



Wien 1, Schwarzenbergplatz 3

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

Rechenschaftsbericht

über das Rechnungsjahr
16. Februar 2023 bis 15. Februar 2024

Inhaltsverzeichnis

Organe der Amundi Austria GmbH	3
Angaben zur Vergütungspolitik	4
Bericht an die Anteilhaber/innen	5
Anlagestrategie	5
Kapitalmarktentwicklung	6
Übersicht über die letzten drei Rechnungsjahre des Fonds	8
Ertragsrechnung und Entwicklung des Fondsvermögens	10
1. Wertentwicklung des Rechnungsjahres (Fonds-Performance)	10
2. Fondsergebnis.....	12
3. Entwicklung des Fondsvermögens	13
Vermögensaufstellung	14
Bestätigungsvermerk	24
Berechnung des Gesamtrisikos	26
Steuerliche Behandlung	27
Fondsbestimmungen	28
Anhang Artikel 8 der Offenlegungsverordnung	33

Organe der Amundi Austria GmbH

Aufsichtsrat

Matteo GERMANO (Vorsitzender)
Domenico AIELLO (stv. Vorsitzender) (von 21.9.2023 bis 28.11.2023)
Christophe LEMARIÉ (stv. Vorsitzender) (bis 31.8.2023)
Francesca CICERI (ab 15.12.2023)
Eli HANTGAN (bis 15.2.2024)
Elodie LAUGEL
Aurélia Marie Catherine Marguerite LECOURTIER-GÉGOUT (ab 16.2.2024)
(stv. Vorsitzender) (ab 12.4.2024)
Marion MORALES ALBINANA-ROSNER (bis 11.10.2023)
Christianus PELLIS
Mag. Karin PASEKA
Thomas GREINER
Beate SCHEIBER

Staatskommissär

Ministerialrätin Mag. Jutta RAUNIG (ab 1.6.2024)
Bundesministerium für Finanzen, Wien
Ministerialrätin Dr. Ingrid EHRENBÖCK-BÄR (bis 31.1.2024)
Bundesministerium für Finanzen, Wien
Amtdirektor Regierungsrat Josef DORFINGER, Stv.
Bundesministerium für Finanzen, Wien

Geschäftsführung

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

Depotbank

State Street Bank International GmbH, Filiale Wien

Prüfer

Deloitte Audit Wirtschaftsprüfungs GmbH

Angaben zur Vergütungspolitik

1.

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

2.

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

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

3.

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

4.

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

5.

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

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

Bericht an die Anteilhaber/innen

Sehr geehrte Anteilhaber/innen!

Wir legen nachstehend den Bericht des Amundi Öko Sozial Net Zero Ambition Bond, Miteigentumsfonds gemäß Investmentfondsgesetz 2011 idgF (InvFG) über das Rechnungsjahr vom 16. Februar 2023 bis 15. Februar 2024 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.

Per 24.11.2023 erfolgte die Zusammenlegung des **Amundi Öko Sozial Net Zero Ambition Bond**, mit dem ebenfalls durch die Amundi Austria GmbH verwalteten Fonds Amundi Euro Corporate Bond, Miteigentumsfonds gemäß Investmentfondsgesetz 2011 idgF (InvFG). Die Zusammenlegung erfolgte auf der Grundlage des § 3 Abs. 2 Z 15 lit a iVm Z 17 InvFG 2011 iVm den Bestimmungen der §§ 114 bis 126 InvFG 2011, als übertragene Übernahme mit dem Amundi Euro Corporate Bond als übertragendem und dem **Amundi Öko Sozial Net Zero Ambition Bond** als übernehmendem Fonds.

Anlagestrategie

Der Fonds verfolgt eine aktive Veranlagungsstrategie und orientiert sich an keinem Referenzwert. Der Öko Sozial Net Zero Ambition Bond investiert überwiegend in Unternehmen, die eine niedrige CO₂-Intensität aufweisen oder ambitionierte Pläne haben, diese entsprechend zu reduzieren. Dies hat zum Ziel, die Emissionsintensität des Portfolios niedrig zu halten und gleichzeitig in Unternehmen zu investieren, die der Veranlagung diese Arbeit abnehmen, indem sie selbst ihre Emissionen stark reduzieren. Wir haben vereinzelt Anleihen von Unternehmen im Einsatz, die USD denominiert sind, wobei die Währung entsprechend abgesichert ist. Was Sektoren angeht, ist die Veranlagung im Bereich „Energie“ und „Energieversorger“ stark untergewichtet, was auf die Ausschlusskriterien in Bezug auf fossile Brennstoffe und Verstromung fossiler Brennstoffe zurückzuführen ist. Was Unternehmensrisiko angeht sahen wir das wirtschaftliche Umfeld zwar als schwierig an, jedoch als geeignetes Umfeld für Unternehmensanleihen. Wir waren daher übergewichtet in BBB bewerteten sowie bei nachrangigen Anleihen. Wenige Prozentpunkte in High Yield Anleihen waren das Rechnungsjahr über ebenfalls im Portfolio. Ein recht großes Gewicht war im Telekom-Sektor veranlagt – ein Sektor, der Opportunitäten in unterschiedlichen (auch langen) Laufzeiten bietet sowie nachrangige Anleihen emittiert und gleichzeitig verhältnismäßig viele Unternehmen aufweist, die Emissionen im Einklang mit 1,5°C explizit anstreben. Wir waren aber auch in Konsumgüter investiert – ein Sektor, der durchaus verschiedene Herangehensweisen in Punkto Dekarbonisierung aufweist. Was den Transport-Sektor angeht, fokussierten wir uns auf Namen die mit Post/Infrastruktur zusammenhängen und mieden andere wie zB Fluglinien. Wir verwenden Derivate zur Absicherung von Zins- und Währungsrisiken sowie zur effizienten Portfoliosteuerung.¹⁾

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

Der Amundi Öko Sozial Net Zero Ambition Bond bewirbt in Artikel 8 der Offenlegungsverordnung dargelegte ökologische und soziale Merkmale und kann teilweise in Wirtschaftstätigkeiten investieren, die zu [einem] Umweltziel[en] beitragen. Gemäß Artikel 11 der Offenlegungsverordnung hat die Verwaltungsgesellschaft zu erläutern, inwieweit die ökologischen oder sozialen Merkmale erfüllt wurden. Diese entsprechende Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten finden Sie im Anhang.

Kapitalmarktentwicklung

Das vergangene Rechnungsjahr war von einer Fortsetzung der globalen Krisenherde gekennzeichnet (Krieg Russland/Ukraine, Spannungen USA/China, Maßnahmen zur Bekämpfung der Covid-Krise, etc.), die die Politik vor große Herausforderungen stellten. Die gestiegene Inflation sorgte vor allem bei Menschen mit geringerem Einkommen für Probleme. Gleichzeitig veranlasste sie die Notenbanken zu massiven Schritten zur Bekämpfung der Inflation, da die langfristigen Auswirkungen einer zu hohen Inflation auf die Wirtschaft extrem negativ wären. Die gestiegenen Zinsen konnten die Inflation zwar eindämmen, bereiteten aber naturgemäß dem Unternehmenssektor, vor allem im Bereich Immobilien, größere Sorgen. Die nachlassende Inflation gegen Ende des Jahres aufgrund der sich verlangsamenden Wirtschaft, lässt jedoch auf niedrigere Zinsen im Jahr 2024 hoffen, was sich bereits durch fallende Renditen im Anleihenbereich und steigende Aktienmärkte bemerkbar machte. So reagierten die Notenbanken, die am Anfang zu zögerlich gewesen waren, mit einer Fortsetzung ihrer Zinserhöhungspolitik auf die hohe Inflation. Im Juni 2022 erreichte die Inflation in den USA den höchsten Stand mit 9,1 %, die Fed erhöhte die Zinsen zwischen Juni 2022 und September 2023 von 1,75 % auf 5,5 %, wo sie bis jetzt stehen. Bis Ende des Jahres schwächte sich die Inflation wieder auf knapp über 3 % ab. Anders als in den USA erreichte die Inflation in der Eurozone ihren Höchststand erst im Oktober 2022 (10,6 %) und fiel sukzessive auf 2,4 % im November 2023, was nur mehr leicht über dem Zielwert von 2 % liegt. Von den im dritten Quartal getätigten Aussagen bezüglich einer länger andauernden Hochzinsphase, sind die Notenbanken im 4. Quartal abgerückt, vor allem die FED, welche sich mehr um eine sich abschwächende Wirtschaft sorgt, als nur um die Inflation. Die EZB vertritt zwar offiziell eine vorsichtigeren Sicht, wird sich jedoch dem Marktdruck bei einer schwachen Wirtschaftslage ebenfalls beugen müssen. Zumindest sieht das der Markt so, weshalb sich die Anleihenrenditen im Dezember nach unten angepasst haben. In Großbritannien stieg die Inflation bis zum Oktober 2022 sogar auf 11,1 % und lag im September 2023 immer noch bei 6,7 %. Erst im 4. Quartal gab es bis Ende November eine weitere Abkühlung auf 3,9 %. Inflationssteigernd wirkten die Folgen des Brexit zu Beginn des Jahres, dämpfend der Rückgang der Energiepreise sowie die sich abschwächende Wirtschaft gegen Ende des Jahres. In den USA blieb das Wirtschaftswachstum entgegen den Markterwartungen klar positiv, während das Wachstum in der Eurozone auf der Stelle trat. In den USA wurde vor allem zu Jahresbeginn 2023 vor einer Rezession gewarnt, da die Zinsstrukturkurve extrem negativ war und dies in der Vergangenheit ein sehr zuverlässiger Indikator für eine bevorstehende Rezession war. Zusätzlich wies eine Reihe von Früh- und Stimmungsindikatoren auf eine Abschwächung der Wirtschaft hin. Aufgrund der niedrigen Arbeitslosenrate in den USA (nach wie vor werden mehr offene Stellen angeboten als Jobs gesucht werden) blieben die Konsumausgaben stabil, die Schwäche kommt vor allem aus dem produzierenden Gewerbe und von den Investitionen, während der Dienstleistungssektor noch keine Zeichen von Schwäche zeigte und die Staatsausgaben sowie die Nettoexporte ebenfalls einen positiven Beitrag lieferten. Gegen Ende des Jahres schwächte sich das Wachstum allgemein ab, was dem hohen Zinsniveau geschuldet war. Die kurzfristigen Zinsen reagierten merklich auf die Zinserhöhungen der Notenbanken, die Renditen 2-jähriger Treasuries stiegen am Höhepunkt auf bis zu 5,2% im Oktober 2023, die Zinsen 2-jähriger deutscher Bundesanleihen auf bis zu 3,38% im September 2023. Gegen Ende des Jahres 2023 fielen die 2-jährigen Treasuries bis auf 4,25% und bei den 2-jährigen deutschen Bundesanleihen bis auf 2,4%. Die Staatsanleihenmärkte der USA und der Eurozone reagierten auf die Zinssteigerungen der Notenbanken mit deutlichen Kursverlusten zwischen Mai und Oktober 2023. Während des Jahres 2023 wurden die Rentenmärkte vor allem von der Frage bestimmt, wann das Ende des Zinserhöhungszyklus der Notenbanken erreicht wird (die sogenannte Terminal Rate) und ob die Notenbankzinsen aufgrund einer erwarteten Abschwächung der Wirtschaft 2024 im Laufe des Jahres 2024 die Zinsen wieder senken könnten. Die Antwort gab es dann im 4. Quartal in Form deutlich gefallener Renditen. Zehnjährige US-Staatsanleihen fielen vom Hoch im Oktober von 5,0 % im Oktober auf 3,9 % gegen Ende des Jahres. Das deutsche Pendant vom Hoch im Oktober von über 3 % auf 2,0 %. Euro-Unternehmensanleihen mit Investment Grade-Rating (+8,1 %) konnten Euro-Staatsanleihen (+6,7 %) seit Jahresbeginn um rund 1,4 % outperformen, da die Risikoaufschläge der Unternehmensanleihen aufgrund der relativ stabilen Lage der Wirtschaft um ca. 30 Basispunkte nachgaben. High Yield-Anleihen verzeichneten bei deutlich fallenden Risikoaufschlägen (ca. -100 Basispunkte) das beste Ergebnis mit +12,0 %. Globale Schwellenländeranleihen haben sich mit 7,5 % auf Eurobasis nur unwesentlich besser entwickelt als die Staatsanleihen der Industrieländer. Das lag auch daran, dass es global gesehen einige makroökonomische Unsicherheiten gab, die sich besonders negativ auf einige Schwellenländer auswirkten. Die Aktienmärkte weltweit haben im Rechnungsjahr mit 19,6 % in EUR positiv überrascht. Das lag an der bis zum Halbjahr noch positiven Wirtschaftslage plus einer Jahresendrallye, die den in 2024 antizipiert fallenden Zinsen geschuldet war. In der schwierigen Phase in der Mitte des Jahres konnten sich die Märkte in einer Seitwärtsphase zumindest stabilisieren.

Europa profitierte vor allem davon, dass es zu keiner Energieknappheit kam, da die Gasspeicher trotz Sanktionen gegen Russland gefüllt werden konnten und es unter anderem aufgrund des milden Winters zu einer Beruhigung und einer darauffolgenden Abschwächung der Energiepreise kam. Zusätzlich sorgte die günstige Bewertung der europäischen Aktienmärkte für Kapitalzuflüsse globaler Investoren. Der MSCI Europe konnte auf Jahressicht ein Plus von 15,8 % verzeichnen. Im März 2023 musste der US-Aktienmarkt einiges verkraften: den Kollaps der Silicon Valley Bank (sie wurde von der US-Bundeseinlagenversicherungsgesellschaft FDIC unter Zwangsverwaltung gestellt), eine Ausweitung der Krise auf die Signature Bank und die First Republic Bank sowie indirekt auch das Scheitern der Credit Suisse (die von UBS übernommen werden musste). Die US-Notenbank Federal Reserve richtete ein Bank Term Funding Program (BTFFP) ein, um qualifizierten Einlageninstituten Darlehen mit einer Laufzeit von bis zu einem Jahr zu gewähren, wenn sie qualifizierte Vermögenswerte als Sicherheiten hinterlegen. Um zu verhindern, dass noch mehr Banken von der Situation betroffen werden, griffen die globalen Regulierungsbehörden, darunter die Federal Reserve, die Bank of Canada, die Bank of England, die Bank of Japan, die Europäische Zentralbank und die Schweizerische Nationalbank ein, um außerordentliche Liquidität bereitzustellen. Ausschlaggebend für die Fortsetzung des Anstiegs des US-Aktienmarktes war zu einem Großteil die massive Outperformance der großen Mega-Caps im IT-Sektor und der großen Titel im zyklischen Konsumgüterbereich und im Segment Kommunikationsdienstleistungen. Viele dieser Unternehmen profitierten vom aufkommenden Hype um das Thema Künstliche Intelligenz (Artificial Intelligence, AI), das mittel- bis langfristig für einen zusätzlichen Wachstumsimpuls sorgen könnte. Die als die „glorreichen Sieben“ titulierten großen Technologie-Unternehmen (Amazon, Alphabet, Apple, Nvidia, Meta, Microsoft, Tesla) haben den MSCI USA Index auf 22,2 % in EUR auf Jahressicht gezogen. Der japanische Aktienmarkt profitierte neben dem schwachen Yen unter anderem davon, dass die Unternehmen verstärkt Reformen zur besseren Vergütung der Aktionäre umsetzen. Die verspätete Wiederöffnung Japans nach der Covid-19-Pandemie gab dem Markt einen deutlichen Auftrieb. Ein weiterer positiver Faktor ist die sich normalisierende Inflation durch steigende Löhne, welche sich positiv auf die Konsumentenlaune niederschlug. Diese Kombination positiver Faktoren führte zu einem sehr positiven Aktienjahr mit einer Performance von ca. 16,2 % in EUR im MSCI Japan. Schwellenländer-Aktien blieben aufgrund der hohen Gewichtung des chinesischen Aktienmarktes, der vor allem unter den langen Lockdowns und der schwachen Entwicklung des Immobilienmarktes litt, deutlich hinter Europa, den USA und Japan zurück und erreichten lediglich ca. 6,1 % in EUR. Der EUR/USD-Wechselkurs war im Rechnungsjahr von großer Volatilität geprägt. Schlussendlich endete gegen Jahresende die Stärkephase des US-Dollar gegenüber dem Euro durch die früher avisierten Zinssenkungen in den USA. Die EZB hielt sich noch bedeckt, daher geht man hier von einer späteren Zinssenkung aus.²⁾

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

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

Übersicht über die letzten drei Rechnungsjahre des Fonds

Fondsvermögen in EUR, Angaben zu den Tranchen in Tranchenwährung

Rechnungsjahresende	15.02.2024	15.02.2023	15.02.2022
Fondsvermögen in 1.000	148.857	55.708	67.882
Ausschüttungsanteile AT0000947643 in EUR			
Rechenwert je Anteil	84,07	81,45	91,45
Anzahl der ausgegebenen Anteile	780.591	228.208	442.965
Ausschüttung je Anteil	1,20	1,20	1,20
Wertentwicklung in %	+4,76	-9,71	-5,87
Thesaurierungsanteile mit KEST-Abzug AT0000719281 in EUR			
Rechenwert je Anteil	133,74	127,68	142,23
Anzahl der ausgegebenen Anteile	509.538	189.567	192.436
zur Thesaurierung verwendeter Ertrag	1,21	-15,33	3,03
Auszahlung gem. § 58 Abs 2 InvFG	0,00	0,00	0,78
Wertentwicklung in %	+4,75	-9,72	-5,88
Thesaurierungsanteile mit KEST-Abzug AT0000A31F33 in EUR bis 14.12.2023			
Rechenwert je Anteil	-	101,34	-
Anzahl der ausgegebenen Anteile	-	20	-
zur Thesaurierung verwendeter Ertrag	-	0,46	-
Auszahlung gem. § 58 Abs 2 InvFG	-	0,14	-
Wertentwicklung in %	-	+1,34	-
Thesaurierungsanteile mit KEST-Abzug AT0000A31F41 in EUR bis 29.01.2024			
Rechenwert je Anteil	-	101,34	-
Anzahl der ausgegebenen Anteile	-	20	-
zur Thesaurierung verwendeter Ertrag	-	0,46	-
Auszahlung gem. § 58 Abs 2 InvFG	-	0,14	-
Wertentwicklung in %	-	+1,34	-
Thesaurierungsanteile mit KEST-Abzug AT0000A31F58 in EUR bis 29.01.2024			
Rechenwert je Anteil	-	101,34	-
Anzahl der ausgegebenen Anteile	-	20	-
zur Thesaurierung verwendeter Ertrag	-	0,46	-
Auszahlung gem. § 58 Abs 2 InvFG	-	0,14	-
Wertentwicklung in %	-	+1,34	-
Thesaurierungsanteile mit KEST-Abzug AT0000A308K8 in EUR			
Rechenwert je Anteil	1.064,22	1.013,55	-
Anzahl der ausgegebenen Anteile	13.688	12.736	-
zur Thesaurierung verwendeter Ertrag	11,31	4,56	-
Auszahlung gem. § 58 Abs 2 InvFG	4,29	1,42	-
Wertentwicklung in %	+5,15	+1,36	-
Thesaurierungsanteile ohne KEST-Abzug AT0000A36HE6 ab 24.11.2023			
Rechenwert je Anteil	147,24	-	-
Anzahl der ausgegebenen Anteile	1.671	-	-
zur Thesaurierung verwendeter Ertrag	0,34	-	-
Wertentwicklung in %	+3,02	-	-

Thesaurierungsanteile ohne KEST-Abzug AT0000A36HB2 ab 24.11.2023

Rechenwert je Anteil	147,53	-	-
Anzahl der ausgegebenen Anteile	1.787	-	-
zur Thesaurierung verwendeter Ertrag	0,36	-	-
Wertentwicklung in %	+3,03	-	-

Ertragsrechnung und Entwicklung des Fondsvermögens

1. Wertentwicklung des Rechnungsjahres (Fonds-Performance)

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

Ausschüttungsanteile AT0000947643	in EUR
Rechenwert am Beginn des Rechnungsjahres	81,45
Ausschüttung am 17.04.2023 (Rechenwert: 80,17) von 1,20 entspricht 0,0150 Anteilen	1,20
Rechenwert am Ende des Rechnungsjahres	84,07
Gesamtwert inkl. (fiktiv) mit dem Ausschüttungsbetrag erworbene Anteile (1,0150 * 84,07)	85,33
Nettoertrag pro Anteil (85,33 - 81,45)	3,88
Wertentwicklung eines Anteiles im Rechnungsjahr in %	+4,76

Thesaurierungsanteile mit KEST-Abzug AT0000719281	in EUR
Rechenwert am Beginn des Rechnungsjahres	127,68
Auszahlung (KESt) am 17.04.2023 (Rechenwert: 127,53) von 0,0000 entspricht 0,0000 Anteilen	0,00
Rechenwert am Ende des Rechnungsjahres	133,74
Gesamtwert inkl. (fiktiv) mit dem Auszahlungsbetrag erworbene Anteile (1,0000 * 133,74)	133,74
Nettoertrag pro Anteil (133,74 - 127,68)	6,06
Wertentwicklung eines Anteiles im Rechnungsjahr in %	+4,75

Thesaurierungsanteile mit KEST-Abzug AT0000A308K8	in EUR
Rechenwert am Beginn des Rechnungsjahres	1.013,55
Auszahlung (KESt) am 17.04.2023 (Rechenwert: 1.011,61) von 1,4215 entspricht 0,0014 Anteilen	1,42
Rechenwert am Ende des Rechnungsjahres	1.064,22
Gesamtwert inkl. (fiktiv) mit dem Auszahlungsbetrag erworbene Anteile (1,0014 * 1.064,22)	1.065,72
Nettoertrag pro Anteil (1.065,72 - 1.013,55)	52,17
Wertentwicklung eines Anteiles im Rechnungsjahr in %	+5,15

Thesaurierungsanteile ohne KEST-Abzug AT0000A36HE6 ab 24.11.2023	in EUR
Rechenwert am Beginn des Rechnungsjahres	142,92
Rechenwert am Ende des Rechnungsjahres	147,24
Wertentwicklung eines Anteiles im Rechnungsjahr in %	+3,02

Thesaurierungsanteile ohne KEST-Abzug AT0000A36HB2 ab 24.11.2023	in EUR
Rechenwert am Beginn des Rechnungsjahres	143,19
Rechenwert am Ende des Rechnungsjahres	147,53
Wertentwicklung eines Anteiles im Rechnungsjahr in %	+3,03

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

Ausschüttung für Ausschüttungsanteile - AT0000947643

Die Ausschüttung von EUR 1,2000 je Anteil wird ab 15.04.2024 von den depotführenden Banken vorgenommen.

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

Auszahlung für Thesaurierungsanteile mit KEST-Abzug - AT0000719281

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

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

Die Auszahlung der Kapitalertragsteuer in der Höhe von EUR 4,2899 je Thesaurierungsanteil mit KEST-Abzug wird ab 15.04.2024 von den depotführenden Banken vorgenommen, sofern keine Befreiungsgründe vorliegen.

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

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

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

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

2. Fondsergebnis

Angaben in EUR

a. Realisiertes Fondsergebnis

Ordentliches Fondsergebnis

Erträge (ohne Kursergebnis)

Zinsenerträge	2.089.755,45	
Dividenderträge	0,00	
Erträge aus Subfonds	0,00	
sonstige Erträge	0,00	
Zinsaufwendungen (inkl. negativer Habenzinsen)	-9,10	2.089.746,35

Aufwendungen

Vergütung an die Verwaltungsgesellschaft	-532.686,47	
Abzügl. Verwaltungskostenrückvergütung aus Subfonds ¹⁾	0,00	
Performancegebühren	0,00	
Kosten für Wirtschaftsprüfer und Steuerberatung	-7.517,60	
Publizitätskosten und Aufsichtskosten	-9.201,42	
Garantiegebühren	0,00	
Kosten für die Depotbank	-83.871,98	
Kosten für Dienste externer Berater	0,00	
Lizenzkosten, Kosten für externe Ratings	-3.990,07	
Sonstige Kosten	0,00	-637.267,54

Ordentliches Fondsergebnis (exkl. Ertragsausgleich)

1.452.478,81

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

Realisierte Gewinne aus Wertpapieren	204.114,00	
Gewinne aus derivativen Instrumenten	257.897,14	
Realisierte Verluste aus Wertpapieren	-615.954,62	
Verluste aus derivativen Instrumenten	-333.685,80	-487.629,28

Realisiertes Fondsergebnis (exkl. Ertragsausgleich)

964.849,53

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

Veränderung des nicht realisierten Kursergebnisses		2.175.317,75
----------------------------------------------------	--	--------------

Ergebnis des Rechnungsjahres ⁴⁾

3.140.167,28

c. Ertragsausgleich

Ertragsausgleich des Rechnungsjahres	290.486,14	
Ertragsausgleich auf den Gewinnvortrag aus Vorjahren	1.251.669,84	1.542.155,98

Fondsergebnis gesamt

4.682.323,26

3. Entwicklung des Fondsvermögens

Fondsvermögen am Beginn des Rechnungsjahres ⁵⁾		55.708.209,78
Ausschüttungsanteile AT0000947643		
Ausschüttung (für Ausschüttungsanteile) am 17.04.2023		-267.075,69
Thesaurierungsanteile mit KEST-Abzug AT0000A308K8		
Auszahlung (für Thesaurierungsanteile) am 17.04.2023		-18.104,22
Thesaurierungsanteile mit KEST-Abzug AT0000A31F33		
Auszahlung (für Thesaurierungsanteile) am 17.04.2023		-2,88
Thesaurierungsanteile mit KEST-Abzug AT0000A31F41		
Auszahlung (für Thesaurierungsanteile) am 17.04.2023		-2,88
Thesaurierungsanteile mit KEST-Abzug AT0000A31F58		
Auszahlung (für Thesaurierungsanteile) am 17.04.2023		-2,88
Ausgabe und Rücknahme von Anteilen		
Ausgabe von Anteilen	99.241.270,83	
Rücknahme von Anteilen	-8.947.688,44	
Anteiliger Ertragsausgleich	-1.542.155,98	88.751.426,41
Fondsergebnis gesamt		
(das Fondsergebnis ist im Detail auf der vorhergehenden Seite dargestellt)		4.682.323,26
Fondsvermögen am Ende des Rechnungsjahres ⁶⁾		148.856.770,90

Erläuterungen zu den Wertangaben bezüglich Fondsergebnis und Entwicklung des Fondsvermögens:

- Die Position beinhaltet die marktübliche Einbehaltung von Administrationskosten der Verwaltungsgesellschaft sowie Dritter.
Für Anteile an anderen Investmentfonds, in die der Fonds investiert („Subfonds“), kann eine Verwaltungsvergütung von bis zu 2,5 % des betreffenden in diesen Subfonds veranlagten Fondsvermögens verrechnet werden. Gegebenenfalls kann zusätzlich eine Performance Fee anfallen.
- 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.
- Kursergebnis gesamt, ohne Ertragsausgleich (realisiertes Kursergebnis ohne Ertragsausgleich, zuzüglich Veränderungen des nicht realisierten Kursergebnisses): EUR 1.687.688,47
- Das Ergebnis des Rechnungsjahres beinhaltet explizit ausgewiesene Transaktionskosten in Höhe von EUR 14.046,34
- Anteilsumlauf zu Beginn des Rechnungsjahres: 228.208 Ausschüttungsanteile, 189.567 Thesaurierungsanteile mit KEST-Abzug, 20 Thesaurierungsanteile mit KEST-Abzug VM(T), 20 Thesaurierungsanteile mit KEST-Abzug VM1(T), 20 Thesaurierungsanteile mit KEST-Abzug VM2(T), 12.736 Thesaurierungsanteile mit KEST-Abzug (I), 0 Thesaurierungsanteile ohne KEST-Abzug (VTI), 0 Thesaurierungsanteile ohne KEST-Abzug (VTA).
- Anteilsumlauf am Ende des Rechnungsjahres: 780.591 Ausschüttungsanteile, 509.538 Thesaurierungsanteile mit KEST-Abzug, 0 Thesaurierungsanteile mit KEST-Abzug VM(T), 0 Thesaurierungsanteile mit KEST-Abzug VM1(T), 0 Thesaurierungsanteile mit KEST-Abzug VM2(T), 13.688 Thesaurierungsanteile mit KEST-Abzug (I), 1.671 Thesaurierungsanteile ohne KEST-Abzug (VTI), 1.787 Thesaurierungsanteile ohne KEST-Abzug (VTA).

Vermögensaufstellung

ISIN	Wertpapier-Bezeichnung	Zinssatz	Käufe / Zugänge Stück / Nominale	Verkäufe / Abgänge (Nom. in 1.000, ger.)	Bestand	Kurs in Wertpapier- währung	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
ZUM AMTLICHEN HANDEL ODER EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT ZUGELASSENE WERTPAPIERE								
ANLEIHEN auf AMERIKANISCHE DOLLAR lautend								
US09062XAF06	BIOGEN INC. 15/25	4,050	0	0	200	98,0710	182.951,22	0,12
US126408HW63	CSX 23/33	5,200	400	0	400	100,8980	376.449,96	0,25
US126650CX62	CVS HEALTH 18/28	4,300	0	0	200	97,2080	181.341,29	0,12
US24703TAK25	DELL IN./EMC 16/46	8,350	0	114	86	126,7570	101.679,90	0,07
US278865BD18	ECOLAB 2027	3,250	0	0	200	94,9120	177.058,11	0,12
US294444UBL98	EQUINIX 20/28	1,550	0	0	300	87,0230	243.511,80	0,16
US42824CAX74	HP ENTERPRISE 16/35	6,200	0	0	300	104,4290	292.218,08	0,20
US47837RAA86	JC INTL/TYCO 20/30	1,750	0	0	300	81,4630	227.953,55	0,15
USY5257YAM94	LENOVO GP. 22/32 REGS	6,536	0	0	200	104,6640	195.250,44	0,13
US690742AJ00	OWENS CORN. 19/29	3,950	0	0	300	94,3700	264.070,52	0,18
USJ4881VAA55	RENESAS ELE. 21/24 REGS	1,543	0	0	200	96,6380	180.277,96	0,12
Summe							2.422.762,83	1,62
ANLEIHEN auf EURO lautend								
DE000AAR0322	AAREAL BK MTN 22/28	0,750	300	0	300	81,9470	245.841,00	0,17
ES0265936031	ABANCA 22/28 FLR MTN	5,250	600	0	600	103,6580	621.948,00	0,42
ES0365936048	ABANCA 23/26 FLR MTN	5,500	200	0	200	101,5750	203.150,00	0,14
XS2747181969	ABB FIN. 24/29 MTN	3,125	240	0	240	99,4170	238.600,80	0,16
XS2747182181	ABB FIN. 24/34 MTN	3,375	270	0	270	98,8260	266.830,20	0,18
XS2348638433	ABN AMRO BK 21/33 MTN	1,000	500	0	900	81,3330	731.997,00	0,49
XS2610209129	ACCIONA ENE. 23/30 MTN	3,750	600	0	600	98,1020	588.612,00	0,40
XS2150015555	AHOLD DELHA. 20/27	1,750	0	0	300	95,5330	286.599,00	0,19
XS2343340852	AIB GP. 21/27 FLR MTN	0,500	600	0	600	91,4320	548.592,00	0,37
XS2156598281	AKZO NOBEL 20/30 MTN	1,625	300	0	300	88,8090	266.427,00	0,18
XS2462468740	AKZO NOBEL 22/32 MTN	2,000	0	0	300	88,1840	264.552,00	0,18
XS2498554992	ALD 22/27 MTN	4,000	300	0	300	100,7970	302.391,00	0,20
FR001400M8T2	ALD 23/26 MTN	4,375	400	0	400	101,1150	404.460,00	0,27
FR001400F6E7	ALD 23/27 MTN	4,250	0	0	400	101,0850	404.340,00	0,27
FR001400NC70	ALD 24/28 MTN	3,875	300	0	300	100,1930	300.579,00	0,20
FR001400NC88	ALD 24/31 MTN	4,000	200	0	200	99,6880	199.376,00	0,13
DE000A254TM8	ALLIANZ MTN 2020/2050	2,121	0	0	200	87,3810	174.762,00	0,12
DE000A289FK7	ALLIANZ SE SUB.20/UNBEFR.	2,625	0	0	200	77,9380	155.876,00	0,11
XS2227906208	AMERN TWR 20/32	1,000	250	0	250	80,3420	200.855,00	0,13
XS2389757944	ANZ N.Z.INTL 21/27 MTN	0,200	0	0	300	89,0300	267.090,00	0,18
XS1197775692	APTIV 15/25	1,500	500	0	500	97,4170	487.085,00	0,33
BE6324664703	ARGE.SPAARB. 20/26 MTN	1,000	500	0	500	94,3500	471.750,00	0,32
XS1942708527	ARGENT.NETH. 19/49FLR MTN	2,750	0	0	300	93,1940	279.582,00	0,19
FR0013252277	ARKEMA 17/27 MTN	1,500	0	0	300	94,4230	283.269,00	0,19
FR0013464815	ARKEMA 19/29 MTN	0,750	200	0	200	86,3560	172.712,00	0,12
FR001400FAZ5	ARKEMA 23/31 MTN	3,500	100	0	300	99,3510	298.053,00	0,20
FR001400CSG4	ARVAL SERV.L 22/26 MTN	4,000	0	0	400	100,2670	401.068,00	0,27
FR001400F6O6	ARVAL SERV.L 23/26 MTN	4,125	0	0	200	100,4310	200.862,00	0,13
XS2554581830	ASR NEDERLA. 22/43 FLR	7,000	600	0	600	112,0530	672.318,00	0,45
XS2694995163	ASR NEDERLA. 23/28	3,625	400	0	400	99,7600	399.040,00	0,27
XS2678749990	ASS.GENERALI 23/33 MTN	5,272	550	0	550	104,2530	573.391,50	0,39
XS2678207676	ASSA-ABLOY 23/26 MTN	3,750	100	0	100	100,8900	100.890,00	0,07
XS2678226114	ASSA-ABLOY 23/30 MTN	3,875	100	0	100	102,9380	102.938,00	0,07
XS2678191904	ASSA-ABLOY 23/35 MTN	4,125	600	0	600	105,6730	634.038,00	0,43
XS2347663507	ASTRAZENECA 21/29 MTN	0,375	500	0	500	86,8500	434.250,00	0,29
XS1144088165	AT + T 14/29	2,600	0	0	100	95,2240	95.224,00	0,06
XS2590758400	AT + T 23/25	3,550	260	0	260	99,7770	259.420,20	0,17
XS2590758822	AT + T 23/34	4,300	360	0	360	103,7450	373.482,00	0,25
XS1482736185	ATLAS COPCO 16/26 MTN	0,625	0	0	200	93,7880	187.576,00	0,13
XS1418788599	AURIZON NET.PTY.16/26 MTN	3,125	300	0	300	99,1350	297.405,00	0,20
XS2759982577	AUTOLIV 24/29 MTN	3,625	140	0	140	99,2500	138.950,00	0,09
XS2431029441	AXA 22/42 FLR MTN	1,875	0	0	300	81,6810	245.043,00	0,16
XS2610457967	AXA 23/43 FLR MTN	5,500	200	0	200	105,6700	211.340,00	0,14
XS2737652474	AXA 24/UND. FLR MTN	6,375	290	0	290	101,9520	295.660,80	0,20
XS2537251170	AXA S.A. 22/30 MTN	3,750	300	0	620	103,4110	641.148,20	0,43
IT0005572166	BANCO BPM 23/27 MTN	4,625	400	0	400	102,3500	409.400,00	0,28
IT0005580136	BANCO BPM 24/30 FLR MTN	4,875	300	0	300	101,4280	304.284,00	0,20

ISIN	Wertpapier-Bezeichnung	Zinssatz	Käufe / Zugänge Stück / Nominale	Verkäufe / Abgänge (Nom. in 1.000, ger.)	Bestand	Kurs in Wertpapier- währung	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
AT0000A0NFW6	BAWAG P.S.K.11-24/11 ZO	0,000	0	0	140	96,1150	134.561,00	0,09
XS2430998893	BBVA 22/29 FLR MTN	0,875	300	200	500	89,8660	449.330,00	0,30
XS2636592102	BBVA 23/33 FLR MTN	5,750	400	0	400	104,0240	416.096,00	0,28
XS2747065030	BBVA 24/34 MTN	3,875	600	0	600	100,0870	600.522,00	0,40
XS2762369549	BBVA 24/36 FLR MTN	4,875	200	0	200	99,7880	199.576,00	0,13
XS2028816028	BCO SABADELL 19/25 MTN	0,875	0	0	300	96,1820	288.546,00	0,19
XS2598331242	BCO SABADELL 23/29 FLR	5,000	600	0	600	104,7450	628.470,00	0,42
XS2677541364	BCO SABADELL 23/29 FLRMTN	5,500	200	0	200	104,4430	208.886,00	0,14
XS2588884481	BCO SABADELL 23/33 FLRMTN	6,000	0	0	200	102,4050	204.810,00	0,14
XS2745719000	BCO SABADELL 24/30 FLR	4,000	300	0	300	100,2970	300.891,00	0,20
XS2194370727	BCO SANTAND. 20/27 MTN	1,125	0	0	300	92,5160	277.548,00	0,19
XS2743029253	BCO SANTAND. 24/28 FLR	3,500	500	0	500	99,1560	495.780,00	0,33
XS2743029766	BCO SANTAND. 24/30 FLR	3,500	500	0	500	98,8250	494.125,00	0,33
XS2751667150	BCO SANTAND. 24/34 FLRMTN	5,000	200	0	200	99,9910	199.982,00	0,13
XS2743029840	BCO SANTAND. 24/34 MTN	3,750	400	0	400	98,7370	394.948,00	0,27
XS2538366878	BCO SANTAND.22/26 FLR MTN	3,625	0	200	300	99,6930	299.079,00	0,20
BE0002963446	BELFIUS BK 23/29 MTN	4,125	400	0	400	102,3750	409.500,00	0,28
BE0002993740	BELFIUS BK 24/29 MTN	3,750	200	0	200	99,0070	198.014,00	0,13
XS2176558620	BERTELSMANN ANL.20/30	1,500	300	0	300	89,1290	267.387,00	0,18
XS2560753936	BERTELSMANN ANL.22/29	3,500	200	0	300	99,7900	299.370,00	0,20
FR00140003P3	BFCM 20/27 MTN	0,100	300	0	300	89,0470	267.141,00	0,18
XS2576362839	BK IRELAND 23/28 FLR MTN	4,875	650	0	650	103,3610	671.846,50	0,45
XS2717301365	BK IRELAND 23/29 FLR MTN	4,625	270	0	270	102,7240	277.354,80	0,19
XS2643234011	BK IRELAND 23/31 FLR MTN	5,000	300	0	300	105,1910	315.573,00	0,21
XS2049707180	BK NOVA SCOT 19/26 MTN	0,125	0	0	300	91,9730	275.919,00	0,19
XS2102357105	BMW FIN. 20/32 MTN	0,875	500	0	500	84,4520	422.260,00	0,28
XS2280845145	BMW FIN. 21/33 MTN	0,200	300	0	300	76,3940	229.182,00	0,15
XS2625968776	BMW FIN. 23/35 MTN	3,625	300	0	300	101,2980	303.894,00	0,20
FR0013381704	BNP PARIBAS 18/30 FLR MTN	2,375	0	0	300	96,8180	290.454,00	0,20
FR0014000UL9	BNP PARIBAS 20/32 MTN	0,625	0	0	400	75,7690	303.076,00	0,20
FR0014001JT3	BNP PARIBAS 21/30 MTN	0,500	700	0	700	84,7270	593.089,00	0,40
FR001400DCZ6	BNP PARIBAS 23/29 FLR MTN	4,375	0	0	100	102,1750	102.175,00	0,07
FR001400LZ16	BNP PARIBAS 23/32 FLR MTN	4,750	300	0	300	104,7440	314.232,00	0,21
FR001400NV51	BNP PARIBAS 24/34 MTN	4,095	300	0	300	100,6260	301.878,00	0,20
XS2308322002	BOOKING HLDG 21/28	0,500	300	0	300	89,5200	268.560,00	0,18
FR0014009YC1	BPCE 22/32 MTN	2,375	300	0	300	91,1660	273.498,00	0,18
FR001400F083	BPCE 23/33 MTN	4,500	0	0	200	103,6210	207.242,00	0,14
FR001400FB22	BPCE 23/35 FLR MTN	5,125	400	0	400	101,2180	404.872,00	0,27
IT0005561243	BPER BANCA 23/29 FLR MTN	5,750	170	0	170	104,3500	177.395,00	0,12
BE0002601798	BPOST 18-26	1,250	300	0	300	94,7630	284.289,00	0,19
FR0014001JP1	BQ.STELL.FR. 21/25 MTN	0,000	300	0	300	96,7040	290.112,00	0,19
FR001400N5B5	BQ.STELL.FR. 24/27 MTN	3,500	300	0	300	99,1540	297.462,00	0,20
FR0013425162	BQUE F.C.MTL 19/29 MTN	1,875	0	0	200	89,7060	179.412,00	0,12
FR0013415692	BQUE POSTALE 19/29 MTN	1,375	0	0	300	89,3020	267.906,00	0,18
FR0014001R34	BQUE POSTALE 21/32FLR MTN	0,750	0	0	200	87,9120	175.824,00	0,12
FR001400NU45	BQUE POSTALE 24/30 MTN	3,500	800	0	800	99,3600	794.880,00	0,53
XS2582814039	BRIT.TELECOM 23/31 MTN	3,750	0	0	220	100,9120	222.006,40	0,15
XS2675225531	BRIT.TELECOM 23/33 MTN	4,250	490	0	490	103,6160	507.718,40	0,34
PTCGDCOM0037	CAIXA GERAL 21/27 FLR MTN	0,375	0	0	300	92,1560	276.468,00	0,19
XS2258971071	CAIXABK 20/26 FLR MTN	0,375	0	0	300	93,9600	281.880,00	0,19
XS2346253730	CAIXABK 21/28 FLR MTN	0,750	500	0	500	90,7550	453.775,00	0,30
XS2649712689	CAIXABK 23/29 FLR MTN	5,000	200	0	200	103,8210	207.642,00	0,14
XS2726256113	CAIXABK 23/33 MTN	4,375	400	0	400	103,9050	415.620,00	0,28
XS2630417124	CAIXABK 23/34 FLR MTN	6,125	600	0	600	104,7030	628.218,00	0,42
XS2764459363	CAIXABK 24/32 FLR MTN	4,125	300	0	300	99,8140	299.442,00	0,20
ES0840609053	CAIXABK 24/UNND. FLR	7,500	200	0	200	101,7310	203.462,00	0,14
XS2133071774	CARLSB.BREW. 20/30 MTN	0,625	0	0	400	85,1890	340.756,00	0,23
FR001400D0F9	CARREF. 22/28 MTN	4,125	0	0	400	102,8620	411.448,00	0,28
FR0014009E07	CARREF. 22/29 MTN	2,375	0	0	300	94,5000	283.500,00	0,19
FR001400HU68	CARREF. 23/30 MTN	3,750	200	0	200	101,0780	202.156,00	0,14
XS2387052744	CASTEL.H.FI. 21/29 MTN	0,875	800	0	800	79,2020	633.616,00	0,43
XS2461785185	CASTEL.H.FI. 22/25 MTN	2,000	400	0	400	97,0560	388.224,00	0,26
XS2337061753	CCEP FIN.IE 21/33	0,875	500	0	500	79,5270	397.635,00	0,27
XS1901137361	CELANESE US 18/27	2,125	450	0	450	94,4860	425.187,00	0,29
AT0000A2STV4	CESKA SPORIT 21/28 FLRMTN	0,500	500	0	500	87,3500	436.750,00	0,29
XS2676413235	CESKA SPORIT 23/28 FLRMTN	5,737	100	0	100	103,4870	103.487,00	0,07
XS2746647036	CESKA SPORIT 24/30FLR MTN	4,824	200	0	200	101,1670	202.334,00	0,14
XS2022084367	CNH INDUST. 19/29 MTN	1,625	500	0	500	90,2140	451.070,00	0,30
DE000CZ43ZN8	COBA 23/30 VAR	5,125	0	0	100	103,2210	103.221,00	0,07

ISIN	Wertpapier-Bezeichnung	Zinssatz	Käufe / Zugänge Stück / Nominale	Verkäufe / Abgänge (Nom. in 1.000, ger.)	Bestand	Kurs in Wertpapier- währung	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
DE000CZ439T8	COBA 24/31 VAR	4,625	100	0	100	100,7670	100.767,00	0,07
DE000CZ45V25	COBA FIX-RESET 20/30 SUB.	4,000	0	0	300	98,0600	294.180,00	0,20
DE000CZ43Z49	COBA FIX-RESET 23/33 SUB.	6,750	300	0	300	105,4620	316.386,00	0,21
DE000CZ40N46	COBA MTN 19/26	1,125	300	0	300	93,7400	281.220,00	0,19
DE000CZ40LD5	COBA T2 NACHRANG 16/26	4,000	0	0	100	99,6720	99.672,00	0,07
XS1995781546	COCA C.HBC F 19/27 MTN	1,000	500	0	500	92,7730	463.865,00	0,31
XS2264977146	COCA-C.EU.P. 20/28	0,200	0	0	300	86,2650	258.795,00	0,17
XS1637093508	COM.GR.FIN.N 17/24 MTN	0,625	0	0	300	98,7500	296.250,00	0,20
XS2528582377	COM.GR.FIN.N 22/30 MTN COMMONW.BK	3,000	600	0	600	98,4870	590.922,00	0,40
XS1750349190	AUSTR.18/28MTN	1,125	0	0	300	92,5980	277.794,00	0,19
XS2758114321	COMPASS GRP 24/31 MTN	3,250	400	0	400	99,2820	397.128,00	0,27
XS2558972415	CONTINENTAL MTN22/27	3,625	300	0	520	100,2110	521.097,20	0,35
XS2630117328	CONTINENTAL MTN23/28	4,000	350	0	350	101,6560	355.796,00	0,24
FR0013519279	COVIVIO 20/30	1,625	0	0	300	87,5590	262.677,00	0,18
FR001400MDV4	COVIVIO 23/32 MTN	4,625	400	0	400	102,7290	410.916,00	0,28
FR00140007B4	CR.MUT.ARKEA 20/26 MTN	0,010	0	0	200	93,3440	186.688,00	0,13
FR0014002BJ9	CR.MUT.ARKEA 21/33 MTN	0,875	400	0	400	77,8640	311.456,00	0,21
XS1395021089	CREDIT AGR. 16/26 MTN	1,250	0	0	300	95,2800	285.840,00	0,19
XS1204154410	CREDIT AGR. 15/27	2,625	0	0	300	96,3080	288.924,00	0,19
FR0014003182	CREDIT AGR. 21/28 MTN	0,375	400	0	400	87,5260	350.104,00	0,24
FR001400GDF9	CREDIT AGR. 23/30 MTN	4,125	600	0	600	103,4450	620.670,00	0,42
FR001400M4O2	CREDIT AGR. 23/33 MTN	4,375	500	0	500	103,5870	517.935,00	0,35
FR001400N2M9	CREDIT AGR. 24/34 MTN	3,750	300	0	300	100,2960	300.888,00	0,20
FR001400N2U2	CREDIT AGR. 24/UN.FLRMTN	6,500	300	0	300	99,6660	298.998,00	0,20
XS2648077274	CRH SMW FIN. 23/35 MTN	4,250	140	0	140	103,6270	145.077,80	0,10
ES0205045026	CRITER.CAIXA 20/27 MTN	0,875	600	0	600	90,3020	541.812,00	0,36
XS2356029541	CTP 21/25 MTN	0,500	400	174	226	95,2120	215.179,12	0,14
XS2434791690	CTP 22/26 MTN	0,875	450	299	151	94,0390	141.998,89	0,10
XS2759989234	CTP 24/30 MTN	4,750	210	0	210	99,8710	209.729,10	0,14
FR0014006FE2	DANONE 21/30 MTN	0,520	300	0	300	83,5090	250.527,00	0,17
FR0014005EJ6	DANONE 21/UND. FLR MTN	1,000	800	0	800	91,7030	733.624,00	0,49
FR001400LY92	DANONE 23/29 MTN	3,706	300	0	300	102,2010	306.603,00	0,21
XS2308298962	DE VOLKSBK 21/28 MTN	0,375	400	0	400	86,2430	344.972,00	0,23
XS2400445289	DELL BK INTL 21/26 MTN	0,500	0	0	300	92,1490	276.447,00	0,19
XS2545259876	DELL BK INTL 22/27 MTN	4,500	700	0	700	102,6280	718.396,00	0,48
DE000A289N78	DEUT.BOERSE SUB.ANL20/47	1,250	500	0	800	91,5500	732.400,00	0,49
XS2534985523	DNB BK 22/27 FLR MTN	3,125	0	0	400	98,7230	394.892,00	0,27
XS2051777873	DS SMITH PLC 19/26 MTN	0,875	450	0	450	93,3530	420.088,50	0,28
XS2654097927	DS SMITH PLC 23/27 MTN	4,375	300	0	300	102,1580	306.474,00	0,21
XS2654098222	DS SMITH PLC 23/30 MTN	4,500	300	0	300	103,4800	310.440,00	0,21
XS2360881549	DSV FIN. 21/33 MTN	0,750	300	0	300	78,1730	234.519,00	0,16
DE000A30WV1	DT.PFBR.BK MTN.35416	4,375	400	0	400	91,5060	366.024,00	0,25
DE000A2TSDE2	DT.TELEKOM MTN 19/31	1,750	0	0	300	91,7710	275.313,00	0,18
XS1883245331	DXC TECHNOLOGY 18/26	1,750	400	0	400	95,6910	382.764,00	0,26
FR0012599892	EDENRED 15-25	1,375	0	0	200	97,8180	195.636,00	0,13
XS2540585564	ELECTROLUX 22/26 MTN	4,125	0	0	650	100,4220	652.743,00	0,44
XS2475919663	ELECTROLUX 22/30 MTN	2,500	300	0	300	90,5990	271.797,00	0,18
XS1209031019	ELM B.V. FLR MTN 15/Und.	2,600	0	0	300	97,3130	291.939,00	0,20
FR001400KWR6	ELO 23/29 MTN	6,000	200	0	200	101,0180	202.036,00	0,14
XS2304340693	EQUINIX 21/33	1,000	500	0	500	78,4590	392.295,00	0,26
XS2083210729	ERSTE GR.BK. 19/30 MTN	1,000	400	0	700	95,0650	665.455,00	0,45
AT0000A36XD5	ERSTE GR.BK. 23/UND. FLR	8,500	200	0	200	105,6850	211.370,00	0,14
FR0013463650	ESSILORLUXO. 19/25 MTN	0,125	400	0	400	95,8520	383.408,00	0,26
XS1198117670	ESSITY 15/25 MTN	1,125	0	0	300	97,1470	291.441,00	0,20
XS1243251375	EUROGRID GMBH MTN.15/25	1,875	0	0	200	97,7180	195.436,00	0,13
XS2615183501	EUROGRID GMBH MTN.23/30	3,722	400	0	400	100,7360	402.944,00	0,27
XS1789623029	EURONEXT 18/25	1,000	0	0	300	96,6180	289.854,00	0,19
XS2009943379	EURONEXT 19/29	1,125	0	0	300	89,5780	268.734,00	0,18
DK0030486402	EURONEXT 21/31	0,750	300	0	300	82,5140	247.542,00	0,17
DK0030486592	EURONEXT 21/41	1,500	200	0	200	72,9730	145.946,00	0,10
DE000A289NX4	EVONIK IND.MTN 20/25	0,625	400	0	400	95,5120	382.048,00	0,26
XS2590759986	FINCECOBK 23/29 MTN FLR	4,625	230	0	230	102,1770	235.007,10	0,16
FR0013515871	FONC.LYONN 20/27	1,500	0	0	300	94,7360	284.208,00	0,19
XS2081474046	FORVIA 19/27	2,375	0	0	100	93,3820	93.382,00	0,06
FR0013266350	GECINA 17-27 MTN	1,375	0	0	300	94,0420	282.126,00	0,19
XS2126170161	GIVAU.FIN.EU 20/32	1,625	0	0	400	87,5310	350.124,00	0,24
XS2715302001	GIVAU.FIN.EU 23/33	4,125	300	0	300	104,2430	312.729,00	0,21
XS1681520356	GLAXOSM.CAP. MTN 17/29	1,375	0	0	300	91,1060	273.318,00	0,18

ISIN	Wertpapier-Bezeichnung	Zins- satz	Käufe / Zugänge Stück / Nominale	Verkäufe / Abgänge (Nom. in 1.000, ger.)	Bestand	Kurs in Wertpapier- währung	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
XS2125145867	GM FINANCIAL 20/26 MTN	0,850	200	0	500	94,3940	471.970,00	0,32
XS2384274366	GM FINANCIAL 21/28 MTN	0,650	0	0	400	86,7450	346.980,00	0,23
XS2587352340	GM FINANCIAL 23/29 MTN	4,300	400	0	400	102,1290	408.516,00	0,27
XS2747270630	GM FINANCIAL 24/28 MTN	3,900	230	0	230	100,2030	230.466,90	0,15
XS2243299463	H.LUNDBECK 20/27 MTN	0,875	0	0	300	89,7670	269.301,00	0,18
XS2198574209	HANN RUECK SUB 2020/2040	1,750	0	0	200	85,1060	170.212,00	0,11
DE000HCB0AZ3	HCOB IS 21/26	0,375	400	0	400	91,5370	366.148,00	0,25
XS1877595014	HEINEKEN 18/31 MTN	1,750	0	0	400	89,8910	359.564,00	0,24
DE000A3E5S00	HOCHTIEF AG MTN 21/29	0,625	500	0	500	85,0330	425.165,00	0,29
XS2388491289	HSBC HLDGS 21/29 FLR MTN	0,641	400	0	400	86,7410	346.964,00	0,23
XS272323593187	IHG FIN. 23/29 MTN	4,375	150	0	150	102,7300	154.095,00	0,10
XS2068065163	INFORMA 19/28 MTN	1,250	300	0	300	90,2720	270.816,00	0,18
XS2258452478	ING GROEP 20/29 FLR	0,250	300	0	600	86,2740	517.644,00	0,35
XS2176621170	ING GROEP 20/31 FLR MTN	2,125	0	0	300	95,0460	285.138,00	0,19
XS2524746687	ING GROEP 22/33 FLR MTN	4,125	500	0	500	98,1330	490.665,00	0,33
XS2764264607	ING GROEP 24/29 FLR MTN	3,875	200	0	200	100,0180	200.036,00	0,13
XS2764264789	ING GROEP 24/35 FLR MTN	4,000	300	0	300	99,4030	298.209,00	0,20
ES0239140017	INMOBIL.COL. 20/28 MTN	1,350	0	0	300	91,3210	273.963,00	0,18
ES0239140025	INMOBIL.COL. 21/29 MTN	0,750	400	0	400	85,3720	341.488,00	0,23
XS1908370171	INTERCONT.HOT.GRP 18/27	2,125	0	0	400	95,7740	383.096,00	0,26
XS2022424993	INTESA SAN. 19/29 MTN	1,750	400	400	400	91,3410	365.364,00	0,25
XS2678939427	INTESA SAN. 23/UND.FLR	9,125	200	0	200	109,8160	219.632,00	0,15
XS2592650373	INTESA SANP.23/28 FLR MTN	5,000	880	0	880	103,0960	907.244,80	0,61
XS2592658947	INTESA SANP.23/33 MTN	5,625	250	0	250	107,8970	269.742,50	0,18
XS1843459782	INTL FLAV.+FRAG. 18/26	1,800	0	0	300	94,6770	284.031,00	0,19
XS1673102734	ISS GLOBAL 17/27 MTN	1,500	300	0	300	92,5420	277.626,00	0,19
DE000A1919H2	JAB HOLDINGS 18/29	2,500	600	0	600	94,7130	568.278,00	0,38
FR0013509643	JCDECAUX SE 20/28	2,625	400	0	400	96,4440	385.776,00	0,26
XS2354444023	JDE PEETS 21/26 MTN	0,000	300	0	300	93,1340	279.402,00	0,19
XS2728561098	JDE PEETS 23/30 MTN	4,125	400	0	400	101,4340	405.736,00	0,27
XS2531438351	JOHN DEE. BK 22/26 MTN	2,500	600	0	600	98,1650	588.990,00	0,40
XS2544400786	JYSKE BK 22/26 FLR MTN	4,625	400	0	400	100,6320	402.528,00	0,27
XS2754488851	JYSKE BK 24/35 FLR MTN	5,125	250	0	250	100,4490	251.122,50	0,17
BE0002664457	KBC GROEP 19/29 FLR MTN	0,500	0	0	400	96,7010	386.804,00	0,26
BE0002799808	KBC GROEP 21/31 MTN	0,750	300	0	300	82,5530	247.659,00	0,17
BE0002987684	KBC GROEP 23/29 FLR MTN	4,250	300	0	300	101,4990	304.497,00	0,20
BE0002914951	KBC GROEP 23/33 FLR MTN	4,875	300	0	600	100,6730	604.038,00	0,41
BE0002990712	KBC GROEP 24/35 FLR MTN	4,750	400	0	400	99,3320	397.328,00	0,27
FR0014000KT3	KLEPIERRE 20/31 MTN	0,875	200	0	600	82,1630	492.978,00	0,33
XS1485533431	KON. KPN 16/28 MTN	1,125	0	0	100	90,5130	90.513,00	0,06
XS2001175657	KONI.PHILIPS 19/26	0,500	0	0	300	92,9270	278.781,00	0,19
XS2475958059	KONI.PHILIPS 22/29 MTN	2,125	0	0	300	91,0650	273.195,00	0,18
XS2676863355	KONI.PHILIPS 23/31 MTN	4,250	300	0	300	100,8940	302.682,00	0,20
XS2486270858	KONINKL.KPN 22/UND. FLR	6,000	0	0	300	104,9030	314.709,00	0,21
XS2764455619	KONINKL.KPN 24/36 MTN	3,875	200	0	200	100,7690	201.538,00	0,14
FR0013519261	LA MONDIALE 20/31	2,125	500	0	500	86,1810	430.905,00	0,29
FR0013447638	LA POSTE 19/34 MTN	1,000	100	0	100	78,5160	78.516,00	0,05
FR0013508694	LA POSTE 20/32 MTN	1,375	0	0	300	85,3290	255.987,00	0,17
XS1685653211	LDN STOCK EXCH.GRP 17/29	1,750	0	0	400	91,6350	366.540,00	0,25
XS2305244241	LEASEPLAN 21/26 MTN	0,250	1.000	0	1.000	92,8930	928.930,00	0,62
FR0013513538	LEGRAND 20/30	0,750	200	0	600	86,5560	519.336,00	0,35
FR0014001556	LEGRAND 23/29	3,500	600	0	600	101,3570	608.142,00	0,41
XS2679903950	LSEG NETHERL 23/26 MTN	4,125	400	0	400	101,4790	405.916,00	0,27
XS2679904685	LSEG NETHERL 23/30 MTN	4,231	300	0	300	104,3440	313.032,00	0,21
DE000A3LSYH6	M.B.INT.FIN. 24/32 MTN	3,250	550	0	550	99,0060	544.533,00	0,37
XS2597677090	MAGNA INTL 23/32	4,375	110	0	110	104,9090	115.399,90	0,08
XS2729836234	MEDIOBANCA 23/30 FLR MTN	4,375	400	0	400	102,0900	408.360,00	0,27
XS2238792175	MEDTR.GLB HD 20/32	0,750	600	0	600	80,6730	484.038,00	0,33
DE000A3LBYM2	MERC.B.FI.CA 22/27 MTN	3,000	0	0	250	99,2390	248.097,50	0,17
DE000A2YPFU9	MERCEDESSENZ MTN 19/31	1,125	600	0	950	85,1520	808.944,00	0,54
XS1233734562	MICHELIN 15/27	1,750	0	0	200	95,8920	191.784,00	0,13
XS2241387252	MIZUHO F.G. 20/25 MTN	0,214	300	0	300	94,7450	284.235,00	0,19
XS2465984107	MIZUHO F.G. 22/27 MTN	1,631	0	0	300	93,9240	281.772,00	0,19
FR0013425154	MMS USA FIN. 19/31	1,750	400	0	400	88,9000	355.600,00	0,24
FR0013425139	MMS USA INV. 19/25	0,625	300	0	300	95,8950	287.685,00	0,19
XS2049769297	MOLNLYCKE HL 19/29 MTN	0,875	500	0	500	85,1150	425.575,00	0,29
XS2672967234	MOLNLYCKE HL 23/28 MTN	4,250	450	0	450	101,5430	456.943,50	0,31
XS1197270819	MONDELEZ INTL 15/27	1,625	300	0	300	95,0830	285.249,00	0,19
XS1117298163	MOODY'S 15/27	1,750	0	0	300	95,8420	287.526,00	0,19

ISIN	Wertpapier-Bezeichnung	Zinssatz	Käufe / Zugänge Stück / Nominale	Verkäufe / Abgänge (Nom. in 1.000, ger.)	Bestand	Kurs in Wertpapier- währung	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
XS2010038227	MOODY'S CORP 19/30	0,950	800	0	800	86,8980	695.184,00	0,47
XS2221845683	MUENCH.RUECK 20/41	1,250	0	0	200	81,9370	163.874,00	0,11
XS1843442622	NASDAQ 19/29	1,750	0	0	300	91,5450	274.635,00	0,18
XS2369906644	NASDAQ 21/33	0,900	400	0	400	77,7430	310.972,00	0,21
XS2643673952	NASDAQ 23/32	4,500	300	0	300	105,2390	315.717,00	0,21
XS1788834700	NATIONWIDE BLDG 18/26 FLR	1,500	500	0	500	97,4120	487.060,00	0,33
XS1788515606	NATWEST GP. 18/26 MTN	1,750	400	0	400	97,6870	390.748,00	0,26
XS2387060259	NATWEST GRP 21/29 FLR MTN	0,670	700	0	700	86,2470	603.729,00	0,41
XS2307853098	NATWEST GRP 21/30 FLR MTN	0,780	400	0	400	85,4870	341.948,00	0,23
XS2382950330	NATWEST GRP 21/32 FLR MTN	1,043	0	0	400	87,8370	351.348,00	0,24
XS2623518821	NATWEST GRP 23/29 FLR MTN	4,771	200	0	200	102,7660	205.532,00	0,14
XS2592628791	NATWEST GRP 23/34 FLR MTN	5,763	440	0	440	103,5780	455.743,20	0,31
XS2745115837	NATWEST MKTS 24/29 MTN	3,625	300	0	300	99,5030	298.509,00	0,20
XS2203802462	NE PROPERTY 20/27 MTN	3,375	500	0	500	96,2160	481.080,00	0,32
XS2023631489	NIBC BK 19/25 MTN	0,875	400	0	400	95,7980	383.192,00	0,26
XS1623355457	NN GP. 17/27 MTN	1,625	0	0	300	94,9330	284.799,00	0,19
XS2488809612	NOKIA 23/31 MTN	4,375	220	0	400	99,7920	399.168,00	0,27
XS2343459074	NORDEA BK 21/31 FLR MTN	0,625	0	0	200	91,6160	183.232,00	0,12
XS2321526480	NORDEA BK 21/31 MTN	0,500	350	0	350	82,1210	287.423,50	0,19
XS2723860990	NORDEA BK 23/34 FLR MTN	4,875	240	0	240	102,1280	245.107,20	0,16
XS2348030425	NOVO NO.F.NL 21/28	0,125	0	0	300	88,6910	266.073,00	0,18
DK0030487996	NYKREDIT 21/31 FLR MTN	0,875	300	0	300	91,4190	274.257,00	0,18
DK0030506886	NYKREDIT 22/27 MTN	1,375	0	0	300	92,7280	278.184,00	0,19
DK0030507694	NYKREDIT 22/32 FLR MTN	5,500	0	0	400	102,2910	409.164,00	0,27
XS2078667925	OP YRITYSPA. 19/29 MTN	0,625	200	0	200	84,1370	168.274,00	0,11
XS2258389415	OP YRITYSPA. 20/27 MTN	0,100	0	0	350	88,4100	309.435,00	0,21
FR0013444676	ORANGE 19/26 MTN	0,000	300	0	300	91,9810	275.943,00	0,19
FR0013444692	ORANGE 19/49 MTN	1,375	400	0	400	69,2230	276.892,00	0,19
FR0013447877	ORANGE 19/UND. FLR MTN	1,750	200	0	200	92,9770	185.954,00	0,12
FR0014003B55	ORANGE 21/UND. FLR MTN	1,375	300	0	700	85,8370	600.859,00	0,40
FR001400KKM2	ORANGE 23/35 MTN	3,875	300	0	300	103,7350	311.205,00	0,21
FR001400GDJ1	ORANGE 23/UND. FLR MTN	5,375	600	0	600	104,6320	627.792,00	0,42
XS2242633258	PEPSICO 20/32	0,400	0	0	400	79,1260	316.504,00	0,21
XS1061714165	PEPSICO INC. 14/26 MTN	2,625	200	0	500	98,6060	493.030,00	0,33
XS2353073161	POSTE ITAL 21/UND. FLR	2,625	0	0	300	84,4750	253.425,00	0,17
XS2580271596	PRO.EUR.FIN. 23/30	3,875	0	0	210	100,6250	211.312,50	0,14
XS2580271752	PRO.EUR.FIN. 23/43	4,250	0	0	100	97,5650	97.565,00	0,07
XS2485265214	PROLI.F.II 22/31 MTN	3,125	0	0	300	94,5160	283.548,00	0,19
FR0012384667	PUBLICIS GRP. 14/24	1,625	0	0	300	98,1960	294.588,00	0,20
XS2682093526	RAIF.BK INTL. 23/28 FLRMTN	6,000	200	0	200	104,4230	208.846,00	0,14
XS2381599898	RAIF.BK INTL 21/27 MTN	0,050	0	0	400	87,1540	348.616,00	0,23
XS2547936984	RAIF.BK INTL 22/28 MTN	5,750	0	0	300	106,1550	318.465,00	0,21
FR0013334695	RCI BANQ. 18/26 MTN	1,625	350	0	350	94,9040	332.164,00	0,22
FR001400CRG6	RCI BANQ. 22/28 MTN	4,875	0	0	400	103,5450	414.180,00	0,28
FR001400KXW4	RCI BANQ. 23/26 MTN	4,625	150	0	150	101,2660	151.899,00	0,10
FR001400KY69	RCI BANQ. 23/29 MTN	4,875	200	0	200	103,4300	206.860,00	0,14
FR001400N3F1	RCI BANQ. 24/29 MTN	3,875	450	0	450	99,0280	445.626,00	0,30
XS2242921711	RENTOKIL IN. 20/28 MTN	0,500	450	0	450	87,2430	392.593,50	0,26
XS2655993033	REXEL 23/30	5,250	160	0	160	102,9080	164.652,80	0,11
XS2629468278	ROBERT BOSCH MTN.23/30	3,625	200	0	200	101,4250	202.850,00	0,14
XS2587306403	SAGE GP. 23/28 MTN	3,820	0	0	240	101,3540	243.249,60	0,16
XS2723549528	SAINT-GOBAIN 23/26	3,750	400	0	400	100,6400	402.560,00	0,27
XS2723549361	SAINT-GOBAIN 23/30	3,875	400	0	400	102,0750	408.300,00	0,27
XS2538368221	SANDVIK AB 22/29 MTN	3,750	0	0	190	101,3970	192.654,30	0,13
XS2747776487	SANT.CON.S.F. 24/29 MTN	3,750	600	0	600	99,9300	599.580,00	0,40
XS2385791046	SANTA.UK GRP 21/29 FLR	0,603	400	0	400	85,1850	340.740,00	0,23
XS2525226622	SANTA.UK GRP 22/28 FLR	3,530	300	0	300	98,2470	294.741,00	0,20
XS2678111050	SARTOR.FIN. 23/26	4,250	100	0	100	101,3250	101.325,00	0,07
XS2676395077	SARTOR.FIN. 23/29	4,375	100	0	100	103,4090	103.409,00	0,07
XS2308586911	SBK 1 OSTL. 21/28 MTN	0,125	500	0	500	86,9660	434.830,00	0,29
XS2182067350	SCANIA CV 20/25 MTN	2,250	0	0	300	97,8860	293.658,00	0,20
XS1087816374	SCENTRE MANAGEM.14/24 MTN	2,250	0	0	300	99,0560	297.168,00	0,20
DE000A289Q91	SCHAEFFLER MTN 20/25	2,750	200	0	300	98,0680	294.204,00	0,20
DE000A3823R3	SCHAEFFLER MTN 24/26	4,500	100	0	100	100,9440	100.944,00	0,07
DE000A3823S1	SCHAEFFLER MTN 24/29	4,750	100	0	100	101,4340	101.434,00	0,07
FR001400N277	SCHNEID.ELEC 24/31 MTN	3,000	300	0	300	98,6840	296.052,00	0,20
FR001400N285	SCHNEID.ELEC 24/35 MTN	3,250	200	0	200	98,6950	197.390,00	0,13
FR0013494168	SCHNEIDER EL 20/29 MTN	0,250	0	0	400	87,0600	348.240,00	0,23
FR001400DTA3	SCHNEIDER EL 22/32 MTN	3,500	0	0	400	101,4270	405.708,00	0,27

ISIN	Wertpapier-Bezeichnung	Zins- satz	Käufe / Zugänge Stück /	Verkäufe / Abgänge Nominale	Bestand	Kurs in Wertpapier- währung	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
FR001400F703	SCHNEIDER EL 23/29 MTN	3,125	0	0	100	100,0900	100.090,00	0,07
FR001400F711	SCHNEIDER EL 23/34 MTN	3,375	300	0	300	100,6260	301.878,00	0,20
XS2404247384	SEB 21/31 FLR MTN	0,750	200	0	550	90,5870	498.228,50	0,33
XS2676818482	SEC.TREAS.IE 23/29 MTN	4,375	260	0	260	102,1850	265.681,00	0,18
XS2489775580	SES 22/29 MTN	3,500	400	0	400	98,2100	392.840,00	0,26
XS2446844594	SIEMENS FIN 22/30 MTN	1,000	0	0	300	88,8060	266.418,00	0,18
XS2128498636	SIGNIFY 20/24	2,000	400	0	400	99,4770	397.908,00	0,27
XS2128499105	SIGNIFY 20/27	2,375	500	0	800	95,4640	763.712,00	0,51
XS2388182573	SM.KAPPA TR. 21/29	0,500	0	0	400	84,6000	338.400,00	0,23
XS2163320679	SODEXO 20/25	0,750	300	0	300	96,7210	290.163,00	0,19
XS2579319513	SPAREBK 1 SR 23/27 MTN	3,750	300	0	700	100,5210	703.647,00	0,47
XS1693281617	STAND.CHAR. 17/27 MTN FLR	1,625	300	0	300	94,2550	282.765,00	0,19
XS2102360315	STD.CHARTER 20/28 MTN FLR	0,850	300	0	300	91,2670	273.801,00	0,18
XS2618731256	STD.CHARTER 23/31 FLR MTN	4,874	300	0	300	103,7790	311.337,00	0,21
FR0013518057	STE GENERALE 20/30 MTN	1,250	0	0	400	85,0050	340.020,00	0,23
FR0014004GE5	STE GENERALE 21/27 MTN	0,250	0	0	300	89,5210	268.563,00	0,18
FR0014001GA9	STE GENERALE 21/29FLR MTN	0,500	600	0	600	86,0900	516.540,00	0,35
FR001400KZP3	STE GENERALE 23/26 MTN	4,250	400	0	400	101,6220	406.488,00	0,27
FR001400KZQ1	STE GENERALE 23/29 FLRMTN	4,750	500	0	500	102,7860	513.930,00	0,35
XS2356041165	STELLANTIS 21/33 MTN	1,250	400	0	400	80,0610	320.244,00	0,22
XS2265360359	STORA ENSO 20/30 MTN	0,625	0	0	400	80,6250	322.500,00	0,22
XS2629062568	STORA ENSO 23/26 MTN	4,000	100	0	100	100,3550	100.355,00	0,07
XS2629064267	STORA ENSO 23/29 MTN	4,250	110	0	110	101,7510	111.926,10	0,08
XS2121207828	SVENSKA HDBK 20/30 MTN	0,500	0	0	400	83,4610	333.844,00	0,22
XS2345317510	SVENSKA HDBK 21/28 MTN	0,050	0	0	350	86,1940	301.679,00	0,20
XS2767224921	SVENSKA HDBK 24/34 MTN	3,750	900	0	900	100,5540	904.986,00	0,61
XS2715276163	SVENSKA HDBK. 23/27 MTN	3,875	300	0	300	101,1460	303.438,00	0,20
XS2667124569	SVENSKA HDBK. 23/34 FLR	5,000	390	0	390	102,7200	400.608,00	0,27
XS2282210231	SWEDBK 21/28 MTN	0,200	300	0	300	86,6340	259.902,00	0,17
XS2522879654	SWEDBK 22/32 FLR MTN	3,625	200	0	200	96,8040	193.608,00	0,13
XS2197348324	TAKEDA PHARMA. 20/27	0,750	0	0	300	91,7670	275.301,00	0,18
DE000TLX2102	TALANX AG NTS 14/26	2,500	0	0	100	97,9600	97.960,00	0,07
XS2462605671	TEL.EUROPE 22/UND. FLR	7,125	0	0	300	107,6540	322.962,00	0,22
XS2646608401	TEL.EUROPE 23/UND. FLR	6,750	100	0	100	107,2030	107.203,00	0,07
XS2582389156	TEL.EUROPE 23/UND. FLR	6,135	0	0	200	102,3680	204.736,00	0,14
XS2623868994	TELE2 23/29 MTN	3,750	170	0	170	100,8670	171.473,90	0,12
XS2112289207	TELEFON.EMI. 20/30 MTN	0,664	700	0	700	85,6400	599.480,00	0,40
XS2753310825	TELEFON.EMI. 24/32 MTN	3,698	200	0	200	100,3340	200.668,00	0,13
XS2753311393	TELEFON.EMI. 24/36 MTN	4,055	200	0	200	101,3670	202.734,00	0,14
XS2117452156	TELENOR 20/28 MTN	0,250	0	0	350	88,6820	310.387,00	0,21
XS2696803696	TELENOR 23/30 MTN	4,000	200	0	200	103,5350	207.070,00	0,14
XS2696803852	TELENOR 23/35 MTN	4,250	300	0	300	106,3590	319.077,00	0,21
XS2589828941	TELIA CO 23/32 MTN	3,625	300	0	300	101,9500	305.850,00	0,21
XS1953240261	TELIA CO AB 19/34MTN	2,125	500	0	500	88,5530	442.765,00	0,30
XS0545428285	TELIA COMP. AB 10/25MTN	3,875	300	0	300	100,5720	301.716,00	0,20
XS0826189028	TELIA COMP. AB 12/27MTN	3,000	0	0	300	99,1530	297.459,00	0,20
XS1193213953	TELIA COMP. AB 15/35MTN	1,625	300	0	300	83,2200	249.660,00	0,17
XS1395057430	TELSTRA CORP. 16/26 MTN	1,125	0	0	100	95,4200	95.420,00	0,06
XS2613162424	TELSTRA GROU 23/31 MTN	3,750	160	0	160	102,5320	164.051,20	0,11
XS2002491780	TENNET HLDG 19/30 MTN	0,875	0	0	200	91,0780	182.156,00	0,12
XS2207430120	TENNET HLDG 20/UND.FLR	2,374	0	0	300	96,8570	290.571,00	0,20
XS2549543143	TENNET HLDG 22/28 MTN	3,875	700	0	700	102,9360	720.552,00	0,48
XS2748847204	TERNA R.E.N. 24/31 MTN	3,500	800	0	800	99,2900	794.320,00	0,53
XS2592301365	TESCO TRE.SV 23/31 MTN	4,250	600	0	600	102,7900	616.740,00	0,41
XS2432502008	TORON.DOM.BK 22/27 MTN	0,500	0	0	350	92,2080	322.728,00	0,22
XS1997077364	TRA.F.CO.PTY 19/29	1,450	400	0	400	90,2330	360.932,00	0,24
XS1681520786	TRANSURBAN FIN.CO. 17/28	1,750	300	0	300	93,5300	280.590,00	0,19
XS2114807691	TYCO ELEC.GR 20/25	0,000	300	0	300	96,4440	289.332,00	0,19
XS2207976783	UNICREDIT 20/27 FLR MTN	2,200	0	0	350	96,0560	336.196,00	0,23
XS2588885025	UNICREDIT 23/29 FLR MTN	4,450	300	0	750	101,6180	762.135,00	0,51
IT0005580656	UNICREDIT 24/31 FLR MTN	4,300	500	0	500	99,4820	497.410,00	0,33
IT0005580102	UNICREDIT 24/34 FLR MTN	5,375	600	0	600	100,3080	601.848,00	0,40
XS1654192274	UNIL.FIN.NED 17/29 MTN	1,375	300	0	300	91,0450	273.135,00	0,18
XS2591848275	UNIL.FIN.NED 23/31 MTN	3,250	130	0	130	100,4460	130.579,80	0,09
XS2591848192	UNIL.FIN.NED 23/35 MTN	3,500	300	0	300	101,4650	304.395,00	0,20
XS2767489474	UNIL.FIN.NED 24/32 MTN	3,250	160	0	160	100,3030	160.484,80	0,11
XS2767489391	UNIL.FIN.NED 24/37 MTN	3,500	170	0	170	100,7250	171.232,50	0,12
XS2123970241	V.F. CORP. 20/32	0,625	600	0	600	71,8230	430.938,00	0,29
XS2592659242	V.F. CORP. 23/26	4,125	120	0	120	98,8580	118.629,60	0,08

ISIN	Wertpapier-Bezeichnung	Zinssatz	Käufe / Zugänge Stück / Nominale	Verkäufe / Abgänge (Nom. in 1.000, ger.)	Bestand	Kurs in Wertpapierwährung	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fondsvermögen	
XS2592659671	V.F. CORP. 23/29	4,250	180	0	180	96,9070	174.432,60	0,12	
FR001400EA16	VALEO 22/27 MTN	5,375	200	0	300	102,7160	308.148,00	0,21	
FR0013139482	VALEO SE 16-26 MTN	1,625	0	0	200	96,2300	192.460,00	0,13	
AT000B122080	VB WIEN 21/26 MTN	0,875	100	0	100	93,2250	93.225,00	0,06	
XS2449928543	VE.W.SYS.FIN 22/29 MTN	1,500	300	0	300	91,0170	273.051,00	0,18	
XS2449929517	VE.W.SYS.FIN 22/34 MTN	2,000	300	0	300	86,1880	258.564,00	0,17	
FR0014003G27	VERALLIA 21/28	1,625	0	0	100	91,9410	91.941,00	0,06	
FR0014006EG0	VERALLIA 21/31	1,875	300	0	400	85,8450	343.380,00	0,23	
XS1030900242	VERIZON COMM 14/26	3,250	300	0	300	100,0310	300.093,00	0,20	
XS1405766624	VERIZON COMM 16/28	1,375	400	0	400	91,8390	367.356,00	0,25	
XS1708335978	VERIZON COMM 17/38	2,875	300	0	300	89,4950	268.485,00	0,18	
XS2176561095	VERIZON COMM 20/40	1,850	300	0	300	75,9310	227.793,00	0,15	
XS2320759538	VERIZON COMM 21/29	0,375	0	0	400	85,9980	343.992,00	0,23	
XS2597973812	VESTAS WIND 23/26 MTN	4,125	220	0	220	100,9040	221.988,80	0,15	
XS2725957042	VESTAS WIND 23/31 MTN	4,125	400	0	400	102,5460	410.184,00	0,28	
BE6332786449	VGP 22/27	1,625	500	0	500	91,8910	459.455,00	0,31	
FR001400D8K2	VINCI S.A. 22/32 MTN	3,375	0	0	300	99,7360	299.208,00	0,20	
XS2585239200	VIRGIN MONEY 23/28 FLRMTN	4,625	0	0	150	99,6630	149.494,50	0,10	
XS2560495116	VODAF.INT.F. 22/34 MTN	3,750	0	0	240	101,1440	242.745,60	0,16	
XS2586851300	VODAF.INT.F. 23/43 MTN	4,000	180	0	300	99,7470	299.241,00	0,20	
XS1463101680	VODAFONE GRP 16/31 MTN	1,600	0	0	300	88,3070	264.921,00	0,18	
XS2002019060	VODAFONE GRP 19/39 MTN	2,500	300	0	300	85,2270	255.681,00	0,17	
XS2521820048	VOLVO TREAS. 22/27 MTN	2,000	0	0	300	95,3920	286.176,00	0,19	
XS2583352443	VOLVO TREAS. 23/25 MTN	3,500	170	0	300	99,7850	299.355,00	0,20	
XS2671621402	VOLVO TREAS. 23/26 MTN	3,875	250	0	250	100,8210	252.052,50	0,17	
XS2760218185	VOLVO TREAS. 24/26 MTN	3,125	400	0	400	99,1250	396.500,00	0,27	
DE000A19UR79	VONOVIA FIN. 18/28 MTN	1,500	0	0	200	91,1520	182.304,00	0,12	
FR0012516417	WENDEL SE 15-27	2,500	0	0	200	97,0580	194.116,00	0,13	
XS2115092954	WHIRLP.FIN. 20/28	0,500	350	0	350	87,5180	306.313,00	0,21	
XS2530756191	WOLTERS KLUW 22/26	3,000	0	0	100	99,3820	99.382,00	0,07	
XS2592516210	WOLTERS KLUW 23/31	3,750	400	0	400	102,2340	408.936,00	0,27	
XS1575992596	WOLTERS KLUWER 17/27	1,500	0	0	200	94,6190	189.238,00	0,13	
FR0013521564	WORLDLINE 20/27	0,875	400	0	700	90,4040	632.828,00	0,43	
FR001400KLT5	WORLDLINE 23/28 MTN	4,125	700	0	700	98,4390	689.073,00	0,46	
XS2013626010	ZURICH FI.IE 19/39	1,625	200	0	200	78,3480	156.696,00	0,11	
					Summe		141.358.196,11	94,97	
SUMME DER ZUM AMTLICHEN HANDEL ODER EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT ZUGELASSENEN WERTPAPIERE								<u>143.780.958,94</u>	96,59
SUMME WERTPAPIERVERMÖGEN								<u>143.780.958,94</u>	96,59

FINANZTERMINKONTRAKTE

Bezeichnung / Underlying	Fälligkeit	Whg.	Anzahl / Betrag	Kontraktkurs	unrealisiertes Ergebnis in EUR	%-Anteil am Fondsvermögen
FINANZTERMINKONTRAKTE						
WÄHRUNGSTERMINKONTRAKTE						
CROSS RATE EUR/USD FUT MÄRZ 24	18.03.2024	USD	20	1,0742	-21.267,84	-0,01
				Summe	<u>-21.267,84</u>	-0,01
ZINSTERMINKONTRAKTE						
EURO BOBL FUT (FGBM) MÄRZ 24	07.03.2024	EUR	-40	116,9600	50.900,00	0,03
EURO SCHATZ FUT (FGBS) MÄRZ 24	07.03.2024	EUR	27	105,5000	-7.965,00	-0,01
				Summe	<u>42.935,00</u>	0,02
SUMME FINANZTERMINKONTRAKTE					<u>21.667,16</u>	0,01

BANKGUTHABEN / BANKVERBINDLICHKEITEN

BANKGUTHABEN / BANKVERBINDLICHKEITEN

WÄHRUNG	FONDSWÄHRUNG	BETRAG FONDSWÄHRUNG
EURO	EUR	3.047.139,24
AMERIKANISCHE DOLLAR	EUR	268.834,74
INITIAL MARGIN / VARIATION MARGIN	EUR	69.650,59
SUMME BANKGUTHABEN / BANKVERBINDLICHKEITEN		3.385.624,57

	EUR	%
Wertpapiervermögen	143.780.958,94	96,59
Finanzterminkontrakte	21.667,16	0,01
Zinsenerträge (inkl. negativer Habenzinsen)	1.725.309,97	1,16
Bankguthaben / Bankverbindlichkeiten	3.385.624,57	2,28
Gebührenverbindlichkeiten	-56.789,74	-0,04
FONDSVERMÖGEN	148.856.770,90	100,00

Erläuterungen zur Vermögensaufstellung:

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

DEWISENKURSE

DEWISENKURSE

WÄHRUNG	EINHEITEN	KURS
AMERIKANISCHE DOLLAR	1 EUR =	1,07210 USD

Risikohinweis:

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

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

Das Nettovermögen wird nach folgenden Grundsätzen ermittelt:

- 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)**

ISIN	Wertpapier-Bezeichnung	Zins- satz	Whg.	Käufe / Zugänge Lots / Stück / Nominale (Nom. in 1.000, ger.)	Verkäufe / Abgänge Lots / Stück / Nominale (Nom. in 1.000, ger.)
WERTPAPIERE					
BE6301510028	AB INBEV 18-27 MTN	1,150	EUR	0	300
XS1520907814	ABBVIE 16/28	2,125	EUR	0	200
BE6320935271	ANHEU.-BUSCH 20/32 MTN	2,875	EUR	300	600
AT0000A0NFV8	BAWAG P.S.K.11-23/10 ZO	0,000	EUR	0	965
XS1998215559	BAXTER INTL 19/29	1,300	EUR	0	200
XS2485259241	BBVA 22/25 MTN	1,750	EUR	0	300
FR0011538222	BPCE S.A. 13/23	4,625	EUR	0	100
XS1720922175	BRIT. TELECOM. 17/24 MTN	1,000	EUR	0	300
XS2545263399	CARLSB.BREW. 22/25 MTN	3,250	EUR	0	160
XS2533012790	COCA C.HBC F 22/25 MTN	2,750	EUR	0	120
XS2178586157	CONTINENTAL MTN20/26	2,500	EUR	0	300
XS0862952297	DEUTSCHE POST MTN.12/24	2,875	EUR	0	200
XS1917358621	DEUTSCHE POST MTN.18/28	1,625	EUR	0	300
XS2122486066	DOW CHEMICAL 20/32	1,125	EUR	600	600
XS1316420089	DT. BAHN FIN. 15/30 MTN	1,625	EUR	0	200
BE0002432079	ELIA TRANSM. B. 13-28	3,250	EUR	0	200
ES0205032008	FERROVIAL EMIS. 14/24	2,500	EUR	0	200
XS1147605791	GLAXOSM.CAP. MTN 14/24	1,375	EUR	0	200
XS2147977479	HEINEKEN 20/25 MTN	1,625	EUR	0	300
XS2320789014	HYPONOE LB 21/26 MTN	0,125	EUR	0	300
XS1091654761	IN.DIS.SVCS. 14/24	2,375	EUR	0	100
XS1319817323	INTL FLAV.+FRAG. 16/24	1,750	EUR	0	300
XS1814402878	LEASEPLAN 18/23 MTN	1,000	EUR	0	400
XS2391860843	LINDE 21/26 MTN	0,000	EUR	0	300
XS2521027446	LLOYDS BKG 22/30 FLR MTN	3,125	EUR	0	100
XS2052313827	LYB FINL II 19/31	1,625	EUR	400	400
XS2105735935	MACQUARIE G. 20/27 MTN	0,625	EUR	0	300
XS2448014808	MASTERCARD 22/29	1,000	EUR	0	300
XS1675764945	MITSUB. UFJ FIN.GRP 17/24	0,872	EUR	0	300
XS1197273755	MONDELEZ INTL 15/35	2,375	EUR	0	100
XS1395010397	MONDI FIN. 16/24 MTN	1,500	EUR	0	300
XS1196797614	NATIONWIDE BLDG 15/25 MTN	1,250	EUR	0	200
XS2080205367	NATWEST GP. 19/25 FLR	0,750	EUR	0	300
XS1960685383	NOKIA OYJ 19/26 MTN	2,000	EUR	0	100
XS1585010074	NOVARTIS FIN. 17/27	1,125	EUR	0	300
DK0030045703	NYKREDIT 23/28 MTN	4,000	EUR	0	400
XS1180130939	RABOBK NEDERLD 15/27 MTN	1,375	EUR	0	300
XS2517103250	SAINT-GOBAIN 22/25	1,625	EUR	0	300
DE000A13SL34	SAP SE MTN 14/27	1,750	EUR	0	300
XS2183818637	STAND.CHAR. 20/30 FLR	2,500	EUR	0	300
XS1946004451	TELEFON.EMI. 19/24 MTN	1,069	EUR	0	300
XS2017471553	UNICREDIT 19/25 FLR MTN	1,250	EUR	0	300
XS2237434803	UNIPOL GRUP. 20/30 MTN	3,250	EUR	0	100
XS1140300663	VERBUND AG 14/24	1,500	EUR	0	200
XS1721423462	VODAFONE GRP 17/25 MTN	1,125	EUR	0	300
XS2187689380	VW INTL.FIN 20/UND. FLR	3,875	EUR	0	400
AT0000A2GLA0	WIENERBERGER 20/25	2,750	EUR	0	100
US17275RBC51	CISCO SYSTEMS 16/26	2,950	USD	0	300
FINANZTERMINKONTRAKTE					
---	EURO BOBL FUT (FGBM) DEZ. 23		EUR	58	58
---	EURO BOBL FUT (FGBM) JUN. 23		EUR	46	46
---	EURO BOBL FUT (FGBM) MÄR. 23		EUR	49	16
---	EURO BOBL FUT (FGBM) SEP. 23		EUR	19	19
---	EURO BUND FUT (FGBL) JUN. 23		EUR	8	8
---	EURO BUND FUT (FGBL) MÄR. 23		EUR	0	8
---	EURO BUND FUT (FGBL) SEP. 23		EUR	12	12
---	EURO SCHATZ FUT (FGBS) DEZ. 23		EUR	30	30
---	EURO SCHATZ FUT (FGBS) SEP. 23		EUR	34	34
---	CROSS RATE EUR/USD FUT DEZ. 23		USD	20	20
---	CROSS RATE EUR/USD FUT JUN. 23		USD	20	20

ISIN	Wertpapier-Bezeichnung	Zins- satz	Whg.	Käufe / Zugänge Lots / Stück / Nominale	Verkäufe / Abgänge (Nom. in 1.000, ger.)
---	CROSS RATE EUR/USD FUT MÄR. 23		USD	0	20
---	CROSS RATE EUR/USD FUT SEP. 23		USD	20	20

Wien, am 29. Mai 2024

Amundi Austria GmbH

Franck Jochaud du Plessix

Bernhard Greifeneder

Christian Mathern

Hannes Roubik

Bestätigungsvermerk

Prüfungsurteil

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

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

bestehend aus der Vermögensaufstellung zum 15. Februar 2024, 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 15. Februar 2024 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 3. Juni 2024

Deloitte Audit Wirtschaftsprüfungs GmbH

Mag. Robert Pejhovský
Wirtschaftsprüfer

Berechnung des Gesamtrisikos

Berechnungsmethode des Gesamtrisikos

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

Steuerliche Behandlung des Amundi Öko Sozial Net Zero Ambition Bond

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

Amundi Austria GmbH stellt zudem die steuerliche Behandlung in unserem Download-Center unter download.fonds.at zur Verfügung.

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

Fondsbestimmungen

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

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

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

Artikel 1 *Miteigentumsanteile*

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

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

Artikel 2 *Depotbank (Verwahrstelle)*

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

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

Artikel 3 *Veranlagungsinstrumente und -grundsätze*

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

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

Beschreibung des Veranlagungsschwerpunktes

Der Investmentfonds zielt darauf ab, durch die sukzessive Reduktion der CO₂ Intensität seines Wertpapierportfolios, diese gegen Null streben zu lassen. Der Investmentfonds investiert zu mindestens 51 vH des Fondsvermögens in Anleihen, die in Form von direkt erworbenen Einzeltiteln, sohin nicht über Investmentfonds oder über Derivate gehalten werden, unter Berücksichtigung ökologischer und sozialer Nachhaltigkeitskriterien sowie unter Einhaltung ethischer Ausschlusskriterien. Ein Direkterwerb von Aktien ist nur im Rahmen der Wandlung von Pflichtwandelanleihen zulässig.

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

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

3.1. Wertpapiere

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

3.2. Geldmarktinstrumente

Geldmarktinstrumente dürfen bis zu 49 vH des Fondsvermögens erworben werden.

3.3. Wertpapiere und Geldmarktinstrumente

Der Erwerb nicht voll eingezahlter Wertpapiere oder Geldmarktinstrumente und von Bezugsrechten auf solche Instrumente oder von nicht voll eingezahlten anderen Finanzinstrumenten ist zulässig.

Wertpapiere und Geldmarktinstrumente dürfen erworben werden, wenn sie den Kriterien betreffend die Notiz oder den Handel an einem geregelten Markt oder einer Wertpapierbörse gemäß InvFG entsprechen.

Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die die im vorstehenden Absatz genannten Kriterien nicht erfüllen, dürfen insgesamt bis zu 10 vH des Fondsvermögens erworben werden.

3.4. Anteile an Investmentfonds

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

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

3.5. Derivative Instrumente

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

3.6. Risiko-Messmethode des Investmentfonds

Der Investmentfonds wendet folgende Risikomessmethode an:

Commitment Ansatz

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

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

3.7. Sichteinlagen oder kündbare Einlagen

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

Es ist kein Mindestbankguthaben zu halten.

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

3.8. Vorübergehend aufgenommene Kredite

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

3.9. Pensionsgeschäfte

Pensionsgeschäfte dürfen bis zu 49 vH des Fondsvermögens eingesetzt werden.

3.10. Wertpapierleihe

Wertpapierleihegeschäfte dürfen bis zu 30 vH des Fondsvermögens eingesetzt werden.

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

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

Artikel 4 Modalitäten der Ausgabe und Rücknahme

Die Berechnung des Anteilswertes erfolgt in EUR.

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

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

4.1. Ausgabe und Ausgabeaufschlag

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

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

Die Ausgabe der Anteile ist grundsätzlich nicht beschränkt, die Verwaltungsgesellschaft behält sich jedoch vor, die Ausgabe von Anteilscheinen vorübergehend oder vollständig einzustellen.

Es liegt im Ermessen der Verwaltungsgesellschaft eine Staffelung des Ausgabeaufschlags vorzunehmen.

4.2. Rücknahme und Rücknahmeabschlag

Die Berechnung des Rücknahmepreises bzw. die Rücknahme erfolgt an jedem österreichischen Börsentag mit Ausnahme von Bankfeiertagen. Der Rücknahmepreis ergibt sich aus dem Anteilswert. Es fällt kein Rücknahmeabschlag an. Auf Verlangen eines Anteilnehmers ist diesem sein Anteil an dem Investmentfonds zum jeweiligen Rücknahmepreis gegen Rückgabe des Anteilscheines auszuzahlen.

Artikel 5 Rechnungsjahr

Das Rechnungsjahr des Investmentfonds ist die Zeit vom 16.02. bis zum 15.02..

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 15.04. des folgenden Rechnungsjahres auszuschütten, der Rest wird auf neue Rechnung vorgetragen.

Jedenfalls ist ab dem 15.04. der gemäß InvFG ermittelte Betrag auszuführen, der zutreffendenfalls zur Deckung einer auf den ausschüttungsgleichen Ertrag des Anteilscheines entfallenden Kapitalertragsteuerabfuhrpflicht zu verwenden ist, es sei denn, die Verwaltungsgesellschaft stellt durch Erbringung entsprechender Nachweise von den depotführenden Stellen sicher, dass die Anteilscheine im Auszahlungszeitpunkt nur von Anteilhabern gehalten werden können, die entweder nicht der inländischen Einkommen- oder Körperschaftsteuer unterliegen oder bei denen die Voraussetzungen für eine Befreiung gemäß § 94 des Einkommensteuergesetzes bzw. für eine Befreiung von der Kapitalertragsteuer vorliegen.

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

Die während des Rechnungsjahres vereinnahmten Erträge nach Deckung der Kosten werden nicht ausgeschüttet.

Es ist bei Thesaurierungsanteilscheinen ab 15.04. der gemäß InvFG ermittelte Betrag auszuführen, der zutreffendenfalls zur Deckung einer auf den ausschüttungsgleichen Ertrag des Anteilscheines entfallenden Kapitalertragsteuerabfuhrpflicht zu verwenden ist, es sei denn, die Verwaltungsgesellschaft stellt durch Erbringung entsprechender Nachweise von den depotführenden Stellen sicher, dass die Anteilscheine im Auszahlungszeitpunkt nur von Anteilhabern gehalten werden können, die entweder nicht der inländischen Einkommen- oder Körperschaftsteuer unterliegen oder bei denen die Voraussetzungen für eine Befreiung gemäß § 94 des Einkommensteuergesetzes bzw. für eine Befreiung von der Kapitalertragsteuer vorliegen.

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

Die während des Rechnungsjahres vereinnahmten Erträge nach Deckung der Kosten werden nicht ausgeschüttet.

Es wird keine Auszahlung gemäß InvFG vorgenommen. Der für das Unterbleiben der KEST-Auszahlung auf den Jahresertrag gemäß InvFG maßgebliche Zeitpunkt ist jeweils der 15.04. des folgenden Rechnungsjahres.

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

Werden diese Voraussetzungen zum Auszahlungszeitpunkt nicht erfüllt, ist der gemäß InvFG ermittelte Betrag durch Gutschrift des jeweils depotführenden Kreditinstituts 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 0,72 vH des Fondsvermögens, die auf Grund der Monatsendwerte errechnet wird.

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

Die Verwaltungsgesellschaft hat Anspruch auf Ersatz aller durch die Verwaltung entstandenen Aufwendungen, wie insbesondere Kosten für Pflichtveröffentlichungen, Depotgebühren, Aufwendungen für administrative Tätigkeiten gemäß § 5 Abs 2 Z 1 lit b) InvFG sowie Prüfungs-, Beratungs- und Abschlusskosten. Die Kosten bei Einführung neuer Anteilsgattungen für bestehende Sondervermögen werden zu Lasten der Anteilspreise der neuen Anteilsgattungen in Rechnung gestellt.

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

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

Mit Bescheid der Finanzmarktaufsichtsbehörde GZ FMA-IF25 4801/0002-INV/2023 vom 25. 07. 2023 wurde die Genehmigung zur Änderung der Fondsbestimmungen erteilt. Die geänderten Fondsbestimmungen traten am 31. 10. 2023 in Kraft.

Anhang

Liste der Börsen mit amtlichem Handel und von organisierten Märkten

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

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

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

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

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

https://registers.esma.europa.eu/publication/searchRegister?core=esma_registers_upreg¹²

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

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

Großbritannien und Nordirland Cboe Europe Equities Regulated Market – Integrated Book Segment, London Metal Exchange, Cboe Europe Equities Regulated Market – Reference Price Book Segment, Cboe Europe Equities Regulated Market – Off-Book Segment, London Stock Exchange Regulated Market (derivatives), NEX Exchange Main Board (non-equity), London Stock Exchange Regulated Market, NEX Exchange Main Board (equity), Euronext London Regulated Market, ICE FUTURES EUROPE, ICE FUTURES EUROPE - AGRICULTURAL PRODUCTS DIVISION, ICE FUTURES EUROPE - FINANCIAL PRODUCTS DIVISION, ICE FUTURES EUROPE - EQUITY PRODUCTS DIVISION und Gibraltar Stock Exchange

3. Börsen in außereuropäischen Ländern

3.1. Australien: Sydney, Hobart, Melbourne, Perth

3.2. Argentinien: Buenos Aires

3.3. Brasilien: Rio de Janeiro, Sao Paulo

3.4. Chile: Santiago

3.5. China: Shanghai Stock Exchange, Shenzhen Stock Exchange

3.6. Hongkong: Hongkong Stock Exchange

3.7. Indien: Mumbai

3.8. Indonesien: Jakarta

3.9. Israel: Tel Aviv

3.10. Japan: Tokyo, Osaka, Nagoya, Fukuoka, Sapporo

3.11. Kanada: Toronto, Vancouver, Montreal

3.12. Kolumbien: Bolsa de Valores de Colombia

3.13. Korea: Korea Exchange (Seoul, Busan)

3.14. Malaysia: Kuala Lumpur, Bursa Malaysia Berhad

3.15. Mexiko: Mexiko City

3.16. Neuseeland: Wellington, Auckland

3.17. Peru Bolsa de Valores de Lima

3.18. Philippinen: Philippine Stock Exchange

3.19. Singapur: Singapur Stock Exchange

3.20. Südafrika: Johannesburg

3.21. Taiwan: Taipei

3.22. Thailand: Bangkok

3.23. USA: New York, NYCE American, New York Stock Exchange (NYSE), Philadelphia, Chicago, Boston, Cincinnati, Nasdaq

3.24. Venezuela: Caracas

3.25. Vereinigte Arabische Emirate: Abu Dhabi Securities Exchange (ADX)

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

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

5. Börsen mit Futures und Options Märkten

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

Anhang Artikel 8 der Offenlegungsverordnung

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

Name des Produkts: Amundi Öko Sozial Net Zero Ambition Bond

Unternehmenskennung (LEI-Code): 5299007N3NCCWGRPDV53

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, Verfahrenweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

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

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

Nein

Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: _____

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

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

Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: _____

Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt Es 79,06 % an nachhaltigen Investitionen

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

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

mit einem sozialen Ziel

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



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

Ja, die beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale wurden erfüllt. Während des Geschäftsjahres förderte das Produkt kontinuierlich ökologische und/oder soziale Merkmale, indem er eine höhere ESG-Bewertung sowie eine niedrigere CO₂-Bilanz anstrebt als der „Solactive Euro Corporate IG PAB Index“ (die ESG-Vergleichsbenchmark bzw. Referenzwert). Die ESG-Vergleichsbenchmark ist ein Referenzwert, der seine Bestandteile nach ökologischen Merkmalen bewertet oder einbezieht und dessen Ausrichtung stimmt daher mit den vom Fonds geförderten ökologischen Merkmalen überein. Bei der Ermittlung des ESG-Scores des Fonds und der ESG-Vergleichsbenchmark wird die ESG-Performance durch den Vergleich der durchschnittlichen Performance eines Wertpapiers mit der Branche des Wertpapieremittenten in Bezug auf jedes der drei ESG Merkmale Umwelt, Soziales und Unternehmensführung beurteilt. Der Fonds ist Träger des Österreichischen Umweltzeichens UZ49.

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

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

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Amundi hat ein eigenes internes ESG-Ratingverfahren entwickelt, das auf dem "Best-in-Class"-Ansatz basiert.

Die auf die einzelnen Wirtschaftszweige abgestimmten Ratings zielen darauf ab, die Arbeitsumgebung zu bewerten, in der die Unternehmen tätig sind.

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

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

Am Ende des Berichtszeitraums:

- beträgt das gewichtete durchschnittliche ESG-Score des Portfolios **1.019** (dies entspricht einem ESG Rating von **C**)

- beträgt das gewichtete durchschnittliche ESG-Score des ESG-Anlageuniversum **0.666** (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 Unternehmensemittenten wird global und auf Ebene der relevanten Kriterien durch einen Vergleich mit der durchschnittlichen Performance ihrer Branche bewertet, und zwar durch die Kombination der drei ESG-Dimensionen:

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

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

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

Die Kohlenstoff-Fußabdruck-Intensität des Portfolios, die als vermögenswertgewichteter Portfoliodurchschnitt berechnet und mit der vermögenswertgewichteten Intensität des ökologischen Fußabdrucks der Benchmark verglichen wird.

Infolgedessen hatten Wertpapiere mit einem relativ niedrigen ökologischen Fußabdruck eine höhere Wahrscheinlichkeit, in das Portfolio aufgenommen zu werden, als Wertpapiere mit einem relativ hohen ökologischen Fußabdruck.

- Die gewichtete Kohlenstoff-Intensität des Portfolios beträgt **79.73** Tons/M.EUR.
- Die gewichtete Kohlenstoff-Intensität der Benchmark beträgt **98.13** Tons/M.EUR.

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

Am Ende der Vorperiode betrug das gewichtete durchschnittliche ESG-Score des Portfolios 1.031 (C+) und das gewichtete durchschnittliche ESG-Score des ESG-Anlageuniversums betrug 0.835 (C).

Am Ende der Vorperiode betrug die gewichtete Kohlenstoff-Intensität des Portfolios 108.00 Tons/M.EUR und die gewichtete Kohlenstoff-Intensität der Benchmark betrug 227.00 Tons/M.EUR.

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

- eine CO₂-Intensität, die im Vergleich zu anderen Unternehmen in ihrem Sektor nicht zum letzten Dezil gehört (gilt nur für Sektoren mit hoher Intensität), und
- Die Diversität des Verwaltungsrats gehört im Vergleich zu anderen Unternehmen des Sektors nicht zum letzten Dezil, und
- keine Kontroversen in Bezug auf Arbeitsbedingungen und Menschenrechte haben.
- Keine Kontroversen in Bezug auf biologische Vielfalt und Umweltverschmutzung

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

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

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

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

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

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



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

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

- Ausschluss: Amundi hat normative, tätigkeitsbasierte und sektorbasierte Ausschlussregeln definiert, die einige der wichtigsten nachteiligen Nachhaltigkeitsindikatoren abdecken, die in der Offenlegungsverordnung aufgeführt sind.
- Integration von ESG-Faktoren: Amundi hat Mindeststandards für die Integration von ESG-Faktoren festgelegt, die standardmäßig auf seine aktiv verwalteten offenen Fonds angewandt werden (Ausschluss von Emittenten mit G-Rating und besserer gewichteter

durchschnittlicher ESG-Score als die anwendbare Benchmark). 38 Kriterien, die im ESG-Rating-Ansatz von Amundi verwendet werden, wurden ebenfalls entwickelt, um die wichtigsten Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren zu berücksichtigen.

- **Engagement:** Engagement ist ein kontinuierlicher und zielgerichteter Prozess, der darauf abzielt, die Aktivitäten oder das Verhalten von Unternehmen, in die investiert wird, zu beeinflussen. Das Ziel der Engagement-Aktivitäten kann in zwei Kategorien eingeteilt werden: einen Emittenten dazu zu bewegen, die Art und Weise, wie er die ökologische und soziale Dimension integriert, zu verbessern, einen Emittenten dazu zu bewegen, seine Auswirkungen auf Umwelt-, Sozial- und Menschenrechtsfragen oder andere Nachhaltigkeitsfragen, die für die Gesellschaft und die Weltwirtschaft von Bedeutung sind, zu verbessern.
- **Abstimmen:** Die Abstimmungspolitik von Amundi beruht auf einer ganzheitlichen Analyse aller langfristigen Themen, die die Wertschöpfung beeinflussen können, einschließlich wesentlicher ESG-Themen. Weitere Informationen finden Sie in Amundis Abstimmungspolitik.
- **Überwachung von Kontroversen:** Amundi hat ein System zur Verfolgung von Kontroversen entwickelt, das sich auf drei externe Datenanbieter stützt, um Kontroversen und deren Schweregrad systematisch zu verfolgen. Dieser quantitative Ansatz wird dann durch eine eingehende Bewertung jeder schweren Kontroverse durch ESG-Analysten und die regelmäßige Überprüfung ihrer Entwicklung ergänzt. Dieser Ansatz gilt für alle Fonds von Amundi.

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



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: **Von 16.02.2023 bis 15.02.2024**

Größte Investitionen	Sektor	Land	In % der Vermögenswerte
ISPIM VAR 03/28 EMTN	Unternehmensanleihen	Italien	0,64 %
LPTY 0.25% 02/26 EMTN	Unternehmensanleihen	Niederlande	0,62 %
SHBASS 3.75% 02/34	Unternehmensanleihen	Schweden	0,61 %
MBGGR 1.125% 11/31 EMTN	Unternehmensanleihen	Deutschland	0,54 %
TRNIM 3.5% 01/31 EMTN	Unternehmensanleihen	Italien	0,53 %
FRLBP 3.5% 06/30 EMTN	Unternehmensanleihen	Frankreich	0,53 %
LIGHT 2.375% 05/27	Unternehmensanleihen	Niederlande	0,52 %
UCGIM VAR 02/29 EMTN	Unternehmensanleihen	Italien	0,51 %
ABNANV 1% 06/33	Unternehmensanleihen	Niederlande	0,50 %
DBOERS VAR 06/47	Unternehmensanleihen	Deutschland	0,50 %

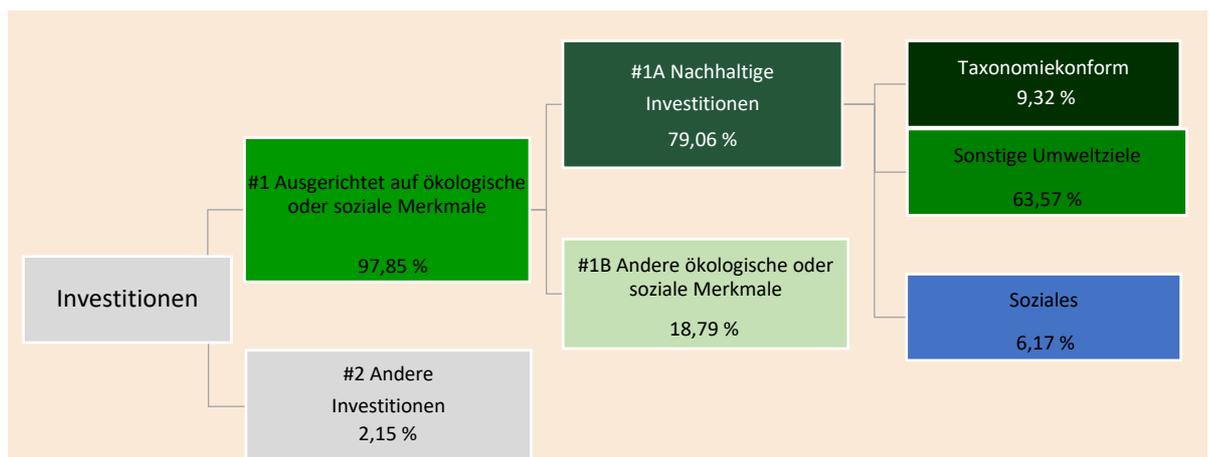
BNFP VAR PERP	Unternehmensanleihen	Frankreich	0,49 %
DELL 4.5% 10/27 EMTN	Unternehmensanleihen	Irland	0,49 %
TENN 3.875% 10/28 EMTN	Unternehmensanleihen	Niederlande	0,49 %
SRBANK 3.75% 11/27 EMTN	Unternehmensanleihen	Norwegen	0,48 %
MCO 0.95% 02/30	Unternehmensanleihen	USD	0,47 %



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

● Wie sah die Vermögensallokation aus?

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



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

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

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

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

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Sektor	In % der Vermögenswerte
Anleihen	97,96%
Unternehmensanleihen	94,50%
Staatsnahe Anleihen	3,46%
Bargeld	2,04%

Taxonomie konforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

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



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

Der Fonds bewirbt sowohl ökologische als auch soziale Merkmale. Der Fonds verpflichtet sich zwar nicht, Investitionen zu tätigen, die mit der EU-Taxonomie konform sind. Auch hat der Fonds im Berichtszeitraum 9,32 % in nachhaltige Investitionen investiert, die der EU-Taxonomie entsprechen. Diese Investitionen trugen zu den Zielen der EU-Taxonomie im Hinblick auf die Klimaschutzmaßnahmen bei.

Die Konformität der Unternehmen, in die investiert wird, mit den oben genannten Zielen der EU-Taxonomie wird anhand von Umsatz- bzw. Ertragszahlen und/oder Daten zu grünen „Use of Proceeds“-Anleihen gemessen.

Der ausgewiesene Prozentsatz der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen des Fonds wurde nicht von den Wirtschaftsprüfern des Fonds oder von Dritten geprüft.

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

Ja:

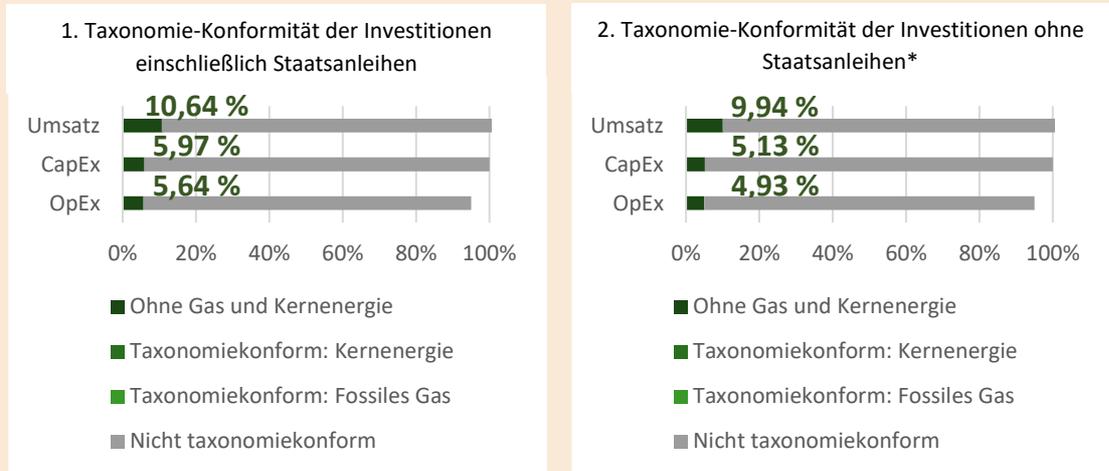
In fossiles Gas In Kernenergie

Nein

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

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

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



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

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

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine 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

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

Zum 15.02.2024 betrug der Anteil der Investitionen des Fonds an Übergangstätigkeiten anhand von Umsatz- bzw. Ertragszahlen und/oder Daten zu grünen „Use of Proceeds“-Anleihen als Indikator 0,05 % und der Anteil der Investitionen an ermöglichenden Tätigkeiten betrug 2,59 %. Der ausgewiesene Prozentsatz der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen des Fonds wurde nicht von den Wirtschaftsprüfern des Fonds oder von Dritten geprüft.

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

Im vorangegangenen Zeitraum wurden keine taxonomiekonformen nachhaltigen Investments gemeldet, da zu diesem Zeitpunkt noch keine verlässlichen Daten verfügbar waren.



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 **63,57 %**.

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-

ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen

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?

Am Ende des Berichtszeitraums betrug der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen **6,17 %**.



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. Für Anleihen und Aktien ohne Rating gelten Mindeststandards für Umwelt- und Sozialschutz durch Kontroversenprüfung anhand der Grundsätze des UN Global Compact. Diese Position kann auch Wertpapiere ohne ESG-Rating enthalten, für die keine Daten für die Messung der Erreichung ökologischer oder sozialer Merkmale verfügbar waren.



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

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

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

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

Die Maßnahmen die ergriffen wurden sind vielfältig. Bei allen Käufen beispielsweise wurde wesentliches Augenmerk darauf gelegt, dass die Unternehmen Klimaziele veröffentlicht haben. Mehrere Verkäufe wiederum hatten eine Verschlechterung des ESG-Ratings als Grund.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Dieser Fonds verfügt über einen spezifischen Index, der als Referenzmaßstab dient.

Index: „Solactive Euro Corporate IG PAB Index“

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

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

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

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

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

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

Damit ist der Referenzwert dauerhaft auf das vom Fonds beworbene CO₂-Reduktionsziel ausgerichtet.

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

Die aus den Indexbestandteilen resultierende Messgröße von CO₂-Intensität gilt auf Dauer als verbindlicher Referenzwert.

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

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

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