

AC – Statistical Value Market Neutral 12 Vol Fund

Zusammensetzung des Wertpapierbestandes
zum 30. Juni 2010

Wertpapierbezeichnung	Anzahl / nominal	Whg	Einstandswert in EUR	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
AMTLICH NOTIERTE WERTPAPIERE					
ANLEIHEN					
DEUTSCHLAND					
Bundesobligation 3,50% 08/04/2011	5.200.000,00	EUR	5.365.899,50	5.324.020,00	8,5
Bundesobligation 3,50% 14/10/2011	1.800.000,00	EUR	1.875.810,00	1.870.128,00	3,0
Bundesrepublik Deutschland 5,00% 04/07/2011	1.600.000,00	EUR	1.685.460,00	1.672.288,00	2,7
Bundesrepublik Deutschland 5,25% 04/01/2011	3.750.000,00	EUR	3.878.931,96	3.844.275,00	6,2
Bundesschatzanweisungen 1,25% 11/03/2011	1.900.000,00	EUR	1.907.231,29	1.912.350,00	3,1
Bundesschatzanweisungen 1,50% 10/06/2011	2.000.000,00	EUR	2.022.160,00	2.020.320,00	3,2
Bundesschatzanweisungen 4,00% 10/09/2010	2.000.000,00	EUR	2.077.585,00	2.013.200,00	3,2
Hessen, Land 24/01/2014 FRN	800.000,00	EUR	798.430,00	793.600,00	1,3
SUMME DEUTSCHLAND			19.611.507,75	19.450.181,00	31,2
FRANKREICH					
France Government Bond OAT 6,50% 25/04/2011	4.150.000,00	EUR	4.414.560,14	4.347.042,00	7,0
French Treasury Note BTAN 1,50% 12/09/2011	9.650.000,00	EUR	9.725.715,00	9.759.045,00	15,6
French Treasury Note BTAN 2,50% 12/07/2010	1.000.000,00	EUR	1.015.030,00	998.000,00	1,6
French Treasury Note BTAN 3,50% 12/07/2011	4.600.000,00	EUR	4.754.036,22	4.737.540,00	7,6
SUMME FRANKREICH			19.909.341,36	19.841.627,00	31,8
NIEDERLANDE					
Netherlands Government Bond 4,00% 15/01/2011	2.450.000,00	EUR	2.552.715,00	2.497.040,00	4,0
Netherlands Government Bond 5,00% 15/07/2011	2.200.000,00	EUR	2.320.590,00	2.300.760,00	3,7
Netherlands Government Bond 5,50% 15/07/2010	600.000,00	EUR	632.550,00	600.990,00	1,0
SUMME NIEDERLANDE			5.505.855,00	5.398.790,00	8,7
SUMME ANLEIHEN			45.026.704,11	44.690.598,00	71,7
ZERTIFIKATE					
IRLAND					
S&P GSCI Enhanced Crude Oil Total Return Treasury Bill Secured Source ETC	39.959,00	EUR	5.086.123,23	5.236.139,45	8,4
SUMME IRLAND			5.086.123,23	5.236.139,45	8,4
SUMME ZERTIFIKATE			5.086.123,23	5.236.139,45	8,4
SUMME AMTLICH NOTIERTE WERTPAPIERE			50.112.827,34	49.926.737,45	80,1
DERIVATE					
OPTIONEN UND FUTURES					
DEUTSCHLAND					
BOBL FUTURE SEP10	561,00	EUR	-	134.819,52	0,2
EURO STOXX 50 FUTURE SEP10	196,00	EUR	-	-320.709,99	-0,5
SCHATZ FUTURE SEP10	1.448,00	EUR	-	5.415,52	0,0
SUMME DEUTSCHLAND			-	-180.474,95	-0,3
EUROPÄISCHE ZENTRALBANK					
EURO E-MINI FUTURE SEP10	-80,00	USD	-	-108.747,40	-0,2
FX EURO/DOLLAR FUTURE SEP10	1.559,00	USD	-	115.154,93	0,2
FX EUR/USD FUTURE SEP10	43,00	USD	-	106.548,27	0,2
SUMME EUROPÄISCHE ZENTRALBANK			-	112.955,80	0,2

AC

AC – Statistical Value Market Neutral 12 Vol Fund

Zusammensetzung des Wertpapierbestandes (Fortsetzung) zum 30. Juni 2010

Wertpapierbezeichnung	Anzahl / nominal	Whg	Einstandswert in EUR	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
GROSSBRITANNIEN					
3 MTH EURO EURIBOR SEP10	1.538,00	EUR	-	-176.447,05	-0,3
FTSE 100 INDEX FUTURE SEP10	39,00	GBP	-	-145.599,77	-0,2
SUMME GROSSBRITANNIEN			-	-322.046,82	-0,5
SCHWEIZ					
SMI-FUTURE SEP10	53,00	CHF	-	-133.323,09	-0,2
SUMME SCHWEIZ			-	-133.323,09	-0,2
VEREINIGTE STAATEN VON AMERIKA					
S&P GSCI INDEX FUTURE JUL10	64,00	USD	-	-132.875,50	-0,2
S&P 500 E-MINI FUTURE SEP10	276,00	USD	-	-742.056,45	-1,2
2 YR T-NOTES FUTURE ZT SEP10	701,00	USD	-	484.631,61	0,8
5 YR T-NOTES FUTURE ZF SEP10	557,00	USD	-	769.393,80	1,2
SUMME VEREINIGTE STAATEN VON AMERIKA			-	379.093,46	0,6
SUMME OPTIONEN UND FUTURES			-	-143.795,60	-0,2
SUMME DERIVATE			-	-143.795,60	-0,2
SUMME WERTPAPIERBESTAND			50.112.827,34	49.782.941,85	79,8

Durch Rundung der Prozentanteile können bei der Berechnung geringfügige Rundungsdifferenzen entstehen. Die Aufstellung der Veränderungen des Wertpapierbestandes für den Berichtszeitraum ist kostenlos am Sitz der Verwaltungsgesellschaft oder über die Depotbank und die Zahlstellen erhältlich. Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil des Halbjahresberichtes.