

# KEPLER High Grade Corporate Rentenfonds

## Halbjahresbericht

vom

1. September 2023 bis 29. Februar 2024

**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        | AT0000653688 |
| Thesaurierungsanteil       | AT0000653696 |
| Thesaurierungsanteil IT    | AT0000A1CTE6 |
| Thesaurierungsanteil IT VV | AT0000A2AX87 |

## **Inhaltsübersicht**

|                                                      |    |
|------------------------------------------------------|----|
| Allgemeine Informationen zur Verwaltungsgesellschaft | 4  |
| Allgemeine Fondsdaten                                | 5  |
| Vermögensaufstellung                                 | 6  |
| Zusammensetzung des Fondsvermögens                   | 16 |

## Allgemeine Informationen zur Verwaltungsgesellschaft

### Gesellschafter:

Raiffeisenlandesbank Oberösterreich Aktiengesellschaft  
Oberösterreichische Landesbank Aktiengesellschaft  
Oberösterreichische Versicherung Aktiengesellschaft

### Staatskommissäre:

Mag. Kristina Fuchs (bis 29.02.2024)  
Mag. Hans-Jürgen Gaugl (ab 01.03.2024)  
MMag. Marco Rossegger

### Aufsichtsrat:

Mag. Christian Ratz (Vorsitzender)  
Mag. Klaus Kumpfmüller (Stv. Vorsitzender)  
Dr. Teodoro Cocca  
Mag. Serena Denkmaier  
Gerhard Lauss  
Mag. Thomas Pointner

### Geschäftsführung:

Andreas Lassner-Klein  
Dr. Michael Bumberger

### Prokuristen:

Mag. Josef Bindeus  
Kurt Eichhorn  
Dietmar Felber  
Rudolf Gattringer (bis 30.11.2023)  
Mag. Bernhard Hiebl  
Roland Himmelfreundpointner  
Mag. Uli Krämer  
Mag. Katharina Lang  
Renate Mittmannsgruber  
Dr. David Striegl

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 High Grade Corporate Rentenfonds

### Sehr geehrter Anteilinhaber!

Die KEPLER-FONDS Kapitalanlagegesellschaft m.b.H. erlaubt sich, den Halbjahresbericht des KEPLER High Grade Corporate Rentenfonds - OGAW gem. §§ 2 iVm 50 InvFG 2011 - vom 1. September 2023 bis 29. Februar 2024 vorzulegen.

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

| Fondsdetails                                   | per 31.08.2023 | per 29.02.2024 |
|------------------------------------------------|----------------|----------------|
|                                                | EUR            | EUR            |
| Fondsvermögen                                  | 158.662.671,58 | 149.895.367,37 |
| errechneter Wert je Ausschüttungsanteil        | 93,56          | 96,73          |
| Ausgabepreis je Ausschüttungsanteil            | 95,89          | 99,14          |
| errechneter Wert je Thesaurierungsanteil IT    | 141,10         | 147,61         |
| Ausgabepreis je Thesaurierungsanteil IT        | 144,62         | 151,30         |
| errechneter Wert je Thesaurierungsanteil IT VV | 141,31         | 147,85         |
| Ausgabepreis je Thesaurierungsanteil IT VV     | 144,84         | 151,54         |
| errechneter Wert je Thesaurierungsanteil       | 138,92         | 145,16         |
| Ausgabepreis je Thesaurierungsanteil           | 142,39         | 148,78         |

#### Umlaufende KEPLER High Grade Corporate Rentenfonds-Anteile zum Berichtsstichtag

|                                                   |              |
|---------------------------------------------------|--------------|
| <b>Ausschüttungsanteile per 31.08.2023</b>        | 524.419,572  |
| Ausgabe                                           | 16.081,499   |
| Rücknahmen                                        | -24.059,000  |
| <b>Ausschüttungsanteile per 29.02.2024</b>        | 516.442,071  |
| <b>Thesaurierungsanteile IT per 31.08.2023</b>    | 591.817,000  |
| Ausgabe                                           | 6.322,000    |
| Rücknahmen                                        | -102.372,000 |
| <b>Thesaurierungsanteile IT per 29.02.2024</b>    | 495.767,000  |
| <b>Thesaurierungsanteile IT VV per 31.08.2023</b> | 42.007,321   |
| Ausgabe                                           | 936,722      |
| Rücknahmen                                        | -8.507,574   |
| <b>Thesaurierungsanteile IT VV per 29.02.2024</b> | 34.436,469   |
| <b>Thesaurierungsanteile per 31.08.2023</b>       | 145.034,065  |
| Ausgabe                                           | 16.549,641   |
| Rücknahmen                                        | -12.322,812  |
| <b>Thesaurierungsanteile per 29.02.2024</b>       | 149.260,894  |

## Vermögensaufstellung zum 29.02.2024

| ISIN                                                                             | BEZEICHNUNG                        | STÜCKE/<br>NOMINALE<br>IN TSD | KÄUFE<br>ZUGÄNGE | VERKÄUFE<br>ABGÄNGE | KURS   | KURSWERT<br>IN EUR | ANTEIL<br>IN % |
|----------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------|-------------------------------|------------------|---------------------|--------|--------------------|----------------|
| Wertpapiervermögen                                                               |                                    |                               |                  |                     |        |                    |                |
| Zum amtlichen Handel oder einem anderen geregelten Markt zugelassene Wertpapiere |                                    |                               |                  |                     |        |                    |                |
| Anleihen                                                                         |                                    |                               |                  |                     |        |                    |                |
| lautend auf EUR                                                                  |                                    |                               |                  |                     |        |                    |                |
| XS2273810510                                                                     | 0,0000 % AROUNDTOWN 20/26 MTN      | 500                           |                  |                     | 86,17  | 430.845,00         | 0,29           |
| XS2408033210                                                                     | 0,0000 % GAZ FINANCE 21/28MTN REGS | 600                           |                  |                     | 52,50  | 315.000,00         | 0,21           |
| XS2383886947                                                                     | 0,0000 % LANXESS AG 21/27 MTN      | 600                           |                  |                     | 87,23  | 523.356,00         | 0,35           |
| XS2263684776                                                                     | 0,0000 % NESTLE F.I. 20/33 MTN     | 600                           |                  |                     | 75,27  | 451.644,00         | 0,30           |
| XS2400997131                                                                     | 0,0000 % TOYOTA M.FIN 21/25 MTN    | 500                           | 170              |                     | 94,48  | 472.405,00         | 0,32           |
| DE000A2YNQ58                                                                     | 0,0000 % WIRECARD AG 19/24REG.S    | 300                           |                  |                     | 15,72  | 47.166,00          | 0,03           |
| XS2259776230                                                                     | 0,0100 % BAWAG P.S.K. 20/35 MTN    | 1.000                         |                  |                     | 67,72  | 677.200,00         | 0,45           |
| XS2375836553                                                                     | 0,0340 % BECTON.DICK 21/25         | 180                           |                  |                     | 94,84  | 170.708,40         | 0,11           |
| XS2391348740                                                                     | 0,0500 % ARION BANK 21/26 MTN      | 300                           |                  |                     | 91,18  | 273.549,00         | 0,18           |
| XS2345317510                                                                     | 0,0500 % SVENSKA HDBK 21/28 MTN    | 500                           |                  |                     | 86,25  | 431.225,00         | 0,29           |
| DE000A3H2ZX9                                                                     | 0,1000 % DT.PFBR.BANK MTN.35384    | 400                           |                  |                     | 86,71  | 346.824,00         | 0,23           |
| FR0013444544                                                                     | 0,1250 % DASSAULT SYS 19/26        | 300                           |                  |                     | 92,38  | 277.134,00         | 0,18           |
| BE6322991462                                                                     | 0,1250 % EUROCLEAR BK 20/25 MTN    | 300                           |                  | 200                 | 95,46  | 286.374,00         | 0,19           |
| FR0013482833                                                                     | 0,1250 % LVMH 20/28 MTN            | 200                           |                  |                     | 89,35  | 178.692,00         | 0,12           |
| XS2102916793                                                                     | 0,1250 % MERCK FINL S MTN 20/25    | 200                           |                  | 200                 | 95,60  | 191.202,00         | 0,13           |
| XS2287624584                                                                     | 0,1250 % MOTABILITY 21/28 MTN      | 400                           |                  |                     | 86,28  | 345.108,00         | 0,23           |
| FR00140022B3                                                                     | 0,1250 % STE GENERALE 21/28 MTN    | 400                           |                  |                     | 87,39  | 349.564,00         | 0,23           |
| XS2257961818                                                                     | 0,1250 % UPM KYMMENE 20/28 MTN     | 580                           |                  |                     | 85,73  | 497.251,40         | 0,33           |
| XS2374595044                                                                     | 0,1250 % VOLKSW.FIN.SERV.MTN.21/27 | 800                           |                  |                     | 90,42  | 723.352,00         | 0,48           |
| XS2298304499                                                                     | 0,2000 % BCO SANTAND. 21/28 MTN    | 400                           |                  | 400                 | 87,43  | 349.732,00         | 0,23           |
| FR0013453040                                                                     | 0,2500 % ALSTOM 19/26              | 200                           |                  |                     | 91,32  | 182.636,00         | 0,12           |
| XS2381560411                                                                     | 0,2500 % ASB BANK 21/28 MTN        | 600                           |                  |                     | 85,78  | 514.674,00         | 0,34           |
| FR0014001168                                                                     | 0,2500 % BFCM 21/28 MTN            | 400                           |                  | 400                 | 85,75  | 342.988,00         | 0,23           |
| XS2381362966                                                                     | 0,2500 % BK NOVA SCOT 21/28 MTN    | 500                           |                  |                     | 86,34  | 431.710,00         | 0,29           |
| XS2345982362                                                                     | 0,2500 % CS AG 21/26 MTN           | 500                           |                  |                     | 93,71  | 468.545,00         | 0,31           |
| XS2265990452                                                                     | 0,2500 % HERA 20/30 MTN            | 300                           |                  | 300                 | 79,68  | 239.037,00         | 0,16           |
| AT0000A2R9G1                                                                     | 0,2500 % KOMM.AUS. 21/24 MTN       | 200                           |                  |                     | 99,14  | 198.282,00         | 0,13           |
| XS2384734542                                                                     | 0,2500 % NIBC BANK 21/26 MTN       | 500                           |                  |                     | 91,24  | 456.190,00         | 0,30           |
| XS2117452156                                                                     | 0,2500 % TELENOR 20/28 MTN         | 150                           |                  |                     | 88,43  | 132.640,50         | 0,09           |
| DE000A3MP4U9                                                                     | 0,2500 % VONOVIA SE MTN 21/28      | 600                           |                  |                     | 84,70  | 508.170,00         | 0,34           |
| XS2363117321                                                                     | 0,3000 % AM.HONDA FI. 21/28 MTN    | 400                           |                  |                     | 87,38  | 349.512,00         | 0,23           |
| XS2405875480                                                                     | 0,3000 % COLGATE-PALM 21/29        | 400                           |                  |                     | 85,77  | 343.068,00         | 0,23           |
| XS2305026929                                                                     | 0,3420 % NTT FINANCE 21/30 REGS    | 350                           |                  |                     | 83,81  | 293.321,00         | 0,20           |
| XS2404213485                                                                     | 0,3500 % PROCTER+GAMB 21/30        | 600                           |                  |                     | 84,72  | 508.302,00         | 0,34           |
| XS2347663507                                                                     | 0,3750 % ASTRAZENECA 21/29 MTN     | 600                           |                  |                     | 86,28  | 517.704,00         | 0,35           |
| PTCGDCOM0037                                                                     | 0,3750 % CAIXA GERAL 21/27 FLR MTN | 500                           |                  |                     | 92,12  | 460.595,00         | 0,31           |
| XS2191509038                                                                     | 0,3750 % CARLSB.BREW. 20/27 MTN    | 400                           |                  |                     | 90,39  | 361.556,00         | 0,24           |
| XS2416413339                                                                     | 0,3750 % CO. RABOBANK 21/27 FLRMTN | 200                           |                  |                     | 91,54  | 183.080,00         | 0,12           |
| XS2432567555                                                                     | 0,3750 % DNB BANK 22/28 FLR MTN    | 300                           |                  |                     | 91,27  | 273.804,00         | 0,18           |
| XS2250024010                                                                     | 0,3750 % INVESTOR 20/35 MTN        | 170                           |                  |                     | 70,68  | 120.162,80         | 0,08           |
| XS2306621934                                                                     | 0,3750 % LANDSBANKINN 21/25 MTN    | 300                           |                  |                     | 94,62  | 283.851,00         | 0,19           |
| FR0014005OK3                                                                     | 0,3750 % LEGRAND 21/31             | 400                           |                  |                     | 81,82  | 327.276,00         | 0,22           |
| XS2055627538                                                                     | 0,3750 % RAIF.BK INTL 19/26 MTN    | 200                           |                  | 200                 | 91,50  | 182.998,00         | 0,12           |
| XS2411720233                                                                     | 0,3750 % SANDVIK 21/28 MTN         | 600                           |                  |                     | 86,69  | 520.146,00         | 0,35           |
| XS2363982344                                                                     | 0,3750 % SPBK 1 SR-BK 21/27 FLRMTN | 300                           |                  | 300                 | 91,63  | 274.890,00         | 0,18           |
| XS2352405216                                                                     | 0,3750 % TRANSM.FIN. 21/28 MTN     | 180                           |                  |                     | 85,81  | 154.458,00         | 0,10           |
| XS2411311652                                                                     | 0,3990 % NTT FINANCE 21/28 MTN     | 200                           | 200              |                     | 87,07  | 174.136,00         | 0,12           |
| XS0620233097                                                                     | 0,4000 % UNICREDIT 11/26 MTN       | 150                           |                  |                     | 167,55 | 251.319,00         | 0,17           |
| XS2358736051                                                                     | 0,4190 % ST.GR.O.I. 21/28 MTN      | 600                           |                  |                     | 86,16  | 516.978,00         | 0,34           |
| XS2343340852                                                                     | 0,5000 % AIB GROUP 21/27 FLR MTN   | 500                           |                  |                     | 91,46  | 457.285,00         | 0,31           |
| AT0000A2RK00                                                                     | 0,5000 % BAUSP.WUEST. 21/26 MTN    | 400                           |                  |                     | 90,60  | 362.400,00         | 0,24           |
| FR0014007LL3                                                                     | 0,5000 % BPCE 22/28 FLR MTN        | 300                           |                  |                     | 90,72  | 272.160,00         | 0,18           |
| XS2051494222                                                                     | 0,5000 % BRIT.TELECOM 19/25 MTN    | 170                           |                  |                     | 95,13  | 161.727,80         | 0,11           |
| XS2122485845                                                                     | 0,5000 % DOW CHEMICAL 20/27        | 500                           |                  |                     | 91,23  | 456.140,00         | 0,30           |
| XS2296207116                                                                     | 0,5000 % INVESTEC BK 21/27 FLR MTN | 380                           |                  |                     | 92,21  | 350.405,60         | 0,23           |
| XS2346225878                                                                     | 0,5000 % MET.LIFE F.I 21/29        | 200                           |                  |                     | 86,09  | 172.178,00         | 0,11           |
| XS2384697830                                                                     | 0,5000 % PUBLIC STOR. 21/30        | 600                           |                  |                     | 81,55  | 489.300,00         | 0,33           |
| XS2441296923                                                                     | 0,5000 % SANTANDER CB 22/25 MTN    | 200                           |                  |                     | 95,26  | 190.514,00         | 0,13           |
| XS2360041474                                                                     | 0,5000 % SEGRO CAPITA 21/31        | 160                           |                  |                     | 77,17  | 123.473,60         | 0,08           |
| XS2405390043                                                                     | 0,5000 % SYDBANK 21/26 FLR MTN     | 300                           |                  |                     | 93,90  | 281.700,00         | 0,19           |

|              |                                    |     |     |       |            |      |
|--------------|------------------------------------|-----|-----|-------|------------|------|
| SK4000018925 | 0,5000 % TATRA BANKA 21/28 FLR MTN | 500 |     | 86,97 | 434.825,00 | 0,29 |
| XS2292547317 | 0,5790 % 2I RETE GAS 21/31 MTN     | 240 |     | 80,70 | 193.682,40 | 0,13 |
| XS2385791046 | 0,6030 % SANTA.UK GRP 21/29 FLR    | 380 |     | 85,48 | 324.824,00 | 0,22 |
| XS2224621420 | 0,6250 % ADIDAS AG ANL 20/35       | 300 |     | 74,26 | 222.780,00 | 0,15 |
| XS2070192591 | 0,6250 % BOSTON SCIEN 19/27        | 300 |     | 90,16 | 270.492,00 | 0,18 |
| XS2320438653 | 0,6250 % CADENT FIN. 21/30 MTN     | 300 |     | 83,05 | 249.135,00 | 0,17 |
| XS2280835260 | 0,6250 % DIG.INTR.HO. 21/31 REGS   | 380 |     | 77,58 | 294.788,80 | 0,20 |
| XS2270142966 | 0,6250 % DT. BAHN FIN. 20/50 MTN   | 510 |     | 52,32 | 266.832,00 | 0,18 |
| BE0002831122 | 0,6250 % FLUVIUS SYS. 21/31 MTN    | 300 |     | 80,01 | 240.033,00 | 0,16 |
| XS2084497705 | 0,6250 % FRESE.MED.CARE MTN 19/26  | 400 | 400 | 91,69 | 366.776,00 | 0,24 |
| XS2078696866 | 0,6250 % GRENKE FIN. 19/25 MTN     | 370 |     | 96,69 | 357.745,60 | 0,24 |
| XS2385390724 | 0,6250 % HIME 21/28                | 450 |     | 86,96 | 391.297,50 | 0,26 |
| DE000A3H3GF4 | 0,6250 % HOWOGE MTN 21/28          | 200 |     | 87,39 | 174.772,00 | 0,12 |
| FR00140011M0 | 0,6250 % ICADE S.A. 21/31          | 300 |     | 77,58 | 232.734,00 | 0,16 |
| XS2270406452 | 0,6250 % MOLNLYCKE HL 20/31 MTN    | 250 |     | 79,41 | 198.535,00 | 0,13 |
| XS2343459074 | 0,6250 % NORDEA BANK 21/31 FLR MTN | 310 |     | 91,57 | 283.851,50 | 0,19 |
| XS2384274366 | 0,6500 % GM FINANCIAL 21/28 MTN    | 750 | 150 | 86,79 | 650.940,00 | 0,43 |
| DE000AAR0322 | 0,7500 % AAREAL BANK MTN 22/28     | 200 | 200 | 80,54 | 161.076,00 | 0,11 |
| XS2315784715 | 0,7500 % APA INFRAST. 21/29 MTN    | 450 |     | 85,64 | 385.362,00 | 0,26 |
| XS2440690456 | 0,7500 % ATLAS C.FIN. 22/32 MTN    | 220 |     | 82,05 | 180.516,60 | 0,12 |
| AT0000A2RZL4 | 0,7500 % ERSTE+STE.BK 21/28        | 600 |     | 87,77 | 526.632,00 | 0,35 |
| XS2389353264 | 0,7500 % GOLDM.S.GRP 21/32 MTN     | 100 | 260 | 78,82 | 78.816,00  | 0,05 |
| ES0239140025 | 0,7500 % INMOBIL.COL. 21/29 MTN    | 100 |     | 85,84 | 85.840,00  | 0,06 |
| XS1495373505 | 0,7500 % KONINKLIJKE DSM 16/26 MTN | 300 | 400 | 93,86 | 281.574,00 | 0,19 |
| AT0000A28HX3 | 0,7500 % OBERBANK 19/26 MTN        | 400 |     | 91,57 | 366.272,00 | 0,24 |
| XS2322253944 | 0,7500 % OP YRITYSPA. 21/31 MTN    | 440 |     | 83,69 | 368.253,60 | 0,25 |
| XS2198580271 | 0,7500 % WOLTERS KLUW 20/30        | 800 |     | 85,33 | 682.640,00 | 0,46 |
| XS1623404412 | 0,8500 % U.S. BANCORP 2024 MTN     | 500 |     | 99,01 | 495.030,00 | 0,33 |
| XS2346207892 | 0,8750 % AMERIC.TOWER 21/29        | 600 |     | 86,30 | 517.806,00 | 0,35 |
| XS2430998893 | 0,8750 % BBVA 22/29 FLR MTN        | 200 | 200 | 89,91 | 179.822,00 | 0,12 |
| FR0014007LK5 | 0,8750 % BNP PARIBAS 22/30 FLR MTN | 600 |     | 85,30 | 511.806,00 | 0,34 |
| BE6325493268 | 0,8750 % COFINIMMO 20/30           | 500 |     | 79,64 | 398.180,00 | 0,27 |
| XS2322438990 | 0,8750 % CZECH GAS N. 21/31        | 250 |     | 80,90 | 202.260,00 | 0,13 |
| XS2343114687 | 0,8750 % EUROFIN.SCIF 21/31        | 450 |     | 79,24 | 356.598,00 | 0,24 |
| XS2442764747 | 0,8750 % IBM 22/30                 | 750 | 150 | 86,67 | 650.010,00 | 0,43 |
| XS2013618421 | 0,8750 % ISS GLOBAL 19/26 MTN      | 350 |     | 93,38 | 326.812,50 | 0,22 |
| XS2414830963 | 0,8750 % KERRFINL SVC. 21/31       | 280 |     | 82,49 | 230.977,60 | 0,15 |
| XS2229470146 | 0,8750 % KON. KPN 20/32 MTN        | 500 |     | 79,42 | 397.100,00 | 0,26 |
| DE000A3MQNP4 | 0,8750 % LEG IMMOBILIEN MTN 22/29  | 600 |     | 85,69 | 514.158,00 | 0,34 |
| XS2407028435 | 0,8750 % MVM ENERGET. 21/27        | 400 |     | 86,25 | 345.016,00 | 0,23 |
| AT000B122080 | 0,8750 % VB WIEN 21/26 MTN         | 200 |     | 93,48 | 186.968,00 | 0,12 |
| XS2388876232 | 0,9660 % MBANK 21/27 FLR MTN       | 300 |     | 89,01 | 267.030,00 | 0,18 |
| XS2288925568 | 1,0000 % BALDER FINLA 21/29 MTN    | 600 |     | 80,70 | 484.182,00 | 0,32 |
| XS2356569736 | 1,0000 % BAY.LDSBK.21/31 MTN       | 100 |     | 87,92 | 87.919,00  | 0,06 |
| XS2447564332 | 1,0000 % BMW FIN. 22/28 MTN        | 200 |     | 91,36 | 182.728,00 | 0,12 |
| XS2248827771 | 1,0000 % CA IMMO 20/25             | 200 |     | 92,12 | 184.244,00 | 0,12 |
| FR0014005EJ6 | 1,0000 % DANONE 21/UND. FLR MTN    | 400 |     | 91,85 | 367.380,00 | 0,25 |
| XS2431320378 | 1,0000 % MEOBANCA 22/29 FLR MTN    | 400 | 300 | 88,83 | 355.312,00 | 0,24 |
| XS2022093517 | 1,0000 % OMV 19/34 MTN             | 700 |     | 77,08 | 539.588,00 | 0,36 |
| XS2439004412 | 1,0000 % PRO.EUR.FIN. 22/29        | 220 |     | 88,39 | 194.460,20 | 0,13 |
| XS2348241048 | 1,0000 % RBANK 21/28 FLR MTN       | 300 |     | 88,52 | 265.569,00 | 0,18 |
| XS2348408514 | 1,0000 % SPP DISTRIBU 21/31        | 450 |     | 75,89 | 341.509,50 | 0,23 |
| FR0014006FB8 | 1,0110 % ARGAN 21/26               | 600 |     | 89,66 | 537.948,00 | 0,36 |
| XS1716616179 | 1,1000 % WHIRLPOOL F.LUX. 17/27    | 320 |     | 90,76 | 290.441,60 | 0,19 |
| XS2081016763 | 1,1040 % BP CAP.MKTS 19/34 MTN     | 300 |     | 77,03 | 231.075,00 | 0,15 |
| XS2341269970 | 1,1250 % AKER BP 21/29 MTN         | 500 | 200 | 87,06 | 435.295,00 | 0,29 |
| XS1198117670 | 1,1250 % ESSITY 15/25 MTN          | 300 |     | 97,13 | 291.387,00 | 0,19 |
| BE6334365713 | 1,1250 % EUROCL.INV. 22/26         | 300 |     | 94,26 | 282.789,00 | 0,19 |
| FR0013430535 | 1,1250 % INLI 19/29                | 400 | 200 | 87,28 | 349.100,00 | 0,23 |
| XS1803247557 | 1,1250 % LUNAR FUNDING V 18/26 MTN | 450 |     | 94,30 | 424.345,50 | 0,28 |
| XS1395057430 | 1,1250 % TELSTRA CORP. 16/26 MTN   | 500 |     | 95,24 | 476.190,00 | 0,32 |
| XS2366415110 | 1,1250 % TH.FISHER SC 21/33        | 400 | 200 | 80,98 | 323.924,00 | 0,22 |
| XS1412266816 | 1,1500 % JOHNSON + JOHNSON 16/28   | 600 |     | 91,98 | 551.880,00 | 0,37 |
| AT0000A1NWX1 | 1,2000 % RLBK OBEROESTERR.16-24    | 600 |     | 97,63 | 585.795,43 | 0,39 |
| AT0000A2VCV4 | 1,2500 % ERSTE BK HU 22/26         | 500 |     | 96,92 | 484.615,00 | 0,32 |
| XS2441552192 | 1,2500 % GOLDM.S.GRP 22/29 MTN     | 360 |     | 88,99 | 320.360,40 | 0,21 |
| XS1955187858 | 1,2500 % SIEMENS FIN 19/31 MTN     | 290 |     | 87,77 | 254.533,00 | 0,17 |
| XS2438026366 | 1,2500 % THAMES WATER 22/32 MTN    | 600 |     | 74,85 | 449.124,00 | 0,30 |
| XS1577962084 | 1,3000 % BAXTER INTL 17/25         | 300 |     | 96,93 | 290.796,00 | 0,19 |
| XS2176560444 | 1,3000 % VERIZON COMM 20/33        | 600 | 600 | 81,37 | 488.226,00 | 0,33 |
| XS1963836892 | 1,3490 % MARSH+MCLENN 19/26        | 500 |     | 94,52 | 472.590,00 | 0,32 |
| XS2193982803 | 1,3620 % UPJOHN FINAN 20/27        | 370 |     | 91,58 | 338.834,90 | 0,23 |
| XS2444286145 | 1,3750 % ALFA LA.TR. 22/29 MTN     | 270 |     | 90,02 | 243.056,70 | 0,16 |
| DE000A180B80 | 1,3750 % ALLIANZ FIN. II 16/31 MTN | 600 |     | 89,57 | 537.438,00 | 0,36 |
| XS2411178630 | 1,3750 % BAY.LDSBK.21/32 MTN       | 300 | 300 | 84,21 | 252.621,00 | 0,17 |

|              |                                    |     |     |       |            |      |
|--------------|------------------------------------|-----|-----|-------|------------|------|
| XS2428716000 | 1,3750 % DIG.INTR.HO. 22/32        | 260 |     | 80,32 | 208.824,20 | 0,14 |
| XS2458285355 | 1,3750 % DSV FINANCE 22/30 MTN     | 230 |     | 88,63 | 203.846,70 | 0,14 |
| XS2312744217 | 1,3750 % ENEL 21/UND. FLR          | 600 |     | 87,88 | 527.280,00 | 0,35 |
| XS2463961248 | 1,3750 % LINDE 22/31 MTN           | 400 |     | 87,86 | 351.440,00 | 0,23 |
| FR0013535150 | 1,3750 % PRAEMIA HEAL 20/30        | 300 |     | 83,07 | 249.198,00 | 0,17 |
| XS2353473692 | 1,3750 % RAIF.BK INTL 21/33FLR MTN | 400 |     | 84,04 | 336.148,00 | 0,22 |
| XS2447983813 | 1,3750 % SVENSKA HDBK 22/29 MTN    | 300 |     | 90,06 | 270.168,00 | 0,18 |
| XS2199604096 | 1,3750 % UNIQA INSUR. 20/30        | 600 |     | 86,58 | 519.456,00 | 0,35 |
| XS1202213291 | 1,4000 % PPG INDUSTR. 15/27        | 600 |     | 94,31 | 565.854,00 | 0,38 |
| XS2433135543 | 1,4750 % HLDGE TRANSP 22/31 MTN    | 200 |     | 84,88 | 169.752,00 | 0,11 |
| XS1379122101 | 1,5000 % AMERICA MOVIL 16/24       | 500 |     | 99,93 | 499.645,00 | 0,33 |
| XS2456839013 | 1,5000 % BERK.HATH.F. 22/30        | 100 | 300 | 89,63 | 89.631,00  | 0,06 |
| XS1859010685 | 1,5000 % CITIGROUP 18/26 FLR MTN   | 300 | 200 | 96,76 | 290.271,00 | 0,19 |
| XS1890836296 | 1,5000 % CLOVERIE 18/28 MTN        | 500 |     | 92,05 | 460.255,00 | 0,31 |
| XS2290544068 | 1,5000 % CPI PROP.GRP 21/31 MTN    | 660 |     | 63,48 | 418.974,60 | 0,28 |
| XS2466368938 | 1,5000 % DIAGEO CAP. 22/29 MTN     | 400 |     | 91,30 | 365.208,00 | 0,24 |
| BE0002846278 | 1,5000 % KBC GROEP 22/26 FLR MTN   | 600 |     | 97,39 | 584.322,00 | 0,39 |
| XS1689185426 | 1,5000 % MAGNA INTL INC. 17/27     | 400 |     | 93,77 | 375.092,00 | 0,25 |
| XS2232045463 | 1,5000 % MOL NYRT. 20/27           | 800 |     | 91,69 | 733.536,00 | 0,49 |
| XS1395010397 | 1,5000 % MONDI FINANCE 16/24 MTN   | 400 |     | 99,66 | 398.624,00 | 0,27 |
| XS2314246526 | 1,5000 % STEDIN HLDG. 21/UND. FLR  | 400 |     | 91,02 | 364.092,00 | 0,24 |
| XS2308313860 | 1,6250 % AUSNET SVCS 21/81 FLR     | 400 |     | 91,66 | 366.644,00 | 0,24 |
| XS1718417717 | 1,6250 % BASF MTN 17/37            | 250 |     | 78,68 | 196.687,50 | 0,13 |
| XS2397252011 | 1,6250 % HEIMSTADEN 21/31 MTN      | 600 |     | 70,27 | 421.608,00 | 0,28 |
| XS2218405772 | 1,6250 % MERCK KGAA SUB.ANL.20/80  | 500 |     | 93,63 | 468.125,00 | 0,31 |
| XS2436807940 | 1,6250 % P3 GROUP 22/29 MTN        | 600 |     | 87,81 | 526.878,00 | 0,35 |
| DE000A2TSTG3 | 1,6250 % SAP SE IS 18/31           | 800 | 200 | 90,54 | 724.304,00 | 0,48 |
| XS2002018500 | 1,6250 % VODAFONE GRP 19/30 MTN    | 400 | 400 | 88,85 | 355.384,00 | 0,24 |
| XS2465984107 | 1,6310 % MIZUHO F.G. 22/27 MTN     | 600 |     | 93,86 | 563.142,00 | 0,38 |
| XS1769041606 | 1,7000 % NOVARTIS FIN. 18/38       | 400 |     | 82,78 | 331.128,00 | 0,22 |
| XS1528093799 | 1,7500 % AUTOSTRAD IT. 16/27 MTN   | 410 |     | 94,38 | 386.962,10 | 0,26 |
| XS1969600748 | 1,7500 % CNH INDUSTR. 19/27        | 400 |     | 94,83 | 379.320,00 | 0,25 |
| XS1528141788 | 1,7500 % GREAT-WEST LIFECO 16/26   | 250 |     | 95,81 | 239.535,00 | 0,16 |
| XS1672151492 | 1,7500 % HOLCIM FIN.LUX. 17/29 MTN | 700 |     | 90,46 | 633.248,00 | 0,42 |
| XS1788515606 | 1,7500 % NATWEST GROUP 18/26 MTN   | 300 |     | 97,75 | 293.262,00 | 0,20 |
| XS2478690931 | 1,7500 % SEB 22/26 MTN             | 500 |     | 95,43 | 477.145,00 | 0,32 |
| XS2407027031 | 1,7500 % VIA OUTLETS 21/28         | 600 |     | 87,99 | 527.946,00 | 0,35 |
| XS1602547264 | 1,7760 % BANK AMERI. 17/27 FLR MTN | 500 |     | 95,71 | 478.525,00 | 0,32 |
| XS1843459782 | 1,8000 % INTL FLAV.+FRAG. 18/26    | 600 |     | 94,66 | 567.948,00 | 0,38 |
| XS2055079904 | 1,8230 % WIN.DEA FIN. 19/31        | 700 |     | 83,56 | 584.906,00 | 0,39 |
| XS1377682676 | 1,8750 % COCA COLA HBC F.16/24 MTN | 300 |     | 98,61 | 295.842,00 | 0,20 |
| DE000DL19WL7 | 1,8750 % DT.BANK MTN 22/28         | 700 |     | 93,19 | 652.316,00 | 0,44 |
| XS1571293684 | 1,8750 % ERICSSON 17/24 MTN        | 150 |     | 99,99 | 149.989,50 | 0,10 |
| XS1708167652 | 1,8750 % VERIZON COMM 17/29        | 450 | 150 | 91,73 | 412.803,00 | 0,28 |
| XS2461234622 | 1,9630 % JPMORG.CHASE 22/30 FLR    | 400 |     | 91,86 | 367.448,00 | 0,25 |
| XS1292389415 | 2,0000 % APPLE 15/27               | 800 | 200 | 96,43 | 771.408,00 | 0,51 |
| DE000A3MQQV5 | 2,0000 % DEUT.BOERSE SUB.ANL22/48  | 200 |     | 91,72 | 183.434,00 | 0,12 |
| XS1843435923 | 2,0000 % FID.NATL INF 19/30        | 800 |     | 90,75 | 726.000,00 | 0,48 |
| FR0013368206 | 2,0000 % RENAULT 18-26 MTN         | 400 |     | 95,00 | 379.988,00 | 0,25 |
| XS2196317742 | 2,0000 % SES 20/28 MTN             | 500 |     | 92,72 | 463.590,00 | 0,31 |
| XS2430287362 | 2,0850 % PROSUS 22/30 MTN REGS     | 350 | 250 | 84,80 | 296.786,00 | 0,20 |
| XS2010045511 | 2,1250 % NGG FINANCE 19/82 FLR     | 300 |     | 91,64 | 274.911,00 | 0,18 |
| XS2517103417 | 2,1250 % SAINT-GOBAIN 22/28        | 200 |     | 94,94 | 189.872,00 | 0,13 |
| XS1851268893 | 2,2000 % BPP EU.HLDG. 18/25 MTN    | 300 |     | 96,64 | 289.932,00 | 0,19 |
| DE000LB13HZ5 | 2,2000 % LBBW T2 MTN 19/29         | 300 |     | 84,96 | 254.886,00 | 0,17 |
| DE000A14JN8  | 2,2410 % ALLIANZ SUB 2015/2045     | 100 |     | 97,23 | 97.225,00  | 0,06 |
| XS1729882024 | 2,2500 % TALANX AG NACHR.ANL 17/47 | 600 |     | 92,30 | 553.788,00 | 0,37 |
| XS2207430120 | 2,3740 % TENNET HLDG 20/UND.FLR    | 400 |     | 96,91 | 387.628,00 | 0,26 |
| XS1975757789 | 2,3750 % BCA POP.SOND 19/24        | 330 |     | 99,79 | 329.300,40 | 0,22 |
| XS2463988795 | 2,3750 % EQT 22/28                 | 340 |     | 93,00 | 316.183,00 | 0,21 |
| FR0013413887 | 2,3750 % ORANGE 19/UND. FLR MTN    | 300 |     | 97,72 | 293.163,00 | 0,20 |
| XS2418392143 | 2,3750 % UNIQA INSUR. 21/41 FLR    | 500 |     | 82,31 | 411.540,00 | 0,27 |
| FI4000523287 | 2,3750 % VR-GROUP 22/29            | 200 |     | 93,94 | 187.884,00 | 0,13 |
| XS2431964001 | 2,5000 % D.V.I. VERMO IS 22/27     | 400 |     | 90,03 | 360.120,00 | 0,24 |
| XS2475919663 | 2,5000 % ELECTROLUX 22/30 MTN      | 500 |     | 90,27 | 451.335,00 | 0,30 |
| XS2243564478 | 2,5000 % IMMOFINANZ 20/27          | 400 |     | 76,48 | 305.924,00 | 0,20 |
| XS2224439385 | 2,5000 % OMV AG 20/UND FLR         | 500 |     | 94,89 | 474.440,00 | 0,32 |
| XS2180009081 | 2,6000 % AT + T INC. 20/38         | 900 | 250 | 84,37 | 759.348,00 | 0,51 |
| AT0000A1QE42 | 2,6310 % ERSTE GP BNK 17-27 FLR    | 300 |     | 95,31 | 285.937,50 | 0,19 |
| FR001400CH94 | 2,7500 % AUTO.SUD FR 22/32 MTN     | 500 |     | 95,00 | 475.015,00 | 0,32 |
| XS2533012790 | 2,7500 % COCA C.HBC F 22/25 MTN    | 300 | 300 | 98,40 | 295.185,00 | 0,20 |
| XS2481288525 | 2,7500 % COLOPL. FIN. 22/30 MTN    | 300 | 200 | 94,71 | 284.127,00 | 0,19 |
| XS1172951508 | 2,7500 % PET. MEX. 15/27 MTN       | 350 |     | 85,68 | 299.876,50 | 0,20 |
| XS2526839761 | 2,7500 % SIEMENS FIN 22/30 MTN     | 400 |     | 97,10 | 388.380,00 | 0,26 |
| XS2530506752 | 2,8750 % OP YRITYSPA. 22/25 MTN    | 560 |     | 98,83 | 553.420,00 | 0,37 |



|              |                                    |     |     |     |        |            |      |
|--------------|------------------------------------|-----|-----|-----|--------|------------|------|
| XS2510903862 | 2,8750 % SSE PLC 22/29 MTN         | 270 |     |     | 97,33  | 262.796,40 | 0,18 |
| XS2486461283 | 2,9490 % NATL GRID 22/30 MTN       | 400 |     | 200 | 96,00  | 384.008,00 | 0,26 |
| XS2744299335 | 3,0000 % RED EL.FIN. 24/34 MTN     | 300 | 300 |     | 97,06  | 291.180,00 | 0,19 |
| XS1843449395 | 3,0000 % TAKEDA PHARMA.18/30 REGS  | 300 |     | 200 | 96,08  | 288.252,00 | 0,19 |
| XS2231715322 | 3,0000 % ZF FINANCE GMBH MTN 20/25 | 500 |     |     | 98,04  | 490.190,00 | 0,33 |
| XS2535308634 | 3,1250 % MEDTR.GLB HD 22/31        | 300 |     | 300 | 97,76  | 293.289,00 | 0,20 |
| XS2532247892 | 3,1250 % SKF 22/28                 | 500 |     |     | 98,03  | 490.165,00 | 0,33 |
| XS2228683350 | 3,2010 % NISSAN MOTOR 20/28 REGS   | 500 |     |     | 96,25  | 481.260,00 | 0,32 |
| XS2592088236 | 3,2040 % ROCHE F. EUR 23/29 MTN    | 610 |     |     | 100,41 | 612.488,80 | 0,41 |
| BE0002644251 | 3,2500 % AGEAS 19/49 FLR           | 200 |     |     | 92,71  | 185.414,00 | 0,12 |
| XS2193661324 | 3,2500 % BP CAP.MKTS 20/UND FLR    | 650 |     |     | 96,71  | 628.641,00 | 0,42 |
| DE000A3LSYH6 | 3,2500 % M.B.INT.FIN. 24/32 MTN    | 340 | 340 |     | 98,53  | 335.015,60 | 0,22 |
| XS1843448314 | 3,2500 % MUENCH.RUECK 18/49        | 600 |     |     | 95,23  | 571.362,00 | 0,38 |
| XS2525246901 | 3,2500 % NATIONW.BLDG 22/29 MTN    | 300 |     | 300 | 98,29  | 294.867,00 | 0,20 |
| FR001400N285 | 3,2500 % SCHNEID.ELEC 24/35 MTN    | 300 | 300 |     | 97,98  | 293.940,00 | 0,20 |
| CH1210198136 | 3,2500 % SW.LIFE F.I 22/29         | 700 |     | 100 | 98,35  | 688.450,00 | 0,46 |
| XS2591848275 | 3,2500 % UNIL.FIN.NED 23/31 MTN    | 340 |     |     | 99,93  | 339.748,40 | 0,23 |
| XS2534785865 | 3,3750 % BBVA 22/27 MTN            | 600 |     |     | 99,57  | 597.390,00 | 0,40 |
| FR001400G412 | 3,3750 % KERING 23/33 MTN          | 400 |     | 200 | 98,49  | 393.956,00 | 0,26 |
| XS2498042584 | 3,3750 % NED.GASUNIE 22/34 MTN     | 370 |     |     | 98,81  | 365.600,70 | 0,24 |
| CH1230759495 | 3,3900 % CS (SCHWEIZ) 22/25 MTN    | 560 |     |     | 99,44  | 556.858,40 | 0,37 |
| XS2632655135 | 3,4000 % UNILEVER CAP 23/33 MTN    | 100 |     |     | 100,44 | 100.439,00 | 0,07 |
| FR001400NU45 | 3,5000 % BQUE POSTALE 24/30 MTN    | 600 | 600 |     | 99,09  | 594.540,00 | 0,40 |
| XS2631835332 | 3,5000 % STATNETT 23/33 MTN        | 200 |     |     | 100,67 | 201.348,00 | 0,13 |
| XS2747596315 | 3,5470 % ASS.GENERALI 24/34 MTN    | 800 | 800 |     | 97,64  | 781.080,00 | 0,52 |
| XS2726335099 | 3,5860 % ROCHE F. EUR 23/36 MTN    | 360 | 360 |     | 101,97 | 367.081,20 | 0,24 |
| FR001400IU3  | 3,6250 % EDENRED 23/31             | 300 |     |     | 98,84  | 296.529,00 | 0,20 |
| XS2751598322 | 3,6250 % ENAGAS FIN. 24/34 MTN     | 300 | 300 |     | 97,63  | 292.902,00 | 0,20 |
| BE6338167909 | 3,6250 % EUROCLEAR BK 22/27 MTN    | 190 |     |     | 100,66 | 191.259,70 | 0,13 |
| XS2681383662 | 3,6250 % RECKITT BEN. 23/28 MTN    | 600 | 600 |     | 100,98 | 605.862,00 | 0,40 |
| XS2629468278 | 3,6250 % ROBERT BOSCH MTN.23/30    | 400 |     |     | 101,05 | 404.196,00 | 0,27 |
| XS2522879654 | 3,6250 % SWEDBANK 22/32 FLR MTN    | 400 |     |     | 96,77  | 387.096,00 | 0,26 |
| XS2565831943 | 3,6310 % TORON.DOM.BK 22/29 MTN    | 270 |     |     | 100,01 | 270.032,40 | 0,18 |
| XS1879567144 | 3,6400 % AROUNDTOWN 18/30 FLR      | 300 |     |     | 71,46  | 214.366,00 | 0,14 |
| XS2593105476 | 3,7500 % ASTRAZENECA 23/32 MTN     | 400 |     |     | 102,74 | 410.948,00 | 0,27 |
| XS2582814039 | 3,7500 % BRIT.TELECOM 23/31 MTN    | 500 |     |     | 100,14 | 500.715,00 | 0,33 |
| XS2577874782 | 3,7500 % HEIDELB.MAT. MTN 23/32    | 500 |     |     | 99,38  | 496.920,00 | 0,33 |
| FR001400DP44 | 3,7500 % PERNOD-RICA. 22/32 MTN    | 300 |     | 300 | 101,87 | 305.604,00 | 0,20 |
| FR001400OF19 | 3,7500 % PLUXEE 24/32              | 300 | 300 |     | 99,50  | 298.504,00 | 0,20 |
| XS2063427574 | 3,7500 % POZAVAROVALN.SAV.19/39FLR | 200 | 200 |     | 82,43  | 164.856,00 | 0,11 |
| XS2655865546 | 3,8500 % TOYOTA M.CRD 23/30 MTN    | 680 |     |     | 101,81 | 692.301,20 | 0,46 |
| XS2678226114 | 3,8750 % ASSA-ABLOY 23/30 MTN      | 220 | 220 |     | 102,59 | 225.702,40 | 0,15 |
| FR001400AY79 | 3,8750 % BFCM 22/32 MTN FLR        | 300 |     |     | 97,88  | 293.652,00 | 0,20 |
| FR001400IBM5 | 3,8750 % BOUYGUES 23/31            | 300 |     |     | 102,54 | 307.623,00 | 0,21 |
| FR001400N4L7 | 3,8750 % BPCE 24/29 MTN            | 600 | 600 |     | 99,69  | 598.128,00 | 0,40 |
| BE0002939206 | 3,8750 % FLUVIUS SYS. 23/33 MTN    | 400 |     |     | 100,77 | 403.060,00 | 0,27 |
| XS2599730822 | 3,8750 % HEINEKEN 23/30 MTN        | 200 |     | 200 | 102,66 | 205.312,00 | 0,14 |
| XS2764264607 | 3,8750 % ING GROEP 24/29 FLR MTN   | 600 | 600 |     | 99,77  | 598.644,00 | 0,40 |
| FR001400NDQ2 | 3,8750 % KLEPIERRE 24/33 MTN       | 200 | 200 |     | 98,81  | 197.614,00 | 0,13 |
| BE6343825251 | 3,8750 % LONZA F.INTL 23/33        | 500 |     | 300 | 101,11 | 505.570,00 | 0,34 |
| XS2718201515 | 3,8750 % NESTE 23/31 MTN           | 240 | 240 |     | 101,31 | 243.144,00 | 0,16 |
| XS2178833773 | 3,8750 % STELLANTIS N.V. 20/26 MTN | 400 |     | 150 | 100,29 | 401.164,00 | 0,27 |
| XS2625136531 | 4,0000 % AKZO NOBEL 23/33 MTN      | 500 |     |     | 101,96 | 509.805,00 | 0,34 |
| XS2672452237 | 4,0000 % CONTINENTAL MTN23/27      | 280 |     |     | 101,11 | 283.116,40 | 0,19 |
| FR001400F7K2 | 4,0000 % CREDIT AGR. 23/33 MTN     | 600 |     |     | 103,07 | 618.402,00 | 0,41 |
| BE0002938190 | 4,0000 % GBL 23/33                 | 300 |     |     | 102,60 | 307.794,00 | 0,21 |
| AT0000A32HA3 | 4,0000 % HYPO NOE LB 23/27         | 600 |     |     | 99,88  | 599.256,00 | 0,40 |
| BE0002925064 | 4,0000 % PROXIMUS 23/30 MTN        | 500 |     |     | 102,74 | 513.690,00 | 0,34 |
| XS2439704318 | 4,0000 % SSE 22/UND.FLR            | 400 |     |     | 97,15  | 388.584,00 | 0,26 |
| XS2597740476 | 4,1090 % NW MUT.GL.F. 23/30 MTN    | 500 |     | 300 | 102,91 | 514.570,00 | 0,34 |
| XS2582860909 | 4,1250 % ABERTIS INF. 23/29 MTN    | 300 |     |     | 100,72 | 302.172,00 | 0,20 |
| XS2531479462 | 4,1250 % BAWAG P.S.K. 23/27 MTN    | 300 |     |     | 99,94  | 299.820,00 | 0,20 |
| BE0002963446 | 4,1250 % BELFIUS BK 23/29 MTN      | 800 | 800 |     | 102,42 | 819.376,00 | 0,55 |
| FR001400GGZ0 | 4,1250 % BFCM 23/29 MTN            | 800 |     |     | 102,21 | 817.672,00 | 0,55 |
| XS2698773913 | 4,1250 % BMW FINANCE 23/33 MTN     | 600 | 600 |     | 105,12 | 630.690,00 | 0,42 |
| FR001400I4X9 | 4,1250 % BNP PARIBAS 23/33 MTN     | 300 |     | 300 | 103,99 | 311.967,00 | 0,21 |
| XS2621007660 | 4,1250 % BOOKING HLDG 23/33        | 410 |     |     | 103,13 | 422.849,40 | 0,28 |
| XS2573569576 | 4,1250 % DANSKE BK 23/31 FLR MTN   | 410 |     |     | 101,82 | 417.470,20 | 0,28 |
| AT0000A32RP0 | 4,1250 % HYPO VORARL. 23/26 MTN    | 300 |     |     | 99,40  | 298.191,00 | 0,20 |
| XS2633317701 | 4,1250 % ITALGAS 23/32 MTN         | 300 |     |     | 101,69 | 305.058,00 | 0,20 |
| XS2728561098 | 4,1250 % JDE PEETS 23/30 MTN       | 270 | 270 |     | 100,64 | 271.714,50 | 0,18 |
| XS2644756608 | 4,1250 % ROYAL BK CDA 23/28 MTN    | 300 |     | 300 | 102,01 | 306.033,00 | 0,20 |
| DE000A3LBGG1 | 4,1250 % TRATON FIN. 22/25 MTN     | 300 |     |     | 100,39 | 301.167,00 | 0,20 |
| FR001400MLN4 | 4,1250 % URW 23/30 MTN             | 200 | 200 |     | 100,56 | 201.120,00 | 0,13 |
| FR001400KLT5 | 4,1250 % WORLDLINE 23/28 MTN       | 500 | 500 |     | 97,49  | 487.470,00 | 0,33 |

|              |                                    |       |     |     |        |            |      |
|--------------|------------------------------------|-------|-----|-----|--------|------------|------|
| CH1266847149 | 4,1560 % ZUER.KB 23/29 FLR         | 300   |     | 300 | 102,07 | 306.207,00 | 0,20 |
| XS2722162315 | 4,1830 % TELEFON.EMI. 23/33 MTN    | 500   | 500 |     | 102,23 | 511.145,00 | 0,34 |
| XS2676863355 | 4,2500 % KONI.PHILIPS 23/31 MTN    | 600   | 600 |     | 100,34 | 602.016,00 | 0,40 |
| XS2672967234 | 4,2500 % MOLNLYCKE HL 23/28 MTN    | 190   | 190 |     | 101,32 | 192.513,70 | 0,13 |
| XS2607040958 | 4,2500 % NATL. GAS TR. 23/30 MTN   | 420   |     |     | 101,92 | 428.051,40 | 0,29 |
| XS0132424028 | 4,2680 % HYPO TIROL 01/26FLR MTN   | 1.000 |     |     | 97,97  | 979.710,00 | 0,65 |
| XS2726256113 | 4,3750 % CAIXABANK 23/33 MTN       | 200   | 200 |     | 103,85 | 207.690,00 | 0,14 |
| FR001400LUK3 | 4,3750 % CARREFOUR 23/31 MTN       | 300   | 300 |     | 103,37 | 310.098,00 | 0,21 |
| FR001400M4O2 | 4,3750 % CREDIT AGRI. 23/33 MTN    | 400   | 400 |     | 103,52 | 414.088,00 | 0,28 |
| DE000A3515S3 | 4,3750 % HASPA IS.R.890            | 600   | 600 |     | 103,21 | 619.242,00 | 0,41 |
| XS2590621368 | 4,3750 % NBN CO 23/33 MTN          | 100   |     |     | 104,87 | 104.871,00 | 0,07 |
| XS2676395077 | 4,3750 % SARTOR.FIN. 23/29         | 300   | 300 |     | 102,66 | 307.989,00 | 0,21 |
| XS2576550672 | 4,3750 % THAMES WATER 23/31 MTN    | 200   |     | 220 | 93,00  | 185.996,00 | 0,12 |
| CH1236363391 | 4,3750 % UBS GROUP 23/31 FLR MTN   | 300   |     |     | 101,90 | 305.700,00 | 0,20 |
| XS0245906150 | 4,4060 % M6 DUBA AUTOP.KONCE.06/25 | 2.650 |     |     | 99,25  | 192.225,25 | 0,13 |
| XS2557084733 | 4,5000 % ABN AMRO BK 22/34 MTN     | 300   |     |     | 105,04 | 315.117,00 | 0,21 |
| FR001400KHI6 | 4,5000 % ENGIE 23/42 MTN           | 300   | 300 |     | 104,13 | 312.387,00 | 0,21 |
| FR001400LCK1 | 4,5000 % INDIGO GROUP 23/30        | 300   | 300 |     | 102,89 | 308.679,00 | 0,21 |
| XS2489727991 | 4,5000 % LB.HESS.-THR. 22/32 VAR   | 200   |     | 200 | 92,63  | 185.266,00 | 0,12 |
| XS2569069375 | 4,5000 % LLOYDS BKG 23/29 FLR MTN  | 490   |     |     | 102,25 | 501.029,90 | 0,33 |
| XS2715941949 | 4,5000 % SANDOZ FIN. 23/33         | 240   | 240 |     | 103,74 | 248.976,00 | 0,17 |
| XS2644417227 | 4,5000 % SANTANDER CONS. MTN 23/26 | 200   |     |     | 100,86 | 201.726,00 | 0,13 |
| FR001400ION6 | 4,5000 % WENDEL 23/30              | 300   |     |     | 103,87 | 311.601,00 | 0,21 |
| XS2739054489 | 4,5060 % BARCLAYS 24/33 FLR MTN    | 310   | 310 |     | 100,38 | 311.190,40 | 0,21 |
| XS2532473555 | 4,5650 % SMITH+NEPHEW 22/29        | 300   |     | 300 | 104,24 | 312.708,00 | 0,21 |
| XS1550988643 | 4,6250 % NN GROUP 17/48 FLR MTN    | 400   |     | 250 | 100,62 | 402.464,00 | 0,27 |
| DK0030512421 | 4,6250 % NYKREDIT 23/29 MTN        | 600   | 600 |     | 102,15 | 612.924,00 | 0,41 |
| XS2526881532 | 4,6250 % TELIA CO AB 22/82 FLR     | 150   |     |     | 100,43 | 150.648,00 | 0,10 |
| XS2617457127 | 4,6250 % VOLKSWAGEN BK. MTN 23/31  | 800   |     |     | 103,07 | 824.520,00 | 0,55 |
| XS1799939027 | 4,6250 % VOLKSWAGEN INTL18/UND.FLR | 900   |     | 100 | 96,35  | 867.159,00 | 0,58 |
| XS2694872594 | 4,6250 % VOLKSWAGEN LEASING 23/29  | 250   | 370 | 120 | 104,04 | 260.092,50 | 0,17 |
| XS2630465875 | 4,6250 % WERFEN 23/28 MTN          | 600   |     |     | 101,34 | 608.058,00 | 0,41 |
| XS2613666739 | 4,6360 % MIT.UFJ FIN.23/31 MTN FLR | 300   |     |     | 104,08 | 312.246,00 | 0,21 |
| XS0188935174 | 4,6543 % AXA S.A 04/UND. FLR MTN   | 800   |     |     | 95,73  | 765.840,00 | 0,51 |
| XS2595028536 | 4,6560 % MORGAN STANLEY 23/29 FLR  | 360   |     |     | 102,77 | 369.964,80 | 0,25 |
| XS2552362704 | 4,7000 % GR.-W.LIFECO 22/29        | 250   |     |     | 104,72 | 261.802,50 | 0,17 |
| XS0253410236 | 4,7300 % KOMMUNALKRED.06/26 FLRMTN | 500   |     |     | 99,23  | 496.168,00 | 0,33 |
| XS2723556572 | 4,7471 % MACQUARIE G. 23/30 MTN    | 400   | 600 | 200 | 104,57 | 418.276,00 | 0,28 |
| XS2759989234 | 4,7500 % CTP 24/30 MTN             | 600   | 600 |     | 100,54 | 603.264,00 | 0,40 |
| XS2647371843 | 4,7500 % ORLEN 23/30 MTN           | 600   |     |     | 102,55 | 615.288,00 | 0,41 |
| XS2579606927 | 4,7500 % RAIF.BK INT. 23/27FLR MTN | 300   |     |     | 100,86 | 302.565,00 | 0,20 |
| AT000B122155 | 4,7500 % VB WIEN 23/27 MTN         | 300   |     | 300 | 102,23 | 306.687,00 | 0,20 |
| XS2577053825 | 4,8000 % UNICREDIT 23/29 FLR MTN   | 600   |     |     | 103,32 | 619.902,00 | 0,41 |
| XS2621539910 | 4,8560 % HSBC HLDGS 23/33 FLR MTN  | 600   |     |     | 105,11 | 630.678,00 | 0,42 |
| FR001400L4V8 | 4,8750 % ALD 23/28 MTN             | 300   | 500 | 200 | 103,99 | 311.967,00 | 0,21 |
| XS2498976047 | 4,8750 % ARION BANK 22/24 MTN      | 400   |     |     | 100,64 | 402.544,00 | 0,27 |
| XS2705604234 | 4,8750 % BCO SANTAND. 23/31 MTN    | 600   | 600 |     | 104,83 | 628.974,00 | 0,42 |
| XS2592240712 | 4,8750 % DE VOLKSBANK 23/30 MTN    | 500   |     |     | 103,66 | 518.295,00 | 0,35 |
| DE000HCB0BZ1 | 4,8750 % HCOB IS 23/27             | 500   | 500 |     | 99,53  | 497.655,00 | 0,33 |
| XS2644969425 | 4,8750 % REALTY INCOM 23/30        | 350   |     |     | 105,35 | 368.718,00 | 0,25 |
| XS2679898184 | 4,8750 % REWE INTL F. 23/30        | 200   | 200 |     | 104,24 | 208.488,00 | 0,14 |
| FR001400M6F5 | 4,8750 % STE GENERALE 23/31 FLRMTN | 300   | 300 |     | 103,57 | 310.722,00 | 0,21 |
| AT0000A37249 | 4,8750 % WIENERBERGER 23/28        | 390   | 390 |     | 104,11 | 406.044,60 | 0,27 |
| XS2598331242 | 5,0000 % BCO SABADELL 23/29 FLR    | 600   |     |     | 104,43 | 626.574,00 | 0,42 |
| XS2643234011 | 5,0000 % BK IRELAND 23/31 FLR MTN  | 360   |     |     | 105,39 | 379.404,00 | 0,25 |
| XS2649712689 | 5,0000 % CAIXABANK 23/29 FLR MTN   | 400   |     |     | 103,93 | 415.716,00 | 0,28 |
| DE000A30VT06 | 5,0000 % DT.BANK MTN 22/30         | 300   |     |     | 102,56 | 307.665,00 | 0,21 |
| XS2592650373 | 5,0000 % INTESA SANP.23/28 FLR MTN | 330   |     |     | 103,08 | 340.177,20 | 0,23 |
| DE000A3LJPA8 | 5,0000 % JAB HOLDINGS 23/33        | 200   |     |     | 106,47 | 212.942,00 | 0,14 |
| FR001400F0H3 | 5,0000 % JCDECAUX 23/29            | 400   |     |     | 104,80 | 419.196,00 | 0,28 |
| XS2615271629 | 5,0000 % JYSKE BANK 23/28 FLR MTN  | 220   |     |     | 102,28 | 225.020,40 | 0,15 |
| DE000A30VQB2 | 5,0000 % VONOVIA SE MTN 22/30      | 300   |     |     | 104,17 | 312.516,00 | 0,21 |
| XS2698713695 | 5,1250 % FRESENIUS SE MTN 23/30    | 600   | 600 |     | 106,53 | 639.198,00 | 0,43 |
| XS2754488851 | 5,1250 % JYSKE BANK 24/35 FLR MTN  | 150   | 150 |     | 100,46 | 150.696,00 | 0,10 |
| DE000DK010W7 | 5,1500 % DEKA MTN.S.7782           | 300   | 300 |     | 94,40  | 283.185,00 | 0,19 |
| AT000B121967 | 5,1920 % VOLKSBANK WIEN 17-27 FLR  | 500   |     |     | 100,33 | 501.630,00 | 0,33 |
| CH1224575899 | 5,2300 % RAIF.SCHWEIZ 22/27        | 500   |     |     | 104,03 | 520.135,00 | 0,35 |
| XS2673969650 | 5,2500 % IN.DIS.SVCS. 23/28        | 350   | 350 |     | 103,55 | 362.439,00 | 0,24 |
| XS0158363852 | 5,3750 % NATIXIS SA 02/27 MTN      | 200   |     |     | 103,19 | 206.380,00 | 0,14 |
| FR001400L1E0 | 5,5000 % CARMILA 23/28 MTN         | 400   | 400 |     | 104,33 | 417.328,00 | 0,28 |
| XS0213101073 | 5,5000 % PET. MEX. 05/25MTN REGS   | 300   |     |     | 100,65 | 301.959,00 | 0,20 |
| FR001400KL23 | 5,5000 % PRAEMIA HEAL 23/28        | 200   | 200 |     | 104,62 | 209.236,00 | 0,14 |
| FR001400IDY6 | 5,6250 % STE GENERALE 23/33 MTN    | 400   |     |     | 105,68 | 422.728,00 | 0,28 |
| FR001400J861 | 5,6250 % TDF INFRASTR 23/28        | 300   |     |     | 104,83 | 314.496,00 | 0,21 |
| XS2641794081 | 5,7010 % ALPERIA 23/28 MTN         | 800   |     |     | 103,73 | 829.848,00 | 0,55 |

|              |                                  |     |     |     |        |            |      |
|--------------|----------------------------------|-----|-----|-----|--------|------------|------|
| BE0002913946 | 5,7500 % CRELAN 23/28 MTN        | 200 | 400 | 200 | 104,31 | 208.610,00 | 0,14 |
| DE000A351U49 | 5,8240 % ALLIANZ SUB 2023/2053   | 600 |     |     | 108,28 | 649.650,00 | 0,43 |
| BE6342251038 | 5,8500 % ELIA GROUP 23/UND FLR   | 500 |     |     | 102,74 | 513.675,00 | 0,34 |
| XS2555420103 | 5,8500 % UNICREDIT 22/27 FLR MTN | 290 |     |     | 104,80 | 303.920,00 | 0,20 |
| FR001400KWR6 | 6,0000 % ELO 23/29 MTN           | 300 | 300 |     | 100,15 | 300.435,00 | 0,20 |
| XS2713801780 | 6,0000 % NIBC BANK 23/28 MTN     | 200 | 200 |     | 106,54 | 213.080,00 | 0,14 |
| XS2698603326 | 6,1250 % OTP BNK 23/27 FLR MTN   | 500 | 500 |     | 102,94 | 514.675,00 | 0,34 |
| XS2615584328 | 6,5000 % TDC NET 23/31 MTN       | 400 |     |     | 107,05 | 428.208,00 | 0,29 |
| XS2553604690 | 7,3750 % ISLANDSBANKI 23/26 MTN  | 210 |     |     | 104,21 | 218.838,90 | 0,15 |
| XS2695009998 | 7,8750 % GRENKE FIN. 23/27 MTN   | 380 | 380 |     | 107,87 | 409.902,20 | 0,27 |

lautend auf ITL

|              |                                 |           |  |  |       |            |      |
|--------------|---------------------------------|-----------|--|--|-------|------------|------|
| XS0071094667 | 0,0000 % COBA DRES.D.FIN. NK/26 | 700.000   |  |  | 88,06 | 318.350,75 | 0,21 |
| XS0071948540 | 0,0000 % UBS FIN. 97/27 ZERO    | 1.200.000 |  |  | 87,76 | 543.878,69 | 0,36 |

lautend auf USD

|              |                                    |       |  |  |        |            |      |
|--------------|------------------------------------|-------|--|--|--------|------------|------|
| XS0743062845 | 0,0000 % BARCLAYS BK 12/27 ZO MTN  | 810   |  |  | 85,92  | 642.125,67 | 0,43 |
| US66989HAR93 | 2,2000 % NOVARTIS CAP 20/30        | 500   |  |  | 86,08  | 397.130,47 | 0,26 |
| XS1219971774 | 3,2000 % STAND. CHART. 15/25 REGS  | 400   |  |  | 97,34  | 359.243,40 | 0,24 |
| XS0909427782 | 3,8000 % E.ON INT F. 13/33 MTN DL  | 1.000 |  |  | 83,68  | 772.102,79 | 0,52 |
| US10373QAE08 | 4,2340 % BP CAP. MARK. AMER. 18/28 | 600   |  |  | 97,33  | 538.798,67 | 0,36 |
| XS2638075700 | 6,6250 % INTESA SANP. 23/33 REGS   | 500   |  |  | 101,27 | 467.180,29 | 0,31 |
| US172967AL52 | 7,8750 % CITIGROUP INC. 2025       | 400   |  |  | 102,73 | 379.162,21 | 0,25 |
| US25156PAC77 | 8,7500 % DT.TELEK.INTL F. 00/30    | 600   |  |  | 117,87 | 652.537,37 | 0,44 |
| US35177PAL13 | 9,0000 % ORANGE 2031               | 300   |  |  | 120,84 | 334.486,99 | 0,22 |

Strukturierte Produkte

lautend auf EUR

|              |                                    |     |  |  |       |            |      |
|--------------|------------------------------------|-----|--|--|-------|------------|------|
| DE000BLB5GT7 | 0,0000 % BAY.LDSBK.OPF.R.20269 VAR | 200 |  |  | 97,15 | 194.300,00 | 0,13 |
| XS0211284491 | 2,0000 % RABOBK NEDERLD05/35FLRMTN | 200 |  |  | 87,96 | 175.922,00 | 0,12 |

Nicht zum amtlichen Handel oder einem anderen geregelten Markt zugelassene Wertpapiere

Anleihen

lautend auf EUR

|              |                                  |       |     |  |        |            |      |
|--------------|----------------------------------|-------|-----|--|--------|------------|------|
| XS0307745744 | 0,0000 % LEHMAN BROTH. 07/14 MTN | 2.300 |     |  | 0,14   | 3.197,00   | 0,00 |
| AT0000A37CU1 | 4,0000 % KOMM.AUS. 23/25         | 500   | 500 |  | 100,02 | 500.080,00 | 0,33 |
| AT0000446869 | 4,6250 % RLBK BURG.R. 05-25 6    | 110   |     |  | 99,49  | 109.434,49 | 0,07 |

|                          |  |  |  |  |  |                |       |
|--------------------------|--|--|--|--|--|----------------|-------|
| Summe Wertpapiervermögen |  |  |  |  |  | 146.351.465,67 | 97,64 |
|--------------------------|--|--|--|--|--|----------------|-------|

|             |                        |         |         |      |                    |                |
|-------------|------------------------|---------|---------|------|--------------------|----------------|
| BEZEICHNUNG | NOMINALE/<br>KONTRAKTE | OPENING | CLOSING | KURS | KURSWERT<br>IN EUR | ANTEIL<br>IN % |
|-------------|------------------------|---------|---------|------|--------------------|----------------|

Derivative Produkte

Devisentermingeschäfte

Abgeschlossen mit Raiffeisenlandesbank Oberösterreich

Verkauf

|                                 |    |            |  |  |           |      |
|---------------------------------|----|------------|--|--|-----------|------|
| USD/EUR Laufzeit bis 19.04.2024 | 2) | -5.100.000 |  |  | 94.645,62 | 0,06 |
|---------------------------------|----|------------|--|--|-----------|------|

|                |  |  |  |  |           |      |
|----------------|--|--|--|--|-----------|------|
| Summe Derivate |  |  |  |  | 94.645,62 | 0,06 |
|----------------|--|--|--|--|-----------|------|

### Bankguthaben/Verbindlichkeiten

|                                               |                     |             |
|-----------------------------------------------|---------------------|-------------|
| EUR                                           | 1.621.675,40        | 1,08        |
| nicht EU-Währungen                            | 1.515,02            | 0,00        |
| <b>Summe Bankguthaben / Verbindlichkeiten</b> | <b>1.623.190,42</b> | <b>1,08</b> |

### Sonstiges Vermögen

|                                                   |                     |             |
|---------------------------------------------------|---------------------|-------------|
| Ausstehende Zahlungen                             | -47.061,16          | -0,03       |
| Diverse Gebühren                                  | -15.782,05          | -0,01       |
| Zinsansprüche                                     | 1.876.950,29        | 1,25        |
| Zinsen Anlagekonten (inkl. negativer Habenzinsen) | 11.958,58           | 0,01        |
| <b>Summe sonstiges Vermögen</b>                   | <b>1.826.065,66</b> | <b>1,22</b> |

### Fondsvermögen

**149.895.367,37 100,00**

## Devisenkurse

Vermögenswerte in fremder Währung wurden zu folgenden Devisenkursen umgerechnet:

| WÄHRUNG                 | KURS       |
|-------------------------|------------|
| Italienische Lire (ITL) | 1.936,2700 |
| US-Dollar (USD)         | 1,0838     |

Die Vermögensgegenstände des Sondervermögens sind auf der Grundlage von Kursen bzw. Marktsätzen per 28. Februar 2024 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:

- 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.
- 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.
- 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**

|              |                                    |     |       |
|--------------|------------------------------------|-----|-------|
| XS2286044370 | 0,0000 % ABB FIN.B.V. 21/30 MTN    |     | 400   |
| BE6315719490 | 0,0000 % BELFIUS BK 19/26 MTN      |     | 300   |
| BE0002597756 | 0,0000 % ELIA GROUP 18/UND FLR     |     | 100   |
| XS2303089697 | 0,0100 % SPAREBANK 1 21/28 MTN     |     | 500   |
| XS2389757944 | 0,2000 % ANZ N.Z.INTL 21/27 MTN    |     | 320   |
| DE000A289LU4 | 0,2500 % AAREAL BANK MTN S.304     |     | 200   |
| XS2265371042 | 0,3500 % MACQUARIE G. 20/28 MTN    |     | 600   |
| XS2115094737 | 0,3750 % SEB 20/27 MTN             |     | 280   |
| XS2100788780 | 0,4500 % GENL MILLS 20/26          |     | 600   |
| XS2250008245 | 0,4950 % MORGAN STANLEY 20/29 FLR  |     | 500   |
| AT0000A2STV4 | 0,5000 % CESKA SPORIT 21/28 FLRMTN |     | 300   |
| XS2325565104 | 0,5000 % FRES.FIN.IRE 21/28 MTN    |     | 500   |
| XS2373642102 | 0,5770 % BARCLAYS 21/29 FLR MTN    |     | 300   |
| XS1482736185 | 0,6250 % ATLAS COPCO 16/26 MTN     |     | 600   |
| XS2264194205 | 0,6250 % CTP N.V. 20/23 MTN        |     | 400   |
| XS2402178300 | 0,7500 % CK H.EUR.21 21/29         |     | 600   |
| XS2167002521 | 0,7500 % SWEDBANK 20/25 MTN        |     | 300   |
| XS2432361421 | 0,8750 % NIBC BANK 22/27 MTN       |     | 600   |
| XS2079079799 | 1,0000 % ING GROEP 19/30 FLR MTN   |     | 300   |
| XS2002491517 | 1,0000 % NATWEST MKTS 19/24 MTN    |     | 200   |
| CH0483180946 | 1,0000 % UBS GROUP 19/27 FLR       |     | 1.000 |
| XS1197833053 | 1,1250 % COCA-COLA CO. 15/27       |     | 600   |
| XS2346125573 | 1,1250 % ORLEN S.A. 21/28 MTN      |     | 700   |
| XS2063268754 | 1,2500 % IN.DIS.SVCS. 19/26        |     | 300   |
| XS2443920249 | 1,2500 % ING GROEP 22/27 FLR MTN   |     | 300   |
| XS2455401328 | 1,2500 % SEGRO CAPITA 22/26        |     | 140   |
| XS1896851224 | 1,3750 % TESCO C.TR.SERV.18/23 MTN |     | 300   |
| XS2468378059 | 1,6250 % CAIXABANK 22/26 FLR MTN   |     | 400   |
| AT0000A1LHT0 | 1,6250 % NOVOMATIC 16-23 MTN 1     |     | 300   |
| XS1615079974 | 1,6380 % JPMORGAN CHASE 17/28 FLR  |     | 500   |
| XS1571982468 | 1,7500 % 2I RETE GAS 17/26 MTN     |     | 200   |
| XS2481498173 | 1,7500 % UNIL.FIN.NED 22/28 MTN    |     | 480   |
| XS2177442295 | 1,8070 % TELEFON.EMI. 20/32 MTN    |     | 500   |
| XS1538284230 | 1,8750 % CREDIT AGR. 16/26 MTN     |     | 400   |
| XS1109802568 | 1,8750 % VODAFONE GRP 14/25 MTN    | 400 | 400   |
| XS2466350993 | 1,9520 % TORON.DOM.BK 22/30 MTN    |     | 700   |
| FR0013507860 | 2,0000 % CAPGEMINI 20/29           |     | 500   |
| XS1968706108 | 2,0000 % CREDIT AGRIL. 19/29 MTN   |     | 500   |
| CH1170565753 | 2,0200 % ZUER.KB 22/28 FLR         |     | 200   |
| XS2446386356 | 2,1030 % MORGAN STANLEY 22/26 FLR  |     | 300   |
| FR0014009E07 | 2,3750 % CARREFOUR 22/29 MTN       |     | 300   |
| XS2150054372 | 2,3750 % SAINT-GOBAIN 20/27        |     | 200   |
| XS1292352843 | 2,3840 % EESTI ENERGIA 15/23       |     | 200   |
| FR0013233384 | 2,5000 % ACCOR 17/24               |     | 300   |
| XS1201001572 | 2,5000 % BCO SANTANDER 15/25 MTN   |     | 100   |
| DE000A3LBMV2 | 3,0000 % MERC.B.FI.CA 22/27 MTN    |     | 600   |
| XS2530756191 | 3,0000 % WOLTERS KLUW 22/26        |     | 170   |
| FR001400CMY0 | 3,1250 % BFCM 22/27 MTN            |     | 800   |
| XS2553817763 | 3,1250 % GSK CAP B.V. 22/32 MTN    |     | 400   |
| CH1194000357 | 3,1250 % UBS GROUP 22/30 MTN       |     | 200   |
| XS2573331324 | 3,6250 % ABN AMRO BK 23/26 MTN     |     | 200   |
| XS2694995163 | 3,6250 % ASR NEDERLA. 23/28        | 100 | 100   |
| XS2573807778 | 3,6250 % AXA S.A. 23/33 MTN        |     | 600   |
| XS2072829794 | 3,6250 % NETFLIX INC. 19/30 REGS   |     | 400   |
| FR001400F0V4 | 3,8750 % BNP PARIBAS 23/31 FLR MTN |     | 600   |
| XS2530444624 | 3,8750 % FRESE.MED.CARE MTN 22/27  |     | 400   |
| XS2595418323 | 4,0000 % BASF MTN 23/29            |     | 300   |
| XS2469031749 | 4,1250 % GRENKE FIN. 22/24 MTN     |     | 380   |
| XS2628821873 | 4,1250 % LLOYDS BK C. 23/27 MTN    |     | 150   |

|                 |                                    |     |     |
|-----------------|------------------------------------|-----|-----|
| FR001400IDW0    | 4,1250 % STE GENERALE 23/27 MTN    |     | 600 |
| XS2717300391    | 4,1250 % SWEDBANK 23/28 MTN        | 320 | 320 |
| XS2725957042    | 4,1250 % VESTAS WIND 23/31 MTN     | 190 | 190 |
| FR001400F6E7    | 4,2500 % ALD 23/27 MTN             |     | 300 |
| XS2723577149    | 4,5000 % CARRIER GLOB 23/32 REGS   | 230 | 230 |
| XS2643673952    | 4,5000 % NASDAQ 23/32              |     | 230 |
| FR001400G6Y4    | 4,6250 % BPCE 23/30 FLR MTN        |     | 300 |
| XS2544400786    | 4,6250 % JYSKE BANK 22/26 FLR MTN  |     | 500 |
| XS2765027193    | 4,6250 % RAIF.BK INT. 24/29FLR MTN | 100 | 100 |
| XS2535725159    | 4,6250 % VIER GAS TRA. MTN22/32    |     | 300 |
| XS1953271225    | 4,7390 % UNICREDIT 19/29 FLR MTN   |     | 200 |
| FR001400LWN3    | 4,7500 % BFCM 23/31 MTN            | 800 | 800 |
| XS2676883114    | 4,7500 % EUROFIN.SCIF 23/30        | 320 | 320 |
| DE000NLB4RS5    | 4,8750 % NORDLB MTN 23/28          |     | 320 |
| XS2550868801    | 5,1250 % SUEZ.INTL 22/27           |     | 600 |
| BE0002872530    | 5,3750 % CRELAN 22/25 MTN          |     | 400 |
| AT0000351119    | 5,4300 % BAWAG P.S.K. 04-24        |     | 480 |
| XS1311440082    | 5,5000 % GENERALI 15/47 FLR MTN    |     | 200 |
| DE000A11QJP7    | 5,6250 % OLD.LDSBK.BK. MTI 23/26   | 200 | 200 |
| XS2676413235    | 5,7370 % CESKA SPORIT 23/28 FLRMTN | 100 | 100 |
| FR001400M2G2    | 5,7500 % TELEPERFORM. 23/31 MTN    | 100 | 100 |
| XS2585964476    | 5,8850 % CCB-CR.COOP. 23/27 FLRMTN |     | 320 |
| XS2560693181    | 7,3500 % OTP BNK 22/26 FLR MTN     |     | 400 |
| XS2675884733    | 7,8750 % VOLKSWAGEN INTL 23/UNDFLR | 100 | 100 |
| Iautend auf USD |                                    |     |     |
| US92343VER15    | 4,3290 % VERIZON COMM 2028         |     | 500 |

| BEZEICHNUNG | OPENING<br>KONTRAKTE/NOMINALE | CLOSING<br>KONTRAKTE/NOMINALE |
|-------------|-------------------------------|-------------------------------|
|-------------|-------------------------------|-------------------------------|

Derivative Produkte

Devisentermingeschäfte

Abgeschlossen mit Raiffeisenlandesbank Oberösterreich

Verkauf

|                                 |           |
|---------------------------------|-----------|
| USD/EUR Laufzeit bis 19.10.2023 | 4.700.000 |
| USD/EUR Laufzeit bis 19.10.2023 | 700.000   |

## Zusammensetzung des Fondsvermögens per 29.02.2024

| Wertpapiervermögen                                                                            | EUR                   | %             |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------|---------------|
| <b>Zum amtlichen Handel oder einem anderen geregelten Markt zugelassene Wertpapiere</b>       |                       |               |
| Anleihen                                                                                      | 145.368.532,18        | 96,98         |
| Strukturierte Produkte                                                                        | 370.222,00            | 0,25          |
| <b>Nicht zum amtlichen Handel oder einem anderen geregelten Markt zugelassene Wertpapiere</b> |                       |               |
| Anleihen                                                                                      | 612.711,49            | 0,41          |
| <b>Summe Wertpapiervermögen</b>                                                               | <b>146.351.465,67</b> | <b>97,64</b>  |
| <hr/>                                                                                         |                       |               |
| Derivative Produkte                                                                           | EUR                   | %             |
| <b>Devisentermingeschäfte</b>                                                                 |                       |               |
|                                                                                               | 94.645,62             | 0,06          |
| <b>Summe derivative Produkte</b>                                                              | <b>94.645,62</b>      | <b>0,06</b>   |
| <hr/>                                                                                         |                       |               |
| Bankguthaben/Verbindlichkeiten                                                                | EUR                   | %             |
| <b>Summe Bankguthaben/Verbindlichkeiten</b>                                                   | <b>1.623.190,42</b>   | <b>1,08</b>   |
| <hr/>                                                                                         |                       |               |
| Sonstiges Vermögen                                                                            | EUR                   | %             |
| <b>Summe Sonstiges Vermögen</b>                                                               | <b>1.826.065,66</b>   | <b>1,22</b>   |
| <hr/>                                                                                         |                       |               |
| <b>FOND S V E R M Ö G E N</b>                                                                 | <b>149.895.367,37</b> | <b>100,00</b> |
| <hr/>                                                                                         |                       |               |

KEPLER-FONDS Kapitalanlagegesellschaft m.b.H.

Andreas Lassner-Klein

Dr. Michael Bumberger