
Halbjahresbericht
30. Juni 2024 (ungeprüft)

Amundi S.F.

Ein Luxemburger Investmentfonds
(Fonds Commun de Placement)

Amundi S.F.

Ungeprüfter Halbjahresbericht

R.C.S. Luxemburg K 651

für den Zeitraum vom 01.01.2024 bis zum 30.06.2024

Auf alleiniger Grundlage dieses Finanzberichts kann keine Zeichnung entgegengenommen werden. Zeichnungen sind nur auf der Grundlage des aktuellen Verkaufsprospekts und der Wesentlichen Anlegerinformationen (Key Information Document, KID) gültig, begleitet vom letzten Jahresbericht und einer Kopie des letzten Halbjahresberichts, falls danach veröffentlicht.

	<u>Seite</u>
Organisation	4
Portfolioangaben zum 30.06.2024	
Anleiheiteifonds	
Amundi S.F. - Diversified Short-Term Bond ESG	6
Amundi S.F. - Euro Curve 7-10year	9
Amundi S.F. - Euro Curve 10+year	10
Amundi S.F. - SBI FM India Bond	12
Rohstoffteifonds	
Amundi S.F. - EUR Commodities	13
Konten:	
Nettovermögensaufstellung	14
Finanzdaten zu den vergangenen 3 Jahren	17
Aufwands- und Ertragsrechnung und Veränderungen des Nettovermögens	19
Anmerkungen zum Geschäftsbericht zum 30.06.2024	
1 Einleitung	22
2 Wichtigste Bilanzierungsgrundsätze	22
3 Verwendete Wechselkurse zum 30. Juni 2024	23
4 Verwaltungs-, anlageverwaltungs- und vertriebsgebühren	24
5 Erfolgsabhängige Gebühr	24
6 Depot- und Zahlstelle, Verwalter, Register- und Transferstelle	24
7 Besteuerung des Fonds - <i>Taxe d'abonnement</i>	25
8 Offene Positionen aus Termingeschäften	25
9 Offene Positionen aus Devisenterminkontrakten	26
10 Optionen	27
11 Swapgeschäfte	28
12 Sicherheiten	29
13 Sonstige Erträge	29
14 Sonstige Kosten	29
15 Kontoauszug der Portfoliobewegungen	33
16 Dividenden	29
17 Transaktionskosten	29
18 Wertpapierleihgeschäfte	30
19 Folgeereignisse	30
Zusätzliche Informationen über den Vertreter und den Vertrieb des Fonds in und/oder aus der Schweiz	31

**VERWALTUNGSGESELLSCHAFT,
DOMIZIL- UND VERTRIEBSSTELLE**

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

**VERWALTUNGSRAT DER
VERWALTUNGSGESELLSCHAFT**

Vorsitzender

David Joseph HARTE
Chief Executive Officer,
Amundi Ireland Limited,
in Irland ansässig

Mitglieder

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

Bernard DE WIT
Berater des CEO
Amundi Asset Management S.A.S,
in Frankreich ansässig

Céline BOYER-CHAMMARD
Head of Sustainable Transformation and Organization Division,
Amundi Asset Management S.A.S,
in Frankreich ansässig

Claude KREMER
Partner - Arendt & Medernach S.A.,
Independent Director,
in Luxemburg ansässig

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

Pascal BIVILLE
Unabhängiges Verwaltungsratsmitglied,
in Frankreich ansässig

François MARION
Unabhängiges Verwaltungsratsmitglied,
in Frankreich ansässig

**GESCHÄFTSLEITER DER
VERWALTUNGSGESELLSCHAFT**

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

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

Pierre BOSIO
Deputy Chief Executive Officer und Chief Operating Officer,
Amundi Luxembourg S.A.,
in Luxemburg ansässig

Charles GIRALDEZ *(bis 2. April 2024)*
Deputy Chief Executive Officer,
Amundi Luxembourg S.A.,
in Luxemburg ansässig

Benjamin LAUNAY *(bis 31. Mai 2024)*
Real Estate Portfolio Manager,
Amundi Luxembourg S.A.,
in Luxemburg ansässig

Loredana CARLETTI
Head of Amundi Real Assets (ARA) Luxembourg,
Amundi Luxembourg S.A.,
in Luxemburg ansässig

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

Société Générale Luxembourg
11, Avenue Emile Reuter
L-2420 Luxembourg
Großherzogtum Luxemburg

ANLAGEVERWALTER

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

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

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

Amundi Asset Management
91-93, Boulevard Pasteur
75015 Paris
Frankreich

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

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

Amundi Ireland Limited
1, George's Quay Plaza
George's Quay
Dublin 2
Irland

**WIRTSCHAFTSPRÜFER /
CABINET DE RÉVISION AGRÉÉ**

PricewaterhouseCoopers, *Société coopérative*
2, rue Gerhard Mercator
B.P. 1443, L-1014 Luxemburg
Großherzogtum Luxemburg

RECHTSBERATER

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

Wertpapierbestand zum 30.06.2024

Anzahl Nennwert	Marktwert	% des NIW	Anzahl Nennwert	Marktwert	% des NIW
	EUR			EUR	
Positive Positionen	841,454,804	94.39			
Übertragbare und amtlich notierte Wertpapiere und/oder auf anderen Märkten gehandelte Wertpapiere	762,907,510	85.58			
Anleihen	762,907,510	85.58			
<i>Australien</i>	15,374,182	1.72			
15,000,000 WESTFIELD AMERICAN MANAGEMENT LTD 2.625% 30/03/2029	15,374,182	1.72			
<i>Belgien</i>	51,202,043	5.74			
5,000,000 BARRY CALLEBAUT NV 4.00% 14/06/2029	5,016,150	0.56			
5,000,000 BELFIUS BANQUE SA/NV 4.875% 11/06/2035	5,057,900	0.57			
10,000,000 CRELAN SA VAR 28/02/2030	10,641,200	1.18			
10,000,000 CRELAN SA VAR 30/04/2035	10,129,000	1.14			
5,000,000 KBC GROUP SA/NV VAR 17/04/2035	5,046,600	0.57			
10,000,000 KBC GROUP SA/NV VAR 19/01/2029	9,408,911	1.06			
5,000,000 KBC GROUP SA/NV VAR 19/03/2034	5,902,282	0.66			
<i>Dänemark</i>	10,095,700	1.13			
10,000,000 ORSTED VAR 14/03/2034	10,095,700	1.13			
<i>Deutschland</i>	78,654,250	8.82			
5,000,000 AAREAL BANK AG 0.75% 18/04/2028	4,367,150	0.49			
5,000,000 AAREAL BANK AG 5.875% 29/05/2026	5,058,050	0.57			
5,000,000 COMMERZBANK AG VAR PERPETUAL EUR (ISIN DE000CB94MF6)	4,916,000	0.55			
5,000,000 COMMERZBANK AG VAR 18/01/2030	5,203,200	0.58			
5,000,000 DEUTSCHE LUFTHANSA AG 4.00% 21/05/2030	4,993,500	0.56			
30,000,000 FEDERAL REPUBLIC OF GERMANY 2.90% 18/06/2026	30,036,600	3.37			
5,000,000 GEWOBA WOHNUMBAU BERLIN 0.125% 24/06/2027	4,486,650	0.50			
5,000,000 HAMBURG COMMERCIAL BANK AG 4.75% 02/05/2029	5,092,800	0.57			
5,000,000 K S AKTIENGESELLSCHAFT 4.25% 19/06/2029	4,992,000	0.56			
5,000,000 NORDDEUTSCHE LANDESBANK GIROZENTRALE VAR 23/08/2034	4,966,900	0.56			
5,000,000 VONOVIA SE 0.375% 16/06/2027	4,541,400	0.51			
<i>Finnland</i>	9,280,100	1.04			
5,000,000 CASTELLUM HELSINKI FINANCE HOLDING ABP 0.875% 17/09/2029	4,128,900	0.46			
5,000,000 INDUSTRIAL POWER CORPORATION 4.75% 01/06/2030	5,151,200	0.58			
<i>Frankreich</i>	132,618,580	14.89			
5,000,000 ALSTOM SA VAR PERPETUAL	5,081,500	0.57			
5,000,000 ARKEMA SA VAR PERPETUAL EUR (ISIN FR001400ORA4)	4,994,750	0.56			
5,000,000 CARMILA SAS 5.50% 09/10/2028	5,216,750	0.59			
5,600,000 CMA CGM 5.50% 15/07/2029	5,633,040	0.63			
10,000,000 COVIVIO SA 1.625% 23/06/2030	8,756,700	0.98			
5,000,000 CREDIT AGRICOLE SA VAR PERPETUAL EUR (ISIN FR001400N2U2)	5,007,600	0.56			
5,000,000 CREDIT AGRICOLE SA VAR REGS 10/01/2033	4,338,558	0.49			
5,000,000 CREDIT MUTUEL ARKEA HOME LOANS SFH VAR 15/05/2035	5,012,950	0.56			
			5,000,000 ELECTRICITE DE FRANCE VAR PERPETUAL EUR (ISIN FR0013534336)	4,373,400	0.49
			10,000,000 ELECTRICITE DE FRANCE VAR PERPETUAL EUR (ISIN FR001400EFQ6)	10,694,000	1.21
			5,000,000 ELO 5.875% 17/04/2028	4,921,450	0.55
			5,000,000 ENGIE SA VAR PERPETUAL EUR (ISIN FR001400QOK5)	4,970,650	0.56
			10,000,000 ICADE SA 1.00% 19/01/2030	8,481,300	0.95
			5,000,000 LA BANQUE POSTALE VAR 05/03/2034	5,162,450	0.58
			10,000,000 LA BANQUE POSTALE 4.375% 17/01/2030	10,173,800	1.14
			10,000,000 LA MONDIALE SOCIETE D ASSURANCE A FORME MUTUELLE VAR 26/01/2047	9,092,139	1.02
			5,000,000 SOCIETE GENERALE SA VAR PERPETUAL	5,092,250	0.57
			5,000,000 SOCIETE GENERALE SA VAR REGS 10/01/2029	4,745,043	0.53
			5,000,000 TDF INFRASTRUCTURE SAS 5.625% 21/07/2028	5,227,250	0.59
			5,000,000 TELEPERFORMANCE SE 5.25% 22/11/2028	5,119,400	0.57
			10,000,000 UNIBAIL-RODAMCO SE VAR PERPETUAL	10,523,600	1.19
			<i>Großbritannien</i>	68,761,085	7.71
			5,000,000 AVIVA PLC VAR 12/09/2049	5,445,067	0.61
			5,000,000 BARCLAYS PLC VAR PERPETUAL GBP (ISIN XS2591803841)	6,115,645	0.69
			5,000,000 HSBC HOLDINGS PLC VAR 16/11/2034	6,401,959	0.72
			5,000,000 LLOYDS BANKING GROUP PLC VAR PERPETUAL	6,039,040	0.68
			10,000,000 NATIONWIDE BUILDING SOCIETY VAR 16/04/2034	9,985,900	1.12
			5,000,000 NATIONWIDE BUILDING SOCIETY VAR 18/07/2030	4,323,443	0.48
			5,000,000 NATWEST GROUP PLC VAR 06/06/2033	6,117,827	0.69
			15,000,000 SANTANDER UK PLC 3.125% 12/05/2031	14,935,050	1.67
			5,000,000 STANDARD CHARTERED PLC VAR REGS 15/03/2033	4,469,139	0.50
			5,000,000 STANDARD CHARTERED PLC VAR 08/02/2030	4,928,015	0.55
			<i>Irland</i>	10,001,550	1.12
			5,000,000 AIB GROUP PLC VAR PERPETUAL EUR (ISIN XS2808268390)	5,005,500	0.56
			5,000,000 BANK OF IRELAND VAR 10/08/2034	4,996,050	0.56
			<i>Italien</i>	84,931,566	9.54
			5,000,000 A2A SPA VAR PERPETUAL	4,959,500	0.56
			5,000,000 BANCA POPOLARE DI SONDRIO SPA VAR 04/06/2030	4,977,000	0.56
			10,000,000 BANCO BPM SPA VAR 17/01/2030	10,229,600	1.15
			5,000,000 BPER BANCA SPA VAR PERPETUAL	5,183,350	0.58
			5,000,000 FINCOBANK SPA VAR PERPETUAL	5,132,400	0.58
			5,000,000 ICCREA BANCA SPA VAR 05/02/2030	5,014,600	0.56
			5,000,000 INTESA SANPAOLO SPA VAR PERPETUAL EUR (ISIN XS2223761813)	4,781,550	0.54
			5,000,000 INTESA SANPAOLO SPA 5.148% 10/06/2030	5,449,195	0.61
			15,000,000 ITALY BTP 0% 15/08/2024	14,938,950	1.68
			10,000,000 MEDIOBANCA BANCA DI CREDITO FINANZIARIO SPA VAR 04/07/2030	9,893,100	1.11
			5,000,000 UNICREDIT SPA VAR PERPETUAL	4,579,650	0.51
			5,000,000 UNICREDIT SPA VAR REGS 02/04/2034	4,773,921	0.54
			5,000,000 UNICREDIT SPA VAR 23/01/2031	5,018,750	0.56
			<i>Jersey Inseln</i>	5,268,680	0.59
			5,000,000 HEATHROW FUNDING LTD 2.75% 13/10/2031	5,268,680	0.59

Die beigegeführten Anmerkungen sind integraler Bestandteil dieses Geschäftsberichts.

Wertpapierbestand zum 30.06.2024

Anzahl Nennwert	Marktwert	% des NIW
	EUR	
Derivative Instrumente	1,345,997	0.15
Optionen	1,345,997	0.15
<i>Luxemburg</i>	1,345,997	0.15
185,000,000 CALL CDX OPTION - ITRAXX EUROPE CROSSOVER SERIES 41 INDEX - 225.00 - 17.07.24	16,709	0.00
185,000,000 PUT CDX OPTION - ITRAXX EUROPE CROSSOVER SERIES 41 INDEX - 325.00 - 17.07.24	1,329,288	0.15
Negative Positionen	-773,313	-0.09
Derivative Instrumente	-773,313	-0.09
Optionen	-773,313	-0.09
<i>Luxemburg</i>	-773,313	-0.09
-185,000,000 CALL CDX OPTION - ITRAXX EUROPE CROSSOVER SERIES 41 INDEX - 262.50 - 17.07.24	-23,271	0.00
-185,000,000 PUT CDX OPTION - ITRAXX EUROPE CROSSOVER SERIES 41 INDEX - 350.00 - 17.07.24	-594,585	-0.07
-185,000,000 PUT CDX OPTION - ITRAXX EUROPE CROSSOVER SERIES 41 INDEX - 400.00 - 17.07.24	-155,457	-0.02
Gesamtwertpapierbestand	840,681,491	94.30

Die beigegeführten Anmerkungen sind integraler Bestandteil dieses Geschäftsberichts.

Wertpapierbestand zum 30.06.2024

Anzahl Nennwert	Marktwert	% des NIW	Anzahl Nennwert	Marktwert	% des NIW
	EUR			EUR	
Positive Positionen	67,412,097	98.93	760,000 REPUBLIC OF PORTUGAL 2.875% 20/10/2034	736,326	1.08
Übertragbare und amtlich notierte Wertpapiere und/oder auf anderen Märkten gehandelte Wertpapiere	66,957,986	98.26	<i>Spanien</i>	13,392,013	19.65
Anleihen	66,957,986	98.26	400,000 BANCO DE SABADELL SA 3.25% 05/06/2034	397,788	0.58
<i>Belgien</i>	3,917,004	5.75	500,000 CAJAMAR CAJA RURAL 3.375% 16/02/2028	496,365	0.73
2,780,000 BELGIUM 0% 22/10/2031	2,248,408	3.30	5,630,000 KINGDOM OF SPAIN 0.70% 30/04/2032	4,672,900	6.86
900,000 KINGDOM OF BELGIUM 0.35% 22/06/2032	732,636	1.08	560,000 KINGDOM OF SPAIN 3.25% 30/04/2034	554,266	0.81
740,000 KINGDOM OF BELGIUM 3.00% 22/06/2033	738,039	1.08	1,650,000 KINGDOM OF SPAIN 3.45% 31/10/2034	1,654,868	2.43
210,000 KINGDOM OF BELGIUM 3.30% 22/06/2054	197,921	0.29	5,520,000 KINGDOM OF SPAIN 3.55% 31/10/2033	5,615,826	8.24
<i>Deutschland</i>	23,536,471	34.54	Aktien/Anteile aus OGAW/OGA	454,111	0.67
5,150,000 FEDERAL REPUBLIC OF GERMANY 0% 15/02/2032	4,296,336	6.31	Aktien/Anteile aus Investmentfonds	454,111	0.67
5,641,000 FEDERAL REPUBLIC OF GERMANY 0% 15/08/2030	4,882,116	7.16	<i>Frankreich</i>	454,111	0.67
3,000,000 FEDERAL REPUBLIC OF GERMANY 1.70% 15/02/2032	2,841,420	4.17	0.379 AMUNDI EURO LIQUIDITY RATED SRI FCP EUR (ISIN FR0014005XMO)	399,649	0.59
5,860,000 FEDERAL REPUBLIC OF GERMANY 2.20% 15/02/2034	5,712,153	8.38	0.518 AMUNDI EURO LIQUIDITYSHORT TERM SRI FCP	54,462	0.08
3,400,000 FEDERAL REPUBLIC OF GERMANY 2.30% 15/02/2033	3,359,472	4.93	Gesamtwertpapierbestand	67,412,097	98.93
2,420,000 FEDERAL REPUBLIC OF GERMANY 2.60% 15/08/2033	2,444,974	3.59			
<i>Finnland</i>	645,515	0.95			
650,000 REPUBLIC OF FINLAND 3.00% 15/09/2034	645,515	0.95			
<i>Frankreich</i>	5,445,420	7.99			
3,970,000 FRANCE OAT 1.25% 25/05/2034	3,303,517	4.85			
2,730,000 FRENCH REPUBLIC 0% 25/05/2032	2,141,903	3.14			
<i>Irland</i>	1,105,293	1.62			
820,000 IRELAND 1.30% 15/05/2033	720,706	1.06			
470,000 IRISH REPUBLIC 0.35% 18/10/2032	384,587	0.56			
<i>Italien</i>	14,525,465	21.32			
400,000 BANCO BPM SPA 3.25% 28/05/2031	396,548	0.58			
200,000 CREDIT AGRICOLE ITALIA SPA 3.50% 11/03/2036	201,366	0.30			
300,000 CREDIT AGRICOLE ITALIE 3.50% 15/07/2033	303,690	0.45			
5,550,000 ITALIAN REPUBLIC 0.95% 01/06/2032	4,480,904	6.57			
3,390,000 ITALIAN REPUBLIC 4.00% 30/10/2031	3,447,867	5.06			
2,140,000 ITALIAN REPUBLIC 4.20% 01/03/2034	2,174,390	3.19			
4,360,000 ITALY BTP 0.60% 01/08/2031	3,520,700	5.17			
<i>Niederlande</i>	3,211,175	4.71			
1,690,000 KINGDOM OF THE NETHERLANDS 2.50% 15/07/2033	1,651,299	2.42			
1,150,000 NETHERLANDS 0% 15/07/2031	951,706	1.40			
620,000 NETHERLANDS 2.50% 15/01/2033	608,170	0.89			
<i>Österreich</i>	346,682	0.51			
350,000 REPUBLIC OF AUSTRIA 2.90% 20/02/2033	346,682	0.51			
<i>Portugal</i>	832,948	1.22			
107,000 REPUBLIC OF PORTUGAL 1.65% 16/07/2032	96,622	0.14			

Die beigegeführten Anmerkungen sind integraler Bestandteil dieses Geschäftsberichts.

Wertpapierbestand zum 30.06.2024

Anzahl Nennwert	Marktwert	% des NIW	Anzahl Nennwert	Marktwert	% des NIW
	EUR			EUR	
Positive Positionen	68,579,401	98.03			
Übertragbare und amtlich notierte Wertpapiere und/oder auf anderen Märkten gehandelte Wertpapiere	66,835,214	95.54			
Anleihen	66,835,214	95.54			
<i>Belgien</i>	3,610,319	5.16			
160,000 BELGIUM 0.40% 22/06/2040	101,560	0.15			
350,000 BELGIUM 0.65% 22/06/2071	141,894	0.20			
170,000 BELGIUM 1.70% 22/06/2050	117,076	0.17			
138,000 BELGIUM 2.15% 22/06/2066	99,247	0.14			
90,000 BELGIUM 2.25% 22/06/2057	67,227	0.10			
280,000 BELGIUM 3.75% 22/06/2045	290,726	0.42			
110,000 BELGIUM 4.25% 28/03/2041	121,545	0.17			
480,000 BELGIUM 5.00% 28/03/2035	558,744	0.79			
280,000 EUROPEAN UNION 3.375% 05/10/2054	270,704	0.39			
95,000 KINGDOM OF BELGIUM 1.40% 22/06/2053	58,250	0.08			
370,000 KINGDOM OF BELGIUM 2.85% 22/10/2034	360,750	0.52			
200,000 KINGDOM OF BELGIUM 3.30% 22/06/2054	188,496	0.27			
750,000 KINGDOM OF BELGIUM 3.45% 22/06/2043	747,270	1.06			
500,000 KINGDOM OF BELGIUM 3.50% 22/06/2055	486,830	0.70			
<i>Deutschland</i>	19,747,969	28.23			
1,070,000 FEDERAL REPUBLIC OF GERMANY 0% 15/08/2052	514,659	0.74			
2,480,000 FEDERAL REPUBLIC OF GERMANY 1.00% 15/05/2038	2,006,791	2.87			
600,000 FEDERAL REPUBLIC OF GERMANY 1.80% 15/08/2053	493,986	0.71			
5,440,000 GERMANY BUND 0% 15/05/2035	4,136,141	5.91			
900,000 GERMANY BUND 0% 15/08/2050	454,743	0.65			
5,608,000 GERMANY BUND 3.25% 04/07/2042	6,029,834	8.62			
5,110,000 GERMANY BUND 4.75% 04/07/2034	6,111,815	8.73			
<i>Finnland</i>	1,066,645	1.52			
200,000 FINLAND 1.125% 15/04/2034	167,820	0.24			
360,000 FINLAND 1.375% 15/04/2047	253,310	0.36			
650,000 REPUBLIC OF FINLAND 3.00% 15/09/2034	645,515	0.92			
<i>Frankreich</i>	13,292,975	19.00			
5,010,000 FRANCE OAT 0.50% 25/05/2040	3,192,020	4.57			
3,420,000 FRANCE OAT 0.50% 25/06/2044	1,939,448	2.77			
4,527,828 FRANCE OAT 0.75% 25/05/2052	2,267,265	3.24			
4,400,000 FRANCE OAT 0.75% 25/05/2053	2,148,432	3.07			
1,960,000 FRANCE OAT 1.25% 25/05/2034	1,630,955	2.33			
1,023,000 FRANCE OAT 2.00% 25/05/2048	758,186	1.08			
2,050,000 FRENCH REPUBLIC 0.50% 25/05/2072	719,263	1.03			
700,000 FRENCH REPUBLIC 3.25% 25/05/2055	637,406	0.91			
<i>Irland</i>	955,071	1.37			
230,000 IRELAND 1.50% 15/05/2050	160,823	0.23			
670,000 IRELAND 1.70% 15/05/2037	572,575	0.82			
270,000 IRELAND 2.00% 18/02/2045	221,673	0.32			
			<i>Italien</i>	10,861,794	15.53
			90,000 ITALIAN REPUBLIC 3.25% 01/03/2038	80,564	0.12
			950,000 ITALIAN REPUBLIC 4.05% 30/10/2037	933,480	1.33
			1,710,000 ITALIAN REPUBLIC 4.15% 01/10/2039	1,669,234	2.39
			1,900,000 ITALIAN REPUBLIC 4.45% 01/09/2043	1,895,041	2.71
			3,630,000 ITALIAN REPUBLIC 4.50% 01/10/2053	3,594,861	5.14
			240,000 ITALY BTP 0.95% 01/03/2037	164,714	0.24
			290,000 ITALY BTP 2.15% 01/03/2072	168,934	0.24
			100,000 ITALY BTP 2.95% 01/09/2038	86,062	0.12
			1,450,000 ITALY BTP 3.10% 01/03/2040	1,246,841	1.78
			1,081,000 ITALY BTP 3.45% 01/03/2048	925,325	1.32
			93,000 ITALY BTP 4.75% 01/09/2044	96,738	0.14
			<i>Kroatien</i>	191,971	0.27
			186,000 REPUBLIC OF CROATIA 4.00% 14/06/2035	191,971	0.27
			<i>Niederlande</i>	2,600,479	3.72
			700,000 NETHERLANDS 0% 15/01/2052	325,395	0.47
			200,000 NETHERLANDS 0.50% 15/01/2040	140,100	0.20
			755,000 NETHERLANDS 2.75% 15/01/2047	734,494	1.05
			440,000 NETHERLANDS 3.75% 15/01/2042	487,674	0.70
			820,000 NETHERLANDS 4.00% 15/01/2037	912,816	1.30
			<i>Österreich</i>	1,868,615	2.67
			269,000 AUSTRIA 0.85% 30/06/2120	115,116	0.16
			118,000 AUSTRIA 1.50% 20/02/2047	84,724	0.12
			147,000 AUSTRIA 2.10% 20/09/2117	106,027	0.15
			557,000 AUSTRIA 3.15% 20/06/2044	545,320	0.78
			471,000 AUSTRIA 3.80% 26/01/2062	521,425	0.75
			217,000 AUSTRIA 4.15% 15/03/2037	238,468	0.34
			260,000 REPUBLIC OF AUSTRIA 2.90% 20/02/2033	257,535	0.37
			<i>Portugal</i>	1,685,623	2.41
			510,000 OBRIGACOES DO TESOURO 3.625% 12/06/2054	492,094	0.70
			509,000 PORTUGAL 0.90% 12/10/2035	395,478	0.57
			200,000 PORTUGAL 4.10% 15/02/2045	212,246	0.30
			240,000 REPUBLIC OF PORTUGAL 1.15% 11/04/2042	164,587	0.24
			420,000 REPUBLIC OF PORTUGAL 3.50% 18/06/2038	421,218	0.60
			<i>Spanien</i>	10,953,753	15.66
			1,380,000 KINGDOM OF SPAIN 1.90% 31/10/2052	906,412	1.30
			310,000 KINGDOM OF SPAIN 2.70% 31/10/2048	252,923	0.36
			560,000 KINGDOM OF SPAIN 3.25% 30/04/2034	554,266	0.79
			2,440,000 KINGDOM OF SPAIN 3.45% 31/10/2034	2,447,198	3.50
			220,000 KINGDOM OF SPAIN 3.90% 30/07/2039	224,668	0.32
			750,000 KINGDOM OF SPAIN 4.00% 31/10/2054	748,245	1.07
			630,000 SPAIN 1.00% 31/10/2050	335,003	0.48
			1,968,000 SPAIN 1.20% 31/10/2040	1,359,868	1.94
			290,000 SPAIN 1.45% 31/10/2071	137,747	0.20
			1,530,000 SPAIN 1.85% 30/07/2035	1,307,645	1.87
			230,000 SPAIN 2.90% 31/10/2046	197,457	0.28
			550,000 SPAIN 3.45% 30/07/2066	487,449	0.70
			768,000 SPAIN 4.70% 30/07/2041	858,693	1.23
			960,000 SPAIN 5.15% 31/10/2044	1,136,179	1.62

Die beigefügten Anmerkungen sind integraler Bestandteil dieses Geschäftsberichts.

Wertpapierbestand zum 30.06.2024

Anzahl Nennwert	Marktwert	% des NIW
	EUR	
Aktien/Anteile aus OGAW/OGA	1,744,187	2.49
Aktien/Anteile aus Investmentfonds	1,744,187	2.49
<i>Frankreich</i>	1,744,187	2.49
1 AMUNDI EURO LIQUIDITY SRI FCP	1,311,749	1.87
4 AMUNDI EURO LIQUIDITYSHORT TERM SRI FCP	432,438	0.62
Gesamtwertpapierbestand	68,579,401	98.03

Die beigefügten Anmerkungen sind integraler Bestandteil dieses Geschäftsberichts.

Wertpapierbestand zum 30.06.2024

Anzahl Nennwert	Marktwert	% des NIW	Anzahl Nennwert	Marktwert	% des NIW
	USD			USD	
Positive Positionen	66,299,550	96.11	50,000,000 POWER FINANCE CORPORATION 7.59% 17/01/2028	599,610	0.87
Übertragbare und amtlich notierte Wertpapiere und/oder auf anderen Märkten gehandelte Wertpapiere	66,299,550	96.11	<i>Industriemetalle und Bergbau</i>	1,780,686	2.58
Anleihen	66,299,550	96.11	1,800,000 PERIAMA HOLDINGS LLC 5.95% 19/04/2026	1,780,686	2.58
<i>Automobilbau und -teile</i>	600,046	0.87	<i>Investmentbanking und Maklerdienste</i>	2,410,288	3.49
50,000,000 MAHINDRA AND MAHINDRA LTD 8.25% 25/03/2027	600,046	0.87	50,000,000 MAHARASHTRA CORPORATION LTD 7.46% 21/02/2035	605,438	0.88
<i>Banken</i>	3,376,808	4.89	50,000,000 MAHARASHTRA CORPORATION LTD 7.47% 21/02/2036	605,807	0.88
600,000 AXIS BANK LTD VAR REGS PERPETUAL	561,684	0.81	100,000,000 SMALL IND DEV BANK OF INDIA 7.68% 09/07/2027	1,199,043	1.73
50,000,000 EUROPEAN BANK FOR RECONSTRUCTION AND DEVELOPMENT EBRD 6.30% 26/10/2027	587,054	0.85	<i>Telekommunikationsgeräte</i>	1,047,420	1.52
600,000 HDFC BANK LTD VAR PERPETUAL	555,942	0.81	1,100,000 NETWORK I2I LIMITED VAR REGS PERPETUAL	1,047,420	1.52
40,000,000 HDFC BANK LTD 7.77% 28/06/2027	477,182	0.69	Gesamtwertpapierbestand	66,299,550	96.11
100,000,000 NABARD 7.62% 31/01/2028	1,194,946	1.73			
<i>Behörden</i>	52,693,982	76.39			
100,000,000 ASIAN DEVELOPMENT BANK ADB 6.20% 06/10/2026	1,183,301	1.72			
50,000,000 GOVERNMENT OF GUJARAT 8.57% 06/11/2028	626,867	0.91			
50,000,000 GOVERNMENT OF WEST BENGAL 6.79% 30/06/2028	588,458	0.85			
37,000,000 INDIA 5.77% 03/08/2030	416,390	0.60			
47,000,000 INDIA 5.79% 11/05/2030	531,011	0.77			
37,000,000 INDIA 5.85% 01/12/2030	416,954	0.60			
70,000,000 INDIA 6.45% 07/10/2029	819,694	1.19			
120,000,000 INDIA 6.64% 16/06/2035	1,394,475	2.02			
38,000,000 INDIA 6.67% 17/12/2050	436,068	0.63			
46,000,000 INDIA 6.68% 17/09/2031	541,028	0.78			
68,000,000 INDIA 6.79% 26/12/2029	807,201	1.17			
121,000,000 INDIA 7.57% 17/06/2033	1,500,988	2.18			
42,000,000 INDIA 7.59% 20/03/2029	514,381	0.75			
42,000,000 INDIA 7.61% 09/05/2030	516,886	0.75			
48,000,000 INDIA 8.24% 10/11/2033	622,338	0.90			
40,000,000 REPUBLIC OF INDIA 6.67% 15/12/2035	465,991	0.68			
25,000,000 REPUBLIC OF INDIA 6.79% 15/05/2027	298,321	0.43			
80,000,000 REPUBLIC OF INDIA 6.99% 15/12/2051	954,076	1.38			
35,000,000 REPUBLIC OF INDIA 7.18% 14/08/2033	423,528	0.61			
725,000,000 REPUBLIC OF INDIA 7.18% 24/07/2037	8,801,810	12.77			
470,000,000 REPUBLIC OF INDIA 7.26% 22/08/2032	5,707,297	8.27			
550,000,000 REPUBLIC OF INDIA 7.30% 19/06/2053	6,801,729	9.86			
192,000,000 REPUBLIC OF INDIA 7.36% 12/09/2052	2,391,990	3.47			
210,000,000 REPUBLIC OF INDIA 7.40% 19/09/2062	2,629,927	3.81			
305,000,000 REPUBLIC OF INDIA 7.41% 19/12/2036	3,770,680	5.47			
522,000,000 REPUBLIC OF INDIA 7.54% 23/05/2036	6,514,428	9.44			
140,000,000 REPUBLIC OF INDIA 7.72% 15/06/2049	1,810,275	2.62			
32,000,000 REPUBLIC OF INDIA 8.60% 02/06/2028	404,546	0.59			
50,000,000 STATE OF KARNATAKA 7.44% 28/02/2034	603,766	0.88			
200,000 UNITED STATES OF AMERICA 0.375% 15/07/2024	199,578	0.29			
<i>Finanzdienstleistungen und Kreditwirtschaft</i>	4,390,320	6.37			
50,000,000 LIC HOUSING FINANCE LTD 7.72% 12/02/2026	596,995	0.87			
170,000,000 LIC HOUSING FINANCE LTD 7.835% 11/05/2027	2,033,177	2.95			
1,200,000 POWER FINANCE CORPORATION 1.841% 21/09/2028	1,160,538	1.68			

Die beigegeführten Anmerkungen sind integraler Bestandteil dieses Geschäftsberichts.

Wertpapierbestand zum 30.06.2024

Anzahl Nennwert	Marktwert	% des NIW
	EUR	
Positive Positionen	109,279,636	93.87
<i>Übertragbare und amtlich notierte Wertpapiere und/oder auf anderen Märkten gehandelte Wertpapiere</i>	2,995,860	2.57
Anleihen	2,995,860	2.57
<i>Behörden</i>	2,995,860	2.57
3,000,000 AUSTRIA 0% 15/07/2024	2,995,860	2.57
Geldmarktinstrumente	106,283,776	91.30
<i>Behörden</i>	106,283,776	91.30
6,100,000 FRANCE BTF 0% 02/10/2024	6,044,124	5.19
6,300,000 FRANCE BTF 0% 03/07/2024	6,298,803	5.41
6,600,000 FRANCE BTF 0% 04/09/2024	6,557,298	5.63
6,000,000 FRANCE BTF 0% 07/08/2024	5,978,100	5.14
6,300,000 FRANCE BTF 0% 10/07/2024	6,295,023	5.41
6,000,000 FRANCE BTF 0% 11/09/2024	5,956,560	5.12
6,050,000 FRANCE BTF 0% 11/12/2024	5,953,140	5.11
6,500,000 FRANCE BTF 0% 14/08/2024	6,471,530	5.56
6,650,000 FRANCE BTF 0% 14/11/2024	6,561,289	5.64
6,650,000 FRANCE BTF 0% 16/10/2024	6,579,776	5.65
6,320,000 FRANCE BTF 0% 17/07/2024	6,310,394	5.42
6,610,000 FRANCE BTF 0% 18/09/2024	6,558,044	5.63
2,650,000 FRANCE BTF 0% 18/12/2024	2,605,745	2.24
6,450,000 FRANCE BTF 0% 21/08/2024	6,417,428	5.51
6,450,000 FRANCE BTF 0% 24/07/2024	6,435,617	5.53
5,750,000 FRANCE BTF 0% 28/08/2024	5,716,593	4.91
3,050,000 FRANCE BTF 0% 30/10/2024	3,013,766	2.59
6,550,000 FRANCE BTF 0% 31/07/2024	6,530,546	5.61
Gesamtwertpapierbestand	109,279,636	93.87

Die beigefügten Anmerkungen sind integraler Bestandteil dieses Geschäftsberichts.

	Erläut Amundi S.F. - Diversified Short-Term Bond ESG		Amundi S.F. - Euro Curve 7-10year	
	30.06.2024 EUR	30.06.2023 EUR	30.06.2024 EUR	30.06.2023 EUR
Aktiva				
<i>Wertpapiere zu Einstandspreisen</i>	829,371,399	1,096,855,229	68,619,453	69,306,585
<i>Realisierte Nettogewinne/(-verluste) aus Wertpapieren</i>	10,737,408	-27,320,085	-1,207,356	-4,024,889
Anlagen in Wertpapieren zum Marktwert	2 840,108,807	1,069,535,144	67,412,097	65,281,696
Zum Marktwert erworbene Optionskontrakte mit Vorabprämie	2, 10 1,345,997	1,950,006	-	-
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisentermingeschäften	2, 9 341,375	1,393,163	-	-
Nicht realisierter Nettogewinn aus Finanztermingeschäften	2, 8 -	6,281,611	157,735	-
Bareinlagen bei Banken und Maklern	47,884,643	66,565,626	539,529	2,465,392
Zinsguthaben	11,576,238	13,732,833	487,934	495,412
Guthaben aus Dividenden	-	-	-	-
Forderungen aus Zeichnungen	1,869,422	490,019	116,774	493,125
Forderungen aus Wertpapierverkäufen	202,626	3,363,083	-	-
Sonstige Forderungen	-	-	-	56,589
Gesamtsumme der Aktiva	903,329,108	1,163,311,485	68,714,069	68,792,214
Passiva				
Banküberziehung/Maklerverbindlichkeiten	-	-	14,129	-
Zum Marktwert ausgefertigte Optionskontrakte mit Vorabprämie	2, 10 773,313	1,470,715	-	-
Nicht realisierter Nettoverlust aus termingeschäftartigen Optionen	2, 10 223,520	-	16,780	28,280
Nicht realisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften	2, 9 -	-	-	-
Nicht realisierter Nettoverlust aus Finanztermingeschäften	2, 8 864,864	-	-	23,450
Nicht realisierter Nettoverlust aus Swapgeschäften	2, 11 74,299	2,573,071	334,481	398,139
Fällige Dividenden	-	-	16	24
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen	1,284,217	2,714,606	19,711	38,595
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen	5,600,000	16,823,504	-	-
Angefallene Kosten	2,620,082	1,940,838	184,719	159,440
Sonstige Verbindlichkeiten	375,444	-	4,604	96,742
Gesamtsumme der Passiva	11,815,739	25,522,734	574,440	744,670
Nettovermögen	891,513,369	1,137,788,751	68,139,629	68,047,544

Die beigegefügt Anmerkungen sind integraler Bestandteil dieses Geschäftsberichts.

	Erläut	Amundi S.F. - Euro Curve 10+year		Amundi S.F. - SBI FM India Bond	
		30.06.2024 EUR	30.06.2023 EUR	30.06.2024 USD	30.06.2023 USD
Aktiva					
Wertpapiere zu Einstandspreisen		76,290,736	63,097,227	67,220,159	43,968,515
Realisierte Nettogewinne/(-verluste) aus Wertpapieren		-7,711,335	-9,723,217	-920,609	-1,563,094
Anlagen in Wertpapieren zum Marktwert	2	68,579,401	53,374,010	66,299,550	42,405,421
Zum Marktwert erworbene Optionskontrakte mit Vorabprämie	2, 10	-	-	-	-
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisentermingeschäften	2, 9	-	-	31,390	52,160
Nicht realisierter Nettogewinn aus Finanztermingeschäften	2, 8	-	43,690	27,016	-
Bareinlagen bei Banken und Maklern		511,119	1,404,848	2,215,031	2,939,667
Zinsguthaben		836,374	625,082	1,041,356	549,321
Guthaben aus Dividenden		-	-	-	-
Forderungen aus Zeichnungen		2,203	120,633	-	-
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		3,698,056	-	-	-
Sonstige Forderungen		-	-	-	-
Gesamtsumme der Aktiva		73,627,153	55,568,263	69,614,343	45,946,569
Passiva					
Banküberziehung/Maklerverbindlichkeiten		110,115	-	-	-
Zum Marktwert ausgefertigte Optionskontrakte mit Vorabprämie	2, 10	-	-	-	-
Nicht realisierter Nettoverlust aus termingeschäftartigen Optionen	2, 10	10,710	25,630	-	-
Nicht realisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften	2, 9	-	-	-	-
Nicht realisierter Nettoverlust aus Finanztermingeschäften	2, 8	12,170	-	-	-
Nicht realisierter Nettoverlust aus Swapgeschäften	2, 11	222,987	709,693	-	-
Fällige Dividenden		-	-	-	-
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		52,514	26,424	-	-
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		3,087,622	-	199,963	-
Angefallene Kosten		172,378	130,902	428,753	292,970
Sonstige Verbindlichkeiten		3,070	-	-	-
Gesamtsumme der Passiva		3,671,566	892,649	628,716	292,970
Nettovermögen		69,955,587	54,675,614	68,985,627	45,653,599

Die beigegeführten Anmerkungen sind integraler Bestandteil dieses Geschäftsberichts.

	Erläut	Amundi S.F. - EUR Commodities		Konsolidiert	
		30.06.2024 EUR	30.06.2023 EUR	30.06.2024 EUR	30.06.2023 EUR
Aktiva					
Wertpapiere zu Einstandspreisen		108,597,713	143,517,679	1,151,911,468	1,450,019,773
Realisierte Nettogewinne/(-verluste) aus Wertpapieren		681,923	755,312	-4,670,732	-37,849,386
Anlagen in Wertpapieren zum Marktwert	2	109,279,636	144,272,991	1,147,240,736	1,412,170,387
Zum Marktwert erworbene Optionskontrakte mit Vorabprämie	2, 10	-	-	1,345,997	1,950,006
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisentermingeschäften	2, 9	464,129	-	834,792	1,440,972
Nicht realisierter Nettogewinn aus Finanztermingeschäften	2, 8	-	-	182,942	6,325,301
Bareinlagen bei Banken und Maklern		7,457,983	8,064,173	58,460,009	85,320,056
Zinsguthaben		-	28,285	13,872,183	15,385,114
Guthaben aus Dividenden		-	-	-	23,716
Forderungen aus Zeichnungen		76,264	110,611	2,064,663	1,214,428
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		-	1,548,953	3,900,682	4,912,036
Sonstige Forderungen		-	-	-	56,589
Gesamtsumme der Aktiva		117,278,012	154,025,013	1,227,902,004	1,528,798,605
Passiva					
Banküberziehung/Maklerverbindlichkeiten		-	-	124,244	-
Zum Marktwert ausgefertigte Optionskontrakte mit Vorabprämie	2, 10	-	-	773,313	1,470,715
Nicht realisierter Nettoverlust aus termingeschäftartigen Optionen	2, 10	-	-	251,010	53,910
Nicht realisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften	2, 9	-	502,761	-	502,761
Nicht realisierter Nettoverlust aus Finanztermingeschäften	2, 8	-	-	877,034	99,865
Nicht realisierter Nettoverlust aus Swapgeschäften	2, 11	654,194	769,901	1,285,961	4,450,804
Fällige Dividenden		-	-	16	24
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		44,626	126,129	1,401,068	2,929,236
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		-	1,544,923	8,874,197	18,368,427
Angefallene Kosten		165,659	332,179	3,542,886	3,050,922
Sonstige Verbindlichkeiten		-	-	383,118	96,742
Gesamtsumme der Passiva		864,479	3,275,893	17,512,847	31,023,406
Nettovermögen		116,413,533	150,749,120	1,210,389,157	1,497,775,199

Die beigegeführten Anmerkungen sind integraler Bestandteil dieses Geschäftsberichts.

Amundi S.F. - Diversified Short-Term Bond ESG

	ISIN	Anzahl der Einheiten		Währung	NIW je Einheit		NIW je Einheit 31.12.2022
		30.06.2024			30.06.2024	31.12.2023	
Klasse A jährliche Ausschüttung	LU2357810188	64,714.466		EUR	49.20	49.72	48.65
Klasse A keine Ausschüttung	LU1706854152	2,298,648.231		EUR	53.02	51.89	49.53
Klasse E Vierteljährliche Ausschüttung	LU1706854236	1,074.652		EUR	4.996	4.989	4.917
Klasse E keine Ausschüttung	LU1499628912	63,420,973.453		EUR	5.360	5.247	5.011
Klasse E keine Ausschüttung	LU1706854319	63,420,973.453		USD	5.745	5.796	5.348
Klasse F keine Ausschüttung	LU2357810428	576,898.149		EUR	5.146	5.050	4.847
Klasse H jährliche Ausschüttung	LU2357810691	543.947		EUR	988.66	1,000.40	975.35
Klasse H Vierteljährliche Ausschüttung	LU1889052269	1.191		EUR	1,011.25	1,008.72	991.16
Klasse H keine Ausschüttung	LU1503126044	120,476.752		EUR	1,097.11	1,072.34	1,020.97
Klasse I keine Ausschüttung	LU1706854400	246,772.281		EUR	1,084.36	1,059.43	1,007.82
Klasse R jährliche Ausschüttung	LU2357810931	211.577		EUR	49.49	50.09	48.80
Klasse R keine Ausschüttung	LU2357810774	440,318.086		EUR	52.70	51.51	49.04
Gesamtvermögen				EUR	891,513,369	893,059,060	1,348,948,819

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

	ISIN	Anzahl der Einheiten		Währung	NIW je Einheit		NIW je Einheit 31.12.2022
		30.06.2024			30.06.2024	31.12.2023	
Klasse A Ausschüttung	LU0536711285	140.005		EUR	63.88	65.54	61.80
Klasse A jährliche Ausschüttung	LU0536711103	172,666.349		EUR	67.93	70.14	65.31
Klasse A keine Ausschüttung	LU0367810172	38,666.675		EUR	78.57	80.05	74.45
Klasse C keine Ausschüttung	LU0536711442	17.007		EUR	59.70	61.20	57.67
Klasse E vierteljährliche Zielausschüttung	LU0857391824	156,628.217		EUR	4.838	5.003	4.747
Klasse E keine Ausschüttung	LU0271693920	3,030,529.579		EUR	7.301	7.457	6.970
Klasse F keine Ausschüttung	LU0271694654	443,502.825		EUR	6.588	6.747	6.341
Klasse H keine Ausschüttung	LU0332132041	17,029.995		EUR	1,575.90	1,605.15	1,492.11
Klasse I keine Ausschüttung	LU0433266433	354.516		EUR	1,452.00	1,477.48	1,370.83
Klasse R Ausschüttung	LU1706854665	103.140		EUR	44.98	46.15	43.52
Klasse R keine Ausschüttung	LU1706853857	4,264.357		EUR	46.83	47.60	44.18
Gesamtvermögen				EUR	68,139,629	80,172,529	65,951,028

Amundi S.F. - Euro Curve 10+year

	ISIN	Anzahl der Einheiten		Währung	NIW je Einheit		NIW je Einheit 31.12.2022
		30.06.2024			30.06.2024	31.12.2023	
Klasse A jährliche Ausschüttung	LU0281585215	14,088.675		EUR	76.53	81.60	75.36
Klasse E vierteljährliche Zielausschüttung	LU0857391741	636,117.617		EUR	4.749	5.060	4.740
Klasse E keine Ausschüttung	LU0271691981	3,785,525.370		EUR	7.201	7.578	6.990
Klasse F keine Ausschüttung	LU0271692013	1,320,022.626		EUR	6.500	6.858	6.361
Klasse H keine Ausschüttung	LU0332132397	18,100.541		EUR	1,657.89	1,739.86	1,596.06
Klasse I keine Ausschüttung	LU0433266516	5.000		EUR	1,590.08	1,667.10	1,527.09
Gesamtvermögen				EUR	69,955,587	68,648,052	48,314,242

Amundi S.F. - SBI FM India Bond

	ISIN	Anzahl der Einheiten		Währung	NIW je Einheit		NIW je Einheit
		30.06.2024			30.06.2024	31.12.2023	
Klasse A keine Ausschüttung	LU2251232760	500.000		USD	9.90	9.61	9.15
Klasse A2 Keine Ausschüttung	LU2251232844	500.000		USD	9.84	9.56	9.12
Klasse H keine Ausschüttung	LU2338645448	57,607.832		USD	1,010.31	978.15	924.35
Klasse H keine Ausschüttung	LU2338646925	8,738.754		EUR	1,077.33	1,012.00	-
Klasse I keine Ausschüttung	LU2251232927	0.500		USD	10,082.66	9,765.04	9,234.12
Klasse I2 Keine Ausschüttung	LU2251233065	67.500		USD	10,060.01	9,747.40	9,225.84
Gesamtvermögen				USD	68,985,627	51,004,559	42,934,062

Amundi S.F. - EUR Commodities

	ISIN	Anzahl der Einheiten		Währung	NIW je Einheit		NIW je Einheit
		30.06.2024			30.06.2024	31.12.2023	
Klasse A abgesichert keine Ausschüttung	LU1694769693	4,962.130		CHF	35.43	34.78	39.43
Klasse A abgesichert keine Ausschüttung	LU1694769859	425,542.836		USD	41.05	39.52	43.03
Klasse A keine Ausschüttung	LU0271695388	1,230,189.501		EUR	27.74	26.90	29.86
Klasse C abgesichert keine Ausschüttung	LU1694770196	7,557.383		USD	44.05	42.66	46.89
Klasse C keine Ausschüttung	LU0372625102	31,654.253		EUR	15.47	15.08	16.90
Klasse E keine Ausschüttung	LU0273973874	1,296,193.054		EUR	2.483	2.408	2.675
Klasse F keine Ausschüttung	LU0273974336	1,090,434.604		EUR	2.180	2.122	2.375
Klasse H jährliche Ausschüttung	LU0484923635	7.000		EUR	726.58	719.60	795.09
Klasse H abgesichert keine Ausschüttung	LU1772191695	3,329.830		USD	1,250.63	1,202.45	1,303.44
Klasse H keine Ausschüttung	LU0271872185	25,281.701		EUR	538.19	520.69	575.44
Klasse I jährliche Ausschüttung	LU1694770352	176.000		EUR	507.27	502.86	554.69
Klasse I abgesichert keine Ausschüttung	LU0419230916	9,854.652		USD	958.53	920.68	996.24
Klasse I keine Ausschüttung	LU0271695461	54,016.072		EUR	556.30	537.71	593.13
Klasse R abgesichert keine Ausschüttung	LU1706854582	6,039.914		USD	55.69	53.54	58.06
Klasse R keine Ausschüttung	LU1706853931	46,240.207		EUR	57.32	55.46	61.29
Gesamtvermögen				EUR	116,413,533	126,731,148	192,203,646

		Erläut Amundi S.F. - Diversified Short-Term Bond ESG		Amundi S.F. - Euro Curve 7-10year	
		30.06.2024 EUR	30.06.2023 EUR	30.06.2024 EUR	30.06.2023 EUR
Erträge					
Nettodividenden	2	149,032	237,620	-	-
Zinsen auf Wertpapiere	2	19,059,065	21,690,418	658,256	394,153
Zinsen auf Bankkonten	2	692,051	533,584	12,309	9,310
Zinsen auf Swapgeschäfte	2	25,000	761,024	499	129,880
Sonstige Erträge	13	12,604	13,773	1,012	-
Gesamtsumme der Erträge		19,937,752	23,236,419	672,076	533,343
Ausgaben					
Managementgebühren	4	2,025,919	2,992,016	269,723	234,305
Vertriebsgebühren	4	-	-	-	24
Depot- und Verwaltungsgebühren	6	352,905	626,091	40,490	36,396
„Taxe d'abonnement“	7	165,951	233,496	17,024	15,968
Honorare		21,539	27,026	1,786	1,448
Druck- und Veröffentlichungskosten		1,319	5,028	109	269
Transaktionskosten	17	165,271	300,983	17,334	12,867
Gebühren für Annahme und Übermittlung von Aufträgen		1,802,848	2,588,592	68,496	38,028
Zinsen auf Swapgeschäfte	2	1,023,469	432,258	121,151	145,839
Sonstige Kosten	14	251,608	348,017	18,876	13,621
Gesamtsumme der Ausgaben		5,810,829	7,553,507	554,989	498,765
Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums (01.01.2024)		893,059,060	1,348,948,819	80,172,529	65,951,028
Operativer Nettoertrag/(-verlust)		14,126,923	15,682,912	117,087	34,578
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Wertpapierverkäufen		14,966,730	-28,951,963	-587,451	-2,552,961
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Devisen		-1,707,657	-950,776	-29	-3,729
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Devisentermingeschäften		-3,225,311	7,581,545	-	-3,885
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Finanztermingeschäften		-1,950,772	-567,945	-110,101	828,416
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Optionskontrakten		1,095,950	-7,153,594	186,235	22,695
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Swapgeschäften		50,863	2,253,423	-30,311	-44,554
Realisierter Nettogewinn/(-verlust)		9,229,803	-27,789,310	-541,657	-1,754,018
Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus Wertpapieren		-7,773,487	27,414,666	-1,513,582	4,453,493
Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus Devisentermingeschäften		-774,612	-6,195,642	-	7,119
Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus Finanztermingeschäften		6,647,824	-7,027,291	422,020	-459,910
Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus Optionskontrakten		843,403	529,292	-29,620	-11,550
Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus Swapgeschäften		-2,875,630	-3,690,835	5,881	-29,482
Veränderung des nicht realisierten Nettojahresgewinns/(-verlusts)		-3,932,502	11,030,190	-1,115,301	3,959,670
Nettoanstieg/(-rückgang) des Nettovermögens durch das operative Geschäft		19,424,224	-1,076,208	-1,539,871	2,240,230
Nettozeichnungen/(-rücknahmen)		-20,808,682	-209,839,180	-10,323,307	-124,041
Dividendenausschüttungen	16	-161,233	-244,680	-169,722	-19,673
Neubewertung des kombinierten Nettovermögens		-	-	-	-
Nettovermögen am Ende des Zeitraums		891,513,369	1,137,788,751	68,139,629	68,047,544

Die beigegeführten Anmerkungen sind integraler Bestandteil dieses Geschäftsberichts.

Erläut Amundi S.F. - Euro Curve 10+year

Amundi S.F. - SBI FM India Bond

		30.06.2024 EUR	30.06.2023 EUR	30.06.2024 USD	30.06.2023 USD
Erträge					
Nettodividenden	2	-	-	-	-
Zinsen auf Wertpapiere	2	964,305	697,135	1,564,054	1,297,584
Zinsen auf Bankkonten	2	14,049	11,366	44,639	58,433
Zinsen auf Swapgeschäfte	2	400	47,761	-	-
Sonstige Erträge	13	519	16	-	79
Gesamtsumme der Erträge		979,273	756,278	1,608,693	1,356,096
Ausgaben					
Managementgebühren	4	317,512	200,793	117,172	89,527
Vertriebsgebühren	4	-	-	-	-
Depot- und Verwaltungsgebühren	6	34,342	26,141	56,391	61,651
„Taxe d'abonnement“	7	17,917	12,761	15,935	11,254
Honorare		1,736	1,114	15,985	12,077
Druck- und Veröffentlichungskosten		106	207	95	178
Transaktionskosten	17	16,289	8,568	501	-
Gebühren für Annahme und Übermittlung von Aufträgen		56,057	24,710	18,744	10,833
Zinsen auf Swapgeschäfte	2	92,439	85,458	-	-
Sonstige Kosten	14	22,205	11,858	280,927	133,631
Gesamtsumme der Ausgaben		558,603	371,610	505,750	319,151
Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums (01.01.2024)		68,648,052	48,314,242	51,004,559	42,934,062
Operativer Nettoertrag/(-verlust)		420,670	384,668	1,102,943	1,036,945
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Wertpapierverkäufen		-2,826,548	-2,032,079	-22,171	-1,007,621
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Devisen		-20	-6,182	14,552	13,154
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Devisentermingeschäften		-	-20,767	30,481	73,624
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Finanztermingeschäften		-314,018	37,200	-164,039	-
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Optionskontrakten		218,765	-29,228	-	-
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Swapgeschäften		-428,995	26,352	-	-
Realisierter Nettogewinn/(-verlust)		-3,350,816	-2,024,704	-141,177	-920,843
Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus Wertpapieren		-839,249	3,758,368	748,348	1,871,127
Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus Devisentermingeschäften		-	26,068	27,315	103,660
Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus Finanztermingeschäften		-102,815	150,020	27,016	-
Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus Optionskontrakten		-15,930	-13,540	-	-
Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus Swapgeschäften		414,083	-26,585	-	-
Veränderung des nicht realisierten Nettojahresgewinns/(-verlusts)		-543,911	3,894,331	802,679	1,974,787
Nettoanstieg/(-rückgang) des Nettovermögens durch das operative Geschäft		-3,474,057	2,254,295	1,764,445	2,090,889
Nettozeichnungen/(-rücknahmen)		4,832,080	4,112,819	16,216,623	628,648
Dividendenausschüttungen	16	-50,488	-5,742	-	-
Neubewertung des kombinierten Nettovermögens		-	-	-	-
Nettovermögen am Ende des Zeitraums		69,955,587	54,675,614	68,985,627	45,653,599

Die beigegeführten Anmerkungen sind integraler Bestandteil dieses Geschäftsberichts.

	Erläut	Amundi S.F. - EUR Commodities		Konsolidiert	
		30.06.2024 EUR	30.06.2023 EUR	30.06.2024 EUR	30.06.2023 EUR
Erträge					
Nett dividenden	2	-	-	149,032	988,146
Zinsen auf Wertpapiere	2	84,107	149,678	22,225,074	24,120,737
Zinsen auf Bankkonten	2	168,429	167,958	928,488	789,604
Zinsen auf Swapgeschäfte	2	-	-	25,899	938,665
Sonstige Erträge	13	48	516	14,183	14,486
Gesamtsumme der Erträge		252,584	318,152	23,342,676	26,851,638
Ausgaben					
Managementgebühren	4	444,715	590,018	3,167,196	4,443,058
Vertriebsgebühren	4	4,034	5,222	4,034	5,372
Depot- und Verwaltungsgebühren	6	69,166	102,518	549,519	888,215
„Taxe d'abonnement“	7	21,393	27,541	237,153	311,311
Honorare		3,041	3,657	43,017	45,288
Druck- und Veröffentlichungskosten		64	680	1,687	6,528
Transaktionskosten	17	-	-	199,361	350,547
Gebühren für Annahme und Übermittlung von Aufträgen		19,340	25,687	1,964,230	2,704,453
Zinsen auf Swapgeschäfte	2	-	-	1,237,059	663,555
Sonstige Kosten	14	33,964	80,284	588,772	586,811
Gesamtsumme der Ausgaben		595,717	835,607	7,992,028	10,005,138
Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums (01.01.2024)		126,731,148	192,203,646	1,214,783,177	1,772,647,601
Operativer Nettoertrag/(-verlust)		-343,133	-517,455	15,350,648	16,846,500
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Wertpapierverkäufen		2,430,310	954,595	13,962,354	-31,982,549
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Devisen		84,019	-37,269	-1,610,109	-976,229
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Devisentermingeschäften		-70,203	-224,094	-3,267,074	7,400,282
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Finanztermingeschäften		-	-	-2,527,948	-2,214,651
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Optionskontrakten		-	-	1,500,950	-7,160,127
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Swapgeschäften		5,277,068	-16,455,835	4,868,625	-14,220,614
Realisierter Nettogewinn/(-verlust)		7,721,194	-15,762,603	12,926,798	-49,153,888
Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus Wertpapieren		-322,096	710,635	-9,750,168	41,554,815
Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus Devisentermingeschäften		1,048,942	-135,387	299,816	-6,202,828
Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus Finanztermingeschäften		-	-	6,992,236	-9,014,436
Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus Optionskontrakten		-	-	797,853	504,202
Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus Swapgeschäften		-2,807,870	-3,499,248	-5,263,536	-7,246,150
Veränderung des nicht realisierten Nettojahresgewinns/(-verlusts)		-2,081,024	-2,924,000	-6,923,799	19,595,603
Nettoanstieg/(-rückgang) des Nettovermögens durch das operative Geschäft		5,297,037	-19,204,058	21,353,647	-12,711,785
Nettozeichnungen/(-rücknahmen)		-15,612,409	-22,250,468	-26,781,398	-230,337,012
Dividendenausschüttungen	16	-2,243	-	-383,686	-270,095
Neubewertung des kombinierten Nettovermögens		-	-	1,417,417⁽¹⁾	-31,553,510⁽²⁾
Nettovermögen am Ende des Zeitraums		116,413,533	150,749,120	1,210,389,157	1,497,775,199

⁽¹⁾Die Überschrift „Neubewertung des konsolidierten Nettovermögens“ mit einem Betrag von EUR 1,417,417 in der Kombinierten Gewinn- und Verlustrechnung und den Veränderungen des Nettovermögens zum 30. Juni 2024 enthält: die Ergebnisse der Veränderungen der Wechselkurse zwischen dem 31. Dezember 2023 und dem 30. Juni 2024 zur Umrechnung des „Nettoinventarwerts zu Beginn des Jahres“ für Teilfonds, die auf eine andere Währung als die konsolidierte Währung lauten..

⁽²⁾Die Überschrift „Neubewertung des konsolidierten Nettovermögens“ mit einem Betrag von EUR -31,553,510 in der Kombinierten Gewinn- und Verlustrechnung und den Veränderungen des Nettovermögens zum 30. Juni 2023 enthält: Die Ergebnisse der Veränderungen der Wechselkurse zwischen dem 31. Dezember 2022 und dem 30. Juni 2023 zur Umrechnung des „Nettoinventarwerts zu Beginn des Jahres“ für Teilfonds, die auf eine andere Währung als die konsolidierte Währung lauten.

1 EINLEITUNG

Amundi S.F. (der „Fonds“) ist organisiert als *Fonds Commun de Placement* (FCP) mit mehreren separaten Teilfonds (jeweils ein „Teilfonds“ und zusammen die „Teilfonds“). Der Fonds ist ein am 6. Juni 2003 gegründeter Organismus für gemeinsame Anlagen in Wertpapiere (OGAW) und fällt unter Teil I des geänderten Luxemburger Gesetzes vom 17. Dezember 2010 über Organismen für gemeinsame Anlagen. Er unterliegt den zum Jahresende wirksamen Verwaltungsvorschriften, die letztmals am 31. März 2021 aktualisiert und am 21. April 2021 im Recueil Electronique des Sociétés et Associations (RESA, elektronisches Verzeichnis der Gesellschaften und Vereine) veröffentlicht wurden.

Der Fonds stellt ein gemeinsames Eigentum ohne Rechtspersönlichkeit an Wertpapieren und anderen Vermögenswerten dar. Er wird verwaltet von Amundi Luxembourg S.A. (die „Verwaltungsgesellschaft“), eine als Aktiengesellschaft („société anonyme“) gemäß Kapitel 15 des Gesetzes vom 17. Dezember 2010 in seiner jeweils gültigen Fassung organisierte hundertprozentige Tochtergesellschaft von Amundi Asset Management S.A.S, eingetragen im Handels- und Firmenregister unter der Nummer B 57.255 mit eingetragenem Sitz in Luxemburg. Er wurde am 20. Dezember 1996 auf unbestimmte Zeit gegründet. Seine Satzung wurde am 28. Januar 1997 im Mémorial veröffentlicht und letztmals am 1. Januar 2018 geändert.

Die Vermögenswerte der verschiedenen Teilfonds werden separat im Einklang mit ihrer jeweiligen Anlagepolitik und ihren Anlagezielen angelegt. Alle Teilfonds lauten in EUR oder USD (die „Basiswährung“) und alle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten der einzelnen Teilfonds werden in der Basiswährung dieses Teilfonds bewertet. Der Nettoinventarwert („NIW“) je Einheit in einer anderen Währung als Euro ist die tägliche Umrechnung des NIW je Einheit in Euro.

Folgender Teilfonds wurde am 16. Januar 2024 liquidiert:

Amundi S.F. - Amundi Target Trend 2024

Folgender Teilfonds wurde am 28. Februar 2024 liquidiert:

Amundi S.F. - SMBC Amundi Protect Fund USD Step 201803

Zum 30. Juni 2024 gab es die nachstehend aufgeführten 5 aktiven Teilfonds:

Anleiheiteilfonds

Amundi S.F. - Diversified Short-Term Bond ESG

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

Amundi S.F. - Euro Curve 10+year

Amundi S.F. - SBI FM India Bond

Rohstoffteilfonds

Amundi S.F. - EUR Commodities

Unter „Finanzielle Angaben zu den vergangenen drei Jahren“ sind die einzelnen, zum 30. Juni 2024 aktiven Anteilklassen aufgelistet, die im aktuellen Prospekt beschrieben werden.

2 GRUNDSÄTZE DER RECHNUNGSLEGUNG

■ PRÄSENTATION DES GESCHÄFTSBERICHTS

Dieser Geschäftsbericht wird erstellt in Übereinstimmung mit den in Luxemburg geltenden gesetzlichen und behördlichen Vorschriften für Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapiere sowie den in Luxemburg allgemein anerkannten Grundsätzen der Rechnungslegung.

Der Finanzbericht gibt die am letzten Geschäftstag des Zeitraums auf Grundlage der letzten verfügbaren Marktpreise der Anlagen berechneten Nettoinventarwerte („NIW“) wieder.

Bewertung von Anlagen und andere Anlagen

Es gilt folgende Preispolitik:

- **Bewertung von Anlagen** - An Börsen oder regulierten Märkten oder anderen regulierten Märkten notierte oder gehandelte Anlagen werden am jeweiligen Bewertungstag um 18:00 Uhr Luxemburger Zeit bewertet. Hiervon ausgenommen ist der Teilfonds Amundi S.F. - European Equity Optimal Volatility, dessen Anlagen zu den letzten verfügbaren Kursen um 22:00 Uhr Luxemburger Zeit bewertet werden. Der Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft des Fonds überprüft regelmäßig die Preisfindungsregeln (Bid/Mid/Ask) der einzelnen Teilfonds, und sie können an den Anlagezyklus und/oder das Anlageziel des jeweiligen Teilfonds angepasst werden. Falls gehaltene Vermögenswerte des Portfolios eines Teilfonds am entsprechenden Tag nicht an einer Börse oder an einem regulierten Markt oder einem anderen regulierten Markt notiert oder gehandelt werden oder falls der letzte verfügbare Kurs (der gemäß vorstehendem Absatz ermittelt wurde) von Vermögenswerten, die an einer Börse notiert oder gehandelt oder an so einem Markt gehandelt werden, den Marktwert des entsprechenden Vermögenswerts nicht angemessen wiedergibt, basiert der Wert dieser Vermögenswerte auf dem vernünftigerweise vorhersehbaren Kurs, den der Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft umsichtig und in gutem Glauben ermittelt.
- **Offene und geschlossene OGA** - Einheiten oder Anteile offener OGA werden zu ihrem letzten ermittelten und verfügbaren Nettoinventarwert bewertet. Falls dieser Preis den Marktwert dieser Vermögenswerte nicht angemessen wiedergibt, ermittelt der Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft den Preis umsichtig und in gutem Glauben. Einheiten oder Anteile geschlossener OGA werden zu ihrem letzten verfügbaren Marktwert bewertet.
- **Devisentermingeschäfte** - Devisentermingeschäfte werden bewertet zum am Datum der „Nettovermögensaufstellung“ geltenden Terminkurs für den Zeitraum bis zu ihrer Fälligkeit. Nicht realisierte Nettogewinne und -verluste aus Devisentermingeschäften werden in der „Nettovermögensaufstellung“ verbucht. Realisierte Nettogewinne/(-verluste) bzw. Veränderungen nicht realisierter Nettogewinne/(-verluste) aus Devisentermingeschäften werden unter „Aufwands- und Ertragsrechnung und Veränderungen des Nettovermögens“ verbucht. Der Fonds bietet auch abgesicherte Anteilklassen an. Alle Gewinne/(Verluste) aus in abgesicherten Anteilklassen verwendeten Devisentermingeschäften werden ausschließlich der entsprechenden Anteilklasse zugeteilt.
- **Finanztermingeschäfte** - Finanztermingeschäfte werden zum verfügbaren offiziellen Börsenpreis bewertet (gemäß der vorstehend unter „Bewertung von Anlagen“ beschriebenen Preispolitik). Ersteinschusszahlungen erfolgen bei Abschluss der Termingeschäfte in bar. Der Teilfonds zahlt oder erhält regelmäßig nachfolgende Zahlungen, die Schwankungsmargen genannt werden. Sie basieren auf Änderungen des Marktwerts offener Termingeschäfte. Nicht realisierte Nettogewinne und -verluste aus Finanztermingeschäften werden in der „Nettovermögensaufstellung“ verbucht. Realisierte Nettogewinne/(-verluste) bzw. Veränderungen nicht realisierter Nettogewinne/(-verluste) aus Finanztermingeschäften werden unter „Aufwands- und Ertragsrechnung und Veränderungen des Nettovermögens“ verbucht. Bei Abschluss des Kontrakts verzeichnet der betroffene Teilfonds einen realisierten Gewinn bzw. Verlust in Höhe der Differenz zwischen den Erlösen (bzw. den Kosten) aus dem Abschluss- und dem Eröffnungsgeschäft.
- **Optionskontrakte mit Vorabprämie** - Wenn der Teilfonds einen Optionskontrakt mit Vorabprämie erwirbt, zahlt er eine Prämie und ein Betrag in Höhe dieser Prämie wird als Vermögenswert verbucht. Wenn der Teilfonds eine Option mit Vorabprämie ausfertigt, erhält er eine Prämie und ein Betrag in Höhe dieser Prämie wird als Verbindlichkeit verbucht.

Der Vermögenswert bzw. die Verbindlichkeit wird täglich angepasst, um den aktuellen Marktwert des Optionskontrakts wiederzugeben.

Optionskontrakte, die an einer Börse oder an einem regulierten Markt oder an einem anderen regulierten Markt notiert oder gehandelt werden, werden zum Börsenpreis bewertet (gemäß der vorstehend unter „Bewertung von Anlagen“ beschriebenen Preispolitik). Außerbörslich gehandelte Optionen werden zum aktuellen Marktpreis je nach täglich von Dritten berechneten Preisen bewertet und mit dem von der Gegenpartei erhaltenen Wert abgeglichen.

Sind die letzten verfügbaren Kurse nicht repräsentativ, so beruht die Bewertung auf dem möglichen Realisierungswert, den der Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft umsichtig und in gutem Glauben schätzt.

Wenn eine Option nicht ausgeübt wird und verfällt, erzielt der Teilfonds einen Gewinn bzw. Verlust in Höhe der erhaltenen oder gezahlten Prämie. Erhaltene oder gezahlte Prämien und nicht realisierte Nettogewinne und -verluste aus Optionskontrakten werden in der „Nettovermögensaufstellung“ unter „Zum Marktwert erworbene Optionskontrakte mit Vorabprämie“ oder „Zum Marktwert ausgefertigte Optionskontrakte mit Vorabprämie“ verbucht.

Realisierte Nettogewinne/(-verluste) bzw. Veränderungen nicht realisierter Nettogewinne/(-verluste) aus Optionskontrakten werden unter „Aufwands- und Ertragsrechnung und Veränderungen des Nettovermögens“ verbucht.

- **Termingeschäftartige Optionen** - Termingeschäftartige Optionen werden zum verfügbaren offiziellen Börsenpreis bewertet (gemäß der vorstehend unter „Bewertung von Anlagen“ beschriebenen Preispolitik). Ersteinschusszahlungen werden bei Abschluss des Kontrakts in bar bezahlt. Der Teilfonds zahlt oder erhält regelmäßig nachfolgende positive oder negative Barmittelflüsse, die Schwankungsmargen genannt werden. Sie basieren auf Änderungen des Marktwerts offener Optionen. Bei Abschluss des Kontrakts verzeichnet der betroffene Teilfonds einen realisierten Gewinn bzw. Verlust in Höhe der Differenz zwischen den Erlösen (bzw. den Kosten) aus dem Abschluss- und dem Eröffnungsgeschäft.

Nicht realisierte Nettogewinne und -verluste aus termingeschäftartigen Optionen werden in der „Nettovermögensaufstellung“ verbucht.

Realisierte Nettogewinne/(-verluste) bzw. Veränderungen nicht realisierter Nettogewinne/(-verluste) aus termingeschäftartigen Optionen werden unter „Aufwands- und Ertragsrechnung und Veränderungen des Nettovermögens“ verbucht.

- **Swappeschäfte** - Teilfonds können verschiedene Arten von Swappeschäften eingehen, etwa Zinsswaps, Swaptions, Inflationsswaps, Credit Default Swaps und Total Return Swaps. Nicht realisierte Nettogewinne und -verluste aus Swappeschäften werden in der „Nettovermögensaufstellung“ verbucht. Swappeschäfte werden zum angemessenen Marktwert bewertet, der gemäß den vom Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft festgelegten Verfahren umsichtig und in gutem Glauben ermittelt wird.

Swappeschäfte werden an jedem Berechnungsdatum des Nettoinventarwerts zum aktuellen Marktpreis bewertet. Der Marktwert basiert auf der Bewertung von im Kontrakt festgeschriebenen Aspekten und von externen Anbietern, Wertpapierhändlern oder internen Modellen gemäß den vom Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft festgelegten Verfahren bezogen.

Effektive Zinskosten/-einnahmen aus Swaps werden vollständig unter „Aufwands- und Ertragsrechnung und Veränderungen des Nettovermögens“ verbucht. Angefallene Kosten/Erträge aus Swaps werden an jedem Berechnungsdatum des Nettoinventarwerts für jedes Swappeschäft aufgerechnet und der resultierende Nettosaldo je Swap wird entweder als Zinsaufwand oder Zinsertrag aus Swaps in der „Aufwands- und Ertragsrechnung und Veränderungen des Nettovermögens“ ausgewiesen.

- **Erträge** - Zinseinkünfte werden auf Tagesbasis verrechnet. Dividenden werden nach Abzug von Quellensteuern ausgewiesen und als Erträge am Tag der Dividendenzahlung verbucht.
- **Realisierte Nettogewinne und -verluste** – Realisierte Nettogewinne und -verluste umfassen die Gewinne oder Verluste aus dem Handel mit Wertpapieren und anderen Anlagen, Finanztermingeschäften, Devisentermingeschäften, Optionen, CFDs, Swaps und anderen Anlagen im Laufe des Jahres, sowie Differenzen aus der Neubewertung anderer in anderen Währungen lautenden Vermögenswerte und Verbindlichkeiten zum Jahresende. Realisierte Nettogewinne- und -verluste werden auf Grundlage der gewichteten Durchschnittskosten verkaufter Anlagen ermittelt. Hiervon ausgenommen sind Termingeschäfte und CFDs, bei denen das FIFO-Verfahren (First-In First-Out) zur Anwendung kommt.
- **Konsolidierter Geschäftsbericht** - Die Zahlen der einzelnen Teilfonds werden in ihrer jeweiligen Basiswährung ausgewiesen. Der konsolidierte Geschäftsbericht wird in Euro wiedergegeben und die Summe des Nettovermögens der Teilfonds, die in einer anderen Währung lauten, wird zum Ende des Zeitraums geltenden Wechselkurs in Euro umgerechnet. Der konsolidierte Geschäftsbericht wird nur zu Informationszwecken vorgelegt.
- **Wertpapierleihgeschäfte** - Teilfonds können Wertpapiere in ihren Portfolios an einen Entleiher verleihen. Der Teilfonds erhält für diese Transaktion eine Sicherheit als Garantie. Verliehene Wertpapiere werden einem externen Makler überlassen und diese Vermögenswerte werden weiterhin als Teil des Portfolios des Teilfonds bewertet. Am Ende eines Leihgeschäfts muss der Teilfonds dem Entleiher die erhaltene Sicherheit zurückgeben. Die Parteien können Leihgeschäfte jederzeit beenden. Ein Teilfonds erhält durch Wertpapierleihgeschäfte zusätzliche Erträge je nach den vertraglichen Vereinbarungen. Diese Vergütung wird unter „Aufwands- und Ertragsrechnung und Veränderungen des Nettovermögens“ ausgewiesen.

3 VERWENDETE WECHSELKURSE ZUM 30. JUNI 2024

Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, die in anderen Währungen als der Basiswährung des entsprechenden Teilfonds lauten, werden zu den am 30. Juni 2024 geltenden Wechselkursen umgerechnet. Gewinne und Verluste aus Devisenvorgängen werden unter „Aufwands- und Ertragsrechnung und Veränderungen des Nettovermögens“ erfasst. Transaktionen in Fremdwährungen werden zu den am Transaktionsdatum geltenden Wechselkursen in die Basiswährung des entsprechenden Teilfonds umgerechnet.

Zum 30. Juni 2024 wurden folgende Wechselkurse verwendet:

1 EUR =		1 EUR =	
1.60480	AUD	1,475.26390	KRW
5.95295	BRL	19.59745	MXN
1.46655	CAD	5.05600	MYR
0.96305	CHF	11.41150	NOK
1,011.65170	CLP	1.75885	NZD
7.82465	CNH	62.81420	PHP
7.78740	CNY	4.30850	PLN
4,441.49330	COP	4.97720	RON
25.04550	CZK	92.43850	RUB
1.95583	DEM	4.02075	SAR
7.45745	DKK	11.35000	SEK
0.84785	GBP	1.45250	SGD
8.36760	HKD	39.33055	THB
394.92500	HUF	35.13575	TRY
17,549.90700	IDR	34.76915	TWD
4.03750	ILS	1.07175	USD
89.37055	INR	19.57015	ZAR
172.40170	JPY		

4 VERWALTUNGS-, ANLAGEVERWALTUNGS- UND VERTRIEBSGEBÜHREN

Die Verwaltungsgebühr ist ein Prozentanteil am Nettoinventarwert jedes Teilfonds. Laut Prospekt liegt sie je nach Teilfonds und Anteilklasse zwischen 0.30% und 2.25% pro Jahr.

Die Verwaltungsgebühren für Anteile der Klasse X werden von der Verwaltungsgesellschaft berechnet und direkt vom Anteilinhaber eingezogen. Sie werden nicht dem Teilfonds berechnet oder im Nettoinventarwert wiedergegeben.

Zum 30. Juni 2024 wurden die folgenden effektiven Gebührensätze für Verwaltungsgebühren angewendet:

Teilfonds	Klasse A	Klasse A2	Klasse B	Klasse C	Klasse E	Klasse F	Klasse G	Klasse H	Klasse I	Klasse I2	Klasse R	Klasse U	Klasse W	Klasse W1
Amundi S.F. - Diversified Short-Term Bond ESG	0.60%	*	*	*	0.60%	1.10%	*	0.35%	0.30%	*	0.30%	*	*	*
Amundi S.F. - Euro Curve 7-10year	0.60%	*	*	0.90%	1.05%	1.60%	*	0.55%	0.40%	*	0.40%	*	*	*
Amundi S.F. - Euro Curve 10+year	0.60%	*	*	*	1.05%	1.60%	*	0.55%	0.40%	*	*	*	*	*
Amundi S.F. - SBI FM India Bond	1.10%	1.30%	*	*	*	*	*	0.40%	0.50%	0.60%	*	*	*	*
Amundi S.F. - EUR Commodities	1.00%	*	*	1.00%	1.00%	1.75%	*	0.55%	0.40%	*	0.55%	*	*	*

*Nicht aufgelegt und/oder nicht anwendbar

Die Vertriebsgebühr ist ein Prozentanteil am Nettoinventarwert jedes Teilfonds. Laut Prospekt liegt sie je nach Anteilklasse zwischen 0.00% und bis zu 1.00% pro Jahr.

Zum 30. Juni 2024 wurden die folgenden effektiven Gebührensätze für Vertriebsgebühren angewendet:

Teilfonds	Klasse A	Klasse A2	Klasse B	Klasse C	Klasse E	Klasse F	Klasse G	Klasse H	Klasse I	Klasse I2	Klasse K	Klasse R	Klasse U	Klasse W	Klasse W1
Amundi S.F. - Diversified Short-Term Bond ESG	*	*	*	*	*	*	*	*	*	*	*	*	*	*	*
Amundi S.F. - Euro Curve 7-10year	*	*	*	1.00%	*	*	*	*	*	*	*	*	*	*	*
Amundi S.F. - Euro Curve 10+year	*	*	*	*	*	*	*	*	*	*	*	*	*	*	*
Amundi S.F. - SBI FM India Bond	*	*	*	*	*	*	*	*	*	*	*	*	*	*	*
Amundi S.F. - EUR Commodities	*	*	*	1.00%	*	*	*	*	*	*	*	*	*	*	*

*Nicht aufgelegt und/oder nicht anwendbar

Die Verwaltungs- und die Vertriebsgebühr fallen an jedem Bewertungstag an und werden auf Grundlage des Nettoinventarwerts des Teilfonds und der Anteilklasse berechnet. Sie sind jeden Monat rückwirkend zahlbar.

Die Verwaltungsgesellschaft bezahlt die Anlageverwalter im Einklang mit den Verwaltungsvorschriften des Fonds aus der zu zahlenden Verwaltungsgebühr.

5 ERFOLGSABHÄNGIGE GEBÜHR

Bei bestimmten Einheitsklassen bestimmter Teilfonds erhält die Verwaltungsgesellschaft unter Umständen eine erfolgsabhängige Gebühr, wenn sich der Nettoinventarwert je Einheit der Klasse während des Leistungszeitraums wie im Prospekt ausgewiesen besser entwickelt als sein Vergleichsindex oder seine Erfolgshürde überschreitet.

Die erfolgsabhängige Gebühr für den Diversified Short Term Bond ESG und den SBI FM India Bond wird anhand der Benchmarkmethode berechnet.

Die Berechnung der erfolgsabhängigen Gebühren gilt für jede betroffene Einheitsklasse und am jeweiligen Datum der Berechnung des Nettoinventarwerts. Die Berechnung basiert auf dem Vergleich zwischen:

- dem Nettoinventarwert der entsprechenden Einheitsklasse (vor Abzug der erfolgsabhängigen Gebühr); und
- Die Referenzanlage, die den NIW der entsprechenden Anteilklasse am ersten Tag des Beobachtungszeitraums der Wertentwicklung (vor Abzug der erfolgsabhängigen Gebühr) darstellt und nachbildet, berichtigt um Zeichnungen/Rücknahmen und unter Berücksichtigung des Vergleichsindex der erfolgsabhängigen Gebühren bzw. der Erfolgshürde (wie für die jeweiligen Teilfonds und Anteilklassen angegeben).

Die erfolgsabhängigen Gebühren sind ein Prozentanteil der positiven Differenz zwischen dem Nettovermögen der Anteilklasse (vor Abzug der erfolgsabhängigen Gebühr) und der Referenzanlage, sofern folgende kumulative Bedingungen erfüllt sind:

- die Differenz ist positiv;
- die relative Wertentwicklung der Anteilklasse im Vergleich zur Referenzanlage ist seit Beginn des Beobachtungszeitraums der Wertentwicklung positiv oder null. Eine schlechtere Wertentwicklung innerhalb der vergangenen fünf Jahre muss zurückgefordert werden, bevor eine neue erfolgsabhängige Gebühr anfällt.

Ab 1. Januar 2022 wird der Vergleich über einen Beobachtungszeitraum der Wertentwicklung von höchstens fünf Jahren durchgeführt. Das Datum der Fälligkeit ist dabei der 31. Dezember des jeweiligen Jahres (nachstehend das „Datum der Fälligkeit“).

Bei Teilfonds mit einem Fälligkeitsdatum wird die Wertentwicklung ab dem Auflegungsdatum der entsprechenden Anteilklasse über einen Beobachtungszeitraum verglichen, der am Fälligkeitsdatum des Teilfonds endet.“

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

Die Depot- und Zahlstelle und die Verwaltungs-, Register- und Transferstelle erhalten für ihre Dienstleistungen die nachstehend aufgeführten Gebühren aus den Vermögenswerten der entsprechenden Teilfonds.

- **Depot- und Zahlstelle:** Die Depot-, die Zahl- und die Verwaltungsstelle sind zum Erhalt einer Gebühr berechtigt, die einem Prozentanteil der Vermögenswerte des jeweiligen Teilfonds (oder ggf. der jeweiligen Einheitsklasse) entspricht. Je nach Land, in dem die Vermögenswerte des jeweiligen Teilfonds gehalten werden, liegt dieser Prozentanteil zwischen 0.003 % und 0.5 % der dem jeweiligen Teilfonds oder der jeweiligen Einheitsklasse zugrunde liegenden Vermögenswerte. Diese Gebühr ist vierteljährlich rückwirkend fällig.
- **Verwaltungsstelle:** Die Gebühr für die erbrachten wesentlichen Dienstleistungen beläuft sich auf einen Jahressatz von 0.01 %. Sie fällt an jedem Bewertungstag an und wird an jedem Bewertungstag auf Grundlage des Nettoinventarwerts des entsprechenden Teilfonds berechnet. Sie ist monatlich rückwirkend fällig.
- **Register- und Transferstelle:** Die Vergütung der bereitgestellten Dienstleistungen erfolgt im Wesentlichen anhand der Anzahl vorhandener aktiver Anteilklassen, der Anzahl der Kundenkonten und der Anzahl bearbeiteter Transaktionen.

7 BESTEUERUNG DES FONDS - TAXE D'ABONNEMENT

Den zurzeit in Luxemburg geltenden Gesetzen zufolge unterliegt der Fonds keinen Einkommens- oder Kapitalertragsteuern. Der Fonds unterliegt der Zeichnungssteuer *Taxe d'abonnement*. Diese beläuft sich auf einen Jahressatz von 0.05% des Nettoinventarwerts der einzelnen Teilfonds am Ende jedes Kalenderquartals und wird vierteljährlich berechnet und gezahlt. Bei Anteilklassen, die sich nur an geeignete institutionelle Anleger richten und Teilfonds, deren alleiniges Ziel die gemeinsame Anlage in Geldmarktinstrumente und Einlagen bei Kreditinstituten ist, verringert sich diese Steuer um 0.01% des Nettoinventarwerts.

Gemäß Artikel 175 (a) des geänderten Gesetzes vom 17. Dezember 2010 ist Nettovermögen, das in OGA investiert ist, die bereits der *Taxe d'abonnement* unterliegen, von dieser Steuer befreit.

Zins- und Dividendenerträge des Fonds können im Ursprungsland einer nicht erstattungsfähigen Quellensteuer unterliegen.

8 OFFENE POSITIONEN AUS TERMINGESCHÄFTEN

Zum 30. Juni 2024 hatten bestimmte Teilfonds die folgenden Positionen aus Termingeschäften.

Amundi S.F. - Diversified Short-Term Bond ESG

Anzahl der Kontrakte Kauf/Verkauf	Bezeichnung	Fälligkeit datum	Währung	Nicht realisierter Gewinn/Verlust in EUR
-3,897	EURO BOBL	09-2024	EUR	-3,055,750.00
547	EURO BUND	09-2024	EUR	-357,960.00
-325	EURO BUXL	09-2024	EUR	-273,040.00
9,096	EURO SCHATZ	09-2024	EUR	3,304,470.00
-836	EURO-OAT FUTURES	09-2024	EUR	360,000.00
-318	LONG GILT	09-2024	GBP	-309,429.73
-330	US 10 YR NOTE FUTURE	09-2024	USD	-242,462.68
-295	US 10YR ULTRA T NOTE	09-2024	USD	-298,024.47
1,975	US 2 YR NOTE FUTURE	09-2024	USD	931,325.80
-1,406	US 5 YR NOTE FUTURE	09-2024	USD	-923,992.59
Total:				-864,863.67

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

Anzahl der Kontrakte Kauf/Verkauf	Bezeichnung	Fälligkeit datum	Währung	Nicht realisierter Gewinn/Verlust in EUR
-22	EURO BOBL	09-2024	EUR	-23,980.00
132	EURO BUND	09-2024	EUR	118,050.00
-34	EURO BUXL	09-2024	EUR	-29,240.00
65	EURO SCHATZ	09-2024	EUR	35,415.00
-8	EURO-BTP FUTURE	09-2024	EUR	1,280.00
-43	EURO-OAT FUTURES	09-2024	EUR	56,210.00
Total:				157,735.00

Amundi S.F. - Euro Curve 10+year

Anzahl der Kontrakte Kauf/Verkauf	Bezeichnung	Fälligkeit datum	Währung	Nicht realisierter Gewinn/Verlust in EUR
124	EURO BUND	09-2024	EUR	20,490.00
-14	EURO BUXL	09-2024	EUR	-12,040.00
39	EURO-BTP FUTURE	09-2024	EUR	-48,360.00
-66	EURO-OAT FUTURES	09-2024	EUR	27,740.00
Total:				-12,170.00

Amundi S.F. - SBI FM India Bond

Anzahl der Kontrakte Kauf/Verkauf	Bezeichnung	Fälligkeit datum	Währung	Nicht realisierter Gewinn/Verlust in USD
13	US 10 YR NOTE FUTURE	09-2024	USD	16,046.88
13	US 5 YR NOTE FUTURE	09-2024	USD	10,968.75
Total:				27,015.63

9 OFFENE POSITIONEN AUS DEWSENTERMINKONTRAKTEN

Zum 30. Juni 2024 hatten folgende Teilfonds die nachstehend aufgelisteten offenen Positionen aus Devisentermingeschäften und zugehörigen nicht realisierten Wertsteigerungen/Wertverluste:

■ Amundi S.F. - Diversified Short-Term Bond ESG

	Währung	Betrag in EUR
Gekaufte Devisen	EUR	234,740,636.11
	GBP	42,008,051.09
	USD	8,433,850.14
	Total:	285,182,537.34
Verkaufte Devisen	EUR	50,611,484.14
	GBP	132,586,441.21
	USD	101,643,236.93
	Total:	284,841,162.28
Gesamte nicht realisierte Gewinne/Verluste		341,375.06

Das letzte Ablaufdatum aller offenen Kontrakte ist der 12. September 2024.

■ Amundi S.F. - SBI FM India Bond

	Währung	Betrag in USD
Gekaufte Devisen	INR	17,521,926.62
	USD	4,550,000.00
	Total:	22,071,926.62
Verkaufte Devisen	EUR	1,178,925.00
	INR	4,561,612.08
	USD	16,300,000.00
	Total:	22,040,537.08
Gesamte nicht realisierte Gewinne/Verluste		31,389.54

Das letzte Ablaufdatum aller offenen Kontrakte ist der 26. Juli 2024.

■ Amundi S.F. - EUR Commodities

	Währung	Betrag in EUR
Gekaufte Devisen	CHF	189,033.51
	EUR	1,207,716.47
	USD	30,832,353.05
	Total:	32,229,103.03
Verkaufte Devisen	CHF	5,513.87
	EUR	30,555,433.34
	USD	1,204,026.40
	Total:	31,764,973.61
Gesamte nicht realisierte Gewinne/Verluste		464,129.42

Das letzte Ablaufdatum aller offenen Kontrakte ist der 10. Juli 2024.

10 OPTIONEN

Zum 30. Juni 2024 hatten bestimmte Teilfonds die folgenden offenen Positionen:

OPTIONSKONTRAKTE MIT VORABPRÄMIE

Informationen hierzu finden Sie unter Wertpapierportfolio.

TERMINGESCHÄFTARTIGE OPTIONEN

Zum 30. Juni 2024 hatten bestimmte Teilfonds die folgenden Positionen aus Termingeschäften.

■ Amundi S.F. - Diversified Short-Term Bond ESG

Geschäft	Ausübungs	Fälligkeit datum	Währung	Anzahl der Optionen
EURO BUND FUTURE /CALL	135.50	26.07.2024	EUR	-1,000
EURO BUND FUTURE /CALL	139.50	26.07.2024	EUR	1,000
EURO BUND FUTURE /CALL	133.00	26.07.2024	EUR	1,000
EURO BUND FUTURE /CALL	134.50	26.07.2024	EUR	-1,000
EURO BUND FUTURE /PUT	130.00	26.07.2024	EUR	-1,000
EURO BUND FUTURE /PUT	127.50	26.07.2024	EUR	1,000

Zum 30. Juni 2024 belief sich der gesamte nicht realisierte Nettoverlust aus termingeschäftartigen Optionen auf EUR 223,520.00.

■ Amundi S.F. - Euro Curve 7-10year

Geschäft	Ausübungs	Fälligkeit datum	Währung	Anzahl der Optionen
EURO BUND FUTURE /CALL	135.00	26.07.2024	EUR	297

Zum 30. Juni 2024 belief sich der nicht realisierte Verlust aus termingeschäftartigen Optionen auf EUR 16,780.00.

■ Amundi S.F. - Euro Curve 10+year

Geschäft	Ausübungs	Fälligkeit datum	Währung	Anzahl der Optionen
EURO BUND FUTURE /CALL	135.00	26.07.2024	EUR	307

Zum 30. Juni 2024 belief sich der nicht realisierte Verlust aus termingeschäftartigen Optionen auf EUR 10,710.00.

11 SWAPGESCHÄFTE

Zum 30. Juni 2024 hatten bestimmte Teilfonds die folgenden Positionen aus Swapgeschäften. In Anmerkung 12 finden Sie genaue Informationen zu den Sicherheiten.

Amundi S.F. - Diversified Short-Term Bond ESG

Fälligkeit datum	Geschäft	Basiswert	Sicherheitsbetrag Zinssatz	Gezahlter Satz	Währung	Nominal	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in EUR
02. Apr. 26	Zinsswap	-	2.912%	Ester 1D	EUR	150,000,000	-373,744.13
04. Juni 26	Zinsswap	-	3.209%	Ester 1D	EUR	80,000,000	299,444.67
Total:							-74,299.46

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

Fälligkeit datum	Geschäft	Basiswert	Sicherheitsbetrag Zinssatz	Gezahlter Satz	Währung	Nominal	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in EUR
20. Juni 28	Käufer des Credit Default Swap	iTraxx Europe Crossover Series 39 Index	-	5.000%	EUR	1,479,990	-119,457.37
20. Juni 28	Käufer des Credit Default Swap	iTraxx Europe Crossover Series 39 Index	-	5.000%	EUR	690,662	-55,746.77
20. Juni 28	Käufer des Credit Default Swap	iTraxx Europe Crossover Series 39 Index	-	5.000%	EUR	1,973,320	-159,276.50
Total:							-334,480.64

Amundi S.F. - Euro Curve 10+year

Fälligkeit datum	Geschäft	Basiswert	Sicherheitsbetrag Zinssatz	Gezahlter Satz	Währung	Nominal	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in EUR
20. Juni 28	Käufer des Credit Default Swap	iTraxx Europe Crossover Series 39 Index	-	5.000%	EUR	1,183,992	-95,565.90
20. Juni 28	Käufer des Credit Default Swap	iTraxx Europe Crossover Series 39 Index	-	5.000%	EUR	591,996	-47,782.95
20. Juni 28	Käufer des Credit Default Swap	iTraxx Europe Crossover Series 39 Index	-	5.000%	EUR	986,660	-79,638.25
Total:							-222,987.10

Amundi S.F. - EUR Commodities

Fälligkeit datum	Geschäft	Basiswert	Sicherheitsbetrag Zinssatz	Gezahlter Satz	Währung	Nominal	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in EUR
05. Juli 24	Commodity Index Swap	BBG Commodity	-	0.075%	USD	14,500,000	-65,466.75
05. Juli 24	Commodity Index Swap	BBG Commodity	-	0.07%	USD	46,000,000	-207,570.03
05. Juli 24	Commodity Index Swap	BBG Commodity	-	0.08%	USD	32,500,000	-146,818.90
05. Juli 24	Commodity Index Swap	BBG Commodity	0.07%	-	USD	2,500,000	9,118.85
05. Juli 24	Commodity Index Swap	BBG Commodity 3M Fwd	-	0.075%	USD	19,500,000	-132,359.19
05. Juli 24	Commodity Index Swap	BBG Commodity 6M Fwd	-	0.095%	USD	16,000,000	-111,098.16
Total:							-654,194.18

12 SICHERHEITEN

Zum 30. Juni 2024 wurden von Maklern und Gegenparteien für Transaktionen mit außerbörslich gehandelten Derivaten folgende Sicherheiten gezahlt/erhalten:

Teilfonds	Teilfonds Währung	Gegenpartei	Art der Sicherheiten	Erhaltener Sicherheitsbetrag (in der Währung des Teilfonds)	Gezahlter (in der Währung des Teilfonds)
Amundi S.F. - Diversified Short-Term Bond ESG	EUR	CITIGROUP, BANK OF AMERICA	Bargeldanlagen	290,000.00	270,000.00
Amundi S.F. - Euro Curve 7-10year	EUR	CITIGROUP	Bargeldanlagen	-	530,000.00
Amundi S.F. - Euro Curve 10+year	EUR	CITIGROUP	Bargeldanlagen	-	270,000.00
Amundi S.F. - EUR Commodities	EUR	JP MORGAN	Bargeldanlagen	-	300,000.00

13 SONSTIGE ERTRÄGE

Die Beträge der sonstigen Erträge in der Gewinn- und Verlustrechnung und den Veränderungen des Nettovermögens umfassen hauptsächlich Druck-/Veröffentlichungsgebühren und Rücknahmegebühren.

14 SONSTIGER AUFWAND

Salden aus der Rubrik „Sonstige Kosten“ in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und den Veränderungen des Nettovermögens beinhalten sonstige Steuern und Zinsen sowie Bankgebühren.

15 DARSTELLUNG DER PORTFOLIOBEWEGUNGEN

Eine Liste der Veränderungen des Portfolios im zum 30. Juni 2024 beendeten Zeitraum sind am eingetragenen Sitz der Verwaltungsgesellschaft des Fonds kostenlos erhältlich.

In den Anmerkungen zum Geschäftsbericht werden alle Einzelheiten bezüglich der zum 30. Juni 2024 ausstehenden Derivate ausgewiesen.

16 DIVIDENDEN

- **Ausschüttende Klassen** Diese Klassen schütten täglich einen Betrag aus, der vom entstandenen Nettoertrag abhängt. Die täglichen Beträge fallen monatlich an und werden monatlich gezahlt.
- **Jährliche Ausschüttung:** Diese Klassen schütten einen jährlichen Betrag aus, der vom Vorjahresertrag oder der Vorjahresdividende abhängt und auf einem jährlichen Renditeziel basiert, das am Auflagdatum/zu Jahresbeginn bestimmt wird. Je nach Teilfonds kann der Ertrag nach oder vor Abzug von Gebühren ausgeschüttet werden.
- **Vierteljährliche Zielausschüttung:** Diese Klassen streben die vierteljährliche Ausschüttung einer Dividende an. Sie basiert auf einem jährlichen Renditeziel und wird zu Jahresbeginn festgelegt. Weitere Einzelheiten sind in der Beschreibung der Richtlinien der Dividendenausschüttung im Prospekt des Fonds zu finden. Im Laufe des Zeitraums wurden nur die im Prospekt beschriebenen Ausschüttungen durchgeführt.

17 TRANSAKTIONSKOSTEN

Die Transaktionskosten des Teilfonds, die im Jahr 2022 in Verbindung mit dem Kauf oder Verkauf von Finanzinstrumenten entstanden sind, werden in einer speziellen Kostenzeile unter „Aufwands- und Ertragsrechnung und Veränderungen des Nettovermögens“ ausgewiesen. Die Transaktionskosten umfassen die direkten Kosten in Verbindung mit dem Erwerb oder Verkauf von Finanzinstrumenten, die auf Transaktionsbestätigungen einzeln ersichtlich sind.

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

Bei einigen Teilfonds kann dies je nach Art der Anlagen des Teilfonds dazu führen, dass im Abschnitt zu den Transaktionskosten keine Daten ausgewiesen werden. Transaktionen im Zusammenhang mit Wertpapierleihgeschäften und die zugehörigen Kosten werden bei diesen Zahlen nicht berücksichtigt.

18 WERTPAPIERLEIHGESCHÄFTE

Die beliehenen Wertpapiere hatten zum 30. Juni 2024 folgenden Marktwert: Die Länder der Gegenparteien werden gemäß dem Standard ISO 3166-1 aufgeführt.

Teilfonds	Währung	Gegenpartei	Marktwert der verliehenen
Amundi S.F. - Euro Curve 7-10year	EUR	SOCIETE GENERALE (FR)	7,548,257.34
Total:			7,548,257.34

Zum 30. Juni 2024 hat sich der Teilfonds wie folgt zu Vereinbarungen vollständig besicherter Wertpapierbeleihungen mit erstklassigen Finanzinstituten verpflichtet:

■ Amundi S.F. - Euro Curve 7-10year

Gegenpartei	Erhaltener Sicherheitsbetrag	Emittent	Rating	Währung	Art der Sicherheiten
SOCIETE GENERALE (FR)	4,990,607.79	ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO	BBB	EUR	Wertpapiere
	4,467,313.96	ASTRAZENECA PLC	-	EUR	Wertpapiere
	2,558,778.28	MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC	-	EUR	Wertpapiere
	522,367.25	PADDY POWER P.L.C.	-	EUR	Wertpapiere

Für die am 30. Juni 2024 beendete Berichtsperiode entspricht der Nettobetrag der Erträge aus Wertpapierleihgeschäften dem vom jeweiligen Teilfonds erwirtschafteten Bruttobetrag (erfasst unter „Sonstige Erträge“ in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und den Veränderungen des Nettovermögens). Die unter „Sonstige Aufwendungen“ erfassten direkten und indirekten Kosten und Gebühren werden hiervon abgezogen.

Teilfonds	Währung	Gesamtbruttobetrag der Erträge aus Wertpapierbeleihungen	Direkte und indirekte Kosten und Gebühren Amundi Intermediation	Bruttobetrag Rückübertragung Nettobetrag der Erträge aus Wertpapierbeleihungen
Amundi S.F. - Euro Curve 7-10year	EUR	1 642.94	575.03	1 067.91

Die Erträge aus Wertpapierbeleihungen werden mit der verbundenen Parteien Amundi Intermediation nach folgenden Anteilen aufgeteilt:

	Teilfonds	Amundi Intermediation
Alle Teilfonds	65%	35%

19 FOLGEEREIGNISSE

Es sind keine Ereignisse nach dem Abschlussstichtag eingetreten.

Vertreter, Zahlstelle, Erfüllungsort und Gerichtsstand

In Bezug auf die Anteile, die in und/oder von der Schweiz vertrieben werden, befindet sich der Erfüllungsort und der Gerichtsstand am Sitz des schweizerischen Vertreters, nämlich des:

Caceis (Switzerland) S.A.
Route de Signy 35
CH-1260 Nyon
Schweiz

Die Zahlstelle in der Schweiz ist:

CACEIS Bank, Paris, Niederlassung Nyon / Schweiz
Route de Signy 32
CH-1260 Nyon
Schweiz

Veröffentlichungen

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

Caceis (Switzerland) S.A.
Route de Signy 35
CH-1260 Nyon
Schweiz

Mitteilungen über den Fonds werden in der Schweiz auf der elektronischen Plattform „Fundinfo“ veröffentlicht.

Der Nettoinventarwert ohne Provisionen für jedes einzelne Portfolio wird täglich auf der elektronischen Plattform „Fundinfo“ veröffentlicht. Dieser Wert bestimmt den im Verkaufsprospekt beschriebenen Handelspreis (der Nettoinventarwert, berichtigt um die angemessene Rücklage für Handelskosten, geteilt durch die Anzahl der ausgegebenen Anteile, um so eine definitive Anpassung zu erreichen).

Zahlung von Rückübertragungen und mit Vertriebsaktivitäten verbundene Zuwendungen

Zum Zeitpunkt des Vertriebs in der Schweiz können die Fondsverwalter den qualifizierten Anlegern Rückübertragungen zahlen – allerdings nur denjenigen mit einer finanziellen Beteiligung in Anteilen für gemeinsame Anlagen für Dritte, die unten aufgeführt sind:

- Lebensversicherungsgesellschaften;
- Altersvorsorge und andere Sozialversicherungsgesellschaften;
- Anlagestiftungen;
- Schweizer Fondsverwalter;
- ausländische Fondsverwalter und Gesellschaften;
- Investmentunternehmen.

Die Fondsleitung kann die Vergütungen in Verbindung mit Vertriebsaktivitäten an die im Folgenden bezeichneten Vertreter und Vertriebspartner zahlen:

- Vertreter, die im Sinne von Artikel 13, al. 1 und 2, KAG (Loi fédérale sur les placements collectifs de capitaux, LPCC) einer Genehmigungspflicht unterliegen;
- Vertreter, die im Sinne von Artikel 13, al. 3, KAG und Artikel 8, KKV (Ordonnance sur les placements collectifs de capitaux, OPCC) von einer Genehmigungspflicht freigestellt sind;
- Vertriebspartner, die die Anteile der SICAV ausschließlich bei institutionellen Anlegern anlegen, deren Einlagen professionell verwaltet werden,
- Vertriebspartner, die Anteile der SICAV ausschließlich auf der Grundlage einer schriftlichen Vollmacht zur Vermögensverwaltung anlegen.

Die Gesamtkostenquote (TER) wird wie folgt festgelegt:

Die Gesamtkostenquote (TER) wird gemäß den Empfehlungen der Asset Management Association Switzerland (AMAS) berechnet. Im Herbst 2020 fusionierten die Asset Management Platform (AMP) Switzerland und die Swiss Funds and Asset Management Association (SFAMA) zur Asset Management Association Switzerland (AMAS).

Die Gesamtkostenquote (TER) wird wie folgt festgelegt:

AMUNDI S.F.	Währung	Isin	Anteilklassen	TER %	Performance- gebühr %
Amundi S.F. - Diversified Short-Term Bond ESG	EUR	LU2357810188	- A jährliche Ausschüttung	0.96%	-
	EUR	LU1706854152	- A keine Ausschüttung	0.92%	-
	EUR	LU1706854236	- E vierteljährliche Ausschüttung	0.99%	-
	EUR	LU1499628912	- E keine Ausschüttung	0.98%	-
	USD	LU1706854319	- E keine Ausschüttung	0.98%	-
	EUR	LU2357810428	- F keine Ausschüttung	1.51%	-
	EUR	LU2357810691	- H jährliche Ausschüttung	0.62%	-
	EUR	LU1889052269	- H vierteljährliche Ausschüttung	0.48%	-
	EUR	LU1503126044	- H keine Ausschüttung	0.70%	-
	EUR	LU1706854400	- I keine Ausschüttung	0.60%	-
	EUR	LU2357810931	- R jährliche Ausschüttung	0.63%	-
EUR	LU2357810774	- R keine Ausschüttung	0.72%	-	
Amundi S.F. - Euro Curve 7-10year	EUR	LU0536711285	- A Ausschüttung	0.90%	-
	EUR	LU0536711103	- A jährliche Ausschüttung	0.93%	-
	EUR	LU0367810172	- A keine Ausschüttung	0.93%	-
	EUR	LU0536711442	- C keine Ausschüttung	2.17%	-
	EUR	LU0857391824	- E vierteljährliche Zielausschüttung	1.43%	-
	EUR	LU0271693920	- E keine Ausschüttung	1.44%	-
	EUR	LU0271694654	- F keine Ausschüttung	1.99%	-
	EUR	LU0332132041	- H keine Ausschüttung	0.88%	-
	EUR	LU0433266433	- I keine Ausschüttung	0.67%	-
	EUR	LU1706854665	- R Ausschüttung	0.70%	-
EUR	LU1706853857	- R keine Ausschüttung	0.80%	-	
Amundi S.F. - Euro Curve 10+year	EUR	LU0281585215	- A jährliche Ausschüttung	0.97%	-
	EUR	LU0857391741	- E vierteljährliche Zielausschüttung	1.45%	-
	EUR	LU0271691981	- E keine Ausschüttung	1.43%	-
	EUR	LU0271692013	- F keine Ausschüttung	1.99%	-
	EUR	LU0332132397	- H keine Ausschüttung	0.87%	-
	EUR	LU0433266516	- I keine Ausschüttung	0.68%	-
Amundi S.F. - SBI FM India Bond	USD	LU2251232760	- A keine Ausschüttung	1.52%	-
	USD	LU2251232844	- A2 Keine Ausschüttung	1.71%	-
	USD	LU2338645448	- H keine Ausschüttung	0.82%	-
	EUR	LU2338646925	- H keine Ausschüttung	0.83%	-
	USD	LU2251232927	- I keine Ausschüttung	0.88%	-
	USD	LU2251233065	- I2 Keine Ausschüttung	0.97%	-
Amundi S.F. - EUR Commodities	EUR	LU0271695388	- A keine Ausschüttung	1.21%	-
	CHF	LU1694769693	- A abgesichert keine Ausschüttung	1.31%	-
	USD	LU1694769859	- A abgesichert keine Ausschüttung	1.31%	-
	EUR	LU0372625102	- C keine Ausschüttung	2.21%	-
	USD	LU1694770196	- C abgesichert keine Ausschüttung	2.30%	-
	EUR	LU0273973874	- E keine Ausschüttung	1.25%	-
	EUR	LU0273974336	- F keine Ausschüttung	2.00%	-
	EUR	LU1694770352	- I jährliche Ausschüttung	0.57%	-
	EUR	LU0271695461	- I keine Ausschüttung	0.56%	-
	EUR	LU0419230916	- I abgesichert keine Ausschüttung	0.67%	-
	EUR	LU1706853931	- R keine Ausschüttung	0.75%	-
	EUR	LU1706854582	- R abgesichert keine Ausschüttung	0.86%	-
	EUR	LU0484923635	- H jährliche Ausschüttung	0.72%	-
	EUR	LU0271872185	- H keine Ausschüttung	0.76%	-
	USD	LU1772191695	- H abgesichert keine Ausschüttung	0.85%	-

Kontaktangaben

Amundi S.F.

Amundi Luxembourg S.A.

5, Allée Scheffer,

L-2520 Luxembourg

Tel.: 352 2686 8080

www.amundi.lu/amundi-funds