

---

**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
<b>Portfolioangaben zum 30/06/22:</b>	
<b>Anleiheteilfonds</b>	
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
<b>Aktienteilfonds</b>	
Amundi S.F. - European Equity Optimal Volatility	13
<b>Commodities-Teilfonds</b>	
Amundi S.F. - EUR Commodities	14
<b>Konten:</b>	
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 Luxembourg  
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 Luxembourg  
Großherzogtum Luxemburg

**DEPOT- UND ZAHLSTELLE**

Société Générale Luxembourg  
11, Avenue Emile Reuter  
L-2420 Luxembourg  
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	
<b>Positive Positionen</b>	<b>1,281,080,881</b>	<b>94.73</b>	10,000,000	GROUPAMA ASSURANCES MUTUELLES SA VAR PERPETUAL	10,099,500 0.75
<b>Übertragbare und amtlich notierte Wertpapiere und/oder auf anderen Märkten gehandelte Wertpapiere</b>	<b>1,140,478,388</b>	<b>84.33</b>	15,000,000	HOLDING DINFRASTRUCTURES ET DES METIERS DE ENVIRONMENT 0.125% 16/09/2025	13,396,500 0.99
<b>Anleihen</b>	<b>1,140,478,388</b>	<b>84.33</b>	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% 14A 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		<b>Aktien/Anteile aus OGAW/OGA</b>	<b>122,203,902</b>	<b>9.04</b>
15,000,000	ING GROUP NV VAR 29/11/2025	14,041,200	1.04		<b>Aktien/Anteile aus Investmentfonds</b>	<b>122,203,902</b>	<b>9.04</b>
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
<b>Derivative Instrumente</b>	<b>18,398,591</b>	<b>1.36</b>
<b>Optionen</b>	<b>18,398,591</b>	<b>1.36</b>
<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
<b>Negative Positionen</b>	<b>-13,335,033</b>	<b>-0.99</b>
<b>Derivative Instrumente</b>	<b>-13,335,033</b>	<b>-0.99</b>
<b>Optionen</b>	<b>-13,335,033</b>	<b>-0.99</b>
<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
<b>Gesamtwertpapierbestand</b>	<b>1,267,745,848</b>	<b>93.74</b>

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	
<b>Positive Positionen</b>	<b>72,965,010</b>	<b>98.12</b>			
<b>Übertragbare und amtlich notierte Wertpapiere und/oder auf anderen Märkten gehandelte Wertpapiere</b>	<b>69,862,538</b>	<b>93.95</b>			
<b>Anleihen</b>	<b>69,862,538</b>	<b>93.95</b>			
<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 FÜR WIEDERAUFBAU 0% 09/11/2028	809,838	1.09			
2,360,000 KREDITANSTALT FÜR 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>	6,402,738	8.61
			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>	2,091,836	2.81
			2,440,000 AUSTRIA 0% 20/02/2031	2,091,836	2.81
			<i>Portugal</i>	2,313,989	3.11
			2,480,000 REPUBLIC OF PORTUGAL 1.65% 16/07/2032	2,313,989	3.11
			<i>Schweden</i>	467,823	0.63
			504,000 KOMMUNINVEST I SVERIGE AB 0.875% 01/09/2029	467,823	0.63
			<i>Spanien</i>	12,319,925	16.57
			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
			<b>Aktien/Anteile aus OGAW/OGA</b>	<b>3,102,472</b>	<b>4.17</b>
			<b>Aktien/Anteile aus Investmentfonds</b>	<b>3,102,472</b>	<b>4.17</b>
			<i>Frankreich</i>	3,102,472	4.17
			3 AMUNDI EUR LIQUIDITY SRI FCP	3,102,472	4.17
			<b>Gesamtwertpapierbestand</b>	<b>72,965,010</b>	<b>98.12</b>

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	
<b>Positive Positionen</b>	<b>36,642,519</b>	<b>96.99</b>			
<b>Übertragbare und amtlich notierte Wertpapiere und/oder auf anderen Märkten gehandelte Wertpapiere</b>	<b>35,727,215</b>	<b>94.57</b>			
<b>Anleihen</b>	<b>35,727,215</b>	<b>94.57</b>			
<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
			<b>Aktien/Anteile aus OGAW/OGA</b>	<b>915,304</b>	<b>2.42</b>
			<b>Aktien/Anteile aus Investmentfonds</b>	<b>915,304</b>	<b>2.42</b>
			<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	
	<b>Gesamtwertpapierbestand</b>	<b>36,642,519</b>	<b>96.99</b>

Die beigefügten Anmerkungen sind integraler Bestandteil dieses Geschäftsberichts.

## Wertpapierbestand zum 30/06/22

Anzahl Nennwert	Marktwert	% des NIW
	USD	
<b>Positive Positionen</b>	<b>21,270,892</b>	<b>90.44</b>
<b>Übertragbare und amtlich notierte Wertpapiere und/oder auf anderen Märkten gehandelte Wertpapiere</b>	<b>21,270,892</b>	<b>90.44</b>
<b>Anleihen</b>	<b>21,270,892</b>	<b>90.44</b>
<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
<b>Gesamtwertpapierbestand</b>	<b>21,270,892</b>	<b>90.44</b>

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	
<b>Positive Positionen</b>	<b>41,479,575</b>	<b>84.15</b>			
<b>Übertragbare und amtlich notierte Wertpapiere und/oder auf anderen Märkten gehandelte Wertpapiere</b>	<b>41,479,575</b>	<b>84.15</b>			
<b>Aktien</b>	<b>41,479,575</b>	<b>84.15</b>			
<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 MEDITBANCA 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
			<b>Gesamtwertpapierbestand</b>	<b>41,479,575</b>	<b>84.15</b>

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	
<b>Positive Positionen</b>	<b>206,200,743</b>	<b>91.31</b>	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>	<b>104,679,991</b>	<b>46.36</b>	4,000,000 NETHERLANDS 0% 28/10/2022	4,003,760	1.77
<b>Anleihen</b>	<b>104,679,991</b>	<b>46.36</b>	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>	<b>Gesamtwertpapierbestand</b>	<b>206,200,743</b>	<b>91.31</b>
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			
<b>Geldmarktinstrumente</b>	<b>101,520,752</b>	<b>44.95</b>			
<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
<b>Aktiva</b>					
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	-	-	-
<b>Gesamtsumme der Aktiva</b>		<b>1,439,647,717</b>	<b>-</b>	<b>75,257,313</b>	<b>109,284,123</b>
<b>Passiva</b>					
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
<b>Gesamtsumme der Passiva</b>		<b>87,232,583</b>	<b>-</b>	<b>897,084</b>	<b>1,589,864</b>
<b>Nettovermögen</b>		<b>1,352,415,134</b>	<b>-</b>	<b>74,360,229</b>	<b>107,694,259</b>

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
<b>Aktiva</b>					
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		-	-	-	-
<b>Gesamtsumme der Aktiva</b>		<b>38,798,064</b>	<b>70,368,847</b>	<b>23,642,787</b>	<b>45,185,539</b>
<b>Passiva</b>					
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	-	-
<b>Gesamtsumme der Passiva</b>		<b>1,020,205</b>	<b>1,197,919</b>	<b>123,598</b>	<b>20,171,721</b>
<b>Nettovermögen</b>		<b>37,777,859</b>	<b>69,170,928</b>	<b>23,519,189</b>	<b>25,013,818</b>

Die beigegefügten 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
<b>Aktiva</b>					
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	-	-
<b>Gesamtsumme der Aktiva</b>		<b>49,571,514</b>	<b>62,126,260</b>	<b>247,605,392</b>	<b>156,345,386</b>
<b>Passiva</b>					
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
<b>Gesamtsumme der Passiva</b>		<b>276,630</b>	<b>626,801</b>	<b>21,772,592</b>	<b>2,137,283</b>
<b>Nettovermögen</b>		<b>49,294,884</b>	<b>61,499,459</b>	<b>225,832,800</b>	<b>154,208,103</b>

Die beigegeführten Anmerkungen sind integraler Bestandteil dieses Geschäftsberichts.

	Erläut	Konsolidiert	
		30/06/2022 EUR	30/06/2021 EUR
<b>Aktiva</b>			
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
<b>Gesamtsumme der Aktiva</b>		<b>1,873,495,035</b>	<b>665,781,624</b>
<b>Passiva</b>			
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
<b>Gesamtsumme der Passiva</b>		<b>111,317,319</b>	<b>26,896,974</b>
<b>Nettovermögen</b>		<b>1,762,177,716</b>	<b>638,884,650</b>

Die beigelegten Anmerkungen sind integraler Bestandteil dieses Geschäftsberichts.

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

	ISIN	Anzahl der Einheiten		Währung	NIW je Einheit		
		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	-
<b>Gesamtvermögen</b>				<b>EUR</b>	<b>1,352,415,134</b>	<b>1,377,781,723</b>	<b>1,071,962,165</b>

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

	ISIN	Anzahl der Einheiten		Währung	NIW je Einheit		
		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
<b>Gesamtvermögen</b>				<b>EUR</b>	<b>74,360,229</b>	<b>101,266,287</b>	<b>126,648,491</b>

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

	ISIN	Anzahl der Einheiten		Währung	NIW je Einheit		
		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
<b>Gesamtvermögen</b>				<b>EUR</b>	<b>37,777,859</b>	<b>54,360,751</b>	<b>113,852,545</b>

## 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	-
<b>Gesamtvermögen</b>				<b>USD</b>	<b>23,519,189</b>	<b>25,473,917</b>	<b>-</b>

## 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
<b>Gesamtvermögen</b>				<b>EUR</b>	<b>49,294,884</b>	<b>54,290,723</b>	<b>70,937,457</b>

## 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
<b>Gesamtvermögen</b>				<b>EUR</b>	<b>225,832,800</b>	<b>162,547,628</b>	<b>96,476,837</b>

	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
<b>Erträge</b>					
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	-
<b>Gesamtsumme der Erträge</b>		<b>16,495,637</b>	<b>-</b>	<b>342,624</b>	<b>786,910</b>
<b>Ausgaben</b>					
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
<b>Gesamtsumme der Ausgaben</b>		<b>10,568,503</b>	<b>-</b>	<b>490,653</b>	<b>680,404</b>
<b>Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums (01/01/22)</b>		<b>1,377,781,723</b>	<b>-</b>	<b>101,266,287</b>	<b>126,648,491</b>
<b>Operativer Nettoertrag/(-verlust)</b>		<b>5,927,134</b>	<b>-</b>	<b>-148,029</b>	<b>106,506</b>
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
<b>Realisierter Nettogewinn/(-verlust)</b>		<b>-5,134,454</b>	<b>-</b>	<b>-8,255,191</b>	<b>440</b>
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
<b>Veränderung des nicht realisierten Nettojahresgewinns/(-verlusts)</b>		<b>-71,578,620</b>	<b>-</b>	<b>-3,329,465</b>	<b>-2,811,127</b>
<b>Nettoanstieg/(-rückgang) des Nettovermögens durch das operative Geschäft</b>		<b>-70,785,940</b>	<b>-</b>	<b>-11,732,685</b>	<b>-2,704,181</b>
Nettozeichnungen/(-rücknahmen)		45,439,027	-	-15,172,889	-16,249,087
Dividendenausschüttungen	17	-19,676	-	-484	-964
<b>Neubewertung des konsolidierten Nettovermögens</b>		<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Zeitraums</b>		<b>1,352,415,134</b>	<b>-</b>	<b>74,360,229</b>	<b>107,694,259</b>

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
<b>Erträge</b>					
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	-
<b>Gesamtsumme der Erträge</b>		<b>441,652</b>	<b>750,527</b>	<b>714,284</b>	<b>3,188</b>
<b>Ausgaben</b>					
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
<b>Gesamtsumme der Ausgaben</b>		<b>248,079</b>	<b>440,563</b>	<b>108,929</b>	<b>10,393</b>
<b>Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums (01/01/22)</b>		<b>54,360,751</b>	<b>113,852,545</b>	<b>25,473,917</b>	<b>-</b>
<b>Operativer Nettoertrag/(-verlust)</b>		<b>193,573</b>	<b>309,964</b>	<b>605,355</b>	<b>-7,205</b>
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	-	-
<b>Realisierter Nettogewinn/(-verlust)</b>		<b>-4,913,314</b>	<b>-401,069</b>	<b>-129,087</b>	<b>8,755</b>
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	-	-
<b>Veränderung des nicht realisierten Nettojahresgewinns/(-verlusts)</b>		<b>-7,152,271</b>	<b>-6,771,393</b>	<b>-2,430,996</b>	<b>-7,732</b>
<b>Nettoanstieg/(-rückgang) des Nettovermögens durch das operative Geschäft</b>		<b>-11,872,012</b>	<b>-6,862,498</b>	<b>-1,954,728</b>	<b>-6,182</b>
Nettozeichnungen/(-rücknahmen)		-4,710,589	-37,818,466	-	25,020,000
Dividendenausschüttungen	17	-291	-653	-	-
<b>Neubewertung des konsolidierten Nettovermögens</b>		<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Zeitraums</b>		<b>37,777,859</b>	<b>69,170,928</b>	<b>23,519,189</b>	<b>25,013,818</b>

Die beigegefügt 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
<b>Erträge</b>					
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
<b>Gesamtsumme der Erträge</b>		<b>932,898</b>	<b>1,286,806</b>	<b>449,821</b>	<b>440,149</b>
<b>Ausgaben</b>					
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
<b>Gesamtsumme der Ausgaben</b>		<b>486,615</b>	<b>740,057</b>	<b>1,045,980</b>	<b>734,530</b>
<b>Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums (01/01/22)</b>		<b>54,290,723</b>	<b>70,937,457</b>	<b>162,547,628</b>	<b>96,476,837</b>
<b>Operativer Nettoertrag/(-verlust)</b>		<b>446,283</b>	<b>546,749</b>	<b>-596,159</b>	<b>-294,381</b>
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
<b>Realisierter Nettogewinn/(-verlust)</b>		<b>5,501,892</b>	<b>-7,074,330</b>	<b>63,101,086</b>	<b>25,755,640</b>
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
<b>Veränderung des nicht realisierten Nettojahresgewinns/(-verlusts)</b>		<b>-6,958,173</b>	<b>3,967,835</b>	<b>-24,334,849</b>	<b>-4,937,009</b>
<b>Nettoanstieg/(-rückgang) des Nettovermögens durch das operative Geschäft</b>		<b>-1,009,998</b>	<b>-2,559,746</b>	<b>38,170,078</b>	<b>20,524,250</b>
Nettozeichnungen/(-rücknahmen)		-3,985,841	-6,878,252	25,115,094	37,207,016
Dividendenausschüttungen	17	-	-	-	-
<b>Neubewertung des konsolidierten Nettovermögens</b>		<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Zeitraums</b>		<b>49,294,884</b>	<b>61,499,459</b>	<b>225,832,800</b>	<b>154,208,103</b>

Die beigegeführten Anmerkungen sind integraler Bestandteil dieses Geschäftsberichts.

	Erläut	Konsolidiert	
		30/06/2022 EUR	30/06/2021 EUR
<b>Erträge</b>			
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
<b>Gesamtsumme der Erträge</b>		<b>19,345,866</b>	<b>6,704,533</b>
<b>Ausgaben</b>			
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
<b>Gesamtsumme der Ausgaben</b>		<b>12,944,022</b>	<b>3,778,663</b>
<b>Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums (01/01/22)</b>		<b>1,772,647,601</b>	<b>633,188,017</b>
<b>Operativer Nettoertrag/(-verlust)</b>		<b>6,401,844</b>	<b>2,925,870</b>
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
<b>Realisierter Nettogewinn/(-verlust)</b>		<b>50,176,543</b>	<b>20,911,592</b>
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
<b>Veränderung des nicht realisierten Nettojahresgewinns/(-verlusts)</b>		<b>-115,678,699</b>	<b>6,501,342</b>
<b>Nettoanstieg/(-rückgang) des Nettovermögens durch das operative Geschäft</b>		<b>-59,100,312</b>	<b>30,338,804</b>
Nettozeichnungen/(-rücknahmen)		33,361,037	-24,640,554
Dividendenausschüttungen	17	-20,451	-1,617
<b>Neubewertung des konsolidierten Nettovermögens</b>		<b>15,289,841</b>	<b>-</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Zeitraums</b>		<b>1,775,501,481</b>	<b>638,884,650</b>

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 Auflagedatum 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
<b>Gesamt:</b>				<b>-2,696,989.83</b>

### 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
<b>Gesamt:</b>				<b>-161,070.00</b>

### 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
<b>Gesamt:</b>				<b>-144,190.00</b>

### 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
<b>Gesamt:</b>				<b>39,270.00</b>

## 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
	<b>Gesamt:</b>	<b>158,408,324.91</b>
Verkaufte Devisen	CZK	3,286.80
	EUR	2,258,432.10
	GBP	24,445,669.95
	USD	132,471,901.93
	<b>Gesamt:</b>	<b>159,179,290.78</b>
<b>Nicht realisiert gesamt:</b>		<b>-770,965.87</b>

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
	<b>Gesamt:</b>	<b>70.58</b>
Verkaufte Devisen	CZK	70.70
	<b>Gesamt:</b>	<b>70.70</b>
<b>Nicht realisiert gesamt:</b>		<b>-0.12</b>

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
	<b>Gesamt:</b>	<b>63.95</b>
Verkaufte Devisen	CZK	64.06
	<b>Gesamt:</b>	<b>64.06</b>
<b>Nicht realisiert gesamt:</b>		<b>-0.11</b>

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
	<b>Gesamt:</b>	<b>4,886,068.25</b>
Verkaufte Devisen	USD	4,950,000.00
	<b>Gesamt:</b>	<b>4,950,000.00</b>
<b>Nicht realisiert gesamt:</b>		<b>-63,931.75</b>

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
	<b>Gesamt:</b>	<b>43,435,025.13</b>
Verkaufte Devisen	CHF	30,660.04
	EUR	32,745,418.45
	USD	10,095,411.76
	<b>Gesamt:</b>	<b>42,871,490.25</b>
<b>Nicht realisiert gesamt:</b>		<b>563,534.88</b>

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
<b>Total:</b>							<b>-384,579.93</b>

#### ■ 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
<b>Total:</b>							<b>-547,584.81</b>

#### ■ 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
<b>Total:</b>							<b>-20,238,237.31</b>

### 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%	-

<b>Amundi S.F.</b>	<b>Währung</b>	<b>Isin</b>	<b>Anteilklassen</b>	<b>TER%</b>	<b>Performance Gebühr%</b>
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%	-
	EUR	LU0433266516	Klasse I keine Ausschüttung	0,52%	-
SBI FM India Bond	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%
	USD	LU2251233065	Klasse I2 keine Ausschüttung	1,02%	-
European Equity Optimal Volatility	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	LU1920533152	Klasse R keine Ausschüttung	0,96%	-
EUR Commodities	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 <sup>(1)</sup>	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 <sup>(2)</sup>	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 <sup>(3)</sup>
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	-	-	-	-	-	-

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

<sup>(2)</sup> 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.

<sup>(3)</sup> 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](http://www.amundi.lu/amundi-funds)