



Generali AktivMix Dynamik Protect 80

Halbjahresbericht

zum 31. Januar 2024

Generali AktivMix Dynamik Protect 80

Vermögensübersicht zum 31. Januar 2024

Hinweis

Der Kauf von Anteilen eines Teilfonds erfolgt auf der Basis der wesentlichen Anlegerinformationen sowie des Verkaufsprospektes einschließlich des Verwaltungs- und Sonderreglements. Der jeweils aktuelle Verkaufsprospekt und die wesentlichen Anlegerinformationen, das Verwaltungsreglement sowie die Jahres- und Halbjahresberichte sind kostenlos in Papierform bei der luxemburgischen Verwaltungsgesellschaft Generali Investments Luxembourg S.A., 4, rue Jean Monnet, L-2180 Luxemburg erhältlich. Ebenfalls kostenlos bei der Verwaltungsgesellschaft erhältlich ist eine Übersicht über die Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestandes.

	Kurswert in EUR	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
I. Vermögensgegenstände		232.728.629,33	100,13
1. Aktien		37.385.557,49	16,09
- Belgien	127.157,42		0,05
- Dänemark	1.305.877,74		0,56
- Deutschland	2.122.487,86		0,91
- Finnland	282.419,15		0,12
- Frankreich	2.580.294,99		1,11
- Großbritannien	3.803.453,52		1,64
- Irland	695.835,07		0,30
- Italien	501.303,00		0,22
- Niederlande	2.053.729,00		0,88
- Norwegen	225.384,82		0,10
- Österreich	298.507,42		0,13
- Portugal	38.625,65		0,02
- Schweden	1.293.958,13		0,56
- Schweiz	2.465.577,82		1,06
- Spanien	617.466,88		0,27
- Vereinigte Staaten von Amerika	18.973.479,02		8,16
2. Anleihen		167.217.992,34	71,95
- Australien	1.157.789,80		0,50
- Belgien	3.694.491,28		1,59
- Bulgarien	3.090.281,67		1,33
- Dänemark	2.358.721,03		1,01
- Deutschland	27.681.380,88		11,91
- Finnland	364.783,57		0,16
- Frankreich	15.230.924,12		6,55
- Großbritannien	12.024.079,53		5,17
- Irland	2.814.372,82		1,21
- Italien	33.112.825,36		14,25
- Japan	383.091,52		0,16
- Katar	1.357.842,99		0,58
- Lettland	1.436.145,81		0,62
- Luxemburg	3.651.433,39		1,57
- Mexiko	2.736.239,55		1,18
- Niederlande	8.838.759,04		3,80
- Norwegen	1.052.275,64		0,45
- Österreich	1.495.657,69		0,64
- Peru	1.474.610,39		0,63
- Portugal	537.584,89		0,23
- Rumänien	4.283.711,24		1,84
- Schweden	1.530.215,79		0,66
- Schweiz	1.696.237,83		0,73
- Spanien	7.392.134,59		3,18
- Ungarn	4.970.035,24		2,14
- Venezuela	2.916.924,90		1,26
- Vereinigte Staaten von Amerika	19.935.441,78		8,58
3. Investmentanteile		10.409.995,50	4,48
- Irland	6.181.192,50		2,66
- Luxemburg	4.228.803,00		1,82
4. Derivate		-652.284,38	-0,28
5. Forderungen		1.643.074,38	0,71
6. Bankguthaben		13.210.845,45	5,68
7. Sonstige Vermögensgegenstände		3.513.448,55	1,51
II. Verbindlichkeiten		-313.270,35	-0,13
III. Fondsvermögen		232.415.358,98	100,00 ¹⁾

Fußnoten:

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

US5949181045	Microsoft Corp.	STK	3.905	277	0	USD	408,590	1.472.379,41	0,63
US60855R1005	Molina Healthcare Inc.	STK	247	301	54	USD	355,200	80.961,93	0,03
US60871R2094	Molson Coors Beverage Co.	STK	871	871	0	USD	62,870	50.532,71	0,02
US6174464486	Morgan Stanley	STK	1.566	378	242	USD	87,620	126.621,07	0,05
US55354G1004	MSCI Inc.	STK	223	223	0	USD	602,240	123.932,56	0,05
ES0116870314	Naturgy Energy Group S.A.	STK	3.282	3.282	0	EUR	25,000	82.050,00	0,04
FI0009013296	Neste Oyj	STK	1.103	0	2.070	EUR	32,640	36.001,92	0,02
US65339F1012	Nextera Energy Inc.	STK	1.289	1.289	2.754	USD	59,280	70.513,47	0,03
US6541061031	NIKE Inc.	STK	2.200	1.160	0	USD	104,180	211.503,71	0,09
CH0012005267	Novartis AG	STK	6.540	2.160	0	CHF	92,590	647.219,54	0,28
DK0062498333	Novo-Nordisk AS	STK	7.898	8.600	702	DKK	748,200	792.756,15	0,34
DK0060336014	Novozymes A/S	STK	1.882	1.882	1.329	DKK	358,800	90.589,29	0,04
US6703461052	Nucor Corp.	STK	610	725	115	USD	188,900	106.334,15	0,05
US67066G1040	NVIDIA Corp.	STK	1.592	323	0	USD	627,740	922.218,50	0,40
US62944T1051	NVR Inc.	STK	17	17	0	USD	7.120,670	111.707,09	0,05
US6795801009	Old Dominion Freight Line Inc.	STK	282	108	0	USD	395,870	103.017,89	0,04
AT0000743059	OMV AG	STK	2.446	1.119	0	EUR	40,160	98.231,36	0,04
FR0000120321	Oréal S.A., L'	STK	614	0	128	EUR	446,300	274.028,20	0,12
FI0009014377	Orion Corp.	STK	2.409	2.409	0	EUR	42,950	103.466,55	0,04
DK0060252690	Pandora A/S	STK	1.134	632	137	DKK	1.018,000	154.869,40	0,07
US7043261079	Paychex Inc.	STK	831	439	158	USD	122,420	93.878,12	0,04
GB0006776081	Pearson PLC	STK	9.168	9.168	0	GBP	9,638	103.286,01	0,04
US7170811035	Pfizer Inc.	STK	9.486	5.647	0	USD	27,020	236.526,30	0,10
US7427181091	Procter & Gamble Co., The	STK	2.356	577	0	USD	157,490	342.404,32	0,15
US7433151039	Progressive Corp.	STK	884	884	824	USD	179,710	146.600,51	0,06
NL0013654783	Prosus N.V.	STK	2.099	2.099	0	EUR	27,810	58.373,19	0,03
US7443201022	Prudential Financial Inc.	STK	1.153	454	0	USD	106,630	113.453,97	0,05
US7475251036	QUALCOMM Inc.	STK	1.818	1.818	0	USD	145,980	244.905,31	0,11
US74834L1008	Quest Diagnostics Inc.	STK	329	0	64	USD	128,830	39.113,25	0,02
NL0000379121	Randstad N.V.	STK	1.455	735	313	EUR	52,600	76.533,00	0,03
GB00B24CGK77	Reckitt Benckiser Group	STK	1.740	2.644	904	GBP	56,880	115.688,14	0,05
GB00B2B0DG97	Relx PLC	STK	10.412	3.128	483	GBP	32,860	399.927,90	0,17
ES0173516115	Repsol S.A.	STK	3.597	11.166	7.569	EUR	13,665	49.153,01	0,02
US7611521078	ResMed Inc.	STK	673	673	0	USD	191,380	118.856,40	0,05
US78409V1044	S&P Global Inc.	STK	592	194	46	USD	454,560	248.326,97	0,11
GB00B8C3BL03	Sage Group PLC, The	STK	8.567	1.940	3.091	GBP	11,930	119.467,34	0,05
GB00B019KW72	Sainsbury PLC, J.	STK	28.875	12.574	0	GBP	2,733	92.244,75	0,04
FR0000120578	Sanofi S.A.	STK	945	1.148	203	EUR	92,450	87.365,25	0,04
FR0000121972	Schneider Electric SE	STK	1.099	830	1.506	EUR	184,500	202.765,50	0,09
US81762P1021	ServiceNow Inc.	STK	362	133	0	USD	785,730	262.477,98	0,11
GB00BP6MXD84	Shell PLC	STK	12.500	1.248	5.960	GBP	24,740	361.484,51	0,16
SE0000148884	Skandinaviska Enskilda Banken	STK	11.495	11.495	0	SEK	149,600	151.949,63	0,07
SE0000108227	SKF AB	STK	4.927	4.927	0	SEK	197,300	85.895,17	0,04
FR0000130809	Société Générale S.A.	STK	2.104	2.104	4.881	EUR	23,795	50.064,68	0,02
CH0012549785	Sonova Holding AG	STK	139	139	0	CHF	279,200	41.480,12	0,02
GB0007908733	SSE PLC	STK	1.766	1.766	4.885	GBP	16,780	34.638,78	0,01
US8552441094	Starbucks Corp.	STK	1.234	1.234	0	USD	94,080	107.133,04	0,05
NL0000226223	STMicroelectronics N.V.	STK	4.020	471	392	EUR	41,090	165.181,80	0,07
SE0000112724	Svenska Cellulosa AB	STK	7.260	7.260	4.523	SEK	140,850	90.355,08	0,04
CH0126881561	Swiss Re AG	STK	717	0	1.200	CHF	99,100	75.945,60	0,03
CH0008742519	Swisscom AG	STK	175	175	195	CHF	515,600	96.440,79	0,04
US87165B1035	Synchrony Financial	STK	1.155	156	578	USD	39,700	42.313,94	0,02
US8716071076	Synopsys Inc.	STK	252	252	264	USD	543,180	126.315,10	0,05
US87612E1064	Target Corp.	STK	948	400	400	USD	140,520	122.929,88	0,05
GB0008782301	Taylor Wimpey PLC	STK	62.607	35.022	13.611	GBP	1,475	107.943,11	0,05
SE0005190238	Tele2 AB	STK	5.900	5.900	0	SEK	84,640	44.125,21	0,02
US8825081040	Texas Instruments Inc.	STK	1.661	430	0	USD	162,050	248.387,44	0,11
US8725401090	TJX Companies Inc.	STK	1.562	1.562	0	USD	96,820	139.558,75	0,06
FR0000120271	TotalEnergies SE	STK	8.328	8.328	0	EUR	60,430	503.261,04	0,22
IE00BK9ZQ967	Trane Technologies PLC	STK	532	0	65	USD	257,750	126.538,09	0,05
US89417E1091	Travelers Companies Inc.,The	STK	551	658	107	USD	213,540	108.577,99	0,05
US89832Q1094	Truist Financial Corp.	STK	3.581	3.581	0	USD	38,170	126.135,53	0,05
US90384S3031	Ulta Beauty Inc.	STK	231	106	0	USD	508,740	108.447,32	0,05
IT0005239360	UniCredit S.p.A.	STK	9.150	9.150	0	EUR	27,035	247.370,25	0,11
FI0009005987	UPM Kymmene Corp.	STK	1.507	3.533	3.201	EUR	33,440	50.394,08	0,02
US91913Y1001	Valero Energy Corp.	STK	902	25	0	USD	141,890	118.105,27	0,05
US9224751084	Veeva System Inc.	STK	620	620	0	USD	210,910	120.670,14	0,05
AT0000746409	Verbund AG	STK	1.084	1.084	0	EUR	75,300	81.625,20	0,04
US92532F1003	Vertex Pharmaceuticals Inc.	STK	368	68	0	USD	446,080	151.485,66	0,07
US92826C8394	VISA Inc.	STK	1.531	329	0	USD	277,150	391.562,45	0,17
SE0000115446	Volvo (publ), AB	STK	8.267	9.059	792	SEK	249,050	181.925,50	0,08
US9314271084	Walgreens Boots Alliance Inc.	STK	2.705	2.705	0	USD	22,760	56.813,36	0,02
US2546871060	Walt Disney Co., The	STK	2.994	1.686	870	USD	96,940	267.834,04	0,12
US9553061055	West Pharmaceutic.Services Inc	STK	311	311	0	USD	376,090	107.935,21	0,05
NL0000395903	Wolters Kluwer N.V.	STK	590	590	1.594	EUR	138,900	81.951,00	0,04
US98978V1035	Zoetis Inc.	STK	680	15	109	USD	191,430	120.124,03	0,05
CH0011075394	Zurich Insurance Group AG	STK	304	304	575	CHF	438,400	142.447,20	0,06
						EUR		35.002.025,38	15,06
Verzinsliche Wertpapiere									
Inland									
DE000A254TM8	2,1210 % Allianz SE - Sub. Floating Rate Notes 2020/2050	EUR	1.200	0	0	%	88,017	1.056.204,86	0,45
DE000A3E5TR0	2,6000 % Allianz SE - Sub. Floating Rate Notes 2021/1900	EUR	1.000	1.000	0	%	76,406	764.064,31	0,33

DE000BU0E063	0,0000 % Bundesrep.Deutschland - Unverzinsliche Schatzanweisungen 2023/2024	EUR	10.000	0	0	%	98,594	9.859.369,80	4,24
DE000BU0E097	0,0000 % Bundesrep.Deutschland - Unverzinsliche Schatzanweisungen 2023/2024	EUR	10.000	10.000	0	%	97,813	9.781.297,00	4,21
DE000CB0HRQ9	0,7500 % Commerzbank AG - Floating Rate Medium Term 2020/2026	EUR	1.000	0	0	%	96,402	964.024,00	0,41
DE000CZ45W57	3,0000 % Commerzbank AG - Floating Rate Medium Term 2022/2027	EUR	800	0	0	%	97,786	782.290,38	0,34
DE000CZ439T8	4,6250 % Commerzbank AG - Floating Rate Medium Term 2024/2031	EUR	400	400	0	%	101,758	407.032,90	0,18
XS2198879145	2,1250 % Fraport AG Ffm.Airport.Ser.AG - Anleihe 2020/2027	EUR	900	0	0	%	96,624	869.613,36	0,37
DE000A289QR9	0,7500 % Mercedes-Benz Group AG - Anleihe 2020/2030	EUR	875	0	0	%	86,720	758.803,45	0,33
XS2011260531	1,6250 % Merck KGaA - Sub. Floating Rate Notes 2019/2079	EUR	300	0	0	%	97,768	293.304,53	0,13
XS2221845683	1,2500 % Münchener Rückvers.-Ges. AG - FRN 2020/2041	EUR	600	0	0	%	82,513	495.076,53	0,21
DE000A3E5FR9	0,6250 % Vonovia SE - Medium Term Notes 2021/2031	EUR	2.100	0	0	%	78,586	1.650.299,76	0,71
						EUR		27.681.380,88	11,91
Ausland									
XS2055651918	1,1250 % Abertis Infraestructuras S.A. - Medium-Term Notes 2019/2028	EUR	1.100	0	0	%	91,259	1.003.845,57	0,43
BE6325355822	1,8750 % AGEAS SA/NV - Sub. Floating Rate Notes 2020/2051	EUR	1.000	0	0	%	80,375	803.750,67	0,35
BE6317598850	3,8750 % AGEAS SA/NV - Sub. Floating Rate Notes 2019/Undated	EUR	200	0	0	%	81,262	162.524,51	0,07
XS2464405229	2,2500 % AIB Group PLC - Floating Rate Medium Term 2022/2028	EUR	750	0	0	%	95,811	718.583,44	0,31
XS2555925218	5,7500 % AIB Group PLC - Floating Rate Medium Term 2022/2029	EUR	500	0	0	%	107,045	535.226,25	0,23
BE6324664703	1,0000 % Argenta Spaarbank N.V. - Anleihe 2020/2026	EUR	800	0	0	%	94,313	754.504,82	0,32
XS2314312179	1,3750 % AXA S.A. - Floating Rate Medium Term 2021/2041	EUR	1.600	0	0	%	82,082	1.313.304,45	0,57
XS2455392584	2,6250 % Banco de Sabadell S.A. - Floating Rate Medium Term 2022/2026	EUR	600	600	0	%	98,356	590.137,06	0,25
XS2553801502	5,1250 % Banco de Sabadell S.A. - Floating Rate Medium Term 2022/2028	EUR	1.000	0	0	%	105,260	1.052.600,39	0,45
XS2751667150	5,0000 % Banco Santander S.A. - Sub. Floating Rate Notes 2024/2034	EUR	500	500	0	%	100,608	503.041,52	0,22
XS2321427408	0,6940 % Bank of America Corp. - Floating Rate Medium Term 2021/2031	EUR	1.667	0	0	%	83,625	1.394.024,80	0,60
XS1602547264	1,7760 % Bank of America Corp. - Floating Rate Medium Term 2017/2027	EUR	1.000	0	0	%	96,137	961.369,70	0,41
XS2148370211	3,6480 % Bank of America Corp. - Floating Rate Medium Term 2020/2029	EUR	500	0	0	%	100,323	501.613,50	0,22
XS2576362839	4,8750 % Bank of Ireland Group PLC - Floating Rate Medium Term 2023/2028	EUR	1.500	0	0	%	104,038	1.560.563,13	0,67
ES0213679JR9	0,6250 % Bankinter S.A. - Medium-Term Notes 2020/2027	EUR	700	0	0	%	90,482	633.370,68	0,27
ES0213679OF4	1,2500 % Bankinter S.A. - FRN 2021/2032	EUR	1.500	0	0	%	89,222	1.338.325,49	0,58
XS2430951660	0,8770 % Barclays PLC - Floating Rate Medium Term 2022/2028	EUR	1.000	0	0	%	91,974	919.740,85	0,40
XS1757394322	1,3750 % Barclays PLC - Floating Rate Medium Term 2013/2048	EUR	1.000	0	0	%	97,438	974.384,74	0,42
XS2707629056	6,7500 % BAWAG Group AG - Sub. Floating Rate Notes 2023/2034	EUR	800	800	0	%	105,128	841.024,88	0,36
FR0013532280	0,5000 % BNP Paribas S.A. - Floating Rate Medium Term 2020/2028	EUR	1.000	0	0	%	89,457	894.566,98	0,38
FR0013476611	1,1250 % BNP Paribas S.A. - Sub. Floating Rate Notes 2020/2032	EUR	500	0	0	%	90,941	454.707,29	0,20
XS2193661324	3,2500 % BP Capital Markets PLC - Sub. Floating Rate Notes 2020/Undated	EUR	1.000	0	0	%	97,005	970.049,26	0,42
FR0014003SA0	0,6250 % Bque Fédérative du Cr. Mutuel - Medium Term Notes 2021/2028	EUR	2.100	0	0	%	87,104	1.829.186,73	0,79
XS2536817211	4,1250 % Bulgarien - Medium Term Notes 2022/2029	EUR	3.000	0	0	%	103,009	3.090.281,67	1,33
PTCGDDOM0036	5,7500 % Caixa Geral de Depósitos S.A. - Floating Rate Medium Term 2022/2028	EUR	500	0	0	%	107,517	537.584,89	0,23
XS2346253730	0,7500 % Caixabank S.A. - Medium Term Notes 2021/2028	EUR	1.000	0	0	%	91,120	911.200,90	0,39
FR0013142536	2,3750 % Carmila S.A.S. - Senior Notes 2016/2024	EUR	500	0	0	%	98,796	493.981,19	0,21
XS2182121827	1,6250 % Corporación Andina de Fomento - Medium Term Notes 2020/2025	EUR	3.000	0	0	%	97,231	2.916.924,90	1,26
XS2637421848	4,7500 % Danske Bank AS - Floating Rate Medium Term 2023/2030	EUR	1.000	1.000	0	%	104,613	1.046.131,83	0,45
XS2202902636	1,7500 % De Volksbank N.V. - Floating Rate Medium Term 2020/2030	EUR	600	0	0	%	95,063	570.376,85	0,25
XS2233217558	0,0000 % EDP Finance B.V. - Registered Notes 2020/2028	USD	1.200	0	0	%	88,663	981.824,28	0,42

XS0452188054	5,6250 % ENEL Finance Intl N.V. - Medium-Term Notes 2009/2024	GBP	1.200	0	0	%	99,889	1.401.130,67	0,60
XS2576550086	6,3750 % ENEL S.p.A. - FRN 2023/Undated	EUR	400	0	0	%	106,313	425.252,90	0,18
XS2334857138	0,0000 % ENI S.p.A. - Subordinated Undated Floating 2021/1900	EUR	1.600	1.600	0	%	87,629	1.402.071,36	0,60
XS2178833690	1,3750 % Equinor ASA - Anleihe 2020/2032	EUR	596	0	0	%	87,140	519.356,06	0,22
AT0000A2J645	1,6250 % Erste Group Bank AG - Sub. Floating Rate Notes 2020/2031	EUR	700	0	0	%	93,519	654.632,81	0,28
XS2249882064	4,7500 % European Investment Bank (EIB) - Medium Term Notes 2020/2025	BRL	14.000	0	0	%	94,260	2.450.463,01	1,05
XS2607183980	5,1250 % Harley Davidson Finl Serv.Inc. - Guaranteed Registered Notes 2023/2026	EUR	1.500	0	0	%	102,623	1.539.337,88	0,66
XS2486589596	3,0190 % HSBC Holdings PLC - Anleihe 2022/2027	EUR	1.300	0	0	%	98,683	1.282.880,40	0,55
FR0014001IM0	0,6250 % Icade S.A. - Anleihe 2021/2031	EUR	1.000	0	0	%	78,381	783.811,09	0,34
XS2554746185	4,8750 % ING Groep N.V. - Floating Rate Medium Term 2022/2027	EUR	1.300	0	0	%	103,282	1.342.667,01	0,58
US45950VEM46	6,3000 % International Finance Corp. - Medium-Term Notes 2014/2024	INR	500.000	0	0	%	99,509	5.524.052,07	2,38
XS2317069685	0,7500 % Intesa Sanpaolo S.p.A. - Medium Term Notes 2021/2028	EUR	921	0	0	%	90,123	830.034,48	0,36
XS2081018629	1,0000 % Intesa Sanpaolo S.p.A. - Medium-Term Notes 2019/2026	EUR	1.404	0	0	%	93,709	1.315.671,47	0,57
XS2559133363	8,2480 % Intesa Sanpaolo S.p.A. - Floating Rate Medium Term 2022/2033	USD	3.000	3.000	0	%	109,427	3.029.396,07	1,30
XS2065601937	0,8750 % Iren S.p.A. - Medium-Term Notes 2019/2029	EUR	681	0	0	%	86,717	590.542,18	0,25
IT0005474330	0,0000 % Italien, Republik - Buoni del Tes.Polien. 2021/2024	EUR	8.000	0	0	%	97,189	7.775.124,40	3,35
IT0005549388	0,0000 % Italien, Republik - Buoni Ordin. d. Tesoro 2023/2024	EUR	2.500	2.500	0	%	98,665	2.466.634,63	1,06
IT0005466013	0,9500 % Italien, Republik - Buoni del Tes.Polien. 2021/2032	EUR	3.000	0	0	%	81,493	2.444.782,17	1,05
IT0005327306	1,4500 % Italien, Republik - Buoni del Tes.Polien. 2018/2025	EUR	8.000	0	0	%	97,906	7.832.457,60	3,37
US465410BG26	5,3750 % Italien, Republik - Registered Notes 2002/2032	USD	2.381	0	0	%	99,455	2.185.238,12	0,94
XS2155352151	3,4000 % Katar, Staat - Anleihe 2020/2025	USD	1.500	0	0	%	98,095	1.357.842,99	0,58
BE0002839208	0,7500 % KBC Groep N.V. - Floating Rate Medium Term 2022/2028	EUR	1.000	0	0	%	92,135	921.352,04	0,40
USB5341FAB79	5,7960 % KBC Groep N.V. - Floating Rate Term 2023/2029	USD	1.300	0	0	%	101,270	1.214.883,75	0,52
FR00140087C4	1,0000 % La Banque Postale - Floating Rate Medium Term 2022/2028	EUR	1.500	0	0	%	92,033	1.380.489,06	0,59
FR0013519261	2,1250 % La Mondiale - Anleihe 2020/2031	EUR	2.800	0	0	%	86,342	2.417.586,50	1,04
FR0013455854	4,3750 % La Mondiale - Sub. Floating Rate Notes 2019/Undated	EUR	100	0	0	%	91,982	91.981,89	0,04
XS2576364371	3,5000 % Lettland, Republik - Medium Term Notes 2023/2028	EUR	1.412	0	0	%	101,710	1.436.145,81	0,62
XS1699636574	2,2500 % Lloyds Banking Group PLC - Anleihe 2017/2024	GBP	1.500	0	0	%	97,665	1.712.411,67	0,74
XS2521027446	3,1250 % Lloyds Banking Group PLC - Floating Rate Medium Term 2022/2030	EUR	1.300	1.300	0	%	96,953	1.260.385,23	0,54
XS2753547673	4,6250 % Logicor Financing S.à.r.l. - Medium Term Notes 2024/2028	EUR	320	320	0	%	100,583	321.866,71	0,14
ES0224244105	2,8750 % Mapfre S.A. - Medium Term Notes 2022/2030	EUR	700	0	0	%	91,773	642.412,08	0,28
XS2444273168	2,3750 % Mexiko - Registered Notes 2022/2030	EUR	3.000	3.000	0	%	91,208	2.736.239,55	1,18
XS2307853098	0,7800 % NatWest Group PLC - Floating Rate Medium Term 2021/2030	EUR	750	0	0	%	85,875	644.061,38	0,28
XS2623518821	4,7710 % NatWest Group PLC - Floating Rate Medium Term 2018/2048	EUR	1.000	0	0	%	103,386	1.033.858,28	0,44
XS2384734542	0,2500 % NIBC Bank N.V. - Medium Term Notes 2021/2026	EUR	1.000	0	0	%	91,534	915.337,96	0,39
XS2630448434	6,3750 % NIBC Bank N.V. - Medium Term Notes 2023/2025	EUR	1.500	1.500	0	%	103,887	1.558.309,22	0,67
DK0009526998	0,7500 % Nykredit Realkredit A/S - Medium-Term Notes 2020/2027	EUR	1.429	0	0	%	91,854	1.312.589,20	0,56
XS1315181708	2,7500 % Peru - Registered Bonds 2015/2026	EUR	1.500	0	0	%	98,307	1.474.610,39	0,63
FR001400H2O3	4,5000 % RCI Banque S.A. - Medium Term Notes 2023/2027	EUR	1.000	0	0	%	102,063	1.020.632,98	0,44
FR001400F0U6	4,6250 % RCI Banque S.A. - Medium Term Notes 2023/2026	EUR	1.000	0	0	%	101,643	1.016.430,23	0,44
XS2552369469	4,6250 % Red Electrica Corporacion S.A. - FRN 2023/Undated	EUR	700	0	0	%	102,457	717.200,90	0,31
XS2538441598	6,6250 % Rumänien - Medium Term Notes 2022/2029	EUR	4.000	0	0	%	107,093	4.283.711,24	1,84
XS2226645278	2,5000 % Sampo OYJ - FRN 2020/2052	EUR	435	0	0	%	83,858	364.783,57	0,16
XS2525226622	3,5300 % Santander UK Group Hldgs PLC - Floating Rate Medium Term 2022/2028	EUR	1.071	0	0	%	99,012	1.060.416,26	0,46

XS1345415472	3,6250 % Santander UK Group Holdings PLC - Medium Term Notes 2016/2026	GBP	1.500	0	0	%	96,536	1.692.617,87	0,73
XS2489775580	3,5000 % SES S.A. - Medium Term Notes 2022/2029	EUR	900	0	0	%	97,678	879.103,67	0,38
FR0014006XA3	0,6250 % Société Générale S.A. - Floating Rate Medium Term 2021/2027	EUR	1.000	0	0	%	91,689	916.892,31	0,39
FR0014002QE8	1,1250 % Société Générale S.A. - Sub. Floating Rate Notes 2021/2031	EUR	500	0	0	%	92,348	461.740,99	0,20
US83368TBR86	6,4460 % Société Générale S.A. - Floating Rate Medium Term 2023/2029	USD	1.000	0	0	%	103,052	950.973,77	0,41
XS1693281617	1,6250 % Standard Chartered PLC - Floating Rate Medium Term 2017/2027	EUR	500	0	0	%	94,655	473.273,59	0,20
XS2464732770	2,7500 % Stellantis N.V. - Medium Term Notes 2022/2032	EUR	607	0	0	%	93,582	568.043,09	0,24
XS2325328313	1,8750 % Storebrand Livsforsikring AS - Sub. Floating Rate Notes 2021/2051	EUR	667	0	0	%	79,898	532.919,58	0,23
XS1426022536	1,5460 % Sumitomo Mitsui Financ. Group - Registered Notes 2016/2026	EUR	400	0	900	%	95,773	383.091,52	0,16
XS2572496623	4,2500 % Swedbank AB - Medium-Term Notes 2023/2028	EUR	1.500	0	0	%	102,014	1.530.215,79	0,66
XS1057783174	2,7500 % Sydney Airport Fin.Co.Pty Ltd. - Medium Term Notes 2014/2024	EUR	900	0	0	%	99,698	897.280,49	0,39
XS2290960520	1,6250 % TotalEnergies SE - Sub. Floating Rate Notes 2021/1900	EUR	400	0	0	%	90,399	361.595,38	0,16
XS2432131188	3,2500 % TotalEnergies SE - Sub. Floating Rate Notes 1900/1900	EUR	1.000	1.000	0	%	84,304	843.043,28	0,36
XS2156236452	2,2800 % Toyota Finance Australia Ltd. - Medium Term Notes 2020/2027	EUR	269	0	0	%	96,844	260.509,31	0,11
CH0520042489	0,2500 % UBS Group AG - Anleihe 2020/2026	EUR	1.000	0	0	%	96,225	962.251,51	0,41
CH1194000340	2,7500 % UBS Group AG - Floating Rate Medium Term 2022/2027	EUR	750	0	0	%	97,865	733.986,32	0,32
XS2753429047	4,0000 % Ungarn - Bonds 2024/2029	EUR	3.000	3.000	0	%	99,315	2.979.458,88	1,28
XS2010026214	4,2500 % Ungarn, Republik - Medium Term Notes 2022/2031	EUR	2.000	0	0	%	99,529	1.990.576,36	0,86
XS2207976783	2,2000 % UniCredit S.p.A. - Floating Rate Medium Term 2020/2027	EUR	1.000	0	0	%	96,514	965.136,66	0,42
IT0005580656	4,3000 % UniCredit S.p.A. - Floating Rate Medium Term 2024/2031	EUR	1.338	1.338	0	%	100,178	1.340.377,16	0,58
XS2588885025	4,4500 % UniCredit S.p.A. - Floating Rate Medium Term 2023/2029	EUR	500	0	0	%	102,021	510.106,16	0,22
US9128284V99	2,8750 % United States of America - Treasury Bonds 2018/2028	USD	11.000	11.000	0	%	95,270	9.670.694,79	4,16
XS2123970167	0,2500 % V.F. Corp. - Registered Notes 2020/2028	EUR	403	0	0	%	85,446	344.349,04	0,15
DE000A2R8ND3	0,6250 % Vonovia Finance B.V. - Medium-Term Notes 2019/2027	EUR	1.500	0	0	%	89,236	1.338.545,45	0,58
							EUR	139.536.611,46	60,04
Sonstige Beteiligungswertpapiere									
Ausland									
CH0012032048	Roche Holding AG - Genussscheine	STK	990	990	0	CHF	246,700	261.044,25	0,11
						EUR		261.044,25	0,11
Investmentanteile									
Gruppenfremde Investmentanteile									
Ausland									
IE00B3F81R35	iShsIII-Core EO Corp.Bd U.ETF	ANT	13.500	0	0	EUR	117,795	1.590.232,50	0,68
LU1861138961	AIS-Amundi MSCI EM SRI PABFonds	ANT	93.000	93.000	0	EUR	45,471	4.228.803,00	1,82
IE00BHZPJ346	iShsIV-MSCI JPN ESG.Enh.U.ETFShares	ANT	814.000	0	0	EUR	5,640	4.590.960,00	1,98
						EUR		10.409.995,50	4,48
Summe Wertpapiervermögen							EUR	215.013.545,33	92,51
Derivate								-652.284,38	-0,28
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen)									
Aktienindex-Derivate									
Forderungen/Verbindlichkeiten									
Aktienindex-Terminkontrakte									
S&P 500 E-MINI Future 15/03/2024		CME	USD	Anzahl -16				-201.135,05	-0,09
STOXX 600(SXXP) 15/03/2024		EUREX	EUR	Anzahl -140				-66.500,00	-0,03
Zins-Derivate									
Forderungen/Verbindlichkeiten									
Optionsrechte									
Optionsrechte auf Aktienindices									
PUT S&P 500 INDEX - SPX 21/06/2024		EUREX	USD	-90				-67.687,91	-0,03
CALL S&P 500 INDEX - SPX 21/06/2024		EUREX	USD	-90				-2.292.668,30	-0,99
CALL S&P 500 INDEX - SPX 21/06/2024		EUREX	USD	90				1.205.509,16	0,52
PUT S&P 500 INDEX - SPX 21/06/2024		EUREX	USD	90				201.817,93	0,09

Terminkontrakte									
Zinsterminkontrakte									
EURO-BTP FUTURE 07/03/2024	CME	EUR	Anzahl 180				671.400,00	0,29	
EURO-BOBL FUTURE 07/03/2024	CME	EUR	Anzahl -119				-90.440,00	-0,04	
EURO-BOBL FUTURE 07/03/2024	CME	EUR	Anzahl -81				-62.370,00	-0,03	
Devisen-Derivate									
Forderungen/Verbindlichkeiten									
Terminkontrakte auf Devisen									
EURO FX Currency Future (CME) 18/03/2024	CME	USD	Anzahl 417				117.367,23	0,05	
EURO / GBP Future 18/03/2024	CME	GBP	Anzahl 74				-67.577,44	-0,03	
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds									
EUR-Guthaben bei:							EUR	13.210.845,45	5,68
Morgan Stanley		EUR	46.774,09		%	100,000	46.774,09	0,02	
Verwahrstelle		EUR	11.725.900,16		%	100,000	11.725.900,16	5,05	
Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen									
Verwahrstelle		DKK	21.241,24		%	100,000	2.849,60	0,00	
Verwahrstelle		NOK	100.713,62		%	100,000	8.873,06	0,00	
Verwahrstelle		SEK	74.591,80		%	100,000	6.590,98	0,00	
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen									
Morgan Stanley		GBP	76.443,26		%	100,000	89.355,07	0,04	
Morgan Stanley		JPY	1.724.125,00		%	100,000	10.761,51	0,00	
Morgan Stanley		USD	319.496,00		%	100,000	294.833,20	0,13	
Verwahrstelle		CHF	72.238,26		%	100,000	77.210,62	0,03	
Verwahrstelle		GBP	124.444,51		%	100,000	145.464,07	0,06	
Verwahrstelle		JPY	24.963.602,00		%	100,000	155.815,81	0,07	
Verwahrstelle		USD	700.490,09		%	100,000	646.417,28	0,28	
Sonstige Vermögensgegenstände							EUR	5.156.522,93	2,22
Dividendenforderungen Aktien		GBP	12.906,44				15.086,43	0,01	
Dividendenforderungen Aktien		USD	12.521,81				11.555,22	0,00	
Initial Margin		EUR	600.566,30				600.566,30	0,26	
Initial Margin		GBP	146.520,00				171.268,26	0,07	
Initial Margin		USD	2.970.950,00				2.741.613,99	1,18	
Quellensteuererstattungsansprüche		CHF	223,66				239,06	0,00	
Quellensteuererstattungsansprüche		DKK	2.816,64				377,86	0,00	
Quellensteuererstattungsansprüche		EUR	26.529,79				26.529,79	0,01	
Quellensteuererstattungsansprüche		NOK	11.679,82				1.029,01	0,00	
Quellensteuererstattungsansprüche		EUR	4.445,51				4.445,51	0,00	
Zinsansprüche		EUR	1.583.811,50				1.583.811,50	0,68	
Sonstige Verbindlichkeiten							EUR	-313.270,35	-0,13
Verbindlichkeiten aus Anteilrückkäufen		EUR	-523,60				-523,60	0,00	
Verbindlichkeiten Prüfungskosten		EUR	-16.521,87				-16.521,87	-0,01	
Verbindlichkeiten Verwahrstelle		EUR	-7.671,14				-7.671,14	0,00	
Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung		EUR	-288.553,74				-288.553,74	-0,12	
Fondsvermögen							EUR	232.415.358,98	100,00 ¹⁾
Anteilwert							EUR	104,64	
Umlaufende Anteile							STK	2.221.183	

Fußnoten:

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

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

Die Vermögensgegenstände des Sondervermögens sind auf der Grundlage nachstehender Kurse/Marktsätze bewertet:

Alle Vermögenswerte: Kurse per 30.01.2024

Devisenkurse (in Mengennotiz)	30.01.2024
Brasilianischer Real (BRL)	5,38525 = 1 EUR
Britische Pfund (GBP)	0,8555 = 1 EUR
Dänische Krone (DKK)	7,4541 = 1 EUR
Indische Rupie (INR)	90,06895 = 1 EUR
Japanische Yen (JPY)	160,21225 = 1 EUR
Norwegische Krone (NOK)	11,3505 = 1 EUR
Schwedische Krone (SEK)	11,31725 = 1 EUR
Schweizer Franken (CHF)	0,9356 = 1 EUR
US-Dollar (USD)	1,08365 = 1 EUR

Marktschlüssel**Terminbörsen**

CME	Chicago Mercantile Exchange
EUREX	EUREX Frankfurt

Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen:

Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schuldscheindarlehen (Marktzuordnung zum Berichtsstichtag):

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Volumen in 1.000
Börsengehandelte Wertpapiere					
Aktien					
Inland					
DE0005200000	Beiersdorf AG	STK	0	910	
DE000A1DAHH0	Brenntag SE	STK	0	867	
DE000CBK1001	Commerzbank AG	STK	3.144	3.144	
DE0005810055	Deutsche Börse AG	STK	0	1.122	
DE0006231004	Infineon Technologies AG	STK	3.150	3.150	
DE0007100000	Mercedes-Benz Group AG	STK	1.430	1.430	
DE0007010803	RATIONAL AG	STK	0	75	
DE000A1J5RX9	Telefónica Deutschland Hldg AG	STK	0	18.717	
Ausland					
DK0010244508	A.P.Møller-Mærsk A/S	STK	0	32	
DK0010244425	A.P.Møller-Mærsk A/S	STK	0	29	
US0028241000	Abbott Laboratories	STK	0	1.588	
US00287Y1091	AbbVie Inc.	STK	0	735	
US00751Y1064	Advance Auto Parts Inc.	STK	0	704	
US02209S1033	Altria Group Inc.	STK	3.119	3.119	
GB00B1XZS820	Anglo American PLC	STK	1.277	1.277	
US0394831020	Archer Daniels Midland Co.	STK	0	1.286	
SE0017486897	Atlas Copco AB	STK	6.269	6.269	
US0527691069	Autodesk Inc.	STK	6	554	
US05722G1004	Baker Hughes Co.	STK	0	1.877	
US0865161014	Best Buy Co. Inc.	STK	88	779	
FR0013280286	bioMerieux	STK	0	528	
US09247X1019	Blackrock Inc.	STK	0	210	
SE0020050417	Boliden AB	STK	669	2.629	
FR0000120503	Bouygues S.A.	STK	0	1.769	
GB0007980591	BP PLC	STK	0	56.211	
US11135F1012	Broadcom Inc.	STK	0	184	
US11133T1034	Broadridge Financial Solutions	STK	577	577	
US1491231015	Caterpillar Inc.	STK	0	395	
US12504L1098	CBRE Group Inc.	STK	0	699	
US1729081059	Cintas Corp.	STK	0	237	
US17275R1023	Cisco Systems Inc.	STK	0	4.702	
US1746101054	Citizens Financial Group Inc.	STK	1.991	1.991	
CH0198251305	Coca-Cola HBC AG	STK	0	1.352	
FR0000045072	Crédit Agricole S.A.	STK	0	8.887	
IE0001827041	CRH PLC	STK	1.783	5.629	
US22822V1017	Crown Castle Internatl Corp.	STK	0	1.023	
US2473617023	Delta Air Lines Inc.	STK	0	1.105	
US2521311074	DexCom Inc.	STK	1.131	1.131	
BE0974259880	D'leteren Group S.A.	STK	587	587	
US2605571031	Dow Inc.	STK	0	1.237	
FR0010208488	Engie S.A.	STK	0	7.806	
US29364G1031	Entergy Corp.	STK	433	433	
SE0015658109	Epiroc AB	STK	0	6.060	
US29444U7000	Equinix Inc.	STK	0	154	
US5184391044	Estée Lauder Compan. Inc., The	STK	759	759	
US30161N1019	Exelon Corp.	STK	0	2.745	
US31620M1062	Fidelity Natl Inform.Svcs Inc.	STK	0	1.086	

US3377381088	Fiserv Inc.	STK	0	911
PTGALOAM0009	Galp Energia SGPS S.A.	STK	0	4.862
CH0030170408	Geberit AG	STK	0	236
US3696043013	General Electric Co.	STK	0	879
NO0010582521	Gjensidige Forsikring ASA	STK	0	3.568
FR0000052292	Hermes International S.C.A.	STK	0	122
US42824C1099	Hewlett Packard Enterprise Co.	STK	0	3.456
US4432011082	Howmet Aerospace Inc.	STK	0	1.157
US4456581077	Hunt (J.B.) Transport Svcs Inc	STK	0	300
ES0144580Y14	Iberdrola S.A.	STK	0	22.174
US45167R1041	IDEX Corp.	STK	272	272
GB0004544929	Imperial Brands PLC	STK	1.564	1.564
GB0031638363	Intertek Group PLC	STK	2.112	2.112
US4595061015	Intl Flavors & Fragrances Inc.	STK	0	717
GB00BM8Q5M07	JD Sports Fashion PLC	STK	36.123	36.123
GB00BZ4BQC70	Johnson, Matthey PLC	STK	2.423	4.834
US46625H1005	JPMorgan Chase & Co.	STK	0	1.662
FR0000121485	Kering S.A.	STK	0	391
FI0009000202	Kesko Oyj	STK	0	2.923
FR0000121964	Klépierre S.A.	STK	0	2.167
FI0009013403	KONE Oyj	STK	0	2.067
US5007541064	Kraft Heinz Co., The	STK	3.180	3.180
IE000S9YS762	Linde plc	STK	0	362
GB00B0SWJX34	London Stock Exchange Group PLC	STK	0	1.444
US5486611073	Lowe's Companies Inc.	STK	247	753
US5500211090	Lululemon Athletica Inc.	STK	0	244
US58933Y1055	Merck & Co. Inc.	STK	1.363	2.997
FI0009014575	Metso Outotec Oyj	STK	5.652	10.609
IT0004965148	Moncler S.p.A.	STK	0	666
GB00B1CRLC47	Mondi PLC	STK	0	3.704
GB00BDR05C01	National Grid PLC	STK	0	2.853
GB00BM8PJY71	NatWest Group PLC	STK	0	40.436
CH0038863350	Nestlé S.A.	STK	0	3.417
US6516391066	Newmont Corp.	STK	0	1.438
NL0010773842	NN Group N.V.	STK	1.838	3.056
NL0015001LR8	NN Group N.V. - Anrechte	STK	1.218	1.218
FI0009000681	Nokia Oyj	STK	0	45.767
NO0005052605	Norsk Hydro ASA	STK	0	9.721
DK0060534915	Novo-Nordisk AS	STK	3.912	7.824
NL0009538784	NXP Semiconductors NV	STK	632	632
US6821891057	ON Semiconductor Corp.	STK	1.556	1.556
US6826801036	Oneok Inc. (New)	STK	0	962
NO0003733800	Orkla ASA	STK	0	7.295
DK0060094928	Orsted A/S	STK	854	854
US6907421019	Owens Corning (New)	STK	419	419
US70450Y1038	PayPal Holdings Inc.	STK	0	1.184
IE00BLS09M33	Pentair PLC	STK	22	826
US7134481081	PepsiCo Inc.	STK	0	1.359
US7185461040	Phillips 66	STK	0	1.168
US6934751057	PNC Financial Services Group	STK	0	952
US74340W1036	ProLogis Inc.	STK	0	1.436
US7445731067	Public Service Ent. Group Inc.	STK	0	983
ES0173093024	Red Electrica Corporacion S.A.	STK	0	3.562
US75886F1075	Regeneron Pharmaceuticals Inc.	STK	51	164
US7591EP1005	Regions Financial Corp.	STK	3.375	3.375
US7703231032	Robert Half International Inc.	STK	25	655
US79466L3024	salesforce.com Inc.	STK	0	813
CH1243598427	Sandoz Group AG	STK	876	876
GB00BP9LHF23	Schroders PLC	STK	0	9.754
GB00B1WY2338	Smiths Group PLC	STK	0	2.898
GB0007669376	St. James's Place PLC	STK	0	4.314
US8574771031	State Street Corp.	STK	1.519	1.519
US8581191009	Steel Dynamics Inc.	STK	489	489
US74144T1088	T. Rowe Price Group Inc.	STK	0	518
US8740541094	Take-Two Interactive Softw.Inc	STK	744	744
CH0102993182	TE Connectivity Ltd.	STK	0	829
NO0010063308	Telenor ASA	STK	7.965	7.965
GB00BLGZ9862	Tesco PLC	STK	51.339	51.339
US88160R1014	Tesla Inc.	STK	0	1.540
US8923561067	Tractor Supply Co.	STK	241	515
US90353T1007	Uber Technologies Inc.	STK	0	1.251
BE0974320526	Umicore S.A.	STK	0	1.965
GB00B10RZP78	Unilever PLC	STK	0	7.344
US91879Q1094	Vail Resorts Inc.	STK	0	214
FR0013176526	Valéo S.E.	STK	0	2.406
CH0311864901	VAT Group AG	STK	0	267
US92338C1036	Veralto Corp.	STK	294	294
US92343V1044	Verizon Communications Inc.	STK	0	3.662
FR0000127771	Vivendi S.A.	STK	0	5.812
GB00BH4HKS39	Vodafone Group PLC	STK	0	193.185
FI0009003727	Wärtsilä Corp.	STK	0	5.000

US9418481035	Waters Corp.	STK	205	205
FR0000121204	Wendel SE	STK	1.132	1.132
NL0015001LH9	Wolters Kluwer N.V. - Anrechte	STK	1.594	1.594
US98138H1014	Workday Inc.	STK	0	431
FR0011981968	Worldline S.A.	STK	2.425	2.425
US98419M1009	Xylem Inc.	STK	0	552
US98956P1021	Zimmer Biomet Holdings Inc.	STK	0	434
Verzinsliche Wertpapiere				
Inland				
DE0001102606	1,7000 % Bundesrep.Deutschland - Anleihe 2022/2032	EUR	0	300
DE000A289XH6	1,6250 % Mercedes-Benz Int.Fin. B.V. - Anleihe 2020/2023	EUR	0	125
Ausland				
XS2193669657	1,1250 % Amcor UK Finance PLC - Anleihe 2020/2027	EUR	0	46
IT0005346579	2,1250 % Cassa Depositi e Prestiti SpA - Medium Term Notes 2018/2023	EUR	0	300
XS1485748393	0,9550 % General Motors Financial Co. - Medium Term Notes 2016/2023	EUR	0	50
XS1326311070	2,3750 % IE2 Holdco S.A. - Medium Term Notes 2015/2023	EUR	0	60
XS0986194883	4,0000 % Intesa Sanpaolo S.p.A. - Medium Term Notes 2013/2023	EUR	0	70
XS2151069775	2,3750 % Lloyds Bank Corporate Markets - Medium Term Notes 2020/2026	EUR	0	130
XS2329143510	0,1840 % Mizuho Financial Group Inc. - Medium Term Notes 2021/2026	EUR	0	130
US91282CDJ71	1,3750 % United States of America - Treasury Bonds 2021/2031	USD	0	400
US912828X885	2,3750 % United States of America - Treasury Bonds 2017/2027	USD	0	800
US91282CEU18	2,8750 % United States of America - Treasury Notes 2022/2025	USD	0	1.400
Investmentanteile				
Gruppenfremde Investmentanteile				
Ausland				
IE00BKM4GZ66	iShs Core MSCI EM IMI U.ETF	ANT	0	152.500
Derivate (In Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe.)				
Aktienindex-Derivate				
Aktienindex-Terminkontrakte				
Verkaufte Kontrakte				
(Basiswerte: S&P 500 E-MINI FUTURE, STOXX 600(SXXP))		EUR		6.572
Zinsterminkontrakte				
Gekaufte Kontrakte				
(Basiswert(e): EURO-BTP FUTURE, US 5YR NOTE FUTURE (CBT))		EUR		175.175
Verkaufte Kontrakte				
(Basiswert(e): EURO-BOBL FUTURE, EURO-BUND FUTURE)		EUR		80.154
Devisenterminkontrakte				
Kauf von Devisen auf Termin				
EUR/GBP		GBP		9.305
EUR/USD		USD		64.125
EUR/JPY		JPY		4.320
Verkauf von Devisen auf Termin				
EUR/USD		USD		9.606

Generali AktivMix Dynamik Protect 80

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben nach der Derivateverordnung

Das durch Derivate erzielte zugrundeliegende Exposure EUR -652.284,38

Vertragspartner der derivativen Geschäfte

Morgan Stanley

	Nominal In Stk bzw. Whg. in 1.000	Kurswert in EUR befristet	unbefristet
--	---	------------------------------	-------------

Gesamtbetrag der i.Z.m. Derivaten von Dritten gewährten Sicherheiten: EUR 441.723,87

davon:
Bankguthaben EUR 441.723,87

Die Auslastung der Obergrenze für das Marktrisikopotential wurde für dieses Sondervermögen gemäß der Derivateverordnung nach dem einfachen Ansatz ermittelt.

Sonstige Angaben

Anteilwert EUR 104,64

Umlaufende Anteile STK 2.221.183

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %) 92,51

Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %) -0,28

Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände

Die Bewertung der Vermögensgegenstände erfolgte während des Geschäftsjahres sowie zum Berichtsstichtag per 31.01.2024 grundsätzlich zum letzten gehandelten Börsen- oder Marktkurs, der eine verlässliche Bewertung gewährleistet.

Vermögensgegenstände, die weder zum Handel an Börsen zugelassen sind noch in einem anderen organisierten Markt zugelassen oder in diesen einbezogen sind oder für die kein handelbarer Kurs verfügbar ist, werden zu dem aktuellen Verkehrswert bewertet, der bei sorgfältiger Einschätzung nach geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten angemessen ist.

Im Geschäftsjahr sowie zum Berichtsstichtag per 31.01.2024 wurden die folgenden Vermögensgegenstände nicht zum letzten gehandelten Börsen- oder Marktkurs bewertet:

Bankguthaben und sonst. Vermögensgegenstände	zum Nennwert
Verbindlichkeiten	zum Rückzahlungsbetrag
Fremdwährungsumrechnung	auf Basis der Closing Spot-Kurse von WM Company / Reuters

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

Im abgelaufenen Geschäftsjahr wurden keine Geschäfte gemäß Verordnung (EU) 2015/2365 getätigt.

Luxemburg, 13.03.2024

Generali Investments Luxembourg S.A.

Generali Investments Luxembourg S.A.

<https://www.generali-investments.lu>