



Jahresbericht zum 31. März 2018

UniAbsoluterErtrag

Verwaltungsgesellschaft:
Union Investment Luxembourg S.A.

Inhaltsverzeichnis

	Seite
Vorwort	3
UniAbsoluterErtrag	5
Anlagepolitik	5
Wertentwicklung des Fonds	5
Geografische Länderaufteilung	6
Wirtschaftliche Aufteilung	6
Entwicklung der letzten 3 Geschäftsjahre	7
Zusammensetzung des Fondsvermögens	7
Zurechnung auf die Anteilklassen	7
Veränderung des Fondsvermögens	8
Aufwands- und Ertragsrechnung	8
Entwicklung der Anzahl der Anteile im Umlauf	8
Vermögensaufstellung	9
Devisenkurse	20
Zu- und Abgänge im Berichtszeitraum	21
Erläuterungen zum Bericht	34
Bericht des Abschlussprüfers (Réviseur d'entreprises agréé)	36
Sonstige Informationen der Verwaltungsgesellschaft	38
Verwaltungsgesellschaft, Verwaltungsrat, Geschäftsführer, Gesellschafter, Portfoliomanagement, Abschlussprüfer (Réviseur d'entreprises agréé), Verwahrstelle, Zahl- und Vertriebsstellen	43

Vorwort

Union Investment – Ihrem Interesse verpflichtet

Mit einem verwalteten Vermögen von rund 326 Milliarden Euro zählt die Union Investment Gruppe zu den größten deutschen Fondsgesellschaften für private und institutionelle Anleger. Sie ist Experte für Fondsvermögensverwaltung in der genossenschaftlichen FinanzGruppe. Etwa 4,4 Millionen private und institutionelle Anleger vertrauen uns als Partner für fondsbasierte Vermögensanlagen.

Die Idee der Gründung 1956 ist heute aktueller denn je: Privatanleger sollten die Chance haben, an der wirtschaftlichen Entwicklung teilzuhaben - und das bereits mit kleinen monatlichen Sparbeiträgen. Die Interessen dieser Investoren sind bis heute zentrales Anliegen für uns, dem wir uns mit unseren rund 3.050 Mitarbeitern verpflichtet fühlen. Rund 1.230 Publikums- und Spezialfonds bieten privaten und institutionellen Anlegern Lösungen, die auf ihre individuellen Anforderungen zugeschnitten sind – von Aktien-, Renten- und Geldmarktfonds über Offene Immobilienfonds bis hin zu intelligenten Lösungen zur Vermögensbildung, zum Risikomanagement oder zur privaten und betrieblichen Altersvorsorge.

Die Basis der starken Anlegerorientierung von Union Investment bildet die partnerschaftliche Zusammenarbeit mit den Beratern der Volks- und Raiffeisenbanken. In rund 11.100 Bankstellen stehen sie den Anlegern für eine individuelle Beratung in allen Fragen der Vermögensanlage zur Seite.

Bester Beleg für die Qualität unseres Fondsmanagements: unsere Auszeichnungen für einzelne Fonds - und das gute Abschneiden in Branchenratings. So erhielten wir im Januar 2018 bei den Euro Fund Awards 2018 von den Redaktionen von Euro, Eurofondsexpress, Euro am Sonntag und Börse-Online zahlreiche Auszeichnungen für unsere Fonds. Zudem hat das Fachmagazin Capital in seinem Fonds-Kompass Union Investment im Februar 2018 erneut mit der Höchstnote von fünf Sternen bedacht und als Top-Fondsgesellschaft ausgezeichnet. Damit sind wir die einzige Fondsgesellschaft, die diese renommierte Auszeichnung seit ihrer erstmaligen Vergabe im Jahr 2003 ohne Unterbrechung erhalten hat.

Darüber hinaus wurde Union Investment im November 2017 bei den Scope Awards 2018 zum vierten Mal in Folge als bester Asset Manager in der Kategorie „Socially Responsible Investing“ prämiert. Außerdem erhielten wir den Scope Alternative Investment Award 2018 als „Bester Asset Manager Retail Real Estate Global“ und „Bester Asset Manager Retail Real Estate Germany“ im Bereich Offene Immobilienfonds.

Im Oktober 2017 wurde der Trading Desk von Union Investment als „Multi Asset Desk of the Year 2017“ von Strategic Insight/TheTRADE ausgezeichnet.

Rentenmärkte mit freundlicher Tendenz

Zu Beginn des Berichtszeitraums tendierten US-Staatsanleihen aufwärts. Wesentliche Einflussfaktoren waren die Trump-Administration und die Normalisierung der US-Geldpolitik durch die Notenbank (Fed). Die US-Regierung stand lange Zeit mit ihren Steuersenkungsplänen, die erst zum Jahresende 2017 hin umgesetzt werden konnten, im Blickpunkt. Die Fed setzte ihren restriktiven Kurs mit Leitzinserhöhungen und der Reduzierung ihrer stark aufgeblähten Notenbankbilanz fort. Ungeachtet dessen präsentierte sich der Rentenmarkt zunächst recht freundlich. Die Rendite der richtungsweisenden US-Treasuries mit zehn Jahren Laufzeit lag im September 2017 lediglich knapp oberhalb von 2,0 Prozent. Danach wendete sich das Blatt und die Renditen zogen sukzessive an. Sehr gute Konjunkturdaten und die Befürchtung anziehender Teuerungsraten ließen die Zehnjahresrenditen auf knapp drei Prozent ansteigen, zudem tendierte die US-Zinskurve deutlich flacher. Vor allem im kurzen Laufzeitbereich stiegen die Renditen deutlich an, während sie am langen Ende (30 Jahre) fielen. Bislang stieg die Inflation in nur geringem Maße und blieb nahe an der von der Fed gesetzten Zielmarke von zwei Prozent. Doch zuletzt waren US-Treasuries vor allem vor dem Hintergrund der Handelsstreits der USA mit China als sicherer Anlegehafen sehr gefragt. Alleine im März 2018 gewannen sie auf Indexebene (JP Morgan Global Bond US-Index) ein Prozent hinzu. Für das Berichtsjahr ergab sich insgesamt ein Anstieg von 0,5 Prozent.

Auch im Euroraum bestimmten sehr gute Konjunkturdaten und die sich unter dem Zielwert der Europäischen Zentralbank (EZB) von rund zwei Prozent bewegende Inflation das Geschehen. Die EZB behielt im Gegensatz zur Fed aber ihre expansive Geldpolitik bei, wenngleich sie die Summe der monatlichen Anleihekäufe zwischenzeitlich halbierte. Mit Leitzinserhöhungen dürfte frühestens im Verlauf des Jahres 2019 zu rechnen sein. Die konjunkturelle Lage hat sich im gesamten Euroraum deutlich verbessert, was den Peripheriemärkten zugutekam. Die verschiedenen Wahlen in der Region verunsicherten hingegen nur kurzzeitig. In Deutschland waren vor allem im mittleren Laufzeitbereich deutlich anziehende Renditen zu beobachten. Von der unlängst aufgetretenen Risikoaversion der Anleger im Zusammenhang mit dem Handelsstreit der USA und China konnten europäische Staatsanleihen ebenfalls deutlich profitieren. Auf Indexebene (iBoxx Euro Sovereign-Index) gewannen diese im März 2018 1,6 Prozent hinzu. Für den gesamten Berichtszeitraum ergibt sich damit ein Plus von 3,1 Prozent.

Europäische Unternehmenspapiere und Anleihen aus den Schwellenländern waren im Verlauf der vergangenen zwölf Monate sehr gefragt. Auf Indexebene waren Kurszuwächse und Spreadeinengungen zu beobachten. An beiden Primärmärkten wurden sehr viele Neuemissionen platziert.

Aktienbörsen uneinheitlich, aber größtenteils aufwärts

Die globalen Aktienmärkte haben in den vergangenen zwölf Monaten überwiegend Kurszuwächse verzeichnet. Unterstützt von der robusten Konjunktur in allen wichtigen Wirtschaftsräumen, verbesserte sich der MSCI World-Index in lokaler Währung um 7,9 Prozent. Zuletzt kam es zu Kursrückschlägen.

In den USA gewann der marktbreite S&P 500-Index 11,8 Prozent. Die von Präsident Trump angekündigten Infrastrukturmaßnahmen und Steuersenkungen sorgten anfangs für Fantasie. Trotz wachsender Zweifel legten die Börsen zunächst zu, hauptsächlich unterstützt von anhaltend positiven Unternehmensnachrichten. Auch die restriktivere Geldpolitik der Notenbank belastete kaum. Ab Dezember 2017 wurden die Notierungen von der US-Steuerreform beflügelt. Doch im Frühjahr 2018 sorgten wachsende Inflationssorgen und vor allem die Einführung massiver Strafzölle auf Importe in die USA für Verunsicherung.

Die Aktienbörsen im Euroraum mussten wiederholt Rücksetzer hinnehmen. Vorübergehend belasteten der starke Euro-Wechselkurs sowie politische Unsicherheiten. Positive Unternehmenszahlen, starke Konjunkturdaten und die tendenziell behutsame Geldpolitik der EZB sorgten hingegen für Unterstützung. Anfang 2018 beflügelte die positive Marktlage in den USA, während politische Risiken in Europa ausgeblendet wurden. Im Februar und März 2018 kam es dann zu einer kräftigen Korrektur, nachdem die Trump-Administration protektionistische Maßnahmen angekündigt hatte. Der EUROSTOXX 50-Index verlor unter starken Schwankungen letztendlich 4,0 Prozent.

Die japanische Börse verzeichnete im Berichtsjahr spürbare Zuwächse. Hintergrund waren robuste Wachstumsdaten und eine Abschwächung des Yen-Wechselkurses. Dieser stieg zuletzt wieder deutlich an. Im Frühjahr 2018 belasteten dann die Ereignisse in den USA. Der NIKKEI 225-Index gewann unter Schwankungen in Lokalwährung 13,5 Prozent.

Die Börsen der Schwellenländer notierten ausgesprochen fest, der MSCI Emerging Markets-Index kletterte in lokaler Währung um 19,3 Prozent. Treiber waren vor allem die teilweise deutlich aufgehellten konjunkturellen Perspektiven in sämtlichen Regionen. Die höchsten Zugewinne erzielten dabei die asiatischen Märkte, die um 25,2 Prozent stiegen. Aber auch Lateinamerika und Osteuropa präsentierten sich mit einem Plus von 17,0 beziehungsweise 12,7 Prozent sehr stark.

Wichtiger Hinweis:

Die Datenquelle der genannten Finanzindizes ist, sofern nicht anders ausgewiesen, Datastream. Die Quelle für alle Angaben der Anteilwertentwicklung auf den nachfolgenden Seiten sind eigene Berechnungen von Union Investment nach der Methode des Bundesverbands Deutscher Investmentgesellschaften (BVI), sofern nicht anders ausgewiesen. Die Kennzahlen veranschaulichen die Wertentwicklung in der Vergangenheit. Zukünftige Ergebnisse können sowohl niedriger als auch höher ausfallen.

Detaillierte Angaben zur Verwaltungsgesellschaft und Verwahrstelle des Investmentvermögens (Fonds) finden Sie auf den letzten Seiten dieses Berichtes.

Anlagepolitik

Anlageziel und Anlagepolitik sowie wesentliche Ereignisse

Der aus drei Anteilklassen bestehende UniAbsoluterErtrag ist ein global ausgerichteter Mischfonds der einen Multi-Asset-Ansatz mit Absolute Return Charakter verfolgt. Dabei kombiniert das Fondsmanagement marktabhängige und eher marktneutrale Anlagestrategien aller Assetklassen (beispielsweise Aktien, Renten, Rohstoffe) flexibel miteinander. Marktneutrale Anlagestrategien können unter anderem aus einer Kombination von Long- und Shortpositionen bestehen. Ziel der Anlagepolitik ist die Erwirtschaftung einer angemessenen Rendite des angelegten Kapitals bei gleichzeitiger Beachtung wirtschaftlicher und politischer Risiken.

Struktur des Portfolios und wesentliche Veränderungen

Der UniAbsoluterErtrag investierte sein Fondsvermögen im abgelaufenen Geschäftsjahr überwiegend in Investmentfonds. Der Gesamtanteil lag zuletzt bei 89 Prozent des Fondsvermögens. Die wichtigste Fondsklasse bildeten hierbei Rentenfonds mit zuletzt 38 Prozent, gefolgt von Aktien- und Mischfonds mit zuletzt 29 bzw. 22 Prozent. Geringere Bestände, unter anderem in Aktien, Renten und Liquidität ergänzten das Portfolio.

Die gehaltenen Rentenfonds waren mit ihrem Vermögen, unter regionalen Gesichtspunkten, überwiegend in den globalen Märkten investiert. Darunter waren die aufstrebenden Volkswirtschaften (Emerging Markets), Nordamerika sowie Positionen im asiatisch-pazifischen Raum mit geringerer Gewichtung vertreten. Ebenfalls wurden speziell Positionen aus dem europäischen Raum gehalten.

Die enthaltenen Aktienfonds waren mit ihrem Vermögen überwiegend auf europäischer Ebene investiert. Weiterhin wurden auch hier Investitionen auf globaler Ebene getätigt. Konzentration lag dabei auch auf den Bereichen Nordamerika und Asien. Das Gros der Mischfonds lag auf globaler und europäischer Ebene.

Während des Berichtszeitraums hielt der Fonds Fremdwährungsbestände, zuletzt mit insgesamt 13 Prozent des Fondsvermögens. Die wichtigste Position lag hierbei auf dem US-Dollar mit zuletzt 12 Prozent. Eine Vielzahl weiterer Währungsbeimischungen, unter anderem in das Britische Pfund ergänzten das Portfolio.

Der Fonds nimmt in Bezug auf die Anteilklasse UniAbsoluterErtrag A für das Geschäftsjahr vom 1. April 2017 bis zum 31. März 2018 eine Ausschüttung in Höhe von 0,30 Euro pro Anteil vor.

Der Fonds nimmt in Bezug auf die Anteilklasse UniAbsoluterErtrag -net- A für das Geschäftsjahr vom 1. April 2017 bis zum 31. März 2018 eine Ausschüttung in Höhe von 0,30 Euro pro Anteil vor.

Der Fonds nimmt in Bezug auf die Anteilklasse UniAbsoluterErtrag I für das Geschäftsjahr vom 1. April 2017 bis zum 31. März 2018 eine Ausschüttung in Höhe von 0,60 Euro pro Anteil vor.

Hinweis: Aufgrund einer risikoorientierten Betrachtungsweise können die dargestellten Werte von der Vermögensaufstellung abweichen.

Wertentwicklung in Prozent ¹⁾

	6 Monate	1 Jahr	3 Jahre	10 Jahre
Klasse A	-0,29	1,19	-3,15 ²⁾	-
Klasse -net- A	-0,43	0,89	-3,96 ²⁾	-
Klasse I	-0,20	1,37	-2,51 ²⁾	-

1) Auf Basis veröffentlichter Anteilwerte (BVI-Methode).

2) Seit Auflegung.

UniAbsoluterErtrag

Geografische Länderaufteilung ¹⁾

Luxemburg	55,38 %
Irland	14,24 %
Großbritannien	10,42 %
Frankreich	5,13 %
Deutschland	3,94 %
Schweiz	2,77 %
Australien	1,35 %
Vereinigte Staaten von Amerika	0,84 %
Europäische Gemeinschaft	0,50 %
Ägypten	0,47 %
Griechenland	0,46 %
Cayman Inseln	0,11 %
Belgien	0,05 %
Spanien	0,04 %
Brasilien	0,03 %
Italien	0,03 %
Jungferninseln (GB)	0,03 %
Niederlande	0,03 %
Türkei	0,03 %
Argentinien	0,02 %
Dänemark	0,02 %
Finnland	0,02 %
Singapur	0,02 %
Bahrain	0,01 %
Bermudas	0,01 %
Kanada	0,01 %
Mexiko	0,01 %
Nigeria	0,01 %
Oman	0,01 %
Portugal	0,01 %
China	0,00 %
Wertpapiervermögen	96,00 %
Optionen	-0,13 %
Terminkontrakte	0,04 %
Credit Default Swaps	-0,23 %
Sonstige Finanzinstrumente	0,02 %
Bankguthaben	3,84 %
Sonstige Vermögensgegenstände/Sonstige Verbindlichkeiten	0,46 %
Fondsvermögen	100,00 %

1) Aufgrund von Rundungsdifferenzen in den Einzelpositionen können die Summen vom tatsächlichen Wert abweichen.

Wirtschaftliche Aufteilung ¹⁾

Investmentfondsanteile	88,86 %
Diversifizierte Finanzdienste	4,73 %
Staatsanleihen	0,94 %
Multisektor	0,50 %
Lebensmittel, Getränke & Tabak	0,10 %
Energie	0,09 %
Roh-, Hilfs- & Betriebsstoffe	0,09 %
Gebrauchsgüter & Bekleidung	0,08 %
Immobilien	0,08 %
Automobile & Komponenten	0,07 %
Investitionsgüter	0,07 %
Telekommunikationsdienste	0,06 %
Transportwesen	0,06 %
Banken	0,05 %
Groß- und Einzelhandel	0,04 %
Gewerbliche Dienste & Betriebsstoffe	0,03 %
Haushaltsartikel & Körperpflegeprodukte	0,03 %
Medien	0,03 %
Software & Dienste	0,03 %
Gesundheitswesen: Ausstattung & Dienste	0,02 %
Halbleiter & Geräte zur Halbleiterproduktion	0,01 %
Hardware & Ausrüstung	0,01 %
Pharmazeutika, Biotechnologie & Biowissenschaften	0,01 %
Versorgungsbetriebe	0,01 %
Wertpapiervermögen	96,00 %
Optionen	-0,13 %
Terminkontrakte	0,04 %
Credit Default Swaps	-0,23 %
Sonstige Finanzinstrumente	0,02 %
Bankguthaben	3,84 %
Sonstige Vermögensgegenstände/Sonstige Verbindlichkeiten	0,46 %
Fondsvermögen	100,00 %

1) Aufgrund von Rundungsdifferenzen in den Einzelpositionen können die Summen vom tatsächlichen Wert abweichen.

UniAbsoluterErtrag

Entwicklung der letzten 3 Geschäftsjahre

Klasse A

Datum	Fondsvermögen Mio. EUR	Anteilumlauf Tsd.	Mittelauf- kommen Mio. EUR	Anteilwert EUR
31.03.2016	535,69	11.104	538,53	48,24
31.03.2017	726,00	15.483	210,37	46,89
31.03.2018	680,46	14.353	-53,57	47,41

Klasse -net- A

Datum	Fondsvermögen Mio. EUR	Anteilumlauf Tsd.	Mittelauf- kommen Mio. EUR	Anteilwert EUR
31.03.2016	1.001,15	20.401	1.006,59	49,07
31.03.2017	1.411,38	29.674	452,80	47,56
31.03.2018	1.386,85	28.918	-36,10	47,96

Klasse I

Datum	Fondsvermögen Mio. EUR	Anteilumlauf Tsd.	Mittelauf- kommen Mio. EUR	Anteilwert EUR
31.03.2016	90,88	921	91,33	98,72
31.03.2017	106,77	1.110	18,91	96,15
31.03.2018	100,34	1.033	-7,56	97,16

Zusammensetzung des Fondsvermögens zum 31. März 2018

	EUR
Wertpapiervermögen (Wertpapierereinstandskosten: EUR 2.004.918.093,40)	2.079.388.482,03
Bankguthaben	83.339.232,35
Sonstige Bankguthaben	13.219.199,15
Nicht realisierte Gewinne aus Terminkontrakten	1.350.122,99
Nicht realisierte Gewinne aus Swapgeschäften	733.949,19
Nicht realisierte Gewinne aus Zinsswapgeschäften	482.004,91
Zinsforderungen aus Wertpapieren	182.266,61
Zinsforderungen aus Zinsswapgeschäften	374.080,00
Dividendenforderungen	1.171,20
Forderungen aus Anteilverkäufen	1.352.662,23
Forderungen aus Wertpapiergeschäften	379.662,71
Sonstige Forderungen	2.593.951,11
	2.183.396.784,48
Optionen	-2.929.332,72
Verbindlichkeiten aus Anteilrücknahmen	-342.628,56
Nicht realisierte Verluste aus Devisentermingeschäften	-1.369.422,00
Nicht realisierte Verluste aus Credit Default Swaps	-5.064.038,09
Zinsverbindlichkeiten	-86.040,73
Verbindlichkeiten aus Wertpapiergeschäften	-2.448.614,10
Sonstige Passiva	-3.498.631,68
	-15.738.707,88
Fondsvermögen	2.167.658.076,60

Zurechnung auf die Anteilklassen

Klasse A

Anteiliges Fondsvermögen	680.463.380,41 EUR
Umlaufende Anteile	14.353.461,000
Anteilwert	47,41 EUR

Klasse -net- A

Anteiliges Fondsvermögen	1.386.850.886,65 EUR
Umlaufende Anteile	28.917.778,000
Anteilwert	47,96 EUR

Klasse I

Anteiliges Fondsvermögen	100.343.809,54 EUR
Umlaufende Anteile	1.032.770,000
Anteilwert	97,16 EUR

UniAbsoluterErtrag

Veränderung des Fondsvermögens

im Berichtszeitraum vom 1. April 2017 bis zum 31. März 2018

	Total EUR	Klasse A EUR	Klasse -net- A EUR	Klasse I EUR
Fondsvermögen zu Beginn des Berichtszeitraumes	2.244.144.625,76	726.000.205,50	1.411.376.818,07	106.767.602,19
Ordentlicher Nettoertrag	5.586.341,83	3.022.276,61	2.148.926,86	415.138,36
Ertrags- und Aufwandsausgleich	-7.837.117,50	-2.503.555,13	-5.181.590,28	-151.972,09
Mittelzuflüsse aus Anteilverkäufen	73.301.414,46	17.235.494,80	47.080.240,60	8.985.679,06
Mittelabflüsse aus Anteilrücknahmen	-170.530.900,37	-70.803.386,69	-83.184.185,88	-16.543.327,80
Realisierte Gewinne	398.146.764,24	127.360.180,09	251.942.248,37	18.844.335,78
Realisierte Verluste	-376.218.452,97	-120.425.953,71	-237.959.068,52	-17.833.430,74
Nettoveränderung nicht realisierter Gewinne	1.292.894.586,10	415.059.200,22	816.263.098,60	61.572.287,28
Nettoveränderung nicht realisierter Verluste	-1.290.010.072,99	-413.868.950,44	-814.754.819,35	-61.386.303,20
Ausschüttung	-1.819.111,96	-612.130,84	-880.781,82	-326.199,30
Fondsvermögen zum Ende des Berichtszeitraumes	2.167.658.076,60	680.463.380,41	1.386.850.886,65	100.343.809,54

Aufwands- und Ertragsrechnung

im Berichtszeitraum vom 1. April 2017 bis zum 31. März 2018

	Total EUR	Klasse A EUR	Klasse -net- A EUR	Klasse I EUR
Dividenden	11.552,72	3.714,11	7.292,22	546,39
Erträge aus Investmentanteilen	12.564.758,40	4.037.284,04	7.928.722,26	598.752,10
Zinsen auf Anleihen	1.356.815,83	433.339,35	859.267,39	64.209,09
Zinserträge aus Zinsswapgeschäften	1.232.646,29	395.837,59	779.082,28	57.726,42
Bankzinsen	-167.774,18	-53.571,06	-106.295,68	-7.907,44
Erträge aus Wertpapierleihe	3.589,90	1.158,29	2.261,16	170,45
Sonstige Erträge	2.928.964,19	938.792,05	1.850.941,41	139.230,73
Ertragsausgleich	7.666.616,36	2.336.743,93	5.198.220,11	131.652,32
Erträge insgesamt	25.597.169,51	8.093.298,30	16.519.491,15	984.380,06
Zinsaufwendungen	-189.352,40	-60.523,47	-119.890,08	-8.938,85
Zinsaufwendungen aus Zinsswapgeschäften	-1.626.130,12	-520.904,37	-1.028.392,84	-76.832,91
Verwaltungsvergütung	-15.373.519,63	-3.697.480,98	-11.314.002,12	-362.036,53
Pauschalgebühr	-2.187.908,18	-701.183,70	-1.383.029,08	-103.695,40
Veröffentlichungskosten	-11.912,71	-3.789,23	-7.565,85	-557,63
Taxe d'abonnement	-480.376,61	-153.954,80	-303.654,62	-22.767,19
Sonstige Aufwendungen	-312.129,17	-99.996,34	-197.399,87	-14.732,96
Aufwandsausgleich	170.501,14	166.811,20	-16.629,83	20.319,77
Aufwendungen insgesamt	-20.010.827,68	-5.071.021,69	-14.370.564,29	-569.241,70
Ordentlicher Nettoertrag	5.586.341,83	3.022.276,61	2.148.926,86	415.138,36
Transaktionskosten im Geschäftsjahr gesamt ¹⁾	4.454.382,76			

Laufende Kosten in Prozent ^{1) 2)}

1,51 1,80 1,34

1) Siehe Erläuterungen zum Bericht.

2) Für den Fonds UniAbsoluterErtrag / Klasse -net- A und I wurde im Berichtszeitraum kein Ausgabeaufschlag erhoben. Die Vertriebskosten wurden aus der Verwaltungsvergütung entnommen.

Entwicklung der Anzahl der Anteile im Umlauf

	Klasse A Stück	Klasse -net- A Stück	Klasse I Stück
Umlaufende Anteile zu Beginn des Berichtszeitraumes	15.482.676,000	29.673.956,000	1.110.469,000
Ausgegebene Anteile	363.055,000	976.792,000	92.213,000
Zurückgenommene Anteile	-1.492.270,000	-1.732.970,000	-169.912,000
Umlaufende Anteile zum Ende des Berichtszeitraumes	14.353.461,000	28.917.778,000	1.032.770,000

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Berichtes.

UniAbsoluterErtrag

Vermögensaufstellung zum 31. März 2018

ISIN	Wertpapiere		Zugänge	Abgänge	Bestand	Kurs	Kurswert EUR	Anteil am Fonds- vermögen % ¹⁾
Aktien, Anrechte und Genussscheine								
Börsengehandelte Wertpapiere								
Belgien								
BE0974293251	Anheuser-Busch InBev S.A./NV	EUR	18.254	11.354	6.900	89,2800	616.032,00	0,03
BE0974268972	bpost S.A.	EUR	20.000	0	20.000	18,3600	367.200,00	0,02
							983.232,00	0,05
Dänemark								
DK0060079531	DSV A/S	DKK	4.500	0	4.500	474,3000	286.343,88	0,01
DK0060228559	TDC AS	DKK	35.000	0	35.000	50,1200	235.343,05	0,01
							521.686,93	0,02
Deutschland								
DE0005439004	Continental AG	EUR	2.800	600	2.200	224,3000	493.460,00	0,02
DE0005557508	Dte. Telekom AG	EUR	68.000	21.000	47.000	13,2500	622.750,00	0,03
DE0006048432	Henkel AG & Co. KGaA -VZ-	EUR	6.000	0	6.000	106,8500	641.100,00	0,03
DE0006231004	Infineon Technologies AG	EUR	23.000	10.000	13.000	21,7400	282.620,00	0,01
DE0006599905	Merck KGaA	EUR	6.000	3.000	3.000	77,9000	233.700,00	0,01
DE000PSM7770	ProSiebenSat.1 Media SE	EUR	11.500	2.500	9.000	28,1800	253.620,00	0,01
DE0007236101	Siemens AG	EUR	7.000	0	7.000	103,5200	724.640,00	0,03
DE0007472060	Wirecard AG	EUR	7.000	36.748	5.000	95,9200	479.600,00	0,02
							3.731.490,00	0,16
Finnland								
FI0009005318	Nokian Renkaat OYJ	EUR	14.880	4.500	10.380	36,9000	383.022,00	0,02
							383.022,00	0,02
Frankreich								
FR0000121261	Cie Generale des Etablissements Michelin	EUR	7.500	2.000	5.500	119,9000	659.450,00	0,03
FR0000130650	Dassault Systemes S.A.	EUR	5.900	1.400	4.500	110,4000	496.800,00	0,02
FR0000121667	Essilor International S.A.	EUR	3.600	0	3.600	109,6000	394.560,00	0,02
FR0000121485	Kering S.A.	EUR	1.900	1.350	550	388,8000	213.840,00	0,01
FR0000121014	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	EUR	2.819	0	2.819	250,2000	705.313,80	0,03
FR0000130577	Publicis Groupe S.A.	EUR	4.500	0	4.500	56,5800	254.610,00	0,01
							2.724.573,80	0,12
Irland								
IE00BYTBXV33	Ryanair Holdings Plc.	EUR	42.000	27.000	15.000	16,0000	240.000,00	0,01
							240.000,00	0,01
Italien								
IT0001347308	Buzzi Unicem S.p.A.	EUR	40.723	30.000	10.723	19,0100	203.844,23	0,01
IT0004965148	Moncler S.p.A.	EUR	14.500	0	14.500	30,9000	448.050,00	0,02
							651.894,23	0,03
Niederlande								
NL0000235190	Airbus SE	EUR	7.000	4.500	2.500	93,8000	234.500,00	0,01
							234.500,00	0,01
Portugal								
PTCTT0AM0001	CTT-Correios de Portugal S.A.	EUR	179.648	79.648	100.000	3,1280	312.800,00	0,01
							312.800,00	0,01
Schweiz								
CH0012142631	Clariant AG	CHF	30.000	10.000	20.000	22,8100	387.431,00	0,02
CH0030170408	Geberit AG	CHF	1.850	1.350	500	422,4000	179.363,06	0,01
CH0002168083	Panalpina Weltransport Holding AG	CHF	4.000	0	4.000	120,6000	409.681,53	0,02
CH0012255151	Swatch Group	CHF	500	0	500	421,4000	178.938,43	0,01
CH0012255144	Swatch Group AG	CHF	3.500	0	3.500	80,0500	237.940,55	0,01
CH0012453913	Temenos Group AG	CHF	3.200	1.500	1.700	114,4000	165.163,48	0,01
							1.558.518,05	0,08

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Berichtes.

UniAbsoluterErtrag

ISIN	Wertpapiere	Zugänge	Abgänge	Bestand	Kurs	Kurswert	Anteil am Fondsvermögen % ¹⁾
						EUR	
Spanien							
ES0148396007	Industria de Diseño Textil S.A.	EUR	20.000	0	20.000	25,4300	508.600,00
ES0178430E18	Telefonica S.A.	EUR	50.000	0	50.000	8,0280	401.400,00
						910.000,00	0,04
Börsengehandelte Wertpapiere						12.251.717,01	0,55
Aktien, Anrechte und Genussscheine						12.251.717,01	0,55
Anleihen							
Börsengehandelte Wertpapiere							
EUR							
XS1748389688	2,500 % Chengdu Xingcheng Investment Group Co. Ltd. v.18(2021)		100.000	0	100.000	99,9930	99.993,00
GR0114030555	3,500 % Griechenland v.17(2023)		10.000.000	0	10.000.000	100,6250	10.062.500,00
						10.162.493,00	0,46
USD							
XS1772360803	6,797 % Akbank T.A.S. Reg.S. Fix-to-Float v.18(2028)		200.000	0	200.000	99,1915	161.326,34
US01609WAV46	4,200 % Alibaba Group Holding Ltd. v.17(2047)		200.000	0	200.000	95,9310	156.023,42
US03512TAB70	6,500 % AngloGold Ashanti Holdings Plc. v.10(2040)		500.000	0	500.000	104,1500	423.477,27
XS1719264324	9,750 % Anton Oilfield Services Group/Hong Kong v.17(2020)		400.000	0	400.000	104,0000	338.293,89
XS1627599654	8,750 % China Evergrande Group Reg.S. v.17(2025)		400.000	0	400.000	100,1765	325.856,71
USY39694AA51	5,875 % Indika Energy Capital III Pte. Ltd. Reg.S. v.17(2024)		400.000	200.000	200.000	95,2500	154.915,83
USN4717BAD84	6,500 % Jababeka International BV Reg.S. v.16(2023)		200.000	0	200.000	96,7095	157.289,58
USY59505AA82	6,750 % Medco Platinum Road Pte. Ltd. Reg.S. v.18(2025)		200.000	0	200.000	96,0000	156.135,64
XS1713469911	6,950 % MHP Lux S.A. Reg.S. v.18(2026)		400.000	0	400.000	99,7500	324.469,38
US67778NAA63	7,500 % Oil & Gas Holding Company B.S.C. Reg.S. v.17(2027)		400.000	200.000	200.000	99,2500	161.421,48
XS1750114396	6,750 % Oman Reg.S. v.18(2048)		200.000	0	200.000	96,0000	156.135,64
XS1759179002	5,200 % Shimao Property Holdings Ltd. v.18(2025)		600.000	300.000	300.000	97,0000	236.643,08
XS1698689301	5,250 % Trillion Chance Ltd. v.17(2018)		200.000	0	200.000	100,3000	163.129,22
XS1750996206	5,500 % Turkiye Sinai Kalkinma Bankasi AS EMTN v.18(2023)		200.000	0	200.000	97,2090	158.101,98
USG9328DAP53	6,125 % Vedanta Resources Plc. Reg.S. v.17(2024)		200.000	0	200.000	97,7500	158.981,87
XS1788516679	6,100 % Yapi Ve Kredi Bankasi AS Reg.S. v.18(2023)		300.000	0	300.000	99,0000	241.522,32
XS1619839779	7,375 % Zenith Bank Plc. Reg.S. v.17(2022)		200.000	0	200.000	103,4935	168.323,17
						3.642.046,82	0,20
Börsengehandelte Wertpapiere						13.804.539,82	0,66
Neuemissionen, die zum Börsenhandel vorgesehen sind							
USD							
XS1756563919	7,250 % Fantasia Holdings Group Co. Ltd. v.18(2019)		400.000	0	400.000	101,0875	328.820,04
XS1748392559	3,750 % Sunny Optical Technology Group Co. Ltd. v.18(2023)		200.000	0	200.000	98,9490	160.931,93
XS1734639799	4,750 % Yankuang Group (Cayman) Ltd. Reg.S. v.17(2020)		200.000	0	200.000	97,8250	159.103,85
						648.855,82	0,04
Neuemissionen, die zum Börsenhandel vorgesehen sind						648.855,82	0,04
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere							
EUR							
XS1242327168	2,750 % BRF S.A. Reg.S. v.15(2022)		200.000	0	200.000	95,9600	191.920,00
XS1679505070	1,625 % Rail Transit International Development Co. Ltd. Greenbond v.18(2022)		200.000	0	200.000	99,3525	198.705,00
						390.625,00	0,02
USD							
USL0178WAG70	7,500 % Altice Financing S.A. Reg.S. v.16(2026)		400.000	0	400.000	98,9545	321.881,76
USP20058AC08	6,875 % Capex S.A. Reg.S. v.17(2024)		200.000	0	200.000	100,0950	162.795,80
USC3535CAJ74	6,875 % First Quantum Minerals Ltd. Reg.S. v.18(2026)		200.000	0	200.000	95,0990	154.670,24
USG38327AA30	6,500 % GeoPark Ltd. Reg.S. v.17(2024)		200.000	0	200.000	100,5000	163.454,50
USP5R6DPAAB4	6,125 % Itau Unibanco Holding (Cayman Islands Branch) S.A. Reg.S. Fix-to-Float Perp.		200.000	0	200.000	98,4000	160.039,03
USP5R6DPAB67	6,500 % Itau Unibanco Holding (Cayman Islands Branch) S.A. Reg.S. Perp.		300.000	0	300.000	99,2000	242.010,25
XS1533923238	8,750 % Kernel Holding S.A. Reg.S. v.17(2022)		400.000	0	400.000	107,7500	350.491,99
USG5825AAB82	6,875 % MARB BondCo Plc. Reg.S. v.18(2025)		400.000	200.000	200.000	91,0000	148.003,58
USL6366MAC75	8,250 % MHP S.A. Reg.S. v.13(2020)		200.000	0	200.000	109,1110	177.459,54
XS1577965004	7,750 % MHP SE Reg.S. v.17(2024)		400.000	200.000	200.000	105,2500	171.179,96

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Berichtes.

UniAbsoluterErtrag

ISIN	Wertpapiere	Zugänge	Abgänge	Bestand	Kurs	Kurswert	Anteil am Fondsvermögen % ¹⁾	
						EUR		
USL6388GAB60	5,125 % Millicom International Cellular S.A. Reg.S. v.17(2028)	300.000	0	300.000	95,4715	232.914,13	0,01	
USN6945AAK36	5,999 % Petrobras Global Finance BV Reg.S. v.17(2028)	400.000	200.000	200.000	98,7500	160.608,28	0,01	
XS1759468967	4,850 % Rusal Capital D.A.C. Reg.S. v.18(2023)	800.000	600.000	200.000	96,0000	156.135,64	0,01	
USG91237AA87	7,000 % Tullow Oil Plc. Reg.S. v.18(2025)	400.000	0	400.000	99,7500	324.469,38	0,01	
USP94461AE36	7,375 % Unifin Financiera, S.A.B. de C.V., SOFOM, E.N.R. Reg.S. v.18(2026)	400.000	200.000	200.000	97,7180	158.929,82	0,01	
USG9844KAC39	6,250 % Yingde Gases Investment Ltd. Reg.S. v.18(2023)	200.000	0	200.000	98,2805	159.844,68	0,01	
USP989MJBNO3	7,000 % YPF S.A. Reg.S. v.17(2047)	200.000	0	200.000	90,8000	147.678,30	0,01	
						3.392.566,88	0,18	
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere						3.783.191,88	0,20	
Nicht notierte Wertpapiere								
EGP								
EGT9980B9I16	0,000 % Ägypten v.17(2018)	235.000.000	0	235.000.000	92,7842	10.086.125,52	0,47	
						10.086.125,52	0,47	
USD								
XS1788498167	6,375 % Yuzhou Properties Co. Ltd. v.18(2021)	400.000	0	400.000	99,6250	324.062,78	0,01	
						324.062,78	0,01	
						10.410.188,30	0,48	
Nicht notierte Wertpapiere						28.646.775,82	1,38	
Anleihen								
Credit Linked Notes								
USD								
XS1772800204	5,075 % DME Airport DAC Ltd. LPN v.18(2023)	200.000	0	200.000	99,2500	161.421,48	0,01	
						161.421,48	0,01	
						161.421,48	0,01	
Investmentfondsanteile²⁾								
Deutschland								
DE0008490988	Dte. Global Hybrid Bond Fundd	EUR	0	300.000	284,032	40,0100	11.364.120,32	0,52
DE000A0M80M2	UniFavorit: Aktien -I-	EUR	0	416.587	327,591	140,7100	46.095.329,61	2,13
DE000A1C81J5	UniInstitutional Euro Reserve Plus	EUR	150.000	652.681	222,319	100,3400	22.307.488,46	1,03
						79.766.938,39	3,68	
Frankreich								
IE00B906V41	FundLogic Alternatives Plc. - IPM Systematic Macro UCITS Fund	EUR	0	0	9,355	1.080,9770	10.112.539,84	0,47
IE00BWFRC140	Lyxor / Chenavari Credit Fund	EUR	33.517	0	33,517	102,3745	3.431.286,12	0,16
IE00B844SH66	Lyxor/WNT Fund	EUR	87.651	0	87,651	113,0223	9.906.517,62	0,46
FR0007078811	METROPOLE Funds SICAV - Metropole Selection	EUR	25.915	0	25,915	618,8000	16.036.202,00	0,74
FR0013275070	OFI Risk Arb Absolu FCP	EUR	55.412	0	55,412	99,8300	5.531.779,96	0,26
FR0010757831	Syquant Capital - Helium Opportunités	EUR	0	0	39,575	1.349,5370	53.407.926,78	2,46
						98.426.252,32	4,55	
Großbritannien								
IE00B8G2MF47	Insight LIBOR Plus Fund	EUR	0	0	61.730,989	1,1262	69.521.439,81	3,21
IE0032904330	J O Hambro Capital Management Umbrella Fund Plc. - Euro A Shs Fund	EUR	0	0	13.744,537	3,5720	49.095.486,16	2,26
IE00BYW7BD64	Marshall Wace UCITS Funds PLC - MW Liquid Alpha Fund	EUR	0	35,656	125,293	105,1142	13.170.073,46	0,61
IE00BYW7B815	Marshall Wace UCITS Funds Plc. MW Liquid Alpha Fund - Klasse A Euro	EUR	0	0	222,169	109,2143	24.264.031,82	1,12
IE00BPT2B085	Neuberger Berman Global Bond Absolute Return Fund	EUR	700.000	0	700.000	9,9900	6.993.000,00	0,32
IE00BDZRX300	Neuberger Berman Short Duration Emerging Market Debt Fund	EUR	4.400.000	1.300.000	3.100.000	10,5500	32.705.000,00	1,51
IE00B7FN4C24	Neuberger Berman Short Duration High Yield Bond Fund	USD	1.275.000	0	1.275.000	12,4600	12.919.004,64	0,60
IE00BLP5S791	Old Mutual Dublin Funds Plc. - Old Mutual Global Equity Absolute Return Fund	EUR	0	7.351,209	9.392,577	1,7177	16.133.629,51	0,74
						224.801.665,40	10,37	
Irland								
IE00BYZTN220	BLACKWALL EUROPE I/S FUND	EUR	315,682	0	1.270,820	10,0600	12.784.449,20	0,59
IE00B762GJ90	BNY Mellon Global Funds PLC - Emerging Markets Debt Fund	EUR	90,000	36,756	53,244	153,6869	8.182.905,30	0,38
IE00BCZRQT02	Fort Global UCITS Funds PLC - Contrarian Fund	EUR	0	0	10,493	1.060,0000	11.122.580,00	0,51
IE00B6TLWG59	GAM Star Fund Plc. - Cat Bond Fund	EUR	306,000	0	306,000	13,2000	4.039.200,00	0,19
IE00B59P9M57	GAM Star Fund Plc. - Global Rates	EUR	1.394,895	0	1.394,895	10,8113	15.080.628,31	0,70
IE00BYPJR538	GAM Star Fund plc - MBS Total Return	USD	2.000,000	0	2.000,000	10,9318	17.779.621,05	0,82
IE00B50JD354	GAM Star Plc. - Credit Opportunities Fund	EUR	0	0	1.750,000	15,7070	27.487.250,00	1,27

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Berichtes.

UniAbsoluterErtrag

ISIN	Wertpapiere		Zugänge	Abgänge	Bestand	Kurs	Kurswert	Anteil am Fondsvermögen % ¹⁾
							EUR	
IE00B5429P46	GLG Investments VI Plc. - European Equity Alternative	EUR	210.101	0	210.101	124,8500	26.231.109,85	1,21
IE00BLG30Y36	Hedge Invest International Funds - HI Numen Credit Fund	EUR	0	0	267.855	97,3300	26.070.327,15	1,20
IE00B85RQ587	Muzinich Funds - Long Short Credit Yield	EUR	161	0	177.417	126,0600	22.365.200,38	1,03
IE00B21J0335	Odey Investments PLC - Odey European Focus Absolute Return Fund	EUR	0	0	49.595	91,3031	4.528.177,24	0,21
IE00BYQDQ804	Old Mutual Absolute Return Government Bond Fund	EUR	0	344.734	1.956.600	10,5578	20.657.391,48	0,95
IE00B6VHBN16	PIMCO Funds Global Investors Series Plc. - Capital Securities Fund	EUR	0	1.107.139	3.272.461	13,4600	44.047.325,06	2,03
IE00B80G9288	PIMCO Funds Global Investors Series Plc. - Income Fund	EUR	5.175.395	2.668.978	2.506.417	13,5700	34.012.078,69	1,57
IE00BD38JM62	PIMCO GIS Mortgage Opportunities Fund	USD	1.961.592	0	1.961.592	10,4200	16.621.768,43	0,77
IE0003895277	PineBridge Asia ex Japan Small Cap Equity Fund	USD	0	0	24.640	681,6533	13.658.564,94	0,63
IE00BF0J8075	Trium Opportunistic Equity Fund	EUR	33.292	0	33.292	98,7900	3.288.916,68	0,15
							307.957.493,76	14,21
Luxemburg								
LU1021293185	AB Mortgage Income Portfolio S1 USD Inc	USD	500.000	0	500.000	16,4500	6.688.623,24	0,31
LU0476877054	Aberdeen Global - Japanese Smaller Companies Fund	EUR	0	0	1.249.874	25,9135	32.388.609,90	1,49
LU1040796796	AGENDA SICAV - Liquid Premium	EUR	0	0	1.069.142	9,8400	10.520.357,28	0,49
LU1664206528	Allianz Discovery Germany Strategy	EUR	12.414	0	12.414	1.014,5800	12.594.996,12	0,58
LU1570265261	Alpha UCITS SICAV - Fair Oaks Dynamic Credit Fund	EUR	5.000	0	15.000	1.020,8000	15.312.000,00	0,71
LU0272941112	Amundi Funds - Absolute Volatility Euro Equities	EUR	4.554	0	18.086	1.219,4300	22.054.610,98	1,02
LU0313648254	Amundi Funds II-European Equity Value	EUR	8.242	0	8.242	1.955,7400	16.119.209,08	0,74
LU1103259088	AQR UCITS Funds - Style Premia UCITS Fund	EUR	0	33.566	86.061	117,7100	10.130.240,31	0,47
LU0493865678	Ashmore SICAV - Emerging Markets Local Currency Bond Fund	EUR	505.931	222.425	283.506	79,0600	22.413.984,36	1,03
LU0575255335	Assenagon Alpha Volatility	EUR	0	381	11.748	1.021,6200	12.001.991,76	0,55
LU0188167505	AXA IM FIIS - US Short Duration High Yield	USD	70.000	0	70.000	187,2900	10.661.380,82	0,49
LU1337225053	BlueBay Global Sovereign Opportunities Fund	EUR	12.785	33.858	126.995	122,9600	15.615.305,20	0,72
LU1063708694	Boussard & Gavaudan SICAV - Absolute Return	EUR	14.212	0	14.212	1.120,2800	15.921.419,36	0,73
LU0784437740	BPI Global Investments Fund - BPI Alternative Iberian Equities Long short Fund	EUR	793.974	0	1.269.545	12,1210	15.388.154,95	0,71
LU0501220262	CGS FMS SICAV - Global Evolution Frontier Markets (Sub - Fund 1)	EUR	133.146	0	133.146	164,9500	21.962.432,70	1,01
LU0893376748	Cigogne UCITS - M&A Arbitrage	EUR	0	0	25.304	1.164,3200	29.461.953,28	1,36
LU1572743505	DB Platinum Midocean Absolute Return Credit	EUR	2.000	0	2.000	10.018,8800	20.037.760,00	0,92
LU1047850851	DNB Fund - TMT Absolute Return	EUR	21.323	0	169.545	112,0586	18.998.975,34	0,88
LU1155061614	Exane Funds 1 - Exane Archimedes Fund Cl. E	EUR	0	323	2.282	9.681,8100	22.093.890,42	1,02
LU0961411492	Falcon - Twelve-Falcon Insurance Linked Strategy Fund	EUR	46.000	0	46.000	109,6800	5.045.280,00	0,23
LU0650958159	Fidelity Active Strategy - Emerging Markets Fund	USD	0	0	387.680	178,9800	56.425.930,23	2,60
LU1135780176	Goldman Sachs Global Strategic Macro Bond Portfolio	EUR	0	3.249	305.132	102,9600	31.416.390,72	1,45
LU0490769915	Janus Henderson Fund - Janus Henderson United Kingdom Absolute Return Fund	EUR	0	539.279	3.122.221	7,1259	22.248.634,62	1,03
LU0248049412	JPMorgan Funds - Europe Strategic Value Fund	EUR	144.942	0	144.942	110,5800	16.027.686,36	0,74
LU0406668342	JPMorgan Funds - Systematic Alpha	EUR	0	110.853	112.627	110,2100	12.412.621,67	0,57
LU0189453631	Julius Bär Multibond - ABS Fund	EUR	0	0	196.952	114,3100	22.513.583,12	1,04
LU1388736503	Jupiter Global Fund - Jupiter Global Absolute Return	EUR	390.000	0	960.000	9,6200	9.235.200,00	0,43
LU0522256634	Jupiter JGF - Global Convertibles	EUR	777.967	863.977	777.967	13,9300	10.837.080,31	0,50
LU1602251818	Laffitte Risk Arbitrage UCITS/Luxembourg	EUR	2.602	381	2.221	11.259,7700	25.007.949,17	1,15
LU1162198839	LFIS Vision UCITS - Premia	EUR	0	524	22.676	1.154,5700	26.181.029,32	1,21
LU0394778749	LO Funds - Convertible Bond Asia USD	USD	786.800	392.218	786.800	17,5371	11.220.777,65	0,52
LU0834815101	LRI OptoFlex	EUR	3.500	0	41.318	1.220,9000	50.445.146,20	2,33
LU0489687755	Mandarine Funds - Mandarine Unique Small & Mid Caps Europe	EUR	0	507	230	92.922,4600	21.372.165,80	0,99
LU0476438642	Melchior European Absolute Return Fund	EUR	0	65.000	11.180	107,1891	1.198.374,03	0,06
LU1358059555	Melchior Selected Trust - Velox Fund	EUR	46.076	0	172.709	110,3373	19.056.239,56	0,88
LU0562189042	Merrill Lynch Investment Solutions - AQR Global Relative Value UCITS Fund	EUR	0	29.521	78.250	119,4600	9.347.745,00	0,43
LU1468410581	Merrill Lynch Investment Solutions - Enhanced Cross-Asset Volatility Premium Fd	EUR	100.000	0	340.000	102,2100	34.751.400,00	1,60
LU0994402526	Merrill Lynch Investment Solutions - Enhanced Volatility Premium Fund	EUR	0	0	191.385	118,8600	22.748.021,10	1,05
LU0333226826	Merrill Lynch Investment Solutions - Marshall Wace Tops UCITS Fund	EUR	0	0	121.009	144,4000	17.473.656,28	0,81
LU1680845879	Merrill Lynch Investment Solutions - Ramius Merger Arbitrage UCITS Fund	EUR	50.000	0	50.000	98,3500	4.917.500,00	0,23
LU1067856788	Most Diversified Portfolio SICAV - TOBAM Anti-Benchmark US Equity Fund A1	EUR	0	1.810	1.731	13.086,3800	22.652.523,78	1,05
LU1732224917	Pareto-Par.Nordic Corporate Bd	EUR	254.894	0	254.894	99,8483	25.450.732,58	1,17
LU0194438841	Parvest - Japan Small Cap	EUR	0	0	330.249	182,4000	60.237.417,60	2,78

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Berichtes.

UniAbsoluterErtrag

ISIN	Wertpapiere		Zugänge	Abgänge	Bestand	Kurs	Kurswert	Anteil am Fondsvermögen % ¹⁾
							EUR	
LU0823411292	Parvest Equity USA Small Cap	EUR	0	0	93.895	225,9413	21.214.757,05	0,98
LU1071462532	Pictet TR - Agora	EUR	0	0	219.807	125,0400	27.484.667,28	1,27
LU0635020901	Pictet TR - Kosmos	EUR	0	0	244.846	109,7500	26.871.848,50	1,24
LU0273643493	RWC Funds SICAV - RWC Global Convertibles Fund	EUR	6.781	7.258	6.781	1.593,9900	10.808.846,19	0,50
LU1429039461	Schroder Gaia Two Sigma Diversified	EUR	0	0	139.165	109,9100	15.295.625,15	0,71
LU1125543352	Serviced Platform SICAV - MSK Equity UCITS Fund	EUR	0	74.041	101.293	90,8083	9.198.245,13	0,42
LU0765416804	SKY Harbor Global Funds - US Short Duration High Yield Fund	USD	103.242	0	103.242	122,2400	10.262.863,63	0,47
LU1469429549	Threadneedle Lux - Pan European Absolute Alpha	EUR	150.000	0	310.000	10,0400	3.112.400,00	0,14
LU1669793827	UI - Aktia EM Frontier Bond+	EUR	50.275	0	50.275	100,2400	5.039.566,00	0,23
LU0090772608	UniEuropa Mid&Small Caps	EUR	0	0	649.930	52,9200	34.394.295,60	1,59
LU0006041197	UniFavorit: Renten	EUR	0	3.168.000	2.734.640	24,5500	67.135.412,00	3,10
LU1088284630	Uninstitutional CoCo Bonds	EUR	0	50.000	48.511	106,0300	5.143.621,33	0,24
LU1545615871	Uninstitutional EM Corporate Bonds Flexible	EUR	25.000	0	25.000	98,7200	2.468.000,00	0,11
LU1589413688	Uninstitutional EM High Yield Bonds	EUR	25.000	0	25.000	99,6700	2.491.750,00	0,11
LU0482734919	Uninstitutional EM Sovereign Bonds	EUR	112.078	0	112.078	90,2500	10.115.039,50	0,47
LU0315299569	Uninstitutional Global Convertibles	EUR	45.000	0	45.000	114,3500	5.145.750,00	0,24
LU1756676109	Uninstitutional MultiPremia	EUR	100.000	0	100.000	99,8200	9.982.000,00	0,46
LU0175818722	Uninstitutional Short Term Credit	EUR	105.000	0	754.079	46,4300	35.011.887,97	1,62
LU1099836758	Uninstitutional Structured Credit High Yield	EUR	0	0	69.200	119,8000	8.290.160,00	0,38
LU0247467987	UniReserve: Euro-Corporates	EUR	0	25.000	133.418	42,6200	5.686.275,16	0,26
LU1602255561	Vontobel Fund - Twentyfour Monument European Asset Backed Securities	EUR	100.000	0	100.000	102,4600	10.246.000,00	0,47
LU1577341644	Wellington Global Thematic Market Neutral Fund	EUR	510.000	0	510.000	9,4464	4.817.664,00	0,22
							1.198.805.654,69	55,31
Vereinigte Staaten von Amerika								
IE0031574977	Brandes Investment Funds PLC - Brandes European Value Fund	EUR	435.991	0	435.991	36,5900	15.952.910,69	0,74
							15.952.910,69	0,74
Investmentfondsanteile							1.925.710.915,25	88,86
Zertifikate								
Börsengehandelte Wertpapiere								
Australien								
XS1590565625	Macquarie Bank Ltd. (London Branch)/Maquarie Commodity Product 233T Index Zert. v.17(2020)	USD	349.895	0	349.895	103,2000	29.364.205,90	1,35
							29.364.205,90	1,35
Börsengehandelte Wertpapiere							29.364.205,90	1,35
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere								
Deutschland								
XS0461202136	Dte. Bank AG (London Branch)/DBLCI FLEX 40 USD TRAC Index Zert. v.14(2019)	USD	26.000	0	26.000	101,1100	2.137.805,97	0,10
							2.137.805,97	0,10
Europäische Gemeinschaft								
DE000DD2JTX0	DZ Bank AG/Euro Stoxx 50 Index Zert. v.17(2019)	EUR	315.000	0	315.000	34,0800	10.735.200,00	0,50
							10.735.200,00	0,50
Frankreich								
XS1673285638	BNP Paribas Arbitrage Issuance BV/BNP Paribas Strategy 3YCL Index Zert. v.17(2020)	USD	115	0	115	106.060,9375	9.918.685,70	0,46
							9.918.685,70	0,46
Schweiz								
XS1605262119	Credit Suisse AG/Credit Suisse Custom Commodity 109 Total Return Index Zert. v.17(2018)	USD	350	0	350	204.660,0000	58.250.792,88	2,69
							58.250.792,88	2,69
Vereinigte Staaten von Amerika								
XS1009877918	Credit Suisse AG/Credit Suisse Custom Commodity 140 Total Return Index Zert. v.17(2018)	USD	13	0	13	209.140,0000	2.210.962,02	0,10
							2.210.962,02	0,10
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere							83.253.446,57	3,85
Zertifikate							112.617.652,47	5,20
Wertpapiervermögen							2.079.388.482,03	96,00

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Berichtes.

UniAbsoluterErtrag

ISIN	Wertpapiere	Zugänge	Abgänge	Bestand	Kurs	Kurswert EUR	Anteil am Fonds- vermögen % 1)
Optionen							
Long-Positionen							
EUR							
	Call on Euro Stoxx 50 Price Index Juni 2018/3.450,00	1.000	0	1.000		240.000,00	0,01
	Call on 3MO Euribor Future März 2019/100,500	4.000	0	4.000		-40.000,00	0,00
	Put on Euribor 3M Mid-curve Future Juni 2018/100,000	2.000	0	2.000		-135.000,00	-0,01
	Put on EUR/JPY Mai 2018/128,00	40.000.000	0	40.000.000		132.040,00	0,01
	Put on 3MO Euribor Future März 2019/100,000	4.000	0	4.000		-275.000,00	-0,01
						-77.960,00	0,00
GBP							
	Call on 3MO Libor Currency Future Juni 2018/99,375	7.000	0	7.000		-403.521,92	-0,02
	Call on 3MO Libor Currency Future Juni 2018/99,625	7.000	0	7.000		-84.911,46	0,00
						-488.433,38	-0,02
JPY							
	Call on Nikkei 225 Stock Average Index (JPY) Juni 2018/23.500,00	300	0	300		140.208,48	0,01
						140.208,48	0,01
USD							
	Call on 3MO Eurodollar Future Juni 2019/98,125	3.000	0	3.000		213.466,70	0,01
	Call on 3MO Eurodollar Future März 2019/98,125	3.000	0	3.000		121.980,97	0,01
	Put on Eurodollar Mid-curve Future Juni 2018/97,00	3.000	0	3.000		91.485,73	0,00
	Put on 3MO Eurodollar Future Juni 2019/96,875	3.000	0	3.000		335.447,67	0,02
	Put on 3MO Eurodollar Future März 2019/97,250	3.000	0	3.000		625.152,48	0,03
						1.387.533,55	0,07
Long-Positionen							
						961.348,65	0,06
Short-Positionen							
EUR							
	Call on EUR/JPY Mai 2018/140,00	0	40.000.000	-40.000.000		-1.560,00	0,00
	Call on 3MO Euribor Future März 2019/100,375	0	4.000	-4.000		25.000,00	0,00
	Put on Euribor 3M Mid-curve Future Juni 2018/99,750	0	2.000	-2.000		43.750,00	0,00
	Put on EUR/JPY Mai 2018/120,00	0	40.000.000	-40.000.000		-1.640,00	0,00
	Put on Euro Stoxx 50 Price Index Juni 2018/3.000,00	0	800	-800		-216.000,00	-0,01
	Put on Euro Stoxx 50 Price Index Juni 2018/3.100,00	0	1.000	-1.000		-413.000,00	-0,02
	Put on 3MO Euribor Future März 2019/99,750	0	4.000	-4.000		125.000,00	0,01
						-438.450,00	-0,02
GBP							
	Call on 3MO Libor Currency Future Juni 2018/99,500	0	14.000	-14.000		314.892,02	0,01
						314.892,02	0,01
JPY							
	Put on Nikkei 225 Stock Average Index (JPY) Juni 2018/21.750,00	0	300	-300		-2.317.328,72	-0,11
						-2.317.328,72	-0,11
USD							
	Call on 3MO Eurodollar Future Juni 2019/97,875	0	3.000	-3.000		-365.942,91	-0,02
	Call on 3MO Eurodollar Future März 2019/98,000	0	3.000	-3.000		-182.971,46	-0,01
	Call on 5YR Treasury 6% Future April 2018/114,25	1.850	3.700	-1.850		-611.175,49	-0,03
	Put on Eurodollar Mid-curve Future Juni 2018/96,75	0	3.000	-3.000		-15.247,62	0,00
	Put on 3MO Eurodollar Future Juni 2019/96,500	0	3.000	-3.000		-60.990,49	0,00
	Put on 3MO Eurodollar Future März 2019/97,000	0	3.000	-3.000		-213.466,70	-0,01
						-1.449.794,67	-0,07
Short-Positionen							
						-3.890.681,37	-0,19
Optionen							
						-2.929.332,72	-0,13

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Berichtes.

UniAbsoluterErtrag

ISIN	Wertpapiere	Zugänge	Abgänge	Bestand	Kurs	Kurswert EUR	Anteil am Fonds- vermögen % 1)
Terminkontrakte							
Long-Positionen							
EUR							
	Continental AG Future Juni 2018	10	0	10		-99,60	0,00
	DAX Performance-Index Future Juni 2018	134	4	130		-861.787,50	-0,04
	Dte. Telekom AG Future Juni 2018	225	75	150		2.677,25	0,00
	EURO STOXX Chemicals Future Juni 2018	190	0	190		-529.150,00	-0,02
	Henkel AG & Co. KGaA -VZ- Future Juni 2018	80	0	80		-34.512,00	0,00
	Infineon Technologies AG Future Juni 2018	100	0	100		-9.703,00	0,00
	iSTOXX Europe Value Factor Index (Net Return) (EUR) Future Juni 2018	7.000	0	7.000		-945.000,00	-0,04
	Stoxx 600 Utilities Future Juni 2018	20	0	20		2.675,00	0,00
						-2.374.899,85	-0,10
GBP							
	LIF 3MO Sterling Future Dezember 2019	4.000	0	4.000		-171.135,20	-0,01
						-171.135,20	-0,01
USD							
	CME 3MO Euro-Dollar Future Dezember 2018	3.100	300	2.800		-576.360,09	-0,03
	MSCI USA Value Weight Capacity Index (Net Return) (USD) Future Juni 2018	3.436	0	3.436		-2.964.615,75	-0,14
	Russell 2000 Index Future Juni 2018	442	0	442		-1.342.498,17	-0,06
	US Dollar Currency Future Juni 2018	2.896	0	2.896		-1.825.160,61	-0,08
						-6.708.634,62	-0,31
						-9.254.669,67	-0,42
Long-Positionen							
Short-Positionen							
CHF							
	Geberit AG Future Juni 2018	0	10	-10		5.084,67	0,00
	Nestlé S.A. Future Juni 2018	0	100	-100		8.048,41	0,00
	Panalpina Welttransport Holding AG Future Juni 2018	10	20	-10		20.770,70	0,00
						33.903,78	0,00
EUR							
	Accor S.A. Future Juni 2018	40	90	-50		10.334,50	0,00
	Carrefour S.A. Future Juni 2018	0	200	-200		12.038,00	0,00
	Cie de Saint-Gobain Future Juni 2018	45	95	-50		15.908,90	0,00
	Dte. Lufthansa AG Future Mai 2018	0	125	-125		3.055,25	0,00
	EURO STOXX Automobiles&Parts Future Juni 2018	7	27	-20		-13.650,00	0,00
	EURO STOXX Industrial Goods&Services Future Juni 2018	0	30	-30		14.150,00	0,00
	European Aeronautic Defence and Space Co. Future Juni 2018	0	25	-25		7.862,75	0,00
	EUX 30YR Bundesanleihe 4% Future Juni 2018	0	150	-150		-440.000,00	-0,02
	Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide Future Juni 2018	0	80	-80		34.228,00	0,00
	Henkel AG & Co. KGaA Future Juni 2018	0	150	-150		6.755,60	0,00
	Hugo Boss AG Future Juni 2018	30	85	-55		3.514,30	0,00
	iSTOXX Europe Momentum Factor Net Return Index (EUR) Future Juni 2018	0	3.384	-3.384		219.960,00	0,01
	Koninklijke Philips NV Future Juni 2018	75	150	-75		4.413,25	0,00
	Merck KGaA Future Juni 2018	0	55	-55		9.653,55	0,00
	MSCI Europe Index (Net Return) (EUR) Future Juni 2018	0	2.439	-2.439		512.190,00	0,02
	MSCI World Net EUR Index Future Juni 2018	0	1.870	-1.870		1.802.605,20	0,08
	MTU Aero Engines AG Future Juni 2018	15	35	-20		-5.277,80	0,00
	STOXX Europe 600 Price Index (EUR) Future Juni 2018	0	7.649	-7.649		2.200.393,00	0,10
	Stoxx 600 Automobiles&Parts Future Juni 2018	0	15	-15		-2.400,00	0,00
	Stoxx 600 Construction&Materials Future Juni 2018	10	56	-46		20.605,54	0,00
	STOXX 600 Food & Beverages Future Juni 2018	0	20	-20		9.460,00	0,00
	STOXX 600 Technology Index (Price) (EUR) Future Juni 2018	0	55	-55		42.575,00	0,00
	Stoxx 600 Telecommunications Future Juni 2018	0	46	-46		12.845,01	0,00
	Valéo S.A. Future Juni 2018	30	60	-30		2.069,90	0,00
						4.483.289,95	0,19

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Berichtes.

UniAbsoluterErtrag

ISIN	Wertpapiere	Zugänge	Abgänge	Bestand	Kurs	Kurswert EUR	Anteil am Fonds- vermögen % 1)
GBP							
	FTSE 100 Index Future Juni 2018	0	13	-13		19.689,02	0,00
	LIF 3MO Sterling Future Dezember 2018	0	4.000	-4.000		798.573,87	0,04
						818.262,89	0,04
JPY							
	Yen Denominated Nikkei 225 Index Future Juni 2018	223	1.500	-1.277		-2.101.943,34	-0,10
						-2.101.943,34	-0,10
USD							
	CBT 2YR US T-Bill 6% Future Juni 2018	0	1.050	-1.050		40.024,15	0,00
	CBT 5YR US T-Bond Note 6% Future Juni 2018	0	1.400	-1.400		-330.999,80	-0,02
	CME 3MO Euro-Dollar Future Dezember 2019	0	2.800	-2.800		398.471,17	0,02
	E-Mini S&P 500 Index Future Juni 2018	300	557	-257		1.525.656,66	0,07
	MINI MSCI EM INDEX FUTURE (NYSE) Future Juni 2018	0	1.175	-1.175		1.990.383,85	0,09
	MSCI Asia Pacific ex Japan Index Future Juni 2018	0	89	-89		86.126,70	0,00
	MSCI USA Index (Net Return) (USD) Index Future Juni 2018	0	1.224	-1.224		3.663.934,29	0,17
	NYSE FANG+ Index Future Juni 2018	0	2	-2		-2.317,64	0,00
						7.371.279,38	0,33
Short-Positionen						10.604.792,66	0,46
Terminkontrakte						1.350.122,99	0,04
Credit Default Swaps							
Gekauft							
EUR							
	Barclays Bank Plc./iTraxx Europe S27 5Yr Index CDS v.17(2022)	75.000.000	0	75.000.000		-1.790.992,50	-0,08
	Barclays Bank Plc./Vereinigte Staaten von Amerika CDS v.17(2021)	0	0	100.000.000		-114.516,00	-0,01
	Dte. Bank AG, Frankfurt/iTraxx Europe S27 5Yr Index CDS v.17(2022)	100.000.000	0	100.000.000		-2.387.990,00	-0,11
	J.P. Morgan Securities Plc., London/iTraxx Europe S28 3Yr Index CDS v.17(2020)	160.000.000	0	160.000.000		-3.357.680,00	-0,15
						-7.651.178,50	-0,35
USD							
	J.P. Morgan Securities Plc., London/Großbritannien CDS v.17(2022)	50.000.000	0	50.000.000		-1.448.837,93	-0,07
						-1.448.837,93	-0,07
Gekauft							
Verkauft							
EUR							
	Dte. Bank AG, Frankfurt/iTraxx Europe S27 10Yr Index CDS v.17(2027)	0	54.000.000	-54.000.000		558.003,60	0,03
	J.P. Morgan Securities Plc., London/iTraxx Europe S28 5Yr Index CDS v.17(2022)	0	100.000.000	-100.000.000		2.317.190,00	0,11
						2.875.193,60	0,14
USD							
	J.P. Morgan Securities Plc., London/Spanien CDS v.18(2022)	0	50.000.000	-50.000.000		1.160.784,74	0,05
						1.160.784,74	0,05
Verkauft							
Credit Default Swaps						4.035.978,34	0,19
						-5.064.038,09	-0,23
Sonstige Finanzinstrumente							
AUD							
	SWAP Australian Bank Bill Swap Rate 6 Monate (BBSW)/2.6150% 03.10.2023	0	34.000.000	-34.000.000		-2.610.543,46	-0,12
	SWAP Australian Bank Bill Swap Rate 6 Monate (BBSW)/2.6150% 03.10.2023	34.000.000	0	34.000.000		2.593.052,17	0,12
	SWAP Australian Bank Bill Swap Rate 6 Monate (BBSW)/2.6550% 29.09.2023	0	65.000.000	-65.000.000		-5.071.182,96	-0,23
	SWAP Australian Bank Bill Swap Rate 6 Monate (BBSW)/2.6550% 29.09.2023	65.000.000	0	65.000.000		4.956.917,11	0,23
	SWAP 2.1725%/Australian Bank Bill Swap Rate 3 Monate (BBSW) 03.10.2020	82.000.000	0	82.000.000		2.175.200,41	0,10
	SWAP 2.1725%/Australian Bank Bill Swap Rate 3 Monate (BBSW) 03.10.2020	0	82.000.000	-82.000.000		-2.151.802,68	-0,10
	SWAP 2.1875%/Australian Bank Bill Swap Rate 3 Monate (BBSW) 29.09.2020	150.000.000	0	150.000.000		3.996.835,54	0,18
	SWAP 2.1875%/Australian Bank Bill Swap Rate 3 Monate (BBSW) 29.09.2020	0	150.000.000	-150.000.000		-3.919.159,91	-0,18
						-30.683,78	0,00
EUR							
	SWAP EURIBOR (EUR) 6 Monate/0.4870% 20.02.2023	90.000.000	0	90.000.000		1.550.790,00	0,07
	SWAP EURIBOR (EUR) 6 Monate/0.4870% 20.02.2023	0	90.000.000	-90.000.000		-2.145.460,50	-0,10

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Berichtes.

UniAbsoluterErtrag

ISIN	Wertpapiere	Zugänge	Abgänge	Bestand	Kurs	Kurswert EUR	Anteil am Fonds- vermögen % 1)
	SWAP EURIBOR (EUR) 6 Monate/1.6645% 20.02.2048	16.750.000	0	16.750.000	6.351.523,29		0,29
	SWAP EURIBOR (EUR) 6 Monate/1.6645% 20.02.2048	0	16.750.000	-16.750.000	-7.070.067,63		-0,33
	SWAP EUROZONE HICP EX TOBACCO/1.2675% 28.09.2022	130.000.000	0	130.000.000	138.600.612,80		6,39
	SWAP EUROZONE HICP EX TOBACCO/1.2675% 28.09.2022	0	130.000.000	-130.000.000	-137.751.342,30		-6,35
	SWAP EUROZONE HICP EX TOBACCO/1.2940% 15.11.2022	65.000.000	0	65.000.000	69.194.333,00		3,19
	SWAP EUROZONE HICP EX TOBACCO/1.2940% 15.11.2022	0	65.000.000	-65.000.000	-68.893.247,80		-3,18
	SWAP EUROZONE HICP EX TOBACCO/1.3490% 15.11.2022	0	65.000.000	-65.000.000	-69.080.487,45		-3,19
	SWAP EUROZONE HICP EX TOBACCO/1.3490% 15.11.2022	65.000.000	0	65.000.000	69.194.333,00		3,19
	SWAP EUROZONE HICP EX TOBACCO/1.5425% 15.06.2025	0	0	-3.000.000	-3.377.266,17		-0,16
	SWAP EUROZONE HICP EX TOBACCO/1.5425% 15.06.2025	0	0	3.000.000	3.296.353,62		0,15
	SWAP 1.1470%/EURIBOR (EUR) 6 Monate 20.02.2028	88.000.000	0	88.000.000	9.769.284,80		0,45
	SWAP 1.1470%/EURIBOR (EUR) 6 Monate 20.02.2028	0	88.000.000	-88.000.000	-8.187.403,84		-0,38
	SWAP 1.4425%/EUROZONE HICP EX TOBACCO 28.09.2027	0	130.000.000	-130.000.000	-141.006.427,90		-6,51
	SWAP 1.4425%/EUROZONE HICP EX TOBACCO 28.09.2027	130.000.000	0	130.000.000	139.977.827,60		6,46
	SWAP 1.4730%/EUROZONE HICP EX TOBACCO 15.11.2027	65.000.000	0	65.000.000	70.046.865,20		3,23
	SWAP 1.4730%/EUROZONE HICP EX TOBACCO 15.11.2027	0	65.000.000	-65.000.000	-70.352.588,80		-3,25
	SWAP 1.5220%/EUROZONE HICP EX TOBACCO 15.11.2027	65.000.000	0	65.000.000	70.385.848,00		3,25
	SWAP 1.5220%/EUROZONE HICP EX TOBACCO 15.11.2027	0	65.000.000	-65.000.000	-70.352.588,80		-3,25
	SWAP 1.5425%/EURIBOR (EUR) 6 Monate 14.11.2027	0	63.000.000	-63.000.000	-4.635.494,01		-0,21
	SWAP 1.5425%/EURIBOR (EUR) 6 Monate 14.11.2027	63.000.000	0	63.000.000	4.662.866,25		0,22
	Total Return SWAP Strategie GS UI ARP Swap/Strategie GS UI ARP Swap 18.01.19	29.939.430	0	29.939.430	-122.430,11		-0,01
	Total Return SWAP Strategie JPM Mergers & Acquisitions/Strategie JPM Mergers & Acquisitions 15.02.19	39.909.600	0	39.909.600	1.997.344,58		0,09
	Total Return SWAP STRATEGIE DB Tax Profiteure EU/STRATEGIE DB Tax Profiteure EU 14.12.18	30.563.340	10.187.780	20.375.560	-35.465,29		0,00
	Total Return SWAP STRATEGIE JPM Factor Hedge Europe/STRATEGIE JPM Factor Hedge Europe 07.12.18	19.950.000	382.000	19.568.000	-244.610,76		-0,01
	Total Return SWAP STRATEGIE zu MS FSI Europe/STRATEGIE zu MS FSI Europe 01.06.19	65.000.000	0	65.000.000	-596.103,95		-0,03
					1.176.996,83		0,02
GBP							
	Total Return SWAP LIBOR (GBP) 6 Monate/STRATEGIE JPM HCT UK Domestic Long 15.02.19	30.148.200	9.658.900	20.489.300	935.280,79		0,04
					935.280,79		0,04
HUF							
	SWAP 1.0000%/BUBOR (HUF) 6 Monate 23.01.2023	10.000.000.000	0	10.000.000.000	1.517.009,93		0,07
	SWAP 1.0000%/BUBOR (HUF) 6 Monate 23.01.2023	0	10.000.000.000	-10.000.000.000	-1.446.223,65		-0,07
					70.786,28		0,00
JPY							
	SWAP LIBOR (JPY) 6 Monate/0.2900% 27.03.2028	5.350.000.000	0	5.350.000.000	1.207.952,13		0,06
	SWAP LIBOR (JPY) 6 Monate/0.2900% 27.03.2028	0	5.350.000.000	-5.350.000.000	-1.182.970,54		-0,05
	SWAP LIBOR (JPY) 6 Monate/0.3250% 12.06.2028	0	2.600.000.000	-2.600.000.000	-644.432,49		-0,03
	SWAP LIBOR (JPY) 6 Monate/0.3250% 12.06.2028	2.600.000.000	0	2.600.000.000	617.293,90		0,03
	SWAP LIBOR (JPY) 6 Monate/0.3850% 17.07.2028	0	5.400.000.000	-5.400.000.000	-1.585.716,93		-0,07
	SWAP LIBOR (JPY) 6 Monate/0.3850% 17.07.2028	5.400.000.000	0	5.400.000.000	1.311.770,41		0,06
	SWAP 0.1130%/LIBOR (JPY) 6 Monate 27.03.2023	10.700.000.000	0	10.700.000.000	462.121,93		0,02
	SWAP 0.1130%/LIBOR (JPY) 6 Monate 27.03.2023	0	10.700.000.000	-10.700.000.000	-464.117,84		-0,02
	SWAP 0.1225%/LIBOR (JPY) 6 Monate 12.06.2023	5.300.000.000	0	5.300.000.000	248.400,87		0,01
	SWAP 0.1225%/LIBOR (JPY) 6 Monate 12.06.2023	0	5.300.000.000	-5.300.000.000	-251.778,58		-0,01
	SWAP 0.1620%/LIBOR (JPY) 6 Monate 17.07.2023	10.700.000.000	0	10.700.000.000	663.531,91		0,03
	SWAP 0.1620%/LIBOR (JPY) 6 Monate 17.07.2023	0	10.700.000.000	-10.700.000.000	-529.603,93		-0,02
	Total Return SWAP STRATEGIE JPM Japan Financials/STRATEGIE JPM Japan Financials 20.09.18	2.119.200.000	4.000.000	2.115.200.000	-613.358,02		-0,03
	Total Return SWAP STRATEGIE JPM Japan Financials/STRATEGIE JPM Japan Financials 20.09.18	2.177.200.000	62.000.000	2.115.200.000	-613.655,35		-0,03
	Total Return SWAP STRATEGIE JPM VOL EQUITY NKY/STRATEGIE JPM VOL EQUITY NKY 15.02.19	1.266.340.800	0	1.266.340.800	-120.235,06		-0,01
	Total Return SWAP STRATEGIE MS Japan Buyback/STRATEGIE MS Japan Buyback 02.11.18	2.431.000.000	18.020.511	2.412.979.489	738.419,44		0,04
					-756.378,15		-0,02
PLN							
	SWAP 2.1525%/WIBOR Warsaw Interbank 6 Months Offered Rate 04.10.2020	0	220.000.000	-220.000.000	-2.497.605,09		-0,12
	SWAP 2.1525%/WIBOR Warsaw Interbank 6 Months Offered Rate 04.10.2020	220.000.000	0	220.000.000	2.740.171,79		0,13
					242.566,70		0,01

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Berichtes.

UniAbsoluterErtrag

ISIN	Wertpapiere	Zugänge	Abgänge	Bestand	Kurs	Kurswert	Anteil am Fondsvermögen % ¹⁾
						EUR	
SEK							
	SWAP STIBOR (SEK) 3 Monate/2.0350% 14.11.2027	626.000.000	0	626.000.000		5.347.655,16	0,25
	SWAP STIBOR (SEK) 3 Monate/2.0350% 14.11.2027	0	626.000.000	-626.000.000		-5.705.819,17	-0,26
						-358.164,01	-0,01
USD							
	Excess Return SWAP/Barclays Liquidity Nearby 1717 BCI Energy and Industrial Metals Capped Strategy 16.04.18	25.000.000	0	25.000.000		175.388,10	0,01
	Excess Return SWAP/Barclays Liquidity Nearby 1720 BCI Energy and Industrial Metals Capped Strategy 16.04.18	25.000.000	0	25.000.000		-204.840,41	-0,01
	Excess Return SWAP/DB Commodity Deferred 6 Index 11.10.18	27.000.000	0	27.000.000		339.162,12	0,02
	Excess Return SWAP/DB Commodity Nearby 6 Index 11.10.18	27.000.000	0	27.000.000		-332.983,97	-0,02
	Excess Return SWAP/DB Commodity Volatilit.Premium Index (USD) 08.02.19	15.000.000	15.379	14.984.621		93.886,20	0,00
	Excess Return SWAP/DB Commodity Volatilit.Premium Index (USD) 13.02.19	14.115.900	0	14.115.900		88.443,23	0,00
	Excess Return SWAP/DB Commodity Volatilit.Premium Index (USD) 27.11.18	12.161.799	211.801	11.949.998		74.872,76	0,00
	Excess Return SWAP/DB Commodity Volatilit.Premium Index (USD) 27.11.18	12.321.087	252.491	12.068.596		75.615,83	0,00
	Excess Return SWAP/DB Commodity Volatilit.Premium Index (USD) 27.11.18	12.431.097	254.746	12.176.351		76.290,98	0,00
	Excess Return SWAP/Deutsche Bank AG Commodity Momentum Alpha Long Index 11.10.18	7.000.000	0	7.000.000		11.126,68	0,00
	Excess Return SWAP/Deutsche Bank AG Commodity Momentum Alpha Short Index 11.10.18	7.000.000	0	7.000.000		18.339,92	0,00
	Excess Return SWAP/J.P. Morgan Locator Strategy exAL 11.10.18	25.120.899	0	25.120.899		-487.098,87	-0,02
	Excess Return SWAP/Morgan Stanley Anti Radar ex Agriculture & Livestock ER Index 11.10.18	165.000.000	0	165.000.000		1.653.092,83	0,08
	Excess Return SWAP/Morgan Stanley Dynamic Weekly Backwardated Basket XAL (UCITS) Index 31.10.18	3.500.000	0	3.500.000		-62.231,95	0,00
	Excess Return SWAP/Morgan Stanley Dynamic Weekly Contango Basket XAL (UCITS) Index 31.10.18	3.500.000	0	3.500.000		14.372,80	0,00
	Excess Return SWAP/MS Radar ex Agri & LvstK Finl Index 11.10.18	165.000.000	0	165.000.000		-980.347,15	-0,04
	SWAP LIBOR (USD) 3 Monate/2.2050% 20.11.2020	0	367.300.000	-367.300.000		-6.247.932,20	-0,29
	SWAP LIBOR (USD) 3 Monate/2.2050% 20.11.2020	367.300.000	0	367.300.000		7.969.552,76	0,37
	SWAP LIBOR (USD) 3 Monate/2.4530% 13.01.2021	633.000.000	0	633.000.000		13.513.667,19	0,62
	SWAP LIBOR (USD) 3 Monate/2.4530% 13.01.2021	0	633.000.000	-633.000.000		-11.753.544,21	-0,54
	SWAP LIBOR (USD) 3 Monate/2.5425% 11.05.2037	31.000.000	0	31.000.000		10.653.220,46	0,49
	SWAP LIBOR (USD) 3 Monate/2.5425% 11.05.2037	0	31.000.000	-31.000.000		-9.485.719,17	-0,44
	SWAP LIBOR (USD) 3 Monate/2.8220% 02.02.2038	24.000.000	0	24.000.000		8.486.825,86	0,39
	SWAP LIBOR (USD) 3 Monate/2.8220% 02.02.2038	0	24.000.000	-24.000.000		-8.379.644,21	-0,39
	SWAP US CPI Urban Consumer Non Seasonal Adjusted Index/2.1437% 08.11.2027	0	90.000.000	-90.000.000		-71.867.798,00	-3,32
	SWAP US CPI Urban Consumer Non Seasonal Adjusted Index/2.1437% 08.11.2027	90.000.000	0	90.000.000		73.022.529,40	3,37
	SWAP US CPI Urban Consumer Non Seasonal Adjusted Index/2.1645% 01.12.2027	90.000.000	0	90.000.000		69.118.564,04	3,19
	SWAP US CPI Urban Consumer Non Seasonal Adjusted Index/2.1645% 01.12.2027	0	90.000.000	-90.000.000		-68.360.443,77	-3,15
	SWAP US CPI Urban Consumer Non Seasonal Adjusted Index/2.1662% 28.09.2027	180.000.000	0	180.000.000		146.779.582,34	6,77
	SWAP US CPI Urban Consumer Non Seasonal Adjusted Index/2.1662% 28.09.2027	0	180.000.000	-180.000.000		-144.457.740,42	-6,66
	SWAP 2.0325%/US CPI Urban Consumer Non Seasonal Adjusted Index 01.12.2022	90.000.000	0	90.000.000		70.752.056,36	3,26
	SWAP 2.0325%/US CPI Urban Consumer Non Seasonal Adjusted Index 01.12.2022	0	90.000.000	-90.000.000		-71.416.512,08	-3,29
	SWAP 2.0475%/US CPI Urban Consumer Non Seasonal Adjusted Index 08.11.2022	0	90.000.000	-90.000.000		-73.555.188,58	-3,39
	SWAP 2.0475%/US CPI Urban Consumer Non Seasonal Adjusted Index 08.11.2022	90.000.000	0	90.000.000		72.713.406,44	3,35
	SWAP 2.0625%/LIBOR (USD) 3 Monate 20.11.2019	360.300.000	0	360.300.000		5.872.816,75	0,27
	SWAP 2.0625%/LIBOR (USD) 3 Monate 20.11.2019	0	360.300.000	-360.300.000		-7.483.246,70	-0,35
	SWAP 2.0650%/US CPI Urban Consumer Non Seasonal Adjusted Index 28.09.2022	180.000.000	0	180.000.000		145.947.988,78	6,73
	SWAP 2.0650%/US CPI Urban Consumer Non Seasonal Adjusted Index 28.09.2022	0	180.000.000	-180.000.000		-147.845.511,10	-6,82
	SWAP 2.3225%/LIBOR (USD) 3 Monate 11.05.2027	0	55.000.000	-55.000.000		-10.045.958,65	-0,46
	SWAP 2.3225%/LIBOR (USD) 3 Monate 11.05.2027	55.000.000	0	55.000.000		8.406.185,78	0,39
	SWAP 2.3475%/LIBOR (USD) 3 Monate 11.01.2020	0	616.000.000	-616.000.000		-12.954.419,39	-0,60
	SWAP 2.3475%/LIBOR (USD) 3 Monate 11.01.2020	616.000.000	0	616.000.000		11.338.472,60	0,52
	SWAP 2.7200%/LIBOR (USD) 3 Monate 02.02.2028	0	42.000.000	-42.000.000		-8.227.479,63	-0,38
	SWAP 2.7200%/LIBOR (USD) 3 Monate 02.02.2028	42.000.000	0	42.000.000		8.033.055,87	0,37
	Total Return SWAP LIBOR (USD) 3 Monate/S&P 500 Index TR 21.01.19	25.000.000	12.500.000	12.500.000		531.094,07	0,03
	Total Return SWAP S&P Regional Banks Select Industry Index/LIBOR (USD) 3 Monate 21.01.19	25.000.000	12.500.000	12.500.000		-482.763,49	-0,02
	Total Return SWAP STRATEGIE MS UI CUBE RATES/STRATEGIE MS UI CUBE RATES 20.03.19	87.017.400	0	87.017.400		-56.599,17	0,00
	Total Return SWAP STRATEGIE Barclays FX Month End/STRATEGIE Barclays FX Month End 23.04.19	9.546.188	0	9.546.188		99.219,33	0,00
	Total Return SWAP STRATEGIE BARCLAYS RATES CARRY/STRATEGIE BARCLAYS RATES CARRY 19.04.19	25.107.376	0	25.107.376		121.402,34	0,01
	Total Return SWAP STRATEGIE BARCLAYS RATES MOMENTUM/STRATEGIE BARCLAYS RATES MOMENTUM 19.04.19	13.602.272	0	13.602.272		-15.806,93	0,00
	Total Return SWAP STRATEGIE GS INTRADAY TREND VIX ER STRATEGY/STRATEGIE GS INTRADAY TREND VIX ER STRATEGY 04.12.18	44.818.400	20.926.400	23.892.000		1.196.761,30	0,06

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Berichtes.

UniAbsoluterErtrag

ISIN	Wertpapiere	Zugänge	Abgänge	Bestand	Kurs	Kurswert	Anteil am Fondsvermögen % ¹⁾
						EUR	
	Total Return SWAP STRATEGIE JPM Financial Leverage/STRATEGIE JPM Financial Leverage 15.02.19	25.060.025	0	25.060.025		199.370,16	0,01
	Total Return SWAP STRATEGIE JPM FSI EM/STRATEGIE JPM FSI EM 15.02.19	25.318.325	0	25.318.325		-149.642,07	-0,01
	Total Return SWAP STRATEGIE JPM HCT Cyber Security/STRATEGIE JPM HCT Cyber Security 02.08.18	12.049.400	803.000	11.246.400		7.474,91	0,00
	Total Return SWAP STRATEGIE JPM HCT Cyber Security/STRATEGIE JPM HCT Cyber Security 31.07.18	11.711.700	465.300	11.246.400		7.474,91	0,00
	Total Return SWAP STRATEGIE JPM Oil Services/STRATEGIE JPM Oil Services 15.02.19	12.440.662	0	12.440.662		-183.150,98	-0,01
	Total Return SWAP STRATEGIE JPM PROFITEURE LNG LONG/LIBOR (USD) 6 Monate 15.02.19	12.725.063	0	12.725.063		-385.688,91	-0,02
	Total Return SWAP STRATEGIE JPM Value Sectorneutral/STRATEGIE JPM Value Sectorneutral 15.02.19	60.477.885	0	60.477.885		515.546,31	0,02
	Total Return SWAP STRATEGIE JPM Value Tax/STRATEGIE JPM Value Tax 15.02.19	51.715.500	0	51.715.500		-2.154.526,10	-0,10
	Total Return SWAP STRATEGIE JPM VIX INTRADAY CURVE STRATEGY/STRATEGIE JPM VIX INTRADAY CURVE STRATEGY 15.02.19	25.704.000	0	25.704.000		-156.831,40	-0,01
	Total Return SWAP Strategie MS Global Equity Volatility/Strategie MS Global Equity Volatility 17.12.18	15.472.500	219.000	15.253.500		-53.550,49	0,00
	Total Return SWAP STRATEGIE US Equity Tail Hedge Index/STRATEGIE US Equity Tail Hedge Index 18.12.18	11.507.636	230.836	11.276.800		-184.109,97	-0,01
	Total Return SWAP STRATEGIE zu MS FX Carry DM/STRATEGIE zu MS FX Carry DM 22.03.19	213.282	32	213.250		0,00	0,00
						-64.450,56	-0,02
Sonstige Finanzinstrumente						1.215.954,10	0,02
Bankguthaben - Kontokorrent						83.339.232,35	3,84
Sonstige Vermögensgegenstände/Sonstige Verbindlichkeiten						10.357.655,94	0,46
Fondsvermögen in EUR						2.167.658.076,60	100,00

- 1) Aufgrund von Rundungsdifferenzen in den Einzelpositionen können die Summen vom tatsächlichen Wert abweichen.
- 2) Angaben zu Ausgabebaufschlägen, Rücknahmeabschlägen sowie zur maximalen Höhe der Verwaltungsgebühr für Zielfondsanteile sind auf Anfrage am Sitz der Verwaltungsgesellschaft, bei der Verwahrstelle und bei den Zahlstellen kostenlos erhältlich. Von gehaltenen Anteilen eines Zielfonds, die unmittelbar oder aufgrund einer Übertragung von derselben Verwaltungsgesellschaft oder von einer Gesellschaft verwaltet werden, mit der die Verwaltungsgesellschaft durch eine gemeinsame Verwaltung oder Beherrschung oder eine wesentliche direkte oder indirekte Beteiligung verbunden ist, wird keine oder eine reduzierte Verwaltungsvergütung berechnet.

Devisentermingeschäfte

Zum 31.03.2018 standen folgende offene Devisentermingeschäfte aus:

Währung		Währungsbetrag	Kurswert	Anteil am Fondsvermögen %
			EUR	
PLN/EUR	Währungskäufe	84.667.244,00	19.984.663,21	0,92
NZD/EUR	Währungskäufe	2.730.000,00	1.591.433,08	0,07
NOK/EUR	Währungskäufe	127.610.626,81	13.208.344,79	0,61
JPY/EUR	Währungskäufe	428.980.000,00	3.278.570,73	0,15
GBP/EUR	Währungskäufe	2.890.000,00	3.288.100,15	0,15
CZK/EUR	Währungskäufe	562.511.422,00	22.155.553,41	1,02
AUD/EUR	Währungskäufe	2.550.000,00	1.581.256,10	0,07
USD/EUR	Währungskäufe	2.000.000,00	1.616.098,93	0,07
EUR/AUD	Währungsverkäufe	2.680.000,00	1.661.869,16	0,08
EUR/CAD	Währungsverkäufe	2.480.000,00	1.557.054,43	0,07
EUR/CHF	Währungsverkäufe	58.931.555,00	50.059.300,34	2,31
EUR/CZK	Währungsverkäufe	281.550.940,00	11.089.404,84	0,51
EUR/NOK	Währungsverkäufe	140.873.223,70	14.576.206,22	0,67
EUR/SEK	Währungsverkäufe	32.110.000,00	3.117.904,06	0,14
EUR/USD	Währungsverkäufe	1.960.000,00	1.583.776,95	0,07

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Berichtes.

Bilaterale Devisentermingeschäfte

Zum 31.03.2018 standen folgende offene bilaterale Devisentermingeschäfte aus:

Währung		Währungsbetrag in Kaufwährung	Währungsbetrag in Verkaufswährung	Kurswert EUR	Anteil am Fondsvermögen %
AUD/CAD	Bilaterale Währungsgeschäfte	50.044.793,72	49.389.467,00	31.212.016,92	1,44
AUD/JPY	Bilaterale Währungsgeschäfte	25.000.000,00	2.028.032.000,00	15.579.063,93	0,72
CAD/AUD	Bilaterale Währungsgeschäfte	98.731.776,07	100.187.710,27	62.306.169,38	2,87
CHF/SEK	Bilaterale Währungsgeschäfte	94.723.015,62	810.193.817,32	80.458.936,37	3,71
JPY/AUD	Bilaterale Währungsgeschäfte	2.080.554.000,00	25.000.000,00	15.931.010,71	0,73
SEK/CHF	Bilaterale Währungsgeschäfte	798.969.045,33	95.334.128,05	77.565.368,35	3,58
SEK/USD	Bilaterale Währungsgeschäfte	163.916.000,00	20.138.738,56	15.937.381,82	0,74
USD/ZAR	Bilaterale Währungsgeschäfte	21.667.526,50	272.501.900,00	17.668.787,91	0,82
ZAR/USD	Bilaterale Währungsgeschäfte	272.501.900,00	21.806.979,04	18.656.605,78	0,86

Bilaterale Devisentermingeschäfte mit Barausgleich

Zum 31.03.2018 standen folgende offene bilaterale Devisentermingeschäfte mit Barausgleich aus:

Währung		Währungsbetrag in Kaufwährung	Währungsbetrag in Verkaufswährung	Kurswert EUR	Anteil am Fondsvermögen %
ARS/USD	Bilaterale Währungsgeschäfte	235.320.000,00	11.658.162,00	9.447.291,32	0,44
USD/KRW	Bilaterale Währungsgeschäfte	12.000.000,00	12.822.000.000,00	9.751.719,48	0,45
USD/TWD	Bilaterale Währungsgeschäfte	25.000.000,00	723.075.000,00	20.303.291,05	0,94

Devisenkurse

Für die Bewertung von Vermögenswerten in fremder Währung wurde zum nachstehenden Devisenkurs zum 31. März 2018 in Euro umgerechnet.

Ägyptisches Pfund	EGP	1	21,6181
Argentinischer Peso	ARS	1	24,7508
Australischer Dollar	AUD	1	1,6028
Britisches Pfund	GBP	1	0,8765
Dänische Krone	DKK	1	7,4538
Hongkong Dollar	HKD	1	9,6508
Japanischer Yen	JPY	1	130,7540
Kanadischer Dollar	CAD	1	1,5852
Mexikanischer Peso	MXN	1	22,4435
Neuseeländischer Dollar	NZD	1	1,7041
Norwegische Krone	NOK	1	9,6540
Polnischer Zloty	PLN	1	4,2121
Schwedische Krone	SEK	1	10,2987
Schweizer Franken	CHF	1	1,1775
Singapur Dollar	SGD	1	1,6121
Südafrikanischer Rand	ZAR	1	14,5660
Südkoreanischer Won	KRW	1	1.310,6143
Taiwan Dollar	TWD	1	35,8519
Tschechische Krone	CZK	1	25,3800
Ungarischer Forint	HUF	1	312,1000
US Amerikanischer Dollar	USD	1	1,2297

UniAbsoluterErtrag

Zu- und Abgänge vom 1. April 2017 bis 31. März 2018

Während des Berichtszeitraumes getätigte Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Schuldscheindarlehen und Derivaten, einschließlich Änderungen ohne Geldbewegungen, soweit sie nicht in der Vermögensaufstellung genannt sind.

ISIN	Wertpapiere	Zugänge	Abgänge
Aktien, Anrechte und Genussscheine			
Börsengehandelte Wertpapiere			
Dänemark			
DK0010244508	A P Moller-Maersk AS	210	210
DK0060745370	Nets AS	0	35.500
Deutschland			
DE0005190003	Bayerische Motoren Werke AG	3.800	3.800
DE0006062144	Covestro AG	1.500	1.500
DE0007100000	Daimler AG	11.511	11.511
DE0005140008	Dte. Bank AG	22.000	22.000
DE0005810055	Dte. Börse AG	2.000	2.000
DE0008232125	Dte. Lufthansa AG	11.000	11.000
DE0005552004	Dte. Post AG	18.500	18.500
DE000ENAG999	E.ON SE	85.000	85.000
DE000EVNK013	Evonik Industries AG	7.500	7.500
DE0006602006	Gea Group AG	16.000	16.000
DE0006047004	HeidelbergCement AG	8.500	8.500
DE000A1PHFF7	Hugo Boss AG	1.500	1.500
DE000SHA0159	Schaeffler AG	16.000	16.000
DE000SHL1006	Siemens Healthineers AG	7.000	7.000
Frankreich			
FR0010340141	Aéroports de Paris S.A.	2.817	2.817
FR0000120172	Carrefour S.A.	4.000	4.000
FR0013176526	Valéo S.A.	5.500	5.500
FR0000125486	Vinci S.A.	3.500	3.500
Großbritannien			
GB00BZ4BQC70	Johnson, Matthey Plc.	12.000	12.000
GB00B24CGK77	Reckitt Benckiser Group Plc.	4.200	4.200
GB00BH4HKS39	Vodafone Group Plc.	60.000	60.000
GB00BYK2V80	Worldpay Group Plc.	0	289.997
Irland			
IE0001827041	CRH Plc.	7.000	7.000
Niederlande			
NL0011821392	Philips Lighting N.V.	3.000	3.000
NL0000009355	Unilever NV	5.000	5.000
Österreich			
AT0000837307	Zumtobel AG	28.000	28.000
Schweden			
SE0006886750	Atlas Copco AB	10.000	10.000
SE0000106270	Hennes & Mauritz AB	8.000	8.000
Schweiz			
CH0210483332	Cie Financière Richemont AG	4.700	4.700
CH0319416936	Flughafen Zürich AG	302	302
CH0025238863	Kühne + Nagel International AG	1.600	1.600
CH0038863350	Nestle S.A.	4.000	4.000
Vereinigte Staaten von Amerika			
US3032501047	Fair Isaac & Corporation	0	13.471
US31620M1062	Fidelity National Information Services Inc.	0	23.731
US57636Q1040	Mastercard Inc.	0	17.143
US70450Y1038	PayPal Holdings Inc.	0	34.824
US92826C8394	VISA Inc.	0	24.013

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Berichtes.

UniAbsoluterErtrag

ISIN	Wertpapiere	Zugänge	Abgänge
Anleihen			
Börsengehandelte Wertpapiere			
EUR			
XS1715303779	5,250 % Argentinien v.17(2028)	100.000	100.000
GR0000169723	0,000 % Griechenland v.17(2017)	40.000.000	40.000.000
GR0000170739	0,000 % Griechenland v.17(2017)	16.500.000	16.500.000
GR0000173766	0,000 % Griechenland v.17(2018)	50.000.000	50.000.000
GR0000174772	0,000 % Griechenland v.17(2018)	30.000.000	30.000.000
GR0000175787	0,000 % Griechenland v.17(2018)	20.000.000	20.000.000
XS1744744191	2,750 % Mazedonien Reg.S. v.18(2025)	100.000	100.000
XS1698063739	3,375 % Residomo Sro Reg.S. v.17(2024)	100.000	100.000
XS1199954691	1,250 % Syngenta Finance AG EMTN v.15(2027)	200.000	200.000
USD			
XS1753595328	5,450 % ABJA Investment Co. Pte Ltd. v.18(2028)	700.000	700.000
XS1763161012	6,625 % Agua y Saneamientos Argentinos S.A. v.18(2023)	400.000	400.000
US05968LAK89	4,875 % Bancolombia S.A. Reg.S. Fix-to-Float v.17(2027)	300.000	300.000
XS1744630341	3,875 % Central Plaza Development Ltd. v.18(2021)	300.000	300.000
XS1611005957	5,375 % China Aoyuan Property Group Ltd. v.17(2022)	400.000	400.000
XS1713666318	0,000 % China Minmetals Corporation Reg.S. Fix-to-Float Unendl.	300.000	300.000
XS1676123851	0,000 % Concord New Energy Group Ltd. v.18(2021)	200.000	200.000
XS1750118462	5,125 % Country Garden Holdings Company Ltd. v.18(2025)	200.000	200.000
XS1755429732	7,875 % Ecuador Reg.S. v.18(2028)	300.000	300.000
XS1696908471	2,500 % Emirate of Abu Dhabi Reg.S. v.17(2022)	200.000	200.000
XS1692930404	0,000 % Fidelity Bank Plc. Reg.S. v.17(2022)	200.000	200.000
XS1746281226	7,100 % GCL New Energy Holdings Ltd. v.18(2021)	700.000	700.000
USY2700AAB53	8,000 % Geo Coal International Pte. Ltd. Reg.S. v.17(2022)	200.000	200.000
XS1756497944	4,500 % HongKong Xiangyu Investment Co. Ltd. v.18(2023)	300.000	300.000
USP5626FAA05	0,000 % Intercorp Financial Services Inc. Reg.S. v.17(2027)	200.000	200.000
IL0060002446	4,250 % Israel Electric Corporation Ltd. v.18(2028)	200.000	200.000
XS1701582881	0,000 % Jiangsu Nantong Sanjian Construction Group Co. Reg.S. v.17(2020)	200.000	200.000
XS1717086216	8,250 % Jiayuan International Group Ltd. Reg.S. v.17(2018)	200.000	200.000
XS1577950311	7,375 % Jordanien Reg.S. v.17(2047)	200.000	200.000
USY47606AH47	3,500 % Kia Motors Corporation Reg.S. v.17(2027)	200.000	200.000
XS1675862103	7,500 % Königreich Bahrain Reg.S. v.17(2047)	200.000	200.000
XS1545506401	6,000 % KWG Property Holding Ltd. Reg.S. v.17(2022)	200.000	200.000
XS1685542141	5,200 % KWG Property Holding Ltd. v.17(2022)	900.000	900.000
XS0859367194	6,000 % Libanon v.12(2023)	200.000	200.000
XS1743535491	4,500 % Longfor Properties Co. Ltd. v.18(2028)	200.000	200.000
USG5975LAA47	4,875 % Melco Resorts Ltd. Reg.S. v.17(2025)	200.000	200.000
XS1717013095	7,625 % Nigeria Reg.S. v.17(2047)	200.000	200.000
XS1777972941	0,000 % Nigeria Reg.S. v.18(2038)	200.000	200.000
XS1684793018	4,500 % Postal Savings Bank of China Fix-to-Float v.17 perp.	200.000	200.000
XS1772202211	0,000 % Redco Properties Group Ltd. v.18(2019)	200.000	200.000
XS1635996603	7,000 % RKI Overseas Finance 2017 A Ltd. Perp.	200.000	200.000
XS1693971043	4,125 % Sibur Holding OAO Reg.S. v.17(2023)	300.000	300.000
XS1677024579	4,900 % Sino-Ocean Group Holding Ltd. Reg.S. Fix-to-Float Perp.	200.000	200.000
XS1712553418	7,750 % SSMS Plantation Holdings Pte. Ltd. v.18(2023)	200.000	200.000
XS1700048843	3,700 % Tewoo Group Finance No. 4 Ltd. Reg.S. v.17(2018)	400.000	400.000
XS1749435324	6,250 % Times China Holdings Ltd. v.18(2021)	450.000	450.000
XS1686704948	4,500 % Tupras Türkiye Petrol Rafinerileri AS Reg.S. v.17(2024)	400.000	400.000
XS1691349010	5,125 % Türkiye Cumhuriyeti Ziraat Bankasi AS Reg.S. v.17(2023)	300.000	300.000
XS0882347072	3,875 % Türkiye Halk Bankasi AS Reg.S v.13(2020)	200.000	200.000
XS1623796072	7,000 % Türkiye IS Bankasi AS Reg.S. FRN v.17(2028)	200.000	200.000
XS1577952952	7,375 % Ukraine v.17(2032)	300.000	300.000
XS1725337445	3,369 % Union Bank of the Philippines EMTN v.17(2022)	300.000	300.000
XS1699845068	0,000 % United Overseas Bank Ltd. EMTN Fix-to-Float Perp.	600.000	600.000
US91911TAM53	4,375 % Vale Overseas Ltd. v.12(2022)	200.000	200.000
XS1679350014	3,750 % Weichai International Hong Kong Energy Group Co. Perp.	200.000	200.000
USG98149AD29	5,500 % Wynn Resorts Ltd. Reg.S. v.17(2027)	400.000	400.000
XS1577730895	5,750 % Yancoal International Resources Development Co. Ltd. Perp.	200.000	200.000
XS1634372954	5,850 % Yapi Ve Kredi Bankasi Reg.S. v.17(2024)	200.000	200.000
XS1692251413	7,250 % Zhongrong International Resources Co.Ltd. Reg.S. v.17(2020)	200.000	200.000

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Berichtes.

UniAbsoluterErtrag

ISIN	Wertpapiere	Zugänge	Abgänge
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere			
EUR			
XS1693959931	2,125 % CPI Property Group Reg.S. EMTN v. 17(2024)	200.000	200.000
USD			
USL00849AA47	6,000 % Adecoagro S.A. Reg.S. v.17(2027)	400.000	400.000
USP3772WAH53	4,625 % Banco do Brasil S.A. (Cayman Branch) Reg.S. v.17(2025)	200.000	200.000
US105756BY51	5,625 % Brasilien v.16(2047)	200.000	200.000
USN15516AA01	3,500 % Braskem Netherlands Finance BV Reg.S. v.17(2023)	200.000	200.000
USN15516AB83	4,500 % Braskem Netherlands Finance BV Reg.S. v.17(2028)	200.000	200.000
USP2867KAG15	3,950 % Colbun S.A. Reg.S. v.17(2027)	200.000	200.000
XS1707041262	8,875 % Ecuador Reg.S. v.17(2027)	200.000	200.000
US31572UAG13	4,000 % Fibria Overseas Finance Ltd. v.17(2025)	100.000	100.000
USG4066TAA00	6,250 % Gran Tierra Energy International Holding, Ltd. Reg.S. v.18(2025)	200.000	200.000
USN3700LAB10	5,250 % Greenko Dutch BV Reg.S. v.17(2024)	200.000	200.000
US46556MAL63	6,125 % Itau Unibanco Holding (Cayman Islands Branch) S.A. Reg.S. Fix-to-Float Perp.	200.000	200.000
USG5825AAA00	7,000 % MARB BondCo Plc. Reg.S. v.17(2024)	200.000	200.000
USP6629MAD40	5,500 % Mexico City Airport Trust Reg.S. v.17(2047)	400.000	400.000
USP71340AC09	4,750 % Nemak S.A.B. de C.V. Reg.s. v.18(2025)	200.000	200.000
USL7915RAA43	4,950 % Rede D2Or Finance S.à.r.l. Reg.S. v.18(2028)	200.000	200.000
USL79090AB95	5,875 % Rumo Luxembourg S.à.r.l Reg.S. v.18(2025)	400.000	400.000
USP82290AR17	3,750 % S.A.C.I. Falabella Reg.S. v.17(2027)	200.000	200.000
USP84523AB85	4,500 % San Miguel Industrias PET S.A. Reg.S. v. 17(2022)	200.000	200.000
USA8372TAE85	7,000 % Suzano Austria GmbH Reg.S. v.17(2047)	200.000	200.000
USA8372TAC20	7,000 % Suzano Austria GmbH Reg.S. v.17(2047)	200.000	200.000
US88163VAD10	6,150 % Teva Pharmaceutical Finance Co. LLC v.06(2036)	300.000	300.000
XS1662406468	8,250 % TV AZTECA S.A.B. de C.V. Reg.S. v.17(2024)	200.000	200.000
US98105HAF73	5,250 % Woori Bank Reg.S. Fix-to-Float Perp.	200.000	200.000
Credit Linked Notes			
USD			
XS1589106910	7,500 % CBOM Finance Plc. FRN Reg.S. v.17(2022)	200.000	200.000
XS1752568144	3,949 % PhosAgro Bond Funding DAC/Phosagro OJSC Reg.S. LPN v.18(2023)	800.000	800.000
Investmentfondsanteile ¹⁾			
Deutschland			
DE000A0Q2SF3	ATHENA UI	0	20.000
Frankreich			
FR0011521574	Laffitte Risk Arbitrage UCITS	0	2.602
FR0010326140	Lyxor ETF Russia (DJ RusIndex Titans 10) (EUR)	0	367.159
IE008BV74V41	Lyxor/WNT Fund	0	90.668
Großbritannien			
IE00BDZRX185	Neuberger Berman Short Duration Emerging Market Debt Fund	0	4.400.000
IE00B7FN4F54	Neuberger Berman Short Duration High Yield Bond Fund	0	1.731.287
Irland			
IE00BD616X26	GLG Investments VI Plc. - Global Equity Alternative	0	275.527
Luxemburg			
LU0496389908	AB SICAV I - Euro High Yield Portfolio	0	439.779
LU0639174274	Allianz Discovery Germany Strategy	0	10.420
LU0194345913	AXA IM Fixed Income Investment Strategies - US Short Duration High Yield	0	136.059
LU0525202155	BlackRock Strategic Funds - BlackRock European Diversified Equity Absolute Return Fund	0	84.907
LU0982748476	Deutsche Invest I Euro Corporate Bonds	0	310.235
LU1432415641	Deutsche Invest I Euro High Yield Corporates RD	0	215.000
LU0242506524	Goldman Sachs Emerging Markets Debt Portfolio	270.914	270.914
LU0451950587	Janus Henderson Horizon Fund - Janus Henderson Horizon Euro Corporate Bond Fund	0	69.514
LU0360483100	Morgan Stanley Investment Funds - Euro Corporate Bond Fund	0	360.788
LU0529383175	NN (L) SICAV - European High Yield	0	600
LU0141799097	Nordea 1 SICAV - European High Yield Bond Fund	0	1.006.976
LU1311575093	Pareto SICAV - Pareto Nordic Corporate Bond	245.400	245.400
LU0844696376	Pictet - Emerging Corporate Bonds	109.000	109.000

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Berichtes.

UniAbsoluterErtrag

ISIN	Wertpapiere	Zugänge	Abgänge
LU0170991672	Pictet Funds - Global Emerging Debt	40.970	40.970
LU0765417018	SKY Harbor Global Funds - US Short Duration High Yield Fund	0	90.655
LU0358423738	UBS Lux Bond SICAV - Convert Global EUR	60.000	60.000
LU0117073196	UniEuroRenta Corporates -M-	0	2.000
LU1348768679	UniInstitutional Basic Global Corporates IG	0	103.889
LU0061890835	UniOptimus -net- -A-	0	5.500
LU0262776809	UniOpti4	0	71.866
LU0201780276	UniReserve: Euro -M-	0	490
LU0926440222	Vontobel Fund - Emerging Markets Debt	52.017	52.017

Vereinigte Staaten von Amerika

IE00B664JN33	Finsbury High Income Fund	0	12.940
--------------	---------------------------	---	--------

Zertifikate

An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere

Europäische Gemeinschaft

DE000DG946L1	DZ Bank AG Dte. Zentral-Genossenschaftsbank/Euro Stoxx 50 Zert. v.16(2017)	0	700.000
DE000TB45HG0	HSBC Trinkaus & Burkhardt AG/Euro Stoxx 50 Zert. v.16(2017)	0	341.300

Schweiz

XS1396688043	Credit Suisse AG (London Branch)/Credit Suisse Custom 109 Total Return Index Zert. v.16(2017)	0	350
--------------	---	---	-----

Optionen

EUR

Call on BOBL Future Januar 2018/131,750	6.000	6.000
Call on DAX Index Dezember 2017/13.250,00	2.000	2.000
Call on DAX Index Januar 2018/13.500,00	2.500	2.500
Call on DAX Index März 2018/13.200,00	400	400
Call on DAX Index März 2018/13.800,00	400	400
Call on DAX Performance-Index Dezember 2017/13.400,00	2.000	2.000
Call on EUR/CHF Januar 2018/1,175	75.000.000	75.000.000
Call on EUR/CHF Januar 2018/1,175	50.000.000	50.000.000
Call on EUR/CHF Januar 2018/1,225	150.000.000	150.000.000
Call on EUR/CHF Januar 2018/1,225	100.000.000	100.000.000
Call on EUR/CHF Januar 2018/1,275	75.000.000	75.000.000
Call on EUR/CHF Januar 2018/1,275	50.000.000	50.000.000
Call on EUR/CHF Oktober 2017/1,15	50.000.000	50.000.000
Call on EUR/CHF Oktober 2017/1,20	100.000.000	100.000.000
Call on EUR/CHF Oktober 2017/1,25	50.000.000	50.000.000
Call on Euribor 3M Mid-curve Future Juni 2018/100,250	2.000	2.000
Call on Euribor 3M Mid-curve Future Juni 2018/100,375	2.000	2.000
Call on Euro Bund 10 Year Future Februar 2018/159,50	2.200	2.200
Call on Euro Bund 10 Year Future März 2018/159,00	2.200	2.200
Call on Euro Bund 10 Year Future November 2017/164,50	1.000	1.000
Call on EURO STOXX Bank Index März 2018/140,00	1.650	1.650
Call on Euro Stoxx 50 Price Index Dezember 2017/3.675,00	1.000	1.000
Call on Euro Stoxx 50 Price Index Dezember 2017/3.725,00	2.000	2.000
Call on Euro Stoxx 50 Price Index Dezember 2018/3.500,00	0	4.000
Call on Euro Stoxx 50 Price Index März 2018/3.800,00	3.000	3.000
Call on Euro Stoxx 50 Price Index März 2018/3.825,00	1.150	1.150
Call on EUR/USD Dezember 2017/1,2	30.000.000	30.000.000
Call on EUR/USD Juni 2017/1,09	70.000.000	0
Call on EUR/USD Oktober 2017/1,20	30.000.000	30.000.000
Call on EUR/USD September 2017/1,13	70.000.000	70.000.000
Put on DAX Index Juni 2017/11.400,0	0	1.500
Put on DAX Index März 2018/12.600,00	400	400
Put on Euro Bund 10 Year Future April 2017/158,50	0	1.000
Put on Euro Bund 10 Year Future August 2017/158,00	2.000	2.000
Put on Euro Bund 10 Year Future August 2017/160,50	2.000	2.000
Put on Euro Bund 10 Year Future Juli 2017/161,00	1.600	1.600
Put on Euro Bund 10 Year Future Juni 2017/160,00	1.000	1.000
Put on Euro Bund 10 Year Future November 2017/157,00	1.000	1.000
Put on EURO STOXX Bank Index Mai 2017/110,0	5.500	5.500
Put on EURO STOXX Bank Index März 2018/120,00	1.650	1.650

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Berichtes.

UniAbsoluterErtrag

ISIN	Wertpapiere	Zugänge	Abgänge
	Put on EURO STOXX 50 Index Dezember 2017/3.100,00	0	3.000
	Put on Euro Stoxx 50 Price Index Dezember 2017/2.800,00	3.000	0
	Put on Euro Stoxx 50 Price Index Dezember 2017/3.150,00	4.500	4.500
	Put on Euro Stoxx 50 Price Index Dezember 2017/3.450,00	4.500	4.500
	Put on Euro Stoxx 50 Price Index Juni 2017/3.350,0	3.000	3.000
	Put on Euro Stoxx 50 Price Index Juni 2017/3.500,0	3.000	3.000
	Put on Euro Stoxx 50 Price Index Mai 2017/3.400,0	1.000	1.000
	Put on Euro Stoxx 50 Price Index März 2018/3.550,00	600	600
	Put on Euro Stoxx 50 Price Index November 2017/3.525,00	1.200	1.200
	Put on EUR/USD März 2018/1,1750	80.000.000	80.000.000
	Put on EUR/USD März 2018/1,2050	80.000.000	80.000.000
	Put on STOXX 600 Basic Resources Index Juni 2017/385,0	1.750	1.750
GBP			
	Call on GBP/USD Dezember 2017/1,31	40.000.000	40.000.000
	Call on GBP/USD Dezember 2017/1,325	40.000.000	40.000.000
	Call on GBP/USD Dezember 2017/1,325	20.000.000	20.000.000
	Call on GBP/USD Februar 2018/1,37	20.000.000	20.000.000
	Call on Royal Mail Plc. Juni 2018/5,80	30	30
	Call on 3MO Libor Currency Future März 2018/99,375	2.500	2.500
	Call on 3MO Libor Currency Future März 2018/99,500	5.000	5.000
	Call on 3MO Libor Currency Future März 2018/99,625	2.500	2.500
	Put on GBP/USD Dezember 2017/1,31	40.000.000	40.000.000
	Put on GBP/USD Dezember 2017/1,3250	40.000.000	40.000.000
	Put on 3MO Libor Currency Future März 2018/99,125	7.500	7.500
JPY			
	Call on Nikkei 225 Stock Average Index Dezember 2020/21.000,00	0	500
	Call on Nikkei 225 Stock Average Index (JPY) Juni 2018/25.000,00	300	300
USD			
	Call on CBT 10YR US T-Bond Note Future Februar 2018/122,00	1.600	1.600
	Call on CBT 10YR US T-Bond Note Future November 2017/127,50	1.000	1.000
	Call on CBT 10YR US T-Bond Note Future November 2017/129,00	1.000	1.000
	Call on CBT 10YR US T-Bond Note Future September 2017/127,50	1.000	1.000
	Call on S&P 500 Index Dezember 2017/2.325,00	0	600
	Call on S&P 500 Index Dezember 2017/2.530,00	200	200
	Call on S&P 500 Index Dezember 2017/2.560,00	400	400
	Call on S&P 500 Index September 2017/2.450,00	500	500
	Call on 3MO Eurodollar Future Juni 2018/98,50	1.500	1.500
	Call on 3MO Eurodollar Future Juni 2018/98,75	1.500	1.500
	Call on 5YR Treasury 6% Future März 2018/114,25	1.850	1.850
	Put on CBT 10YR US T-Bond Note Future August 2017/122,00	650	650
	Put on CBT 10YR US T-Bond Note Future August 2017/124,50	650	650
	Put on CBT 10YR US T-Bond Note Future November 2017/123,50	1.000	1.000
	Put on CBT 10YR US T-Bond Note Future November 2017/124,00	1.000	1.000
	Put on Eurodollar Mid-curve Future Juni 2018/97,00	3.000	3.000
	Put on Eurodollar Mid-curve Future Juni 2018/97,25	3.000	3.000
	Put on Nasdaq 100 Index Dezember 2017/5.175,00	150	150
	Put on Nasdaq 100 Index Dezember 2017/5.500,00	150	150
	Put on PG & E Corporation November 2017/55,00	1.200	1.200
	Put on S&P 500 Index Dezember 2017/2.275,00	300	300
	Put on S&P 500 Index Dezember 2017/2.400,00	300	300
	Put on S&P 500 Index Juni 2017/2.175,00	0	500
	Put on 3MO Eurodollar Future Dezember 2018/97,500	6.000	6.000
	Put on 3MO Eurodollar Future Dezember 2018/97,750	6.000	6.000
	Put on 3MO Eurodollar Future Juni 2018/97,750	4.000	4.000
	Put on 3MO Eurodollar Future Juni 2018/97,875	8.250	8.250
	Put on 3MO Eurodollar Future Juni 2018/98,000	4.000	4.000
	Put on 3MO Eurodollar Future Juni 2018/98,125	8.250	8.250
Terminkontrakte			
CHF			
	Cie Financière Richemont AG Future Juni 2018	50	50
	Cie Financière Richemont AG Future März 2018	50	50

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Berichtes.

UniAbsoluterErtrag

ISIN	Wertpapiere	Zugänge	Abgänge
	Euro/Schweizer Franken Future Dezember 2017	1.000	1.000
	Euro/Schweizer Franken Future März 2018	1.000	1.000
	Flughafen Zuerich Future März 2018	18	18
	Kühne + Nagel International AG Future Juni 2018	10	10
	Nestlé S.A. Future März 2018	50	50
	Swatch Group Future Juni 2018	100	100
	Swiss Market Index Future Dezember 2017	280	280
	Swiss Market Index Future September 2017	280	280
	Temenos Group AG Future Juni 2018	20	20
	The Swatch Group Future März 2018	365	365
EUR			
	Accor S.A. Future März 2018	90	90
	Bayer. Motorenwerke AG Future März 2018	33	33
	bpost S.A. Future Juni 2018	250	250
	Carrefour S.A. Future März 2018	250	250
	Continental AG Future März 2018	20	20
	Covestro AG Future Juni 2018	25	25
	CRH Plc. Future Juni 2018	100	100
	DAX Performance-Index Future Dezember 2017	175	175
	DAX Performance-Index Future Juni 2017	226	226
	DAX Performance-Index Future Juni 2017	1	0
	DAX Performance-Index Future März 2018	309	309
	DAX Performance-Index Future März 2018	4	4
	DAX Performance-Index Future September 2017	223	223
	Dow Jones EURO STOXX 50 Dividend Index Future Dezember 2022	2.687	2.687
	Dte. Post AG Future März 2018	150	150
	EUREX Dow Jones EURO STOXX 50 Dividend Index Future Dezember 2018	2.366	2.366
	EUREX Dow Jones EURO STOXX 50 Dividend Index Future Dezember 2019	2.500	2.500
	EUREX Dow Jones EURO STOXX 50 Index Future Dezember 2017	8.114	8.114
	EUREX Dow Jones EURO STOXX 50 Index Future Dezember 2017	600	600
	EUREX Dow Jones EURO STOXX 50 Index Future Juni 2017	6.938	11.553
	EUREX Dow Jones EURO STOXX 50 Index Future Juni 2017	1.321	1.321
	EUREX Dow Jones EURO STOXX 50 Index Future Juni 2018	320	320
	EUREX Dow Jones EURO STOXX 50 Index Future März 2018	4.960	4.960
	EUREX Dow Jones EURO STOXX 50 Index Future März 2018	300	300
	EUREX Dow Jones EURO STOXX 50 Index Future September 2017	6.768	6.768
	EUREX Dow Jones EURO STOXX 50 Index Future September 2017	1.930	1.930
	EURO STOXX Telecommunications Future März 2018	12	12
	EURO STOXX Automobiles&Parts Future März 2018	13	13
	EURO STOXX Automobiles&Parts Future März 2018	4	4
	EURO STOXX Banks Future Dezember 2017	640	640
	EURO STOXX Chemicals Future März 2018	190	190
	EURO STOXX Industrial Goods&Services Future Juni 2017	550	550
	EURO STOXX Industrial Goods&Services Future März 2018	10	10
	Euro Stoxx Small Index Future Dezember 2017	1.659	1.659
	Euro Stoxx Small Index Future Juni 2017	794	794
	Euro Stoxx Small Index Future September 2017	1.659	1.659
	Euro Stoxx Small (Price) Index Future März 2018	1.659	1.659
	European Aeronautic Defence and Space Co. Future März 2018	60	60
	European Aeronautic Defence and Space Co. Future März 2018	25	25
	EUX 10 YR Euro-OAT Future Dezember 2017	331	331
	EUX 10 YR Euro-OAT Future Juni 2017	456	300
	EUX 10 YR Euro-OAT Future September 2017	306	306
	EUX 10 YR Euro-OAT Future September 2017	270	270
	EUX 10YR Euro-Bund Future Juni 2017	140	0
	EUX 10YR Euro-Bund Future März 2018	250	250
	EUX 10YR Euro-Bund Future September 2017	1.216	1.216
	EUX 2YR Euro-Schatz Future September 2017	2.800	2.800
	EUX 30YR Bundesanleihe 4% Future März 2018	220	220
	EUX 5YR Euro-Bobl Future Dezember 2017	890	890
	EUX 5YR Euro-Bobl Future März 2018	1.859	1.859
	Fraport AG Future März 2018	125	125
	Fresenius Medical Care AG & Co. KGaA Future März 2018	25	25
	Gea Group AG Future Juni 2018	50	50

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Berichtes.

UniAbsoluterErtrag

ISIN	Wertpapiere	Zugänge	Abgänge
	Gea Group AG Future März 2018	100	100
	Gea Group AG Future März 2018	50	50
	HeidelbergCement AG Future Juni 2018	20	20
	Henkel AG & Co. KGaA Future März 2018	135	135
	Henkel AG & Co. KGaA -VZ- Future März 2018	106	106
	Ibex 35 Index Future Dezember 2017	317	317
	Ibex 35 Index Future März 2018	11	11
	Ibex 35 Index Future November 2017	429	429
	Infineon Technologies AG Future März 2018	150	150
	ISTOXX Europe Momentum Factor Net Return Index (Net Return) (EUR) Future Dezember 2017	1.756	1.756
	ISTOXX Europe Momentum Factor Net Return Index (Net Return) (EUR) Future Juni 2017	3.614	3.614
	ISTOXX Europe Momentum Factor Net Return Index (Net Return) (EUR) Future März 2018	3.384	3.384
	ISTOXX Europe Momentum Factor Net Return Index (Net Return) (EUR) Future September 2017	5.377	5.377
	ISTOXX Europe Quality Factor Index (Net Return) (EUR) Future März 2018	1.243	1.243
	ISTOXX Europe Quality Factor Index (Net Return) (EUR) Future September 2017	1.280	1.280
	ISTOXX Europe Size Factor Index (Net Return) (EUR) Future Dezember 2017	1.552	1.552
	ISTOXX Europe Size Factor Index (Net Return) (EUR) Future Juni 2017	591	591
	ISTOXX Europe Size Factor Index (Net Return) (EUR) Future Juni 2017	396	396
	ISTOXX Europe Size Factor Index (Net Return) (EUR) Future September 2017	1.552	1.552
	ISTOXX Europe Value Factor Index (Net Return) (EUR) Future Dezember 2017	7.000	7.000
	ISTOXX Europe Value Factor Index (Net Return) (EUR) Future März 2018	8.925	8.925
	ISTOXX Europe Value Factor Index (Net Return) (EUR) Future September 2017	9.046	9.046
	Kering S.A. Future Juni 2018	10	10
	LIF 3MO Euribor Future Juni 2018	13.500	13.500
	LIF 3MO Euribor Future Juni 2019	500	500
	Lufthansa AG Future März 2018	100	100
	MDAX Performance-Index Future Juni 2017	373	373
	MDAX Performance-Index Future Juni 2017	0	195
	MDAX Performance-Index Future März 2018	6	6
	MSCI Europe Index Future Dezember 2017	2.439	2.439
	MSCI Europe Index Future Juni 2017	2.439	0
	MSCI Europe Index Future März 2018	2.439	2.439
	MSCI Europe Index Future September 2017	2.439	2.439
	MSCI World Net EUR Index Future Dezember 2017	1.870	1.870
	MSCI World Net EUR Index Future Juni 2017	3.739	0
	MSCI World Net EUR Index Future März 2018	1.870	1.870
	MSCI World Net EUR Index Future September 2017	3.970	3.970
	MTU Aero Engines AG Future März 2018	91	91
	Pernod-Ricard S.A. Future März 2018	23	23
	Philips Electronic Future März 2018	100	100
	ProSiebenSat.1 Media SE Future März 2018	84	84
	Salvatore Ferragamo Italia S.p.A. AG Future März 2018	20	20
	SKF AB -B- Future Juni 2018	275	275
	S&P-MIB Index Future Dezember 2017	589	589
	S&P-MIB Index Future Juni 2018	9	9
	S&P-MIB Index Future März 2018	17	17
	STOXX Europe 600 Price Index (EUR) Future Dezember 2017	6.735	6.735
	STOXX Europe 600 Price Index (EUR) Future Juni 2017	6.295	1.355
	STOXX Europe 600 Price Index (EUR) Future März 2018	8.946	8.946
	STOXX Europe 600 Price Index (EUR) Future September 2017	9.147	9.147
	Stoxx 600 Automobiles&Parts Future März 2018	60	60
	Stoxx 600 Automobiles&Parts Future September 2017	203	203
	Stoxx 600 Banks Future Dezember 2017	241	241
	Stoxx 600 Banks Future März 2018	15	15
	Stoxx 600 Banks Future September 2017	1.666	1.666
	Stoxx 600 Basic Resources Future Dezember 2017	453	453
	Stoxx 600 Basic Resources Future Juni 2017	620	620
	Stoxx 600 Basic Resources Future Juni 2017	533	533
	Stoxx 600 Basic Resources Future März 2018	250	250
	Stoxx 600 Basic Resources Future September 2017	802	802
	Stoxx 600 Construction&Materials Future März 2018	56	56
	STOXX 600 Food & Beverages Future März 2018	16	16
	Stoxx 600 Industrial Goods&Services Future Dezember 2017	219	219
	Stoxx 600 Industrial Goods&Services Future Juni 2017	951	951
	Stoxx 600 Industrial Goods&Services Future September 2017	951	951

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Berichtes.

UniAbsoluterErtrag

ISIN	Wertpapiere	Zugänge	Abgänge
	Stoxx 600 Oil&Gas Future Dezember 2017	309	309
	Stoxx 600 Oil&Gas Future Juni 2017	1.525	1.525
	Stoxx 600 Oil&Gas Future September 2017	1.071	1.071
	Stoxx 600 Personal&Household Future Dezember 2017	42	42
	Stoxx 600 Personal&Household Future März 2018	5	5
	Stoxx 600 Personal&Household Future September 2017	128	128
	Stoxx 600 Real Estate Future Dezember 2017	207	207
	Stoxx 600 Real Estate Future September 2017	646	646
	STOXX 600 Technology Index (Price) (EUR) Future März 2018	43	43
	Stoxx 600 Telecommunications Future Dezember 2017	386	386
	Stoxx 600 Telecommunications Future März 2018	386	386
	Stoxx 600 Telecommunications Future März 2018	16	16
	Stoxx 600 Utilities Future Dezember 2017	117	117
	Stoxx 600 Utilities Future September 2017	379	379
	VSTOXX Index Future Februar 2018	4.209	4.209
	VSTOXX Index Future Juli 2017	3.948	3.948
	VSTOXX Index Future März 2018	2.312	2.312
	VSTOXX Index Future Oktober 2017	3.597	3.597
	VSTOXX Index Future September 2017	3.225	3.225
	VSTOXX Volatilitätsindex Mini Future April 2017	0	1.895
	VSTOXX Volatilitätsindex Mini Future August 2017	3.774	3.774
	VSTOXX Volatilitätsindex Mini Future Dezember 2017	4.024	4.024
	VSTOXX Volatilitätsindex Mini Future Januar 2018	4.273	4.273
	VSTOXX Volatilitätsindex Mini Future Juni 2017	3.788	3.788
	VSTOXX Volatilitätsindex Mini Future Mai 2017	2.292	3.058
	VSTOXX Volatilitätsindex Mini Future November 2017	4.168	4.168
	10YR Euro-BTP 6% Future Dezember 2017	1.268	1.268
	10YR Euro-BTP 6% Future Juni 2017	258	0
	10YR Euro-BTP 6% Future März 2018	950	950
	10YR Euro-BTP 6% Future September 2017	1.034	1.034
GBP			
	Brittische Pound Currency Future Juni 2017	0	537
	FTSE 100 Index Future Juni 2017	268	268
	FTSE 100 Index Future März 2018	13	13
	FTSE 100 Index Future September 2017	268	268
	Kingfisher Plc. Future Juni 2018	50	50
	LIF Long Gilt Future Juni 2017	298	298
	LIF Long Gilt Future September 2017	298	298
	LIF 3MO Sterling Future Dezember 2018	740	740
	LIF 3MO Sterling Future Juni 2018	220	220
	LIF 3MO Sterling Future März 2018	740	740
	LIF 3MO Sterling Future März 2019	740	740
	LIF 3MO Sterling Future September 2018	2.000	2.000
	Tesco Plc. Future Februar 2018	65	65
	WPP Plc. Future Juni 2018	15	15
JPY			
	Tokyo Stock Price (TOPIX) Index Future Juni 2017	0	610
	Tokyo Stock Price (TOPIX) Index Future September 2017	259	259
	Yen Denominated Nikkei 225 Index Future Dezember 2017	1.910	1.910
	Yen Denominated Nikkei 225 Index Future Dezember 2017	320	320
	Yen Denominated Nikkei 225 Index Future Juni 2017	2.293	825
	Yen Denominated Nikkei 225 Index Future März 2018	2.005	2.005
	Yen Denominated Nikkei 225 Index Future September 2017	1.470	1.470
USD			
	British Pound Currency Future Dezember 2017	950	950
	British Pound Currency Future Juni 2017	1.565	0
	British Pound Currency Future September 2017	650	650
	CBOE Volatility Index (VIX) Future Januar 2018	598	598
	CBOE Volatility Index (VIX) Future Mai 2017	428	316
	CBT 10YR US T-Bond Note Future Dezember 2017	80	80
	CBT 10YR US T-Bond Note Future Juni 2017	1.510	923
	CBT 10YR US T-Bond Note Future Juni 2017	400	400
	CBT 10YR US T-Bond Note Future März 2018	1.600	1.600

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Berichtes.

UniAbsoluterErtrag

ISIN	Wertpapiere	Zugänge	Abgänge
	CBT 10YR US T-Bond Note Future September 2017	1.210	1.210
	CBT 2YR US T-Bill 6% Future Dezember 2017	1.500	1.500
	CBT 2YR US T-Bill 6% Future März 2018	2.050	2.050
	CBT 2YR US T-Bill 6% Future September 2017	1.750	1.750
	CBT 5YR US T-Bond Note 6% Future Juni 2017	826	826
	CBT 5YR US T-Bond Note 6% Future März 2018	1.800	1.800
	CBT 5YR US T-Bond Note 6% Future September 2017	521	521
	Chicago Board Options Exchange SPX Volatility Index Future April 2017	353	0
	Chicago Board Options Exchange SPX Volatility Index Future August 2017	554	554
	Chicago Board Options Exchange SPX Volatility Index Future Dezember 2017	553	553
	Chicago Board Options Exchange SPX Volatility Index Future Februar 2018	628	628
	Chicago Board Options Exchange SPX Volatility Index Future Juli 2017	545	545
	Chicago Board Options Exchange SPX Volatility Index Future Juni 2017	525	525
	Chicago Board Options Exchange SPX Volatility Index Future März 2018	328	328
	Chicago Board Options Exchange SPX Volatility Index Future November 2017	587	587
	Chicago Board Options Exchange SPX Volatility Index Future Oktober 2017	516	516
	Chicago Board Options Exchange SPX Volatility Index Future September 2017	464	464
	CME Nasdaq 100 E-Mini Index Future Dezember 2017	100	100
	CME Nasdaq 100 E-Mini Index Future Juni 2017	340	340
	CME Nasdaq 100 E-Mini Index Future März 2018	100	100
	CME 3MO Euro-Dollar Future Dezember 2017	2.500	2.500
	CME 3MO Euro-Dollar Future Dezember 2018	1.450	1.450
	CME 3MO Euro-Dollar Future Juni 2018	3.993	3.993
	CME 3MO Euro-Dollar Future Juni 2018	3.490	3.490
	CME 3MO Euro-Dollar Future Juni 2019	1.032	1.032
	CME 3MO Euro-Dollar Future Juni 2019	300	300
	CME 3MO Euro-Dollar Future März 2018	1.300	1.300
	CME 3MO Euro-Dollar Future März 2018	1.000	1.000
	CME 3MO Euro-Dollar Future März 2019	1.300	1.300
	CME 3MO Euro-Dollar Future September 2017	1.000	1.000
	E-Mini S&P 500 Index Future Dezember 2017	1.879	1.879
	E-Mini S&P 500 Index Future Juni 2017	3.542	2.568
	E-Mini S&P 500 Index Future Juni 2017	830	830
	E-Mini S&P 500 Index Future März 2018	3.857	3.857
	E-Mini S&P 500 Index Future März 2018	153	153
	E-Mini S&P 500 Index Future September 2017	2.408	2.408
	EUREX MSCI AC Asia Pacific Ex Japan Index Future Dezember 2017	339	339
	EUREX MSCI AC Asia Pacific Ex Japan Index Future Juni 2017	339	0
	EUREX MSCI AC Asia Pacific Ex Japan Index Future September 2017	339	339
	MINI MSCI EM (NYSE) Index Future (NYSE) Dezember 2017	1.360	1.360
	MINI MSCI EM (NYSE) Index Future (NYSE) Juni 2017	588	500
	MINI MSCI EM (NYSE) Index Future (NYSE) März 2018	1.375	1.375
	MINI MSCI EM (NYSE) Index Future (NYSE) September 2017	2.084	2.084
	MINI MSCI EM (NYSE) Index Future (NYSE) September 2017	335	335
	MSCI Asia Pacific ex Japan Index Future März 2018	339	339
	MSCI USA Equal Weighted Net USD Index Future Dezember 2017	818	818
	MSCI USA Equal Weighted Net USD Index Future Juni 2017	202	399
	MSCI USA Equal Weighted Net USD Index Future März 2018 2017	603	603
	MSCI USA Equal Weighted Net USD Index Future September 2017	399	399
	MSCI USA Index (Net Return) (USD) Index Future Dezember 2017	2.653	2.653
	MSCI USA Index (Net Return) (USD) Index Future Juni 2017	2.021	560
	MSCI USA Index (Net Return) (USD) Index Future März 2018	2.589	2.589
	MSCI USA Index (Net Return) (USD) Index Future September 2017	2.196	2.196
	MSCI USA Momentum Index Future Dezember 2017	552	552
	MSCI USA Momentum Index Future Juni 2017	274	702
	MSCI USA Momentum Index Future September 2017	552	552
	MSCI USA Momentum USD NTR Index Future März 2018	757	757
	MSCI USA Quality Net Return (USD) Index Future Dezember 2017	1.060	1.060
	MSCI USA Quality Net Return (USD) Index Future Juni 2017	529	1.060
	MSCI USA Quality Net Return (USD) Index Future März 2018	1.060	1.060
	MSCI USA Quality Net Return (USD) Index Future September 2017	1.060	1.060
	MSCI USA Value Weighted Net USD Index Future Dezember 2017	4.536	4.536
	MSCI USA Value Weighted Net USD Index Future Juni 2017	541	3.446
	MSCI USA Value Weighted Net USD Index Future März 2018	4.536	4.536
	MSCI USA Value Weighted Net USD Index Future September 2017	4.047	4.047

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Berichtes.

UniAbsoluterErtrag

ISIN	Wertpapiere	Zugänge	Abgänge
	Russell 2000 Index Future Dezember 2017	384	384
	Russell 2000 Index Future März 2018	442	442
	Russell 2000 Index Future September 2017	534	534
	Russell 2000 Index Future September 2017	384	384
	The Russell 2000 Mini Index Future Juni 2017	0	534
	US Dollar Currency Future Dezember 2017	2.668	2.668
	US Dollar Currency Future Juni 2017	638	2.597
	US Dollar Currency Future März 2018	3.108	3.108
	US Dollar Currency Future September 2017	3.523	3.523

Credit Default Swaps

EUR

Barclays Bank Plc./iTraxx Europe Crossover S28 5Yr Index CDS v.17(2022)	50.000.000	50.000.000
Barclays Bank Plc./iTraxx Europe Crossover S28 5Yr Index CDS v.17(2022)	50.000.000	50.000.000
Barclays Bank PLC/iTraxx Europe S28 5Yr Index CDS v.17(2022)	50.000.000	50.000.000
J.P. Morgan Securities Plc., London/iTraxx Europe Crossover S27 5Yr Index CDS v.17(2022)	50.000.000	50.000.000
J.P. Morgan Securities Plc., London/iTraxx Europe S27 5Yr Index CDS v.17(2022)	200.000.000	200.000.000
J.P. Morgan Securities Plc., London/iTraxx Europe S27 5Yr Index CDS v.17(2022)	30.000.000	30.000.000

USD

Barclays Bank Plc./CDX Emerging Markets S27 5Yr Index CDS v.17(2022)	50.000.000	50.000.000
Barclays Bank Plc./iTraxx Asia ex-Japan Investment Grade S28 5Yr Index CDS v.18(2022)	30.000.000	30.000.000
Barclays Bank Plc./Korea CDS v.17(2022)	100.000.000	100.000.000
Barclays Bank Plc./Korea CDS v.18(2022)	50.000.000	50.000.000
BNP Paribas London/iTraxx Asia ex-Japan Investment Grade S27 5Yr Index CDS v.17(2022)	30.000.000	30.000.000
BNP Paribas S.A., Paris/iTraxx Asia ex-Japan Investment Grade S27 5Yr Index CDS v.17(2022)	100.000.000	100.000.000
BNP Paribas S.A./Großbritannien v.00(2032) CDS v.17(2022)	25.000.000	25.000.000
J.P. Morgan Securities Plc., London/Großbritannien CDS v.17(2022)	25.000.000	25.000.000
J.P. Morgan Securities Plc., London/Korea CDS v.17(2022)	50.000.000	50.000.000
J.P. Morgan Securities Plc., London/Korea CDS v.17(2022)	35.000.000	35.000.000

Sonstige Finanzinstrumente

CAD

SWAP 1.9800%/Canada Bankers Acceptance (CAD) 3 Monate 21.06.2028	52.700.000	52.700.000
SWAP 1.9800%/Canada Bankers Acceptance (CAD) 3 Monate 21.06.2028	52.700.000	52.700.000

EUR

SWAP EONIA /1D EONIA EUR 01.09.2019	790.000.000	790.000.000
SWAP EONIA /1D EONIA EUR 01.09.2019	790.000.000	790.000.000
SWAP EONIA 1D EONIA EUR/ 01.09.2020	395.000.000	395.000.000
SWAP EONIA 1D EONIA EUR/ 01.09.2020	395.000.000	395.000.000
SWAP EONIA 1D EONIA EUR/ 14.06.2019	330.000.000	330.000.000
SWAP EONIA 1D EONIA EUR/ 14.06.2019	330.000.000	330.000.000
SWAP EONIA /1D EONIA EUR 19.09.2018	13.500.000.000	13.500.000.000
SWAP EONIA /1D EONIA EUR 19.09.2018	13.500.000.000	13.500.000.000
SWAP EONIA /1D EONIA EUR 21.06.2018	4.500.000.000	4.500.000.000
SWAP EONIA /1D EONIA EUR 21.06.2018	4.500.000.000	4.500.000.000
SWAP EONIA /1D EONIA EUR 21.06.2018	4.500.000.000	4.500.000.000
SWAP EONIA /1D EONIA EUR 21.06.2018	4.500.000.000	4.500.000.000
SWAP EONIA /1D EONIA EUR 21.06.2018	4.500.000.000	4.500.000.000
SWAP EONIA /1D EONIA EUR 21.06.2018	4.500.000.000	4.500.000.000
SWAP EONIA 1D EONIA EUR/ 25.01.2022	445.100.000	445.100.000
SWAP EONIA 1D EONIA EUR/ 25.01.2022	445.100.000	445.100.000
SWAP EONIA /1D EONIA EUR 27.01.2021	443.900.000	443.900.000
SWAP EONIA /1D EONIA EUR 27.01.2021	443.900.000	443.900.000
SWAP EONIA /1D EONIA EUR 28.06.2019	790.000.000	790.000.000
SWAP EONIA /1D EONIA EUR 28.06.2019	790.000.000	790.000.000
SWAP EONIA 1D EONIA EUR/ 28.06.2020	395.000.000	395.000.000
SWAP EONIA 1D EONIA EUR/ 28.06.2020	395.000.000	395.000.000
SWAP EURIBOR (EUR) 3 Monate/-0.2750% 21.06.2018	4.500.000.000	4.500.000.000
SWAP EURIBOR (EUR) 3 Monate/-0.2750% 21.06.2018	4.500.000.000	4.500.000.000
SWAP EURIBOR (EUR) 3 Monate/-0.2800% 21.06.2018	4.500.000.000	4.500.000.000
SWAP EURIBOR (EUR) 3 Monate/-0.2800% 21.06.2018	4.500.000.000	4.500.000.000
SWAP EURIBOR (EUR) 3 Monate/-0.2850% 21.06.2018	4.500.000.000	4.500.000.000
SWAP EURIBOR (EUR) 3 Monate/-0.2850% 21.06.2018	4.500.000.000	4.500.000.000

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Berichtes.

UniAbsoluterErtrag

ISIN	Wertpapiere	Zugänge	Abgänge
	Swap Euribor (EUR) 3 Monate/-0.2895% 19.09.2018	13.500.000.000	13.500.000.000
	SWAP EURIBOR (EUR) 3 Monate/-0.2895% 19.09.2018	13.500.000.000	13.500.000.000
	SWAP EURIBOR (EUR) 6 Monate/-0.1210% 06.02.2020	149.000.000	149.000.000
	SWAP EURIBOR (EUR) 6 Monate/-0.1210% 06.02.2020	149.000.000	149.000.000
	SWAP EURIBOR (EUR) 6 Monate/-0.1260% 05.02.2020	149.300.000	149.300.000
	SWAP EURIBOR (EUR) 6 Monate/-0.1260% 05.02.2020	149.300.000	149.300.000
	SWAP EURIBOR (EUR) 6 Monate/-0.1450% 03.07.2019	100.000.000	100.000.000
	SWAP EURIBOR (EUR) 6 Monate/-0.1450% 03.07.2019	100.000.000	100.000.000
	SWAP EURIBOR (EUR) 6 Monate/-0.1520% 30.06.2019	133.000.000	133.000.000
	SWAP EURIBOR (EUR) 6 Monate/-0.1520% 30.06.2019	133.000.000	133.000.000
	SWAP EURIBOR (EUR) 6 Monate/0.2180% 18.08.2022	120.000.000	120.000.000
	SWAP EURIBOR (EUR) 6 Monate/0.2180% 18.08.2022	120.000.000	120.000.000
	SWAP EURIBOR (EUR) 6 Monate/0.8090% 19.05.2027	15.000.000	15.000.000
	SWAP EURIBOR (EUR) 6 Monate/0.8090% 19.05.2027	15.000.000	15.000.000
	SWAP EURIBOR (EUR) 6 Monate/0.8100% 30.06.2027	22.000.000	22.000.000
	SWAP EURIBOR (EUR) 6 Monate/0.8100% 30.06.2027	22.000.000	22.000.000
	SWAP EURIBOR (EUR) 6 Monate/0.8320% 26.05.2027	15.000.000	15.000.000
	SWAP EURIBOR (EUR) 6 Monate/0.8320% 26.05.2027	15.000.000	15.000.000
	SWAP EURIBOR (EUR) 6 Monate/0.8360% 08.05.2027	15.000.000	15.000.000
	SWAP EURIBOR (EUR) 6 Monate/0.8360% 08.05.2027	15.000.000	15.000.000
	SWAP EURIBOR (EUR) 6 Monate/0.8490% 03.07.2027	21.000.000	21.000.000
	SWAP EURIBOR (EUR) 6 Monate/0.8490% 03.07.2027	21.000.000	21.000.000
	SWAP EURIBOR (EUR) 6 Monate/1.0840% 05.02.2028	30.900.000	30.900.000
	SWAP EURIBOR (EUR) 6 Monate/1.0840% 05.02.2028	30.900.000	30.900.000
	SWAP EURIBOR (EUR) 6 Monate/1.1250% 06.02.2028	31.000.000	31.000.000
	SWAP EURIBOR (EUR) 6 Monate/1.1250% 06.02.2028	31.000.000	31.000.000
	SWAP EURIBOR (EUR) 6 Monate/1.5390% 11.01.2048	12.000.000	12.000.000
	SWAP EURIBOR (EUR) 6 Monate/1.5390% 11.01.2048	12.000.000	12.000.000
	SWAP EUROZONE HICP EX TOBACCO/1.3625% 15.05.2027	80.000.000	80.000.000
	SWAP EUROZONE HICP EX TOBACCO/1.3625% 15.05.2027	80.000.000	80.000.000
	SWAP -0.1680%/EURIBOR (EUR) 6 Monate 18.08.2019	298.500.000	298.500.000
	SWAP -0.1680%/EURIBOR (EUR) 6 Monate 18.08.2019	298.500.000	298.500.000
	SWAP 0.2095%/EURIBOR (EUR) 6 Monate 30.06.2022	90.000.000	90.000.000
	SWAP 0.2095%/EURIBOR (EUR) 6 Monate 30.06.2022	90.000.000	90.000.000
	SWAP 0.2370%/EURIBOR (EUR) 6 Monate 03.07.2022	81.000.000	81.000.000
	SWAP 0.2370%/EURIBOR (EUR) 6 Monate 03.07.2022	81.000.000	81.000.000
	SWAP 0.3650%/EURIBOR (EUR) 6 Monate 17.01.2023	80.000.000	80.000.000
	SWAP 0.3650%/EURIBOR (EUR) 6 Monate 17.01.2023	80.000.000	80.000.000
	SWAP 0.4780%/EURIBOR (EUR) 6 Monate 05.02.2023	120.000.000	120.000.000
	SWAP 0.4780%/EURIBOR (EUR) 6 Monate 05.02.2023	120.000.000	120.000.000
	SWAP 0.4980%/EURIBOR (EUR) 6 Monate 06.02.2023	120.000.000	120.000.000
	SWAP 0.4980%/EURIBOR (EUR) 6 Monate 06.02.2023	120.000.000	120.000.000
	SWAP 0.9000%/EURIBOR (EUR) 6 Monate 11.01.2028	30.600.000	30.600.000
	SWAP 0.9000%/EURIBOR (EUR) 6 Monate 11.01.2028	30.600.000	30.600.000
	SWAP 1.1530%/EUROZONE HICP EX TOBACCO 15.05.2022	80.000.000	80.000.000
	SWAP 1.1530%/EUROZONE HICP EX TOBACCO 15.05.2022	80.000.000	80.000.000
	SWAP 1.6700%/EURIBOR (EUR) 6 Monate 19.03.2028	61.000.000	61.000.000
	SWAP 1.6700%/EURIBOR (EUR) 6 Monate 19.03.2028	61.000.000	61.000.000
	Total Return SWAP EURIBOR (EUR) 1 Monat/STOXX Europe 600 Price Index (EUR) 24.05.18	73.473.760	73.473.760
	Total Return SWAP EURIBOR (EUR) 3 Monate/MSCI Daily Gross TR Europe Euro 25.09.18	63.900.000	63.900.000
	Total Return SWAP MSCI Europe Daily Value EUR TR Net EUR Index/EURIBOR (EUR) 3 Monate 25.09.18	24.500.000	24.500.000
	Total Return SWAP MSCI Europe Equal Weighted Net EUR/EURIBOR (EUR) 3 Monate 25.09.18	14.500.000	14.500.000
	Total Return SWAP MSCI EUROPE MOMENTUM Net EUR Index/EURIBOR (EUR) 3 Monate 25.09.18	10.300.000	10.300.000
	Total Return SWAP MSCI EUROPE QUALITY Net Return EUR Index/EURIBOR (EUR) 3 Monate 25.09.18	14.600.000	14.600.000
	Total Return SWAP Strategie GS UI ARP Swap/Strategie GS UI ARP Swap 18.01.19	2.003.944	2.003.944
	Total Return SWAP STRATEGIE DB Tax Profiteure EU/STRATEGIE DB Tax Profiteure EU 18.12.18	10.055.030	10.055.030
	Total Return SWAP STRATEGIE JPM HCT Electric Vehicles/STRATEGIE JPM HCT Electric Vehicles 23.10.18	12.190.200	12.190.200
	Total Return SWAP STRATEGIE zu JPM HCT Global Payment/STRATEGIE zu JPM HCT Global Payment 29.05.18	28.382.707	28.382.707
	Total Return SWAP STRATEGIE zu MS FSI Europe/EURIBOR (EUR) 1 Monat 24.05.18	75.109.577	75.109.577
	Total Return SWAP TRS Aktienbasket, fiktives Underlying/TRS Aktienbasket, fiktives Underlying 10.04.18	11.000.014	11.000.014
	Total Return SWAP TRS Aktienbasket, fiktives Underlying/TRS Aktienbasket, fiktives Underlying 19.10.17	0	25.000.042
	Total Return SWAP TRS Aktienbasket, fiktives Underlying/TRS Aktienbasket, fiktives Underlying 27.09.17	0	22.499.987
	Total Return SWAP TRS Aktienbasket, fiktives Underlying/TRS Aktienbasket, fiktives Underlying 29.05.17	0	14.999.983
	Total Return SWAP TRS Aktienbasket, fiktives Underlying/TRS Aktienbasket, fiktives Underlying 30.05.17	91.500.000	91.500.000
	Total Return SWAP TRS Aktienbasket, fiktives Underlying/TRS Aktienbasket, fiktives Underlying 30.05.17	91.500.000	91.500.000

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Berichtes.

UniAbsoluterErtrag

ISIN	Wertpapiere	Zugänge	Abgänge
	Total Return SWAP TRS Aktienbasket, fiktives Underlying/TRS Aktienbasket, fiktives Underlying 30.05.17	90.000.000	90.000.000
	Total Return SWAP TRS Aktienbasket, fiktives Underlying/TRS Aktienbasket, fiktives Underlying 30.05.17	0	88.000.000
GBP			
	SWAP LIBOR (GBP) 6 Monate/1.2560% 21.06.2028	31.250.000	31.250.000
	SWAP LIBOR (GBP) 6 Monate/1.2560% 21.06.2028	31.250.000	31.250.000
	Total Return SWAP ICE LIBOR (GBP) 3 Monate/STRATEGIE JPM HCT UK Domestic Long 09.08.18	12.961.250	12.961.250
	Total Return SWAP ICE LIBOR (GBP) 3 Monate/STRATEGIE JPM HCT UK Domestic Long 09.08.18	4.666.050	4.666.050
	Total Return SWAP ICE LIBOR (GBP) 3 Monate/STRATEGIE JPM HCT UK Domestic Long 13.08.18	9.912.000	9.912.000
	Total Return SWAP ICE LIBOR (GBP) 3 Monate/STRATEGIE JPM HCT UK Domestic Long 13.08.18	9.848.000	9.848.000
	Total Return SWAP LIBOR (GBP) 3 Monate/STRATEGIE JPM HCT UK Domestic Short 09.08.18	10.761.400	10.761.400
	Total Return SWAP LIBOR (GBP) 3 Monate/STRATEGIE JPM HCT UK Domestic Short 09.08.18	10.371.900	10.371.900
	Total Return SWAP LIBOR (GBP) 6 Monate/STRATEGIE JPM HCT UK Domestic Long 15.02.19	29.033.200	29.033.200
	Total Return SWAP LIBOR (GBP) 6 Monate/STRATEGIE JPM HCT UK Domestic Long 15.02.19	4.984.005	4.984.005
	Total Return SWAP LIBOR (GBP) 6 Monate/STRATEGIE JPM HCT UK Domestic Long 15.02.19	4.933.020	4.933.020
HKD			
	Total Return SWAP STRATEGIE JPM HCT Green China/STRATEGIE JPM HCT Green China 01.08.18	93.933.000	93.933.000
	Total Return SWAP STRATEGIE JPM HCT Green China/STRATEGIE JPM HCT Green China 03.08.18	92.016.000	92.016.000
JPY			
	Total Return SWAP STRATEGIE JPM VOL EQUITY NKY/STRATEGIE JPM VOL EQUITY NKY 15.02.19	645.954.931	645.954.931
	Total Return SWAP TRS Aktienbasket, fiktives Underlying/TRS Aktienbasket, fiktives Underlying 08.11.17	0	2.466.451.300
MXN			
	SWAP Mexico Interbank TIIE (MXN) 28 Day/7.4640% 29.10.2027	605.000.000	605.000.000
	SWAP Mexico Interbank TIIE (MXN) 28 Day/7.4640% 29.10.2027	605.000.000	605.000.000
	SWAP 7.2700%/Mexico Interbank TIIE (MXN) 28 Day 04.11.2022	1.035.000.000	1.035.000.000
	SWAP 7.2700%/Mexico Interbank TIIE (MXN) 28 Day 04.11.2022	1.035.000.000	1.035.000.000
NOK			
	SWAP NIBOR (NOK) 6 Monat/1.5940% 17.01.2023	804.000.000	804.000.000
	SWAP NIBOR (NOK) 6 Monat/1.5940% 17.01.2023	804.000.000	804.000.000
PLN			
	SWAP 2.2500%/WIBOR Warsaw Interbank 6 Months Offered Rate 29.01.2021	260.000.000	260.000.000
	SWAP 2.2500%/WIBOR Warsaw Interbank 6 Months Offered Rate 29.01.2021	260.000.000	260.000.000
	SWAP 2.4500%/WIBOR Warsaw Interbank 6 Months Offered Rate 11.07.2022	140.000.000	140.000.000
	SWAP 2.4500%/WIBOR Warsaw Interbank 6 Months Offered Rate 11.07.2022	140.000.000	140.000.000
SEK			
	SWAP STIBOR (SEK) 3 Monate/2.1070% 19.03.2028	625.000.000	625.000.000
	SWAP STIBOR (SEK) 3 Monate/2.1070% 19.03.2028	625.000.000	625.000.000
USD			
	Excess Return SWAP/Barclays Liquidity Nearby 1717 BCI Energy and Industrial Metals Capped Strategy 19.04.17	0	25.000.000
	Excess Return SWAP/Barclays Liquidity Nearby 1720 BCI Energy and Industrial Metals Capped Strategy 19.04.17	0	25.000.000
	Excess Return SWAP/DB Commodity Volatilit.Premium Index (USD) 04.05.17	50.012	10.674.598
	Excess Return SWAP/DB Commodity Volatilit.Premium Index (USD) 11.07.17	202.804	10.748.747
	Excess Return SWAP/DB Commodity Volatilit.Premium Index (USD) 27.11.17	1.424.713	17.924.713
	Excess Return SWAP/DB Commodity Volatilit.Premium Index (USD) 27.11.17	227.402	6.518.354
	Excess Return SWAP/Deutsche Bank AG Commodity Momentum Alpha Long Index 11.10.17	6.800.000	6.800.000
	Excess Return SWAP/Deutsche Bank AG Commodity Momentum Alpha Long Index 24.04.17	0	30.000.000
	Excess Return SWAP/Deutsche Bank AG Commodity Momentum Alpha Long Index 24.07.17	27.000.000	27.000.000
	Excess Return SWAP/Deutsche Bank AG Commodity Momentum Alpha Long Index 24.07.17	3.300.000	3.300.000
	Excess Return SWAP/Deutsche Bank AG Commodity Momentum Alpha Long Index 24.07.17	3.200.000	3.200.000
	Excess Return SWAP/Deutsche Bank AG Commodity Momentum Alpha Short Index 11.10.17	6.800.000	6.800.000
	Excess Return SWAP/Deutsche Bank AG Commodity Momentum Alpha Short Index 24.04.17	0	30.000.000
	Excess Return SWAP/Deutsche Bank AG Commodity Momentum Alpha Short Index 24.07.17	27.000.000	27.000.000
	Excess Return SWAP/Deutsche Bank AG Commodity Momentum Alpha Short Index 24.07.17	3.300.000	3.300.000
	Excess Return SWAP/Deutsche Bank AG Commodity Momentum Alpha Short Index 24.07.17	3.200.000	3.200.000
	Excess Return SWAP/Morgan Stanley Anti Radar ex Agriculture & Livestock ER Index 11.10.17	175.000.000	175.000.000
	Excess Return SWAP/Morgan Stanley Anti Radar ex Agriculture & Livestock ER Index 11.10.17	135.000.000	135.000.000
	Excess Return SWAP/Morgan Stanley Anti Radar ex Agriculture & Livestock ER Index 11.10.18	143.495.387	143.495.387
	Excess Return SWAP/Morgan Stanley Anti Radar ex Agriculture & Livestock ER Index 24.04.17	0	150.000.000
	Excess Return SWAP/Morgan Stanley Anti Radar ex Agriculture & Livestock ER Index 24.04.17	0	25.000.000
	Excess Return SWAP/Morgan Stanley Anti Radar ex Agriculture & Livestock ER Index 24.07.17	175.000.000	175.000.000

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Berichtes.

UniAbsoluterErtrag

ISIN	Wertpapiere	Zugänge	Abgänge
	Excess Return SWAP/MS Radar ex Agri & Lvstk Finl Index 11.10.17	175.000.000	175.000.000
	Excess Return SWAP/MS Radar ex Agri & Lvstk Finl Index 11.10.17	135.000.000	135.000.000
	Excess Return SWAP/MS Radar ex Agri & Lvstk Finl Index 11.10.18	144.704.123	144.704.123
	Excess Return SWAP/MS Radar ex Agri & Lvstk Finl Index 24.04.17	0	25.000.000
	Excess Return SWAP/MS Radar ex Agri & Lvstk Finl Index 24.04.17	0	150.000.000
	Excess Return SWAP/MS Radar ex Agri & Lvstk Finl Index 24.07.17	175.000.000	175.000.000
	Excess Return SWAP/Societe Generale U Carry L 11.10.17	35.900.000	35.900.000
	Excess Return SWAP/Societe Generale U Carry L 11.10.18	36.500.000	36.500.000
	Excess Return SWAP/Societe Generale U Carry L 24.04.17	0	16.500.000
	Excess Return SWAP/Societe Generale U Carry L 24.07.17	17.100.000	17.100.000
	Excess Return SWAP/Societe Generale U Carry L 24.07.17	16.500.000	16.500.000
	Excess Return SWAP/Societe Generale U Carry S 11.10.17	35.900.000	35.900.000
	Excess Return SWAP/Societe Generale U Carry S 11.10.18	36.500.000	36.500.000
	Excess Return SWAP/Societe Generale U Carry S 24.04.17	0	16.500.000
	Excess Return SWAP/Societe Generale U Carry S 24.07.17	17.100.000	17.100.000
	Excess Return SWAP/Societe Generale U Carry S 24.07.17	16.500.000	16.500.000
	SWAP LIBOR (USD) 3 Monate/1.9325% 16.05.2022	210.000.000	210.000.000
	SWAP LIBOR (USD) 3 Monate/1.9325% 16.05.2022	210.000.000	210.000.000
	SWAP 1.5500%/LIBOR (USD) 3 Monate 16.05.2019	273.000.000	273.000.000
	SWAP 1.5500%/LIBOR (USD) 3 Monate 16.05.2019	273.000.000	273.000.000
	SWAP 2.1740%/LIBOR (USD) 3 Monate 25.05.2027	18.500.000	18.500.000
	SWAP 2.1740%/LIBOR (USD) 3 Monate 25.05.2027	18.500.000	18.500.000
	SWAP 2.1830%/LIBOR (USD) 3 Monate 19.05.2027	17.500.000	17.500.000
	SWAP 2.1830%/LIBOR (USD) 3 Monate 19.05.2027	17.500.000	17.500.000
	SWAP 2.2650%/LIBOR (USD) 3 Monate 16.05.2027	54.000.000	54.000.000
	SWAP 2.2650%/LIBOR (USD) 3 Monate 16.05.2027	54.000.000	54.000.000
	SWAP 2.2900%/LIBOR (USD) 3 Monate 08.05.2027	18.000.000	18.000.000
	SWAP 2.2900%/LIBOR (USD) 3 Monate 08.05.2027	18.000.000	18.000.000
	Total Return SWAP STRATEGIE GS INTRADAY TREND VIX ER STRATEGY/STRATEGIE GS INTRADAY TREND VIX ER STRATEGY 18.10.18	24.974.473	24.974.473
	Total Return SWAP STRATEGIE JPM FSI EM/STRATEGIE JPM FSI EM 28.08.18	12.306.000	12.306.000
	Total Return SWAP STRATEGIE JPM HCT AEROSPACE DEFENSE /STRATEGIE JPM HCT AEROSPACE DEFENSE 20.07.18	15.000.000	15.000.000
	Total Return SWAP STRATEGIE JPM HCT RETAIL DISRUPTED /STRATEGIE JPM HCT RETAIL DISRUPTED 20.07.18	16.885.005	16.885.005
	Total Return SWAP STRATEGIE JPM Oil Services/STRATEGIE JPM Oil Services 17.11.18	10.948.665	10.948.665
	Total Return SWAP STRATEGIE JPM Value Sectorneutral/STRATEGIE JPM Value Sectorneutral 07.12.18	24.942.500	24.942.500
	Total Return SWAP STRATEGIE JPM Value Sectorneutral/STRATEGIE JPM Value Sectorneutral 15.02.19	51.545.450	51.545.450
	Total Return SWAP STRATEGIE JPM Value Tax/STRATEGIE JPM Value Tax 07.12.18	25.090.000	25.090.000
	Total Return SWAP STRATEGIE JPM VIX INTRADAY CURVE STRATEGY/STRATEGIE JPM VIX INTRADAY CURVE STRATEGY 15.02.19	12.852.750	12.852.750
	Total Return SWAP STRATEGIE JPM VIX INTRADAY CURVE STRATEGY/STRATEGIE JPM VIX INTRADAY CURVE STRATEGY 29.09.18	28.391.550	28.391.550
	Total Return SWAP Strategie MS Global Equity Volatility/Strategie MS Global Equity Volatility 22.03.19	10.191.000	10.191.000
	Total Return SWAP STRATEGIE zu GS Intraday Trend US Series 82 Excess Return Strategy/STRATEGIE zu GS Intraday Trend US S	20.266.000	20.266.000
	Total Return SWAP Strategie zu MS Global Rates Curve Carry/Strategie zu MS Global Rates Curve Carry 21.03.18	68.000	11.327.000
	Total Return SWAP STRATEGIE zu MS Rates Carry 10-2 ExtUni ex Italy Strategy /STRATEGIE zu MS Rates Carry 10-2 ExtUni ex	26.073.116	26.073.116
	Total Return SWAP STRATEGIE zu MS Rates Momentum ExtUni Strategy/STRATEGIE zu MS Rates Momentum ExtUni Strategy 22.06.18	25.912.072	25.912.072
	Total Return SWAP Strategie zu Pilot Strategie-Swap Morgan Stanley/Strategie zu Pilot Strategie-Swap Morgan Stanley 15.1	216.000	9.311.400
	Total Return SWAP Strategie zu Pilot Strategie-Swap Morgan Stanley/Strategie zu Pilot Strategie-Swap Morgan Stanley 15.1	144.000	6.207.600
	Total Return SWAP TRS Aktienbasket, fiktives Underlying/TRS Aktienbasket, fiktives Underlying 01.06.17	0	7.800.000
	Total Return SWAP TRS Aktienbasket, fiktives Underlying/TRS Aktienbasket, fiktives Underlying 01.06.17	0	7.800.000
	Total Return SWAP TRS Aktienbasket, fiktives Underlying/TRS Aktienbasket, fiktives Underlying 01.06.17	0	13.200.000
	Total Return SWAP TRS Aktienbasket, fiktives Underlying/TRS Aktienbasket, fiktives Underlying 01.06.17	0	5.500.000
	Total Return SWAP TRS Aktienbasket, fiktives Underlying/TRS Aktienbasket, fiktives Underlying 06.12.17	0	15.000.039
	Total Return SWAP TRS Aktienbasket, fiktives Underlying/TRS Aktienbasket, fiktives Underlying 22.09.17	26.700.000	26.700.000
	Total Return SWAP TRS Aktienbasket, fiktives Underlying/TRS Aktienbasket, fiktives Underlying 22.09.17	15.900.000	15.900.000
	Total Return SWAP TRS Aktienbasket, fiktives Underlying/TRS Aktienbasket, fiktives Underlying 22.09.17	15.800.000	15.800.000
	Total Return SWAP TRS Aktienbasket, fiktives Underlying/TRS Aktienbasket, fiktives Underlying 22.09.17	11.200.000	11.200.000
	Total Return SWAP TRS Aktienbasket, fiktives Underlying/TRS Aktienbasket, fiktives Underlying 28.05.18	15.000.028	15.000.028
	Total Return SWAP TRS Aktienbasket, fiktives Underlying/TRS Aktienbasket, fiktives Underlying 28.05.18	15.000.028	15.000.028

- 1) Angaben zu Ausgabebeschlüssen, Rücknahmeabschlüssen sowie zur maximalen Höhe der Verwaltungsgebühr für Zielfondsanteile sind auf Anfrage am Sitz der Verwaltungsgesellschaft, bei der Verwahrstelle und bei den Zahlstellen kostenlos erhältlich. Von gehaltenen Anteilen eines Zielfonds, die unmittelbar oder aufgrund einer Übertragung von derselben Verwaltungsgesellschaft oder von einer Gesellschaft verwaltet werden, mit der die Verwaltungsgesellschaft durch eine gemeinsame Verwaltung oder Beherrschung oder eine wesentliche direkte oder indirekte Beteiligung verbunden ist, wird keine oder eine reduzierte Verwaltungsvergütung berechnet.

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Berichtes.

Erläuterungen zum Bericht per Ende März 2018

Die Buchführung des Fonds erfolgt in Euro.

Der Jahresabschluss des Fonds wurde auf der Grundlage der im Domizilland gültigen Gliederungs- und Bewertungsgrundsätze erstellt.

Der Kurswert der Wertpapiere und sonstigen börsennotierten Derivate entspricht dem jeweiligen Börsen- oder Marktwert zum Ende des Geschäftsjahres. An einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere werden zu den an diesem Markt verzeichneten Marktpreisen bewertet. Investitionen in Zielfonds werden zu deren zuletzt veröffentlichten Kursen bewertet.

Soweit der Fonds zum Stichtag OTC-Derivate im Bestand hat, erfolgt die Bewertung auf Tagesbasis auf der Grundlage indikativer Broker-Quotierungen oder von finanzmathematischen Bewertungsmodellen.

Soweit der Fonds zum Stichtag schwebende Devisentermingeschäfte verzeichnet, werden diese auf der Grundlage der für die Restlaufzeit gültigen Terminkurse bewertet.

Wertpapiere, deren Kurse nicht marktgerecht sind, sowie alle Vermögenswerte für die keine repräsentativen Marktwerte erhältlich sind, werden zu einem Verkehrswert bewertet, den die Verwaltungsgesellschaft nach Treu und Glauben und anerkannten Bewertungsregeln hergeleitet hat.

Das Bankguthaben wurde mit dem Nennwert angesetzt.

Die auf andere als auf die Fondswährung lautenden Vermögensgegenstände und Verbindlichkeiten wurden zu den letzten verfügbaren Devisenmittelkursen in Euro umgerechnet. Geschäftsvorfälle in Fremdwährungen werden zum Zeitpunkt der buchhalterischen Erfassung in die Fondswährung umgerechnet. Realisierte und unrealisierte Währungsgewinne und -verluste werden erfolgswirksam erfasst.

Im Laufe des Geschäftsjahres hat der Fonds die buchhalterische Erfassung der Erträge aus Zielfonds von einer look-through orientierten auf eine ausschüttungsorientierte Darstellung umgestellt. Die Umstellung ist seit dem 1.1.2018 gültig.

Die Zinsabgrenzung enthält die Stückzinsen zum Ende des Geschäftsjahres.

Die Position Zinsen auf Anleihen enthält, soweit zutreffend, auch anteilige Erträge aufgrund von Emissionsrenditen.

Der Fonds weist unterschiedliche Anteilsklassen aus, welche in ihrem Verhältnis zum Nettoinventarwert und nach Abzug zuzurechnender Aufwendungen an der Entwicklung des Fonds partizipieren.

Der Erwerb von Anteilen darf nur auf der Grundlage des aktuellen Verkaufsprospektes und den wesentlichen Anlegerinformationen, denen der letzte Jahresbericht und gegebenenfalls der letzte Halbjahresbericht beigelegt sind, erfolgen.

Der Ausgabe- bzw. Rücknahmepreis der Fondsanteile wird vom Nettoinventarwert pro Anteil zu den jeweiligen gültigen Handelstagen und, soweit zutreffend, zuzüglich eines im Verkaufsprospekt definierten Ausgabeaufschlags und/oder Dispositionsausgleichs bestimmt. Der Ausgabeaufschlag wird zu Gunsten der Verwaltungsgesellschaft und der Vertriebsstelle erhoben und kann nach der Größenordnung des Kaufauftrages gestaffelt werden. Der Dispositionsausgleich wird dem Fonds gutgeschrieben.

Die Vergütung der Verwaltungsgesellschaft sowie die Pauschalgebühr werden auf Basis des kalendertäglichen Nettofondsvermögens erfasst und monatlich ausbezahlt. Die Pauschalgebühr deckt die Vergütung der Verwahrstelle, bankübliche Depot- und Lagerstellengebühren für die Verwahrung von Vermögensgegenständen, Honorare der Abschlussprüfer, Kosten für die Beauftragung von Stimmrechtsvertretungen und Kosten für Hauptverwaltungstätigkeiten, wie zum Beispiel die Fondsbuchhaltung sowie das Berichts- und Meldewesen, ab. Die Berechnung erfolgt auf der Grundlage vertraglicher Vereinbarungen.

Einzelne Anteilsklassen des Fonds unterliegen einer erfolgsabhängigen Vergütung, die auf der Grundlage der im Prospekt definierten Modalitäten von der Verwaltungsgesellschaft erhoben wird. Die erfolgsabhängige Verwaltungsvergütung für das zum 31. März 2018 endende Geschäftsjahr wird täglich abgegrenzt und erfolgswirksam erfasst. Die im Geschäftsjahr zahlungswirksamen Beträge werden in der Ertrags- und Aufwandsrechnung unter der Position „Erfolgsabhängige Verwaltungsvergütung“ ausgewiesen, die abgegrenzten Beträge sind in der Position „Nettoveränderung nicht realisierter Verluste“ enthalten.

Sofern die Aufwands- und Ertragsrechnung sonstige Aufwendungen enthält, bestehen diese aus den im Verkaufsprospekt genannten Kosten wie beispielsweise staatliche Gebühren, Kosten für die Verwaltung von Sicherheiten oder Kosten für Prospektänderungen.

In den ordentlichen Nettoerträgen sind ein Ertragsausgleich und ein Aufwandsausgleich verrechnet. Diese beinhalten während der Berichtsperiode angefallene Nettoerträge, die der Anteilnehmer im Ausgabepreis mitbezahlt und der Anteilverkäufer im Rücknahmepreis vergütet erhält.

Das Fondsvermögen unterliegt im Großherzogtum Luxemburg einer Steuer, der „Taxe d'abonnement“ von gegenwärtig 0,05 % per annum, zahlbar pro Quartal auf das jeweils am Quartalsende ausgewiesene Netto-Fondsvermögen. Soweit das Fondsvermögen in anderen Luxemburger Investmentfonds angelegt ist, die ihrerseits bereits der Taxe d'abonnement unterliegen, entfällt diese Steuer für den Teil des Fondsvermögens, welcher in solche Luxemburger Investmentfonds angelegt ist.

Die Einnahmen aus der Anlage des Fondsvermögens werden in Luxemburg nicht besteuert, sie können jedoch etwaigen Quellen- oder Abzugsteuern in Ländern unterliegen, in welchen das Fondsvermögen angelegt ist. Weder die Verwaltungsgesellschaft noch die Verwahrstelle werden Quittungen über solche Steuern für einzelne oder alle Anteilinhaber einholen.

Im Zusammenhang mit dem Abschluss von börsennotierten und/oder OTC-Derivaten hat der Fonds Sicherheiten in Form von Bankguthaben oder Wertpapieren zu liefern oder zu erhalten.

Die Positionen „Sonstige Bankguthaben/Bankverbindlichkeiten“ enthalten die vom Fonds gestellten/erhaltenen Sicherheiten in Form von Bankguthaben für börsennotierte Derivate und/oder gestellte Sicherheiten für OTC-Derivate. Gestellte Sicherheiten in Form von Wertpapieren werden in der Vermögensaufstellung gekennzeichnet. Erhaltene Sicherheiten in Form von Wertpapieren sowie Sicherheiten für OTC-Derivate in Form von Bankguthaben werden in der Zusammensetzung des Fondsvermögens und der Vermögensaufstellung nicht erfasst.

Die Wertentwicklung der Fondsanteile ist auf Basis der jeweils an den Stichtagen veröffentlichten Anteilwerte gemäß der BVI-Formel ermittelt worden. Sie kann im Einzelfall von der Entwicklung der Anteilwerte, wie sie im Fondsbericht ermittelt wurden, geringfügig abweichen.

Für die Berechnung der Kennzahl „Laufende Kosten“ wurde die Berechnungsmethode, die dem Committee of European Securities Regulators (Rundschreiben CESR/10-674 vom 1. Juli 2010) entspricht, angewandt.

Die laufenden Kosten geben an, wie stark das Fondsvermögen mit Kosten belastet wurde und können von Jahr zu Jahr schwanken. Berücksichtigt werden neben der Verwaltungsvergütung und Pauschalgebühr sowie der Taxe d'abonnement alle übrigen Kosten, die im Fonds angefallen sind. Bei Fonds mit wesentlichem Anteil an anderen Fonds werden die Kosten dieser Fonds mitberücksichtigt. Diese Kennzahl weist den Gesamtbetrag dieser Kosten als Prozentsatz des durchschnittlichen Fondsvolumens innerhalb eines Geschäftsjahres aus. Eine etwaige erfolgsabhängige Vergütung sowie die anfallenden Transaktionskosten - mit Ausnahme der Transaktionskosten der Verwahrstelle - sind in der Kennzahl „Laufende Kosten“ nicht berücksichtigt.

Die Transaktionskosten bezeichnen sämtliche Kosten, die im Geschäftsjahr für Rechnung des Fonds separat ausgewiesen bzw. abgerechnet wurden und in direktem Zusammenhang mit einem Kauf oder Verkauf von Vermögensgegenständen stehen.

Es können der Verwaltungsgesellschaft in ihrer Funktion als Verwaltungsgesellschaft des Fonds im Zusammenhang mit Handelsgeschäften geldwerte Vorteile („soft commissions“, z. B. Broker-Research, Finanzanalysen, Markt- und Kursinformationssysteme) entstehen, die im Interesse der Anteilinhaber bei den Anlageentscheidungen verwendet werden, wobei derartige Handelsgeschäfte nicht mit natürlichen Personen geschlossen werden, die betreffenden Dienstleister nicht gegen die Interessen des Fonds handeln dürfen und ihre Dienstleistungen im direkten Zusammenhang mit den Aktivitäten des Fonds erbringen.

Hinweis auf das Gesetz vom 17. Dezember 2010

Der Fonds wurde nach Teil I des Luxemburger Gesetzes vom 17. Dezember 2010 über Organismen für gemeinsame Anlagen („Gesetz vom 17. Dezember 2010“) aufgelegt und erfüllt die Anforderungen der Richtlinie 2009/65/EG des Europäischen Parlaments und des Rates vom 13. Juli 2009 zur Koordinierung der Rechts- und Verwaltungsvorschriften betreffend bestimmte Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren („Richtlinie 2009/65/EG“).

Bericht des Réviseur d'entreprises agréé

An die Anteilscheininhaber des
UniAbsoluterErtrag

Bericht über die Jahresabschlussprüfung

Prüfungsurteil

Wir haben den Jahresabschluss des UniAbsoluterErtrag (der "Fonds") - bestehend aus der Zusammensetzung des Fondsvermögens und der Vermögensaufstellung zum 31. März 2018, der Aufwands- und Ertragsrechnung und der Veränderung des Fondsvermögens für das zu diesem Datum endende Geschäftsjahr sowie den Erläuterungen mit einer Zusammenfassung wesentlicher Rechnungslegungsmethoden - geprüft.

Nach unserer Beurteilung vermittelt der beigefügte Jahresabschluss des Fonds, in Übereinstimmung mit den in Luxemburg geltenden gesetzlichen Bestimmungen und Verordnungen betreffend die Aufstellung und Darstellung von Jahresabschlüssen, ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild der Vermögens- und Finanzlage zum 31. März 2018 sowie der Ertragslage und der Entwicklung des Nettovermögenswertes für das zu diesem Datum endende Geschäftsjahr.

Grundlage für das Prüfungsurteil

Wir führten unsere Abschlussprüfung in Übereinstimmung mit dem Gesetz über die Prüfungstätigkeit (das "Gesetz vom 23. Juli 2016") und nach den für Luxemburg von der Commission de Surveillance du Secteur Financier ("CSSF") angenommenen internationalen Prüfungsstandards ("ISA") durch. Unsere Verantwortung gemäß dieser Verordnung, dem Gesetz vom 23. Juli 2016 und diesen Standards wird im Abschnitt « Verantwortung des Réviseur d'entreprises agréé für die Jahresabschlussprüfung » weitergehend beschrieben. Wir sind in Bezug auf den Fonds unabhängig, in Übereinstimmung mit dem für Luxemburg von der CSSF angenommenen „International Ethics Standards Board for Accountants' Code of Ethics for Professional Accountants“ („IESBA Code“) sowie den beruflichen Verhaltensanforderungen, welche im Rahmen der Jahresabschlussprüfung einzuhalten sind und haben alle sonstigen Berufspflichten in Übereinstimmung mit diesen Verhaltensanforderungen erfüllt. Wir sind der Auffassung, dass die von uns erlangten Prüfungsnachweise ausreichend und geeignet sind, um als Grundlage für unser Prüfungsurteil zu dienen.

Sonstige Informationen

Der Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft ist verantwortlich für die sonstigen Informationen. Diese stellen Informationen dar, welche im Jahresbericht enthalten sind, jedoch nicht Teil des Jahresabschlusses oder unseres Berichts des Réviseur d'entreprises agréé zu diesem Jahresabschluss sind.

Unser Prüfungsurteil zum Jahresabschluss deckt nicht die sonstigen Informationen ab und wir geben keinerlei Sicherheit jedweder Art auf diese Informationen.

Im Zusammenhang mit der Prüfung des Jahresabschlusses besteht unsere Verantwortung darin, die sonstigen Informationen zu lesen und dabei zu beurteilen, ob eine wesentliche Unstimmigkeit zwischen diesen und dem Jahresabschluss oder mit den bei der Abschlussprüfung gewonnenen Erkenntnissen besteht oder die sonstigen Informationen auch ansonsten wesentlich falsch dargestellt erscheinen. Sollten wir auf Basis der von uns durchgeführten Tätigkeiten schlussfolgern, dass die sonstigen Informationen wesentliche falsche Darstellungen enthalten, sind wir verpflichtet, diesen Sachverhalt zu berichten. Wir haben diesbezüglich nichts zu berichten.

Verantwortung des Verwaltungsrats der Verwaltungsgesellschaft für den Jahresabschluss

Der Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft ist verantwortlich für die Aufstellung und sachgerechte Gesamtdarstellung des Jahresabschlusses in Übereinstimmung mit den in Luxemburg geltenden gesetzlichen Bestimmungen und Verordnungen zur Aufstellung und Darstellung des Jahresabschlusses und für die internen Kontrollen, die der Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft als notwendig erachtet, um eine Aufstellung des Jahresabschlusses zu ermöglichen, der frei von wesentlichen beabsichtigten oder unbeabsichtigten falschen Darstellungen ist.

Im Rahmen der Aufstellung des Jahresabschlusses liegt es im Verantwortungsbereich des Verwaltungsrates der Verwaltungsgesellschaft, die Fähigkeit des Fonds zur Fortführung der Geschäftstätigkeit zu beurteilen und, soweit zutreffend, Fragen in Bezug auf die Fortführung der Geschäftstätigkeit und Anwendung des Rechnungslegungsgrundsatzes der Geschäftsführung mitzuteilen, sofern der Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft nicht beabsichtigt, den Fonds zu liquidieren oder die Geschäftstätigkeit einzustellen oder ihm keine andere realistische Alternative zur Verfügung steht.

Verantwortung des Réviseur d'entreprises agréé für die Jahresabschlussprüfung

Zielsetzung unserer Prüfung ist die Erlangung einer hinreichenden Sicherheit, ob der Jahresabschluss als Ganzes frei von wesentlichen, beabsichtigten oder unbeabsichtigten falschen Darstellungen ist und hierzu einen Bericht des Réviseur d'entreprises agréé zu erstellen, der unser Prüfungsurteil enthält. Hinreichende Sicherheit entspricht einem hohen Grad an Sicherheit, ist jedoch keine Garantie dafür, dass eine in Übereinstimmung mit dem Gesetz vom 23. Juli 2016 und mit den für Luxemburg von der CSSF angenommenen ISAs durchgeführte Prüfung stets eine wesentliche falsche Darstellung, soweit vorhanden, aufdeckt. Falsche Darstellungen können entweder aus Unrichtigkeiten oder aus Verstößen resultieren und werden als wesentlich angesehen, wenn vernünftigerweise davon ausgegangen werden kann, dass diese individuell oder insgesamt die auf der Grundlage dieses Jahresabschlusses getroffenen wirtschaftlichen Entscheidungen von Adressaten beeinflussen.

Im Rahmen einer Abschlussprüfung in Übereinstimmung mit dem Gesetz vom 23. Juli 2016 und nach den für Luxemburg von der CSSF angenommenen ISAs üben wir unser pflichtgemäßes Ermessen aus und bewahren eine kritische Grundhaltung. Darüber hinaus:

- Identifizieren und beurteilen wir das Risiko wesentlicher Falschdarstellungen im Jahresabschluss infolge von Unrichtigkeiten oder Verstößen, planen und führen Prüfungshandlungen als Antwort auf diese Risiken durch und erlangen Prüfungsnachweise, die ausreichend und angemessen sind, um unser Prüfungsurteil herzuleiten. Das Risiko, dass wesentliche Falschdarstellungen nicht aufgedeckt werden, ist bei Verstößen höher als bei Unrichtigkeiten, da Verstöße betrügerisches Zusammenwirken, Fälschungen, beabsichtigte Unvollständigkeiten, irreführende Angaben bzw. das Außerkraftsetzen interner Kontrollen beinhalten können.
- Gewinnen wir ein Verständnis des für die Abschlussprüfung relevanten internen Kontrollsystems, um Prüfungshandlungen zu planen, die unter den gegebenen Umständen angemessen sind, nicht jedoch mit dem Ziel, ein Prüfungsurteil zur Wirksamkeit des internen Kontrollsystems des Fonds abzugeben.
- Beurteilen wir die Angemessenheit der vom Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft angewandten Bilanzierungsmethoden, der rechnungslegungsrelevanten Schätzungen und den entsprechenden Anhangangaben.

- Schlussfolgern wir über die Angemessenheit der Anwendung des Rechnungslegungsgrundsatzes der Fortführung der Geschäftstätigkeit durch den Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft sowie auf der Grundlage der erlangten Prüfungsnachweise, ob eine wesentliche Unsicherheit im Zusammenhang mit Ereignissen oder Gegebenheiten besteht, die wesentliche Zweifel an der Fähigkeit des Fonds zur Fortführung der Geschäftstätigkeit aufwerfen könnten. Sollten wir schlussfolgern, dass eine wesentliche Unsicherheit besteht, sind wir verpflichtet im Bericht des Réviseur d'entreprises agréé auf die dazugehörigen Anhangangaben im Jahresabschluss hinzuweisen, oder, falls die Angaben unangemessen sind, das Prüfungsurteil zu modifizieren. Diese Schlussfolgerungen basieren auf der Grundlage der bis zum Datum des Berichts des Réviseur d'entreprises agréé erlangten Prüfungsnachweise. Zukünftige Ereignisse oder Gegebenheiten können jedoch dazu führen, dass der Fonds seine Geschäftstätigkeit nicht mehr fortführen kann.
- Beurteilen wir die Gesamtdarstellung, den Aufbau und den Inhalt des Jahresabschlusses einschließlich der Anhangangaben und beurteilen, ob dieser die zugrundeliegenden Geschäftsvorfälle und Ereignisse sachgerecht darstellt.

Wir teilen den für die Überwachung Verantwortlichen unter anderem den geplanten Prüfungsumfang und -zeitraum sowie die wesentlichen Prüfungsfeststellungen einschließlich wesentlicher Schwächen im internen Kontrollsystem mit, die wir im Rahmen der Prüfung identifizieren.

ERNST & YOUNG
Société Anonyme
Cabinet de révision agréé

Dr. Christoph Haas

Luxemburg, 14. Juni 2018

Sonstige Informationen der Verwaltungsgesellschaft

Sonstige Angaben

Wertpapiergeschäfte werden grundsätzlich nur mit Kontrahenten getätigt, die durch das Fondsmanagement in eine Liste genehmigter Parteien aufgenommen wurden, deren Zusammensetzung fortlaufend überprüft wird. Dabei stehen Kriterien wie die Ausführungsqualität, die Höhe der Transaktionskosten, die Researchqualität und die Zuverlässigkeit bei der Abwicklung von Wertpapierhandelsgeschäften im Vordergrund. Darüber hinaus werden die jährlichen Geschäftsberichte der Kontrahenten eingesehen.

Der Anteil der Wertpapiertransaktionen, die im Berichtszeitraum vom 1. April 2017 bis 31. März 2018 für Rechnung der von der Union Investment Luxembourg S.A. verwalteten Publikumsfonds mit im Konzernverbund stehenden oder über wesentliche Beteiligungen verbundene Unternehmen ausgeführt wurden, betrug 3,17 Prozent. Ihr Umfang belief sich hierbei auf insgesamt 1.663.494.660,95 Euro.

Informationen zum Risikomanagementverfahren

Die zur Überwachung des mit Derivaten verbundenen Gesamtrisikos herangezogene Methode ist der absolute VaR-Ansatz.

Das zur Ermittlung des absoluten VaR-Ansatzes verwendete Modell ist ein VaR (Value-at-Risk) Modell. Die Kennzahl Value-at-Risk (VaR) ist ein mathematisch statistisches Konzept und gibt den möglichen Verlust eines Portfolios während eines bestimmten Zeitraums, der mit einer bestimmten Wahrscheinlichkeit nicht überschritten wird, an.

Zur Ermittlung der VaR Kennzahl wird eine Monte Carlo Simulation herangezogen. Die verwendeten Parameter dazu sind:

- Haltedauer: 20 Tage
- Konfidenzniveau: 99%
- Historischer Beobachtungszeitraum: 1 Jahr (gleichgewichtet)

Die anhand des oben erläuterten Modells ermittelte Auslastung des mit Derivaten verbundenen Gesamtrisikos und entsprechender Limitauslastung bei einem aufsichtsrechtlichen Limit von 20% betrug für den minimalen, maximalen und durchschnittlich berechneten VaR Wert:

Minimum VaR 0,61%; Limitauslastung 3%,

Maximum VaR 3,42%; Limitauslastung 17%,

Durchschnittlicher VaR 1,17%; Limitauslastung 6%.

Hebelwirkung

Die ermittelte durchschnittliche Hebelwirkung nach der Bruttomethode betrug 1.226%.

Angaben zur Vergütungspolitik der Union Investment Luxembourg S.A.

Umfang der Vergütungspolitik

Die Vergütungspolitik und -praxis umfasst feste und variable Bestandteile der Gehälter und freiwillige Altersversorgungsleistungen.

Beschreibung der Berechnung der Vergütungselemente

Die Vergütung setzt sich aus folgenden Bestandteilen zusammen:

- 1) Fixe Vergütungen: Gesamtsumme der im abgelaufenen Geschäftsjahr gezahlten monatlichen Grundgehälter sowie des 13. Tarifgehaltes.
- 2) Variable Vergütungen: Gesamtsumme der im abgelaufenen Geschäftsjahr gezahlten variablen Vergütungsbestandteile. Hierunter fallen die variable Leistungsvergütung sowie Sonderzahlungen aufgrund des Geschäftsergebnisses.

Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr von der Verwaltungsgesellschaft gezahlten Mitarbeitervergütung (Stand: 31. Dezember 2017)

Personalbestand		63
Feste Vergütung	EUR	4.300.000,00
Variable Vergütung	EUR	900.000,00
Gesamtvergütung	EUR	5.200.000,00
<hr/>		
Anzahl Mitarbeiter mit Führungsfunktion		9
Gesamtvergütung der Mitarbeiter mit Führungsfunktion	EUR	1.700.000,00

Anzahl der von der Verwaltungsgesellschaft verwalteten Fonds (Stand: 31. Dezember 2017): 178

Ergänzende Angaben gemäß ESMA - Leitlinien für den UniAbsoluterErtrag

Derivate

Durch OTC und börsengehandelte Derivate erzielter zugrundeliegendes Exposure: EUR 16.023.253.404,70

Identität der Gegenpartei(en) bei diesen Derivategeschäften:

Barclays Bank PLC, London
 BNP Paribas S.A., Paris
 Citigroup Global Markets Ltd., London
 Commerzbank AG, Frankfurt
 Deutsche Bank AG, Frankfurt
 Deutsche Bank AG, London
 DZ Privatbank S.A., Luxemburg
 Goldman Sachs International., London
 J.P. Morgan Securities PLC, London
 Merrill Lynch Intl., London
 Morgan Stanley & Co. Intl. PLC, London
 Nomura International PLC, London
 Société Générale S.A., Paris

Art und Höhe der entgegengenommenen Sicherheiten (Collateral Received) für OTC Derivate, die auf das Kontrahentenrisiko des OGAW anrechenbar sind: EUR 1.470.000,00

Davon:

Bankguthaben	EUR	1.470.000,00
Schuldverschreibungen	EUR	0,00
Aktien	EUR	0,00

Techniken für eine effiziente Portfolioverwaltung

Exposure, das durch Techniken für eine effiziente Portfolioverwaltung erzielt wird EUR 0,00

Identität der Gegenpartei(en) bei diesen Techniken für eine effiziente Portfolioverwaltung:

nicht zutreffend

Art und Höhe der entgegengenommenen Sicherheiten (Collateral Received), die auf das Kontrahentenrisiko des OGAW anrechenbar sind: EUR 0,00

Davon:

Bankguthaben	EUR	0,00
Schuldverschreibungen	EUR	0,00
Aktien	EUR	0,00

Erträge, die sich aus Wertpapierleihe für eine effiziente Portfolioverwaltung für den gesamten Berichtszeitraum ergeben, einschließlich der angefallenen direkten und indirekten Kosten und Gebühren Klasse A EUR 1.158,29

Erträge, die sich aus Wertpapierleihe für eine effiziente Portfolioverwaltung für den gesamten Berichtszeitraum ergeben, einschließlich der angefallenen direkten und indirekten Kosten und Gebühren Klasse -net- A EUR 2.261,16

Erträge, die sich aus Wertpapierleihe für eine effiziente Portfolioverwaltung für den gesamten Berichtszeitraum ergeben, einschließlich der angefallenen direkten und indirekten Kosten und Gebühren Klasse I EUR 170,45

Die Erträge aus Wertpapierleihgeschäften werden nach Abzug der damit verbundenen Kosten zwischen dem Fonds und der Verwaltungsgesellschaft Union Investment Luxembourg S.A., für ihre Tätigkeit als Agent, aufgeteilt, wobei der mehrheitliche Teil dem Fondsvermögen gutgeschrieben wird.

ZUSÄTZLICHE ANGABEN ZU ENTGEGENGENOMMENEN SICHERHEITEN BEI OTC-DERIVATEN UND TECHNIKEN FÜR EINE EFFIZIENTE PORTFOLIOVERWALTUNG

Identität des Emittenten, wenn die von diesem Emittenten erhaltenen Sicherheiten 20% des Nettoinventarwerts des OGAW überschreiten nicht zutreffend

Besicherungen im Zusammenhang mit OTC Derivaten und Techniken für eine effiziente Portfolioverwaltung

Die Besicherung erfolgt nicht vollständig durch Wertpapiere, die von einem EU-Mitgliedstaat begeben oder garantiert werden.

Zusätzliche Anhangangaben gemäß der Verordnung (EU) 2015/2365 über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte für den UniAbsoluterErtrag

	Wertpapierleihe	Pensionsgeschäfte	Total Return Swaps ¹⁾
Verwendete Vermögensgegenstände			
absolut	nicht zutreffend	nicht zutreffend	733.949,19
in % des Fondsvermögen	nicht zutreffend	nicht zutreffend	0,03 %
Zehn größte Gegenparteien ²⁾			
1. Name	nicht zutreffend	nicht zutreffend	Goldman Sachs International., London
1. Bruttovolumen offene Geschäfte	nicht zutreffend	nicht zutreffend	1.074.331,19
1. Sitzstaat	nicht zutreffend	nicht zutreffend	Großbritannien
2. Name	nicht zutreffend	nicht zutreffend	Morgan Stanley & Co. Intl. PLC, London
2. Bruttovolumen offene Geschäfte	nicht zutreffend	nicht zutreffend	657.052,36
2. Sitzstaat	nicht zutreffend	nicht zutreffend	Großbritannien
3. Name	nicht zutreffend	nicht zutreffend	Deutsche Bank AG, London
3. Bruttovolumen offene Geschäfte	nicht zutreffend	nicht zutreffend	409.288,46
3. Sitzstaat	nicht zutreffend	nicht zutreffend	Großbritannien
4. Name	nicht zutreffend	nicht zutreffend	Barclays Bank PLC, London
4. Bruttovolumen offene Geschäfte	nicht zutreffend	nicht zutreffend	175.362,43
4. Sitzstaat	nicht zutreffend	nicht zutreffend	Großbritannien
5. Name	nicht zutreffend	nicht zutreffend	J.P. Morgan Securities PLC, London
5. Bruttovolumen offene Geschäfte	nicht zutreffend	nicht zutreffend	-1.582.085,25
5. Sitzstaat	nicht zutreffend	nicht zutreffend	Großbritannien
Art(en) von Abwicklung und Clearing (z.B. zweiseitig, dreiseitig, Central Counterparty)			
	nicht zutreffend	nicht zutreffend	zweiseitig
Geschäfte gegliedert nach Restlaufzeiten (absolute Beträge)			
unter 1 Tag	nicht zutreffend	nicht zutreffend	nicht zutreffend
1 Tag bis 1 Woche (= 7 Tage)	nicht zutreffend	nicht zutreffend	nicht zutreffend
1 Woche bis 1 Monat (= 30 Tage)	nicht zutreffend	nicht zutreffend	-29.452,31
1 bis 3 Monate	nicht zutreffend	nicht zutreffend	nicht zutreffend
3 Monate bis 1 Jahr (= 365 Tage)	nicht zutreffend	nicht zutreffend	1.154.690,71
über 1 Jahr	nicht zutreffend	nicht zutreffend	-391.289,21
unbefristet	nicht zutreffend	nicht zutreffend	nicht zutreffend
Art(en) und Qualität(en) der erhaltenen Sicherheiten			
Arten	nicht zutreffend	nicht zutreffend	Bankguthaben
Qualitäten ³⁾	nicht zutreffend	nicht zutreffend	EUR
Währung(en) der erhaltenen Sicherheiten			
	nicht zutreffend	nicht zutreffend	EUR
Sicherheiten gegliedert nach Restlaufzeiten (absolute Beträge)			
unter 1 Tag	nicht zutreffend	nicht zutreffend	nicht zutreffend
1 Tag bis 1 Woche (= 7 Tage)	nicht zutreffend	nicht zutreffend	nicht zutreffend
1 Woche bis 1 Monat (= 30 Tage)	nicht zutreffend	nicht zutreffend	nicht zutreffend
1 bis 3 Monate	nicht zutreffend	nicht zutreffend	nicht zutreffend
3 Monate bis 1 Jahr (= 365 Tage)	nicht zutreffend	nicht zutreffend	nicht zutreffend
über 1 Jahr	nicht zutreffend	nicht zutreffend	nicht zutreffend
unbefristet	nicht zutreffend	nicht zutreffend	1.090.000,00
Ertrags- und Kostenanteile			
Ertragsanteil des Fonds			
absolut	3.589,90	nicht zutreffend	14.753.145,75
in % der Bruttoerträge	50,50 %	nicht zutreffend	90,55 %
Kostenanteil des Fonds	3.519,10	nicht zutreffend	1.540.296,45
davon Kosten an Verwaltungsgesellschaft / Ertragsanteil der Verwaltungsgesellschaft			
absolut	3.449,10	nicht zutreffend	nicht zutreffend
in % der Bruttoerträge	48,52 %	nicht zutreffend	nicht zutreffend
davon Kosten an Dritte / Ertragsanteil Dritter			
absolut	70,00	nicht zutreffend	1.540.296,45
in % der Bruttoerträge	0,98 %	nicht zutreffend	9,45 %

Erträge für den Fonds aus Wiederanlage von Barsicherheiten, bezogen auf alle Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total Return Swaps (absoluter Betrag)

nicht zutreffend

Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total Return Swaps**Verliehene Wertpapiere in % aller verleihbaren Vermögensgegenstände des Fonds**

nicht zutreffend

Zehn größte Sicherheitenaussteller, bezogen auf alle Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total Return Swaps ⁴⁾

1. Name	Morgan Stanley & Co. Intl. PLC, London
1. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	1.000.000,00
2. Name	Goldman Sachs International, London
2. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	90.000,00

Wiederangelegte Sicherheiten in % der empfangenen Sicherheiten, bezogen auf alle Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total Return Swapskeine wiederangelegten Sicherheiten;
gemäß Verkaufsprospekt ist bei Bankguthaben eine Wiederanlage zu 100% möglich**Verwahrer / Kontoführer von empfangenen Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps**

Gesamtzahl Verwahrer / Kontoführer	1
1. Name	DZ PRIVATBANK S.A.
1. Verwahrter Betrag absolut	1.090.000,00

Verwahrt begebener Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps

In % aller begebenen Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps

gesonderte Konten / Depots	nicht zutreffend
Sammelkonten / Depots	nicht zutreffend
andere Konten / Depots	nicht zutreffend
Verwahrt bestimmt Empfänger	100 %

- 1) Die Sicherheiten für Total Return Swaps befinden sich in einem Sicherheitenpool, so dass auch andere Derivate darunter besichert sind.
- 2) Es werden nur die tatsächlichen Gegenparteien des Fonds aufgelistet. Die Anzahl dieser Gegenparteien kann weniger als zehn betragen.
- 3) Es werden nur Vermögensgegenstände als Sicherheit genommen, die für den Fonds nach Maßgabe des Gesetzes vom 17. Dezember 2010 erworben werden dürfen und die Bestimmungen der entsprechenden CSSF-Rundschreiben erfüllen. Neben ggf. Bankguthaben handelt es sich um hochliquide Vermögensgegenstände, die an einem liquiden Markt mit transparenter Preisfeststellung gehandelt werden. Die gestellten Sicherheiten werden von Emittenten mit einer hohen Kreditqualität ausgegeben. Weitere Informationen zu Sicherheitenanforderungen befinden sich in dem Verkaufsprospekt des Fonds.
- 4) Es werden nur die tatsächlichen Sicherheitenaussteller des Fonds aufgelistet. Die Anzahl dieser Sicherheitenaussteller kann weniger als zehn betragen.

Verwaltungsgesellschaft und zugleich Hauptverwaltungsgesellschaft

Union Investment Luxembourg S.A.
308, route d'Esch
L-1471 Luxemburg
Großherzogtum Luxemburg
R.C.S.L. B 28679

Eigenkapital per 31.12.2017:
Euro 164,837 Millionen
nach Gewinnverwendung

Leitungsorgan der Union Investment Luxembourg S.A.:

Verwaltungsrat

Verwaltungsratsvorsitzender

Hans Joachim REINKE
Vorsitzender des Vorstandes der
Union Asset Management Holding AG
Frankfurt am Main

Stv. Verwaltungsratsvorsitzender

Giovanni GAY
Mitglied der Geschäftsführung der
Union Investment Privatfonds GmbH
Frankfurt am Main

Weitere Mitglieder des Verwaltungsrates

Björn JESCH (bis zum 31.12.2017)
Mitglied der Geschäftsführung der
Union Investment Privatfonds GmbH
Frankfurt am Main

Dr. Frank ENGELS (ab dem 01.02.2018)
Mitglied der Geschäftsführung der
Union Investment Privatfonds GmbH
Frankfurt am Main

Nikolaus SILLEM
Mitglied der Geschäftsführung der
Union Investment Institutional GmbH
Frankfurt am Main

Maria LÖWENBRÜCK
Mitglied der Geschäftsführung der
Union Investment Luxembourg S.A.
Luxemburg

Rudolf KESSEL (bis zum 20.04.2017)
Mitglied der Geschäftsführung der
Union Investment Luxembourg S.A.
Luxemburg

Dr. Joachim VON CORNBERG
Mitglied der Geschäftsführung der
Union Investment Luxembourg S.A.
Luxemburg

Karl-Heinz MOLL (ab dem 01.07.2017)
Mitglied des Verwaltungsrates

Bernd SCHLICHTER
unabhängiges Mitglied des
Verwaltungsrates

Klaus Peter STRÄBER (ab dem 01.07.2017)
unabhängiges Mitglied des
Verwaltungsrates

Geschäftsführer der Union Investment Luxembourg S.A.

Maria LÖWENBRÜCK
Rudolf KESSEL (bis zum 30.06.2017)
Dr. Joachim VON CORNBERG

Gesellschafter der Union Investment Luxembourg S.A.

Union Asset Management Holding AG
Frankfurt am Main

Auslagerung des Portfoliomanagements an folgende, der Union Investment Gruppe angehörende, Gesellschaften:

Union Investment Privatfonds GmbH
Weißfrauenstraße 7
D-60311 Frankfurt am Main

Union Investment Institutional GmbH
Weißfrauenstraße 7
D-60311 Frankfurt am Main

Abschlussprüfer (Réviseur d'entreprises agréé)

Ernst & Young S.A.
35E avenue John F. Kennedy
L-1855 Luxembourg

die zugleich Abschlussprüfer der
Union Investment Luxembourg S.A. ist.

Verwahrstelle und zugleich Hauptzahlstelle

DZ PRIVATBANK S.A.
4, rue Thomas Edison
L-1445 Luxemburg-Strassen

Zahl- und Vertriebsstelle im Großherzogtum Luxemburg

DZ PRIVATBANK S.A.
4, rue Thomas Edison
L-1445 Luxemburg-Strassen

Zahl- und Vertriebsstellen sowie Informationsstellen in der Bundesrepublik Deutschland

DZ BANK AG
Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank
Platz der Republik
60265 Frankfurt am Main
Sitz: Frankfurt am Main

BBBank eG
Herrenstraße 2-10
76133 Karlsruhe
Sitz: Karlsruhe

Deutsche Apotheker- und Ärztebank eG
Richard-Oskar-Mattern-Str. 6
40547 Düsseldorf
Sitz: Düsseldorf

Weitere Vertriebsstellen in der Bundesrepublik Deutschland

Die den vorgenannten Banken sowie den genossenschaftlichen Zentralbanken angeschlossenen Kreditinstitute sind weitere Vertriebsstellen in der Bundesrepublik Deutschland.

Zahl- und Vertriebsstelle in Österreich

VOLKSBANK WIEN AG
Kolingasse 14-16
A-1090 Wien

Weitere von der Verwaltungsgesellschaft verwaltete Fonds

BBBank Konzept Dividendenwerte Union
Commodities-Invest
FairWorldFonds
LIGA Portfolio Concept
LIGA-Pax-Cattolico-Union
LIGA-Pax-Corporates-Union
LIGA-Pax-Laurent-Union (2022)
PE-Invest SICAV
PrivatFonds: Konsequenz
PrivatFonds: Konsequenz pro
Quoniam Funds Selection SICAV
SpardaRentenPlus
UniAsia
UniAsiaPacific
UniAusschüttung
UniDividendenAss
UniDynamicFonds: Europa
UniDynamicFonds: Global
UniEM Fernost
UniEM Global
UniEM Osteuropa
UniEuroAnleihen
UniEuroAspirant
UniEuroKapital
UniEuroKapital Corporates
UniEuroKapital -net-
UniEuropa
UniEuropa Mid&Small Caps
UniEuropaRenta
UniEuroRenta Corporates
UniEuroRenta Corporates Deutschland 2019
UniEuroRenta Corporates 2018
UniEuroRenta EM 2021
UniEuroRenta EmergingMarkets
UniEuroRenta Real Zins
UniEuroRenta Unternehmensanleihen EM 2021
UniEuroRenta Unternehmensanleihen 2020
UniEuroRenta 5J
UniEuroSTOXX 50
UniExtra: EuroStoxx 50
UniFavorit: Aktien Europa
UniFavorit: Renten
UniGarant: Aktien Welt (2020)
UniGarant: ChancenVielfalt (2019) II
UniGarant: ChancenVielfalt (2020)
UniGarant: ChancenVielfalt (2020) II
UniGarant: ChancenVielfalt (2021)
UniGarant: Commodities (2018)
UniGarant: Commodities (2019)
UniGarant: Deutschland (2019)
UniGarant: Deutschland (2019) II
UniGarant: Emerging Markets (2018)
UniGarant: Emerging Markets (2020)
UniGarant: Emerging Markets (2020) II
UniGarant: Erneuerbare Energien (2018)
UniGarant: Nordamerika (2021)
UniGarant: Rohstoffe (2020)
UniGarantExtra: Deutschland (2019)
UniGarantExtra: Deutschland (2019) II
UniGarantPlus: Erneuerbare Energien (2018)
UniGarantPlus: Europa (2018)
UniGarantTop: Europa
UniGarantTop: Europa II
UniGarantTop: Europa III
UniGarantTop: Europa IV
UniGarantTop: Europa V
UniGarant95: Aktien Welt (2020)
UniGarant95: ChancenVielfalt (2019)
UniGarant95: ChancenVielfalt (2019) II
UniGarant95: ChancenVielfalt (2020)
UniGarant95: Nordamerika (2019)
UniGlobal Dividende
UniGlobal II
UniIndustrie 4.0
UniInstitutional Asian Bond and Currency Fund
UniInstitutional Asset Balance Plus
UniInstitutional Basic Emerging Markets
UniInstitutional Basic Global Corporates HY
UniInstitutional Basic Global Corporates IG
UniInstitutional CoCo Bonds
UniInstitutional Convertibles Protect
UniInstitutional Corporate Hybrid Bonds
UniInstitutional EM Bonds 2018
UniInstitutional EM Corporate Bonds
UniInstitutional EM Corporate Bonds Flexible
UniInstitutional EM Corporate Bonds Low Duration Sustainable
UniInstitutional EM Corporate Bonds 2020
UniInstitutional EM Corporate Bonds 2022
UniInstitutional EM High Yield Bonds
UniInstitutional EM Sovereign Bonds
UniInstitutional Euro Corporate Bonds 2019
UniInstitutional Euro Covered Bonds 2019
UniInstitutional Euro Liquidity
UniInstitutional Euro Subordinated Bonds
UniInstitutional European Bonds: Diversified
UniInstitutional European Bonds: Governments Peripherie
UniInstitutional European Corporate Bonds +
UniInstitutional European Equities Concentrated
UniInstitutional Financial Bonds 2022
UniInstitutional German Corporate Bonds +
UniInstitutional Global Convertibles
UniInstitutional Global Convertibles Sustainable
UniInstitutional Global Corporate Bonds Short Duration
UniInstitutional Global Corporate Bonds Sustainable
UniInstitutional Global Corporate Bonds 2022
UniInstitutional Global Covered Bonds
UniInstitutional Global Credit
UniInstitutional Global High Dividend Equities Protect
UniInstitutional Global High Yield Bonds
UniInstitutional IMMUNO Nachhaltigkeit
UniInstitutional Local EM Bonds
UniInstitutional Multi Credit

UniInstitutional MultiPremia
UniInstitutional SDG Equities
UniInstitutional Short Term Credit
UniInstitutional Structured Credit High Yield
UniKonzept: Dividenden
UniKonzept: Portfolio
UniMarktführer
UnionProtect: Europa (CHF)
UniOptima
UniOptimus -net-
UniOpti4
UniPacific Aktien
UniPremium Evolution 100
UniPremium Evolution 25
UniProfiAnlage (2019)
UniProfiAnlage (2019/II)
UniProfiAnlage (2020)
UniProfiAnlage (2020/II)
UniProfiAnlage (2021)
UniProfiAnlage (2023)
UniProfiAnlage (2023/II)
UniProfiAnlage (2024)
UniProfiAnlage (2025)
UniProfiAnlage (2027)
UniProInvest: Struktur
UniProtect: Europa
UniProtect: Europa II
UniRak Emerging Markets
UniRak Nachhaltig
UniRak Nachhaltig Konservativ
UniRak Nordamerika
UniRent Europa
UniRent Global
UniRent Kurz URA
UniRent Mündel
UniRent Mündel Flex
UniRenta Corporates
UniRentEuro Mix
UniRentEuro Staatsanleihen Flex
UniReserve
UniReserve: Euro-Corporates
UniSector
UniStruktur
UniValueFonds: Europa
UniValueFonds: Global
UniVorsorge 1
UniVorsorge 2
UniVorsorge 3
UniVorsorge 4
UniVorsorge 5
UniVorsorge 6
UniVorsorge 7
UniWirtschaftsAspirant
VBMH Vermögen

Die Union Investment Luxembourg S.A. verwaltet ebenfalls Fonds nach dem Gesetz vom 13. Februar 2007 über spezialisierte Investmentfonds.

Union Investment Luxembourg S.A.
308, route d'Esch
L-1471 Luxemburg
service@union-investment.com
privatkunden.union-investment.de