

# KEPLER Short Invest Rentenfonds

## Halbjahresbericht

vom

1. August 2022 bis 31. Jänner 2023

**Verwaltungsgesellschaft:**

KEPLER-FONDS Kapitalanlagegesellschaft m.b.H.  
Europaplatz 1a  
4020 Linz  
Telefon: (0732) 6596-25314  
Telefax: (0732) 6596-25319  
www.kepler.at

**Depotbank / Verwahrstelle:**

Raiffeisenlandesbank Oberösterreich Aktiengesellschaft

**Fondsmanagement:**

KEPLER-FONDS Kapitalanlagegesellschaft m.b.H.

**Prüfer:**

KPMG Austria GmbH, Wirtschaftsprüfungs- und Steuerberatungsgesellschaft

**ISIN je Tranche:**

|                      |              |
|----------------------|--------------|
| Ausschüttungsanteil  | AT0000618723 |
| Thesaurierungsanteil | AT0000A044U8 |

## **Inhaltsübersicht**

|                                                      |    |
|------------------------------------------------------|----|
| Allgemeine Informationen zur Verwaltungsgesellschaft | 4  |
| Allgemeine Fondsdaten                                | 5  |
| Vermögensaufstellung                                 | 6  |
| Zusammensetzung des Fondsvermögens                   | 11 |

## Allgemeine Informationen zur Verwaltungsgesellschaft

### Gesellschafter:

Raiffeisenlandesbank Oberösterreich Aktiengesellschaft  
Oberösterreichische Landesbank Aktiengesellschaft  
Oberösterreichische Versicherung Aktiengesellschaft

### Staatskommissäre:

Mag. Gabriele Herbeck (bis 31.12.2022)  
MMag. Marco Rossegger

### Aufsichtsrat:

Mag. Christian Ratz (Vorsitzender)  
Mag. Klaus Kumpfmüller (Stv. Vorsitzender)  
Dr. Teodoro Cocca  
Mag. Serena Denkmair  
Gerhard Lauss  
Mag. Othmar Nagl

### Geschäftsführung:

Andreas Lassner-Klein  
Dr. Michael Bumberger

### Prokuristen:

Mag. Josef Bindeus  
Kurt Eichhorn  
Dietmar Felber  
Rudolf Gattringer  
Mag. Bernhard Hiebl  
Roland Himmelfreundpointner  
Mag. Uli Krämer  
Mag. Katharina Lang  
Renate Mittmannsgruber

Alle Daten und Informationen wurden mit größter Sorgfalt zusammengestellt und geprüft. Die verwendeten Quellen stufen wir als zuverlässig ein. Die verwendete Software rechnet mit einer größeren Genauigkeit als die angezeigten zwei Kommastellen. Durch weitere Berechnungen mit ausgewiesenen Ergebnissen können Abweichungen nicht ausgeschlossen werden.

Die Vervielfältigung von Informationen oder Daten, insbesondere die Verwendung von Texten, Textteilen oder Bildmaterial aus dieser Unterlage sowie die Einspielung und Verarbeitung dieser Daten in IT-Systeme bedarf der vorherigen ausdrücklichen Zustimmung der KEPLER-FONDS KAG.

## KEPLER Short Invest Rentenfonds

### Sehr geehrter Anteilinhaber!

Die KEPLER-FONDS Kapitalanlagegesellschaft m.b.H. erlaubt sich, den Halbjahresbericht des KEPLER Short Invest Rentenfonds - OGAW gem. §§ 2 iVm 50 InvFG 2011 - vom 1. August 2022 bis 31. Jänner 2023 vorzulegen.

#### Vergleich der Fondsdaten zum Berichtsstichtag gegenüber dem Beginn des Berichtszeitraums

| Fondsdetails                             | per 31.07.2022 | per 31.01.2023 |
|------------------------------------------|----------------|----------------|
|                                          | EUR            | EUR            |
| Fondsvermögen                            | 39.478.588,03  | 30.958.920,00  |
| errechneter Wert je Ausschüttungsanteil  | 9.480,94       | 9.488,70       |
| Ausgabepreis je Ausschüttungsanteil      | 9.480,94       | 9.488,70       |
| errechneter Wert je Thesaurierungsanteil | 10.961,48      | 10.970,45      |
| Ausgabepreis je Thesaurierungsanteil     | 10.961,48      | 10.970,45      |

#### Umlaufende KEPLER Short Invest Rentenfonds-Anteile zum Berichtsstichtag

|                                             |           |
|---------------------------------------------|-----------|
| <b>Ausschüttungsanteile per 31.07.2022</b>  | 1.377,130 |
| Ausgabe                                     | 8,000     |
| Rücknahmen                                  | -828,700  |
| <b>Ausschüttungsanteile per 31.01.2023</b>  | 556,430   |
| <b>Thesaurierungsanteile per 31.07.2022</b> | 2.410,449 |
| Ausgabe                                     | 94,445    |
| Rücknahmen                                  | -164,141  |
| <b>Thesaurierungsanteile per 31.01.2023</b> | 2.340,753 |

## Vermögensaufstellung zum 31.01.2023

| ISIN                                                                                    | BEZEICHNUNG                        | STÜCKE/<br>NOMINALE<br>IN TSD | KÄUFE<br>ZUGÄNGE | VERKÄUFE<br>ABGÄNGE | KURS   | KURSWERT<br>IN EUR | ANTEIL<br>IN % |
|-----------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------|-------------------------------|------------------|---------------------|--------|--------------------|----------------|
| <b>Wertpapiervermögen</b>                                                               |                                    |                               |                  |                     |        |                    |                |
| <b>Zum amtlichen Handel oder einem anderen geregelten Markt zugelassene Wertpapiere</b> |                                    |                               |                  |                     |        |                    |                |
| <b>Anleihen</b>                                                                         |                                    |                               |                  |                     |        |                    |                |
| <b>lautend auf EUR</b>                                                                  |                                    |                               |                  |                     |        |                    |                |
| XS2306220190                                                                            | 0,0000 % ALD 21/24 MTN             | 100                           |                  |                     | 95,92  | 95.924,00          | 0,31           |
| XS2375836470                                                                            | 0,0000 % BECTON,DICK 21/23         | 300                           |                  |                     | 98,34  | 295.029,00         | 0,95           |
| CH1120418079                                                                            | 0,0000 % BK.J.BAER CO 21/24        | 200                           |                  |                     | 94,67  | 189.338,00         | 0,61           |
| XS2264980363                                                                            | 0,0000 % CNH INDUST. 20/24 MTN     | 300                           |                  |                     | 96,13  | 288.381,00         | 0,93           |
| IT0001308607                                                                            | 0,0000 % DEXIA CREDI. 99-24        | 123                           | 123              |                     | 191,89 | 236.024,29         | 0,76           |
| XS2402064559                                                                            | 0,0000 % HITA.HC CAP. 21/24 MTN    | 200                           |                  |                     | 93,68  | 187.362,00         | 0,61           |
| XS0252835110                                                                            | 0,0000 % LEHMAN BROTH.06/11FLR MTN | 1.000                         |                  |                     | 0,37   | 3.660,00           | 0,01           |
| XS0300055547                                                                            | 0,0000 % LEHMAN BROTH.07/12FLR MTN | 300                           |                  |                     | 0,31   | 930,00             | 0,00           |
| XS2348030268                                                                            | 0,0000 % NOVO NO.F.NL 21/24        | 100                           |                  |                     | 95,86  | 95.857,00          | 0,31           |
| XS2374595127                                                                            | 0,0000 % VOLKSW.FIN.SERV.MTN.21/25 | 100                           |                  |                     | 93,22  | 93.217,00          | 0,30           |
| DE000A3MP4S3                                                                            | 0,0000 % VONOVIA SE MTN 21/23      | 300                           |                  |                     | 98,07  | 294.195,00         | 0,95           |
| FR0014006XE5                                                                            | 0,0100 % BFCM 21/25 MTN            | 200                           |                  |                     | 92,89  | 185.772,00         | 0,60           |
| XS2406549464                                                                            | 0,0100 % DANSKE BK 21/24 MTN       | 200                           |                  |                     | 97,04  | 194.076,00         | 0,63           |
| DE000CB0HRP1                                                                            | 0,0200 % COBA 20/23 S.964          | 200                           |                  |                     | 97,80  | 195.596,00         | 0,63           |
| XS2079723552                                                                            | 0,0500 % DNB BANK 19/23 MTN        | 200                           |                  | 200                 | 97,68  | 195.358,00         | 0,63           |
| XS2003420465                                                                            | 0,1250 % BK QUEENSLD 19/24 MTN     | 300                           |                  | 300                 | 95,68  | 287.028,00         | 0,93           |
| XS2398745849                                                                            | 0,1250 % BPP EU.HLDG. 21/23 MTN    | 330                           |                  |                     | 96,67  | 319.001,10         | 1,03           |
| XS2122377281                                                                            | 0,1250 % LAENSFOER.BK 20/25 MTN    | 200                           |                  |                     | 92,61  | 185.222,00         | 0,60           |
| XS1509009483                                                                            | 0,1250 % OBEROEST.LBK 16-23        | 400                           | 200              | 300                 | 97,75  | 391.000,00         | 1,26           |
| XS2117485248                                                                            | 0,1250 % SCANIA CV 20/23 MTN       | 200                           |                  |                     | 99,92  | 199.846,00         | 0,65           |
| DE000A3KNP88                                                                            | 0,1250 % TRATON FIN. 21/25 MTN     | 200                           |                  |                     | 92,51  | 185.020,00         | 0,60           |
| FR0013516051                                                                            | 0,2500 % ESSILORLUXO. 20/24 MTN    | 200                           |                  |                     | 97,51  | 195.026,00         | 0,63           |
| XS2397239000                                                                            | 0,2500 % HEIMSTADEN 21/24 MTN      | 300                           |                  |                     | 89,67  | 269.004,00         | 0,87           |
| AT0000A2R9G1                                                                            | 0,2500 % KOMM.AUS. 21/24 MTN       | 200                           |                  |                     | 94,23  | 188.454,00         | 0,61           |
| XS2176534282                                                                            | 0,2500 % SEB 20/23 MTN             | 225                           |                  |                     | 99,31  | 223.438,50         | 0,72           |
| XS2016070430                                                                            | 0,3000 % WESTPAC SEC.NZ 19/24 MTN  | 300                           |                  |                     | 95,91  | 287.721,00         | 0,93           |
| XS1991125896                                                                            | 0,3750 % CIBC 19/24 MTN            | 100                           |                  |                     | 96,32  | 96.322,00          | 0,31           |
| XS2193956716                                                                            | 0,3750 % HYPO NOE LB 20/24         | 100                           |                  |                     | 95,63  | 95.632,00          | 0,31           |
| DE000LB2CHW4                                                                            | 0,3750 % LBBW MTN 19/24            | 200                           |                  |                     | 96,11  | 192.216,00         | 0,62           |
| XS1960678099                                                                            | 0,3750 % MEDTR.GLB HD 19/23        | 100                           |                  |                     | 99,81  | 99.809,00          | 0,32           |
| XS2346591113                                                                            | 0,3750 % VIRGIN MONEY 21/24 FLRMTN | 200                           |                  |                     | 98,53  | 197.056,00         | 0,64           |
| XS1935204641                                                                            | 0,5000 % ANZ N.Z.INTL 19/24MTN     | 200                           | 200              |                     | 97,29  | 194.588,00         | 0,63           |
| XS1717012014                                                                            | 0,5000 % BNZ INTERNAT.FDG 17/23MTN | 300                           |                  |                     | 99,39  | 298.176,00         | 0,96           |
| XS2259867039                                                                            | 0,5000 % ISLANDSBANKI 20/23 MTN    | 300                           |                  |                     | 97,27  | 291.804,00         | 0,94           |
| XS2121467497                                                                            | 0,5000 % LANDSBANKINN 20/24 MTN    | 200                           | 200              |                     | 93,11  | 186.222,00         | 0,60           |
| XS1774629346                                                                            | 0,6250 % A.N.Z. BKG GRP 18/23 MTN  | 100                           |                  | 300                 | 99,91  | 99.905,00          | 0,32           |
| XS2262798494                                                                            | 0,6250 % ARION BANK 20/24 MTN      | 200                           |                  |                     | 94,97  | 189.946,00         | 0,61           |
| XS1456422135                                                                            | 0,6250 % JPMORGAN CHASE 16/24 MTN  | 300                           |                  |                     | 97,70  | 293.088,00         | 0,95           |
| XS1599125157                                                                            | 0,6250 % NATIONWIDE BLDG 17/23 MTN | 100                           |                  | 400                 | 99,57  | 99.569,00          | 0,32           |
| XS1857683335                                                                            | 0,6250 % TORONTO-DOM. BK 18/23 MTN | 300                           |                  |                     | 99,01  | 297.015,00         | 0,96           |
| XS2231267829                                                                            | 0,6250 % YORKSH.BLDG 20/25 MTN     | 200                           |                  |                     | 91,62  | 183.240,00         | 0,59           |
| XS1424730973                                                                            | 0,7500 % DANSKE BK 16/23 MTN       | 100                           |                  | 200                 | 99,32  | 99.322,00          | 0,32           |
| DE000A2LQ9Q6                                                                            | 0,7500 % DT.PFBR.BANK MTN.35304    | 300                           |                  |                     | 99,98  | 299.937,00         | 0,97           |
| XS1843436574                                                                            | 0,7500 % FID.NATL INF 19/23        | 300                           |                  |                     | 99,38  | 298.131,00         | 0,96           |
| XS1864037541                                                                            | 0,7500 % NATL GRID NA 18/23 MTN    | 200                           |                  | 200                 | 98,81  | 197.616,00         | 0,64           |
| XS1720806774                                                                            | 0,7500 % RLBK OBEROEST. 17/23 MTN  | 300                           |                  |                     | 99,26  | 297.765,00         | 0,96           |
| XS2265801238                                                                            | 0,7920 % LUMINOR BANK 20/24 MTN    | 250                           |                  |                     | 95,77  | 239.422,50         | 0,77           |
| XS1883354620                                                                            | 0,8750 % ABB.IRE.FIN. 18/23        | 300                           |                  |                     | 98,65  | 295.935,00         | 0,96           |
| XS1935139995                                                                            | 0,8750 % ABN AMRO BK 19/24 MTN     | 200                           |                  |                     | 97,99  | 195.974,00         | 0,63           |
| XS1685798370                                                                            | 0,8750 % AHOLD DELHA. 17/24        | 200                           |                  |                     | 96,27  | 192.536,00         | 0,62           |
| XS1807409450                                                                            | 0,8750 % HYPO NOE L.F.N.W. 18/23   | 300                           |                  |                     | 98,31  | 294.924,00         | 0,95           |
| XS1842961440                                                                            | 0,8750 % NORDEA BK 18/23 MTN       | 100                           |                  |                     | 99,28  | 99.280,00          | 0,32           |
| XS2444424639                                                                            | 1,0000 % GM FINANCIAL 22/25 MTN    | 100                           |                  |                     | 94,84  | 94.842,00          | 0,31           |
| XS1403264374                                                                            | 1,0000 % MCDONALDS CORP. 16/23 MTN | 200                           |                  |                     | 98,50  | 197.000,00         | 0,64           |
| XS1946004451                                                                            | 1,0690 % TELEFON.EMI. 19/24 MTN    | 200                           |                  |                     | 97,97  | 195.940,00         | 0,63           |
| XS1584122177                                                                            | 1,1250 % ESSITY 17/24 MTN          | 300                           |                  |                     | 97,42  | 292.245,00         | 0,94           |
| XS1809240515                                                                            | 1,1250 % NIBC BANK 18/23 MTN       | 300                           |                  | 300                 | 99,63  | 298.890,00         | 0,97           |
| XS1837997979                                                                            | 1,1250 % NM PLC 18/23 MTN          | 200                           |                  |                     | 99,43  | 198.854,00         | 0,64           |
| XS1907150350                                                                            | 1,1250 % TELE2 AB 18/24 MTN        | 100                           |                  |                     | 96,72  | 96.716,00          | 0,31           |
| XS1391085740                                                                            | 1,2500 % CK HUTCH.FIN.(16) 16/23   | 400                           |                  |                     | 99,66  | 398.644,00         | 1,29           |

|              |                                    |     |     |        |            |      |
|--------------|------------------------------------|-----|-----|--------|------------|------|
| XS1433231377 | 1,2500 % DZ BANK MTN.16/23         | 100 |     | 99,32  | 99.322,00  | 0,32 |
| XS1379122101 | 1,5000 % AMERICA MOVIL 16/24       | 300 |     | 97,81  | 293.442,00 | 0,95 |
| XS1910851242 | 1,5000 % GRENKE FIN. 18/23 MTN     | 400 |     | 99,01  | 396.056,00 | 1,28 |
| XS1146282634 | 1,6250 % VERIZON COMM 14/24        | 300 |     | 98,16  | 294.480,00 | 0,95 |
| XS1115208107 | 1,8750 % MORGAN STANLEY 14/23 MTN  | 200 |     | 99,89  | 199.780,00 | 0,65 |
| XS2135797202 | 1,8760 % BP CAP.MKTS 20/24 MTN     | 300 |     | 98,44  | 295.305,00 | 0,95 |
| AT0000325568 | 1,9420 % RLB STEIERM. 03-43 4      | 300 |     | 85,04  | 255.120,00 | 0,82 |
| AT000B112552 | 2,0000 % OBERBK 13-23 MTN          | 600 |     | 99,85  | 599.118,00 | 1,95 |
| XS2407911705 | 2,0030 % TH.FISHER SC 21/23 FLR    | 300 |     | 99,85  | 299.550,00 | 0,97 |
| XS1767087940 | 2,1040 % ACEA S.P.A. 18/23 MTN FLR | 200 |     | 100,00 | 199.998,00 | 0,65 |
| XS2480543102 | 2,1250 % CS AG 22/24 MTN           | 190 |     | 96,65  | 183.629,30 | 0,59 |
| XS1432392170 | 2,1250 % STORA ENSO 16/23 MTN      | 200 |     | 99,74  | 199.470,00 | 0,64 |
| SK4000018578 | 2,1930 % SLOVENSK.SPO 21/27 FLR    | 600 |     | 104,11 | 624.636,00 | 2,03 |
| XS1939356645 | 2,2000 % GM FINANCIAL 19/24 MTN    | 300 |     | 98,75  | 296.247,00 | 0,96 |
| XS0925599556 | 2,2500 % WELLS FARGO 13/23 MTN     | 300 |     | 99,89  | 299.679,00 | 0,97 |
| XS0232189331 | 2,2620 % NORDIC INV.BK 05/25MTN    | 250 |     | 100,36 | 250.900,00 | 0,81 |
| AT0000A1U9K9 | 2,3000 % ERSTE GP BNK 17-27 FLR    | 200 |     | 89,43  | 178.850,00 | 0,58 |
| XS0134061893 | 2,3220 % UNICR.BK AUS. 01/33FLRMTN | 200 |     | 90,87  | 181.730,00 | 0,59 |
| XS1280111961 | 2,3680 % CS AG 15/25 FLR MTN       | 100 |     | 94,99  | 94.988,00  | 0,31 |
| XS1823532996 | 2,4410 % BNP PARIBAS 18/23 FLR MTN | 300 |     | 100,15 | 300.435,00 | 0,97 |
| XS0183122398 | 2,4520 % BARCL. BK 03/23 FLR MTN   | 200 |     | 97,77  | 195.532,00 | 0,63 |
| BE0002840214 | 2,4670 % KBC GROEP 22/25 FLR REGS  | 200 |     | 99,98  | 199.952,00 | 0,65 |
| FI4000513577 | 2,5020 % OMA SAASTOP. 21/25 FLR    | 300 |     | 97,56  | 292.665,00 | 0,95 |
| XS1828132735 | 2,5040 % MITSUB. UFJ FIN.GRP 18/23 | 300 |     | 100,11 | 300.342,00 | 0,97 |
| XS2407916761 | 2,5120 % VOLVO TREAS. 21/23 FLRMTN | 300 |     | 100,30 | 300.906,00 | 0,97 |
| IT0005244774 | 2,5130 % CASSA D.PR. 17-23 FLR MTN | 300 |     | 99,98  | 299.928,00 | 0,97 |
| XS2576245364 | 2,5340 % SAINT-GOBAIN 23/24 FLR    | 100 | 100 | 100,08 | 100.082,00 | 0,32 |
| XS1717591884 | 2,5520 % BCO SANTANDER 17/24FLRMTN | 300 |     | 100,17 | 300.495,00 | 0,97 |
| XS1795253134 | 2,5630 % CITIGROUP 18/23 FLR MTN   | 100 | 200 | 100,02 | 100.015,00 | 0,32 |
| FR0013322146 | 2,5700 % RCI BANQUE 18/25 FLR MTN  | 400 |     | 98,04  | 392.152,00 | 1,27 |
| XS1787278008 | 2,5750 % CREDIT AGR. 18/23FLRMTN   | 100 |     | 100,03 | 100.025,00 | 0,32 |
| DE000A2GSCY9 | 2,5820 % M.B.INT.FIN. MTN 17/24    | 400 |     | 100,21 | 400.844,00 | 1,29 |
| BE6301509012 | 2,5880 % AB INBEV 18/24 FLR MTN    | 100 |     | 100,11 | 100.113,00 | 0,32 |
| FR0013323672 | 2,6020 % BPCE S.A. 18/23 FLR MTN   | 100 |     | 100,03 | 100.028,00 | 0,32 |
| XS1616341829 | 2,6210 % STE GENERALE 17/24FLR MTN | 200 |     | 100,68 | 201.354,00 | 0,65 |
| FR0013446580 | 2,6400 % CARREFOUR B. 19/23 FLRMTN | 100 |     | 100,11 | 100.107,00 | 0,32 |
| DE000A3K5G19 | 2,6450 % TRATON FIN. 22/24 FLR MTN | 300 |     | 99,80  | 299.388,00 | 0,97 |
| XS2353018141 | 2,6520 % BALDER FINLA 21/23 FLRMTN | 300 |     | 99,10  | 297.306,00 | 0,96 |
| DE000A162AY8 | 2,6640 % LBB IS.S.548 VAR          | 200 |     | 100,13 | 200.257,00 | 0,65 |
| XS1729872736 | 2,6840 % FORD MOTOR CRED.17/24 FLR | 200 |     | 97,49  | 194.978,00 | 0,63 |
| XS1801906279 | 2,7540 % MIZUHO FINL GRP 18/23 FLR | 100 | 200 | 100,06 | 100.060,00 | 0,32 |
| XS2342059784 | 2,7980 % BARCLAYS 21/26 FLRMTN     | 300 |     | 98,51  | 295.536,00 | 0,95 |
| XS2305049897 | 2,8210 % TOYOTA M.FIN 21/24 FLRMTN | 300 |     | 100,73 | 302.199,00 | 0,98 |
| XS1907118464 | 2,8220 % AT + T 2023 FLR           | 200 |     | 100,39 | 200.782,00 | 0,65 |
| XS1633845158 | 2,8430 % LLOYDS BKG GRP 17/24 MTN  | 300 | 300 | 100,59 | 301.782,00 | 0,97 |
| XS2485554088 | 2,8480 % NATWEST MKTS 22/25 FLRMTN | 180 |     | 100,35 | 180.626,40 | 0,58 |
| XS1882544205 | 2,8970 % ING GROEP 18/23 MTN FLR   | 200 |     | 100,39 | 200.772,00 | 0,65 |
| XS0136314415 | 2,9580 % UNICR.BK AUS. 01/31MTNFLR | 200 |     | 92,56  | 185.124,00 | 0,60 |
| XS2384578824 | 2,9770 % BBVA 21/23 FLR MTN        | 200 |     | 100,50 | 201.000,00 | 0,65 |
| XS2381633150 | 2,9840 % CS AG 21/23 FLR MTN       | 100 |     | 99,80  | 99.803,00  | 0,32 |
| XS2322254165 | 3,0620 % GOLDM.S.GRP 21/26 FLR MTN | 300 |     | 99,65  | 298.959,00 | 0,97 |
| XS2387929834 | 3,0810 % BK AMERICA 21/26 FLR MTN  | 200 |     | 99,15  | 198.308,00 | 0,64 |
| XS2389353181 | 3,1020 % GOLDM.S.GRP 21/27 FLR MTN | 200 |     | 98,63  | 197.264,00 | 0,64 |
| XS2388490802 | 3,1410 % HSBC HLDGS 21/26 FLR MTN  | 300 |     | 99,45  | 298.353,00 | 0,96 |
| XS2293577354 | 3,1480 % BCO SANTAND. 21/26FLR MTN | 300 |     | 99,22  | 297.660,00 | 0,96 |
| XS1811433983 | 3,1490 % BANK AMERI. 18/24 FLR MTN | 200 |     | 100,05 | 200.108,00 | 0,65 |
| XS2400358474 | 3,2420 % MACQUARIE BK 21/23FLR MTN | 100 |     | 100,41 | 100.410,00 | 0,32 |
| XS2287753987 | 3,3340 % OP YRITYSPA. 21/24 FLR    | 200 |     | 100,73 | 201.468,00 | 0,65 |
| XS1910947941 | 3,3410 % VOLKSWAGEN INTL 18/24 FLR | 100 |     | 101,40 | 101.400,00 | 0,33 |
| DE000DDA0Y53 | 3,3930 % DZ BANK IS.A1345VAR       | 300 |     | 101,38 | 304.131,00 | 0,98 |
| XS2555192710 | 3,7500 % SWEDBANK 22/25 MTN        | 300 | 300 | 100,50 | 301.488,00 | 0,97 |
| XS1992938347 | 3,8370 % ALPHA BK.RO. 19/24 FLRMTN | 500 |     | 100,51 | 502.555,00 | 1,62 |
| AT000B007950 | 4,1250 % ERSTE GP BNK 13-23 FLRMTN | 300 |     | 100,21 | 300.642,00 | 0,97 |
| XS2554487905 | 4,1250 % VW INTL.FIN 22/25 MTN     | 200 | 200 | 101,06 | 202.120,00 | 0,65 |
| XS1824425265 | 4,2980 % PET. MEX. 18/23 FLR MTN   | 400 |     | 99,91  | 399.648,00 | 1,29 |
| XS2499691330 | 5,5000 % OTP BNK 22/25 FLRMTN      | 140 |     | 100,03 | 140.037,80 | 0,45 |
| XS0997355036 | 5,8750 % RAIF.LABA NO 13/23 MTN    | 300 |     | 100,91 | 302.742,00 | 0,98 |
| DE000A0B1K12 | 6,0000 % DT.PFBR.BANK 05/25 VAR    | 200 | 200 | 103,78 | 207.560,00 | 0,67 |
| XS0981632804 | 6,0000 % RAIF.BK INTL 13/23 MTN    | 300 |     | 101,59 | 304.764,00 | 0,98 |
| XS2577033553 | 7,1250 % RAIFFEISENBK 23/26FLR MTN | 100 | 100 | 101,47 | 101.466,00 | 0,33 |

## Strukturierte Produkte

## lautend auf EUR

|              |                                 |     |  |       |            |      |
|--------------|---------------------------------|-----|--|-------|------------|------|
| XS0218189925 | 0,0000 % DEXIA CL 05/25 FLR MTN | 200 |  | 94,87 | 189.745,33 | 0,61 |
|--------------|---------------------------------|-----|--|-------|------------|------|

|              |                                    |     |  |       |            |      |
|--------------|------------------------------------|-----|--|-------|------------|------|
| XS0224713254 | 1,0000 % AUSTRIA 05/25 FLR MTN     | 200 |  | 96,97 | 193.930,00 | 0,63 |
| IT0006592981 | 1,9450 % EUR. BK REC.DEV. 05-25FLR | 130 |  | 99,49 | 129.337,00 | 0,42 |

**Nicht zum amtlichen Handel oder einem anderen geregelten Markt zugelassene Wertpapiere**

**Anleihen**

**lautend auf EUR**

|              |                                    |     |     |       |            |      |
|--------------|------------------------------------|-----|-----|-------|------------|------|
| XS0205185456 | 0,0000 % LEHMAN BROTH.04/09FLR MTN | 700 |     | 0,43  | 3.038,00   | 0,01 |
| XS1132135747 | 2,8750 % CESKE DRAHY 14/24         | 200 | 200 | 97,20 | 194.404,00 | 0,63 |

**Summe Wertpapiervermögen** **30.138.468,22** **97,35**

**Bankguthaben/Verbindlichkeiten**

|     |  |  |  |  |            |      |
|-----|--|--|--|--|------------|------|
| EUR |  |  |  |  | 547.053,74 | 1,77 |
|-----|--|--|--|--|------------|------|

**Summe Bankguthaben / Verbindlichkeiten** **547.053,74** **1,77**

**Sonstiges Vermögen**

|                                                   |  |  |  |  |            |      |
|---------------------------------------------------|--|--|--|--|------------|------|
| Ausstehende Zahlungen                             |  |  |  |  | 103.365,63 | 0,33 |
| Diverse Gebühren                                  |  |  |  |  | -1.030,10  | 0,00 |
| Zinsansprüche                                     |  |  |  |  | 169.875,83 | 0,55 |
| Zinsen Anlagekonten (inkl. negativer Habenzinsen) |  |  |  |  | 1.186,68   | 0,00 |

**Summe sonstiges Vermögen** **273.398,04** **0,88**

**Fondsvermögen** **30.958.920,00** **100,00**

Die Vermögensgegenstände des Sondervermögens sind auf der Grundlage von Kursen bzw. Marktsätzen per 30. Jännerr 2023 oder letztbekannte bewertet.

### **Regeln für die Vermögensbewertung**

Der Wert eines Anteiles ergibt sich aus der Teilung des Gesamtwertes des Investmentfonds einschließlich der Erträge durch die Zahl der ausgegebenen Anteile. Bei Investmentfonds mit mehreren Anteilscheingattungen ergibt sich der Wert eines Anteiles einer Anteilscheingattung aus der Teilung des Wertes einer Anteilscheingattung einschließlich der Erträge durch die Zahl der ausgegebenen Anteile dieser Anteilscheingattung.

Der Gesamtwert des Investmentfonds ist aufgrund der jeweiligen Kurswerte der im Investmentfonds befindlichen Wertpapiere, Geldmarktinstrumente, Anteile an Investmentfonds und Bezugsrechte zuzüglich des Wertes der zum Investmentfonds gehörenden Finanzanlagen, Geldbeträge, Guthaben, Forderungen und sonstigen Rechte abzüglich Verbindlichkeiten, zu ermitteln.

Die Kurswerte der Vermögenswerte werden wie folgt ermittelt:

- a) Der Wert von Vermögenswerten, welche an einer Börse oder an einem anderen geregelten Markt notiert oder gehandelt werden, wird grundsätzlich auf der Grundlage des letzten verfügbaren Kurses ermittelt.
- b) Sofern ein Vermögenswert nicht an einer Börse oder an einem anderen geregelten Markt notiert oder gehandelt wird oder sofern für einen Vermögenswert, welcher an einer Börse oder an einem anderen geregelten Markt notiert oder gehandelt wird, der Kurs den tatsächlichen Marktwert nicht angemessen widerspiegelt, wird auf die Kurse zuverlässiger Datenprovider oder alternativ auf Marktpreise gleichartiger Wertpapiere oder andere anerkannte Bewertungsmethoden zurückgegriffen.
- c) Anteile an einem OGAW, OGA oder AIF werden mit den zuletzt verfügbaren Rücknahmepreisen bewertet bzw. sofern deren Anteile an Börsen oder geregelten Märkten gehandelt werden (z.B. ETFs) mit den jeweils zuletzt verfügbaren Schlusskursen.
- d) Der Liquidationswert von Futures und Optionen, die an einer Börse oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden, wird auf der Grundlage des letzten verfügbaren Abwicklungspreises berechnet.

Zur Preisberechnung des Investmentfonds werden grundsätzlich die jeweils letzten veröffentlichten bzw. verfügbaren Kurse der vom Investmentfonds erworbenen Vermögenswerte herangezogen. Entspricht der letzte veröffentlichte Kurs aufgrund der politischen oder wirtschaftlichen Situation ganz offensichtlich und nicht nur im Einzelfall nicht den tatsächlichen Werten, so kann eine Preisberechnung für den Investmentfonds unterbleiben, wenn dieser 5 % oder mehr seines Fondsvermögens in Vermögenswerte investiert hat, die keine bzw. keine marktkonformen Kurse aufweisen.

### **Angaben zu Wertpapierfinanzierungsgeschäften gem. VO (EU) 2015/2365**

In den Fondsbestimmungen des Investmentfonds werden Angaben zu unter diese Verordnung fallende Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (Pensionsgeschäfte und Wertpapierleihgeschäfte) gemacht, sodass grundsätzlich die Möglichkeit besteht, derartige Geschäfte für den Investmentfonds zu tätigen.

Die derzeitige Strategie des Investmentfonds sieht jedoch weder die Durchführung von Pensions- oder Wertpapierleihegeschäften noch den Abschluss von Total Return Swaps (Gesamtrenditeswaps) oder vergleichbaren Derivatgeschäften vor.

Im Berichtszeitraum wurden keine Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Gesamtrendite-Swaps im Sinne der Verordnung (EU) 2015/2365 durchgeführt daher erfolgen keine Angaben gem. Art 13 iVm Abschnitt A des Anhangs zu VO (EU) 2015/2365.

## Während des Berichtszeitraumes getätigte Käufe und Verkäufe, soweit sie nicht in der Vermögensaufstellung angeführt sind

| ISIN | BEZEICHNUNG | KÄUFE                  | VERKÄUFE               |
|------|-------------|------------------------|------------------------|
|      |             | ZUGÄNGE                | ABGÄNGE                |
|      |             | STÜCKE/NOMINALE IN TSD | STÜCKE/NOMINALE IN TSD |

### Wertpapiervermögen

#### Zum amtlichen Handel oder einem anderen geregelten Markt zugelassene Wertpapiere

##### Anleihen

##### lautend auf EUR

|              |                                    |     |     |
|--------------|------------------------------------|-----|-----|
| XS2102355588 | 0,0000 % BMW FIN. 20/23 MTN        |     | 200 |
| XS1692846790 | 0,0940 % JOHN DEERE BK17/22 MTNFLR |     | 100 |
| XS2170609403 | 0,1250 % GLAXOSM.CAP. MTN 20/23MTN |     | 200 |
| XS0158194562 | 0,2190 % EL. FRANCE 02/22 FLR MTN  | 100 | 200 |
| DK0009525917 | 0,2500 % NYKREDIT 19/23 MTN        |     | 300 |
| XS1573958409 | 0,3000 % SWEDBANK 17/22 MTN        |     | 200 |
| XS1681855539 | 0,3240 % HSBC HLDGS 17/23 FLR MTN  |     | 200 |
| XS1957532887 | 0,3500 % AM.HONDA FI. 19/22 MTN    |     | 100 |
| XS1944456018 | 0,3750 % IBM 19/23                 |     | 300 |
| XS1685589027 | 0,6250 % HYPO VORARLG BK 17/22 MTN |     | 200 |
| XS1810806635 | 0,6250 % UBS AG LDN 18/23 MTN      |     | 300 |
| XS1584041252 | 0,6720 % BNP PARIBAS 17/22 FLR MTN |     | 100 |
| BE6298043272 | 0,7500 % BELFIUS BK 17/22 MTN      |     | 100 |
| XS1693260702 | 0,7500 % LEASEPLAN 17/22 MTN       |     | 200 |
| XS1828028677 | 0,9700 % DT.TELEK.INTL F.18/22 MTN |     | 100 |
| BE0002281500 | 1,0030 % KBC GROEP 17/22 MTN FLR   |     | 100 |
| XS1876097715 | 1,0580 % MBANK 18/22               |     | 200 |
| XS1664644710 | 1,1250 % B.A.T. CAP. 17/23 MTN     |     | 300 |
| XS2226795321 | 1,1250 % CNAC FIN. HK 20/24        |     | 200 |
| XS1333139746 | 1,1250 % SVENSK.HDLBS. 15/22 MTN   |     | 100 |
| XS1767930826 | 1,2030 % FORD MOTOR CRED.18/22 FLR |     | 400 |
| XS1726323436 | 1,2200 % JYSKE BK 17/22 MTN FLR    |     | 300 |
| DE000A2E4ZJ8 | 1,4200 % DT.PFBR.BANK MTN.35288VAR |     | 300 |
| XS1843449809 | 1,4910 % TAKEDA PHARMA.18/22 REGS  |     | 100 |
| XS1310493744 | 1,5000 % JPMORGAN CHASE 15/22 MTN  |     | 100 |
| DE000A19X793 | 1,5500 % VONOVIA FINANCE 18/22 FLR |     | 300 |
| XS1725734872 | 1,6250 % HUARONG UNI.I.H. 17/22    |     | 200 |
| FR0013309606 | 1,7490 % RCI BANQUE 18/23 FLR MTN  |     | 200 |
| XS1756434194 | 1,7880 % BNP PARIBAS 18/23 FLR MTN |     | 100 |
| XS1317305198 | 1,8750 % CARNIVAL 15/22            |     | 200 |
| XS0825855751 | 2,2500 % FORTUM OYJ 12/22 MTN      |     | 100 |
| DE000DB5DCS4 | 2,3750 % DT.BANK MTN 13/23         |     | 200 |
| XS0863484035 | 2,3750 % HETA ASS.RES. 12/22       |     | 500 |
| XS1564443759 | 2,4720 % IBERDROLA FIN. 17/24 FLR  |     | 300 |
| XS1788584321 | 2,5770 % BBVA 18/23 FLR MTN        |     | 300 |
| XS2240469523 | 2,7840 % BMW FINANCE 20/23 FLR MTN |     | 200 |
| DE000TLX2003 | 3,1250 % TALANX AG NTS 13/23       |     | 300 |

## Zusammensetzung des Fondsvermögens per 31.01.2023

| Wertpapiervermögen                                                                            | EUR                  | %             |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------|---------------|
| <b>Zum amtlichen Handel oder einem anderen geregelten Markt zugelassene Wertpapiere</b>       |                      |               |
| Anleihen                                                                                      | 29.428.013,89        | 95,05         |
| Strukturierte Produkte                                                                        | 513.012,33           | 1,66          |
| <b>Nicht zum amtlichen Handel oder einem anderen geregelten Markt zugelassene Wertpapiere</b> |                      |               |
| Anleihen                                                                                      | 197.442,00           | 0,64          |
| <b>Summe Wertpapiervermögen</b>                                                               | <b>30.138.468,22</b> | <b>97,35</b>  |
| <b>Bankguthaben/Verbindlichkeiten</b>                                                         |                      |               |
| <b>Summe Bankguthaben/Verbindlichkeiten</b>                                                   | <b>547.053,74</b>    | <b>1,77</b>   |
| <b>Sonstiges Vermögen</b>                                                                     |                      |               |
| <b>Summe Sonstiges Vermögen</b>                                                               | <b>273.398,04</b>    | <b>0,88</b>   |
| <b>FOND S V E R M Ö G E N</b>                                                                 | <b>30.958.920,00</b> | <b>100,00</b> |

KEPLER-FONDS Kapitalanlagegesellschaft m.b.H.

Andreas Lassner-Klein

Dr. Michael Bumberger