



Wien 1, Schwarzenbergplatz 3

## **Amundi ESG Income 3**

**Miteigentumsfonds gemäß Investmentfondsgesetz 2011 idgF (InvFG)**

### **Rechenschaftsbericht**

über das Rechnungsjahr  
5. Juni 2022 – 04. Juni 2023

# Inhaltsverzeichnis

<b>Organe der Amundi Austria GmbH</b> .....	<b>3</b>
<b>Angaben zur Vergütungspolitik</b> .....	<b>4</b>
<b>Bericht an die Anteilhaber/innen</b> .....	<b>5</b>
<b>Anlagestrategie</b> .....	<b>6</b>
<b>Kapitalmarktentwicklung</b> .....	<b>6</b>
<b>Übersicht über die letzten drei Rechnungsjahre des Fonds</b> .....	<b>9</b>
<b>Ertragsrechnung und Entwicklung des Fondsvermögens</b> .....	<b>10</b>
1. Wertentwicklung des Rechnungsjahres (Fonds-Performance).....	10
2. Fondsergebnis.....	12
3. Entwicklung des Fondsvermögens.....	13
<b>Vermögensaufstellung</b> .....	<b>14</b>
<b>Bestätigungsvermerk</b> .....	<b>26</b>
<b>Steuerliche Behandlung</b> .....	<b>28</b>
<b>Fondsbestimmungen</b> .....	<b>29</b>
<b>Anhang Artikel 8 der Offenlegungsverordnung</b> .....	<b>34</b>

# Organe der Amundi Austria GmbH

## **Aufsichtsrat**

Matteo GERMANO (Vorsitzender)  
Christophe LEMARIÉ (stv. Vorsitzender) (bis 31.8.2023)  
Domenico AIELLO  
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)  
Mag. Hannes ROUBIK  
Alois STEINBÖCK

## **Depotbank**

UniCredit Bank Austria AG, 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!**

Wir legen nachstehend den Bericht des Amundi ESG Income 3, Miteigentumsfonds gemäß Investmentfondsgesetz 2011 idgF (InvFG) über das Rechnungsjahr vom 05.06.2022 bis 04.06.2023 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.

### **Methode zur Berechnung des Gesamtrisikos:**

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

## Anlagestrategie

Der Fonds war das gesamte Rechnungsjahr hinweg bei Aktien konstant knapp unter 65 % gewichtet. High Yield und Emerging Markets Anleihen wurden reduziert und waren konstant mit 5 % bzw 3 % im Portfolio vertreten. Das Zinsänderungsrisiko wurde ab April 2023 leicht erhöht. Innerhalb der Staatsanleihen wurde verstärkt auf deutsche Staatsanleihen und weniger auf italienische Anleihen gesetzt.

Der Fonds hält weiterhin an ESG Ausschlusskriterien fest, die in Übereinstimmung mit dem Vertriebspartner getroffen wurden.

Der Fonds verfolgt eine aktive Veranlagungsstrategie und orientiert sich an keinem Referenzwert. <sup>1)</sup>

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

Der Amundi ESG Income 3 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 Jahr 2022 stand ganz im Zeichen der Fortsetzung des Anstiegs der Inflation. Durch den Einmarsch Russlands und den dadurch verursachten Krieg in der Ukraine kam es zusätzlich zu den bestehenden Inflationstreibern zu einer Beschleunigung des Anstiegs der Energiepreise, vor allem bei Gas. Aber auch Nahrungsmittelpreise stiegen deutlich. Die globalen Notenbanken mussten daher ihren Kampf gegen die Inflation intensivieren, um ihre Glaubwürdigkeit beim Thema Inflationsbekämpfung nicht zu verlieren. Das angekündigte Ende des quantitativen Easings und damit eine schrittweise Rücknahme der lockeren Geldpolitik, von der „Risky Assets“ zuvor stark profitiert hatten, wurde von den Kapitalmärkten extrem negativ aufgenommen. 2022 markierte den Beginn der Kehrtwende in der Geldpolitik. Einerseits verlangsamte sich die Dynamik des Wirtschaftswachstums gegenüber den Höchstständen im Jahr 2021, andererseits führten die sich erholende Nachfrage und anhaltende Lieferengpässe – verschärft durch den Krieg in der Ukraine – zu Inflationswerten deutlich über den Zielen der Zentralbanken. Als Reaktion darauf gingen die Zentralbanken vor allem in den USA, in UK und Europa, die zuvor angenommen hatten, die Inflation sei nur ein vorübergehendes Phänomen, dazu über, die Zinsen deutlich zu erhöhen, da die Preiserhöhungen auch bereits zu einem massiven politischen Problem wurden. Stagflationsbefürchtungen nahmen zu, nachdem bei steigenden Preisen die Wachstumsaussichten unter Druck gerieten, was durch geopolitische Spannungen und die Unterbrechungen der europäischen Gasversorgung aus Russland noch verschärft wurde. Die EZB beschloss, ihre Nettokäufe von Vermögenswerten im Rahmen ihres Programms zum Ankauf von Vermögenswerten einzustellen und schuf ein neues Anti-Fragmentierungs-Tool. Im Juni erreichte die Inflation ein 40-Jahreshoch von 9,1 % und hielt die Fed unter Druck. Die Zentralbank erhöhte die Leitzinsen in mehreren Schritten von 0,25 % bis auf 3,25 % im September und wird weiterhin auf einem Straffungskurs bleiben. Zu Jahresende lag die Rendite 10-jähriger US-Staatsanleihen bei fast 3,9 %. Der Druck auf das Wirtschaftswachstum nahm weiter zu, der Einkaufsmanagerindex für das verarbeitende Gewerbe bleibt schwach. Infolgedessen wird die Aufgabe der Fed angesichts ihres doppelten Mandats, Preisstabilität und Wirtschaftswachstum in Einklang zu bringen, schwierig. Trotzdem sorgen starke Arbeitsmärkte und niedrige Arbeitslosenquoten dafür, dass der Gesamtkonsum vorerst robust ist, auch wenn wir einige Wolken am Horizont sehen. Der starke Anstieg der Inflation führte zu steigenden Notenbankzinsen und zu der Erwartung, dass die Notenbanken die Zinsen so lange erhöhen müssen, bis sie die Inflation in den Griff bekommen. Dadurch kamen sämtliche Rentenmärkte extrem unter Druck und die meisten Staatsanleihenmärkte der Industriestaaten erzielten 2022 das mit Abstand schlechteste Ergebnis seit vielen Jahrzehnten. Auch

Unternehmensanleihen und High Yield Anleihen korrigierten deutlich. Die Aktienmärkte reagierten – nach dem starken Anstieg 2021 – auf die steigenden Zinsen und auf die Erwartung, dass die Wirtschaftsdynamik deutlich abnehmen wird, mit massiven Kursrückgängen, wobei vor allem Wachstumsaktien, Kommunikationsdienstleistungen und zyklische Konsumaktien sowie Industrieaktien deutlich unter Druck gerieten, defensive Sektoren – vor allem der Energiesektor - konnten outperformen. Das Jahr 2022 war geprägt von marktübergreifenden Divergenzen. Während auf der einen Seite die anhaltende Inflation die Hauptsorge bleibt, kamen im Jahresverlauf auch Sorgen um das Wirtschaftswachstum dazu, insbesondere in Europa und in gewissem Maße in den USA. Der Rückgang der US-amerikanischen und europäischen Aktien ist ein Hinweis auf die Neubewertung, die von Stagflationsbefürchtungen angeführt wird, die sich auf die Verbrauchernachfrage und schließlich auf die Unternehmensgewinne auswirken könnten. Gegen Jahresende kam zwar eine „Bärenmarktrallye“ zustande, aber die starken US-Arbeitsmarktdaten für November schwächten das Markt-Narrativ einer moderateren Notenbankpolitik, sodass sich für die US-Inflation ein gemischtes Bild ergab, da die Dienstleistungskomponenten weiterhin hartnäckig sind. Die Fed verlangsamte das Tempo der Zinserhöhungen, bekräftigte aber, dass ihre Aufgabe noch lange nicht erledigt ist. Die Zentralbanken, einschließlich der EZB, werden sich auf einem schmalen Grat bewegen, bei dem die Gefahr von Fehlern groß ist. Belastend wirkte 2022 auch die Schwäche der Wirtschaft Chinas, hervorgerufen vor allem durch die Null-Covid-Politik und die Immobilienkrise. Gleichzeitig sehen wir zunehmende geopolitische Risiken in Europa und den USA. In den Emerging Markets dürfte jedoch die sich zuletzt abzeichnende Beschleunigung der Wiederöffnung in China früher als erwartet zu einem Aufschwung führen, während sich Europa noch in der Rezession und die USA in einer deutlichen Abschwächung befinden werden. Dies unterstreicht ein wesentliches Merkmal der Aussichten für 2023: die starke regionale Asynchronität der Wirtschaftszyklen. Die Anleihenmärkte standen 2022 im Zeichen der Inflation, der Politik der Zentralbanken und der Wachstumssorgen. Bei Staatsanleihen schauen die Märkte weiterhin auf die Inflation und die Reaktion der Fed, aber die Aufmerksamkeit dürfte sich bald auf das Wachstum und die Rezessionsängste richten. Vorläufig ist die Richtung der Zinsen noch aufwärts. Die Fed hat klargelegt, dass sie nun mit höheren finalen Zinsen rechnet als im September erwartet. Die Frage, wie lange die Zentralbank die Zinsen restriktiv hält, gewinnt an Bedeutung. Die Zentralbanken der Schwellenmärkte setzten ihren Spagat zwischen Wachstum und Inflation ebenso fort wie ihre Pendanten der Industriestaaten. Für ausgewählte Schwellenländer wie Indien sind importierte Inflation und steigende Kosten für Rohstoffimporte jedoch ein größeres Problem. In Lateinamerika erhöhten die Zentralbanken von Brasilien, Chile und Peru die Zinsen, um die Inflation zu kontrollieren. Der US-Dollar konnte in den ersten drei Quartalen 2022 gegenüber dem Euro deutlich zulegen. Während Europa stark unter der Energieabhängigkeit von Russland leidet, profitierte der Dollar von der steigenden Zinsdifferenz gegenüber der Eurozone, vom stabileren Wachstum und von Produktivitätsgewinnen in den USA. Im vierten Quartal kam es jedoch zu einer Korrektur beim Dollarkurs. Im ersten Quartal 2023 waren die Themen Inflation und Notenbankpolitik nach wie vor die wichtigsten Treiber der Märkte. Während die Inflation in den USA ihren Rückgang fortsetzte (von 9,1 % im Juni 2022 auf 6 % im Februar 2023), fiel der Rückgang bei der Kerninflation von 6,6 % im September 2022 auf 5,5 % im Februar 2023 deutlich geringer aus. In der Eurozone fiel die Inflation von 10,6 % im Oktober 2022 auf 6,9 % im März 2023 vor allem aufgrund der rückläufigen Energiepreise. Im Gegensatz dazu stieg die Kerninflation im März 2023 auf einen neuen Höchststand von 5,7 %. Während der Markt Anfang März noch davon ausgegangen war, dass die Fed die Zinsen bis Jahresmitte auf 5,5 % erhöhen würde, brachte der Kollaps der Silicon Valley Bank (sie wurde von der US-Bundeseinlagenversicherungsgesellschaft FDIC unter Zwangsverwaltung gestellt), die Ausweitung der Liquiditätskrise auf die Signature Bank und indirekt auch das Scheitern der Credit Suisse (die von UBS übernommen werden musste) einen kompletten Umschwung bei der erwarteten Notenbankpolitik in den USA. Der Markt begann binnen weniger Tage, die erwarteten Zinserhöhungen der Fed auszupreisen und stattdessen ging der Markt auf einmal davon aus, dass die Fed die Zinsen bis Jahresende 2023 auf 4 % senken könnte. Da die Inflation weiterhin hartnäckig über den Inflationszielen der Notenbanken Federal Reserve und EZB bleibt und der Arbeitsmarkt sich in den USA weiterhin sehr stabil zeigt, sendeten die Notenbanken Signale an die Märkte, dass die Inflationsbekämpfung das oberste Ziel bleibe und dass eine systematische Bankenkrise nicht zu erwarten sei. Obwohl verschiedene Indikatoren in den USA auf ein erhöhtes Rezessionsrisiko hinweisen (inverse Zinsstruktur, Einkaufsmanager-Index des produzierenden Gewerbes, Leading Indicators, Bereitschaft der Banken zur Kreditvergabe, etc.) bietet der stabile Konsum, unterstützt durch die niedrige Arbeitslosenrate, sowie die Wiedereröffnung der chinesischen Wirtschaft, die Normalisierung der Lieferketten und über den Erwartungen liegende Wirtschaftsdaten in der Eurozone (nach dem Rückgang der Gas- und Energiepreise) nach wie vor die Hoffnung auf eine sanfte Landung der US-Wirtschaft. Der Aktienmarkt legte einen fulminanten Start hin, ehe zuerst Befürchtungen einer zu restriktiven Notenbankpolitik und dann die Probleme im Bankensektor zu einer Korrektur führten. Die Maßnahmen zur Stabilisierung des Bankensektors und die damit verbundenen Erwartungen, dass die Fed die Zinsen im Jahresverlauf wieder senken könnte, führten zu einer Fortsetzung der Rallye und die Märkte beendeten das erste Quartal 2023 durchwegs positiv wobei Europa vor den USA und Japan sowie den Emerging Markets

lag. Auf Sektorebene konnten zyklische Konsumtitel am stärksten zulegen, gefolgt vom IT-Sektor und Kommunikationsdienstleistungen. Versorger, Energie und defensive Konsumgüter entwickelten sich gegen den Trend leicht negativ. Auf der Rentenseite konnten sowohl Staatsanleihen als auch Unternehmensanleihen bei extrem hoher Volatilität nach dem bisher schlechtesten Rentenjahr 2022 im ersten Quartal 2023 leicht zulegen, High Yield Anleihen lagen vor Emerging Markets Anleihen. Gold war Profiteur der hohen Volatilität und stieg auf Dollarbasis im ersten Quartal 2023 um 8 %. <sup>2)</sup>

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

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

# Übersicht über die letzten drei Rechnungsjahre des Fonds

Fondsvermögen in EUR, Angaben zu den Tranchen in Tranchenwährung

Rechnungsjahre	04.06.2023	04.06.2022	04.06.2021
Fondsvermögen	247.291.520,70	266.509.951,92	278.894.943,65

## Ausschüttungsanteile AT0000A1KTU5 in EUR

Rechenwert je Anteil	84,31	89,33	96,96
Anzahl der ausgegebenen Anteile	2.874.051,08	2.947.598,93	2.875.810,08
Ausschüttung je Anteil	1,2647	1,3490	2,90
Zwischenausschüttung je Anteil	1,2992	1,4724	0,9363
Wertentwicklung in %	-2,72	-3,63	9,99

## Thesaurierungsanteile mit KESSt-Abzug AT0000A2QMH2 in EUR \*)

Rechenwert je Anteil	94,96	97,58	101,21
Anzahl der ausgegebenen Anteile	52.479,11	32.801,50	474,00
Zur Thesaurierung verwendeter Ertrag	-1,9978	-0,7113	-0,0039
Auszahlung gemäß § 58 Abs 2 InvFG	0,0000	0,0000	0,0000
Wertentwicklung in %	-2,68	-3,59	1,21

\*) Erstmalig Anteile am 28.5.2021

# Ertragsrechnung und Entwicklung des Fondsvermögens

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

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

<b>Ausschüttungsanteile AT0000A1KTU5</b>	In EUR
Rechenwert am Beginn des Rechnungsjahres	89,33
Ausschüttung am 1.8.2022 von 1,3490 (entspricht 0,015046 Anteilen) (Rechenwert für einen Ausschüttungsanteil am 1.8.2022 (Ex-Tag): 89,66)	
Zwischenausschüttung am 31.1.2023 von 1,2992 (entspricht 0,015481 Anteilen) (Rechenwert für einen Ausschüttungsanteil am 31.1.2023 (Ex-Tag): 83,92)	
Rechenwert am Ende des Rechnungsjahres	84,31
Gesamtwert inkl. (fiktiv) durch Ausschüttung erworbene Anteile (1,015046 * 1,015481 * 84,31)	86,90
Wertentwicklung eines Anteiles im Rechnungsjahr in %	-2,72
Nettoertrag pro Anteil	-2,43

<b>Thesaurierungsanteile mit KESSt-Abzug AT0000A2QMH2</b>	In EUR
Rechenwert am Beginn des Rechnungsjahres	97,58
Rechenwert am Ende des Rechnungsjahres	94,96
Wertentwicklung eines Anteils im Rechnungsjahr in %	-2,68
Nettoertrag pro Anteil	-2,62

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.

### **Zwischenausschüttung für Ausschüttungsanteile - AT0000A1KTU5**

Die Ausschüttung von EUR 1,2992 je Anteil wurde ab 31.1.2023 von den depotführenden Banken vorgenommen.

Die kuponauszahlende Bank ist verpflichtet, von der Ausschüttung Kapitalertragsteuer in der Höhe von EUR 0,3573 je Anteil einzubehalten, sofern keine Befreiungsgründe vorliegen.

### **Ausschüttung für Ausschüttungsanteile - T0000A1KTU5**

Die Ausschüttung von EUR 1,2647 je Anteil wird ab 31.7.2023 von den depotführenden Banken vorgenommen.

Die kuponauszahlende Bank ist verpflichtet, von der Ausschüttung Kapitalertragsteuer in der Höhe von EUR 0,2714 je Anteil einzubehalten, sofern keine Befreiungsgründe vorliegen.

### **Auszahlung für Thesaurierungsanteile mit KESSt-Abzug - AT0000A2QMH2**

Die Kapitalertragsteuer beträgt EUR 0,00 je Anteil, daher wird keine Auszahlung vorgenommen.

## 2. Fondsergebnis

Angaben in EUR

### a. Realisiertes Fondsergebnis

#### Ordentliches Fondsergebnis

#### **Erträge (ohne Kursergebnis) 4.307.139,47**

Zinsenerträge (inkl. ordentliche Erträge ausl. Subfonds)	1.735.739,14
Dividendenerträge	3.341.507,86
Ausschüttungen ausländischer Subfonds	18.553,72
einbehaltene Quellensteuer Zinsen	-387,43
einbehaltene Quellensteuer Dividenden	-767.032,31
	<u>4.328.380,98</u>
Zinsaufwendungen (Sollzinsen)	-12.802,58
Einlageverwarentgelt	<u>-8.438,93</u>

#### **Aufwendungen**

Vergütung an die Verwaltungsgesellschaft	-3.611.264,92	<b>-4.091.269,27</b>
Verwaltungskostenrückvergütung aus Subfonds <sup>1)</sup>	0,00	
Kosten für den Wirtschaftsprüfer und steuerliche Vertretung	-17.453,60	
Publizitätskosten und Aufsichtskosten	-595,58	
Kosten für die Depotbank	-446.025,05	
Lizenzkosten, Kosten für externe Ratings	-200,68	
sonstige Kosten	<u>-15.729,44</u>	

#### **Ordentliches Fondsergebnis (exkl. Ertragsausgleich) 215.870,20**

#### **Realisiertes Kursergebnis <sup>2) 3)</sup>**

Realisierte Gewinne aus Wertpapieren (inkl. außerordentliche agE ausl. Subfonds)	6.551.711,93
Realisierte Gewinne aus derivativen Instrumenten (inkl. Devisengewinne)	3.705.749,09
Realisierte Verluste aus Wertpapieren	-9.039.035,96
Realisierte Verluste aus derivativen Instrumenten (inkl. Devisenverluste)	<u>-6.938.796,55</u>

#### **Realisiertes Kursergebnis (exkl. Ertragsausgleich) -5.720.371,49**

#### **Realisiertes Fondsergebnis (exkl. Ertragsausgleich) -5.504.501,29**

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

Veränderung des nicht realisierten Kursergebnisses	<u>-1.685.406,71</u>
<b>Ergebnis des Rechnungsjahres <sup>4)</sup></b>	<b>-7.189.908,00</b>

### c. Ertragsausgleich

Ertragsausgleich für Erträge des Rechnungsjahres	<u>-38.688,35</u>
<b>Fondsergebnis gesamt</b>	<b>-7.228.596,35</b>

### 3. Entwicklung des Fondsvermögens

<b>Fondsvermögen am Beginn des Rechnungsjahres</b> <sup>5)</sup>	266.509.951,92
<b>Ausschüttung am 1.8.2022 (inkl. Ausschüttungsausgleich)</b>	
Ausschüttung (für Ausschüttungsanteile) (AT0000A1KTU5)	-4.011.956,95
<b>Zwischenausschüttung am 31.1.2023 (inkl. Ausschüttungsausgleich)</b>	
Ausschüttung (für Ausschüttungsanteile) (AT0000A1KTU5)	-3.853.860,83
<b>Ausgabe und Rücknahme von Anteilen (inkl. Ausschüttungsausgleich)</b>	-4.124.017,09
Ausgabe von 218.072,62 Anteilen und Rücknahme von 271.942,86 Anteilen	
<b>Fondsergebnis gesamt</b> (das Fondsergebnis ist im Detail im Punkt 2. dargestellt)	<u>-7.228.596,35</u>
<b>Fondsvermögen am Ende des Rechnungsjahres</b> <sup>6)</sup>	<u><b>247.291.520,70</b></u>

#### 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 2,50 % 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 Veränderung des nicht realisierten Kursergebnisses): EUR -7.405.778,20.
- 4) Das Ergebnis des Rechnungsjahres beinhaltet explizit ausgewiesene Transaktionskosten in Höhe von EUR -65.484,53.
- 5) Anteilsulauf am Beginn des Rechnungsjahres: 2.947.598,93 Ausschüttungsanteile, 32.801,50 Thesaurierungsanteile mit KEST-Abzug.
- 6) Anteilsulauf am Ende des Rechnungsjahres: 2.874.051,08 Ausschüttungsanteile, 52.479,11 Thesaurierungsanteile mit KEST-Abzug.

# Vermögensaufstellung

Gattungsbezeichnung	ISIN	Bestand	Käufe/	Verkäufe/	Kurs in WP-Whg	Kurswert in EUR	% des FV
		04.06.23	Zugänge	Abgänge			
		im Berichtszeitraum					
		Stücke / Anteile / Nominale in 1.000					
<b>Wertpapiere</b>							
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>							
<b>Aktien in EUR</b>							
ACCOR S.A.Actions Port. EO 3	FR0000120404	18.415	18.889	474	31,690000	583.571,35	0,24
adidas AGNamens-Aktien o.N.	DE000A1EWWW0	3.714	1.236	211	159,520000	592.457,28	0,24
Akzo Nobel N.V.Aandelen aan toonder EO0,5	NL0013267909	6.511	0	395	73,040000	475.563,44	0,19
Allianz SEvink.Namens-Aktien o.N.	DE0008404005	3.643	0	255	210,150000	765.576,45	0,31
Alstom S.A.Actions Port. EO 7	FR0010220475	7.038	4.168	0	26,950000	189.674,10	0,08
ANDRITZ AGAKTIEN O.N.	AT0000730007	365	365	0	52,150000	19.034,75	0,01
ASML Holding N.V.Aandelen op naam EO -,09	NL0010273215	1.193	0	82	674,600000	804.797,80	0,33
BAYERISCHE MOTOREN WERKE	DE0005190003	6.463	0	453	106,160000	686.112,08	0,28
AGSTAMMAKTIE EO 1							
BNP PARIBAS S.A.Actions Port. EO 2	FR0000131104	11.275	0	794	56,480000	636.812,00	0,26
Cappemini SEActions Port. EO 8	FR0000125338	3.754	0	263	167,700000	629.545,80	0,25
Cie Génle Éts Michelin ScpAActions Nom. EO -,50	FR001400AJ45	4.236	4.236	0	27,430000	116.193,48	0,05
CNH Industrial N.V.Aandelen op naam EO -,01	NL0010545661	47.884	0	3.380	12,565000	601.662,46	0,24
Covestro AGInhaber-Aktien o.N.	DE0006062144	3.747	2.607	541	38,670000	144.896,49	0,06
CRH PLCRegistered Shares EO -,32	IE0001827041	18.700	0	1.319	45,460000	850.102,00	0,34
DEUTSCHE POST AGNAMENS-AKTIE O.N.	DE0005552004	12.824	0	904	42,880000	549.893,12	0,22
DEUTSCHE TELEKOM AGNAMENS-AKTIE O.N.	DE0005557508	36.157	0	2.551	19,138000	691.972,67	0,28
EssilorLuxottica S.A.Actions Port. EO 0,18	FR0000121667	3.892	75	273	171,320000	666.777,44	0,27
INFINEON TECHNOLOGIES AGNAMENS-AKTIE O.N.	DE0006231004	5.329	2.830	0	35,805000	190.804,85	0,08
KON. KPN N.V.Aandelen aan toonder EO -,04	NL0000009082	191.351	0	13.516	3,172000	606.965,37	0,25
PUBLICIS GROUPE S.A.Actions Port. EO 0,40	FR0000130577	10.863	0	766	70,800000	769.100,40	0,31
Sanofi S.A.Actions Port. EO 2	FR0000120578	5.426	0	4.532	94,980000	515.361,48	0,21
SAP SEInhaber-Aktien o.N.	DE0007164600	5.808	0	407	124,360000	722.282,88	0,29
Schneider Electric SEActions Port. EO 4	FR0000121972	5.976	683	448	165,620000	989.745,12	0,40
SIEMENS AGNAMENS-AKTIE O.N.	DE0007236101	4.924	0	346	159,280000	784.294,72	0,32
Siemens Energy AGNamens-Aktien o.N.	DE000ENER6Y0	29.571	6.370	1.586	24,400000	721.532,40	0,29
Solaria Energia Y Medio Ambi.Acciones Port. EO -,01	ES0165386014	37.811	36.312	1.878	12,940000	489.274,34	0,20
Stellantis N.V.Aandelen op naam EO -,01	NL00150001Q9	39.498	0	2.788	14,830000	585.755,34	0,24
STMICROELECTRONICS N.V.Aandelen aan toonder EO 1,04	NL0000226223	3.985	2.481	444	42,010000	167.409,85	0,07
UCB S.A.Actions Nom. o.N.	BE0003739530	6.224	0	1.643	82,500000	513.480,00	0,21
Valéo S.E.Actions Port. EO 1	FR0013176526	9.214	5.166	0	18,990000	174.973,86	0,07
VERBUND AGINHABERAKTIE KAT. A O.N.	AT0000746409	8.842	1.470	1.978	68,050000	601.698,10	0,24
<b>Aktien in AUD</b>							
ANZ Group Holdings Ltd.Registered Shares o.N.	AU000000ANZ3	30.807	32.336	34.219	22,770000	432.528,91	0,17
<b>Aktien in CAD</b>							
Ballard Power Systems Inc.Registered Shares o.N.	CA0585861085	3.600	3.600	0	5,770000	14.404,99	0,01
<b>Aktien in CHF</b>							
LONZA GROUP AGNamens-Aktien SF 1	CH0013841017	1.119	0	76	586,800000	674.780,80	0,27
Nestlé S.A.Namens-Aktien SF -,10	CH0038863350	10.205	0	5.067	109,600000	1.149.386,50	0,46
Partners Group Holding AGNamens-Aktien SF -,01	CH0024608827	557	0	33	841,600000	481.729,73	0,19
<b>Aktien in DKK</b>							
Vestas Wind Systems A/SNavne-Aktier DK -,20	DK0061539921	6.384	4.274	682	204,300000	175.104,88	0,07
<b>Aktien in GBP</b>							
AstraZeneca PLCRegistered Shares DL -,25	GB0009895292	6.563	6.993	430	117,480000	897.318,87	0,36
Britvic PLCRegistered Shares LS -,20	GB00B0N8QD54	55.399	0	3.912	8,880000	572.526,18	0,23
HSBC HOLDINGS PLCRegistered Shares DL -,50	GB0005405286	97.683	0	55.837	6,027000	685.173,63	0,28
ITM Power PLCRegistered Shares LS -,05	GB00B0130H42	17.975	17.975	0	0,698000	14.601,75	0,01
Lloyds Banking Group PLCRegistered Shares LS -,10	GB0008706128	1.102.840	0	403.343	0,454450	583.282,68	0,24
National Grid PLCReg. Shares LS -,12431289	GB00BDR05C01	54.214	0	3.827	10,550000	665.647,60	0,27
Rentokil Initial PLCRegistered Shares LS 0,01	GB00B082RF11	102.051	0	7.205	6,482000	769.851,13	0,31
Tesco PLCRegistered Shs LS -,0633333	GB00BLGZ9862	265.487	284.093	18.606	2,624000	810.751,11	0,33
Unilever PLCRegistered Shares LS -,031111	GB00B10RZP78	12.123	12.930	18.838	40,565000	572.324,12	0,23
Whitbread PLCReg. Shares LS -,76797385	GB00B1KJJ408	4.718	3.152	469	33,740000	185.260,77	0,07
<b>Aktien in HKD</b>							
China Suntien Green Energy CrpRegistered Shares H YC 1	CNE100000TW9	46.000	46.000	0	3,060000	16.745,28	0,01

Gattungsbezeichnung	ISIN	Bestand 04.06.23	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs in WP-Whg	Kurswert in EUR	% des FV
		Stücke / Anteile / Nominale in 1.000					
<b>Aktien in JPY</b>							
KURITA WATER INDUSTRIES LTD.Registered Shares o.N.	JP3270000007	22.400	21.200	600	5.830,000000	871.820,51	0,35
Recruit Holdings Co. Ltd.Registered Shares o.N.	JP3970300004	12.600	0	200	4.452,000000	374.486,54	0,15
<b>Aktien in NOK</b>							
Aker Carbon Capture ASANavne-Aksjer NK 1	NO0010890304	35.732	44.087	8.355	13,130000	39.705,58	0,02
NEL ASANavne-Aksjer NK -,20	NO0010081235	599.792	670.925	71.133	13,760000	698.471,39	0,28
<b>Aktien in SEK</b>							
PowerCell Sweden AB (publ)Namn-Aktier SK-,022	SE0006425815	1.654	1.654	0	83,740000	11.987,71	0,00
<b>Aktien in USD</b>							
AbbVie Inc.Registered Shares DL -,01	US00287Y1091	12.235	0	2.570	136,870000	1.561.329,96	0,63
ADVANCED MICRO DEVICES INC.Registered Shares DL -,01	US0079031078	20.624	11.173	1.252	117,860000	2.266.322,91	0,92
American Tower Corp.Registered Shares DL -,01	US03027X1000	5.347	5.661	314	191,150000	952.943,03	0,39
AUTODESK INC.Registered Shares o.N.	US0527691069	6.761	1.360	417	204,240000	1.287.461,32	0,52
CDW Corp.Registered Shares DL -,01	US12514G1085	6.051	0	424	174,220000	982.896,11	0,40
Cigna Group, TheRegistered Shares DL 1	US1255231003	4.307	4.520	213	257,030000	1.032.146,02	0,42
Crown Holdings Inc.Registered Shares DL 5	US2283681060	9.694	0	682	80,370000	726.406,02	0,29
Darling Ingredients Inc.Registered Shares DL -,01	US2372661015	24.345	24.895	550	64,060000	1.454.049,41	0,59
Eli Lilly and CompanyRegistered Shares o.N.	US5324571083	5.253	0	369	442,330000	2.166.388,04	0,88
First Solar Inc.Registered Shares DL -,001	US3364331070	7.508	7.097	543	206,740000	1.447.208,91	0,59
Graphic Packaging Holding Co.Registered Shares DL -,01	US3886891015	35.807	0	2.527	25,000000	834.623,09	0,34
Hewlett Packard Enterprise Co.Registered Shares DL -,01	US42824C1099	65.432	0	15.305	15,240000	929.731,65	0,38
Hilton Worldwide Holdings Inc.Registered Shares DL -,01	US43300A2033	6.332	6.774	442	142,800000	843.046,57	0,34
HOME DEPOT INC., THERegistered Shares DL -,05	US4370761029	7.133	1.624	483	295,940000	1.968.150,69	0,80
Intercontinental Exchange Inc.Registered Shares DL -,01	US45866F1049	14.064	5.940	813	107,980000	1.415.906,69	0,57
IQVIA Holdings Inc.Registered Shares DL -,01	US46266C1053	5.340	0	375	201,370000	1.002.578,71	0,41
JOHNSON CONTR.INTL.DL-,01	IE00BY7QL619	18.773	19.256	483	62,390000	1.092.021,32	0,44
Linde plcRegistered Shares EO -,001	IE000S9Y5762	3.017	3.083	66	360,470000	1.013.974,16	0,41
Medtronic PLCRegistered Shares DL -,0001	IE00BTN1Y115	14.041	0	989	83,760000	1.096.521,52	0,44
MICROSOFT CORP.Registered Shares DL-,00000625	US5949181045	19.367	1.221	5.287	335,400000	6.056.306,75	2,45
Mondelez International Inc.Registered Shares Class A o.N.	US6092071058	23.141	0	1.632	74,270000	1.602.426,06	0,65
Mosaic Co., TheRegistered Shares DL -,01	US61945C1036	18.101	0	1.277	33,080000	558.278,01	0,23
NATIONAL INSTRUMENTS CORP.Registered Shares DL -,01	US6365181022	13.470	27.740	14.270	57,800000	725.901,82	0,29
ProLogis Inc.Registered Shares DL -,01	US74340W1036	12.731	0	897	124,920000	1.482.780,77	0,60
Pure Storage Inc.Reg.Shares Cl.A DL -,0001	US74624M1027	36.588	37.531	943	34,250000	1.168.373,50	0,47
S&P Global Inc.Registered Shares DL 1	US78409V1044	4.333	1.547	235	376,030000	1.519.125,44	0,61
Sunnova Energy International IRegistered Shares DL -,0001	US86745K1043	1.662	2.822	1.160	17,910000	27.752,94	0,01
Trane Technologies PLCRegistered Shares DL 1	IE00BK9ZQ967	5.430	0	380	173,010000	875.897,91	0,35
Xylem Inc.Registered Shares DL -,01	US98419M1009	8.245	0	579	105,060000	807.626,40	0,33
<b>Verzinsliche Wertpapiere in EUR</b>							
Banca Comercială Română S.A.EO-FLR Non-Pref.MTN 23(26/27)	AT0000A34CN3	100	100	0	101,371000	101.371,00	0,04
Banca Transilvania S.A.EO-FLR Non-Pr.Bonds 23(26/27)	XS2616733981	160	160	0	102,278000	163.644,80	0,07
Bank Gospodarstwa KrajowegoEO-Medium-Term Nts 2023(33)	XS2589727168	100	100	0	103,891000	103.891,00	0,04
Bundesrep.DeutschlandAnl.v.2020 (2030)	DE0001030708	4.203	4.503	300	85,421000	3.590.244,63	1,45
Bundesrep.DeutschlandBundesobl.v.2020(25)	DE0001030716	1.379	1.379	0	94,084000	1.297.418,36	0,52
Carnival PLC EO-Notes 2019(29/29)	XS2066744231	521	0	0	54,894000	285.997,74	0,12
Ceská Sportitelna ASEO-FLR Non-Pref.MTN 22(24/25)	XS2555412001	100	100	0	101,190000	101.190,00	0,04
Cheplapharm Arzneimittel GmbHAnleihe v.20(20/27) Reg.S	XS2112973107	225	225	0	91,734000	206.401,50	0,08
Cheplapharm Arzneimittel GmbHAnleihe v.23(26/30) 144A	XS2618869445	225	225	0	100,300000	225.675,00	0,09
Constellium SEEO-Notes 2021(21/29) 144A	XS2335148701	330	125	0	84,704000	279.523,20	0,11
Dufry One B.V.EO-Notes 2021(21/28)	XS2333564503	100	0	0	89,180000	89.180,00	0,04
Energizer Gamma Acquisition B.EO-Notes 2021(21/29) 144A	XS2353487304	115	0	0	80,264000	92.303,60	0,04
Erste Group Bank AGAdditional Tier 2 Notes 2030	XS2083210729	100	100	0	90,615000	90.615,00	0,04
European Investment BankEO-Medium-Term Notes 2014(26)	XS1107718279	928	928	0	94,585000	877.748,80	0,35
Faurecia SEEO-Notes 2021(21/29)	XS2312733871	431	0	0	82,353000	354.941,43	0,14

Gattungsbezeichnung	ISIN	Bestand 04.06.23	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs in WP-Whg	Kurswert in EUR	% des FV
		Stücke / Anteile / Nominale in 1.000					
<b>Verzinsliche Wertpapiere in EUR (Fortsetzung)</b>							
Food Service Project S.A.EO-Notes 2022(22/27) Reg.S	XS2432286974	100	0	0	95,691000	95.691,00	0,04
Grünenthal GmbHAnleihe v.21(21/28) 144A	XS2337703610	250	0	0	92,933000	232.332,50	0,09
Grifols Escrow Issuer S.A.EO-Notes 2021(21/28) 144A	XS2393002519	385	125	0	84,026000	323.500,10	0,13
IHO Verwaltungs GmbHAnleihe v.19(19/27)144A	XS2004458720	420	0	0	89,650000	376.530,00	0,15
Internat. Cons. Airl. Group SAEO-Bonds 2021(21/29) Ser.B	XS2322423539	500	0	0	87,060000	435.300,00	0,18
Intrum ABEO-Notes 17(17/24) 144A *)	XS1634534017	435	0	0	49,854168	216.865,68	0,09
IrlandEO-Treasury Bonds 2018(31)	IE00BFZRQ242	1.711	1.711	0	90,916000	1.555.297,42	0,63
Italien, RepublikEO-B.T.P. 2021(24)	IT0005454050	846	846	0	97,799000	827.379,54	0,33
Kreditanst.f.WiederaufbauMed.Term Nts. v.20(28)	XS2209794408	1.765	1.765	0	86,249000	1.522.294,85	0,62
Lune Holdings S.à r.l.EO-Notes 2021(21/28) 144A	XS2406727409	125	125	0	85,336000	106.670,00	0,04
Nemak S.A.B. de C.V.EO-Notes 2021(21/28) Reg.S	XS2362994068	100	0	100	80,338000	80.338,00	0,03
Nordmazedonien, RepublikEO-Bonds 2023(26/27) Reg.S	XS2582522681	220	220	0	102,275000	225.005,00	0,09
Nova Ljubljanska Banka d.d.EO-FLR Pref. Notes 22(24/25)	XS2498964209	100	100	0	98,701000	98.701,00	0,04
Organon/Org.For.De.Co-IssuerEO-Notes 2021(21/28) 144A	XS2332250880	287	0	150	87,629000	251.495,23	0,10
Power Finance Corp. Ltd.EO-Medium-Term Notes 2021(28)	XS2384373341	100	0	0	83,055000	83.055,00	0,03
Powszechna K.O.(PKO)Bk PolskiEO-FLR Preferred MTN 23(25/26)	XS2582358789	100	100	0	100,449000	100.449,00	0,04
Raiffeisen Bank Zrt.EO-FLR Pref. MTN 2022(24/25)	XS2559379529	100	100	0	102,573000	102.573,00	0,04
Sappi Papier Holding GmbHNotes 2021/2028	XS2310951103	140	0	0	89,356000	125.098,40	0,05
Sherwood Financing PLC EO-Notes 2021(21/26) 144A	XS2010027295	100	0	0	84,596000	84.596,00	0,03
TAP - Transp.Aér.Port.SGPS SAEO-Obrigações 2019(19/24)Reg.S	PTTAPDOM0005	200	500	300	98,203000	196.406,00	0,08
Ziggo Bond Co. B.V.EO-Notes 2020(20/30) 144A	XS2116386561	504	0	0	72,844000	367.133,76	0,15
Ziggo Bond Co. B.V.EO-Notes 2020(20/30) Reg.S	XS2116386132	150	150	0	72,844000	109.266,00	0,04
<b>Verzinsliche Wertpapiere in BRL</b>							
International Bank Rec. Dev.RB/DL-Medium-Term Nts 2021(26)	XS2288097640	1.200	1.200	0	90,227000	203.668,85	0,08
<b>Verzinsliche Wertpapiere in GBP</b>							
Sherwood Financing PLCLS-Notes 2021(21/26) 144A	XS2010026644	125	0	0	81,844000	119.063,14	0,05
<b>Verzinsliche Wertpapiere in IDR</b>							
European Bank Rec. Dev.RP/DL-Medium-Term Nts.2020(25)	XS2265998430	3.600.000	3.600.000	0	96,842000	216.843,82	0,09
<b>Verzinsliche Wertpapiere in INR</b>							
European Bank Rec. Dev.IR/DL-Medium-Term Nts 2021(24)	XS2301346008	12.000	12.000	0	98,648000	134.086,81	0,05
European Bank Rec. Dev.IR/DL-Medium-Term Nts 2021(26)	XS2286302257	13.000	13.000	0	96,008000	141.373,27	0,06
<b>Verzinsliche Wertpapiere in MXN</b>							
International Finance Corp.MN-Medium-Term Notes 2018(30)	XS1753775730	6.000	6.000	0	92,978000	297.507,39	0,12
<b>Verzinsliche Wertpapiere in RUB</b>							
European Bank Rec. Dev.RL-Zo Med-Term Nts 2016(26)	XS1349367547	23.000	0	0	67,869000	179.015,66	0,07
<b>Verzinsliche Wertpapiere in USD</b>							
AAAdvant.Loy.IP Ltd./Am.Air.IncDL-Nts 2021(26-29) 144A	US00253XAB73	118	0	312	97,060000	106.339,32	0,04
Abra Global FinanceDL-Notes 2023(28) 144A	US000852AB97	606	706	100	81,130000	458.380,91	0,19
AdaptHealth LLC DL-Notes 2021(21/30) 144A	US00653VAE11	50	0	0	79,317000	36.975,90	0,01
AEGEA Finance S.a.r.l.DL-Notes 2022(22/29) 144A	US00775CAB28	200	0	0	94,360000	175.954,50	0,07
Africa Finance Corp.DL-Med.-Term Nts 2021(28)Reg.S	XS2337067792	250	0	0	81,956000	191.030,72	0,08
African Export-Import BankDL-Med.-T. Nts 21(26/26) Reg.S	XS2343006958	200	200	210	89,507000	166.905,04	0,07
Altice France S.A.DL-Notes 2021(21/29) 144A	US02156LAF85	200	200	0	72,616000	135.408,14	0,05
American Airlines Inc.DL-Nts 2020(20/25) 144A	US023771S586	200	200	0	110,201000	205.493,45	0,08
AngloGold Ashanti Holdings PLC DL-Notes 2020(20/30)	US03512TAE10	200	0	0	86,010000	160.384,13	0,06
Antofagasta PLC DL-Notes 2020(20/30) Reg.S	USG0398NZ620	200	0	0	81,439000	151.860,52	0,06

\*) Kurs inkl. Indexratio / Inflationsfaktor

Gattungsbezeichnung	ISIN	Bestand 04.06.23	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs in WP-Whg	Kurswert in EUR	% des FV
		Stücke / Anteile / Nominale in 1.000					
<b>Verzinsliche Wertpapiere in USD (Fortsetzung)</b>							
Archrock Pr.LP/Ar.Par.Fi.Corp.DL-Notes 2019(19/27) 144A	US03959KAA88	323	0	175	97,753000	294.384,59	0,12
Argentinien, RepublikDL-Bonds 2020(20/31-35)	US040114HT09	450	450	0	23,923000	100.371,54	0,04
Axis Bank Ltd.DL-FLR Cap.MTN 21(26/Und.)RegS	USY1009XAA73	210	0	0	86,422000	169.210,01	0,07
Banistmo S.A.DL-Notes 2020(20/27) Reg.S	USP15383CD50	200	0	0	93,616000	174.567,15	0,07
Bath & Body Works Inc.DL-Notes 2015(15/35)	US501797AL82	274	0	150	91,780000	234.466,64	0,09
BBVA Bancomer SA(Texas Branch)DL-FLR CAP.NT.18(28/33)Reg.S	USP16259AM84	200	0	0	88,112000	164.303,76	0,07
Beazer Homes USA Inc.DL-Notes 2017(17/27)	US07556QBR56	402	100	217	92,661000	347.300,56	0,14
Braskem Netherlands Fin. B.V.DL-Notes 2023(23/33) Reg.S	USN15516AG70	200	200	0	96,862000	180.620,02	0,07
Brink&apos;s Co., TheDL-Notes 2017(17/27) 144A	US109696AA22	510	100	0	93,871000	446.358,77	0,18
Burgan Bank K.P.S.C.DL-FLR Notes 2020(26/31)	XS2265369491	220	0	0	76,718000	157.362,92	0,06
Côte d&apos;Ivoire, RepublikDL-Notes 2017(31- 33) Reg.S	XS1631415400	210	0	0	87,403000	171.130,76	0,07
Clear Channel Outdo.Hldgs Inc.DL-Notes 2021(21/28) 144A	US18453HAC07	440	440	0	76,013000	311.833,67	0,13
Clearwater Paper Corp.DL-Notes 2020(20/28) 144A	US18538RAJ23	485	179	0	89,623000	405.269,26	0,16
Clearway Energy Operating LLCDL-Notes 2021(21/32) 144A	US18539UAE55	230	0	0	82,762000	177.476,67	0,07
Coca Cola Icecek A.S.DL- Sust.Lkd.Bds.22(22/29)Reg.S	XS2434515313	200	0	0	88,565000	165.148,48	0,07
Commercial Metals Co. DL-Notes 2021(21/31)	US201723AP84	200	200	0	85,049000	158.592,14	0,06
Commscope Inc.DL-Notes 2021(21/29) 144A	US203372AX50	203	120	92	80,390000	152.153,00	0,06
Continuum Energy Levanter Pte.DL-Notes 2021(24/21-27) Reg.S *)	USY1753QAB87	210	0	0	84,102690	164.668,92	0,07
Cornerstone Building Brand.IncDL-Notes 2020(20/29) 144A	US21925DAA72	490	0	0	74,527000	340.480,44	0,14
CT TrustDL-Notes 2022(22/32) Reg.S	USG2588BAA29	210	210	0	79,071000	154.817,12	0,06
Delek Logistics Pt.LP/Fin.CorpDL-Notes 2021(21/28) 144A	US24665FAC68	135	0	0	93,866000	118.147,50	0,05
Development Bk of PhilippinesDL-Notes 2021(31) Reg.S	XS2301051541	380	0	200	80,823000	286.352,52	0,12
Edgewell Personal Care Co.DL-Notes 2020(20/28) 144A	US28035QAA04	140	0	0	94,593000	123.472,29	0,05
Eldorado Gold Corp. Ltd.DL-Notes 2021(21/29) 144A	US284902AF02	169	0	86	90,573000	142.714,44	0,06
Falabella S.A.DL-Notes 2021(21/32) Reg.S	USP3984LAA81	210	0	0	78,905000	154.492,10	0,06
Far East Horizon LtdDL-Medium-Term Notes 2021(26)	XS2393797530	200	0	0	86,011000	160.386,00	0,06
Ford Motor Credit Co. LLCDL-Notes 2017(27/27)	US345397YT41	600	0	0	90,261000	504.933,10	0,20
Freedom Mortgage Corp.DL-Notes 2021(21/27) 144A	US35640YAG26	145	0	0	83,251000	112.548,55	0,05
Gap Inc.DL-Notes 2021(21/29) 144A	US364760AP35	237	137	0	71,327000	157.610,36	0,06
Gap Inc.DL-Notes 2021(21/31) 144A	US364760AQ18	55	0	0	69,591000	35.686,03	0,01
GC Treasury Center Co. Ltd.DL-Med.-T.Nts 2022(22/52)Reg.S	US36830DAF87	200	0	0	85,171000	158.819,64	0,06
Global Aircraft Leasing Co.LtdDL-Notes 2019(19/24) 144A	US37960JAA60	560	20	0	90,856000	474.017,49	0,19
Hanwha Life Insurance Co. Ltd.DL-FLR Notes 2022(27/32) Reg.S	USY306AXAD26	210	0	0	88,997000	174.251,74	0,07
Hat Holdings I LLC/Hldg.II LLCDL-Notes 2021(21/26) 144A	US418751AE33	414	119	0	88,155000	340.274,77	0,14
Hillenbrand Inc.DL-Notes 2021(21/31)	US431571AE83	332	0	200	84,106000	260.343,97	0,11
Hilton Domestic Operating Co.DL-Notes 2020(20/29) 144A	US432833AJ07	542	50	100	89,387000	451.706,25	0,18
Iron Mountain Inc.DL-Notes 2020(20/30) 144A	US46284VAJ08	442	372	0	91,240000	376.001,86	0,15
Jeff. Fin.LLC/JFIN Co-Iss.Corp.DL-Notes 2021(21/28) 144A 3C7	US47232MAF95	200	0	0	83,217000	155.175,98	0,06
Kaisa Group Holdings Ltd.DL-Notes 2017(17/22)	XS1627597955	200	0	0	7,353000	13.711,25	0,01
KB HomeDL-Notes 2019(26/27)	US48666KAX72	376	0	0	102,563000	359.551,42	0,15
Klabin Austral GmbHAnleihe 2019-2029	USA35155AA77	200	0	0	98,433000	183.549,48	0,07
Kolumbien, RepublikDL-Bonds 2019(19/49)	US195325DQ52	250	0	0	67,738000	157.890,08	0,06
Lamb Weston Holdings Inc.DL-Notes 2021(21/30) 144A	US513272AD65	90	0	0	90,926000	76.297,98	0,03
Lamb Weston Holdings Inc.DL-Notes 2021(21/32) 144A	US513272AE49	90	0	0	90,442000	75.891,85	0,03
Lenovo Group Ltd.DL-Notes 2020(20/30) Reg.S	USY5257YAJ65	200	0	0	84,085000	156.794,56	0,06
Level 3 Financing Inc.DL-Notes 2023(23/30) Reg.S	USU52783AZ71	98	98	0	97,139000	89.112,71	0,04
Light Serv.d.Elet.SA/Lt.Ene.SADL-Notes 2021(21/26) Reg.S	USP62763AB64	210	0	0	39,018000	76.395,32	0,03
Lithia Motors Inc.DL-Notes 2020(20/31) 144A	US536797AF03	275	275	0	86,060000	220.656,38	0,09
M/I Homes Inc.DL-Notes 2020(23/28)	US55305BAS07	50	0	75	93,621000	43.644,12	0,02
MashreqBank PSCDL-FLR Bds 2022(27/33)	XS2548003503	210	210	0	104,649000	204.897,58	0,08
Medline Borrower LPDL-Notes 2021(21/29) 144A	US62482BAB80	40	0	0	87,323000	32.566,50	0,01

\*) Kurs inkl. Indexratio / Inflationsfaktor

Gattungsbezeichnung	ISIN	Bestand 04.06.23	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs in WP-Whg	Kurswert in EUR	% des FV
		Stücke / Anteile / in 1.000	Nominale				
<b>Verzinsliche Wertpapiere in USD (Fortsetzung)</b>							
MeituanDL-Notes 2020(20/30) RegS	USG59669AC89	200	0	0	79,183000	147.653,72	0,06
Mercer International Inc.DL-Notes 2021(21/29)	US588056BB60	418	100	0	78,744000	306.885,39	0,12
Mexico City Airport TrustDL-Notes 2017(17/47) Reg.S	USP6629MAD40	290	0	0	76,760000	207.546,50	0,08
MFB Magyar Fejlesztési Bk Zrt.DL-Notes 2023(28) 2021(26/Und.)	XS2630760796 XS2362785656	200 200	200 0	0 0	99,932000 89,895000	186.344,69 167.628,55	0,08 0,07
Minsur S.A.DL-Notes 2021(21/31) 144A	US60447KAB61	200	0	0	86,569000	161.426,51	0,07
Namibia, Republic ofDL-Notes 2015(25) Reg.S	XS1311099540	200	0	0	94,980000	177.110,62	0,07
NBK Tier I Financing (2) Ltd.DL-FLR Cap. Secs 2019(25/Und.)	XS2010037922	200	0	0	92,202000	171.930,45	0,07
NCR Corp.DL-Notes 2019(19/29) 144A	US62886EAV02	225	0	245	99,476000	208.681,18	0,08
Neptune Energy Bondco PLCDL-Notes 2018(18/25) 144A	US64073KAA16	250	250	0	98,536000	229.676,94	0,09
Novelis Corp.DL-Notes 2021(21/31) 144A	US670001AH91	65	0	0	83,011000	50.307,35	0,02
OneMain Finance Corp.DL-Notes 2021(21/27)	US682691AB63	310	0	0	85,469000	247.031,75	0,10
Ooredoo International FinanceDL-Med.-Term Nts 2021(31)Reg.S	XS2311299957	250	0	0	87,343000	203.587,25	0,08
OTP Bank Nyrt.DL-FLR Med.Term Nts 23(28/33)	XS2586007036	200	200	0	98,608000	183.875,81	0,07
Outfront Media Capit.LLC/Corp.DL-Notes 2020(20/25) 144A	US69007TAD63	487	0	0	100,345000	455.624,59	0,18
Owens-Brockway Glass Cont.Inc.DL-Notes 2023(23/31) 144A	US69073TAU79	90	90	0	102,340000	85.875,72	0,03
Parkland Corp.DL-Notes 2021(21/30) 144A	US70137WAL28	280	0	0	87,314000	227.942,01	0,09
PeruDL-Bonds 2010(50)	US715638BM30	320	0	0	101,600000	303.128,06	0,12
Prime Sec.Serv.Bor.LLC/Fin.IncDL-Notes 2020(20/28) 144A	US74166MAE66	496	0	0	93,531000	432.533,46	0,17
PT Bank Negara Indonesia TBKDL-FLR Notes 2021(27/Und.)	XS2385923722	200	200	0	81,817000	152.565,38	0,06
REC Ltd.DL-Med.-Term Nts 2023(28)Reg.S	US74947MAD48	200	200	0	99,725000	185.958,70	0,08
Royal Caribbean Cruises Ltd.DL-Notes 2021(21/28) 144A	US780153BG60	260	260	0	92,816000	224.998,00	0,09
Royal Caribbean Cruises Ltd.DL-Notes 2022(22/27) 144A	US780153BL55	100	100	0	109,191000	101.805,04	0,04
SeaWorld Parks & Entert. Inc.DL-Notes 2021(21/29) 144A	US81282UAG76	150	0	0	90,979000	127.237,42	0,05
Serbien, RepublikDL-Treasury Nts 2020(30) Reg.S	XS2264555744	310	0	200	76,359000	220.701,04	0,09
Shinhan Card Co. Ltd.DL-Notes 2022(27)	XS2427995001	200	0	0	90,409000	168.587,01	0,07
Sigma Alimentos S.A.DL-Notes 2016(16/26) Reg.S	USP8674JAE93	200	0	0	96,939000	180.763,60	0,07
Singtel Grp Treasury Pte Ltd.DL-Medium-Term Nts 2020(20/30)	XS2185867160	200	0	0	83,949000	156.540,95	0,06
Spectrum Brands Inc.DL-Notes 2020(20/30) 144A	US84762LAW54	284	0	200	91,723000	242.872,89	0,10
Star Ergy Geotherm.(WayangW.)DL-Notes 2018(18/18-33) Reg.S *)	USG84393AC49	232	0	0	79,523264	172.014,33	0,07
Stillwater Mining Co. DL-Notes 2021(25/29) Reg.S	USU85969AF71	210	0	0	79,911000	156.461,80	0,06
Summit Materials LLC/Summit MaDL-Notes 2020(20/29) 144A	US86614RAN70	495	0	0	95,103000	438.916,46	0,18
Suzano Austria GmbHNotes 2021-2032	US86964WAK80	141	0	0	79,442000	104.436,36	0,04
Sweihsan PV Power Company PJSCDL-Bonds 2022(22/22-49) Reg.S *)	XS2382853641	200	0	0	78,808380	146.955,16	0,06
Taylor Morrison Communit.Inc.DL-Notes 2019(19/27) 144A	US87724RAA05	167	0	0	98,152000	152.826,29	0,06
Tencent Holdings Ltd.DL-Med.-T. Nts 21(21/51) Reg.S	US88032XBC74	310	0	0	73,667000	212.920,33	0,09
Tenet Healthcare Corp.DL-Notes 2022(22/30) 144A	US88033GDP28	255	255	0	97,917000	232.798,80	0,09
TopBuild Corp.DL-Notes 2021(21/32) 144A	US89055FAC77	70	0	0	85,238000	55.630,60	0,02
Total Play Telecom. S.A. de C.V.Notes 2020/2025 - 144A	US89157FAA84	385	0	0	71,145000	255.380,40	0,10
TSMC Arizona Corp.DL-Notes 2022(22/52)	US872898AJ06	200	0	0	94,611000	176.422,54	0,07
Tupy Overseas S.A.DL-Notes 2021(21/31) Reg.S	USL9326VAB29	200	0	0	79,495000	148.235,51	0,06
Uniti G.LP/Fib.HI./G.F.19/CSLDL-Notes 2021(21/30) 144A	US91327AAB89	250	0	0	62,750000	146.263,58	0,06
Uniti G.LP/Fib.HI./G.F.19/CSLDL-Notes 2023(23/28) 144A	US91327TAA97	30	30	0	98,470000	27.542,77	0,01
US Foods Inc.DL-Notes 2021(21/29) 144A	US90290MAD39	270	100	250	92,444000	232.715,30	0,09
Viking Cruises Ltd.DL-Notes 2020(22/25) 144A	US92676XAE76	200	200	0	105,727000	197.150,72	0,08
Western Global Airlines LLCDL-Notes 2020(20/25) 144A	US958278AA10	393	0	0	7,100000	26.015,57	0,01
Windstr.Esc.LLC/Esc.Fin.Corp.DL-Notes 2020(20/28) 144A	US97382WAA18	200	200	0	83,522000	155.744,72	0,06
<b>Andere Wertpapiere in CHF</b>							
ROCHE HOLDING AGInhaber-Genußscheine o.N.	CH0012032048	4.136	0	288	292,800000	1.244.497,79	0,50

\*) Kurs inkl. Indexratio / Inflationsfaktor

Gattungsbezeichnung	ISIN	Bestand 04.06.23 Stücke / Anteile / Nominale in 1.000	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs in WP-Whg	Kurswert in EUR	% des FV
<b>Inflation Linked in EUR</b>							
Bundesrep.DeutschlandInflationsindex. Anl.v.15(26) *)	DE0001030567	717	0	211	121,460060	870.868,63	0,35
<b>Zertifikate auf Rohstoffe in EUR</b>							
Amundi Physical Metals PLCETC 23.05.18 Physical Gold	FR0013416716	14.935	3.758	7.824	72,770000	1.086.819,95	0,44
<b>Summe der börsengehandelten Wertpapiere</b>						<b>107.395.651,35</b>	<b>43,43</b>
<b>Frei handelbare Wertpapiere</b>							
<b>Aktien in EUR</b>							
KERRY GROUP PLCRegistered Shares A EO - ,125	IE0004906560	8.015	2.145	600	92,460000	741.066,90	0,30
Prysmian S.p.A.Azioni nom. EO 0,10	IT0004176001	4.897	2.459	0	36,500000	178.740,50	0,07
Snam S.p.A.Azioni nom. o.N.	IT0003153415	38.683	38.683	0	4,979000	192.602,66	0,08
<b>Aktien in AUD</b>							
Bluescope Steel Ltd.Registered Shares o.N.	AU000000BSLO	33.273	0	2.032	19,590000	401.910,27	0,16
Brambles Ltd.Registered Shares o.N.	AU000000BXB1	2.673	2.673	0	13,380000	22.052,50	0,01
CSL LTD.Registered Shares o.N.	AU000000CSL8	3.667	0	257	308,000000	696.408,93	0,28
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD.Registered Shares o.N.	AU000000NAB4	34.200	0	2.414	25,790000	543.851,28	0,22
TRANSURBAN GROUPTriple Stapled Securities o.N.	AU000000TCL6	56.186	0	3.967	14,620000	506.498,53	0,20
Woolworths Group Ltd.Registered Shares o.N.	AU000000WOW2	19.479	0	1.189	37,550000	451.002,87	0,18
<b>Aktien in CAD</b>							
CANADIAN IMPERIAL BK OF COMM.Registered Shares o.N.	CA1360691010	22.700	0	1.300	57,360000	902.962,55	0,37
CANADIAN NATIONAL RAILWAY CO.Registered Shares o.N.	CA1363751027	1.700	1.000	0	157,980000	186.245,49	0,08
<b>Aktien in HKD</b>							
AIA Group LtdRegistered Shares o.N.	HK0000069689	65.400	0	4.200	78,000000	606.855,86	0,25
Hongkong Exch. + Clear. Ltd.Registered Shs (BL 100) o.N.	HK0388045442	9.600	0	200	302,400000	345.355,37	0,14
<b>Aktien in JPY</b>							
Astellas Pharma Inc.Registered Shares o.N.	JP3942400007	53.600	0	3.600	2.229,000000	797.600,41	0,32
HITACHI LTD.Registered Shares o.N.	JP3788600009	14.600	2.700	600	8.297,000000	808.694,44	0,33
KDDI CORP.Registered Shares o.N.	JP3496400007	25.500	0	2.000	4.407,000000	750.228,82	0,30
KOMATSU LTD.Registered Shares o.N.	JP3304200003	28.200	28.900	700	3.347,000000	630.108,49	0,25
KUBOTA CORP.Registered Shares o.N.	JP3266400005	12.400	10.200	1.300	1.985,500000	164.362,25	0,07
MITSUBISHI ELECTRIC CORP.Registered Shares o.N.	JP3902400005	59.000	0	4.000	1.903,000000	749.551,21	0,30
MITSUBISHI ESTATE CO. LTD.Registered Shares o.N.	JP3899600005	62.000	12.300	3.400	1.674,500000	693.086,36	0,28
Mitsubishi UFJ Finl Grp Inc.Registered Shares o.N.	JP3902900004	121.500	0	8.300	969,300000	786.221,65	0,32
NINTENDO CO. LTD.Registered Shares o.N.	JP3756600007	17.000	16.200	1.000	6.050,000000	686.617,40	0,28
NIPPON TEL. AND TEL. CORP.Registered Shares o.N.	JP3735400008	27.400	0	1.800	4.040,000000	738.996,60	0,30
SEKISUI HOUSE LTD.Registered Shares o.N.	JP3420600003	33.000	0	2.100	2.746,500000	605.067,82	0,24
Seven & I Holdings Co. Ltd.Registered Shares o.N.	JP3422950000	17.500	0	3.700	5.995,000000	700.386,47	0,28
Sony Group Corp.Registered Shares o.N.	JP3435000009	11.400	0	500	13.550,000000	1.031.227,91	0,42
Tokio Marine Holdings Inc.Registered Shares o.N.	JP3910660004	28.300	30.000	1.700	3.167,000000	598.335,83	0,24
TOKYO ELECTRON LTD.Registered Shares o.N.	JP3571400005	5.000	3.400	100	19.275,000000	643.390,88	0,26
TOYOTA MOTOR CORP.Registered Shares o.N.	JP3633400001	75.000	0	5.000	2.009,500000	1.006.143,17	0,41
<b>Aktien in SGD</b>							
DBS GROUP HOLDINGS LTD.Registered Shares SD 1	SG1L01001701	27.700	0	1.800	30,600000	586.243,39	0,24
<b>Aktien in USD</b>							
Adobe Inc.Registered Shares o.N.	US00724F1012	4.304	524	295	436,370000	1.751.094,57	0,71
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC.Registered Shares DL 1	US0091581068	4.571	620	940	281,040000	1.197.737,95	0,48
American Water Works Co. Inc.Registered Shares DL -,01	US0304201033	10.664	0	923	145,790000	1.449.540,40	0,59
AMGEN INC.Registered Shares DL -,0001	US0311621009	4.933	0	347	218,070000	1.002.973,58	0,41
AT & T Inc.Registered Shares DL 1	US00206R1023	72.742	0	5.137	15,210000	1.031.565,73	0,42
BANK OF AMERICA CORP.Registered Shares DL 0,01	US0605051046	34.901	0	8.786	28,710000	934.229,37	0,38
BECTON, DICKINSON & CO.Registered Shares DL 1	US0758871091	5.452	0	384	251,790000	1.279.902,18	0,52

\*) Kurs inkl. Indexratio / Inflationsfaktor

Gattungsbezeichnung	ISIN	Bestand 04.06.23	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs in WP-Whg	Kurswert in EUR	% des FV
		Stücke / Anteile / Nominale in 1.000					
<b>Aktien in USD (Fortsetzung)</b>							
Bk of New York Mellon Corp., The Registered Shares DL -,01	US0640581007	34.052	35.572	1.520	42,740000	1.356.936,72	0,55
BORGWARNER INC. Registered Shares DL -,01	US0997241064	22.207	0	1.565	47,680000	987.207,83	0,40
BOSTON SCIENTIFIC CORP. Registered Shares DL -,01	US1011371077	22.839	23.427	588	51,820000	1.103.460,89	0,45
CARDINAL HEALTH INC. Registered Shares o.N.	US14149Y1082	13.861	0	5.476	84,590000	1.093.190,98	0,44
CISCO SYSTEMS INC. Registered Shares DL-,001	US17275R1023	39.499	8.744	2.406	50,020000	1.842.095,92	0,74
Comcast Corp. Reg. Shares Class A DL -,01	US20030N1019	28.210	28.799	589	39,190000	1.030.767,70	0,42
CVS Health Corp. Registered Shares DL-,01	US1266501006	8.659	9.268	609	69,990000	565.049,10	0,23
DANAHER CORP. Registered Shares DL -,01	US2358511028	6.045	1.539	393	234,620000	1.322.341,99	0,53
DEERE & CO. Registered Shares DL 1	US2441991054	4.006	174	267	371,070000	1.385.955,36	0,56
EBAY INC. Registered Shares DL -,001	US2786421030	15.303	0	1.079	44,390000	633.350,59	0,26
ELECTRONIC ARTS INC. Registered Shares DL -,01	US2855121099	10.383	0	731	127,670000	1.235.930,83	0,50
FEDEX CORP. Registered Shares DL -,10	US31428X1063	5.369	0	327	221,740000	1.109.992,13	0,45
GILEAD SCIENCES INC. Registered Shares DL -,001	US3755581036	14.492	0	9.863	77,890000	1.052.428,21	0,43
HARTFORD FINL SVCSGRP INC., THE Registered Shares DL -,01	US4165151048	16.781	0	1.182	70,550000	1.103.817,58	0,45
Hershey Co., The Registered Shares DL 1,-	US4278661081	7.455	0	524	260,910000	1.813.513,64	0,73
INTL BUSINESS MACHINES CORP. Registered Shares DL -,20	US4592001014	10.077	0	1.965	132,420000	1.244.134,39	0,50
INTL FLAVORS & FRAGRANCES INC. Registered Shares DL -,125	US4595061015	8.470	0	596	80,050000	632.160,27	0,26
JPMorgan Chase & Co. Registered Shares DL 1	US46625H1005	10.888	0	767	140,470000	1.425.982,34	0,58
LAM RESEARCH CORP. Registered Shares DL -,001	US5128071082	1.644	0	114	613,670000	940.630,72	0,38
MICRON TECHNOLOGY INC. Registered Shares DL -,10	US5951121038	16.345	0	1.153	69,170000	1.054.108,11	0,43
NIKE INC. Registered Shares Class B o.N.	US6541061031	8.886	0	626	107,780000	892.949,59	0,36
NVIDIA CORP. Registered Shares DL-,001	US67066G1040	5.373	0	377	393,270000	1.970.108,35	0,80
PEPSICO INC. Registered Shares DL -,0166	US7134481081	11.997	0	845	184,060000	2.058.801,75	0,83
PFIZER INC. Registered Shares DL -,05	US7170811035	37.085	0	2.618	38,360000	1.326.353,64	0,54
QUALCOMM INC. Registered Shares DL -,0001	US7475251036	7.860	0	3.168	115,620000	847.301,48	0,34
Salesforce Inc. Registered Shares DL -,001	US79466L3024	10.933	5.968	666	213,030000	2.171.513,67	0,88
Stanley Black & Decker Inc. Registered Shares DL 2,50	US8545021011	10.146	3.425	581	80,730000	763.681,49	0,31
STARBUCKS CORP. Reg. Shares DL -,001	US8552441094	11.178	0	787	99,500000	1.036.978,23	0,42
SYSCO CORP. Registered Shares DL 1	US8718291078	16.556	0	1.167	72,640000	1.121.279,05	0,45
TARGET CORP. Registered Shares DL -,0833	US87612E1064	8.457	8.929	472	133,220000	1.050.432,65	0,42
TJX COMPANIES INC. Registered Shares DL 1	US8725401090	15.886	0	6.027	78,110000	1.156.920,85	0,47
UNION PACIFIC CORP. Registered Shares DL 2,50	US9078181081	5.936	0	416	198,660000	1.099.478,59	0,44
United Rentals	US9113631090	2.804	0	195	361,600000	945.341,85	0,38
V.F. CORP. Registered Shares o.N.	US9182041080	24.059	12.317	1.653	18,120000	406.460,38	0,16
VERIZON COMMUNICATIONS INC. Registered Shares DL -,10	US92343V1044	33.855	8.096	2.359	34,580000	1.091.516,39	0,44
VISA Inc. Reg. Shares Class A DL -,0001	US92826C8394	10.819	708	731	228,790000	2.307.844,87	0,93
Walt Disney Co., The Registered Shares DL -,01	US2546871060	20.536	6.252	1.425	90,770000	1.737.963,47	0,70
Waste Management Inc. Registered Shares DL -,01	US94106L1098	8.759	1.320	522	164,960000	1.347.148,98	0,54
<b>Verzinsliche Wertpapiere in EUR</b>							
Nexi S.p.A. EO-Nts 2021 (21/29) Reg.S	XS2332590475	516	260	0	84,931000	438.243,96	0,18
Shiba Bidco S.p.A. EO-Notes 2021 (21/28) 144A	XS2397065504	125	0	0	86,712000	108.390,00	0,04
Volvo Car ABEO-Med.-Term Nts 2022 (22/28)	XS2486825669	225	0	0	95,040000	213.840,00	0,09
<b>Verzinsliche Wertpapiere in USD</b>							
Brasilien DL-Bonds 2014 (14/45)	US105756BW95	210	0	0	77,423000	151.590,42	0,06
Chile, Republik DL-Notes 2020 (31/32)	US168863DN50	250	0	0	86,189000	200.897,39	0,08
Dominikanische Republik DL-Bonds 2015 (45) Reg.S	USP3579EBE60	370	0	0	89,207000	307.739,41	0,12
DP World Ltd. DL-Med.-Term Nts 2007 (37) Reg.S	XS0308427581	100	0	100	108,528000	101.186,89	0,04
Indian Railway Fin. Corp. Ltd. DL-Notes 2017 (27)	XS1733877762	320	0	0	94,358000	281.521,23	0,11
Kolumbien, Republik DL-Bonds 2006 (37)	US195325BK01	150	0	0	93,929000	131.363,11	0,05
Mexiko DL-Med.-Term Notes 2012 (12/44)	US91086QBB32	450	0	0	84,808000	355.821,17	0,14
Mexiko DL-Notes 2017 (27)	US91087BAC46	250	0	0	98,305000	229.138,50	0,09
Paraguay, Republik DL-Bonds 2019 (19/48-50) Reg.S	USP75744AG08	200	0	0	85,027000	158.551,12	0,06
Peru DL-Bonds 2005 (25)	US715638AS19	180	0	0	105,210000	176.567,99	0,07
Teva Pharmac. Fin. NL III B.V. DL-Notes 2016 (16/26)	US88167AAE10	100	0	200	90,410000	84.294,44	0,03
Uruguay, Republik DL-Bonds 2014 (48-50)	US760942BA98	200	0	0	98,792000	184.218,92	0,07
Uruguay, Republik DL-Bonds 2022 (22/32-34)	US760942BE11	52	52	0	109,590000	52.931,80	0,02
Uruguay, Republik DL-Notes 2003 (33)	US917288BA96	120	0	0	124,357000	139.134,21	0,06
<b>Summe der frei handelbaren Wertpapiere</b>						<b>75.979.421,73</b>	<b>30,72</b>

Gattungsbezeichnung	ISIN	Bestand 04.06.23	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs in WP-Whg	Kurswert in EUR	% des FV
		Stücke / Anteile / in 1.000	Nominale				
<b>Investmentzertifikate in EUR</b>							
AIS-AM.IDX MSCI EUR.SRI PABAct. Nom. IE EUR Dis. oN	LU1861136593	559	344	341	1.390,030000	776.645,90	0,31
AIS-AM.IDX MSCI USA SRI PABAct. Nom. DR AH EUR Acc. oN	LU1861136247	44.274	18.490	81.124	90,580000	4.010.338,92	1,62
AIS-Amu.Idx MSCI Japan SRI PABAct.Nom.UC.E.DR EO Acc.oN	LU2233156749	20.496	25.589	29.553	46,445000	951.936,72	0,38
AIS-Amundi MSCI EM SRI PABAct. Nom. IE EUR Acc. oN	LU1861137724	3.658	1.949	3.772	1.059,650000	3.876.199,70	1,57
AIS-Amundi MSCI EM SRI PABAct.Nom.U. ETF DR USD Acc. oN	LU1861138961	220.208	0	0	48,780000	10.741.746,24	4,34
AIS-MSCI PAC.X JPN SRI PABNamens-Anteile IE (C) o.N.	LU0390718863	338	946	608	2.627,280000	888.393,71	0,36
Amundi Öko Sozial Euro Corp. Bond Miteigentumsanteile - Ausschüttend	AT0000706734	95.515	17.393	24.041	111,940000	10.691.949,10	4,32
Amundi Öko Sozial Euro Government Bond A	AT0000856026	2.659.538	409.892	44.658	6,650000	17.685.927,70	7,15
AMUNDI OPTIRENDITE(T)	AT0000A05TK3	4.486	21.049	33.715	114,860000	515.261,96	0,21
<b>Summe der Investmentzertifikate</b>						<b>50.138.399,95</b>	<b>20,28</b>
<b>Summe Wertpapiervermögen</b>						<b>233.513.473,03</b>	<b>94,43</b>
<b>Derivate</b> (Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen)							
<b>Wertpapier-Terminkontrakte</b>							
<b>Wertpapier-Terminkontrakte auf Renten</b>							
FBTP JUN/23 FT	EUR	-4				-23.000,00	-0,01
FGBL SEP/23 FT	EUR	38				-3.040,00	0,00
FGBM SEP/23 FT	EUR	17				-3.060,00	0,00
<b>Summe der Wertpapier-Terminkontrakte</b>						<b>-29.100,00</b>	<b>-0,01</b>
<b>Aktienindex-Derivate</b>							
<b>Aktienindex-Terminkontrakte</b>							
FESX JUN/23 FT	EUR	-1				-2.565,00	0,00
FESX JUN/23 FT	EUR	-1				-2.600,00	0,00
FESX JUN/23 FT	EUR	-2				-5.170,00	0,00
FESX JUN/23 FT	EUR	-1				-2.575,00	0,00
FESX JUN/23 FT	EUR	-3				-7.785,00	0,00
FESX JUN/23 FT	EUR	-1				-2.605,00	0,00
FESX JUN/23 FT	EUR	-1				-2.597,50	0,00
FESX JUN/23 FT	EUR	-1				-2.607,50	0,00
FESX JUN/23 FT	EUR	-1				-2.555,00	0,00
FESX JUN/23 FT	EUR	-1				-2.545,00	0,00
FESX JUN/23 FT	EUR	-2				-5.070,00	0,00
FESX JUN/23 FT	EUR	-2				-5.055,00	0,00
FESX JUN/23 FT	EUR	-5				-16.750,00	-0,01
FESX JUN/23 FT	EUR	-3				-210,00	0,00
FESX JUN/23 FT	EUR	-3				-480,00	0,00
MSP5 JUN/23 FT	USD	-1				-18.539,93	-0,01
MSP5 JUN/23 FT	USD	-1				-18.565,57	-0,01
MSP5 JUN/23 FT	USD	-1				-18.542,26	-0,01
MSP5 JUN/23 FT	USD	-1				-18.544,59	-0,01
MSP5 JUN/23 FT	USD	-1				-18.553,91	-0,01
MSP5 JUN/23 FT	USD	-1				-18.551,58	-0,01
MSP5 JUN/23 FT	USD	-1				-18.546,92	-0,01
MSP5 JUN/23 FT	USD	-1				-7.913,38	0,00
MSP5 JUN/23 FT	USD	-1				-6.712,97	0,00
NKJP JUN/23 FT	JPY	-18				-241.834,86	-0,10
NKJP JUN/23 FT	JPY	-3				-47.766,14	-0,02
<b>Summe der Aktienindex-Derivate</b>						<b>-495.242,11</b>	<b>-0,20</b>
<b>Devisen-Derivate</b>							
<b>Devisenterminkontrakte (Verkauf)</b>							
<b>Offene Positionen</b>							
USD/EUR 19.80 Mio.						-517.288,85	-0,21

			Kurswert in EUR	% des FV
<b>Währungskontrakte</b>				
EUBP JUN/23 FT	GBP	2	-8.815,83	0,00
EUBP JUN/23 FT	GBP	8	-35.263,31	-0,01
EUJP JUN/23 FT	JPY	-7	-40.072,15	-0,02
URO JUN/23 FT	USD	15	10.926,06	0,00
URO JUN/23 FT	USD	13	9.241,99	0,00
URO JUN/23 FT	USD	38	25.686,45	0,01
URO JUN/23 FT	USD	4	-10.931,89	0,00
URO JUN/23 FT	USD	10	-40.266,19	-0,02
URO JUN/23 FT	USD	2	-7.377,28	0,00
URO JUN/23 FT	USD	3	-11.048,44	0,00
<b>Summe der Devisen-Derivate</b>			<b>-625.209,44</b>	<b>-0,25</b>
<b>Bankguthaben</b>				
<b>EUR - Guthaben</b>				
	EUR	3.452.809,58	3.452.809,58	1,40
	EUR	768.038,52	768.038,52	0,31
<b>Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen</b>				
	DKK	6.834.259,00	917.547,26	0,37
	NOK	868.039,71	73.463,08	0,03
	SEK	676.323,71	58.535,89	0,02
<b>Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen</b>				
	AUD	177.556,34	109.481,03	0,04
	CAD	277.672,14	192.560,43	0,08
	CHF	641.622,46	659.359,22	0,27
	CNY	17.231,22	2.270,79	0,00
	GBP	302.148,09	351.641,65	0,14
	HKD	707.820,67	84.204,72	0,03
	JPY	79.382.487,73	529.950,39	0,21
	MXN	10.072,89	537,18	0,00
	SGD	98.154,83	67.887,28	0,03
	USD	6.940.540,53	6.471.064,78	2,62
<b>Collaterals 1)</b>				
	EUR	110.000,00	110.000,00	0,04
	EUR	600.000,00	600.000,00	0,24
<b>Summe der Bankguthaben</b>			<b>14.449.351,80</b>	<b>5,84</b>
<b>Swaps</b>				
<b>Credit Default Swap</b>				
CDX-EMS39V1-5Y AUS00795			30.340,51	0,01
CDX-EMS39V1-5Y AUS00795			13.791,14	0,01
CDX-EMS39V1-5Y AUS00795			13.791,14	0,01
CDX-EMS39V1-5Y AUS00795			13.791,14	0,01
CDX-EMS39V1-5Y AUS00795			13.791,14	0,01
CDX-NAHYS40V1-5Y AUS00795			-178.722,19	-0,07
CDX-NAHYS40V1-5Y AUS00795			-5.585,07	0,00
CDX-NAHYS40V1-5Y AUS00795			-5.585,07	0,00
ITRAXX-XOVERS39V1-5Y AUS00795			-151.612,32	-0,06
<b>Summe der Swaps</b>			<b>-255.999,58</b>	<b>-0,10</b>
<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>				
Zinsansprüche			482.587,65	0,20
Dividendenansprüche			300.425,82	0,12
<b>Summe sonstige Vermögensstände</b>			<b>783.013,47</b>	<b>0,32</b>
<b>Abgrenzungen Verbindlichkeiten</b>				
Verwaltungsvergütung			-48.766,47	-0,02
<b>Summe der Abgrenzungen Verbindlichkeiten</b>			<b>-48.766,47</b>	<b>-0,02</b>
<b>Fondsvermögen</b>			<b>247.291.520,70</b>	<b>100,00</b>

**Ausschüttungsanteile AT0000A1KTU5**  
**Anteilswert**

**STK** 2.874.051,08  
**EUR** 84,31

**Thesaurierungsanteile mit KEST-Abzug AT0000A2QMH2**  
**Anteilswert**

**STK** 52.479,11  
**EUR** 94,96

#### 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.

<b>Devisenkurse</b>			<b>per 5.6.2023</b>
Australischer Dollar	AUD	1,621800	= 1 Euro (EUR)
Real	BRL	5,316100	= 1 Euro (EUR)
Kanadischer Dollar	CAD	1,442000	= 1 Euro (EUR)
Schweizer Franken	CHF	0,973100	= 1 Euro (EUR)
Renminbi Yuan	CNY	7,588200	= 1 Euro (EUR)
Dänische Krone	DKK	7,448400	= 1 Euro (EUR)
Pfund Sterling	GBP	0,859250	= 1 Euro (EUR)
Hongkong-Dollar	HKD	8,405950	= 1 Euro (EUR)
Rupiah	IDR	16.077,525250	= 1 Euro (EUR)
Indische Rupie52	INR	88,284300	= 1 Euro (EUR)
Yen	JPY	149,792300	= 1 Euro (EUR)
Mexikanischer Peso	MXN	18,751400	= 1 Euro (EUR)
Norwegische Krone	NOK	11,816000	= 1 Euro (EUR)
Rubel	RUB	87,198350	= 1 Euro (EUR)
Schwedische Krone	SEK	11,554000	= 1 Euro (EUR)
Singapur-Dollar	SGD	1,445850	= 1 Euro (EUR)
US-Dollar	USD	1,072550	= 1 Euro (EUR)

1) Erläuterung zum Ausweis gemäß der delegierten Verordnung (EU) Nr. 2016/2251 zur Ergänzung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 des Europäischen Parlaments und des Rates über OTC-Derivate, zentrale Gegenparteien und Transaktionsregister durch technische Regulierungsstandards zu Risikominderungstechniken für nicht durch eine zentrale Gegenpartei gelearnte OTC-Derivatekontrakte:

2) In Höhe der positiven Bewertung der OTC-Derivate hält der Fonds Sicherheiten in Form von Barmitteln von der Citigroup GI. Markets Europe AG Frankf.

3) In Höhe der positiven Bewertung der OTC-Derivate hält der Fonds Sicherheiten in Form von Barmitteln von der BOFA Sec. Europe SA Paris.

#### 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  
(Marktzuordnung zum Berichtsstichtag)**

Gattungsbezeichnung	ISIN	Whg.	Käufe/Zugänge Stücke / Anteile / Nominale in 1.000	Verkäufe/Abgänge
<b>Aktien</b>				
ANZ Group Holdings Ltd.Registered Shares Def. o.N.	AU0000261372	AUD	32.336	32.336
CHINA OV.LAND & INV. LTD.Registered Shares o.N.	HK0688002218	HKD	233.500	233.500
Linde plcRegistered Shares EO -,001	IE000S9YS762	EUR	3.083	3.083
PNC FINANCIAL SERVICES GROUPRegistered Shares DL 5	US6934751057	USD	5.710	5.710
Truist Financial Corp.Registered Shares DL 5	US89832Q1094	USD	26.717	26.717
AIR LIQUIDE-SA ET.EXPL.P.G.CL.Actions Port. EO 5,50	FR0000120073	EUR	519	957
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN S.A.Actions au Porteur (C.R.) EO 4	FR0000125007	EUR	1.259	2.550
EuroAPI SASActions Nom. EO 1	FR0014008VX5	EUR	0	1
Koninklijke Philips N.V.Aandelen aan toonder EO 0,20	NL0000009538	EUR	0	17.659
Linde PLCRegistered Shares EO 0,001	IE00BZ12WP82	EUR	323	3.326
Siemens Gamesa Renew. En. S.A.Acciones Port. EO -,17	ES0143416115	EUR	3.701	7.874
UBS GROUP AG SF -,10	CH0244767585	CHF	0	44.297
GN STORE NORD ASNavne-Aktier DK 1	DK0010272632	DKK	0	11.116
Orsted A/SIndehaver Aktier DK 10	DK0060094928	DKK	454	7.193
PERSIMMON PLCRegistered Shares LS -,10	GB0006825383	GBP	0	21.187
Link Real Estate Investment TrRegistered Units o.N.	HK0823032773	HKD	0	93.200
FUJITSU LTD.Registered Shares o.N.	JP3818000006	JPY	0	5.400
Sumitomo Mitsui Financ. GroupRegistered Shares o.N.	JP3890350006	JPY	0	18.400
Yamato Holdings Co. Ltd.Registered Shares o.N.	JP3940000007	JPY	0	26.200
AFFILIATED MANAGERS GROUP INC.Registered Shares o.N.	US0082521081	USD	0	7.397
Apple Inc.Registered Shares o.N.	US0378331005	USD	0	43.472
Bright Horizons Family Sol.IncRegistered Shares DL -,001	US1091941005	USD	0	8.712
CATERPILLAR INC.Registered Shares DL 1	US1491231015	USD	0	7.981
CHUBB LTD. SF 24,77	CH0044328745	USD	0	8.045
Citigroup Inc.Registered Shares DL -,01	US1729674242	USD	0	16.624
DARDEN RESTAURANTS INC.Registered Shares o.N.	US2371941053	USD	0	6.523
Elevance Health Inc.Registered Shares DL -,01	US0367521038	USD	0	3.795
General Motors Co.Registered Shares DL -,01	US37045V1008	USD	0	22.525
Live Nation Entertainment Inc.Registered Shares DL -,01	US5380341090	USD	0	14.071
MKS INSTRUMENTS INC.Registered Shares o.N.	US55306N1046	USD	6.103	13.445
Morgan StanleyRegistered Shares DL -,01	US6174464486	USD	0	10.000
Motorola Solutions Inc.Registered Shares DL -,01	US6200763075	USD	0	5.221
Zendesk Inc.Registered Shares DL -,01	US98936J1016	USD	0	6.594
<b>Investmentzertifikate</b>				
Amundi Central & Eastern Europe Bond (T)	AT0000764873	EUR	13.925	13.925
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>				
Bank Gospodarstwa KrajowegoEO-Medium-Term Nts 2016(26)	XS1403619411	EUR	200	200
Belden Inc.EO-Notes 2021(21/31) 144A	XS2367228561	EUR	220	220
Diebold Nixdorf Dutch Hldg BVEO-Notes 2022(22/25) 144A	XS2572122971	EUR	420	420
Diebold Nixdorf Inc.DL-Notes 2022(22/25) Reg.S	USU25317AB13	USD	118	118
Neinor Homes SAEO-Notes 2021(21/26) Reg.S	XS2332219612	EUR	313	313
OTP Bank Nyrt.EO-FLR Preferred MTN 22(25/26)	XS2560693181	EUR	100	100
Polen, RepublikDL-Notes 2022(27)	US857524AD47	USD	150	150
South Africa, Republic ofDL-Notes 2022(32)	US836205BC70	USD	200	200
Sunoco L.P./Sunoco Fin. Corp.DL-Notes 2022(22/30)	US86765LAZ04	USD	140	140
ADLER Real Estate AGAnleihe v.2018(2018/2026)	XS1713464524	EUR	0	100
Arcelik A.S.EO-Notes 2021(21/26) Reg.S	XS2346972263	EUR	0	100
ContourGlobal Power Hldgs S.A.EO-Notes 2020(20/26) 144A	XS2274815872	EUR	0	249
Diebold Nixdorf Dutch Hldg BVEO-Notes 2020(20/25) 144A	XS2206383080	EUR	0	408
Kroatien, RepublikEO-Notes 2019(29)	XS1843434876	EUR	0	290
Neinor Homes SAEO-Notes 2021(21/26) 144A	XS2332219703	EUR	0	313
Nordmazedonien, RepublikEO-Bonds 2021(27/28) Reg.S	XS2310118893	EUR	0	230
European Investment BankYC-Medium-Term Notes 2021(24)	XS2332164966	CNY	0	2.000
Kreditanst.f.WiederaufbauYC-Med.Term Nts. v.21(24)	XS2322827382	CNY	0	3.000
European Bank Rec. Dev.RP/DL-Medium-Term Nts 2017(22)	XS1734550897	IDR	0	3.200.000
Inter-American Dev. BankRP/DL-Med.-Term Notes 2016(23)	XS1377496457	IDR	0	3.000.000
Adani Green Energy (UP) Ltd.DL-Notes 2019(19/24) Reg.S	XS1854172043	USD	0	210
AIA Group LtdDL-Med.-T.Nts 2020(20/40)Reg.S	US00131MAK99	USD	0	200
Alb.Cos LLC/Safe.Inc/N.A.I./A.DL-Notes 2020(20/29) 144A	US013092AG61	USD	0	241
All.Univ.Holdco LLC/Fin.Corp.DL-Notes 2019(19/26) 144A	US019576AA51	USD	0	490
American Axle & Mfg Inc.DL-Notes 2018(18/27)	US02406PAU49	USD	0	444
Anadolu Efes Birac.M.ve G.S.ASDL-Notes 2021(21/28) Reg.S	XS2355105292	USD	0	200
Artera Services LLCSDL-Notes 2020(20/25) 144A	US73939VAA26	USD	0	545
Asbury Automotive Group Inc.DL-Notes 2020(20/30)	US043436AV64	USD	208	596
B3 S.A. - Brasil Bolsa BalcaoDL-Notes 2021(21/31) 144A	US11778EAAA7	USD	0	275
Bombardier Inc.DL-Notes 2021(21/26) 144A	US097751BV25	USD	0	55
BoS Funding Ltd.DL-Medium-Term Notes 2019(24)	XS2052951600	USD	0	250
BrasilienDL-Bonds 2020(20/30)	US105756CC23	USD	0	200

Gattungsbezeichnung	ISIN	Whg.	Käufe/Zugänge Stücke / Anteile / Nominale in 1.000	Verkäufe/Abgänge Stücke / Anteile / Nominale in 1.000
<b>Verzinsliche Wertpapiere (Fortsetzung)</b>				
Côte d'Ivoire, RepublikDL-Notes 2015(26-28) Reg.S	XS1196517434	USD	0	210
Cathay Pacif.MTN Fin.(HK) Ltd.DL-Medium-Term Notes 2021(26)	XS2333657422	USD	0	210
CDI Escrow Issuer Inc.DL-Notes 2022(22/30) 144A	US12511VAA61	USD	0	105
Cencosud S.A.DL-Notes 2015(15/25) Reg.S	USP2205JAK62	USD	0	250
CHS/Commun.Health Systems Inc.DL-Notes 2020(20/27) 144A	US12543DBG43	USD	0	498
CJSC Dvlpmnt Bk of KazakhstanDL-Med.-Term Nts 2021(31)Reg.S	XS2337670694	USD	0	200
Corp.Nacion.del Cobre de ChileDL-Notes 2020(20/30) Reg.S	USP3143NBH63	USD	0	240
Diebold Nixdorf Inc.DL-Notes 2020(20/25) 144A	US253657AA82	USD	0	115
Dominikanische RepublikDL-Bonds 2015(25) Reg.S	USP3579EBD87	USD	0	200
Fortune Star (BVI) Ltd.DL-Notes 2020(23/24)	XS2132420758	USD	0	200
GeorgienDL-Notes 2021(26) Reg.S	XS2334109423	USD	0	200
Gol Finance S.A.DL-Notes 2020(22/26) 144A	US36254VAC28	USD	0	600
Greenko Dutch B.V.DL-Notes 2021(23/22-26) Reg.S	USN3700LAD75	USD	0	200
Industrias Peñoles S.A.B.de CVDL-Notes 2020(20/50) Reg.S	USP55409AC34	USD	0	240
Inversiones CMPC S.A.DL-Notes 2020(20/30) Reg.S	USP58072AS10	USD	0	200
JD.com Inc.DL-Notes 2016(16/26)	US47215PAC05	USD	0	250
Joseph T. Ryerson & Son Inc.DL-Notes 2020(20/28) 144A	US48088LAB36	USD	0	312
JSC NC Kazakhstan Temir ZholyDL-Notes 2012(42) Reg.S	XS0799658637	USD	0	210
Kasikornbank PCLDL-FLR Med.-T.Nts 19(26/31)	XS2056558088	USD	0	200
KB Kookmin Card Co.Ltd.DL-Notes 2021(26)	XS2332357099	USD	0	210
Kolumbien, RepublikDL-Bonds 2004(24)	US195325BD67	USD	0	180
Koppers Inc.DL-Notes 2017(17/25) 144A	US500605AH33	USD	0	365
Logan Merger Sub Inc.DL-Notes 2020(23/27) 144A	US541056AA53	USD	0	502
Lumen Technologies Inc.DL-Debts 1998(98/28) Ser.G	US156686AM96	USD	0	145
MARB BondCo PLCDL-Notes 2021(26/31) Reg.S	USG5825AAC65	USD	0	200
Millicom Intl Cellular S.A.DL-Notes 2020(20/31) Reg.S	USL6388GHX18	USD	0	200
Mineral Resources Ltd.DL-Notes 2022(22/27) 144A	US603051AC70	USD	0	60
Mineral Resources Ltd.DL-Notes 2022(22/30) 144A	US603051AD53	USD	0	60
Minerva Luxembourg S.A.DL-Notes 2021(21/31) 144A	US603374AF69	USD	0	340
Minerva Luxembourg S.A.DL-Notes 2021(21/31) Reg.S	USL6401PAJ23	USD	0	200
MTN (Mauritius) Invest. Ltd.DL-Notes 2014(24) Reg.S	XS1128996425	USD	0	200
Natura & Co Lux.Holdings SàrlDL-Notes 2022(22/29) Reg.S	USL6S52VAA02	USD	0	200
Network i2i Ltd.DL-FLR Secs 2021(26/Und.)Reg.S	USV6703DAC84	USD	0	250
Nielsen Finance LLC/Co.DL-Notes 2021(21/29) 144A	US65409QBH48	USD	0	75
Nielsen Finance LLC/Co.DL-Notes 2021(21/31) 144A	US65409QBK76	USD	0	75
Prosus N.V.DL-Notes 2020(20/51) Reg.S	USN7163RAQ67	USD	0	220
PT Bank Mandiri (Persero) TBKDL-Medium-Term Notes 2019(24)	XS1978319108	USD	0	200
PT Pelabuhan IndonesiaDL-Notes 2015(25) Reg.S	USY7133MAC39	USD	0	200
PT.Hyundai Motor Man.IndonesiaDL-Notes 2021(26)	XS2338042828	USD	0	200
QNB Finance Ltd.DL-Medium-Term Notes 2020(25)	XS2233188353	USD	0	220
REC Ltd.DL-Med.-Term Nts 2020(23)Reg.S	US74947MAC64	USD	0	200
Renewable Energy Group Inc.DL-Notes 2021(24/28) 144A	US75972AAD54	USD	0	290
Royal Capital B.V.DL-FLR Notes 2020(26/Und.)	XS2202749003	USD	0	200
Royal Caribbean Cruises Ltd.DL-Notes 2020(20/25) 144A	US780153AZ50	USD	100	229
Safehold Inc.DL-Notes 2019(19/24)	US45031UCF66	USD	0	394
Shinhan Bank Co. Ltd.DL-Med.-Term Nts 2021(26)Reg.S	US82460EAQ35	USD	0	210
SK Hynix Inc.DL-Notes 2021(31) Reg.S	USY8085FBD16	USD	0	200
South Africa, Republic ofDL-Notes 2017(47)	US836205AX27	USD	0	200
Star E.Geo.Da.II Ltd/Salak LtdDL-Notes 2020(29/38) Reg.S	USG8438NAB31	USD	0	210
Starwood Property Trust Inc.DL-Notes 2021(21/24) 144A	US85571BAW54	USD	0	30
Sunoco L.P./Sunoco Fin. Corp.DL-Notes 2021(21/30) 144A	US86765LAU17	USD	0	90
TBC Bank JSCDL-Notes 2019(24) Reg.S	XS1843434363	USD	0	200
Twitter Inc.DL-Notes 2022(22/30) 144A	US90184LAP76	USD	0	180
United Overseas Bank Ltd.DL-FLR Med.-T.Nts 17(23/Und.)	XS1699845068	USD	0	200
Vena Energy Capital Pte. Ltd.DL-Med.-Term Notes 2020(25)	XS2122900330	USD	0	200
VM Holding S.A.DL-Notes 2017(17/27) Reg.S	USP98118AA38	USD	0	200
Braskem Idesa S.A.P.I.DL-Notes 2021(21/32) Reg.S	USP1850NAB75	USD	0	210
<b>Andere Wertpapiere</b>				
Australia & N. Z. Bkg Grp Ltd. Anrechte	AU0000232860	AUD	2.179	2.179
Koninklijke Philips N.V. Anrechte	NL0015000VF4	EUR	0	17.659

Wien, am 20. September 2023

### Amundi Austria GmbH

Franck Jochaud du Plessix

Christian Mathern

Hannes Roubik

Alois Steinböck

# Bestätigungsvermerk

## Prüfungsurteil

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

Amundi ESG Income 3,  
Miteigentumsfonds gemäß Investmentfondsgesetz 2011 idgF (InvFG)

bestehend aus der Vermögensaufstellung zum 4. 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 4. 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 28. September 2023

Deloitte Audit Wirtschaftsprüfungs GmbH

Mag. Robert Pejhovský  
Wirtschaftsprüfer

## Steuerliche Behandlung

### des Amundi ESG Income 3

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

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

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

# Fondsbestimmungen

## Fondsbestimmungen für den

### **Amundi ESG Income 3**

#### gemäß InvFG 2011

Die Fondsbestimmungen für den Investmentfonds **Amundi ESG Income 3**, 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 UniCredit Bank Austria AG, Wien.

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

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

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

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

#### **Beschreibung des Veranlagungsschwerpunktes**

Der Investmentfonds veranlagt hauptsächlich, das heißt zu **mindestens 66 vH** des Fondsvermögens direkt oder indirekt über Investmentfonds in Anleihen (in Form von Wertpapieren und/oder Geldmarktinstrumenten), Aktien und diesen gleichwertigen Wertpapieren, welche die Kriterien eines nachhaltigen Investments erfüllen müssen. Dies wird dadurch gewährleistet, dass aufgrund von vordefinierten Ausschlusskriterien bestimmte Titel von der Veranlagung absolut ausgeschlossen werden und im Übrigen die Titelauswahl aufgrund der Bewertung nach Umwelt-, Sozial- und Governance – Kriterien (ESG) erfolgt, aus denen eine Gesamtbewertung ermittelt wird.

Die durch Direktanlagen in Aktien und aktienähnliche begebare Wertpapiere, über Derivate sowie indirekt über Investmentfonds repräsentierte Aktienquote beträgt je nach Markteinschätzung **bis zu 70 vH** des Fondsvermögens.

Zu Diversifikationszwecken kann bis zu **maximal 10 vH** des Fondsvermögens in Gold-Zertifikate veranlagt werden, wenn diese dem Erwerber keinen Herausgabeanspruch auf physisches Gold, sondern lediglich einen Zahlungsanspruch gegenüber dem Emittenten vermitteln.

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

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

##### **3.1. Wertpapiere**

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

##### **3.2. Geldmarktinstrumente**

Geldmarktinstrumente dürfen **bis zu 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 20 vH** des Fondsvermögens und **insgesamt bis zu 100 vH** des Fondsvermögens erworben werden, sofern diese (OGAW bzw. OGA) ihrerseits jeweils zu nicht mehr als 10 vH des Fondsvermögens in Anteile anderer Investmentfonds investieren.

Anteile an OGA dürfen **insgesamt bis zu 30 vH** des Fondsvermögens erworben werden.

### 3.5. Derivative Instrumente

Derivative Instrumente dürfen als Teil der Anlagestrategie **bis zu 34 vH** des Fondsvermögens (berechnet auf Basis der aktuellen Marktpreise) und zur Absicherung eingesetzt werden.

### 3.6. Risiko-Messmethode des Investmentfonds

Der Investmentfonds wendet folgende Risikomessmethode an:

#### Commitment Ansatz

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

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

### 3.7. Sichteinlagen oder kündbare Einlagen

Sichteinlagen und kündbare Einlagen mit einer Laufzeit von höchstens 12 Monaten dürfen **bis zu 34 vH** des Fondsvermögens gehalten werden.

Es ist kein Mindestbankguthaben zu halten.

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

### 3.8. Vorübergehend aufgenommene Kredite

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

### 3.9. Pensionsgeschäfte

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

### 3.10. Wertpapierleihe

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

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

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

## Artikel 4 Modalitäten der Ausgabe und Rücknahme

Die Berechnung des Anteilswertes erfolgt in EUR.

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

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

### 4.1. Ausgabe und Ausgabeaufschlag

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

Der Ausgabepreis ergibt sich aus dem Anteilswert zuzüglich eines Aufschlages pro Anteil in Höhe von **bis zu 3,00 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 entspricht dem Anteilswert. Es fällt kein Rücknahmeabschlag an.

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

## Artikel 5 Rechnungsjahr

Das Rechnungsjahr des Investmentfonds ist die Zeit vom 05.06. bis zum 04.06.

## Artikel 6 Anteilsgattungen und Ertragnisverwendung

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

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

#### **6.1. Ertragnisverwendung bei Ausschüttungsanteilscheinen (Ausschütter)**

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

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

Die Beträge sind an die Inhaber von Ausschüttungsanteilscheinen ab 31.07. des folgenden Rechnungsjahres auszuschütten, der Rest wird auf neue Rechnung vorgetragen.

Jedenfalls ist ab dem 31.07. der gemäß InvFG ermittelte Betrag auszuführen, 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 31.07. der gemäß InvFG ermittelte Betrag auszuführen, 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 31.07. des folgenden Rechnungsjahres.

Die Verwaltungsgesellschaft stellt durch Erbringung entsprechender Nachweise von den depotführenden Stellen sicher, dass die Anteilscheine im Auszahlungszeitpunkt nur von Anteilhabern gehalten werden können, die entweder nicht der inländischen Einkommen- oder Körperschaftsteuer unterliegen oder bei denen die Voraussetzungen für eine Befreiung gemäß § 94 des Einkommensteuergesetzes bzw. für eine Befreiung von der Kapitalertragsteuer vorliegen.

Werden diese Voraussetzungen zum Auszahlungszeitpunkt nicht erfüllt, ist der gemäß InvFG ermittelte Betrag durch Gutschrift des jeweils depotführenden Kreditinstituts auszuführen.

#### **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 **1,50 vH** des Fondsvermögens, die aufgrund des **Durchschnitts** der Fondsvermögenswerte je Preisberechnungstag bereinigt um allfällige dafür vorgenommene Abgrenzungen errechnet und monatlich in 12 Teilbeträgen angelastet 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\\_upreg](https://registers.esma.europa.eu/publication/searchRegister?core=esma_registers_upreg)<sup>1</sup>

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

1.2.1. Luxemburg Euro MTF Luxemburg

##### 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.

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

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

### 3. Börsen in außereuropäischen Ländern

- |       |              |  |
|-------|--------------|--|
| 3.1.  | Australien:  | Sydney, Hobart, Melbourne, Perth                 |
| 3.2.  | Argentinien: | Buenos Aires                                     |
| 3.3.  | Brasilien:   | Rio de Janeiro, Sao Paulo                        |
| 3.4.  | Chile:       | Santiago   |
| 3.5.  | China:       | Shanghai Stock Exchange, Shenzhen Stock Exchange |
| 3.6.  | Hongkong:    | Hongkong Stock Exchange                          |
| 3.7.  | Indien:      | Mumbai   |
| 3.8.  | Indonesien:  | Jakarta  |
| 3.9.  | Israel:      | Tel Aviv   |
| 3.10. | Japan:       | Tokyo, Osaka, Nagoya, Fukuoka, Sapporo           |
| 3.11. | Kanada:      | Toronto, Vancouver, Montreal                     |

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

3.12.	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.	Vereinigtes 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 ESG Income 3

**Unternehmenskennung (LEI-Code):** 213800M2ERS4I5W18D20

## 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 45,43% 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

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.



**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 **INDEX AMUNDI RATING D**. 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.

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 gewichtete durchschnittliche ESG-Score des Portfolios **0,62** (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](http://www.amundi.at) verfügbar ist.

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

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

- **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.

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

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

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

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

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

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

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

Die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und die UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte wurden in unsere ESG-Bewertungsmethodik integriert.

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

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

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

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



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

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

- **Ausschluss:** Amundi hat normative, tätigkeitsbasierte und sektorbasierte Ausschlussregeln definiert, die einige der wichtigsten nachteiligen Nachhaltigkeitsindikatoren abdecken, die in der Offenlegungsverordnung aufgeführt sind.
- **Integration von ESG-Faktoren:** Amundi hat Mindeststandards für die Integration von ESG-Faktoren festgelegt, die standardmäßig auf seine aktiv verwalteten offenen Fonds angewandt werden (Ausschluss von Emittenten mit G-Rating und besserer gewichteter durchschnittlicher ESG-Score als die anwendbare Benchmark). 38 Kriterien, die im ESG-Rating-Ansatz von Amundi verwendet werden, wurden ebenfalls entwickelt, um die wichtigsten Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren zu berücksichtigen.
- **Engagement:** Engagement ist ein kontinuierlicher und zielgerichteter Prozess, der darauf abzielt, die Aktivitäten oder das Verhalten von Unternehmen, in die investiert wird, zu beeinflussen. Das Ziel der Engagement-Aktivitäten kann in zwei Kategorien eingeteilt werden: einen Emittenten dazu zu bewegen, die Art und Weise, wie er die ökologische und soziale Dimension integriert, zu verbessern, einen Emittenten dazu zu bewegen,

seine Auswirkungen auf Umwelt-, Sozial- und Menschenrechtsfragen oder andere Nachhaltigkeitsfragen, die für die Gesellschaft und die Weltwirtschaft von Bedeutung sind, zu verbessern..

- **Abstimmen:** Die Abstimmungspolitik von Amundi beruht auf einer ganzheitlichen Analyse aller langfristigen Themen, die die Wertschöpfung beeinflussen können, einschließlich wesentlicher ESG-Themen. Weitere Informationen finden Sie in Amundis Abstimmungspolitik.
- **Überwachung von Kontroversen:** Amundi hat ein System zur Verfolgung von Kontroversen entwickelt, das sich auf drei externe Datenanbieter stützt, um Kontroversen und deren Schweregrad systematisch zu verfolgen. Dieser quantitative Ansatz wird dann durch eine eingehende Bewertung jeder schweren Kontroverse durch ESG-Analysten und die regelmäßige Überprüfung ihrer Entwicklung ergänzt. Dieser Ansatz gilt für alle Fonds von Amundi.

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



### Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

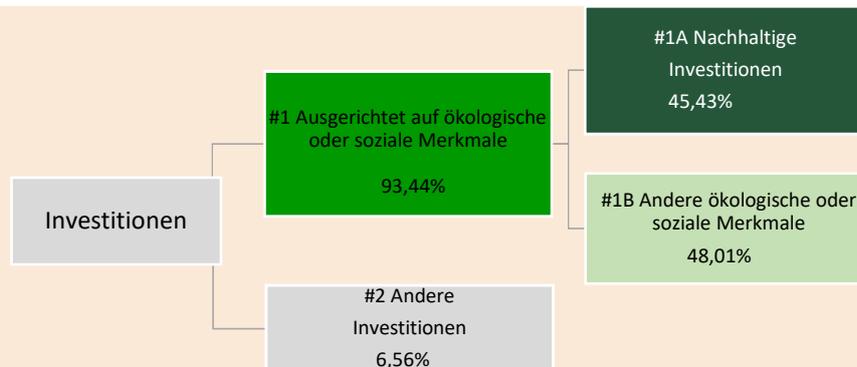
Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: **Von 05/06/2022 bis 04/06/2023**

<b>Größe Investitionen</b>	<b>Sektor</b>	<b>In % der Vermögenswerte</b>	<b>Land</b>
AMUNDI EURO GOVERNMENT BOND - AD	Investmentfonds	7,16%	AUT
AMUNDI OKO SOZIAL EURO CORPORATE BOND	Investmentfonds	4,33%	AUT
AMND MSCI EM SRI ETF(PAR)	Investmentfonds	4,33%	LUX
MICROSOFT CORP	IT	2,45%	USA
AMU INDEX MSCI USA SRI - UCITS ETF	Investmentfonds	1,62%	LUX
AMU IDX MSCI EMERG MKTS SRI PAB IEC	Investmentfonds	1,61%	LUX
DBR % 08/30 G	Schatzanleihen	1,45%	DEU
VISA INC -A	Finanzwesen	0,93%	USA
ADVANCED MICRO DEVICES	IT	0,92%	USA
SALESFORCE COM	IT	0,88%	USA
ELI LILLY & CO	Gesundheit	0,88%	USA
PEPSICO INC	Nicht-zyklische Konsumgüter	0,83%	USA
NVIDIA CORP	IT	0,80%	USA
HOME DEPOT INC	Zyklische Konsumgüter	0,80%	USA
CISCO SYSTEMS INC	IT	0,75%	USA



## 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
<b>Aktien</b>	<b>63,32%</b>
Materialien	3,34%
Industriewerte	8,60%
Zykl. Konsumgüter	6,62%
Nicht-Zykl. Konsumgüter	6,47%
Gesundheitswesen	9,37%
Finanzwesen	8,82%
Informationstechnologie	12,23%
Telekommunikation	4,73%
Versorger	1,56%
Immobilien	1,58%
<b>Anleihen</b>	<b>26,48%</b>
Staatsanleihen	10,11%
Staatsnahe Anleihen	7,54%

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

besicherte Anleihen	0,04%
Unternehmensanleihen	8,79%
<b>Bargeld</b>	<b>10,20%</b>



### 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)

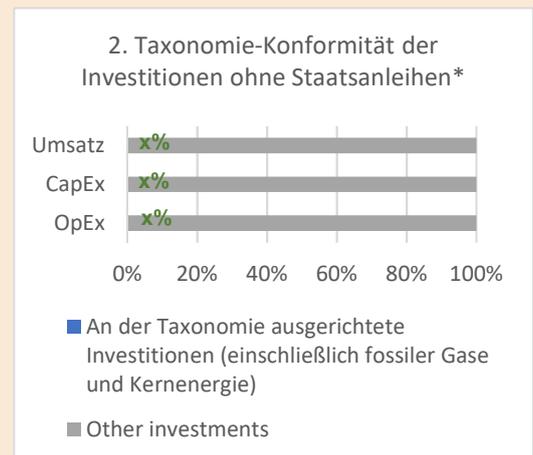
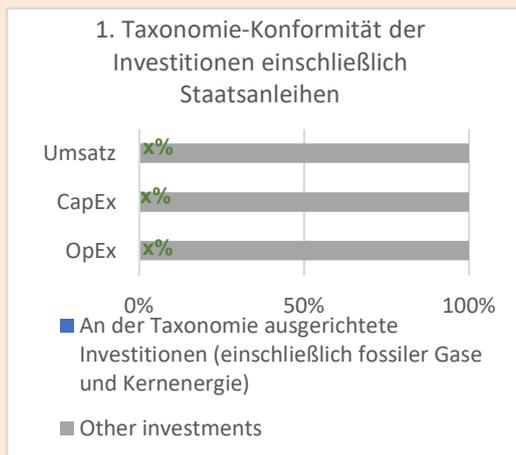
- **Wird mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie<sup>1</sup> investiert?**

Ja:
  In fossiles Gas
  In Kernenergie

Nein

<sup>1</sup>Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas  d/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels (Klimaschutz<sup>1</sup>) 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

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

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.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar ermö-

glichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen 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

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

- **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 betrug der Anteil der nachhaltigen Investitionen mit nicht an der Taxonomie ausgerichteten Umweltzielen 38,45%. 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. Sie 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.

In der Berichtsperiode war es notwendig, dass Wertpapiere aufgrund eines ESG Downgrades ESG-Downgrade aus dem Portfolio verkauft werden mussten.



## 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

- **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.