



Wien 1, Schwarzenbergplatz 3

**Amundi Öko Sozial Net Zero Ambition Bond**  
**Miteigentumsfonds gemäß Investmentfondsgesetz 2011 idgF (InvFG)**

**Rechenschaftsbericht**

über das Rumpfrechnungsjahr  
16. Februar 2024 bis 31. Mai 2024

## Inhaltsverzeichnis

|   |           |
|---|-----------|
| <b>Organe der Amundi Austria GmbH</b> .....                           | <b>3</b>  |
| <b>Angaben zur Vergütungspolitik</b> .....                            | <b>4</b>  |
| <b>Bericht an die Anteilsinhaber/innen</b> .....                      | <b>5</b>  |
| <b>Anlagestrategie</b> .....  | <b>5</b>  |
| <b>Kapitalmarktentwicklung</b> .....                                  | <b>6</b>  |
| <b>Übersicht über das Rumpfrechnungsjahr des Fonds</b> .....          | <b>9</b>  |
| <b>Ertragsrechnung und Entwicklung des Fondsvermögens</b> .....       | <b>10</b> |
| 1. Wertentwicklung des Rumpfrechnungsjahres (Fonds-Performance) ..... | 10        |
| 2. Fondsergebnis.....   | 12        |
| 3. Entwicklung des Fondsvermögens .....                               | 13        |
| <b>Vermögensaufstellung</b> .....                                     | <b>14</b> |
| <b>Bestätigungsvermerk</b> .....                                      | <b>24</b> |
| <b>Berechnung des Gesamtrisikos</b> .....                             | <b>26</b> |
| <b>Steuerliche Behandlung</b> .....                                   | <b>27</b> |
| <b>Fondsbestimmungen</b> .....  | <b>28</b> |
| <b>Anhang Informationen gemäß Art 11 der OffenlegungsVO</b> .....     | <b>33</b> |

# Organe der Amundi Austria GmbH

## **Aufsichtsrat**

Matteo GERMANO (Vorsitzender)

Francesca CICERI

Elodie LAUGEL

Aurélia Marie Catherine Marguerite LECOURTIER-GÉGOUT (ab 16.2.2024)

(stv. Vorsitzender) (ab 12.4.2024)

Christianus PELLIS

Mag. Karin PASEKA

Harald ZNAIMER (ab 21.5.2024)

Thomas GREINER (bis 21.5.2024)

Beate SCHEIBER

## **Staatskommissär**

Ministerialrätin Mag. Jutta RAUNIG (ab 1.6.2024)

Bundesministerium für Finanzen, Wien

Amtsleiter Regierungsrat Josef DORFINGER, Stv.

Bundesministerium für Finanzen, Wien

## **Geschäftsführung**

Franck Patrick Gabriel JOCHAUD DU PLESSIX (Vorsitzender)

Christian MATHERN (stv. Vorsitzender)

Bernhard GREIFENEDER

Mag. Hannes ROUBIK

## **Depotbank**

State Street Bank International GmbH, Filiale Wien

## **Prüfer**

Deloitte Audit Wirtschaftsprüfungs GmbH

## Angaben zur Vergütungspolitik

1.

|   |                   |
|---|-------------------|
| Anzahl der Mitarbeiter  | 151               |
| davon Begünstigte (sonstige Risikoträger) gemäß § 20 Abs. 2 Z 5 AIFMG                     | 44                |
| Gesamtsumme der an die Mitarbeiter (inkl. Geschäftsführung) der VWG gezahlten Vergütungen | EUR 15,382.434,08 |
| davon variable Vergütung  | EUR 2,892.647,02  |

2.

|   |                  |
|---|------------------|
| Gesamtsumme der Vergütungen an Risikoträger   | EUR 6,735.608,36 |
| davon Gesamtsumme der variablen Vergütungen an Risikoträger   | EUR 2,007.722,04 |
| davon Vergütungen an die Geschäftsführung   | EUR 1,803.158,33 |
| davon Vergütungen an die Führungskräfte   | EUR 1,785.677,83 |
| davon Vergütungen an sonstige Risikoträger  | EUR 2,627.236,13 |
| davon Vergütungen an die Mitarbeiter mit Kontrollfunktionen   | EUR 519.536,07   |
| davon Vergütungen an die Mitarbeiter, die sich aufgrund ihrer Gesamtvergütung in derselben Einkommensstufe befinden wie Geschäftsführung und Risikoträger | EUR 0,00         |

*Sämtliche Angaben in den Punkten 1 und 2 beziehen sich auf die Datenerfassung gemäß Gruppenvorgaben per 31.12.2023. Die ausgewiesenen Werte beinhalten unter Berücksichtigung der entsprechenden Vergütungspolitik gegebenenfalls auch aufgeschobene variable Vergütungen ehemaliger Risikoträger.*

3.

Die Höhe der Gesamtvergütungen setzt sich aus fixen und variablen Bestandteilen zusammen. Die fixen Anteile orientieren sich an der Funktion, dem Grad der Verantwortung, der Ausbildung und den Kompetenzen der einzelnen Funktionsträger. Variable Bestandteile werden eingesetzt, um eine direkte Verknüpfung zwischen Entlohnung und risikobereinigter Leistung sowohl auf kurzfristige als auch auf langfristige Sicht zu schaffen und um auf diese Weise einen Gleichklang zwischen den Kundeninteressen, den Interessen der Gesellschaft und ihrer Stakeholder mit jenen der Mitarbeiter und Organe herzustellen. Für diese Zwecke werden auch Instrumente als Teil der variablen Vergütung eingesetzt. Die Berechnung der Höhe der variablen Vergütung basiert auf individuellen risikobasierten quantitativen und qualitativen Kriterien für einen mehrjährigen Betrachtungszeitraum.

4.

Die letzte zentrale unabhängige Überprüfung wurde im 2. Quartal 2023 durchgeführt, die detaillierten Ergebnisse wurden dem Vergütungsausschuss und dem Aufsichtsrat in ihrer Sitzung am 14.12.2023 zur Kenntnis gebracht. Es gab keinerlei Unregelmäßigkeiten oder Beanstandungen.

5.

Sowohl Vergütungsausschuss als auch Aufsichtsrat haben zuletzt in ihrer Sitzung vom 14.12.2023 die Grundsätze der Vergütungspolitik überprüft. Eine neue Version der Remuneration Policy wurde am 14.12.2023 beschlossen, in der sowohl eine Anpassung an den ESG-Ansatz der Gruppe als auch eine Erweiterung der ESG-Ziele erfolgten.

*Einzelheiten der aktuellen Vergütungspolitik sind auf der Internet-Seite der Verwaltungsgesellschaft (<http://www.amundi.at>) abrufbar und werden auf Anfrage kostenlos in Papierform zur Verfügung gestellt.*

# Bericht an die Anteilhaber/innen

## Sehr geehrte Anteilhaber/innen!

Wir legen nachstehend den Bericht des Amundi Öko Sozial Net Zero Ambition Bond, Miteigentumsfonds gemäß Investmentfondsgesetz 2011 idgF (InvFG) über das Rumpfrechnungsjahr vom 16. Februar 2024 bis 31. Mai 2024 vor.

Das Rechnungsjahrende wurde vom 15.2. auf 31.5. geändert.

Per 1.6.2024 hat ein Depotbankwechsel von der State Street Bank International GmbH zur Raiffeisen Bank International AG stattgefunden.

## Anlagestrategie

Der Fonds verfolgt eine aktive Veranlagungsstrategie und orientiert sich an keinem Referenzwert. Der Amundi Öko Sozial Net Zero Ambition Bond investiert überwiegend in Unternehmen, die entweder bereits eine niedrige CO<sub>2</sub>-Intensität aufweisen oder ambitionierte Pläne haben, diese entsprechend zu reduzieren. Dies hat zum Ziel, die Emissionsintensität des Portfolios einerseits niedrig zu halten und gleichzeitig in Unternehmen zu investieren, die der Veranlagung diese Arbeit abnehmen, indem sie selbst ihre Emissionen stark reduzieren. Diese Kriterien waren und sind demnach zentral für die Selektion der Wertpapiere. Wir hatten vereinzelt Anleihen von Unternehmen im Einsatz, die USD denominiert sind, wobei die Währung entsprechend abgesichert war. Was Sektoren angeht, war die Veranlagung im Bereich „Energie“ und „Energieversorger“ stark untergewichtet, was auf die Ausschlusskriterien in Bezug auf fossile Brennstoffe sowie der Verstromung fossiler Brennstoffe zurückzuführen war. Auch viele Emittenten aus Sektoren wie Transport oder Chemie schafften es nicht in unsere Anlagestrategie. Umso mehr gilt der Fokus auf die verbleibenden Emittenten/Sektoren im Zuge der Veranlagung. Ein recht großes Gewicht war im Telekom-Sektor veranlagt – ein Sektor, der Opportunitäten in unterschiedlichen (auch langen) Laufzeiten bietet sowie nachrangige Anleihen emittiert, die eine attraktivere Rendite aufweisen. Gleichzeitig gibt es dort verhältnismäßig viele Unternehmen, die Emissionen im Einklang mit 1,5°C explizit anstreben. Generell strebten wir jedoch an, ambitionierte Unternehmen aus allen Sektoren auszuwählen. Wir sahen das wirtschaftliche Umfeld für Unternehmen als „schwierig aber schaffbar“ an, was – gepaart mit historisch gesehen höheren Zinsen – ein geeignetes Umfeld für Unternehmensanleihen war. Wir waren über die Hälfte in Anleihen mit BBB+, BBB, BBB- Rating investiert und mengten auch ein paar Prozentpunkte an sogenannten „High Yield“ Anleihen bei. Wir verwenden Derivate zur Absicherung von Zins- und Währungsrisiken sowie zur effizienten Portfoliosteuerung.<sup>1)</sup>

Im abgelaufenen Rumpfrechnungsjahr wurden keine Derivate getätigt, die unter die Berichtspflichten der ESMA Guidelines ESMA/2012/832 fallen.

Der Fonds berücksichtigte die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren gemäß Anhang 1, Tabelle 1 der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1288, die auf die Strategie des Fonds zutreffen, und stützte sich auf eine Kombination aus folgenden Maßnahmen:

- Ausschlussgrundsätze: Amundi hat normative, tätigkeits- und sektorbasierte Ausschlussregeln definiert, die einige der wichtigsten nachteiligen Nachhaltigkeitsauswirkungen abdecken, die in der Offenlegungsverordnung aufgeführt sind.

- Integration von ESG-Faktoren: Amundi hat Mindeststandards für die Integration von ESG-Faktoren festgelegt, die standardmäßig auf seine aktiv verwalteten offenen Fonds angewandt werden (Ausschluss von Emittenten mit G-Rating und besser gewichteter durchschnittlicher ESG-Score als die anwendbare Benchmark). 38 Kriterien, die im ESG-Rating-Ansatz von Amundi verwendet werden, wurden ebenfalls entwickelt, um die wichtigsten Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren zu berücksichtigen.
- Engagement: Engagement ist ein kontinuierlicher und zielgerichteter Prozess, der darauf abzielt, die Aktivitäten oder das Verhalten von Unternehmen, in die investiert wird, zu beeinflussen. Das Ziel der Engagement-Aktivitäten kann in zwei Kategorien eingeteilt werden: einen Emittenten dazu zu bewegen, die Art und Weise, wie er die ökologische und soziale Dimension integriert, zu verbessern, einen Emittenten dazu zu bewegen, seine Auswirkungen auf Umwelt-, Sozial- und Menschenrechtsfragen oder andere Nachhaltigkeitsfragen, die für die Gesellschaft und die Weltwirtschaft von Bedeutung sind, zu verbessern.
- Abstimmung: Die Abstimmungspolitik von Amundi beruhte auf einer ganzheitlichen Analyse aller langfristigen Themen, die die Wertschöpfung beeinflussen können, einschließlich wesentlicher ESG-Themen. Weitere Informationen finden Sie in Amundis Abstimmungspolitik.

## Kapitalmarktentwicklung

Das vergangene Rechnungsjahr war von einer Fortsetzung der globalen Krisenherde gekennzeichnet (Krieg Russland/Ukraine, Spannungen USA/China, Israel/Palästina bzw. Iran etc.), die die Politik vor große Herausforderungen stellten. Die gestiegene Inflation sorgte vor allem bei Menschen mit geringerem Einkommen für Probleme. Gleichzeitig veranlasste sie die Notenbanken zu massiven Schritten zur Bekämpfung der Inflation, da die langfristigen Auswirkungen einer zu hohen Inflation auf die Wirtschaft extrem negativ wären. Die gestiegenen Zinsen konnten die Inflation zwar eindämmen, bereiteten aber naturgemäß dem Unternehmenssektor, vor allem im Bereich Immobilien, größere Sorgen. Die nachlassende Inflation ab Ende 2023, die damit verbundenen Zinssenkungserwartungen und die überraschend stabile Wirtschaftslage bis ins Jahr 2024 hinein wirkten für beinahe alle Assetklassen unterstützend.

### Volkswirtschaft

Makro, Notenbanken und Inflation: Die Notenbanken, die am Anfang zu zögerlich gewesen waren, erhöhten die Leitzinsen bis ins H2 2023 hinein, um die Inflation zu dämpfen. Sowohl in Europa als auch den USA näherte sich die Inflation wieder dem Zielniveau von ca. 2 % an, wobei die Nachhaltigkeit dieses Trends noch nicht klar ist. Der bereits vom Markt fix eingepreiste deutliche Zinssenkungspfad wird nun gegen Ende Q1 2024 wieder in Frage gestellt, was an den deutlich höheren impliziten Leitzinsen ersichtlich ist. Entsprechend volatil haben sich speziell die Anleihensegmente entwickelt, die die veränderten Annahmen permanent widerspiegeln. In Großbritannien stieg die Inflation bis zum Oktober 2022 sogar auf 11,1 % und lag im September 2023 immer noch bei 6,7 %. Ende Q1 2024 lag sie noch immer bei über 3 %. In den USA blieb das Wirtschaftswachstum entgegen den ursprünglichen Markterwartungen klar positiv, während das Wachstum in der Eurozone auf der Stelle trat. Aufgrund der niedrigen Arbeitslosenrate in den USA blieben die Konsumausgaben stabil, Schwäche kommt vor allem aus dem produzierenden Gewerbe und von den Investitionen, während der Dienstleistungssektor noch keine Zeichen von Schwäche zeigte und die Staatsausgaben sowie die Nettoexporte ebenfalls einen positiven Beitrag lieferten. Gegen Ende des Jahres schwächte sich das Wachstum allgemein ab, was dem hohen Zinsniveau geschuldet war.

### Anleihen

Geldmarkt und kurzfristige Zinsen: Die kurzfristigen Zinsen reagierten stärker auf die Zinserhöhungen der Notenbanken, die Renditen 2-jähriger Treasuries stiegen auf bis zu 5,2 % im Oktober 2023, die Zinsen 2-jähriger deutscher Bundesanleihen auf bis zu 3,38 % im März 2023 und beendeten das Jahr 2023 bei 2,4 %. Ein Abflauen der Zinssenkungserwartungen führte zu einem Anstieg bis fast 3 % gegen Ende Q1 2024.

**Staatsanleihen:** Die Staatsanleihenmärkte der USA und der Eurozone reagierten auf die Zinssteigerungen der Notenbanken mit deutlichen Kursverlusten zwischen Mai und Oktober 2023. Während des Jahres 2023 wurden die Anleihenmärkte vor allem von der Frage bestimmt, wann das Ende des Zinserhöhungszyklus der Notenbanken erreicht wird (die sogenannte Terminal Rate) und ob die Notenbanken aufgrund einer erwarteten Abschwächung der Wirtschaft 2024 im Laufe des Jahres 2024 die Zinsen wieder senken könnten. Die Antwort gab es dann im 4. Quartal in Form deutlich gefallener Renditen. Zehnjährige US-Staatsanleihen fielen vom Hoch im Oktober von 5,0 % auf 3,9 % gegen Ende des Jahres und stiegen dann wieder auf 4,2 % gegen Ende Q1 2024. Das deutsche Pendant fiel vom Hoch im Oktober von über 3 % auf 2,0 % und stieg gegen Ende Q1 2024 auf 2,3 % an.

**Unternehmensanleihen:** Euro-Unternehmensanleihen mit Investment Grade-Rating (+6,78 %) konnten Euro-Staatsanleihen (+3,92 %) im Berichtszeitraum klar outperformen, da die Risikoaufschläge der Unternehmensanleihen aufgrund der relativ stabilen Lage der Wirtschaft um ca. 12 Basispunkte nachgaben. High Yield-Anleihen verzeichneten bei deutlich fallenden Risikoaufschlägen (ca. -72 Basispunkte) das beste Ergebnis mit +10,89 %.

**Schwellenländeranleihen:** Globale Schwellenländeranleihen haben sich mit fast 10 % auf Eurobasis deutlich besser entwickelt als die Staatsanleihen der Industrieländer, was vor allem an der guten Performance im Q1 2024 lag.

## **Aktien**

Die Aktienmärkte weltweit haben im Rechnungsjahr mit 25,82 %, gemessen am MSCI World AC in EUR, positiv überrascht. Das lag an der bis zum Halbjahr noch positiven Wirtschaftslage und einer Jahresendrallye, die von der Erwartung fallender Zinsen für 2024 getragen war. Im Q1 2024 konnten die Aktien von guten Wirtschaftsdaten profitieren.

**Aktien Europa:** Europa profitierte vor allem davon, dass es zu keiner Energieknappheit kam, da die Gasspeicher trotz Sanktionen gegen Russland gefüllt werden konnten und es unter anderem aufgrund des milden Winters zu einer Beruhigung und einer darauffolgenden Abschwächung der Energiepreise kam. Zusätzlich sorgte die günstige Bewertung der europäischen Aktienmärkte für Kapitalzuflüsse globaler Investoren. Der MSCI Europe konnte im Berichtszeitraum ein Plus von 14,79 % verzeichnen.

**Aktienmarkt USA:** Ausschlaggebend für die Fortsetzung des Anstiegs des US-Aktienmarktes war zu einem Großteil die massive Outperformance der großen Mega-Caps im IT-Sektor und der großen Titel im zyklischen Konsumgüterbereich und im Segment Kommunikationsdienstleistungen. Viele dieser Unternehmen profitierten vom aufkommenden Hype um das Thema Künstliche Intelligenz (Artificial Intelligence, AI), das mittel- bis langfristig für einen zusätzlichen Wachstumsimpuls sorgen könnte. Die als die „glorreichen Sieben“ titulierten großen Technologie-Unternehmen (Amazon, Alphabet, Apple, Nvidia, Meta, Microsoft, Tesla) haben den MSCI USA Index im Berichtszeitraum auf ein Plus von 30,44 % (in EUR) gezogen. Im Jahr 2024 konnten dann auch Energie- und Finanzdienstleistungsunternehmen stark zulegen.

**Aktienmarkt Japan:** Der japanische Aktienmarkt profitierte neben dem schwachen Yen unter anderem davon, dass die Unternehmen verstärkt Reformen zur besseren Vergütung der Aktionäre umsetzen. Ein weiterer positiver Faktor ist die sich normalisierende Inflation durch steigende Löhne, welche sich positiv auf die Konsumentenlaune niederschlug. Die Industrieproduktion war zuletzt rückläufig, wobei der Dienstleistungssektor das Wachstum weiterhin stützt. Diese Kombination großteils positiver Faktoren führte zu einer sehr positiven Entwicklung im Berichtszeitraum mit einer Performance von ca. 25,94 % im MSCI Japan (in EUR).

**Aktienmärkte Schwellenländer:** Schwellenländer-Aktien blieben aufgrund der hohen Gewichtung des chinesischen Aktienmarktes, der vor allem unter den langen Lockdowns und der schwachen Entwicklung des Immobilienmarktes litt, deutlich hinter Europa, den USA und Japan zurück und erreichten im Berichtszeitraum lediglich ca. 8,8 % im MSCI EM (in EUR).

Währungen: Der EUR/USD-Wechselkurs war im Rechnungsjahr von großer Volatilität geprägt und blieb schließlich im Berichtszeitraum fast unverändert.<sup>2)</sup>

<sup>1)</sup> Aufgrund unterschiedlicher Berechnungsmethoden kann es zwischen den Prozentangaben der Anlagestrategie und der Vermögensaufstellung zu Abweichungen kommen.

<sup>2)</sup> Im Zusammenhang mit der Bewertung in der aktuellen Marktsituation verweisen wir auf die Erläuterungen zur Ermittlung des Fondsrechenwertes der Vermögensaufstellung ("Risikohinweis").



# Übersicht über das Rumpfrechnungsjahr des Fonds

Fondsvermögen in EUR, Angaben zu den Tranchen in Tranchenwährung

| Rechnungsjahresende   | 31.05.2024 <sup>1)</sup> | 15.02.2024 | 15.02.2023 |
|---|--------------------------|------------|------------|
| Fondsvermögen in 1.000  | 148.183                  | 148.857    | 55.708     |
| <b>Ausschüttungsanteile AT0000947643 in EUR</b>                         |                          |            |            |
| Rechenwert je Anteil  | 83,33                    | 84,07      | 81,45      |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile   | 786.231                  | 780.591    | 228.208    |
| Ausschüttung je Anteil  | 0,35                     | 1,20       | 1,20       |
| Wertentwicklung in %  | +0,54                    | +4,76      | -9,71      |
| <b>Thesaurierungsanteile mit KEST-Abzug AT0000719281 in EUR</b>         |                          |            |            |
| Rechenwert je Anteil  | 134,46                   | 133,74     | 127,68     |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile   | 530.670                  | 509.538    | 189.567    |
| zur Thesaurierung verwendeter Ertrag                                    | 0,75                     | 1,21       | -15,33     |
| Auszahlung gem. § 58 Abs 2 InvFG  | 0,00                     | 0,00       | 0,00       |
| Wertentwicklung in %  | +0,54                    | +4,75      | -9,72      |
| <b>Thesaurierungsanteile mit KEST-Abzug AT0000A308K8 in EUR</b>         |                          |            |            |
| Rechenwert je Anteil  | 1.066,83                 | 1.064,22   | 1.013,55   |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile   | 10.185                   | 13.688     | 12.736     |
| zur Thesaurierung verwendeter Ertrag                                    | 5,21                     | 11,31      | 4,56       |
| Auszahlung gem. § 58 Abs 2 InvFG  | 1,9808                   | 4,29       | 1,42       |
| Wertentwicklung in %  | +0,65                    | +5,15      | +1,36      |
| <b>Thesaurierungsanteile ohne KEST-Abzug AT0000A36HE6 ab 24.11.2023</b> |                          |            |            |
| Rechenwert je Anteil  | 148,03                   | 147,24     | -          |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile   | 1.671                    | 1.671      | -          |
| zur Thesaurierung verwendeter Ertrag                                    | 0,83                     | 0,34       | -          |
| Wertentwicklung in %  | +0,54                    | +3,02      | -          |
| <b>Thesaurierungsanteile ohne KEST-Abzug AT0000A36HB2 ab 24.11.2023</b> |                          |            |            |
| Rechenwert je Anteil  | 148,34                   | 147,53     | -          |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile   | 1.326                    | 1.787      | -          |
| zur Thesaurierung verwendeter Ertrag                                    | 0,85                     | 0,36       | -          |
| Wertentwicklung in %  | +0,55                    | +3,03      | -          |

1) Rumpfrechnungsjahr von 16.02.2024 - 31.05.2024

# Ertragsrechnung und Entwicklung des Fondsvermögens

## 1. Wertentwicklung des Rumpfrechnungsjahres (Fonds-Performance)

Ermittlung nach OeKB-Berechnungsmethode:  
pro Anteil in Tranchenwährung ohne Berücksichtigung des Ausgabeaufschlages

| <b>Ausschüttungsanteile AT0000947643</b>   | <b>in EUR</b> |
|--|---------------|
| Rechenwert am Beginn des Rumpfrechnungsjahres  | 84,07         |
| Ausschüttung am 15.04.2024 (Rechenwert: 83,86) von 1,20 entspricht 0,0143 Anteilen       | 1,20          |
| Rechenwert am Ende des Rumpfrechnungsjahres  | 83,33         |
| Gesamtwert inkl. (fiktiv) mit dem Ausschüttungsbetrag erworbene Anteile (1,0143 * 83,33) | 84,52         |
| Nettoertrag pro Anteil (84,52 - 84,07)   | 0,45          |
| <b>Wertentwicklung eines Anteiles im Rumpfrechnungsjahr in %</b>                         | <b>+0,54</b>  |

| <b>Thesaurierungsanteile mit KEST-Abzug AT0000719281</b>                                   | <b>in EUR</b> |
|--|---------------|
| Rechenwert am Beginn des Rumpfrechnungsjahres  | 133,74        |
| Auszahlung (KESt) am 15.04.2024 (Rechenwert: 135,31) von 0,0000 entspricht 0,0000 Anteilen | 0,00          |
| Rechenwert am Ende des Rumpfrechnungsjahres  | 134,46        |
| Gesamtwert inkl. (fiktiv) mit dem Auszahlungsbetrag erworbene Anteile (1,0000 * 134,46)    | 134,46        |
| Nettoertrag pro Anteil (134,46 - 133,74)   | 0,72          |
| <b>Wertentwicklung eines Anteiles im Rumpfrechnungsjahr in %</b>                           | <b>+0,54</b>  |

| <b>Thesaurierungsanteile mit KEST-Abzug AT0000A308K8</b>                                     | <b>in EUR</b> |
|--|---------------|
| Rechenwert am Beginn des Rumpfrechnungsjahres  | 1.064,22      |
| Auszahlung (KESt) am 15.04.2024 (Rechenwert: 1.073,09) von 4,2899 entspricht 0,0040 Anteilen | 4,29          |
| Rechenwert am Ende des Rumpfrechnungsjahres  | 1.066,83      |
| Gesamtwert inkl. (fiktiv) mit dem Auszahlungsbetrag erworbene Anteile (1,0040 * 1.066,83)    | 1.071,09      |
| Nettoertrag pro Anteil (1.071,09 - 1.064,22)   | 6,87          |
| <b>Wertentwicklung eines Anteiles im Rumpfrechnungsjahr in %</b>                             | <b>+0,65</b>  |

| <b>Thesaurierungsanteile ohne KEST-Abzug AT0000A36HE6</b>        | <b>in EUR</b> |
|--|---------------|
| Rechenwert am Beginn des Rumpfrechnungsjahres                    | 147,24        |
| Rechenwert am Ende des Rumpfrechnungsjahres                      | 148,03        |
| <b>Wertentwicklung eines Anteiles im Rumpfrechnungsjahr in %</b> | <b>+0,54</b>  |

| <b>Thesaurierungsanteile ohne KEST-Abzug AT0000A36HB2</b>        | <b>in EUR</b> |
|--|---------------|
| Rechenwert am Beginn des Rumpfrechnungsjahres                    | 147,53        |
| Rechenwert am Ende des Rumpfrechnungsjahres                      | 148,34        |
| <b>Wertentwicklung eines Anteiles im Rumpfrechnungsjahr in %</b> | <b>+0,55</b>  |

Die Anteilswertermittlung durch die Depotbank erfolgt getrennt je Anteilscheinklasse. Die Jahresperformanzenwerte der einzelnen Anteilscheinklassen können voneinander abweichen. Wertentwicklungen der Vergangenheit lassen keine verlässlichen Rückschlüsse auf die zukünftige Entwicklung eines Investmentfonds zu.

### **Ausschüttung für Ausschüttungsanteile - AT0000947643**

Die Ausschüttung von EUR 0,3500 je Anteil wird ab 31.07.2024 von den depotführenden Banken vorgenommen.

Die kuponauszahlende Bank ist verpflichtet, von der Ausschüttung Kapitalertragsteuer in der Höhe von EUR 0,0000 je Anteil einzubehalten, sofern keine Befreiungsgründe vorliegen.

### **Auszahlung für Thesaurierungsanteile mit KEST-Abzug - AT0000719281**

Die Kapitalertragsteuer beträgt EUR 0,0000 je Anteil, daher wird keine Auszahlung vorgenommen.

### **Auszahlung für Thesaurierungsanteile mit KEST-Abzug (I) - AT0000A308K8**

Die Auszahlung der Kapitalertragsteuer in der Höhe von EUR 1,9808 je Thesaurierungsanteil mit KEST-Abzug wird ab 31.07.2024 von den depotführenden Banken vorgenommen, sofern keine Befreiungsgründe vorliegen.

### **Auszahlung für Thesaurierungsanteile ohne KEST-Abzug (Inlandstranche) - AT0000A36HE6**

Eine allfällige Auszahlung für Thesaurierungsanteile ohne KEST-Abzug (Vollthesaurierer Inlandstranche) entfällt nach Maßgabe des § 58 Abs 2 InvFG.

### **Auszahlung für Thesaurierungsanteile ohne KEST-Abzug (Auslandstranche) - AT0000A36HB2**

Eine allfällige Auszahlung für Thesaurierungsanteile ohne KEST-Abzug (Vollthesaurierer Auslandstranche) entfällt nach Maßgabe des § 58 Abs 2 InvFG.

## 2. Fondsergebnis

Angaben in EUR

### a. Realisiertes Fondsergebnis

#### Ordentliches Fondsergebnis

##### Erträge (ohne Kursergebnis)

|  |              |              |
|--|--------------|--------------|
| Zinsenerträge                                  | 1.278.979,03 |              |
| Dividenderträge                                | 0,00         |              |
| Erträge aus Subfonds                           | 0,00         |              |
| sonstige Erträge                               | 0,00         |              |
| Zinsaufwendungen (inkl. negativer Habenzinsen) | -383,05      | 1.278.595,98 |

##### Aufwendungen

|   |             |             |
|---|-------------|-------------|
| Vergütung an die Verwaltungsgesellschaft                          | -309.309,47 |             |
| Abzügl. Verwaltungskostenrückvergütung aus Subfonds <sup>1)</sup> | 0,00        |             |
| Performancegebühren   | 0,00        |             |
| Kosten für Wirtschaftsprüfer und Steuerberatung                   | -3.341,56   |             |
| Publizitätskosten und Aufsichtskosten                             | -9.031,36   |             |
| Garantiegebühren  | 0,00        |             |
| Kosten für die Depotbank  | -46.552,27  |             |
| Kosten für Dienste externer Berater                               | 0,00        |             |
| Lizenzkosten, Kosten für externe Ratings                          | 0,00        |             |
| Sonstige Kosten   | 0,00        | -368.234,66 |

#### **Ordentliches Fondsergebnis (exkl. Ertragsausgleich)**

**910.361,32**

##### Realisiertes Kursergebnis (exkl. Ertragsausgleich) <sup>2) 3)</sup>

|                                       |             |            |
|---------------------------------------|-------------|------------|
| Realisierte Gewinne aus Wertpapieren  | 266.889,43  |            |
| Gewinne aus derivativen Instrumenten  | 117.957,10  |            |
| Realisierte Verluste aus Wertpapieren | -352.351,43 |            |
| Verluste aus derivativen Instrumenten | -71.879,41  | -39.384,31 |

#### **Realisiertes Fondsergebnis (exkl. Ertragsausgleich)**

**870.977,01**

##### b. Nicht realisiertes Kursergebnis <sup>2) 3)</sup>

|  |  |            |
|--|--|------------|
| Veränderung des nicht realisierten Kursergebnisses |  | -27.858,20 |
|--|--|------------|

#### **Ergebnis des Rumpfrechnungsjahres <sup>4)</sup>**

**843.118,81**

##### c. Ertragsausgleich

|  |            |            |
|--|------------|------------|
| Ertragsausgleich des Rumpfrechnungsjahres            | -23.759,25 |            |
| Ertragsausgleich auf den Gewinnvortrag aus Vorjahren | -56.694,82 | -80.454,07 |

#### **Fondsergebnis gesamt**

**762.664,74**

### 3. Entwicklung des Fondsvermögens

|  |               |                       |
|--|---------------|-----------------------|
| <b>Fondsvermögen am Beginn des Rumpfrechnungsjahres <sup>5)</sup></b>      |               | <b>148.856.770,90</b> |
| <b>Ausschüttungsanteile AT0000947643</b>                                   |               |                       |
| Ausschüttung (für Ausschüttungsanteile) am 15.04.2024                      |               | -968.905,65           |
| <b>Thesaurierungsanteile mit KEST-Abzug AT0000A308K8</b>                   |               |                       |
| Auszahlung (für Thesaurierungsanteile) am 15.04.2024                       |               | -53.975,53            |
| <b>Ausgabe und Rücknahme von Anteilen</b>                                  |               |                       |
| Ausgabe von Anteilen   | 9.076.502,84  |                       |
| Rücknahme von Anteilen   | -9.570.129,43 |                       |
| Anteiliger Ertragsausgleich  | 80.454,07     | -413.172,52           |
| <b>Fondsergebnis gesamt</b>  |               | <b>762.664,74</b>     |
| (das Fondsergebnis ist im Detail auf der vorhergehenden Seite dargestellt) |               |                       |
| <b>Fondsvermögen am Ende des Rumpfrechnungsjahres <sup>6)</sup></b>        |               | <b>148.183.381,94</b> |

#### Erläuterungen zu den Wertangaben bezüglich Fondsergebnis und Entwicklung des Fondsvermögens:

- 1) Die Position beinhaltet die marktübliche Einbehaltung von Administrationskosten der Verwaltungsgesellschaft sowie Dritter.  
Für Anteile an anderen Investmentfonds, in die der Fonds investiert („Subfonds“), kann eine Verwaltungsvergütung von bis zu 2,5 % des betreffenden in diesen Subfonds veranlagten Fondsvermögens verrechnet werden. Gegebenenfalls kann zusätzlich eine Performance Fee anfallen.
- 2) Realisierte Gewinne und realisierte Verluste sind nicht periodenabgegrenzt und stehen so wie die Veränderung des nicht realisierten Kursergebnisses nicht unbedingt in Beziehung zu der Wertentwicklung des Fonds im Rumpfrechnungsjahr.
- 3) Kursergebnis gesamt, ohne Ertragsausgleich (realisiertes Kursergebnis ohne Ertragsausgleich, zuzüglich Veränderungen des nicht realisierten Kursergebnisses): EUR -67.242,51
- 4) Das Ergebnis des Rumpfrechnungsjahres beinhaltet explizit ausgewiesene Transaktionskosten in Höhe von EUR 7.018,00
- 5) Anteilsulauf zu Beginn des Rumpfrechnungsjahres: 780.591 Ausschüttungsanteile, 509.538 Thesaurierungsanteile mit KEST-Abzug, 13.688 Thesaurierungsanteile mit KEST-Abzug (I), 1.671 Thesaurierungsanteile ohne KEST-Abzug (VTI), 1.787 Thesaurierungsanteile ohne KEST-Abzug (VTA).
- 6) Anteilsulauf am Ende des Rumpfrechnungsjahres: 786.231 Ausschüttungsanteile, 530.670 Thesaurierungsanteile mit KEST-Abzug, 10.185 Thesaurierungsanteile mit KEST-Abzug (I), 1.671 Thesaurierungsanteile ohne KEST-Abzug (VTI), 1.326 Thesaurierungsanteile ohne KEST-Abzug (VTA).

# Vermögensaufstellung

| ISIN   | Wertpapier-Bezeichnung    | Zinssatz | Käufe / Zugänge<br>Stück / Nominale | Verkäufe / Abgänge<br>(Nom. in 1.000, ger.) | Bestand | Kurs in<br>Wertpapier-<br>währung | Kurswert<br>in EUR | %-Anteil<br>am<br>Fonds-<br>vermögen |
|--|---------------------------|----------|-------------------------------------|---|---------|-----------------------------------|--------------------|--------------------------------------|
| <b>ZUM AMTLICHEN HANDEL ODER EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT ZUGELASSENE WERTPAPIERE</b> |                           |          |                                     |   |         |                                   |                    |                                      |
| <b>ANLEIHEN auf EURO lautend</b>   |                           |          |                                     |   |         |                                   |                    |                                      |
| DE000AAR0322   | AAREAL BK MTN 22/28       | 0,750    | 0                                   | 0   | 300     | 86,8860                           | 260.658,00         | 0,18                                 |
| ES0265936031   | ABANCA 22/28 FLR MTN      | 5,250    | 0                                   | 0   | 600     | 103,7590                          | 622.554,00         | 0,42                                 |
| ES0365936048   | ABANCA 23/26 FLR MTN      | 5,500    | 0                                   | 0   | 200     | 101,2980                          | 202.596,00         | 0,14                                 |
| XS2747182181   | ABB FIN. 24/34 MTN        | 3,375    | 0                                   | 0   | 270     | 98,1660                           | 265.048,20         | 0,18                                 |
| XS2348638433   | ABN AMRO BK 21/33 MTN     | 1,000    | 0                                   | 0   | 900     | 81,5530                           | 733.977,00         | 0,50                                 |
| XS2610209129   | ACCIONA ENE. 23/30 MTN    | 3,750    | 0                                   | 0   | 600     | 96,2330                           | 577.398,00         | 0,39                                 |
| XS2150015555   | AHOLD DELHA. 20/27        | 1,750    | 0                                   | 0   | 300     | 95,3170                           | 285.951,00         | 0,19                                 |
| XS2343340852   | AIB GP. 21/27 FLR MTN     | 0,500    | 0                                   | 0   | 600     | 91,9270                           | 551.562,00         | 0,37                                 |
| XS2156598281   | AKZO NOBEL 20/30 MTN      | 1,625    | 0                                   | 0   | 300     | 89,3240                           | 267.972,00         | 0,18                                 |
| XS2462468740   | AKZO NOBEL 22/32 MTN      | 2,000    | 0                                   | 0   | 300     | 88,3440                           | 265.032,00         | 0,18                                 |
| XS2498554992   | ALD 22/27 MTN             | 4,000    | 0                                   | 0   | 300     | 100,5320                          | 301.596,00         | 0,20                                 |
| FR001400M8T2   | ALD 23/26 MTN             | 4,375    | 0                                   | 0   | 400     | 101,1290                          | 404.516,00         | 0,27                                 |
| FR001400F6E7   | ALD 23/27 MTN             | 4,250    | 0                                   | 0   | 400     | 101,0960                          | 404.384,00         | 0,27                                 |
| FR001400NC70   | ALD 24/28 MTN             | 3,875    | 0                                   | 0   | 300     | 99,8660                           | 299.598,00         | 0,20                                 |
| FR001400NC88   | ALD 24/31 MTN             | 4,000    | 0                                   | 0   | 200     | 99,6610                           | 199.322,00         | 0,13                                 |
| DE000A254TM8   | ALLIANZ MTN 2020/2050     | 2,121    | 0                                   | 0   | 200     | 88,6580                           | 177.316,00         | 0,12                                 |
| DE000A289FK7   | ALLIANZ SE SUB.20/UNBEFR. | 2,625    | 0                                   | 0   | 200     | 78,5710                           | 157.142,00         | 0,11                                 |
| XS2227906208   | AMERN TWR 20/32           | 1,000    | 0                                   | 0   | 250     | 79,7240                           | 199.310,00         | 0,13                                 |
| XS2389757944   | ANZ N.Z.INTL 21/27 MTN    | 0,200    | 0                                   | 0   | 300     | 89,3310                           | 267.993,00         | 0,18                                 |
| XS1197775692   | APTIV 15/25               | 1,500    | 0                                   | 0   | 500     | 98,0800                           | 490.400,00         | 0,33                                 |
| BE6324664703   | ARGE.SPAARB. 20/26 MTN    | 1,000    | 0                                   | 0   | 500     | 95,9430                           | 479.715,00         | 0,32                                 |
| XS1942708527   | ARGENT.NETH. 19/49FLR MTN | 2,750    | 0                                   | 0   | 300     | 93,8510                           | 281.553,00         | 0,19                                 |
| FR0013252277   | ARKEMA 17/27 MTN          | 1,500    | 0                                   | 0   | 300     | 94,2950                           | 282.885,00         | 0,19                                 |
| FR0013464815   | ARKEMA 19/29 MTN          | 0,750    | 0                                   | 0   | 200     | 85,5670                           | 171.134,00         | 0,12                                 |
| FR001400FAZ5   | ARKEMA 23/31 MTN          | 3,500    | 0                                   | 0   | 300     | 97,7710                           | 293.313,00         | 0,20                                 |
| FR001400ORA4   | ARKEMA 24/UND. FLR MTN    | 4,800    | 200                                 | 0   | 200     | 100,5640                          | 201.128,00         | 0,14                                 |
| FR001400CSG4   | ARVAL SERV.L 22/26 MTN    | 4,000    | 0                                   | 0   | 400     | 100,2460                          | 400.984,00         | 0,27                                 |
| FR001400F6O6   | ARVAL SERV.L 23/26 MTN    | 4,125    | 0                                   | 0   | 200     | 100,2360                          | 200.472,00         | 0,14                                 |
| XS2554581830   | ASR NEDERLA. 22/43 FLR    | 7,000    | 0                                   | 0   | 600     | 112,9420                          | 677.652,00         | 0,46                                 |
| XS2694995163   | ASR NEDERLA. 23/28        | 3,625    | 0                                   | 0   | 400     | 99,6200                           | 398.480,00         | 0,27                                 |
| XS2790191303   | ASR NEDERLA. 24/UND. FLR  | 6,625    | 280                                 | 0   | 280     | 99,9990                           | 279.997,20         | 0,19                                 |
| XS2678749990   | ASS.GENERALI 23/33 MTN    | 5,272    | 0                                   | 0   | 550     | 105,6080                          | 580.844,00         | 0,39                                 |
| XS2678191904   | ASSA-ABLOY 23/35 MTN      | 4,125    | 0                                   | 0   | 600     | 103,5790                          | 621.474,00         | 0,42                                 |
| XS2347663507   | ASTRAZENECA 21/29 MTN     | 0,375    | 0                                   | 0   | 500     | 86,4340                           | 432.170,00         | 0,29                                 |
| XS1482736185   | ATLAS COPCO 16/26 MTN     | 0,625    | 0                                   | 0   | 200     | 93,8920                           | 187.784,00         | 0,13                                 |
| XS1418788599   | AURIZON NET.PTY.16/26 MTN | 3,125    | 0                                   | 0   | 300     | 98,5020                           | 295.506,00         | 0,20                                 |
| XS2431029441   | AXA 22/42 FLR MTN         | 1,875    | 0                                   | 0   | 300     | 83,1430                           | 249.429,00         | 0,17                                 |
| XS2610457967   | AXA 23/43 FLR MTN         | 5,500    | 0                                   | 0   | 200     | 106,9740                          | 213.948,00         | 0,14                                 |
| XS2737652474   | AXA 24/UND. FLR MTN       | 6,375    | 0                                   | 0   | 290     | 103,8130                          | 301.057,70         | 0,20                                 |
| XS2537251170   | AXA S.A. 22/30 MTN        | 3,750    | 0                                   | 0   | 620     | 101,9180                          | 631.891,60         | 0,43                                 |
| IT0005572166   | BANCO BPM 23/27 MTN       | 4,625    | 0                                   | 0   | 400     | 102,2860                          | 409.144,00         | 0,28                                 |
| IT0005580136   | BANCO BPM 24/30 FLR MTN   | 4,875    | 0                                   | 0   | 300     | 102,2200                          | 306.660,00         | 0,21                                 |
| AT0000AONFW6   | BAWAG P.S.K.11-24/11 ZO   | 0,000    | 0                                   | 0   | 140     | 97,7850                           | 136.899,00         | 0,09                                 |
| XS2430998893   | BBVA 22/29 FLR MTN        | 0,875    | 0                                   | 0   | 500     | 90,3010                           | 451.505,00         | 0,30                                 |
| XS2636592102   | BBVA 23/33 FLR MTN        | 5,750    | 0                                   | 0   | 400     | 104,5580                          | 418.232,00         | 0,28                                 |
| XS2747065030   | BBVA 24/34 MTN            | 3,875    | 0                                   | 0   | 600     | 100,4470                          | 602.682,00         | 0,41                                 |
| XS2762369549   | BBVA 24/36 FLR MTN        | 4,875    | 0                                   | 0   | 200     | 101,0340                          | 202.068,00         | 0,14                                 |
| XS2028816028   | BCO SABADELL 19/25 MTN    | 0,875    | 0                                   | 0   | 300     | 96,8370                           | 290.511,00         | 0,20                                 |
| XS2598331242   | BCO SABADELL 23/29 FLR    | 5,000    | 0                                   | 0   | 600     | 104,3040                          | 625.824,00         | 0,42                                 |
| XS2677541364   | BCO SABADELL 23/29 FLRMTN | 5,500    | 0                                   | 0   | 200     | 105,2030                          | 210.406,00         | 0,14                                 |
| XS2588884481   | BCO SABADELL 23/33 FLRMTN | 6,000    | 0                                   | 0   | 200     | 104,0760                          | 208.152,00         | 0,14                                 |
| XS2745719000   | BCO SABADELL 24/30 FLR    | 4,000    | 0                                   | 0   | 300     | 100,6830                          | 302.049,00         | 0,20                                 |
| XS2194370727   | BCO SANTAND. 20/27 MTN    | 1,125    | 0                                   | 0   | 300     | 92,8860                           | 278.658,00         | 0,19                                 |
| XS2743029253   | BCO SANTAND. 24/28 FLR    | 3,500    | 0                                   | 0   | 500     | 99,1960                           | 495.980,00         | 0,33                                 |
| XS2743029766   | BCO SANTAND. 24/30 FLR    | 3,500    | 0                                   | 0   | 500     | 98,8050                           | 494.025,00         | 0,33                                 |
| XS2751667150   | BCO SANTAND. 24/34 FLRMTN | 5,000    | 0                                   | 0   | 200     | 101,5700                          | 203.140,00         | 0,14                                 |
| XS2743029840   | BCO SANTAND. 24/34 MTN    | 3,750    | 0                                   | 0   | 400     | 99,5600                           | 398.240,00         | 0,27                                 |
| XS2538366878   | BCO SANTAND.22/26 FLR MTN | 3,625    | 0                                   | 0   | 300     | 99,7380                           | 299.214,00         | 0,20                                 |
| XS2705604077   | BCO SANTAND.23/27 FLR MTN | 4,625    | 300                                 | 0   | 300     | 101,5390                          | 304.617,00         | 0,21                                 |
| BE0002963446   | BELFIUS BK 23/29 MTN      | 4,125    | 0                                   | 0   | 400     | 101,6480                          | 406.592,00         | 0,27                                 |
| BE0002993740   | BELFIUS BK 24/29 MTN      | 3,750    | 0                                   | 0   | 200     | 98,6410                           | 197.282,00         | 0,13                                 |

| ISIN         | Wertpapier-Bezeichnung    | Zinssatz | Käufe / Zugänge<br>Stück / Nominale | Verkäufe / Abgänge<br>Nom. in 1.000, ger.) | Bestand | Kurs in<br>Wertpapier-<br>währung | Kurswert<br>in EUR | %-Anteil<br>am<br>Fonds-<br>vermögen |
|--------------|---------------------------|----------|-------------------------------------|--|---------|-----------------------------------|--------------------|--------------------------------------|
| XS2176558620 | BERTELSMANN ANL.20/30     | 1,500    | 0                                   | 0  | 300     | 88,6060                           | 265.818,00         | 0,18                                 |
| XS2560753936 | BERTELSMANN ANL.22/29     | 3,500    | 0                                   | 0  | 300     | 98,8870                           | 296.661,00         | 0,20                                 |
| FR00140003P3 | BFCM 20/27 MTN            | 0,100    | 0                                   | 0  | 300     | 89,0880                           | 267.264,00         | 0,18                                 |
| XS2576362839 | BK IRELAND 23/28 FLR MTN  | 4,875    | 0                                   | 0  | 650     | 102,8810                          | 668.726,50         | 0,45                                 |
| XS2717301365 | BK IRELAND 23/29 FLR MTN  | 4,625    | 0                                   | 0  | 270     | 102,6900                          | 277.263,00         | 0,19                                 |
| XS2643234011 | BK IRELAND 23/31 FLR MTN  | 5,000    | 0                                   | 0  | 300     | 105,3340                          | 316.002,00         | 0,21                                 |
| XS2049707180 | BK NOVA SCOT 19/26 MTN    | 0,125    | 0                                   | 0  | 300     | 92,3010                           | 276.903,00         | 0,19                                 |
| XS2102357105 | BMW FIN. 20/32 MTN        | 0,875    | 0                                   | 0  | 500     | 83,2150                           | 416.075,00         | 0,28                                 |
| XS2280845145 | BMW FIN. 21/33 MTN        | 0,200    | 0                                   | 0  | 300     | 76,0280                           | 228.084,00         | 0,15                                 |
| XS2625968776 | BMW FIN. 23/35 MTN        | 3,625    | 0                                   | 0  | 300     | 99,1870                           | 297.561,00         | 0,20                                 |
| XS2823825802 | BMW INT. INV 24/32 MTN    | 3,500    | 650                                 | 0  | 650     | 98,8490                           | 642.518,50         | 0,43                                 |
| FR0013381704 | BNP PARIBAS 18/30 FLR MTN | 2,375    | 0                                   | 0  | 300     | 97,5250                           | 292.575,00         | 0,20                                 |
| FR0014000UL9 | BNP PARIBAS 20/32 MTN     | 0,625    | 0                                   | 0  | 400     | 76,6540                           | 306.616,00         | 0,21                                 |
| FR0014001JT3 | BNP PARIBAS 21/30 MTN     | 0,500    | 0                                   | 0  | 700     | 85,6510                           | 599.557,00         | 0,40                                 |
| FR001400LZI6 | BNP PARIBAS 23/32 FLR MTN | 4,750    | 0                                   | 0  | 300     | 104,6290                          | 313.887,00         | 0,21                                 |
| FR001400NV51 | BNP PARIBAS 24/34 MTN     | 4,095    | 0                                   | 0  | 300     | 100,8320                          | 302.496,00         | 0,20                                 |
| XS2308322002 | BOOKING HLDG 21/28        | 0,500    | 0                                   | 0  | 300     | 89,3420                           | 268.026,00         | 0,18                                 |
| FR0014009YC1 | BPCE 22/32 MTN            | 2,375    | 0                                   | 0  | 300     | 91,0760                           | 273.228,00         | 0,18                                 |
| FR001400F083 | BPCE 23/33 MTN            | 4,500    | 0                                   | 0  | 200     | 103,7560                          | 207.512,00         | 0,14                                 |
| FR001400FB22 | BPCE 23/35 FLR MTN        | 5,125    | 0                                   | 0  | 400     | 102,3970                          | 409.588,00         | 0,28                                 |
| IT0005561243 | BPER BANCA 23/29 FLR MTN  | 5,750    | 0                                   | 0  | 170     | 105,2290                          | 178.889,30         | 0,12                                 |
| BE0002601798 | BPOST 18-26               | 1,250    | 0                                   | 0  | 300     | 94,7120                           | 284.136,00         | 0,19                                 |
| FR0014001JP1 | BQ.STELL.FR. 21/25 MTN    | 0,000    | 0                                   | 0  | 300     | 97,6490                           | 292.947,00         | 0,20                                 |
| FR001400N5B5 | BQ.STELL.FR. 24/27 MTN    | 3,500    | 0                                   | 0  | 300     | 99,1520                           | 297.456,00         | 0,20                                 |
| FR0013425162 | BQUE F.C.MTL 19/29 MTN    | 1,875    | 0                                   | 0  | 200     | 90,7010                           | 181.402,00         | 0,12                                 |
| FR0013415692 | BQUE POSTALE 19/29 MTN    | 1,375    | 0                                   | 0  | 300     | 89,3330                           | 267.999,00         | 0,18                                 |
| FR0014001R34 | BQUE POSTALE 21/32FLR MTN | 0,750    | 0                                   | 0  | 200     | 89,5100                           | 179.020,00         | 0,12                                 |
| FR001400NU45 | BQUE POSTALE 24/30 MTN    | 3,500    | 0                                   | 0  | 800     | 98,7040                           | 789.632,00         | 0,53                                 |
| XS2802928692 | BRENTAG FIN 24/32 MTN     | 3,875    | 500                                 | 0  | 500     | 97,4860                           | 487.430,00         | 0,33                                 |
| XS2582814039 | BRIT.TELECOM 23/31 MTN    | 3,750    | 0                                   | 0  | 220     | 99,6520                           | 219.234,40         | 0,15                                 |
| XS2675225531 | BRIT.TELECOM 23/33 MTN    | 4,250    | 0                                   | 0  | 490     | 102,2970                          | 501.255,30         | 0,34                                 |
| PTCGDCOM0037 | CAIXA GERAL 21/27 FLR MTN | 0,375    | 0                                   | 0  | 300     | 92,4820                           | 277.446,00         | 0,19                                 |
| XS2258971071 | CAIXABK 20/26 FLR MTN     | 0,375    | 0                                   | 0  | 300     | 94,9710                           | 284.913,00         | 0,19                                 |
| XS2346253730 | CAIXABK 21/28 FLR MTN     | 0,750    | 0                                   | 0  | 500     | 91,5660                           | 457.830,00         | 0,31                                 |
| XS2649712689 | CAIXABK 23/29 FLR MTN     | 5,000    | 0                                   | 0  | 200     | 103,8460                          | 207.692,00         | 0,14                                 |
| XS2726256113 | CAIXABK 23/33 MTN         | 4,375    | 0                                   | 0  | 400     | 104,4430                          | 417.772,00         | 0,28                                 |
| XS2630417124 | CAIXABK 23/34 FLR MTN     | 6,125    | 0                                   | 0  | 600     | 105,9320                          | 635.592,00         | 0,43                                 |
| XS2764459363 | CAIXABK 24/32 FLR MTN     | 4,125    | 0                                   | 0  | 300     | 100,2360                          | 300.708,00         | 0,20                                 |
| ES0840609053 | CAIXABK 24/UND. FLR       | 7,500    | 0                                   | 0  | 200     | 105,0860                          | 210.172,00         | 0,14                                 |
| XS2133071774 | CARLSB.BREW. 20/30 MTN    | 0,625    | 0                                   | 0  | 400     | 84,6350                           | 338.540,00         | 0,23                                 |
| FR001400D0F9 | CARREF. 22/28 MTN         | 4,125    | 0                                   | 0  | 400     | 101,8300                          | 407.320,00         | 0,27                                 |
| FR0014009E07 | CARREF. 22/29 MTN         | 2,375    | 0                                   | 0  | 300     | 93,8240                           | 281.472,00         | 0,19                                 |
| FR001400HU68 | CARREF. 23/30 MTN         | 3,750    | 0                                   | 0  | 200     | 99,9990                           | 199.998,00         | 0,13                                 |
| XS2387052744 | CASTEL.H.FI. 21/29 MTN    | 0,875    | 0                                   | 0  | 800     | 81,3630                           | 650.904,00         | 0,44                                 |
| XS2461785185 | CASTEL.H.FI. 22/25 MTN    | 2,000    | 0                                   | 0  | 400     | 97,9920                           | 391.968,00         | 0,26                                 |
| XS2337061753 | CCEP FIN.IE 21/33         | 0,875    | 0                                   | 0  | 500     | 78,5040                           | 392.520,00         | 0,26                                 |
| XS1901137361 | CELANESE US 18/27         | 2,125    | 0                                   | 0  | 450     | 94,9130                           | 427.108,50         | 0,29                                 |
| XS2826616596 | CELLNEX FIN. 24/29 MTN    | 3,625    | 500                                 | 0  | 500     | 98,8070                           | 494.035,00         | 0,33                                 |
| AT0000A2STV4 | CESKA SPORIT 21/28 FLRMTN | 0,500    | 0                                   | 0  | 500     | 88,0800                           | 440.400,00         | 0,30                                 |
| XS2676413235 | CESKA SPORIT 23/28 FLRMTN | 5,737    | 0                                   | 0  | 100     | 103,2260                          | 103.226,00         | 0,07                                 |
| XS2746647036 | CESKA SPORIT 24/30FLR MTN | 4,824    | 0                                   | 0  | 200     | 101,2210                          | 202.442,00         | 0,14                                 |
| XS2022084367 | CNH INDUSTR. 19/29 MTN    | 1,625    | 0                                   | 0  | 500     | 90,1310                           | 450.655,00         | 0,30                                 |
| DE000CZ43ZN8 | COBA 23/30 VAR            | 5,125    | 0                                   | 0  | 100     | 104,1750                          | 104.175,00         | 0,07                                 |
| DE000CZ439T8 | COBA 24/31 VAR            | 4,625    | 0                                   | 0  | 100     | 102,1790                          | 102.179,00         | 0,07                                 |
| DE000CZ45V25 | COBA FIX-RESET 20/30 SUB. | 4,000    | 0                                   | 0  | 300     | 99,3260                           | 297.978,00         | 0,20                                 |
| DE000CZ43Z49 | COBA FIX-RESET 23/33 SUB. | 6,750    | 0                                   | 0  | 300     | 107,6890                          | 323.067,00         | 0,22                                 |
| DE000CZ40N46 | COBA MTN 19/26            | 1,125    | 0                                   | 0  | 300     | 94,8450                           | 284.535,00         | 0,19                                 |
| DE000CZ45YA3 | COBA MTN 24/27VAR1037     | 4,640    | 200                                 | 0  | 200     | 100,4090                          | 200.818,00         | 0,14                                 |
| DE000CZ40LD5 | COBA T2 NACHRANG 16/26    | 4,000    | 0                                   | 0  | 100     | 100,1570                          | 100.157,00         | 0,07                                 |
| XS1995781546 | COCA C.HBC F 19/27 MTN    | 1,000    | 0                                   | 0  | 500     | 92,6520                           | 463.260,00         | 0,31                                 |
| XS2264977146 | COCA-C.EU.P. 20/28        | 0,200    | 0                                   | 0  | 300     | 85,9030                           | 257.709,00         | 0,17                                 |
| XS1637093508 | COM.GR.FIN.N 17/24 MTN    | 0,625    | 0                                   | 0  | 300     | 99,7230                           | 299.169,00         | 0,20                                 |
| XS2528582377 | COM.GR.FIN.N 22/30 MTN    | 3,000    | 0                                   | 0  | 600     | 97,3100                           | 583.860,00         | 0,39                                 |
| XS2758114321 | COMPASS GRP 24/31 MTN     | 3,250    | 0                                   | 0  | 400     | 97,9400                           | 391.760,00         | 0,26                                 |
| XS2558972415 | CONTINENTAL MTN22/27      | 3,625    | 0                                   | 0  | 520     | 99,7630                           | 518.767,60         | 0,35                                 |
| XS2630117328 | CONTINENTAL MTN23/28      | 4,000    | 0                                   | 0  | 350     | 101,0060                          | 353.521,00         | 0,24                                 |
| FR0013519279 | COVIVIO 20/30             | 1,625    | 0                                   | 0  | 300     | 87,2730                           | 261.819,00         | 0,18                                 |
| FR001400MDV4 | COVIVIO 23/32 MTN         | 4,625    | 0                                   | 0  | 400     | 101,3020                          | 405.208,00         | 0,27                                 |
| FR001400Q7X2 | COVIVIO HOT. 24/33 MTN    | 4,125    | 600                                 | 0  | 600     | 97,8890                           | 587.334,00         | 0,40                                 |

| ISIN          | Wertpapier-Bezeichnung     | Zinssatz | Käufe / Zugänge<br>Stück / Nominale | Verkäufe / Abgänge<br>(Nom. in 1.000, ger.) | Bestand | Kurs in<br>Wertpapier-<br>währung | Kurswert<br>in EUR | %-Anteil<br>am<br>Fonds-<br>vermögen |
|---------------|----------------------------|----------|-------------------------------------|---|---------|-----------------------------------|--------------------|--------------------------------------|
| FR00140007B4  | CR.MUT.ARKEA 20/26 MTN     | 0,010    | 0                                   | 0   | 200     | 94,0860                           | 188.172,00         | 0,13                                 |
| FR0014002BJ9  | CR.MUT.ARKEA 21/33 MTN     | 0,875    | 0                                   | 0   | 400     | 78,1140                           | 312.456,00         | 0,21                                 |
| XS1204154410  | CREDIT AGRIC. 15/27        | 2,625    | 0                                   | 0   | 300     | 97,1340                           | 291.402,00         | 0,20                                 |
| FR0014003182  | CREDIT AGRIC. 21/28 MTN    | 0,375    | 0                                   | 0   | 400     | 88,1640                           | 352.656,00         | 0,24                                 |
| FR001400GDF9  | CREDIT AGRIC. 23/30 MTN    | 4,125    | 0                                   | 0   | 600     | 102,6310                          | 615.786,00         | 0,42                                 |
| FR001400M4O2  | CREDIT AGRIC. 23/33 MTN    | 4,375    | 0                                   | 0   | 500     | 103,6220                          | 518.110,00         | 0,35                                 |
| FR001400N2M9  | CREDIT AGRIC. 24/34 MTN    | 3,750    | 0                                   | 0   | 300     | 100,0620                          | 300.186,00         | 0,20                                 |
| FR001400O9D2  | CREDIT AGRIC. 24/36 MTN    | 4,125    | 300                                 | 0   | 300     | 100,5980                          | 301.794,00         | 0,20                                 |
| FR001400N2U2  | CREDIT AGRIC. 24/UN.FLRMTN | 6,500    | 0                                   | 0   | 300     | 101,1980                          | 303.594,00         | 0,20                                 |
| XS2648077274  | CRH SMW FIN. 23/35 MTN     | 4,250    | 0                                   | 0   | 140     | 102,0700                          | 142.898,00         | 0,10                                 |
| ES0205045026  | CRITER.CAIXA 20/27 MTN     | 0,875    | 0                                   | 0   | 600     | 90,5750                           | 543.450,00         | 0,37                                 |
| XS2356029541  | CTP 21/25 MTN              | 0,500    | 0                                   | 0   | 226     | 96,1710                           | 217.346,46         | 0,15                                 |
| XS2434791690  | CTP 22/26 MTN              | 0,875    | 0                                   | 0   | 151     | 94,5950                           | 142.838,45         | 0,10                                 |
| XS2759989234  | CTP 24/30 MTN              | 4,750    | 0                                   | 0   | 210     | 100,4290                          | 210.900,90         | 0,14                                 |
| FR0014006FE2  | DANONE 21/30 MTN           | 0,520    | 0                                   | 0   | 300     | 82,9690                           | 248.907,00         | 0,17                                 |
| FR0014005EJ6  | DANONE 21/UND. FLR MTN     | 1,000    | 0                                   | 0   | 800     | 92,2280                           | 737.824,00         | 0,50                                 |
| XS2308298962  | DE VOLKSBK 21/28 MTN       | 0,375    | 0                                   | 0   | 400     | 87,5480                           | 350.192,00         | 0,24                                 |
| DE000A289N78  | DEUT.BOERSE SUB.ANL20/47   | 1,250    | 0                                   | 0   | 800     | 92,2210                           | 737.768,00         | 0,50                                 |
| XS2534985523  | DNB BK 22/27 FLR MTN       | 3,125    | 0                                   | 0   | 400     | 98,5540                           | 394.216,00         | 0,27                                 |
| XS2051777873  | DS SMITH PLC 19/26 MTN     | 0,875    | 0                                   | 0   | 450     | 93,5180                           | 420.831,00         | 0,28                                 |
| XS2654097927  | DS SMITH PLC 23/27 MTN     | 4,375    | 0                                   | 0   | 300     | 100,9030                          | 302.709,00         | 0,20                                 |
| XS2654098222  | DS SMITH PLC 23/30 MTN     | 4,500    | 0                                   | 0   | 300     | 102,1850                          | 306.555,00         | 0,21                                 |
| XS2360881549  | DSV FIN. 21/33 MTN         | 0,750    | 0                                   | 0   | 300     | 76,6710                           | 230.013,00         | 0,16                                 |
| DE000A30WVFV1 | DT.PFBR.BK MTN.35416       | 4,375    | 0                                   | 0   | 400     | 96,3350                           | 385.340,00         | 0,26                                 |
| DE000A2TSDE2  | DT.TELEKOM MTN 19/31       | 1,750    | 0                                   | 0   | 300     | 90,6950                           | 272.085,00         | 0,18                                 |
| XS1883245331  | DXC TECHNOLOGY 18/26       | 1,750    | 0                                   | 0   | 400     | 96,2990                           | 385.196,00         | 0,26                                 |
| FR0012599892  | EDENRED 15-25              | 1,375    | 0                                   | 0   | 200     | 98,1450                           | 196.290,00         | 0,13                                 |
| XS2540585564  | ELECTROLUX 22/26 MTN       | 4,125    | 0                                   | 0   | 650     | 99,8760                           | 649.194,00         | 0,44                                 |
| XS2475919663  | ELECTROLUX 22/30 MTN       | 2,500    | 0                                   | 0   | 300     | 91,3310                           | 273.993,00         | 0,18                                 |
| FR001400OP33  | ELIS 24/30 MTN             | 3,750    | 200                                 | 0   | 200     | 99,0610                           | 198.122,00         | 0,13                                 |
| XS1209031019  | ELM B.V. 15/UND. FLR MTN   | 2,600    | 0                                   | 0   | 300     | 97,4240                           | 292.272,00         | 0,20                                 |
| FR001400KWR6  | ELO 23/29 MTN              | 6,000    | 0                                   | 0   | 200     | 99,4450                           | 198.890,00         | 0,13                                 |
| XS2304340693  | EQUINIX 21/33              | 1,000    | 0                                   | 0   | 500     | 78,2620                           | 391.310,00         | 0,26                                 |
| XS2083210729  | ERSTE GR.BK. 19/30 MTN     | 1,000    | 0                                   | 0   | 700     | 96,4130                           | 674.891,00         | 0,46                                 |
| AT0000A36XD5  | ERSTE GR.BK. 23/UND. FLR   | 8,500    | 0                                   | 0   | 200     | 107,8700                          | 215.740,00         | 0,15                                 |
| FR0013463650  | ESSILORLUXO. 19/25 MTN     | 0,125    | 0                                   | 0   | 400     | 96,6180                           | 386.472,00         | 0,26                                 |
| XS1198117670  | ESSITY 15/25 MTN           | 1,125    | 0                                   | 0   | 300     | 97,8810                           | 293.643,00         | 0,20                                 |
| XS1243251375  | EUROGRID GMBH MTN.15/25    | 1,875    | 0                                   | 0   | 200     | 98,1630                           | 196.326,00         | 0,13                                 |
| XS2615183501  | EUROGRID GMBH MTN.23/30    | 3,722    | 0                                   | 0   | 400     | 99,6480                           | 398.592,00         | 0,27                                 |
| XS1789623029  | EURONEXT 18/25             | 1,000    | 0                                   | 0   | 300     | 97,5410                           | 292.623,00         | 0,20                                 |
| XS2009943379  | EURONEXT 19/29             | 1,125    | 0                                   | 0   | 300     | 88,8750                           | 266.625,00         | 0,18                                 |
| DK0030486402  | EURONEXT 21/31             | 0,750    | 0                                   | 0   | 300     | 82,5820                           | 247.746,00         | 0,17                                 |
| DK0030486592  | EURONEXT 21/41             | 1,500    | 0                                   | 0   | 200     | 71,9350                           | 143.870,00         | 0,10                                 |
| DE000A289NX4  | EVONIK IND.MTN 20/25       | 0,625    | 0                                   | 0   | 400     | 96,0960                           | 384.384,00         | 0,26                                 |
| XS2590759986  | FINCECOBK 23/29 MTN FLR    | 4,625    | 0                                   | 0   | 230     | 101,8020                          | 234.144,60         | 0,16                                 |
| FR0013515871  | FONC.LYONN 20/27           | 1,500    | 0                                   | 0   | 300     | 93,8990                           | 281.697,00         | 0,19                                 |
| XS2081474046  | FORVIA 19/27               | 2,375    | 0                                   | 0   | 100     | 94,8380                           | 94.838,00          | 0,06                                 |
| FR0013266350  | GECINA 17-27 MTN           | 1,375    | 0                                   | 0   | 300     | 93,5230                           | 280.569,00         | 0,19                                 |
| XS2126170161  | GIVAU.FIN.EU 20/32         | 1,625    | 0                                   | 0   | 400     | 86,4580                           | 345.832,00         | 0,23                                 |
| XS2715302001  | GIVAU.FIN.EU 23/33         | 4,125    | 0                                   | 0   | 300     | 102,5150                          | 307.545,00         | 0,21                                 |
| XS1681520356  | GLAXOSM.CAP. MTN 17/29     | 1,375    | 0                                   | 0   | 300     | 90,2000                           | 270.600,00         | 0,18                                 |
| XS2125145867  | GM FINANCIAL 20/26 MTN     | 0,850    | 0                                   | 0   | 500     | 95,0720                           | 475.360,00         | 0,32                                 |
| XS2384274366  | GM FINANCIAL 21/28 MTN     | 0,650    | 0                                   | 0   | 400     | 87,5150                           | 350.060,00         | 0,24                                 |
| XS2587352340  | GM FINANCIAL 23/29 MTN     | 4,300    | 0                                   | 0   | 400     | 101,2780                          | 405.112,00         | 0,27                                 |
| XS2747270630  | GM FINANCIAL 24/28 MTN     | 3,900    | 0                                   | 0   | 230     | 99,7800                           | 229.494,00         | 0,15                                 |
| XS2243299463  | H.LUNDBECK 20/27 MTN       | 0,875    | 0                                   | 0   | 300     | 90,1360                           | 270.408,00         | 0,18                                 |
| XS2198574209  | HANN RUECK SUB 2020/2040   | 1,750    | 0                                   | 0   | 200     | 86,3130                           | 172.626,00         | 0,12                                 |
| DE000HCB0AZ3  | HCOB IS 21/26              | 0,375    | 0                                   | 0   | 400     | 93,0530                           | 372.212,00         | 0,25                                 |
| XS1877595014  | HEINEKEN 18/31 MTN         | 1,750    | 0                                   | 0   | 400     | 88,9630                           | 355.852,00         | 0,24                                 |
| DE000A3E5S00  | HOCHTIEF AG MTN 21/29      | 0,625    | 0                                   | 0   | 500     | 85,2540                           | 426.270,00         | 0,29                                 |
| XS2388491289  | HSBC HLDGS 21/29 FLR MTN   | 0,641    | 0                                   | 0   | 400     | 87,4960                           | 349.984,00         | 0,24                                 |
| XS2788605660  | HSBC HLDGS 24/35 FLR MTN   | 4,599    | 400                                 | 0   | 400     | 100,0920                          | 400.368,00         | 0,27                                 |
| XS2723593187  | IHG FIN. 23/29 MTN         | 4,375    | 0                                   | 0   | 150     | 101,6560                          | 152.484,00         | 0,10                                 |
| XS2068065163  | INFORMA 19/28 MTN          | 1,250    | 0                                   | 0   | 300     | 90,7390                           | 272.217,00         | 0,18                                 |
| XS2258452478  | ING GROEP 20/29 FLR        | 0,250    | 0                                   | 0   | 600     | 87,5270                           | 525.162,00         | 0,35                                 |
| XS2176621170  | ING GROEP 20/31 FLR MTN    | 2,125    | 0                                   | 0   | 300     | 95,9940                           | 287.982,00         | 0,19                                 |
| XS2524746687  | ING GROEP 22/33 FLR MTN    | 4,125    | 0                                   | 0   | 500     | 99,2780                           | 496.390,00         | 0,33                                 |
| XS2764264607  | ING GROEP 24/29 FLR MTN    | 3,875    | 0                                   | 0   | 200     | 100,0830                          | 200.166,00         | 0,14                                 |
| XS2818300407  | ING GROEP 24/34 FLR MTN    | 4,375    | 400                                 | 0   | 400     | 99,1560                           | 396.624,00         | 0,27                                 |



| ISIN         | Wertpapier-Bezeichnung    | Zinssatz | Käufe / Zugänge<br>Stück / Nominale | Verkäufe / Abgänge<br>(Nom. in 1.000, ger.) | Bestand | Kurs in<br>Wertpapier-<br>währung | Kurswert<br>in EUR | %-Anteil<br>am<br>Fonds-<br>vermögen |
|--------------|---------------------------|----------|-------------------------------------|---|---------|-----------------------------------|--------------------|--------------------------------------|
| XS2764264789 | ING GROEP 24/35 FLR MTN   | 4,000    | 0                                   | 0   | 300     | 100,5590                          | 301.677,00         | 0,20                                 |
| ES0239140017 | INMOBIL.COL. 20/28 MTN    | 1,350    | 0                                   | 0   | 300     | 90,4130                           | 271.239,00         | 0,18                                 |
| ES0239140025 | INMOBIL.COL. 21/29 MTN    | 0,750    | 0                                   | 0   | 400     | 85,6520                           | 342.608,00         | 0,23                                 |
| XS1908370171 | INTERCONT.HOT.GRP 18/27   | 2,125    | 0                                   | 0   | 400     | 95,3920                           | 381.568,00         | 0,26                                 |
| XS2022424993 | INTESA SAN. 19/29 MTN     | 1,750    | 0                                   | 0   | 400     | 90,8440                           | 363.376,00         | 0,25                                 |
| XS2678939427 | INTESA SAN. 23/UND.FLR    | 9,125    | 0                                   | 0   | 200     | 111,2200                          | 222.440,00         | 0,15                                 |
| XS2592650373 | INTESA SANP.23/28 FLR MTN | 5,000    | 0                                   | 0   | 880     | 102,8020                          | 904.657,60         | 0,61                                 |
| XS2592658947 | INTESA SANP.23/33 MTN     | 5,625    | 0                                   | 0   | 250     | 109,8940                          | 274.735,00         | 0,19                                 |
| XS1843459782 | INTL FLAV.+FRAG. 18/26    | 1,800    | 0                                   | 0   | 300     | 95,2500                           | 285.750,00         | 0,19                                 |
| XS1673102734 | ISS GLOBAL 17/27 MTN      | 1,500    | 0                                   | 0   | 300     | 92,8310                           | 278.493,00         | 0,19                                 |
| DE000A1919H2 | JAB HOLDINGS 18/29        | 2,500    | 0                                   | 0   | 600     | 94,0320                           | 564.192,00         | 0,38                                 |
| DE000A3K5HW7 | JAB HOLDINGS 22/32        | 4,750    | 500                                 | 0   | 500     | 103,6430                          | 518.215,00         | 0,35                                 |
| FR0013509643 | JCDECAUX SE 20/28         | 2,625    | 0                                   | 0   | 400     | 96,0060                           | 384.024,00         | 0,26                                 |
| XS2354444023 | JDE PEETS 21/26 MTN       | 0,000    | 0                                   | 0   | 300     | 93,9220                           | 281.766,00         | 0,19                                 |
| XS2728561098 | JDE PEETS 23/30 MTN       | 4,125    | 0                                   | 0   | 400     | 100,3940                          | 401.576,00         | 0,27                                 |
| XS2544400786 | JYSKE BK 22/26 FLR MTN    | 4,625    | 0                                   | 200   | 200     | 100,4690                          | 200.938,00         | 0,14                                 |
| XS2754488851 | JYSKE BK 24/35 FLR MTN    | 5,125    | 0                                   | 0   | 250     | 101,8660                          | 254.665,00         | 0,17                                 |
| BE0002664457 | KBC GROEP 19/29 FLR MTN   | 0,500    | 0                                   | 0   | 400     | 97,9850                           | 391.940,00         | 0,26                                 |
| BE0002799808 | KBC GROEP 21/31 MTN       | 0,750    | 0                                   | 0   | 300     | 82,8790                           | 248.637,00         | 0,17                                 |
| BE0002987684 | KBC GROEP 23/29 FLR MTN   | 4,250    | 0                                   | 0   | 300     | 101,7140                          | 305.142,00         | 0,21                                 |
| BE0002914951 | KBC GROEP 23/33 FLR MTN   | 4,875    | 0                                   | 0   | 600     | 101,5100                          | 609.060,00         | 0,41                                 |
| BE0002990712 | KBC GROEP 24/35 FLR MTN   | 4,750    | 0                                   | 0   | 400     | 100,6850                          | 402.740,00         | 0,27                                 |
| FR0014000KT3 | KLEPIERRE 20/31 MTN       | 0,875    | 0                                   | 0   | 600     | 82,7080                           | 496.248,00         | 0,33                                 |
| XS2001175657 | KONI.PHILIPS 19/26        | 0,500    | 0                                   | 0   | 300     | 94,0420                           | 282.126,00         | 0,19                                 |
| XS2475958059 | KONI.PHILIPS 22/29 MTN    | 2,125    | 0                                   | 0   | 300     | 92,3470                           | 277.041,00         | 0,19                                 |
| XS2676863355 | KONI.PHILIPS 23/31 MTN    | 4,250    | 0                                   | 0   | 300     | 102,0500                          | 306.150,00         | 0,21                                 |
| XS2486270858 | KONINKL.KPN 22/UND. FLR   | 6,000    | 0                                   | 0   | 300     | 105,2030                          | 315.609,00         | 0,21                                 |
| XS2764455619 | KONINKL.KPN 24/36 MTN     | 3,875    | 0                                   | 0   | 200     | 97,8880                           | 195.776,00         | 0,13                                 |
| FR0013519261 | LA MONDIALE 20/31         | 2,125    | 0                                   | 0   | 500     | 86,8840                           | 434.420,00         | 0,29                                 |
| FR0013508694 | LA POSTE 20/32 MTN        | 1,375    | 400                                 | 0   | 700     | 85,0160                           | 595.112,00         | 0,40                                 |
| XS1685653211 | LDN STOCK EXCH.GRP 17/29  | 1,750    | 0                                   | 0   | 400     | 91,1680                           | 364.672,00         | 0,25                                 |
| XS2305244241 | LEASEPLAN 21/26 MTN       | 0,250    | 0                                   | 0   | 1.000   | 94,0380                           | 940.380,00         | 0,63                                 |
| FR0013513538 | LEGRAND 20/30             | 0,750    | 0                                   | 0   | 600     | 85,9910                           | 515.946,00         | 0,35                                 |
| FR00140015S6 | LEGRAND 23/29             | 3,500    | 0                                   | 0   | 600     | 100,4980                          | 602.988,00         | 0,41                                 |
| XS2679903950 | LSEG NETHERL 23/26 MTN    | 4,125    | 0                                   | 0   | 400     | 100,9530                          | 403.812,00         | 0,27                                 |
| XS2679904685 | LSEG NETHERL 23/30 MTN    | 4,231    | 0                                   | 0   | 300     | 102,8920                          | 308.676,00         | 0,21                                 |
| DE000A382988 | M.B.INT.FIN. 24/30 MTN    | 3,250    | 700                                 | 0   | 700     | 98,0560                           | 686.392,00         | 0,46                                 |
| DE000A3LSYH6 | M.B.INT.FIN. 24/32 MTN    | 3,250    | 0                                   | 0   | 550     | 97,4290                           | 535.859,50         | 0,36                                 |
| XS2597677090 | MAGNA INTL 23/32          | 4,375    | 0                                   | 0   | 110     | 103,3240                          | 113.656,40         | 0,08                                 |
| XS2729836234 | MEDIOBANCA 23/30 FLR MTN  | 4,375    | 0                                   | 0   | 400     | 101,8180                          | 407.272,00         | 0,27                                 |
| XS2238792175 | MEDTR.GLB HD 20/32        | 0,750    | 0                                   | 0   | 600     | 79,8660                           | 479.196,00         | 0,32                                 |
| DE000A2YPFU9 | MERCEDESBENZ MTN 19/31    | 1,125    | 0                                   | 0   | 950     | 84,6570                           | 804.241,50         | 0,54                                 |
| FR0013425154 | MMS USA FIN. 19/31        | 1,750    | 100                                 | 0   | 500     | 88,6000                           | 443.000,00         | 0,30                                 |
| FR0013425139 | MMS USA INV. 19/25        | 0,625    | 0                                   | 0   | 300     | 96,7650                           | 290.295,00         | 0,20                                 |
| FR0013425147 | MMS USA INV. 19/28        | 1,250    | 300                                 | 0   | 300     | 91,2010                           | 273.603,00         | 0,18                                 |
| XS1117298163 | MOODY'S 15/27             | 1,750    | 0                                   | 0   | 300     | 95,6410                           | 286.923,00         | 0,19                                 |
| XS2010038227 | MOODY'S CORP 19/30        | 0,950    | 0                                   | 0   | 800     | 86,1640                           | 689.312,00         | 0,47                                 |
| XS2221845683 | MUENCH.RUECK 20/41        | 1,250    | 0                                   | 0   | 200     | 82,9000                           | 165.800,00         | 0,11                                 |
| XS2817890077 | MUENCH.RUECK 24/44        | 4,250    | 800                                 | 0   | 800     | 98,1590                           | 785.272,00         | 0,53                                 |
| XS1843442622 | NASDAQ 19/29              | 1,750    | 0                                   | 0   | 300     | 91,5570                           | 274.671,00         | 0,19                                 |
| XS2369906644 | NASDAQ 21/33              | 0,900    | 0                                   | 0   | 400     | 77,3770                           | 309.508,00         | 0,21                                 |
| XS2643673952 | NASDAQ 23/32              | 4,500    | 0                                   | 0   | 300     | 103,7930                          | 311.379,00         | 0,21                                 |
| XS1788834700 | NATIONWIDE BLDG 18/26 FLR | 1,500    | 0                                   | 0   | 500     | 98,1770                           | 490.885,00         | 0,33                                 |
| XS1788515606 | NATWEST GP. 18/26 MTN     | 1,750    | 0                                   | 200   | 200     | 98,4080                           | 196.816,00         | 0,13                                 |
| XS2387060259 | NATWEST GRP 21/29 FLR MTN | 0,670    | 0                                   | 0   | 700     | 87,3410                           | 611.387,00         | 0,41                                 |
| XS2307853098 | NATWEST GRP 21/30 FLR MTN | 0,780    | 0                                   | 0   | 400     | 86,4700                           | 345.880,00         | 0,23                                 |
| XS2382950330 | NATWEST GRP 21/32 FLR MTN | 1,043    | 0                                   | 0   | 400     | 89,7400                           | 358.960,00         | 0,24                                 |
| XS2623518821 | NATWEST GRP 23/29 FLR MTN | 4,771    | 0                                   | 0   | 200     | 102,8000                          | 205.600,00         | 0,14                                 |
| XS2592628791 | NATWEST GRP 23/34 FLR MTN | 5,763    | 0                                   | 0   | 440     | 104,6510                          | 460.464,40         | 0,31                                 |
| XS2745115837 | NATWEST MKTS 24/29 MTN    | 3,625    | 0                                   | 0   | 300     | 99,4870                           | 298.461,00         | 0,20                                 |
| XS2203802462 | NE PROPERTY 20/27 MTN     | 3,375    | 0                                   | 0   | 500     | 96,8070                           | 484.035,00         | 0,33                                 |
| XS2023631489 | NIBC BK 19/25 MTN         | 0,875    | 0                                   | 0   | 400     | 96,7080                           | 386.832,00         | 0,26                                 |
| XS1623355457 | NN GP. 17/27 MTN          | 1,625    | 0                                   | 0   | 300     | 94,1960                           | 282.588,00         | 0,19                                 |
| XS2602037629 | NN GRP 24/UND. FLR        | 6,375    | 400                                 | 0   | 400     | 101,4050                          | 405.620,00         | 0,27                                 |
| XS2488809612 | NOKIA 23/31 MTN           | 4,375    | 0                                   | 0   | 400     | 100,4620                          | 401.848,00         | 0,27                                 |
| XS2343459074 | NORDEA BK 21/31 FLR MTN   | 0,625    | 0                                   | 0   | 200     | 93,0770                           | 186.154,00         | 0,13                                 |
| XS2321526480 | NORDEA BK 21/31 MTN       | 0,500    | 0                                   | 0   | 350     | 82,1620                           | 287.567,00         | 0,19                                 |
| XS2723860990 | NORDEA BK 23/34 FLR MTN   | 4,875    | 0                                   | 0   | 240     | 102,9770                          | 247.144,80         | 0,17                                 |
| XS2348030425 | NOVO NO.F.NL 21/28        | 0,125    | 0                                   | 0   | 300     | 88,2700                           | 264.810,00         | 0,18                                 |

| ISIN         | Wertpapier-Bezeichnung    | Zinssatz | Käufe / Zugänge<br>Stück / Nominale | Verkäufe / Abgänge<br>(Nom. in 1.000, ger.) | Bestand | Kurs in<br>Wertpapier-<br>währung | Kurswert<br>in EUR | %-Anteil<br>am<br>Fonds-<br>vermögen |
|--------------|---------------------------|----------|-------------------------------------|---|---------|-----------------------------------|--------------------|--------------------------------------|
| DK0030487996 | NYKREDIT 21/31 FLR MTN    | 0,875    | 0                                   | 0   | 300     | 93,2040                           | 279.612,00         | 0,19                                 |
| DK0030506886 | NYKREDIT 22/27 MTN        | 1,375    | 0                                   | 0   | 300     | 93,2210                           | 279.663,00         | 0,19                                 |
| DK0030507694 | NYKREDIT 22/32 FLR MTN    | 5,500    | 0                                   | 0   | 400     | 102,9640                          | 411.856,00         | 0,28                                 |
| DK0030394986 | NYKREDIT 24/29 MTN        | 3,875    | 600                                 | 0   | 600     | 99,2500                           | 595.500,00         | 0,40                                 |
| XS2078667925 | OP YRITYSPA. 19/29 MTN    | 0,625    | 0                                   | 0   | 200     | 84,9780                           | 169.956,00         | 0,11                                 |
| FR0013444676 | ORANGE 19/26 MTN          | 0,000    | 0                                   | 0   | 300     | 92,3390                           | 277.017,00         | 0,19                                 |
| FR0013444692 | ORANGE 19/49 MTN          | 1,375    | 0                                   | 0   | 400     | 65,7130                           | 262.852,00         | 0,18                                 |
| FR0013447877 | ORANGE 19/UND. FLR MTN    | 1,750    | 0                                   | 0   | 200     | 93,2670                           | 186.534,00         | 0,13                                 |
| FR0014003B55 | ORANGE 21/UND. FLR MTN    | 1,375    | 0                                   | 0   | 700     | 86,4590                           | 605.213,00         | 0,41                                 |
| FR001400KKM2 | ORANGE 23/35 MTN          | 3,875    | 0                                   | 0   | 300     | 102,0510                          | 306.153,00         | 0,21                                 |
| FR001400GDJ1 | ORANGE 23/UND. FLR MTN    | 5,375    | 0                                   | 0   | 600     | 104,4410                          | 626.646,00         | 0,42                                 |
| XS2242633258 | PEPSICO 20/32             | 0,400    | 0                                   | 0   | 400     | 78,2230                           | 312.892,00         | 0,21                                 |
| XS2353073161 | POSTE ITAL 21/UND. FLR    | 2,625    | 0                                   | 0   | 300     | 87,7620                           | 263.286,00         | 0,18                                 |
| XS2580271596 | PRO.EUR.FIN. 23/30        | 3,875    | 0                                   | 0   | 210     | 99,7170                           | 209.405,70         | 0,14                                 |
| XS2580271752 | PRO.EUR.FIN. 23/43        | 4,250    | 0                                   | 0   | 100     | 97,5220                           | 97.522,00          | 0,07                                 |
| XS2485265214 | PROL.I.F.II 22/31 MTN     | 3,125    | 0                                   | 0   | 300     | 93,7080                           | 281.124,00         | 0,19                                 |
| FR0012384667 | PUBLICIS GRP. 14/24       | 1,625    | 0                                   | 0   | 300     | 98,8270                           | 296.481,00         | 0,20                                 |
| XS2682093526 | RAIF.BK INT. 23/28 FLRMTN | 6,000    | 0                                   | 0   | 200     | 103,3830                          | 206.766,00         | 0,14                                 |
| XS2765027193 | RAIF.BK INT. 24/29FLR MTN | 4,625    | 100                                 | 0   | 100     | 99,0820                           | 99.082,00          | 0,07                                 |
| XS2381599898 | RAIF.BK INTL 21/27 MTN    | 0,050    | 0                                   | 0   | 400     | 87,6840                           | 350.736,00         | 0,24                                 |
| XS2547936984 | RAIF.BK INTL 22/28 MTN    | 5,750    | 0                                   | 0   | 300     | 104,9990                          | 314.997,00         | 0,21                                 |
| FR0013334695 | RCI BANQ. 18/26 MTN       | 1,625    | 0                                   | 0   | 350     | 95,6260                           | 334.691,00         | 0,23                                 |
| FR001400CRG6 | RCI BANQ. 22/28 MTN       | 4,875    | 0                                   | 0   | 400     | 103,2450                          | 412.980,00         | 0,28                                 |
| FR001400KXW4 | RCI BANQ. 23/26 MTN       | 4,625    | 0                                   | 0   | 150     | 101,3220                          | 151.983,00         | 0,10                                 |
| FR001400KY69 | RCI BANQ. 23/29 MTN       | 4,875    | 0                                   | 0   | 200     | 103,3760                          | 206.752,00         | 0,14                                 |
| FR001400P3D4 | RCI BANQ. 24/27 MTN       | 3,750    | 300                                 | 0   | 300     | 99,2610                           | 297.783,00         | 0,20                                 |
| FR001400N3F1 | RCI BANQ. 24/29 MTN       | 3,875    | 0                                   | 0   | 450     | 99,5910                           | 448.159,50         | 0,30                                 |
| FR001400P3E2 | RCI BANQ. 24/31 MTN       | 4,125    | 350                                 | 0   | 350     | 99,5380                           | 348.383,00         | 0,24                                 |
| XS2242921711 | RENTOKIL IN. 20/28 MTN    | 0,500    | 0                                   | 0   | 450     | 87,3040                           | 392.868,00         | 0,27                                 |
| XS2655993033 | REXEL 23/30               | 5,250    | 0                                   | 0   | 160     | 102,8930                          | 164.628,80         | 0,11                                 |
| XS2587306403 | SAGE GP. 23/28 MTN        | 3,820    | 0                                   | 0   | 240     | 100,3620                          | 240.868,80         | 0,16                                 |
| XS2723549528 | SAINT-GOBAIN 23/26        | 3,750    | 0                                   | 0   | 400     | 100,1760                          | 400.704,00         | 0,27                                 |
| XS2723549361 | SAINT-GOBAIN 23/30        | 3,875    | 0                                   | 0   | 400     | 101,0270                          | 404.108,00         | 0,27                                 |
| XS2538368221 | SANDVIK AB 22/29 MTN      | 3,750    | 0                                   | 0   | 190     | 100,4890                          | 190.929,10         | 0,13                                 |
| XS2747776487 | SANT.CON.S.F. 24/29 MTN   | 3,750    | 0                                   | 0   | 600     | 99,9630                           | 599.778,00         | 0,40                                 |
| XS2385791046 | SANTA.UK GRP 21/29 FLR    | 0,603    | 0                                   | 0   | 400     | 87,0120                           | 348.048,00         | 0,23                                 |
| XS2525226622 | SANTA.UK GRP 22/28 FLR    | 3,530    | 0                                   | 0   | 300     | 98,7830                           | 296.349,00         | 0,20                                 |
| XS2678111050 | SARTOR.FIN. 23/26         | 4,250    | 0                                   | 0   | 100     | 100,7170                          | 100.717,00         | 0,07                                 |
| XS2676395077 | SARTOR.FIN. 23/29         | 4,375    | 0                                   | 0   | 100     | 101,8990                          | 101.899,00         | 0,07                                 |
| XS2308586911 | SBK 1 OSTL. 21/28 MTN     | 0,125    | 0                                   | 0   | 500     | 87,8690                           | 439.345,00         | 0,30                                 |
| XS2182067350 | SCANIA CV 20/25 MTN       | 2,250    | 0                                   | 0   | 300     | 98,3450                           | 295.035,00         | 0,20                                 |
| XS1087816374 | SCENTRE MANAGEM.14/24 MTN | 2,250    | 0                                   | 0   | 300     | 99,7480                           | 299.244,00         | 0,20                                 |
| DE000A289Q91 | SCHAEFFLER MTN 20/25      | 2,750    | 0                                   | 0   | 300     | 98,3630                           | 295.089,00         | 0,20                                 |
| DE000A3823R3 | SCHAEFFLER MTN 24/26      | 4,500    | 0                                   | 0   | 100     | 100,8270                          | 100.827,00         | 0,07                                 |
| DE000A3823S1 | SCHAEFFLER MTN 24/29      | 4,750    | 0                                   | 0   | 100     | 100,9850                          | 100.985,00         | 0,07                                 |
| DE000A383HC1 | SCHAEFFLER MTN 24/30      | 4,500    | 300                                 | 0   | 300     | 98,9520                           | 296.856,00         | 0,20                                 |
| FR001400N277 | SCHNEID.ELEC 24/31 MTN    | 3,000    | 0                                   | 0   | 300     | 97,9390                           | 293.817,00         | 0,20                                 |
| FR001400N285 | SCHNEID.ELEC 24/35 MTN    | 3,250    | 0                                   | 0   | 200     | 96,8400                           | 193.680,00         | 0,13                                 |
| FR0013494168 | SCHNEIDER EL 20/29 MTN    | 0,250    | 0                                   | 0   | 400     | 87,0000                           | 348.000,00         | 0,23                                 |
| FR001400DTA3 | SCHNEIDER EL 22/32 MTN    | 3,500    | 0                                   | 0   | 400     | 100,2430                          | 400.972,00         | 0,27                                 |
| FR001400F711 | SCHNEIDER EL 23/34 MTN    | 3,375    | 0                                   | 0   | 300     | 99,0210                           | 297.063,00         | 0,20                                 |
| XS2404247384 | SEB 21/31 FLR MTN         | 0,750    | 0                                   | 0   | 550     | 91,8510                           | 505.180,50         | 0,34                                 |
| XS2774448521 | SEB 24/34 FLR MTN         | 4,500    | 270                                 | 0   | 270     | 100,4980                          | 271.344,60         | 0,18                                 |
| XS2676818482 | SEC.TREAS.IE 23/29 MTN    | 4,375    | 0                                   | 0   | 260     | 101,5050                          | 263.913,00         | 0,18                                 |
| XS2128499105 | SIGNIFY 20/27             | 2,375    | 0                                   | 0   | 800     | 95,8040                           | 766.432,00         | 0,52                                 |
| XS2388182573 | SM.KAPPA TR. 21/29        | 0,500    | 0                                   | 0   | 400     | 84,6680                           | 338.672,00         | 0,23                                 |
| XS2163320679 | SODEXO 20/25              | 0,750    | 0                                   | 0   | 300     | 97,2880                           | 291.864,00         | 0,20                                 |
| BE6350792089 | SOLVAY 24/31              | 4,250    | 600                                 | 0   | 600     | 99,4920                           | 596.952,00         | 0,40                                 |
| XS2579319513 | SPAREBK 1 SR 23/27 MTN    | 3,750    | 0                                   | 0   | 700     | 100,2450                          | 701.715,00         | 0,47                                 |
| XS1693281617 | STAND.CHAR. 17/27 MTN FLR | 1,625    | 0                                   | 0   | 300     | 94,9230                           | 284.769,00         | 0,19                                 |
| XS2102360315 | STD.CHARTER 20/28 MTN FLR | 0,850    | 0                                   | 0   | 300     | 92,5550                           | 277.665,00         | 0,19                                 |
| XS2618731256 | STD.CHARTER 23/31 FLR MTN | 4,874    | 0                                   | 0   | 300     | 104,2900                          | 312.870,00         | 0,21                                 |
| FR0013518057 | STE GENERALE 20/30 MTN    | 1,250    | 0                                   | 0   | 400     | 85,6660                           | 342.664,00         | 0,23                                 |
| FR0014004GE5 | STE GENERALE 21/27 MTN    | 0,250    | 0                                   | 0   | 300     | 90,1230                           | 270.369,00         | 0,18                                 |
| FR0014001GA9 | STE GENERALE 21/29FLR MTN | 0,500    | 0                                   | 0   | 600     | 87,1810                           | 523.086,00         | 0,35                                 |
| FR001400KZP3 | STE GENERALE 23/26 MTN    | 4,250    | 0                                   | 0   | 400     | 101,1620                          | 404.648,00         | 0,27                                 |
| FR001400KZQ1 | STE GENERALE 23/29 FLRMTN | 4,750    | 0                                   | 0   | 500     | 102,8020                          | 514.010,00         | 0,35                                 |
| XS2356041165 | STELLANTIS 21/33 MTN      | 1,250    | 0                                   | 0   | 400     | 79,5120                           | 318.048,00         | 0,21                                 |
| XS2265360359 | STORA ENSO 20/30 MTN      | 0,625    | 0                                   | 0   | 400     | 80,7290                           | 322.916,00         | 0,22                                 |

| ISIN         | Wertpapier-Bezeichnung    | Zins-<br>satz | Käufe /<br>Zugänge<br>Stück / | Verkäufe /<br>Abgänge<br>Nominale | Bestand | Kurs in<br>Wertpapier-<br>währung | Kurswert<br>in EUR | %-Anteil<br>am<br>Fonds-<br>vermögen |
|--------------|---------------------------|---------------|-------------------------------|-----------------------------------|---------|-----------------------------------|--------------------|--------------------------------------|
| XS2629064267 | STORA ENSO 23/29 MTN      | 4,250         | 0                             | 0                                 | 110     | 101,1890                          | 111.307,90         | 0,08                                 |
| XS2121207828 | SVENSKA HDBK 20/30 MTN    | 0,500         | 0                             | 0                                 | 400     | 84,3240                           | 337.296,00         | 0,23                                 |
| XS2767224921 | SVENSKA HDBK 24/34 MTN    | 3,750         | 0                             | 0                                 | 900     | 100,0100                          | 900.090,00         | 0,61                                 |
| XS2715276163 | SVENSKA HDBK. 23/27 MTN   | 3,875         | 0                             | 0                                 | 300     | 100,8640                          | 302.592,00         | 0,20                                 |
| XS2667124569 | SVENSKA HDBK. 23/34 FLR   | 5,000         | 0                             | 0                                 | 390     | 102,8250                          | 401.017,50         | 0,27                                 |
| XS2282210231 | SWEDBK 21/28 MTN          | 0,200         | 0                             | 0                                 | 300     | 88,2920                           | 264.876,00         | 0,18                                 |
| XS2522879654 | SWEDBK 22/32 FLR MTN      | 3,625         | 0                             | 0                                 | 200     | 98,0280                           | 196.056,00         | 0,13                                 |
| XS2197348324 | TAKEDA PHARMA. 20/27      | 0,750         | 0                             | 0                                 | 300     | 91,5940                           | 274.782,00         | 0,19                                 |
| XS2462605671 | TEL.EUROPE 22/UND. FLR    | 7,125         | 0                             | 0                                 | 300     | 108,7230                          | 326.169,00         | 0,22                                 |
| XS2646608401 | TEL.EUROPE 23/UND. FLR    | 6,750         | 0                             | 0                                 | 100     | 108,0010                          | 108.001,00         | 0,07                                 |
| XS2582389156 | TEL.EUROPE 23/UND. FLR    | 6,135         | 0                             | 0                                 | 200     | 104,2800                          | 208.560,00         | 0,14                                 |
| XS2755535577 | TEL.EUROPE 24/UND. FLR    | 5,752         | 300                           | 0                                 | 300     | 101,6910                          | 305.073,00         | 0,21                                 |
| XS2623868994 | TELE2 23/29 MTN           | 3,750         | 0                             | 0                                 | 170     | 99,1910                           | 168.624,70         | 0,11                                 |
| XS2112289207 | TELEFON.EMI. 20/30 MTN    | 0,664         | 0                             | 0                                 | 700     | 85,1990                           | 596.393,00         | 0,40                                 |
| XS2753310825 | TELEFON.EMI. 24/32 MTN    | 3,698         | 0                             | 0                                 | 200     | 98,9040                           | 197.808,00         | 0,13                                 |
| XS2753311393 | TELEFON.EMI. 24/36 MTN    | 4,055         | 0                             | 0                                 | 200     | 99,1610                           | 198.322,00         | 0,13                                 |
| XS2696803696 | TELENOR 23/30 MTN         | 4,000         | 0                             | 0                                 | 200     | 102,4760                          | 204.952,00         | 0,14                                 |
| XS2696803852 | TELENOR 23/35 MTN         | 4,250         | 0                             | 0                                 | 300     | 104,8490                          | 314.547,00         | 0,21                                 |
| XS2589828941 | TELIA CO 23/32 MTN        | 3,625         | 0                             | 0                                 | 300     | 100,1290                          | 300.387,00         | 0,20                                 |
| XS1953240261 | TELIA CO AB 19/34MTN      | 2,125         | 0                             | 0                                 | 500     | 88,7290                           | 443.645,00         | 0,30                                 |
| XS1193213953 | TELIA COMP. AB 15/35MTN   | 1,625         | 0                             | 0                                 | 300     | 82,7120                           | 248.136,00         | 0,17                                 |
| XS1395057430 | TELSTRA CORP. 16/26 MTN   | 1,125         | 0                             | 0                                 | 100     | 95,5040                           | 95.504,00          | 0,06                                 |
| XS2207430120 | TENNET HLDG 20/UND.FLR    | 2,374         | 0                             | 0                                 | 300     | 97,3220                           | 291.966,00         | 0,20                                 |
| XS2783604742 | TENNET HLDG 24/UND.FLR    | 4,625         | 500                           | 0                                 | 500     | 99,3180                           | 496.590,00         | 0,34                                 |
| XS2783649176 | TENNET HLDG 24/UND.FLR    | 4,875         | 270                           | 0                                 | 270     | 99,5230                           | 268.712,10         | 0,18                                 |
| XS2748847204 | TERNA R.E.N. 24/31 MTN    | 3,500         | 0                             | 0                                 | 800     | 97,9980                           | 783.984,00         | 0,53                                 |
| XS2798269069 | TERNA R.E.N. 24/UND. FLR  | 4,750         | 700                           | 0                                 | 700     | 99,3620                           | 695.534,00         | 0,47                                 |
| XS2592301365 | TESCO TRE.SV 23/31 MTN    | 4,250         | 0                             | 0                                 | 600     | 101,4200                          | 608.520,00         | 0,41                                 |
| XS2432502008 | TORON.DOM.BK 22/27 MTN    | 0,500         | 0                             | 0                                 | 350     | 92,0680                           | 322.238,00         | 0,22                                 |
| XS1997077364 | TRA.F.CO.PTY 19/29        | 1,450         | 0                             | 0                                 | 400     | 89,4460                           | 357.784,00         | 0,24                                 |
| XS1681520786 | TRANSURBAN FIN.CO. 17/28  | 1,750         | 0                             | 0                                 | 300     | 92,9400                           | 278.820,00         | 0,19                                 |
| XS2114807691 | TYCO ELEC.GR 20/25        | 0,000         | 0                             | 0                                 | 300     | 97,4380                           | 292.314,00         | 0,20                                 |
| XS2207976783 | UNICREDIT 20/27 FLR MTN   | 2,200         | 0                             | 0                                 | 350     | 96,3600                           | 337.260,00         | 0,23                                 |
| XS2588885025 | UNICREDIT 23/29 FLR MTN   | 4,450         | 0                             | 0                                 | 750     | 101,5210                          | 761.407,50         | 0,51                                 |
| IT0005580656 | UNICREDIT 24/31 FLR MTN   | 4,300         | 0                             | 0                                 | 500     | 100,5410                          | 502.705,00         | 0,34                                 |
| IT0005580102 | UNICREDIT 24/34 FLR MTN   | 5,375         | 0                             | 0                                 | 600     | 101,8200                          | 610.920,00         | 0,41                                 |
| IT0005585051 | UNICREDIT 24/34 MTN       | 4,000         | 900                           | 0                                 | 900     | 99,2080                           | 892.872,00         | 0,60                                 |
| XS2591848192 | UNIL.FIN.NED 23/35 MTN    | 3,500         | 0                             | 0                                 | 300     | 99,3600                           | 298.080,00         | 0,20                                 |
| XS2123970241 | V.F. CORP. 20/32          | 0,625         | 0                             | 0                                 | 600     | 69,6310                           | 417.786,00         | 0,28                                 |
| XS2592659242 | V.F. CORP. 23/26          | 4,125         | 0                             | 0                                 | 120     | 98,5030                           | 118.203,60         | 0,08                                 |
| XS2592659671 | V.F. CORP. 23/29          | 4,250         | 0                             | 0                                 | 180     | 95,2870                           | 171.516,60         | 0,12                                 |
| FR001400EA16 | VALEO 22/27 MTN           | 5,375         | 0                             | 0                                 | 300     | 103,1420                          | 309.426,00         | 0,21                                 |
| FR001400PAJ8 | VALEO 24/30 MTN           | 4,500         | 400                           | 0                                 | 400     | 97,9920                           | 391.968,00         | 0,26                                 |
| FR0013139482 | VALEO SE 16-26 MTN        | 1,625         | 0                             | 0                                 | 200     | 96,1950                           | 192.390,00         | 0,13                                 |
| AT000B122080 | VB WIEN 21/26 MTN         | 0,875         | 0                             | 0                                 | 100     | 94,4130                           | 94.413,00          | 0,06                                 |
| XS2449928543 | VE.W.SYS.FIN 22/29 MTN    | 1,500         | 0                             | 0                                 | 300     | 89,9460                           | 269.838,00         | 0,18                                 |
| XS2449929517 | VE.W.SYS.FIN 22/34 MTN    | 2,000         | 0                             | 0                                 | 300     | 84,2030                           | 252.609,00         | 0,17                                 |
| FR0014003G27 | VERALLIA 21/28            | 1,625         | 0                             | 0                                 | 100     | 91,7360                           | 91.736,00          | 0,06                                 |
| FR0014006EG0 | VERALLIA 21/31            | 1,875         | 0                             | 0                                 | 400     | 86,6410                           | 346.564,00         | 0,23                                 |
| XS1708335978 | VERIZON COMM 17/38        | 2,875         | 0                             | 0                                 | 300     | 88,3910                           | 265.173,00         | 0,18                                 |
| XS2176561095 | VERIZON COMM 20/40        | 1,850         | 0                             | 0                                 | 300     | 75,2490                           | 225.747,00         | 0,15                                 |
| XS2320759538 | VERIZON COMM 21/29        | 0,375         | 0                             | 0                                 | 400     | 86,0940                           | 344.376,00         | 0,23                                 |
| XS2770514789 | VERIZON COMM 24/32        | 3,500         | 280                           | 0                                 | 280     | 98,1850                           | 274.918,00         | 0,19                                 |
| XS2770514946 | VERIZON COMM 24/36        | 3,750         | 210                           | 0                                 | 210     | 98,0600                           | 205.926,00         | 0,14                                 |
| XS2597973812 | VESTAS WIND 23/26 MTN     | 4,125         | 0                             | 0                                 | 220     | 100,3070                          | 220.675,40         | 0,15                                 |
| XS2725957042 | VESTAS WIND 23/31 MTN     | 4,125         | 0                             | 0                                 | 400     | 100,5430                          | 402.172,00         | 0,27                                 |
| BE6332786449 | VGP 22/27                 | 1,625         | 0                             | 0                                 | 500     | 92,0620                           | 460.310,00         | 0,31                                 |
| FR001400D8K2 | VINCI S.A. 22/32 MTN      | 3,375         | 0                             | 0                                 | 300     | 98,6500                           | 295.950,00         | 0,20                                 |
| XS2585239200 | VIRGIN MONEY 23/28 FLRMTN | 4,625         | 0                             | 0                                 | 150     | 102,1480                          | 153.222,00         | 0,10                                 |
| XS2757511113 | VIRGIN MONEY 24/28 FLRMTN | 4,000         | 150                           | 0                                 | 150     | 99,8770                           | 149.815,50         | 0,10                                 |
| XS2560495116 | VODAF.INT.F. 22/34 MTN    | 3,750         | 0                             | 0                                 | 240     | 99,0890                           | 237.813,60         | 0,16                                 |
| XS2586851300 | VODAF.INT.F. 23/43 MTN    | 4,000         | 0                             | 0                                 | 300     | 97,1430                           | 291.429,00         | 0,20                                 |
| XS1463101680 | VODAFONE GRP 16/31 MTN    | 1,600         | 0                             | 0                                 | 300     | 86,9400                           | 260.820,00         | 0,18                                 |
| XS2002019060 | VODAFONE GRP 19/39 MTN    | 2,500         | 0                             | 0                                 | 300     | 83,3740                           | 250.122,00         | 0,17                                 |
| XS2521820048 | VOLVO TREAS. 22/27 MTN    | 2,000         | 0                             | 0                                 | 300     | 95,1720                           | 285.516,00         | 0,19                                 |
| XS2583352443 | VOLVO TREAS. 23/25 MTN    | 3,500         | 0                             | 0                                 | 300     | 99,5790                           | 298.737,00         | 0,20                                 |
| XS2671621402 | VOLVO TREAS. 23/26 MTN    | 3,875         | 0                             | 0                                 | 250     | 100,3270                          | 250.817,50         | 0,17                                 |
| XS2760218185 | VOLVO TREAS. 24/26 MTN    | 3,125         | 0                             | 0                                 | 400     | 98,7500                           | 395.000,00         | 0,27                                 |
| DE000A19UR79 | VONOVIA SE 18/28 MTN      | 1,500         | 0                             | 0                                 | 200     | 91,5420                           | 183.084,00         | 0,12                                 |

| ISIN  | Wertpapier-Bezeichnung | Zinssatz | Käufe / Zugänge<br>Stück / Nominale | Verkäufe / Abgänge<br>(Nom. in 1.000, ger.) | Bestand | Kurs in Wertpapierwährung | Kurswert in EUR       | %-Anteil am Fondsvermögen |
|---|------------------------|----------|-------------------------------------|---|---------|---------------------------|-----------------------|---------------------------|
| FR0012516417  | WENDEL SE 15-27        | 2,500    | 0                                   | 0   | 200     | 96,8600                   | 193.720,00            | 0,13                      |
| XS2115092954  | WHIRLP.FIN. 20/28      | 0,500    | 0                                   | 0   | 350     | 88,1850                   | 308.647,50            | 0,21                      |
| XS2592516210  | WOLTERS KLUW 23/31     | 3,750    | 0                                   | 0   | 400     | 100,5870                  | 402.348,00            | 0,27                      |
| XS1575992596  | WOLTERS KLUWER 17/27   | 1,500    | 0                                   | 0   | 200     | 94,5900                   | 189.180,00            | 0,13                      |
| FR0013521564  | WORLDLINE 20/27        | 0,875    | 0                                   | 0   | 700     | 90,0220                   | 630.154,00            | 0,43                      |
| FR001400KLT5  | WORLDLINE 23/28 MTN    | 4,125    | 0                                   | 0   | 700     | 98,4340                   | 689.038,00            | 0,46                      |
| XS2782800713  | WPP FIN. 24/29 MTN     | 3,625    | 400                                 | 0   | 400     | 98,2240                   | 392.896,00            | 0,27                      |
| XS2782803147  | WPP FIN. 24/33 MTN     | 4,000    | 280                                 | 0   | 280     | 98,2160                   | 275.004,80            | 0,19                      |
| XS2013626010  | ZURICH FI.IE 19/39     | 1,625    | 0                                   | 0   | 200     | 76,7950                   | 153.590,00            | 0,10                      |
| Summe   |                        |          |                                     |   |         |                           | 143.128.899,61        | 96,59                     |
| <b>SUMME DER ZUM AMTLICHEN HANDEL ODER EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT ZUGELASSENEN WERTPAPIERE</b> |                        |          |                                     |   |         |                           | <u>143.128.899,61</u> | 96,59                     |
| <b>SUMME WERTPAPIERVERMÖGEN</b>   |                        |          |                                     |   |         |                           | <u>143.128.899,61</u> | 96,59                     |

## FINANZTERMINKONTRAKTE

| Bezeichnung / Underlying           | Fälligkeit | Whg. | Anzahl / Betrag | Kontraktkurs | unrealisiertes Ergebnis in EUR | %-Anteil am Fondsvermögen |
|------------------------------------|------------|------|-----------------|--------------|--------------------------------|---------------------------|
| <b>FINANZTERMINKONTRAKTE</b>       |            |      |                 |              |                                |                           |
| <b>ZINSTERMINKONTRAKTE</b>         |            |      |                 |              |                                |                           |
| EURO SCHATZ FUT (FGBS) SEP. 24     | 06.09.2024 | EUR  | 22              | 105,2250     | 990,00                         | 0,00                      |
| Summe                              |            |      |                 |              | <u>990,00</u>                  | 0,00                      |
| <b>SUMME FINANZTERMINKONTRAKTE</b> |            |      |                 |              | <u>990,00</u>                  | 0,00                      |

## BANKGUTHABEN / BANKVERBINDLICHKEITEN

### BANKGUTHABEN / BANKVERBINDLICHKEITEN

| WÄHRUNG   | FONDSWÄHRUNG | BETRAG FONDSWÄHRUNG |
|---|--------------|---------------------|
| EURO  | EUR          | 3.156.978,00        |
| AMERIKANISCHE DOLLAR                              | EUR          | 153.901,96          |
| INITIAL MARGIN / VARIATION MARGIN                 | EUR          | 16.028,00           |
| <b>SUMME BANKGUTHABEN / BANKVERBINDLICHKEITEN</b> |              | <u>3.326.907,96</u> |

|   | EUR                   | %             |
|---|-----------------------|---------------|
| <b>Wertpapiervermögen</b>                   | <b>143.128.899,61</b> | <b>96,59</b>  |
| Finanzterminkontrakte                       | 990,00                | 0,00          |
| Zinsenerträge (inkl. negativer Habenzinsen) | 1.726.584,37          | 1,17          |
| Bankguthaben / Bankverbindlichkeiten        | 3.326.907,96          | 2,24          |
| <b>FONDSVERMÖGEN</b>                        | <b>148.183.381,94</b> | <b>100,00</b> |

#### Erläuterungen zur Vermögensaufstellung:

Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Gesamttrendite-Swaps im Sinne der Verordnung (EU) 2015/2365 wurden, insoweit sie laut Fondsbestimmungen zulässig sind, im Berichtszeitraum nicht eingesetzt.

## DEWISENKURSE

### DEWISENKURSE

#### WÄHRUNG

AMERIKANISCHE DOLLAR

#### EINHEITEN

1 EUR =

#### KURS

1,08410 USD

#### Risikohinweis:

Es besteht das Risiko, dass aufgrund von Kursbildungen auf illiquiden Märkten die Bewertungskurse bestimmter Wertpapiere von ihren tatsächlichen Veräußerungen abweichen können (Bewertungsrisiko).

Der Wert eines Anteiles ergibt sich aus der Teilung des Gesamtwertes des Kapitalanlagefonds einschließlich der Erträge durch die Zahl der Anteile. Der Gesamtwert des Kapitalanlagefonds ist aufgrund der jeweiligen Kurswerte der zu ihm gehörigen Wertpapiere, Geldmarktinstrumente und Bezugsrechte zuzüglich des Wertes der zum Fonds gehörenden Finanzanlagen, Geldbeträge, Guthaben, Forderungen und sonstigen Rechte abzüglich Verbindlichkeiten, von der Depotbank zu ermitteln.

Das Nettovermögen wird nach folgenden Grundsätzen ermittelt:

- a) Der Wert von Vermögenswerten, welche an einer Börse oder an einem anderen geregelten Markt notiert oder gehandelt werden, wird grundsätzlich auf der Grundlage des letzten verfügbaren Kurses ermittelt.
- b) Sofern ein Vermögenswert nicht an einer Börse oder an einem anderen geregelten Markt notiert oder gehandelt wird oder sofern für einen Vermögenswert, welcher an einer Börse oder an einem anderen geregelten Markt notiert oder gehandelt wird, der Kurs den tatsächlichen Marktwert nicht angemessen widerspiegelt, wird auf die Kurse zuverlässiger Datenprovider oder alternativ auf Marktpreise gleichartiger Wertpapiere oder andere anerkannte Bewertungsmethoden zurückgegriffen.

**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               | Wertpapier-Bezeichnung    | Zins-<br>satz | Whg. | Käufe / Zugänge<br>Lots / Stück / Nominale (Nom. in 1.000,<br>ger.) | Verkäufe / Abgänge<br>(Nom. in 1.000,<br>ger.) |
|--------------------|---------------------------|---------------|------|---|--|
| <b>WERTPAPIERE</b> |                           |               |      |   |  |
| XS2747181969       | ABB FIN. 24/29 MTN        | 3,125         | EUR  | 0   | 240  |
| XS2678207676       | ASSA-ABLOY 23/26 MTN      | 3,750         | EUR  | 0   | 100  |
| XS2678226114       | ASSA-ABLOY 23/30 MTN      | 3,875         | EUR  | 0   | 100  |
| XS1144088165       | AT + T 14/29              | 2,600         | EUR  | 0   | 100  |
| XS2590758400       | AT + T 23/25              | 3,550         | EUR  | 0   | 260  |
| XS2590758822       | AT + T 23/34              | 4,300         | EUR  | 0   | 360  |
| XS2759982577       | AUTOLIV 24/29 MTN         | 3,625         | EUR  | 0   | 140  |
| FR001400DCZ6       | BNP PARIBAS 23/29 FLR MTN | 4,375         | EUR  | 0   | 100  |
| XS2757515882       | COCA C.HBC F 24/28 MTN    | 3,375         | EUR  | 190   | 190  |
| XS1750349190       | COMMONW.BK AUSTR.18/28MTN | 1,125         | EUR  | 0   | 300  |
| XS1395021089       | CREDIT AGR. 16/26 MTN     | 1,250         | EUR  | 0   | 300  |
| FR001400LY92       | DANONE 23/29 MTN          | 3,706         | EUR  | 0   | 300  |
| XS2400445289       | DELL BK INTL 21/26 MTN    | 0,500         | EUR  | 0   | 300  |
| XS2545259876       | DELL BK INTL 22/27 MTN    | 4,500         | EUR  | 0   | 700  |
| XS2531438351       | JOHN DEE. BK 22/26 MTN    | 2,500         | EUR  | 0   | 600  |
| XS1485533431       | KON. KPN 16/28 MTN        | 1,125         | EUR  | 0   | 100  |
| FR0013447638       | LA POSTE 19/34 MTN        | 1,000         | EUR  | 0   | 100  |
| XS2775724862       | LLOYDS BKG 24/27 FLR MTN  | 4,638         | EUR  | 150   | 150  |
| DE000A382962       | M.B.INT.FIN. 24/27 MTN    | 3,250         | EUR  | 550   | 550  |
| DE000A3LBMY2       | MERC.B.FI.CA 22/27 MTN    | 3,000         | EUR  | 0   | 250  |
| XS1233734562       | MICHELIN 15/27            | 1,750         | EUR  | 0   | 200  |
| XS2241387252       | MIZUHO F.G. 20/25 MTN     | 0,214         | EUR  | 0   | 300  |
| XS2465984107       | MIZUHO F.G. 22/27 MTN     | 1,631         | EUR  | 0   | 300  |
| XS2049769297       | MOLNLYCKE HL 19/29 MTN    | 0,875         | EUR  | 0   | 500  |
| XS2672967234       | MOLNLYCKE HL 23/28 MTN    | 4,250         | EUR  | 0   | 450  |
| XS1197270819       | MONDELEZ INTL 15/27       | 1,625         | EUR  | 0   | 300  |
| XS2258389415       | OP YRITYSPA. 20/27 MTN    | 0,100         | EUR  | 0   | 350  |
| XS1061714165       | PEPSICO INC. 14/26 MTN    | 2,625         | EUR  | 0   | 500  |
| XS2629468278       | ROBERT BOSCH MTN.23/30    | 3,625         | EUR  | 0   | 200  |
| FR001400F703       | SCHNEIDER EL 23/29 MTN    | 3,125         | EUR  | 0   | 100  |
| XS2489775580       | SES 22/29 MTN             | 3,500         | EUR  | 0   | 400  |
| XS2446844594       | SIEMENS FIN 22/30 MTN     | 1,000         | EUR  | 0   | 300  |
| XS2128498636       | SIGNIFY 20/24             | 2,000         | EUR  | 0   | 400  |
| XS2629062568       | STORA ENSO 23/26 MTN      | 4,000         | EUR  | 0   | 100  |
| XS2345317510       | SVENSKA HDBK 21/28 MTN    | 0,050         | EUR  | 0   | 350  |
| DE000TLX2102       | TALANX AG NTS 14/26       | 2,500         | EUR  | 0   | 100  |
| XS2117452156       | TELENOR 20/28 MTN         | 0,250         | EUR  | 0   | 350  |
| XS0545428285       | TELIA COMP. AB 10/25MTN   | 3,875         | EUR  | 0   | 300  |
| XS0826189028       | TELIA COMP. AB 12/27MTN   | 3,000         | EUR  | 0   | 300  |
| XS2613162424       | TELSTRA GROU 23/31 MTN    | 3,750         | EUR  | 0   | 160  |
| XS2002491780       | TENNET HLDG 19/30 MTN     | 0,875         | EUR  | 0   | 200  |
| XS2549543143       | TENNET HLDG 22/28 MTN     | 3,875         | EUR  | 0   | 700  |
| XS1654192274       | UNIL.FIN.NED 17/29 MTN    | 1,375         | EUR  | 0   | 300  |
| XS2591848275       | UNIL.FIN.NED 23/31 MTN    | 3,250         | EUR  | 0   | 130  |
| XS2767489474       | UNIL.FIN.NED 24/32 MTN    | 3,250         | EUR  | 0   | 160  |
| XS2767489391       | UNIL.FIN.NED 24/37 MTN    | 3,500         | EUR  | 0   | 170  |
| XS1030900242       | VERIZON COMM 14/26        | 3,250         | EUR  | 0   | 300  |
| XS1405766624       | VERIZON COMM 16/28        | 1,375         | EUR  | 0   | 400  |
| XS2530756191       | WOLTERS KLUW 22/26        | 3,000         | EUR  | 400   | 500  |
| US09062XAF06       | BIOGEN INC. 15/25         | 4,050         | USD  | 0   | 200  |
| US126408HW63       | CSX 23/33                 | 5,200         | USD  | 0   | 400  |
| US126650CX62       | CVS HEALTH 18/28          | 4,300         | USD  | 0   | 200  |
| US24703TAK25       | DELL IN./EMC 16/46        | 8,350         | USD  | 0   | 86   |
| US278865BD18       | ECOLAB 2027               | 3,250         | USD  | 0   | 200  |
| US29444UBL98       | EQUINIX 20/28             | 1,550         | USD  | 0   | 300  |
| US42824CAX74       | HP ENTERPRISE 16/35       | 6,200         | USD  | 0   | 300  |
| US47837RAA86       | JC INTL/TYCO 20/30        | 1,750         | USD  | 0   | 300  |
| USY5257YAM94       | LENOVO GP. 22/32 REGS     | 6,536         | USD  | 0   | 200  |
| US690742AJ00       | OWENS CORN. 19/29         | 3,950         | USD  | 0   | 300  |
| USJ4881VAA55       | RENESAS ELE. 21/24 REGS   | 1,543         | USD  | 0   | 200  |

| ISIN                         | Wertpapier-Bezeichnung         | Zins-<br>satz | Whg. | Käufe / Zugänge<br>Lots / Stück | Verkäufe / Abgänge<br>/ Nominale (Nom. in 1.000,<br>ger.) |
|------------------------------|--------------------------------|---------------|------|---------------------------------|---|
| <b>FINANZTERMINKONTRAKTE</b> |                                |               |      |                                 |   |
| ---                          | EURO BOBL FUT (FGBM) JUN. 24   |               | EUR  | 36                              | 36  |
| ---                          | EURO BOBL FUT (FGBM) MÄR. 24   |               | EUR  | 40                              | 0   |
| ---                          | EURO SCHATZ FUT (FGBS) JUN. 24 |               | EUR  | 24                              | 24  |
| ---                          | EURO SCHATZ FUT (FGBS) MÄR. 24 |               | EUR  | 0                               | 27  |
| ---                          | CROSS RATE EUR/USD FUT JUN. 24 |               | USD  | 20                              | 20  |
| ---                          | CROSS RATE EUR/USD FUT MÄR. 24 |               | USD  | 0                               | 20  |

Wien, am 28. August 2024

### Amundi Austria GmbH

**Franck Jochaud du Plessix**

**Bernhard Greifeneder**

**Christian Mathern**

**Hannes Roubik**

# Bestätigungsvermerk

## Prüfungsurteil

Wir haben den beigefügten Rechenschaftsbericht der Amundi Austria GmbH, über den von ihr verwalteten

Amundi Öko Sozial Net Zero Ambition Bond,  
Miteigentumsfonds gemäß Investmentfondsgesetz 2011 idgF (InvFG)

bestehend aus der Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2024, der Ertragsrechnung für das an diesem Stichtag endende Rumpfrechnungsjahr und den sonstigen in Anlage I Schema B Investmentfondsgesetz 2011 (InvFG 2011) vorgesehenen Angaben, geprüft.

Nach unserer Beurteilung entspricht der Rechenschaftsbericht den gesetzlichen Vorschriften und vermittelt ein möglichst getreues Bild der Vermögens- und Finanzlage zum 31. Mai 2024 sowie der Ertragslage des Fonds für das an diesem Stichtag endende Rumpfrechnungsjahr in Übereinstimmung mit den österreichischen unternehmensrechtlichen Vorschriften und den Bestimmungen des InvFG 2011.

## Grundlage für das Prüfungsurteil

Wir haben unsere Abschlussprüfung gemäß § 49 Abs 5 InvFG 2011 in Übereinstimmung mit den österreichischen Grundsätzen ordnungsmäßiger Abschlussprüfung durchgeführt. Diese Grundsätze erfordern die Anwendung der International Standards on Auditing (ISA). Unsere Verantwortlichkeiten nach diesen Vorschriften und Standards sind im Abschnitt "Verantwortlichkeiten des Abschlussprüfers für die Prüfung des Rechenschaftsberichts" unseres Bestätigungsvermerks weitergehend beschrieben. Wir sind von der Gesellschaft unabhängig in Übereinstimmung mit den österreichischen unternehmensrechtlichen und berufsrechtlichen Vorschriften und wir haben unsere sonstigen beruflichen Pflichten in Übereinstimmung mit diesen Anforderungen erfüllt. Wir sind der Auffassung, dass die von uns bis zum Datum des Bestätigungsvermerks erlangten Prüfungsnachweise ausreichend und geeignet sind, um als Grundlage für unser Prüfungsurteil zu diesem Datum zu dienen.

## Sonstige Informationen

Die gesetzlichen Vertreter sind für die sonstigen Informationen verantwortlich. Die sonstigen Informationen umfassen alle Informationen im Rechenschaftsbericht, ausgenommen die Vermögensaufstellung, die Ertragsrechnung, die sonstigen in Anlage I Schema B InvFG 2011 vorgesehenen Angaben und den Bestätigungsvermerk.

Unser Prüfungsurteil zum Rechenschaftsbericht erstreckt sich nicht auf diese sonstigen Informationen und wir geben dazu keine Art der Zusicherung.

Im Zusammenhang mit unserer Prüfung des Rechenschaftsberichts haben wir die Verantwortlichkeit, diese sonstigen Informationen zu lesen und dabei zu würdigen, ob die sonstigen Informationen wesentliche Unstimmigkeiten zum Rechenschaftsbericht oder zu unseren bei der Abschlussprüfung erlangten Kenntnissen aufweisen oder anderweitig falsch dargestellt erscheinen.

Falls wir auf der Grundlage der von uns zu den vor dem Datum des Bestätigungsvermerks des Abschlussprüfers erlangten sonstigen Informationen durchgeführten Arbeiten den Schluss ziehen, dass eine wesentliche falsche Darstellung dieser sonstigen Informationen vorliegt, sind wir verpflichtet, über diese Tatsache zu berichten. Wir haben in diesem Zusammenhang nichts zu berichten.

## Verantwortlichkeiten der gesetzlichen Vertreter und des Aufsichtsrats für den Rechenschaftsbericht

Die gesetzlichen Vertreter sind verantwortlich für die Aufstellung des Rechenschaftsberichts und dafür, dass dieser in Übereinstimmung mit den österreichischen unternehmensrechtlichen Vorschriften und den Bestimmungen des InvFG 2011 ein möglichst getreues Bild der Vermögens-, Finanz- und Ertragslage des Fonds vermittelt. Ferner sind die gesetzlichen Vertreter verantwortlich für die internen Kontrollen, die sie als notwendig erachten, um die Aufstellung eines Rechenschaftsberichts zu ermöglichen, der frei von wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern ist.



Der Aufsichtsrat ist verantwortlich für die Überwachung des Rechnungslegungsprozesses der Gesellschaft betreffend den von ihr verwalteten Fonds.

### **Verantwortlichkeiten des Abschlussprüfers für die Prüfung des Rechenschaftsberichts**

Unsere Ziele sind, hinreichende Sicherheit darüber zu erlangen, ob der Rechenschaftsbericht als Ganzes frei von wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern ist und einen Bestätigungsvermerk zu erteilen, der unser Prüfungsurteil beinhaltet. Hinreichende Sicherheit ist ein hohes Maß an Sicherheit, aber keine Garantie dafür, dass eine in Übereinstimmung mit den österreichischen Grundsätzen ordnungsmäßiger Abschlussprüfung, die die Anwendung der ISA erfordern, durchgeführte Abschlussprüfung eine wesentliche falsche Darstellung, falls eine solche vorliegt, stets aufdeckt. Falsche Darstellungen können aus dolosen Handlungen oder Irrtümern resultieren und werden als wesentlich angesehen, wenn von ihnen einzeln oder insgesamt vernünftigerweise erwartet werden könnte, dass sie die auf der Grundlage dieses Rechenschaftsberichts getroffenen wirtschaftlichen Entscheidungen von Nutzern beeinflussen.

Als Teil einer Abschlussprüfung in Übereinstimmung mit den österreichischen Grundsätzen ordnungsmäßiger Abschlussprüfung, die die Anwendung der ISA erfordern, üben wir während der gesamten Abschlussprüfung pflichtgemäßes Ermessen aus und bewahren eine kritische Grundhaltung.

Darüber hinaus gilt:

- Wir identifizieren und beurteilen die Risiken wesentlicher falscher Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern im Rechenschaftsbericht, planen Prüfungshandlungen als Reaktion auf diese Risiken, führen sie durch und erlangen Prüfungsnachweise, die ausreichend und geeignet sind, um als Grundlage für unser Prüfungsurteil zu dienen. Das Risiko, dass aus dolosen Handlungen resultierende wesentliche falsche Darstellungen nicht aufgedeckt werden, ist höher als ein aus Irrtümern resultierendes, da dolose Handlungen kollusives Zusammenwirken, Fälschungen, beabsichtigte Unvollständigkeiten, irreführende Darstellungen oder das Außerkraftsetzen interner Kontrollen beinhalten können.
- Wir gewinnen ein Verständnis von dem für die Abschlussprüfung relevanten internen Kontrollsystem um Prüfungshandlungen zu planen, die unter den gegebenen Umständen angemessen sind, jedoch nicht mit dem Ziel, ein Prüfungsurteil zur Wirksamkeit des internen Kontrollsystems der Gesellschaft abzugeben.
- Wir beurteilen die Angemessenheit der von den gesetzlichen Vertretern angewandten Rechnungslegungsmethoden sowie die Vertretbarkeit der von den gesetzlichen Vertretern dargestellten geschätzten Werte in der Rechnungslegung und damit zusammenhängende Angaben.
- Wir beurteilen die Gesamtdarstellung, den Aufbau und den Inhalt des Rechenschaftsberichts einschließlich der Angaben sowie ob der Rechenschaftsbericht die zugrunde liegenden Geschäftsvorfälle und Ereignisse in einer Weise wiedergibt, dass ein möglichst getreues Bild erreicht wird.

Wir tauschen uns mit dem Aufsichtsrat unter anderem über den geplanten Umfang und die geplante zeitliche Einteilung der Abschlussprüfung sowie über bedeutsame Prüfungsfeststellungen, einschließlich etwaiger bedeutsamer Mängel im internen Kontrollsystem, die wir während unserer Abschlussprüfung erkennen, aus.

Wien, am 2. September 2024

Deloitte Audit Wirtschaftsprüfungs GmbH

Mag. Robert Pejhovský  
Wirtschaftsprüfer

## **Berechnung des Gesamtrisikos**

### **Berechnungsmethode des Gesamtrisikos**

Commitment-Ansatz (gemäß dem 3. Hauptstück der 4. Derivate-Risikoberechnungs- und MeldeV)

## **Steuerliche Behandlung des Amundi Öko Sozial Net Zero Ambition Bond**

Die steuerliche Behandlung wird von der Österreichischen Kontrollbank (OeKB) auf Basis der Daten aus der Fondsbuchhaltung berechnet, auf [www.profitweb.at](http://www.profitweb.at) veröffentlicht und steht zum Download zur Verfügung.

Amundi Austria GmbH stellt zudem die steuerliche Behandlung in unserem Download-Center unter [download.fonds.at](http://download.fonds.at) zur Verfügung.

Alle Zahlenangaben beziehen sich auf die am Abschlussstichtag im Umlauf befindlichen Anteile und auf inländische Anleger, die unbeschränkt steuerpflichtig sind. Anleger mit Sitz, Wohnsitz oder gewöhnlichem Aufenthalt außerhalb Österreichs haben die jeweiligen Gesetze zu beachten.

# Fondsbestimmungen

## Fondsbestimmungen für den *Amundi Öko Sozial Net Zero Ambition Bond* gemäß InvFG 2011

Die Fondsbestimmungen für den Investmentfonds **Amundi Öko Sozial Net Zero Ambition Bond**, Miteigentumsfonds gemäß **Investmentfondsgesetz 2011 idGF** (InvFG), wurden von der Finanzmarktaufsicht (FMA) genehmigt.

Der Investmentfonds ist ein Organismus zur gemeinsamen Veranlagung in Wertpapieren (OGAW) und wird von der Amundi Austria GmbH (nachstehend „Verwaltungsgesellschaft“ genannt) mit Sitz in Wien verwaltet.

### **Artikel 1** *Miteigentumsanteile*

Die Miteigentumsanteile werden durch Anteilscheine (Zertifikate) mit Wertpapiercharakter verkörpert, die auf Inhaber lauten.

Die Anteilscheine werden in Sammelurkunden je Anteilsgattung dargestellt. Effektive Stücke können daher nicht ausgefolgt werden.

### **Artikel 2** *Depotbank (Verwahrstelle)*

#### **Bis 31.05.2024:**

Die für den Investmentfonds bestellte Depotbank (Verwahrstelle) ist die State Street Bank International GmbH, Filiale Wien, Wien.

Zahlstellen für Anteilscheine sind die Depotbank (Verwahrstelle) oder sonstige im Prospekt genannte Zahlstellen.

#### **Ab 01.06.2024:**

Die für den Investmentfonds bestellte Depotbank (Verwahrstelle) ist die Raiffeisen Bank International AG, Wien.

Zahlstellen für Anteilscheine sind die Depotbank (Verwahrstelle) oder sonstige im Prospekt genannte Zahlstellen.

### **Artikel 3** *Veranlagungsinstrumente und -grundsätze*

Der Investmentfonds verfolgt eine aktive Veranlagungsstrategie und orientiert sich an keinem Referenzwert.

Für den Investmentfonds dürfen nachstehende Vermögenswerte nach Maßgabe des InvFG ausgewählt werden.

#### **Beschreibung des Veranlagungsschwerpunktes**

Der Investmentfonds zielt darauf ab, durch die sukzessive Reduktion der CO<sub>2</sub> Intensität seines Wertpapierportfolios, diese gegen Null streben zu lassen. Der Investmentfonds investiert zu mindestens **51 vH** des Fondsvermögens in Anleihen, die in Form von direkt erworbenen Einzeltiteln, sohin nicht über Investmentfonds oder über Derivate gehalten werden, unter Berücksichtigung ökologischer und sozialer Nachhaltigkeitskriterien sowie unter Einhaltung ethischer Ausschlusskriterien. Ein Direkterwerb von Aktien ist nur im Rahmen der Wandlung von Pflichtwandelanleihen zulässig.

Der Investmentfonds investiert überwiegend in Euro und gegen Euro kursgesicherte Positionen. Wird das Währungsrisiko durch Kurssicherungsgeschäfte beseitigt, so können diese Veranlagungen den auf Euro lautenden Veranlagungen zugeordnet werden. Das ungesicherte Währungsrisiko kann dabei **bis zu 2 vH** des Fondsvermögens betragen. Veranlagungen in zum Euro fixierten, ehemaligen Währungen der Euro-Staaten werden Veranlagungen in Euro zugeordnet.

Die nachfolgenden Veranlagungsinstrumente werden unter Einhaltung des obig beschriebenen Veranlagungsschwerpunktes für das Fondsvermögen erworben.

Gegebenenfalls können Anteile an Investmentfonds erworben werden, deren Anlagerestriktionen hinsichtlich des obig beschriebenen Veranlagungsschwerpunktes und der unten zu den Veranlagungsinstrumenten angeführten Beschränkungen abweichen. Die jederzeitige Einhaltung des obig beschriebenen Veranlagungsschwerpunktes bleibt hiervon unberührt.

#### **3.1. Wertpapiere**

Wertpapiere (einschließlich Wertpapiere mit eingebetteten derivativen Instrumenten) dürfen **bis zu 100 vH** des Fondsvermögens erworben werden.

#### **3.2. Geldmarktinstrumente**

Geldmarktinstrumente dürfen **bis zu 49 vH** des Fondsvermögens erworben werden.

#### **3.3. Wertpapiere und Geldmarktinstrumente**

Der Erwerb nicht voll eingezahlter Wertpapiere oder Geldmarktinstrumente und von Bezugsrechten auf solche Instrumente oder von nicht voll eingezahlten anderen Finanzinstrumenten ist zulässig. Wertpapiere und Geldmarktinstrumente dürfen erworben werden, wenn sie den Kriterien betreffend die Notiz oder den Handel an einem geregelten Markt oder einer Wertpapierbörse gemäß InvFG entsprechen. Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die die im vorstehenden Absatz genannten Kriterien nicht erfüllen, dürfen insgesamt **bis zu 10 vH** des Fondsvermögens erworben werden.

#### **3.4. Anteile an Investmentfonds**

Anteile an Investmentfonds (OGAW, OGA) dürfen **jeweils bis zu 10 vH** des Fondsvermögens und **insgesamt bis zu 10 vH** des Fondsvermögens erworben werden, sofern diese (OGAW bzw. OGA) ihrerseits jeweils zu nicht mehr als 10 vH des Fondsvermögens in Anteile anderer Investmentfonds investieren.

Anteile an OGA dürfen **insgesamt bis zu 10 vH** des Fondsvermögens erworben werden.

### 3.5. Derivative Instrumente

Derivative Instrumente dürfen als Teil der Anlagestrategie **bis zu 49 vH** des Fondsvermögens (berechnet auf Basis der aktuellen Marktpreise) und zur Absicherung eingesetzt werden.

### 3.6. Risiko-Messmethode des Investmentfonds

Der Investmentfonds wendet folgende Risikomessmethode an:

#### Commitment Ansatz

Der Commitment Wert wird gemäß dem 3. Hauptstück der 4. Derivate-Risikoberechnungs- und MeldeV idgF ermittelt.

Das Gesamtrisiko derivativer Instrumente, die nicht der Absicherung dienen, darf **100 vH** des Gesamtnettowerts des Fondsvermögens nicht überschreiten.

### 3.7. Sichteinlagen oder kündbare Einlagen

Sichteinlagen und kündbare Einlagen mit einer Laufzeit von höchstens 12 Monaten dürfen **bis zu 49 vH** des Fondsvermögens gehalten werden.

Es ist kein Mindestbankguthaben zu halten.

Im Rahmen von Umschichtungen des Fondsportfolios und/oder der begründeten Annahme drohender Verluste bei Wertpapieren kann der Investmentfonds den Anteil an Wertpapieren unterschreiten und einen höheren Anteil an Sichteinlagen oder kündbaren Einlagen mit einer Laufzeit von höchstens 12 Monaten aufweisen.

### 3.8. Vorübergehend aufgenommene Kredite

Die Verwaltungsgesellschaft darf für Rechnung des Investmentfonds vorübergehend Kredite **bis zur Höhe von 10 vH** des Fondsvermögens aufnehmen.

### 3.9. Pensionsgeschäfte

Pensionsgeschäfte dürfen **bis zu 49 vH** des Fondsvermögens eingesetzt werden.

### 3.10. Wertpapierleihe

Wertpapierleihegeschäfte dürfen **bis zu 30 vH** des Fondsvermögens eingesetzt werden.

Der Erwerb von Veranlagungsinstrumenten ist nur einheitlich für den ganzen Investmentfonds und nicht für eine einzelne Anteilsgattung oder eine Gruppe von Anteilsgattungen zulässig.

Dies gilt jedoch nicht für Währungssicherungsgeschäfte. Diese können auch ausschließlich zugunsten einer einzigen Anteilsgattung abgeschlossen werden. Ausgaben und Einnahmen aufgrund eines Währungssicherungsgeschäfts werden ausschließlich der betreffenden Anteilsgattung zugeordnet.

## **Artikel 4 Modalitäten der Ausgabe und Rücknahme**

Die Berechnung des Anteilswertes erfolgt in EUR.

Der Wert der Anteile wird an jedem österreichischen Börsentag mit Ausnahme von Bankfeiertagen ermittelt.

Der Zeitpunkt der Berechnung des Anteilswertes fällt mit dem Berechnungszeitpunkt des Ausgabe- und Rücknahmepreises zusammen.

### 4.1. Ausgabe und Ausgabeaufschlag

Die Berechnung des Ausgabepreises bzw. die Ausgabe erfolgt an jedem österreichischen Börsentag mit Ausnahme von Bankfeiertagen.

Der Ausgabepreis ergibt sich aus dem Anteilswert zuzüglich eines Aufschlages pro Anteil in Höhe von **bis zu 2,50 vH** zur Deckung der Ausgabekosten der Verwaltungsgesellschaft.

Die Ausgabe der Anteile ist grundsätzlich nicht beschränkt, die Verwaltungsgesellschaft behält sich jedoch vor, die Ausgabe von Anteilscheinen vorübergehend oder vollständig einzustellen. Es liegt im Ermessen der Verwaltungsgesellschaft eine Staffelung des Ausgabeaufschlags vorzunehmen.

### 4.2. Rücknahme und Rücknahmeabschlag

Die Berechnung des Rücknahmepreises bzw. die Rücknahme erfolgt an jedem österreichischen Börsentag mit Ausnahme von Bankfeiertagen. Der Rücknahmepreis ergibt sich aus dem Anteilswert. Es fällt kein Rücknahmeabschlag an.

Auf Verlangen eines Anteilinhabers ist diesem sein Anteil an dem Investmentfonds zum jeweiligen Rücknahmepreis gegen Rückgabe des Anteilscheines auszuführen.

## **Artikel 5 Rechnungsjahr**

Das am 16.02.2024 begonnene Rechnungsjahr des Investmentfonds endet am 31.05.2024. Das am 01.06.2024 beginnende Rechnungsjahr des Investmentfonds endet zum 28.02.2025. In der Folge ist das Rechnungsjahr des Investmentfonds die Zeit vom 01.03. bis zum Ultimo Februar des nächsten Kalenderjahres.

## **Artikel 6 Anteilsgattungen und Ertragnisverwendung**

Für den Investmentfonds können sowohl Ausschüttungsanteilscheine und/oder Thesaurierungsanteilscheine mit KEST-Auszahlung als auch Thesaurierungsanteilscheine ohne KEST-Auszahlung und zwar jeweils über ein Stück oder Bruchteile davon ausgegeben werden.

Für diesen Investmentfonds können verschiedene Gattungen von Anteilscheinen ausgegeben werden. Die Bildung der Anteilsgattungen sowie die Ausgabe von Anteilen einer Anteilsgattung liegen im Ermessen der Verwaltungsgesellschaft.

### 6.1. Ertragnisverwendung bei Ausschüttungsanteilscheinen (Ausschütter)

Die während des Rechnungsjahres vereinnahmten Erträge (Zinsen und Dividenden) können nach Deckung der Kosten nach dem Ermessen der Verwaltungsgesellschaft ausgeschüttet werden. Eine Ausschüttung kann unter Berücksichtigung der Interessen der Anteilhaber unterbleiben. Ebenso steht die Ausschüttung von Erträgen aus der Veräußerung von Vermögenswerten des Investmentfonds einschließlich von Bezugsrechten im Ermessen der Verwaltungsgesellschaft. Eine Ausschüttung aus der Fondssubstanz sowie Zwischenausschüttungen sind zulässig.

Das Fondsvermögen darf durch Ausschüttungen in keinem Fall das im Gesetz vorgesehene Mindestvolumen für eine Kündigung unterschreiten.

Die Beträge sind an die Inhaber von Ausschüttungsanteilscheinen für das am 31.05.2024 endende Rechnungsjahr ab 31.07.2024 und für die nachfolgenden Rechnungsperioden ab 30.04. des folgenden Rechnungsjahres auszuschütten, der Rest wird auf neue Rechnung vorgetragen.

Jedenfalls ist für das am 31.05.2024 endende Rechnungsjahr ab 31.07.2024 und für nachfolgende Rechnungsperioden ab 30.04. der gemäß InvFG ermittelte Betrag auszuzahlen, der zutreffendenfalls zur Deckung einer auf den ausschüttungsgleichen Ertrag des Anteilscheines entfallenden Kapitalertragsteuerabfuhrpflicht zu verwenden ist, es sei denn, die Verwaltungsgesellschaft stellt durch Erbringung entsprechender Nachweise von den depotführenden Stellen sicher, dass die Anteilscheine im Auszahlungszeitpunkt nur von Anteilhabern gehalten werden können, die entweder nicht der inländischen Einkommen- oder Körperschaftsteuer unterliegen oder bei denen die Voraussetzungen für eine Befreiung gemäß § 94 des Einkommensteuergesetzes bzw. für eine Befreiung von der Kapitalertragsteuer vorliegen.

### 6.2. Ertragnisverwendung bei Thesaurierungsanteilscheinen mit KEST-Auszahlung (Thesaurierer)

Die während des Rechnungsjahres vereinnahmten Erträge nach Deckung der Kosten werden nicht ausgeschüttet. Es ist bei Thesaurierungsanteilscheinen für das am 31.05.2024 endende Rechnungsjahr ab 31.07.2024 und für nachfolgende Rechnungsperioden ab 30.04. der gemäß InvFG ermittelte Betrag auszuzahlen, der zutreffendenfalls zur Deckung einer auf den ausschüttungsgleichen Ertrag des Anteilscheines entfallenden Kapitalertragsteuerabfuhrpflicht zu verwenden ist, es sei denn, die Verwaltungsgesellschaft stellt durch Erbringung entsprechender Nachweise von den depotführenden Stellen sicher, dass die Anteilscheine im Auszahlungszeitpunkt nur von Anteilhabern gehalten werden können, die entweder nicht der inländischen Einkommen- oder Körperschaftsteuer unterliegen oder bei denen die Voraussetzungen für eine Befreiung gemäß § 94 des Einkommensteuergesetzes bzw. für eine Befreiung von der Kapitalertragsteuer vorliegen.

### 6.3. Ertragnisverwendung bei Thesaurierungsanteilscheinen ohne KEST-Auszahlung (Vollthesaurierer)

Die während des Rechnungsjahres vereinnahmten Erträge nach Deckung der Kosten werden nicht ausgeschüttet. Es wird keine Auszahlung gemäß InvFG vorgenommen. Der für das Unterbleiben der KEST-Auszahlung auf den Jahresertrag gemäß InvFG maßgebliche Zeitpunkt ist jeweils für das am 31.05.2024 endende Rechnungsjahr der 31.07.2024 und für nachfolgende Rechnungsperioden der 30.04. des folgenden Rechnungsjahres. Die Verwaltungsgesellschaft stellt durch Erbringung entsprechender Nachweise von den depotführenden Stellen sicher, dass die Anteilscheine im Auszahlungszeitpunkt nur von Anteilhabern gehalten werden können, die entweder nicht der inländischen Einkommen- oder Körperschaftsteuer unterliegen oder bei denen die Voraussetzungen für eine Befreiung gemäß § 94 des Einkommensteuergesetzes bzw. für eine Befreiung von der Kapitalertragsteuer vorliegen. Werden diese Voraussetzungen zum Auszahlungszeitpunkt nicht erfüllt, ist der gemäß InvFG ermittelte Betrag durch Gutschrift des jeweils depotführenden Kreditinstituts auszuzahlen.

### 6.4. Ertragnisverwendung bei Thesaurierungsanteilscheinen ohne KEST-Auszahlung (Vollthesaurierer Auslandstranche)

Der Vertrieb der Thesaurierungsanteilscheine ohne KEST-Auszahlung erfolgt ausschließlich im Ausland.

Die während des Rechnungsjahres vereinnahmten Erträge nach Deckung der Kosten werden nicht ausgeschüttet. Es wird keine Auszahlung gemäß InvFG vorgenommen. Die Verwaltungsgesellschaft stellt durch Erbringung entsprechender Nachweise sicher, dass die Anteilscheine im Auszahlungszeitpunkt nur von Anteilhabern gehalten werden können, die entweder nicht der inländischen Einkommen- oder Körperschaftsteuer unterliegen oder bei denen die Voraussetzungen für eine Befreiung gemäß § 94 des Einkommensteuergesetzes bzw. für eine Befreiung von der Kapitalertragssteuer vorliegen.

### Artikel 7 *Verwaltungsgebühr, Ersatz von Aufwendungen, Abwicklungsgebühr*

Die Verwaltungsgesellschaft erhält für ihre Verwaltungstätigkeit als jährliche Vergütung

- a) eine Verwaltungsgebühr bis zu einer Höhe von **0,72 vH** des Fondsvermögens und
- b) eine Administrationsgebühr bis zu einer Höhe von **0,23 vH** des Fondsvermögens.

Es liegt im Ermessen der Verwaltungsgesellschaft, eine Staffelung der Verwaltungsgebühr vorzunehmen.

Die Verwaltungsgesellschaft hat Anspruch auf Ersatz aller durch die Verwaltung entstandenen Aufwendungen für außerordentlichen Sonderaufwand, für die Kosten aus Portfoliotransaktionen (Brokerspesen, Kosten des externen Trading Desks) für Kosten aus Datenprovidern sowie für allfällige Steuern auf Vermögenswerte und/oder deren Erträge. Die Kosten bei Einführung neuer Anteilsgattungen für bestehende Investmentfonds werden zu Lasten der Anteilspreise der neuen Anteilsgattungen in Rechnung gestellt. Die Verwaltungsgebühr und die Administrationsgebühr werden aufgrund des **Durchschnitts** der Fondsvermögenswerte je Preisberechnungstag bereinigt um allfällige dafür vorgenommene Abgrenzungen errechnet und monatlich in 12 Teilbeträgen angelastet.

Bei Abwicklung des Investmentfonds erhält die abwickelnde Stelle eine Vergütung von **bis zu 0,5 vH** des Fondsvermögens.

**Nähere Angaben und Erläuterungen zu diesem Investmentfonds finden sich im Prospekt.**

Mit Bescheid der Finanzmarktaufsichtsbehörde GZ FMA-IF25 6200/0002-ASM/2024 vom 26.01.2024 wurde die Genehmigung zur Änderung der Fondsbestimmungen erteilt. Die geänderten Fondsbestimmungen traten am 31.05.2024 in Kraft.

## Anhang

### Liste der Börsen mit amtlichem Handel und von organisierten Märkten

#### 1. Börsen mit amtlichem Handel und organisierten Märkten in den Mitgliedstaaten des EWR sowie Börsen in europäischen Ländern außerhalb der Mitgliedstaaten des EWR, die als gleichwertig mit geregelten Märkten gelten

Jeder Mitgliedstaat hat ein aktuelles Verzeichnis der von ihm genehmigten Märkte zu führen. Dieses Verzeichnis ist den anderen Mitgliedstaaten und der Kommission zu übermitteln.

Die Kommission ist gemäß dieser Bestimmung verpflichtet, einmal jährlich ein Verzeichnis der ihr mitgeteilten geregelten Märkte zu veröffentlichen.

Infolge verringerter Zugangsschranken und der Spezialisierung in Handelssegmente ist das Verzeichnis der „geregelten Märkte“ größeren Veränderungen unterworfen. Die Kommission wird daher neben der jährlichen Veröffentlichung eines Verzeichnisses im Amtsblatt der Europäischen Union eine aktualisierte Fassung auf ihrer offiziellen Internetseite zugänglich machen.

##### 1.1. Das aktuell gültige Verzeichnis der geregelten Märkte finden Sie unter

[https://registers.esma.europa.eu/publication/searchRegister?core=esma\\_registers\\_upreg](https://registers.esma.europa.eu/publication/searchRegister?core=esma_registers_upreg)<sup>1</sup>

##### 1.2. Gemäß § 67 Abs. 2 Z 2 InvFG anerkannte Märkte im EWR:

Märkte im EWR, die von den jeweils zuständigen Aufsichtsbehörden als anerkannte Märkte eingestuft werden.

### 2. Börsen in europäischen Ländern außerhalb der Mitgliedstaaten des EWR

|      |   |   |
|------|---|---|
| 2.1. | Bosnien Herzegowina:                                    | Sarajevo, Banja Luka  |
| 2.2. | Montenegro:   | Podgorica   |
| 2.3. | Russland:   | Moscow Exchange   |
| 2.4. | Schweiz   | SIX Swiss Exchange AG, BX Swiss AG  |
| 2.5. | Serbien:  | Belgrad   |
| 2.6. | Türkei:   | Istanbul (betr. Stock Market nur "National Market")   |
| 2.7. | Vereinigtes Königreich<br>Großbritannien und Nordirland | Cboe Europe Equities Regulated Market – Integrated Book Segment, London Metal Exchange, Cboe Europe Equities Regulated Market – Reference Price Book Segment, Cboe Europe Equities Regulated Market – Off-Book Segment, London Stock Exchange Regulated Market (derivatives), NEX Exchange Main Board (non-equity), London Stock Exchange Regulated Market, NEX Exchange Main Board (equity), Euronext London Regulated Market, ICE FUTURES EUROPE, ICE FUTURES EUROPE - AGRICULTURAL PRODUCTS DIVISION, ICE FUTURES EUROPE - FINANCIAL PRODUCTS DIVISION, ICE FUTURES EUROPE - EQUITY PRODUCTS DIVISION und Gibraltar Stock Exchange |

### 3. Börsen in außereuropäischen Ländern

|       |              |  |
|-------|--------------|--|
| 3.1.  | Australien:  | Sydney, Hobart, Melbourne, Perth                 |
| 3.2.  | Argentinien: | Buenos Aires                                     |
| 3.3.  | Brasilien:   | Rio de Janeiro, Sao Paulo                        |
| 3.4.  | Chile:       | Santiago   |
| 3.5.  | China:       | Shanghai Stock Exchange, Shenzhen Stock Exchange |
| 3.6.  | Hongkong:    | Hongkong Stock Exchange                          |
| 3.7.  | Indien:      | Mumbai   |
| 3.8.  | Indonesien:  | Jakarta  |
| 3.9.  | Israel:      | Tel Aviv   |
| 3.10. | Japan:       | Tokyo, Osaka, Nagoya, Fukuoka, Sapporo           |
| 3.11. | Kanada:      | Toronto, Vancouver, Montreal                     |
| 3.12. | Kolumbien:   | Bolsa de Valores de Colombia                     |
| 3.13. | Korea:       | Korea Exchange (Seoul, Busan)                    |
| 3.14. | Malaysia:    | Kuala Lumpur, Bursa Malaysia Berhad              |
| 3.15. | Mexiko:      | Mexiko City                                      |

<sup>1</sup> Zum Öffnen des Verzeichnisses in der Spalte links unter „Entity Type“ die Einschränkung auf „Regulated market“ auswählen und auf „Search“ (bzw. auf „Show table columns“ und „Update“) klicken. Der Link kann durch die ESMA geändert werden.

|       |                               |  |
|-------|-------------------------------|--|
| 3.16. | Neuseeland:                   | Wellington, Auckland   |
| 3.17  | Peru                          | Bolsa de Valores de Lima   |
| 3.18. | Philippinen:                  | Philippine Stock Exchange  |
| 3.19. | Singapur:                     | Singapur Stock Exchange  |
| 3.20. | Südafrika:                    | Johannesburg   |
| 3.21. | Taiwan:                       | Taipei   |
| 3.22. | Thailand:                     | Bangkok  |
| 3.23. | USA:                          | New York, NYCE American, New York Stock Exchange (NYSE), Philadelphia, Chicago, Boston, Cincinnati, Nasdaq |
| 3.24. | Venezuela:                    | Caracas  |
| 3.25. | Vereinigte Arabische Emirate: | Abu Dhabi Securities Exchange (ADX)  |

#### 4. Organisierte Märkte in Ländern außerhalb der Mitgliedstaaten der Europäischen Union

|      |          |  |
|------|----------|--|
| 4.1. | Japan:   | Over the Counter Market  |
| 4.2. | Kanada:  | Over the Counter Market  |
| 4.3. | Korea:   | Over the Counter Market  |
| 4.4. | Schweiz: | Over the Counter Market der Mitglieder der International Capital Market Association (ICMA), Zürich |
| 4.5. | USA      | Over The Counter Market (unter behördlicher Beaufsichtigung wie z.B. durch SEC, FINRA)             |

#### 5. Börsen mit Futures und Options Märkten

|       |              |   |
|-------|--------------|---|
| 5.1.  | Argentinien: | Bolsa de Comercio de Buenos Aires   |
| 5.2.  | Australien:  | Australian Options Market, Australian Securities Exchange (ASX)   |
| 5.3.  | Brasilien:   | Bolsa Brasileira de Futuros, Bolsa de Mercadorias & Futuros, Rio de Janeiro Stock Exchange, Sao Paulo Stock Exchange  |
| 5.4.  | Hongkong:    | Hong Kong Futures Exchange Ltd.   |
| 5.5.  | Japan:       | Osaka Securities Exchange, Tokyo International Financial Futures Exchange, Tokyo Stock Exchange   |
| 5.6.  | Kanada:      | Montreal Exchange, Toronto Futures Exchange   |
| 5.7.  | Korea:       | Korea Exchange (KRX)  |
| 5.8.  | Mexiko:      | Mercado Mexicano de Derivados   |
| 5.9.  | Neuseeland:  | New Zealand Futures & Options Exchange  |
| 5.10. | Philippinen: | Manila International Futures Exchange   |
| 5.11. | Singapur:    | The Singapore Exchange Limited (SGX)  |
| 5.12. | Südafrika:   | Johannesburg Stock Exchange (JSE), South African Futures Exchange (SAFEX)   |
| 5.13. | Türkei:      | TurkDEX   |
| 5.14. | USA:         | NYCE American, Chicago Board Options Exchange, Chicago Board of Trade, Chicago Mercantile Exchange, Comex, FINEX, ICE Future US Inc. New York, Nasdaq, New York Stock Exchange, Boston Options Exchange (BOX) |



**Anhang Informationen gemäß Art 11 der OffenlegungsVO**

**Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten**

**Name des Produkts:** Amundi Öko Sozial Net Zero Ambition Bond

**Unternehmenskennung (LEI-Code):** 5299007N3NCCWGRP53

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. In dieser Verordnung ist kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten festgelegt. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

### Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?



Ja



X

Nein



Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: \_\_\_\_\_



in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind



in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind



Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: \_\_\_\_\_



Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt Es 80,27 % an nachhaltigen Investitionen



mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind



mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind



mit einem sozialen Ziel



Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt



### Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Ja, die beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale wurden erfüllt. Während des Geschäftsjahres förderte das Produkt kontinuierlich ökologische und/oder soziale Merkmale, indem es einen höheren ESG-Score anstrebte als der ESG-Score des **SOLACTIVE EURO CORPORATE IG PAB Index** (die ESG-Vergleichsbenchmark bzw. Referenzwert). Bei der Ermittlung des ESG-Scores des Anlageuniversums wurde die ESG-Performance kontinuierlich bewertet, indem die durchschnittliche Performance eines Wertpapiers mit der Branche des Wertpapieremittenten in Bezug auf jedes der drei Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale verglichen wurde.

Während des Geschäftsjahres förderte das Produkt kontinuierlich Umwelteigenschaften, indem es darauf abzielte, seine CO<sub>2</sub>-Intensität zu reduzieren, indem es seine CO<sub>2</sub>-Fußabdruckintensität an die seiner Benchmark anpasste- **SOLACTIVE EURO CORPORATE IG PAB Index**.

Der Fonds ist Träger des Österreichischen Umweltzeichens UZ49. Im Rahmen der jährlichen Umweltzeichenzertifizierung (zuletzt per 21. Dezember 2023 lt. Prüfact-Nr. VKI 1156-2023) wird die Einhaltung der Vorgaben des Österreichischen Umweltzeichens Prüfung bestätigt.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

### ● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Amundi hat ein eigenes internes ESG-Ratingverfahren entwickelt, das auf dem "Best-in-Class"-Ansatz basiert. Die auf die einzelnen Wirtschaftszweige abgestimmten Ratings zielen darauf ab, die Arbeitsumgebung zu bewerten, in der die Unternehmen tätig sind. Weitere Einzelheiten finden Sie im Abschnitt "Nachhaltige Anlagen" des Verkaufsprospekts.

Der verwendete Nachhaltigkeitsindikator ist der ESG-Score des Produkts, der am ESG-Score des Anlageuniversums des Produkts gemessen wird.

Am Ende des Berichtszeitraums:

- beträgt das gewichtete durchschnittliche ESG-Score des Portfolios **1,07** (dies entspricht einem ESG Rating von **C**).
- beträgt das gewichtete durchschnittliche ESG-Score des ESG-Anlageuniversum **0,687** (dies entspricht einem ESG Rating von **C**).

Das Amundi ESG-Rating, das zur Bestimmung des ESG-Scores verwendet wird, ist ein quantitativer ESG-Score, der in sieben Stufen von A (beste Punktzahl im Universum) bis G (schlechteste Punktzahl) übersetzt wird. In der Amundi ESG-Ratingskala entsprechen die Wertpapiere, die auf der Ausschlussliste stehen, einem G. Die ESG-Performance von Emittenten wird global und auf Ebene der relevanten Kriterien durch einen Vergleich mit der durchschnittlichen Performance ihrer Branche bewertet, und zwar durch die Kombination der drei ESG-Dimensionen:

- **Umweltdimension:** Hier wird untersucht, inwieweit die Emittenten in der Lage sind, ihre direkten und indirekten Umweltauswirkungen zu kontrollieren, indem sie ihren Energieverbrauch einschränken, ihre Treibhausgasemissionen reduzieren, den Ressourcenabbau bekämpfen und die biologische Vielfalt schützen.
- **Soziale Dimension:** Hier wird gemessen, wie ein Emittent mit zwei unterschiedlichen Konzepten arbeitet: die Strategie des Emittenten zur Entwicklung seines Humankapitals und die Achtung der Menschenrechte im Allgemeinen;
- **Governance-Dimension:** Hier wird die Fähigkeit des Emittenten bewertet, die Grundlage für einen wirksamen Corporate-Governance-Rahmen zu gewährleisten und langfristig Werte zu schaffen.

Die von Amundi ESG-Rating angewandte Methodik stützt sich auf 38 Kriterien, die entweder generisch (für alle Unternehmen unabhängig von ihrer Tätigkeit) oder sektorspezifisch sind, die je nach Sektor gewichtet und hinsichtlich ihrer Auswirkungen auf den Ruf, die betriebliche Effizienz und die Vorschriften für einen Emittenten berücksichtigt werden. Die ESG-Ratings von Amundi können global für die drei Dimensionen E, S und G oder individuell für jeden ökologischen oder sozialen Faktor abgegeben werden.

Weitere Einzelheiten finden Sie im Abschnitt "Nachhaltige Anlagen" des Verkaufsprospekts.

Die Kohlenstoff-Fußabdruck-Intensität des Portfolios, die als vermögenswertgewichteter Portfoliodurchschnitt berechnet und mit der vermögenswertgewichteten Intensität des ökologischen Fußabdrucks der Benchmark verglichen wird. Infolgedessen hatten Wertpapiere mit einem relativ niedrigen ökologischen Fußabdruck eine höhere Wahrscheinlichkeit, in das Portfolio aufgenommen zu werden, als Wertpapiere mit einem relativ hohen ökologischen Fußabdruck.

- Die gewichtete Kohlenstoff-Intensität des Portfolios beträgt **73,73** Tons/M.EUR.
- Die gewichtete Kohlenstoff-Intensität der Benchmark beträgt **96,56** Tons/M.EUR.

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Am Ende der Vorperiode betrug das gewichtete durchschnittliche ESG-Score des Portfolios 1,019 (dies entspricht einem ESG Rating von C) und das gewichtete durchschnittliche ESG-Score des ESG-Anlageuniversums betrug 0,666 (dies entspricht einem ESG Rating von C).

Am Ende der Vorperiode betrug die gewichtete Kohlenstoff-Intensität des Portfolios 79,73 Tons/M.EUR und die gewichtete Kohlenstoff-Intensität der Benchmark betrug 98,13 Tons/M.EUR.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Die Ziele der nachhaltigen Investitionen bestanden darin, in Unternehmen zu investieren, die zwei Kriterien erfüllen:

- 1) beste Umwelt- und Sozialpraktiken anwenden und
- 2) keine Produkte herstellen oder Dienstleistungen erbringen, die der Umwelt und der Gesellschaft schaden.

Damit davon ausgegangen werden kann, dass das Unternehmen, in das investiert wird, einen Beitrag zu dem oben genannten Ziel leistet, muss es in seinem Tätigkeitsbereich bei mindestens einem seiner wesentlichen Umwelt- oder Sozialfaktoren zu den "Best Performern" gehören.

Die Definition des Begriffs "Best Performer" basiert auf der Amundi-eigenen ESG-Methode, die darauf abzielt, die ESG-Leistung eines Unternehmens, in das investiert wird, zu messen. Um als "Best Performer" eingestuft zu werden, muss ein Unternehmen, in das investiert wird, innerhalb seines Sektors bei mindestens einem wesentlichen Umwelt- oder Sozialfaktor die drei besten Bewertungen (A, B oder C auf einer Bewertungsskala von A bis G) erzielen. Wesentliche Umwelt- und Sozialfaktoren werden auf Branchenebene ermittelt. Die Identifizierung der wesentlichen Faktoren basiert auf dem Amundi ESG-Analyseverfahren, das außerfinanzielle Daten und eine qualitative Analyse der damit verbundenen Branchen- und Nachhaltigkeitsthemen kombiniert. Faktoren, die als wesentlich identifiziert werden, leisten einen Beitrag von mehr als 10 % zum gesamten ESG-Score. Für den Energiesektor beispielsweise sind folgende Faktoren wesentlich: Emissionen und Energie, biologische Vielfalt und Umweltverschmutzung, Gesundheit und Sicherheit, lokale Gemeinschaften und Menschenrechte. Einen vollständigen Überblick über die Sektoren und Faktoren finden Sie in der Erklärung zur Berücksichtigung von Nachhaltigkeitsrisiken von Amundi, die unter [www.amundi.at](http://www.amundi.at) verfügbar ist.

Um zu den oben genannten Zielen beizutragen, sollte das Unternehmen, in das investiert wird, nicht in nennenswertem Umfang an Aktivitäten beteiligt sein (z. B. Tabak, Waffen, Glücksspiel, Kohle, Luftfahrt, Fleischproduktion, Herstellung von Düngemitteln und Pestiziden, Produktion von Einwegplastik), die nicht mit diesen Kriterien vereinbar sind.

Der nachhaltige Charakter einer Investition wurde auf der Ebene des Unternehmens, in das investiert wurde, bewertet.

Bei den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

● ***Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?***

Um sicherzustellen, dass nachhaltige Investitionen keines der Umwelt- oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt ("do not significantly harm", "DNSH"), setzt Amundi zwei Filter ein:

Der erste DNSH-Filter stützt sich auf die Überwachung der obligatorischen Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen in Anhang 1, Tabelle 1 der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1288, sofern robuste Daten verfügbar sind (z. B. die Treibhausgasintensität von Unternehmen, in die investiert wird), und zwar durch eine Kombination von Indikatoren (z. B. die Kohlenstoffintensität) und spezifischen Schwellenwerten oder Regeln (z. B. dass die Kohlenstoffintensität des Unternehmens, in das investiert wird, nicht zum letzten Dezil des Sektors gehört).

Amundi berücksichtigt bereits bestimmte wichtigste nachteilige Auswirkungen im Rahmen seiner Ausschlusspolitik als Teil der Grundsätze für nachhaltiges Investieren von Amundi. Diese Ausschlüsse, die zusätzlich zu den oben genannten Tests gelten, decken die folgenden Themen ab: Ausschlüsse für kontroverse Waffen, Verstöße gegen die Prinzipien des UN Global Compact, Kohle und Tabak.

Neben den spezifischen Nachhaltigkeitsfaktoren, die vom ersten Filter abgedeckt werden, hat Amundi einen zweiten Filter definiert, der die oben genannten obligatorischen Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen nicht berücksichtigt, um zu überprüfen, ob das Unternehmen im Vergleich zu anderen Unternehmen seines Sektors in ökologischer oder sozialer Hinsicht insgesamt nicht schlecht abschneidet, was einem Umwelt- oder Sozial-Score von E oder höher unter Verwendung des ESG-Ratings von Amundi entspricht.

– ***Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?***

Die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen wurden wie im ersten DNSH-Filter ("Do not significantly harm") oben beschrieben berücksichtigt:

Der erste DNSH-Filter stützt sich auf die Überwachung der obligatorischen Hauptindikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen in Anhang 1, Tabelle 1 der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1288, wenn durch die Kombination der folgenden Indikatoren und spezifischer Schwellenwerte oder Regeln zuverlässige Daten verfügbar sind:

- eine CO<sub>2</sub>-Intensität, die im Vergleich zu anderen Unternehmen in ihrem Sektor nicht zum letzten Dezil gehört (gilt nur für Sektoren mit hoher Intensität), und
- Die Diversität des Verwaltungsrats gehört im Vergleich zu anderen Unternehmen des Sektors nicht zum letzten Dezil, und
- keine Kontroversen in Bezug auf Arbeitsbedingungen und Menschenrechte haben.
- Keine Kontroversen in Bezug auf biologische Vielfalt und Umweltverschmutzung

Amundi berücksichtigt im Rahmen seiner Ausschlusspolitik als Teil der Grundsätze für nachhaltiges Investieren von Amundi bereits bestimmte wichtigste nachteilige Auswirkungen (Principle Adverse Impacts). Diese Ausschlüsse, die zusätzlich zu den oben

genannten Tests gelten, decken die folgenden Themen ab: Ausschluss von kontroversen Waffen, Verstöße gegen die Prinzipien des UN Global Compact, Kohle und Tabak.

– ***Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:***

Die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und die UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte wurden in unsere ESG-Bewertungsmethodik integriert. Unser firmeneigenes ESG-Rating-Tool bewertet Emittenten anhand der verfügbaren Daten von unseren Datenanbietern. Das Modell verfügt beispielsweise über ein spezielles Kriterium mit der Bezeichnung "Community Involvement & Human Rights", das auf alle Sektoren angewendet wird, zusätzlich zu anderen menschenrechtsbezogenen Kriterien wie sozial verantwortliche Lieferketten, Arbeitsbedingungen und Arbeitsbeziehungen. Darüber hinaus führen wir mindestens vierteljährlich ein Kontroversen-Monitoring durch, das Unternehmen einschließt, bei denen Menschenrechtsverletzungen festgestellt wurden. Wenn Kontroversen auftraten, bewerteten Analysten die Situation und wendeten eine Punktzahl auf die Kontroverse an (unter Verwendung unserer firmeneigenen Bewertungsmethodik) und bestimmten die beste Vorgehensweise. Die Bewertungen der Kontroversen werden vierteljährlich aktualisiert, um den Trend und die Abhilfemaßnahmen zu verfolgen.

*In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.*

*Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.*

*Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.*



**Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Der Fonds berücksichtigte alle verbindlichen wichtigsten nachteiligen Auswirkungen gemäß Anhang 1, Tabelle 1 der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1288, die auf die Strategie des Fonds zutreffen, und stützte sich auf eine Kombination aus Ausschlussgrundsätzen (normativ und sektorbezogen), der Integration von ESG-Ratings in den Anlageprozess, Engagement und Abstimmungsansätzen:

- Ausschluss: Amundi hat normative, tätigkeitsbasierte und sektorbasierte Ausschlussregeln definiert, die einige der wichtigsten nachteiligen Nachhaltigkeitsindikatoren abdecken, die in der Offenlegungsverordnung aufgeführt sind.

- Integration von ESG-Faktoren: Amundi hat Mindeststandards für die Integration von ESG-Faktoren festgelegt, die standardmäßig auf seine aktiv verwalteten offenen Fonds angewandt werden (Ausschluss von Emittenten mit G-Rating und besserer gewichteter durchschnittlicher ESG-Score als die anwendbare Benchmark). 38 Kriterien, die im ESG-Rating-Ansatz von Amundi verwendet werden, wurden ebenfalls entwickelt, um die wichtigsten Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren zu berücksichtigen.
- Engagement: Engagement ist ein kontinuierlicher und zielgerichteter Prozess, der darauf abzielt, die Aktivitäten oder das Verhalten von Unternehmen, in die investiert wird, zu beeinflussen. Das Ziel der Engagement-Aktivitäten kann in zwei Kategorien eingeteilt werden: einen Emittenten dazu zu bewegen, die Art und Weise, wie er die ökologische und soziale Dimension integriert, zu verbessern, einen Emittenten dazu zu bewegen, seine Auswirkungen auf Umwelt-, Sozial- und Menschenrechtsfragen oder andere Nachhaltigkeitsfragen, die für die Gesellschaft und die Weltwirtschaft von Bedeutung sind, zu verbessern.
- Abstimmen: Die Abstimmungspolitik von Amundi beruht auf einer ganzheitlichen Analyse aller langfristigen Themen, die die Wertschöpfung beeinflussen können, einschließlich wesentlicher ESG-Themen. Weitere Informationen finden Sie in Amundis Abstimmungspolitik.
- Überwachung von Kontroversen: Amundi hat ein System zur Verfolgung von Kontroversen entwickelt, das sich auf drei externe Datenanbieter stützt, um Kontroversen und deren Schweregrad systematisch zu verfolgen. Dieser quantitative Ansatz wird dann durch eine eingehende Bewertung jeder schweren Kontroverse durch ESG-Analysten und die regelmäßige Überprüfung ihrer Entwicklung ergänzt. Dieser Ansatz gilt für alle Fonds von Amundi.

Informationen darüber, wie die obligatorischen Indikatoren für die wichtigsten negativen Auswirkungen verwendet werden, finden Sie in der Erklärung zur Berücksichtigung von Nachhaltigkeitsrisiken von Amundi, die unter [www.amundi.at](http://www.amundi.at) abrufbar ist.



## Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: **Von 16.02.2024 bis 31.05.2024**

| Größe Investitionen     | Sektor     | Land        | In % der Vermögenswerte |
|-------------------------|------------|-------------|-------------------------|
| LPTY 0.25% 02/26 EMTN   | Corporates | Niederlande | 0,63 %                  |
| ISPIM VAR 03/28 EMTN    | Corporates | Italien     | 0,62 %                  |
| SHBASS 3.75% 02/34      | Corporates | Schweden    | 0,61 %                  |
| UCGIM 4% 03/34 EMTN     | Corporates | Italien     | 0,61 %                  |
| MBGGR 1.125% 11/31 EMTN | Corporates | Deutschland | 0,55 %                  |
| FRLBP 3.5% 06/30 EMTN   | Corporates | Frankreich  | 0,54 %                  |
| TRNIM 3.5% 01/31 EMTN   | Corporates | Italien     | 0,54 %                  |

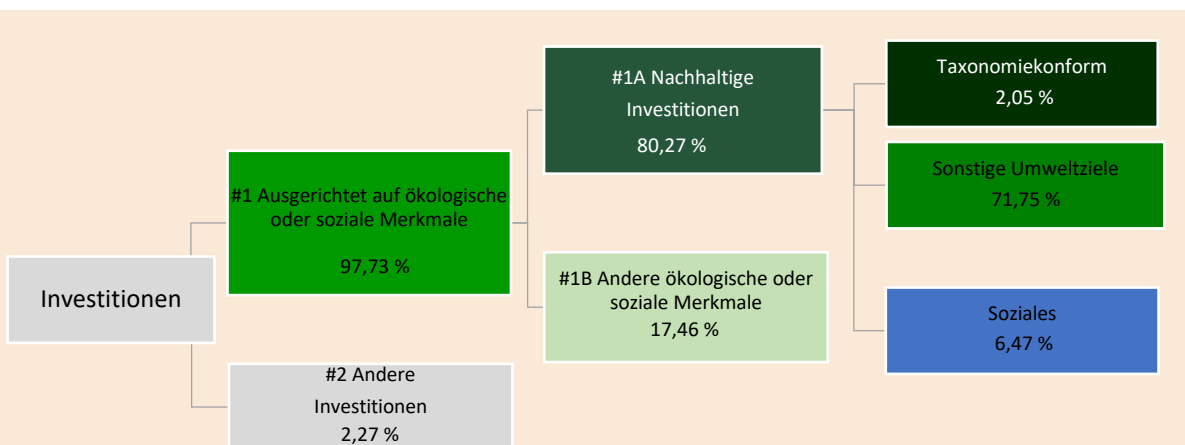
|                            |            |             |        |
|----------------------------|------------|-------------|--------|
| MUNRE VAR 05/44            | Corporates | Deutschland | 0,53 % |
| UCGIM VAR 02/29<br>EMTN    | Corporates | Italien     | 0,52 % |
| LIGHT 2.375% 05/27         | Corporates | Niederlande | 0,52 % |
| DBOERS VAR 06/47           | Corporates | Deutschland | 0,50 % |
| BNFP VAR PERP              | Corporates | Frankreich  | 0,50 % |
| ABNANV 1% 06/33            | Corporates | Niederlande | 0,50 % |
| SRBANK 3.75% 11/27<br>EMTN | Corporates | Norwegen    | 0,48 % |
| WLNFP 4.125%<br>09/28 EMTN | Corporates | Frankreich  | 0,48 % |



## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

### ● Wie sah die Vermögensallokation aus?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.



**#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

**#2 Andere Investitionen** umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.



## In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

| Sektor               | In % der Vermögenswerte |
|----------------------|-------------------------|
| <b>Anleihen</b>      | <b>99,29%</b>           |
| Staatsanleihen       | 1,56%                   |
| Staatsnahe Anleihen  | 2,84%                   |
| Unternehmensanleihen | 94,89%                  |
| <b>Bargeld</b>       | <b>0,71%</b>            |



### Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Der Fonds bewirbt sowohl ökologische als auch soziale Merkmale. Der Fonds verpflichtet sich zwar nicht, Investitionen zu tätigen, die mit der EU-Taxonomie konform sind. Auch hat der Fonds im Berichtszeitraum 2,05 % in nachhaltige Investitionen investiert, die der EU-Taxonomie entsprechen.

### ● Wird mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie<sup>1</sup> investiert?

Ja:

In fossiles Gas

In Kernenergie

Nein

Verlässliche Daten zur Angleichung an die EU-Taxonomie für fossiles Gas und Kernenergie waren im Berichtszeitraum nicht verfügbar.

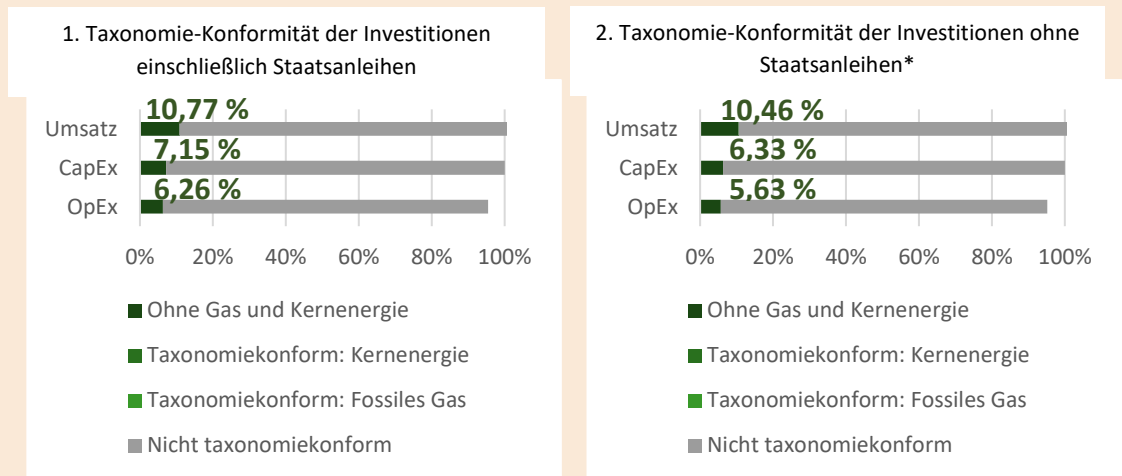
<sup>1</sup>Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels (Klimaschutz) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



\* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

**Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen..

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Zum 31.05.2024 betrug der Anteil der Investitionen des Fonds an Übergangstätigkeiten anhand von Umsatz- bzw. Ertragszahlen und/oder Daten zu grünen „Use of Proceeds“-Anleihen als Indikator 0,06 % und der Anteil der Investitionen an ermöglichenden Tätigkeiten betrug 2,61 %. Der ausgewiesene Prozentsatz der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen des Fonds wurde nicht von den Wirtschaftsprüfern des Fonds oder von Dritten geprüft.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Im vorangegangenen Zeitraum wurde ein Anteil von 9,32 % in taxonomiekonformen nachhaltigen Investments gemeldet, im heurigen Rumpfrechnungsjahr war der Anteil an taxonomiekonformen nachhaltigen Investments 2,05 %.



● **Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

Am Ende des Berichtszeitraums betrug der Anteil der nachhaltigen Investitionen mit nicht an der Taxonomie ausgerichteten Umweltzielen **71,75 %**.

Dies ist darauf zurückzuführen, dass einige Emittenten zwar als nachhaltige Investitionen im Sinne der Offenlegungsverordnung gelten (können), aber einen Teil ihrer Aktivitäten nicht mit den EU-Taxonomiestandards in Einklang bringen oder für die noch keine Daten zur Verfügung stehen, um eine EU-Taxonomiebewertung durchzuführen.

 sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für öko-logisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeit

en gemäß der  
Verordnung (EU)  
2020/852 nicht  
berücksichtigen



### Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Am Ende des Berichtszeitraums betrug der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen **6,47 %**.



### Welche Investitionen fielen unter "Andere Investitionen", welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz

Unter "#2 Andere Investitionen" wurden Barmittel und Instrumente zum Zwecke des Liquiditäts- und Portfoliorisikomanagements erfasst. Für Anleihen und Aktien ohne Rating gelten Mindeststandards für Umwelt- und Sozialschutz durch Kontroversenprüfung anhand der Grundsätze des UN Global Compact. Diese Position kann auch Wertpapiere ohne ESG-Rating enthalten, für die keine Daten für die Messung der Erreichung ökologischer oder sozialer Merkmale verfügbar waren.



### Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Nachhaltigkeitsindikatoren werden im Portfoliomanagementsystem kontinuierlich zur Verfügung gestellt, so dass die Portfoliomanager die Auswirkungen ihrer Anlageentscheidungen beurteilen können.

Diese Indikatoren sind in den Kontrollrahmen von AMUNDI eingebettet, wobei die Zuständigkeiten zwischen der ersten Kontrollebene, die von den Investitionsteams selbst durchgeführt wird, und der zweiten Kontrollebene, auf der die Einhaltung der vom Fonds geförderten ökologischen oder sozialen Merkmale laufend überwacht wird und die in den Zuständigkeitsbereich der Risikoteams fällt, aufgeteilt sind.

Darüber hinaus legen die „Grundsätze für nachhaltiges Investieren“ von AMUNDI einen aktiven Ansatz für das Engagement fest, der den Dialog mit den Unternehmen, in die investiert wird, einschließlich der Unternehmen im Portfolio dieses Produkts, fördert. Unser jährlicher Engagementbericht, der unter <https://about.amundi.com/esg-documentation> abrufbar ist, enthält eine detaillierte Berichterstattung über dieses Engagement und seine Ergebnisse.

Im abgelaufenen Rechnungsjahr wurden einige Verkäufe aufgrund einer Verschlechterung der Nachhaltigkeitsmerkmale getätigt. Bei (Zu-)Käufen achteten wir weiterhin auf die Haltung der Unternehmen in Bezug auf Klimaziele wie auch andere Nachhaltigkeitskriterien.



### Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Dieser Fonds verfügt über einen spezifischen Index, der als Referenzmaßstab dient, um festzustellen, ob dieses Finanzprodukt mit den von ihm geförderten ökologischen Merkmalen in Einklang steht.

Index: „Solactive Euro Corporate IG PAB Index“

Link: <https://www.solactive.com/indices/?index=DE000SL0AYZ1#documents>

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

Dieses Produkt hat keinen ESG-Vergleichsmaßstab.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**

Der Referenzwert ist ein regelbasierter Index, der die Performance von auf Euro lautenden Investment-Grade-Unternehmensanleihen misst. Der Index bietet ein Engagement in einem Portfolio, das auf der ESG-Klimaanalyse von ISS basiert und mit einem 1,5°C-Szenario bis 2050 im Einklang steht.

Damit ist der Referenzwert dauerhaft auf das vom Fonds beworbene CO<sub>2</sub>-Reduktionsziel ausgerichtet.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**

Die aus den Indexbestandteilen resultierende Messgröße von CO<sub>2</sub>-Intensität gilt auf Dauer als verbindlicher Referenzwert.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

Der gegenständliche Index („Solactive Euro Corporate IG PAB Index“) unterscheidet sich von einem „relevanten breiten Marktindex“ insbesondere durch folgende signifikanten Kriterien:

- Mindestens 50%ige Reduktion der Kohlenstoffemissionen (basierend auf Scope 1, 2 und 3 Emissionen) im Vergleich zum investierbaren Universum.
- Mindestens 7%ige Reduzierung der Kohlenstoffemissionen pro Jahr (basierend auf den Scope 1, 2 und 3 Emissionen).
- Verringerung der Kohlenstoffintensität um mindestens 50 % (basierend auf den Emissionen von Scope 1, 2 und 3 und den Buchwerten von Eigenkapital und Schulden) im Vergleich zum investierbaren Universum.
- Reduzierung der Kohlenstoffintensität um mindestens 7 % pro Jahr (basierend auf den Emissionen nach Scope 1, 2 und 3 und dem Buchwert des Eigen- und Fremdkapitals).