

S700

ISIN: AT0000A1E2A5 (A)

ISIN: AT0000727383 (T)

Allianz Invest Kapitalanlagegesellschaft mbH

Halbjahresbericht

vom 01.01.2018 – 30.06.2018

www.allianzinvest.at



Allgemeines zur Allianz Invest Kapitalanlagegesellschaft mbH

Gesellschaft	Allianz Invest Kapitalanlagegesellschaft mbH Hietzinger Kai 101-105, 1130 Wien Tel: 01/ 505 54 80; Fax: 01/ 505 54 81
Gründung	29. April 1991
Gesellschafter	Allianz Investmentbank AG
Aufsichtsrat	Dr. Harald Lankisch (Vorsitzender) Univ.-Prof. Dr. Christian Nowotny (Vorsitzender-Stellvertreter) RA Dr. Corvin Hummer Dkfm. Reinhard Pinzer Wolfgang Jerabek (Mitarbeitervertreter) Mag. Daniel Planer (Mitarbeitervertreter)
Geschäftsführung	Michael Bode Mag. Christian Ramberger
Prokuristen	Mag. Doris Kals Mag. Anton Kuzmanoski Mag. Jan Fellmayer
Staatskommissär Staatskommissärstellvertreter	Mag. Heidrun Zanetta AD Thomas Galee
Prüfer	KPMG Austria GmbH Wirtschaftsprüfungs- und Steuerberatungsgesellschaft
Depotbank	Allianz Investmentbank AG

Zusammensetzung des Fondsvermögens per 30. Juni 2018

1. Wertpapiere	EUR	%
Amtlich notierte Wertpapiere		
Anleihen		
EUR	30.912.010,82	80,66
Zerobonds		
EUR	1.626.099,10	4,24
Neuemissionen		
Anleihen		
EUR	2.785.915,57	7,27
Zerobonds		
EUR	1.265.137,82	3,30
Strips		
EUR	1.407.660,26	3,67
Summe Wertpapiere	37.996.823,57	99,14
2. Bankguthaben/ -verbindlichkeiten		
EUR	174.447,47	0,46
Summe Bankguthaben/ -verbindlichkeiten	174.447,47	0,46
3. Abgrenzungen		
Anteilige Erträge (aus Wertpapieren/Bankguthaben) und Aufwendungen	155.013,16	0,40
Fondsvermögen	38.326.284,20	100,00

Darstellung der Fondsdaten zum Berichtsstichtag:

Fondsdaten in EUR	per 31.12.2017	per 30.06.2018
Fondsvolumen gesamt	46.147.266,11	38.326.284,20
Errechneter Wert je Ausschüttungsanteil	179,32	178,47
Ausgabepreis je Ausschüttungsanteil	182,91	182,04
Errechneter Wert je Thesaurierungsanteil	187,28	186,37
Ausgabepreis je Thesaurierungsanteil	191,03	190,10

Ausschüttung/Auszahlung in EUR	per 19.04.2018
Ausschüttung je Ausschüttungsanteil	0,5797
Auszahlung je Thesaurierungsanteil	0,6055

Umlaufende Anteile zum Berichtsstichtag:

Ausschüttungsanteile	128.010
Thesaurierungsanteile	83.064
Gesamt umlaufende Anteile per 30.06.2018	211.074

Überblick über die ausgewiesenen Erträge und Fondsentwicklung der letzten Rechnungsjahre in EUR:

Datum	Fonds- vermögen gesamt	Errechneter Wert je Ausschüttungs- anteil	Ausschüttung je Anteil	Anteile	Wertent- wicklung in %
23.04.15	144.099.662,77	190,55	-	10	-
31.12.15	133.831.095,74	185,55	5,55	128.010	-
31.12.16	45.362.096,98	186,41	6,6800	128.010	3,47
31.12.17	46.147.266,11	179,32	0,5797	128.010	-0,18
30.06.18	38.326.284,20	178,47	-	128.010	-

Datum	Errechneter Wert je Thesaurierungs- anteil	Zur Thesaurierung verwendeter Betrag	Auszahlung je Anteil	Anteile	Wertent- wicklung in %
31.12.14	183,65	4,68	1,07	518.703	13,11
31.12.15	185,54	8,23	2,13	593.290	1,59
31.12.16	189,81	6,36	2,1517	113.268	3,46
31.12.17	187,28	1,60	0,6055	123.840	-0,19
30.06.18	186,37	-	-	83.064	-

Anteilswertermittlung und Wertpapierbewertung

Der Wert eines Anteiles ergibt sich aus der Teilung des Gesamtwertes des Investmentfonds einschließlich der Erträge durch die Zahl der Anteile. Der Gesamtwert des Investmentfonds ist aufgrund der jeweiligen Kurswerte der zu ihm gehörigen Wertpapiere, Geldmarktinstrumente und Bezugsrechte zuzüglich des Wertes der zum Fonds gehörenden Finanzanlagen, Geldbeträge, Guthaben, Forderungen und sonstigen Rechte abzüglich Verbindlichkeiten, von der Depotbank zu ermitteln.

Das Nettovermögen wird nach folgenden Grundsätzen ermittelt:

- a) Der Wert von Vermögenswerten, welche an einer Börse oder an einem anderen geregelten Markt notiert oder gehandelt werden, wird grundsätzlich auf der Grundlage des letzten verfügbaren Kurses ermittelt, welcher bei der letzten Preisberechnung vor dem Stichtag verwendet wurde.
- b) Sofern ein Vermögenswert nicht an einer Börse oder an einem anderen geregelten Markt notiert oder gehandelt wird oder sofern für einen Vermögenswert, welcher an einer Börse oder an einem anderen geregelten Markt notiert oder gehandelt wird, der Kurs den tatsächlichen Marktwert nicht angemessen widerspiegelt, wird auf die Kurse zuverlässiger Datenprovider oder alternativ auf Marktpreise gleichartiger Wertpapiere oder andere anerkannte Bewertungsmethoden zurückgegriffen.

Es besteht das Risiko, dass aufgrund von Kursbildungen auf illiquiden Märkten die Bewertungskurse bestimmter Wertpapiere von ihren tatsächlichen Veräußerungen abweichen können (Bewertungsrisiko).

Berechnung des Gesamtrisikos

Die Berechnung des Gesamtrisikos erfolgt nach dem Commitment Approach.

Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Gesamtrendite-Swaps

Wertpapierleihegeschäfte im Sinne der VO (EU) 2015/2365 (The Regulation on Transparency of Securities Financing Transactions and of Reuse) dürfen für den Fonds nicht eingesetzt werden. Wertpapierleihegeschäfte wurden deshalb nicht eingesetzt.

Pensionsgeschäfte im Sinne der VO (EU) 2015/2365 (The Regulation on Transparency of Securities Financing Transactions and of Reuse) dürfen für den Fonds nicht eingesetzt werden. Pensionsgeschäfte wurden deshalb nicht eingesetzt.

Total Return Swaps (Gesamtrendite-Swaps) im Sinne der VO (EU) 2015/2365 (The Regulation on Transparency of Securities Financing Transactions and of Reuse) dürfen für den Fonds nicht eingesetzt werden. Total Return Swaps wurden deshalb nicht eingesetzt.

Vermögensaufstellung für den S700 per 30. Juni 2018

ISIN		Zugang	Abgang	Stand am 30.06.2018	Tageskurs	Kurswert EUR	Anteil in %
Amtlich notierte Wertpapiere							
Anleihen							
Währung: EUR							
AT0000386115	3,900 REPUBLIC OF AUSTRIA GOVERNMENT BOND 15.07.20	180.000,00	-200.000,00	80.000,00	109,234500	87.387,60	0,23
AT0000A0U3T4	3,400 REPUBLIC OF AUSTRIA GOVERNMENT BOND 22.11.22	250.000,00	-50.000,00	350.000,00	116,312500	407.093,75	1,06
AT0000A185T1	1,650 REPUBLIC OF AUSTRIA GOVERNMENT BOND 21.10.24	275.000,00	-125.000,00	200.000,00	109,935000	219.870,00	0,57
AT0000A1K9F1	1,500 REPUBLIC OF AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20.02.47	430.000,00	-150.000,00	280.000,00	101,533000	284.292,40	0,74
AT0000A1VGK0	0,500 REPUBLIC OF AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20.04.27	435.000,00	-100.000,00	335.000,00	100,196499	335.658,27	0,88
BE0000318270	3,750 KINGDOM OF BELGIUM GOVERNMENT BOND 28.09.20	525.000,00	-200.000,00	425.000,00	109,693499	466.197,37	1,22
BE0000334434	0,800 KINGDOM OF BELGIUM GOVERNMENT BOND 22.06.25	340.000,00	-150.000,00	340.000,00	103,749000	352.746,60	0,92
BE0000338476	1,600 KINGDOM OF BELGIUM GOVERNMENT BOND 22.06.47	570.000,00	-150.000,00	420.000,00	98,267498	412.723,49	1,08
BE0000339482	0,200 KINGDOM OF BELGIUM GOVERNMENT BOND 22.10.23	630.000,00	-180.000,00	450.000,00	101,258000	455.661,00	1,19
DE0001102374	0,500 BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND 15.02.25	1.500.000,00	-700.000,00	950.000,00	103,739500	985.525,25	2,57
DE0001102432	1,250 BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND 15.08.48	900.000,00	-250.000,00	650.000,00	105,159000	683.533,50	1,78
DE0001104677	0,000 BUNDESSCHATZANWEISUNGEN 15.03.19	1.000.000,00	-800.000,00	200.000,00	100,501000	201.002,00	0,52
DE0001104685	0,000 BUNDESSCHATZANWEISUNGEN 14.06.19	500.000,00	0,00	500.000,00	100,666000	503.330,00	1,31
DE0001141737	0,000 BUNDESOBLIGATION 09.04.21	2.100.000,00	-650.000,00	1.450.000,00	101,705500	1.474.729,75	3,85
ES00000126B2	2,750 SPAIN GOVERNMENT BOND 31.10.24	1.300.000,00	-475.000,00	925.000,00	112,742000	1.042.863,50	2,72
ES00000128C6	2,900 SPAIN GOVERNMENT BOND 31.10.46	750.000,00	-255.000,00	620.000,00	107,945000	669.259,00	1,75
ES00000128X2	0,050 SPAIN GOVERNMENT BOND 31.01.21	1.300.000,00	-390.000,00	910.000,00	100,346000	913.148,60	2,38
ES0000012A89	1,450 SPAIN GOVERNMENT BOND 31.10.27	2.110.000,00	-595.000,00	1.515.000,00	101,387499	1.536.020,61	4,01
ES0000012A97	0,450 SPAIN GOVERNMENT BOND 31.10.22	800.000,00	-240.000,00	560.000,00	100,912500	565.110,00	1,47
FI4000047089	1,625 FINLAND GOVERNMENT BOND 15.09.22	100.000,00	-50.000,00	100.000,00	108,209500	108.209,50	0,28
FI4000079041	2,000 FINLAND GOVERNMENT BOND 15.04.24	120.000,00	-55.000,00	115.000,00	111,616000	128.358,40	0,33
FI4000106117	0,375 FINLAND GOVERNMENT BOND 15.09.20	200.000,00	-50.000,00	150.000,00	102,169500	153.254,25	0,40
FI4000242870	1,375 FINLAND GOVERNMENT BOND 15.04.47	70.000,00	-25.000,00	45.000,00	103,629489	46.633,27	0,12
FI4000278551	0,500 FINLAND GOVERNMENT BOND 15.09.27	225.000,00	-60.000,00	165.000,00	100,036000	165.059,40	0,43
FR0012517027	0,500 FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT 25.05.25	1.925.000,00	-825.000,00	1.650.000,00	102,102000	1.684.683,00	4,40
FR0013257524	2,000 FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT 25.05.48	1.650.000,00	-450.000,00	1.200.000,00	108,921000	1.307.052,00	3,41
FR0013283686	0,000 FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT 25.03.23	2.350.000,00	-850.000,00	1.500.000,00	100,701000	1.510.515,00	3,94
FR0013286192	0,750 FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT 25.05.28	3.540.000,00	-1.175.000,00	2.365.000,00	101,030500	2.389.371,32	6,23
IE00B2QTFG59	4,400 IRELAND GOVERNMENT BOND 18.06.19	200.000,00	-50.000,00	150.000,00	104,670000	157.005,00	0,41
IE00B4TV0D44	5,400 IRELAND GOVERNMENT BOND 13.03.25	110.000,00	-60.000,00	150.000,00	133,565000	200.347,50	0,52
IE00BDHDPQ37	0,000 IRELAND GOVERNMENT BOND 18.10.22	140.000,00	-45.000,00	95.000,00	100,601495	95.571,42	0,25
IE00BJ38CQ36	0,800 IRELAND GOVERNMENT BOND 15.03.22	40.000,00	-45.000,00	95.000,00	103,946495	98.749,17	0,26
IE00BV8C9186	2,000 IRELAND GOVERNMENT BOND 18.02.45	65.000,00	-30.000,00	85.000,00	107,039000	90.983,15	0,24
IT0005162828	2,700 ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 01.03.47	1.425.000,00	-325.000,00	1.100.000,00	88,219000	970.409,00	2,53
IT0005246340	1,850 ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 15.05.24	1.550.000,00	-700.000,00	850.000,00	98,148500	834.262,25	2,18
IT0005250946	0,350 ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 15.06.20	2.600.000,00	-400.000,00	2.200.000,00	99,044000	2.178.968,00	5,69
IT0005274805	2,050 ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 01.08.27	3.975.000,00	-1.150.000,00	2.825.000,00	94,637000	2.673.495,25	6,98
IT0005277444	0,900 ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 01.08.22	2.900.000,00	-900.000,00	2.000.000,00	96,953500	1.939.070,00	5,06
NL0009348242	3,500 NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 15.07.20	150.000,00	-100.000,00	250.000,00	108,632500	271.581,25	0,71
NL0010418810	1,750 NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 15.07.23	150.000,00	-300.000,00	50.000,00	110,006500	55.003,25	0,14
NL0010721999	2,750 NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 15.01.47	290.000,00	-100.000,00	215.000,00	142,250000	305.837,50	0,80
NL0010733424	2,000 NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 15.07.24	270.000,00	-250.000,00	170.000,00	112,397500	191.075,75	0,50
NL0011896857	0,000 NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 15.01.22	650.000,00	-175.000,00	475.000,00	101,538499	482.307,87	1,26
NL0012171458	0,750 NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 15.07.27	800.000,00	-175.000,00	625.000,00	103,391499	646.196,87	1,69
PTOTEBEO0020	4,100 PORTUGAL OBRIGACOES DO TESOURO OT 15.02.45	90.000,00	-25.000,00	65.000,00	122,175477	79.414,06	0,21
PTOTEKOE0011	2,875 PORTUGAL OBRIGACOES DO TESOURO OT 15.10.25	280.000,00	-90.000,00	190.000,00	111,050500	210.995,95	0,55
PTOTESOE0013	2,200 PORTUGAL OBRIGACOES DO TESOURO OT 17.10.22	280.000,00	-40.000,00	240.000,00	107,717500	258.522,00	0,67
PTOTEYOE0007	3,850 PORTUGAL OBRIGACOES DO TESOURO OT 15.04.21	175.000,00	-100.000,00	75.000,00	110,569000	82.926,75	0,22
	Summe EUR					30.912.010,82	80,66
Zerobonds							
Währung: EUR							
FR0013157096	0,000 FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT 25.05.21	2.500.000,00	-1.100.000,00	1.600.000,00	101,631194	1.626.099,10	4,24
	Summe EUR					1.626.099,10	4,24
Neuemissionen							
Anleihen							
Währung: EUR							
BE0000345547	0,800 KINGDOM OF BELGIUM GOVERNMENT BOND 22.06.28	975.000,00	-325.000,00	650.000,00	100,682000	654.433,00	1,71
DE0001102440	0,500 BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND 15.02.28	2.750.000,00	-950.000,00	1.800.000,00	101,744500	1.831.401,00	4,78
IE00BDHDP44	0,900 IRELAND GOVERNMENT BOND 15.05.28	210.000,00	-60.000,00	150.000,00	100,639000	150.958,50	0,39
PTOTEV0E0018	2,125 PORTUGAL OBRIGACOES DO TESOURO OT 17.10.28	195.000,00	-50.000,00	145.000,00	102,843497	149.123,07	0,39
	Summe EUR					2.785.915,57	7,27
Zerobonds							
Währung: EUR							
DE0001141778	0,000 BUNDESOBLIGATION 14.04.23	1.500.000,00	-550.000,00	950.000,00	101,455824	963.830,33	2,51
ES0L01905105	0,000 SPAIN LETRAS DEL TESORO 10.05.19	300.000,00	0,00	300.000,00	100,435830	301.307,49	0,79
	Summe EUR					1.265.137,82	3,30
Strips							
Währung: EUR							
FR0124909666	0,000 FRANCE TREASURY BILL BTF 22.05.19	1.300.000,00	0,00	1.300.000,00	100,567062	1.307.371,81	3,41

PTPBT5GE0034	0,00 PORTUGAL TREASURY BILL 17.05.19	100.000,00	0,00	100.000,00	100,288450	100.288,45	0,26
	Summe EUR					1.407.660,26	3,67

Gesamtsumme Wertpapiere						37.996.823,57	99,14
-------------------------	--	--	--	--	--	---------------	-------

Während des Berichtszeitraumes getätigte Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, soweit sie nicht in der Vermögensaufstellung genannt wurden:

Währung: EUR

AT0000383864	6,250 REPUBLIC OF AUSTRIA GOVERNMENT BOND 15.07.27	0,00	-100.000,00
AT0000A001X2	3,500 REPUBLIC OF AUSTRIA GOVERNMENT BOND 15.09.21	0,00	-100.000,00
AT0000A04967	4,150 REPUBLIC OF AUSTRIA GOVERNMENT BOND 15.03.37	50.000,00	-175.000,00
AT0000A08968	4,350 REPUBLIC OF AUSTRIA GOVERNMENT BOND 15.03.19	0,00	-200.000,00
AT0000A0DXC2	4,850 REPUBLIC OF AUSTRIA GOVERNMENT BOND 15.03.26	0,00	-150.000,00
AT0000A0N9A0	3,650 REPUBLIC OF AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20.04.22	0,00	-100.000,00
AT0000A0U299	3,800 REPUBLIC OF AUSTRIA GOVERNMENT BOND 26.01.62	0,00	-75.000,00
AT0000A0VRQ6	3,150 REPUBLIC OF AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20.06.44	0,00	-100.000,00
AT0000A105W3	1,750 REPUBLIC OF AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20.10.23	0,00	-100.000,00
AT0000A12B06	1,150 REPUBLIC OF AUSTRIA GOVERNMENT BOND 19.10.18	100.000,00	-100.000,00
AT0000A1K9C8	0,750 REPUBLIC OF AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20.10.26	0,00	-100.000,00
BE0000291972	5,500 KINGDOM OF BELGIUM GOVERNMENT BOND 28.03.28	0,00	-250.000,00
BE0000304130	5,000 KINGDOM OF BELGIUM GOVERNMENT BOND 28.03.35	0,00	-225.000,00
BE0000308172	4,000 KINGDOM OF BELGIUM GOVERNMENT BOND 28.03.22	0,00	-200.000,00
BE0000320292	4,250 KINGDOM OF BELGIUM GOVERNMENT BOND 28.03.41	0,00	-100.000,00
BE0000321308	4,250 KINGDOM OF BELGIUM GOVERNMENT BOND 28.09.21	0,00	-100.000,00
BE0000324336	4,500 KINGDOM OF BELGIUM GOVERNMENT BOND 28.03.26	50.000,00	-100.000,00
BE0000325341	4,250 KINGDOM OF BELGIUM GOVERNMENT BOND 28.09.22	0,00	-300.000,00
BE0000326356	4,000 KINGDOM OF BELGIUM GOVERNMENT BOND 28.03.32	0,00	-50.000,00
BE0000331406	3,750 KINGDOM OF BELGIUM GOVERNMENT BOND 22.06.45	0,00	-125.000,00
BE0000332412	2,600 KINGDOM OF BELGIUM GOVERNMENT BOND 22.06.24	0,00	-150.000,00
BE0000336454	1,900 KINGDOM OF BELGIUM GOVERNMENT BOND 22.06.38	0,00	-100.000,00
BE0000337460	1,000 KINGDOM OF BELGIUM GOVERNMENT BOND 22.06.26	0,00	-100.000,00
BE0000340498	2,150 KINGDOM OF BELGIUM GOVERNMENT BOND 22.06.66	25.000,00	-75.000,00
BE0000341504	0,800 KINGDOM OF BELGIUM GOVERNMENT BOND 22.06.27	0,00	-150.000,00
BE0312761332	0,000 KINGDOM OF BELGIUM TREASURY BILL 13.12.18	100.000,00	-100.000,00
DE0001102309	1,500 BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND 15.02.23	0,00	-100.000,00
DE0001102325	2,000 BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND 15.08.23	0,00	-100.000,00
DE0001102333	1,750 BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND 15.02.24	0,00	-250.000,00
DE0001102341	2,500 BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND 15.08.46	0,00	-250.000,00
DE0001102358	1,500 BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND 15.05.24	0,00	-150.000,00
DE0001102366	1,000 BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND 15.08.24	0,00	-100.000,00
DE0001102382	1,000 BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND 15.08.25	0,00	-200.000,00
DE0001102390	0,500 BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND 15.02.26	0,00	-150.000,00
DE0001102408	0,000 BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND 15.08.26	0,00	-350.000,00
DE0001102416	0,250 BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND 15.02.27	0,00	-350.000,00
DE0001104669	0,000 BUNDESCHATZANWEISUNGEN 14.12.18	600.000,00	-600.000,00
DE0001134922	6,250 BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND 04.01.24	0,00	-100.000,00
DE0001135069	5,625 BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND 04.01.28	0,00	-200.000,00
DE0001135143	6,250 BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND 04.01.30	0,00	-50.000,00
DE0001135176	5,500 BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND 04.01.31	0,00	-250.000,00
DE0001135226	4,750 BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND 04.07.34	0,00	-150.000,00
DE0001135275	4,000 BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND 04.01.37	0,00	-200.000,00
DE0001135366	4,750 BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND 04.07.40	0,00	-100.000,00
DE0001135390	3,250 BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND 04.01.20	0,00	-100.000,00
DE0001135408	3,000 BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND 04.07.20	0,00	-400.000,00
DE0001135424	2,500 BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND 04.01.21	0,00	-100.000,00
DE0001135432	3,250 BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND 04.07.42	0,00	-250.000,00
DE0001135440	3,250 BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND 04.07.21	0,00	-500.000,00
DE0001135457	2,250 BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND 04.09.21	0,00	-300.000,00
DE0001135465	2,000 BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND 04.01.22	0,00	-50.000,00
DE0001135473	1,750 BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND 04.07.22	0,00	-500.000,00
DE0001135481	2,500 BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND 04.07.44	0,00	-100.000,00
DE0001135499	1,500 BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND 04.09.22	0,00	-350.000,00
DE0001141711	0,000 BUNDESobligation 17.04.20	0,00	-100.000,00
DE0001141729	0,250 BUNDESobligation 16.10.20	0,00	-250.000,00
DE0001141745	0,000 BUNDESobligation 08.10.21	0,00	-50.000,00
ES0000011868	6,000 SPAIN GOVERNMENT BOND 31.01.29	0,00	-225.000,00
ES00000120N0	4,900 SPAIN GOVERNMENT BOND 30.07.40	0,00	-150.000,00
ES00000121G2	4,800 SPAIN GOVERNMENT BOND 31.01.24	0,00	-300.000,00
ES00000121S7	4,700 SPAIN GOVERNMENT BOND 30.07.41	150.000,00	-250.000,00
ES00000122E5	4,650 SPAIN GOVERNMENT BOND 30.07.25	0,00	-300.000,00
ES00000123B9	5,500 SPAIN GOVERNMENT BOND 30.04.21	0,00	-250.000,00
ES00000123C7	5,900 SPAIN GOVERNMENT BOND 30.07.26	0,00	-200.000,00
ES00000123K0	5,850 SPAIN GOVERNMENT BOND 31.01.22	0,00	-400.000,00
ES00000123U9	5,400 SPAIN GOVERNMENT BOND 31.01.23	0,00	-250.000,00
ES00000123X3	4,400 SPAIN GOVERNMENT BOND 31.10.23	0,00	-150.000,00
ES0000012411	5,750 SPAIN GOVERNMENT BOND 30.07.32	0,00	-250.000,00
ES00000124H4	5,150 SPAIN GOVERNMENT BOND 31.10.44	150.000,00	-200.000,00
ES00000124V5	2,750 SPAIN GOVERNMENT BOND 30.04.19	0,00	-1.000.000,00
ES00000126C0	1,400 SPAIN GOVERNMENT BOND 31.01.20	150.000,00	-650.000,00
ES00000126Z1	1,600 SPAIN GOVERNMENT BOND 30.04.25	0,00	-100.000,00
ES00000127A2	1,950 SPAIN GOVERNMENT BOND 30.07.30	0,00	-150.000,00
ES00000127G9	2,150 SPAIN GOVERNMENT BOND 31.10.25	0,00	-100.000,00
ES00000127Z9	1,950 SPAIN GOVERNMENT BOND 30.04.26	0,00	-100.000,00
ES00000128B8	0,750 SPAIN GOVERNMENT BOND 30.07.21	0,00	-200.000,00

ES00000128E2	3,450 SPAIN GOVERNMENT BOND 30.07.66	0,00	-75.000,00
ES00000128H5	1,300 SPAIN GOVERNMENT BOND 31.10.26	0,00	-325.000,00
ES00000128P8	1,500 SPAIN GOVERNMENT BOND 30.04.27	0,00	-200.000,00
ES0000012932	4,200 SPAIN GOVERNMENT BOND 31.01.37	0,00	-200.000,00
ES0L01901187	0,000 SPAIN LETRAS DEL TESORO 18.01.19	650.000,00	-650.000,00
FI4000006176	4,000 FINLAND GOVERNMENT BOND 04.07.25	0,00	-50.000,00
FI4000010848	3,375 FINLAND GOVERNMENT BOND 15.04.20	0,00	-100.000,00
FI4000020961	3,500 FINLAND GOVERNMENT BOND 15.04.21	0,00	-50.000,00
FI4000037635	2,750 FINLAND GOVERNMENT BOND 04.07.28	0,00	-100.000,00
FI4000046545	2,625 FINLAND GOVERNMENT BOND 04.07.42	0,00	-50.000,00
FI4000062625	1,500 FINLAND GOVERNMENT BOND 15.04.23	0,00	-100.000,00
FI4000197959	0,500 FINLAND GOVERNMENT BOND 15.04.26	0,00	-50.000,00
FR0000187635	5,750 FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT 25.10.32	0,00	-175.000,00
FR0000571085	8,500 FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT 25.04.23	50.000,00	-150.000,00
FR0000571150	6,000 FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT 25.10.25	0,00	-300.000,00
FR0000571218	5,500 FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT 25.04.29	0,00	-400.000,00
FR0010070060	4,750 FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT 25.04.35	0,00	-350.000,00
FR0010171975	4,000 FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT 25.04.55	75.000,00	-225.000,00
FR0010192997	3,750 FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT 25.04.21	0,00	-300.000,00
FR0010371401	4,000 FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT 25.10.38	0,00	-100.000,00
FR0010466938	4,250 FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT 25.10.23	0,00	-450.000,00
FR0010773192	4,500 FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT 25.04.41	0,00	-400.000,00
FR0010854182	3,500 FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT 25.04.20	0,00	-800.000,00
FR0010870956	4,000 FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT 25.04.60	50.000,00	-200.000,00
FR0010916924	3,500 FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT 25.04.26	0,00	-350.000,00
FR0010949651	2,500 FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT 25.10.20	0,00	-200.000,00
FR0011059088	3,250 FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT 25.10.21	0,00	-250.000,00
FR0011196856	3,000 FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT 25.04.22	0,00	-350.000,00
FR0011317783	2,750 FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT 25.10.27	300.000,00	-500.000,00
FR0011337880	2,250 FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT 25.10.22	0,00	-250.000,00
FR0011461037	3,250 FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT 25.05.45	0,00	-200.000,00
FR0011486067	1,750 FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT 25.05.23	0,00	-250.000,00
FR0011619436	2,250 FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT 25.05.24	100.000,00	-250.000,00
FR0011883966	2,500 FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT 25.05.30	0,00	-550.000,00
FR0011962398	1,750 FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT 25.11.24	100.000,00	-200.000,00
FR0011993179	0,500 FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT 25.11.19	0,00	-750.000,00
FR0012968337	0,250 FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT 25.11.20	0,00	-200.000,00
FR0013131877	0,500 FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT 25.05.26	0,00	-300.000,00
FR0013154028	1,750 FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT 25.05.66	25.000,00	-50.000,00
FR0013200813	0,250 FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT 25.11.26	0,00	-500.000,00
FR0013219177	0,000 FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT 25.05.22	0,00	-400.000,00
FR0124747561	0,000 FRANCE TREASURY BILL BTF 04.01.19	1.100.000,00	-1.100.000,00
FR0124747579	0,000 FRANCE TREASURY BILL BTF 30.01.19	600.000,00	-600.000,00
FR0124747587	0,000 FRANCE TREASURY BILL BTF 27.02.19	1.200.000,00	-1.200.000,00
IE00B6089D15	5,900 IRELAND GOVERNMENT BOND 18.10.19	0,00	-250.000,00
IE00B60Z6194	5,000 IRELAND GOVERNMENT BOND 18.10.20	0,00	-50.000,00
IE00B6X95T99	3,400 IRELAND GOVERNMENT BOND 18.03.24	0,00	-100.000,00
IE00BJ38CR43	2,400 IRELAND GOVERNMENT BOND 15.05.30	0,00	-50.000,00
IE00BV8C9418	1,000 IRELAND GOVERNMENT BOND 15.05.26	0,00	-100.000,00
IE00BV8C9B83	1,700 IRELAND GOVERNMENT BOND 15.05.37	0,00	-50.000,00
IT0000366655	9,000 ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 01.11.23	250.000,00	-700.000,00
IT0001086567	7,250 ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 01.11.26	0,00	-150.000,00
IT0001174611	6,500 ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 01.11.27	0,00	-250.000,00
IT0001278511	5,250 ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 01.11.29	0,00	-150.000,00
IT0001444378	6,000 ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 01.05.31	0,00	-500.000,00
IT0003256820	5,750 ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 01.02.33	0,00	-150.000,00
IT0003535157	5,000 ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 01.08.34	0,00	-400.000,00
IT0003644769	4,500 ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 01.02.20	0,00	-550.000,00
IT0003934657	4,000 ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 01.02.37	0,00	-150.000,00
IT0004009673	3,750 ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 01.08.21	0,00	-350.000,00
IT0004286966	5,000 ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 01.08.39	0,00	-50.000,00
IT0004356843	4,750 ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 01.08.23	100.000,00	-700.000,00
IT0004423957	4,500 ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 01.03.19	0,00	-300.000,00
IT0004489610	4,250 ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 01.09.19	0,00	-200.000,00
IT0004513641	5,000 ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 01.03.25	0,00	-350.000,00
IT0004532559	5,000 ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 01.09.40	0,00	-300.000,00
IT0004536949	4,250 ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 01.03.20	0,00	-300.000,00
IT0004695075	4,750 ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 01.09.21	0,00	-100.000,00
IT0004759673	5,000 ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 01.03.22	0,00	-500.000,00
IT0004801541	5,500 ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 01.09.22	0,00	-450.000,00
IT0004848831	5,500 ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 01.11.22	0,00	-50.000,00
IT0004923998	4,750 ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 01.09.44	0,00	-200.000,00
IT0004992308	2,500 ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 01.05.19	0,00	-450.000,00
IT0005001547	3,750 ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 01.09.24	0,00	-200.000,00
IT0005024234	3,500 ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 01.03.30	0,00	-300.000,00
IT0005028003	2,150 ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 15.12.21	0,00	-50.000,00
IT0005030504	1,500 ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 01.08.19	0,00	-200.000,00
IT0005069395	1,050 ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 01.12.19	0,00	-200.000,00
IT0005083057	3,250 ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 01.09.46	0,00	-150.000,00
IT0005090318	1,500 ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 01.06.25	0,00	-150.000,00
IT0005107708	0,700 ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 01.05.20	0,00	-550.000,00
IT0005127086	2,000 ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 01.12.25	0,00	-250.000,00
IT0005170839	1,600 ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 01.06.26	0,00	-250.000,00
IT0005175598	0,450 ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 01.06.21	0,00	-200.000,00

IT0005210650	1,250 ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 01.12.26	0,00	-350.000,00
IT0005217390	2,800 ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 01.03.67	0,00	-100.000,00
IT0005273013	3,450 ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 01.03.48	100.000,00	-100.000,00
IT0005320178	0,000 ITALY BUONI ORDINARI DEL TESORO BOT 14.01.19	800.000,00	-800.000,00
IT0005323362	0,000 ITALY BUONI ORDINARI DEL TESORO BOT 14.02.19	700.000,00	-700.000,00
IT0005326597	0,000 ITALY BUONI ORDINARI DEL TESORO BOT 14.03.19	1.100.000,00	-1.100.000,00
NL0000102234	4,000 NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 15.01.37	25.000,00	-175.000,00
NL0000102317	5,500 NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 15.01.28	0,00	-150.000,00
NL0009446418	3,750 NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 15.01.42	0,00	-100.000,00
NL0009712470	3,250 NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 15.07.21	150.000,00	-300.000,00
NL0010060257	2,250 NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 15.07.22	0,00	-250.000,00
NL0010071189	2,500 NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 15.01.33	25.000,00	-75.000,00
NL0010881827	0,250 NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 15.01.20	0,00	-50.000,00
NL0011220108	0,250 NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 15.07.25	0,00	-100.000,00
NL0011819040	0,500 NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 15.07.26	0,00	-200.000,00
PTPBT3GE0036	0,000 PORTUGAL TREASURY BILL 18.01.19	100.000,00	-100.000,00
SI0002103388	3,000 SLOVENIA GOVERNMENT BOND 08.04.21	50.000,00	-50.000,00
SI0002103602	2,250 SLOVENIA GOVERNMENT BOND 03.03.32	100.000,00	-100.000,00
SI0002103685	1,250 SLOVENIA GOVERNMENT BOND 22.03.27	100.000,00	-100.000,00
SK4120009762	3,625 SLOVAKIA GOVERNMENT BOND 16.01.29	100.000,00	-100.000,00
SK4120012220	0,625 SLOVAKIA GOVERNMENT BOND 22.05.26	100.000,00	-100.000,00