

KAPITALVERWALTUNGSGESELLSCHAFT:



RP Gamma

HALBJAHRESBERICHT

ZUM 30. JUNI 2018

VERWAHRSTELLE:



Niederlassung Frankfurt am Main

ASSET MANAGEMENT:

RP Crest

Halbjahresbericht RP Gamma

Vermögensübersicht zum 30.06.2018

Anlageschwerpunkte	Tageswert in EUR	% Anteil am Fondsvermögen
I. Vermögensgegenstände	654.634.168,07	101,20
1. Anleihen	618.264.774,10	95,58
< 1 Jahr	374.062.783,06	57,83
>= 1 Jahr bis < 3 Jahre	221.870.592,84	34,30
>= 3 Jahre bis < 5 Jahre	22.331.398,20	3,45
2. Investmentanteile EUR	34.088.850,00 34.088.850,00	5,27 5,27
3. Derivate	-22.602.881,17	-3,49
4. Bankguthaben	21.191.639,08	3,28
5. Sonstige Vermögensgegenstände	3.691.786,06	0,57
II. Verbindlichkeiten	-7.793.278,91	-1,20
III. Fondsvermögen	646.840.889,15	100,00

Halbjahresbericht RP Gamma

Vermögensaufstellung zum 30.06.2018

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2018	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Bestandspositionen							EUR	652.353.624,10	100,85
Börsengehandelte Wertpapiere							EUR	572.581.375,77	88,52
Verzinsliche Wertpapiere							EUR	572.581.375,77	88,52
1,6250 % Banco Santander Totta S.A. EO-M.-T.Obr.Hipotecárias14(19)	PTBSQEOE0029		EUR	8.000	0	0 %	101,508	8.120.613,60	1,26
1,8750 % Bank Nederlandse Gemeenten EO-Medium-Term Notes 2012(19)	XS0789996245		EUR	11.000	11.000	0 %	102,155	11.236.995,00	1,74
0,5000 % Bank of Nova Scotia, The EO-M.-T. Mortg.Cov.Bds 15(20)	XS1264790939		EUR	10.000	0	0 %	101,409	10.140.940,00	1,57
3,8750 % Bank of Scotland PLC EO-Medium-Term Bonds 2005(20)	XS0212074388		EUR	10.000	0	0 %	106,628	10.662.773,00	1,65
1,2500 % Belfius Bank S.A. EO-Cov.Med.-Term Nts 2014(19)	BE0002459346		EUR	5.500	0	0 %	100,900	5.549.522,00	0,86
1,5000 % Berlin Hyp AG Hyp.-Pfandbr. v.13(20) Ser.175	DE000BHY1414		EUR	7.000	0	0 %	103,272	7.229.048,40	1,12
0,0000 % Berlin Hyp AG Hyp.-Pfandbr. v.16(19) Ser.197	DE000BHY0BD2		EUR	30.000	30.000	0 %	100,250	30.075.060,00	4,65
1,0000 % BNP Paribas Home Loan SFH EO-Med.-T.Obl.Fin.Hab.2014(19)	FR0011757434		EUR	25.000	0	0 %	100,861	25.215.267,50	3,90
1,7500 % BPCE SFH EO-Med.-T.Obl.Fin.Hab.2012(19)	FR0011362151		EUR	5.000	0	0 %	102,909	5.145.471,00	0,80
3,3750 % BPER Banca S.p.A. EO-Mortg.Cov.MTN 2013(18)	IT0004965346		EUR	5.000	0	0 %	101,005	5.050.250,00	0,78
0,2500 % Bundesrep.Deutschland Bundesobl.Ser.170 v.2014(19)	DE0001141703		EUR	15.000	0	0 %	101,204	15.180.547,50	2,35
0,2500 % Bundesrep.Deutschland Bundesobl.Ser.172 v.2015(20)	DE0001141729		EUR	27.000	0	0 %	102,078	27.560.925,00	4,26
1,1250 % Cais. Ctr. du Crd. Imm. France EO-Medium-Term Notes 2014(19)	XS1057307487		EUR	5.500	0	0 %	101,190	5.565.439,00	0,86
0,1000 % Canadian Imperial Bk of Comm. EO-Med.-T. Cov.Notes 2015(18)	XS1332474912		EUR	5.000	0	0 %	100,192	5.009.600,00	0,77
4,3750 % Cie de Financement Foncier EO-Med.-T.Obl.Foncières 07(19)	FR0010464321		EUR	55.000	40.000	0 %	103,795	57.087.360,00	8,83
0,3750 % Commerzbank AG MTH S.P5 v.14(19)	DE000CZ40KE5		EUR	20.000	0	0 %	100,895	20.179.048,00	3,12
4,3750 % Commerzbank AG MTN-HPF.Em.2308 v.09(2019)	DE000EH1A311		EUR	15.000	5.000	0 %	104,708	15.706.207,50	2,43
1,3750 % Commonwealth Bank of Australia EO-Mortg.Cov.Med.-T.Nts 14(19)	XS1015892182		EUR	3.000	0	0 %	100,935	3.028.062,00	0,47
2,8750 % Credit Suisse (Guernsey Br.) EO-Med.-T.Hyp.Pf.-Br.2011(18)	XS0692723553		EUR	21.300	0	0 %	100,940	21.500.177,40	3,32
1,0000 % Credit Suisse (Guernsey Br.) EO-Med.-T.Hyp.Pf.-Br.2014(19)	XS1044479373		EUR	20.000	0	0 %	100,901	20.180.120,00	3,12
4,1250 % Danske Bank AS EO-Med.-Term Cov.Bds 2009(19)	XS0469000144		EUR	10.000	0	0 %	106,188	10.618.837,00	1,64
3,3750 % DB Privat-u.Firmenkundenbk AG Hyp.Pfbrief MTN 03/20 v10(20)	DE000A0WMBH0		EUR	4.000	0	0 %	106,475	4.259.001,60	0,66
4,8750 % DEPFA ACS BANK DAC EO-Medium-Term Nts 2004(19)	DE000A0BCLA9		EUR	5.000	0	0 %	104,420	5.220.979,50	0,81
0,6250 % Deutsche Hypothekenbank MTN-HPF S.438 v.14(19)	DE000DHY4382		EUR	6.000	0	0 %	101,044	6.062.628,60	0,94
1,3750 % Dexia Crédit Local S.A. EO-Medium-Term Notes 2014(19)	XS1045697494		EUR	10.000	0	0 %	102,065	10.206.530,00	1,58
0,2000 % Dexia Crédit Local S.A. EO-Medium-Term Notes 2015(18)	XS1268552061		EUR	7.000	0	5.500 %	100,032	7.002.212,00	1,08
1,8750 % DNB Boligkreditt A.S. EO-Mortg. Covered MTN 2012(19)	XS0794233865		EUR	10.000	0	0 %	102,100	10.210.041,00	1,58
1,1250 % DNB Boligkreditt A.S. EO-Mortg. Covered MTN 2013(18)	XS0992304369		EUR	5.000	0	0 %	100,535	5.026.760,00	0,78

Halbjahresbericht RP Gamma

Vermögensaufstellung zum 30.06.2018

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2018	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
2,7500 % DNB Boligkreditt A.S. EO-MTN Hyp.-Pfandbr,2012(22)	XS0759310930		EUR	6.000	0	0	% 110,050	6.602.983,20	1,02
2,0000 % Eika Boligkreditt A.S. EO-Med.-Term Cov. Nts 2012(19)	XS0794570944		EUR	8.900	0	0	% 102,211	9.096.791,46	1,41
0,1000 % Hamburger Sparkasse AG Pfandbr.Ausg.30 v.2016(2022)	DE000A2AAPV8		EUR	5.000	0	0	% 100,472	5.023.576,00	0,78
0,6250 % HSH Nordbank AG HYPF v.14(19) SER.2171	DE000HSH4S28		EUR	5.000	0	0	% 100,782	5.039.099,50	0,78
1,1250 % Länsförsäkringar Hypotek AB EO-Cov.Med.-T.Nts 2013(20)	XS0926822189		EUR	10.000	0	0	% 102,485	10.248.530,00	1,58
1,7500 % Münchener Hypothekenbank MTN-HPF Ser.1546 v.12(22)	DE000MHB06J1		EUR	10.000	0	0	% 107,048	10.704.839,00	1,65
1,1250 % Münchener Hypothekenbank MTN-OPF Ser.1633 v.2013(2018)	DE000MHB11J1		EUR	30.000	0	10.000	% 100,378	30.113.520,00	4,66
0,7500 % Nationwide Building Society EO-Medium-Term Notes 2014(19)	XS1081041557		EUR	35.000	35.000	0	% 101,033	35.361.539,50	5,47
1,2500 % NIBC Bank N.V. EO-Mortg. Cov. MTN 2014(19)	XS1054163347		EUR	10.000	0	0	% 101,167	10.116.700,00	1,56
1,1250 % Norddeutsche Landesbank -GZ- MTN-Flugzeugpfandbr.v.14(19)	XS1033923142		EUR	5.000	0	0	% 100,788	5.039.410,00	0,78
0,0250 % Norddeutsche Landesbank -GZ- OPF-MTN 2015(2019)	XS1191428652		EUR	20.000	0	0	% 100,217	20.043.400,00	3,10
0,8750 % Nordrhein-Westfalen, Land Landessch.v.14(19) R.1309	DE000NRW0FC1		EUR	14.000	0	0	% 101,992	14.278.853,40	2,21
1,7500 % Nykredit Realkredit A/S EO-Med.-Term Cov.Bds 2013(19)	LU0996352158		EUR	7.000	0	0	% 101,132	7.079.268,00	1,09
0,7500 % OP-Asuntoluottopankki Oyj EO-Cov. Med.-Term Nts 2014(19)	XS1076088001		EUR	5.000	5.000	0	% 101,017	5.050.835,00	0,78
1,2500 % Royal Bank of Canada EO-Med.-Term Nts 2013(18)Reg.S	XS0986254455		EUR	5.800	0	0	% 100,516	5.829.928,00	0,90
1,5000 % SpareBank 1 Boligkreditt AS EO-Med.-Term Cov. Bds 2013(20)	XS0942804351		EUR	5.300	0	0	% 103,336	5.476.792,63	0,85
2,7500 % SpareBank 1 Boligkreditt AS EO-Med.-Term Cov.Nts 2012(19)	XS0738895373		EUR	5.000	0	0	% 101,785	5.089.230,00	0,79
1,2500 % Sparebanken Vest Boligkred. AS EO-Med.-Term Hyp.Pf. 2014(19)	XS1015552836		EUR	5.000	0	0	% 100,847	5.042.350,00	0,78
1,5000 % Landesbank Baden-Württemberg DL-MTN-Pfbr.765 v.16(19)REG-S	DE000LB09QM2		USD	11.000	0	0	% 98,840	9.313.313,48	1,44

An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere

EUR 45.683.398,33 7,06

Verzinsliche Wertpapiere

EUR 45.683.398,33 7,06

0,3750 % DNB Boligkreditt A.S. EO-Mortg. Covered MTN 2014(19)	XS1117515871		EUR	5.000	0	0	% 100,839	5.041.941,00	0,78
1,0000 % Sparkasse Hannover Öff.Pfdbr.R.1 13(18)	DE000A1YCRK5		EUR	1.800	0	0	% 100,447	1.808.038,62	0,28
1,2500 % Sparkasse Holstein Hyp.Pfandbr.Nr.2 v.2014(2020)	DE000A11QDT2		EUR	5.000	0	0	% 102,414	5.120.681,00	0,79
0,8750 % United States of America DL-Notes 2012(19)	US912828TH30		USD	40.000	40.000	0	% 98,391	33.712.737,71	5,21

Halbjahresbericht RP Gamma

Vermögensaufstellung zum 30.06.2018

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2018	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Investmentanteile							EUR	34.088.850,00	5,27
Gruppenfremde Investmentanteile							EUR	34.088.850,00	5,27
Xtrackers MSCI World Swap Inhaber-Anteile 1C o.N.	LU0274208692		ANT	675.000	675.000	0	EUR 50,502	34.088.850,00	5,27
Summe Wertpapiervermögen							EUR	652.353.624,10	100,85
Derivate							EUR	-22.602.881,17	-3,49
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)									
Aktienindex-Derivate							EUR	-20.380.998,30	-3,15
Forderungen/Verbindlichkeiten									
Aktienindex-Terminkontrakte							EUR	2.960.849,53	0,46
FUTURE SPI 200 INDEX 09.18 ASX		226	AUD	Anzahl	-599			221.371,14	0,03
FUTURE SMI 09.18 EUREX		185	CHF	Anzahl	-632			-750.767,91	-0,12
FUTURE DAX (PERFORMANCE-INDEX) 09.18 EUREX		185	EUR	Anzahl	-264			233.262,50	0,04
FUTURE EURO STOXX 50 PR.EUR 09.18 EUREX		185	EUR	Anzahl	-5449			2.066.200,00	0,32
FUTURE FTSE/MIB INDEX 09.18 IDEM		609	EUR	Anzahl	-645			399.025,00	0,06
FUTURE HANG SENG INDEX 07.18 HKFE		456	HKD	Anzahl	-512			-1.637.997,49	-0,25
FUTURE CBOE VIX 08.18 CFE		AD1	USD	Anzahl	-300			-397.986,98	-0,06
FUTURE E-MINI S+P 500 INDEX 09.18 CME		352	USD	Anzahl	-1341			2.155.051,82	0,33
FUTURE EM NR USD 09.18 EUREX		185	USD	Anzahl	-875			109.045,74	0,02
FUTURE MSCI WORLD NR USD 09.18 EUREX		185	USD	Anzahl	-2275			563.645,71	0,09
Optionsrechte							EUR	-23.341.847,83	-3,61
Optionsrechte auf Aktienindices							EUR	-23.341.847,83	-3,61
S+P/ASX 200 INDEX PUT 19.07.18 BP 6200,00 ASX		226		Anzahl	-33000	AUD	62,100	-1.297.271,63	-0,20
SMI PUT 20.07.18 BP 8550,00 EUREX		185		Anzahl	-15000	CHF	90,000	-1.164.797,24	-0,18

Halbjahresbericht RP Gamma

Vermögensaufstellung zum 30.06.2018

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2018	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
DAX(PERF.-INDEX) PUT 20.07.18 BP 12500,00 EUREX			185	Anzahl -10000			EUR 278,400	-2.784.000,00	-0,43
ESTX 50 PR.EUR PUT 20.07.18 BP 3450,00 EUREX			185	Anzahl -40000			EUR 74,500	-2.980.000,00	-0,46
ESTX 50 PR.EUR PUT 20.07.18 BP 3475,00 EUREX			185	Anzahl -40000			EUR 91,000	-3.640.000,00	-0,56
FTSE MIB INDEX PUT 20.07.18 BP 21500,00 IDEM			609	Anzahl -3000			EUR 340,000	-1.020.000,00	-0,16
FTSE MIB INDEX PUT 20.07.18 BP 22000,00 IDEM			609	Anzahl -3000			EUR 593,000	-1.779.000,00	-0,28
HANG SENG INDEX PUT 30.07.18 BP 28000,00 HKFE			456	Anzahl -62500			HKD 370,000	1.514.986,08	0,23
MSCI EM NR USD PUT 23.07.18 BP 490,00 EUREX			185	Anzahl -150000			USD 11,100	-1.426.246,36	-0,22
MSCI WORLD PUT 23.07.18 BP 6000,00 EUREX			185	Anzahl -50000			USD 75,300	-3.225.115,64	-0,50
S+P 500 INDEX PUT 20.07.18 BP 2745,00 CBOE			361	Anzahl -60000			USD 43,162	-2.218.386,16	-0,34
S+P 500 INDEX PUT 20.07.18 BP 2760,00 CBOE			361	Anzahl -75000			USD 51,708	-3.322.016,88	-0,51
Zins-Derivate							EUR	-39.198,11	-0,01
Forderungen/Verbindlichkeiten									
Zinsterminkontrakte							EUR	-39.198,11	-0,01
FUTURE EURO-BUND 09.18 EUREX			185	EUR -31.500.000				-488.250,00	-0,08
FUTURE 10Y TREASURY NOTE (SYNTH.) 09.18 CBOT			362	USD 363.900.000				427.369,09	0,07
FUTURE US LONG BOND (SYNTH.) 09.18 CBOT			362	USD 15.500.000				21.682,80	0,00
Optionsrechte							EUR	-4.585.970,91	-0,71
Optionsrechte auf Rentenindex-Terminkontrakte							EUR	-4.585.970,91	-0,71
FUTURE ESCHATZ 09.18 CALL 27.07.18 BP 112,20 EUREX			185	EUR Anzahl 12000			EUR 0,040	-253.750,00	-0,04
FUTURE ESCHATZ 09.18 CALL 27.07.18 BP 112,30 EUREX			185	EUR Anzahl 12000			EUR 0,025	-160.000,00	-0,02
FUTURE ESCHATZ 09.18 CALL 27.07.18 BP 112,40 EUREX			185	EUR Anzahl -8000			EUR 0,015	80.000,00	0,01
FUTURE ESCHATZ 09.18 PUT 27.07.18 BP 111,70 EUREX			185	EUR Anzahl 4000			EUR 0,005	-160.000,00	-0,02
FUTURE ESCHATZ 09.18 PUT 27.07.18 BP 111,80 EUREX			185	EUR Anzahl -8000			EUR 0,005	520.000,00	0,08
FUTURE ESCHATZ 09.18 PUT 27.07.18 BP 111,90 EUREX			185	EUR Anzahl 4000			EUR 0,015	-380.000,00	-0,06
FUTURE EU-BUND 09.18 CALL 27.07.18 BP 159,50 EUREX			185	EUR Anzahl -1000			EUR 3,100	-1.900.000,00	-0,29
FUTURE EU-BUND 09.18 PUT 27.07.18 BP 159,50 EUREX			185	EUR Anzahl -1000			EUR 0,050	1.174.500,00	0,18
FUT US LONG B 09.18 CALL 27.07.18 BP 144,00 CBOT			362	USD Anzahl -500			USD 1,563	-669.222,20	-0,10
FUT US LONG B 09.18 CALL 27.07.18 BP 145,00 CBOT			362	USD Anzahl -500			USD 1,000	-428.302,21	-0,07

Halbjahresbericht RP Gamma

Vermögensaufstellung zum 30.06.2018

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2018	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
FUT US LONG B 09.18 PUT 27.07.18 BP 144,00 CBOT			362	USD	Anzahl -500		USD 0,563	-240.919,99	-0,04
FUT US LONG B 09.18 PUT 27.07.18 BP 145,00 CBOT			362	USD	Anzahl -500		USD 1,000	-428.302,21	-0,07
FUTURE 10Y TREA 09.18 CALL 27.07.18 BP 119,50 CBOT			362	USD	Anzahl -2500		USD 0,875	-1.873.822,17	-0,29
FUTURE 10Y TREA 09.18 PUT 27.07.18 BP 119,50 CBOT			362	USD	Anzahl -2500		USD 0,188	-401.533,32	-0,06
FUTURE 2Y TRE. 09.18 CALL 27.07.18 BP 106,125 CBOT			362	USD	Anzahl 4000		USD 0,055	374.767,86	0,06
FUTURE 2Y TRE. 09.18 CALL 27.07.18 BP 106,25 CBOT			362	USD	Anzahl 3000		USD 0,031	160.613,33	0,02
Devisen-Derivate							EUR	2.403.286,15	0,37
Forderungen/Verbindlichkeiten									
Optionsrechte							EUR	1.587.395,07	0,25
Optionsrechte auf Devisen							EUR	1.587.395,07	0,25
FUT CR AD/DL 2PM 09.18 CALL 06.07.18 BP 76,50 CME			352	USD	1.000.000		USD 0,005	4.283,02	0,00
FUT CR AD/DL 2PM 09.18 CALL 06.07.18 BP 77,00 CME			352	USD	1.000.000		USD 0,005	4.283,02	0,00
FUT CR AD/DL 2PM 09.18 PUT 06.07.18 BP 74,50 CME			352	USD	1.000.000		USD 0,690	591.057,05	0,09
FUT CR AD/DL 2PM 09.18 PUT 06.07.18 BP 75,00 CME			352	USD	1.000.000		USD 1,090	933.698,82	0,14
FUT EURO FX 2PM 09.18 CALL 06.07.18 BP 1,20 CME			352	USD	100.000.000		USD 0,000	12.849,07	0,00
FUT EURO FX 2PM 09.18 PUT 06.07.18 BP 1,17 CME			352	USD	100.000.000		USD 0,003	274.113,41	0,04
FUT GBP/USD 2PM09.18 CALL 06.07.18 BP 136,50 CME			359	USD	375.000		USD 0,010	3.212,27	0,00
FUT GBP/USD 2PM09.18 PUT 06.07.18 BP 133,00 CME			359	USD	375.000		USD 0,910	292.316,26	0,05
FUT JPY/USD 2PM 09.18 CALL 06.07.18 BP 92,00 CME			352	USD	-437.500		USD 0,040	-14.990,58	0,00
FUT JPY/USD 2PM 09.18 PUT 06.07.18 BP 92,00 CME			352	USD	-437.500		USD 1,370	-513.427,27	-0,08
Währungsterminkontrakte							EUR	815.891,08	0,13
FUTURE CROSS RATE AUD/USD 09.18 CME			352	USD	1.500.000		USD 73,980	618.930,96	0,10
FUTURE CROSS RATE EUR/USD 09.18 CME			352	USD	-11.875.000		USD 1,174	-72.704,30	-0,01
FUTURE CROSS RATE GBP/USD 09.18 CME			352	USD	221.875		USD 132,360	182.756,55	0,03
FUTURE CROSS RATE JPY/USD 09.18 CME			352	USD	-343.750		USD 90,675	86.907,87	0,01

Halbjahresbericht RP Gamma

Vermögensaufstellung zum 30.06.2018

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2018	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds							EUR	21.191.639,08	3,28
Bankguthaben							EUR	21.191.639,08	3,28
Guthaben bei BNP Paribas Securities Services (GD) Niederlassung Frankfurt (V)									
Guthaben in Fondswährung									
			EUR	4.347.088,36			% 100,000	4.347.088,36	0,67
Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen									
			GBP	407.036,68			% 100,000	460.396,65	0,07
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen									
			AUD	2.248.996,73			% 100,000	1.423.685,97	0,22
			CAD	86.877,45			% 100,000	56.579,26	0,01
			JPY	207.059,00			% 100,000	1.601,51	0,00
			USD	9.372.480,26			% 100,000	8.028.508,02	1,24
Guthaben bei BNP Paribas Securities Services S.C.A. - Zweigniederlassung Frankfurt									
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen									
			CHF	870.140,00			% 100,000	750.767,90	0,12
			HKD	1.126.600,00			% 100,000	123.011,41	0,02
Guthaben bei Landesbank Baden-Württemberg (GD) Stuttgart (V)									
Vorzeitig kündbares Termingeld									
			EUR	6.000.000,00			% 100,000	6.000.000,00	0,93
Sonstige Vermögensgegenstände							EUR	3.691.786,06	0,57
Zinsansprüche									
			EUR	3.691.786,06				3.691.786,06	0,57
Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme							EUR	-5.307.162,47	-0,82
EUR - Kredite									
			EUR	-1.130.987,50			% 100,000	-1.130.987,50	-0,17
Kredite in Nicht-EU/EWR-Währungen									
			HKD	-1.060.874,57			% 100,000	-115.834,97	-0,02
			CHF	-167.208,46			% 100,000	-144.269,59	-0,02
			AUD	-349.700,00			% 100,000	-221.371,15	-0,03
			USD	-4.313.191,93			% 100,000	-3.694.699,26	-0,57

Halbjahresbericht RP Gamma

Vermögensaufstellung zum 30.06.2018

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2018	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Sonstige Verbindlichkeiten							EUR	-2.486.116,44	-0,38
Zinsverbindlichkeiten			EUR	-6.570,63				-6.570,63	0,00
Verwaltungsvergütung			EUR	-514.515,37				-514.515,37	-0,08
Verwahrstellenvergütung			EUR	-202.910,48				-202.910,48	-0,03
Veröffentlichungskosten			EUR	-1.193,33				-1.193,33	0,00
Prüfungskosten			EUR	-8.143,00				-8.143,00	0,00
Portfoliomanagervergütung			EUR	-1.752.783,63				-1.752.783,63	-0,27
							EUR	646.840.889,15	100,00 1)
Fondsvermögen									
RP Gamma Anteilklasse I									
Anteilwert							EUR	106,57	
Ausgabepreis							EUR	111,90	
Rücknahmepreis							EUR	106,57	
Anzahl Anteile							STK	151.900	
RP Gamma Anteilklasse IL									
Anteilwert							EUR	110,20	
Ausgabepreis							EUR	110,20	
Rücknahmepreis							EUR	110,20	
Anzahl Anteile							STK	2.271.859	
RP Gamma Anteilklasse RL									
Anteilwert							EUR	107,56	
Ausgabepreis							EUR	107,56	
Rücknahmepreis							EUR	107,56	
Anzahl Anteile							STK	64.907	

Halbjahresbericht RP Gamma

Vermögensaufstellung zum 30.06.2018

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2018	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
RP Gamma Anteilklasse RT									
Anteilwert							EUR	99,22	
Ausgabepreis							EUR	99,22	
Rücknahmepreis							EUR	99,22	
Anzahl Anteile							STK	67.929	
RP Gamma Anteilklasse ILD									
Anteilwert							EUR	85,46	
Ausgabepreis							EUR	85,46	
Rücknahmepreis							EUR	85,46	
Anzahl Anteile							STK	829.971	
RP Gamma Anteilklasse IXL									
Anteilwert							EUR	98,60	
Ausgabepreis							EUR	98,60	
Rücknahmepreis							EUR	98,60	
Anzahl Anteile							STK	2.998.446	

Fußnoten:

1) Durch Rundung der Prozent-Anteile bei der Berechnung können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.

Halbjahresbericht RP Gamma

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

Die Vermögensgegenstände des Sondervermögens sind auf Grundlage der zuletzt festgestellten Kurse/Marktsätze bewertet.

Devisenkurse (in Mengennotiz)

		per 29.06.2018	
AUD	(AUD)	1,5797000	= 1 EUR (EUR)
CAD	(CAD)	1,5355000	= 1 EUR (EUR)
CHF	(CHF)	1,1590000	= 1 EUR (EUR)
GBP	(GBP)	0,8841000	= 1 EUR (EUR)
HKD	(HKD)	9,1585000	= 1 EUR (EUR)
JPY	(JPY)	129,2896000	= 1 EUR (EUR)
USD	(USD)	1,1674000	= 1 EUR (EUR)

Marktschlüssel

b) Terminbörsen

185	Eurex Deutschland
226	Sydney - ASX-Fut. + Opt.
352	Chicago - CME Globex
359	Chicago Merc. Ex.
361	Chicago - CBOE Opt. Ex.
362	Chicago Board of Trade
456	Hongkong - HKFE
609	Mailand - IDEM
AD1	CBOE Futures Exch. (CFE)

Halbjahresbericht RP Gamma

Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen: - Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schuldscheindarlehen (Marktzuordnung zum Berichtsstichtag):

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile Whg. in 1.000	Käufe bzw. Zugänge	Verkäufe bzw. Abgänge	Volumen in 1.000
Börsengehandelte Wertpapiere					
Verzinsliche Wertpapiere					
3,3750 % Deutsche Bank AG MTN-HPF v.2011(2018)	DE000DB5EVA0	EUR	0	5.000	
1,3750 % Deutsche Pfandbriefbank AG MTN-HPF Reihe 15204 v.13(18)	DE000A1X2566	EUR	0	7.500	
2,3750 % LfA Förderbank Bayern Inh.-Schv.R.1121 v.12(22)	DE000LFA1214	EUR	0	11.200	
1,2500 % SpareBank 1 Boligkredit AS EO-Med.-Term Cov. Bds 2012(18)	XS0820929437	EUR	0	4.800	
1,5000 % Sparebanken Vest Boligkred. AS EO-Med.-Term Hyp.Pf. 2013(18)	XS0969571065	EUR	0	22.400	
4,2500 % UniCredit S.p.A. EO-Covered MTN 2011(18)	IT0004734429	EUR	0	5.000	
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere					
Verzinsliche Wertpapiere					
1,0000 % Aareal Bank AG MTN-HPF.S.174 v.2013(2018)	DE000AAR0165	EUR	0	10.000	
0,1710 % Nordea Bank AB EO-FLR Med.-Term Nts 2013(18)	XS0935835313	EUR	0	10.500	
0,7500 % Stadtparkasse München Pfdbr.Reihe 6 v.2014(2018)	DE000A1YC392	EUR	0	5.000	
1,3750 % United States of America DL-Notes 2013(18)	US912828VK31	USD	0	40.000	
Nichtnotierte Wertpapiere					
Verzinsliche Wertpapiere					
4,5000 % Cie de Financement Foncier EO-Med.-T.Obl.Foncières 03(18)	FR0000474652	EUR	0	5.000	
0,8750 % Hamburg, Freie und Hansestadt Land.Schatzanw. v.12(18)	DE000A1H3EP0	EUR	0	10.000	
1,3750 % Landesbank Baden-Württemberg MTN-Pfandbr.Ser.739 v.12(18)	DE000LB0M596	EUR	0	2.000	

Halbjahresbericht RP Gamma

Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen: - Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schuldscheindarlehen (Marktzuordnung zum Berichtsstichtag):

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile Whg. in 1.000	Käufe bzw. Zugänge	Verkäufe bzw. Abgänge	Volumen in 1.000
---------------------	------	-------------------------------------	--------------------------	-----------------------------	---------------------

Derivate

(In Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe)

Terminkontrakte

Aktienindex-Terminkontrakte

Gekaufte Kontrakte:

(Basiswert(e): CBOE VOLATILITY, HANG SENG, MSCI EM NR USD, MSCI WORLD NR USD, RUSSELL 2000, S+P 500, SMI PR CHF)

EUR

131.451,46

Verkaufte Kontrakte:

(Basiswert(e): CBOE VOLATILITY, DAX PERFORMANCE-INDEX, ESTX 50 PR.EUR, FTSE 100, FTSE MIB, HANG SENG, MSCI EM NR USD, MSCI WORLD NR USD, RUSSELL 2000, S+P 500, S+P/ASX 200, SMI PR CHF)

EUR

9.677.064,81

Zinsterminkontrakte

Gekaufte Kontrakte:

(Basiswert(e): 10Y.US TRE.NT.SYN.AN., 8,5-10Y.ITA.GOV.BD.SYN.AN, EURO-BUND, EURO-SCHATZ, U.S.A. TRE.SYN.AN. (LONG))

EUR

8.480.095,20

Verkaufte Kontrakte:

(Basiswert(e): 10Y.US TRE.NT.SYN.AN., EURO-BUND, U.S.A. TRE.SYN.AN. (LONG))

EUR

8.448.210,30

Währungsterminkontrakte

Gekaufte Kontrakte:

(Basiswert(e): CROSS RATE AD/DL, CROSS RATE EO/DL, CROSS RATE LS/DL, CROSS RATE YN/DL)

EUR

383.365,31

Halbjahresbericht RP Gamma

Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen: - Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schuldscheindarlehen (Marktzuordnung zum Berichtsstichtag):

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile Whg. in 1.000	Käufe bzw. Zugänge	Verkäufe bzw. Abgänge	Volumen in 1.000
Verkaufte Kontrakte: (Basiswert(e): CROSS RATE AD/DL, CROSS RATE EO/DL, CROSS RATE LS/DL, CROSS RATE YN/DL)		EUR			269.314,32
Optionsrechte					
Optionsrechte auf Aktienindex-Derivate					
Optionsrechte auf Aktienindices					
Verkaufte Verkaufsoptionen (Put): (Basiswert(e): DAX PERFORMANCE-INDEX, ESTX 50 PR.EUR, FTSE 100, FTSE MIB, HANG SENG, MSCI EM NR USD, MSCI WORLD NR USD, RUSSELL 2000, S+P 500, S+P/ASX 200, SMI PR CHF)		EUR			152.638,54
Optionsrechte auf Zins-Derivate					
Optionsrechte auf Zinsterminkontrakte					
Gekaufte Kaufoptionen (Call): (Basiswert(e): FUTURE 10Y TREASURY NOTE (SYNTH.) 03.18 CBOT, FUTURE 10Y TREASURY NOTE (SYNTH.) 06.18 CBOT, FUTURE 2Y TREASURY NOTE (SYNTH.) 03.18 CBOT, FUTURE 2Y TREASURY NOTE (SYNTH.) 06.18 CBOT, FUTURE 2Y TREASURY NOTE (SYNTH.) 09.18 CBOT, FUTURE EURO-BUND 03.18 EUREX, FUTURE EURO-SCHATZ 03.18 EUREX, FUTURE EURO-SCHATZ 06.18 EUREX, FUTURE EURO-SCHATZ 09.18 EUREX, FUTURE US LONG BOND (SYNTH.) 03.18 CBOT, FUTURE US LONG BOND (SYNTH.) 06.18 CBOT)		EUR			8.429,96

Halbjahresbericht RP Gamma

Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen: - Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schuldscheindarlehen (Marktzuordnung zum Berichtsstichtag):

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile Whg. in 1.000	Käufe bzw. Zugänge	Verkäufe bzw. Abgänge	Volumen in 1.000
Verkaufte Kaufoptionen (Call): (Basiswert(e): FUTURE 10Y TREASURY NOTE (SYNTH.) 03.18 CBOT, FUTURE 10Y TREASURY NOTE (SYNTH.) 06.18 CBOT, FUTURE 10Y TREASURY NOTE (SYNTH.) 09.18 CBOT, FUTURE EURO-BUND 03.18 EUREX, FUTURE EURO-BUND 06.18 EUREX, FUTURE EURO-BUND 09.18 EUREX, FUTURE EURO-SCHATZ 06.18 EUREX, FUTURE EURO-SCHATZ 09.18 EUREX, FUTURE LONG TERM EURO BTP 09.18 EUREX, FUTURE US LONG BOND (SYNTH.) 03.18 CBOT, FUTURE US LONG BOND (SYNTH.) 06.18 CBOT, FUTURE US LONG BOND (SYNTH.) 09.18 CBOT)		EUR			45.406,66
Verkaufte Verkaufsoptionen (Put): (Basiswert(e): FUTURE 10Y TREASURY NOTE (SYNTH.) 03.18 CBOT, FUTURE 10Y TREASURY NOTE (SYNTH.) 06.18 CBOT, FUTURE 10Y TREASURY NOTE (SYNTH.) 09.18 CBOT, FUTURE EURO-BUND 03.18 EUREX, FUTURE EURO-BUND 06.18 EUREX, FUTURE EURO-BUND 09.18 EUREX, FUTURE EURO-SCHATZ 06.18 EUREX, FUTURE LONG TERM EURO BTP 09.18 EUREX, FUTURE US LONG BOND (SYNTH.) 03.18 CBOT, FUTURE US LONG BOND (SYNTH.) 06.18 CBOT, FUTURE US LONG BOND (SYNTH.) 09.18 CBOT)		EUR			34.237,75
Gekaufte Verkaufsoptionen (Put): (Basiswert(e): FUTURE 10Y TREASURY NOTE (SYNTH.) 06.18 CBOT, FUTURE 10Y TREASURY NOTE (SYNTH.) 09.18 CBOT, FUTURE EURO-BUND 03.18 EUREX, FUTURE EURO-BUND 06.18 EUREX, FUTURE EURO-BUND 09.18 EUREX, FUTURE EURO-SCHATZ 06.18 EUREX, FUTURE US LONG BOND (SYNTH.) 09.18 CBOT)		EUR			2.331,87
Optionsrechte auf Devisen-Derivate					
Optionsrechte auf Devisen					
Gekaufte Kaufoptionen (Call): (Basiswert(e): FUTURE CROSS RATE AUD/USD 2PM EUR 03.18 CME, FUTURE CROSS RATE AUD/USD 2PM EUR 06.18 CME, FUTURE CROSS RATE EUR/USD 2PM EUR 03.18 CME, FUTURE CROSS RATE EUR/USD 2PM EUR 06.18 CME, FUTURE CROSS RATE GBP/USD 2PM EUR 03.18 CME, FUTURE CROSS RATE GBP/USD 2PM EUR 06.18 CME)		EUR			5.370,94

**Halbjahresbericht
RP Gamma**

**Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen:
- Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schuldscheindarlehen (Marktzuordnung zum Berichtsstichtag):**

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile Whg. in 1.000	Käufe bzw. Zugänge	Verkäufe bzw. Abgänge	Volumen in 1.000
Gekaufte Verkaufsoptionen (Put): (Basiswert(e): FUTURE CROSS RATE AUD/USD 2PM EUR 03.18 CME, FUTURE CROSS RATE AUD/USD 2PM EUR 06.18 CME, FUTURE CROSS RATE EUR/USD 2PM EUR 03.18 CME, FUTURE CROSS RATE EUR/USD 2PM EUR 06.18 CME, FUTURE CROSS RATE GBP/USD 2PM EUR 03.18 CME, FUTURE CROSS RATE GBP/USD 2PM EUR 06.18 CME, FUTURE CROSS RATE JPY/USD 2PM EUR 03.18 CME)		EUR			5.549,85
Verkaufte Kaufoptionen (Call): (Basiswert(e): FUTURE CROSS RATE GBP/USD 2PM EUR 03.18 CME, FUTURE CROSS RATE GBP/USD 2PM EUR 06.18 CME, FUTURE CROSS RATE JPY/USD 2PM EUR 03.18 CME, FUTURE CROSS RATE JPY/USD 2PM EUR 06.18 CME)		EUR			1.393,30
Verkaufte Verkaufsoptionen (Put): (Basiswert(e): FUTURE CROSS RATE GBP/USD 2PM EUR 06.18 CME, FUTURE CROSS RATE JPY/USD 2PM EUR 03.18 CME, FUTURE CROSS RATE JPY/USD 2PM EUR 06.18 CME)		EUR			1.028,47

Anteilklassenmerkmale im Überblick

Anteilklasse	Mindestanlagesumme in Währung	Ausgabeaufschlag bis zu 5,00%, derzeit (Angabe in %)	Verwaltungsvergütung bis zu 0,400% p.a., derzeit (Angabe in % p.a.)	Ertragsverwendung
RP Gamma Anteilklasse I	100.000	5,000	0,150	Thesaurierer
RP Gamma Anteilklasse IL	keine	0,000	0,100	Thesaurierer
RP Gamma Anteilklasse RL	keine	0,000	0,225	Thesaurierer
RP Gamma Anteilklasse RT	keine	0,000	0,150	Thesaurierer
RP Gamma Anteilklasse ILD	250	0,000	0,100	Ausschüttung ohne Zwischenausschüttung
RP Gamma Anteilklasse IXL	100.000.000	0,000	0,100	Thesaurierer

Halbjahresbericht RP Gamma

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)	100,85
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)	-3,49

Sonstige Angaben

RP Gamma Anteilklasse I

Anteilwert	EUR	106,57
Ausgabepreis	EUR	111,90
Rücknahmepreis	EUR	106,57
Anzahl Anteile	STK	151.900

RP Gamma Anteilklasse IL

Anteilwert	EUR	110,20
Ausgabepreis	EUR	110,20
Rücknahmepreis	EUR	110,20
Anzahl Anteile	STK	2.271.859

RP Gamma Anteilklasse RL

Anteilwert	EUR	107,56
Ausgabepreis	EUR	107,56
Rücknahmepreis	EUR	107,56
Anzahl Anteile	STK	64.907

RP Gamma Anteilklasse RT

Anteilwert	EUR	99,22
Ausgabepreis	EUR	99,22
Rücknahmepreis	EUR	99,22
Anzahl Anteile	STK	67.929

Halbjahresbericht RP Gamma

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

RP Gamma Anteilklasse ILD

Anteilwert	EUR	85,46
Ausgabepreis	EUR	85,46
Rücknahmepreis	EUR	85,46
Anzahl Anteile	STK	829.971

RP Gamma Anteilklasse IXL

Anteilwert	EUR	98,60
Ausgabepreis	EUR	98,60
Rücknahmepreis	EUR	98,60
Anzahl Anteile	STK	2.998.446

Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände

Bewertung

Für Devisen, Aktien, Anleihen und Derivate, die zum Handel an einer Börse oder an einem anderen organisierten Markt zugelassen oder in diesen einbezogen sind, wird der letzte verfügbare handelbare Kurs gemäß § 27 KARBV zugrunde gelegt.

Für Investmentanteile werden die aktuellen Werte, für Bankguthaben und Verbindlichkeiten der Nennwert bzw. Rückzahlungsbetrag gemäß § 29 KARBV zugrunde gelegt.

Für Vermögensgegenstände, die weder zum Handel an einer Börse noch an einem anderen organisierten Markt zugelassen oder in den regulierten Markt oder Freiverkehr einer Börse einbezogen sind oder für die kein handelbarer Kurs verfügbar ist, werden gemäß § 28 KARBV i.V.m. § 168 Absatz 3 KAGB die Verkehrswerte zugrunde gelegt, die sich bei sorgfältiger Einschätzung nach geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten ergeben. Unter dem Verkehrswert ist der Betrag zu verstehen, zu dem der jeweilige Vermögensgegenstand in einem Geschäft zwischen sachverständigen, vertragswilligen und unabhängigen Geschäftspartnern ausgetauscht werden könnte.

Frankfurt am Main, den 2. Juli 2018

Universal-Investment-Gesellschaft mbH
Die Geschäftsführung

Halbjahresbericht RP Gamma

Anteilklassen im Überblick

Erstausgabedatum

Anteilklasse I	2. Januar 2009
Anteilklasse RL	20. Februar 2012
Anteilklasse IL	20. Februar 2012
Anteilklasse RT	14. Februar 2014
Anteilklasse ILD	1. Juni 2015
Anteilklasse IXL	3. August 2015

Erstausgabepreise

Anteilklasse I	€ 100,00 zzgl. Ausgabeaufschlag
Anteilklasse RL	€ 100,00 zzgl. Ausgabeaufschlag
Anteilklasse IL	€ 100,00 zzgl. Ausgabeaufschlag
Anteilklasse RT	€ 100,00 zzgl. Ausgabeaufschlag
Anteilklasse ILD	€ 100,00 zzgl. Ausgabeaufschlag
Anteilklasse IXL	€ 100,00 zzgl. Ausgabeaufschlag

Ausgabeaufschlag

Anteilklasse I	derzeit 5,00%
Anteilklasse RL	derzeit 0,00%
Anteilklasse IL	derzeit 0,00%
Anteilklasse RT	derzeit 0,00%
Anteilklasse ILD	derzeit 0,00%
Anteilklasse IXL	derzeit 0,00%

Mindestanlagesumme

Anteilklasse I	€ 100.000,00
Anteilklasse RL	keine
Anteilklasse IL	€ 250.000,00
Anteilklasse RT	keine
Anteilklasse ILD	€ 250.000,00
Anteilklasse IXL	€ 100.000.000,00

Verwaltungsvergütung

Anteilklasse I	derzeit 0,150% p.a. ²
Anteilklasse RL	derzeit 0,225% p.a. ²
Anteilklasse IL	derzeit 0,100% p.a. ²
Anteilklasse RT	derzeit 0,150% p.a. ²
Anteilklasse ILD	derzeit 0,100 % p.a.
Anteilklasse IXL	derzeit 0,100 % p.a.

Mindestens € 50.000,00 p.a. bezogen auf das Gesamtvermögen.

Verwahrstellenvergütung

Anteilklasse I	derzeit 0,10% p.a.
Anteilklasse RL	derzeit 0,10% p.a.
Anteilklasse IL	derzeit 0,10% p.a.
Anteilklasse RT	derzeit 0,10% p.a.
Anteilklasse ILD	derzeit 0,10% p.a.
Anteilklasse IXL	derzeit 0,10% p.a.

Mindestens € 20.000,00 p.a. bezogen auf das Gesamtvermögen.

Asset Management-Vergütung

Anteilklasse I	derzeit 0,70% p.a.
Anteilklasse RL	derzeit 1,25% p.a.
Anteilklasse IL	derzeit 0,85% p.a.
Anteilklasse RT	derzeit 2,00% p.a.
Anteilklasse ILD	derzeit 0,85% p.a.
Anteilklasse IXL	derzeit 1,25% p.a.

² Der Berechnung der Verwaltungsvergütung liegt eine volumenabhängige Staffel zugrunde. Je nach Höhe des Fondsvolumens kommen daher unterschiedlich hohe Vergütungssätze zur Anwendung.

Halbjahresbericht RP Gamma

Anteilklassen im Überblick

Erfolgsabhängige Asset Management-Vergütung

Anteilklasse I	derzeit 15% der vom Fonds in der Abrechnungsperiode erwirtschafteten Rendite über dem Referenzwert (EURIBOR@ 1M TR (EUR)) zzgl. eines Schwellenwertes von 1,50%, aber nur bei einem neuen Höchststand des Anteilwerts.
Anteilklasse RL / IL / RT / ILD	derzeit 20% der vom Fonds in der Abrechnungsperiode erwirtschafteten Rendite über dem Referenzwert (EURIBOR@ 1M TR (EUR)) zzgl. eines Schwellenwertes von 1,50%, aber nur bei einem neuen Höchststand des Anteilwerts.
Anteilklasse IXL	keine

Währung

Anteilklasse I	Euro
Anteilklasse RL	Euro
Anteilklasse IL	Euro
Anteilklasse RT	Euro
Anteilklasse ILD	Euro
Anteilklasse IXL	Euro

Ertragsverwendung

Anteilklasse I	Thesaurierung
Anteilklasse RL	Thesaurierung
Anteilklasse IL	Thesaurierung
Anteilklasse RT	Thesaurierung
Anteilklasse ILD	Ausschüttung
Anteilklasse IXL	Thesaurierung

Wertpapier-Kennnummer / ISIN

Anteilklasse I	A0RB9E / DE000A0RB9E6
Anteilklasse RL	A1JSUB / DE000A1JSUB5
Anteilklasse IL	A1JSUA / DE000A1JSUA7
Anteilklasse RT	A1W9CB / DE000A1W9CB2
Anteilklasse ILD	A14N5U / DE000A14N5U5
Anteilklasse IXL	A14UVZ / DE000A14UVZ7

Halbjahresbericht RP Gamma

Kurzübersicht über die Partner

1. Kapitalverwaltungsgesellschaft

Universal-Investment-Gesellschaft mbH

Hausanschrift:

Theodor-Heuss-Allee 70
60486 Frankfurt am Main

Postanschrift:

Postfach 17 05 48
60079 Frankfurt am Main

Telefon: 069 / 710 43-0

Telefax: 069 / 710 43-700

www.universal-investment.com

Gründung: 1968

Rechtsform: Gesellschaft mit beschränkter Haftung

Gezeichnetes und eingezahltes Kapital: EUR 10.400.000,-

Eigenmittel: EUR 58.194.000,- (Stand: Dezember 2017)

Geschäftsführer:

Frank Eggloff, München

Markus Neubauer, Frankfurt am Main

Michael Reinhard, Bad Vilbel

Stefan Rockel, Lauterbach (Hessen)

Alexander Tannenbaum, Mühlheim am Main

Bernd Vorbeck, Elsenfeld

Aufsichtsrat:

Prof. Dr. Harald Wiedmann (Vorsitzender), Berlin

Dr. Axel Eckhardt, Düsseldorf

Daniel Fischer, Bad Vilbel

Daniel F. Just, Pöcking

2. Verwahrstelle

BNP Paribas Securities Services S.C.A.

Zweigniederlassung Frankfurt am Main

Hausanschrift:

Europa-Allee 12
60327 Frankfurt am Main

Telefon: 069 / 15205-0

Telefax: 069 / 15205-550

www.bnpparibas.de

Rechtsform: Société en commandite par actions

(Kommanditgesellschaft auf Aktien französischen Rechts)

Haftendes Eigenkapital: € 787,9 Mio. (Stand: 31.12.2016)

3. Asset Management-Gesellschaft

RP Crest GmbH

Hausanschrift:

Landsberger Str. 110
80339 München

Telefon: 089 / 552 9962-0

Telefax: 089 / 552 9962-30

www.rpcrest.com

4. Anlageausschuss

Christian Mardeck,

RP Crest, München

Eckehard Dettinger-Klemm,

RP Crest, München