungen des Nettovermögens“ verbucht. Bei Abschluss des Kontrakts verzeichnet der betroffene Teilfonds einen realisierten Gewinn bzw. Verlust in Höhe der Differenz zwischen den Erlösen (bzw. den Kosten) aus dem Abschluss- und dem Eröffnungsgeschäft.
- **Optionskontrakte mit Vorabprämie** - Wenn der Teilfonds einen Optionskontrakt mit Vorabprämie erwirbt, zahlt er eine Prämie und ein Betrag in Höhe dieser Prämie wird als Vermögenswert verbucht. Wenn der Teilfonds eine Option mit Vorabprämie ausfertigt, erhält er eine Prämie und ein Betrag in Höhe dieser Prämie wird als Verbindlichkeit verbucht. Der Vermögenswert bzw. die Verbindlichkeit wird täglich angepasst, um den aktuellen Marktwert des Optionskontrakts wiederzugeben. Optionskontrakte, die an einer Börse oder an einem regulierten Markt oder an einem anderen regulierten Markt notiert oder gehandelt werden, werden zum Börsenpreis bewertet (gemäß der vorstehend unter „Bewertung von Anlagen“ beschriebenen Preispolitik). Außerbörslich gehandelte Optionen werden zum aktuellen Marktpreis je nach täglich von Dritten berechneten Preisen bewertet und mit dem von der Gegenpartei erhaltenen Wert abgeglichen. Sind die letzten verfügbaren Kurse nicht repräsentativ, so beruht die Bewertung auf dem möglichen Realisierungswert, den der Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft umsichtig und in gutem Glauben schätzt.

Wenn eine Option nicht ausgeübt wird und verfällt, erzielt der Teilfonds einen Gewinn bzw. Verlust in Höhe der erhaltenen oder gezahlten Prämie. Erhaltene oder gezahlte Prämien und nicht realisierte Nettogewinne und -verluste aus Optionskontrakten werden in der „Nettovermögensaufstellung“ unter „Zum Marktwert erworbene Optionskontrakte mit Vorabprämie“ oder „Zum Marktwert ausgefertigte Optionskontrakte mit Vorabprämie“ verbucht.

Realisierte Nettogewinne/(-verluste) bzw. Veränderungen nicht realisierter Nettogewinne/(-verluste) aus Optionskontrakten werden unter „Aufwands- und Ertragsrechnung und Veränderungen des Nettovermögens“ verbucht.

- **Termingeschäftartige Optionen** - Termingeschäftartige Optionen werden zum verfügbaren offiziellen Börsenpreis bewertet (gemäß der vorstehend unter „Bewertung von Anlagen“ beschriebenen Preispolitik). Ersteinschusszahlungen werden bei Abschluss des Kontrakts in bar bezahlt. Der Teilfonds zahlt oder erhält regelmäßig nachfolgende positive oder negative Barmittelflüsse, die Schwankungsmargen genannt werden. Sie basieren auf Änderungen des Marktwerts offener Optionen. Bei Abschluss des Kontrakts verzeichnet der betroffene Teilfonds einen realisierten Gewinn bzw. Verlust in Höhe der Differenz zwischen den Erlösen (bzw. den Kosten) aus dem Abschluss- und dem Eröffnungsgeschäft. Nicht realisierte Nettogewinne und -verluste aus termingeschäftartigen Optionen werden in der „Nettovermögensaufstellung“ verbucht.
- **Swappeschäfte** - Teilfonds können verschiedene Arten von Swappeschäften eingehen, etwa Zinsswaps, Swaptions, Inflationsswaps, Credit Default Swaps und Total Return Swaps. Nicht realisierte Nettogewinne und -verluste aus Swappeschäften werden in der „Nettovermögensaufstellung“ verbucht. Realisierte Nettogewinne/(-verluste) bzw. Veränderungen nicht realisierter Nettogewinne/(-verluste) aus Swappeschäften werden unter „Aufwands- und Ertragsrechnung und Veränderungen des Nettovermögens“ verbucht. Swappeschäfte werden zum angemessenen Marktwert bewertet, der gemäß den vom Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft festgelegten Verfahren umsichtig und in gutem Glauben ermittelt wird. Swappeschäfte werden an jedem Berechnungsdatum des Nettoinventarwerts zum aktuellen Marktpreis bewertet. Der Marktwert basiert auf der Bewertung von im Kontrakt festgeschriebenen Aspekten und wird von externen Anbietern, Wertpapierhändlern oder internen Modellen gemäß den vom Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft festgelegten Verfahren bezogen. Effektive Zinskosten/-einnahmen aus Swaps werden vollständig unter „Aufwands- und Ertragsrechnung und Veränderungen des Nettovermögens“ verbucht. Angefallene Kosten/Erträge aus Swaps werden an jedem Berechnungsdatum des Nettoinventarwerts für jedes Swappeschäft aufgerechnet und der resultierende Nettosaldo je Swap wird entweder als Zinskosten oder Zinseinnahmen aus Swaps unter „Aufwands- und Ertragsrechnung und Veränderungen des Nettovermögens“ erfasst.
- **Erträge** - Zinseinkünfte werden auf Tagesbasis verrechnet. Dividenden werden nach Abzug von Quellensteuern ausgewiesen und als Erträge am Tag der Dividendenzahlung erfasst.
- **Realisierte Nettogewinne und -verluste** - Realisierte Nettogewinne und -verluste umfassen die Gewinne oder Verluste aus dem Handel mit Wertpapieren und anderen Anlagen, Finanztermingeschäften, Devisentermingeschäften, Optionen, CFDs, Swaps und anderen Anlagen im Laufe des Zeitraums, sowie Differenzen aus der Neubewertung anderer in anderen Währungen lautenden Vermögenswerte und Verbindlichkeiten zum Ende des Zeitraums. Realisierte Nettogewinne- und -verluste werden auf Grundlage der gewichteten Durchschnittskosten verkaufter Anlagen ermittelt. Hiervon ausgenommen sind Termingeschäfte und CFDs, bei denen das FIFO-Verfahren (First-In First-Out) zur Anwendung kommt.
- **Konsolidierter Geschäftsbericht** - Die Zahlen der einzelnen Teilfonds werden in ihrer jeweiligen Basiswährung ausgewiesen. Der konsolidierte Geschäftsbericht wird nur zu Informationszwecken vorgelegt.
- **Wertpapierleihgeschäfte** - Teilfonds können Wertpapiere in ihren Portfolios an einen Entleiher verleihen. Der Teilfonds erhält für diese Transaktion eine Sicherheit als Garantie. Verleihte Wertpapiere werden einem externen Makler überlassen und diese Vermögenswerte werden weiterhin als Teil des Portfolios des Teilfonds bewertet. Am Ende eines Leihgeschäfts muss der Teilfonds dem Entleiher die erhaltene Sicherheit zurückgeben. Die Parteien können Leihgeschäfte jederzeit beenden. Ein Teilfonds erhält durch Wertpapierleihgeschäfte zusätzliche Erträge je nach den vertraglichen Vereinbarungen. Diese Vergütung wird unter „Aufwands- und Ertragsrechnung und Veränderungen des Nettovermögens“ ausgewiesen.

3 VERWENDETE WECHSELKURSE ZUM 30. JUNI 2022

Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, die in anderen Währungen als der Basiswährung des entsprechenden Teilfonds lauten, werden zu den am 30. Juni 2022 geltenden Wechselkursen umgerechnet. Transaktionen in Fremdwährungen werden zu den am Transaktionsdatum geltenden Wechselkursen in die Basiswährung des entsprechenden Teilfonds umgerechnet.

Zum 30. Juni 2022 wurden folgende Wechselkurse verwendet:

| | | | |
|--------------|-----|-------------|-----|
| 1 EUR = | | 1 EUR = | |
| 1.52035 | AUD | 142.02965 | JPY |
| 5.46715 | BRL | 1,357.41230 | KRW |
| 1.34855 | CAD | 21.09275 | MXN |
| 1.00090 | CHF | 4.60785 | MYR |
| 979.44560 | CLP | 10.32875 | NOK |
| 7.00890 | CNH | 1.68145 | NZD |
| 6.99855 | CNY | 57.48405 | PHP |
| 4,350.22340 | COP | 4.70015 | PLN |
| 24.73550 | CZK | 4.94650 | RON |
| 1.95583 | DEM | 57.23845 | RUB |
| 7.43665 | DKK | 3.92265 | SAR |
| 19.65445 | EGP | 10.71315 | SEK |
| 0.86080 | GBP | 1.45495 | SGD |
| 8.20360 | HKD | 36.96190 | THB |
| 396.79000 | HUF | 17.45535 | TRY |
| 15,574.59175 | IDR | 31.08490 | TWD |
| 3.66130 | ILS | 1.04545 | USD |
| 82.56180 | INR | 17.12705 | ZAR |

4 VERWALTUNGS-, ANLAGEVERWALTUNGS- UND VERTRIEBSGEBÜHREN

Die Verwaltungsgebühr ist ein Prozentanteil am Nettoinventarwert jedes Teilfonds. Laut Prospekt liegt sie je nach Teilfonds und Anteilklasse zwischen 0.30% und 2.25% pro Jahr.

Die Verwaltungsgebühren für Anteile der Klasse X werden von der Verwaltungsgesellschaft berechnet und direkt vom Anteilinhaber eingezogen. Sie werden nicht dem Teilfonds berechnet oder im Nettoinventarwert wiedergegeben.

Zum 30. Juni 2022 wurden die folgenden effektiven Gebührensätze für Verwaltungsgebühren angewendet:

| Teilfond | Klasse A | Klasse B | Klasse C | Klasse E | Klasse F | Klasse G | Klasse H | Klasse I | Klasse P | Klasse R | Klasse U | Klasse W | Klasse W1 |
|--|----------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|-----------|
| Amundi S.F. - Diversified Short-Term Bond | 0.60% | * | * | 0.60% | 1.10% | * | 0.35% | 0.30% | * | 0.30% | * | * | * |
| Amundi S.F. - Euro Curve 7-10year | 0.60% | * | 0.90% | 1.05% | 1.60% | * | 0.55% | 0.40% | * | 0.40% | * | * | * |
| Amundi S.F. - Euro Curve 10+year | 0.60% | * | * | 1.05% | 1.60% | * | 0.55% | 0.40% | * | * | * | * | * |
| Amundi S.F. - SBI FM India Bond | 1.30% | * | * | * | * | * | 0.40% | 0.60% | * | * | * | * | * |
| Amundi S.F. - European Equity Optimal Volatility | 1.50% | 1.50% | 1.50% | 1.50% | 2.25% | 1.50% | 0.80% | 0.60% | * | 0.75% | * | * | * |
| Amundi S.F. - EUR Commodities | 1.00% | * | 1.00% | 1.00% | 1.75% | * | 0.55% | 0.40% | * | 0.55% | * | * | * |

Die Vertriebsgebühr ist ein Prozentanteil am Nettoinventarwert jedes Teilfonds. Laut Prospekt liegt sie je nach Anteilklasse zwischen 0.20% und bis zu 1.50% pro Jahr. Zum 30. Juni 2022 wurden die folgenden effektiven Gebührensätze für Vertriebsgebühren angewendet:

| Teilfond | Klasse A | Klasse B | Klasse C | Klasse E | Klasse F | Klasse G | Klasse H | Klasse I | Klasse K | Klasse P | Klasse R | Klasse U | Klasse W | Klasse W1 |
|--|----------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|-----------|
| Amundi S.F. - Diversified Short-Term Bond | * | * | * | * | * | * | * | * | * | * | * | * | * | * |
| Amundi S.F. - Euro Curve 7-10year | * | * | 1.00% | * | * | * | * | * | * | * | * | * | * | * |
| Amundi S.F. - Euro Curve 10+year | * | * | * | * | * | * | * | * | * | * | * | * | * | * |
| Amundi S.F. - SBI FM India Bond | * | * | * | * | * | * | * | * | * | * | * | * | * | * |
| Amundi S.F. - European Equity Optimal Volatility | * | * | 1.00% | * | * | 0.50% | * | * | * | * | * | * | * | * |
| Amundi S.F. - EUR Commodities | * | * | 1.00% | * | * | * | * | * | * | * | * | * | * | * |

Die Verwaltungs- und die Vertriebsgebühr fallen an jedem Bewertungstag an und werden auf Grundlage des Nettoinventarwerts des Teilfonds und der Anteilklasse berechnet. Sie sind jeden Monat rückwirkend zahlbar.

Die Verwaltungsgesellschaft bezahlt die Anlageverwalter im Einklang mit den Verwaltungsvorschriften des Fonds aus der zu zahlenden Verwaltungsgebühr.

5 ERFOLGSABHÄNGIGE GEBÜHR

Bei bestimmten Anteilklassen bestimmter Teilfonds erhält die Verwaltungsgesellschaft unter Umständen eine erfolgsabhängige Gebühr, wenn sich der Nettoinventarwert je Einheit der Klasse während des Leistungszeitraums wie im Prospekt ausgewiesen besser entwickelt als sein Vergleichsindex oder seine Erfolgshürde überschreitet. Der Leistungszeitraum endet mit dem Kalenderjahr. Hiervon ausgenommen sind die Teilfonds Emerging Markets Bond 2024, Emerging Markets Bond 2025, Global High Yield Opportunities 2025, Saving Box I, Saving Box II und Saving Box III, deren Leistungszeitraum am Auflegedatum beginnt und am Datum der Fälligkeit endet.

Die erfolgsabhängige Gebühr beträgt mindestens 15% (falls zutreffend und je nach Anteilklasse). Sie wird berechnet unter Bezugnahme auf den Anstieg der Vermögenswerte der Klasse über den Anstieg des Vergleichsindex oder die Erfolgshürde hinaus, bereinigt um Zeichnungen und Rücknahmen der entsprechenden Anteilklassen im Leistungszeitraum. Die Berechnung gestaltet sich folgendermaßen:

1) bei positivem Vergleichsindex oder positiver Wertentwicklung erhält die Verwaltungsgesellschaft eine erfolgsabhängige Gebühr in Höhe des im Prospekt aufgelisteten Prozentanteils der positiven Wertentwicklung der entsprechenden Anteilklassen gegenüber dem jeweiligen Vergleichsindex. Dabei gilt gegebenenfalls das (nachstehend definierte) Höchststandprinzip während des Zeitraums der Wertentwicklung.

2) wenn der Vergleichsindex oder die Ergebnishürde des Teilfonds im Laufe des Zeitraums der Wertentwicklung zurückgehen, erhält die Verwaltungsgesellschaft eine erfolgsabhängige Gebühr in Höhe des im Prospekt aufgelisteten Prozentanteils der positiven Wertentwicklung der entsprechenden Anteilklassen. Dabei gilt gegebenenfalls das Höchststandprinzip während des Zeitraums der Wertentwicklung.

3) Wenn die Wertentwicklung einer Klasse den Höchststand und den Vergleichsindex oder die Erfolgshürde überschreitet, die Wertentwicklung über den Höchststand hinaus jedoch geringer ist als die Wertentwicklung über den Vergleichsindex oder die Erfolgshürde hinaus, wird die erfolgsabhängige Gebühr unter Bezugnahme auf den Anteil der Wertentwicklung über den Höchststand hinaus und nicht über den Vergleichsindex oder die Erfolgshürde hinaus berechnet.

Gemäß der Definition im Prospekt sieht das High-Watermark-Prinzip vor, einen Nettoinventarwert je Einheit festzulegen. Wenn dieser unterschritten wird, wird keine erfolgsabhängige Gebühr gezahlt.

Er entspricht dem Nettoinventarwert je Einheit der jeweiligen Anteilklasse, bei dem letztmals eine erfolgsabhängige Gebühr gezahlt wurde oder falls in dieser Klasse noch nie eine erfolgsabhängige Gebühr gezahlt wurde, dem Nettoinventarwert je Einheit, bei dem die Klasse aufgelegt wurde oder falls diese Klasse erstmalig eine erfolgsabhängige Gebühr einführt, dem Nettoinventarwert je Einheit am Geschäftstag unmittelbar vor dem Datum der Einführung der erfolgsabhängigen Gebühr in dieser Klasse.

Sofern nicht anders festgelegt werden die Vergleichsindizes oder Erfolgshürden vor Abzug von Verwaltungsgebühren und anderen Gebühren und Kosten basierend auf einem Gesamtertragsindex berechnet.

Die Wertentwicklung von Einheiten der Klasse F (außer Anleihefond) wird anhand eines „Preisindex“ berechnet, d. h. die Berechnung der Wertentwicklung des Vergleichsindex oder der Erfolgshürde erfolgt nach Abzug von Dividenden.

Eine etwaige erfolgsabhängige Gebühr für Einheiten der Klasse X wird von der Verwaltungsgesellschaft berechnet und direkt vom Anteilinhaber eingezogen und daher nicht im Nettoinventarwert wiedergegeben

6 DEPOT- UND ZAHLSTELLE, VERWALTUNGS-, REGISTER- UND TRANSFERSTELLE

Die Depot- und Zahlstelle und die Verwaltungs-, Register- und Transferstelle erhalten für ihre Dienstleistungen die nachstehend aufgeführten Gebühren aus den Vermögenswerten der entsprechenden Teilfonds.

- **Depot- und Zahlstelle:** Die Gebühr entspricht einem Prozentanteil des Portfoliowerts der einzelnen Teilfonds zum jeweiligen Monatsende. Er liegt zwischen 0.003% und 0.50% pro Jahr, je nachdem, wo die Vermögenswerte des entsprechenden Teilfonds gehalten werden. Die Gebühr fällt an jedem Bewertungstag an und wird an jedem Bewertungstag berechnet. Sie ist jeden Monat rückwirkend zahlbar.
- **Verwaltungsstelle:** Die Gebühr für die erbrachten wesentlichen Dienstleistungen beläuft sich auf einen Jahressatz von 0.01%. Sie fällt an jedem Bewertungstag an und wird an jedem Bewertungstag auf Grundlage des Nettoinventarwerts des entsprechenden Teilfonds berechnet. Sie ist monatlich rückwirkend zahlbar.
- **Register- und Transferstelle:** Die Vergütung der bereitgestellten Dienstleistungen erfolgt im Wesentlichen anhand der Anzahl vorhandener aktiver Anteilklassen, der Anzahl der Kundenkonten und der Anzahl bearbeiteter Transaktionen.

7 BESTEUERUNG DES FONDS - TAXE D'ABONNEMENT

Den zurzeit in Luxemburg geltenden Gesetzen zufolge unterliegt der Fonds keinen Einkommens- oder Kapitalertragsteuern. Der Fonds unterliegt der Zeichnungssteuer *Taxe d'abonnement*. Diese beläuft sich auf einen Jahressatz von 0.05% des Nettoinventarwerts der einzelnen Teilfonds am Ende jedes Kalenderquartals und wird vierteljährlich berechnet und gezahlt. Bei Anteilklassen, die sich nur an geeignete institutionelle Anleger richten und Teilfonds, deren alleiniges Ziel die gemeinsame Anlage in Geldmarktinstrumente und Einlagen bei Kreditinstituten ist, verringert sich diese Steuer um 0.01% des Nettoinventarwerts.

Gemäß Artikel 175 (a) des geänderten Gesetzes vom 17. Dezember 2010 ist Nettovermögen, das in OGA investiert ist, die bereits der *Taxe d'abonnement* unterliegen, von dieser Steuer befreit.

Zins- und Dividendenerträge des Fonds können im Ursprungsland einer nicht erstattungsfähigen Quellensteuer unterliegen.

8 OFFENE POSITIONEN AUS TERMINGESCHÄFTEN

Zum 30. Juni 2022 hatten bestimmte Teilfonds die folgenden Positionen aus Termingeschäften.

■ Amundi S.F. - Diversified Short-Term Bond

| Anzahl der Kontrakte Kauf/Verkauf | Bezeichnung | Fälligkeits datum | Währung | Nicht realisierter Gewinn/Verlust in EUR |
|--------------------------------------|---------------------|----------------------|---------|---|
| -1,148 | EURO BOBL | 09-2022 | EUR | -3,276,980.00 |
| 127 | EURO BUND | 09-2022 | EUR | 98,290.00 |
| -7,218 | EURO SCHATZ | 09-2022 | EUR | -105,820.00 |
| -43 | LONG GILT | 09-2022 | GBP | 185,827.14 |
| -617 | US 2 YR NOTE FUTURE | 10-2022 | USD | -378,953.18 |
| -634 | US 5 YR NOTE FUTURE | 10-2022 | USD | 780,646.21 |
| Gesamt: | | | | -2,696,989.83 |

■ Amundi S.F. - Euro Curve 7-10year

| Anzahl der Kontrakte Kauf/Verkauf | Bezeichnung | Fälligkeits datum | Währung | Nicht realisierter Gewinn/Verlust in EUR |
|--------------------------------------|------------------|----------------------|---------|---|
| -19 | EURO BOBL | 09-2022 | EUR | 15,770.00 |
| -58 | EURO BUND | 09-2022 | EUR | -210,400.00 |
| 113 | EURO-BTP FUTURE | 09-2022 | EUR | 132,250.00 |
| -22 | EURO-OAT FUTURES | 09-2022 | EUR | -98,690.00 |
| Gesamt: | | | | -161,070.00 |

■ Amundi S.F. - Euro Curve 10+year

| Anzahl der Kontrakte Kauf/Verkauf | Bezeichnung | Fälligkeits datum | Währung | Nicht realisierter Gewinn/Verlust in EUR |
|--------------------------------------|------------------|----------------------|---------|---|
| -6 | EURO BUND | 09-2022 | EUR | -13,040.00 |
| 9 | EURO BUXL | 09-2022 | EUR | -45,260.00 |
| 6 | EURO-BTP FUTURE | 09-2022 | EUR | 38,380.00 |
| -30 | EURO-OAT FUTURES | 09-2022 | EUR | -124,270.00 |
| Gesamt: | | | | -144,190.00 |

■ Amundi S.F. - European Equity Optimal Volatility

| Anzahl der Kontrakte Kauf/Verkauf | Bezeichnung | Fälligkeits datum | Währung | Nicht realisierter Gewinn/Verlust in EUR |
|--------------------------------------|-------------|----------------------|---------|---|
| -1,650 | MSCI EUROPE | 09-2022 | EUR | 39,270.00 |
| Gesamt: | | | | 39,270.00 |

9 OFFENE POSITIONEN AUS DEWSENTERMINKONTRAKTEN

Zum 30. Juni 2022 hatten folgende Teilfonds die nachstehend aufgelisteten offenen Positionen aus Devisentermingeschäften und zugehörigen nicht realisierten Wertsteigerungen/Wertverluste.

■ Amundi S.F. - Diversified Short-Term Bond

| | Währung | Betrag in EUR |
|---------------------------------|----------------|-----------------------|
| Gekaufte Devisen | EUR | 156,156,826.77 |
| | USD | 2,251,498.14 |
| | Gesamt: | 158,408,324.91 |
| Verkaufte Devisen | CZK | 3,286.80 |
| | EUR | 2,258,432.10 |
| | GBP | 24,445,669.95 |
| | USD | 132,471,901.93 |
| | Gesamt: | 159,179,290.78 |
| Nicht realisiert gesamt: | | -770,965.87 |

Das letzte Ablaufdatum aller offenen Kontrakte ist 14. September 2022.

■ Amundi S.F. - Euro Curve 7-10year

| | Währung | Betrag in EUR |
|---------------------------------|----------------|---------------|
| Gekaufte Devisen | EUR | 70.58 |
| | Gesamt: | 70.58 |
| Verkaufte Devisen | CZK | 70.70 |
| | Gesamt: | 70.70 |
| Nicht realisiert gesamt: | | -0.12 |

Das letzte Ablaufdatum aller offenen Kontrakte ist 14. September 2022.

■ Amundi S.F. - Euro Curve 10+year

| | Währung | Betrag in EUR |
|---------------------------------|----------------|---------------|
| Gekaufte Devisen | EUR | 63.95 |
| | Gesamt: | 63.95 |
| Verkaufte Devisen | CZK | 64.06 |
| | Gesamt: | 64.06 |
| Nicht realisiert gesamt: | | -0.11 |

Das letzte Ablaufdatum aller offenen Kontrakte ist 14. September 2022.

■ Amundi S.F. - SBI FM India Bond

| | Währung | Betrag in USD |
|---------------------------------|----------------|---------------------|
| Gekaufte Devisen | INR | 4,886,068.25 |
| | Gesamt: | 4,886,068.25 |
| Verkaufte Devisen | USD | 4,950,000.00 |
| | Gesamt: | 4,950,000.00 |
| Nicht realisiert gesamt: | | -63,931.75 |

Das letzte Ablaufdatum aller offenen Kontrakte ist 09. September 2022.

■ Amundi S.F. - EUR Commodities

| | Währung | Betrag in EUR |
|---------------------------------|----------------|----------------------|
| Gekaufte Devisen | CHF | 254,473.13 |
| | EUR | 9,928,104.18 |
| | USD | 33,252,447.82 |
| | Gesamt: | 43,435,025.13 |
| Verkaufte Devisen | CHF | 30,660.04 |
| | EUR | 32,745,418.45 |
| | USD | 10,095,411.76 |
| | Gesamt: | 42,871,490.25 |
| Nicht realisiert gesamt: | | 563,534.88 |

Das letzte Ablaufdatum aller offenen Kontrakte ist 08. Juli 2022.

10 SONSTIGE ERTRÄGE

Die Beträge der sonstigen Erträge in der Gewinn- und Verlustrechnung und den Veränderungen des Nettovermögens umfassen Rabattgebühren.

11 SONSTIGE KOSTEN

Salden aus der Rubrik „Sonstige Kosten“ in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und den Veränderungen des Nettovermögens beinhalten sonstige Steuern und Zinsen sowie Bankgebühren.

12 OPTIONEN

Zum 30. Juni 2022 hatten bestimmte Teilfonds die folgenden offenen Positionen:

OPTIONSKONTRAKTE MIT VORABPRÄMIE

Informationen hierzu finden Sie unter Wertpapierportfolio.

TERMINGESCHÄFTARTIGE OPTIONEN

■ Amundi S.F. - Diversified Short-Term Bond

| Geschäft | Ausübung | Fälligkeits datum | Währung | Anzahl der Optionen |
|------------------------|----------|-------------------|---------|---------------------|
| EURO BUND FUTURE /CALL | 150.00 | 26/08/22 | EUR | -1,225 |
| EURO BUND FUTURE /CALL | 147.50 | 26/08/22 | EUR | -1,225 |
| EURO BUND FUTURE /CALL | 145.00 | 26/08/22 | EUR | 1,225 |
| EURO BUND FUTURE /CALL | 153.50 | 26/08/22 | EUR | 1,225 |
| EURO BUND FUTURE /PUT | 142.00 | 26/08/22 | EUR | -1,225 |
| EURO BUND FUTURE /PUT | 139.50 | 26/08/22 | EUR | 1,225 |

Zum 30. Juni 2022 belief sich der gesamte nicht realisierte Nettogewinn aus termingeschäftartigen Optionen auf EUR 36,750.00.

■ Amundi S.F. - Euro Curve 7-10year

| Geschäft | Ausübung | Fälligkeits datum | Währung | Anzahl der Optionen |
|------------------------|----------|-------------------|---------|---------------------|
| EURO BUND FUTURE /CALL | 152.50 | 22/07/22 | EUR | 223 |

Zum 30. Juni 2022 belief sich der gesamte nicht realisierte Nettogewinn aus termingeschäftartigen Optionen auf EUR 62,440.00.

■ Amundi S.F. - Euro Curve 10+year

| Geschäft | Ausübung | Fälligkeits datum | Währung | Anzahl der Optionen |
|------------------------|----------|-------------------|---------|---------------------|
| EURO BUND FUTURE /CALL | 152.50 | 22/07/22 | EUR | 111 |

Zum 30. Juni 2022 belief sich der gesamte nicht realisierte Nettogewinn aus termingeschäftartigen Optionen auf EUR 31,080.00.

13 SWAPGESCHÄFTE

In Anmerkung 12 finden Sie genaue Informationen zu den Sicherheiten.

■ Amundi S.F. - Euro Curve 7-10year

| Fälligkeits datum | Geschäft | Zugrundeliegender | Sicherheitsbetrag Zinssatz | Gezahlter Satz | Währung | Nominal | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in EUR |
|----------------------|----------|-------------------|-------------------------------|----------------|---------|-----------|--|
| 2. Mar. 32 | Zinsswap | - | 0.850% | Euribor 6M | EUR | 3,000,000 | -384,579.93 |
| Total: | | | | | | | -384,579.93 |

■ Amundi S.F. - Euro Curve 10+year

| Fälligkeits datum | Geschäft | Zugrundeliegender | Sicherheitsbetrag Zinssatz | Gezahlter Satz | Währung | Nominal | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in EUR |
|----------------------|----------|-------------------|-------------------------------|----------------|---------|-----------|--|
| 2. Mar. 32 | Zinsswap | - | 0.850% | Euribor 6M | EUR | 2,100,000 | -269,205.95 |
| 3. Mar. 32 | Zinsswap | - | 0.800% | Euribor 6M | EUR | 2,100,000 | -278,378.86 |
| Total: | | | | | | | -547,584.81 |

■ Amundi S.F. - EUR Commodities

| Fälligkeits datum | Geschäft | Zugrundeliegender | Sicherheitsbetrag Zinssatz | Gezahlter Satz | Währung | Nominal | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in EUR |
|----------------------|----------------------|-------------------|-------------------------------|----------------|---------|------------|--|
| 6. Juli 22 | Commodity Index Swap | BBG Cmdty 1M Fwd | - | 0.08% | USD | 40,000,000 | -3,062,532.04 |
| 6. Juli 22 | Commodity Index Swap | BBG Commodity | - | 0.075% | USD | 74,000,000 | -5,613,397.92 |
| 6. Juli 22 | Commodity Index Swap | BBG Commodity | - | 0.065% | USD | 71,000,000 | -5,385,306.76 |
| 6. Juli 22 | Commodity Index Swap | BBG Commodity | - | 0.065% | USD | 82,000,000 | -6,219,650.06 |
| 6. Juli 22 | Commodity Index Swap | BBG Commodity | - | 0.075% | USD | 4,000,000 | -387,205.12 |
| 6. Juli 22 | Commodity Index Swap | BBG Commodity | 0.065% | - | USD | 3,000,000 | 177,204.20 |
| 6. Juli 22 | Commodity Index Swap | BBG Commodity | 0.065% | - | USD | 4,000,000 | 236,269.51 |
| 6. Juli 22 | Commodity Index Swap | BBG Commodity | 0.075% | - | USD | 5,000,000 | 16,380.88 |
| Total: | | | | | | | -20,238,237.31 |

14 WERTPAPIERBELEIHUNGEN

Für den zum 30. Juni 2022 beendeten Zeitraum entspricht der Nettobetrag der Erträge aus Wertpapierbeleihungen dem Bruttobetrag der Einnahmen der einzelnen Teilfonds (in der Aufwands- und Ertragsrechnung und den Veränderungen des Nettovermögens unter der Rubrik „Sonstige Erträge“ erfasst). Hiervon abgezogen werden direkte und indirekte Kosten und Gebühren, die unter der Überschrift „Sonstige Ausgaben“ erfasst sind.

| Teilfonds | Währung | Gesamtbruttobetrag der Erträge aus Wertpapierbeleihungen | Direkte und indirekte Kosten und Gebühren | | Bruttobetrag- Rückübertragung Nettobetrag der Erträge aus Wertpapierbeleihungen |
|------------------------------------|---------|--|--|--------|---|
| | | | Amundi Intermediation | CACEIS | |
| Amundi S.F. - Euro Curve 7-10 year | EUR | 1,618.92 | 566.62 | | 1,052.30 |

Die Einkünfte aus Wertpapierleihen werden mit der verbundenen Gesellschaft Amundi Intermediation in folgende Anteile aufgeteilt:

| | Teilfonds | Amundi Intermediation |
|----------------|-----------|--------------------------|
| Alle Teilfonds | 65% | 35% |

15 SICHERHEITEN

Zum 30. Juni 2022 wurden von Maklern und Gegenparteien für Transaktionen mit außerbörslich gehandelten Derivaten folgende Sicherheiten gezahlt/erhalten:

| Teilfonds | Teilfonds Währung | Gegenpartei | Art der Sicherheiten | Erhaltener Si- cherheitsbetrag (in der Währung des Teilfonds) | Gezahlter Sicherheitsbetrag (in der Währung des Teilfonds) |
|---|----------------------|---|-------------------------|--|---|
| Amundi S.F. - Diversified Short-Term Bond | EUR | BOFA SECURITIES EUROPE SA, JP MORGAN CHASE & CO | Bargeldanlagen | 3,860,000 | - |
| Amundi S.F. - Euro Curve 7-10year | EUR | JP MORGAN CHASE & CO | Bargeldanlagen | - | 260,000 |
| Amundi S.F. - Euro Curve 10+year | EUR | BOFA SECURITIES EUROPE SA, JP MORGAN CHASE & CO | Bargeldanlagen | - | 550,000 |
| Amundi S.F. - EUR Commodities | EUR | JP MORGAN CHASE & CO, MACQUARIE SECURITIE, SOCIETE GENERALE | Bargeldanlagen | - | 19,970,000 |

16 KONTOAUSZUG DER PORTFOLIOBEWEGUNGEN

Eine Liste der Veränderungen des Portfolios im zum 30. Juni 2022 beendeten Zeitraum sind am eingetragenen Sitz der Verwaltungsgesellschaft des Fonds kostenlos erhältlich.

In den Anmerkungen zum Geschäftsbericht werden alle Einzelheiten bezüglich der zum 30. Juni 2022 ausstehenden Derivate ausgewiesen.

17 DIVIDENDEN

- **Ausschüttende Klassen** Diese Klassen schütten täglich einen Betrag aus, der vom entstandenen Nettoertrag abhängt. Die täglichen Beträge fallen monatlich an und werden monatlich gezahlt.
- **Jährliche Ausschüttung:** Diese Klassen schütten einen jährlichen Betrag aus, der vom Vorjahresertrag oder der Vorjahresdividende abhängt und auf einem jährlichen Renditeziel basiert, das am Auflagdatum/zu Jahresbeginn bestimmt wird. Je nach Teilfonds kann der Ertrag nach oder vor Abzug von Gebühren ausgeschüttet werden.
- **Vierteljährliche Zielausschüttung:** Diese Klassen streben die vierteljährliche Ausschüttung einer Dividende an. Sie basiert auf einem jährlichen Renditeziel und wird zu Jahresbeginn festgelegt.

Weitere Einzelheiten sind in der Beschreibung der Richtlinien der Dividendenausschüttung im Prospekt des Fonds zu finden. Im Laufe des Zeitraums wurden nur die im Prospekt beschriebenen Ausschüttungen durchgeführt.

Vertreter, Zahlstelle, Erfüllungsort und Gerichtsstand

In Bezug auf die Anteile, die in und/oder von der Schweiz vertrieben werden, befindet sich der Erfüllungsort und der Gerichtsstand am Sitz des schweizerischen Vertreters, nämlich des:

Caceis (Switzerland) S.A. (seit 8. Februar 2022)
Route de Signy 35
CH-1260 Nyon
Schweiz

Die Zahlstelle in der Schweiz ist:

CACEIS Bank, Paris, Zweigniederlassung Nyon / Schweiz * (seit 8. Februar 2022)
Route de Signy 35
CH-1260 Nyon
Schweiz

* Am 8. August 2022 und als Niederlassung einer französischen Gesellschaft, die von Paris nach Montrouge (92) umgezogen ist, wurde der Name der Depotbank wie folgt geändert: CACEIS Bank, Montrouge, Zweigniederlassung Nyon / Schwei.

Veröffentlichungen

Prospekt und Basisinformationsblatt (oder gleichwertiges Dokument), Statuten, Liste der Käufe und Verkäufe sowie der Jahres- und Halb-jahresbericht können kostenlos beim Vertreter bezogen werden.

Caceis (Switzerland) S.A. (seit 7. Februar 2022)
Route de Signy 35
CH-1260 Nyon
Schweiz

Mitteilungen über den Fonds werden in der Schweiz auf der elektronischen Plattform "Fundinfo" veröffentlicht.

Der Nettoinventarwert für jedes einzelne Portfolio*, ausgenommen Provisionen, werden täglich auf der elektronischen Plattform „Fundinfo“ veröffentlicht. Dieser Wert bestimmt den im Verkaufsprospekt beschriebenen Handelspreis (der Nettoinventarwert, berichtigt um die angemessene Rücklage für Handelskosten, geteilt durch die Anzahl der ausgegebenen Anteile, um so eine definitive Anpassung zu erreichen).

Zahlung von Rückübertragungen und mit Vertriebsaktivitäten verbundene Zuwendungen

Zum Zeitpunkt des Vertriebs in der Schweiz können die Fondsverwalter den qualifizierten Anlegern Rückübertragungen zahlen – allerdings nur denjenigen mit einer finanziellen Beteiligung in Anteilen für gemeinsame Anlagen für Dritte, die unten aufgeführt sind:

- Lebensversicherungsgesellschaften;
- Altersvorsorge und andere Sozialversicherungsgesellschaften;
- Anlagestiftungen;
- Schweizer Fondsverwalter;
- ausländische Fondsverwalter und Gesellschaften;
- Investmentunternehmen.

Die Fondsleitung kann die Vergütungen in Verbindung mit Vertriebsaktivitäten an die im Folgenden bezeichneten Vertreter und Vertriebspartner zahlen:

- Vertreter, die im Sinne von Artikel 13, al. 1 und 2, KAG (Loi fédérale sur les placements collectifs de capitaux, LPCC) einer Genehmigungspflicht unterliegen;
- Vertreter, die im Sinne von Artikel 13, al. 3, KAG und Artikel 8, KKV (Ordonnance sur les placements collectifs de capitaux, OPCC) von einer Genehmigungspflicht freigestellt sind;
- Vertriebspartner, die die Anteile der SICAV ausschließlich bei institutionellen Anlegern anlegen, deren Einlagen professionell verwaltet werden,
- Vertriebspartner, die Anteile der SICAV ausschließlich auf der Grundlage einer schriftlichen Vollmacht zur Vermögensverwaltung anlegen.

Die Gesamtkostenquote (TER) wird wie folgt festgelegt:

| Amundi S.F. | Währung | Isin | Anteilklassen | TER% | Performance Gebühr% |
|-----------------------------|--------------|-----------------------------|--|-------|---------------------|
| Diversified Short-Term Bond | EUR | LU2357810188 | Klasse A jährliche Ausschüttung | 0,85% | 0,00% |
| | EUR | LU1706854152 | Klasse A keine Ausschüttung | 0,82% | 0,00% |
| | EUR | LU1706854236 | Klasse E Vierteljährliche Ausschüttung | 0,73% | 0,00% |
| | EUR | LU1499628912 | Klasse E keine Ausschüttung | 0,79% | 0,00% |
| | USD | LU1706854319 | Klasse E keine Ausschüttung | 0,79% | 0,00% |
| | EUR | LU2357810428 | Klasse F keine Ausschüttung | 1,40% | - |
| | EUR | LU2357810691 | Klasse H jährliche Ausschüttung | 0,50% | - |
| | EUR | LU1889052269 | Klasse H Vierteljährliche Ausschüttung | 0,57% | - |
| | EUR | LU1503126044 | Klasse H keine Ausschüttung | 0,58% | - |
| | EUR | LU1706854400 | Klasse I keine Ausschüttung | 0,49% | - |
| Euro Curve 7-10 year | EUR | LU2357810931 | Klasse R jährliche Ausschüttung | 0,54% | - |
| | EUR | LU2357810774 | Klasse R keine Ausschüttung | 0,45% | - |
| | EUR | LU0536711285 | Klasse A Ausschüttung | 0,87% | - |
| | EUR | LU0536711103 | Klasse A jährliche Ausschüttung | 0,86% | - |
| | EUR | LU0367810172 | Klasse A keine Ausschüttung | 0,85% | - |
| | EUR | LU0536711442 | Klasse C keine Ausschüttung | 2,12% | - |
| | EUR | LU0857391824 | Klasse E vierteljährliche Zielausschüttung | 1,35% | - |
| | EUR | LU0271693920 | Klasse E keine Ausschüttung | 1,36% | - |
| | EUR | LU0271694654 | Klasse F keine Ausschüttung | 1,90% | - |
| | EUR | LU0332132041 | Klasse H keine Ausschüttung | 0,81% | - |
| EUR | LU0433266433 | Klasse I keine Ausschüttung | 0,63% | - | |
| EUR | LU1706854665 | Klasse R Ausschüttung | 0,61% | - | |
| EUR | LU1706853857 | Klasse R keine Ausschüttung | 0,66% | - | |

| Amundi S.F. | Währung | Isin | Anteilklassen | TER% | Performance Gebühr% |
|------------------------------------|----------------|--------------|--|-------------|--------------------------------|
| Euro Curve 10+year | EUR | LU0281585215 | Klasse A jährliche Ausschüttung | 0,79% | - |
| | EUR | LU0857391741 | Klasse E vierteljährliche Zielausschüttung | 1,31% | - |
| | EUR | LU0271691981 | Klasse E keine Ausschüttung | 1,31% | - |
| | EUR | LU0271692013 | Klasse F keine Ausschüttung | 1,86% | - |
| | EUR | LU0332132397 | Klasse H keine Ausschüttung | 0,76% | - |
| SBI FM India Bond | EUR | LU0433266516 | Klasse I keine Ausschüttung | 0,52% | - |
| | USD | LU2251232760 | Klasse A keine Ausschüttung | 1,56% | - |
| | USD | LU2251232844 | Klasse A2 keine Ausschüttung | 1,76% | - |
| | USD | LU2338645448 | Klasse H keine Ausschüttung | 0,89% | - |
| | USD | LU2251232927 | Klasse I keine Ausschüttung | 1,01% | 0,09% |
| European Equity Optimal Volatility | USD | LU2251233065 | Klasse I2 keine Ausschüttung | 1,02% | - |
| | EUR | LU1920531966 | Klasse A keine Ausschüttung | 1,77% | - |
| | EUR | LU1920532261 | Klasse C keine Ausschüttung | 2,76% | - |
| | EUR | LU1920532428 | Klasse E keine Ausschüttung | 1,82% | - |
| | EUR | LU1920532691 | Klasse F keine Ausschüttung | 2,57% | - |
| | EUR | LU1920532774 | Klasse G keine Ausschüttung | 2,31% | - |
| | EUR | LU1920532857 | Klasse H keine Ausschüttung | 1,07% | - |
| | EUR | LU1920532931 | Klasse I keine Ausschüttung | 0,77% | - |
| EUR Commodities | EUR | LU1920533152 | Klasse R keine Ausschüttung | 0,96% | - |
| | CHF | LU1694769693 | Klasse A abgesichert keine Ausschüttung | 1,30% | - |
| | USD | LU1694769859 | Klasse A abgesichert keine Ausschüttung | 1,30% | - |
| | EUR | LU0271695388 | Klasse A keine Ausschüttung | 1,20% | - |
| | USD | LU1694770196 | Klasse C abgesichert keine Ausschüttung | 2,30% | - |
| | EUR | LU0372625102 | Klasse C keine Ausschüttung | 2,21% | - |
| | EUR | LU0273973874 | Klasse E keine Ausschüttung | 1,25% | - |
| | EUR | LU0273974336 | Klasse F keine Ausschüttung | 2,00% | - |
| | EUR | LU0484923635 | Klasse H jährliche Ausschüttung | 0,70% | - |
| | USD | LU1772191695 | Klasse H abgesichert keine Ausschüttung | 0,85% | - |
| | EUR | LU0271872185 | Klasse H keine Ausschüttung | 0,77% | - |
| | EUR | LU1694770352 | Klasse I jährliche Ausschüttung | 0,56% | - |
| | USD | LU0419230916 | Klasse I abgesichert keine Ausschüttung | 0,66% | - |
| | EUR | LU0271695461 | Klasse I keine Ausschüttung | 0,56% | - |
| | USD | LU1706854582 | Klasse R abgesichert keine Ausschüttung | 0,85% | - |
| | EUR | LU1706853931 | Klasse R keine Ausschüttung | 0,77% | - |

VERORDNUNG ÜBER WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTE

Die SICAV ist während des Zeitraums keine Transaktionen eingegangen, die der EU-Verordnung Nr. 2015/2365 über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften und der Weiterverwendung unterliegen. Deshalb müssen keine globalen, gebündelten oder individuellen Daten oder Informationen zur Wiederverwendung oder Verwahrung von Sicherheiten ausgewiesen werden.

ERFOLGSABHÄNGIGE GEBÜHR

Im Anschluss an die Leitlinien der Europäischen Wertpapier- und Marktaufsichtsbehörde zu erfolgsabhängigen Gebühren (ESMA34-39-992) wirkten sich die Daten zu erfolgsabhängigen Gebühren zum 30. Juni 2022 folgendermaßen aus:

| Name des Teilfonds | Währung des Teilfonds | Anteil | ISIN | Erzielter Betrag der erfolgsabhängigen Gebühren am Ende des Beobachtungszeitraums (in der Währung des Teilfonds) | Prozentanteil basierend auf dem NIW am Ende des Beobachtungszeitraums ⁽¹⁾ | Täglicher Betrag der erfolgsabhängigen Gebühren während des Zeitraums aufgrund von Rücknahmen (in der Währung des Teilfonds) | Prozentanteil basierend auf dem NIW im Laufe des Geschäftsjahrs ⁽²⁾ | Zum Ende des Zeitraums (Ende des Bilanzierungszeitraums) angefallener Betrag der erfolgsabhängigen Gebühren (in der Währung des Teilfonds) | Prozentanteil basierend auf dem NIW am Ende des Geschäftsjahrs ⁽³⁾ |
|--|-----------------------|--|--------------|--|--|--|--|--|---|
| Amundi S.F. - Diversified Short-Term Bond | EUR | Klasse A jährliche Ausschüttung | LU2357810188 | - | - | 0.71 | 0.00% | - | - |
| | | Klasse A keine Ausschüttung | LU1706854152 | - | - | 4.71 | 0.00% | - | - |
| | | Klasse E Vierteljährliche Ausschüttung | LU1706854236 | - | - | - | - | - | - |
| | | Klasse E keine Ausschüttung | LU1499628912 | - | - | 986.71 | 0.00% | - | - |
| Amundi S.F. - SBI FM India Bond | USD | Klasse A keine Ausschüttung | LU2251232760 | - | - | - | - | - | - |
| | | Klasse I keine Ausschüttung | LU2251232927 | - | - | - | - | - | - |
| Amundi S.F. - European Equity Optimal Volatility | EUR | Klasse A keine Ausschüttung | LU1920531883 | - | - | - | - | - | - |
| | | Klasse C keine Ausschüttung | LU1920532345 | - | - | - | - | - | - |
| | | Klasse F keine Ausschüttung | LU1920532691 | - | - | - | - | - | - |

⁽¹⁾ Erzielter Betrag der erfolgsabhängigen Gebühren am Ende des Beobachtungszeitraums in der Währung des Teilfonds, geteilt durch den NIW am Ende des Beobachtungszeitraums

⁽²⁾ Täglicher Betrag der erfolgsabhängigen Gebühren während des Zeitraums aufgrund von Rücknahmen in der Währung des Teilfonds, geteilt durch den durchschnittlichen NIW im Laufe des Geschäftsjahrs.

⁽³⁾ Zum Ende des Zeitraums (Ende des Bilanzierungszeitraums) angefallener Betrag der erfolgsabhängigen Gebühren in der Währung des Teilfonds, geteilt durch den NIW am Ende des Bilanzierungszeitraums.

Kontakt Daten

Amundi S.F.
Amundi Luxembourg S.A.
5, Allée Scheffer,
L-2520 Luxembourg

Tel.: 352 2686 8080

www.amundi.lu/amundi-funds