
Halbjahresbericht
30. Juni 2021 (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 01.01.2021 bis zum 30.06.2021

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	6
Portfolioangaben zum 30.06.2021:	
Anleiheiteifonds	
Amundi S.F. - Euro Curve 1-3year	8
Amundi S.F. - Euro Curve 3-5year	9
Amundi S.F. - Euro Curve 7-10year	10
Amundi S.F. - Euro Curve 10+year	11
Amundi S.F. - SBI FM India Bond	12
Aktienteifonds	
Amundi S.F. - European Equity Market Plus	13
Amundi S.F. - European Equity Optimal Volatility	17
Amundi S.F. - European Research	18
Commodities-Teilfonds	
Amundi S.F. - EUR Commodities	19
Konten:	
Nettovermögensaufstellung	20
Statistische Aufstellung zu den Einheiten	25
Aufwands- und Ertragsrechnung für das Nettovermögen	28
Anmerkungen zum Geschäftsbericht zum 30.06.2021	33
1 Einleitung	33
2 Grundsätze der Rechnungslegung	33
3 Verwendete Wechselkurse zum 30. Juni 2021	34
4 Management-, Anlageverwaltungs- und Vertriebsgebühren	35
5 Performancegebühr	35
6 Depot- und Zahlstelle, Verwaltungs-, Register- und Transferstelle	36
7 Besteuerung des Fonds - <i>Taxe d'abonnement</i>	36
8 Offene Positionen aus Termingeschäften	37
9 Offene Positionen aus Devisenterminkontrakten	39
10 Sonstige Erträge	39
11 Sonstige Ausgaben	39
12 Kontoauszug der Portfoliobewegungen	39
13 Dividenden	39
14 Optionen	40
15 Swapgeschäfte	41
16 Sicherheiten	42
17 Transaktionskosten	42
18 Richtlinie für Vertretungsstimmrechte	42
19 Sammelklagen	42
Zusätzliche Informationen über den Vertreter und den Vertrieb des Fonds in und/oder aus der Schweiz	43
Zusätzliche Informationen	45

**VERWALTUNGSGESELLSCHAFT,
DOMIZIL- UND VERTRIEBSSTELLE**

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

**VERWALTUNGSRAT DER
VERWALTUNGSGESELLSCHAFT**

Vorsitzender

David Joseph HARTE

Deputy Head der Abteilung Operations, Services and Technology, 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 unabhängiges Verwaltungsratsmitglied,
Arendt & Medernach S.A.,
in Luxemburg ansässig

Christian PELLIS

Chief Executive Officer,
Amundi Deutschland GmbH,
in Deutschland ansässig

Enrico TURCHI

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

François VEVERKA *(bis 3. Mai 2021)*

Independent Director,
in Frankreich ansässig

Pascal BIVILLE *(seit 3. Mai 2021)*

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,
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

**VERWALTUNGS-, REGISTER-
UND TRANSFERSTELLE**

Société Générale Luxembourg
(Operatives Zentrum)
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 Ireland Limited
1, George's Quay Plaza
George's Quay
Dublin 2
Irland

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

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

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

Amundi Asset Management
90, Boulevard Pasteur
75015 Paris
Frankreich

Amundi Pioneer Asset Management, Inc.
60, State Street
Boston, MA 02109-1820
USA

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

**WIRTSCHAFTSPRÜFER /
CABINET DE RÉVISION AGRÉÉ**

Deloitte Audit, *Société à responsabilité limitée (bis 14. April 2021)*
20, Boulevard de Kockelscheuer
L-1821 Luxembourg
Großherzogtum Luxemburg

PricewaterhouseCoopers, *Genossenschaft (seit 15. April 2021)*
2, rue Gerhard Mercator
B.P. 1443, L-1014 Luxembourg
Großherzogtum Luxemburg

RECHTSBERATER

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

Wertpapierbestand zum 30.06.2021

Anzahl Nennwert	Marktwert	% des NIW	Anzahl Nennwert	Marktwert	% des NIW
	EUR			EUR	
Positive Positionen	19,318,160	96.29			
Übertragbare und amtlich notierte Wertpapiere und/oder auf anderen Märkten gehandelte Wertpapiere	18,887,750	94.14			
Anleihen	18,887,750	94.14			
<i>Belgien</i>	152,954	0.76			
150,000 EUROPEAN UNION 0% 06/07/2026	152,954	0.76			
<i>Deutschland</i>	2,280,127	11.36			
1,210,000 FEDERAL REPUBLIC OF GERMANY 0% 15/08/2030	1,243,481	6.19			
1,020,000 GERMANY BUND 0% 13/10/2023	1,036,646	5.17			
<i>Frankreich</i>	4,083,146	20.35			
350,000 FRANCE OAT 0% 25/02/2022	351,540	1.75			
953,000 FRANCE OAT 0% 25/03/2023	963,692	4.80			
758,000 FRANCE OAT 0% 25/05/2022	762,419	3.80			
1,000,000 FRANCE OAT 1.75% 25/05/2023	1,045,810	5.22			
924,000 FRANCE OAT 2.25% 25/10/2022	959,685	4.78			
<i>Irland</i>	604,167	3.01			
150,000 IRELAND 0.80% 15/03/2022	151,512	0.76			
420,000 IRELAND 3.90% 20/03/2023	452,655	2.25			
<i>Italien</i>	5,998,627	29.91			
1,020,000 ITALY BTP 0% 15/04/2024	1,025,773	5.12			
424,000 ITALY BTP 0.05% 15/01/2023	427,027	2.13			
313,000 ITALY BTP 0.60% 15/06/2023	318,963	1.59			
418,000 ITALY BTP 0.90% 01/08/2022	424,078	2.11			
461,000 ITALY BTP 0.95% 01/03/2023	471,331	2.35			
400,000 ITALY BTP 0.95% 15/03/2023	409,124	2.04			
690,000 ITALY BTP 1.00% 15/07/2022	700,405	3.49			
470,000 ITALY BTP 1.45% 15/09/2022	480,622	2.40			
462,000 ITALY BTP 4.50% 01/05/2023	503,557	2.51			
641,000 ITALY BTP 5.50% 01/09/2022	685,376	3.42			
512,000 ITALY BTP 5.50% 01/11/2022	552,371	2.75			
<i>Niederlande</i>	616,325	3.07			
294,000 NETHERLANDS 0% 15/01/2022	295,064	1.47			
99,000 NETHERLANDS 3.75% 15/01/2023	105,876	0.53			
191,000 NETHERLANDS 7.50% 15/01/2023	215,385	1.07			
<i>Österreich</i>	1,013,372	5.05			
115,000 AUSTRIA 0% 20/04/2023	116,351	0.58			
180,000 AUSTRIA 0% 20/04/2025	183,683	0.92			
186,000 AUSTRIA 0% 20/09/2022	187,536	0.93			
243,000 AUSTRIA 3.40% 22/11/2022	256,798	1.28			
260,000 AUSTRIA 3.65% 20/04/2022	269,004	1.34			
<i>Portugal</i>	877,480	4.37			
846,000 PORTUGAL 2.20% 17/10/2022	877,480	4.37			
<i>Spanien</i>	3,261,552	16.26			
340,000 SPAIN 0% 30/04/2023	343,203	1.71			
1,010,000 SPAIN 0% 31/05/2024	1,022,201	5.10			
			Aktien/Anteile aus OGAW/OGA	430,410	2.15
			Aktien/Anteile aus Investmentfonds	430,410	2.15
			<i>Frankreich</i>	430,410	2.15
			0.412 AMUNDI EURO LIQUIDITY RATED SRI	430,410	2.15
			Gesamtwertpapierbestand	19,318,160	96.29

Die beigegeführten Anmerkungen sind integraler Bestandteil dieses Geschäftsberichts.

Wertpapierbestand zum 30.06.2021

Anzahl Nennwert	Marktwert	% des NIW	Anzahl Nennwert	Marktwert	% des NIW
	EUR			EUR	
Positive Positionen	46,037,635	96.64	Aktien/Anteile aus OGAW/OGA	1,025,881	2.15
Übertragbare und amtlich notierte Wertpapiere und/oder auf anderen Märkten gehandelte Wertpapiere	45,011,754	94.49	Aktien/Anteile aus Investmentfonds	1,025,881	2.15
Anleihen	45,011,754	94.49	<i>Frankreich</i>	<i>1,025,881</i>	<i>2.15</i>
<i>Belgien</i>	<i>3,153,390</i>	<i>6.62</i>	0.982 AMUNDI EURO LIQUIDITY RATED SRI	1,025,881	2.15
1,200,000 BELGIUM 0.50% 22/10/2024	1,244,844	2.62	Gesamtwertpapierbestand	46,037,635	96.64
1,000,000 BELGIUM 0.80% 22/06/2025	1,054,300	2.21			
470,000 BELGIUM 2.25% 22/06/2023	497,354	1.04			
350,000 EUROPEAN UNION 0% 06/07/2026	356,892	0.75			
<i>Deutschland</i>	<i>801,472</i>	<i>1.68</i>			
782,000 GERMANY BUND 0% 11/04/2025	801,472	1.68			
<i>Finnland</i>	<i>750,811</i>	<i>1.58</i>			
740,000 FINLAND 0% 15/09/2023	750,811	1.58			
<i>Frankreich</i>	<i>10,201,253</i>	<i>21.41</i>			
4,700,000 FRANCE OAT 0% 25/03/2025	4,793,624	10.06			
2,300,000 FRANCE OAT 0.50% 25/05/2025	2,392,529	5.02			
1,800,000 FRANCE OAT 1.00% 25/05/2027	1,942,128	4.08			
990,000 FRANCE OAT 2.25% 25/05/2024	1,072,972	2.25			
<i>Irland</i>	<i>600,122</i>	<i>1.26</i>			
492,000 IRELAND 5.40% 13/03/2025	600,122	1.26			
<i>Italien</i>	<i>13,111,022</i>	<i>27.52</i>			
4,090,000 ITALY BTP 0% 15/04/2024	4,113,149	8.63			
1,200,000 ITALY BTP 0.35% 01/02/2025	1,219,716	2.56			
700,000 ITALY BTP 0.95% 01/12/2031	706,195	1.48			
4,368,000 ITALY BTP 1.85% 01/07/2025	4,696,822	9.86			
2,000,000 ITALY BTP 5.00% 01/03/2025	2,375,140	4.99			
<i>Niederlande</i>	<i>1,889,982</i>	<i>3.97</i>			
900,000 NETHERLANDS 0% 15/01/2024	916,101	1.92			
900,000 NETHERLANDS 2.00% 15/07/2024	973,881	2.05			
<i>Österreich</i>	<i>2,118,286</i>	<i>4.45</i>			
790,000 AUSTRIA 0% 20/04/2025	806,163	1.69			
1,220,000 AUSTRIA 1.65% 21/10/2024	1,312,123	2.76			
<i>Portugal</i>	<i>1,013,420</i>	<i>2.13</i>			
870,000 PORTUGAL 5.65% 15/02/2024	1,013,420	2.13			
<i>Spanien</i>	<i>11,371,996</i>	<i>23.87</i>			
2,390,000 SPAIN 0% 31/05/2024	2,418,871	5.08			
2,795,000 SPAIN 0.25% 30/07/2024	2,853,975	5.99			
1,200,000 SPAIN 1.60% 30/04/2025	1,291,512	2.71			
1,640,000 SPAIN 4.65% 30/07/2025	1,978,135	4.15			
2,488,000 SPAIN 4.80% 31/01/2024	2,829,503	5.94			

Die beigegeführten Anmerkungen sind integraler Bestandteil dieses Geschäftsberichts.

Wertpapierbestand zum 30.06.2021

Anzahl Nennwert	Marktwert	% des NIW	Anzahl Nennwert	Marktwert	% des NIW
	EUR			EUR	
Positive Positionen	101,201,887	93.97			
Übertragbare und amtlich notierte Wertpapiere und/oder auf anderen Märkten gehandelte Wertpapiere	98,925,804	91.86			
Anleihen	98,925,804	91.86			
<i>Belgien</i>	4,079,246	3.79			
2,650,000 BELGIUM 0% 22/10/2031	2,622,705	2.44			
570,000 BELGIUM 5.50% 28/03/2028	798,279	0.74			
650,000 EUROPEAN UNION 0.70% 30/06/2051	658,262	0.61			
<i>Deutschland</i>	18,980,777	17.62			
8,788,000 FEDERAL REPUBLIC OF GERMANY 0% 15/08/2030	9,031,164	8.39			
9,358,000 GERMANY BUND 0.50% 15/08/2027	9,949,613	9.23			
<i>Finnland</i>	1,864,689	1.73			
560,000 FINLAND 0.50% 15/09/2028	591,685	0.55			
610,000 FINLAND 0.50% 15/09/2029	644,263	0.60			
516,000 FINLAND 2.75% 04/07/2028	628,741	0.58			
<i>Frankreich</i>	11,916,896	11.07			
2,342,000 FRANCE OAT 0% 25/11/2029	2,355,537	2.19			
3,740,000 FRANCE OAT 0.75% 25/11/2028	3,999,369	3.71			
1,350,000 FRANCE OAT 1.00% 25/05/2027	1,456,596	1.35			
2,838,000 FRANCE OAT 5.50% 25/04/2029	4,105,394	3.82			
<i>Irland</i>	2,517,627	2.34			
650,000 IRELAND 0.20% 18/10/2030	658,275	0.61			
1,730,000 IRELAND 0.90% 15/05/2028	1,859,352	1.73			
<i>Italien</i>	22,336,501	20.74			
5,440,000 ITALY BTP 0% 15/04/2024	5,470,789	5.08			
3,150,000 ITALY BTP 0.95% 01/12/2031	3,177,878	2.95			
3,726,000 ITALY BTP 1.35% 01/04/2030	3,947,809	3.67			
1,850,000 ITALY BTP 3.00% 01/08/2029	2,206,292	2.05			
1,693,000 ITALY BTP 3.50% 01/03/2030	2,102,723	1.95			
1,320,000 ITALY BTP 5.25% 01/11/2029	1,822,471	1.69			
2,603,000 ITALY BTP 6.50% 01/11/2027	3,608,539	3.35			
<i>Lettland</i>	710,712	0.66			
720,000 LATVIA 0% 17/03/2031	710,712	0.66			
<i>Niederlande</i>	4,093,272	3.80			
1,990,000 NETHERLANDS 0.75% 15/07/2028	2,146,096	1.99			
1,400,000 NETHERLANDS 5.50% 15/01/2028	1,947,176	1.81			
<i>Österreich</i>	3,054,789	2.84			
1,240,000 AUSTRIA 0.50% 20/02/2029	1,306,315	1.21			
320,000 AUSTRIA 0.75% 20/02/2028	342,464	0.32			
1,000,000 AUSTRIA 6.25% 15/07/2027	1,406,010	1.31			
<i>Portugal</i>	3,950,669	3.67			
1,420,000 PORTUGAL 0.475% 18/10/2030	1,448,187	1.34			
550,000 PORTUGAL 0.70% 15/10/2027	578,776	0.54			
1,459,000 PORTUGAL 3.875% 15/02/2030	1,923,706	1.79			
			<i>Spanien</i>	25,420,626	23.60
			5,410,000 SPAIN 0% 31/05/2024	5,475,353	5.08
			1,200,000 SPAIN 1.25% 31/10/2030	1,300,032	1.21
			1,059,000 SPAIN 1.40% 30/07/2028	1,159,467	1.08
			13,640,000 SPAIN 1.45% 30/04/2029	15,017,776	13.94
			1,800,000 SPAIN 5.15% 31/10/2028	2,467,998	2.29
			Aktien/Anteile aus OGAW/OGA	2,276,083	2.11
			Aktien/Anteile aus Investmentfonds	2,276,083	2.11
			<i>Frankreich</i>	2,276,083	2.11
			2 AMUNDI EURO LIQUIDITY RATED SRI	2,275,325	2.11
			0.041 AMUNDI TRESO COURT TERME PART I C	758	0.00
			Gesamtwertpapierbestand	101,201,887	93.97

Die beigegeführten Anmerkungen sind integraler Bestandteil dieses Geschäftsberichts.

Wertpapierbestand zum 30.06.2021

Anzahl Nennwert	Marktwert EUR	% des NIW	Anzahl Nennwert	Marktwert EUR	% des NIW
Positive Positionen	65,312,217	94.42			
Übertragbare und amtlich notierte Wertpapiere und/oder auf anderen Märkten gehandelte Wertpapiere	63,632,363	91.99			
Anleihen	63,632,363	91.99			
<i>Belgien</i>	<i>6,142,761</i>	<i>8.88</i>			
530,000 BELGIUM 0.40% 22/06/2040	510,347	0.74			
350,000 BELGIUM 0.65% 22/06/2071	291,540	0.42			
20,000 BELGIUM 1.60% 22/06/2047	23,634	0.03			
360,000 BELGIUM 1.70% 22/06/2050	435,276	0.63			
300,000 BELGIUM 1.90% 22/06/2038	368,979	0.53			
138,000 BELGIUM 2.15% 22/06/2066	193,269	0.28			
220,000 BELGIUM 2.25% 22/06/2057	306,863	0.44			
120,000 BELGIUM 3.75% 22/06/2045	199,564	0.29			
760,000 BELGIUM 4.25% 28/03/2041	1,277,050	1.85			
1,300,000 BELGIUM 5.00% 28/03/2035	2,131,155	3.08			
400,000 EUROPEAN UNION 0.70% 30/06/2051	405,084	0.59			
<i>Deutschland</i>	<i>10,548,659</i>	<i>15.25</i>			
841,000 GERMANY BUND 2.50% 04/07/2044	1,290,758	1.87			
2,398,000 GERMANY BUND 3.25% 04/07/2042	3,974,661	5.75			
3,032,000 GERMANY BUND 4.00% 04/01/2037	4,940,857	7.14			
370,000 STATE OF NORTH RHINE WESTPHALIA 0.95% 10/01/2121	342,383	0.49			
<i>Finnland</i>	<i>1,266,444</i>	<i>1.83</i>			
620,000 FINLAND 0.75% 15/04/2031	668,217	0.97			
390,000 FINLAND 1.125% 15/04/2034	438,212	0.63			
110,000 FINLAND 2.625% 04/07/2042	160,015	0.23			
<i>Frankreich</i>	<i>12,494,781</i>	<i>18.06</i>			
1,800,000 FRANCE OAT 0.50% 25/05/2040	1,764,558	2.55			
100,000 FRANCE OAT 0.50% 25/06/2044	95,565	0.14			
660,000 FRANCE OAT 0.75% 25/05/2052	631,066	0.91			
591,000 FRANCE OAT 1.25% 25/05/2034	662,204	0.96			
1,720,000 FRANCE OAT 1.25% 25/05/2036	1,927,053	2.79			
644,000 FRANCE OAT 1.50% 25/05/2050	748,598	1.08			
870,000 FRANCE OAT 1.75% 25/05/2066	1,096,296	1.58			
1,200,000 FRANCE OAT 1.75% 25/06/2039	1,457,124	2.11			
343,000 FRANCE OAT 2.00% 25/05/2048	441,767	0.64			
590,000 FRANCE OAT 4.00% 25/04/2055	1,118,392	1.62			
760,000 FRANCE OAT 4.00% 25/04/2060	1,504,283	2.17			
660,000 FRANCE OAT 4.00% 25/10/2038	1,047,875	1.51			
<i>Irland</i>	<i>1,262,401</i>	<i>1.83</i>			
400,000 IRELAND 1.50% 15/05/2050	465,456	0.67			
670,000 IRELAND 1.70% 15/05/2037	796,945	1.16			
<i>Italien</i>	<i>11,951,671</i>	<i>17.28</i>			
3,450,000 ITALY BTP 0% 15/04/2024	3,469,527	5.03			
280,000 ITALY BTP 2.45% 01/09/2050	320,841	0.46			
247,000 ITALY BTP 3.10% 01/03/2040	312,742	0.45			
1,231,000 ITALY BTP 3.45% 01/03/2048	1,677,077	2.42			
			1,320,000 ITALY BTP 3.85% 01/09/2049	1,925,774	2.78
			1,478,000 ITALY BTP 4.75% 01/09/2044	2,366,633	3.42
			1,183,000 ITALY BTP 5.00% 01/09/2040	1,879,077	2.72
			<i>Kanada</i>	<i>1,799,621</i>	<i>2.60</i>
			2,550,000 CANADA 2.00% 01/12/2051	1,799,621	2.60
			<i>Lettland</i>	<i>167,807</i>	<i>0.24</i>
			170,000 LATVIA 0% 17/03/2031	167,807	0.24
			<i>Niederlande</i>	<i>3,960,572</i>	<i>5.73</i>
			200,000 NETHERLANDS 0.50% 15/01/2040	211,122	0.31
			690,000 NETHERLANDS 2.50% 15/01/2033	894,661	1.29
			905,000 NETHERLANDS 2.75% 15/01/2047	1,461,729	2.12
			400,000 NETHERLANDS 3.75% 15/01/2042	686,856	0.99
			440,000 NETHERLANDS 4.00% 15/01/2037	706,204	1.02
			<i>Österreich</i>	<i>2,658,148</i>	<i>3.84</i>
			149,000 AUSTRIA 0.85% 30/06/2120	137,052	0.20
			147,000 AUSTRIA 2.10% 20/09/2117	243,761	0.35
			517,000 AUSTRIA 3.15% 20/06/2044	821,358	1.19
			271,000 AUSTRIA 3.80% 26/01/2062	564,577	0.82
			557,000 AUSTRIA 4.15% 15/03/2037	891,400	1.28
			<i>Portugal</i>	<i>1,133,531</i>	<i>1.64</i>
			300,000 PORTUGAL 0.475% 18/10/2030	305,955	0.44
			159,000 PORTUGAL 0.90% 12/10/2035	163,326	0.24
			410,000 PORTUGAL 4.10% 15/02/2045	664,250	0.96
			<i>Spanien</i>	<i>10,245,967</i>	<i>14.81</i>
			853,000 KINGDOM OF SPAIN 0.50% 31/10/2031	854,970	1.24
			310,000 KINGDOM OF SPAIN 2.70% 31/10/2048	407,120	0.59
			1,257,000 SPAIN 0.10% 30/04/2031	1,219,391	1.76
			1,320,000 SPAIN 1.00% 31/10/2050	1,194,019	1.73
			550,000 SPAIN 1.20% 31/10/2040	558,745	0.81
			470,000 SPAIN 1.85% 30/07/2035	537,337	0.78
			660,000 SPAIN 2.90% 31/10/2046	891,898	1.29
			541,000 SPAIN 4.20% 31/01/2037	808,508	1.17
			768,000 SPAIN 4.70% 30/07/2041	1,270,172	1.83
			900,000 SPAIN 4.90% 30/07/2040	1,509,588	2.17
			550,000 SPAIN 5.15% 31/10/2044	994,219	1.44
			Aktien/Anteile aus OGAW/OGA	1,679,854	2.43
			Aktien/Anteile aus Investmentfonds	1,679,854	2.43
			<i>Frankreich</i>	<i>1,679,854</i>	<i>2.43</i>
			2 AMUNDI EURO LIQUIDITY RATED SRI	1,679,854	2.43
			Gesamtwertpapierbestand	65,312,217	94.42

Die beigegeführten Anmerkungen sind integraler Bestandteil dieses Geschäftsberichts.

Wertpapierbestand zum 30.06.2021

Anzahl Nennwert	Marktwert	% des NIW
	USD	
Positive Positionen	20,539,580	82.11
Übertragbare und amtlich notierte Wertpapiere und/oder auf anderen Märkten gehandelte Wertpapiere	20,539,580	82.11
Anleihen	20,539,580	82.11
<i>Behörden</i>	<i>18,899,375</i>	<i>75.55</i>
68,000,000 INDIA 5.15% 09/11/2025	898,015	3.59
52,000,000 INDIA 5.22% 15/06/2025	690,780	2.76
68,000,000 INDIA 5.63% 12/04/2026	912,305	3.65
37,000,000 INDIA 5.77% 03/08/2030	481,852	1.93
47,000,000 INDIA 5.79% 11/05/2030	612,329	2.45
37,000,000 INDIA 5.85% 01/12/2030	491,327	1.96
76,000,000 INDIA 6.19% 16/09/2034	975,734	3.90
76,000,000 INDIA 6.22% 16/03/2035	975,908	3.90
120,000,000 INDIA 6.64% 16/06/2035	1,604,404	6.40
38,000,000 INDIA 6.67% 17/12/2050	485,302	1.94
46,000,000 INDIA 6.68% 17/09/2031	627,675	2.51
35,000,000 INDIA 6.79% 15/05/2027	486,533	1.95
68,000,000 INDIA 6.79% 26/12/2029	936,589	3.74
86,000,000 INDIA 7.17% 08/01/2028	1,212,672	4.85
68,000,000 INDIA 7.26% 14/01/2029	965,306	3.86
25,500,000 INDIA 7.27% 08/04/2026	363,069	1.45
51,000,000 INDIA 7.57% 17/06/2033	738,435	2.95
67,000,000 INDIA 7.59% 11/01/2026	962,275	3.85
42,000,000 INDIA 7.59% 20/03/2029	605,147	2.42
42,000,000 INDIA 7.61% 09/05/2030	608,519	2.43
39,000,000 INDIA 7.72% 25/05/2025	563,719	2.25
34,000,000 INDIA 7.73% 19/12/2034	497,507	1.99
67,000,000 INDIA 8.15% 24/11/2026	987,177	3.95
48,000,000 INDIA 8.24% 10/11/2033	732,074	2.93
32,000,000 REPUBLIC OF INDIA 8.60% 02/06/2028	484,722	1.94
<i>Investmentbanking und Maklerdienste</i>	<i>1,640,205</i>	<i>6.56</i>
900,000 MUTHOOT FINANCE 4.40% REGS 02/09/2023	928,395	3.71
600,000 POWER FINANCE CORPORATION 6.15% 06/12/2028	711,810	2.85
Gesamtwertpapierbestand	20,539,580	82.11

Die beigegeführten Anmerkungen sind integraler Bestandteil dieses Geschäftsberichts.

Wertpapierbestand zum 30.06.2021

Anzahl Nennwert	Marktwert	% des NIW	Anzahl Nennwert	Marktwert	% des NIW
	EUR			EUR	
Positive Positionen	113,817,646	99.39	6,871 INFINEON TECHNOLOGIES AG-NOM	232,377	0.20
Übertragbare und amtlich notierte Wertpapiere und/oder auf anderen Märkten gehandelte Wertpapiere	113,206,592	98.86	1,239 KION GROUP	111,361	0.10
Aktien	113,197,824	98.85	1,402 KNORR BREMSE AG	135,994	0.12
<i>Belgien</i>	<i>2,406,623</i>	<i>2.10</i>	289 MERCK KGAA	46,731	0.04
5,519 AGEAS NV	258,289	0.23	879 MTU AERO ENGINES HLDG AG	183,623	0.16
11,414 ANHEUSER BUSCH INBEV SA/NV	694,086	0.60	1,154 MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS AG-NOM	266,516	0.23
6,624 GROUPE BRUXELLES LAMBERT	624,908	0.55	7,271 PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	657,008	0.57
2,732 KBC GROUPE	175,668	0.15	3,883 PUMA AG	390,436	0.34
11,871 PROXIMUS	193,379	0.17	10,987 RWE AG	335,763	0.29
2,131 SOLVAY	228,443	0.20	12,432 SAP SE	1,477,418	1.29
6,102 TELENET GROUP HOLDING	193,677	0.17	1,144 SARTORIUS VZ PFD	502,216	0.44
433 UCB SA	38,173	0.03	8,057 SIEMENS AG-NOM	1,076,576	0.94
<i>Dänemark</i>	<i>4,563,138</i>	<i>3.98</i>	3,575 SIEMENS ENERGY AG	90,877	0.08
198 A.P. MOELLER-MAERSK B	479,939	0.42	268 SYMRISE	31,490	0.03
2,413 CARLSBERG B	379,331	0.33	9,266 TEAMVIEWER AG	293,918	0.26
3,760 COLOPLAST B	520,295	0.45	148,726 TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	330,915	0.29
1,232 DSV PANALPINA A/S	242,300	0.21	2,346 UNIPER SE	72,867	0.06
353 GENMAB	121,808	0.11	224 VOLKSWAGEN AG	62,003	0.05
25,094 NOVO NORDISK	1,772,988	1.54	1,185 VOLKSWAGEN AG PFD	250,272	0.22
680 NOVOZYMES AS-B	43,226	0.04	4,362 VONOVIA SE NAMEN AKT REIT	237,816	0.21
1,493 ORSTED SH	176,680	0.15	2,872 ZALANDO	292,800	0.26
3,085 PANDORA AB	349,727	0.31	<i>Finnland</i>	<i>2,003,080</i>	<i>1.75</i>
14,485 VESTAS WIND SYSTEM A/S	476,844	0.42	6,934 FORTUM OYJ	161,285	0.14
<i>Deutschland</i>	<i>16,023,806</i>	<i>13.99</i>	412 KONE B	28,346	0.02
761 1&1 DRILLISCH AKTIENGESELLCHAFT	19,634	0.02	21,669 METSO OUTOTEC OYI	212,270	0.19
2,163 ADIDAS NOM	678,966	0.59	6,697 NELES CORPORATION	81,436	0.07
3,694 ALLIANZ SE-NOM	776,848	0.68	3,383 NESTE CORPORATION	174,698	0.15
10,378 BASF SE	689,514	0.60	78,259 NOKIA OYJ	353,378	0.31
8,956 BAYER AG	458,637	0.40	1,062 NOKIAN RENKAAT OYJ	36,161	0.03
1,307 BAYERISCHE MOTORENWERKE	116,728	0.10	4,077 ORION NEW B	147,791	0.13
865 BEIERSDORF	88,014	0.08	6,364 STORA ENSO OYJ-R	97,910	0.09
2,128 BRENNTAG AG	166,878	0.15	15,629 UPM KYMMENE OYJ	498,564	0.44
2,310 CARL ZEISS MEDITEC	376,415	0.33	16,879 WARTSILA OYJ	211,241	0.18
50,213 COMMERZBANK	300,374	0.26	<i>France</i>	<i>18,437,812</i>	<i>16.11</i>
213 CONTINENTAL AG	26,408	0.02	781 ACCOR SA	24,594	0.02
7,709 COVESTRO AG	419,832	0.37	2,084 AIR LIQUIDE	307,723	0.27
5,731 DAIMLER	431,544	0.38	475 ARKEMA	50,255	0.04
721 DELIVERY HERO AG	80,319	0.07	2,591 ATOS SE	132,918	0.12
21,820 DEUTSCHE BANK AG-NOM	239,715	0.21	30,292 AXA	647,794	0.57
3,714 DEUTSCHE BOERSE AG	546,701	0.48	1,276 BIOMERIEUX SA	125,048	0.11
23,992 DEUTSCHE POST AG-NOM	1,376,181	1.20	24,321 BNP PARIBAS	1,285,850	1.13
22,670 DEUTSCHE TELEKOM AG-NOM	403,798	0.35	12,566 BOUYGUES	391,934	0.34
2,014 DEUTSCHE WOHNEN AG REIT	103,882	0.09	1,779 CAP GEMINI SE	288,198	0.25
15,159 E.ON SE	147,861	0.13	11,635 CNP ASSURANCES	166,962	0.15
18,630 EVONIK INDUSTRIES AG	526,856	0.46	9,534 COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN SA	529,518	0.46
1,104 FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	77,324	0.07	493 COVIVIO SA REIT	35,555	0.03
1,117 GEA GROUP AG	38,157	0.03	26,796 CREDIT AGRICOLE SA	316,568	0.28
6,690 HEIDELBERGCEMENT AG	483,955	0.42	10,601 DANONE SA	629,381	0.55
1,968 HENKEL KGAA VZ PFD	175,231	0.15	26 DASSAULT AVIATION	25,792	0.02
3,012 HOCHTIEF	195,057	0.17	432 DASSAULT SYSTEMES	88,344	0.08
			16,109 ELECTRICITE DE FRANCE SA	185,576	0.16

Die beigefügten Anmerkungen sind integraler Bestandteil dieses Geschäftsberichts.

Wertpapierbestand zum 30.06.2021

Anzahl Nennwert	Marktwert	% des NIW	Anzahl Nennwert	Marktwert	% des NIW		
	EUR			EUR			
7,351	ENGIE SA	84,933	0.07	2,966	NEXI SPA	54,901	0.05
2,241	ESSILOR LUXOTTICA SA	348,789	0.30	12,225	PIRELLI C SPA	59,854	0.05
965	FAURECIA	39,922	0.03	3,431	POSTE ITALIANE SPA	38,256	0.03
1,558	GECINA ACT	201,294	0.18	1,470	PRYSMIAN SPA	44,438	0.04
397	IMERYS SA	15,642	0.01	24,076	SNAM RETE GAS	117,371	0.10
316	IPSEN	27,720	0.02	277,091	TELECOM ITALIA SPA	116,073	0.10
668	KERING	492,316	0.43	14,630	UNICREDIT SPA	145,569	0.13
5,292	KLEPIERRE REITS	114,995	0.10	23,716	UNIPOLSAI AZ	58,057	0.05
4,127	LEGRAND	368,376	0.32		<i>Jersey Inseln</i>	940,517	0.82
3,570	L'OREAL SA	1,341,606	1.18	4,212	EXPERIAN PLC	136,696	0.12
2,946	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	1,948,189	1.71	5,698	FERGUSON PLC	667,073	0.58
3,211	MICHELIN (CGDE)-SA	431,880	0.38	12,050	WPP PLC	136,748	0.12
27,308	NATIXIS	109,232	0.10		<i>Luxemburg</i>	369,820	0.32
18,749	ORANGE	180,272	0.16	12,852	ARCELORMITTAL SA	332,224	0.29
2,392	PERNOD RICARD	447,782	0.39	390	EUROFINS SCIENTIFIC SE	37,596	0.03
4,206	PUBLICIS GROUPE	226,872	0.20		<i>Niederlande</i>	11,682,895	10.20
318	REMY COINTREAU	55,364	0.05	2,734	ABN AMRO GROUP N.V.	27,865	0.02
4,806	RENAULT SA	163,813	0.14	321	ADYEN BV	661,421	0.58
3,319	SAFRAN	388,057	0.34	74,997	AEGON NV	262,415	0.23
13,044	SANOFI	1,152,568	1.01	3,079	AIRBUS BR BEARER SHS	333,887	0.29
1,117	SARTORIUS STEDIM BIOTECH	445,571	0.39	2,660	AKZO NOBEL NV	277,172	0.24
9,665	SCHNEIDER ELECTRIC SA	1,282,352	1.12	579	ARGEN-X N V	147,703	0.13
20,949	SOCIETE GENERALE A	520,792	0.45	5,436	ASML HOLDING N.V.	3,149,617	2.75
1,973	SUEZ SA ACT	39,559	0.03	6,475	HEINEKEN NV	661,745	0.58
1,306	TELEPERFORMANCE SE	447,044	0.39	58,301	ING GROUP NV	649,473	0.57
1,038	THALES SA	89,310	0.08	2,167	JUST EAT TAKEAWAY COM N V	168,744	0.15
31,651	TOTAL ENERGIES SE	1,207,644	1.05	28,326	KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE	710,133	0.62
2,209	UBISOFT ENTERTAINMENT	130,419	0.11	4,469	KONINKLIJKE DSM NV	703,421	0.61
4,498	UNIBAIL RODAMCO SE REITS	328,309	0.29	9,327	KONINKLIJKE PHILIPS N.V.	389,775	0.34
4,115	VALEO SA	104,398	0.09	23,149	NN GROUP NV	920,867	0.80
2,149	VINCI SA	193,389	0.17	3,695	PROSUS N V	304,727	0.27
4,996	VIVENDI	141,537	0.12	1,154	QIAGEN NV	47,037	0.04
1,721	WORLDLINE	135,856	0.12	5,740	RANDSTAD HOLDING NV	370,230	0.32
	<i>Ireland</i>	1,278,980	1.12	56,785	STELLANTIS NV	939,224	0.82
6,815	BANK OF IRELAND GROUP PLC	30,783	0.03	14,074	STMICROELECTRONICS NV	430,735	0.38
5,544	DALATA HOTEL	21,261	0.02	6,217	WOLTERS KLUWER CVA	526,704	0.46
918	DCC PLC	63,285	0.06		<i>Norwegen</i>	1,009,269	0.88
2,701	FLUTTER ENTMT RG	412,443	0.35	2,748	ADEVINTA ASA RG REGISTERED SHS	44,432	0.04
1,742	KERRY GROUP A	205,208	0.18	6,228	EQUINOR ASA	111,184	0.10
2,644	KINGSPAN GROUP PLC	210,568	0.18	15,630	MOWI ASA	335,423	0.28
175	LINDE PLC	42,586	0.04	31,183	NORSK HYDRO ASA	167,880	0.15
6,401	SMURFIT KAPPA	292,846	0.26	30,494	ORKLA ASA	262,063	0.23
	<i>Isle of Man</i>	394,097	0.34	1,988	YARA INTERNATIONAL ASA	88,287	0.08
19,382	ENTAIN PLC	394,097	0.34		<i>Österreich</i>	278,085	0.24
	<i>Italien</i>	2,547,510	2.22	4,608	OMV AG	221,046	0.19
1,025	DIASORIN SPA	163,488	0.14	1,661	VOESTALPINE AG	57,039	0.05
153,975	ENEL SPA	1,205,931	1.05		<i>Portugal</i>	105,477	0.09
28,331	ENI SPA	290,959	0.25	11,525	GALP ENERGIA SGPS SA-B	105,477	0.09
9,434	LEONARDO AZIONE POST RAGGRUPPAMENTO	64,264	0.06				
13,717	MEDIOBANCA SPA	135,112	0.12				
933	MONCLER SPA	53,237	0.05				

Die beigegeführten Anmerkungen sind integraler Bestandteil dieses Geschäftsberichts.

Wertpapierbestand zum 30.06.2021

Anzahl Nennwert	Marktwert EUR	% des NIW	Anzahl Nennwert	Marktwert EUR	% des NIW
<i>Schweden</i>			1,209	ZURICH INSURANCE GROUP AG	409,397 0.36
	5,891,671	5.14	<i>Spanien</i>		
1,927	AB INDUSTRIVAERDEN C	59,509 0.05	2,282	ACS	51,550 0.05
7,723	ASSA ABLOY AB	196,311 0.17	2,938	AMADEUS IT GROUP SA	174,282 0.15
15,596	ATLAS COPCO B	691,994 0.61	167,086	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	873,527 0.75
6,262	BOLIDEN AB	203,135 0.18	153,013	BANCO SANTANDER SA	492,625 0.43
8,951	ELECTROLUX B	209,433 0.18	93,445	CAIXABANK	242,396 0.21
1,183	ELECTROLUX PROFESSIONAL AB	7,074 0.01	5,009	ENAGAS	97,600 0.09
21,477	EPIROC AB	355,656 0.31	13,388	ENDESA	273,918 0.24
3,056	EQT AB	93,590 0.08	56,406	IBERDROLA SA	579,854 0.50
36,079	ERICSSON LM-B SHS	382,632 0.33	15,035	INDITEX	446,690 0.39
11,368	ESSITY AB	318,107 0.28	49,209	MAFPRE SA	87,715 0.08
3,905	EVOLUTION AB	520,718 0.45	9,782	NATURGY ENERGY GROUP SA	212,074 0.19
15,015	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	300,537 0.26	10,037	RED ELECTRICA CORPORACION SA	157,129 0.14
4,760	HEXAGON AB	59,512 0.05	47,010	REPSOL	496,144 0.43
25,457	HUSQVARNA AB	285,394 0.25	2,318	SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY SA	65,275 0.06
3,891	ICA GRUPPEN AB	152,809 0.13	11,001	TELEFONICA SA	43,355 0.04
34,848	INVESTOR AB	677,753 0.59	<i>Vereinigtes Königreich</i>		
5,969	KINNEVIK AB	201,635 0.18		23,392,392	20.44
1,387	LUNDIN ENERGY AB	41,410 0.04	33,357	3I GROUP	455,795 0.40
5,244	NIBE INDUSTRIER AB B	46,546 0.04	147,623	ABRDN PLC	466,024 0.41
11,927	SANDVIK	257,074 0.22	5,844	ADMIRAL GROUP	214,032 0.19
5,587	SKANSKA AB-B SHS	125,049 0.11	1,892	ANGLO AMERICAN PLC	63,309 0.06
12,359	SKF AB-B SHS	265,532 0.23	2,300	ANTOFAGASTA PLC	38,461 0.03
1,852	SWEDBANK A SHS A	29,078 0.03	10,704	ASHTAD GROUP	668,836 0.58
10,913	TELE2 B	125,464 0.11	8,453	ASSOCIATED BRITISH FOODS	218,205 0.19
13,508	TELIA COMPANY SHS	50,585 0.04	16,731	ASTRAZENECA PLC	1,692,298 1.49
11,582	VOLVO AB-B SHS	235,134 0.21	1,131	AVEVA GROUP	48,853 0.04
<i>Schweiz</i>			56,761	AVIVA PLC	268,382 0.23
	17,578,518	15.36	188,132	BARCLAYS PLC	375,015 0.33
4,893	ABB LTD-NOM	140,112 0.12	17,105	BARRATT DEVELOPMENTS	138,522 0.12
835	ADECCO GROUP INC	47,882 0.04	2,990	BERKELEY GROUP HOLDINGS UNITS	160,045 0.14
5,643	ALCON INC	333,469 0.29	30,108	BHP GROUP PLC	747,045 0.65
17	BARRY CALLEBAUT N	33,342 0.03	146,783	BP PLC	538,606 0.47
5,225	CIE FINANCIERE RICHEMONT SA	533,606 0.47	19,595	BRITISH LAND CO REIT	112,966 0.10
9,717	COCA COLA HBC	295,885 0.26	54,700	BT GROUP PLC	123,616 0.11
503	COCA COLA HBC GBP	15,316 0.01	5,505	BUNZL	153,200 0.13
8,931	CREDIT SUISSE GROUP AG-NOM	78,963 0.07	5,997	BURBERRY GROUP	144,328 0.13
1,072	GEBERIT AG-NOM	678,679 0.59	8,084	COCA COLA EUROPEAN PARTNERS PLC	400,481 0.35
48	GIVAUDAN N	188,418 0.16	8,865	COMPASS GROUP PLC	157,173 0.14
8,724	HOLCIM LTD	441,691 0.39	616	CRODA INTERNATIONAL PLC	52,871 0.05
3,816	KUEHNE UND NAGEL INTERNATIONAL AG-NOM	1,102,122 0.96	22,277	DIAGEO	898,138 0.78
5,425	LOGITECH INTERNATIONAL NOM	554,773 0.48	81,304	DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC	269,924 0.24
1,136	LONZA GROUP AG N	679,610 0.59	36,944	EVRAZ PLC	254,771 0.22
38,766	NESTLE SA	4,074,639 3.57	45,360	GLAXOSMITHKLINE PLC	750,003 0.65
25,763	NOVARTIS AG-NOM	1,981,697 1.73	1,041	HALMA PLC	32,645 0.03
543	PARTNERS GROUP HOLDING N	694,230 0.61	1,718	HARGREAVES LANSDOWN	31,800 0.03
9,838	ROCHE HOLDING LTD	3,128,112 2.73	262,143	HSBC HOLDINGS PLC	1,274,300 1.11
120	SGS SA-NOM	312,425 0.27	24,229	INFORMA PLC	141,572 0.12
828	SIKA LTD	228,489 0.20	2,112	INTERTEK GROUP	136,052 0.12
1,282	SONOVA HOLDING AG	406,984 0.36	13,622	JD SPORTS FASHION PLC	145,828 0.13
77	STRAUMANN HOLDING (NAMEN)	103,608 0.09	1,802	JOHNSON MATTHEY PLC	64,506 0.06
5,792	SWISS RE AG	441,084 0.39	86,005	KINGFISHER	365,179 0.32
1,177	SWISSCOM N	567,133 0.50			
8,272	UBS GROUP INC NAMEN AKT	106,852 0.09			

Die beigegeführten Anmerkungen sind integraler Bestandteil dieses Geschäftsberichts.

Wertpapierbestand zum 30.06.2021

Anzahl Nennwert	Marktwert	% des NIW	Anzahl Nennwert	Marktwert	% des NIW	
	EUR			EUR		
23,374	LAND SECURITIES GROUP PLC R E I T	183,899	0.16	Gesamtwertpapierbestand	113,817,646	99.39
109,926	LEGAL & GENERAL GROUP	329,861	0.29			
753,661	LLOYDS BANKING GROUP PLC	409,907	0.36			
12,848	MEGGITT PLC	69,026	0.06			
94,015	MELROSE INDUSTRIES SHS	169,861	0.15			
60,374	M&G PLC	160,983	0.14			
20,214	MONDI PLC	447,630	0.39			
47,505	NATIONAL GRID PLC	509,553	0.44			
80,565	NATWEST GROUP PLC	190,702	0.17			
578	NEXT PLC	52,895	0.05			
4,623	NINETY ONE PLC	11,858	0.01			
5,798	OCADO GROUP	135,283	0.12			
8,208	PEARSON	79,360	0.07			
7,214	PERSIMMON PLC	248,576	0.22			
14,378	QUILTER PLC	24,914	0.02			
5,577	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	415,587	0.36			
6,829	RELX PLC	153,516	0.13			
1,367	RELX PLC	30,558	0.03			
6,307	RENTOKIL INITIAL	36,367	0.03			
19,740	RIO TINTO PLC	1,367,969	1.19			
72,667	ROYAL DUTCH SHELL A SHARES	1,224,703	1.07			
18,291	ROYAL DUTCH SHELL B SHARES	298,085	0.26			
13,260	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A	225,473	0.20			
50,655	SAGE GRP	403,729	0.35			
91,762	SAINSBURY(J)	290,534	0.25			
3,913	SCHRODERS LTD	160,130	0.14			
23,099	SEGRO PLC REIT	294,506	0.26			
14,457	SMITH & NEPHEW	263,138	0.23			
6,233	SMITHS GROUP	115,446	0.10			
1,248	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	197,933	0.17			
14,313	SSE PLC	250,179	0.22			
66,098	STANDARD CHARTERED	354,956	0.31			
29,093	TATE & LYLE PLC	250,245	0.22			
65,684	TAYLOR WINPEY PLC	121,620	0.11			
12,738	UNILEVER	627,737	0.55			
18,849	UNILEVER PLC	930,481	0.81			
5,338	UNITED UTILITIES GROUP PLC	60,590	0.05			
489,446	VODAFONE GROUP	691,821	0.60			
	Warrants, Rechte	8,768	0.01			
	<i>Schweiz</i>	6,075	0.01			
10,742	COMPAGNIE FINANCIERE RICHEMONT SA WARRANT 22/11/2023	6,075	0.01			
8,931	CREDIT SUISSE GROUP AG 06/05/2021	-	0.00			
	<i>Spanien</i>	2,693	0.00			
2,282	ACS DE CONSTRUCCION Y SERVICIOS SA RGT 06/07/2021	2,693	0.00			
	Aktien/Anteile aus OGAW/OGA	611,054	0.53			
	Aktien/Anteile aus Investmentfonds	611,054	0.53			
	<i>Luxemburg</i>	611,054	0.53			
636	AMUNDI FUNDS ABSOLUTE RETURN FOREX X EUR (C)	611,054	0.53			

Die beigefügten Anmerkungen sind integraler Bestandteil dieses Geschäftsberichts.

Wertpapierbestand zum 30.06.2021

Anzahl Nennwert	Marktwert	% des NIW	Anzahl Nennwert	Marktwert	% des NIW
	EUR			EUR	
Positive Positionen	57,648,102	93.74	18,050 KONINKLIJKE PHILIPS N.V.	754,310	1.23
Übertragbare und amtlich notierte Wertpapiere und/oder auf anderen Märkten gehandelte Wertpapiere	57,648,102	93.74	8,443 PROSUS N V	696,294	1.13
Aktien	57,648,102	93.74	109,057 STELLANTIS NV	1,803,803	2.93
<i>Belgien</i>	1,298,416	2.11	<i>Schweden</i>	1,789,427	2.91
12,369 KBC GROUPE	795,326	1.29	28,866 LUNDIN ENERGY AB	861,825	1.40
4,693 SOLVAY	503,090	0.82	59,079 SWEDBANK A SHS A	927,602	1.51
<i>Dänemark</i>	2,782,829	4.52	<i>Schweiz</i>	5,234,116	8.51
17,117 GN GREAT NORDIC	1,260,944	2.05	29,024 NESTLE SA	3,050,671	4.96
21,540 NOVO NORDISK	1,521,885	2.47	6,867 ROCHE HOLDING LTD	2,183,445	3.55
<i>Deutschland</i>	9,715,532	15.80	<i>Spanien</i>	812,315	1.32
4,067 ADIDAS NOM	1,276,631	2.08	79,019 IBERDROLA SA	812,315	1.32
5,945 ALLIANZ SE-NOM	1,250,234	2.03	<i>Vereinigtes Königreich</i>	10,122,028	16.46
7,089 BAYERISCHE MOTORENWERKE	633,119	1.03	34,471 ANGLO AMERICAN PLC	1,153,450	1.88
5,466 DEUTSCHE BOERSE AG	804,595	1.31	16,002 ASTRAZENECA PLC	1,618,560	2.64
20,136 DEUTSCHE POST AG-NOM	1,155,001	1.88	46,666 PRUDENTIAL PLC	746,645	1.21
16,750 FRESENIUS SE & CO KGAA	736,916	1.20	12,904 RECKITT BENCKISER GROUP PLC	961,581	1.56
3,807 HANNOVER RUECK SE	537,168	0.87	51,228 ROYAL DUTCH SHELL A SHARES	863,378	1.40
10,049 KION GROUP	903,204	1.47	53,669 ROYAL DUTCH SHELL B SHARES	874,634	1.42
4,973 MERCK KGAA	804,134	1.31	1,928 ROYAL DUTCH SHELL PLC-A	32,784	0.05
12,083 SIEMENS AG-NOM	1,614,530	2.62	64,875 SMITHS GROUP	1,201,599	1.95
<i>Finnland</i>	434,809	0.71	98,312 STANDARD CHARTERED	527,950	0.86
8,420 NESTE CORPORATION	434,809	0.71	8,181 UNILEVER	403,165	0.66
<i>Frankreich</i>	9,382,521	15.26	24,598 UNILEVER PLC	1,214,279	1.98
9,025 AIR LIQUIDE	1,332,632	2.17	370,719 VODAFONE GROUP	524,003	0.85
17,515 ALSTOM	745,964	1.21	Gesamtwertpapierbestand	57,648,102	93.74
20,943 BNP PARIBAS	1,107,256	1.80			
7,356 BOUYGUES	229,434	0.37			
10,178 CAP GEMINI SE	1,648,836	2.68			
3,216 LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	2,126,740	3.47			
20,431 PUBLICIS GROUPE	1,102,048	1.79			
12,664 THALES SA	1,089,611	1.77			
<i>Irland</i>	3,659,173	5.95			
34,194 CRH PLC	1,453,245	2.37			
6,977 FLUTTER ENTMT RG	1,065,388	1.73			
9,682 KERRY GROUP A	1,140,540	1.85			
<i>Italien</i>	5,637,505	9.17			
154,177 ENEL SPA	1,207,514	1.96			
33,027 FINECOBANK	485,497	0.79			
65,109 MEDIOBANCA SPA	641,324	1.04			
121,604 NEXI SPA	2,250,890	3.67			
48,131 POSTE ITALIANE SPA	536,661	0.87			
105,768 SNAM RETE GAS	515,619	0.84			
<i>Niederlande</i>	6,779,431	11.02			
17,181 AIRBUS BR BEARER SHS	1,863,107	3.03			
83,494 ING GROUP NV	930,123	1.51			
277,826 KONINKLIJKE KPN NV	731,794	1.19			

Die beigegeführten Anmerkungen sind integraler Bestandteil dieses Geschäftsberichts.

Wertpapierbestand zum 30.06.2021

Anzahl Nennwert	Marktwert	% des NIW	Anzahl Nennwert	Marktwert	% des NIW
	EUR			EUR	
Positive Positionen	43,168,832	100.39			
Übertragbare und amtlich notierte Wertpapiere und/oder auf anderen Märkten gehandelte Wertpapiere	43,091,208	100.21			
Aktien	43,091,208	100.21			
<i>Belgien</i>	868,068	2.02			
8,317 KBC GROUPE	534,783	1.24			
3,109 SOLVAY	333,285	0.78			
<i>Dänemark</i>	1,848,815	4.30			
11,451 GN GREAT NORDIC	843,551	1.96			
14,228 NOVO NORDISK	1,005,264	2.34			
<i>Deutschland</i>	6,753,969	15.71			
2,719 ADIDAS NOM	853,494	1.99			
3,997 ALLIANZ SE-NOM	840,569	1.95			
4,732 BAYERISCHE MOTORENWERKE	422,615	0.98			
3,630 DEUTSCHE BOERSE AG	534,336	1.24			
13,541 DEUTSCHE POST AG-NOM	776,712	1.81			
6,848 DWS GROUP GMBH CO KGAA	261,731	0.61			
11,064 FRESENIUS SE & CO KGAA	486,761	1.13			
2,550 HANNOVER RUECK SE	359,805	0.84			
6,807 KION GROUP	611,813	1.42			
3,327 MERCK KGAA	537,976	1.25			
7,994 SIEMENS AG-NOM	1,068,157	2.49			
<i>Finnland</i>	495,955	1.15			
4,713 HUHTAMAKI OYJ	188,284	0.44			
5,958 NESTE CORPORATION	307,671	0.71			
<i>Frankreich</i>	6,488,850	15.09			
6,007 AIR LIQUIDE	886,993	2.06			
11,658 ALSTOM	496,514	1.15			
14,082 BNP PARIBAS	744,515	1.73			
5,205 BOUYGUES	162,344	0.38			
6,843 CAP GEMINI SE	1,108,566	2.58			
3,583 FNAC DARTY	194,378	0.45			
2,150 LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	1,421,795	3.32			
13,738 PUBLICIS GROUPE	741,028	1.72			
8,516 THALES SA	732,717	1.70			
<i>Irland</i>	2,435,130	5.66			
22,623 CRH PLC	961,478	2.23			
4,664 FLUTTER ENTMT RG	712,193	1.66			
6,464 KERRY GROUP A	761,459	1.77			
<i>Italien</i>	3,762,161	8.75			
103,671 ENEL SPA	811,951	1.89			
22,116 FINECOBANK	325,105	0.76			
43,780 MEDIOBANCA SPA	431,233	1.00			
81,086 NEXI SPA	1,500,903	3.49			
31,759 POSTE ITALIANE SPA	354,113	0.82			
69,509 SNAM RETE GAS	338,856	0.79			
			<i>Niederlande</i>	5,156,021	11.99
			11,565 AIRBUS BR BEARER SHS	1,254,108	2.91
			9,486 ASR NEDERLAND N.V	309,149	0.72
			8,053 BASIC FIT N.V.	290,391	0.68
			56,555 ING GROUP NV	630,023	1.47
			185,728 KONINKLIJKE KPN NV	489,208	1.14
			12,014 KONINKLIJKE PHILIPS N.V.	502,065	1.17
			5,677 PROSUS N V	468,182	1.09
			73,331 STELLANTIS NV	1,212,895	2.81
			<i>Österreich</i>	531,835	1.24
			14,484 AMS	245,232	0.57
			6,386 BAWAG GROUP AG	286,603	0.67
			<i>Schweden</i>	1,203,790	2.80
			19,139 LUNDIN ENERGY AB	571,415	1.33
			40,276 SWEDBANK A SHS A	632,375	1.47
			<i>Schweiz</i>	3,492,826	8.12
			19,403 NESTLE SA	2,039,421	4.74
			4,571 ROCHE HOLDING LTD	1,453,405	3.38
			<i>Spanien</i>	1,080,453	2.51
			24,518 APPLUS SERVICES	202,028	0.47
			53,134 IBERDROLA SA	546,218	1.27
			164,134 INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP SA	332,207	0.77
			<i>Vereinigtes Königreich</i>	8,973,335	20.87
			19,416 ALLFUNDS GROUP PLC	284,988	0.66
			22,889 ANGLO AMERICAN PLC	765,900	1.78
			10,570 ASTRAZENECA PLC	1,069,128	2.49
			33,518 BRITVIC	365,850	0.85
			4,834 DECHRA PHARMACEUTICALS	246,078	0.57
			426,109 ITV	623,193	1.45
			76,111 MEGGITT PLC	408,904	0.95
			31,378 PRUDENTIAL PLC	502,041	1.17
			8,615 RECKITT BENCKISER GROUP PLC	641,973	1.49
			33,709 ROYAL DUTCH SHELL A SHARES	568,119	1.32
			35,584 ROYAL DUTCH SHELL B SHARES	579,906	1.35
			2,034 ROYAL DUTCH SHELL PLC-A	34,586	0.08
			43,623 SMITHS GROUP	807,974	1.88
			64,803 STANDARD CHARTERED	348,001	0.81
			21,928 UNILEVER	1,080,627	2.52
			21,692 VISTRY GROUP PLC	297,287	0.69
			246,753 VODAFONE GROUP	348,780	0.81
			Aktien/Anteile aus OGAW/OGA	77,624	0.18
			Aktien/Anteile aus Investmentfonds	77,624	0.18
			<i>Frankreich</i>	77,624	0.18
			0.335 AMUNDI EURO LIQUIDITY SRI	77,624	0.18
			Gesamtwertpapierbestand	43,168,832	100.39

Die beigegeführten Anmerkungen sind integraler Bestandteil dieses Geschäftsberichts.

Wertpapierbestand zum 30.06.2021

Anzahl Nennwert	Marktwert	% des NIW
	EUR	
Positive Positionen	125,140,687	81.15
Übertragbare und amtlich notierte Wertpapiere und/oder auf anderen Märkten gehandelte Wertpapiere	84,206,512	54.61
Anleihen	84,206,512	54.61
<i>Behörden</i>	<i>84,206,512</i>	<i>54.61</i>
3,500,000 BERLIN LAND 1.875% 10/09/2021	3,516,485	2.28
6,600,000 BERLIN LAND 3.125% 17/08/2021	6,631,086	4.30
5,750,000 FRANCE OAT 3.25% 25/10/2021	5,821,300	3.77
800,000 FREE HANSEATIC CITY OF BREMEN 0% 12/10/2021	801,304	0.52
6,300,000 FREE HANSEATIC CITY OF BREMEN 0% 13/07/2021	6,301,197	4.09
5,250,000 FREE HANSEATIC CITY OF BREMEN 0% 30/11/2021	5,262,652	3.41
1,100,000 GERMANY BUND 0% 08/10/2021	1,101,969	0.71
6,800,000 GERMANY BUND 0% 10/12/2021	6,820,060	4.42
1,650,000 STATE OF HESSEN 0% 15/09/2021	1,652,046	1.07
2,950,000 STATE OF HESSEN 1.125% 10/12/2021	2,972,332	1.93
6,710,000 STATE OF HESSEN 3.00% 23/08/2021	6,744,757	4.37
2,550,000 STATE OF LOWER SAXONY 1.625% 23/07/2021	2,553,341	1.66
1,750,000 STATE OF LOWER SAXONY 2.75% 13/09/2021	1,761,830	1.14
7,150,000 STATE OF NORTH RHINE WESTPHALIA 0.375% 19/10/2021	7,170,520	4.66
7,450,000 STATE OF NORTH RHINE WESTPHALIA 0.50% 15/12/2021	7,486,654	4.86
6,050,000 STATE OF NORTH RHINE WESTPHALIA 2.00% 15/09/2021	6,082,307	3.94
100,000 STATE OF NORTH RHINE WESTPHALIA 3.50% 07/07/2021	100,056	0.06
7,200,000 STATE OF RHINELAND PALATINATE 0.50% 03/09/2021	7,213,680	4.69
4,200,000 STATE OF SARRLAND 0.375% 28/10/2021	4,212,936	2.73
Geldmarktinstrumente	40,934,175	26.54
Anleihen	40,934,175	26.54
<i>Behörden</i>	<i>40,934,175</i>	<i>26.54</i>
1,100,000 BELGIUM 0% 09/09/2021	1,101,342	0.71
6,500,000 BELGIUM 0% 11/11/2021	6,515,405	4.23
4,950,000 BELGIUM 0% 15/07/2021	4,951,203	3.21
2,550,000 FRANCE BTF 0% 04/11/2021	2,555,942	1.66
2,250,000 FRANCE BTF 0% 06/10/2021	2,253,915	1.46
850,000 FRANCE BTF 0% 11/08/2021	772,801	0.50
4,600,000 FRANCE BTF 0% 14/07/2021	4,601,032	2.98
350,000 FRANCE BTF 0% 18/08/2021	350,294	0.23
1,900,000 GERMANY BUBILLS 0% 15/12/2021	1,905,662	1.24
7,200,000 GERMANY BUBILLS 0% 24/11/2021	7,218,936	4.68
5,550,000 GERMANY BUBILLS 0% 25/08/2021	5,555,494	3.60
2,050,000 GERMANY BUBILLS 0% 28/07/2021	2,050,998	1.33
1,100,000 NETHERLANDS 0% 30/08/2021	1,101,151	0.71
Gesamtwertpapierbestand	125,140,687	81.15

Die beigefügten Anmerkungen sind integraler Bestandteil dieses Geschäftsberichts.

	Erläut	Amundi S.F. - Euro Curve 1-3year		Amundi S.F. - Euro Curve 3-5year	
		30.06.2021 EUR	30.06.2020 EUR	30.06.2021 EUR	30.06.2020 EUR
Aktiva					
Wertpapiere zu Einstandspreisen		19,626,753	26,197,174	46,530,543	67,390,290
Nicht realisierte Nettogewinne/(-verluste) aus Wertpapieren		-308,593	-128,321	-492,908	12,336
Wertpapieren zum Marktwert	2	19,318,160	26,068,853	46,037,635	67,402,626
Zum Marktwert erworbene Optionen mit Vorabprämie	2, 14	-	-	-	-
Nicht realisierter Nettogewinn aus termingeschäftartigen Optionen	2, 14	-	-	-	-
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisentermingeschäften	2, 9	-	-	-	-
Nicht realisierter Nettogewinn aus Finanztermingeschäften	2, 8	1,660	-	29,855	-
Nicht realisierter Nettogewinn aus Swapgeschäften	2, 15	-	-	-	2,373
Bareinlagen bei Banken und Maklern		826,175	1,874,507	1,857,990	532,141
Zinsguthaben		93,883	178,148	270,923	565,618
Guthaben aus Dividenden		-	-	-	-
Forderungen aus Zeichnungen		200	-	36,908	18,918
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		99,391	1,161,819	198,783	223,637
Sonstige Forderungen		-	-	-	-
Gesamtsumme der Aktiva		20,339,469	29,283,327	48,432,094	68,745,313
Passiva					
Banküberziehung/Maklerverbindlichkeiten		-	35	-	-
Zum Marktwert geschriebene Optionen mit Vorabprämie	2, 14	-	-	-	-
Nicht realisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften	2, 9	-	-	-	-
Nicht realisierter Nettoverlust aus Finanztermingeschäften	2, 8	-	15,260	-	47,790
Nicht realisierter Nettoverlust aus Swapgeschäften	2, 15	45,868	-	114,671	-
Zahlungsverpflichtungen aus Rücknahmen		6,954	20,275	122,718	231,097
Zahlungsverpflichtungen aus Wertpapierkäufen		152,538	318,083	355,922	-
Angefallene Kosten		63,838	104,950	181,510	225,498
Sonstige Zahlungsverpflichtungen		7,478	-	18,696	2,599
Gesamtsumme der Passiva		276,676	458,603	793,517	506,984
Nettovermögen		20,062,793	28,824,724	47,638,577	68,238,329

Die beigegeführten Anmerkungen sind integraler Bestandteil dieses Geschäftsberichts.

	Erläut	Amundi S.F. - Euro Curve 7-10year		Amundi S.F. - Euro Curve 10+year	
		30.06.2021 EUR	30.06.2020 EUR	30.06.2021 EUR	30.06.2020 EUR
Aktiva					
Wertpapiere zu Einstandspreisen		102,137,739	111,626,388	68,139,815	89,325,015
Nicht realisierte Nettogewinne/(-verluste) aus Wertpapieren		-935,852	496,197	-2,827,598	1,288,349
Wertpapieren zum Marktwert	2	101,201,887	112,122,585	65,312,217	90,613,364
Zum Marktwert erworbene Optionen mit Vorabprämie	2, 14	-	-	-	-
Nicht realisierter Nettogewinn aus termingeschäftartigen Optionen	2, 14	3,000	-	2,100	-
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisentermingeschäften	2, 9	-	-	-	-
Nicht realisierter Nettogewinn aus Finanztermingeschäften	2, 8	106,603	72,710	82,480	639,310
Nicht realisierter Nettogewinn aus Swappeschäften	2, 15	-	4,350	-	3,823
Bareinlagen bei Banken und Maklern		7,004,053	12,649,190	3,576,438	779,664
Zinsguthaben		471,448	582,936	505,377	319,710
Guthaben aus Dividenden		-	-	-	-
Forderungen aus Zeichnungen		175	24,927	592,061	21,262
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		496,957	1,299,523	298,174	503,713
Sonstige Forderungen		-	-	-	-
Gesamtsumme der Aktiva		109,284,123	126,756,221	70,368,847	92,880,846
Passiva					
Banküberziehung/Maklerverbindlichkeiten		-	-	-	104,697
Zum Marktwert geschriebene Optionen mit Vorabprämie	2, 14	-	-	-	-
Nicht realisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften	2, 9	-	-	7,499	-
Nicht realisierter Nettoverlust aus Finanztermingeschäften	2, 8	-	-	-	-
Nicht realisierter Nettoverlust aus Swappeschäften	2, 15	267,565	-	229,341	-
Zahlungsverpflichtungen aus Rücknahmen		305,603	62,433	290,803	275,943
Zahlungsverpflichtungen aus Wertpapierkäufen		644,417	-	396,564	-
Angefallene Kosten		328,655	278,379	236,320	193,026
Sonstige Zahlungsverpflichtungen		43,624	4,764	37,392	4,187
Gesamtsumme der Passiva		1,589,864	345,576	1,197,919	577,853
Nettovermögen		107,694,259	126,410,645	69,170,928	92,302,993

Die beigegefügten Anmerkungen sind integraler Bestandteil dieses Geschäftsberichts.

	Erläut	Amundi S.F. - SBI FM India Bond		Amundi S.F. - European Equity Market Plus	
		30.06.2021 USD	30.06.2020 USD	30.06.2021 EUR	30.06.2020 EUR
Aktiva					
Wertpapiere zu Einstandspreisen		20,559,737	-	87,795,818	94,819,000
Nicht realisierte Nettogewinne/(-verluste) aus Wertpapieren		-20,157	-	26,021,828	1,183,455
Wertpapieren zum Marktwert	2	20,539,580	-	113,817,646	96,002,455
Zum Marktwert erworbene Optionen mit Vorabprämie	2, 14	-	-	-	-
Nicht realisierter Nettogewinn aus termingeschäftartigen Optionen	2, 14	-	-	-	-
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisentermingeschäften	2, 9	12,425	-	-	-
Nicht realisierter Nettogewinn aus Finanztermingeschäften	2, 8	-	-	-	80,577
Nicht realisierter Nettogewinn aus Swapgeschäften	2, 15	-	-	-	-
Bareinlagen bei Banken und Maklern		24,370,000	-	3,414,381	2,788,041
Zinsguthaben		263,534	-	-	-
Guthaben aus Dividenden		-	-	173,452	116,964
Forderungen aus Zeichnungen		-	-	593	69,586
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		-	-	-	-
Sonstige Forderungen		-	-	-	-
Gesamtsumme der Aktiva		45,185,539	-	117,406,072	99,057,623
Passiva					
Banküberziehung/Maklerverbindlichkeiten		18,503,701	-	2,641,332	469,229
Zum Marktwert geschriebene Optionen mit Vorabprämie	2, 14	-	-	-	-
Nicht realisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften	2, 9	-	-	-	-
Nicht realisierter Nettoverlust aus Finanztermingeschäften	2, 8	-	-	17,711	-
Nicht realisierter Nettoverlust aus Swapgeschäften	2, 15	-	-	-	-
Zahlungsverpflichtungen aus Rücknahmen		-	-	53,798	48,859
Zahlungsverpflichtungen aus Wertpapierkäufen		1,657,628	-	-	-
Angefallene Kosten		10,392	-	177,096	142,399
Sonstige Zahlungsverpflichtungen		-	-	-	-
Gesamtsumme der Passiva		20,171,721	-	2,889,937	660,487
Nettovermögen		25,013,818	-	114,516,135	98,397,136

Die beigegefügten Anmerkungen sind integraler Bestandteil dieses Geschäftsberichts.

	Erläut	Amundi S.F. - European Equity Optimal Volatility		Amundi S.F. - European Research	
		30.06.2021 EUR	30.06.2020 EUR	30.06.2021 EUR	30.06.2020 EUR
Aktiva					
Wertpapiere zu Einstandspreisen		49,646,060	67,582,781	36,993,345	185,668,251
Nicht realisierte Nettogewinne/(-verluste) aus Wertpapieren		8,002,042	48,960	6,175,487	-7,058,981
Wertpapieren zum Marktwert	2	57,648,102	67,631,741	43,168,832	178,609,270
Zum Marktwert erworbene Optionen mit Vorabprämie	2, 14	-	5,706,388	-	-
Nicht realisierter Nettogewinn aus termingeschäftartigen Optionen	2, 14	-	-	-	-
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisentermingeschäften	2, 9	-	-	-	-
Nicht realisierter Nettogewinn aus Finanztermingeschäften	2, 8	460,950	468,165	-	-
Nicht realisierter Nettogewinn aus Swapgeschäften	2, 15	-	-	-	-
Bareinlagen bei Banken und Maklern		3,864,798	14,403,712	80,018	2,606,403
Zinsguthaben		-	-	-	-
Guthaben aus Dividenden		88,215	132,192	41,118	167,917
Forderungen aus Zeichnungen		1,178	1,412	87,152	16,152
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		63,007	2,009,033	-	-
Sonstige Forderungen		10	-	-	-
Gesamtsumme der Aktiva		62,126,260	90,352,643	43,377,120	181,399,742
Passiva					
Banküberziehung/Maklerverbindlichkeiten		-	177,113	-	-
Zum Marktwert geschriebene Optionen mit Vorabprämie	2, 14	-	6,796,771	-	-
Nicht realisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften	2, 9	-	-	-	-
Nicht realisierter Nettoverlust aus Finanztermingeschäften	2, 8	-	-	-	53,970
Nicht realisierter Nettoverlust aus Swapgeschäften	2, 15	-	-	-	-
Zahlungsverpflichtungen aus Rücknahmen		159,693	992,512	12,824	91,821
Zahlungsverpflichtungen aus Wertpapierkäufen		76,916	-	-	-
Angefallene Kosten		390,192	375,295	362,551	599,602
Sonstige Zahlungsverpflichtungen		-	4,320	-	-
Gesamtsumme der Passiva		626,801	8,346,011	375,375	745,393
Nettovermögen		61,499,459	82,006,632	43,001,745	180,654,349

Die beigegeführten Anmerkungen sind integraler Bestandteil dieses Geschäftsberichts.

	Erläut	Amundi S.F. - EUR Commodities		Konsolidiert	
		30.06.2021 EUR	30.06.2020 EUR	30.06.2021 EUR	30.06.2020 EUR
Aktiva					
Wertpapiere zu Einstandspreisen		125,662,703	112,444,274	553,869,569	755,053,173
Nicht realisierte Nettogewinne/(-verluste) aus Wertpapieren		-522,016	-304,471	35,095,392	-4,462,476
Wertpapieren zum Marktwert	2	125,140,687	112,139,803	588,964,961	750,590,697
Zum Marktwert erworbene Optionen mit Vorabprämie	2, 14	-	-	-	5,706,388
Nicht realisierter Nettogewinn aus termingeschäftartigen Optionen	2, 14	-	-	5,100	-
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisentermingeschäften	2, 9	330,241	82,127	340,718	82,127
Nicht realisierter Nettogewinn aus Finanztermingeschäften	2, 8	-	-	681,548	1,260,762
Nicht realisierter Nettogewinn aus Swapgeschäften	2, 15	-	1,086,410	-	1,096,956
Bareinlagen bei Banken und Maklern		29,958,090	12,153,106	71,131,702	47,786,764
Zinsguthaben		803,558	510,332	2,367,411	2,156,744
Guthaben aus Dividenden		-	-	302,785	417,073
Forderungen aus Zeichnungen		112,810	111,884	831,077	264,141
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		-	-	1,156,312	5,197,725
Sonstige Forderungen		-	-	10	-
Gesamtsumme der Aktiva		156,345,386	126,083,662	665,781,624	814,559,377
Passiva					
Banküberziehung/Maklerverbindlichkeiten		-	-	18,244,393	751,074
Zum Marktwert geschriebene Optionen mit Vorabprämie	2, 14	-	-	-	6,796,771
Nicht realisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften	2, 9	-	-	7,499	-
Nicht realisierter Nettoverlust aus Finanztermingeschäften	2, 8	-	-	17,711	117,020
Nicht realisierter Nettoverlust aus Swapgeschäften	2, 15	1,505,409	-	2,162,854	-
Zahlungsverpflichtungen aus Rücknahmen		148,021	98,083	1,100,414	1,821,023
Zahlungsverpflichtungen aus Wertpapierkäufen		-	-	3,024,135	318,083
Angefallene Kosten		476,870	244,345	2,225,795	2,163,494
Sonstige Zahlungsverpflichtungen		6,983	4,242	114,173	20,112
Gesamtsumme der Passiva		2,137,283	346,670	26,896,974	11,987,577
Nettovermögen		154,208,103	125,736,992	638,884,650	802,571,800

Die beigegeführten Anmerkungen sind integraler Bestandteil dieses Geschäftsberichts.

Amundi S.F. - Euro Curve 1-3year

	ISIN	Anzahl der Einheiten		Währung	NIW je Einheit		NIW je Einheit
		30.06.2021			30.06.2021	31.12.2020	
Klasse A Jährliche Ausschüttung	LU0271690827	6,750.851		EUR	465.36	468.22	472.37
Klasse A Keine Ausschüttung	LU0271690744	20,334.055		EUR	60.65	61.03	61.57
Klasse E Keine Ausschüttung	LU0271690660	914,015.623		EUR	5.692	5.732	5.792
Klasse F Keine Ausschüttung	LU0279958614	1,084,243.194		EUR	5.404	5.451	5.528
Klasse H Jährliche Ausschüttung	LU0271691122	82.751		EUR	1,024.55	1,030.10	1,037.64
Klasse H Keine Ausschüttung	LU0332132637	2,974.837		EUR	1,170.07	1,176.39	1,184.92
Klasse I Keine Ausschüttung	LU0433266359	955.274		EUR	1,100.23	1,104.87	1,110.27
Klasse R Jährliche Ausschüttung	LU1706854749	100.000		EUR	49.14	49.36	49.63
Klasse R Keine Ausschüttung	LU1706853691	101.003		EUR	49.19	49.41	49.69
Gesamtvermögen				EUR	20,062,793	24,014,731	53,271,610

Amundi S.F. - Euro Curve 3-5year

	ISIN	Anzahl der Einheiten		Währung	NIW je Einheit		NIW je Einheit
		30.06.2021			30.06.2021	31.12.2020	
Klasse A Jährliche Ausschüttung	LU0281584838	51,221.092		EUR	66.76	67.33	66.57
Klasse A Keine Ausschüttung	LU0367809836	33,526.627		EUR	70.20	70.79	70.00
Klasse E Keine Ausschüttung	LU0271691478	4,291,223.068		EUR	6.632	6.703	6.660
Klasse F Keine Ausschüttung	LU0279958887	1,015,806.132		EUR	6.230	6.314	6.308
Klasse H Keine Ausschüttung	LU0332132553	3,075.435		EUR	1,415.55	1,427.13	1,410.48
Klasse I Keine Ausschüttung	LU0400221809	1,949.416		EUR	1,344.88	1,354.61	1,336.25
Klasse R Keine Ausschüttung	LU1706853774	2,030.357		EUR	50.59	50.97	50.31
Gesamtvermögen				EUR	47,638,577	56,576,198	76,730,672

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

	ISIN	Anzahl der Einheiten		Währung	NIW je Einheit		NIW je Einheit
		30.06.2021			30.06.2021	31.12.2020	
Klasse A Ausschüttung	LU0536711285	1,297.646		EUR	77.75	79.50	75.51
Klasse A Jährliche Ausschüttung	LU0536711103	205,697.426		EUR	82.07	83.92	79.70
Klasse A Keine Ausschüttung	LU0367810172	135,371.137		EUR	93.55	95.66	90.85
Klasse C Keine Ausschüttung	LU0536711442	93.889		EUR	73.84	75.98	73.11
Klasse E Vierteljährliche Zielausschüttung	LU0857391824	264,703.541		EUR	6.020	6.173	5.897
Klasse E Keine Ausschüttung	LU0271693920	2,916,241.814		EUR	8.825	9.045	8.631
Klasse F Keine Ausschüttung	LU0271694654	393,752.149		EUR	8.095	8.320	7.982
Klasse H Keine Ausschüttung	LU0332132041	22,855.071		EUR	1,873.66	1,915.42	1,818.25
Klasse I Keine Ausschüttung	LU0433266433	2,705.932		EUR	1,716.51	1,753.15	1,660.96
Klasse R Ausschüttung	LU1706854665	100.437		EUR	54.69	55.86	52.94
Klasse R Keine Ausschüttung	LU1706853857	909.617		EUR	55.30	56.49	53.54
Gesamtvermögen				EUR	107,694,259	126,648,491	129,932,211

Amundi S.F. - Euro Curve 10+year

	ISIN	Anzahl der Einheiten		Währung	NIW je Einheit		NIW je Einheit
		30.06.2021			30.06.2021	31.12.2020	
Klasse A Jährliche Ausschüttung	LU0281585215	4,218.788		EUR	112.45	120.50	107.54
Klasse E Vierteljährliche Zielausschüttung	LU0857391741	109,064.304		EUR	7.139	7.671	6.884

Die beigegeführten Anmerkungen sind integraler Bestandteil dieses Geschäftsberichts.

Amundi S.F. - Euro Curve 10+year

	Anzahl der Einheiten		Wahrung	NIW je Einheit	NIW je Einheit	NIW je Einheit
	ISIN	30.06.2021		30.06.2021	31.12.2020	31.12.2019
Klasse E Keine Ausschüttung	LU0271691981	279,738.516	EUR	10.509	11.288	10.086
Klasse F Keine Ausschüttung	LU0271692013	166,108.041	EUR	9.643	10.386	9.332
Klasse H Keine Ausschüttung	LU0332132397	23,880.190	EUR	2,379.78	2,549.43	2,266.22
Klasse I Keine Ausschüttung	LU0433266516	2,884.110	EUR	2,269.87	2,429.39	2,155.57
Gesamtvermögen			EUR	69,170,928	113,852,545	75,855,037

Amundi S.F. - SBI FM India Bond

	Anzahl der Einheiten		Wahrung	NIW je Einheit	NIW je Einheit	NIW je Einheit
	ISIN	30.06.2021		30.06.2021	31.12.2020	31.12.2019
Klasse A Keine Ausschüttung	LU2251232760	500.000	USD	10.00	-	-
Klasse A2 - Ausschüttung	LU2251232844	500.000	USD	9.99	-	-
Klasse H Keine Ausschüttung	LU2338645448	25,000.000	USD	999.75	-	-
Klasse I Keine Ausschüttung	LU2251232927	0.500	USD	9,998.22	-	-
Klasse I2 - Ausschüttung	LU2251233065	0.500	USD	9,997.88	-	-
Gesamtvermögen			USD	25,013,818	-	-

Amundi S.F. - European Equity Market Plus

	Anzahl der Einheiten		Wahrung	NIW je Einheit	NIW je Einheit	NIW je Einheit
	ISIN	30.06.2021		30.06.2021	31.12.2020	31.12.2019
Klasse A Keine Ausschüttung	LU0536711871	102,744.299	CHF	157.25	133.32	138.17
Klasse A Keine Ausschüttung	LU0380935170	102,744.299	EUR	143.45	123.27	127.11
Klasse E Keine Ausschüttung	LU0285097662	622,605.337	EUR	15.720	13.518	13.961
Klasse H Keine Ausschüttung	LU0383420295	30,933.319	EUR	2,908.97	2,497.86	2,571.91
Klasse I Keine Ausschüttung	LU1619842302	5.000	EUR	1,291.54	1,108.21	1,139.16
Gesamtvermögen			EUR	114,516,135	104,263,131	118,949,274

Amundi S.F. - European Equity Optimal Volatility

	Anzahl der Einheiten		Wahrung	NIW je Einheit	NIW je Einheit	NIW je Einheit
	ISIN	30.06.2021		30.06.2021	31.12.2020	31.12.2019
Klasse A Keine Ausschüttung	LU1920531883	1,293,727.977	EUR	36.15	37.57	40.88
Klasse A Keine Ausschüttung	LU1920531966	1,293,727.977	USD	42.87	45.97	45.89
Klasse C Keine Ausschüttung	LU1920532345	4,029.232	EUR	37.49	39.15	43.03
Klasse C Keine Ausschüttung	LU1920532261	4,029.232	USD	44.46	47.90	48.30
Klasse E Keine Ausschüttung	LU1920532428	3,387,955.401	EUR	3.611	3.753	4.084
Klasse F Keine Ausschüttung	LU1920532691	483,971.105	EUR	3.787	3.950	4.332
Klasse G Keine Ausschüttung	LU1920532774	5,317.367	EUR	3.743	3.900	4.265
Klasse H Keine Ausschüttung	LU1920532857	640.008	EUR	749.96	776.63	839.12
Klasse I Keine Ausschüttung	LU1920533079	5.000	EUR	762.40	788.37	849.20
Klasse I Keine Ausschüttung	LU1920532931	5.000	USD	904.13	964.62	953.22
Klasse R Keine Ausschüttung	LU1920533152	100.000	EUR	39.72	41.12	44.37
Gesamtvermögen			EUR	61,499,459	70,937,457	92,948,448

Die beigegefügten Anmerkungen sind integraler Bestandteil dieses Geschäftsberichts.

Amundi S.F. - European Research

	ISIN	Anzahl der Einheiten		Währung	NIW je Einheit		
		30.06.2021			30.06.2021	31.12.2020	31.12.2019
Klasse A Keine Ausschüttung	LU1920533400	1,740,533.664		EUR	7.56	6.56	6.91
Klasse A Keine Ausschüttung	LU1920533236	1,740,533.664		USD	8.96	8.03	7.76
Klasse B Keine Ausschüttung	LU1920533582	-		EUR	-	5.10	5.42
Klasse B Keine Ausschüttung	LU1920533665	-		USD	-	6.24	6.09
Klasse C Keine Ausschüttung	LU1920533749	63,248.615		EUR	5.34	4.66	4.95
Klasse E Keine Ausschüttung	LU1920533822	1,596,964.630		EUR	7.809	6.782	7.141
Klasse F Keine Ausschüttung	LU1920534044	835,217.167		EUR	6.528	5.700	6.048
Klasse G Keine Ausschüttung	LU1920534127	12,610.393		EUR	5.521	4.807	5.087
Klasse H Keine Ausschüttung	LU1920534390	914.664		EUR	1,657.69	1,434.49	1,498.78
Klasse I Keine Ausschüttung	LU1920534473	1,084,800.018		EUR	9.21	7.96	8.31
Klasse I Keine Ausschüttung	LU1920534556	1,084,800.018		USD	10.93	9.74	9.33
Klasse R Keine Ausschüttung	LU1920534630	100.000		EUR	58.68	50.75	53.00
Klasse U Keine Ausschüttung	LU1920534713	-		EUR	-	-	50.51
Klasse U Keine Ausschüttung	LU1920534804	-		USD	-	-	56.69
Gesamtvermögen				EUR	43,001,745	40,418,627	256,084,152

Amundi S.F. - EUR Commodities

	ISIN	Anzahl der Einheiten		Währung	NIW je Einheit		
		30.06.2021			30.06.2021	31.12.2020	31.12.2019
Klasse A Abgesichert Keine Ausschüttung	LU1694769693	4,862.130		CHF	34.05	28.77	30.36
Klasse A Abgesichert Keine Ausschüttung	LU1694769859	272,716.955		USD	36.19	30.41	31.50
Klasse A Keine Ausschüttung	LU0271695388	1,704,326.753		EUR	25.62	21.62	22.74
Klasse B Abgesichert Keine Ausschüttung	LU1694769933	-		USD	-	28.25	29.70
Klasse C Abgesichert Keine Ausschüttung	LU1694770196	16,189.127		USD	40.06	33.83	35.41
Klasse C Keine Ausschüttung	LU0372625102	19,132.723		EUR	14.73	12.49	13.27
Klasse E Keine Ausschüttung	LU0273973874	2,999,623.008		EUR	2.297	1.938	2.039
Klasse F Keine Ausschüttung	LU0273974336	2,223,151.530		EUR	2.063	1.747	1.852
Klasse H Jährliche Ausschüttung	LU0484923635	4.000		EUR	677.33	570.12	596.68
Klasse H Abgesichert Keine Ausschüttung	LU1772191695	717.417		USD	1,089.38	913.48	942.91
Klasse H Keine Ausschüttung	LU0271872185	17,889.784		EUR	490.52	412.97	432.44
Klasse I Jährliche Ausschüttung	LU1694770352	4,670.000		EUR	471.41	396.48	414.39
Klasse I Abgesichert Keine Ausschüttung	LU0419230916	6,195.733		USD	829.45	694.70	715.56
Klasse I Keine Ausschüttung	LU0271695461	145,598.505		EUR	504.12	424.00	443.17
Klasse R Abgesichert Keine Ausschüttung	LU1706854582	3,529.488		USD	48.51	40.67	41.98
Klasse R Keine Ausschüttung	LU1706853931	4,614.443		EUR	52.24	43.98	46.05
Gesamtvermögen				EUR	154,208,103	96,476,837	186,257,422

	Erläut	Amundi S.F. - Euro Curve 1-3year		Amundi S.F. - Euro Curve 3-5year	
		30.06.2021 EUR	30.06.2020 EUR	30.06.2021 EUR	30.06.2020 EUR
Erträge					
Nettodividenden	2	-	-	-	-
Zinsen aus Wertpapiere	2	145,369	351,267	355,379	929,992
Zinsen aus Bankkonten	2	-	-	-	-
Zinsen aus Swapgeschäfte	2	-	1,061	-	-
Sonstige Erträge	10, 19	-	-	-	-
Gesamtsumme der Erträge		145,369	352,328	355,379	929,992
Ausgaben					
Managementgebühren	4	79,973	119,878	253,358	353,986
Vertriebsgebühren	4	-	-	-	-
Depot- und Verwaltungsgebühren	6	6,128	10,207	14,223	20,073
„Taxe d'abonnement“	7	4,982	6,951	11,833	16,891
Honorare		489	739	1,150	1,430
Druck- und Veröffentlichungskosten		217	370	511	715
Performancegebühr	5	-	-	-	-
Transaktionskosten		3,854	2,043	9,664	4,057
Gebühren für Annahme und Übermittlung von Aufträgen		8,444	-	24,197	-
Zinsen aus Swapgeschäfte		11,529	1,209	28,822	2,599
Sonstige Kosten	11, 19	7,116	11,646	16,166	14,698
Gesamtsumme der Ausgaben		122,732	153,043	359,924	414,449
Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums (01.01.2021)		24,014,731	53,271,610	56,576,198	76,730,672
Nettogeschäftsertrag/(-verlust)		22,637	199,285	-4,545	515,543
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Verkauf von Wertpapieren		-146,418	-1,118,950	-353,472	-876,544
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Devisengeschäften		1,517	-1,497	-385	-97
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Devisentermingeschäften		-	-	633	-
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Finanztermingeschäften		189,220	23,280	369,200	-111,130
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Optionsgeschäften		-21,415	-26,058	-55,312	-36,538
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Swapgeschäften		-38,225	35,948	-95,562	-
Realisierter Nettogewinn/(-verlust)		-15,321	-1,087,277	-134,898	-1,024,309
Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus Wertpapieren		-127,139	345,413	-349,063	285,755
Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus Devisentermingeschäften		-	-	-	-
Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus Finanztermingeschäften		5,075	-48,520	28,275	-79,260
Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus Optionsgeschäften		-	-	-	-
Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus Swapgeschäften		-33,339	-	-83,347	2,373
Jährliche Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts)		-155,403	296,893	-404,135	208,868
Nettoanstieg/(-rückgang) des Nettovermögens infolge des operativen Geschäfts		-148,087	-591,099	-543,578	-299,898
Nettozeichnungen/(-rücknahmen)		-3,803,851	-23,855,787	-8,394,043	-8,192,445
Ausgewiesene Dividende	13	-	-	-	-
Nettovermögen am Ende des Zeitraums		20,062,793	28,824,724	47,638,577	68,238,329

Die beigegeführten Anmerkungen sind integraler Bestandteil dieses Geschäftsberichts.

	Erläut	Amundi S.F. - Euro Curve 7-10year		Amundi S.F. - Euro Curve 10+year	
		30.06.2021 EUR	30.06.2020 EUR	30.06.2021 EUR	30.06.2020 EUR
Erträge					
Nettodividenden	2	-	-	-	-
Zinsen aus Wertpapiere	2	786,899	1,064,688	742,947	865,046
Zinsen aus Bankkonten	2	-	177	112	832
Zinsen aus Swapgeschäfte	2	11	-	39	-
Sonstige Erträge	10, 19	-	-	7,429	-
Gesamtsumme der Erträge		786,910	1,064,865	750,527	865,878
Ausgaben					
Managementgebühren	4	408,624	436,877	242,705	273,592
Vertriebsgebühren	4	51	26	-	-
Depot- und Verwaltungsgebühren	6	33,730	34,754	23,266	24,176
„Taxe d'abonnement“	7	26,744	29,245	16,817	19,894
Honorare		2,565	2,562	1,948	2,041
Druck- und Veröffentlichungskosten		1,140	1,281	866	1,021
Performancegebühr	5	-	-	-	-
Transaktionskosten		62,001	5,559	18,401	6,447
Gebühren für Annahme und Übermittlung von Aufträgen		53,724	-	56,757	-
Zinsen aus Swapgeschäfte		63,481	4,764	57,644	4,187
Sonstige Kosten	11, 19	28,344	18,875	22,159	14,727
Gesamtsumme der Ausgaben		680,404	533,943	440,563	346,085
Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums (01.01.2021)		126,648,491	129,932,211	113,852,545	75,855,037
Nettogeschäftsertrag/(-verlust)		106,506	530,922	309,964	519,793
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Verkauf von Wertpapieren		-292,806	1,070,018	-664,981	-1,971,065
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Devisengeschäften		-1,146	-145	-9,632	-1,825
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Devisentermingeschäften		1,687	-	-11,521	-
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Finanztermingeschäften		601,622	-416,550	538,471	-42,565
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Optionsgeschäften		-117,793	-63,131	-62,282	-33,878
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Swapgeschäften		-191,124	-	-191,124	-
Realisierter Nettogewinn/(-verlust)		440	590,192	-401,069	-2,049,333
Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus Wertpapieren		-2,744,718	990,991	-6,671,156	788,373
Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus Devisentermingeschäften		-	-	-7,499	-
Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus Finanztermingeschäften		126,643	53,560	71,855	797,220
Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus Optionsgeschäften		3,000	-	2,100	-
Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus Swapgeschäften		-196,052	4,350	-166,693	3,823
Jährliche Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts)		-2,811,127	1,048,901	-6,771,393	1,589,416
Nettoanstieg/(-rückgang) des Nettovermögens infolge des operativen Geschäfts		-2,704,181	2,170,015	-6,862,498	59,876
Nettozeichnungen/(-rücknahmen)		-16,249,087	-5,690,591	-37,818,466	16,395,068
Ausgewiesene Dividende	13	-964	-990	-653	-6,988
Nettovermögen am Ende des Zeitraums		107,694,259	126,410,645	69,170,928	92,302,993

Die beigegeführten Anmerkungen sind integraler Bestandteil dieses Geschäftsberichts.

	Erläut	*Amundi S.F. - SBI FM India Bond		Amundi S.F. - European Equity Market Plus	
		30.06.2021 USD	30.06.2020 USD	30.06.2021 EUR	30.06.2020 EUR
Erträge					
Nettodividenden	2	-	-	1,991,595	1,504,078
Zinsen aus Wertpapiere	2	3,188	-	34,238	76,041
Zinsen aus Bankkonten	2	-	-	-	1,108
Zinsen aus Swapgeschäfte	2	-	-	-	-
Sonstige Erträge	10, 19	-	-	49	-
Gesamtsumme der Erträge		3,188	-	2,025,882	1,581,227
Ausgaben					
Managementgebühren	4	3,564	-	216,925	203,761
Vertriebsgebühren	4	-	-	-	-
Depot- und Verwaltungsgebühren	6	2,951	-	40,052	36,143
„Taxe d'abonnement“	7	3,126	-	28,297	22,920
Honorare		485	-	2,476	2,319
Druck- und Veröffentlichungskosten		18	-	1,101	1,018
Performancegebühr	5	-	-	-	-
Transaktionskosten		-	-	1,201	1,203
Gebühren für Annahme und Übermittlung von Aufträgen		-	-	2,104	-
Zinsen aus Swapgeschäfte		-	-	-	-
Sonstige Kosten	11, 19	249	-	21,425	13,980
Gesamtsumme der Ausgaben		10,393	-	313,581	281,344
Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums (01.01.2021)		-	-	104,263,131	118,949,274
Nettogeschäftsertrag/(-verlust)		-7,205	-	1,712,301	1,299,883
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Verkauf von Wertpapieren		-	-	451,209	-364,865
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Devisengeschäften		8,755	-	88,600	-54,378
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Devisentermingeschäften		-	-	-	-
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Finanztermingeschäften		-	-	449,692	-87,359
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Optionsgeschäften		-	-	-	-
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Swapgeschäften		-	-	-	-
Realisierter Nettogewinn/(-verlust)		8,755	-	989,501	-506,602
Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus Wertpapieren		-20,157	-	14,081,132	-16,250,269
Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus Devisentermingeschäften		12,425	-	-	-
Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus Finanztermingeschäften		-	-	-50,581	79,411
Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus Optionsgeschäften		-	-	-	-
Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus Swapgeschäften		-	-	-	-
Jährliche Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts)		-7,732	-	14,030,551	-16,170,858
Nettoanstieg/(-rückgang) des Nettovermögens infolge des operativen Geschäfts		-6,182	-	16,732,353	-15,377,577
Nettozeichnungen/(-rücknahmen)		25,020,000	-	-6,479,349	-5,174,561
Ausgewiesene Dividende	13	-	-	-	-
Nettovermögen am Ende des Zeitraums		25,013,818	-	114,516,135	98,397,136

* Für den Zeitraum vom Auflegedatum des Teilfonds (siehe Anmerkung 1 dieses Berichts) bis 30. Juni 2021.

Die beigegeführten Anmerkungen sind integraler Bestandteil dieses Geschäftsberichts.

	Erläut	Amundi S.F. - European Equity Optimal Volatility		Amundi S.F. - European Research	
		30.06.2021 EUR	30.06.2020 EUR	30.06.2021 EUR	30.06.2020 EUR
Erträge					
Nett dividenden	2	1,280,770	908,582	840,663	2,045,866
Zinsen aus Wertpapiere	2	6,036	-	47,224	-
Zinsen aus Bankkonten	2	-	595	-	292
Zinsen aus Swapgeschäfte	2	-	-	-	-
Sonstige Erträge	10, 19	-	32,621	22,936	-
Gesamtsumme der Erträge		1,286,806	941,798	910,823	2,046,158
Ausgaben					
Managementgebühren	4	496,682	651,134	285,095	964,228
Vertriebsgebühren	4	821	1,579	1,854	1,762
Depot- und Verwaltungsgebühren	6	42,226	56,903	14,526	64,590
„Taxe d'abonnement“	7	15,834	20,869	8,792	40,198
Honorare		1,469	1,712	936	3,900
Druck- und Veröffentlichungskosten		653	856	416	1,950
Performancegebühr	5	-	-	9,305	-
Transaktionskosten		96,296	331,104	34,226	131,968
Gebühren für Annahme und Übermittlung von Aufträgen		50,931	-	14,694	-
Zinsen aus Swapgeschäfte		-	-	-	-
Sonstige Kosten	11, 19	35,145	59,805	8,265	24,751
Gesamtsumme der Ausgaben		740,057	1,123,962	378,109	1,233,347
Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums (01.01.2021)		70,937,457	92,948,448	40,418,627	256,084,152
Nettogeschäftsertrag/(-verlust)		546,749	-182,164	532,714	812,811
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Verkauf von Wertpapieren		4,046,277	-2,434,770	1,783,159	-7,273,479
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Devisengeschäften		6,638	6,353	1,087	-44,442
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Devisentermingeschäften		-	-	-	-
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Finanztermingeschäften		-10,469,915	4,512,605	-	208,152
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Optionsgeschäften		-657,330	22,195	-	-
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Swapgeschäften		-	-	-	-
Realisierter Nettogewinn/(-verlust)		-7,074,330	2,106,383	1,784,246	-7,109,769
Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus Wertpapieren		3,536,389	-6,833,694	3,588,543	-29,349,648
Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus Devisentermingeschäften		-	-	-	-
Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus Finanztermingeschäften		1,264,632	2,414,165	-	-67,590
Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus Optionsgeschäften		-833,186	-495,671	-	-
Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus Swapgeschäften		-	-	-	-
Jährliche Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts)		3,967,835	-4,915,200	3,588,543	-29,417,238
Nettoanstieg/(-rückgang) des Nettovermögens infolge des operativen Geschäfts		-2,559,746	-2,990,981	5,905,503	-35,714,196
Nettozeichnungen/(-rücknahmen)		-6,878,252	-7,950,835	-3,322,385	-39,715,607
Ausgewiesene Dividende	13	-	-	-	-
Nettovermögen am Ende des Zeitraums		61,499,459	82,006,632	43,001,745	180,654,349

Die beigegefügt Anmerkungen sind integraler Bestandteil dieses Geschäftsberichts.

	Erläut	Amundi S.F. - EUR Commodities		Konsolidiert	
		30.06.2021 EUR	30.06.2020 EUR	30.06.2021 EUR	30.06.2020 EUR
Erträge					
Nettodividenden	2	-	-	4,113,028	4,458,526
Zinsen aus Wertpapiere	2	435,737	364,611	2,556,517	3,651,645
Zinsen aus Bankkonten	2	4,218	1,311	4,330	4,315
Zinsen aus Swapgeschäfte	2	142	847	192	1,908
Sonstige Erträge	10, 19	52	20	30,466	32,641
Gesamtsumme der Erträge		440,149	366,789	6,704,533	8,149,035
Ausgaben					
Managementgebühren	4	432,606	432,277	2,418,973	3,435,733
Vertriebsgebühren	4	3,293	3,135	6,019	6,502
Depot- und Verwaltungsgebühren	6	45,930	43,045	222,569	289,891
„Taxe d'abonnement“	7	20,405	15,018	136,340	171,986
Honorare		2,678	2,796	14,120	17,499
Druck- und Veröffentlichungskosten		1,190	1,398	6,109	8,609
Performancegebühr	5	-	-	9,305	-
Transaktionskosten		96,907	-	322,550	482,381
Gebühren für Annahme und Übermittlung von Aufträgen		45,372	-	256,223	-
Zinsen aus Swapgeschäfte		33,426	29,454	194,902	42,213
Sonstige Kosten	11, 19	52,723	70,728	191,553	229,210
Gesamtsumme der Ausgaben		734,530	597,851	3,778,663	4,684,024
Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums (01.01.2021)		96,476,837	186,257,422	633,188,017	990,028,826
Nettogeschäftsertrag/(-verlust)		-294,381	-231,062	2,925,870	3,465,011
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Verkauf von Wertpapieren		-529,731	-862,826	4,293,237	-13,832,481
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Devisengeschäften		114,597	60,452	208,659	-35,579
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Devisentermingeschäften		-142,235	122,850	-151,436	122,850
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Finanztermingeschäften		-	-	-8,321,710	4,086,433
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Optionsgeschäften		-	-	-914,132	-137,410
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Swapgeschäften		26,313,009	-26,625,686	25,796,974	-26,589,738
Realisierter Nettogewinn/(-verlust)		25,755,640	-27,305,210	20,911,592	-36,385,925
Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus Wertpapieren		-110,495	154,441	11,186,496	-49,868,638
Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus Devisentermingeschäften		393,284	288,384	396,262	288,384
Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus Finanztermingeschäften		-	-	1,445,899	3,148,986
Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus Optionsgeschäften		-	-	-828,086	-495,671
Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus Swapgeschäften		-5,219,798	-6,562,153	-5,699,229	-6,551,607
Jährliche Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts)		-4,937,009	-6,119,328	6,501,342	-53,478,546
Nettoanstieg/(-rückgang) des Nettovermögens infolge des operativen Geschäfts		20,524,250	-33,655,600	30,338,804	-86,399,460
Nettozeichnungen/(-rücknahmen)		37,207,016	-26,864,830	-24,640,554	-101,049,588
Ausgewiesene Dividende	13	-	-	-1,617	-7,978
Nettovermögen am Ende des Zeitraums		154,208,103	125,736,992	638,884,650	802,571,800

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 entspricht Teil I des geänderten Luxemburger Gesetzes vom 17. Dezember 2010 in Bezug auf Organismen für gemeinsame Anlagen. Es gelten die zum Jahresende wirksamen Managementvorschriften. Sie wurden letztmals am 29. Juni 2018 aktualisiert und am 16. Juli 2018 im *Recueil Electronique des Sociétés et Associations* („RESA“) veröffentlicht.

Der Fonds ist eine Gesellschaft ohne Rechtspersönlichkeit. Ihre Wertpapiere und anderen Vermögenswerte befinden sich in gemeinschaftlichem Eigentum. Sie wird verwaltet von Amundi Luxembourg S.A. (die „Verwaltungsgesellschaft“), einer als Aktiengesellschaft („société anonyme“) gemäß Kapitel 15 des Gesetzes vom 17. Dezember 2010 in seiner jeweils gültigen Fassung organisierten, hundertprozentigen Tochtergesellschaft von Amundi Asset Management S.A.S, eingetragen im Handels- und Unternehmensregister unter Nummer B 57.255 mit eingetragenem Sitz in Luxemburg. Sie wurde am 20. Dezember 1996 auf unbestimmte Zeit gegründet. Die Gesellschaftssatzung wurde am 28. Januar 1997 im *Mémorial* veröffentlicht und letztmals am 1. Januar 2018 geändert.

Die Vermögenswerte der verschiedenen Teilfonds sind separat gemäß ihren jeweiligen Anlagerichtlinien und Anlagezielen investiert. Alle Teilfonds lauten in EUR oder USD (die „Basiswährung“) und alle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten der einzelnen Teilfonds werden in der Basiswährung dieses Teilfonds bewertet. Die Anteilinhaber dürfen Zeichnungen in Euro, US-Dollar und Schweizer Franken vornehmen oder nach einem Beschluss des Verwaltungsrats der Verwaltungsgesellschaft in anderen frei konvertierbaren Währung. Der Nettoinventarwert („NIW“) je Einheit in einer anderen Währung als Euro entspricht der täglichen Umrechnung des NIW je Einheit in Euro.

Der folgende Teilfonds wurde aufgelegt:

Amundi S.F. - SBI FM India Bond am 17. Juni 2021

Zum 30. Juni 2021 waren folgende acht Teilfonds aktiv:

Anleihteilfonds

Amundi S.F. - Euro Curve 1-3year
 Amundi S.F. - Euro Curve 3-5year
 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 Market Plus
 Amundi S.F. - European Equity Optimal Volatility
 Amundi S.F. - European Research

Commodities-Teilfonds

Amundi S.F. - EUR Commodities

In der „Statistischen Aufstellung zu den Einheiten“ werden die einzelnen Anteilklassen zum 30. Juni 2020 detailliert aufgeführt und der letzte Prospekt enthält eine Beschreibung der Anteilklassen.

2 GRUNDSÄTZE DER RECHNUNGSLEGUNG

■ PRÄSENTATION DES GESCHÄFTSBERICHTS

Dieser Geschäftsbericht wird erstellt im Einklang mit den rechtlichen und regulatorischen Anforderungen für Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapiere in Luxemburg und den allgemein anerkannten Grundsätzen der Rechnungslegung in Luxemburg.

Der Geschäftsbericht gibt den Nettoinventarwert („NIW“) wieder, der am letzten Geschäftstag des Zeitraums zu den zuletzt verfügbaren Marktkursen der Anlagen berechnet wurde.

Bewertung von Anlagen und sonstigen Anlagen

für die Preisermittlung gelten folgende Richtlinien:

- **Bewertung von Anlagen** - Anlagen, die an einer Börse oder auf einem regulierten Markt oder auf einem anderen regulierten Markt notiert oder gehandelt werden, werden am entsprechenden Bewertungstag zu dem um 18:00 Luxemburger Zeit zuletzt verfügbaren Kurs bewertet, außer beim 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. Falls vom Portfolio eines Teilfonds am entsprechenden Tag gehaltene Vermögenswerte nicht an einer Börse oder auf einem regulierten Markt oder auf einem anderen regulierten Markt notiert oder gehandelt werden oder falls der zuletzt verfügbare Kurs (ermittelt gemäß dem vorstehenden Absatz) von Vermögenswerten, die an einer Börse notiert oder gehandelt oder auf einem solchen Markt gehandelt werden, nicht dem Marktwert der jeweiligen Vermögenswerte entspricht, basiert der Wert dieser Vermögenswerte auf einem vernünftigerweise vorhersehbaren Verkaufspreis, den der Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft umsichtig und in gutem Glauben ermittelt.
- **Offene und geschlossene OGA** - Einheiten oder Anteile offener OGA werden zu ihrem zuletzt ermittelten und verfügbaren Nettoinventarwert berechnet. Wenn dieser Preis nicht dem Marktwert dieser Vermögenswerte entspricht, ermittelt der Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft den Preis umsichtig und in gutem Glauben. Einheiten oder Anteile eines geschlossenen OGA werden zu ihrem zuletzt verfügbaren Marktwert bewertet.
- **Devisentermingeschäfte** - Devisentermingeschäfte werden zum Terminkurs, der am Datum der „Nettovermögensaufstellung“ gilt, für den Zeitraum bis zu ihrer Fälligkeit bewertet. Nicht realisierte Nettogewinne und -verluste aus Devisentermingeschäften werden in der Aufwands- und Ertragsrechnung 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. Alle Gewinne/(verluste) aus den in abgesicherten Anteilklassen verwendeten Devisentermingeschäften werden ausschließlich der jeweiligen Anteilklasse zugeordnet.
- **Finanztermingeschäfte** - Finanztermingeschäfte werden zum verfügbaren offiziellen Börsenpreis bewertet (gemäß der oben unter „Bewertung von Anlagen“ beschriebenen Richtlinien für die Preisermittlung). 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 Aufwands- und Ertragsrechnung 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.
- **Optionen mit Vorabprämie** - Wenn der Teilfonds einen Option 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 schreibt, erhält er eine Prämie und ein Betrag in Höhe dieser Prämie wird als Verbindlichkeit verbucht.
 Um den aktuellen Marktwert der Optionsgeschäfte wiederzugeben, wird der Vermögenswert bzw. die Verbindlichkeit täglich angepasst.
 Optionsgeschäfte, die an einer Börse oder auf einem regulierten Markt oder an einem anderen regulierten Markt notiert oder gehandelt werden, werden zum Kurs der Börsennotierung bewertet (gemäß der oben unter „Bewertung von Anlagen“ beschriebenen Richtlinien für die Preisermittlung). Außerbörslich gehandelte Optionen werden zum aktuellen täglich von externen Vermittlern berechneten aktuellen Marktpreis bewertet und dieser wird mit dem von der Gegenpartei erhaltenen Betrag verglichen.
 Sollten die letzten verfügbaren Kurse nicht repräsentativ sein, 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, realisiert der Teilfonds einen Gewinn oder Verlust in Höhe der erhaltenen oder gezahlten Prämie. Erhaltene oder gezahlte Prämien und nicht realisierte Nettogewinne und -verluste aus Optionsgeschäften werden in der Aufwands- und Ertragsrechnung unter „Zum Marktwert erworbene Optionen mit Vorabprämie“ oder „Zum Marktwert geschriebene Optionen mit Vorabprämie“ verbucht. Realisierte Nettogewinne/(-verluste) bzw. Veränderungen nicht realisierter Nettogewinne/(-verluste) aus Optionsgeschäften werden unter „Aufwands- und Ertragsrechnung und Veränderungen des Nettovermögens“ verbucht.

- **Termingeschäftartige Optionen** - Termingeschäftartige Optionen werden zum verfügbaren offiziellen Börsenpreis bewertet (gemäß der oben unter „Bewertung von Anlagen“ beschriebenen Richtlinien für die Preisermittlung). 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 Aufwands- und Ertragsrechnung verbucht. Realisierte Nettogewinne/(-verluste) bzw. Veränderungen nicht realisierter Nettogewinne/(-verluste) aus termingeschäftartigen Optionen werden unter „Aufwands- und Ertragsrechnung und Veränderungen des Nettovermögens“ verbucht.
- **Swappeschäfte** - Teilfonds können verschiedenartige Swappeschäfte abschließen, etwa Zinsswaps, Swaptions, Inflationsswaps, Credit Default Swaps und Total Return Swaps. Nicht realisierte Nettogewinne und -verluste aus Swappeschäften werden in der Aufwands- und Ertragsrechnung verbucht. Swappeschäfte werden zum Marktwert bewertet, der umsichtig und in gutem Glauben gemäß den vom Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft festgelegten Verfahren bestimmt. Swappeschäfte werden zum aktuellen Marktpreis am Bewertungsdatum des Nettoinventarwerts bewertet. Der Marktwert basiert auf der Bewertung vertraglich festgelegter Elemente. Er wird anhand von externen Vermittlern, Market-Makern oder internen Modellen gemäß den vom Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft festgelegten Verfahren bestimmt. Effektive Zinskosten/erträge aus Swaps werden vollständig unter „Aufwands- und Ertragsrechnung und Veränderungen des Nettovermögens“ verbucht. Angefallene Kosten/Erträge aus Swaps werden an jedem Bewertungsdatum des Nettoinventarwerts für jedes Swappeschäft saldiert und der Nettosaldo wird unter „Aufwands- und Ertragsrechnung und Veränderungen des Nettovermögens“ je Swap entweder als Swap-Zinskosten oder Swap-Zinsertrag verbucht.
- **Ertrag** - Zinserträge werden auf Tagesbasis verrechnet. Dividenden werden abzüglich der einbehaltenen Quellensteuer ausgewiesen und als Erträge am Tag der Ertrag zum Ex-Tag verbucht.
- **Realisierter Nettogewinn und -verlust** - Der realisierte Nettogewinn und -verlust umfasst den Gewinn oder Verlust aus dem Handel mit Wertpapieren und anderen Anlagen, Finanztermingeschäften, Devisentermingeschäften, Optionen, CFDs, Swaps und anderen Anlagen im Laufe des Jahres und den Unterschieden aus der Anpassung anderer in Fremdwährung lautender Vermögenswerte und Verbindlichkeiten zum Jahresende. Realisierte Nettogewinne- und -verluste werden auf Grundlage der gewichteten Durchschnittskosten der verkauften Anlagen ermittelt. Dies gilt nicht für Termingeschäfte und CFDs, bei denen das FIFO-Verfahren („First-In First-Out“) verwendet wird.
- **Konsolidierter Geschäftsbericht** - Die Zahlen der einzelnen Teilfonds werden in der jeweiligen Basiswährung ausgewiesen. Die Währung des konsolidierten Geschäftsberichts ist der Euro. Der Betrag des Nettovermögens der Teilfonds, der in einer anderen Währung lautet, wird zu den zum am Ende des Zeitraums geltenden Wechselkursen in Euro umgerechnet. Der konsolidierte Geschäftsbericht wird nur zu Informationszwecken vorgelegt.
- **Wertpapierleihgeschäfte** - Teilfonds können Wertpapiere ihres Portfolios einem Entleiher leihen. Bei dieser Transaktion erhält der Teilfonds eine Sicherheit als Garantie. Verliehene Wertpapiere werden an einen externen Makler abgegeben und diese Vermögenswerte werden weiterhin als Bestandteil des Portfolios des Teilfonds bewertet. Am Ende des Leihgeschäfts muss der Teilfonds die erhaltene Sicherheit wieder an den Entleiher zurückgeben. Die Parteien können Leihgeschäfte jederzeit beenden. Je nach Vertragsvereinbarungen entstehen durch Wertpapierleihgeschäfte zusätzliche Erträge für den Teilfonds. Diese Vergütung wird unter „Aufwands- und Ertragsrechnung und Veränderungen des Nettovermögens“ verbucht.

3 VERWENDETE WECHSELKURSE ZUM 30. JUNI 2021

Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, die in anderen Währungen als der Basiswährung des entsprechenden Teilfonds, werden zu den am 30. Juni 2021 geltenden Wechselkursen umgerechnet. Transaktionen in Fremdwährungen werden zu den am Transaktionsdatum geltenden Wechselkursen in die Basiswährung des jeweiligen Teilfonds umgerechnet.

Zum 30. Juni 2021 wurden folgende Wechselkurse verwendet:

1 EUR =		1 EUR =	
1.57965	AUD	131.62305	JPY
5.95070	BRL	1,335.50130	KRW
1.46850	CAD	23.61185	MXN
1.09620	CHF	4.92330	MYR
863.46570	CLP	10.20490	NOK
7.66195	CNH	1.69715	NZD
7.66265	CNY	57.88970	PHP
4,428.15090	COP	4.51475	PLN
25.50700	CZK	4.92450	RON
1.95583	DEM	86.63445	RUB
7.43625	DKK	4.44760	SAR
18.61270	EGP	10.14200	SEK
0.85845	GBP	1.59410	SGD
9.20950	HKD	38.00810	THB
351.03000	HUF	10.30250	TRY
17,195.55050	IDR	33.04215	TWD
3.86425	ILS	1.18590	USD
88.14795	INR	16.93315	ZAR

4 MANAGEMENT-, ANLAGEVERWALTUNGS- UND VERTRIEBSGEBÜHREN

Die Managementgebühr ist ein Prozentanteil des Nettoinventarwerts des jeweiligen Teilfonds. Je nach Teilfonds und Anteilklasse entspricht dies laut Prospekt jährlich 0,25% bis 2,25%.

Die Managementgebühren für Einheiten der Klasse X berechnet die Verwaltungsgesellschaft direkt dem Anteilinhaber und fordert sie von diesem ein. Sie werden nicht den Teilfonds berechnet und kommen nicht im Nettoinventarwert zum Ausdruck.

Zum 30. Juni 2021 wurde eine tatsächliche Managementgebühr in folgender Höhe angewendet:

Teilfonds	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. - Euro Curve 1-3year	0.60%	*	*	0.75%	1.10%	*	0.45%	0.25%	*	0.30%	*	*	*
Amundi S.F. - Euro Curve 3-5year	0.60%	*	*	1.05%	1.60%	*	0.55%	0.40%	*	0.40%	*	*	*
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 Market Plus	0.50%	*	*	0.65%	*	*	0.35%	0.25%	*	*	*	*	*
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. - European Research	1.50%	1.50%	1.50%	1.50%	2.25%	1.50%	0.80%	0.65%	*	0.75%	*	*	*
Amundi S.F. - EUR Commodities	1.00%	*	1.00%	1.00%	1.75%	*	0.55%	0.40%	*	0.55%	*	*	*

*Nicht aufgelegt und/oder nicht anwendbar

Die etwaig anfallende Vertriebsgebühr ist ein Prozentanteil des Nettoinventarwerts des jeweiligen Teilfonds. Je nach Anteilklasse entspricht dies laut Prospekt jährlich 0.00% bis 1.00%.

Zum 30. Juni 2021 wurde eine tatsächliche Vertriebsgebühr in folgender Höhe angewendet:

Teilfonds	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. - Euro Curve 1-3year	*	*	*	*	*	*	*	*	*	*	*	*	*	*
Amundi S.F. - Euro Curve 3-5year	*	*	*	*	*	*	*	*	*	*	*	*	*	*
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 Market Plus	*	*	*	*	*	*	*	*	*	*	*	*	*	*
Amundi S.F. - European Equity Optimal Volatility	*	1.00%	1.00%	*	*	0.50%	*	*	*	*	*	*	*	*
Amundi S.F. - European Research	*	1.00%	1.00%	*	*	0.50%	*	*	*	*	*	*	*	*
Amundi S.F. - EUR Commodities	*	*	1.00%	*	*	*	*	*	*	*	*	*	*	*

*Nicht aufgelegt und/oder nicht anwendbar

Die Managementgebühr und die Vertriebsgebühr werden berechnet und entstehen an jedem Bewertungstag auf Grundlage des Nettoinventarwerts des Teilfonds und der Anteilklasse und sind vierteljährlich rückwirkend fällig.

Die Verwaltungsgesellschaft vergütet die Anlageverwalter im Einklang mit den Managementvorschriften des Fonds aus der an sie zu zahlenden Managementgebühr.

5 PERFORMANCEGEBÜHR

Wenn sich bei bestimmten Anteilklassen bestimmter Teilfonds der Nettoinventarwert je Einheit der Klasse während ihres Performancezeitraums besser entwickelt als der Benchmark oder eine Performancehürde, kann die Verwaltungsgesellschaft eine Performancegebühr erhalten.

Der Performancezeitraum umfasst ein ganzes Kalenderjahr.

Die Performancegebühr beträgt (falls zutreffend und je nach Anteilklasse) höchstens 25%. Sie wird berechnet unter Bezugnahme auf den Anstieg der Vermögenswerte der Klasse über den Anstieg des Benchmarks oder die Performancehürde hinaus, bereinigt um die Zeichnungen und Rücknahmen der entsprechenden Anteilklasse im Performancezeitraum. Für die Berechnung gilt Folgendes:

- 1) bei positiven Benchmark- oder Performanceerträgen erhält die Verwaltungsgesellschaft eine Performancegebühr in Höhe des in Anhang I des Prospekts aufgeführten Prozentanteils der besseren Wertentwicklung, welche die entsprechenden Anteilklassen im Performancezeitraum im Vergleich zu ihrem Benchmark erzielen, vorbehaltlich eines etwaig geltenden Höchststandprinzips (gemäß nachstehender Definition).
- 2) wenn der Benchmark oder die Performancehürde des Teilfonds im Performancezeitraum sinkt, erhält die Verwaltungsgesellschaft eine Performancegebühr in Höhe des in Anhang I des Prospekts aufgeführten Prozentanteils der positiven Performance, welche die entsprechenden Anteilklassen im Performancezeitraum erzielen, vorbehaltlich eines etwaig geltenden Höchststandprinzips (gemäß nachstehender Definition).
- 3) wenn die Performance einer Klasse den Höchststand und den Benchmark oder die Performancehürde übertrifft, die höhere Performance gegenüber dem Höchststand jedoch geringer ist als die höhere Performance gegenüber dem Benchmark oder der Performancehürde, wird die Performancegebühr unter Bezugnahme auf den Anteil der höheren Performance gegenüber dem Höchststand und nicht dem Benchmark oder der Performancehürde berechnet.

Gemäß der Definition im Prospekt wird beim Höchststandprinzip ein Nettoinventarwert je Einheit festgelegt, unter dem keine Performancegebühr gezahlt wird.

Er wird festgelegt zum Nettoinventarwert je Einheit der entsprechenden Klassen, zu dem die letzte Performancegebühr gezahlt wurde oder falls noch nie eine Performancegebühr gezahlt wurde, zum Nettoinventarwert je Einheit, zu dem die Klasse aufgelegt wurde oder falls in dieser Klasse erstmalig eine Performancegebühr eingeführt wird, zum Nettoinventarwert je Einheit der Klasse am Geschäftstag unmittelbar vor dem Datum der Einführung der Performancegebühr für diese Klasse.

Sofern nicht anders festgelegt, werden die Benchmarks oder Performancehürden ohne Abzug von Managementgebühren und anderen Gebühren und Kosten basierend auf einem Total Return Index berechnet.

Bei Einheiten der Klasse F (außer Anleihteilfonds) wird die Performance anhand eines „Preisindex“ berechnet, d. h. die Berechnung der Performance des Benchmark oder der Performancehürde erfolgt abzüglich Dividenden.

Bei Einheiten der Klasse X berechnet die Verwaltungsgesellschaft die Performancegebühr ggf. direkt den Anteilinhabern und fordert sie von diesen ein. Daher kommt sie im Nettoinventarwert nicht zum Ausdruck.

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

Die Depot- und Zahlstelle, die Verwaltungsstelle und die Register- und Transferstelle erhalten für ihre Dienstleistung die nachstehend aufgeführte Gebühr aus den Vermögenswerten der entsprechenden Teilfonds.

- **Depot- und Zahlstelle:** Die Gebühr ist ein Prozentanteil des Portfoliowerts des jeweiligen Teilfonds zu jedem Monatsende. Sie liegt zwischen 0.003% und 1.50% pro Jahr, je nachdem, wo die Vermögenswerte des entsprechenden Teilfonds gehalten werden. Die Berechnung der Gebühr erfolgt zu jedem Bewertungstag und sie ist vierteljährlich rückwirkend fällig.
- **Verwaltungsstelle:** Die Gebühr für die wichtigsten Dienstleistungen entspricht einem jährlichen Prozentsatz von 0,01% und die Berechnung erfolgt zu jedem Bewertungstag auf Grundlage des Nettoinventarwerts des entsprechenden Fonds. Sie ist vierteljährlich rückwirkend fällig.
- **Register- und Transferstelle:** Die Hauptkomponenten der Vergütung der Dienstleistungen sind die Anzahl der aktiven Anteilklassen, die Anzahl der Kundenkonten und die Anzahl der bearbeiteten Transaktionen.

7 BESTEUERUNG DES FONDS - TAXE D'ABONNEMENT

Gemäß der derzeit in Luxemburg geltenden Gesetzgebung unterliegt der Fonds keinen Einkommens- oder Kapitalertragssteuern. Der Fonds unterliegt einer Zeichnungssteuer *Taxe d'abonnement* in Höhe eines jährlichen Prozentsatzes von 0.05% basierend auf dem Nettoinventarwert jedes Teilfonds am Ende jedes Kalenderquartals, die vierteljährlich berechnet und bezahlt wird. Bei Anteilklassen, die sich nur an geeignete institutionelle Anleger richten und bei Teilfonds, deren einziges Ziel die gemeinsame Anlage in Geldmarktinstrumente und Einlagen bei Kreditinstituten ist, verringert sich diese Steuer auf 0.01% des Nettoinventarwerts. Nettovermögen, das in OGA investiert ist, die bereits einer *Taxe d'abonnement* unterliegen, ist gemäß Artikel 175 (a) des geänderten Gesetzes von 17. Dezember 2010 von dieser Steuer befreit.

Möglicherweise unterliegen Zins- und Dividendeneinkünfte des Fonds in den Ursprungsländern einer nicht erstattungsfähigen Quellensteuer.

8 OFFENE POSITIONEN AUS TERMINGESCHÄFTEN

Zum 30. Juni 2021 hatten bestimmte Teilfonds die folgenden Positionen aus Termingeschäften:

■ Amundi S.F. - Euro Curve 1-3year

Anzahl der Kontrakte Kauf/Verkauf	Bezeichnung	Fälligkeits datum	Währung	Nicht realisierter Gewinn/Verlust in EUR
4	EURO BOBL	09-2021	EUR	600.00
-20	EURO BUND	09-2021	EUR	-6,680.00
6	EURO BUXL	09-2021	EUR	3,980.00
18	EURO SCHATZ	09-2021	EUR	-900.00
13	EURO-BTP FUTURE	09-2021	EUR	8,560.00
-12	EURO-OAT FUTURES	09-2021	EUR	-3,150.00
-5	SHORT EURO BTP	09-2021	EUR	-750.00
Gesamt:				1,660.00

■ Amundi S.F. - Euro Curve 3-5year

Anzahl der Kontrakte Kauf/Verkauf	Bezeichnung	Fälligkeits datum	Währung	Nicht realisierter Gewinn/Verlust in EUR
66	EURO BOBL	09-2021	EUR	9,900.00
-26	EURO BUND	09-2021	EUR	-810.00
15	EURO BUXL	09-2021	EUR	6,440.00
23	EURO-BTP FUTURE	09-2021	EUR	19,840.00
-33	EURO-OAT FUTURES	09-2021	EUR	-10,390.00
-9	SHORT EURO BTP	09-2021	EUR	-1,350.00
-21	US 5 YR NOTE FUTURE	10-2021	USD	6,225.41
Gesamt:				29,855.41

■ Amundi S.F. - Euro Curve 7-10year

Anzahl der Kontrakte Kauf/Verkauf	Bezeichnung	Fälligkeits datum	Währung	Nicht realisierter Gewinn/Verlust in EUR
-102	EURO BOBL	09-2021	EUR	-13,090.00
-13	EURO BUND	09-2021	EUR	-5,850.00
37	EURO BUXL	09-2021	EUR	29,860.00
94	EURO-BTP FUTURE	09-2021	EUR	84,980.00
-3	EURO-OAT FUTURES	09-2021	EUR	-1,280.00
-13	SHORT EURO BTP	09-2021	EUR	-1,950.00
-47	US 5 YR NOTE FUTURE	10-2021	USD	13,933.05
Gesamt:				106,603.05

■ Amundi S.F. - Euro Curve 10+year

Anzahl der Kontrakte Kauf/Verkauf	Bezeichnung	Fälligkeits datum	Währung	Nicht realisierter Gewinn/Verlust in EUR
-5	EURO BOBL	09-2021	EUR	-50.00
-77	EURO BUND	09-2021	EUR	2,120.00
32	EURO BUXL	09-2021	EUR	24,700.00
100	EURO-BTP FUTURE	09-2021	EUR	93,500.00
-4	EURO-OAT FUTURES	09-2021	EUR	-1,710.00
-27	SHORT EURO BTP	09-2021	EUR	-4,050.00
-14	US ULTRA BOND CBT	09-2021	USD	-41,536.23
-28	US 5 YR NOTE FUTURE	10-2021	USD	9,506.11
Gesamt:				82,479.88

■ Amundi S.F. - European Equity Market Plus

Anzahl der Kontrakte Kauf/Verkauf	Bezeichnung	Fälligkeits datum	Währung	Nicht realisierter Gewinn/Verlust in EUR
13	EURO STOXX 50	09-2021	EUR	-8,970.00
5	FTSE 100 INDEX	09-2021	GBP	-8,084.34
3	SWISS MKT INDEX FUT	09-2021	CHF	-656.81
			Gesamt:	-17,711.15

■ Amundi S.F. - European Equity Optimal Volatility

Anzahl der Kontrakte Kauf/Verkauf	Bezeichnung	Fälligkeits datum	Währung	Nicht realisierter Gewinn/Verlust in EUR
-2,100	MSCI EUROPE	09-2021	EUR	460,950.00
			Gesamt:	460,950.00

9 OFFENE POSITIONEN AUS DEWSENTERMINKONTRAKTEN

Zum 30. Juni 2021 hatten bestimmte Teilfonds die folgenden offenen Positionen bei Devisenterminkontrakten:

■ Amundi S.F. - Euro Curve 10+year

	Wahrung	Betrag in EUR
Gekaufte Devisen	EUR	1,693,854.16
	Gesamt:	1,693,854.16
Verkaufte Devisen	CAD	1,701,353.59
	Gesamt:	1,701,353.59
	Gesamt:	-7,499.43

Das letzte Ablaufdatum aller offenen Kontrakte ist 29. Juli 2021.

■ Amundi S.F. - SBI FM India Bond

	Wahrung	Betrag in USD
Gekaufte Devisen	INR	2,312,424.60
	Gesamt:	2,312,424.60
Verkaufte Devisen	USD	2,300,000.00
	Gesamt:	2,300,000.00
	Gesamt:	12,424.60

Das letzte Ablaufdatum aller offenen Kontrakte ist 30. September 2021.

■ Amundi S.F. - EUR Commodities

	Wahrung	Betrag in EUR
Gekaufte Devisen	CHF	158,298.25
	EUR	4,021,670.58
	USD	15,498,994.43
	Gesamt:	19,678,963.26
Verkaufte Devisen	CHF	7,448.91
	EUR	15,254,617.97
	USD	4,086,655.69
	Gesamt:	19,348,722.57
	Gesamt:	330,240.69

Das letzte Ablaufdatum aller offenen Kontrakte ist spatestens 12. Juli 2021.

10 SONSTIGE ERTRAGE

Betrage unter „Sonstige Ertrage“ in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und den Veranderungen des Nettovermogens beinhalten verringerte Gebuhren.

11 SONSTIGE AUSGABEN

Salden unter „Sonstige Ausgaben“ in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und den Veranderungen des Nettovermogens beinhalten sonstige Steuern, Zinskosten und Bankgebuhren.

12 KONTOAUSZUG DER PORTFOLIOBEWEGUNGEN

Eine Liste der Veranderungen des Portfolios im Berichtszeitraum bis zum 30. Juni 2021 sind kostenlos am Geschaftssitz der Verwaltungsgesellschaft des Fonds erhaltlich.

Alle Angaben zu den zum 30. Juni 2021 ausstehenden Derivatgeschaften sind in den Anmerkungen zum Geschäftsbericht ausgewiesen.

13 DIVIDENDEN

- **Ausschüttende Klassen:** Diese Klassen schütten je nach entstandenem Nettoertrag taglich einen Betrag aus; die taglichen Betrage werden angehuft und monatlich ausgezahlt.
- **Jahrliche Ausschüttung:** Diese Klassen schütten je nach dem im Vorjahr entstandenem Ertrag jahrlich einen Betrag aus oder sie schütten je nach einem am Auflegungsdatum/zu Jahresbeginn festgelegten jahrlichen Renditeziel eine Dividende aus. Je nach Teilfonds ist der auszuschüttende Ertrag abzuglich Gebuhren oder ohne Abzug von Gebuhren
- **Vierteljahrliches Ausschüttungsziel:** Diese Klassen streben die vierteljahrliche Ausschüttung einer Dividende je nach einem zu Jahresbeginn festgelegten Renditeziel an.
- **Vierteljahrliche Ausschüttung:** Diese Klassen schütten je nach dem im selben Quartal entstandenem Nettoertrag vierteljahrlich einen Betrag aus.

Im Fondsprospekt werden die Richtlinien fur die Ausschüttung von Dividenden genauer beschrieben. Im Laufe des Jahres gab es nur die im Prospekt beschriebenen Ausschüttungen.

14 OPTIONEN

Zum 30. Juni 2021 hatten bestimmte Teilfonds die folgenden offenen Positionen:

OPTIONEN MIT VORABPRÄMIE

Siehe Wertpapierbestand.

TERMINGESCHÄFTARTIGE OPTIONEN

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

Geschäft	Ausübung	Fälligkeits datum	Währung	Anzahl der Optionen
EURO BUXL COMDTY /CALL	213.00	27.08.2021	EUR	100
EURO BUXL COMDTY /CALL	216.00	27.08.2021	EUR	-100

Zum 30. Juni 2021 belief sich der gesamte nicht realisierte Nettogewinn aus termingeschäftartigen Optionen auf EUR 3,000.00.

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

Geschäft	Ausübung	Fälligkeits datum	Währung	Anzahl der Optionen
EURO BUXL COMDTY /CALL	213.00	27.08.2021	EUR	70
EURO BUXL COMDTY /CALL	216.00	27.08.2021	EUR	-70

Zum 30. Juni 2021 belief sich der gesamte nicht realisierte Nettogewinn aus termingeschäftartigen Optionen auf EUR 2,100.00.

15 SWAPGESCHÄFTE

In Anmerkung 14 finden Sie genaue Informationen zu den Sicherheiten.

■ Amundi S.F. - Euro Curve 1-3year

Fälligkeitsdatum	Geschäft	Zugrundeliegender	Sicherheitsbetrag Zinssatz	Gezahlter Satz	Währung	Nominal	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (in der Währung des Teilfonds)
15. Okt. 25	Inflationsswap	-	0.674%	1M CPTFEMU Index	EUR	1,200,000	-45,868.21
Total:							-45,868.21

■ Amundi S.F. - Euro Curve 3-5year

Fälligkeitsdatum	Geschäft	Zugrundeliegender	Sicherheitsbetrag Zinssatz	Gezahlter Satz	Währung	Nominal	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (in der Währung des Teilfonds)
15. Okt. 25	Inflationsswap	-	0.674%	1M CPTFEMU Index	EUR	3,000,000	-114,670.52
Total:							-114,670.52

■ Amundi S.F. - Euro Curve 7-10year

Fälligkeitsdatum	Geschäft	Zugrundeliegender	Sicherheitsbetrag Zinssatz	Gezahlter Satz	Währung	Nominal	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (in der Währung des Teilfonds)
15. Okt. 25	Inflationsswap	-	0.674%	1M CPTFEMU Index	EUR	7,000,000	-267,564.52
Total:							-267,564.52

■ Amundi S.F. - Euro Curve 10+year

Fälligkeitsdatum	Geschäft	Zugrundeliegender	Sicherheitsbetrag Zinssatz	Gezahlter Satz	Währung	Nominal	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (in der Währung des Teilfonds)
15. Okt. 25	Inflationsswap	-	0.674%	1M CPTFEMU Index	EUR	6,000,000	-229,341.01
Total:							-229,341.01

■ Amundi S.F. - EUR Commodities

Fälligkeitsdatum	Geschäft	Zugrundeliegender	Sicherheitsbetrag Zinssatz	Gezahlter Satz	Währung	Nominal	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (in der Währung des Teilfonds)
8. Juli 21	Commodity Index Swap	BBG Cmnty 1M Fwd	-	0.08%	USD	22,000,000	-149,115.15
8. Juli 21	Commodity Index Swap	BBG Commodity	-	0.075%	USD	38,000,000	-327,065.34
8. Juli 21	Commodity Index Swap	BBG Commodity	-	0.065%	USD	43,000,000	-370,080.38
8. Juli 21	Commodity Index Swap	BBG Commodity	-	0.065%	USD	46,000,000	-395,899.96
8. Juli 21	Commodity Index Swap	BBG Commodity	0.065%	-	USD	4,000,000	-84,029.31
8. Juli 21	Commodity Index Swap	BBG Commodity	-	0.065%	USD	5,500,000	84,804.86
8. Juli 21	Commodity Index Swap	BBG Comodity 3M Fwd	-	0.095%	USD	16,000,000	-138,885.71
8. Juli 21	Commodity Index Swap	BBG Comodity 3M Fwd	-	0.095%	USD	3,000,000	46,747.82
8. Juli 21	Commodity Index Swap	BBG Comodity 6M Fwd	-	0.115%	USD	10,000,000	-114,589.64
8. Juli 21	Commodity Index Swap	BBG Comodity 6M Fwd	-	0.12%	USD	5,000,000	-57,295.98
Total:							-1,505,408.79

16 SICHERHEITEN

Zum 30. Juni 2021 wurden für Geschäfte mit außerbörslich gehandelten Derivaten folgende Sicherheiten von Maklern und Gegenparteien erhalten oder von diesen gezahlt:

Teilfonds	Teilfonds Währung	Gegenpartei	Art der Sicherheiten	Erhaltener Sicherheitsbetrag (in der Währung des Teilfonds)	Gezahlter Sicher- heitsbetrag (in der Währung des Teilfonds)
Amundi S.F. - Euro Curve 3-5year	EUR	JP MORGAN CHASE	Bargeldanlagen	-	260,000
Amundi S.F. - Euro Curve 7-10year	EUR	JP MORGAN CHASE	Bargeldanlagen	-	300,000
Amundi S.F. - Euro Curve 10+year	EUR	JP MORGAN CHASE	Bargeldanlagen	-	270,000
Amundi S.F. - EUR Commodities	EUR	JP MORGAN, MACQUARIE, SOCIETE GENERALE	Bargeldanlagen	-	1,840,000

17 TRANSAKTIONSKOSTEN

Die im Zeitraum 2021 im Zusammenhang mit dem Erwerb oder Verkauf von Finanzinstrumenten angefallenen Transaktionskosten des Teilfonds sind unter „Aufwands- und Ertragsrechnung und Veränderungen des Nettovermögens“ in einer speziellen Kostenzeile aufgeführt. Transaktionskosten umfassen direkt in Verbindung mit dem Kauf oder Verkauf von Finanzinstrumenten stehende Kosten, soweit diese Kosten in Transaktionsbestätigungen separat ausgewiesen werden.

Bei einigen Anlageklassen sind Transaktionskosten in der Regel in den Handelspreisen enthalten und werden nicht separat ausgewiesen.

Je nach Art der Anlage des Teilfonds kann dies dazu führen, dass bei einigen Teilfonds im Abschnitt zu den Transaktionskosten keine Daten aufgeführt sind.

Transaktionen im Zusammenhang mit Wertpapierleihgeschäften und die damit verbundenen Kosten sind in diesen Zahlen nicht enthalten.

18 RICHTLINIE FÜR VERTRETUNGSSTIMMRECHTE

Die Verwaltungsgesellschaft verfügt über eine Richtlinie für Vertretungsstimmrechte. Diese ermöglicht die Ausübung von Stimmrechten in Verbindung mit den Wertpapieren des Portfolios. Die Verwaltungsgesellschaft zielt darauf ab, Vertretungsstimmen im besten Interesse des Fonds abzugeben. Bei Vertretungsstimmrechten werden die kurz- und langfristigen wirtschaftlichen Auswirkungen des Vorschlags auf den Wert des Portfoliobestands in Betracht gezogen. Allgemein ist die Verwaltungsgesellschaft der Ansicht, dass die Unterstützung der Unternehmensstrategie und die Zustimmung zu Vorschlägen des Managements den Wert des Portfolios steigern. Gelegentlich können vom Management vorgebrachte Vorschläge diesen Wert jedoch beeinträchtigen und dies kann die Stimmen beeinflussen, welche die Verwaltungsgesellschaft abgibt.

Die Verwaltungsgesellschaft übt Stimmrechte im Einklang mit der Richtlinie für Vertretungsstimmrechte oder einer anderen autorisierten Richtlinie aus. Dies gilt auch, wenn beauftragte Anlageverwalter dazu autorisiert sind, über Wertpapiere des Portfolios abzustimmen. Die Verwaltungsgesellschaft und/oder der Anlageverwalter können die Dienstleistungen eines unabhängigen Dritten in Anspruch nehmen. Dieser kann bei der Analyse von Vertretern mitwirken, Empfehlungen für Aktionärsversammlungen abgeben, Aufzeichnungen führen und Abstimmungsdienste bereitstellen, unter der Voraussetzung, dass der Dienstleister seine Dienste im Einklang mit der Richtlinie für Vertretungsstimmrechte erbringt.

19 SAMMELKLAGEN

Eine Sammelklage ermöglicht einer Gruppe von Anlegern, bei Verlusten eine finanzielle Entschädigung von einem Unternehmen oder öffentlichen Einrichtung einzufordern.

Die Verwaltungsgesellschaft hat zwei unabhängige Unternehmen damit beauftragt, sie bei Aktivitäten im Zusammenhang mit Sammelklagen mit ihren Diensten zu unterstützen und eine globale Reichweite zu gewährleisten.

Im Geschäftsbericht werden die im Voraus gezahlten Kosten der Dienste in Verbindung mit der Portfolioanalyse, der Erfassung der Depotdaten und der Unterstützung bei anderen Aktivitäten im Zusammenhang mit Sammelklagen unter „Sonstige Ausgaben“ verbucht.

Die nach Beilegung der Sammelklage erhaltenen Beträge werden im Geschäftsbericht unter „Sonstige Erträge“ verbucht.

Im Zeitraum, der am 30. Juni 2021 endete, wurden keine Erträge aus dieser Aktivität verzeichnet.

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:

BNP PARIBAS SECURITIES SERVICES, Paris,
succursale de Zurich, Selnastrasse 16,
CH-8002 Zürich CH, Schweiz

Die Zahlstelle in der Schweiz ist:

BNP PARIBAS SECURITIES SERVICES, Paris,
succursale de Zurich, Selnastrasse 16,
CH-8002 Zürich CH, Schweiz

Veröffentlichungen

Die Satzung des Fonds, der Verkaufsprospekt, die Dokumente mit wesentlichen Anlegerinformationen, die Liste der Käufe und Verkäufe und die Jahres- und Halbjahresberichte können kostenlos unter folgender Adresse angefordert werden:

BNP PARIBAS SECURITIES SERVICES, Paris,
succursale de Zurich, Selnastrasse 16,
CH-8002 Zürich CH, 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 %
Euro Curve 1-3year	EUR	LU0271690827	Klasse A Jährliche Ausschüttung	0.80%	-
	EUR	LU0271690744	Klasse A Keine Ausschüttung	0.80%	-
	EUR	LU0271690660	Klasse E Keine Ausschüttung	0.96%	-
	EUR	LU0279958614	Klasse F Keine Ausschüttung	1.32%	-
	EUR	LU0271691122	Klasse H Jährliche Ausschüttung	0.65%	-
	EUR	LU0332132637	Klasse H Keine Ausschüttung	0.64%	-
	EUR	LU0433266359	Klasse I Keine Ausschüttung	0.40%	-
	EUR	LU1706854749	Klasse R Jährliche Ausschüttung	0.46%	-
	EUR	LU1706853691	Klasse R Keine Ausschüttung	0.47%	-
Euro Curve 3-5year	EUR	LU0281584838	Klasse A Jährliche Ausschüttung	0.83%	-
	EUR	LU0367809836	Klasse A Keine Ausschüttung	0.82%	-
	EUR	LU0271691478	Klasse E Keine Ausschüttung	1.29%	-
	EUR	LU0279958887	Klasse F Keine Ausschüttung	1.84%	-
	EUR	LU0332132553	Klasse H Keine Ausschüttung	0.77%	-
	EUR	LU0400221809	Klasse I Keine Ausschüttung	0.59%	-
	EUR	LU1706853774	Klasse R Keine Ausschüttung	0.62%	-
Euro Curve 7-10year	EUR	LU0536711285	Klasse A Ausschüttung	0.82%	-
	EUR	LU0536711103	Klasse A Jährliche Ausschüttung	0.82%	-
	EUR	LU0367810172	Klasse A Keine Ausschüttung	0.82%	-
	EUR	LU0536711442	Klasse C Keine Ausschüttung	2.12%	-
	EUR	LU0857391824	Klasse E Vierteljährliches Ausschüttungsziel	1.29%	-
	EUR	LU0271693920	Klasse E Keine Ausschüttung	1.29%	-
	EUR	LU0271694654	Klasse F Keine Ausschüttung	1.84%	-
	EUR	LU0332132041	Klasse H Keine Ausschüttung	0.77%	-
	EUR	LU0433266433	Klasse I Keine Ausschüttung	0.56%	-
	EUR	LU1706854665	Klasse R Ausschüttung	0.59%	-
	EUR	LU1706853857	Klasse R Keine Ausschüttung	0.61%	-

Amundi S.F	Währung	Isin	Anteilklassen	TER %	Performance Gebühr %
Euro Curve 10+year	EUR	LU0281585215	Klasse A Jährliche Ausschüttung	0.86%	-
	EUR	LU0857391741	Klasse E Vierteljährliche Zielausschüttung	1.32%	-
	EUR	LU0271691981	Klasse E Keine Ausschüttung	1.33%	-
	EUR	LU0271692013	Klasse F Keine Ausschüttung	1.87%	-
	EUR	LU0332132397	Klasse H Keine Ausschüttung	0.80%	-
SBI FM India Bond	EUR	LU0433266516	Klasse I Keine Ausschüttung	0.60%	-
	USD	LU2251232760	Klasse A Keine Ausschüttung*	1.86%	-
	USD	LU2251232844	Klasse A2 Keine Ausschüttung*	2.06%	-
	USD	LU2338645448	Klasse H Keine Ausschüttung*	1.17%	-
	USD	LU2251232927	Klasse I Keine Ausschüttung*	0.85%	-
European Equity Market Plus	USD	LU2251233065	Klasse I2 - Keine Ausschüttung*	0.93%	-
	CHF	LU0536711871	Klasse A Keine Ausschüttung	0.67%	-
	EUR	LU0380935170	Klasse A Keine Ausschüttung	0.67%	-
	EUR	LU0285097662	Klasse E Keine Ausschüttung	0.82%	-
	EUR	LU0383420295	Klasse H Keine Ausschüttung	0.52%	-
European Equity Optimal Volatility	EUR	LU1619842302	Klasse I Keine Ausschüttung	0.36%	-
	EUR	LU1920531883	Klasse A Keine Ausschüttung	1.87%	-
	USD	LU1920531966	Klasse A Keine Ausschüttung	1.87%	-
	EUR	LU1920532345	Klasse C Keine Ausschüttung	2.87%	-
	USD	LU190532261	Klasse C Keine Ausschüttung	2.87%	-
	EUR	LU1920532428	Klasse E Keine Ausschüttung	1.89%	-
	EUR	LU1920532691	Klasse F Keine Ausschüttung	2.64%	-
	EUR	LU1920532774	Klasse G Keine Ausschüttung	2.39%	-
	EUR	LU1920532857	Klasse H Keine Ausschüttung	1.17%	-
	EUR	LU1920533079	Klasse I Keine Ausschüttung	0.87%	-
European Research	USD	LU1920532931	Klasse I Keine Ausschüttung	0.87%	-
	EUR	LU1920533152	Klasse R Keine Ausschüttung	1.06%	-
	EUR	LU1920533400	Klasse A Keine Ausschüttung	1.74%	0.00%
	USD	LU1920533236	Klasse A Keine Ausschüttung	1.74%	0.00%
	EUR	LU1920533582	Klasse B Keine Ausschüttung*	2.81%	-
	USD	LU1920533665	Klasse B Keine Ausschüttung*	2.81%	-
	EUR	LU1920533749	Klasse C Keine Ausschüttung	2.73%	-
	EUR	LU1920533822	Klasse E Keine Ausschüttung	1.76%	-
	EUR	LU1920534044	Klasse F Keine Ausschüttung	2.68%	0.18%
	EUR	LU1920534127	Klasse G Keine Ausschüttung	2.25%	-
EUR Commodities	EUR	LU1920534390	Klasse H Keine Ausschüttung	1.03%	-
	EUR	LU1920534473	Klasse I Keine Ausschüttung	0.84%	-
	USD	LU1920534556	Klasse I Keine Ausschüttung	0.84%	-
	EUR	LU1920534630	Klasse R Keine Ausschüttung	0.93%	-
	CHF	LU1694769693	Klasse A Abgesichert Keine Ausschüttung	1.30%	-
	USD	LU1694769859	Klasse A Abgesichert Keine Ausschüttung	1.31%	-
	EUR	LU0271695388	Klasse A Keine Ausschüttung	1.21%	-
	USD	LU1694769933	Klasse B Abgesichert Keine Ausschüttung*	2.76%	-
	USD	LU1694770196	Klasse C Abgesichert Keine Ausschüttung	2.30%	-
	EUR	LU0372625102	Klasse C Keine Ausschüttung	2.20%	-
	EUR	LU0273973874	Klasse E Keine Ausschüttung	1.22%	-
	EUR	LU0273974336	Klasse F Keine Ausschüttung	1.97%	-
	EUR	LU0484923635	Klasse H Jährliche Ausschüttung	0.68%	-
USD	LU1772191695	Klasse H Abgesichert Keine Ausschüttung	0.86%	-	
EUR	LU0271872185	Klasse H Keine Ausschüttung	0.78%	-	
EUR	LU1694770352	Klasse I Jährliche Ausschüttung	0.56%	-	
USD	LU0419230916	Klasse I Abgesichert Keine Ausschüttung	0.65%	-	
EUR	LU0271695461	Klasse I Keine Ausschüttung	0.57%	-	
USD	LU1706854582	Klasse R Abgesichert Keine Ausschüttung	0.85%	-	
EUR	LU1706853931	Klasse R Keine Ausschüttung	0.75%	-	

* In bestimmten Fällen kann es sein, dass die auf jährlicher Grundlage (Referenzzeitraum von 6 Monaten) berechnete Gesamtkostenquote nicht den wahren Wert repräsentiert (wenn ein Teilfonds in den letzten 6 Monaten übernommen, liquidiert oder aufgelegt wurde, wenn eine Anteilklasse in den letzten 6 Monaten aufgelegt oder liquidiert wurde, wenn die verwalteten Vermögenswerte für eine Anteilklasse in den letzten 6 Monaten deutlich gestiegen oder gefallen sind oder wenn in einer Klasse nur wenige Vermögenswerte verwaltet werden).

VERORDNUNG ÜBER WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTE

Im Zuge der Verordnung 2015/2365 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 25. November 2015 über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften unterlagen dieser Verordnung zum 30. Juni 2021 nur Transaktionen mit reversen Pensionsgeschäften, Pensionsgeschäften, Wertpapierleihgeschäften und Performance Swaps.

■ Total Return Swaps

Amundi S.F. - EUR Commodities	
Betrag der Total Return Swaps in absoluten Zahlen (in der Währung des Teilfonds)	1,768,514.15
Anteil des verwalteten Vermögens	1.15%
Laufzeit der Total Return Swaps aufgeschlüsselt nach folgenden Laufzeitbändern	
Weniger als ein Tag	-
Ein Tag bis eine Woche	-
Eine Woche bis ein Monat	1,768,514.15
Ein bis drei Monate	-
Drei Monate bis ein Jahr	-
Mehr als ein Jahr	-
Offene Laufzeit	-
Total	1,768,514.15
Gegenpartei	
Name der Gegenpartei, Land des Sitzes der Gegenpartei und Bruttovolumen ausstehender Transaktionen	MACQUARIE (AUS) 538,000.80 JP MORGAN CHASE (US)512,698.87 SOCIETE GENERALE (FR) 717,814.98
Angaben zu den Sicherheiten	
<i>Art der Sicherheiten</i>	
Bargeldanlagen	Siehe Anmerkung 16
Wertpapiere	-
<i>Qualität der Sicherheiten</i>	
Rating	-
Laufzeit der Sicherheiten aufgeschlüsselt nach folgenden Laufzeitbändern (in der Währung des Teilfonds)	
Weniger als ein Tag	Siehe Anmerkung 16
Ein Tag bis eine Woche	-
Eine Woche bis ein Monat	-
Ein bis drei Monate	-
Drei Monate bis ein Jahr	-
Mehr als ein Jahr	-
Offene Laufzeit	-
Total	Siehe Anmerkung 16
Verwahrung der vom Fonds im Rahmen von Total Return Swaps gewährten Sicherheiten	
Name der Depotstelle	SOCIETE GENERALE
Bargeldanlagen	SOCIETE GENERALE
Wertpapiere	-
Verwahrung der vom Fonds im Rahmen von Total Return Swaps gewährten Sicherheiten	
Anteil der gehaltenen Sicherheit	-
Daten zu Erträgen und Kosten von Total Return Swaps	
Im Berichtszeitraum entstandene Erträge und Kosten aus Total Return Swaps (in der Währung des Teilfonds)	18,579,522.51

Alle Transaktionen sind bilaterale Transaktionen.

Der ISDA-Rahmenvertrag gilt für alle außerbörslich gehandelten Derivatgeschäfte, auch für vom Teilfonds durchgeführte Total Return Swaps. Ein ISDA-Rahmenvertrag ist eine bilaterale Vereinbarung zwischen dem Teilfonds und einer Gegenpartei. Sie gilt für außerbörslich gehandelte Derivatgeschäfte einschließlich Total Return Swaps. Das gesamte Engagement in außerbörslich gehandelten Derivaten wird zusammen saldiert und besichert. Aus diesem Grund erfolgen Angaben zu Sicherheiten von Total Return Swaps unter Bezugnahme auf Anmerkung 14 des Geschäftsberichts. Diese enthält und berücksichtigt alle vom Teilfonds durchgeführten außerbörslich gehandelten Derivatgeschäfte.

Die erhaltenen Sicherheiten werden verwahrt und nicht wiederverwendet.

Kontakt Daten

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

Tel.: 352 2686 8080

www.amundi.lu/amundi-funds