

Raiffeisen-GreenBonds

Halbjahresbericht

Berichtszeitraum 01.09.2021 – 28.02.2022

Inhaltsverzeichnis

Allgemeine Fondsdaten	3
Fondscharakteristik	3
Rechtlicher Hinweis	4
Fondsdetails	5
Umlaufende Anteile	6
Bericht zur Anlagepolitik des Fonds	6
Zusammensetzung des Fondsvermögens in EUR	7
Vermögensaufstellung in EUR per 28.02.2022	9
Anhang	18

Bericht über den Berichtszeitraum vom 01.09.2021 bis 28.02.2022

Allgemeine Fondsdaten

ISIN	Tranche	Ertragstyp	Währung	Aufledgedatum
AT0000A1KKC2	Raiffeisen-GreenBonds (I) A	Ausschüttung	EUR	01.04.2016
AT0000A292N8	Raiffeisen-GreenBonds (R) A	Ausschüttung	EUR	01.08.2019
AT0000A292T5	Raiffeisen-GreenBonds (RZ) A	Ausschüttung	EUR	01.08.2019
AT0000A1FV69	Raiffeisen-GreenBonds (I) T	Thesaurierung	EUR	15.09.2015
AT0000A292M0	Raiffeisen-GreenBonds (R) T	Thesaurierung	EUR	01.08.2019
AT0000A292S7	Raiffeisen-GreenBonds (RZ) T	Thesaurierung	EUR	01.08.2019
AT0000A296M1	Raiffeisen-GreenBonds (SZ) T ¹	Thesaurierung	EUR	02.09.2019
AT0000A1FV77	Raiffeisen-GreenBonds VTA	Vollthesaurierung Ausland	EUR	15.09.2015
AT0000A1VGH6	Raiffeisen-GreenBonds (S) VTA	Vollthesaurierung Ausland	EUR	02.05.2017
AT0000A1VGG8	Raiffeisen-GreenBonds (R) VTA	Vollthesaurierung Ausland	EUR	02.05.2017
AT0000A1YBY6	Raiffeisen-GreenBonds (RZ) VTA	Vollthesaurierung Ausland	EUR	01.12.2017

¹ Die gegenständliche Tranche SZ ist ausschließlich für Veranlagungen im Zuge der nachhaltigen Vermögensverwaltung der Raiffeisen Bankengruppe vorgesehen.

Fondscharakteristik

Fondswährung	EUR
Rechnungsjahr	01.09. – 31.08.
Ausschüttungs- / Auszahlungs- / Wieder- veranlagungstag	15.11.
Fondsbezeichnung	Investmentfonds gemäß § 2 InvFG (OGAW)
effektive Verwaltungsgebühr des Fonds	I-Tranche (EUR): 0,300 % S-Tranche (EUR): 1,200 % R-Tranche (EUR): 0,600 % RZ-Tranche (EUR): 0,300 % SZ-Tranche (EUR): 0,195 %
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

Der Fonds wird aktiv ohne Bezugnahme zu einem Referenzwert verwaltet.

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 Wertentwicklung wird von der Raiffeisen KAG auf Basis der veröffentlichten Fondspreise nach der OeKB-Methode berechnet. Bei der Berechnung der Wertentwicklung werden individuelle Kosten, wie beispielsweise Transaktionsgebühren, Ausgabeaufschlag (maximal 0,00 %), Rücknahmeabschlag (maximal 0,00 %), Depotgebühren des Anlegers sowie Steuern nicht berücksichtigt. Diese würden sich bei Berücksichtigung mindernd auf die Wertentwicklung auswirken. Die Wertentwicklung der Vergangenheit lässt 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-GreenBonds für den Berichtszeitraum vom 01.09.2021 bis 28.02.2022 vorzulegen. Dem Rechnungsabschluss wurde die Preisberechnung vom 28.02.2022 zu Grunde gelegt.

Fondsdetails

	31.08.2021	28.02.2022
Fondsvermögen gesamt in EUR	237.581.885,06	289.556.647,04
errechneter Wert / Ausschüttungsanteile (I) (AT0000A1KKC2) in EUR	101,59	95,51
Ausgabepreis / Ausschüttungsanteile (I) (AT0000A1KKC2) in EUR	101,59	95,51
errechneter Wert / Ausschüttungsanteile (R) (AT0000A292N8) in EUR	99,44	93,36
Ausgabepreis / Ausschüttungsanteile (R) (AT0000A292N8) in EUR	99,44	93,36
errechneter Wert / Ausschüttungsanteile (RZ) (AT0000A292T5) in EUR	100,04	94,06
Ausgabepreis / Ausschüttungsanteile (RZ) (AT0000A292T5) in EUR	100,04	94,06
errechneter Wert / Thesaurierungsanteile (I) (AT0000A1FV69) in EUR	107,22	101,65
Ausgabepreis / Thesaurierungsanteile (I) (AT0000A1FV69) in EUR	107,22	101,65
errechneter Wert / Thesaurierungsanteile (R) (AT0000A292M0) in EUR	100,52	95,23
Ausgabepreis / Thesaurierungsanteile (R) (AT0000A292M0) in EUR	100,52	95,23
errechneter Wert / Thesaurierungsanteile (RZ) (AT0000A292S7) in EUR	101,05	95,80
Ausgabepreis / Thesaurierungsanteile (RZ) (AT0000A292S7) in EUR	101,05	95,80
errechneter Wert / Thesaurierungsanteile (SZ) (AT0000A296M1) in EUR	99,51	94,37
Ausgabepreis / Thesaurierungsanteile (SZ) (AT0000A296M1) in EUR	99,51	94,37
errechneter Wert / Vollthesaurierungsanteile (I) (AT0000A1FV77) in EUR	108,26	102,83
Ausgabepreis / Vollthesaurierungsanteile (I) (AT0000A1FV77) in EUR	108,26	102,83
errechneter Wert / Vollthesaurierungsanteile (S) (AT0000A1VGH6) in EUR	103,68	98,03
Ausgabepreis / Vollthesaurierungsanteile (S) (AT0000A1VGH6) in EUR	103,68	98,03
errechneter Wert / Vollthesaurierungsanteile (R) (AT0000A1VGG8) in EUR	106,72	101,21
Ausgabepreis / Vollthesaurierungsanteile (R) (AT0000A1VGG8) in EUR	106,72	101,21
errechneter Wert / Vollthesaurierungsanteile (RZ) (AT0000A1YBY6) in EUR	105,88	100,56
Ausgabepreis / Vollthesaurierungsanteile (RZ) (AT0000A1YBY6) in EUR	105,88	100,56

Umlaufende Anteile

	Umlaufende Anteile am 31.08.2021	Absätze	Rücknahmen	Umlaufende Anteile am 28.02.2022
AT0000A1KKC2 (I) A	87.873,934	24.279,465	-16.534,000	95.619,399
AT0000A292N8 (R) A	1.025,483	113.980,110	-2.770,850	112.234,743
AT0000A292T5 (RZ) A	9.910,042	13.115,204	-147,191	22.878,055
AT0000A1FV69 (I) T	495.916,041	1.043.655,597	-455.308,796	1.084.262,842
AT0000A292M0 (R) T	10.565,169	61.797,663	-3.222,882	69.139,950
AT0000A292S7 (RZ) T	35.461,314	32.304,174	-6.137,021	61.628,467
AT0000A296M1 (SZ) T	140.546,492	86.002,537	-54.728,838	171.820,191
AT0000A1FV77 (I) VTA	505.138,310	70.037,840	-167.321,505	407.854,645
AT0000A1VGH6 (S) VTA	97.889,482	2.950,718	-16.175,870	84.664,330
AT0000A1VGG8 (R) VTA	850.358,728	52.753,509	-135.544,717	767.567,520
AT0000A1YBY6 (RZ) VTA	1.502,000	8.032,000	-198,000	9.336,000
Gesamt umlaufende Anteile				2.887.006,142

Bericht zur Anlagepolitik des Fonds

Der Raiffeisen-GreenBonds investierte in der Berichtsperiode in nachhaltige Anleihen, die zur Finanzierung umweltverbessernder Maßnahmen emittiert wurden, also sogenannte „Green Bonds“. Der Bestand des Fonds resultierte aus Anleihen, die in Euro, US-Dollar, kanadische Dollar, australische Dollar, britische Pfund sowie schwedische Kronen denominated waren. Der weitaus überwiegende Teil davon waren Titel in Euro und US-Dollar. Dabei wurde zumeist zumindest die Hälfte des Fremdwährungsrisiko der US-Währung mittels Devisentermingeschäften abgesichert. Es erfolgte jedoch keine Absicherung der Anleihen im australischen Dollar, kanadischen Dollar, britischen Pfund sowie der schwedischen Krone. Das offene Währungsrisiko lag in diesen vier Währungen in Summe bei durchschnittlich 10 %. Während der Berichtsperiode schwankte die mittlere Fristigkeit des Fonds zwischen 5,2 und 5,6 Jahren. Veränderungen des Zinsrisikos erfolgten zumeist im Euro- bzw. US-Dollar-Segment einerseits durch die Investition in Neuemissionen und andererseits durch den Einsatz von Anleihederivaten. Derivate wurden dabei nur zur Absicherung eingesetzt. Das Zinsrisiko war in Europa deutlich höher gewichtet als in den USA. Der Anteil von Staatsanleihen sowie swapkorrelierten Produkten wie Agencies, supranationale Anleihen sowie Provinzanleihen lag bei etwa einem Drittel des Volumens. Etwa zwei Drittel des Fondsvolumens verteilte sich auf Emissionen von Banken und Versicherungen, Unternehmen sowie Energieversorgern. Der Schwerpunkt aller investierten Anleihen lag dabei auf den besten Ratingkategorien, nur ein sehr geringer Teil der Anleihen hatte kein Investment-Grade-Rating. Der Fonds hatte zu Beginn der Berichtsperiode starke Zuflüsse, welche sowohl über den Primär- als auch über den Sekundärmarkt investiert wurden. Bei den finanzierten Projekten lag der Fokus auf den Kategorien Erneuerbare Energien, Energieeffizienz, saubere Mobilität, nachhaltiges Wassermanagement sowie grüne Gebäude. Das Marktumfeld brachte in Summe über den Berichtszeitraum gesehen deutlich steigende Renditen bei sich gleichzeitig deutlich ausweitenden Creditspreads. Dem musste der Fonds vor allem 2022 Tribut zollen und wies für diesen Zeitraum eine deutlich negative Performance von knapp - 5 % auf.

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
Anleihen fix		AUD	8.125.408,22	2,81 %
Anleihen fix		CAD	8.353.320,77	2,88 %
Anleihen fix		EUR	190.267.887,44	65,71 %
Anleihen fix		GBP	7.981.437,68	2,76 %
Anleihen fix		SEK	5.365.800,25	1,85 %
Anleihen fix		USD	66.907.496,77	23,11 %
Summe Anleihen fix			287.001.351,13	99,12 %
Anleihen variabel		EUR	633.500,00	0,22 %
Summe Anleihen variabel			633.500,00	0,22 %
Summe Wertpapiervermögen			287.634.851,13	99,34 %
Derivative Produkte				
Bewertung Finanzterminkontrakte			744.430,00	0,26 %
Bewertung Devisentermingeschäfte			-475.861,18	-0,16 %
Summe Derivative Produkte			268.568,82	0,10 %
Bankguthaben/-verbindlichkeiten				
Bankguthaben/-verbindlichkeiten in Fondswährung			-1.464.921,00	-0,51 %
Bankguthaben/-verbindlichkeiten in Fremdwährung			1.128.994,26	0,39 %
Summe Bankguthaben/-verbindlichkeiten			-335.926,74	-0,12 %
Abgrenzungen				
Zinsenansprüche (aus Wertpapieren und Bankguthaben)			1.246.278,30	0,43 %
Cash Collateral Zinsen gegeben			-104,90	-0,00 %
Summe Abgrenzungen			1.246.173,40	0,43 %
Sonstige Verrechnungsposten				
Diverse Gebühren			-137.019,57	-0,05 %
Summe Sonstige Verrechnungsposten			-137.019,57	-0,05 %

Wertpapierart	OGAW/§ 166	Währung	Kurswert in EUR	Anteil am Fondsvermögen
Cash Collateral				
Forderungen aus gegebenen Sicherheiten			880.000,00	0,30 %
Summe Cash Collateral			880.000,00	0,30 %
Summe Fondsvermögen			289.556.647,04	100,00 %

Vermögensaufstellung in EUR per 28.02.2022

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	Pool-/ILB-Faktor	Kurs	Kurswert in EUR	Anteil am Fondsvermögen
Anleihen fix		AU3CB0249787	EUROPEAN INVESTMENT BANK EIB 2.7 01/12/23	AUD	700.000				101,702000	457.484,18	0,16 %
Anleihen fix		AU3CB0245884	EUROPEAN INVESTMENT BANK EIB 3.3 02/03/28	AUD	5.500.000	4.000.000			104,014000	3.676.233,01	1,27 %
Anleihen fix		AU3SG0002348	NEW S WALES TREASURY CRP NSWTC 1 1/4 11/20/30	AUD	3.000.000	1.500.000			89,647000	1.728.245,99	0,60 %
Anleihen fix		AU3SG0001928	QUEENSLAND TREASURY CORP QTC 2 1/2 03/06/29	AUD	3.500.000				100,636000	2.263.445,04	0,78 %
Anleihen fix		CA045167FA66	ASIAN DEVELOPMENT BANK ASIA 0 3/4 02/10/26	CAD	2.000.000				95,144000	1.328.223,92	0,46 %
Anleihen fix		XS2289822376	EUROPEAN INVESTMENT BANK EIB 1 01/28/28	CAD	2.000.000				93,380000	1.303.598,23	0,45 %
Anleihen fix		CA68333ZAJ62	ONTARIO (PROVINCE OF) ONT 1.85 02/01/27	CAD	3.700.000	1.000.000			98,557000	2.545.359,30	0,88 %
Anleihen fix		CA68323ADL58	ONTARIO (PROVINCE OF) ONT 1.95 01/27/23	CAD	300.000				100,611000	210.681,60	0,07 %
Anleihen fix		CA68323AER10	ONTARIO (PROVINCE OF) ONT 2.65 02/05/25	CAD	1.500.000				101,984000	1.067.783,48	0,37 %
Anleihen fix		CA748148RW51	PROVINCE OF QUEBEC Q 1.65 03/03/22	CAD	200.000				100,014000	139.620,98	0,05 %
Anleihen fix		CA748148SA23	PROVINCE OF QUEBEC Q 1.85 02/13/27	CAD	1.000.000				98,764000	689.379,82	0,24 %
Anleihen fix		CA748148RX35	PROVINCE OF QUEBEC Q 2.6 07/06/25	CAD	1.500.000				102,069000	1.068.673,44	0,37 %
Anleihen fix		XS2026150313	A2A SPA AEMSPA 1 07/16/29	EUR	2.000.000	600.000			96,592000	1.931.840,00	0,67 %
Anleihen fix		XS2403533263	A2A SPA AEMSPA 1 11/02/33	EUR	700.000	700.000			89,837190	628.860,33	0,22 %
Anleihen fix		XS1853999313	AB IGNITIS GRUPE LIEENE 1 7/8 07/10/28	EUR	850.000				101,842000	865.657,00	0,30 %
Anleihen fix		XS1646530565	AB IGNITIS GRUPE LIEENE 2 07/14/27	EUR	600.000				102,662000	615.972,00	0,21 %
Anleihen fix		XS1982037696	ABN AMRO BANK NV ABNANV 0 1/2 04/15/26	EUR	500.000				98,749390	493.746,95	0,17 %
Anleihen fix		XS2292487076	ACEA SPA ACEIM 0 1/4 07/28/30	EUR	2.000.000	700.000			89,407910	1.788.158,20	0,62 %
Anleihen fix		XS1799545329	ACS SERVICIOS COMUNICAC ACSSCCE 1 7/8 04/20/26	EUR	700.000				100,485920	703.401,44	0,24 %
Anleihen fix		ES0200002030	ADIF - ALTA VELOCIDAD ADIFAL 1 1/4 05/04/26	EUR	400.000	100.000			102,713000	410.852,00	0,14 %
Anleihen fix		ES0200002055	ADIF ALTA VELOCIDAD ADIFAL 0.55 04/30/30	EUR	1.000.000				96,197000	961.970,00	0,33 %
Anleihen fix		XS2343340852	AIB GROUP PLC AIB 0 1/2 11/17/27	EUR	1.800.000				94,938690	1.708.896,42	0,59 %
Anleihen fix		XS2187525949	ALLIANDER NV ALLRNV 0 3/8 06/10/30	EUR	2.000.000	500.000			94,092200	1.881.844,00	0,65 %
Anleihen fix		XS1400167133	ALLIANDER NV ALLRNV 0 7/8 04/22/26	EUR	1.200.000				100,504000	1.206.048,00	0,42 %
Anleihen fix		XS2079716853	APPLE INC AAPL 0 11/15/25	EUR	500.000				97,754110	488.770,55	0,17 %
Anleihen fix		XS2346972263	ARCELIK AS ACKAF 3 05/27/26	EUR	800.000				94,601000	756.808,00	0,26 %
Anleihen fix		FR00140005T0	ARKEMA AKEFP 0 1/8 10/14/26	EUR	500.000				96,972000	484.860,00	0,17 %
Anleihen fix		XS2056491587	ASSICURAZIONI GENERALI ASSGEN 2.124 10/01/30	EUR	900.000				95,367950	858.311,55	0,30 %
Anleihen fix		XS2314312179	AXA SA AXASA 1 3/8 10/07/41	EUR	1.000.000				90,109010	901.090,10	0,31 %
Anleihen fix		XS2013745703	BANCO BILBAO VIZCAYA ARG BBVASM 1 06/21/26	EUR	1.400.000				98,650660	1.381.109,24	0,48 %
Anleihen fix		XS1820037270	BANCO BILBAO VIZCAYA ARG BBVASM 1 3/8 05/14/25	EUR	500.000				101,137930	505.689,65	0,17 %

Berichtszeitraum 01.09.2021 – 28.02.2022

Raiffeisen-GreenBonds

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
Anleihen fix		XS2357417257	BANCO SANTANDER SA SANTAN 0 5/8 06/24/29	EUR	800.000				93,172250	745.378,00	0,26 %
Anleihen fix		XS2063247915	BANCO SANTANDER SA SANTAN 0.3 10/04/26	EUR	2.000.000				96,578620	1.931.572,40	0,67 %
Anleihen fix		ES0213679JR9	BANKINTER SA BKTSM 0 5/8 10/06/27	EUR	400.000				93,615500	374.462,00	0,13 %
Anleihen fix		FR00140003P3	BANQUE FED CRED MUTUEL BFCM 0.1 10/08/27	EUR	500.000				93,495290	467.476,45	0,16 %
Anleihen fix		XS1716820029	BARCLAYS PLC BACR 0 5/8 11/14/23	EUR	500.000				100,247000	501.235,00	0,17 %
Anleihen fix		DE000BLB6JJO	BAYERISCHE LANDESBANK BYLAN 0 1/8 02/10/28	EUR	2.600.000				93,171330	2.422.454,58	0,84 %
Anleihen fix		XS2356569736	BAYERISCHE LANDESBANK BYLAN 1 09/23/31	EUR	1.000.000	600.000			93,786250	937.862,50	0,32 %
Anleihen fix		BE0000346552	BELGIUM KINGDOM BGB 1 1/4 04/22/33	EUR	2.000.000	14.800.000	13.800.000		106,577000	2.131.540,00	0,74 %
Anleihen fix		DE000BHY0GA7	BERLIN HYP AG BHH 0 1/2 11/05/29	EUR	1.000.000				93,999040	939.990,40	0,32 %
Anleihen fix		DE000BHY0GB5	BERLIN HYP AG BHH 1 1/2 04/18/28	EUR	200.000				100,090000	200.180,00	0,07 %
Anleihen fix		DE000BHY0GS9	BERLIN HYP AG BHH 1 1/8 10/25/27	EUR	500.000				99,024940	495.124,70	0,17 %
Anleihen fix		FR0013465358	BNP PARIBAS BNP 0 1/2 06/04/26	EUR	1.500.000	800.000			98,092730	1.471.390,95	0,51 %
Anleihen fix		FR00140005J1	BNP PARIBAS BNP 0 3/8 10/14/27	EUR	900.000				95,031610	855.284,49	0,30 %
Anleihen fix		XS1808338542	BNP PARIBAS BNP 1 04/17/24	EUR	300.000				101,027450	303.082,35	0,10 %
Anleihen fix		FR0013405537	BNP PARIBAS BNP 1 1/8 08/28/24	EUR	600.000				101,146900	606.881,40	0,21 %
Anleihen fix		FR0014007LL3	BPCE SA BPCEGP 0 1/2 01/14/28	EUR	2.000.000	2.000.000			94,963810	1.899.276,20	0,66 %
Anleihen fix		FR0013464930	BPCE SA BPCEGP 0 1/8 12/04/24	EUR	600.000				98,758910	592.553,46	0,20 %
Anleihen fix		XS2248827771	CA IMMOBILIEN ANLAGEN AG CAIAV 1 10/27/25	EUR	1.500.000				96,369000	1.445.535,00	0,50 %
Anleihen fix		XS2258971071	CAIXABANK SA CABKSM 0 3/8 11/18/26	EUR	1.300.000				96,519890	1.254.758,57	0,43 %
Anleihen fix		AT0000A2STV4	CESKA SPORITELNA AS CESSPO 0 1/2 09/13/28	EUR	2.500.000	2.500.000			94,417670	2.360.441,75	0,82 %
Anleihen fix		FR0013463775	CNP ASSURANCES CNPFP 2 07/27/50	EUR	1.800.000				95,457480	1.718.234,64	0,59 %
Anleihen fix		DE000CBOHRQ9	COMMERZBANK AG CMZB 0 3/4 03/24/26	EUR	1.000.000				98,702900	987.029,00	0,34 %
Anleihen fix		DE000CZ40NG4	COMMERZBANK AG CMZB 1 1/4 10/23/23	EUR	600.000				101,085650	606.513,90	0,21 %
Anleihen fix		ES00001010G6	COMMUNITY OF MADRID SPAI MADRID 0.16 07/30/28	EUR	1.700.000	1.700.000			95,651000	1.626.067,00	0,56 %
Anleihen fix		ES0000101966	COMMUNITY OF MADRID SPAI MADRID 0.827 07/30/27	EUR	800.000				100,328000	802.624,00	0,28 %
Anleihen fix		XS2068969067	COOPERATIEVE RABOBANK UA RABOBK 0 1/4 10/30/26	EUR	1.200.000				96,695980	1.160.351,76	0,40 %
Anleihen fix		FR0013447232	COVIVIO COVFP 1 1/8 09/17/31	EUR	300.000				91,695450	275.086,35	0,10 %
Anleihen fix		FR0013170834	COVIVIO COVFP 1 7/8 05/20/26	EUR	600.000				103,346600	620.079,60	0,21 %
Anleihen fix		FR0013385515	CREDIT AGRICOLE LONDON ACAFP 0 3/4 12/05/23	EUR	1.100.000				100,990120	1.110.891,32	0,38 %
Anleihen fix		XS2067135421	CREDIT AGRICOLE SA ACAFP 0 3/8 10/21/25	EUR	800.000				97,768950	782.151,60	0,27 %
Anleihen fix		XS2308298962	DE VOLKSBANK NV DEVOBA 0 3/8 03/03/28	EUR	1.600.000				92,488710	1.479.819,36	0,51 %
Anleihen fix		XS2052503872	DE VOLKSBANK NV DEVOBA 0.01 09/16/24	EUR	900.000				98,952320	890.570,88	0,31 %
Anleihen fix		XS2351382473	DERICHEBOURG DBGFP 2 1/4 07/15/28	EUR	625.000				98,935000	618.343,75	0,21 %
Anleihen fix		DE000GRN0016	DEUTSCHE KREDITBANK AG DKRED 0 3/4 09/26/24	EUR	700.000				100,134640	700.942,48	0,24 %
Anleihen fix		DE000GRN0024	DEUTSCHE KREDITBANK AG DKRED 0.01 02/23/26	EUR	1.200.000				97,231020	1.166.772,24	0,40 %
Anleihen fix		XS2331315635	ENEXIS HOLDING NV ENEXIS 0 3/8 04/14/33	EUR	1.300.000				90,013670	1.170.177,71	0,40 %
Anleihen fix		XS2190255211	ENEXIS HOLDING NV ENEXIS 0 5/8 06/17/32	EUR	3.000.000				93,850400	2.815.512,00	0,97 %
Anleihen fix		XS2229434852	ERG SPA ERGIM 0 1/2 09/11/27	EUR	440.000				93,585310	411.775,36	0,14 %
Anleihen fix		XS2386650274	ERG SPA ERGIM 0 7/8 09/15/31	EUR	500.000	500.000			89,061010	445.305,05	0,15 %
Anleihen fix		XS1981060624	ERG SPA ERGIM 1 7/8 04/11/25	EUR	1.000.000				101,508580	1.015.085,80	0,35 %
Anleihen fix		XS2009861480	ESB FINANCE DAC ESBIRE 1 1/8 06/11/30	EUR	3.700.000	1.000.000			98,880800	3.658.589,60	1,26 %
Anleihen fix		XS2176621253	EUROFIMA EUROF 0.1 05/20/30	EUR	2.700.000				94,117000	2.541.159,00	0,88 %
Anleihen fix		XS2055744689	EUROFIMA EUROF 0.15 10/10/34	EUR	1.200.000				89,218000	1.070.616,00	0,37 %
Anleihen fix		XS2171713006	EUROGRID GMBH EUROGR 1.113 05/15/32	EUR	2.000.000				96,407810	1.928.156,20	0,67 %
Anleihen fix		EU000A3K4C42	EUROPEAN UNION EU 0.4 02/04/37	EUR	2.500.000	2.500.000			93,243000	2.331.075,00	0,81 %
Anleihen fix		XS2312733871	FAURECIA EOFP 2 3/8 06/15/29	EUR	800.000				91,764000	734.112,00	0,25 %
Anleihen fix		XS2026171079	FERROVIE DELLO STATO FERROV 1 1/8 07/09/26	EUR	500.000				100,344000	501.720,00	0,17 %
Anleihen fix		XS2193956716	HYPO NOE LB NOE WIEN AG HYN0E 0 3/8 06/25/24	EUR	500.000				99,127500	495.637,50	0,17 %
Anleihen fix		XS1685589027	HYPO VORARLBERG BANK AG VORHYP 0 5/8 09/19/22	EUR	800.000				100,270000	802.160,00	0,28 %
Anleihen fix		FR0013281755	ICADE ICADFP 1 1/2 09/13/27	EUR	1.200.000				100,543340	1.206.520,08	0,42 %

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		XS2350756446	ING GROEP NV INTNED 0 7/8 06/09/32	EUR	200.000				93,544590	187.089,18	0,06 %
Anleihen fix		XS1909186451	ING GROEP NV INTNED 2 1/2 11/15/30	EUR	1.000.000	500.000			106,707270	1.067.072,70	0,37 %
Anleihen fix		XS2317069685	INTESA SANPAOLO SPA ISPIM 0 3/4 03/16/28	EUR	900.000				94,003940	846.035,46	0,29 %
Anleihen fix		XS2089368596	INTESA SANPAOLO SPA ISPIM 0 3/4 12/04/24	EUR	700.000				99,596680	697.176,76	0,24 %
Anleihen fix		XS1636000561	INTESA SANPAOLO SPA ISPIM 0 7/8 06/27/22	EUR	300.000				100,344000	301.032,00	0,10 %
Anleihen fix		IE00BFZRQ242	IRELAND GOVERNMENT BOND IRISH 1.35 03/18/31	EUR	2.000.000	11.000.000	16.000.000		106,749000	2.134.980,00	0,74 %
Anleihen fix		XS2275029085	IREN SPA IREIM 0 1/4 01/17/31	EUR	1.300.000	500.000			86,927420	1.130.056,46	0,39 %
Anleihen fix		XS2065601937	IREN SPA IREIM 0 7/8 10/14/29	EUR	900.000				94,341360	849.072,24	0,29 %
Anleihen fix		XS1881533563	IREN SPA IREIM 1.95 09/19/25	EUR	300.000				103,110970	309.332,91	0,11 %
Anleihen fix		XS2113121904	JAPAN FIN ORG MUNICIPAL JFM 0.05 02/12/27	EUR	1.000.000				97,016000	970.160,00	0,34 %
Anleihen fix		BE0974365976	KBC GROUP NV KBCBB 0 3/8 06/16/27	EUR	3.000.000	1.000.000			96,216990	2.886.509,70	1,00 %
Anleihen fix		BE0002602804	KBC GROUP NV KBCBB 0 7/8 06/27/23	EUR	1.000.000				101,062310	1.010.623,10	0,35 %
Anleihen fix		XS2001175657	KONINKLIJKE PHILIPS NV PHIANA 0 1/2 05/22/26	EUR	1.000.000				98,332680	983.326,80	0,34 %
Anleihen fix		FR0013415692	LA BANQUE POSTALE FRLBP 1 3/8 04/24/29	EUR	800.000				97,924570	783.396,56	0,27 %
Anleihen fix		FR0013384567	LA POSTE SA FRPTT 1.45 11/30/28	EUR	600.000				102,890500	617.343,00	0,21 %
Anleihen fix		DE000LB2CHW4	LB BADEN-WUERTTEMBERG LBBW 0 3/8 05/24/24	EUR	500.000				99,419930	497.099,65	0,17 %
Anleihen fix		DE000LB2CLH7	LB BADEN-WUERTTEMBERG LBBW 0 3/8 07/29/26	EUR	700.000				96,830120	677.810,84	0,23 %
Anleihen fix		XS2227196404	MEDIOBANCA DI CRED FIN BACRED 1 09/08/27	EUR	1.000.000				96,185420	961.854,20	0,33 %
Anleihen fix		DE000A3H3JM4	MERCEDES-BENZ GROUP AG DAIGR 0 3/4 03/11/33	EUR	900.000				92,240460	830.164,14	0,29 %
Anleihen fix		DE000A289QR9	MERCEDES-BENZ GROUP AG DAIGR 0 3/4 09/10/30	EUR	2.000.000				95,501880	1.910.037,60	0,66 %
Anleihen fix		XS1758752635	MITSUBISHI UFJ FIN GRP MUFG 0.68 01/26/23	EUR	200.000				100,683000	201.366,00	0,07 %
Anleihen fix		XS2028900087	MITSUBISHI UFJ FIN GRP MUFG 0.848 07/19/29	EUR	600.000				94,503290	567.019,74	0,20 %
Anleihen fix		XS1890709774	MITSUBISHI UFJ FIN GRP MUFG 0.98 10/09/23	EUR	500.000				101,119570	505.597,85	0,17 %
Anleihen fix		XS2241387252	MIZUHO FINANCIAL GROUP MIZUHO 0.214 10/07/25	EUR	1.400.000				96,955860	1.357.382,04	0,47 %
Anleihen fix		XS1691909920	MIZUHO FINANCIAL GROUP MIZUHO 0.956 10/16/24	EUR	1.000.000				100,659270	1.006.592,70	0,35 %
Anleihen fix		DE000MHB64E1	MUENCHENER HYPOTHEKENBNK MUNHYP 0 3/8 03/09/29	EUR	2.800.000				92,778000	2.597.784,00	0,90 %
Anleihen fix		XS2381261424	MUNICH RE MUNRE 1 05/26/42	EUR	1.200.000				86,924900	1.043.098,80	0,36 %
Anleihen fix		XS2221845683	MUNICH RE MUNRE 1 1/4 05/26/41	EUR	3.000.000				90,521440	2.715.643,20	0,94 %
Anleihen fix		XS2381853279	NATIONAL GRID PLC NGGLN 0 1/4 09/01/28	EUR	2.500.000	1.000.000			93,443190	2.336.079,75	0,81 %
Anleihen fix		XS2104915033	NATL GRID ELECT TRANS NGGLN 0.19 01/20/25	EUR	400.000				98,516890	394.067,56	0,14 %
Anleihen fix		XS2321526480	NORDEA BANK ABP NDASS 0 1/2 03/19/31	EUR	1.800.000				92,161750	1.658.911,50	0,57 %
Anleihen fix		XS2003499386	NORDEA BANK ABP NDASS 0 3/8 05/28/26	EUR	500.000				98,288260	491.441,30	0,17 %
Anleihen fix		XS2443893255	NORDEA BANK ABP NDASS 1 1/8 02/16/27	EUR	700.000	700.000			99,388000	695.716,00	0,24 %
Anleihen fix		DE000NWB0AE6	NRW.BANK NRWKB 0 1/2 09/13/27	EUR	500.000				99,344000	496.720,00	0,17 %
Anleihen fix		DE000NWB0AF3	NRW.BANK NRWKB 0 3/4 06/30/28	EUR	1.150.000	1.000.000			100,520000	1.155.980,00	0,40 %
Anleihen fix		DE000NWB0AD8	NRW.BANK NRWKB 0 3/8 11/17/26	EUR	300.000				99,148000	297.444,00	0,10 %
Anleihen fix		DE000NWB0ACO	NRW.BANK NRWKB 0 7/8 11/10/25	EUR	500.000				101,529000	507.645,00	0,18 %
Anleihen fix		XS2411311579	NTT FINANCE CORP NTT 0.082 12/13/25	EUR	2.500.000	2.500.000			97,373730	2.434.343,25	0,84 %
Anleihen fix		XS2411311652	NTT FINANCE CORP NTT 0.399 12/13/28	EUR	2.500.000	2.500.000			95,368250	2.384.206,25	0,82 %
Anleihen fix		XS1721760541	ORSTED A/S ORSTED 1 1/2 11/26/29	EUR	1.000.000	500.000			101,886570	1.018.865,70	0,35 %
Anleihen fix		XS1720192696	ORSTED A/S ORSTED 2 1/4 11/24/3017	EUR	800.000				100,222090	801.776,72	0,28 %
Anleihen fix		XS2047619064	POSTNL NV PNLNA 0 5/8 09/23/26	EUR	700.000				97,807000	684.649,00	0,24 %
Anleihen fix		XS2021462440	PROLOGIS INTL FUND II PRIFII 0 7/8 07/09/29	EUR	1.000.000				95,118000	951.180,00	0,33 %
Anleihen fix		XS1789176846	PROLOGIS INTL FUND II PRIFII 1 3/4 03/15/28	EUR	250.000				102,240000	255.600,00	0,09 %
Anleihen fix		BE0002830116	PROXIMUS SADP PROXBB 0 3/4 11/17/36	EUR	700.000	700.000			89,568510	626.979,57	0,22 %
Anleihen fix		XS2055627538	RAIFFEISEN BANK INTL RBIIV 0 3/8 09/25/26	EUR	2.000.000				94,151620	1.883.032,40	0,65 %
Anleihen fix		XS2353473692	RAIFFEISEN BANK INTL RBIIV 1 3/8 06/17/33	EUR	1.100.000	500.000			84,159130	925.750,43	0,32 %
Anleihen fix		XS2348241048	RAIFFEISENBANK AS RABKAS 1 06/09/28	EUR	1.100.000				91,129000	1.002.419,00	0,35 %
Anleihen fix		XS2343540519	RED ELECTRICA FIN SA UNI REESM 0 1/2 05/24/33	EUR	2.000.000	1.300.000			93,493570	1.869.871,40	0,65 %
Anleihen fix		XS2103013210	RED ELECTRICA FIN SA UNI REESM 0 3/8 07/24/28	EUR	2.500.000	1.500.000			97,027390	2.425.684,75	0,84 %

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
Anleihen fix		FR0013264488	REGIE AUTONOME DES TRANS RATPPF 0 7/8 05/25/27	EUR	2.400.000	1.400.000			101,718000	2.441.232,00	0,84 %
Anleihen fix		FR0013426731	REGIE AUTONOME DES TRANS RATPPF 0.35 06/20/29	EUR	400.000				97,490000	389.960,00	0,13 %
Anleihen fix		XS1989375412	ROYAL BANK OF CANADA RY 0 1/4 05/02/24	EUR	900.000				99,419240	894.773,16	0,31 %
Anleihen fix		FR0014007LP4	RTE RESEAU DE TRANSPORT RTEFRA 0 3/4 01/12/34	EUR	1.600.000	1.600.000			93,022130	1.488.354,08	0,51 %
Anleihen fix		XS2173114542	SBAB BANK AB SBAB 0 1/2 05/13/25	EUR	900.000				99,412850	894.715,65	0,31 %
Anleihen fix		FR0013015559	SCHNEIDER ELECTRIC SE SUPP 1.841 10/13/25	EUR	300.000				104,140000	312.420,00	0,11 %
Anleihen fix		XS2360041474	SEGRO CAPITAL SARL SGROLN 0 1/2 09/22/31	EUR	2.500.000	2.500.000			89,206640	2.230.166,00	0,77 %
Anleihen fix		XS2081491727	SERVICIOS MEDIO AMBIENTE FCCSER 0.815 12/04/23	EUR	500.000				100,574680	502.873,40	0,17 %
Anleihen fix		XS2081500907	SERVICIOS MEDIO AMBIENTE FCCSER 1.661 12/04/26	EUR	1.000.000	500.000			99,619650	996.196,50	0,34 %
Anleihen fix		FR0014006V25	SFIL SA SFILFR 0 1/4 12/01/31	EUR	4.600.000	4.600.000			94,344000	4.339.824,00	1,50 %
Anleihen fix		XS2388182573	SMURFIT KAPPA TREASURY SKGID 0 1/2 09/22/29	EUR	1.500.000	1.500.000			92,396900	1.385.953,50	0,48 %
Anleihen fix		XS1938381628	SNCF RESEAU RESFER 0 7/8 01/22/29	EUR	500.000				101,336000	506.680,00	0,17 %
Anleihen fix		XS1514051694	SNCF RESEAU RESFER 1 11/09/31	EUR	1.000.000				101,088000	1.010.880,00	0,35 %
Anleihen fix		XS1588061777	SNCF RESEAU RESFER 1 7/8 03/30/34	EUR	400.000				109,098000	436.392,00	0,15 %
Anleihen fix		FR0013536661	SOCIETE GENERALE SOCGEN 0 7/8 09/22/28	EUR	2.500.000	500.000			95,214920	2.380.373,00	0,82 %
Anleihen fix		XS2051032444	SPAREBANK 1 SMN MINGNO 0 1/8 09/11/26	EUR	2.000.000				96,292220	1.925.844,40	0,67 %
Anleihen fix		XS2303089697	SPAREBANK 1 SMN MINGNO 0.01 02/18/28	EUR	2.000.000	700.000			92,636430	1.852.728,60	0,64 %
Anleihen fix		XS1676952481	SSE PLC SSELN 0 7/8 09/06/25	EUR	1.000.000	600.000			99,992310	999.923,10	0,35 %
Anleihen fix		XS1875284702	SSE PLC SSELN 1 3/8 09/04/27	EUR	2.000.000	900.000	500.000		101,239760	2.024.795,20	0,70 %
Anleihen fix		XS2021467753	STANDARD CHARTERED PLC STANLN 0.9 07/02/27	EUR	900.000				97,913220	881.218,98	0,30 %
Anleihen fix		XS2079678400	STEDIN HOLDING NV STEDIN 0 1/2 11/14/29	EUR	2.900.000				95,014500	2.755.420,50	0,95 %
Anleihen fix		XS2407985220	STEDIN HOLDING NV STEDIN 0 11/16/26	EUR	450.000	450.000			95,681340	430.566,03	0,15 %
Anleihen fix		XS2265360359	STORA ENSO OYJ STERV 0 5/8 12/02/30	EUR	2.000.000	1.000.000			90,255560	1.805.111,20	0,62 %
Anleihen fix		XS1998025008	SUMITOMO MITSUI FINL GRP SUMIBK 0.465 05/30/24	EUR	500.000				99,526300	497.631,50	0,17 %
Anleihen fix		XS1694219780	SUMITOMO MITSUI FINL GRP SUMIBK 0.934 10/11/24	EUR	1.000.000				100,529980	1.005.299,80	0,35 %
Anleihen fix		XS1848875172	SVENSKA HANDELSBANKEN AB SHBASS 0 3/8 07/03/23	EUR	500.000				100,380900	501.904,50	0,17 %
Anleihen fix		XS2265968284	SVENSKA HANDELSBANKEN AB SHBASS 0.01 12/02/27	EUR	2.500.000				93,268020	2.331.700,50	0,81 %
Anleihen fix		CH1130818847	SWISS LIFE FINANCE I AG SLHNXV 0 1/2 09/15/31	EUR	2.900.000	2.900.000			89,754380	2.602.877,02	0,90 %
Anleihen fix		XS2169243479	SWISSCOM FINANCE SCMNXX 0 3/8 11/14/28	EUR	1.500.000				96,308700	1.444.630,50	0,50 %
Anleihen fix		XS2411241693	TALANX AG TALANX 1 3/4 12/01/42	EUR	1.500.000	1.500.000			92,895180	1.393.427,70	0,48 %
Anleihen fix		SK4000018925	TATRA BANKA AS TATSK 0 1/2 04/23/28	EUR	2.600.000	1.700.000			94,647000	2.460.822,00	0,85 %
Anleihen fix		XS2288109676	TELECOM ITALIA SPA TITIM 1 5/8 01/18/29	EUR	1.000.000				87,135000	871.350,00	0,30 %
Anleihen fix		XS1946004451	TELEFONICA EMISIONES SAU TELEFO 1.069 02/05/24	EUR	700.000				101,434380	710.040,66	0,25 %
Anleihen fix		XS2082429890	TELIA CO AB TELIAS 1 3/8 05/11/2081	EUR	2.000.000	1.100.000			95,859570	1.917.191,40	0,66 %
Anleihen fix		XS2262065159	TENNET HOLDING BV TENN 0 1/8 11/30/32	EUR	1.000.000				86,707960	867.079,60	0,30 %
Anleihen fix		XS1632897762	TENNET HOLDING BV TENN 0 3/4 06/26/25	EUR	200.000				100,340320	200.680,64	0,07 %
Anleihen fix		XS2406569579	TENNET HOLDING BV TENN 0 7/8 06/16/35	EUR	450.000	450.000			90,058700	405.264,15	0,14 %
Anleihen fix		XS1432384664	TENNET HOLDING BV TENN 1 06/13/26	EUR	200.000				100,615490	201.230,98	0,07 %
Anleihen fix		XS1241581096	TENNET HOLDING BV TENN 1 3/4 06/04/27	EUR	400.000	1.200.000	1.200.000		104,361840	417.447,36	0,14 %
Anleihen fix		XS1828037587	TENNET HOLDING BV TENN 1 3/8 06/05/28	EUR	200.000				101,772460	203.544,92	0,07 %
Anleihen fix		XS1632897929	TENNET HOLDING BV TENN 1 3/8 06/26/29	EUR	1.000.000	800.000			101,293960	1.012.939,60	0,35 %
Anleihen fix		XS2207430120	TENNET HOLDING BV TENN 2.374 PERP	Y EUR	500.000				99,951000	499.755,00	0,17 %
Anleihen fix		XS2209023402	TERNA RETE ELETTRICA TRNIM 0 3/4 07/24/32	EUR	400.000				91,175520	364.702,08	0,13 %
Anleihen fix		XS2357205587	TERNA RETE ELETTRICA TRNIM 0 3/8 06/23/29	EUR	550.000				92,904820	510.976,51	0,18 %
Anleihen fix		XS1980270810	TERNA RETE ELETTRICA TRNIM 1 04/10/26	EUR	800.000				100,031530	800.252,24	0,28 %
Anleihen fix		XS1858912915	TERNA RETE ELETTRICA TRNIM 1 07/23/23	EUR	200.000				101,089000	202.178,00	0,07 %
Anleihen fix		XS2437854487	TERNA RETE ELETTRICA TRNIM 2 3/8 PERP	Y EUR	300.000	300.000			96,077000	288.231,00	0,10 %
Anleihen fix		XS1218319702	UNIBAIL-RODAMCO SE ULFP 1 03/14/25	EUR	1.000.000				99,778140	997.781,40	0,34 %
Anleihen fix		XS2360310044	UNICREDIT SPA UCGIM 0.8 07/05/29	EUR	1.000.000				93,242550	932.425,50	0,32 %
Anleihen fix		XS1140300663	VERBUND AG VERA V 1 1/2 11/20/24	EUR	600.000				102,865560	617.193,36	0,21 %

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
Anleihen fix		XS2002017361	VODAFONE GROUP PLC VOD 0.9 11/24/26	EUR	2.000.000	1.000.000			99,823110	1.996.462,20	0,69 %
Anleihen fix		XS1659112616	ANGLIAN WATER SERV FIN AWLN 1 5/8 08/10/25	GBP	700.000				98,632000	823.747,54	0,28 %
Anleihen fix		XS2251641267	BARCLAYS PLC BACR 1.7 11/03/26	GBP	1.200.000				96,209000	1.377.447,95	0,48 %
Anleihen fix		XS2348693297	CAIXABANK SA CABKSM 1 1/2 12/03/26	GBP	1.000.000	1.000.000			95,226000	1.136.145,08	0,39 %
Anleihen fix		XS2305598216	ING GROEP NV INTNED 1 1/8 12/07/28	GBP	500.000	500.000			91,400000	545.248,46	0,19 %
Anleihen fix		DE000LB2CQX3	LB BADEN-WUERTTEMBERG LBBW 1 1/2 02/03/25	GBP	2.500.000	1.400.000	500.000		97,402000	2.905.267,55	1,00 %
Anleihen fix		XS1997070781	ORSTED A/S ORSTED 2 1/8 05/17/27	GBP	1.000.000	400.000			100,040000	1.193.581,10	0,41 %
Anleihen fix		XS1980180829	AFRICAN DEVELOPMENT BANK AFDB 0 3/8 04/11/24	SEK	5.000.000				99,261000	468.084,20	0,16 %
Anleihen fix		XS1551293019	EUROPEAN INVESTMENT BANK EIB 0 1/2 07/19/22	SEK	2.000.000				100,187000	188.980,37	0,07 %
Anleihen fix		XS1757428088	EUROPEAN INVESTMENT BANK EIB 0 7/8 01/30/25	SEK	10.000.000				99,679000	940.110,72	0,32 %
Anleihen fix		XS2226974504	KINGDOM OF SWEDEN SWED 0 1/8 09/09/30	SEK	22.300.000	10.000.000			96,384000	2.027.146,54	0,70 %
Anleihen fix		XS2259127269	KOMMUNINVEST I SVERIGE KOMINS 0 1/4 11/26/27	SEK	10.000.000				93,357000	880.485,53	0,30 %
Anleihen fix		XS1968465572	KOMMUNINVEST I SVERIGE KOMINS 0 3/8 03/27/24	SEK	4.200.000				99,444000	393.915,63	0,14 %
Anleihen fix		XS1897258098	KOMMUNINVEST I SVERIGE KOMINS 0 5/8 06/01/23	SEK	2.500.000				100,533000	237.041,28	0,08 %
Anleihen fix		XS1943607975	NORDIC INVESTMENT BANK NIB 0 3/8 02/01/24	SEK	2.450.000				99,553000	230.035,98	0,08 %
Anleihen fix		US037833BU32	APPLE INC AAPL 2.85 02/23/23	USD	300.000				101,203000	269.982,66	0,09 %
Anleihen fix		US037833CX61	APPLE INC AAPL 3 06/20/27	USD	1.000.000				103,185000	917.567,03	0,32 %
Anleihen fix		US045167DR18	ASIAN DEVELOPMENT BANK ASIA 1 3/4 08/14/26	USD	1.000.000				99,127000	881.481,48	0,30 %
Anleihen fix		US045167EC30	ASIAN DEVELOPMENT BANK ASIA 2 3/8 08/10/27	USD	5.000.000	900.000			101,855000	4.528.700,37	1,56 %
Anleihen fix		US045167EJ82	ASIAN DEVELOPMENT BANK ASIA 3 1/8 09/26/28	USD	5.500.000				106,669000	5.217.015,70	1,80 %
Anleihen fix		US064159QD10	BANK OF NOVA SCOTIA BNS 2 3/8 01/18/23	USD	1.750.000	1.000.000			100,819000	1.568.923,12	0,54 %
Anleihen fix		US09659X2Q47	BNP PARIBAS BNP 1.675 06/30/27	USD	500.000				94,064000	418.229,51	0,14 %
Anleihen fix		US13607GRR73	CANADIAN IMPERIAL BANK CM 0.95 10/23/25	USD	4.200.000	700.000			94,483000	3.528.776,84	1,22 %
Anleihen fix		US191241AJ70	COCA-COLA FEMSA SAB CV KOF 1.85 09/01/32	USD	1.000.000	500.000			85,959000	764.385,75	0,26 %
Anleihen fix		US74977SDK50	COOPERATIEVE RABOBANK UA RABOBK 1.106 02/24/27	USD	1.000.000				93,876000	834.787,25	0,29 %
Anleihen fix		US298785JH03	EUROPEAN INVESTMENT BANK EIB 0 3/4 09/23/30	USD	5.500.000				89,973000	4.400.440,18	1,52 %
Anleihen fix		US298785JA59	EUROPEAN INVESTMENT BANK EIB 1 5/8 10/09/29	USD	6.500.000	5.500.000			96,976000	5.605.299,90	1,94 %
Anleihen fix		US298785GQ39	EUROPEAN INVESTMENT BANK EIB 2 1/2 10/15/24	USD	500.000				101,895000	453.047,89	0,16 %
Anleihen fix		US298785HD17	EUROPEAN INVESTMENT BANK EIB 2 1/8 04/13/26	USD	1.500.000				100,667000	1.342.763,77	0,46 %
Anleihen fix		US298785HM16	EUROPEAN INVESTMENT BANK EIB 2 3/8 05/24/27	USD	1.000.000				101,959000	906.664,89	0,31 %
Anleihen fix		USN4580HAC18	ING GROEP NV INTNED 1.4 07/01/26	USD	1.000.000				95,747000	851.425,01	0,29 %
Anleihen fix		USN4580HAA51	ING GROEP NV INTNED 4 5/8 01/06/26	USD	1.500.000				106,814000	1.424.756,57	0,49 %
Anleihen fix		US45950VHX73	INTL FINANCE CORP IFC 2 1/8 04/07/26	USD	500.000				100,588000	447.236,67	0,15 %
Anleihen fix		US47837RAA86	JOHNSON CONTROLS/TYCO FI JCI 1 3/4 09/15/30	USD	3.200.000	1.200.000			90,416000	2.572.862,03	0,89 %
Anleihen fix		US500769JG03	KFW KFW 0 3/4 09/30/30	USD	5.000.000	2.200.000			89,823000	3.993.730,83	1,38 %
Anleihen fix		US500769JQ84	KFW KFW 1 10/01/26	USD	6.500.000	6.500.000			95,864000	5.541.025,30	1,91 %
Anleihen fix		US500769JD71	KFW KFW 1 3/4 09/14/29	USD	4.000.000	1.000.000			97,749000	3.476.910,76	1,20 %
Anleihen fix		XS1188118100	KOMMUNALBANKEN AS KBN 2 1/8 02/11/25	USD	7.000.000	2.500.000			100,722000	6.269.654,53	2,17 %
Anleihen fix		XS1798774656	KOREA WATER RESOURCES KORWAT 3 7/8 05/15/23	USD	800.000				102,413000	728.561,65	0,25 %
Anleihen fix		US606822AH76	MITSUBISHI UFJ FIN GRP MUFJ 2.527 09/13/23	USD	550.000				100,868000	493.329,78	0,17 %
Anleihen fix		XS1509084775	MTR CORP CI LTD MTRC 2 1/2 11/02/26	USD	1.300.000	1.000.000			100,816000	1.165.451,07	0,40 %
Anleihen fix		US78016EZT71	ROYAL BANK OF CANADA RY 1.15 07/14/26	USD	2.000.000	1.000.000			94,165000	1.674.714,33	0,58 %
Anleihen fix		USY8085FBD16	SK HYNIX INC HYULE 2 3/8 01/19/31	USD	2.000.000	500.000			90,566000	1.610.706,50	0,56 %
Anleihen fix		US89114TZK14	TORONTO-DOMINION BANK TD 1 1/4 12/13/24	USD	2.000.000	2.000.000			97,320000	1.730.825,66	0,60 %

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
Anleihen fix		US92343VFL36	VERIZON COMMUNICATIONS VZ 1 1/2 09/18/30	USD	3.000.000	1.000.000			88,109000	2.350.513,54	0,81 %
Anleihen fix		US92343VES97	VERIZON COMMUNICATIONS VZ 3 7/8 02/08/29	USD	1.000.000				105,452000	937.726,20	0,32 %
Anleihen variabel		NO0010931181	SCATEC ASA SSONO FLOAT 08/19/25	EUR	700.000				90,500000	633.500,00	0,22 %
Summe der zum amtlichen Handel oder einem anderen geregelten Markt zugelassenen Wertpapiere										287.634.851,13	99,34 %
Summe Wertpapiervermögen										287.634.851,13	99,34 %
Anleihenfutures		FGBL20220308	EURO-BUND FUTURE Mar22 RXH2	EUR	-90				166,150000	729.900,00	0,25 %
Anleihenfutures		FGBL20220308	EURO-BUND FUTURE Mar22 RXH2	EUR	-40				166,150000	14.530,00	0,01 %
Summe Finanzterminkontrakte ¹										744.430,00	0,26 %
Devisentermingeschäfte			Forward / BOUGHT USD / SOLD EUR / Raiffeisen Bank International AG	USD	6.000.000				1,127936	44.495,30	0,02 %
Devisentermingeschäfte			Forward / SOLD USD / BOUGHT EUR / Raiffeisen Bank International AG	USD	-49.000.000				1,127936	-520.356,48	-0,18 %
Summe Devisentermingeschäfte ¹										-475.861,18	-0,16 %
Bankguthaben/-verbindlichkeiten											
				EUR						-1.464.921,00	-0,51 %
				AUD						81.410,36	0,03 %
				CAD						114.312,57	0,04 %
				GBP						128.947,06	0,04 %
				SEK						55.422,63	0,02 %
				USD						748.901,64	0,26 %
Summe Bankguthaben/-verbindlichkeiten										-335.926,74	-0,12 %
Abgrenzungen											
Zinsenansprüche (aus Wertpapieren und Bankguthaben)										1.246.278,30	0,43 %
Cash Collateral Zinsen gegeben										-104,90	-0,00 %
Summe Abgrenzungen										1.246.173,40	0,43 %
Sonstige Verrechnungsposten											
Diverse Gebühren										-137.019,57	-0,05 %
Summe Sonstige Verrechnungsposten										-137.019,57	-0,05 %
Cash Collateral											
Forderungen aus gegebenen Sicherheiten										880.000,00	0,30 %
Summe Cash Collateral										880.000,00	0,30 %
Summe Fondsvermögen										289.556.647,04	100,00 %

ISIN	Ertragstyp		Währung	Errechneter Wert je Anteil	Umlaufende Anteile in Stück
AT0000A1KKC2	I	Ausschüttung	EUR	95,51	95.619.399
AT0000A292N8	R	Ausschüttung	EUR	93,36	112.234.743
AT0000A292T5	RZ	Ausschüttung	EUR	94,06	22.878.055
AT0000A1FV69	I	Thesaurierung	EUR	101,65	1.084.262.842
AT0000A292M0	R	Thesaurierung	EUR	95,23	69.139.950
AT0000A292S7	RZ	Thesaurierung	EUR	95,80	61.628.467
AT0000A296M1	SZ	Thesaurierung	EUR	94,37	171.820.191
AT0000A1FV77	I	Vollthesaurierung Ausland	EUR	102,83	407.854.645
AT0000A1VGH6	S	Vollthesaurierung Ausland	EUR	98,03	84.664.330
AT0000A1VGG8	R	Vollthesaurierung Ausland	EUR	101,21	767.567.520
AT0000A1YBY6	RZ	Vollthesaurierung Ausland	EUR	100,56	9.336.000

Devisenkurse

Vermögenswerte in fremder Währung wurden zu den Devisenkursen per 25.02.2022 in EUR umgerechnet

Währung		Kurs (1 EUR =)
Australische Dollar	AUD	1,556150
Kanadische Dollar	CAD	1,432650
Britische Pfund	GBP	0,838150
Schwedische Kronen	SEK	10,602900
Amerikanische Dollar	USD	1,124550

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
Anleihen fix		ES0200002022	ADIF - ALTA VELOCIDAD ADIFAL 0.8 07/05/23	EUR		800.000
Anleihen fix		XS2079716937	APPLE INC AAPL 0 1/2 11/15/31	EUR		1.100.000
Anleihen fix		XS1527753187	BNP PARIBAS BNP 0 1/2 06/01/22	EUR		400.000
Anleihen fix		FR0013067170	BPCE SA BPCEGP 1 1/8 12/14/22	EUR		400.000
Anleihen fix		XS2081543204	CORP ANDINA DE FOMENTO CAF 0 5/8 11/20/26	EUR		1.300.000
Anleihen fix		XS1107718279	EUROPEAN INVESTMENT BANK EIB 1 1/4 11/13/26	EUR	2.800.000	2.800.000
Anleihen fix		XS1732400319	FERROVIE DELLO STATO FERROV 0 7/8 12/07/23	EUR		470.000
Anleihen fix		XS2233088132	HAMBURGER HOCHBAHN AG HHOCGR 0 1/8 02/24/31	EUR		700.000
Anleihen fix		XS2020608548	HERA SPA HERIM 0 7/8 07/05/27	EUR	1.500.000	2.000.000
Anleihen fix		XS1084043451	HERA SPA HERIM 2 3/8 07/04/24	EUR		400.000
Anleihen fix		XS1979491559	INSTITUT CREDITO OFICIAL ICO 0.2 01/31/24	EUR		300.000
Anleihen fix		XS2398789110	IREN SPA IREIM 0 1/4 01/17/31	EUR	500.000	500.000
Anleihen fix		XS1999841445	KFW KFW 0.01 05/05/27	EUR	3.000.000	3.000.000
Anleihen fix		XS1956022716	OP CORPORATE BANK PLC OPBANK 0 3/8 02/26/24	EUR		200.000
Anleihen fix		XS1958534528	REPUBLIC OF POLAND POLAND 1 03/07/29	EUR		600.000
Anleihen fix		XS1957442541	SNAM SPA SRGIM 1 1/4 08/28/25	EUR		500.000
Anleihen fix		XS1197336263	VESTAS WIND SYSTEMS A/S VWSDC 2 3/4 03/11/22	EUR		800.000
Anleihen fix		XS1222743061	TRANSPORT FOR LONDON TRANLN 2 1/8 04/24/25	GBP		500.000
Anleihen fix		XS2180643889	NEDER WATERSCHAPSBANK NEDWBK 1 05/28/30	USD		5.000.000
Anleihen fix		XS1386139841	NEDER WATERSCHAPSBANK NEDWBK 2 3/8 03/24/26	USD		1.800.000

1 Kursgewinne und -verluste zum Stichtag.

Angaben zu Wertpapierleihegeschäften und Pensionsgeschäften

Gemäß den Fondsbestimmungen werden keine Wertpapierleihegeschäfte für den Fonds durchgeführt. Dementsprechend sind die in § 8 Wertpapierleih- und Pensionsgeschäfteverordnung sowie Art. 13 VO (EU) 2015/2365 vorgesehenen näheren Angaben zu Wertpapierleihegeschäften nicht erforderlich.

Gemäß den Fondsbestimmungen werden 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 Ausfallrisiko 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 28. Februar 2022 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 880.000,00 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 12. April 2022

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