



Wien 1, Schwarzenbergplatz 3

Amundi Öko Sozial Euro Short Term Bond
Miteigentumsfonds gemäß Investmentfondsgesetz 2011 idgF (InvFG)

Rechenschaftsbericht

über das Rechnungsjahr
1. Juli 2022 bis 30. Juni 2023

Inhaltsverzeichnis

Organe der Amundi Austria GmbH	3
Angaben zur Vergütungspolitik	4
Bericht an die Anteilhaber/innen	5
Anlagestrategie	5
Kapitalmarktentwicklung	5
Übersicht über die letzten drei Rechnungsjahre des Fonds	7
Ertragsrechnung und Entwicklung des Fondsvermögens	8
1. Wertentwicklung des Rechnungsjahres (Fonds-Performance)	8
2. Fondsergebnis.....	11
3. Entwicklung des Fondsvermögens	12
Vermögensaufstellung	13
Bestätigungsvermerk	21
Berechnung des Gesamtrisikos	23
Steuerliche Behandlung	24
Fondsbestimmungen	25
Anhang Artikel 8 der Offenlegungsverordnung	30

Organe der Amundi Austria GmbH

Aufsichtsrat

Matteo GERMANO (Vorsitzender)
Domenico AIELLO (stv. Vorsitzender) (ab 21.9.2023)
Christophe LEMARIÉ (stv. Vorsitzender) (bis 31.8.2023)
Eli HANTGAN
Elodie LAUGEL
Marion MORALES ALBINANA-ROSNER
Christianus PELLIS
Mag. Karin PASEKA
Thomas GREINER
Beate SCHEIBER

Staatskommissär

Ministerialrätin Dr. Ingrid EHRENBÖCK-BÄR
Bundesministerium für Finanzen, Wien
Amtdirektor Regierungsrat Josef DORFINGER, Stv.
Bundesministerium für Finanzen, Wien

Geschäftsführung

Franck Patrick Gabriel JOCHAUD DU PLESSIX (Vorsitzender) (ab 9.1.2023)
Gabriele TAVAZZANI (Vorsitzender) (bis 8.1.2023)
Christian MATHERN (stv. Vorsitzender)
Bernhard GREIFENEDER (ab 1.10.2023)
Alois STEINBÖCK (bis 30.9.2023)
Mag. Hannes ROUBIK

Depotbank

State Street Bank International GmbH, Filiale Wien

Prüfer

Deloitte Audit Wirtschaftsprüfungs GmbH

Angaben zur Vergütungspolitik

1.

Anzahl der Mitarbeiter	153
davon Begünstigte (sonstige Risikoträger) gemäß § 20 Abs. 2 Z 5 AIFMG	36
Gesamtsumme der an die Mitarbeiter (inkl. Geschäftsführung) der VWG gezahlten Vergütungen	EUR 16.222.611,97
davon variable Vergütung	EUR 3.052.675,00

2.

Gesamtsumme der variablen Vergütungen an Risikoträger	EUR 2.171.217,00
Gesamtsumme der Vergütungen an Risikoträger	EUR 7.177.153,56
davon Vergütungen an die Geschäftsführung	EUR 1.975.752,23
davon Vergütungen an die Führungskräfte	EUR 1.743.516,46
davon Vergütungen an sonstige Risikoträger	EUR 3.057.917,23
davon Vergütungen an die Mitarbeiter mit Kontrollfunktionen	EUR 399.967,64
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 Daten der VERA-Meldung per 31.12.2022.

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 Frühjahr 2022 durchgeführt, die detaillierten Ergebnisse wurden dem Vergütungsausschuss und dem Aufsichtsrat in ihrer Sitzung am 15.12.2022 zur Kenntnis gebracht. Es gab keinerlei Unregelmäßigkeiten oder Beanstandungen.

5.

Sowohl Vergütungsausschuss als auch Aufsichtsrat haben zuletzt in ihrer Sitzung vom 15.12.2022 die Grundsätze der Vergütungspolitik überprüft. Eine neue Version der Remuneration Policy wurde am 15.12.2022 beschlossen, in der sowohl eine Anpassung an das FMA-Rundschreiben zu den §§ 17a bis 17c InvFG 2011 und § 11 AIFMG vom 3.11.2022 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 Euro Short Term Bond, Miteigentumsfonds gemäß Investmentfondsgesetz 2011 idgF (InvFG) über das Rechnungsjahr vom 1. Juli 2022 bis 30. Juni 2023 vor.

Im Zusammenhang mit den besonderen Marktbedingungen durch COVID-19 kam es im gegenständlichen Investmentfonds weder zu Problemen bei der Bewertung von Vermögensgegenständen noch zu Liquiditätsproblemen.

Anlagestrategie

Der Fonds verfolgt eine aktive Veranlagungsstrategie und orientiert sich an keinem Referenzwert. Die durchschnittliche gebundene Restlaufzeit des Amundi Öko Sozial Euro Short Term Bond wurde das gesamte Rechnungsjahr hindurch bei unter einem Jahr gehalten. Zum Rechnungsjahresende waren Unternehmensanleihen mit knapp 64 % am stärksten gewichtet, gefolgt von Staats- und staatsnahen Anleihen mit 11 % und Covered Bonds/Pfandbriefen mit 21 %. Der Bargeldbestand wurde aufgrund der erwarteten Veränderung des monetärpolitischen Umfelds über das gesamte Rechnungsjahr hindurch etwas höher gehalten. Insbesondere in Phase fortwährender Zinsanstiege half die kurze Restlaufzeit dem Fonds im abgelaufenen Rechnungsjahr, die Verluste durch die Zinsanstiege gut zu begrenzen. In Anbetracht der aufkeimenden Risiken einer Rezession erhöhten wir das Durchschnittsrating leicht um eine Stufe auf A-. Der Amundi Öko Sozial Euro Short Term Bond ist mit dem Österreichischen Umweltzeichen zertifiziert. Demnach spielten und spielen Nachhaltigkeitskriterien bei der Titelselektion eine große Rolle. Derivative Instrumente in Form von Zins- und Währungsfutures wurden zu Hedgingzwecken und zur effizienten Portfolioverwaltung eingesetzt.¹⁾

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

Der Amundi Öko Sozial Euro Short Term Bond bewirbt in Artikel 8 der Offenlegungsverordnung dargelegte ökologische und soziale Merkmale und kann teilweise in Wirtschaftstätigkeiten investieren, die zu [einem] Umweltziel[en] beitragen. Gemäß Artikel 11 der Offenlegungsverordnung hat die Verwaltungsgesellschaft zu erläutern, inwieweit die ökologischen oder sozialen Merkmale erfüllt wurden. Diese entsprechende 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 finden Sie im Anhang.

Kapitalmarktentwicklung

Das vergangene Rechnungsjahr war von einer Fortsetzung der globalen Krisenherde gekennzeichnet (Krieg Russland/Ukraine, Spannungen USA/China, Maßnahmen zur Bekämpfung der Covid-Krise, etc.), die die Politik vor große Herausforderungen stellten. Die gestiegene Inflation sorgt vor allem bei der Bevölkerung mit geringem 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. So reagierten die Notenbanken, die am Anfang zu zögerlich gewesen waren, mit massiven Zinserhöhungen auf die hohe Inflation. Im Juni 2022 erreichte die Inflation in den USA den höchsten Stand mit 9,1 %, die Fed erhöhte die Zinsen zwischen Juni 2022 und Juni 2023 von 1,75 % auf 5,25 %. Bis zum Juni 2023 fiel die US-Inflation auf 3 %, vor allem aufgrund der Normalisierung der Rohstoffpreise, die vorher einen zusätzlichen Schub durch den Russland/Ukraine-Krieg erhalten hatten. Anders als in den USA erreichte die Inflation in der Eurozone ihren Höchststand erst im Oktober 2022 (+10,6 %) und lag auch nach dem Rückgang auf 5,5 % im Juni 2023 deutlich über dem Wert der USA. In Großbritannien stieg die Inflation bis zum Oktober 2022 sogar auf 11,1 % und lag im Juni 2023 immer noch bei 8,7 %. Hier kommen auch noch die Nachwirkungen des Brexit als preissteigernder Faktor dazu. Entlastend wirkte weltweit vor allem der Rückgang der Energiepreise. So fiel der Ölpreis (Sorte Brent) von Juni 2022 bis Juni 2023 von 109,7 Dollar auf 69,3 Dollar. In den USA blieb das Wirtschaftswachstum überraschend stabil, während in der Eurozone das vierte

Quartal 2022 und das erste Quartal 2023 einen leichten Rückgang von jeweils 0,1 % gegenüber dem Vorquartal mit sich brachten. In den USA wird seit mehreren Monaten vor einer Rezession gewarnt, da die Zinsstrukturkurve extrem negativ ist und dies in der Vergangenheit ein sehr zuverlässiger Indikator für eine bevorstehende Rezession war. Zusätzlich weist eine Reihe von Früh- und Stimmungsindikatoren auf eine Abschwächung der Wirtschaft hin. Aufgrund der niedrigen Arbeitslosenrate in den USA (nach wie vor werden mehr offene Stellen angeboten als Jobs gesucht werden) blieben die Konsumausgaben stabil, die Schwäche kommt vor allem aus dem produzierenden Gewerbe und von den Investitionen, während der Dienstleistungssektor noch keine Zeichen von Schwäche zeigt. Die Staatsanleihenmärkte der USA und der Eurozone reagierten auf die Zinssteigerungen der Notenbanken mit deutlichen Kursverlusten im zweiten Halbjahr 2022. Im ersten Halbjahr 2023 konnte nur ein Teil der Verluste wettgemacht werden. 2023 wurden die Rentenmärkte vor allem von der Frage bestimmt, wann das Ende des Zinserhöhungszyklus der Notenbanken erreicht wird (die sogenannte Terminal Rate) und ob die Notenbankzinsen aufgrund einer im zweiten Halbjahr 2023 möglichen Rezession in den USA bereits im Laufe des Jahres 2023 oder 2024 gesenkt werden könnten. Die kurzfristigen Zinsen reagierten stärker auf die Zinserhöhungen der Notenbanken, die Renditen 2-jähriger Treasuries stiegen auf bis zu 5,08 % im Februar 2023, die Zinsen 2-jähriger deutscher Bundesanleihen auf bis zu 3,38 %. 10-jährige US Treasury Renditen erreichten ihren Höchststand von 4,33 % bereits im Oktober 2022 und bewegten sich anschließend in einer Bandbreite zwischen 3,25 % und 4 %. Die Renditen 10-jähriger deutscher Bundesanleihen stiegen ab Anfang August 2022 von 0,8 % bis auf 2,75 % im März 2023 und bewegten sich dann in einer Bandbreite zwischen ca. 2 % bis 2,5 %. Euro-Unternehmensanleihen mit Investment Grade-Rating konnten Euro-Staatsanleihen von Mitte 2022 bis Mitte 2023 um fast 5 % outperformen, da der Unternehmensanleihenmarkt über eine deutlich kürzere Restlaufzeit verfügt als Staatsanleihen und damit weniger stark auf die steigenden Zinsen reagierte. Die Risikoaufschläge von Unternehmensanleihen mit Investment Grade-Rating engten sich um ca. 40 Basispunkte ein. High Yield-Anleihen konnten deutlich outperformen, da sie von der relativ stabilen Wirtschaft und geringen Ausfallraten profitierten. Globale Schwellenländeranleihen haben sich im Durchschnitt deutlich besser entwickelt als die Staatsanleihen der Industrieländer. Die Aktienmärkte haben im Rechnungsjahr positiv überrascht. 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 US-Aktienmarkt vollzog nach dem Tief im Oktober 2022 eine in dieser Dimension unerwartete Rallye, der Markt stieg von seinen Tiefständen um mehr als 25 %. Im März 2023 musste der US-Aktienmarkt den Kollaps der Silicon Valley Bank (sie wurde von der US-Bundeseinlagenversicherungsgesellschaft FDIC unter Zwangsverwaltung gestellt), eine Ausweitung der Krise auf die Signature Bank und die First Republic Bank sowie indirekt auch das Scheitern der Credit Suisse (die von UBS übernommen werden musste) verkraften. Die US-Notenbank Federal Reserve richtete ein Bank Term Funding Program (BTFP) ein, um qualifizierten Einlageninstituten Darlehen mit einer Laufzeit von bis zu einem Jahr zu gewähren, wenn sie qualifizierte Vermögenswerte als Sicherheiten hinterlegen. Um zu verhindern, dass noch mehr Banken von der Situation betroffen werden, griffen die globalen Regulierungsbehörden, darunter die Federal Reserve, die Bank of Canada, die Bank of England, die Bank of Japan, die Europäische Zentralbank und die Schweizerische Nationalbank ein, um außerordentliche Liquidität bereitzustellen. 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 50 größten Unternehmen des Standard & Poor's 500 Index haben den gesamten Standard & Poor's 500 Index um mehr als 10 % übertroffen. Der japanische Aktienmarkt profitierte neben dem schwachen Yen unter anderem davon, dass die Unternehmen verstärkt Reformen zur besseren Vergütung der Aktionäre umsetzen. Da die Wiederöffnung Japans nach der Covid-19-Pandemie relativ spät erfolgte, wurde mit einem überdurchschnittlichen Wachstum der Unternehmensgewinne gerechnet, die Bewertungen sind insgesamt attraktiv. Emerging Markets Aktien blieben aufgrund der hohen Gewichtung des chinesischen Aktienmarktes, der vor allem unter den langen Lockdowns und der schwachen Entwicklung des Immobilienmarktes litt, deutlich zurück. Der US-Dollar fiel gegenüber dem Euro, der japanische Yen fiel auch gegenüber dem US-Dollar und damit noch stärker gegenüber dem Euro.²⁾

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

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

Übersicht über die letzten drei Rechnungsjahre des Fonds

Fondsvermögen in EUR, Angaben zu den Tranchen in Tranchenwährung

Rechnungsjahresende	30.06.2023	30.06.2022	30.06.2021
Fondsvermögen in 1.000	99.025	103.371	97.953
Ausschüttungsanteile AT0000A05TJ5 in EUR			
Rechenwert je Anteil	97,67	97,07	100,38
Anzahl der ausgegebenen Anteile	172.684	194.632	257.057
Ausschüttung je Anteil	0,50	0,10	0,10
Wertentwicklung in %	+0,72	-3,20	+0,40
Thesaurierungsanteile mit KEST-Abzug AT0000A05TK3 in EUR			
Rechenwert je Anteil	114,78	113,97	117,74
Anzahl der ausgegebenen Anteile	709.772	734.829	605.296
zur Thesaurierung verwendeter Ertrag	0,73	0,47	-0,34
Auszahlung gem. § 58 Abs 2 InvFG	0,00	0,00	0,00
Wertentwicklung in %	+0,71	-3,20	+0,40
Thesaurierungsanteile mit KEST-Abzug AT0000A2Z7M3 ab 11.08.2022 in EUR			
Rechenwert je Anteil	100,06		
Anzahl der ausgegebenen Anteile	220		
zur Thesaurierung verwendeter Ertrag	0,48		
Auszahlung gem. § 58 Abs 2 InvFG	0,1815		
Wertentwicklung in %	+0,06		
Thesaurierungsanteile mit KEST-Abzug AT0000A2Z7N1 ab 11.08.2022 in EUR			
Rechenwert je Anteil	100,08		
Anzahl der ausgegebenen Anteile	20		
zur Thesaurierung verwendeter Ertrag	0,50		
Auszahlung gem. § 58 Abs 2 InvFG	0,1899		
Wertentwicklung in %	+0,08		
Thesaurierungsanteile mit KEST-Abzug AT0000A2Z7P6 ab 11.08.2022 in EUR			
Rechenwert je Anteil	100,08		
Anzahl der ausgegebenen Anteile	20		
zur Thesaurierung verwendeter Ertrag	0,50		
Auszahlung gem. § 58 Abs 2 InvFG	0,1899		
Wertentwicklung in %	+0,08		
Thesaurierungsanteile mit KEST-Abzug AT0000A2Z7Q4 ab 11.08.2022 in EUR			
Rechenwert je Anteil	100,08		
Anzahl der ausgegebenen Anteile	20		
zur Thesaurierung verwendeter Ertrag	0,50		
Auszahlung gem. § 58 Abs 2 InvFG	0,1899		
Wertentwicklung in %	+0,08		
Thesaurierungsanteile ohne KEST-Abzug (Inlandstranche) AT0000A28LM8 in EUR			
Rechenwert je Anteil	62,16	61,72	63,76
Anzahl der ausgegebenen Anteile	5.067	5.321	7.030
zur Thesaurierung verwendeter Ertrag	0,40	0,26	-0,18
Wertentwicklung in %	+0,71	-3,20	+0,39
Thesaurierungsanteile ohne KEST-Abzug (Inlandstranche) AT0000A28LL0 in EUR			
Rechenwert je Anteil	62,17	61,73	63,77
Anzahl der ausgegebenen Anteile	5.564	6.458	6.724
zur Thesaurierung verwendeter Ertrag	0,40	0,26	-0,18
Wertentwicklung in %	+0,71	-3,20	+0,41

Ertragsrechnung und Entwicklung des Fondsvermögens

1. Wertentwicklung des Rechnungsjahres (Fonds-Performance)

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

Ausschüttungsanteile AT0000A05TJ5	in EUR
Rechenwert am Beginn des Rechnungsjahres	97,07
Ausschüttung am 15.09.2022 (Rechenwert: 96,78) von 0,10 entspricht 0,0010 Anteilen	0,10
Rechenwert am Ende des Rechnungsjahres	97,67
Gesamtwert inkl. (fiktiv) mit dem Ausschüttungsbetrag erworbene Anteile (1,0010 * 97,67)	97,77
Nettoertrag pro Anteil (97,77 - 97,07)	0,70
Wertentwicklung eines Anteiles im Rechnungsjahr in %	+0,72

Thesaurierungsanteile mit KEST-Abzug AT0000A05TK3	in EUR
Rechenwert am Beginn des Rechnungsjahres	113,97
Rechenwert am Ende des Rechnungsjahres	114,78
Nettoertrag pro Anteil (114,78 - 113,97)	0,81
Wertentwicklung eines Anteiles im Rechnungsjahr in %	+0,71

Thesaurierungsanteile mit KEST-Abzug AT0000A2Z7M3 ab 11.08.2022	in EUR
Rechenwert am Beginn des Rechnungsjahres	100,00
Rechenwert am Ende des Rechnungsjahres	100,06
Nettoertrag pro Anteil (100,06 - 100,00)	0,06
Wertentwicklung eines Anteiles im Rechnungsjahr in %	+0,06

Thesaurierungsanteile mit KEST-Abzug AT0000A2Z7N1 ab 11.08.2022	in EUR
Rechenwert am Beginn des Rechnungsjahres	100,00
Rechenwert am Ende des Rechnungsjahres	100,08
Nettoertrag pro Anteil (100,08 - 100,00)	0,08
Wertentwicklung eines Anteiles im Rechnungsjahr in %	+0,08

Thesaurierungsanteile mit KEST-Abzug AT0000A2Z7P6 ab 11.08.2022	in EUR
Rechenwert am Beginn des Rechnungsjahres	100,00
Rechenwert am Ende des Rechnungsjahres	100,08
Nettoertrag pro Anteil (100,08 - 100,00)	0,08
Wertentwicklung eines Anteiles im Rechnungsjahr in %	+0,08

Thesaurierungsanteile mit KEST-Abzug AT0000A2Z7Q4 ab 11.08.2022	in EUR
Rechenwert am Beginn des Rechnungsjahres	100,00
Rechenwert am Ende des Rechnungsjahres	100,08
Nettoertrag pro Anteil (100,08 - 100,00)	0,08
Wertentwicklung eines Anteiles im Rechnungsjahr in %	+0,08

Thesaurierungsanteile ohne KESt-Abzug (Inlandstranche) AT0000A28LM8	in EUR
Rechenwert am Beginn des Rechnungsjahres	61,72
Rechenwert am Ende des Rechnungsjahres	62,16
Nettoertrag pro Anteil (62,16 - 61,72)	0,44
Wertentwicklung eines Anteiles im Rechnungsjahr in %	+0,71

Thesaurierungsanteile ohne KESt-Abzug (Inlandstranche) AT0000A28LL0	in EUR
Rechenwert am Beginn des Rechnungsjahres	61,73
Rechenwert am Ende des Rechnungsjahres	62,17
Nettoertrag pro Anteil (62,17 - 61,73)	0,44
Wertentwicklung eines Anteiles im Rechnungsjahr in %	+0,71

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 - AT0000A05TJ5

Die Ausschüttung von EUR 0,5000 je Anteil wird ab 15.09.2023 von den depotführenden Banken vorgenommen.

Die kuponanzahlende 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 - AT0000A05TK3

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

Auszahlung für Thesaurierungsanteile mit KEST-Abzug (VM) - AT0000A2Z7M3

Die Auszahlung der Kapitalertragsteuer in der Höhe von EUR 0,1815 je Thesaurierungsanteil mit KEST-Abzug wird ab 15.09.2023 von den depotführenden Banken vorgenommen, sofern keine Befreiungsgründe vorliegen.

Auszahlung für Thesaurierungsanteile mit KEST-Abzug (VM1) - AT0000A2Z7N1

Die Auszahlung der Kapitalertragsteuer in der Höhe von EUR 0,1899 je Thesaurierungsanteil mit KEST-Abzug wird ab 15.09.2023 von den depotführenden Banken vorgenommen, sofern keine Befreiungsgründe vorliegen.

Auszahlung für Thesaurierungsanteile mit KEST-Abzug (VM2) - AT0000A2Z7P6

Die Auszahlung der Kapitalertragsteuer in der Höhe von EUR 0,1899 je Thesaurierungsanteil mit KEST-Abzug wird ab 15.09.2023 von den depotführenden Banken vorgenommen, sofern keine Befreiungsgründe vorliegen.

Auszahlung für Thesaurierungsanteile mit KEST-Abzug (VM3) - AT0000A2Z7Q4

Die Auszahlung der Kapitalertragsteuer in der Höhe von EUR 0,1899 je Thesaurierungsanteil mit KEST-Abzug wird ab 15.09.2023 von den depotführenden Banken vorgenommen, sofern keine Befreiungsgründe vorliegen.

Auszahlung für Thesaurierungsanteile ohne KEST-Abzug (Inlandstranche) - AT0000A28LM8

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) - AT0000A28LL0

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)

Zinserträge	1.448.181,17	
Dividenderträge	0,00	
Erträge aus Subfonds	0,00	
sonstige Erträge	0,00	
Zinsaufwendungen (inkl. negativer Habenzinsen)	-32.384,68	1.415.796,49

Aufwendungen

Vergütung an die Verwaltungsgesellschaft	-314.887,54	
Abzügl. Verwaltungskostenrückvergütung aus Subfonds ¹⁾	0,00	
Performancegebühren	0,00	
Kosten für Wirtschaftsprüfer und Steuerberatung	-7.985,98	
Publizitätskosten und Aufsichtskosten	-1.718,26	
Garantiegebühren	0,00	
Kosten für die Depotbank	-107.312,22	
Kosten für Dienste externer Berater	0,00	
Lizenzkosten, Kosten für externe Ratings	-7.647,76	
Sonstige Kosten	0,00	-439.551,76

Ordentliches Fondsergebnis (exkl. Ertragsausgleich) 976.244,73

Realisiertes Kursergebnis (exkl. Ertragsausgleich) ^{2) 3)}

Realisierte Gewinne aus Wertpapieren	160.980,61	
Gewinne aus derivativen Instrumenten	998.805,55	
Realisierte Verluste aus Wertpapieren	-1.021.032,63	
Verluste aus derivativen Instrumenten	-403.602,45	-264.848,92

Realisiertes Fondsergebnis (exkl. Ertragsausgleich) 711.395,81

b. Nicht realisiertes Kursergebnis ^{2) 3)}

Veränderung des nicht realisierten Kursergebnisses		45.732,78
--	--	-----------

Ergebnis des Rechnungsjahres ⁴⁾ 757.128,59

c. Ertragsausgleich

Ertragsausgleich des Rechnungsjahres		-81.135,99
--------------------------------------	--	------------

Fondsergebnis gesamt 675.992,60

3. Entwicklung des Fondsvermögens

Fondsvermögen am Beginn des Rechnungsjahres ⁵⁾	103.371.321,15
Ausschüttungsanteile AT0000A05TJ5	
Ausschüttung (für Ausschüttungsanteile) am 15.09.2022	-18.994,06
Ausgabe und Rücknahme von Anteilen	
Ausgabe von Anteilen	28.491.413,75
Rücknahme von Anteilen	-33.575.651,58
Anteiliger Ertragsausgleich	81.135,99 -5.003.101,84
Fondsergebnis gesamt (das Fondsergebnis ist im Detail auf der vorhergehenden Seite dargestellt)	675.992,60
Fondsvermögen am Ende des Rechnungsjahres ⁶⁾	99.025.217,85

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 Rechnungsjahr.
- 3) Kursergebnis gesamt, ohne Ertragsausgleich (realisiertes Kursergebnis ohne Ertragsausgleich, zuzüglich Veränderungen des nicht realisierten Kursergebnisses): EUR -219.116,14
- 4) Das Ergebnis des Rechnungsjahres beinhaltet explizit ausgewiesene Transaktionskosten in Höhe von EUR 6.033,39
- 5) Anteilsumlauf zu Beginn des Rechnungsjahres: 194.632 Ausschüttungsanteile, 734.829 Thesaurierungsanteile mit KEST-Abzug, 0 Thesaurierungsanteile mit KEST-Abzug (VM), 0 Thesaurierungsanteile mit KEST-Abzug (VM1), 0 Thesaurierungsanteile mit KEST-Abzug (VM2), 0 Thesaurierungsanteile mit KEST-Abzug (VM3), 5.321 Thesaurierungsanteile ohne KEST-Abzug (VTI), 6.458 Thesaurierungsanteile ohne KEST-Abzug (VTA).
- 6) Anteilsumlauf am Ende des Rechnungsjahres: 172.684 Ausschüttungsanteile, 709.772 Thesaurierungsanteile mit KEST-Abzug, 220 Thesaurierungsanteile mit KEST-Abzug (VM), 20 Thesaurierungsanteile mit KEST-Abzug (VM1), 20 Thesaurierungsanteile mit KEST-Abzug (VM2), 20 Thesaurierungsanteile mit KEST-Abzug (VM3), 5.067 Thesaurierungsanteile ohne KEST-Abzug (VTI), 5.564 Thesaurierungsanteile ohne KEST-Abzug (VTA).

Vermögensaufstellung

ISIN	Wertpapier-Bezeichnung	Zinssatz	Käufe / Zugänge Stück / Nominale	Verkäufe / Abgänge (Nom. in 1.000, ger.)	Bestand	Kurs in Wertpapierwährung	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fondsvermögen
------	------------------------	----------	-------------------------------------	---	---------	---------------------------	-----------------	---------------------------

ZUM AMTLICHEN HANDEL ODER EINEM ANDEREN GEREGELTEN MARKT ZUGELASSENE WERTPAPIERE

ANLEIHEN auf AMERIKANISCHE DOLLAR lautend

US06675GAW50	BFCM 21/25 FLR MTN	5,105	0	0	600	99,2850	546.022,00	0,55
US21688AAQ58	CO. RABOBK 21/24 MTN	0,375	0	0	260	97,2110	231.666,91	0,23
US78016EZY66	ROYAL BK CDA 21/24FLR MTN	5,049	0	0	300	99,5640	273.778,19	0,28
Summe							1.051.467,10	1,06

ANLEIHEN auf EURO lautend

XS2456253082	A.N.Z. BKG GRP 22/25 MTN	0,250	500	0	500	94,0020	470.010,00	0,47
XS2082818951	A.N.Z.BKG.GR 19/29 FLR	1,125	0	0	500	93,8290	469.145,00	0,47
XS2555209035	A.N.Z.BKG.GR 22/24 MTN	3,205	800	0	800	99,0010	792.008,00	0,80
ES0365936048	ABANCA 23/26 FLR MTN	5,500	300	0	300	99,4540	298.362,00	0,30
XS2463975628	ABB FIN. 22/24 FLR	4,298	0	0	600	100,3660	602.196,00	0,61
XS2575555938	ABB FIN. 23/27 MTN	3,250	160	0	160	98,4570	157.531,20	0,16
XS2573331837	ABN AMRO BK 23/25 FLR	3,405	300	0	300	100,1180	300.354,00	0,30
XS2610209129	ACCIONA ENE. 23/30 MTN	3,750	200	0	200	98,2280	196.456,00	0,20
XS2560411543	ACHMEA 22/25 MTN	3,625	400	0	400	98,7680	395.072,00	0,40
XS2224621347	ADIDAS AG ANL 20/24	0,000	0	0	200	95,5660	191.132,00	0,19
XS2003442436	AIB GP. 19/24 MTN	1,250	0	0	130	97,3920	126.609,60	0,13
XS1717433541	AKELIUS RES. 17/24 MTN	1,125	0	0	300	97,0860	291.258,00	0,29
XS2029574634	ALD 19/23 MTN	0,375	0	0	400	99,8750	399.500,00	0,40
XS2306220190	ALD 21/24 MTN	0,000	0	0	100	97,4240	97.424,00	0,10
FR001400D7M0	ALD 22/25 MTN	4,750	500	0	500	100,8500	504.250,00	0,51
XS2017324844	ALFA LA.TR. 19/24 MTN	0,250	0	0	300	95,9940	287.982,00	0,29
DE000A3KY367	ALL.FIN.II 21/24 MTN FLR	4,383	0	0	200	100,9810	201.962,00	0,20
BE6338543786	ARGE.SPAARB. 22/26 MTN	3,250	400	0	400	98,6250	394.500,00	0,40
BE6339428904	ARGE.SPAARB. 22/27 FLRMTN	5,375	300	0	300	99,6040	298.812,00	0,30
FR001400EEX5	ARKEA H.LOAN 22/26 MTN	2,750	500	0	500	97,1700	485.850,00	0,49
XS2287744721	AROUNDTOWN 21/UND FLR	1,625	0	0	300	30,7780	92.334,00	0,09
FR0014005OL1	ARVAL SERV.L 21/25 MTN	0,000	0	0	400	90,4260	361.704,00	0,37
FR001400I9F5	ARVAL SERV.L 23/24 MTN	4,625	500	0	500	100,4200	502.100,00	0,51
XS1962595895	ASB BK 19/24 MTN	0,750	0	0	160	97,5700	156.112,00	0,16
XS1907118464	AT + T 2023 FLR	4,312	0	0	950	100,1160	951.102,00	0,96
XS2590758400	AT + T 23/25	3,550	560	0	560	98,8210	553.397,60	0,56
XS2595361978	AT + T 23/25 FLR	3,890	500	0	500	100,1470	500.735,00	0,51
FR0013378452	ATOS 18-25	1,750	0	0	500	84,8610	424.305,00	0,43
XS2308313860	AUSNET SVCS 21/81 FLR	1,625	0	0	200	85,3790	170.758,00	0,17
IT0005170839	B.T.P. 16-26	1,600	500	0	500	94,1750	470.875,00	0,48
XS1968814332	BAWAG GP. 19/29 FLR MTN	2,375	0	0	400	92,5690	370.276,00	0,37
XS2356569736	BAY.LDSBK.21/31 MTN	1,000	0	0	400	81,9450	327.780,00	0,33
XS2104051433	BBVA 20/30 FLR MTN	1,000	0	0	400	92,6330	370.532,00	0,37
XS2384578824	BBVA 21/23 FLR MTN	4,459	0	0	200	100,1410	200.282,00	0,20
XS1956973967	BBVA SA 19/24 MTN	1,125	0	0	100	98,1790	98.179,00	0,10
ES0413860554	BCO DE SABADELL 16-23	0,125	0	0	200	98,9490	197.898,00	0,20
ES0413860836	BCO SABADELL 23/26	3,500	300	0	300	99,1570	297.471,00	0,30
XS2598331242	BCO SABADELL 23/29 FLR	5,000	400	0	400	99,8440	399.376,00	0,40
XS2014287937	BCO SANTAND. 19/24 MTN	0,250	0	0	300	96,3940	289.182,00	0,29
XS2476266205	BCO SANTAND. 22/24FLR MTN	4,275	0	0	400	100,5960	402.384,00	0,41
XS2575952341	BCO SANTAND. 23/25 FLR	3,727	500	0	500	100,2140	501.070,00	0,51
ES0413900905	BCO SANTAND. 23/26	3,375	700	0	700	98,8330	691.831,00	0,70
FR0013432770	BFCM 19/24 MTN	0,125	0	0	200	97,7370	195.474,00	0,20
FR0014006XE5	BFCM 21/25 MTN	0,010	0	0	400	93,1250	372.500,00	0,38
FR0014009A50	BFCM 22/25 MTN	1,000	0	0	400	94,2020	376.808,00	0,38
XS2632933631	BK MONTREAL 23/25 FLR MTN	3,940	300	0	300	100,1250	300.375,00	0,30
XS2607350985	BK MONTREAL 23/26 MTN	3,375	500	0	500	98,6190	493.095,00	0,50
XS2550897651	BK NOVA SCOT 22/24 MTN	3,050	1.000	0	1.000	98,8340	988.340,00	1,00
XS2618508340	BK NOVA SCOT 23/25 FLRMTN	3,704	600	0	600	100,1190	600.714,00	0,61
XS2240469523	BMW FIN. 20/23 FLR MTN	3,652	0	0	500	100,1460	500.730,00	0,51
FR0013434776	BNP PARIBAS 19/25 FLR MTN	0,500	0	0	400	95,9910	383.964,00	0,39
XS1639238820	BNZ INTERNAT.FDG 17/24MTN	0,500	100	0	100	96,5350	96.535,00	0,10
FR0013429073	BPCE 19/24 MTN	0,625	0	0	100	95,6670	95.667,00	0,10
FR0014009YD9	BPCE 22/27 MTN	1,750	0	0	400	91,6660	366.664,00	0,37
FR001400HAC0	BPCE 23/26 MTN	3,625	300	0	300	98,4350	295.305,00	0,30

ISIN	Wertpapier-Bezeichnung	Zinssatz	Käufe / Zugänge Stück / Nominale	Verkäufe / Abgänge (Nom. in 1.000, ger.)	Bestand	Kurs in Wertpapierwährung	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fondsvermögen
XS2015267953	BQ.STELL.FR. 19/24 MTN	0,625	200	0	300	96,6280	289.884,00	0,29
FR0014001JP1	BQ.STELL.FR. 21/25 MTN	0,000	300	0	400	93,6380	374.552,00	0,38
IT0005185456	C.C.T. 16-23 FLR	3,518	0	0	1.000	99,9940	999.940,00	1,01
XS2332254015	CA A.B(I.BR) 21/24 MTN	0,000	0	0	100	96,7900	96.790,00	0,10
XS2549047244	CA A.B(I.BR) 22/24 MTN	4,250	600	0	600	100,0390	600.234,00	0,61
FR0013344181	CADES 18/23 MTN	0,125	300	0	600	98,9230	593.538,00	0,60
FR0013396355	CAISS.FRANC. 19/25 MTN	0,500	500	0	500	94,9670	474.835,00	0,48
XS1951220596	CAIXABK 19/29 FLR MTN	3,750	0	0	400	98,5850	394.340,00	0,40
ES0313307219	CAIXABK S.A. 19/24	1,000	0	0	100	96,8090	96.809,00	0,10
FR0013519048	CAPGEMINI 20/25	0,625	0	0	200	93,9520	187.904,00	0,19
FR0014009DZ6	CARREF. 22/26 MTN	1,875	0	0	200	93,5200	187.040,00	0,19
XS2461785185	CASTEL.H.FI. 22/25 MTN	2,000	0	0	210	91,8980	192.985,80	0,19
XS2300292617	CELLNEX FIN. 21/26 MTN	0,750	0	0	100	88,4310	88.431,00	0,09
XS2555412001	GESKA SPORIT 22/25 FLRMTN	6,693	400	0	400	101,3090	405.236,00	0,41
XS2634071489	CIBC 23/25 FLR MTN	3,959	400	0	400	100,0330	400.132,00	0,40
XS2264980363	CNH INDUSTR. 20/24 MTN	0,000	0	0	200	97,0060	194.012,00	0,20
XS1956955980	CO. RABOBK 19/24 MTN	0,625	0	0	200	97,8680	195.736,00	0,20
DE000CZ40M21	COBA 18/23 S.903	0,500	0	0	900	99,5270	895.743,00	0,90
DE000CZ40N04	COBA 19/24 S.928	0,625	0	0	320	96,1840	307.788,80	0,31
DE000CZ45WP5	COBA FIX-RESET 21/31 SUB.	1,375	0	0	400	82,5820	330.328,00	0,33
DE000CZ40LD5	COBA T2 NACHRANG 16/26	4,000	0	0	100	97,0810	97.081,00	0,10
XS2051667181	CONTINENTAL MTN19/23REG.S	0,000	0	0	510	99,2330	506.088,30	0,51
FR00140007B4	CR.MUT.ARKEA 20/26 MTN	0,010	0	0	300	90,0830	270.249,00	0,27
XS2016807864	CREDIT AGR. 19/24 MTN	0,500	0	0	300	96,7150	290.145,00	0,29
FR0013516184	CREDIT AGR. 20/30 MTNFLR	1,625	0	0	400	92,6860	370.744,00	0,37
FR00140098S7	CREDIT AGR. 22/25 MTN	1,000	0	0	200	93,8720	187.744,00	0,19
FR001400E7J5	CREDIT AGR. 22/27 MTN	3,375	500	0	500	97,5180	487.590,00	0,49
FR001400GDG7	CREDIT AGR. 23/25 FLRMTN	3,813	500	0	500	100,0420	500.210,00	0,51
FR001400G5S8	CREDIT AGR. 23/26 MTN	3,250	400	0	400	99,0440	396.176,00	0,40
XS1328173080	CRH FUNDING 15/24 MTN	1,875	0	0	800	98,9190	791.352,00	0,80
FR0013426426	CSSE DEP.CON 19/24 MTN	0,000	0	0	300	96,4150	289.245,00	0,29
FR0013534443	CSSE DEP.CON 20/25 MTN	0,010	0	0	100	92,4890	92.489,00	0,09
XS2332689418	DANFOSS F.I 21/26 MTN	0,125	0	0	200	89,1200	178.240,00	0,18
FR0014005EJ6	DANONE 21/UND. FLR MTN	1,000	0	0	200	87,2210	174.442,00	0,18
XS2466171985	DMLR TR.I.FI 22/23 MTNFLR	3,752	0	0	400	100,1190	400.476,00	0,40
XS1652512457	DS SMITH 17/24 MTN	1,375	0	0	200	96,6850	193.370,00	0,20
XS2010039035	DT. BAHN FIN. 19/UNBEFR.	0,950	0	0	400	91,7810	367.124,00	0,37
DE000A3E5K73	DT.PFBR.BK PF.R.15304	0,010	0	0	200	89,4980	178.996,00	0,18
DE000A3MQUY1	DZ HYP PF.R.1253 MTN	3,000	400	0	400	98,5170	394.068,00	0,40
EU000A2SCAD0	EFSF 22/25 MTN	1,500	400	0	400	95,5700	382.280,00	0,39
XS2540585564	ELECTROLUX 22/26 MTN	4,125	400	0	400	100,3530	401.412,00	0,41
FR0013399060	ELO S.A. 19/24 MTN	2,625	0	0	100	98,9410	98.941,00	0,10
XS1982725159	ERSTE GR.BK. 19/24 MTN	0,375	0	0	200	97,1440	194.288,00	0,20
XS2083210729	ERSTE GR.BK. 19/30 MTN	1,000	0	0	400	90,5000	362.000,00	0,37
AT0000A2JAF6	ERSTE GR.BK. 20/25 MTN	0,050	0	0	100	91,6820	91.682,00	0,09
AT0000A2VVQ2	ERSTE GR.BK. 22/26 MTN	1,500	0	0	400	93,6660	374.664,00	0,38
AT0000A33MP9	ERSTE GR.BK. 23/27 MTN	3,125	700	0	700	98,3760	688.632,00	0,70
XS2615183501	EUROGRID GMBH MTN.23/30	3,722	300	0	300	99,1410	297.423,00	0,30
DK0030485271	EURONEXT 21/26	0,125	0	0	200	89,9520	179.904,00	0,18
XS2397372850	EX.IMP.BK.K. 21/24 MTN	0,000	300	0	600	94,9110	569.466,00	0,58
XS2484106716	EX.IMP.BK.K. 22/25 MTN	1,375	0	0	500	94,6790	473.395,00	0,48
XS1943456829	FEDERAT.CAIS 19/24 MTN	0,350	800	0	800	98,0790	784.632,00	0,79
XS2560673662	FEDERAT.CAIS 22/24 MTN	2,875	800	0	800	98,3970	787.176,00	0,79
XS1485748393	GM FINANCIAL 16/23 MTN	0,955	0	0	500	99,4630	497.315,00	0,50
XS2462324745	HALEON NL C. 22/26 MTN	1,250	300	0	530	92,9040	492.391,20	0,50
DE000HCB0A86	HCOB IS 21/26	0,500	0	0	300	83,0730	249.219,00	0,25
XS1958655745	HEIMST.BOST. 19/23 MTN	2,125	0	0	100	98,4110	98.411,00	0,10
XS2430702873	HEIMSTADEN 22/24 FLR MTN	3,769	0	0	160	95,4440	152.710,40	0,15
XS2595829388	HSBC BK 23/25 FLR MTN	3,876	400	0	400	100,2260	400.904,00	0,40
XS2251736646	HSBC HLDGS 20/26 FLR MTN	0,309	0	0	400	90,5160	362.064,00	0,37
XS2597113989	HSBC HLDGS 23/28 FLR MTN	4,752	400	0	400	100,0550	400.220,00	0,40
AT0000A2XG57	HYPONOE LB 22/25	1,375	0	0	600	94,4890	566.934,00	0,57
XS2583741934	IBM 23/27	3,375	500	0	500	98,5060	492.530,00	0,50
XS1843435253	ILL.TOOL WOR 19/24	0,250	0	0	400	94,8350	379.340,00	0,38
XS2557551889	ING BK 22/25 MTN	2,750	500	0	500	97,8260	489.130,00	0,49
XS1689540935	ING GROEP 17/29 FLR MTN	1,625	0	0	400	94,5630	378.252,00	0,38
XS1882544205	ING GROEP 18/23 MTN FLR	4,422	0	0	300	100,1370	300.411,00	0,30
XS1509942923	INMOBIL.COL.SOC.16/24 MTN	1,450	0	0	300	96,0930	288.279,00	0,29
IT0004992787	INTESA SAN. 14/26 MTN	3,250	800	0	800	98,2550	786.040,00	0,79

ISIN	Wertpapier-Bezeichnung	Zinssatz	Käufe / Zugänge Stück /	Verkäufe / Abgänge Nominale (Nom. in 1.000, ger.)	Bestand	Kurs in Wertpapierwährung	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fondsvermögen
XS2022425297	INTESA SAN. 19/24 MTN	1,000	0	0	400	96,8810	387.524,00	0,39
XS2089368596	INTESA SANP. 19/24 MTN	0,750	300	0	440	95,1390	418.611,60	0,42
XS2597970800	INTESA SANP. 23/25FLR MTN	4,177	500	0	500	100,0310	500.155,00	0,51
XS1979446843	INTESA SANP.19/24 MTN	1,500	0	0	150	98,0420	147.063,00	0,15
XS2592650373	INTESA SANP.23/28 FLR MTN	5,000	450	0	450	99,9490	449.770,50	0,45
IT0005424251	ITALIEN 20/24	0,000	0	0	5.000	98,0360	4.901.800,00	4,95
FR0013509627	JCDECAUX SE 20/24	2,000	0	0	300	97,2740	291.822,00	0,29
XS2531438351	JOHN DEE. BK 22/26 MTN	2,500	140	0	140	96,2230	134.712,20	0,14
BE0002631126	KBC GROEP 19/24 MTN	1,125	0	0	400	98,4570	393.828,00	0,40
BE0002832138	KBC GROEP 21/27 FLR MTN	0,250	0	0	200	89,5540	179.108,00	0,18
BE0002900810	KBC GROEP 22/27 FLR MTN	4,375	500	0	500	99,3260	496.630,00	0,50
XS1900542926	KHFC 18/23 REGS	0,750	500	0	1.010	99,0440	1.000.344,40	1,01
XS2442748971	KHFC 22/25 REGS	0,723	300	0	600	94,2030	565.218,00	0,57
XS2289128162	KOMERCNI BK 21/26	0,010	0	0	500	90,3750	451.875,00	0,46
DE000A3MQVV5	KRED.F.WIED.22/27 MTN	1,250	400	0	400	92,8220	371.288,00	0,37
FR0014000774	LA MONDIALE 20/26	0,750	0	0	500	90,7130	453.565,00	0,46
XS2080581189	LB HESS.-THUER.MTN 19/24	0,125	0	0	400	94,5700	378.280,00	0,38
XS2536375368	LB.HESS.-THR. 22/26	2,375	800	0	800	96,6280	773.024,00	0,78
XS2305244241	LEASEPLAN 21/26 MTN	0,250	0	0	300	89,6850	269.055,00	0,27
XS2384269101	LEASEPLAN 21/26 MTN	0,250	0	0	300	88,0570	264.171,00	0,27
XS2477154871	LEASEPLAN 22/25 MTN	2,125	0	0	300	95,7170	287.151,00	0,29
XS1640668353	LEEDS BUILDING 17/24 MTN	0,500	800	0	800	96,5070	772.056,00	0,78
XS2549862758	LETTLAND 22/27 MTN	3,875	300	0	300	101,3030	303.909,00	0,31
XS2327298217	LSEG NETHERL 21/25 MTN	0,000	0	0	100	93,2430	93.243,00	0,09
XS2531803828	MACQUARIE BK 22/27 MTN	2,574	400	0	400	95,4740	381.896,00	0,39
XS2027957815	MEDIOBANCA 19/25 MTN	1,125	300	0	500	93,9830	469.915,00	0,47
DE000A3LBMV2	MERC.B.FI.CA 22/27 MTN	3,000	500	0	500	97,3550	486.775,00	0,49
XS2484586669	MET.LIFE F.I 22/25	1,750	0	0	150	95,4370	143.155,50	0,14
XS2010030752	MFB 20/25	1,375	0	0	500	92,8820	464.410,00	0,47
XS2028899727	MIT.UFJ FIN. 19/24 MTN	0,339	0	0	210	96,2030	202.026,30	0,20
XS2132337697	MIT.UFJ FIN. 20/24 MTN	0,978	0	0	200	97,1760	194.352,00	0,20
XS2530031546	MIT.UFJ FIN.22/25 MTN FLR	3,273	320	0	320	98,5310	315.299,20	0,32
XS2465984107	MIZUHO F.G. 22/27 MTN	1,631	0	0	400	91,4940	365.976,00	0,37
XS1872032369	NATL AUSTR. BK 18/23 MTN	0,625	0	0	200	99,5240	199.048,00	0,20
XS1998797663	NATL AUSTR.B 19/24 MTN	0,250	0	0	390	96,7340	377.262,60	0,38
XS2486461010	NATL GRID 22/26 MTN	2,179	0	0	210	94,9550	199.405,50	0,20
XS1612958253	NATL WESTM. BK 17/24 MTN	0,500	500	0	500	97,0440	485.220,00	0,49
XS2407357768	NATWEST MKTS 21/25 MTN	0,125	0	0	280	90,5990	253.677,20	0,26
XS2553554812	NED.WATERSCH 22/27 MTN	2,750	310	0	310	97,8980	303.483,80	0,31
XS2384734542	NIBC BK 21/26 MTN	0,250	0	0	200	84,5180	169.036,00	0,17
XS1076781589	NN GP. 14/UND.FLRMTN	4,375	0	200	100	98,6850	98.685,00	0,10
XS2019260764	NORDEA BK 19/29 FLR MTN	1,000	0	0	400	95,5400	382.160,00	0,39
XS2584643113	NORDEA BK 23/26 FLR MTN	3,625	390	0	390	98,6320	384.664,80	0,39
XS2561746855	NORDEA MT BK 22/25 MTN	2,625	500	0	500	97,5480	487.740,00	0,49
DE000NLB3Z75	NORDLB HPF.MTN22/27	2,250	200	0	200	95,5520	191.104,00	0,19
XS2305026762	NTT FIN. 21/25 REGS	0,010	0	0	300	93,6530	280.959,00	0,28
DK0009522732	NYKREDIT 19/24 MTN	0,875	0	0	170	98,3210	167.145,70	0,17
DK0009525404	NYKREDIT 19/24 MTN	0,125	0	0	120	95,6770	114.812,40	0,12
DK0030467105	NYKREDIT 20/26 MTN	0,250	0	0	200	89,9160	179.832,00	0,18
XS2500414623	OEKB 22/27 MTN	1,500	280	0	280	93,3520	261.385,60	0,26
XS2197342129	OP YRITYSPA. 20/24 MTN	0,125	0	0	400	96,1690	384.676,00	0,39
FR0013241536	ORANGE 17/23 MTN	0,750	0	0	1.000	99,4430	994.430,00	1,00
FR00140049Z5	ORANGE 21/26 MTN	0,000	0	0	400	89,6760	358.704,00	0,36
XS2560693181	OTP BNK 22/26 FLR MTN	7,350	300	0	300	101,2000	303.600,00	0,31
XS2168625460	PEPSICO 20/24	0,250	300	0	700	97,0350	679.245,00	0,69
XS2270395408	POSTE ITAL 20/24 MTN	0,000	0	0	400	94,0630	376.252,00	0,38
XS2430287529	PROSUS 22/26 MTN REGS	1,207	0	0	100	91,1050	91.105,00	0,09
XS1871439342	RABOBK NEDERLD 18/23 MTN	0,750	0	0	1.200	99,5560	1.194.672,00	1,21
XS1917591411	RAIF.BK INTL 18/23 MTN166	1,000	0	0	500	98,6260	493.130,00	0,50
XS2547936984	RAIF.BK INTL 22/28 MTN	5,750	500	200	300	103,3090	309.927,00	0,31
FR0013292687	RCI BANQ. 17/24 FLR MTN	3,844	0	0	300	99,8240	299.472,00	0,30
FR001400E904	RCI BANQ. 22/25 MTN	4,125	400	0	400	98,9990	395.996,00	0,40
FR0014007KL5	RCI BANQ. 22/25 MTN	0,500	0	0	300	92,6160	277.848,00	0,28
XS2333391303	ROY.SCHIPHOL 21/25 MTN	0,000	200	500	100	92,8640	92.864,00	0,09
XS2031862076	ROYAL BK CDA 19/24 MTN	0,125	0	0	500	95,9330	479.665,00	0,48
XS2531567753	ROYAL BK CDA 22/27 MTN	2,375	500	0	500	95,1850	475.925,00	0,48
XS1962554785	SAINT-GOBAIN 19/24	0,625	0	0	300	97,7410	293.223,00	0,30
XS2018637913	SANT.CON.S.F. 19/24 MTN	0,375	0	0	200	96,4680	192.936,00	0,19
XS2100690036	SANT.CON.S.F. 20/25 MTN	0,375	0	0	300	94,3790	283.137,00	0,29

ISIN	Wertpapier-Bezeichnung	Zins- satz	Käufe / Zugänge Stück /	Verkäufe / Abgänge Nominale (Nom. in 1.000, ger.)	Bestand	Kurs in Wertpapier- währung	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
XS1995645287	SANTANDER UK 19/24 MTN	0,100	250	0	500	96,7430	483.715,00	0,49
XS2489627047	SBAB BK 22/25 MTN	1,875	0	0	280	95,0410	266.114,80	0,27
DE000A289Q91	SCHAEFFLER MTN 20/25	2,750	0	0	100	96,0270	96.027,00	0,10
FR0013201308	SCHNEIDER ELECTRIC 16/24	0,250	0	0	200	95,9590	191.918,00	0,19
XS2020568734	SEB 19/24 MTN	0,050	300	0	600	96,1620	576.972,00	0,58
XS2455401328	SEGRO CAPITA 22/26	1,250	0	0	300	90,6730	272.019,00	0,27
XS2616008038	SIKA CAP. 23/24 FLR	3,465	280	0	280	100,0320	280.089,60	0,28
SK4000022398	SLOVENSK.SPO 23/26 MTN	3,250	500	0	500	98,0760	490.380,00	0,50
FR001400AO22	SOC GENERALE 22/25 FLR	1,500	0	0	800	97,2260	777.808,00	0,79
FR001400FZ73	SOCIETE GEN. 23/26 MTN	3,125	100	0	100	98,6520	98.652,00	0,10
XS1967582831	SPAREBK 1 SR 19/24 MTN	0,625	0	0	190	97,3970	185.054,30	0,19
XS2534276808	SPAREBK 1 SR 22/25 MTN	2,875	500	0	500	97,0540	485.270,00	0,49
XS2555209381	SPAREBNKN SB 22/25 MTN	3,125	200	0	200	98,4300	196.860,00	0,20
XS1616341829	STE GENERALE 17/24FLR MTN	3,454	0	0	300	100,4090	301.227,00	0,30
FR001400F315	STE GENERALE 23/25FLR MTN	3,558	700	0	700	100,0610	700.427,00	0,71
FR001400IDW0	STE GENERALE 23/27 MTN	4,125	500	0	500	99,1470	495.735,00	0,50
XS2407985220	STEDIN HLDG. 21/26 MTN	0,000	200	0	380	88,2450	335.331,00	0,34
FR0013245586	STELLANTIS N.V. 17/24 MTN	2,000	0	0	530	98,6140	522.654,20	0,53
XS2178832379	STELLANTIS N.V. 20/23 MTN	3,375	500	0	900	100,0020	900.018,00	0,91
XS2013536029	SVENSK.HDLB. 19/24 MTN	0,125	0	0	400	96,3900	385.560,00	0,39
SK4000022430	TATRA BKA 23/26 MTN	3,375	400	0	400	98,0110	392.044,00	0,40
XS1946004451	TELEFON.EMI. 19/24 MTN	1,069	0	0	100	98,3640	98.364,00	0,10
XS2508690612	TORON.DOM.BK 22/25 MTN	1,707	900	0	900	95,6350	860.715,00	0,87
XS2549702475	TORON.DOM.BK 22/26 MTN	3,250	500	0	500	98,3100	491.550,00	0,50
XS2577740157	TORONTO-DOM. BK 23/25 FLR	3,650	800	0	800	100,2560	802.048,00	0,81
DE000A3KYMA6	TRATON FIN. 21/24 MTN	0,125	0	0	300	94,5310	283.593,00	0,29
DE000A3KSGM5	TRATON FIN. 21/24 MTN	0,000	0	0	200	96,0040	192.008,00	0,19
DE000A3KNP88	TRATON FIN. 21/25 MTN	0,125	0	0	200	92,6500	185.300,00	0,19
DE000A3K5G19	TRATON FIN. 22/24 FLR MTN	4,208	0	0	500	99,9570	499.785,00	0,50
DE000HV2AYZ8	UC-HVB PF 2123	1,375	0	0	400	92,4700	369.880,00	0,37
DE000HV2AY79	UC-HVB PF 2131	2,750	900	0	900	97,6820	879.138,00	0,89
XS2021993212	UNICREDIT 19/25 FLR MTN	1,625	0	0	500	97,1090	485.545,00	0,49
XS2017471553	UNICREDIT 19/25 FLR MTN	1,250	0	0	400	96,8100	387.240,00	0,39
XS2063547041	UNICREDIT 19/25 MTN	0,500	0	0	600	93,6530	561.918,00	0,57
FR0013330529	URW 18/UND. FLR	2,125	0	0	300	87,4450	262.335,00	0,26
FR001400EA16	VALEO 22/27 MTN	5,375	100	0	100	100,2210	100.221,00	0,10
AT000B122155	VB WIEN 23/27 MTN	4,750	500	0	500	98,5320	492.660,00	0,50
XS2597973812	VESTAS WIND 23/26 MTN	4,125	280	0	280	99,8430	279.560,40	0,28
BE6332786449	VGP 22/27	1,625	0	0	200	81,0690	162.138,00	0,16
XS2230884657	VOLVO TREAS. 20/24 MTN	0,125	0	0	400	95,3730	381.492,00	0,39
XS2342706996	VOLVO TREAS. 21/26 MTN	0,000	0	0	100	89,6490	89.649,00	0,09
XS2534276717	VOLVO TREAS. 22/26 MTN	2,625	500	0	500	96,6570	483.285,00	0,49
SK4120015108	VSEOB.UV.BK 19/24 MTN	0,250	0	0	600	97,1850	583.110,00	0,59
AT000A2GLA0	WIENERBERGER 20/25	2,750	0	0	200	97,1570	194.314,00	0,20
						Summe	93.228.563,50	94,15

ASSET BACKED SECURITIES auf EURO lautend

ES0378641353	FADE 20/25	0,010	0	0	200	92,6010	185.202,00	0,19
						Summe	185.202,00	0,19

SUMME DER ZUM AMTLICHEN HANDEL ODER EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT ZUGELASSENEN WERTPAPIERE

94.465.232,60 95,40

NICHT ZUM AMTLICHEN HANDEL ODER EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT ZUGELASSENE WERTPAPIERE

ANLEIHEN auf AMERIKANISCHE DOLLAR lautend

XS2382222060	SEB 21/24 MTN REGS	0,650	0	0	200	94,1200	172.538,96	0,17
						Summe	172.538,96	0,17

SUMME DER NICHT ZUM AMTLICHEN HANDEL ODER EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT ZUGELASSENEN WERTPAPIERE

172.538,96 0,17

SUMME WERTPAPIERVERMÖGEN

94.637.771,56 95,57

FINANZTERMINKONTRAKTE

Bezeichnung / Underlying	Fälligkeit	Whg.	Anzahl / Betrag	Kontrakt- kurs	unrealisiertes Ergebnis in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
FINANZTERMINKONTRAKTE						
WÄHRUNGSTERMINKONTRAKTE						
CROSS RATE EUR/USD FUT SEP. 23	18.09.2023	USD	9	1,0953	7.084,10	0,01
				Summe	<u>7.084,10</u>	0,01
ZINSTERMINKONTRAKTE						
EURO BOBL FUT (FGBM) SEP. 23	07.09.2023	EUR	-47	115,7100	73.320,00	0,07
				Summe	<u>73.320,00</u>	0,07
SUMME FINANZTERMINKONTRAKTE					<u>80.404,10</u>	0,08

BANKGUTHABEN / BANKVERBINDLICHKEITEN

BANKGUTHABEN / BANKVERBINDLICHKEITEN

WÄHRUNG	FONDSWÄHRUNG	BETRAG FONDSWÄHRUNG
EURO	EUR	3.415.168,14
AMERIKANISCHE DOLLAR	EUR	140.473,92
JAPANISCHE YEN	EUR	4.930,91
INITIAL MARGIN / VARIATION MARGIN	EUR	58.604,15
SUMME BANKGUTHABEN / BANKVERBINDLICHKEITEN		<u>3.619.177,12</u>

	EUR	%
Wertpapiervermögen	94.637.771,56	95,57
Finanzterminkontrakte	80.404,10	0,08
Zinsenerträge (inkl. negativer Habenzinsen)	701.452,38	0,71
Bankguthaben / Bankverbindlichkeiten	3.619.177,12	3,65
Gebührenverbindlichkeiten	<u>-13.587,31</u>	<u>-0,01</u>
FONDSVERMÖGEN	<u>99.025.217,85</u>	100,00

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.

DEWSENKURSE

DEWSENKURSE

WÄHRUNG

AMERIKANISCHE DOLLAR
JAPANISCHE YEN

EINHEITEN

1 EUR =
1 EUR =

KURS

1,09100 USD
157,68770 JPY

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:

- 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.
- 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 (Marktzugang zum Berichtsstichtag)

ISIN	Wertpapier-Bezeichnung	Zins- satz	Whg.	Käufe / Zugänge Lots / Stück / Nominale	Verkäufe / Abgänge (Nom. in 1.000, ger.)
WERTPAPIERE					
XS1402941790	ABB FIN.B.V. 16/23 MTN	0,625	EUR	0	200
XS1892240281	ALD 18/22 MTN	1,250	EUR	0	400
XS1957532887	AM.HONDA FI. 19/22 MTN	0,350	EUR	0	240
XS2159791990	AM.HONDA FI. 20/24 MTN	1,950	EUR	0	500
XS2273810510	AROUNDTOWN 20/26 MTN	0,000	EUR	0	200
XS1713462585	AUTOLIV 18/23	0,750	EUR	0	400
IT0005325946	B.T.P. 18-23	0,950	EUR	0	3.400
FR0013054913	BANQ. POSTALE 15/27 FLR	2,750	EUR	0	500
XS2342059784	BARCLAYS 21/26 FLRMTN	4,301	EUR	0	200
XS1788584321	BBVA 18/23 FLR MTN	2,577	EUR	0	1.000
XS2462324232	BK AMERICA 22/26 FLR MTN	1,949	EUR	0	300
XS2023633931	BK OF IRELD 19/24 FLR MTN	0,750	EUR	0	180
XS1640827843	BK OF QUEENSL. 17/22 MTN	0,500	EUR	0	400
XS2010445026	BMW FIN. 19/22 MTN	0,125	EUR	0	660
XS1584041252	BNP PARIBAS 17/22 FLR MTN	0,672	EUR	0	440
FR0013323672	BPCE S.A. 18/23 FLR MTN	2,602	EUR	0	400
XS1856833543	BQUE F.C.MTL 18/22 MTN	0,500	EUR	0	400
FR0013342128	CARREF. 18/23 MTN	0,875	EUR	0	500
IT0005408080	CAS.DEP.PRES 20/23 MTN	1,500	EUR	0	600
IT0005314544	CASSA D.PR. 17/22 MTN	0,750	EUR	0	1.300
XS1796257092	CIBC 18/23 MTN	0,750	EUR	0	100
FR0013256427	CIE F.FONCIER 17/22 MTN	0,200	EUR	0	400
FR0013213832	CNP ASSURANCES 16/22	1,875	EUR	0	500
XS1787278008	CREDIT AGR. 18/23FLRMTN	2,575	EUR	0	600
ES0205045018	CRITERIA CAIXA 17/23 MTN	1,500	EUR	0	100
FR0013292828	DANONE 17/UND. FLR MTN	1,750	EUR	0	300

ISIN	Wertpapier-Bezeichnung	Zins- satz	Whg.	Käufe / Zugänge Lots / Stück / Nominale	Verkäufe / Abgänge (Nom. in 1.000, ger.)
DE000A3H2457	DEUT.BOERSE ANL 21/26	0,000	EUR	0	400
XS0856032213	DT. BAHN FIN. 12/23 MTN	2,000	EUR	0	200
DE000A3T0X97	DT.PFBR.BK MTN.35413	0,250	EUR	0	400
XS1382792197	DT.TELEK.INTL F.16/23 MTN	0,625	EUR	0	400
FR0013463643	ESSILORLUXO. 19/23 MTN	0,000	EUR	0	200
EU000A3K4DJ5	EU 22/25 MTN	0,800	EUR	250	700
BE6338167909	EUROCLEAR BK 22/27 MTN	3,625	EUR	110	110
XS2001270995	FCA BK(I.BR) 19/22 MTN	0,625	EUR	0	210
XS2293123670	FCA BK(I.BR) 21/23 MTN	0,000	EUR	0	600
XS1843436574	FID.NATL INF 19/23	0,750	EUR	0	300
BE0002420926	FLUVIUS SYSTEM O.12-22MTN	2,750	EUR	0	500
XS2049548444	GM FINANCIAL 19/22 MTN	0,200	EUR	0	440
XS2599731473	HEINEKEN 23/24 MTN	3,875	EUR	140	140
XS2388490802	HSBC HLDGS 21/26 FLR MTN	4,600	EUR	0	900
XS2015295814	ISLAND 19/24 MTN	0,100	EUR	500	1.200
IT0005366007	ITALIEN 19/22	1,000	EUR	0	1.500
IT0005439275	ITALIEN 21/24	0,000	EUR	0	1.000
XS0820547825	JPMORGAN CHASE 12/22 MTN	2,750	EUR	0	1.000
XS1726323436	JYSKE BK 17/22 MTN FLR	1,220	EUR	0	675
DE000A0PM5F0	K.F.W.ANL.V.07/2023	4,625	EUR	500	500
BE0002281500	KBC GROEP 17/22 MTN FLR	1,003	EUR	0	900
XS1611042646	KELLOGG CO. 17/22	0,800	EUR	0	400
DE000LB38077	LBBW MTN OPF 22/27	2,375	EUR	300	300
DE000LB384E5	LBBW MTN.HYP.23/26	2,875	EUR	350	350
XS1972557737	LG CHEM 19/23 REGS	0,500	EUR	0	100
DE000A2RYD83	M.B.INT.FIN. 19/23 MTN	0,625	EUR	0	400
XS2020670696	MEDTR.GLB HD 19/22	0,000	EUR	0	500
XS1960678099	MEDTR.GLB HD 19/23	0,375	EUR	0	250
XS2240133459	MEDTR.GLB HD 20/23	0,000	EUR	0	400
XS0864360358	NATL AUSTR. BK 12/23 MTN	1,875	EUR	0	200
XS1382368113	NATWEST GP. 16/23 MTN	2,500	EUR	0	100
XS2066703989	NEXI S.P.A. 19/24 REGS	1,750	EUR	0	100
XS1550988569	NN GP. 17/23 MTN REGS	0,875	EUR	0	100
XS2171759256	NOKIA 20/25 MTN	2,375	EUR	0	100
XS2411311579	NTT FIN. 21/25 MTN	0,082	EUR	0	210
XS2152924952	OEKB 20/23 MTN	0,000	EUR	1.000	1.000
AT0000A308C5	OESTERREICH 22/26 MTN	2,000	EUR	1.000	1.000
XS1028599287	ORANGE 14/UND. FLR MTN	5,250	EUR	0	300
XS2495085784	PKO BK HIPO. 22/25 MTN	2,125	EUR	0	400
XS2199493169	POLEN 20/23 MTN	0,000	EUR	0	300
XS2114767457	POLEN 20/25 MTN	0,000	EUR	0	500
XS1423826798	REN FIN. 16/23 MTN 3	1,750	EUR	0	100
XS2576245364	SAINT-GOBAIN 23/24 FLR	3,375	EUR	400	400
XS1993969515	SAMHALLSBYG. 19/25 MTN	1,750	EUR	0	280
FR0013324332	SANOFI 18/23 MTN	0,500	EUR	0	200
FR0013517711	SCHNEIDER EL 20/23 MTN	0,000	EUR	0	400
XS2176534282	SEB 20/23 MTN	0,250	EUR	0	200
FR0013321791	STE GENERALE 18/23FLR MTN	2,425	EUR	0	700
XS2156510021	SVENSKA HDBK. 20/25 MTN	1,000	EUR	500	500
XS1982819994	TELECOM ITAL 19/25 MTN	2,750	EUR	0	170
XS1590787799	TELIA CO 17/78 FLR	3,000	EUR	0	339
DE000HV2AGL5	UC-HVB PF 1716	1,875	EUR	0	50
XS0942388462	URW 13/23 MTN	2,500	EUR	0	500
FR0013230943	VALEO SE 17-23 MTN	0,625	EUR	0	100
FR0014002C30	VEOLIA ENVIR 21/26 MTN	0,000	EUR	0	300
XS2479941499	VISA 22/26	1,500	EUR	0	300
XS2374595127	VOLKSW.FIN.SERV.MTN.21/25	0,000	EUR	0	600
XS0968913342	VOLKSWAGEN INTL 13/UN.FLR	5,125	EUR	0	400
XS2342732562	VOLKSWAGEN INTL FLR22/UND	3,748	EUR	0	300
DE000A19X793	VONOVIA FIN. 18/22 FLR	1,550	EUR	0	800
FR0013521549	WORLDLINE 20/23	0,500	EUR	0	500
ES0334699008	P.I.T.C.H. 07-22	5,125	EUR	0	500
IT0005415416	B.T.P. 20/26 FLR	0,650	EUR	400	400
FINANZTERMIKONTRAKTE					
---	EURO BOBL FUT (FGBM) DEZ. 22		EUR	99	99
---	EURO BOBL FUT (FGBM) JUN. 23		EUR	115	115
---	EURO BOBL FUT (FGBM) MÄR. 23		EUR	115	115
---	EURO BOBL FUT (FGBM) SEP. 22		EUR	74	4

ISIN	Wertpapier-Bezeichnung	Zins- satz	Whg.	Käufe / Zugänge Lots / Stück / Nominale (Nom. in 1.000, ger.)	Verkäufe / Abgänge Lots / Stück / Nominale (Nom. in 1.000, ger.)
---	EURO SCHATZ FUT (FGBS) DEZ. 22		EUR	42	42
---	EURO SCHATZ FUT (FGBS) JUN. 23		EUR	34	34
---	EURO SCHATZ FUT (FGBS) MÄR. 23		EUR	38	38
---	EURO SCHATZ FUT (FGBS) SEP. 22		EUR	25	25
---	SHORT EURO-BTP FUT (FBTS) DEZ. 22		EUR	22	22
---	SHORT EURO-BTP FUT (FBTS) JUN. 23		EUR	19	19
---	SHORT EURO-BTP FUT (FBTS) MÄR. 23		EUR	19	19
---	SHORT EURO-BTP FUT (FBTS) SEP. 22		EUR	22	0
---	CROSS RATE EUR/USD FUT DEZ. 22		USD	23	23
---	CROSS RATE EUR/USD FUT JUN. 23		USD	9	9
---	CROSS RATE EUR/USD FUT MÄR. 23		USD	9	9
---	CROSS RATE EUR/USD FUT SEP. 22		USD	0	9

Wien, am 11. Oktober 2023

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 Euro Short Term Bond,
Miteigentumsfonds gemäß Investmentfondsgesetz 2011 idgF (InvFG)

bestehend aus der Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2023, der Ertragsrechnung für das an diesem Stichtag endende Rechnungsjahr 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 30. Juni 2023 sowie der Ertragslage des Fonds für das an diesem Stichtag endende Rechnungsjahr 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 16. Oktober 2023

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 Euro Short Term Bond

Die steuerliche Behandlung wird von der Österreichischen Kontrollbank (OeKB) auf Basis der Daten aus der Fondsbuchhaltung berechnet, auf 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 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 Euro Short Term Bond* gemäß InvFG 2011

Die Fondsbestimmungen für den Investmentfonds **Amundi Öko Sozial Euro Short Term 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)*

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.

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.

Der Investmentfonds investiert zu mindestens 51 vH des Fondsvermögens in Anleihen und Geldmarktinstrumente die in Form von direkt erworbenen Einzeltiteln, sohin nicht indirekt über Investmentfonds oder über Derivate gehalten werden, unter Berücksichtigung ökologischer und sozialer Nachhaltigkeitskriterien sowie unter Einhaltung ethischer Ausschlusskriterien. Das Zinsrisiko entspricht dabei einer Veranlagung mit einer durchschnittlichen Restlaufzeit von bis zu 3 Jahren.

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

3.1. *Wertpapiere*

Wertpapiere (einschließlich Wertpapiere mit eingebetteten derivativen Instrumenten) dürfen **im gesetzlich zulässigen Umfang** erworben werden.

3.2. *Geldmarktinstrumente*

Geldmarktinstrumente dürfen **bis zu 100 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.

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/Ertragssicherung dienen, darf **100 vH** des Gesamtnettowertes 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. Im Rahmen von Umschichtungen des Fondsportfolios und/oder der begründeten Annahme drohender Verluste bei Wertpapieren und/oder Geldmarktinstrumenten kann der Investmentfonds den Anteil an Wertpapieren und/oder Geldmarktinstrumenten unterschreiten und einen höheren Anteil an Sichteinlagen oder kündbaren Einlagen mit einer Laufzeit von höchstens 12 Monaten aufweisen. Es ist kein Mindestbankguthaben zu halten.

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 10 % des Fondsvermögens eingesetzt werden.

3.10. Wertpapierleihe

Wertpapierleihgeschäfte 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.

Es liegt im Ermessen der Verwaltungsgesellschaft, auch Anteilsscheinklassen in anderen Währungen aufzulegen.

4.1. Ausgabe und Ausgabeaufschlag

Die Berechnung des Ausgabebepreises 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 0,5 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 ausbezahlt.

Artikel 5 Rechnungsjahr

Das Rechnungsjahr des Investmentfonds ist die Zeit vom 1 Juli bis zum 30 Juni.

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 Anteilinhaber 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 ab 15. September des folgenden Rechnungsjahres auszuschütten, der Rest wird auf neue Rechnung vorgetragen. Jedenfalls ist ab dem 15. September ein gemäß InvFG ermittelter Betrag auszuzahlen, der zutreffendenfalls zur Deckung einer auf den ausschüttungsgleichen Ertrag des Anteilscheines entfallenden Kapitalertragsteuerabfuhrpflicht zu verwenden ist.

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 ab 15. September der gemäß InvFG ermittelte Betrag auszuzahlen, der zutreffendenfalls zur Deckung einer auf den ausschüttungsgleichen Ertrag des Anteilscheines entfallenden Kapitalertragsteuerabfuhrpflicht zu verwenden ist.

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 der 15. September des folgenden Rechenjahres. 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 auszus zahlen.

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 eine jährliche Vergütung bis zu einer Höhe von 0,40 vH des Fondsvermögens, die auf Grund der Monatsendwerte errechnet wird. Es liegt im Ermessen der Verwaltungsgesellschaft, eine Staffelung der Verwaltungsgebühr vorzunehmen. Die Verwaltungsgesellschaft hat Anspruch auf Ersatz aller durch die Verwaltung entstandenen Aufwendungen wie insbesondere Kosten für Pflichtveröffentlichungen, Depotgebühren, Aufwendungen für administrative Tätigkeiten gemäß § 5 Abs 2 Z 1 lit b) InvFG sowie Prüfungs-, Beratungs- und Abschlusskosten. Die Kosten bei Einführung neuer Anteilsgattungen für bestehende Sondervermögen werden zu Lasten der Anteilspreise der neuen Anteilsgattungen in Rechnung gestellt. Bei Abwicklung des Investmentfonds erhält die abwickelnde Stelle eine Vergütung von 0,5 vH des Fondsvermögens.

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

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_upreg¹²

1.2. Folgende Börsen sind unter das Verzeichnis der Geregelten Märkte zu subsumieren:

- | | |
|------------------|---|
| 1.2.1. Luxemburg | Euro MTF Luxemburg |
| 1.2.2. Schweiz | SIX Swiss Exchange AG, BX Swiss AG ³ |

1.3. 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.

¹ 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.

² Sobald das Vereinigte Königreich Großbritannien und Nordirland (GB) aufgrund des Ausscheidens aus der EU seinen Status als EWR-Mitgliedstaat verliert, verlieren in weiterer Folge auch die dort ansässigen Börsen / geregelten Märkte ihren Status als EWR-Börsen / geregelte Märkte. Für diesen Fall weisen wir darauf hin, dass die in GB ansässigen Börsen und geregelten Märkte

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

als in diesen Fondsbestimmungen ausdrücklich vorgesehene Börsen bzw. anerkannte geregelte Märkte eines Drittlandes im Sinne des InvFG 2011 bzw. der OGAW-RL gelten.

³ Aufgrund des Auslaufens der Börsenäquivalenz für die Schweiz sind die SIX Swiss Exchange AG und die BX Swiss AG bis auf Weiteres unter Punkt 2 „Börsen in europäischen Ländern außerhalb der Mitgliedstaaten des EWR“ zu subsumieren.

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. Serbien: Belgrad
- 2.5. Türkei: Istanbul (betr. Stock Market nur "National Market")

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
- 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 Artikel 8 der Offenlegungsverordnung

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 Euro Short Term Bond

Unternehmenskennung (LEI-Code): 529900IXPIHCZBZNRN88

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



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 58,92% 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 **50% ICE BOFA 0-1 YEAR EURO BROAD MARKET INDEX+50% ICE BOFA 1-3 YEAR EURO CORPORATE INDEX** (die ESG Vergleichsbenchmark). 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.

Der Fonds ist Träger des Österreichischen Umweltzeichens UZ49.

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 **0,81 (dies entspricht einem ESG Rating von C)**
- beträgt das gewichtete durchschnittliche ESG-Score des ESG-Anlageuniversum **0,81 (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.

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

Die oben genannten Nachhaltigkeitsindikatoren wurden nicht mit früheren Zeiträumen verglichen, da die Verordnung noch nicht in Kraft war.

- **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

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.

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

Bei den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen handelt es sich um die be-

deutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

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.

Amundi berücksichtigt bereits bestimmte Principal Adverse Impacts im Rahmen der Ausschlusspolitik des Fonds in Übereinstimmung mit den Ausschlusskriterien des Österreichischen Umweltzeichens UZ49.

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 CO₂-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 abrufbar ist.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
BTPS % 01/24 4Y	Schatzanleihen	4,96%	ITA
RABOBK 0.75% 08/23 GMTN	Finanzwesen	1,22%	NLD
CCTS FRN 07/23	Schatzanleihen	1,03%	ITA
BNS 3.05% 10/24 EMTN	Hypothekenvermögen	1,02%	CAN
KHFC 0.75% 10/23 REGS	Hypothekenvermögen	1,02%	KOR
ORAFP 0.75% 11/09/23	Kommunikationsdienste	1,01%	FRA
AT&T FRN 09/23	Kommunikationsdienste	0,97%	USA
STLA 3.375% 07/23	Zyklische Konsumgüter	0,94%	NLD
CMZB 0.5% 08/23 EMTN	Finanzwesen	0,91%	DEU
HVB 2.75% 02/26	Hypothekenvermögen	0,90%	DEU
TD 1.707% 07/25 EMTN	Hypothekenvermögen	0,89%	CAN

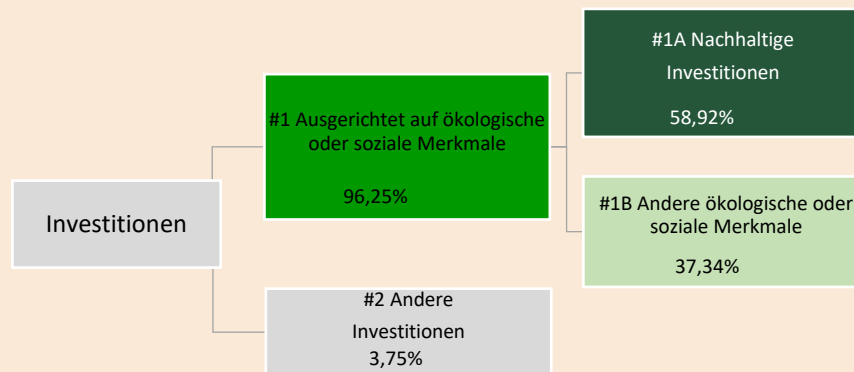
Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: **Von 01/07/2022 bis 30/06/2023**

ANZ 3.205% 11/24 EMTN	Hypothekenvermögen	0,82%	AUS
TD FRN 01/25 EMTN	Finanzwesen	0,82%	CAN
CCDJ 2.875% 11/24	Hypothekenvermögen	0,81%	CAN
CRHID 1.875% 01/24	Industrie	0,81%	NLD



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Wie sah die Vermögensallokation aus?



#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
Anleihen	96,25%
Bargeld	3,75%

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

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.



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

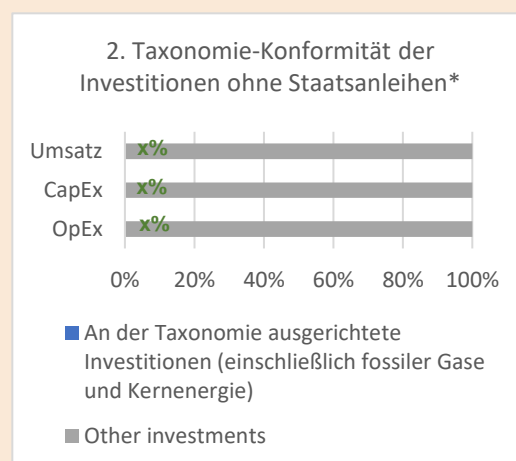
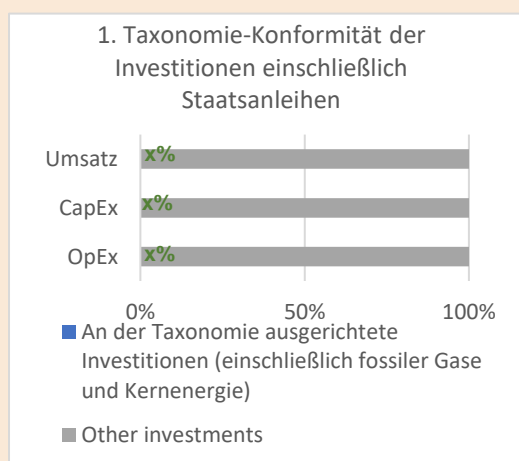
Verlässliche Daten zur EU-Taxonomie waren im Berichtszeitraum nicht verfügbar. (einschließlich Aktivitäten im Zusammenhang mit fossilen Gasen und Kernkraft)

- **Wird mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie¹ investiert?**

- Ja: In fossiles Gas In Kernenergie
- Nein

¹Tätigkeiten 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.

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.



Noch keine Daten verfügbar

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


Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen we-

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

Zuverlässige Daten über Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten waren während des Berichtszeitraums nicht verfügbar.

sentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen..

 sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, **die die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**

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

Für die vorangegangenen Berichtszeiträumen waren keine zuverlässigen Daten zur EU-Taxonomie verfügbar.



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

Am Ende des Berichtszeitraums, beträgt der Anteil der nachhaltigen Investitionen mit nicht an der Taxonomie ausgerichteten Umweltzielen **56,33%**.

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.



- **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Dieses Produkt hat sich nicht verpflichtet, während des Zeitraums sozial nachhaltige Investitionen zu tätigen.



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

Unter "#2 Sonstige" wurden Barmittel und Instrumente zum Zwecke des Liquiditäts- und Portfoliorisikomanagements erfasst. Die 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 gab es immer wieder einzelne Emittenten, deren ESG-Bewertung sich verschlechtert hatte. Diese wurden im Zuge dessen veräußert. Bei Neuemissionen und Aktivitäten am Sekundärmarkt wurden ökologische und soziale Merkmale natürlich ebenfalls berücksichtigt.



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.

Dieses Produkt hat keinen ESG-Vergleichsmaßstab.

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

(Die oben angeführte ESG-Vergleichsbenchmark ist kein Referenzwert im Sinne dieser Frage.)

- **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?**

Dieses Produkt hat keinen ESG-Vergleichsmaßstab.

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

Dieses Produkt hat keinen ESG-Vergleichsmaßstab.

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

Dieses Produkt hat keinen ESG-Vergleichsmaßstab.