



Wien 1, Schwarzenbergplatz 3

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

Rechenschaftsbericht

über das Rechnungsjahr
16. Februar 2022 bis 15. Februar 2023

Inhaltsverzeichnis

Organe der Amundi Austria GmbH	3
Angaben zur Vergütungspolitik	4
Bericht an die Anteilhaber/innen	5
Anlagestrategie	5
Kapitalmarktentwicklung	6
Übersicht über die letzten drei Rechnungsjahre des Fonds	8
Ertragsrechnung und Entwicklung des Fondsvermögens	9
1. Wertentwicklung des Rechnungsjahres (Fonds-Performance)	9
2. Fondsergebnis.....	11
3. Entwicklung des Fondsvermögens	12
Vermögensaufstellung	13
Bestätigungsvermerk	21
Berechnung des Gesamtrisikos	23
Steuerliche Behandlung	24
Fondsbestimmungen	25

Organe der Amundi Austria GmbH

Aufsichtsrat

Matteo GERMANO (Vorsitzender)
Christophe LEMARIÉ (stv. Vorsitzender)
Domenico AIELLO
Eli HANTGAN (ab 17.3.2022)
Elodie LAUGEL (ab 17.3.2022)
Marion MORALES ALBINANA-ROSNER (ab 17.3.2022)
Christianus PELLIS
Satyen S SHAH (bis 17.3.2022)
Mag. Karin PASEKA
Thomas GREINER
Beate SCHEIBER

Staatskommissär

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

Geschäftsführung

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

Depotbank

State Street Bank International GmbH, Filiale Wien

Prüfer

Deloitte Audit Wirtschaftsprüfungs GmbH

Angaben zur Vergütungspolitik

1.

Anzahl der Mitarbeiter	150
davon Begünstigte (sonstige Risikoträger) gemäß § 20 Abs. 2 Z 5 AIFMG	27
Gesamtsumme der an die Mitarbeiter (inkl. Geschäftsführung) der VWG gezahlten Vergütungen	EUR 15.869.125,39
davon variable Vergütung	EUR 3.289.410,00

2.

Gesamtsumme der Vergütungen an Risikoträger	EUR 6.095.783,62
davon Vergütungen an die Geschäftsführung	EUR 1.963.134,03
davon Vergütungen an die Führungskräfte	EUR 1.773.270,98
davon Vergütungen an sonstige Risikoträger	EUR 1.957.658,68
davon Vergütungen an die Mitarbeiter mit Kontrollfunktionen	EUR 401.719,93
davon Vergütungen an die Mitarbeiter, die sich aufgrund ihrer Gesamtvergütung in derselben Einkommensstufe befinden wie Geschäftsführung und Risikoträger	EUR 0,00

Sämtliche Angaben in den Punkten 1 und 2 beziehen sich auf die VERA-Meldung per 31.12.2021.

3.

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

4.

Die letzte zentrale unabhängige Überprüfung wurde im Frühjahr 2022 durchgeführt, die detaillierten Ergebnisse wurden dem Vergütungsausschuss und dem Aufsichtsrat in ihrer Sitzung am 15.12.2022 zur Kenntnis gebracht. Es gab keinerlei Unregelmäßigkeiten oder Beanstandungen.

5.

Sowohl Vergütungsausschuss als auch Aufsichtsrat haben zuletzt in ihrer Sitzung vom 15.12.2022 die Grundsätze der Vergütungspolitik überprüft. Eine neue Version der Remuneration Policy wurde am 15.12.2022 beschlossen, in der sowohl eine Anpassung an das FMA-Rundschreiben zu den §§ 17a bis 17c InvFG 2011 und § 11 AIFMG vom 3.11.2022 als auch eine Erweiterung der ESG-Ziele erfolgten.

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

Bericht an die Anteilsinhaber/innen

Sehr geehrte Anteilsinhaber/innen!

Wir legen nachstehend den Bericht des Amundi Öko Sozial Net Zero Ambition Bond, Miteigentumsfonds gemäß Investmentfondsgesetz 2011 idgF (InvFG) über das Rechnungsjahr vom 16. Februar 2022 bis 15. Februar 2023 vor.

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

Der Name des Fonds wurde geändert von „Amundi Euro Rent – Miteigentumsfonds gemäß Investmentfondsgesetz 2011 idgF (InvFG)“ auf „**Amundi Öko Sozial Net Zero Ambition Bond – Miteigentumsfonds gemäß Investmentfondsgesetz 2011 idgF (InvFG)**“. Inkrafttreten der Namensänderung: 03.10.2022.

Anlagestrategie

Der Fonds verfolgt eine aktive Veranlagungsstrategie und orientiert sich an keinem Referenzwert. Der Fonds hielt im Rechnungsjahr die Duration zunehmend unter jener des Referenzmarktes was in einem niedrigeren Zinsrisiko bei steigenden Zinsen resultierte. Bei den Ländern wurde auf Übergewichte in Peripherieländern gesetzt. Unternehmensanleihen wurden im Rechnungsjahr übergewichtet. Mit Anfang Oktober wurde die Anlagestrategie auf einen Schwerpunkt Unternehmensanleihen umgestellt und infolgedessen die Fondsbestimmungen geändert. Die neue Anlagestrategie setzt schwerpunktmäßig auf Unternehmensanleihen. Subfondspositionen wurden im Zuge der neuen Ausrichtung abgebaut. Bei der Titelselektion wurde besonderer Wert auf die Emissionen der Emittenten sowie auf deren Ambitionen in Bezug auf die Eindämmung des Klimawandels Rücksicht genommen und die investierten Emittenten entsprechend angepasst. Dies hat unter anderem zum Ziel, die Emissionsintensität des Portfolios entsprechend zu reduzieren. Im Zuge dieses Themas kamen auch vermehrt Anleihen in USD zum Einsatz, das Währungsrisiko wurde derivativ abgesichert. Der Fonds wurde mit Anfang Oktober mit dem Österreichischen Umweltzeichen für nachhaltige Finanzprodukte zertifiziert. Sowohl durch dieses als auch durch die entsprechende thematische Selektion spielten Anleihen von Energieunternehmen gegen Ende des Rechnungsjahrs keine Rolle mehr. Der Anteil an High Yield Anleihen wurde ebenfalls leicht erhöht. Abseits der Finanzanleihen war der Fonds stark in Unternehmen im Bereich Telekommunikation und Technologie investiert, die tendenziell niedrigere Emissionswerte ausweisen. Doch auch intensivere Sektoren wie Chemie, Kapitalgüter, Immobilien und Transport finden immer wieder den Weg ins Portfolio - Branchen, in denen Maßnahmen zur Emissionsreduktion besonders vielversprechend sind.¹⁾

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

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

Kapitalmarktentwicklung

Das Jahr 2022 stand ganz im Zeichen der Fortsetzung des Anstiegs der Inflation. Durch den Einmarsch Russlands und den dadurch verursachten Krieg in der Ukraine kam es zusätzlich zu den bestehenden Inflationstreibern zu einer Beschleunigung des Anstiegs der Energiepreise, vor allem bei Gas. Aber auch Nahrungsmittelpreise stiegen deutlich. Die globalen Notenbanken mussten daher ihren Kampf gegen die Inflation intensivieren, um ihre Glaubwürdigkeit beim Thema Inflationsbekämpfung nicht zu verlieren. Das angekündigte Ende des quantitativen Easings und damit eine schrittweise Rücknahme der lockeren Geldpolitik, von der „Risky Assets“ zuvor stark profitiert hatten, wurde von den Kapitalmärkten extrem negativ aufgenommen. 2022 markierte den Beginn der Kehrtwende in der Geldpolitik. Einerseits verlangsamte sich die Dynamik des Wirtschaftswachstums gegenüber den Höchstständen im Jahr 2021, andererseits führten die sich erholende Nachfrage und anhaltende Lieferengpässe – verschärft durch den Krieg in der Ukraine – zu Inflationen deutlich über den Zielen der Zentralbanken. Als Reaktion darauf gingen die Zentralbanken vor allem in den USA, in UK und Europa, die zuvor angenommen hatten, die Inflation sei nur ein vorübergehendes Phänomen, dazu über, die Zinsen deutlich zu erhöhen, da die Preiserhöhungen auch bereits zu einem massiven politischen Problem wurden. Stagflationsbefürchtungen nahmen zu, nachdem bei steigenden Preisen die Wachstumsaussichten unter Druck gerieten, was durch geopolitische Spannungen und die Unterbrechungen der europäischen Gasversorgung aus Russland noch verschärft wurde. Die EZB beschloss, ihre Nettokäufe von Vermögenswerten im Rahmen ihres Programms zum Ankauf von Vermögenswerten einzustellen und schuf ein neues Anti-Fragmentierungs-Tool. Im Juni erreichte die Inflation ein 40-Jahreshoch von 9,1 % und hielt die Fed unter Druck. Die Zentralbank erhöhte die Leitzinsen in mehreren Schritten von 0,25 % bis auf 3,25 % im September und wird weiterhin auf einem Straffungskurs bleiben. Zu Jahresende lag die Rendite 10-jähriger US-Staatsanleihen bei fast 3,9 %. Der Druck auf das Wirtschaftswachstum nahm weiter zu, der Einkaufsmanagerindex für das verarbeitende Gewerbe bleibt schwach. Infolgedessen wird die Aufgabe der Fed angesichts ihres doppelten Mandats, Preisstabilität und Wirtschaftswachstum in Einklang zu bringen, schwierig. Trotzdem sorgen starke Arbeitsmärkte und niedrige Arbeitslosenquoten dafür, dass der Gesamtkonsum vorerst robust ist, auch wenn wir einige Wolken am Horizont sehen. Der starke Anstieg der Inflation führte zu steigenden Notenbankzinsen und zu der Erwartung, dass die Notenbanken die Zinsen so lange erhöhen müssen, bis sie die Inflation in den Griff bekommen. Dadurch kamen sämtliche Rentenmärkte extrem unter Druck und die meisten Staatsanleihenmärkte der Industriestaaten erzielten 2022 das mit Abstand schlechteste Ergebnis seit vielen Jahrzehnten. Auch Unternehmensanleihen und High Yield Anleihen korrigierten deutlich. Die Aktienmärkte reagierten – nach dem starken Anstieg 2021 – auf die steigenden Zinsen und auf die Erwartung, dass die Wirtschaftsdynamik deutlich abnehmen wird, mit massiven Kursrückgängen, wobei vor allem Wachstumsaktien, Kommunikationsdienstleistungen und zyklische Konsumaktien sowie Industrieaktien deutlich unter Druck gerieten, defensive Sektoren – vor allem der Energiesektor - konnten outperformen. Das Jahr 2022 war geprägt von marktübergreifenden Divergenzen. Während auf der einen Seite die anhaltende Inflation die Hauptsorge bleibt, kamen im Jahresverlauf auch Sorgen um das Wirtschaftswachstum dazu, insbesondere in Europa und in gewissem Maße in den USA. Der Rückgang der US-amerikanischen und europäischen Aktien ist ein Hinweis auf die Neubewertung, die von Stagflationsbefürchtungen angeführt wird, die sich auf die Verbrauchernachfrage und schließlich auf die Unternehmensgewinne auswirken könnten. Gegen Jahresende kam zwar eine „Bärenmarktrallye“ zustande, aber die starken US-Arbeitsmarktdaten für November schwächten das Markt-Narrativ einer moderateren Notenbankpolitik, sodass sich für die US-Inflation ein gemischtes Bild ergab, da die Dienstleistungskomponenten weiterhin hartnäckig sind. Die Fed verlangsamte das Tempo der Zinserhöhungen, bekräftigte aber, dass ihre Aufgabe noch lange nicht erledigt ist. Die Zentralbanken, einschließlich der EZB, werden sich auf einem schmalen Grat bewegen, bei dem die Gefahr von Fehlern groß ist. Belastend wirkte 2022 auch die Schwäche der Wirtschaft Chinas, hervorgerufen vor allem durch die Null-Covid-Politik und die Immobilienkrise. Gleichzeitig sehen wir zunehmende geopolitische Risiken in Europa und den USA. In den Emerging Markets dürfte jedoch die sich zuletzt abzeichnende Beschleunigung der Wiederöffnung in China früher als erwartet zu einem Aufschwung führen, während sich Europa noch in der Rezession und die USA in einer deutlichen Abschwächung befinden werden. Dies unterstreicht ein wesentliches Merkmal der Aussichten für 2023: die starke regionale Asynchronität der Wirtschaftszyklen. Die Anleihenmärkte standen 2022 im Zeichen der Inflation, der Politik der Zentralbanken und der Wachstumsorgen.

Bei Staatsanleihen schauen die Märkte weiterhin auf die Inflation und die Reaktion der Fed, aber die Aufmerksamkeit dürfte sich bald auf das Wachstum und die Rezessionsängste richten. Vorläufig ist die Richtung der Zinsen noch aufwärts. Die Fed hat klargestellt, dass sie nun mit höheren finalen Zinsen rechnet als im September erwartet. Die Frage, wie lange die Zentralbank die Zinsen restriktiv hält, gewinnt an Bedeutung. Die Zentralbanken der Schwellenmärkte setzten ihren Spagat zwischen Wachstum und Inflation ebenso fort wie ihre Pendants der Industriestaaten. Für ausgewählte Schwellenländer wie Indien sind importierte Inflation und steigende Kosten für Rohstoffimporte jedoch ein größeres Problem. In Lateinamerika erhöhten die Zentralbanken von Brasilien, Chile und Peru die Zinsen, um die Inflation zu kontrollieren. Der US-Dollar konnte in den ersten drei Quartalen 2022 gegenüber dem Euro deutlich zulegen. Während Europa stark unter der Energieabhängigkeit von Russland leidet, profitierte der Dollar von der steigenden Zinsdifferenz gegenüber der Eurozone, vom stabileren Wachstum und von Produktivitätsgewinnen in den USA. Im vierten Quartal kam es jedoch zu einer Korrektur beim Dollarkurs.²⁾

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

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

Übersicht über die letzten drei Rechnungsjahre des Fonds

Fondsvermögen in EUR, Angaben zu den Tranchen in Tranchenwährung

Rechnungsjahresende	15.02.2023	15.02.2022	15.02.2021
Fondsvermögen in 1.000	55.708	67.882	99.776
Ausschüttungsanteile AT0000947643 in EUR			
Rechenwert je Anteil	81,45	91,45	98,37
Anzahl der ausgegebenen Anteile	228.208	442.965	642.860
Ausschüttung je Anteil	1,20	1,20	1,20
Wertentwicklung in %	-9,71	-5,87	+0,86
Thesaurierungsanteile mit KEST-Abzug AT0000719281 in EUR			
Rechenwert je Anteil	127,68	142,23	152,21
Anzahl der ausgegebenen Anteile	189.567	192.436	240.000
zur Thesaurierung verwendeter Ertrag	-15,33	3,03	4,52
Auszahlung gem. § 58 Abs 2 InvFG	0,0000	0,7825	1,0813
Wertentwicklung in %	-9,72	-5,88	+0,86
Thesaurierungsanteile mit KEST-Abzug AT0000A31F33 in EUR ab 15.11.2022			
Rechenwert je Anteil	101,34	-	-
Anzahl der ausgegebenen Anteile	20	-	-
zur Thesaurierung verwendeter Ertrag	0,46	-	-
Auszahlung gem. § 58 Abs 2 InvFG	0,1441	-	-
Wertentwicklung in %	+1,34	-	-
Thesaurierungsanteile mit KEST-Abzug AT0000A31F41 in EUR ab 15.11.2022			
Rechenwert je Anteil	101,34	-	-
Anzahl der ausgegebenen Anteile	20	-	-
zur Thesaurierung verwendeter Ertrag	0,46	-	-
Auszahlung gem. § 58 Abs 2 InvFG	0,1441	-	-
Wertentwicklung in %	+1,34	-	-
Thesaurierungsanteile mit KEST-Abzug AT0000A31F58 in EUR ab 15.11.2022			
Rechenwert je Anteil	101,34	-	-
Anzahl der ausgegebenen Anteile	20	-	-
zur Thesaurierung verwendeter Ertrag	0,46	-	-
Auszahlung gem. § 58 Abs 2 InvFG	0,1440	-	-
Wertentwicklung in %	+1,34	-	-
Thesaurierungsanteile mit KEST-Abzug AT0000A308K8 in EUR ab 15.11.2022			
Rechenwert je Anteil	1.013,55	-	-
Anzahl der ausgegebenen Anteile	12.736	-	-
zur Thesaurierung verwendeter Ertrag	4,56	-	-
Auszahlung gem. § 58 Abs 2 InvFG	1,4215	-	-
Wertentwicklung in %	+1,36	-	-

Ertragsrechnung und Entwicklung des Fondsvermögens

1. Wertentwicklung des Rechnungsjahres (Fonds-Performance)

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

Ausschüttungsanteile AT0000947643	in EUR
Rechenwert am Beginn des Rechnungsjahres	91,45
Ausschüttung am 19.04.2022 (Rechenwert: 87,30) von 1,20 entspricht 0,0137 Anteilen	1,20
Rechenwert am Ende des Rechnungsjahres	81,45
Gesamtwert inkl. (fiktiv) mit dem Ausschüttungsbetrag erworbene Anteile (1,0137 * 81,45)	82,57
Nettoertrag pro Anteil (82,57 - 91,45)	-8,88
Wertentwicklung eines Anteiles im Rechnungsjahr in %	-9,71

Thesaurierungsanteile mit KEST-Abzug AT0000719281	in EUR
Rechenwert am Beginn des Rechnungsjahres	142,23
Auszahlung (KESt) am 19.04.2022 (Rechenwert: 136,85) von 0,7825 entspricht 0,0057 Anteilen	0,78
Rechenwert am Ende des Rechnungsjahres	127,68
Gesamtwert inkl. (fiktiv) mit dem Auszahlungsbetrag erworbene Anteile (1,0057 * 127,68)	128,41
Nettoertrag pro Anteil (128,41 - 142,23)	-13,82
Wertentwicklung eines Anteiles im Rechnungsjahr in %	-9,72

Thesaurierungsanteile mit KEST-Abzug AT0000A31F33 ab 15.11.2022	in EUR
Rechenwert am Beginn des Rechnungsjahres	100,00
Rechenwert am Ende des Rechnungsjahres	101,34
Nettoertrag pro Anteil (101,34 - 100,00)	1,34
Wertentwicklung eines Anteiles im Rechnungsjahr in %	+1,34

Thesaurierungsanteile mit KEST-Abzug AT0000A31F41 ab 15.11.2022	in EUR
Rechenwert am Beginn des Rechnungsjahres	100,00
Rechenwert am Ende des Rechnungsjahres	101,34
Nettoertrag pro Anteil (101,34 - 100,00)	1,34
Wertentwicklung eines Anteiles im Rechnungsjahr in %	+1,34

Thesaurierungsanteile mit KEST-Abzug AT0000A31F58 ab 15.11.2022	in EUR
Rechenwert am Beginn des Rechnungsjahres	100,00
Rechenwert am Ende des Rechnungsjahres	101,34
Nettoertrag pro Anteil (101,34 - 100,00)	1,34
Wertentwicklung eines Anteiles im Rechnungsjahr in %	+1,34

Thesaurierungsanteile mit KEST-Abzug AT0000A308K8 ab 15.11.2022	in EUR
Rechenwert am Beginn des Rechnungsjahres	1.000,00
Rechenwert am Ende des Rechnungsjahres	1.013,55
Nettoertrag pro Anteil (1.013,55 - 1.000,00)	13,55
Wertentwicklung eines Anteiles im Rechnungsjahr in %	+1,36

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

Ausschüttung für Ausschüttungsanteile - AT0000947643

Die Ausschüttung von EUR 1,2000 je Anteil wird ab 17.04.2023 von den depotführenden Banken vorgenommen.

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

Auszahlung für Thesaurierungsanteile mit KEST-Abzug - AT0000719281

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

Auszahlung für Thesaurierungsanteile mit KEST-Abzug (VM) - AT0000A31F33

Die Auszahlung der Kapitalertragsteuer in der Höhe von EUR 0,1441 je Thesaurierungsanteil mit KEST-Abzug wird ab 17.04.2023 von den depotführenden Banken vorgenommen, sofern keine Befreiungsgründe vorliegen.

Auszahlung für Thesaurierungsanteile mit KEST-Abzug (VM1) - AT0000A31F41

Die Auszahlung der Kapitalertragsteuer in der Höhe von EUR 0,1441 je Thesaurierungsanteil mit KEST-Abzug wird ab 17.04.2023 von den depotführenden Banken vorgenommen, sofern keine Befreiungsgründe vorliegen.

Auszahlung für Thesaurierungsanteile mit KEST-Abzug (VM2) - AT0000A31F58

Die Auszahlung der Kapitalertragsteuer in der Höhe von EUR 0,1440 je Thesaurierungsanteil mit KEST-Abzug wird ab 17.04.2023 von den depotführenden Banken vorgenommen, sofern keine Befreiungsgründe vorliegen.

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

Die Auszahlung der Kapitalertragsteuer in der Höhe von EUR 1,4215 je Thesaurierungsanteil mit KEST-Abzug wird ab 17.04.2023 von den depotführenden Banken vorgenommen, sofern keine Befreiungsgründe vorliegen.

2. Fondsergebnis

Angaben in EUR

a. Realisiertes Fondsergebnis

Ordentliches Fondsergebnis

Erträge (ohne Kursergebnis)

Zinsenerträge	972.148,90	
Dividenderträge	0,00	
Erträge aus Subfonds	-90,61	
sonstige Erträge	0,00	
Zinsaufwendungen (inkl. negativer Habenzinsen)	-4.168,50	967.889,79

Aufwendungen

Vergütung an die Verwaltungsgesellschaft	-299.824,86	
Abzügl. Verwaltungskostenrückvergütung aus Subfonds ¹⁾	0,00	
Performancegebühren	0,00	
Kosten für Wirtschaftsprüfer und Steuerberatung	-7.518,42	
Publizitätskosten und Aufsichtskosten	-6.192,24	
Garantiegebühren	0,00	
Kosten für die Depotbank	-59.076,02	
Kosten für Dienste externer Berater	0,00	
Lizenzkosten, Kosten für externe Ratings	-3.266,02	
Sonstige Kosten	0,00	-375.877,56

Ordentliches Fondsergebnis (exkl. Ertragsausgleich)

592.012,23

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

Realisierte Gewinne aus Wertpapieren	365.679,80	
Gewinne aus derivativen Instrumenten	1.759.014,51	
Realisierte Verluste aus Wertpapieren	-7.749.951,43	
Verluste aus derivativen Instrumenten	-1.427.262,17	-7.052.519,29

Realisiertes Fondsergebnis (exkl. Ertragsausgleich)

-6.460.507,06

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

Veränderung des nicht realisierten Kursergebnisses		310.343,19
--	--	------------

Ergebnis des Rechnungsjahres ⁴⁾

-6.150.163,87

c. Ertragsausgleich

Ertragsausgleich des Rechnungsjahres	1.400.496,95	
Ertragsausgleich auf den Gewinnvortrag aus Vorjahren	-1.805.463,40	-404.966,45

Fondsergebnis gesamt

-6.555.130,32

3. Entwicklung des Fondsvermögens

Fondsvermögen am Beginn des Rechnungsjahres ⁵⁾		67.882.006,28
Ausschüttungsanteile AT0000947643		
Ausschüttung (für Ausschüttungsanteile) am 19.04.2022		-510.154,74
Thesaurierungsanteile mit KEST-Abzug AT0000719281		
Auszahlung (für Thesaurierungsanteile) am 19.04.2022		-146.103,58
Ausgabe und Rücknahme von Anteilen		
Ausgabe von Anteilen	17.028.728,79	
Rücknahme von Anteilen	-22.396.103,10	
Anteiliger Ertragsausgleich	404.966,45	-4.962.407,86
Fondsergebnis gesamt		
(das Fondsergebnis ist im Detail auf der vorhergehenden Seite dargestellt)		-6.555.130,32
Fondsvermögen am Ende des Rechnungsjahres ⁶⁾		55.708.209,78

Erläuterungen zu den Wertangaben bezüglich Fondsergebnis und Entwicklung des Fondsvermögens:

- 1) Die Position beinhaltet die marktübliche Einbehaltung von Administrationskosten der Verwaltungsgesellschaft sowie Dritter.
Für Anteile an anderen Investmentfonds, in die der Fonds investiert („Subfonds“), kann eine Verwaltungsvergütung von bis zu 2,5 % des betreffenden in diesen Subfonds veranlagten Fondsvermögens verrechnet werden. Gegebenenfalls kann zusätzlich eine Performance Fee anfallen.
- 2) Realisierte Gewinne und realisierte Verluste sind nicht periodenabgegrenzt und stehen so wie die Veränderung des nicht realisierten Kursergebnisses nicht unbedingt in Beziehung zu der Wertentwicklung des Fonds im Rechnungsjahr.
- 3) Kursergebnis gesamt, ohne Ertragsausgleich (realisiertes Kursergebnis ohne Ertragsausgleich, zuzüglich Veränderungen des nicht realisierten Kursergebnisses): EUR -6.742.176,10
- 4) Das Ergebnis des Rechnungsjahres beinhaltet explizit ausgewiesene Transaktionskosten in Höhe von EUR 23.433,37
- 5) Anteilsumlauf zu Beginn des Rechnungsjahres: 442.965 Ausschüttungsanteile, 192.436 Thesaurierungsanteile mit KEST-Abzug, - Thesaurierungsanteile mit KEST-Abzug VM(T), - Thesaurierungsanteile mit KEST-Abzug VM1(T), - Thesaurierungsanteile mit KEST-Abzug VM2(T), - Thesaurierungsanteile mit KEST-Abzug (I).
- 6) Anteilsumlauf am Ende des Rechnungsjahres: 228.208 Ausschüttungsanteile, 189.567 Thesaurierungsanteile mit KEST-Abzug, 20 Thesaurierungsanteile mit KEST-Abzug VM(T), 20 Thesaurierungsanteile mit KEST-Abzug VM1(T), 20 Thesaurierungsanteile mit KEST-Abzug VM2(T), 12.736 Thesaurierungsanteile mit KEST-Abzug (I).

Vermögensaufstellung

ISIN	Wertpapier-Bezeichnung	Zins-satz	Käufe / Zugänge Stück / Nominale	Verkäufe / Abgänge (Nom. in 1.000, ger.)	Bestand	Kurs in Wertpapier-währung	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds-vermögen
ZUM AMTLICHEN HANDEL ODER EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT ZUGELASSENE WERTPAPIERE								
ANLEIHEN auf AMERIKANISCHE DOLLAR lautend								
US09062XAF06	BIOGEN INC. 15/25	4,050	200	0	200	97,3760	182.420,38	0,33
US17275RBC51	CISCO SYSTEMS 16/26	2,950	300	0	300	95,1790	267.456,91	0,48
US126650CX62	CVS HEALTH 18/28	4,300	200	0	200	96,4910	180.762,46	0,32
US24703TAK25	DELL IN./EMC 16/46	8,350	200	0	200	115,6810	216.712,25	0,39
US278865BD18	ECOLAB 2027	3,250	200	0	200	93,8210	175.760,58	0,32
US29444UBL98	EQUINIX 20/28	1,550	300	0	300	83,8530	235.630,39	0,42
US42824CAX74	HP ENTERPRISE 16/35	6,200	300	0	300	104,9450	294.899,78	0,53
US47837RAA86	JC INTL/TYCO 20/30	1,750	300	0	300	80,9520	227.478,46	0,41
USY5257YAM94	LENOVO GP. 22/32 REGS	6,536	200	0	200	100,8470	188.922,82	0,34
US690742AJ00	OWENS CORN. 19/29	3,950	300	0	300	93,1380	261.721,62	0,47
USJ4881VAA55	RENESAS ELE. 21/24 REGS	1,543	200	0	200	92,1690	172.665,79	0,31
Summe							2.404.431,44	4,32
ANLEIHEN auf EURO lautend								
BE6301510028	AB INBEV 18-27 MTN	1,150	300	0	300	91,5160	274.548,00	0,49
XS1520907814	ABBVIE 16/28	2,125	0	0	200	92,2730	184.546,00	0,33
XS2348638433	ABN AMRO BK 21/33 MTN	1,000	400	0	400	75,5900	302.360,00	0,54
XS2150015555	AHOLD DELHA. 20/27	1,750	300	0	300	93,5040	280.512,00	0,50
XS2462468740	AKZO NOBEL 22/32 MTN	2,000	300	0	300	86,8030	260.409,00	0,47
FR001400F6E7	ALD 23/27 MTN	4,250	400	0	400	100,6240	402.496,00	0,72
DE000A254TM8	ALLIANZ MTN 2020/2050	2,121	200	0	200	83,6370	167.274,00	0,30
DE000A289FK7	ALLIANZ SE SUB.20/UNBEFR.	2,625	0	0	200	73,9640	147.928,00	0,27
BE6320935271	ANHEU.-BUSCH 20/32 MTN	2,875	300	0	300	93,8110	281.433,00	0,51
XS2389757944	ANZ N.Z.INTL 21/27 MTN	0,200	300	0	300	84,6180	253.854,00	0,46
XS1942708527	ARGENT.NETH. 19/49FLR MTN	2,750	300	0	300	89,2090	267.627,00	0,48
FR0013252277	ARKEMA 17/27 MTN	1,500	300	0	300	92,3730	277.119,00	0,50
FR001400FAZ5	ARKEMA 23/31 MTN	3,500	200	0	200	97,0520	194.104,00	0,35
FR001400CSG4	ARVAL SERV.L 22/26 MTN	4,000	400	0	400	99,6500	398.600,00	0,72
FR001400F6O6	ARVAL SERV.L 23/26 MTN	4,125	200	0	200	100,0270	200.054,00	0,36
XS1144088165	AT + T 14/29	2,600	0	100	100	92,5130	92.513,00	0,17
XS1482736185	ATLAS COPCO 16/26 MTN	0,625	0	0	200	91,2220	182.444,00	0,33
XS2431029441	AXA 22/42 FLR MTN	1,875	300	0	300	77,6920	233.076,00	0,42
XS2537251170	AXA S.A. 22/30 MTN	3,750	320	0	320	101,6590	325.308,80	0,58
AT0000A0NFV8	BAWAG P.S.K.11-23/10 ZO	0,000	0	0	965	96,8050	934.168,25	1,68
AT0000A0NFW6	BAWAG P.S.K.11-24/11 ZO	0,000	0	0	140	92,6750	129.745,00	0,23
XS1998215559	BAXTER INTL 19/29	1,300	0	100	200	85,2360	170.472,00	0,31
XS2485259241	BBVA 22/25 MTN	1,750	300	0	300	95,0430	285.129,00	0,51
XS2430998893	BBVA 22/29 FLR MTN	0,875	400	0	400	85,0930	340.372,00	0,61
XS2028816028	BCO SABADELL 19/25 MTN	0,875	300	0	300	93,4030	280.209,00	0,50
XS2588884481	BCO SABADELL 23/33 FLRMTN	6,000	200	0	200	98,0000	196.000,00	0,35
XS2194370727	BCO SANTAND. 20/27 MTN	1,125	300	0	300	89,5390	268.617,00	0,48
XS2538366878	BCO SANTAND.22/26 FLR MTN	3,625	500	0	500	99,1260	495.630,00	0,89
XS2560753936	BERTELSMANN ANL.22/29	3,500	100	0	100	98,4630	98.463,00	0,18
XS2049707180	BK NOVA SCOT 19/26 MTN	0,125	300	0	300	87,9900	263.970,00	0,47
FR0013381704	BNP PARIBAS 18/30 FLR MTN	2,375	300	0	300	93,7840	281.352,00	0,51
FR0014000UL9	BNP PARIBAS 20/32 MTN	0,625	400	0	400	72,3320	289.328,00	0,52
FR001400DCZ6	BNP PARIBAS 23/29 FLR MTN	4,375	100	0	100	101,1600	101.160,00	0,18
FR001400F083	BPCE 23/33 MTN	4,500	200	0	200	100,3230	200.646,00	0,36
FR0011538222	BPCE S.A. 13/23	4,625	0	0	100	100,4580	100.458,00	0,18
FR0013425162	BQUE F.C.MTL 19/29 MTN	1,875	0	0	200	84,6940	169.388,00	0,30
FR0013415692	BQUE POSTALE 19/29 MTN	1,375	300	0	300	85,4300	256.290,00	0,46
FR0014001R34	BQUE POSTALE 21/32FLR MTN	0,750	0	0	200	81,9870	163.974,00	0,29
XS1720922175	BRIT. TELECOM. 17/24 MTN	1,000	300	0	300	95,4920	286.476,00	0,51
XS2582814039	BRIT. TELECOM 23/31 MTN	3,750	220	0	220	98,5500	216.810,00	0,39
PTCGDCOM0037	CAIXA GERAL 21/27 FLR MTN	0,375	300	0	300	86,3440	259.032,00	0,46
XS2258971071	CAIXABK 20/26 FLR MTN	0,375	0	0	300	89,7950	269.385,00	0,48
XS2133071774	CARLSB.BREW. 20/30 MTN	0,625	400	0	400	80,7110	322.844,00	0,58
XS2545263399	CARLSB.BREW. 22/25 MTN	3,250	160	0	160	99,3100	158.896,00	0,29
FR001400D0F9	CARREF. 22/28 MTN	4,125	400	0	400	101,7650	407.060,00	0,73
FR0014009E07	CARREF. 22/29 MTN	2,375	300	0	300	91,2860	273.858,00	0,49
DE000CZ43ZN8	COBA 23/30 VAR	5,125	100	0	100	101,5220	101.522,00	0,18

ISIN	Wertpapier-Bezeichnung	Zinssatz	Käufe / Zugänge Stück / Nominale	Verkäufe / Abgänge (Nom. in 1.000, ger.)	Bestand	Kurs in Wertpapier- währung	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
DE000CZ45V25	COBA FIX-RESET 20/30 SUB.	4,000	300	0	300	96,3030	288.909,00	0,52
DE000CZ40LD5	COBA T2 NACHRANG 16/26	4,000	0	0	100	98,6910	98.691,00	0,18
XS2533012790	COCA C.HBC F 22/25 MTN	2,750	120	0	120	97,6280	117.153,60	0,21
XS2264977146	COCA-C.EU.P. 20/28	0,200	300	0	300	82,0320	246.096,00	0,44
XS1637093508	COM.GR.FIN.N 17/24 MTN COMMONW.BK	0,625	300	0	300	96,1790	288.537,00	0,52
XS1750349190	AUSTR.18/28MTN	1,125	300	0	300	88,8960	266.688,00	0,48
XS2178586157	CONTINENTAL MTN20/26	2,500	300	0	300	97,1930	291.579,00	0,52
XS2558972415	CONTINENTAL MTN22/27	3,625	220	0	220	99,4770	218.849,40	0,39
FR0013519279	COVIVIO 20/30	1,625	300	0	300	86,7350	260.205,00	0,47
FR00140007B4	CR.MUT.ARKEA 20/26 MTN	0,010	0	100	200	89,5160	179.032,00	0,32
XS1395021089	CREDIT AGR. 16/26 MTN	1,250	0	0	300	93,2790	279.837,00	0,50
XS1204154410	CREDIT AGR. 15/27	2,625	300	0	300	94,0870	282.261,00	0,51
XS2400445289	DELL BK INTL 21/26 MTN	0,500	300	0	300	87,5980	262.794,00	0,47
DE000A289N78	DEUT.BOERSE SUB.ANL20/47	1,250	0	0	300	88,9020	266.706,00	0,48
XS0862952297	DEUTSCHE POST MTN.12/24	2,875	0	100	200	100,1780	200.356,00	0,36
XS1917358621	DEUTSCHE POST MTN.18/28	1,625	300	0	300	92,8060	278.418,00	0,50
XS2534985523	DNB BK 22/27 FLR MTN	3,125	400	0	400	97,9640	391.856,00	0,70
XS1316420089	DT. BAHN FIN. 15/30 MTN	1,625	0	0	200	87,7940	175.588,00	0,32
DE000A2TSDE2	DT.TELEKOM MTN 19/31	1,750	300	0	300	88,3760	265.128,00	0,48
FR0012599892	EDENRED 15-25	1,375	0	0	200	95,6360	191.272,00	0,34
XS2540585564	ELECTROLUX 22/26 MTN	4,125	650	0	650	101,1510	657.481,50	1,18
BE0002432079	ELIA TRANSM. B. 13-28	3,250	0	0	200	98,5200	197.040,00	0,35
XS1209031019	ELM B.V. 15/UND. FLR MTN	2,600	300	0	300	93,9330	281.799,00	0,51
XS2083210729	ERSTE GR.BK. 19/30 MTN	1,000	0	0	300	90,3960	271.188,00	0,49
XS1198117670	ESSITY 15/25 MTN	1,125	0	0	300	95,0270	285.081,00	0,51
XS1243251375	EUROGRID GMBH MTN.15/25	1,875	0	0	200	96,4110	192.822,00	0,35
XS1789623029	EURONEXT 18/25	1,000	300	0	300	93,9650	281.895,00	0,51
XS2009943379	EURONEXT 19/29	1,125	300	0	300	86,0850	258.255,00	0,46
XS2081474046	FAURECIA 19/27	2,375	0	0	100	86,5180	86.518,00	0,16
ES0205032008	FERROVIAL EMIS. 14/24	2,500	0	0	200	97,9310	195.862,00	0,35
FR0013515871	FONC.LYONN 20/27	1,500	300	0	300	92,1500	276.450,00	0,50
FR0013266350	GECINA 17-27 MTN	1,375	300	0	300	91,7770	275.331,00	0,49
XS2126170161	GIVAU.FIN.EU 20/32	1,625	400	0	400	83,5910	334.364,00	0,60
XS1147605791	GLAXOSM.CAP. MTN 14/24	1,375	0	0	200	96,6340	193.268,00	0,35
XS1681520356	GLAXOSM.CAP. MTN 17/29	1,375	300	0	300	88,4230	265.269,00	0,48
XS2125145867	GM FINANCIAL 20/26 MTN	0,850	300	0	300	90,8520	272.556,00	0,49
XS2384274366	GM FINANCIAL 21/28 MTN	0,650	400	0	400	81,6340	326.536,00	0,59
XS2243299463	H.LUNDBECK 20/27 MTN	0,875	300	0	300	87,1310	261.393,00	0,47
XS2198574209	HANN RUECK SUB 2020/2040	1,750	0	0	200	80,2310	160.462,00	0,29
XS1877595014	HEINEKEN 18/31 MTN	1,750	400	0	400	87,1260	348.504,00	0,63
XS2147977479	HEINEKEN 20/25 MTN	1,625	300	0	300	96,2960	288.888,00	0,52
XS2320789014	HYPONOE LB 21/26 MTN	0,125	300	0	300	87,7490	263.247,00	0,47
XS1091654761	IN.DIS.SVCS. 14/24	2,375	0	200	100	97,4310	97.431,00	0,17
XS2258452478	ING GROEP 20/29 FLR	0,250	0	0	300	81,8790	245.637,00	0,44
XS2176621170	ING GROEP 20/31 FLR MTN	2,125	300	0	300	91,7680	275.304,00	0,49
ES0239140017	INMOBIL.COL. 20/28 MTN	1,350	300	0	300	86,1320	258.396,00	0,46
XS1908370171	INTERCONT.HOT.GRP 18/27	2,125	400	0	400	93,0110	372.044,00	0,67
XS2022424993	INTESA SAN. 19/29 MTN	1,750	200	0	400	85,4040	341.616,00	0,61
XS1319817323	INTL FLAV.+FRAG. 16/24	1,750	300	0	300	97,8640	293.592,00	0,53
XS1843459782	INTL FLAV.+FRAG. 18/26	1,800	300	0	300	91,4480	274.344,00	0,49
BE0002664457	KBC GROEP 19/29 FLR MTN	0,500	0	0	400	92,1020	368.408,00	0,66
BE0002914951	KBC GROEP 23/33 FLR MTN	4,875	300	0	300	98,7830	296.349,00	0,53
FR0014000KT3	KLEPIERRE 20/31 MTN	0,875	400	0	400	78,2790	313.116,00	0,56
XS1485533431	KON. KPN 16/28 MTN	1,125	0	100	100	87,7490	87.749,00	0,16
XS2001175657	KONI.PHILIPS 19/26	0,500	0	0	300	90,1590	270.477,00	0,49
XS2475958059	KONI.PHILIPS 22/29 MTN	2,125	300	0	300	89,5540	268.662,00	0,48
XS2486270858	KONINKL.KPN 22/UND. FLR	6,000	300	0	300	101,9350	305.805,00	0,55
FR0013508694	LA POSTE 20/32 MTN	1,375	300	0	300	81,2530	243.759,00	0,44
XS1685653211	LDN STOCK EXCH.GRP 17/29	1,750	400	0	400	89,8230	359.292,00	0,65
XS1814402878	LEASEPLAN 18/23 MTN	1,000	0	0	400	99,5690	398.276,00	0,71
FR0013513538	LEGRAND 20/30	0,750	400	0	400	84,1020	336.408,00	0,60
XS2391860843	LINDE 21/26 MTN	0,000	300	0	300	88,7320	266.196,00	0,48
XS2521027446	LLOYDS BKG 22/30 FLR MTN	3,125	100	0	100	93,5570	93.557,00	0,17
XS2105735935	MACQUARIE G. 20/27 MTN	0,625	300	0	300	87,6140	262.842,00	0,47
XS2448014808	MASTERCARD 22/29	1,000	300	0	300	87,5670	262.701,00	0,47
DE000A3LBMV2	MERC.B.FI.CA 22/27 MTN	3,000	250	0	250	98,4140	246.035,00	0,44
DE000A2YPFU9	MERCEDESSENZ MTN 19/31	1,125	350	0	350	81,9220	286.727,00	0,51
XS1233734562	MICHELIN 15/27	1,750	0	100	200	93,9490	187.898,00	0,34

ISIN	Wertpapier-Bezeichnung	Zinssatz	Käufe / Zugänge Stück / Nominale	Verkäufe / Abgänge (Nom. in 1.000, ger.)	Bestand	Kurs in Wertpapier- währung	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
XS1675764945	MITSUB. UFJ FIN.GRP 17/24	0,872	300	0	300	95,7400	287.220,00	0,52
XS2465984107	MIZUHO F.G. 22/27 MTN	1,631	300	0	300	91,0690	273.207,00	0,49
XS1197273755	MONDELEZ INTL 15/35	2,375	0	0	100	84,0810	84.081,00	0,15
XS1395010397	MONDI FIN. 16/24 MTN	1,500	300	0	300	97,3840	292.152,00	0,52
XS1117298163	MOODY'S 15/27	1,750	300	0	300	93,1880	279.564,00	0,50
XS2221845683	MUENCH.RUECK 20/41	1,250	0	0	200	77,4650	154.930,00	0,28
XS1843442622	NASDAQ 19/29	1,750	300	0	300	88,3140	264.942,00	0,48
XS1196797614	NATIONWIDE BLDG 15/25 MTN	1,250	0	0	200	95,6610	191.322,00	0,34
XS2080205367	NATWEST GP. 19/25 FLR	0,750	300	0	300	94,5360	283.608,00	0,51
XS2382950330	NATWEST GRP 21/32 FLR MTN	1,043	400	0	400	83,1050	332.420,00	0,60
XS1623355457	NN GP. 17/27 MTN	1,625	300	0	300	91,2570	273.771,00	0,49
XS2488809612	NOKIA 23/31 MTN	4,375	180	0	180	99,1060	178.390,80	0,32
XS1960685383	NOKIA OYJ 19/26 MTN	2,000	0	0	100	95,1420	95.142,00	0,17
XS2343459074	NORDEA BK 21/31 FLR MTN	0,625	0	0	200	87,6160	175.232,00	0,31
XS1585010074	NOVARTIS FIN. 17/27	1,125	300	0	300	91,0280	273.084,00	0,49
XS2348030425	NOVO NO.F.NL 21/28	0,125	300	0	300	85,1560	255.468,00	0,46
DK0030506886	NYKREDIT 22/27 MTN	1,375	300	0	300	89,8020	269.406,00	0,48
DK0030507694	NYKREDIT 22/32 FLR MTN	5,500	400	0	400	100,8780	403.512,00	0,72
DK0030045703	NYKREDIT 23/28 MTN	4,000	400	0	400	98,5120	394.048,00	0,71
XS2258389415	OP YRITYSPA. 20/27 MTN	0,100	350	0	350	85,0110	297.538,50	0,53
FR0014003B55	ORANGE 21/UND. FLR MTN	1,375	300	0	400	80,9980	323.992,00	0,58
XS2242633258	PEPSICO 20/32	0,400	400	0	400	75,5150	302.060,00	0,54
XS1061714165	PEPSICO INC. 14/26 MTN	2,625	300	0	300	97,5630	292.689,00	0,53
XS2353073161	POSTE ITAL 21/UND. FLR	2,625	0	0	300	77,6690	233.007,00	0,42
XS2580271596	PRO.EUR.FIN. 23/30	3,875	210	0	210	98,3420	206.518,20	0,37
XS2580271752	PRO.EUR.FIN. 23/43	4,250	100	0	100	96,4120	96.412,00	0,17
XS2485265214	PROL.I.F.II 22/31 MTN	3,125	300	0	300	90,0380	270.114,00	0,48
FR0012384667	PUBLICIS GRP. 14/24	1,625	300	0	300	96,6250	289.875,00	0,52
XS1180130939	RABOBK NEDERLD 15/27 MTN	1,375	300	0	300	92,5110	277.533,00	0,50
XS2381599898	RAIF.BK INTL 21/27 MTN	0,050	400	0	400	82,1560	328.624,00	0,59
XS2547936984	RAIF.BK INTL 22/28 MTN	5,750	300	0	300	104,6470	313.941,00	0,56
FR001400CRG6	RCI BANQ. 22/28 MTN	4,875	400	0	400	101,4310	405.724,00	0,73
XS2587306403	SAGE GP. 23/28 MTN	3,820	240	0	240	99,8800	239.712,00	0,43
XS2517103250	SAINT-GOBAIN 22/25	1,625	300	0	300	95,5650	286.695,00	0,51
XS2538368221	SANDVIK AB 22/29 MTN	3,750	190	0	190	100,4690	190.891,10	0,34
DE000A13SL34	SAP SE MTN 14/27	1,750	300	100	300	95,1530	285.459,00	0,51
XS2182067350	SCANIA CV 20/25 MTN	2,250	300	0	300	96,5230	289.569,00	0,52
XS1087816374	SCENTRE MANAGEM.14/24 MTN	2,250	0	0	300	97,4730	292.419,00	0,53
DE000A289Q91	SCHAEFFLER MTN 20/25	2,750	0	0	100	96,0060	96.006,00	0,17
FR0013494168	SCHNEIDER EL 20/29 MTN	0,250	400	0	400	84,2130	336.852,00	0,60
FR001400DTA3	SCHNEIDER EL 22/32 MTN	3,500	400	0	400	100,7980	403.192,00	0,72
FR001400F703	SCHNEIDER EL 23/29 MTN	3,125	100	0	100	98,8990	98.899,00	0,18
XS2404247384	SEB 21/31 FLR MTN	0,750	350	0	350	86,5040	302.764,00	0,54
XS2446844594	SIEMENS FIN 22/30 MTN	1,000	300	0	300	85,7240	257.172,00	0,46
XS2128499105	SIGNIFY 20/27	2,375	300	0	300	93,4490	280.347,00	0,50
XS2388182573	SM.KAPPA TR. 21/29	0,500	400	0	400	80,3810	321.524,00	0,58
XS2579319513	SPAREBK 1 SR 23/27 MTN	3,750	400	0	400	98,6400	394.560,00	0,71
XS2183818637	STAND.CHAR. 20/30 FLR	2,500	300	0	300	94,5920	283.776,00	0,51
FR0013518057	STE GENERALE 20/30 MTN	1,250	400	0	400	81,7300	326.920,00	0,59
FR0014004GE5	STE GENERALE 21/27 MTN	0,250	300	0	300	86,1650	258.495,00	0,46
XS2265360359	STORA ENSO 20/30 MTN	0,625	400	0	400	79,8140	319.256,00	0,57
XS2121207828	SVENSKA HDBK 20/30 MTN	0,500	400	0	400	79,4150	317.660,00	0,57
XS2345317510	SVENSKA HDBK 21/28 MTN	0,050	350	0	350	82,3420	288.197,00	0,52
XS2197348324	TAKEDA PHARMA. 20/27	0,750	300	0	300	88,5050	265.515,00	0,48
DE000TLX2102	TALANX AG NTS 14/26	2,500	0	100	100	95,9070	95.907,00	0,17
XS2462605671	TEL.EUROPE 22/UND. FLR	7,125	300	0	300	104,6500	313.950,00	0,56
XS2582389156	TEL.EUROPE 23/UND. FLR	6,135	200	0	200	98,4250	196.850,00	0,35
XS1946004451	TELEFON.EMI. 19/24 MTN	1,069	300	0	300	97,8750	293.625,00	0,53
XS2117452156	TELENOR 20/28 MTN	0,250	350	0	350	84,9030	297.160,50	0,53
XS0826189028	TELIA COMP. AB 12/27MTN	3,000	300	0	300	97,6370	292.911,00	0,53
XS1395057430	TELSTRA CORP. 16/26 MTN	1,125	0	0	100	92,6390	92.639,00	0,17
XS2002491780	TENNET HLDG 19/30 MTN	0,875	0	0	200	82,6040	165.208,00	0,30
XS2207430120	TENNET HLDG 20/UND.FLR	2,374	300	0	300	93,7810	281.343,00	0,51
XS2432502008	TORON.DOM.BK 22/27 MTN	0,500	350	0	350	88,1810	308.633,50	0,55
XS2017471553	UNICREDIT 19/25 FLR MTN	1,250	0	100	300	96,2620	288.786,00	0,52
XS2588885025	UNICREDIT 23/29 FLR MTN	4,450	450	0	450	98,2760	442.242,00	0,79
XS2207976783	UNICREDIT 20/27 FLR MTN	2,200	350	0	350	92,5500	323.925,00	0,58
XS2237434803	UNIPOL GRUP. 20/30 MTN	3,250	0	0	100	94,9510	94.951,00	0,17

ISIN	Wertpapier-Bezeichnung	Zinssatz	Käufe / Zugänge Stück / Nominale	Verkäufe / Abgänge (Nom. in 1.000, ger.)	Bestand	Kurs in Wertpapierwährung	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fondsvermögen	
FR001400EA16	VALEO 22/27 MTN	5,375	100	0	100	100,8300	100.830,00	0,18	
FR0013139482	VALEO SE 16-26 MTN	1,625	200	0	200	92,6250	185.250,00	0,33	
FR0014003G27	VERALLIA 21/28	1,625	0	0	100	87,5640	87.564,00	0,16	
FR0014006EG0	VERALLIA 21/31	1,875	100	0	100	81,2170	81.217,00	0,15	
XS1140300663	VERBUND AG 14/24	1,500	0	0	200	96,9710	193.942,00	0,35	
XS2320759538	VERIZON COMM 21/29	0,375	400	0	400	81,7030	326.812,00	0,59	
FR001400D8K2	VINCI S.A. 22/32 MTN	3,375	300	0	300	97,6060	292.818,00	0,53	
XS2585239200	VIRGIN MONEY 23/28 FLRMTN	4,625	150	0	150	99,2500	148.875,00	0,27	
XS2560495116	VODAF.INT.F. 22/34 MTN	3,750	240	0	240	98,0290	235.269,60	0,42	
XS2586851300	VODAF.INT.F. 23/43 MTN	4,000	120	0	120	95,7440	114.892,80	0,21	
XS1463101680	VODAFONE GRP 16/31 MTN	1,600	200	100	300	84,6600	253.980,00	0,46	
XS1721423462	VODAFONE GRP 17/25 MTN	1,125	300	0	300	93,9970	281.991,00	0,51	
XS2521820048	VOLVO TREAS. 22/27 MTN	2,000	300	0	300	93,2360	279.708,00	0,50	
XS2583352443	VOLVO TREAS. 23/25 MTN	3,500	130	0	130	99,8330	129.782,90	0,23	
DE000A19UR79	VONOVIA FIN. 18/28 MTN	1,500	0	200	200	88,0600	176.120,00	0,32	
XS2187689380	VW INTL.FIN 20/UND. FLR	3,875	200	0	400	87,3660	349.464,00	0,63	
FR0012516417	WENDEL SE 15-27	2,500	0	0	200	95,1250	190.250,00	0,34	
AT0000A2GLA0	WIENERBERGER 20/25	2,750	0	0	100	97,6590	97.659,00	0,18	
XS2530756191	WOLTERS KLUW 22/26	3,000	100	0	100	98,4540	98.454,00	0,18	
XS1575992596	WOLTERS KLUWER 17/27	1,500	0	100	200	93,0090	186.018,00	0,33	
FR0013521564	WORLDLINE 20/27	0,875	300	0	300	87,6730	263.019,00	0,47	
					Summe		51.981.701,45	93,31	
SUMME DER ZUM AMTLICHEN HANDEL ODER EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT ZUGELASSENEN WERTPAPIERE								54.386.132,89	97,63
SUMME WERTPAPIERVERMÖGEN								54.386.132,89	97,63

FINANZTERMINKONTRAKTE

Bezeichnung / Underlying	Fälligkeit	Whg.	Anzahl / Betrag	Kontraktkurs	unrealisiertes Ergebnis in EUR	%-Anteil am Fondsvermögen
FINANZTERMINKONTRAKTE						
WÄHRUNGSTERMINKONTRAKTE						
CROSS RATE EUR/USD FUT MÄRZ 23	13.03.2023	USD	20	1,0698	4.636,57	0,01
			Summe		4.636,57	0,01
ZINSTERMINKONTRAKTE						
EURO BOBL FUT (FGBM) MÄRZ 23	08.03.2023	EUR	-33	116,2100	67.590,00	0,12
EURO BUND FUT (FGBL) MÄRZ 23	08.03.2023	EUR	8	134,7400	-56.800,00	-0,10
			Summe		10.790,00	0,02
SUMME FINANZTERMINKONTRAKTE					15.426,57	0,03

BANKGUTHABEN / BANKVERBINDLICHKEITEN

BANKGUTHABEN / BANKVERBINDLICHKEITEN

WÄHRUNG	FONDSWÄHRUNG	BETRAG FONDSWÄHRUNG
EURO	EUR	621.765,82
AMERIKANISCHE DOLLAR	EUR	159.329,46
INITIAL MARGIN / VARIATION MARGIN	EUR	76.803,19
SUMME BANKGUTHABEN / BANKVERBINDLICHKEITEN		857.898,47

	EUR	%
Wertpapiervermögen	54.386.132,89	97,63
Finanzterminkontrakte	15.426,57	0,03
Zinsenerträge (inkl. negativer Habenzinsen)	477.275,42	0,86
Bankguthaben / Bankverbindlichkeiten	857.898,47	1,53
Gebührenverbindlichkeiten	-28.523,57	-0,05
FONDSVERMÖGEN	55.708.209,78	100,00

Erläuterungen zur Vermögensaufstellung:

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

DEWISENKURSE

DEWISENKURSE

WÄHRUNG	EINHEITEN	KURS
AMERIKANISCHE DOLLAR	1 EUR =	1,06760 USD

Risikohinweis:

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

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

Das Nettovermögen wird nach folgenden Grundsätzen ermittelt:

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

**Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte,
soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen:
Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schuldscheindarlehen
(Marktzuordnung zum Berichtsstichtag)**

ISIN	Wertpapier-Bezeichnung	Zins- satz	Whg.	Käufe / Zugänge Lots / Stück / Nominale (Nom. in 1.000, ger.)	Verkäufe / Abgänge Lots / Stück / Nominale (Nom. in 1.000, ger.)
WERTPAPIERE					
DE0004778477	EURO-DM SEC.D86/26 NK	0,000	DEM	0	710
XS1014018045	A.N.Z. BKG GRP 14/24 MTN	2,500	EUR	0	200
XS2026150313	A2A 19/29 MTN	1,000	EUR	0	130
FR0013457058	ACT.LOG.SER. 19/34 MTN	0,500	EUR	0	700
FR0014000AU2	AGENCE FR.DV 20/27 MTN	0,000	EUR	0	4.100
FR0014005NA6	AGENCE FR.DV 21/31 MTN	0,125	EUR	0	600
FR0014002GB5	AGENCE FR.DV 21/36 MTN	0,375	EUR	0	200
FR001400ADF2	AGENCE FR.DV 22/32	1,625	EUR	400	400
FR0013241346	AIR LIQUIDE FIN. 17/27MTN	1,000	EUR	300	300
FR0012766889	AIR LIQUIDE FIN.15/25 MTN	1,250	EUR	0	300
XS1135337498	APPLE 14/26	1,625	EUR	0	200
FR0012300812	APRR 14/25	1,875	EUR	0	200
XS1411404855	ASTRAZENECA 16/24 MTN	0,750	EUR	0	300
IT0004532559	B.T.P. 09-40	5,000	EUR	0	700
IT0004889033	B.T.P. 13-28	4,750	EUR	0	600
IT0005001547	B.T.P. 14-24	3,750	EUR	0	650
IT0005172322	B.T.P. 16-23	0,950	EUR	0	600
IT0005273013	B.T.P. 17-48	3,450	EUR	0	400
XS1117528189	BABCOCK INT.GR.14/22 MTN	1,750	EUR	0	200
XS0947658208	BACARDI 13/23	2,750	EUR	0	100
AT0000A0NFU0	BAWAG P.S.K.11-22/09 ZO	0,000	EUR	0	100
ES0413211816	BBVA SA 14/24	2,250	EUR	0	300
ES0413900376	BCO SANTANDER 14/34	2,000	EUR	0	400
XS2002532724	BD EURO FIN. 19/26	1,208	EUR	300	300
BE0000304130	BELGIQUE 04/35 44	5,000	EUR	0	400
BE0000331406	BELGIQUE 13-45 71	3,750	EUR	0	450
BE0000337460	BELGIQUE 16/26 77	1,000	EUR	0	500
DE000A2NB9R0	BERLIN, LAND LSA19/34A510	0,750	EUR	0	800
XS1140054526	BG ENERGY CAP.14/29 MTN	2,250	EUR	0	200
XS1015217703	BMW FIN. NV 14/24 MTN	2,625	EUR	0	200
XS2430965538	BNG BK 22/32 MTN	0,250	EUR	0	250
DE0001102564	BUNDANL.V.21/31	0,000	EUR	900	900
DE0001102580	BUNDANL.V.22/32	0,000	EUR	700	700
ES0840609038	CAIXABK 21/UND. FLR	3,625	EUR	0	200
ES0413307093	CAIXABK S.A. 15-25	1,000	EUR	0	500
FR0013393899	CREDIT AGRIC. 19/29 MTN	1,000	EUR	0	200
XS1112829947	DIAGEO FIN. 14/24 MTN	1,750	EUR	0	200
XS1934743656	DNB BOLIGKR. 19/26 MTN	0,625	EUR	0	400
XS1617898363	DT.TELEK.INTL F.17/26 MTN	1,125	EUR	300	300
XS1222590488	EDP FIN. 15/25 MTN	2,000	EUR	0	200
XS2283340060	EIB 21/31 MTN	0,000	EUR	0	1.300
XS0505157965	EIB EUR.INV.BK 10/30 MTN	4,000	EUR	0	800
XS1177459531	ENAGAS FINANC. 15/25	1,250	EUR	0	300
AT0000A2L583	ERSTE GR.BK. 20/UND. FLR	4,250	EUR	0	200
XS2181347183	ESTLAND 20/30	0,125	EUR	0	200
EU000A3KTGV8	EU 21/26 MTN	0,000	EUR	0	100
FI4000306758	FINLD 18-34	1,125	EUR	0	200
FI4000480488	FINNLAND 21/52	0,125	EUR	0	100
FR0013451507	FRANKREICH 19/29 O.A.T.	0,000	EUR	1.900	1.900
FR0013404969	FRANKREICH 19/50	1,500	EUR	0	1.400
FR0013516549	FRANKREICH 20/30 O.A.T.	0,000	EUR	800	800
FR0014003513	FRANKREICH 21/27 O.A.T.	0,000	EUR	1.500	1.500
FR0014004J31	FRANKREICH 21/53 O.A.T.	0,750	EUR	0	100
XS0906949523	GAZ CAP. 13/25 MTN	4,364	EUR	0	200
FR0011410281	GP.EMENT 13-23 MTN	3,650	EUR	0	300
XS1654229373	GRAND CITY PROP.17/26 MTN	1,375	EUR	0	200
XS2407955827	HENKEL 21/32 MTN	0,500	EUR	400	400
XS1485597329	HSBC HLDGS 16/24 MTN	0,875	EUR	0	300
FR0011577188	ICADE S.A. 13/23	3,375	EUR	0	200
XS2332687040	INF.WIREL.IT 21/31 MTN	1,750	EUR	0	100
XS2487056041	INST.CRD.OF. 22/26 MTN	1,300	EUR	450	450
IE00BJ38CR43	IRLAND 2030	2,400	EUR	0	500

ISIN	Wertpapier-Bezeichnung	Zins- satz	Whg.	Käufe / Zugänge Lots / Stück / Nominale	Verkäufe / Abgänge (Nom. in 1.000, ger.)
IE00BV8C9186	IRLAND 2045	2,000	EUR	0	100
XS2293755125	ISLAND 21/28 MTN	0,000	EUR	0	100
XS1023541847	ISRAEL 14/24 MTN	2,875	EUR	0	500
IT0005363111	ITALIEN 19/49	3,850	EUR	0	1.500
IT0005408502	ITALIEN 20/25	1,850	EUR	0	600
IT0005413171	ITALIEN 20/30	1,650	EUR	0	2.000
IT0005452989	ITALIEN 21/24	0,000	EUR	0	1.300
IT0005467482	ITALIEN 21/29	0,450	EUR	2.600	2.600
IT0005466013	ITALIEN 21/32	0,950	EUR	0	300
XS1063399536	LETTLAND 14/24 MTN	2,875	EUR	0	800
XS1517174626	LLOYDS BKG GRP 16/23 MTN	1,000	EUR	0	400
DE000A289RN6	M.B.INT.FIN. 20/25 MTN	2,625	EUR	300	300
XS0857662448	MCDONALDS CORP. 12/24 MTN	2,375	EUR	0	200
XS2289587789	MEXIKO 21/33	1,450	EUR	0	200
XS2363910436	MEXIKO 21/36	2,250	EUR	0	200
XS1207683522	NATIONWIDE BLDG 15/27 MTN	0,625	EUR	0	100
XS1191309720	NATL AUSTR. BK 15/27 MTN	0,875	EUR	0	500
NL0000102317	NEDERLD 98-28 1-3	5,500	EUR	0	400
XS2332589972	NEXI S.P.A. 21/26 REGS	1,625	EUR	0	100
NL0015614579	NIEDERLANDE 20/52	0,000	EUR	0	100
NL00150006U0	NIEDERLANDE 21/31	0,000	EUR	0	350
NL0015000B11	NIEDERLANDE 21/38	0,000	EUR	200	500
XS1204140971	NORDEA MORTG.B. 15/27 MTN	0,625	EUR	0	200
XS2411311579	NTT FIN. 21/25 MTN	0,082	EUR	300	300
AT0000A2EJ08	OESTERREICH 20/51 MTN	0,750	EUR	400	400
AT0000A2Y8G4	OESTERREICH 22/49 MTN	1,850	EUR	240	240
XS0834371469	OMV AG 12/27 MTN	3,500	EUR	0	200
XS2224439385	OMV AG 20/UND FLR	2,500	EUR	0	300
XS1069448220	ONTARIO PROV. 14/24 MTN	1,875	EUR	0	500
XS0951216166	ORACLE 13/25	3,125	EUR	0	300
XS1571341830	PARKER-HANNIFIN 17/25REGS	1,125	EUR	0	300
FR0012173862	PERNOD-RICARD 14/24	2,125	EUR	0	500
PTOTE5OE0007	PORTUGAL 06-37	4,100	EUR	0	300
PTOTEQOE0015	PORTUGAL 13-24	5,650	EUR	0	100
PTOTEROE0014	PORTUGAL 14-30	3,875	EUR	0	100
XS0953580981	QUEBEC PROV. 13/23 MTN	2,250	EUR	0	500
XS1079698376	RED ELECTR. F. 14/23 MTN	2,125	EUR	0	200
FR0012938116	REP. FSE 15-25 O.A.T.	1,000	EUR	0	400
FR0013257524	REP. FSE 17-48 O.A.T.	2,000	EUR	0	50
XS2258400162	RUMAENIEN 20/40 MTN REGS	2,625	EUR	0	50
FR0012146801	SANOFI 14/26 MTN	1,750	EUR	300	300
XS1141969912	SKY 14/23 MTN	1,875	EUR	0	500
SK4120012691	SLOWAKEI 17/37 MTN	1,875	EUR	0	200
SI0002103685	SLOWENIEN 17-27	1,250	EUR	0	1.000
XS1225626461	SMITHS GP. 15/23	1,250	EUR	0	200
ES0000012932	SPANIEN 05-37	4,200	EUR	0	400
ES00000124H4	SPANIEN 13-44	5,150	EUR	0	450
ES00000128H5	SPANIEN 16-26	1,300	EUR	0	1.400
ES00000128E2	SPANIEN 16-66	3,450	EUR	0	50
ES0000012E51	SPANIEN 19/29	1,450	EUR	0	1.700
ES0000012G00	SPANIEN 20/50	1,000	EUR	0	200
ES0000012K46	SPANIEN 22/52	1,900	EUR	100	100
XS1482554075	SPAREBK 1 BOLIG.16/26 MTN	0,250	EUR	0	500
XS1287779208	SSE PLC 15/23 MTN	1,750	EUR	0	500
XS1207005023	STATKRAFT 15/30 MTN	1,500	EUR	0	200
XS1846631049	TELECOM ITAL 18/26 MTN	2,875	EUR	0	100
XS2224632971	TOTALENERG. 20/UND. FLR	2,000	EUR	0	100
DE000HV2AYZ8	UC-HVB PF 2123	1,375	EUR	300	300
XS1972548231	VOLKSW.FIN.SERV.MTN.19/24	1,500	EUR	300	300
AT0000811252	AM. EUR.CORP.BD T		EUR	0	23.835
AT0000706734	AM.OE.SO.EO CO.BD		EUR	0	5.100
XS1069552393	HEATHR.FUND. 14/24MTN A27	1,875	EUR	0	200
FINANZTERMIN KONTRAKTE					
---	EURO BOBL FUT (FGBM) DEZ. 22		EUR	57	57
---	EURO BOBL FUT (FGBM) JUN. 22		EUR	77	77
---	EURO BOBL FUT (FGBM) MÄR. 22		EUR	74	0
---	EURO BOBL FUT (FGBM) SEP. 22		EUR	81	81
---	EURO BUND FUT (FGBL) DEZ. 22		EUR	44	44
---	EURO BUND FUT (FGBL) JUN. 22		EUR	50	50

ISIN	Wertpapier-Bezeichnung	Zins- satz	Whg.	Käufe / Zugänge Lots / Stück / Nominale	Verkäufe / Abgänge (Nom. in 1.000, ger.)
---	EURO BUND FUT (FGBL) MÄR. 22		EUR	0	15
---	EURO BUND FUT (FGBL) SEP. 22		EUR	44	44
---	EURO BUXL FUT (FGBX) DEZ. 22		EUR	6	6
---	EURO BUXL FUT (FGBX) JUN. 22		EUR	12	12
---	EURO BUXL FUT (FGBX) MÄR. 22		EUR	0	4
---	EURO BUXL FUT (FGBX) SEP. 22		EUR	9	9
---	EURO SCHATZ FUT (FGBS) DEZ. 22		EUR	62	62
---	EURO SCHATZ FUT (FGBS) JUN. 22		EUR	84	84
---	EURO SCHATZ FUT (FGBS) SEP. 22		EUR	83	83
---	LONG TERM EURO OAT FUT (FOAT) DEZ.22		EUR	6	6
---	LONG TERM EURO OAT FUT (FOAT) SEP.22		EUR	4	4
---	SHORT EURO-BTP FUT (FBTS) MÄR. 22		EUR	0	9
---	CROSS RATE EUR/USD FUT DEZ. 22		USD	20	20
---	ULTRA TEN-YEAR US TREAS.NOTE FUT (UXY) DEZ. 22		USD	18	18
---	ULTRA TEN-YEAR US TREAS.NOTE FUT (UXY) JUN. 22		USD	24	24
---	ULTRA TEN-YEAR US TREAS.NOTE FUT (UXY) MÄR. 22		USD	24	0
---	ULTRA TEN-YEAR US TREAS.NOTE FUT (UXY) SEP. 22		USD	22	22

Wien, am 24. Mai 2023

Amundi Austria GmbH

Franck Jochaud du Plessix

Christian Mathern

Hannes Roubik

Alois Steinböck

Bestätigungsvermerk

Prüfungsurteil

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

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

bestehend aus der Vermögensaufstellung zum 15. Februar 2023, der Ertragsrechnung für das an diesem Stichtag endende Rechnungsjahr und den sonstigen in Anlage I Schema B Investmentfondsgesetz 2011 (InvFG 2011) vorgesehenen Angaben, geprüft.

Nach unserer Beurteilung entspricht der Rechenschaftsbericht den gesetzlichen Vorschriften und vermittelt ein möglichst getreues Bild der Vermögens- und Finanzlage zum 15. Februar 2023 sowie der Ertragslage des Fonds für das an diesem Stichtag endende Rechnungsjahr in Übereinstimmung mit den österreichischen unternehmensrechtlichen Vorschriften und den Bestimmungen des InvFG 2011.

Grundlage für das Prüfungsurteil

Wir haben unsere Abschlussprüfung gemäß § 49 Abs 5 InvFG 2011 in Übereinstimmung mit den österreichischen Grundsätzen ordnungsmäßiger Abschlussprüfung durchgeführt. Diese Grundsätze erfordern die Anwendung der International Standards on Auditing (ISA). Unsere Verantwortlichkeiten nach diesen Vorschriften und Standards sind im Abschnitt "Verantwortlichkeiten des Abschlussprüfers für die Prüfung des Rechenschaftsberichts" unseres Bestätigungsvermerks weitergehend beschrieben. Wir sind von der Gesellschaft unabhängig in Übereinstimmung mit den österreichischen unternehmensrechtlichen und berufsrechtlichen Vorschriften und wir haben unsere sonstigen beruflichen Pflichten in Übereinstimmung mit diesen Anforderungen erfüllt. Wir sind der Auffassung, dass die von uns bis zum Datum des Bestätigungsvermerks erlangten Prüfungsnachweise ausreichend und geeignet sind, um als Grundlage für unser Prüfungsurteil zu diesem Datum zu dienen.

Sonstige Informationen

Die gesetzlichen Vertreter sind für die sonstigen Informationen verantwortlich. Die sonstigen Informationen umfassen alle Informationen im Rechenschaftsbericht, ausgenommen die Vermögensaufstellung, die Ertragsrechnung, die sonstigen in Anlage I Schema B InvFG 2011 vorgesehenen Angaben und den Bestätigungsvermerk.

Unser Prüfungsurteil zum Rechenschaftsbericht erstreckt sich nicht auf diese sonstigen Informationen und wir geben dazu keine Art der Zusicherung.

Im Zusammenhang mit unserer Prüfung des Rechenschaftsberichts haben wir die Verantwortlichkeit, diese sonstigen Informationen zu lesen und dabei zu würdigen, ob die sonstigen Informationen wesentliche Unstimmigkeiten zum Rechenschaftsbericht oder zu unseren bei der Abschlussprüfung erlangten Kenntnissen aufweisen oder anderweitig falsch dargestellt erscheinen.

Falls wir auf der Grundlage der von uns zu den vor dem Datum des Bestätigungsvermerks des Abschlussprüfers erlangten sonstigen Informationen durchgeführten Arbeiten den Schluss ziehen, dass eine wesentliche falsche Darstellung dieser sonstigen Informationen vorliegt, sind wir verpflichtet, über diese Tatsache zu berichten. Wir haben in diesem Zusammenhang nichts zu berichten.

Verantwortlichkeiten der gesetzlichen Vertreter und des Aufsichtsrats für den Rechenschaftsbericht

Die gesetzlichen Vertreter sind verantwortlich für die Aufstellung des Rechenschaftsberichts und dafür, dass dieser in Übereinstimmung mit den österreichischen unternehmensrechtlichen Vorschriften und den Bestimmungen des InvFG 2011 ein möglichst getreues Bild der Vermögens-, Finanz- und Ertragslage des Fonds vermittelt. Ferner sind die gesetzlichen Vertreter verantwortlich für die internen Kontrollen, die sie als notwendig erachten, um die Aufstellung eines Rechenschaftsberichts zu ermöglichen, der frei von wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern ist.

Der Aufsichtsrat ist verantwortlich für die Überwachung des Rechnungslegungsprozesses der Gesellschaft betreffend den von ihr verwalteten Fonds.

Verantwortlichkeiten des Abschlussprüfers für die Prüfung des Rechenschaftsberichts

Unsere Ziele sind, hinreichende Sicherheit darüber zu erlangen, ob der Rechenschaftsbericht als Ganzes frei von wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern ist und einen Bestätigungsvermerk zu erteilen, der unser Prüfungsurteil beinhaltet. Hinreichende Sicherheit ist ein hohes Maß an Sicherheit, aber keine Garantie dafür, dass eine in Übereinstimmung mit den österreichischen Grundsätzen ordnungsmäßiger Abschlussprüfung, die die Anwendung der ISA erfordern, durchgeführte Abschlussprüfung eine wesentliche falsche Darstellung, falls eine solche vorliegt, stets aufdeckt. Falsche Darstellungen können aus dolosen Handlungen oder Irrtümern resultieren und werden als wesentlich angesehen, wenn von ihnen einzeln oder insgesamt vernünftigerweise erwartet werden könnte, dass sie die auf der Grundlage dieses Rechenschaftsberichts getroffenen wirtschaftlichen Entscheidungen von Nutzern beeinflussen.

Als Teil einer Abschlussprüfung in Übereinstimmung mit den österreichischen Grundsätzen ordnungsmäßiger Abschlussprüfung, die die Anwendung der ISA erfordern, üben wir während der gesamten Abschlussprüfung pflichtgemäßes Ermessen aus und bewahren eine kritische Grundhaltung.

Darüber hinaus gilt:

- Wir identifizieren und beurteilen die Risiken wesentlicher falscher Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern im Rechenschaftsbericht, planen Prüfungshandlungen als Reaktion auf diese Risiken, führen sie durch und erlangen Prüfungsnachweise, die ausreichend und geeignet sind, um als Grundlage für unser Prüfungsurteil zu dienen. Das Risiko, dass aus dolosen Handlungen resultierende wesentliche falsche Darstellungen nicht aufgedeckt werden, ist höher als ein aus Irrtümern resultierendes, da dolose Handlungen kollusives Zusammenwirken, Fälschungen, beabsichtigte Unvollständigkeiten, irreführende Darstellungen oder das Außerkraftsetzen interner Kontrollen beinhalten können.
- Wir gewinnen ein Verständnis von dem für die Abschlussprüfung relevanten internen Kontrollsystem um Prüfungshandlungen zu planen, die unter den gegebenen Umständen angemessen sind, jedoch nicht mit dem Ziel, ein Prüfungsurteil zur Wirksamkeit des internen Kontrollsystems der Gesellschaft abzugeben.
- Wir beurteilen die Angemessenheit der von den gesetzlichen Vertretern angewandten Rechnungslegungsmethoden sowie die Vertretbarkeit der von den gesetzlichen Vertretern dargestellten geschätzten Werte in der Rechnungslegung und damit zusammenhängende Angaben.
- Wir beurteilen die Gesamtdarstellung, den Aufbau und den Inhalt des Rechenschaftsberichts einschließlich der Angaben sowie ob der Rechenschaftsbericht die zugrunde liegenden Geschäftsvorfälle und Ereignisse in einer Weise wiedergibt, dass ein möglichst getreues Bild erreicht wird.

Wir tauschen uns mit dem Aufsichtsrat unter anderem über den geplanten Umfang und die geplante zeitliche Einteilung der Abschlussprüfung sowie über bedeutsame Prüfungsfeststellungen, einschließlich etwaiger bedeutsamer Mängel im internen Kontrollsystem, die wir während unserer Abschlussprüfung erkennen, aus.

Wien, am 1. Juni 2023

Deloitte Audit Wirtschaftsprüfung GmbH

Mag. Robert Pejhovský
Wirtschaftsprüfer

Berechnung des Gesamtrisikos

Berechnungsmethode des Gesamtrisikos

Berechnungsmethode des Gesamtrisikos:		Relativer VaR-Ansatz
Verwendetes Referenzvermögen:		100% Bloomberg EURO Aggregate (E)
Betrachtungszeitraum:		16.02.2022 - 02.10.2022

Value at Risk:	Niedrigster Wert des Betrachtungszeitraums in %:	74,60
	Ø Wert des Betrachtungszeitraums in %:	88,91
	Höchster Wert des Betrachtungszeitraums in %:	95,99
	Verwendetes Modell:	Historische Simulation
	Konfidenzintervall in %:	99
	Halteperiode:	20 Geschäftstage
	Länge der Datenhistorie:	250 Geschäftstage

Höhe des Leverage in %: (für die Ermittlung des Leverage gilt eine Nominalwertbetrachtung)	32,03
---	-------

Berechnungsmethode des Gesamtrisikos:		Commitment-Ansatz
Verwendetes Referenzvermögen:		-
Betrachtungszeitraum:		03.10.2022 - 15.02.2023

Value at Risk:	Niedrigster Wert des Betrachtungszeitraums in %:	-
	Ø Wert des Betrachtungszeitraums in %:	-
	Höchster Wert des Betrachtungszeitraums in %:	-
	Verwendetes Modell:	-
	Konfidenzintervall in %:	-
	Halteperiode:	-
	Länge der Datenhistorie:	-

Höhe des Leverage in %: (für die Ermittlung des Leverage gilt eine Nominalwertbetrachtung)	-
---	---

Steuerliche Behandlung des Amundi Öko Sozial Net Zero Ambition Bond

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

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

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

Fondsbestimmungen

Fondsbestimmungen gemäß InvFG 2011

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

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

Artikel 1 Miteigentumsanteile

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

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

Artikel 2 Depotbank (Verwahrstelle)

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

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

Artikel 3 Veranlagungsinstrumente und -grundsätze

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

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

Beschreibung des Veranlagungsschwerpunktes

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

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

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

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

3.1. Wertpapiere

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

3.2. Geldmarktinstrumente

Geldmarktinstrumente dürfen **bis zu 49 vH** des Fondsvermögens erworben werden.

3.3. Wertpapiere und Geldmarktinstrumente

Der Erwerb nicht voll eingezahlter Wertpapiere oder Geldmarktinstrumente und von Bezugsrechten auf solche Instrumente oder von nicht voll eingezahlten anderen Finanzinstrumenten ist zulässig. Wertpapiere und Geldmarktinstrumente dürfen erworben werden, wenn sie den Kriterien betreffend die Notiz oder den Handel an einem geregelten Markt oder einer Wertpapierbörse gemäß InvFG entsprechen. Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die die im vorstehenden Absatz genannten Kriterien nicht erfüllen, dürfen insgesamt **bis zu 10 vH** des Fondsvermögens erworben werden.

3.4. Anteile an Investmentfonds

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

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

3.5. Derivative Instrumente

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

3.6. Risiko-Messmethode des Investmentfonds

Der Investmentfonds wendet folgende Risikomessmethode an:

Commitment Ansatz

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

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

3.7. Sichteinlagen oder kündbare Einlagen

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

Es ist kein Mindestbankguthaben zu halten.

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

3.8. Vorübergehend aufgenommene Kredite

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

3.9. Pensionsgeschäfte

Pensionsgeschäfte dürfen **bis zu 49 vH** des Fondsvermögens eingesetzt werden.

3.10. Wertpapierleihe

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

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

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

Artikel 4 Modalitäten der Ausgabe und Rücknahme

Die Berechnung des Anteilswertes erfolgt in EUR.

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

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

4.1. Ausgabe und Ausgabeaufschlag

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

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

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

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

4.2. Rücknahme und Rücknahmeabschlag

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

Artikel 5 Rechnungsjahr

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

Artikel 6 Anteilsgattungen und Ertragnisverwendung

Fur den Investmentfonds konnen sowohl Ausschuttungsanteilscheine und/oder Thesaurierungsanteilscheine mit KEST-Auszahlung als auch Thesaurierungsanteilscheine ohne KEST-Auszahlung und zwar jeweils uber ein Stuck oder Bruchteile davon ausgegeben werden.

Fur diesen Investmentfonds konnen verschiedene Gattungen von Anteilscheinen ausgegeben werden. Die Bildung der Anteilsgattungen sowie die Ausgabe von Anteilen einer Anteilsgattung liegen im Ermessen der Verwaltungsgesellschaft.

6.1. Ertragnisverwendung bei Ausschuttungsanteilscheinen (Ausschutter)

Die wahrend des Rechnungsjahres vereinnahmten Ertragnisse (Zinsen und Dividenden) konnen nach Deckung der Kosten nach dem Ermessen der Verwaltungsgesellschaft ausgeschuttet werden. Eine Ausschuttung kann unter Berucksichtigung der Interessen der Anteilinhaber unterbleiben. Ebenso steht die Ausschuttung von Ertragen aus der Verauerung von Vermogenswerten des Investmentfonds einschlielich von Bezugsrechten im Ermessen der Verwaltungsgesellschaft. Eine Ausschuttung aus der Fondssubstanz sowie Zwischenausschuttungen sind zulassig.

Das Fondsvermogen darf durch Ausschuttungen in keinem Fall das im Gesetz vorgesehene Mindestvolumen fur eine Kundigung unterschreiten.

Die Betrage sind an die Inhaber von Ausschuttungsanteilscheinen ab 15.04. des folgenden Rechnungsjahres auszuschutten, der Rest wird auf neue Rechnung vorgetragen.

Jedenfalls ist ab dem 15.04. der gema InvFG ermittelte Betrag auszus zahlen, der zutreffendenfalls zur Deckung einer auf den ausschuttungsgleichen Ertrag des Anteilscheines entfallenden Kapitalertragsteuerabfuhrpflicht zu verwenden ist, es sei denn, die Verwaltungsgesellschaft stellt durch Erbringung entsprechender Nachweise von den depotfuhrenden Stellen sicher, dass die Anteilscheine im Auszahlungszeitpunkt nur von Anteilinhabern gehalten werden konnen, die entweder nicht der inlandischen Einkommen- oder Korperschaftssteuer unterliegen oder bei denen die Voraussetzungen fur eine Befreiung gema § 94 des Einkommensteuergesetzes bzw. fur eine Befreiung von der Kapitalertragsteuer vorliegen.

6.2. Ertragnisverwendung bei Thesaurierungsanteilscheinen mit KEST-Auszahlung (Thesaurierer)

Die wahrend des Rechnungsjahres vereinnahmten Ertragnisse nach Deckung der Kosten werden nicht ausgeschuttet. Es ist bei Thesaurierungsanteilscheinen ab 15.04. der gema InvFG ermittelte Betrag auszus zahlen, der zutreffendenfalls zur Deckung einer auf den ausschuttungsgleichen Ertrag des Anteilscheines entfallenden Kapitalertragsteuerabfuhrpflicht zu verwenden ist, es sei denn, die Verwaltungsgesellschaft stellt durch Erbringung entsprechender Nachweise von den depotfuhrenden Stellen sicher, dass die Anteilscheine im Auszahlungszeitpunkt nur von Anteilinhabern gehalten werden konnen, die entweder nicht der inlandischen Einkommen- oder Korperschaftssteuer unterliegen oder bei denen die Voraussetzungen fur eine Befreiung gema § 94 des Einkommensteuergesetzes bzw. fur eine Befreiung von der Kapitalertragsteuer vorliegen.

6.3. Ertragnisverwendung bei Thesaurierungsanteilscheinen ohne KEST-Auszahlung (Vollthesaurierer)

Die wahrend des Rechnungsjahres vereinnahmten Ertragnisse nach Deckung der Kosten werden nicht ausgeschuttet. Es wird keine Auszahlung gema InvFG vorgenommen. Der fur das Unterbleiben der KEST-Auszahlung auf den Jahresertrag gema InvFG magebliche Zeitpunkt ist jeweils der 15.04. des folgenden Rechnungsjahres.

Die Verwaltungsgesellschaft stellt durch Erbringung entsprechender Nachweise von den depotfuhrenden Stellen sicher, dass die Anteilscheine im Auszahlungszeitpunkt nur von Anteilinhabern gehalten werden konnen, die entweder nicht der inlandischen Einkommen- oder Korperschaftssteuer unterliegen oder bei denen die Voraussetzungen fur eine Befreiung gema § 94 des Einkommensteuergesetzes bzw. fur eine Befreiung von der Kapitalertragsteuer vorliegen.

Werden diese Voraussetzungen zum Auszahlungszeitpunkt nicht erfullt, ist der gema InvFG ermittelte Betrag durch Gutschrift des jeweils depotfuhrenden Kreditinstituts auszus zahlen.

Artikel 7 Verwaltungsgebuhr, Ersatz von Aufwendungen, Abwicklungsgebuhr

Die Verwaltungsgesellschaft erhalt fur ihre Verwaltungstatigkeit eine **jahrliche** Vergutung bis zu einer Hohe von **0,72 vH** des Fondsvermogens, die auf Grund der Monatsendwerte errechnet wird.

Es liegt im Ermessen der Verwaltungsgesellschaft, eine Staffelung der Verwaltungsgebuhr vorzunehmen.

Die Verwaltungsgesellschaft hat Anspruch auf Ersatz aller durch die Verwaltung entstandenen Aufwendungen, wie insbesondere Kosten fur Pflichtveroffentlichungen, Depotgebuhren, Aufwendungen fur administrative Tatigkeiten gema § 5 Abs 2 Z 1 lit b) InvFG sowie Prufungs-, Beratungs- und Abschlusskosten.

Die Kosten bei Einfuhrung neuer Anteilsgattungen fur bestehende Sondervermogen werden zu Lasten der Anteilspreise der neuen Anteilsgattungen in Rechnung gestellt.

Bei Abwicklung des Investmentfonds erhalt die abwickelnde Stelle eine Vergutung von **bis zu 0,5 vH** des Fondsvermogens.

Nahere Angaben und Erlauterungen zu diesem Investmentfonds finden sich im Prospekt.

Mit Bescheid der Finanzmarktaufsichtsbehörde GZ FMA-IF-25 4801/0002-INV/2022 vom 21.07.2022 wurde die Genehmigung zur Änderung der Fondsbestimmungen erteilt. Die geänderten Fondsbestimmungen traten am 03.10.2022 in Kraft.

Anhang

Liste der Börsen mit amtlichem Handel und von organisierten Märkten

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

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

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

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

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

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

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

1.2.1. Luxemburg Euro MTF Luxemburg

1.3. Gemäß § 67 Abs. 2 Z 2 InvFG anerkannte Märkte im EWR:

Märkte im EWR, die von den jeweils zuständigen Aufsichtsbehörden als anerkannte Märkte eingestuft werden.

2. Börsen in europäischen Ländern außerhalb der Mitgliedstaaten des EWR

- 2.1. Bosnien Herzegowina: Sarajevo, Banja Luka
- 2.2. Montenegro: Podgorica
- 2.3. Russland: Moscow Exchange
- 2.4. Schweiz SIX Swiss Exchange AG, BX Swiss AG
- 2.5. Serbien: Belgrad
- 2.6. Türkei: Istanbul (betr. Stock Market nur "National Market")
- 2.7. Vereinigtes Königreich

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

3. Börsen in außereuropäischen Ländern

- 3.1. Australien: Sydney, Hobart, Melbourne, Perth
- 3.2. Argentinien: Buenos Aires
- 3.3. Brasilien: Rio de Janeiro, Sao Paulo
- 3.4. Chile: Santiago
- 3.5. China: Shanghai Stock Exchange, Shenzhen Stock Exchange
- 3.6. Hongkong: Hongkong Stock Exchange
- 3.7. Indien: Mumbai
- 3.8. Indonesien: Jakarta

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

- 3.9. Israel: Tel Aviv
- 3.10. Japan: Tokyo, Osaka, Nagoya, Fukuoka, Sapporo
- 3.11. Kanada: Toronto, Vancouver, Montreal
- 3.12. Kolumbien: Bolsa de Valores de Colombia
- 3.13. Korea: Korea Exchange (Seoul, Busan)
- 3.14. Malaysia: Kuala Lumpur, Bursa Malaysia Berhad
- 3.15. Mexiko: Mexiko City
- 3.16. Neuseeland: Wellington, Auckland
- 3.17. Peru: Bolsa de Valores de Lima
- 3.18. Philippinen: Philippine Stock Exchange
- 3.19. Singapur: Singapur Stock Exchange
- 3.20. Südafrika: Johannesburg
- 3.21. Taiwan: Taipei
- 3.22. Thailand: Bangkok
- 3.23. USA: New York, NYCE American, New York Stock Exchange (NYSE), Philadelphia, Chicago, Boston, Cincinnati, Nasdaq
- 3.24. Venezuela: Caracas
- 3.25. Vereinigte Arabische Emirate: Abu Dhabi Securities Exchange (ADX)

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

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

5. Börsen mit Futures und Options Märkten

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

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

Name des Produkts: Amundi Öko Sozial Net Zero Ambition Bond

Unternehmenskennung (LEI-Code): 5299007N3NCCWGRP53

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?



Ja



Nein



Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: _____



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



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



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



Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt Es 74,58% an nachhaltigen Investitionen



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



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



mit einem sozialen Ziel



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

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

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



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

Während des Geschäftsjahres förderte das Produkt kontinuierlich ökologische und/oder soziale Merkmale, indem es einen höheren ESG-Score anstrebte als der ESG-Score des Solactive Euro Corporate IG PAB Index“ (die ESG-Vergleichsbenchmark bzw. Referenzwert). Bei der Ermittlung des ESG-Scores des Anlageuniversums wurde die ESG-Performance kontinuierlich bewertet, indem die durchschnittliche Performance eines Wertpapiers mit der Branche des Wertpapieremittenten in Bezug auf jedes der drei Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale verglichen wurde. Der Fonds ist Träger des Österreichischen Umweltzeichens UZ49

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

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

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

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

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

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

Am Ende des Berichtszeitraums:

- beträgt das gewichtete durchschnittliche ESG-Score des Portfolios **1.031** (dies entspricht einem ESG Rating von **C+**)
- beträgt das gewichtete durchschnittliche ESG-Score des ESG-Anlageuniversum **0.835** (dies entspricht einem ESG Rating von **C**)

Das Amundi ESG-Rating, das zur Bestimmung des ESG-Scores verwendet wird, ist ein quantitativer ESG-Score, der in sieben Stufen von A (beste Punktzahl im Universum) bis G (schlechteste Punktzahl) übersetzt wird. In der Amundi ESG-Ratingskala entsprechen die Wertpapiere, die auf der Ausschlussliste stehen, einem G. Die ESG-Performance von Emittenten wird global und auf Ebene der relevanten Kriterien durch einen Vergleich mit der durchschnittlichen Performance ihrer Branche bewertet, und zwar durch die Kombination der drei ESG-Dimensionen:

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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



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

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

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

werden: einen Emittenten dazu zu bewegen, die Art und Weise, wie er die ökologische und soziale Dimension integriert, zu verbessern, einen Emittenten dazu zu bewegen, seine Auswirkungen auf Umwelt-, Sozial- und Menschenrechtsfragen oder andere Nachhaltigkeitsfragen, die für die Gesellschaft und die Weltwirtschaft von Bedeutung sind, zu verbessern.

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

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

Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
BAWAG 0 Dec23	Unternehmensanleihen	1,68%	AUSTRIA
ELTLX 4.125 Oct26 Call Sep26	Unternehmensanleihen	1,20%	SWEDEN
SANTAN 3.625 Sep26 Call Sep25	Unternehmensanleihen	0,90%	SPAIN
UCGIM 4.45 Feb29 Call Feb28	Unternehmensanleihen	0,79%	ITALY
RENAUL 4.875 Sep28 Call Jun28	Unternehmensanleihen	0,74%	FRANCE
CAFP 4.125 Oct28 Call Jul28	Unternehmensanleihen	0,74%	FRANCE
SUFP 3.5 Nov32 Call Aug32	Unternehmensanleihen	0,73%	FRANCE
NYKRE T2 5.5 Dec32 Call Sep27	Unternehmensanleihen	0,73%	DENMARK
ARVASL 4 Sep26 Call Jun26	Unternehmensanleihen	0,73%	FRANCE
ALDFP 4.25 Jan27	Unternehmensanleihen	0,72%	FRANCE
LPTY 1 May23	Unternehmensanleihen	0,72%	NETHERLANDS
DNBNO 3.125 Sep27 Call Sep26	Unternehmensanleihen	0,71%	NORWAY
SRBANK 3.75 Nov27	Unternehmensanleihen	0,71%	NORWAY
NYKRE 4 Jul28	Unternehmensanleihen	0,71%	DENMARK
IHGLN 2.125 May27 Call Feb27	Unternehmensanleihen	0,68%	UNITED KINGDOM



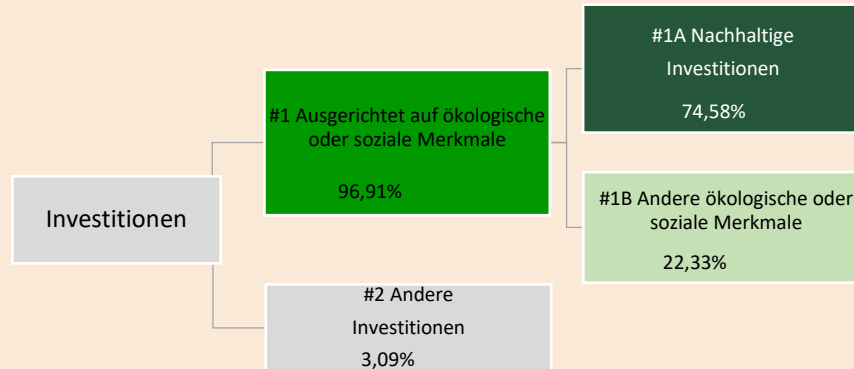
Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: **Von 16/02/2022 bis 15/02/2023**



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Wie sah die Vermögensallokation aus?

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



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

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

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

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

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Sektor	In % der Vermögenswerte
Anleihen	97,93%
Staatsnahe Anleihen	4,15%
Unternehmensanleihen	93,78%
Bargeld	2,07%

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:



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

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen.

- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

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

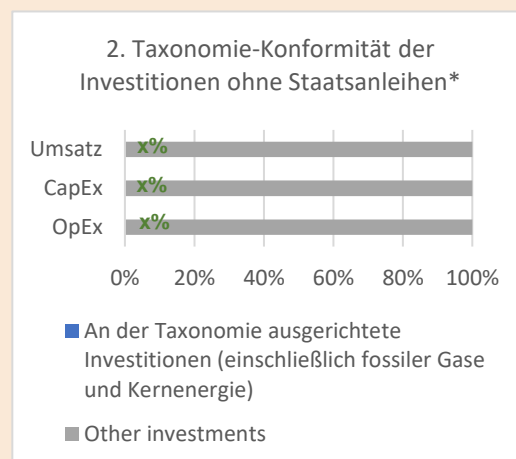
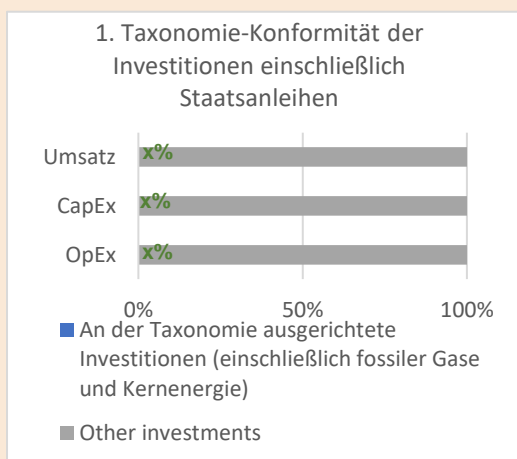
- **Wird mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie¹ investiert?**

Ja:
 In fossiles Gas
 In Kernenergie

Nein

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

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



Noch keine Daten verfügbar

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

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

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen


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

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

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

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

Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen..

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



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

Am Ende des Berichtszeitraums, beträgt der Anteil der nachhaltigen Investitionen mit nicht an der Taxonomie ausgerichteten Umweltzielen **70,50%**.

Dies ist darauf zurückzuführen, dass einige Emittenten zwar als nachhaltige Investitionen im Sinne der Offenlegungsverordnung gelten (können), aber einen Teil ihrer Aktivitäten nicht mit den EU-Taxonomiestandards in Einklang bringen oder für die noch keine Daten zur Verfügung stehen, um eine EU-Taxonomiebewertung durchzuführen.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

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



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

Unter "#2 Sonstige" wurden Barmittel und Instrumente zum Zwecke des Liquiditäts- und Portfoliorisikomanagements erfasst. Sie kann auch Wertpapiere ohne ESG-Rating enthalten, für die keine Daten für die Messung der Erreichung ökologischer oder sozialer Merkmale verfügbar waren.



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

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

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

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

Im Bezugszeitraum wurde bei allen Neukäufen darauf geachtet, die CO₂-Bilanz und der ESG-Score des Fonds im Vergleich zur ESG-Vergleichsbenchmark derart zu gestalten, dass diese zu diesen beworbenen Merkmalen passen. Insbesondere zu Jahresbeginn, wo sich die Indexkomposition dieser an die neuen Emissionsdaten anpasst hat.

Was das Österreichische Umweltzeichen wie auch den ESG-Score des Portfolios angeht, haben wir Wertpapiere von Emittenten, deren ESG-Score sich im Bezugszeitraum zu stark verschlechtert hat, veräußert.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

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

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

Der Referenzwert ist ein regelbasierter Index, der die Performance von auf Euro lautenden Investment-Grade-Unternehmensanleihen misst. Der Index bietet ein Engagement in einem Portfolio, das auf der ESG-Klimaanalyse von ISS basiert und mit einem 1,5°C-Szenario bis 2050 im Einklang steht. Damit ist der Referenzwert dauerhaft auf das vom Fonds beworbene CO₂-Reduktionsziel ausgerichtet

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

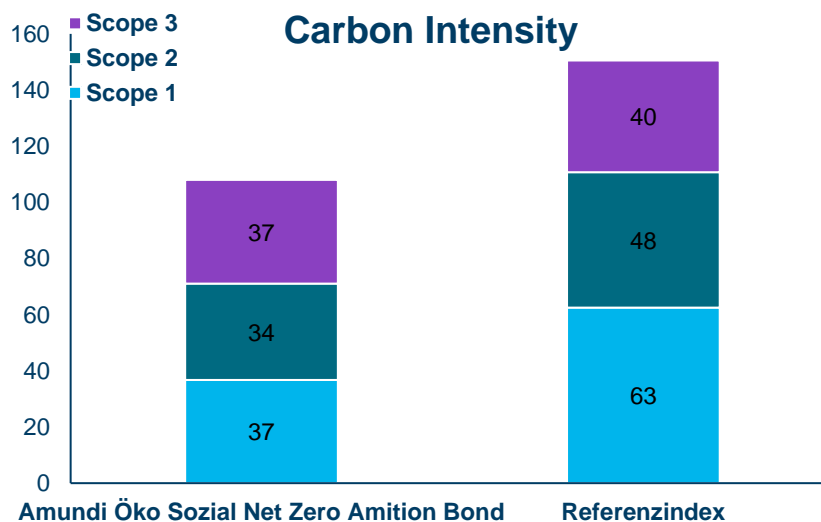
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**

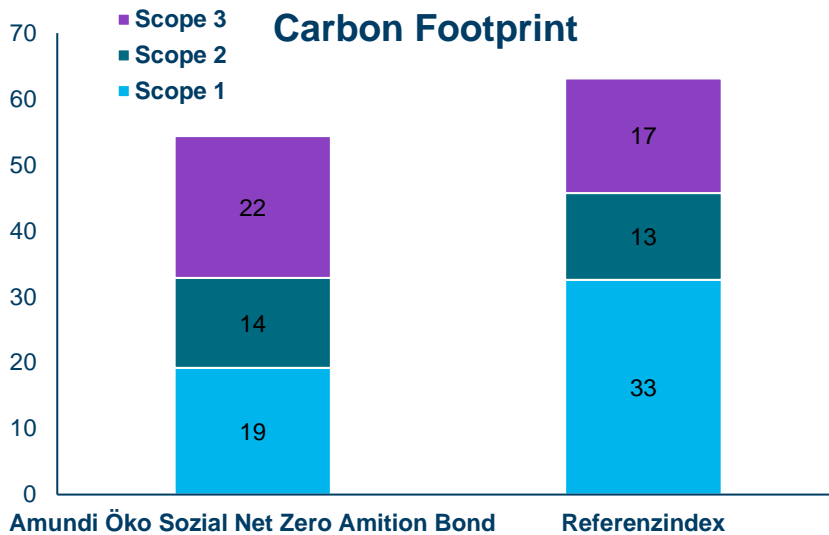
Dieser Fonds verfügt über einen spezifischen Index, der als Referenzmaßstab dient, um festzustellen, ob dieses Finanzprodukt mit den von ihm geförderten ökologischen Merkmalen in Einklang steht.

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

Für diesen Fonds wurde der Solactive Euro Corporate IG PAB Index als Referenzmaßstab definiert, um festzustellen, ob dieses Finanzprodukt mit den von ihm geförderten ökologischen Merkmalen in Einklang steht.

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

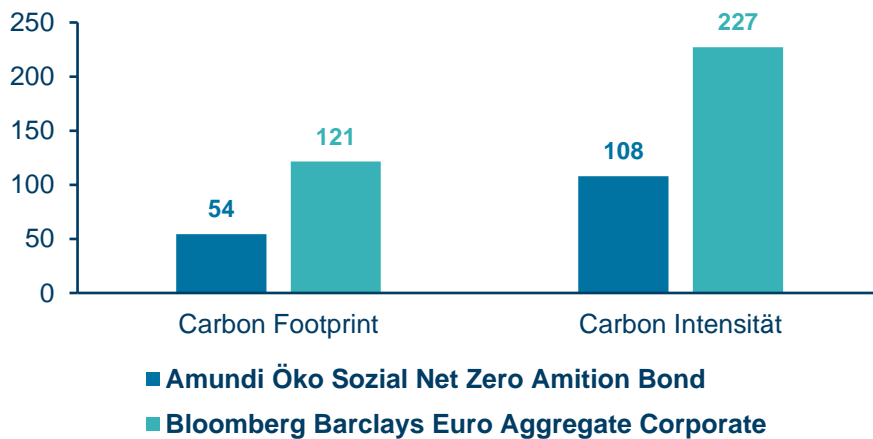




● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

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

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



	Amundi Öko Sozial Net Zero Amition Bond	Bloomberg Barclays Euro Aggregate Corporate
ESG Rating Gesamt	C+	C
Umwelt	B-	C+
Soziales	C	C-
Governance	C	D+

