

Raiffeisen-GlobalAllocation-StrategiesPlus

Halbjahresbericht

Berichtszeitraum 01.04.2019 – 30.09.2019

Inhaltsverzeichnis

Allgemeine Fondsdaten	3
Fondscharakteristik	3
Rechtlicher Hinweis	4
Fondsdetails	5
Umlaufende Anteile	5
Bericht zur Anlagepolitik des Fonds	6
Zusammensetzung des Fondsvermögens in EUR	7
Vermögensaufstellung in EUR per 30.09.2019	9
Anhang	25

Bericht über den Berichtszeitraum vom 01.04.2019 bis 30.09.2019

Allgemeine Fondsdaten

ISIN	Tranche	Ertragstyp	Währung	Auflagedatum
AT0000A0SDX8	Raiffeisen-GlobalAllocation-StrategiesPlus (I) A	Ausschüttung	EUR	16.01.2012
AT0000A0SE09	Raiffeisen-GlobalAllocation-StrategiesPlus (R) A	Ausschüttung	EUR	16.01.2012
AT0000A1Z3C4	Raiffeisen-GlobalAllocation-StrategiesPlus (RZ) A	Ausschüttung	EUR	01.12.2017
AT0000A0SDY6	Raiffeisen-GlobalAllocation-StrategiesPlus (I) T	Thesaurierung	EUR	16.01.2012
AT0000A090H8	Raiffeisen-GlobalAllocation-StrategiesPlus (S) T	Thesaurierung	EUR	04.04.2008
AT0000A0SE17	Raiffeisen-GlobalAllocation-StrategiesPlus (R) T	Thesaurierung	EUR	16.01.2012
AT0000A1Z3D2	Raiffeisen-GlobalAllocation-StrategiesPlus (RZ) T	Thesaurierung	EUR	01.12.2017
AT0000A0SDZ3	Raiffeisen-GlobalAllocation-StrategiesPlus (I) VTA	Vollthesaurierung Ausland	EUR	16.01.2012
AT0000A0SE25	Raiffeisen-GlobalAllocation-StrategiesPlus (R) VTA	Vollthesaurierung Ausland	EUR	16.01.2012
AT0000A1YBX8	Raiffeisen-GlobalAllocation-StrategiesPlus (RZ) VTA	Vollthesaurierung Ausland	EUR	01.12.2017

Fondscharakteristik

Fondswährung	EUR
Rechnungsjahr	01.04. – 31.03.
Ausschüttungs- / Auszahlungs- / Wieder- veranlagungstag	15.06.
Fondsbezeichnung	Investmentfonds gemäß § 2 InvFG (OGAW)
effektive Verwaltungsgebühr des Fonds	I-Tranche (EUR): 0,900 % (exklusiv einer allfälligen erfolgsabhängigen Gebühr) S-Tranche (EUR): 1,100 % R-Tranche (EUR): 1,800 % (exklusiv einer allfälligen erfolgsabhängigen Gebühr) RZ-Tranche (EUR): 0,900 % (exklusiv einer allfälligen erfolgsabhängigen Gebühr) Performanceabhängige Verwaltungsgebühren: Details siehe unten
max. Verwaltungsgebühr der Subfonds	2,200 % (exklusiv einer allfälligen erfolgsabhängigen Gebühr)
Depotbank	Raiffeisen Bank International AG
Verwaltungsgesellschaft	Raiffeisen Kapitalanlage-Gesellschaft m.b.H. Mooslackengasse 12, A-1190 Wien Tel. +43 1 71170-0 Fax +43 1 71170-761092 www.rcm.at Firmenbuchnummer: 83517 w
Fondsmanagement	Raiffeisen Kapitalanlage-Gesellschaft m.b.H.
Abschlussprüfer	KPMG Austria GmbH

Ab Beginn des Berichtszeitraumes erfolgt die Berechnung der Verwaltungsgebühr für jeden Kalendertag auf Basis des jeweiligen Fondsvermögens, während die Verwaltungsgebühr davor auf Grund der Monatsendwerte errechnet wurde. Die Berechnung der Depotbankgebühr (bezogen auf das Fondsvermögen) und der Depotgebühr (bezogen auf das Wertpapiervermögen) wurde ebenfalls auf tägliche Basis umgestellt.

Performanceabhängige Verwaltungsgebühren

Zusätzlich erhält die Verwaltungsgesellschaft für die Anteilscheingattungen Tranche R, RZ und I jährlich eine variable Erfolgsgebühr. Die variable Erfolgsgebühr beträgt unter Berücksichtigung einer sogenannten „High-Water-Mark“ maximal 15 v. H. jener Wertentwicklung des Fonds, die über dem ICE BofAML German Government Bill Index (vormals Merrill Lynch German Government Bill Index) plus drei Prozent (wobei diese Prozentangabe absolut zu verstehen ist und von der Wertentwicklung des Fonds, die über dem Index liegt, in Abzug zu bringen ist) liegt. Die „High-Water-Mark“ entspricht dabei dem Anteilswert an jenem Rechnungsjahresende, zu dem zuletzt eine variable Erfolgsgebühr ausbezahlt wurde. Für eine Wertentwicklung, die unter der „High-Water-Mark“ liegt, wird keine variable Erfolgsgebühr verrechnet.

Diese variable Erfolgsgebühr wird auf Basis des durchschnittlichen Fondsvolumens täglich abgegrenzt und beeinflusst erfolgswirksam den täglich ermittelten Rechenwert. Während des Rechnungsjahres kommt es je nach Performanceverlauf des Fonds auf einem Abgrenzungskonto zu Zu- und Abbuchungen, wobei die Summe der Abbuchungen im Rechnungsjahr die Summe der Zubuchungen nicht übersteigen darf. Bei der Ermittlung des Rechenwertes und der Wertentwicklung wird die OEKB-Methode angewandt, die von einer Wiederveranlagung eventueller Auszahlungen oder Ausschüttungen ausgeht. Die liquiditätswirksame Auszahlung der variablen Erfolgsgebühr erfolgt durch den Fonds jährlich nach Ende des Rechnungsjahres zum Monatsultimo des Folgemonats.

Rechtlicher Hinweis

Die verwendete Software rechnet mit mehr als den angezeigten zwei Kommastellen. Durch weitere Berechnungen mit ausgewiesenen Ergebnissen können geringfügige Abweichungen nicht ausgeschlossen werden.

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

Das Nettovermögen wird nach folgenden Grundsätzen ermittelt:

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

Die Performance wird von der Raiffeisen KAG entsprechend der OeKB-Methode, basierend auf Daten der Depotbank, berechnet (bei der Aussetzung der Auszahlung des Rückgabepreises unter Rückgriff auf allfällige, indikative Werte). Bei der Berechnung der Wertentwicklung werden individuelle Kosten, und zwar der Ausgabeaufschlag (maximal 5,00 % des investierten Betrages) bzw. ein allfälliger Rücknahmeabschlag (maximal 0,00 % des verkauften Betrages), nicht berücksichtigt. Diese wirken sich bei Berücksichtigung in Abhängigkeit der konkreten Höhe entsprechend mindernd auf die Wertentwicklung aus. Performanceergebnisse der Vergangenheit lassen keine verlässlichen Rückschlüsse auf die zukünftige Entwicklung des Fonds zu.

Sehr geehrte Anteilshaber!

Die Raiffeisen Kapitalanlage-Gesellschaft m.b.H. erlaubt sich den Halbjahresbericht des Raiffeisen-GlobalAllocation-StrategiesPlus für den Berichtszeitraum vom 01.04.2019 bis 30.09.2019 vorzulegen. Dem Rechnungsabschluss wurde die Preisberechnung vom 30.09.2019 zu Grunde gelegt.

Fondsdetails

	31.03.2019	30.09.2019
Fondsvermögen gesamt in EUR	152.341.078,42	162.361.648,73
errechneter Wert / Ausschüttungsanteile (I) (AT0000A0SDX8) in EUR	145,22	149,88
Ausgabepreis / Ausschüttungsanteile (I) (AT0000A0SDX8) in EUR	152,48	157,37
errechneter Wert / Ausschüttungsanteile (R) (AT0000A0SE09) in EUR	139,12	142,96
Ausgabepreis / Ausschüttungsanteile (R) (AT0000A0SE09) in EUR	146,08	150,11
errechneter Wert / Ausschüttungsanteile (RZ) (AT0000A1Z3C4) in EUR	100,77	103,95
Ausgabepreis / Ausschüttungsanteile (RZ) (AT0000A1Z3C4) in EUR	100,77	103,95
errechneter Wert / Thesaurierungsanteile (I) (AT0000A0SDY6) in EUR	154,25	160,70
Ausgabepreis / Thesaurierungsanteile (I) (AT0000A0SDY6) in EUR	161,96	168,74
errechneter Wert / Thesaurierungsanteile (S) (AT0000A090H8) in EUR	152,64	159,57
Ausgabepreis / Thesaurierungsanteile (S) (AT0000A090H8) in EUR	160,27	167,55
errechneter Wert / Thesaurierungsanteile (R) (AT0000A0SE17) in EUR	146,16	151,70
Ausgabepreis / Thesaurierungsanteile (R) (AT0000A0SE17) in EUR	153,47	159,29
errechneter Wert / Thesaurierungsanteile (RZ) (AT0000A1Z3D2) in EUR	100,86	105,08
Ausgabepreis / Thesaurierungsanteile (RZ) (AT0000A1Z3D2) in EUR	100,86	105,08
errechneter Wert / Vollthesaurierungsanteile (I) (AT0000A0SDZ3) in EUR	155,23	161,68
Ausgabepreis / Vollthesaurierungsanteile (I) (AT0000A0SDZ3) in EUR	162,99	169,76
errechneter Wert / Vollthesaurierungsanteile (R) (AT0000A0SE25) in EUR	145,48	150,94
Ausgabepreis / Vollthesaurierungsanteile (R) (AT0000A0SE25) in EUR	152,75	158,49
errechneter Wert / Vollthesaurierungsanteile (RZ) (AT0000A1YBX8) in EUR	101,03	105,27
Ausgabepreis / Vollthesaurierungsanteile (RZ) (AT0000A1YBX8) in EUR	101,03	105,27

Umlaufende Anteile

	Umlaufende Anteile am 31.03.2019	Absätze	Rücknahmen	Umlaufende Anteile am 30.09.2019
AT0000A0SDX8 (I) A	3.080,000	0,000	-1.700,000	1.380,000
AT0000A0SE09 (R) A	481,997	0,000	-6,000	475,997
AT0000A1Z3C4 (RZ) A	95,000	0,000	0,000	95,000
AT0000A0SDY6 (I) T	785,272	0,000	-54,438	730,834
AT0000A090H8 (S) T	790.236,000	16.853,920	-23.448,057	783.641,863
AT0000A0SE17 (R) T	84.995,131	27,722	-3.961,764	81.061,089
AT0000A1Z3D2 (RZ) T	219,132	5,733	0,000	224,865
AT0000A0SDZ3 (I) VTA	107.078,171	34.322,254	-6.642,169	134.758,256
AT0000A0SE25 (R) VTA	13.761,311	6.708,952	-1.929,264	18.540,999
AT0000A1YBX8 (RZ) VTA	10,000	0,000	0,000	10,000
Gesamt umlaufende Anteile				1.020.918,903

Bericht zur Anlagepolitik des Fonds

In der strategischen Ausrichtung des Fonds erfolgten folgende wesentliche Änderungen: Im Juni 2019 wurde das US-Zinsrisiko reduziert. Dagegen wurde das Exposure bei Futures auf Energierohstoffe aufgestockt. Im Juli 2019 wurden inflationsgeschützte US-Anleihen (deren nominelles Durationsrisiko abgesichert wurde) in inflationsgeschützte Euro-Anleihen (deren nominelles Durationsrisiko abgesichert wird) umgeschichtet. Im August 2019 wurde das Exposure bei Unternehmensanleihen, italienischen Staatsanleihen und Währungen aus den Schwellenländern reduziert. Schließlich wurden im September 2019 italienische Staatsanleihen gänzlich abgebaut, das Zinsrisiko des Fonds neuerlich reduziert und auch die Position in Futures auf Edelmetallrohstoffe verringert.

Durch die kürzerfristig orientierten aktiven Strategien schwankte die Gesamtaktienquote des Fonds zwischen ca. 10 % und 36 %.

Um Zusatzerträge zu erwirtschaften, wurden Wertpapierleihengeschäfte getätigt.

Zusammensetzung des Fondsvermögens in EUR

Allfällige Abweichungen beim Kurswert sowie beim Anteil am Fondsvermögen ergeben sich aus Rundungsdifferenzen.

OGAW bezieht sich auf Anteile an einem Organismus zur gemeinsamen Veranlagung in Wertpapieren

§ 166 InvFG bezieht sich auf Anteile an Investmentfonds in der Form von "Anderen Sondervermögen"

§ 166 Abs 1 Z 2 InvFG bezieht sich auf Anteile an Spezialfonds

§ 166 Abs 1 Z 3 InvFG bezieht sich auf Anteile an Organismen für gemeinsame Anlagen gemäß § 166 Abs. 1 Z 3 InvFG
(beispielsweise Alternative Investments/Hedgefonds)

§ 166 Abs 1 Z 4 InvFG bezieht sich auf Anteile an Immobilienfonds

Wertpapierart	OGAW/§ 166	Währung	Kurswert in EUR	Anteil am Fondsvermögen
Aktien		BRL	837.873,41	0,52 %
Aktien		CZK	40.227,44	0,02 %
Aktien		EUR	64.579,20	0,04 %
Aktien		GBP	19.594,56	0,01 %
Aktien		HKD	2.343.392,89	1,44 %
Aktien		HUF	36.237,51	0,02 %
Aktien		IDR	229.088,28	0,14 %
Aktien		INR	957.894,00	0,59 %
Aktien		KRW	1.166.013,37	0,72 %
Aktien		MXN	217.991,90	0,13 %
Aktien		MYR	210.270,68	0,13 %
Aktien		PHP	136.742,33	0,08 %
Aktien		PLN	148.920,28	0,09 %
Aktien		RON	65.147,40	0,04 %
Aktien		RUB	281.130,92	0,17 %
Aktien		THB	317.298,87	0,20 %
Aktien		TRY	120.109,78	0,07 %
Aktien		TWD	1.097.298,32	0,68 %
Aktien		USD	38.849,05	0,02 %
Aktien		ZAR	436.221,00	0,27 %
Summe Aktien			8.764.881,19	5,40 %
Aktien ADR		USD	796.991,00	0,49 %
Summe Aktien ADR			796.991,00	0,49 %
Anleihen fix		EUR	12.247.136,77	7,54 %
Anleihen fix		USD	6.293.602,56	3,88 %
Summe Anleihen fix			18.540.739,33	11,42 %
Investmentzertifikate Raiffeisen KAG	OGAW	EUR	1.509.746,46	0,93 %
Summe Investmentzertifikate Raiffeisen KAG			1.509.746,46	0,93 %

Wertpapierart	OGAW/§ 166	Wahrung	Kurswert in EUR	Anteil am Fondsvermogen
Investmentzertifikate extern	OGAW	EUR	6.800.916,28	4,19 %
Investmentzertifikate extern	OGAW	USD	2.424.469,77	1,49 %
Summe Investmentzertifikate extern			9.225.386,05	5,68 %
Partizipationsscheine		USD	90.727,61	0,06 %
Summe Partizipationsscheine			90.727,61	0,06 %
Strukturierte Produkte - Inflationsgebundene Anleihen		EUR	54.760.758,40	33,73 %
Strukturierte Produkte - Inflationsgebundene Anleihen		USD	25.137.915,67	15,48 %
Summe Strukturierte Produkte - Inflationsgebundene Anleihen			79.898.674,07	49,21 %
Summe Wertpapiervermogen			118.827.145,71	73,19 %
Derivative Produkte				
Bewertung Finanzterminkontrakte			-607.538,39	-0,37 %
Bewertung Devisentermingeschafte			-1.284.954,90	-0,79 %
Summe Derivative Produkte			-1.892.493,29	-1,16 %
Bankguthaben/-verbindlichkeiten				
Bankguthaben/-verbindlichkeiten in Fondswahrung			24.025.725,51	14,80 %
Bankguthaben/-verbindlichkeiten in Fremdwahrung			6.601.951,27	4,07 %
Festgeld in Fondswahrung			14.000.000,00	8,62 %
Summe Bankguthaben/-verbindlichkeiten			44.627.676,78	27,49 %
Abgrenzungen				
Zinsenanspruche (aus Wertpapieren und Bankguthaben)			170.514,83	0,10 %
Cash Collateral Zinsen gegeben			-315,93	-0,00 %
Dividendenforderungen			16.105,24	0,01 %
Forderung Bestandsprovision			2.410,39	0,00 %
Summe Abgrenzungen			188.714,53	0,12 %
Sonstige Verrechnungsposten				
Diverse Gebuhren			-319.394,99	-0,20 %
Summe Sonstige Verrechnungsposten			-319.394,99	-0,20 %
Cash Collateral				
Forderungen aus gegebenen Sicherheiten			930.000,00	0,57 %
Summe Cash Collateral			930.000,00	0,57 %
Summe Fondsvermogen			162.361.648,73	100,00 %

Vermögensaufstellung in EUR per 30.09.2019

Die bei den Wertpapieren angeführten Jahreszahlen beziehen sich jeweils auf Emissions- sowie Tilgungszeitpunkt, wobei ein allfälliges vorzeitiges Tilgungsrecht des Emittenten nicht ausgewiesen wird.

Die mit "Y" gekennzeichneten Wertpapiere weisen auf eine offene Laufzeit hin (is perpetual). Der Kurs von Devisentermingeschäften wird in der entsprechenden Gegenwährung zur Währung angegeben.

Allfällige Abweichungen beim Kurswert sowie beim Anteil am Fondsvermögen ergeben sich aus Rundungsdifferenzen.

OGAW bezieht sich auf Anteile an einem Organismus zur gemeinsamen Veranlagung in Wertpapieren

§ 166 InvFG bezieht sich auf Anteile an Investmentfonds in der Form von "Anderen Sondervermögen"

§ 166 Abs 1 Z 2 InvFG bezieht sich auf Anteile an Spezialfonds

§ 166 Abs 1 Z 3 InvFG bezieht sich auf Anteile an Organismen für gemeinsame Anlagen gemäß § 166 Abs. 1 Z 3 InvFG (beispielsweise Alternative Investments/Hedgefonds)

§ 166 Abs 1 Z 4 InvFG bezieht sich auf Anteile an Immobilienfonds

Wertpapierart	OGAW/§ 166	ISIN	Wertpapierbezeichnung	Währung	Bestand Stk./Nom.	Käufe im Berichtszeitraum Stk./Nom.	Verkäufe im Berichtszeitraum Stk./Nom.	Pool-/ILB-Faktor	Kurs	Kurswert in EUR	Anteil am Fondsvermögen
Aktien		BRB3SAACNOR6	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO B3SA3	BRL	4.700				44,380000	45.891,99	0,03 %
Aktien		BRBBDACNPR8	BANCO BRADESCO SA-PREF BBDC4	BRL	10.032	1.672			34,500000	76.147,98	0,05 %
Aktien		BRBBASACNOR3	BANCO DO BRASIL S.A. BBAS3	BRL	4.800				45,340000	47.882,25	0,03 %
Aktien		BRSANBCDAM13	BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT SANB11	BRL	8.100				45,830000	81.674,53	0,05 %
Aktien		BRCCROACNOR2	CCR SA CCRO3	BRL	9.700				16,900000	36.067,02	0,02 %
Aktien		BRPCARACNPR0	CIA BRASILEIRA DE DIS-PREF PCAR4	BRL	1.600				80,500000	28.337,90	0,02 %
Aktien		BREQTLACNOR0	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD EQTL3	BRL	2.300				99,710000	50.456,64	0,03 %
Aktien		BRITUBACNPR1	ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF ITUB4	BRL	7.500				35,530000	58.628,43	0,04 %
Aktien		BRKROTACNOR9	KROTON EDUCACIONAL SA KROT3	BRL	11.100				11,300000	27.596,45	0,02 %
Aktien		BRRENTACNOR4	LOCALIZA RENT A CAR RENT3	BRL	5.655				44,160000	54.943,14	0,03 %
Aktien		BRLRENACNOR1	LOJAS RENNER S.A. LREN3	BRL	3.586	326			50,180000	39.590,66	0,02 %
Aktien		BRMDIAACNOR7	M DIAS BRANCO SA MDIA3	BRL	2.900				34,790000	22.197,51	0,01 %
Aktien		BRPETRACNPR6	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR PETR4	BRL	12.000				27,660000	73.027,29	0,04 %
Aktien		BRSUZBACNOR0	SUZANO SA SUZB3	BRL	7.400	1.800			33,750000	54.948,68	0,03 %
Aktien		BRVIVTACNPR7	TELEFONICA BRASIL S.A.-PREF VIVT4	BRL	2.300				54,960000	27.811,62	0,02 %
Aktien		BRTIMPACNOR1	TIM PARTICIPACOES SA TIMP3	BRL	9.800				11,920000	25.701,24	0,02 %
Aktien		BRVALEACNOR0	VALE SA VALE3	BRL	8.294				47,660000	86.970,08	0,05 %
Aktien		CZ0005112300	CEZ AS CEZ	CZK	2.000				520,000000	40.227,44	0,02 %
Aktien		NL0013654783	PROSUS NV PRX	EUR	960				67,270000	64.579,20	0,04 %
Aktien		GB00BKDRYJ47	AIRTEL AFRICA PLC AAF	GBP	34.500	34.500			0,505000	19.594,56	0,01 %
Aktien		CNE100000Q43	AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H 1288	HKD	139.000	32.000	70.000		3,050000	49.401,35	0,03 %
Aktien		CNE1000001Z5	BANK OF CHINA LTD-H 3988	HKD	243.000	43.000	79.000		3,050000	86.363,50	0,05 %
Aktien		BMG0957L1090	BEIJING ENTERPRISES WATER GR 371	HKD	89.000				4,030000	41.794,51	0,03 %
Aktien		CNE1000002H1	CHINA CONSTRUCTION BANK-H 939	HKD	224.600		41.000		5,920000	154.937,16	0,10 %
Aktien		CNE1000002L3	CHINA LIFE INSURANCE CO-H 2628	HKD	26.000				18,120000	54.897,89	0,03 %
Aktien		KYG210961051	CHINA MENGNIU DAIRY CO 2319	HKD	9.000		11.000		29,200000	30.623,12	0,02 %
Aktien		CNE1000002M1	CHINA MERCHANTS BANK-H 3968	HKD	19.000	20.500	1.500		37,400000	82.803,62	0,05 %
Aktien		HK0941009539	CHINA MOBILE LTD 941	HKD	18.000	3.500	3.500		64,000000	134.238,35	0,08 %
Aktien		CNE1000002Q2	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H 386	HKD	92.000	20.000	8.000		4,600000	49.313,95	0,03 %
Aktien		KYG2108Y1052	CHINA RESOURCES LAND LTD 1109	HKD	16.000	16.000			32,300000	60.220,82	0,04 %
Aktien		HK0267001375	CITIC LTD 267	HKD	38.000				9,910000	43.881,49	0,03 %

Wertpapierart	OGAW/§ 166	ISIN	Wertpapierbezeichnung	Währung	Bestand Stk./Nom.	Käufe im Berichtszeitraum Stk./Nom.	Verkäufe	Pool-/ILB-Faktor	Kurs	Kurswert in EUR	Anteil am Fondsvermögen
Aktien		HK0002007356	CLP HOLDINGS LTD 2	HKD	5.100	1.500	1.000		82,400000	48.969,03	0,03 %
Aktien		HK0883013259	CNOOC LTD 883	HKD	64.000	29.000			11,960000	89.193,93	0,05 %
Aktien		HK1093012172	CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT 1093	HKD	18.000				15,860000	33.265,94	0,02 %
Aktien		KYG3066L1014	ENN ENERGY HOLDINGS LTD 2688	HKD	4.200	4.200			82,050000	40.156,15	0,02 %
Aktien		BMG423131256	HAIER ELECTRONICS GROUP CO 1169	HKD	16.800		4.000		20,000000	39.152,85	0,02 %
Aktien		CNE1000003G1	IND & COMM BK OF CHINA-H 1398	HKD	184.000		35.000		5,190000	111.278,00	0,07 %
Aktien		HK0992009065	LENOVO GROUP LTD 992	HKD	55.000				5,280000	33.839,25	0,02 %
Aktien		KYG5496K1242	LI NING CO LTD 2331	HKD	17.000	17.000			22,850000	45.264,66	0,03 %
Aktien		KYG5635P1090	LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD 960	HKD	14.000	14.000			28,800000	46.983,42	0,03 %
Aktien		KYG596691041	MEITUAN DIANPING-CLASS B 3690	HKD	6.000	6.000			81,000000	56.631,81	0,03 %
Aktien		CNE1000003W8	PETROCHINA CO LTD-H 857	HKD	110.000		20.000		3,960000	50.758,88	0,03 %
Aktien		CNE100000593	PICC PROPERTY & CASUALTY-H 2328	HKD	46.000		16.000		9,150000	49.045,94	0,03 %
Aktien		CNE1000003X6	PING AN INSURANCE GROUP CO-H 2318	HKD	14.500	6.000			89,850000	151.813,44	0,09 %
Aktien		KYG8087W1015	SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP 2313	HKD	4.800		1.000		102,700000	57.442,83	0,04 %
Aktien		KYG8569A1067	SUNAC CHINA HOLDINGS LTD 1918	HKD	11.000	15.000	4.000		31,250000	40.055,93	0,02 %
Aktien		KYG8586D1097	SUNNY OPTICAL TECH 2382	HKD	4.000	4.000			114,400000	53.322,46	0,03 %
Aktien		KYG875721634	TENCENT HOLDINGS LTD 700	HKD	12.658		500		329,400000	485.861,88	0,30 %
Aktien		KYG9431R1039	WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD 151	HKD	59.000		15.000		6,130000	42.144,08	0,03 %
Aktien		KYG9829N1025	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD 968	HKD	84.000	32.000	60.000		4,710000	46.102,48	0,03 %
Aktien		CNE1000004S4	ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H 576	HKD	44.000				6,560000	33.634,17	0,02 %
Aktien		HU0000153937	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL MOL	HUF	4.132				2,940,000000	36.237,51	0,02 %
Aktien		ID1000122807	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT ASII	IDR	48.900				6,650,000000	20.970,03	0,01 %
Aktien		ID1000095003	BANK MANDIRI PERSERO TBK PT BMRI	IDR	44.000				6,975,000000	19.790,89	0,01 %
Aktien		ID1000118201	BANK RAKYAT INDONESIA PERSER BBRI	IDR	239.200				4,180,000000	64.477,16	0,04 %
Aktien		ID1000135700	MITRA KELUARGA KARYASEHAT TB MIKA	IDR	155.000	155.000			2,640,000000	26.387,85	0,02 %
Aktien		ID1000111602	PERUSAHAAN GAS NEGARA TBK PT PGAS	IDR	211.200		36.000		2,150,000000	29.282,01	0,02 %
Aktien		ID1000106800	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK SMGR	IDR	19.000		11.000		11,850,000000	14.519,12	0,01 %
Aktien		ID1000129000	TELEKOMUNIKASI INDONESIA PER TLKM	IDR	193.070				4,310,000000	53.661,22	0,03 %
Aktien		INE860A01027	HCL TECHNOLOGIES LTD HCLT	INR	10.454				1,041,050000	140.882,67	0,09 %
Aktien		INE001A01036	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE HDFC	INR	3.860				2,035,900000	101.729,57	0,06 %
Aktien		INE090A01021	ICICI BANK LTD ICICIBC	INR	28.870				449,200000	167.876,54	0,10 %
Aktien		INE095A01012	INDUSIND BANK LTD IIB	INR	3.700				1,480,800000	70.925,37	0,04 %
Aktien		INE018A01030	LARSEN & TOUBRO LTD LT	INR	6.550				1,472,650000	124.866,03	0,08 %
Aktien		INE002A01018	RELIANCE INDUSTRIES LTD RIL	INR	5.760		2.940		1,309,050000	97.607,28	0,06 %
Aktien		INE647A01010	SRF LTD SRF	INR	2.400				2,752,400000	85.511,84	0,05 %
Aktien		INE195A01028	SUPREME INDUSTRIES LTD SI	INR	5.516				1,204,150000	85.982,16	0,05 %
Aktien		INE467B01029	TATA CONSULTANCY SVCS LTD TCS	INR	3.100				2,056,150000	82.512,54	0,05 %
Aktien		KR7030000004	CHEIL WORLDWIDE INC 030000	KRW	2.370	2.370			24,400,000000	44.021,02	0,03 %
Aktien		KR7086790003	HANA FINANCIAL GROUP 086790	KRW	1.730	430			35,000,000000	46.093,11	0,03 %
Aktien		KR7008770000	HOTEL SHILLA CO LTD 008770	KRW	900				86,800,000000	59.468,11	0,04 %
Aktien		KR7086280005	HYUNDAI GLOVIS CO LTD 086280	KRW	410	410			151,500,000000	47.284,45	0,03 %
Aktien		KR7105560007	KB FINANCIAL GROUP INC 105560	KRW	2.160				42,400,000000	69.717,45	0,04 %
Aktien		KR7051900009	LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE 051900	KRW	50	50			1,306,000,000000	49.709,00	0,03 %
Aktien		KR7035420009	NAVER CORP 035420	KRW	430	430			156,000,000000	51.064,01	0,03 %
Aktien		KR7005490008	POSCO 005490	KRW	270		140		225,000,000000	46.245,36	0,03 %
Aktien		KR7005930003	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD 005930	KRW	10.570				48,400,000000	389.441,50	0,24 %
Aktien		KR7005931001	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF 005935	KRW	2.690	2.690			39,300,000000	80.476,06	0,05 %
Aktien		KR7032830002	SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LT 032830	KRW	780	780			70,600,000000	41.919,99	0,03 %
Aktien		KR7006400006	SAMSUNG SDI CO LTD 006400	KRW	250				222,500,000000	42.344,00	0,03 %
Aktien		KR7055550008	SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD 055550	KRW	1.920	720			41,850,000000	61.167,20	0,04 %

Wertpapierart	OGAW/§ 166	ISIN	Wertpapierbezeichnung	Währung	Bestand Stk./Nom.	Käufe im Berichtszeitraum Stk./Nom.	Verkäufe im Berichtszeitraum Stk./Nom.	Pool-/ILB-Faktor	Kurs	Kurswert in EUR	Anteil am Fondsvermögen
Aktien		KR7034730002	SK HOLDINGS CO LTD 034730	KRW	250				202.500,000000	38.537,80	0,02 %
Aktien		KR7000660001	SK HYNIX INC 000660	KRW	1.590	690			81.400,000000	98.524,31	0,06 %
Aktien		MXP001691213	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L AMXL	MXN	70.800				14,440000	47.569,29	0,03 %
Aktien		MXP320321310	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD FEMSAUBD	MXN	3.800				179,790000	31.788,89	0,02 %
Aktien		MXP001661018	GRUPO AEROPORT DEL SURESTE-B ASURB	MXN	2.800				295,510000	38.499,62	0,02 %
Aktien		MXP370841019	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B GMEXICOB	MXN	17.800				46,490000	38.503,99	0,02 %
Aktien		MX01WA000038	WALMART DE MEXICO SAB DE CV WALMEX*	MXN	22.700				58,350000	61.630,11	0,04 %
Aktien		MYL727700006	DIALOG GROUP BHD DLG	MYR	45.000				3,390000	33.272,99	0,02 %
Aktien		MYL318200002	GENTING BHD GENT	MYR	21.000	7.000			5,740000	26.291,22	0,02 %
Aktien		MYL501400005	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD MAHB	MYR	11.000	11.000	25.100		8,670000	20.801,34	0,01 %
Aktien		MYL518300008	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD PCHEM	MYR	16.000				7,530000	26.278,14	0,02 %
Aktien		MYL129500004	PUBLIC BANK BERHAD PBK	MYR	9.700		4.000		20,040000	42.398,36	0,03 %
Aktien		MYL419700009	SIME DARBY BERHAD SIME	MYR	39.100				2,310000	19.700,10	0,01 %
Aktien		MYL534700009	TENAGA NASIONAL BHD TNB	MYR	14.000	14.000			13,600000	41.528,53	0,03 %
Aktien		PHY0486V1154	AYALA CORPORATION AC	PHP	2.900				893,000000	45.596,80	0,03 %
Aktien		PHY0488F1004	AYALA LAND INC ALI	PHP	49.700		15.000		49,300000	43.140,80	0,03 %
Aktien		PHY0967S1694	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN BPI	PHP	29.700	29.700			91,800000	48.004,73	0,03 %
Aktien		PLCC0000016	CCC SA CCC	PLN	500				139,100000	15.879,54	0,01 %
Aktien		PLOPTTC00011	CD PROJEKT SA	PLN	230				245,100000	12.870,99	0,01 %
Aktien		PLCFRPT00013	CYFROWY POLSAT SA CPS	PLN	12.599				26,920000	77.437,60	0,05 %
Aktien		PLPKN0000018	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN PKN	PLN	1.040				97,860000	23.236,96	0,01 %
Aktien		PLPZU0000011	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE PZU	PLN	2.280				37,450000	19.495,19	0,01 %
Aktien		NL0012294474	DIGI COMMUNICATIONS NV DIGI	RON	2.024				30,200000	12.858,77	0,01 %
Aktien		ROELECACNOR5	SOCIETATEA ENERGETICA ELECTR EL	RON	21.708	4.340			11,450000	52.288,63	0,03 %
Aktien		RU0007661625	GAZPROM PJSC GAZP	RUB	22.900				229,010000	74.475,22	0,05 %
Aktien		RU0009024277	LUKOIL PJSC LKOH	RUB	635		2.165		5.405,000000	48.740,65	0,03 %
Aktien		RU000A0DKV55	NOVATEK PJSC NVTK	RUB	1.900	1.900			1.339,600000	36.145,20	0,02 %
Aktien		RU0009029540	SBERBANK OF RUSSIA PJSC SBER	RUB	37.600	4.700			228,050000	121.769,85	0,07 %
Aktien		TH0765010R16	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR AOT-R	THB	21.300				74,000000	46.986,44	0,03 %
Aktien		TH0001010R16	BANGKOK BANK PUBLIC CO-NVDR BBL-R	THB	9.500				175,000000	49.559,04	0,03 %
Aktien		TH6999010R15	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO BEM-R	THB	131.000				10,800000	42.175,11	0,03 %
Aktien		TH0737010R15	CP ALL PCL-NVDR CPALL-R	THB	20.200				82,000000	49.377,20	0,03 %
Aktien		TH0143010R16	LAND & HOUSES PUB - NVDR LH-R	THB	105.900				9,900000	31.253,05	0,02 %
Aktien		TH0355010R16	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR PTTEP-R	THB	12.000				123,500000	44.178,34	0,03 %
Aktien		TH0646010R18	PTT PCL-NVDR PTT-R	THB	39.000				46,250000	53.769,69	0,03 %
Aktien		TRATHYAO91M5	TURK HAVA YOLLARI AO THYAO	TRY	20				12,100000	39,07	0,00 %
Aktien		TRAGARAN91N1	TURKIYE GARANTI BANKASI GARAN	TRY	72.000	72.000			10,330000	120.070,71	0,07 %
Aktien		TW0001102002	ASIA CEMENT CORP 1102	TWD	20.000	20.000			43,300000	25.497,51	0,02 %
Aktien		KYG202881093	CHAILEASE HOLDING CO LTD 5871	TWD	10.114	2.294	8.500		125,000000	37.223,13	0,02 %
Aktien		TW0002412004	CHUNGHWA TELECOM CO LTD 2412	TWD	18.000	7.000			111,000000	58.826,82	0,04 %
Aktien		TW0002891009	CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT 2891	TWD	81.500		8.500		20,600000	49.431,61	0,03 %
Aktien		TW0002884004	E.SUN FINANCIAL HOLDING CO 2884	TWD	55.765	3.701	40.000		26,250000	43.099,37	0,03 %
Aktien		TW0001476000	ECLAT TEXTILE COMPANY LTD 1476	TWD	2.600	1.600	1.000		416,000000	31.845,39	0,02 %
Aktien		TW0001326007	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE 1326	TWD	15.200	2.000			86,700000	38.800,97	0,02 %
Aktien		TW0001301000	FORMOSA PLASTICS CORP 1301	TWD	9.000	9.000			94,500000	25.041,15	0,02 %
Aktien		TW0009921007	GIANT MANUFACTURING 9921	TWD	5.000	2.000	3.000		211,000000	31.062,21	0,02 %
Aktien		TW0002317005	HON HAI PRECISION INDUSTRY 2317	TWD	24.540	4.000	4.400		73,200000	52.889,02	0,03 %
Aktien		TW0003008009	LARGAN PRECISION CO LTD 3008	TWD	400		300		4.450,000000	52.408,28	0,03 %
Aktien		TW0002454006	MEDIATEK INC 2454	TWD	3.000		5.000		369,000000	32.593,24	0,02 %
Aktien		TW0002886009	MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT 2886	TWD	30.000	30.000			28,750000	25.394,46	0,02 %

Wertpapierart	OGAW/§ 166	ISIN	Wertpapierbezeichnung	Währung	Bestand Stk./Nom.	Käufe im Berichtszeitraum Stk./Nom.	Verkäufe	Pool-/ILB-Faktor	Kurs	Kurswert in EUR	Anteil am Fondsvermögen
Aktien		TW0001303006	NAN YA PLASTICS CORP 1303	TWD	10.000	10.000			69,700000	20.521,67	0,01 %
Aktien		TW0002912003	PRESIDENT CHAIN STORE CORP 2912	TWD	4.500	1.000	2.000		290,000000	38.422,92	0,02 %
Aktien		TW0004147004	TAIMED BIOLOGICS INC 4147	TWD	5.800		1.200		149,000000	25.444,51	0,02 %
Aktien		TW0002330008	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC 2330	TWD	54.800		9.500		272,000000	438.863,39	0,27 %
Aktien		TW0001216000	UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO 1216	TWD	20.000	5.000	8.000		74,800000	44.046,51	0,03 %
Aktien		BMG2519Y1084	CREDICORP LTD BAP	USD	200				212,650000	38.849,05	0,02 %
Aktien		ZAE000035861	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD CPI	ZAR	500				1.282,000000	38.787,48	0,02 %
Aktien		ZAE000066304	FIRSTRAND LTD FSR	ZAR	13.948				63,200000	53.341,18	0,03 %
Aktien		ZAE000018123	GOLD FIELDS LTD GFI	ZAR	9.720		14.680		77,800000	45.759,31	0,03 %
Aktien		ZAE000179420	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD GRT	ZAR	19.600	19.600			23,360000	27.705,28	0,02 %
Aktien		ZAE000067211	IMPERIAL LOGISTICS LTD IPL	ZAR	3.600				53,990000	11.761,14	0,01 %
Aktien		GB00B1CRLC47	MONDI PLC MNP	ZAR	2.700	2.700			285,740000	46.684,03	0,03 %
Aktien		ZAE000261913	MOTUS HOLDINGS LTD MTH	ZAR	3.600				68,900000	15.009,12	0,01 %
Aktien		ZAE000015889	NASPERS LTD-N SHS NPN	ZAR	960				2.319,530000	134.742,56	0,08 %
Aktien		ZAE000109815	STANDARD BANK GROUP LTD SBK	ZAR	3.600				177,800000	38.731,81	0,02 %
Aktien		ZAE000063863	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD WHL	ZAR	7.000	7.000			55,950000	23.699,09	0,01 %
Aktien ADR		US01609W1027	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR BABA	USD	2.980	280			165,980000	451.811,28	0,28 %
Aktien ADR		US0567521085	BAIDU INC - SPON ADR BIDU	USD	300				101,210000	27.735,10	0,02 %
Aktien ADR		US05965X1090	BANCO SANTANDER-CHILE-ADR BSAC	USD	1.070				28,650000	28.002,28	0,02 %
Aktien ADR		US3682872078	GAZPROM PJSC-SPON ADR OGZD	USD	4.600				7,080000	29.749,26	0,02 %
Aktien ADR		US47215P1066	JD.COM INC-ADR JD	USD	2.200				27,820000	55.906,83	0,03 %
Aktien ADR		US55315J1025	MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR MNOD	USD	2.700				25,730000	63.458,32	0,04 %
Aktien ADR		US64110W1027	NETEASE INC-ADR NTES	USD	300	300			260,690000	71.438,23	0,04 %
Aktien ADR		US6475811070	NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR EDU	USD	500	500			106,210000	48.508,79	0,03 %
Aktien ADR		US8336351056	QUIMICA Y MINERA CHIL-SP ADR SQM	USD	800				27,890000	20.380,91	0,01 %
Anleihen fix		XS1883354620	ABBOTT IRELAND FINANCING ABT 0 7/8 09/27/23	EUR	100.000				103,085490	103.085,49	0,06 %
Anleihen fix		XS2017324844	ALFA LAVAL TREASURY INTL ALFASS 0 1/4 06/25/24	EUR	100.000	100.000			100,119000	100.119,00	0,06 %
Anleihen fix		XS1909193317	ALLERGAN FUNDING SCS AGN 2 5/8 11/15/28	EUR	100.000	100.000			114,531150	114.531,15	0,07 %
Anleihen fix		XS1369278251	AMGEN INC AMGN 1 1/4 02/25/22	EUR	100.000				102,662780	102.662,78	0,06 %
Anleihen fix		BE6312821612	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/ ABIBB 1 1/8 07/01/27	EUR	200.000	100.000			105,682880	211.365,76	0,13 %
Anleihen fix		XS1789699607	AP MOLLER-MAERSK A/S MAERSK 1 3/4 03/16/26	EUR	100.000				103,458540	103.458,54	0,06 %
Anleihen fix		XS1619312173	APPLE INC AAPL 0 7/8 05/24/25	EUR	100.000				105,089250	105.089,25	0,06 %
Anleihen fix		XS1875331636	ARGENTUM (GIVAUDAN) GIVNVX 1 1/8 09/17/25	EUR	100.000				105,350460	105.350,46	0,06 %
Anleihen fix		XS1411404855	ASTRAZENECA PLC AZN 0 3/4 05/12/24	EUR	100.000				102,717070	102.717,07	0,06 %
Anleihen fix		XS2051362312	AT&T INC T 1.8 09/14/39	EUR	100.000	100.000			99,152000	99.152,00	0,06 %
Anleihen fix		XS1196380031	AT&T INC T 2.45 03/15/35	EUR	100.000	100.000			111,683760	111.683,76	0,07 %
Anleihen fix		XS1458405898	BANK OF AMERICA CORP BAC 0 3/4 07/26/23	EUR	100.000				102,503450	102.503,45	0,06 %
Anleihen fix		XS1718418103	BASF SE BASGR 0 7/8 11/15/27	EUR	100.000				105,814330	105.814,33	0,07 %
Anleihen fix		XS1840618059	BAYER CAPITAL CORP BV BAYNGR 1 1/2 06/26/26	EUR	100.000	100.000			105,987440	105.987,44	0,07 %
Anleihen fix		XS1139688268	BG ENERGY CAPITAL PLC BGGPR 1 1/4 11/21/22	EUR	100.000				104,003360	104.003,36	0,06 %
Anleihen fix		XS1309436753	BHP BILLITON FINANCE LTD BHP 4 3/4 04/22/76	EUR	100.000				106,845250	106.845,25	0,07 %
Anleihen fix		XS2055728054	BMW FINANCE NV BMW 0 3/8 09/24/27	EUR	100.000	100.000			99,584000	99.584,00	0,06 %
Anleihen fix		FR0013398070	BNP PARIBAS BNP 2 1/8 01/23/27	EUR	100.000	200.000	100.000		110,100320	110.100,32	0,07 %
Anleihen fix		XS1577747782	BOOKING HOLDINGS INC BKNG 0.8 03/10/22	EUR	100.000				101,965180	101.965,18	0,06 %
Anleihen fix		XS1992931508	BP CAPITAL MARKETS PLC BPLN 0.831 11/08/27	EUR	100.000	100.000			103,616710	103.616,71	0,06 %
Anleihen fix		PTBSSL0M0002	BRISA CONCESSAO RODOV SA BRCORO 2 3/8 05/10/27	EUR	100.000				112,877000	112.877,00	0,07 %
Anleihen fix		XS2051494495	BRITISH TELECOMMUNICATIO BRITEL 1 1/8 09/12/29	EUR	100.000	100.000			99,384000	99.384,00	0,06 %
Anleihen fix		AT0000A1LJH1	CA IMMOBILIEN ANLAGEN AG CAIAV 1 7/8 07/12/21	EUR	50.000				102,305000	51.152,50	0,03 %
Anleihen fix		XS1881574591	CIE DE SAINT-GOBAIN SGOFP 0 7/8 09/21/23	EUR	100.000				103,130490	103.130,49	0,06 %
Anleihen fix		XS1457608013	CITIGROUP INC C 0 3/4 10/26/23	EUR	100.000				102,404940	102.404,94	0,06 %

Wertpapierart	OGAW/§ 166	ISIN	Wertpapierbezeichnung	Wahrung	Bestand Stk./Nom.	Kufe im Berichtszeitraum Stk./Nom.	Verkufe	Pool-/ILB-Faktor	Kurs	Kurswert in EUR	Anteil am Fondsvermogen
Anleihen fix		XS1956955980	COOPERATIEVE RABOBANK UA RABOBK 0 5/8 02/27/24	EUR	100.000	200.000	100.000		102,378770	102.378,77	0,06 %
Anleihen fix		FR0013264421	CTE CO TRANSP ELEC CTEFRA 1 1/2 07/29/28	EUR	100.000				109,254920	109.254,92	0,07 %
Anleihen fix		DE000A2YNZX6	DAIMLER AG DAIGR 0 3/4 02/08/30	EUR	100.000	100.000			99,494230	99.494,23	0,06 %
Anleihen fix		DE000A2YNZW8	DAIMLER AG DAIGR 0 3/8 11/08/26	EUR	100.000	150.000	50.000		99,476040	99.476,04	0,06 %
Anleihen fix		DE000A2RYD83	DAIMLER INTL FINANCE BV DAIGR 0 5/8 02/27/23	EUR	50.000				101,708920	50.854,46	0,03 %
Anleihen fix		FR0013216900	DANONE SA BNFP 0.424 11/03/22	EUR	100.000				101,423390	101.423,39	0,06 %
Anleihen fix		XS1936139770	DEUTSCHE BAHN FIN GMBH DBHNGR 1 1/8 12/18/28	EUR	100.000				110,191000	110.191,00	0,07 %
Anleihen fix		DE000A161W62	DEUTSCHE BOERSE AG DBOERS 2 3/4 02/05/41	EUR	50.000	50.000			103,287500	51.643,75	0,03 %
Anleihen fix		XS1734533372	DEUTSCHE POST AG DPWGR 1 12/13/27	EUR	50.000				106,834040	53.417,02	0,03 %
Anleihen fix		XS1828032513	DEUTSCHE TELEKOM INT FIN DT 0 5/8 12/01/22	EUR	100.000				102,055160	102.055,16	0,06 %
Anleihen fix		XS1858856740	DEUTSCHE TELEKOM INT FIN DT 2.2 07/25/33	EUR	100.000				109,814000	109.814,00	0,07 %
Anleihen fix		XS2050404636	DH EUROPE FINANCE DHR 0.2 03/18/26	EUR	100.000	100.000			99,404000	99.404,00	0,06 %
Anleihen fix		XS1896660989	DIAGEO FINANCE PLC DGELN 1 04/22/25	EUR	100.000				104,706400	104.706,40	0,06 %
Anleihen fix		XS1979262448	DNB BANK ASA DNBNO 0 1/4 04/09/24	EUR	100.000	100.000			100,952370	100.952,37	0,06 %
Anleihen fix		XS2051777873	DS SMITH PLC SMDSLN 0 7/8 09/12/26	EUR	100.000	100.000			98,692000	98.692,00	0,06 %
Anleihen fix		XS2047500769	E.ON SE EOANGR 0 08/28/24	EUR	100.000	100.000			99,605440	99.605,44	0,06 %
Anleihen fix		XS1893621026	EDP FINANCE BV EDPLP 1 7/8 10/13/25	EUR	100.000				109,176730	109.176,73	0,07 %
Anleihen fix		FR0013368545	ELECTRICITE DE FRANCE SA EDF 2 10/02/30	EUR	100.000				113,433610	113.433,61	0,07 %
Anleihen fix		BE0002276450	ELIA SYSTEM OP SA/NV ELIASO 1 3/8 04/07/27	EUR	100.000				105,305000	105.305,00	0,06 %
Anleihen fix		FR0013245859	ENGIE SA ENGIFF 0 7/8 03/27/24	EUR	100.000				103,762200	103.762,20	0,06 %
Anleihen fix		FR0013310505	ENGIE SA ENGIFF 1 3/8 PERP	Y EUR	100.000				100,995670	100.995,67	0,06 %
Anleihen fix		XS1811024543	EP INFRASTRUCTURE AS ENAPHO 1.659 04/26/24	EUR	100.000				102,712740	102.712,74	0,06 %
Anleihen fix		XS1584122680	ESSITY AB SCHHYG 0 5/8 03/28/22	EUR	100.000				101,576750	101.576,75	0,06 %
Anleihen fix		XS2001270995	FCA BANK SPA IRELAND FCABNK 0 5/8 11/24/22	EUR	100.000	100.000			100,938470	100.938,47	0,06 %
Anleihen fix		XS1319814577	FEDEX CORP FDX 1 01/11/23	EUR	100.000				102,153810	102.153,81	0,06 %
Anleihen fix		XS1843435923	FIDELITY NATL INFO SERV FIS 2 05/21/30	EUR	100.000	100.000			111,002180	111.002,18	0,07 %
Anleihen fix		XS1956037664	FORTUM OYJ FUMVFH 1 5/8 02/27/26	EUR	100.000	100.000			106,688590	106.688,59	0,07 %
Anleihen fix		XS1612542826	GENERAL ELECTRIC CO GE 0 7/8 05/17/25	EUR	100.000	100.000	100.000		100,515600	100.515,60	0,06 %
Anleihen fix		XS1822828122	GLAXOSMITHKLINE CAPITAL GSK 1 1/4 05/21/26	EUR	100.000				106,832990	106.832,99	0,07 %
Anleihen fix		XS1981823542	GLENCORE FINANCE EUROPE GLENLN 1 1/2 10/15/26	EUR	100.000	100.000			102,759880	102.759,88	0,06 %
Anleihen fix		XS1614198262	GOLDMAN SACHS GROUP INC GS 1 3/8 05/15/24	EUR	50.000				103,926940	51.963,47	0,03 %
Anleihen fix		XS1810653540	HEIDELBERGCEMENT FIN LUX HEIGR 1 3/4 04/24/28	EUR	100.000				108,240590	108.240,59	0,07 %
Anleihen fix		XS1877595444	HEINEKEN NV HEIANA 1 1/4 03/17/27	EUR	100.000				106,756290	106.756,29	0,07 %
Anleihen fix		XS1672151492	HOLCIM FINANCE LUX SA LHNFX 1 3/4 08/29/29	EUR	100.000				107,515260	107.515,26	0,07 %
Anleihen fix		XS1685589027	HYPO VORARLBERG BANK AG VORHYP 0 5/8 09/19/22	EUR	100.000				101,608000	101.608,00	0,06 %
Anleihen fix		XS1847692636	IBERDROLA FINANZAS SAU IBESM 1 1/4 10/28/26	EUR	100.000				107,713460	107.713,46	0,07 %
Anleihen fix		XS1945110861	IBM CORP IBM 1 3/4 01/31/31	EUR	100.000	100.000			112,520300	112.520,30	0,07 %
Anleihen fix		XS1935128956	IMMOFINANZ AG IIAAV 2 5/8 01/27/23	EUR	100.000				105,916850	105.916,85	0,07 %
Anleihen fix		XS1951313763	IMPERIAL BRANDS FIN PLC IMBLN 2 1/8 02/12/27	EUR	100.000	100.000			104,441190	104.441,19	0,06 %
Anleihen fix		XS1595704872	INNOGY FINANCE BV IGYGY 1 04/13/25	EUR	100.000				104,721720	104.721,72	0,06 %
Anleihen fix		XS2022424993	INTESA SANPAOLO SPA ISPIM 1 3/4 07/04/29	EUR	100.000	100.000			105,503420	105.503,42	0,06 %
Anleihen fix		XS1960248919	JPMORGAN CHASE & CO JPM 1.09 03/11/27	EUR	100.000				104,268060	104.268,06	0,06 %
Anleihen fix		XS2042667944	KERRY GROUP FIN SERVICES KYGID 0 5/8 09/20/29	EUR	100.000	100.000			99,671000	99.671,00	0,06 %
Anleihen fix		XS1815116568	KONINKLIJKE PHILIPS NV PHIANA 0 3/4 05/02/24	EUR	100.000				103,160520	103.160,52	0,06 %
Anleihen fix		XS1072249045	LB BADEN-WUERTTEMBERG LBBW 2 7/8 05/27/26	EUR	100.000				103,674040	103.674,04	0,06 %
Anleihen fix		XS1749378342	LLOYDS BANKING GROUP PLC LLOYDS 0 5/8 01/15/24	EUR	100.000				100,180160	100.180,16	0,06 %
Anleihen fix		FR0013257615	LVMH MOET HENNESSY VUITT MCFP 0 3/8 05/26/22	EUR	100.000				101,172710	101.172,71	0,06 %
Anleihen fix		XS1403264374	MCDONALD'S CORP MCD 1 11/15/23	EUR	100.000				103,971660	103.971,66	0,06 %
Anleihen fix		XS2020670779	MEDTRONIC GLOBAL HLDINGS MDT 0 1/4 07/02/25	EUR	100.000	100.000			100,618380	100.618,38	0,06 %
Anleihen fix		FR0013425139	MMS USA FINANCING INC PUBFP 0 5/8 06/13/25	EUR	100.000	100.000			100,284600	100.284,60	0,06 %

Wertpapierart	OGAW/§ 166	ISIN	Wertpapierbezeichnung	Währung	Bestand Stk./Nom.	Käufe im Berichtszeitraum Stk./Nom.	Verkäufe im Berichtszeitraum Stk./Nom.	Pool-/ILB-Faktor	Kurs	Kurswert in EUR	Anteil am Fondsvermögen
Anleihen fix		XS0764278528	MUNICH RE MUNRE 6 1/4 05/26/42	EUR	100.000				116,147520	116.147,52	0,07 %
Anleihen fix		XS1864037541	NATIONAL GRID NA INC NGGLN 0 3/4 08/08/23	EUR	100.000				102,446280	102.446,28	0,06 %
Anleihen fix		XS1755428502	NATURGY FINANCE BV NTGYSM 1 1/2 01/29/28	EUR	100.000				108,985160	108.985,16	0,07 %
Anleihen fix		XS1769040111	NOVARTIS FINANCE SA NOVNVX 0 1/2 08/14/23	EUR	100.000				102,410250	102.410,25	0,06 %
Anleihen fix		AT0000A28HX3	OBERBANK AG OBERBK 0 3/4 06/19/26	EUR	100.000	100.000			102,502000	102.502,00	0,06 %
Anleihen fix		XS1294342792	OMV AG OMVAV 5 1/4 PERP	Y EUR	50.000	50.000			110,649830	55.324,92	0,03 %
Anleihen fix		XS2013539635	OPTUS FINANCE PTY LTD SGTPT 1 06/20/29	EUR	100.000	100.000			104,758600	104.758,60	0,06 %
Anleihen fix		FR0013359197	ORANGE SA ORAFP 1 09/12/25	EUR	100.000	100.000			104,780470	104.780,47	0,06 %
Anleihen fix		FR0013323870	ORANGE SA ORAFP 1 3/8 03/20/28	EUR	100.000				108,469790	108.469,79	0,07 %
Anleihen fix		XS2035473748	PHILIP MORRIS INTL INC PM 0 1/8 08/03/26	EUR	100.000	100.000			97,697000	97.697,00	0,06 %
Anleihen fix		XS1362384262	PRAXAIR INC PX 1.2 02/12/24	EUR	100.000				105,004000	105.004,00	0,06 %
Anleihen fix		XS1900752814	PROCTER & GAMBLE CO/THE PG 1.2 10/30/28	EUR	100.000				109,041260	109.041,26	0,07 %
Anleihen fix		FR0013448669	RCI BANQUE SA RENAUL 0 1/4 03/08/23	EUR	100.000	100.000			99,790000	99.790,00	0,06 %
Anleihen fix		XS1720806774	RLB OBEROESTERREICH RFLBOB 0 3/4 05/22/23	EUR	100.000				101,797500	101.797,50	0,06 %
Anleihen fix		XS1819575066	ROLLS-ROYCE PLC ROLLS 0 7/8 05/09/24	EUR	100.000				102,301080	102.301,08	0,06 %
Anleihen fix		FR0013409844	SANOFI SANFP 0 7/8 03/21/29	EUR	100.000				105,994110	105.994,11	0,07 %
Anleihen fix		DE000A2G8VT5	SAP SE SAPGR 1 03/13/26	EUR	100.000				106,436580	106.436,58	0,07 %
Anleihen fix		XS1135276332	SHELL INTERNATIONAL FIN RDSALN 1 04/06/22	EUR	100.000				102,943330	102.943,33	0,06 %
Anleihen fix		XS2049616621	SIEMENS FINANCIERINGSMAT SIEGR 0 1/8 09/05/29	EUR	100.000	100.000			98,030000	98.030,00	0,06 %
Anleihen fix		FR0013430733	SOCIETE GENERALE SOCGEN 0 7/8 07/01/26	EUR	100.000	100.000			101,924560	101.924,56	0,06 %
Anleihen fix		BE6282459609	SOLVAY SA SOLBBB 1 5/8 12/02/22	EUR	100.000				104,670770	104.670,77	0,06 %
Anleihen fix		XS1582205040	STATKRAFT AS STATK 1 1/8 03/20/25	EUR	100.000				105,468870	105.468,87	0,06 %
Anleihen fix		XS1843449395	TAKEDA PHARMACEUTICAL TACHEM 3 11/21/30	EUR	100.000				118,798810	118.798,81	0,07 %
Anleihen fix		XS1907150350	TELE2 AB TELBSS 1 1/8 05/15/24	EUR	100.000				103,846250	103.846,25	0,06 %
Anleihen fix		XS2001737324	TELENOR ASA TELNO 0 3/4 05/31/26	EUR	100.000	100.000			103,529570	103.529,57	0,06 %
Anleihen fix		XS1851313863	TELFONICA DEUTSCH FINAN ODGR 1 3/4 07/05/25	EUR	100.000				105,845040	105.845,04	0,07 %
Anleihen fix		XS1953240261	TELIA CO AB TELIAS 2 1/8 02/20/34	EUR	100.000	100.000			114,212340	114.212,34	0,07 %
Anleihen fix		XS0903136736	TELSTRA CORP LTD TLSAU 2 1/2 09/15/23	EUR	100.000				110,047560	110.047,56	0,07 %
Anleihen fix		XS1828037587	TENNET HOLDING BV TENN 1 3/8 06/05/28	EUR	100.000				109,420950	109.420,95	0,07 %
Anleihen fix		XS1651071877	THERMO FISHER SCIENTIFIC TMO 1.4 01/23/26	EUR	100.000				105,857830	105.857,83	0,07 %
Anleihen fix		XS1974787480	TOTAL SA TOTAL 1 3/4 PERP	Y EUR	100.000	100.000			103,879330	103.879,33	0,06 %
Anleihen fix		XS1195201931	TOTAL SA TOTAL 2 1/4 PERP	Y EUR	100.000	100.000	100.000		102,536670	102.536,67	0,06 %
Anleihen fix		XS1884740041	TOYOTA MOTOR FINANCE BV TOYOTA 0 5/8 09/26/23	EUR	100.000				102,570000	102.570,00	0,06 %
Anleihen fix		XS2008925344	UNILEVER PLC UNANA 1 1/2 06/11/39	EUR	100.000	100.000			111,256060	111.256,06	0,07 %
Anleihen fix		FR0013394681	VEOLIA ENVIRONNEMENT SA VIEFP 0.892 01/14/24	EUR	100.000				103,527120	103.527,12	0,06 %
Anleihen fix		XS1979280853	VERIZON COMMUNICATIONS VZ 0 7/8 04/08/27	EUR	150.000	150.000			102,965030	154.447,55	0,10 %
Anleihen fix		FR0013397452	VINCI SA DGFP 1 5/8 01/18/29	EUR	100.000				112,043130	112.043,13	0,07 %
Anleihen fix		FR0013424876	VIVENDI SA VIVFP 1 1/8 12/11/28	EUR	100.000	100.000			103,540710	103.540,71	0,06 %
Anleihen fix		XS2002018500	VODAFONE GROUP PLC VOD 1 5/8 11/24/30	EUR	100.000	200.000	100.000		106,919680	106.919,68	0,07 %
Anleihen fix		AT0000A27LQ1	VOESTALPINE AG VOEAV 1 3/4 04/10/26	EUR	100.000	150.000	50.000		102,800000	102.800,00	0,06 %
Anleihen fix		XS1972548231	VOLKSWAGEN FIN SERV AG VW 1 1/2 10/01/24	EUR	150.000	50.000			103,776410	155.664,62	0,10 %
Anleihen fix		XS1586555945	VOLKSWAGEN INTL FIN NV VW 1 7/8 03/30/27	EUR	100.000				105,632420	105.632,42	0,07 %
Anleihen fix		XS2054209833	WINTERSHALL DEA FINANCE WNTRDE 0.84 09/25/25	EUR	100.000	100.000			100,134000	100.134,00	0,06 %
Anleihen fix		US045167EJ82	ASIAN DEVELOPMENT BANK ASIA 3 1/8 09/26/28	USD	4.190.000	4.190.000	8.200.000		111,306000	4.260.078,92	2,62 %
Anleihen fix		US4581X0DC96	INTER-AMERICAN DEVEL BK IADB 3 1/8 09/18/28	USD	2.000.000	2.000.000			111,310000	2.033.523,64	1,25 %
Investmentzertifikate Raiffeisen KAG	OGAW	AT0000688676	RAIFFEISEN-ENERGIE-AKTIE (R) T	EUR	12.377	995			121,980000	1.509.746,46	0,93 %
Investmentzertifikate extern	OGAW	LU0511407297	AB FCP I - EMERGING MARKETS DEBT PORTFOLIO I2 EUR H	EUR	217.189		55.198		22,240000	4.830.283,36	2,98 %
Investmentzertifikate extern	OGAW	LU0326424115	BLACKROCK GLOBAL FUNDS - WORLD MINING FUND CLASS A2 HEDGED	EUR	351.997				3,000000	1.055.991,00	0,65 %
Investmentzertifikate extern	OGAW	LU0263854829	PARTNERS GROUP LISTED INVESTMENTS SICAV - LISTED INFRASTRUC	EUR	3.452				264,960000	914.641,92	0,56 %
Investmentzertifikate extern	OGAW	LU0273177401	DWS INVEST GLOBAL AGRIBUSINESS USD FC	USD	11.626				147,500000	1.566.416,99	0,96 %

Wertpapierart	OGAW/§ 166	ISIN	Wertpapierbezeichnung	Währung	Bestand Stk./Nom.	Käufe im Berichtszeitraum Stk./Nom.	Verkäufe	Pool-/ILB-Faktor	Kurs	Kurswert in EUR	Anteil am Fondsvermögen
Investmentzertifikate extern	OGAW	CH0002783535	FALCON GOLD EQUITY FUND A	USD	3.488		791		269,310000	858.052,78	0,53 %
Partizipationsscheine		XS1800820265	HSBC BANK PLC HSBC 0 03/23/21	USD	9.187				3,539530	29.703,28	0,02 %
Partizipationsscheine		XS2041147658	HSBC BANK PLC HSBC 0 08/18/20	USD	22.029	22.029			2,142920	43.120,70	0,03 %
Partizipationsscheine		XS1540070163	HSBC BANK PLC HSBC 0 12/23/19	USD	1.400				14,000000	17.903,63	0,01 %
Strukturierte Produkte - Inflationsgebundene Anleihen		IT0005246134	BUONI POLIENNALI DEL TES BTPS 1.3 05/15/28	EUR	5.700.000			1,043160	110,149000	6.549.472,76	4,03 %
Strukturierte Produkte - Inflationsgebundene Anleihen		DE0001030559	DEUTSCHLAND I/L BOND DBRI 0 1/2 04/15/30	EUR	5.600.000	3.300.000		1,055480	122,600000	7.246.503,49	4,46 %
Strukturierte Produkte - Inflationsgebundene Anleihen		DE0001030542	DEUTSCHLAND I/L BOND DBRI 0.1 04/15/23	EUR	8.200.000	3.100.000		1,081570	105,233000	9.332.982,18	5,75 %
Strukturierte Produkte - Inflationsgebundene Anleihen		DE0001030567	DEUTSCHLAND I/L BOND DBRI 0.1 04/15/26	EUR	13.750.000	10.850.000		1,052690	110,797000	16.037.297,92	9,88 %
Strukturierte Produkte - Inflationsgebundene Anleihen		FR0011982776	FRANCE (GOVT OF) FRTR 0.7 07/25/30	EUR	6.250.000	500.000	200.000	1,047460	121,713000	7.968.093,69	4,91 %
Strukturierte Produkte - Inflationsgebundene Anleihen		FR0010585901	FRANCE (GOVT OF) FRTR 2.1 07/25/23	EUR	5.900.000	2.050.000		1,141520	113,236000	7.626.408,36	4,70 %
Strukturierte Produkte - Inflationsgebundene Anleihen		US912828UH11	TSY INFL IX N/B TII 0 1/8 01/15/23	USD	3.200.000	200.000		1,111490	99,187500	3.222.534,15	1,98 %
Strukturierte Produkte - Inflationsgebundene Anleihen		US912828WU04	TSY INFL IX N/B TII 0 1/8 07/15/24	USD	9.800.000		1.100.000	1,080480	99,953125	9.667.723,72	5,95 %
Strukturierte Produkte - Inflationsgebundene Anleihen		US912828Y388	TSY INFL IX N/B TII 0 3/4 07/15/28	USD	4.150.000	400.000	250.000	1,022070	105,015625	4.068.812,76	2,51 %
Strukturierte Produkte - Inflationsgebundene Anleihen		US9128285W63	TSY INFL IX N/B TII 0 7/8 01/15/29	USD	8.300.000	8.300.000		1,016060	106,171875	8.178.845,04	5,04 %
Summe der zum amtlichen Handel oder einem anderen geregelten Markt zugelassenen Wertpapiere und Investmentzertifikate										118.801.259,55	73,17 %
Aktien		TW0006488000	GLOBALWAFERS CO LTD 6488	TWD	2.800	800			314,000000	25.886,16	0,02 %
Summe der nicht zum amtlichen Handel oder einem anderen geregelten Markt zugelassenen Wertpapiere										25.886,16	0,02 %
Summe Wertpapiervermögen										118.827.145,71	73,19 %
Aktienindex Futures		FESX20191220	EURO STOXX 50 Dec19 VGZ9	EUR	132				3.530,000000	29.040,00	0,02 %
Aktienindex Futures		FESX20191220	EURO STOXX 50 Dec19 VGZ9	EUR	342				3.530,000000	75.240,00	0,05 %
Aktienindex Futures		FESX20191220	EURO STOXX 50 Dec19 VGZ9	EUR	-17				3.530,000000	-3.740,00	-0,00 %
Aktienindex Futures		FTSE20191220	FTSE 100 IDX FUT Dec19 Z Z9	GBP	-7				7.388,500000	-6.927,97	-0,00 %
Aktienindex Futures		FTSE20191220	FTSE 100 IDX FUT Dec19 Z Z9	GBP	94				7.388,500000	94.089,87	0,06 %
Aktienindex Futures		FSNK20191212	NIKKEI 225 (SGX) Dec19 NIZ9 PIT	JPY	-5				21.800,000000	-13.154,26	-0,01 %
Aktienindex Futures		FTSP20191212	TOPIX INDX FUTR Dec19 TPZ9 PIT	JPY	25				1.597,000000	125.630,64	0,08 %
Aktienindex Futures		FTSP20191212	TOPIX INDX FUTR Dec19 TPZ9 PIT	JPY	11				1.597,000000	3.477,79	0,00 %
Aktienindex Futures		FEMI20191220	MSCI EmgMkt Dec19 MESZ9	USD	4				997,000000	-5.316,28	-0,00 %
Aktienindex Futures		FEMI20191220	MSCI EmgMkt Dec19 MESZ9	USD	6				997,000000	-6.083,58	-0,00 %
Aktienindex Futures		OFES20191220	S&P500 EMINI FUT Dec19 ESZ9	USD	-6				2.963,750000	12.098,65	0,01 %
Anleihenfutures		FCGB20191218	CAN 10YR BOND FUT Dec19 CNZ9	CAD	34				142,980000	45.294,22	-0,03 %
Anleihenfutures		FGBM20191206	EURO-BOBL FUTURE Dec19 OEZ9	EUR	-65				135,600000	52.745,55	0,03 %
Anleihenfutures		FGBM20191206	EURO-BOBL FUTURE Dec19 OEZ9	EUR	-105				135,600000	85.204,35	0,05 %
Anleihenfutures		FGBM20191206	EURO-BOBL FUTURE Dec19 OEZ9	EUR	-3				135,600000	2.434,41	0,00 %
Anleihenfutures		FBTP20191206	Euro-BTP Future Dec19 IKZ9	EUR	-44				145,670000	-25.520,00	-0,02 %
Anleihenfutures		FBTP20191206	Euro-BTP Future Dec19 IKZ9	EUR	15				145,670000	3.600,00	0,00 %
Anleihenfutures		FGBL20191206	EURO-BUND FUTURE Dec19 RXZ9	EUR	-4				174,210000	7.160,00	0,00 %
Anleihenfutures		FGBL20191206	EURO-BUND FUTURE Dec19 RXZ9	EUR	39				174,210000	-34.320,00	-0,02 %
Anleihenfutures		FGBL20191206	EURO-BUND FUTURE Dec19 RXZ9	EUR	-102				174,210000	90.954,52	0,06 %
Anleihenfutures		FGBL20191206	EURO-BUND FUTURE Dec19 RXZ9	EUR	-45				174,210000	38.700,00	0,02 %
Anleihenfutures		FOAT20191206	Euro-OAT Future Dec19 OATZ9	EUR	-66				170,290000	43.560,00	0,03 %
Anleihenfutures		FTNU20191219	US 10yr Ultra Fut Dec19 UXYZ9 PIT	USD	192				142,437500	-387.759,76	-0,24 %
Anleihenfutures		FTNU20191219	US 10yr Ultra Fut Dec19 UXYZ9 PIT	USD	26				142,437500	-66.796,07	-0,04 %
Anleihenfutures		FTNU20191219	US 10yr Ultra Fut Dec19 UXYZ9 PIT	USD	-90				142,437500	181.762,39	0,11 %
Anleihenfutures		FTN520191231	US 5YR NOTE (CBT) Dec19 FVZ9 PIT	USD	257				119,195313	-181.569,59	-0,11 %

Berichtszeitraum 01.04.2019 – 30.09.2019

Raiffeisen-GlobalAllocation-StrategiesPlus

Wertpapierart	OGAW/§ 166	ISIN	Wertpapierbezeichnung	Währung	Bestand Stk./Nom.	Käufe im Berichtszeitraum Stk./Nom.	Verkäufe im Berichtszeitraum Stk./Nom.	Pool-/ILB-Faktor	Kurs	Kurswert in EUR	Anteil am Fondsvermögen
Anleihenfutures		FTN520191231	US 5YR NOTE (CBT) Dec19 FVZ9 PIT	USD	-90				119,195313	62.942,42	0,04 %
Rohstoffindex Futures		XLEN20191230	BCOMEN Energy XL Dec19 XLBZ9	USD	177				35,140000	-544.945,93	-0,34 %
Rohstoffindex Futures		XLEN20191230	BCOMEN Energy XL Dec19 XLBZ9	USD	105				35,140000	-323.273,01	-0,20 %
Rohstoffindex Futures		FCIN20191230	BCOMIN Ind Mets Dec19 FCIZ9	USD	174				115,560000	-77.336,62	-0,05 %
Rohstoffindex Futures		FCIN20191230	BCOMIN Ind Mets Dec19 FCIZ9	USD	62				115,560000	-27.556,73	-0,02 %
Rohstoffindex Futures		FCIN20191230	BCOMIN Ind Mets Dec19 FCIZ9	USD	78				115,560000	-34.668,14	-0,02 %
Rohstoffindex Futures		FCPR20191230	BCOMPR PRECIOUS Dec19 UBPZ9	USD	266				184,720000	-133.929,14	-0,08 %
Rohstoffindex Futures		FCPR20191230	BCOMPR PRECIOUS Dec19 UBPZ9	USD	81				184,720000	-40.782,94	-0,03 %
Währungsfutures		0FCD20191217	C\$ CURRENCY FUT Dec19 CDZ9 PIT	USD	23				0,756380	-10.336,61	-0,01 %
Währungsfutures		0FEC20191216	EURO FX CURR FUT Dec19 ECZ9 PIT	USD	-39				1,101100	51.655,63	0,03 %
Rendite Futures		FTCB20191216	AUST 10Y BOND FUT Dec19 XMZ9 PIT	AUD	257				99,060000	401.476,24	0,25 %
Summe Finanzterminkontrakte ¹										-607.538,39	-0,37 %
Devisentermingeschäfte			Forward / BOUGHT MXN / SOLD USD / Raiffeisen Bank International AG	MXN	81.400.000				21,650443	17.060,83	0,01 %
Devisentermingeschäfte			Forward / BOUGHT RUB / SOLD USD / Raiffeisen Bank International AG	RUB	277.800.000				70,834310	80.797,22	0,05 %
Devisentermingeschäfte			Forward / BOUGHT TRY / SOLD USD / Raiffeisen Bank International AG	TRY	26.400.000				6,295828	-3.062,81	-0,00 %
Devisentermingeschäfte			Forward / SOLD TRY / BOUGHT USD / Raiffeisen Bank International AG	TRY	-2.500.000				6,295828	510,05	0,00 %
Devisentermingeschäfte			Forward / SOLD USD / BOUGHT EUR / Raiffeisen Bank International AG	USD	-26.950.000				1,098299	-654.783,39	-0,40 %
FX NDF			Forward / BOUGHT ARS / SOLD USD / Raiffeisen Bank International AG	ARS	191.700.000				74,205678	-827.733,00	-0,51 %
FX NDF			Forward / BOUGHT ARS / SOLD USD / Raiffeisen Bank International AG	ARS	47.500.000				74,205678	37.304,91	0,02 %
FX NDF			Forward / BOUGHT IDR / SOLD USD / Raiffeisen Bank International AG	IDR	61.100.000.000				15.579,435649	64.951,31	0,04 %
Summe Devisentermingeschäfte ¹										-1.284.954,90	-0,79 %
Bankguthaben/-verbindlichkeiten											
				EUR						24.025.725,51	14,80 %
				AUD						306.827,76	0,19 %
				CAD						510.375,54	0,31 %
				CHF						367.988,77	0,23 %
				GBP						270.128,80	0,17 %
				HKD						3.530,02	0,00 %
				JPY						-427.403,25	-0,26 %
				MXN						13.242,06	0,01 %
				PLN						-9.466,84	-0,01 %
				SEK						95.935,85	0,06 %
				THB						-397,28	-0,00 %
				TRY						10.815,67	0,01 %
				TWD						39.919,50	0,02 %
				USD						5.394.562,25	3,32 %
				ZAR						25.892,42	0,02 %
Festgeld in Fondswährung										14.000.000,00	8,62 %
Summe Bankguthaben/-verbindlichkeiten										44.627.676,78	27,49 %

Wertpapierart	OGAW/§ 166	ISIN	Wertpapierbezeichnung	Währung	Bestand Stk./Nom.	Käufe im Berichtszeitraum Stk./Nom.	Verkäufe Stk./Nom.	Pool-/ILB-Faktor	Kurs	Kurswert in EUR	Anteil am Fondsvermögen
Abgrenzungen											
Zinsenansprüche (aus Wertpapieren und Bankguthaben)										170.514,83	0,10 %
Cash Collateral Zinsen gegeben										-315,93	0,00 %
Dividendenforderungen										16.105,24	0,01 %
Forderung Bestandsprovision										2.410,39	0,00 %
Summe Abgrenzungen										188.714,53	0,12 %
Sonstige Verrechnungsposten											
Diverse Gebühren										-319.394,99	-0,20 %
Summe Sonstige Verrechnungsposten										-319.394,99	-0,20 %
Cash Collateral											
Forderungen aus gegebenen Sicherheiten										930.000,00	0,57 %
Summe Cash Collateral										930.000,00	0,57 %
Summe Fondsvermögen										162.361.648,73	100,00 %

ISIN	Ertragstyp		Währung	Errechneter Wert je Anteil	Umlaufende Anteile in Stück
AT0000A0SDX8	I	Ausschüttung	EUR	149,88	1.380.000
AT0000A0SE09	R	Ausschüttung	EUR	142,96	475.997
AT0000A1Z3C4	RZ	Ausschüttung	EUR	103,95	95.000
AT0000A0SDY6	I	Thesaurierung	EUR	160,70	730.834
AT0000A090H8	S	Thesaurierung	EUR	159,57	783.641.863
AT0000A0SE17	R	Thesaurierung	EUR	151,70	81.061.089
AT0000A1Z3D2	RZ	Thesaurierung	EUR	105,08	224.865
AT0000A0SDZ3	I	Vollthesaurierung Ausland	EUR	161,68	134.758.256
AT0000A0SE25	R	Vollthesaurierung Ausland	EUR	150,94	18.540.999
AT0000A1YBX8	RZ	Vollthesaurierung Ausland	EUR	105,27	10.000

In der Vermögensaufstellung gesperrte Wertpapiere (Wertpapierleihegeschäfte)

ISIN	Wertpapierbezeichnung	Währung	Bestand per 30.09.2019
DE0001030542	DEUTSCHLAND I/L BOND DBRI 0.1 04/15/23	EUR	5.700.000
DE0001030567	DEUTSCHLAND I/L BOND DBRI 0.1 04/15/26	EUR	6.750.000
FR0010585901	FRANCE (GOVT OF) FRTR 2.1 07/25/23	EUR	5.900.000

Devisenkurse

Vermögenswerte in fremder Währung wurden zu den Devisenkursen per 27.09.2019 in EUR umgerechnet

Währung	Kurs (1 EUR =)
Australische Dollar	AUD 1,616200
Brasilianische Real	BRL 4,545150
Kanadische Dollar	CAD 1,448750
Schweizer Franken	CHF 1,085900
Tschechische Kronen	CZK 25,853000

Währung		Kurs (1 EUR =)
Britische Pfund	GBP	0,889150
Hongkong Dollar	HKD	8,581750
Ungarische Forint	HUF	335,235000
Indonesische Rupien	IDR	15.507,134500
Indische Rupien	INR	77,249650
Japanische Yen	JPY	118,402650
Koreanische Won	KRW	1.313,645300
Mexikanische Pesos	MXN	21,491850
Malaysische Ringgit	MYR	4,584800
Philippinische Peso	PHP	56,795650
Polnische Zloty	PLN	4,379850
Rumänische Lei	RON	4,753550
Russische Rubel	RUB	70,417100
Schwedische Kronen	SEK	10,717400
Thailändische Baht	THB	33,545850
Türkische Lire	TRY	6,194350
Taiwan Dollar	TWD	33,964100
Amerikanische Dollar	USD	1,094750
Südafrikanische Rand	ZAR	16,525950

Während des Berichtszeitraumes getätigte Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, soweit sie nicht in der Vermögensaufstellung genannt sind:

Wertpapierart	OGAW/§ 166	ISIN	Wertpapierbezeichnung	Währung		Käufe Zugänge	Verkäufe Abgänge
Aktien		KYG040111059	ANTA SPORTS PRODUCTS LTD 2020	HKD			9.000
Aktien		CNE1000002F5	CHINA COMMUNICATIONS CONST-H 1800	HKD			48.000
Aktien		CNE1000002G3	CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H 552	HKD		74.000	74.000
Aktien		HK0688002218	CHINA OVERSEAS LAND & INVEST 688	HKD			22.000
Aktien		HK0000049939	CHINA UNICOM HONG KONG LTD 762	HKD			55.000
Aktien		KYG2140A1076	CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD 884	HKD		81.000	81.000
Aktien		KYG3777B1032	GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT 175	HKD			35.000
Aktien		BMG5320C1082	KUNLUN ENERGY CO LTD 135	HKD			64.000
Aktien		KYG532241042	KWG GROUP HOLDINGS LTD 1813	HKD		34.500	34.500
Aktien		BMG653181005	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS 2689	HKD			48.000
Aktien		HK0006000050	POWER ASSETS HOLDINGS LTD 6	HKD			7.000
Aktien		CNE100000FN7	SINOPHARM GROUP CO-H 1099	HKD			7.200
Aktien		KR7090430000	AMOREPACIFIC CORP 090430	KRW			350
Aktien		KR7028260008	SAMSUNG C&T CORP 028260	KRW			580
Aktien		KR7096770003	SK INNOVATION CO LTD 096770	KRW			410
Aktien		KR7017670001	SK TELECOM 017670	KRW			290
Aktien		MYL581900007	HONG LEONG BANK BERHAD HLBK	MYR			8.200
Aktien		PHY077751022	BDO UNIBANK INC BDO	PHP		14.000	14.000
Aktien		PLBZ00000044	SANTANDER BANK POLSKA SA SPL	PLN			42
Aktien		RU0009029524	SURGUTNEFTGAS-PREFERENCE SNGSP	RUB			93.500
Aktien		TW0002327004	YAGEO CORPORATION 2327	TWD			3.700
Aktien		ZAE000156550	MONDI LTD MND	ZAR			2.700
Aktien		ZAE000255360	OLD MUTUAL LTD OMU	ZAR			20.700
Aktien		NL0013654783	PROSUS PRX	ZAR		960	
Aktien		ZAE000012084	SHOPRITE HOLDINGS LTD SHP	ZAR			5.400
Aktien GDR		US83367Y2072	ELECTRICA SA-GDR-REG S ELSA	USD			1.085
Anleihen fix		XS1967636199	ABERTIS INFRASTRUCTURAS ABESM 3 03/27/31	EUR		100.000	100.000
Anleihen fix		XS1622624242	ALLERGAN FUNDING SCS AGN 1 1/4 06/01/24	EUR		100.000	100.000

Wertpapierart	OGAW/§ 166	ISIN	Wertpapierbezeichnung	Währung		Käufe Zugänge	Verkäufe Abgänge
Anleihen fix		XS1843443786	ALTRIA GROUP INC MO 3 1/8 06/15/31	EUR			100.000
Anleihen fix		XS1686846061	ANGLO AMERICAN CAPITAL AALLN 1 5/8 09/18/25	EUR			100.000
Anleihen fix		BE6301511034	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/ ABIBB 2 01/23/35	EUR			100.000
Anleihen fix		BE6285457519	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/ ABIBB 2 3/4 03/17/36	EUR		100.000	100.000
Anleihen fix		FR0013252277	ARKEMA AKEFP 1 1/2 04/20/27	EUR			100.000
Anleihen fix		XS1907120528	AT&T INC T 1.8 09/05/26	EUR			100.000
Anleihen fix		XS1799611642	AXA SA AXASA 3 1/4 05/28/49	EUR		100.000	100.000
Anleihen fix		XS1203859928	BAT INTL FINANCE PLC BATSLN 1 1/4 03/13/27	EUR			100.000
Anleihen fix		XS1998215559	BAXTER INTERNATIONAL INC BAX 1.3 05/15/29	EUR		100.000	100.000
Anleihen fix		XS1888229249	BERTELSMANN SE & CO KGAA BERTEL 1 1/4 09/29/25	EUR			100.000
Anleihen fix		XS1823246712	BMW FINANCE NV BMW 0 1/2 11/22/22	EUR			100.000
Anleihen fix		XS2010447238	BMW FINANCE NV BMW 0 3/4 07/13/26	EUR		50.000	50.000
Anleihen fix		XS1747444245	BMW FINANCE NV BMW 0 3/8 07/10/23	EUR		100.000	100.000
Anleihen fix		FR0013405537	BNP PARIBAS BNP 1 1/8 08/28/24	EUR			100.000
Anleihen fix		XS1527126772	BP CAPITAL MARKETS PLC BPLN 1.117 01/25/24	EUR			100.000
Anleihen fix		XS1720922175	BRITISH TELECOMMUNICATIO BRITEL 1 11/21/24	EUR			100.000
Anleihen fix		DE0001102465	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND DBR 0 1/4 02/15/29	EUR		300.000	300.000
Anleihen fix		DE0001102457	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND DBR 0 1/4 08/15/28	EUR			100.000
Anleihen fix		IT0005325946	BUONI POLIENNALI DEL TES BTPS 0.95 03/01/23	EUR			5.600.000
Anleihen fix		XS1806130305	CK HUTCHISON EUR FIN 18 CKHH 2 04/13/30	EUR			100.000
Anleihen fix		XS1197832915	COCA-COLA CO/THE KO 0 3/4 03/09/23	EUR			100.000
Anleihen fix		XS1955024713	COCA-COLA CO/THE KO 0 3/4 09/22/26	EUR		100.000	100.000
Anleihen fix		XS1995795504	COCA-COLA HBC FINANCE BV CCHLN 1 5/8 05/14/31	EUR		100.000	100.000
Anleihen fix		XS1871439342	COOPERATIEVE RABOBANK UA RABOBK 0 3/4 08/29/23	EUR			100.000
Anleihen fix		XS1991126431	COOPERATIEVE RABOBANK UA RABOBK 1 1/8 05/07/31	EUR		100.000	100.000
Anleihen fix		XS1968706108	CREDIT AGRICOLE SA ACAFP 2 03/25/29	EUR		100.000	100.000
Anleihen fix		DE000A190NE4	DAIMLER INTL FINANCE BV DAIGR 1 11/11/25	EUR			100.000
Anleihen fix		DE000A2RYD91	DAIMLER INTL FINANCE BV DAIGR 1 3/8 06/26/26	EUR			50.000
Anleihen fix		DE000A2TSDE2	DEUTSCHE TELEKOM AG DT 1 3/4 03/25/31	EUR			50.000
Anleihen fix		XS1883911924	DNB BANK ASA DNBNO 0.6 09/25/23	EUR			100.000
Anleihen fix		XS1616411036	E.ON SE EOANGR 0 3/8 08/23/21	EUR			50.000
Anleihen fix		XS1616411119	E.ON SE EOANGR 1 5/8 05/22/29	EUR			50.000
Anleihen fix		FR0013367612	ELECTRICITE DE FRANCE SA EDF 4 PERP	EUR			100.000
Anleihen fix		XS1240751062	ELI LILLY & CO LLY 1 5/8 06/02/26	EUR			100.000
Anleihen fix		XS1901055472	ENBW INTL FINANCE BV ENBW 1 7/8 10/31/33	EUR			50.000
Anleihen fix		XS1750986744	ENEL FINANCE INTL NV ENELIM 1 1/8 09/16/26	EUR			100.000
Anleihen fix		FR0013428513	ENGIE SA ENGIFP 1 3/8 06/21/39	EUR		100.000	100.000
Anleihen fix		XS1697916358	FCA BANK SPA IRELAND FCABNK 0 1/4 10/12/20	EUR			100.000
Anleihen fix		XS1548776498	FCE BANK PLC F 0.869 09/13/21	EUR			100.000
Anleihen fix		XS1843436574	FIDELITY NATL INFO SERV FIS 0 3/4 05/21/23	EUR		100.000	100.000
Anleihen fix		XS2013574384	FORD MOTOR CREDIT CO LLC F 2.386 02/17/26	EUR		100.000	100.000
Anleihen fix		XS1936208419	FRESENIUS SE & CO KGAA FREGR 2 7/8 02/15/29	EUR			50.000
Anleihen fix		XS1824462896	G4S INTL FINANCE PLC GFSLN 1 7/8 05/24/25	EUR			100.000
Anleihen fix		XS1612542669	GENERAL ELECTRIC CO GE 0 3/8 05/17/22	EUR			100.000
Anleihen fix		XS1612543394	GENERAL ELECTRIC CO GE 2 1/8 05/17/37	EUR		100.000	100.000
Anleihen fix		XS1202849086	GLENCORE FINANCE EUROPE GLENLN 1 3/4 03/17/25	EUR			100.000
Anleihen fix		XS1797138960	IBERDROLA INTL BV IBESM 2 5/8 PERP	EUR			100.000
Anleihen fix		XS1944456018	IBM CORP IBM 0 3/8 01/31/23	EUR			100.000
Anleihen fix		XS1558013360	IMPERIAL BRANDS FIN PLC IMBLN 1 3/8 01/27/25	EUR			100.000
Anleihen fix		XS2015329498	INVESTOR AB INVSA 1 1/2 06/20/39	EUR		100.000	100.000
Anleihen fix		XS2020670852	MEDTRONIC GLOBAL HLDINGS MDT 1 07/02/31	EUR		100.000	100.000
Anleihen fix		XS1960678255	MEDTRONIC GLOBAL HLDINGS MDT 1 1/8 03/07/27	EUR			100.000

Wertpapierart	OGAW/§ 166	ISIN	Wertpapierbezeichnung	Währung		Käufe Zugänge	Verkäufe Abgänge
Anleihen fix		XS1890709774	MITSUBISHI UFJ FIN GRP MUFG 0.98 10/09/23	EUR			100.000
Anleihen fix		XS1813593313	MONDI FINANCE PLC MNDLNL 1 5/8 04/27/26	EUR			100.000
Anleihen fix		FI4000261201	NESTE OYJ NESVFH 1 1/2 06/07/24	EUR			100.000
Anleihen fix		XS1648298559	NESTLE HOLDINGS INC NESNVX 0 7/8 07/18/25	EUR			100.000
Anleihen fix		FR0013396512	ORANGE SA ORAFP 1 1/8 07/15/24	EUR			100.000
Anleihen fix		XS1824425349	PETROLEOS MEXICANOS PEMEX 2 1/2 11/24/22	EUR			100.000
Anleihen fix		XS1574157357	PFIZER INC PFE 0 1/4 03/06/22	EUR			100.000
Anleihen fix		FR0013412699	RCI BANQUE SA RENAUL 0 3/4 04/10/23	EUR		80.000	80.000
Anleihen fix		FR0013334695	RCI BANQUE SA RENAUL 1 5/8 05/26/26	EUR			50.000
Anleihen fix		FR0013428414	RENAULT SA RENAUL 1 1/4 06/24/25	EUR		100.000	100.000
Anleihen fix		FR0013368164	RTE RESEAU DE TRANSPORT RTEFRA 1 1/2 09/27/30	EUR			100.000
Anleihen fix		FR0013445152	RTE RESEAU DE TRANSPORT RTEFRA 1 1/8 09/09/49	EUR		100.000	100.000
Anleihen fix		FR0013324332	SANOFI SANFP 0 1/2 03/21/23	EUR			100.000
Anleihen fix		DE000A2YB7B5	SCHAEFFLER AG SHAEFF 2 7/8 03/26/27	EUR			50.000
Anleihen fix		XS1476654238	SHELL INTERNATIONAL FIN RDSALN 0 3/8 02/15/25	EUR			100.000
Anleihen fix		XS1955187858	SIEMENS FINANCIERINGSMAT SIEGR 1 1/4 02/28/31	EUR		50.000	100.000
Anleihen fix		XS1141969912	SKY LTD CMCSA 1 7/8 11/24/23	EUR			100.000
Anleihen fix		FR0013403441	SOCIETE GENERALE SOCGEN 1 1/4 02/15/24	EUR			100.000
Anleihen fix		AT0000A0V7D8	STRABAG SE STRAV 4 1/4 05/10/19	EUR			50.000
Anleihen fix		FR0011993500	SUEZ SEVFP 3 PERP	EUR		100.000	100.000
Anleihen fix		XS1715328768	SWEDISH MATCH AB SWEMAT 1.2 11/10/25	EUR			100.000
Anleihen fix		XS1877846110	TELEFONICA EMISIONES SAU TELEFO 1.495 09/11/25	EUR			100.000
Anleihen fix		XS1961772560	TELEFONICA EMISIONES SAU TELEFO 1.788 03/12/29	EUR			100.000
Anleihen fix		XS0933241456	TELENOR ASA TELNO 2 1/2 05/22/25	EUR			100.000
Anleihen fix		XS0746010908	TELIA CO AB TELIAS 3 5/8 02/14/24	EUR			100.000
Anleihen fix		XS1652866002	TERNA SPA TRNIM 1 3/8 07/26/27	EUR			100.000
Anleihen fix		XS1857683335	TORONTO-DOMINION BANK TD 0 5/8 07/20/23	EUR			100.000
Anleihen fix		XS1693818285	TOTAL CAPITAL INTL SA TOTAL 0 5/8 10/04/24	EUR			100.000
Anleihen fix		XS1769090991	UNILEVER NV UNANA 1 1/8 02/12/27	EUR			100.000
Anleihen fix		XS1822301203	UNITED TECHNOLOGIES CORP UTX 1.15 05/18/24	EUR			100.000
Anleihen fix		XS0191154961	VATTENFALL AB VATFAL 5 3/8 04/29/24	EUR			50.000
Anleihen fix		XS1708161291	VERIZON COMMUNICATIONS VZ 1 3/8 10/27/26	EUR			100.000
Anleihen fix		XS2002017361	VODAFONE GROUP PLC VOD 0.9 11/24/26	EUR		100.000	100.000
Anleihen fix		XS1721422068	VODAFONE GROUP PLC VOD 1 7/8 11/20/29	EUR			100.000
Anleihen fix		XS1888179477	VODAFONE GROUP PLC VOD 3.1 01/03/79	EUR			100.000
Anleihen fix		AT0000A1Y3P7	VOESTALPINE AG VOEAV 1 3/8 09/27/24	EUR			100.000
Anleihen fix		XS1944390241	VOLKSWAGEN BANK GMBH VW 1 7/8 01/31/24	EUR			100.000
Anleihen fix		XS2054210252	WINTERSHALL DEA FINANCE WNTRDE 1.332 09/25/28	EUR		100.000	100.000
Anleihen fix		US298785HM16	EUROPEAN INVESTMENT BANK EIB 2 3/8 05/24/27	USD			8.700.000
Investmentzertifikate Raiffeisen KAG	OGAW	AT0000A0JQU5	RAIFFEISEN-INFLATION-SHIELD (R) T	EUR			30.519
Partizipationsscheine		XS1476553554	HSBC BANK PLC HSBC 0 08/15/19	USD			22.029
Strukturierte Produkte - Inflationsgebundene Anleihen		IT0004243512	BUONI POLIENNALI DEL TES BTPS 2.6 09/15/23	EUR			4.000.000
Strukturierte Produkte - Inflationsgebundene Anleihen		DE0001030526	DEUTSCHLAND I/L BOND DBRI 1 3/4 04/15/20	EUR			7.900.000
Strukturierte Produkte - Inflationsgebundene Anleihen		US912828PP91	TSY INFL IX N/B TII 1 1/8 01/15/21	USD			3.500.000
Strukturierte Produkte - Inflationsgebundene Anleihen		US912810PV44	TSY INFL IX N/B TII 1 3/4 01/15/28	USD			7.400.000

1 Kursgewinne und -verluste zum Stichtag.

Zusätzliche Angaben zu Wertpapierleihegeschäften

- Angaben zum Gesamtrisiko (Exposure) (zum Stichtag verliehener Wertpapierbestand im Verhältnis zum Fondsvolumen):

13,56 %

Betrag der verliehenen Wertpapiere: 22.018.812,52 EUR

Anteil an den verleihbaren Vermögenswerten: 18,53 %

Zum Stichtag 30.09.2019 waren folgende Wertpapiere verliehen:

ISIN	Wertpapierbezeichnung	Geregelter Markt	Währung	Assetklasse	Emittent	Rating	Bestand per 30.09.2019	Kurswert (inkl. allfälliger Stückzinsen) 30.09.2019	Anteil am Fondsvermögen
DE0001030542	DEUTSCHLAND I/L BOND DBRI 0.1 04/15/23	LISTED	EUR	Anleihen	Federal Republic of Germany	aaa	5.700.000	6.490.390,60	4,00 %
DE0001030567	DEUTSCHLAND I/L BOND DBRI 0.1 04/15/26	LISTED	EUR	Anleihen	Federal Republic of Germany	aaa	6.750.000	7.876.122,58	4,85 %
FR0010585901	FRANCE (GOVT OF) FRTR 2.1 07/25/23	LISTED	EUR	Anleihen	French Republic	aa	5.900.000	7.652.299,34	4,71 %

- Angaben zu der Identität der Gegenparteien der Wertpapierleihegeschäfte:

Raiffeisen Bank International AG (als anerkanntes Wertpapierleihesystem im Sinne des § 84 InvFG)

- Angaben über Art und Höhe der vom Investmentfonds erhaltenen Sicherheiten, die auf das Gegenparteienrisiko anrechenbar sind:

Gemäß dem zwischen der Verwaltungsgesellschaft und der Raiffeisen Bank International AG abgeschlossenen Rahmenvertrag für Wertpapierleihegeschäfte ist die Raiffeisen Bank International AG verpflichtet, für die entliehenen Wertpapiere Sicherheiten zu liefern. Zulässige Sicherheiten sind Anleihen, Aktien und Anteile an Investmentfonds. Die Emittenten der als Sicherheiten eingesetzten Anleihen können unter anderem Staaten, supranationale Emittenten und/oder Unternehmen sein, wobei es keine Vorgaben bezüglich der Laufzeiten dieser Anleihen gibt. Im Zuge der Sicherheitenbestellung wird gemäß § 4 der Verordnung zu Wertpapierleih- und Pensionsgeschäften (WPV) sowohl hinsichtlich Diversifizierung und Korrelation auf eine insbesondere durch quantitative Emittentengrenzen erzielte Risikosteuerung als auch auf entsprechende Liquidität der Sicherheiten im Sinne der Handel- und Verwertbarkeit geachtet. Die Sicherheiten werden auf bankarbeitstäglicher Basis bewertet und gegenüber der Bewertung der aus dem Fonds verliehenen Wertpapiere unter Anwendung von Bestimmungen der EU Verordnung 575/2013 (CRR) mit einem Aufschlag versehen, der bei Anleihen aufgrund der Bonität des Emittenten und der Restlaufzeit der Anleihe festgelegt wird und mindestens 0,5 v. H. beträgt. Bei Aktien und Anteilen an Investmentfonds beträgt der Aufschlag 10,607 %. Der auf diese Art ermittelte Wert der zu leistenden Sicherheiten führt zu einer laufenden Übersicherung der offenen Wertpapierleihepositionen des Fonds.

Zum Stichtag setzten sich die Sicherheiten wie folgt zusammen:

ISIN	Wertpapierbezeichnung	Geregelter Markt	Währung	Assetklasse	Emittent	Rating	Bestand per 30.09.2019	Kurswert in Portfoliowährung
US191241AD01	COCA-COLA FEMSA SAB CV KOF 4 5/8 02/15/20	LISTED	USD	Anleihen	Coca-Cola Femsa SAB de CV	a	18.000.000	16.566.083,58
XS1891571348	CHINA GOVT INTL BOND CHINA 3 1/4 10/19/23	LISTED	USD	Anleihen	People's Republic of China	a	9.000.000	8.616.828,96

Der Investmentfonds wird hinsichtlich der Wertpapierleihegeschäfte nicht vollständig durch Wertpapiere besichert, die von einem Mitgliedstaat des EWR begeben oder garantiert werden.

Laufzeit der Sicherheiten: unbefristet

Laufzeit der Wertpapierleihe:

Laufzeit / Tage	< 1 Tag	1-7 Tage	7-30 Tage	30-90 Tage	90-360 Tage
	0 %	0 %	0 %	0 %	100 %

Land der Gegenpartei (Raiffeisen Bank International AG): Österreich

Abwicklung: bilateral

- Angaben zur Weiterverwendung von Sicherheiten:

Die erhaltenen Sicherheiten werden nicht weiterverwendet.

- Verwahrung von Sicherheiten, die der Investmentfonds im Rahmen von Wertpapierleihegeschäften erhalten hat:

Die Sicherheiten werden für jeden Fonds auf einem gesonderten Subdepot bei der Depotbank/Verwahrstelle verwahrt.

- Verwahrung von Sicherheiten, die der Investmentfonds im Rahmen von Wertpapierleihegeschäften gestellt hat:

Im Rahmen der gesetzlichen Vorgaben (§ 84 InvFG) ist die Verwaltungsgesellschaft lediglich berechtigt, Wertpapiere an Dritte zu verleihen. Sie ist jedoch nicht berechtigt, Wertpapiere zu entleihen. Daher werden vom Investmentfonds im Rahmen von Wertpapierleihegeschäften keine Sicherheiten gestellt.

Zusätzliche Angaben zu Pensionsgeschäften

Im Berichtszeitraum wurden keine Pensionsgeschäfte für den Fonds durchgeführt. Dementsprechend sind die in § 8 Wertpapierleih- und Pensionsgeschäfteverordnung sowie Art. 13 VO (EU) 2015/2365 vorgesehenen näheren Angaben zu Pensionsgeschäften nicht erforderlich.

Zusätzliche Angaben zu Sicherheiten bei OTC-Derivaten

Entsprechend den Anforderungen der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 des Europäischen Parlaments und des Rates über OTC-Derivate, zentrale Gegenparteien und Transaktionsregister („EMIR“) werden OTC-Derivate mit Ausnahme eines Mindesttransferbetrages („Minimum Transfer Amount“) besichert, wodurch das Ausfallsrisiko der Gegenpartei des OTC-Derivates reduziert wird. Als Sicherheiten wurden in der Berichtsperiode ausschließlich Sichteinlagen eingesetzt, die auf einem bei einer von der Gegenpartei unabhängigen Kreditinstitut geführten Konto eingezahlt werden. Zuschläge (sogenannter „Haircut“) werden dabei nicht berücksichtigt. Die als Sicherheit erhaltenen Sichteinlagen werden nicht für den Kauf weiterer Vermögenswerte für das Fondsvermögen eingesetzt bzw. auch sonst nicht wiederverwendet.

Am Stichtag 30. September 2019 waren ausschließlich OTC-Derivate (Devisentermingeschäfte) mit der Raiffeisen Bank International AG als Gegenpartei offen. Zur Besicherung dieser offenen Positionen war zum genannten Stichtag von der Verwaltungsgesellschaft ein Betrag in der Höhe von 930.000,00 EUR aus dem Fondsvermögen bei der Raiffeisen Bank International AG erlegt.

Total Return Swaps oder vergleichbare derivative Instrumente

Ein Total Return Swap (Gesamtrendite-Swap) ist ein Kreditderivat, bei dem die Erträge und Wertschwankungen des zu Grunde liegenden Finanzinstruments (Basiswert oder Referenzaktivum) gegen fest vereinbarte Zinszahlungen getauscht werden.

Total Return Swaps oder vergleichbare derivative Instrumente wurden im Berichtszeitraum nicht eingesetzt.

Die Raiffeisen Kapitalanlage-Gesellschaft m.b.H. berücksichtigt den Code of Conduct der österreichischen Investmentfondsindustrie 2012.

Wien, am 15. November 2019

Raiffeisen Kapitalanlage-Gesellschaft m.b.H.


Mag. Rainer Schnabl


Mag. (FH) Dieter Aigner


Ing. Michal Kustra

Anhang

Impressum

Eigentümer, Herausgeber und Verleger:
Raiffeisen Kapitalanlage-Gesellschaft m.b.H.
Mooslackengasse 12, A-1190 Wien

Für den Inhalt verantwortlich:
Raiffeisen Kapitalanlage-Gesellschaft m.b.H.
Mooslackengasse 12, A-1190 Wien

Copyright beim Herausgeber, Versandort: Wien

Raiffeisen Capital Management ist die Dachmarke der Unternehmen:

Raiffeisen Kapitalanlage-Gesellschaft m.b.H.
Raiffeisen Immobilien Kapitalanlage-Gesellschaft m.b.H.
Raiffeisen Salzburg Invest GmbH