

# KEPLER Vorsorge Mixfonds

## Halbjahresbericht

vom

1. November 2023 bis 30. April 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       | AT0000969787 |
| Ausschüttungsanteil IT    | AT0000A20DA7 |
| Thesaurierungsanteil      | AT0000722640 |
| Thesaurierungsanteil IT   | AT0000A1A5N5 |
| Thesaurierungsanteil IT 1 | AT0000A37JJ9 |

## **Inhaltsübersicht**

|                                                      |    |
|------------------------------------------------------|----|
| Allgemeine Informationen zur Verwaltungsgesellschaft | 4  |
| Allgemeine Fondsdaten                                | 5  |
| Vermögensaufstellung                                 | 6  |
| Zusammensetzung des Fondsvermögens                   | 18 |

## Allgemeine Informationen zur Verwaltungsgesellschaft

### Gesellschafter:

Raiffeisenlandesbank Oberösterreich Aktiengesellschaft  
Oberösterreichische Landesbank Aktiengesellschaft  
Oberösterreichische Versicherung Aktiengesellschaft

### Staatskommissäre:

Mag. Kristina Fuchs (bis 31.12.2023)  
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 Vorsorge Mixfonds

### Sehr geehrter Anteilinhaber!

Die KEPLER-FONDS Kapitalanlagegesellschaft m.b.H. erlaubt sich, den Halbjahresbericht des KEPLER Vorsorge Mixfonds - OGAW gem. §§ 2 iVm 50 InvFG 2011 - vom 1. November 2023 bis 30. April 2024 vorzulegen.

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

| Fondsdetails                                                | per 31.10.2023 | per 30.04.2024 |
|-------------------------------------------------------------|----------------|----------------|
|                                                             | <b>EUR</b>     | <b>EUR</b>     |
| Fondsvermögen                                               | 586.055.254,51 | 665.223.478,30 |
| errechneter Wert je Ausschüttungsanteil                     | 87,58          | 96,27          |
| Ausgabepreis je Ausschüttungsanteil                         | 90,20          | 99,15          |
| errechneter Wert je Ausschüttungsanteil IT                  | 88,87          | 97,93          |
| Ausgabepreis je Ausschüttungsanteil IT                      | 91,53          | 100,86         |
| errechneter Wert je Thesaurierungsanteil IT                 | 142,70         | 160,79         |
| Ausgabepreis je Thesaurierungsanteil IT                     | 146,98         | 165,61         |
| errechneter Wert je Thesaurierungsanteil IT 1 <sup>1)</sup> | -              | 162,45         |
| Ausgabepreis je Thesaurierungsanteil IT 1                   | -              | 167,32         |
| errechneter Wert je Thesaurierungsanteil                    | 138,70         | 156,11         |
| Ausgabepreis je Thesaurierungsanteil                        | 142,86         | 160,79         |

#### Umlaufende KEPLER Vorsorge Mixfonds-Anteile zum Berichtsstichtag

|                                                                |               |
|----------------------------------------------------------------|---------------|
| <b>Ausschüttungsanteile per 31.10.2023</b>                     | 1.990.591,037 |
| Ausgabe                                                        | 116.798,097   |
| Rücknahmen                                                     | -129.170,488  |
| <b>Ausschüttungsanteile per 30.04.2024</b>                     | 1.978.218,646 |
| <b>Ausschüttungsanteil IT per 31.10.2023</b>                   | 344.177,013   |
| Ausgabe                                                        | 1.693,576     |
| Rücknahmen                                                     | -8.041,631    |
| <b>Ausschüttungsanteil IT per 30.04.2024</b>                   | 337.828,958   |
| <b>Thesaurierungsanteile IT per 31.10.2023</b>                 | 190.347,090   |
| Ausgabe                                                        | 2.132,631     |
| Rücknahmen                                                     | -3.755,597    |
| <b>Thesaurierungsanteile IT per 30.04.2024</b>                 | 188.724,124   |
| <b>Thesaurierungsanteile IT 1 per 14.11.2023 <sup>1)</sup></b> | 0,000         |
| Ausgabe                                                        | 10.251,500    |
| Rücknahmen                                                     | 0,000         |
| <b>Thesaurierungsanteile IT 1 per 30.04.2024</b>               | 10.251,503    |
| <b>Thesaurierungsanteile per 31.10.2023</b>                    | 2.551.883,095 |
| Ausgabe                                                        | 234.155,509   |
| Rücknahmen                                                     | -161.898,868  |
| <b>Thesaurierungsanteile per 30.04.2024</b>                    | 2.624.139,736 |

1) Die Tranche wurde per 14.11.2023 neu aufgelegt.

## Vermögensaufstellung zum 30.04.2024

| 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>Aktien</b>                                                                           |                           |                               |                  |                     |           |                    |                |
| <b>lautend auf EUR</b>                                                                  |                           |                               |                  |                     |           |                    |                |
| NL0011794037                                                                            | AHOLD DELHAIZE,KON.EO-,01 | 60.954                        |                  | 2.310               | 28,11     | 1.713.416,94       | 0,26           |
| IE00BF0L3536                                                                            | AIB GROUP PLC EO -,625    | 495.450                       |                  | 36.260              | 4,86      | 2.407.887,00       | 0,36           |
| FR0000053381                                                                            | DERICHEBOURG S.A. EO -,25 | 295.240                       |                  | 11.680              | 4,05      | 1.195.131,52       | 0,18           |
| FR0000052292                                                                            | HERMES INTERNATIONAL O.N. | 1.090                         |                  | 40                  | 2.298,00  | 2.504.820,00       | 0,38           |
| ES0148396007                                                                            | INDITEX INH. EO 0,03      | 59.130                        | 62.480           | 3.350               | 43,87     | 2.594.033,10       | 0,39           |
| FR0010259150                                                                            | IPSEN S.A. PORT. EO 1     | 21.230                        | 640              | 1.560               | 112,50    | 2.388.375,00       | 0,36           |
| GRS282183003                                                                            | JUMBO S.A. EO 0,88        | 73.063                        |                  | 2.709               | 29,22     | 2.134.900,86       | 0,32           |
| GRS014003032                                                                            | PIRAEUS FIN.HOL. EO 0,93  | 267.474                       | 285.080          | 17.606              | 3,90      | 1.044.218,50       | 0,16           |
| BE0003810273                                                                            | PROXIMUS S.A.             | 140.833                       |                  | 5.860               | 6,93      | 975.972,69         | 0,15           |
| FR0000130577                                                                            | PUBLICIS GRP INH. EO 0,40 | 25.783                        | 1.130            | 13.770              | 104,15    | 2.685.299,45       | 0,40           |
| NL0011821392                                                                            | SIGNIFY N.V. EO -,01      | 35.760                        |                  | 2.100               | 25,52     | 912.595,20         | 0,14           |
| NL00150001Q9                                                                            | STELLANTIS NV EO -,01     | 114.910                       | 121.070          | 6.160               | 23,23     | 2.668.784,75       | 0,40           |
| NL0000226223                                                                            | STMICROELECTRONICS        | 28.060                        |                  | 1.640               | 38,15     | 1.070.489,00       | 0,16           |
| FR0013447729                                                                            | VERALLIA SA (PROM.)EO3,38 | 56.760                        |                  | 2.110               | 36,38     | 2.064.928,80       | 0,31           |
| DE0007664039                                                                            | VOLKSWAGEN AG VZO O.N.    | 8.085                         |                  | 475                 | 120,75    | 976.263,75         | 0,15           |
| <b>lautend auf AUD</b>                                                                  |                           |                               |                  |                     |           |                    |                |
| AU000000FMG4                                                                            | FORTESCUE LTD.            | 141.868                       |                  | 10.382              | 25,67     | 2.230.399,42       | 0,34           |
| AU000000WTC3                                                                            | WISETECH GLOBAL LTD       | 44.735                        |                  | 2.998               | 92,33     | 2.529.662,63       | 0,38           |
| <b>lautend auf CAD</b>                                                                  |                           |                               |                  |                     |           |                    |                |
| CA01626P1484                                                                            | ALIMENTATION COUCHE-TARD  | 45.464                        | 1.398            | 3.085               | 77,68     | 2.412.110,62       | 0,36           |
| CA11777Q2099                                                                            | B2GOLD CORP.              | 478.330                       |                  | 18.915              | 3,60      | 1.176.116,87       | 0,18           |
| CA1366812024                                                                            | CANADIAN TIRE CORP.LTD.CL | 14.356                        |                  | 568                 | 133,81    | 1.312.025,82       | 0,20           |
| CA15101Q1081                                                                            | CELESTICA INC. SV         | 23.395                        | 23.395           |                     | 60,17     | 961.442,73         | 0,14           |
| CA12532H1047                                                                            | CGI INC. A SV             | 28.799                        | 883              | 1.865               | 139,58    | 2.745.496,93       | 0,41           |
| CA2918434077                                                                            | EMPIRE CO. LTD A          | 43.394                        |                  | 2.550               | 32,14     | 952.567,85         | 0,14           |
| CA3039011026                                                                            | FAIRFAX FINL HLDGS SV     | 1.140                         | 1.207            | 67                  | 1.508,03  | 1.174.181,39       | 0,18           |
| <b>lautend auf CHF</b>                                                                  |                           |                               |                  |                     |           |                    |                |
| CH0012032048                                                                            | ROCHE HLDG AG GEN.        | 7.653                         |                  | 291                 | 221,20    | 1.734.630,86       | 0,26           |
| CH0244767585                                                                            | UBS GROUP AG SF -,10      | 77.317                        |                  | 4.448               | 25,10     | 1.988.561,14       | 0,30           |
| <b>lautend auf DKK</b>                                                                  |                           |                               |                  |                     |           |                    |                |
| DK0010244508                                                                            | A.P.MOELL.-M.NAM B DK1000 | 963                           |                  | 38                  | 10.595,00 | 1.368.095,82       | 0,21           |
| DK0062498333                                                                            | NOVO-NORDISK AS B DK 0,1  | 36.251                        | 676              | 1.591               | 884,80    | 4.300.850,76       | 0,65           |
| <b>lautend auf GBP</b>                                                                  |                           |                               |                  |                     |           |                    |                |
| GB0004544929                                                                            | IMPERIAL BRANDS PLC LS-10 | 44.500                        |                  |                     | 18,24     | 950.712,14         | 0,14           |
| GB00BM8Q5M07                                                                            | JD SPORTS FASH. LS -,0005 | 1.506.500                     | 45.050           | 58.450              | 1,17      | 2.057.462,28       | 0,31           |
| GB0007188757                                                                            | RIO TINTO PLC LS-,10      | 38.050                        | 1.150            | 2.800               | 54,57     | 2.432.051,75       | 0,37           |
| GB00B019KW72                                                                            | SAINSBURY-J.- LS-28571428 | 533.254                       |                  | 21.100              | 2,62      | 1.638.936,59       | 0,25           |
| <b>lautend auf HKD</b>                                                                  |                           |                               |                  |                     |           |                    |                |
| CNE100000Q43                                                                            | AGRICULT.BNK OF CN H YC 1 | 3.571.000                     |                  | 210.000             | 3,57      | 1.518.814,11       | 0,23           |
| CNE1000001Z5                                                                            | BANK OF CHINA LTD H YC 1  | 3.517.000                     |                  | 207.000             | 3,63      | 1.520.987,17       | 0,23           |
| CNE1000002H1                                                                            | CHINA CONSTR. BANK H YC 1 | 2.337.000                     |                  | 92.000              | 5,07      | 1.411.605,13       | 0,21           |
| HK0000077468                                                                            | FAR EAST HORIZON          | 1.702.000                     |                  | 67.000              | 5,80      | 1.176.072,53       | 0,18           |
| CNE1000003W8                                                                            | PETROCHINA CO. LTD H YC 1 | 2.510.000                     |                  | 96.000              | 7,30      | 2.182.946,73       | 0,33           |
| KYG8187G1055                                                                            | SITC INTL HLDG.REGS HD-10 | 835.000                       |                  | 33.000              | 17,70     | 1.760.784,87       | 0,26           |
| <b>lautend auf NOK</b>                                                                  |                           |                               |                  |                     |           |                    |                |
| NO0010096985                                                                            | EQUINOR ASA NK 2,50       | 58.930                        | 61.210           | 2.280               | 300,15    | 1.501.909,63       | 0,23           |
| <b>lautend auf SEK</b>                                                                  |                           |                               |                  |                     |           |                    |                |
| SE0017486897                                                                            | ATLAS COPCO B FRIA. O.N.  | 176.220                       | 186.720          | 10.500              | 167,65    | 2.522.092,15       | 0,38           |
| SE0020050417                                                                            | BOLIDEN AB                | 68.299                        |                  | 2.580               | 365,80    | 2.132.849,65       | 0,32           |
| SE0000108656                                                                            | ERICSSON B (FRIA)         | 284.000                       |                  | 11.240              | 56,48     | 1.369.352,39       | 0,21           |
| SE0000115446                                                                            | VOLVO B (FRIA)            | 85.000                        | 90.560           | 5.560               | 284,50    | 2.064.445,36       | 0,31           |
| <b>lautend auf JPY</b>                                                                  |                           |                               |                  |                     |           |                    |                |
| JP3233250004                                                                            | JAPAN POST INSURANCE CO.  | 118.300                       |                  | 3.800               | 2.959,50  | 2.094.578,82       | 0,31           |
| JP3219000001                                                                            | KAMIGUMI CO. LTD          | 54.200                        |                  | 3.200               | 3.423,00  | 1.109.940,77       | 0,17           |
| JP3496400007                                                                            | KDDI CORP.                | 85.600                        | 2.500            | 5.800               | 4.380,00  | 2.243.063,12       | 0,34           |
| JP3877600001                                                                            | MARUBENI CORP.            | 152.400                       | 4.600            | 10.400              | 2.706,00  | 2.467.211,49       | 0,37           |

|              |                         |         |         |        |           |              |      |
|--------------|-------------------------|---------|---------|--------|-----------|--------------|------|
| JP3893600001 | MITSUI + CO.            | 52.900  | 24.800  | 3.000  | 7.519,00  | 2.379.629,67 | 0,36 |
| JP3362700001 | MITSUI OSK LINES        | 76.300  |         | 2.500  | 4.713,00  | 2.151.372,42 | 0,32 |
| JP3756600007 | NINTENDO CO. LTD        | 23.900  | 23.900  |        | 7.649,00  | 1.093.694,88 | 0,16 |
| JP3381000003 | NIPPON STEEL CORP.      | 102.100 |         | 3.300  | 3.444,00  | 2.103.693,69 | 0,32 |
| JP3422950000 | SEVEN + I HLDGS CO. LTD | 173.700 | 181.400 | 68.100 | 2.039,50  | 2.119.420,58 | 0,32 |
| JP3571400005 | TOKYO ELECTRON LTD      | 6.100   | 6.100   |        | 34.230,00 | 1.249.195,33 | 0,19 |

**lautend auf KRW**

|              |                         |         |  |       |           |              |      |
|--------------|-------------------------|---------|--|-------|-----------|--------------|------|
| KR7011200003 | HMM CO.LTD. SW5000      | 138.281 |  | 5.469 | 16.020,00 | 1.499.016,53 | 0,23 |
| KR7033780008 | KT+G CORP. SW 5000      | 20.314  |  | 803   | 89.800,00 | 1.234.392,24 | 0,19 |
| KR7032640005 | LG TELECOM LTD. SW 5000 | 182.588 |  | 7.220 | 9.900,00  | 1.223.175,65 | 0,18 |

**lautend auf PLN**

|              |                           |        |        |       |        |            |      |
|--------------|---------------------------|--------|--------|-------|--------|------------|------|
| PLPEKAO00016 | BANK POLSKA KASA OP. ZY 1 | 24.704 | 26.380 | 1.676 | 171,40 | 981.039,73 | 0,15 |
|--------------|---------------------------|--------|--------|-------|--------|------------|------|

**lautend auf USD**

|              |                           |         |        |        |          |               |      |
|--------------|---------------------------|---------|--------|--------|----------|---------------|------|
| US00287Y1091 | ABBVIE INC. DL-,01        | 22.512  | 670    | 1.320  | 161,52   | 3.390.022,60  | 0,51 |
| IE00B4BNMY34 | ACCENTURE A DL-,0000225   | 10.047  | 300    | 620    | 303,16   | 2.839.687,23  | 0,43 |
| US02005N1000 | ALLY FINANCIAL INC.DL-,10 | 89.740  | 2.740  | 5.540  | 39,16    | 3.276.355,03  | 0,49 |
| US02079K1079 | ALPHABET INC.CL C DL-,001 | 29.310  | 9.430  | 560    | 167,90   | 4.588.056,13  | 0,69 |
| US0378331005 | APPLE INC.                | 71.780  | 1.160  | 3.990  | 173,50   | 11.610.880,10 | 1,74 |
| US0382221051 | APPLIED MATERIALS INC.    | 19.193  | 580    | 1.130  | 205,26   | 3.672.902,46  | 0,55 |
| BMG0450A1053 | ARCH CAPITAL GROUP DL-,01 | 25.610  |        | 1.880  | 91,25    | 2.178.736,25  | 0,33 |
| US00215W1009 | ASE TECHN.HLDG.CO.LTD.    | 121.340 |        | 7.130  | 10,33    | 1.168.601,72  | 0,18 |
| US0530151036 | AUTOM. DATA PROC. DL -,10 | 7.980   |        | 320    | 243,95   | 1.814.955,25  | 0,27 |
| US0533321024 | AUTOZONE INC. DL-,01      | 1.110   |        | 40     | 2.998,78 | 3.103.343,09  | 0,47 |
| US0865161014 | BEST BUY CO. DL-,10       | 18.834  |        | 750    | 75,00    | 1.316.940,15  | 0,20 |
| US12008R1077 | BUILDERS FIRSTSOUR.DL-,01 | 11.530  |        | 880    | 187,46   | 2.015.116,35  | 0,30 |
| IL0010824113 | CHECK POINT SOFTW. TECHS  | 15.501  | 470    | 1.050  | 150,46   | 2.174.417,73  | 0,33 |
| US1255231003 | CIGNA GROUP, THE DL 1     | 9.603   | 280    | 590    | 356,44   | 3.191.211,37  | 0,48 |
| US20030N1019 | COMCAST CORP. A DL-,01    | 71.324  | 2.180  | 4.620  | 38,85    | 2.583.383,74  | 0,39 |
| US23331A1097 | D.R.HORTON INC. DL-,01    | 16.180  |        | 11.290 | 145,97   | 2.201.934,18  | 0,33 |
| US2547091080 | DISCOVER FINL SRVCS DL-01 | 17.170  |        | 680    | 128,00   | 2.049.002,42  | 0,31 |
| US29278D1054 | ENEL CHILE SA ADR REGS/50 | 478.530 |        | 18.920 | 3,08     | 1.374.111,88  | 0,21 |
| US29414B1044 | EPAM SYSTEMS INC. DL-,001 | 7.545   |        | 270    | 239,21   | 1.682.677,09  | 0,25 |
| US3666511072 | GARTNER INC. DL -,0005    | 3.390   |        | 200    | 448,65   | 1.417.978,28  | 0,21 |
| US4278661081 | HERSHEY CO. DL 1          | 9.820   |        | 370    | 192,47   | 1.762.125,12  | 0,26 |
| US4039491000 | HF SINCLAIR CORP. DL-,01  | 39.410  |        | 1.240  | 57,86    | 2.125.920,75  | 0,32 |
| US4370761029 | HOME DEPOT INC. DL-,05    | 11.660  | 340    | 650    | 336,80   | 3.661.279,13  | 0,55 |
| US40434L1052 | HP INC DL -,01            | 70.040  |        | 2.660  | 28,27    | 1.846.010,44  | 0,28 |
| US4824801009 | KLA CORP. DL -,001        | 3.990   | 170    | 2.290  | 713,93   | 2.655.771,68  | 0,40 |
| US5128071082 | LAM RESEARCH CORP.DL-,001 | 3.199   | 140    | 2.030  | 928,81   | 2.770.150,28  | 0,42 |
| US5260571048 | LENNAR CORP.A DL-,10      | 24.070  | 730    | 1.420  | 155,47   | 3.488.870,87  | 0,52 |
| US30303M1027 | META PLATF. A DL-,000006  | 13.169  | 290    | 3.340  | 432,62   | 5.311.553,96  | 0,80 |
| US5949181045 | MICROSOFT DL-,00000625    | 33.660  | 540    | 1.870  | 402,25   | 12.623.284,54 | 1,89 |
| US60770K1079 | MODERNA INC. DL-,0001     | 15.530  |        | 590    | 111,62   | 1.616.127,73  | 0,24 |
| US67066G1040 | NVIDIA CORP. DL-,001      | 4.520   | 4.520  |        | 877,57   | 3.698.132,02  | 0,56 |
| US62944T1051 | NVR INC. DL-,01           | 480     | 10     | 30     | 7.540,00 | 3.374.230,84  | 0,51 |
| US6795801009 | OLD DOMIN.FR.LINE DL-,10  | 11.060  | 11.060 | 5.710  | 184,24   | 1.899.771,02  | 0,29 |
| US7223041028 | PDD HOLDINGS SP.ADR/4     | 17.800  | 18.960 | 1.160  | 126,82   | 2.104.601,90  | 0,32 |
| US71654V1017 | PETROL.BRAS.PFD ADR/2 O.N | 149.860 | 87.590 | 9.290  | 16,41    | 2.292.749,02  | 0,34 |
| US78442P1066 | SLM CORP. DL-,20          | 116.020 |        | 8.670  | 21,63    | 2.339.653,74  | 0,35 |
| US8330341012 | SNAP-ON INC. DL 1         | 9.059   | 270    | 610    | 272,25   | 2.299.377,91  | 0,35 |
| US87165B1035 | SYNCHRONY FIN. DL-,001    | 40.460  |        | 1.740  | 44,70    | 1.686.147,68  | 0,25 |
| US8740391003 | TAIWAN SEMICON.MANU.ADR/5 | 17.550  | 17.550 |        | 138,50   | 2.266.152,34  | 0,34 |
| US8816242098 | TEVA PHARMACEUT. SP.ADR   | 76.720  | 76.720 |        | 14,10    | 1.008.532,54  | 0,15 |
| US9139031002 | UNIV. HEALTH SERV.B DL-01 | 14.174  |        | 960    | 169,12   | 2.234.856,31  | 0,34 |
| US9108734057 | UTD MICROELECTR.ADR NEW/5 | 258.470 |        | 9.820  | 7,79     | 1.877.196,81  | 0,28 |
| US92532F1003 | VERTEX PHARMAC. DL-,01    | 6.500   | 280    | 3.610  | 396,20   | 2.400.988,25  | 0,36 |

**lautend auf ZAR**

|              |                      |         |         |        |       |              |      |
|--------------|----------------------|---------|---------|--------|-------|--------------|------|
| ZAE000083648 | IMPALA PLATINUM O.N. | 552.706 | 312.236 | 18.738 | 89,70 | 2.481.603,77 | 0,37 |
|--------------|----------------------|---------|---------|--------|-------|--------------|------|

**Anleihen****lautend auf EUR**

|              |                                    |       |       |  |        |              |      |
|--------------|------------------------------------|-------|-------|--|--------|--------------|------|
| XS2283224231 | 0,0000 % AGPS BONDCO 21/26         | 400   |       |  | 38,05  | 152.180,00   | 0,02 |
| XS2336188029 | 0,0000 % AGPS BONDCO 21/27 MTN     | 200   |       |  | 37,49  | 74.980,00    | 0,01 |
| FR0013378452 | 0,0000 % ATOS 18-25                | 900   |       |  | 23,19  | 208.683,00   | 0,03 |
| FR0013378460 | 0,0000 % ATOS 18-28                | 2.500 |       |  | 22,55  | 563.675,00   | 0,08 |
| FR0014006G24 | 0,0000 % ATOS 21/29                | 1.800 |       |  | 22,59  | 406.692,00   | 0,06 |
| XS1951067039 | 0,0000 % CBOM FIN. 19/24 REGS      | 1.000 |       |  | 5,00   | 50.000,00    | 0,01 |
| QOXDBM077031 | 0,0000 % COOP.MURATO.+CEMENT.17/23 | 4.500 |       |  | 0,00   | 45,00        | 0,00 |
| XS0300055547 | 0,0000 % LEHMAN BROTH.07/12FLR MTN | 150   |       |  | 0,14   | 216,00       | 0,00 |
| LU2162831981 | 0,0000 % LUXEMBURG 20/30           | 2.000 | 2.000 |  | 84,07  | 1.681.340,00 | 0,25 |
| XS0161702914 | 0,0000 % NIBC BANK 03/43 ZO MTN    | 450   |       |  | 309,01 | 1.390.531,50 | 0,21 |
| XS1843437036 | 0,0000 % RZD CAPITAL 19/27         | 5.000 |       |  | 58,00  | 2.900.000,00 | 0,44 |

|              |                                    |        |       |        |              |      |
|--------------|------------------------------------|--------|-------|--------|--------------|------|
| DE000A3KS5R1 | 0,0000 % SIGNA DEV.F. 21/26 REGS   | 2.200  |       | 13,65  | 300.300,00   | 0,05 |
| XS2015264778 | 0,0000 % UKRAINE 19/28 REGS        | 4.850  |       | 27,43  | 1.330.258,00 | 0,20 |
| DE000A2YNQ58 | 0,0000 % WIRECARD AG 19/24REG.S    | 3.000  |       | 16,93  | 507.900,00   | 0,08 |
| XS2369244087 | 0,1000 % CHILE 21/27               | 2.080  |       | 90,80  | 1.888.660,80 | 0,28 |
| FR0013327491 | 0,1000 % REP. FSE 18-36 O.A.T.     | 1.000  |       | 92,37  | 935.562,29   | 0,14 |
| XS2177363665 | 0,1250 % ARGENTINIEN 20/30         | 2.328  |       | 54,46  | 1.267.898,64 | 0,19 |
| IT0005436701 | 0,1500 % ITALIEN 21/51 FLR         | 3.000  |       | 64,74  | 1.818.360,56 | 0,27 |
| XS2296027217 | 0,2500 % CORP.ANDINA 21/26 MTN     | 380    |       | 93,77  | 356.322,20   | 0,05 |
| AT0000A2T198 | 0,2500 % OESTERREICH 21/36 MTN     | 4.000  |       | 70,91  | 2.836.200,00 | 0,43 |
| XS2338991941 | 0,2500 % QUEBEC,PROV 21/31 MTN     | 1.390  |       | 81,97  | 1.139.383,00 | 0,17 |
| XS0943753631 | 0,3000 % UNICR.BK AUS. 13/29 MTN   | 300    |       | 113,46 | 340.365,36   | 0,05 |
| XS2421195848 | 0,3750 % AROUNDTOWN 21/27 MTN      | 1.000  |       | 84,51  | 845.070,00   | 0,13 |
| XS2348280707 | 0,3750 % MFB 21/26                 | 1.450  |       | 91,75  | 1.330.360,50 | 0,20 |
| IT0005387052 | 0,4000 % ITALIEN 19/30 FLR         | 2.100  |       | 94,07  | 1.974.417,25 | 0,30 |
| XS0742363327 | 0,4200 % UNICR.BK AUS. 12/27 MTN   | 600    |       | 148,33 | 889.994,39   | 0,13 |
| XS2382953789 | 0,4500 % CZECH GAS N. 21/29        | 500    |       | 83,51  | 417.540,00   | 0,06 |
| EU000A3KT6B1 | 0,4500 % EU 21/41 MTN              | 2.000  |       | 63,47  | 1.269.340,00 | 0,19 |
| XS2200244072 | 0,5000 % ARGENTINA 20/29           | 133    |       | 55,16  | 73.285,70    | 0,01 |
| XS2361047538 | 0,5000 % BKRAJOWEGO 21/31 MTN      | 4.950  |       | 78,77  | 3.898.917,00 | 0,59 |
| FR0014001NN8 | 0,5000 % FRANKREICH 21/72          | 5.500  | 450   | 37,79  | 2.078.450,00 | 0,31 |
| XS2296207116 | 0,5000 % INVESTEC BK 21/27 FLR MTN | 1.100  |       | 93,63  | 1.029.875,00 | 0,15 |
| ES0000012132 | 0,5000 % SPANIEN 21/31             | 3.300  |       | 83,01  | 2.739.462,00 | 0,41 |
| XS2080785343 | 0,5000 % TEMASEK FINL 19/31 MTN    | 460    |       | 80,91  | 372.190,60   | 0,06 |
| XS2078696866 | 0,6250 % GRENKE FIN. 19/25 MTN     | 500    |       | 97,31  | 486.525,00   | 0,07 |
| XS2182399274 | 0,6250 % ISLAND 20/26 MTN          | 2.000  | 450   | 94,34  | 1.886.740,00 | 0,28 |
| EU000A3KTGW6 | 0,7000 % EU 21/51 MTN              | 2.430  |       | 54,18  | 1.316.525,40 | 0,20 |
| AT0000A2QQB6 | 0,7000 % OESTERREICH 21/71 MTN     | 5.000  |       | 44,29  | 2.214.350,00 | 0,33 |
| ES0000012C12 | 0,7000 % SPANIEN 18/33 FLR         | 2.500  |       | 96,74  | 2.439.646,36 | 0,37 |
| FR0014004J31 | 0,7500 % FRANKREICH 21/53 O.A.T.   | 11.500 | 2.000 | 51,76  | 5.951.940,00 | 0,88 |
| AT0000A2EJ08 | 0,7500 % OESTERREICH 20/51 MTN     | 1.500  |       | 57,36  | 860.325,00   | 0,13 |
| XS1843433639 | 0,8300 % CHILE 19/31               | 500    |       | 82,28  | 411.375,00   | 0,06 |
| ES0000012I24 | 0,8500 % SPANIEN 21/37             | 3.810  |       | 72,15  | 2.748.915,00 | 0,41 |
| XS2379637767 | 0,8750 % AS LHV GRP 21/25          | 1.250  |       | 97,73  | 1.221.637,50 | 0,18 |
| XS2322438990 | 0,8750 % CZECH GAS N. 21/31        | 1.350  |       | 80,86  | 1.091.569,50 | 0,16 |
| XS2407028435 | 0,8750 % MVM ENERGET. 21/27        | 1.800  |       | 87,21  | 1.569.762,00 | 0,24 |
| XS2125123039 | 0,8750 % SWED.MATCH 20/27 MTN      | 150    |       | 92,49  | 138.730,50   | 0,02 |
| AT0000A2WSC8 | 0,9000 % OESTERREICH 22/32 MTN     | 8.000  | 2.000 | 86,19  | 6.894.960,00 | 1,03 |
| XS2388876232 | 0,9660 % MBANK 21/27 FLR MTN       | 1.600  |       | 90,28  | 1.444.480,00 | 0,22 |
| XS2066744231 | 1,0000 % CARNIVAL 19/29            | 2.100  |       | 79,12  | 1.661.457,00 | 0,25 |
| XS2315951041 | 1,0000 % EURAS.DEV.BK 21/26 MTN    | 2.420  |       | 86,70  | 2.098.055,30 | 0,32 |
| XS2366690332 | 1,0000 % INDONESIA 21/29           | 680    |       | 86,60  | 588.846,00   | 0,09 |
| XS2348241048 | 1,0000 % RBANK 21/28 FLR MTN       | 2.500  |       | 89,82  | 2.245.475,00 | 0,34 |
| SK4000019857 | 1,0000 % SLOWAKEI 21/51            | 2.500  | 2.500 | 53,34  | 1.333.475,00 | 0,20 |
| ES00000127C8 | 1,0000 % SPANIEN 15-30 FLR         | 2.250  |       | 100,94 | 2.304.577,03 | 0,35 |
| DE000A3MP7K3 | 1,1250 % KRED.F.WIED.22/37 MTN     | 5.000  |       | 79,82  | 3.990.800,00 | 0,60 |
| XS2309428113 | 1,1250 % KROATIEN 21/33            | 1.000  |       | 82,78  | 827.760,00   | 0,12 |
| XS2346224806 | 1,1250 % SBB TREASURY 21/29 MTN    | 700    |       | 60,30  | 422.107,00   | 0,06 |
| XS2339399946 | 1,2500 % ANDORRA 21/31 MTN         | 1.000  |       | 84,88  | 848.790,00   | 0,13 |
| XS2445667236 | 1,2500 % ANDORRA 22/27 MTN         | 1.000  |       | 92,84  | 928.400,00   | 0,14 |
| IT0005138828 | 1,2500 % B.T.P. 15-32 FLR          | 400    |       | 98,13  | 394.704,51   | 0,06 |
| XS2239091080 | 1,2500 % BLACK SEA T. 20/30 MTN    | 4.900  |       | 73,81  | 3.616.592,00 | 0,54 |
| XS2314020806 | 1,2500 % PERU 21/33                | 1.000  |       | 78,14  | 781.380,00   | 0,12 |
| IT0005246134 | 1,3000 % B.T.P. 17-28 FLR          | 2.100  |       | 100,08 | 2.134.184,90 | 0,32 |
| XS1195465676 | 1,3750 % TYCO INTL FIN. 15/25      | 500    |       | 96,97  | 484.845,00   | 0,07 |
| XS2069959398 | 1,4000 % INDONESIA 19/31           | 600    |       | 84,07  | 504.420,00   | 0,08 |
| MT0000013202 | 1,4000 % MALTA 21/46               | 1.000  |       | 61,74  | 617.360,00   | 0,09 |
| DE000NRW0M92 | 1,4500 % LAND NRW MTN.LSA R.1531   | 2.000  |       | 51,73  | 1.034.520,00 | 0,16 |
| ES0000012H58 | 1,4500 % SPANIEN 21/71             | 1.000  |       | 48,97  | 489.730,00   | 0,07 |
| XS2290544068 | 1,5000 % CPI PROP.GRP 21/31 MTN    | 2.500  |       | 66,02  | 1.650.575,00 | 0,25 |
| FR00140005C6 | 1,5000 % EUTELSAT 20/28            | 800    | 800   | 73,56  | 588.480,00   | 0,09 |
| XS1551294256 | 1,5000 % ISRAEL 17/27 MTN          | 1.100  | 1.100 | 92,27  | 1.014.915,00 | 0,15 |
| IT0005543803 | 1,5000 % ITALIEN 23/29 FLR         | 2.500  | 2.500 | 100,44 | 2.570.088,57 | 0,39 |
| XS2015296465 | 1,5000 % SERBIEN 19/29 REGS        | 1.000  |       | 83,99  | 839.940,00   | 0,13 |
| SI0002103487 | 1,5000 % SLOWENIEN 15-35           | 3.000  |       | 84,66  | 2.539.830,00 | 0,38 |
| XS2259191430 | 1,5000 % UNGARN 20/50              | 1.000  |       | 55,66  | 556.630,00   | 0,08 |
| XS2398746144 | 1,6250 % BPP EU.HLDG. 21/30 MTN    | 1.750  |       | 84,26  | 1.474.497,50 | 0,22 |
| XS1725553066 | 1,6250 % CGNPC INT. 17/24          | 600    |       | 98,18  | 589.074,00   | 0,09 |
| XS2190979489 | 1,6250 % EUSTREAM 20/27            | 638    |       | 87,67  | 559.328,22   | 0,08 |
| XS2397252011 | 1,6250 % HEIMSTADEN 21/31 MTN      | 1.000  |       | 72,58  | 725.770,00   | 0,11 |
| XS2310118893 | 1,6250 % NORDMAZEDON. 21/28 REGS   | 500    |       | 87,49  | 437.465,00   | 0,07 |
| BE0000348574 | 1,7000 % BELGIQUE 19/50            | 1.800  |       | 70,51  | 1.269.126,00 | 0,19 |
| XS2364199757 | 1,7500 % RUMAENIEN 21/30 MTN REGS  | 490    |       | 81,19  | 397.845,70   | 0,06 |
| MT0000013293 | 1,8000 % MALTA 21/51               | 3.100  |       | 62,18  | 1.927.456,00 | 0,29 |
| XS1953056253 | 1,8750 % LETTLAND,REP 19/49 MTN    | 450    |       | 70,40  | 316.777,50   | 0,05 |
| XS2073758885 | 1,8750 % PERUSA.LISTR 19/31 REGS   | 1.930  |       | 82,40  | 1.590.300,70 | 0,24 |

|              |                                     |       |       |        |              |              |      |
|--------------|-------------------------------------|-------|-------|--------|--------------|--------------|------|
| SK4120012691 | 1,8750 % SLOWAKEI 17/37 MTN         | 2.800 |       | 80,75  | 2.261.112,00 | 0,34         |      |
| XS2408608219 | 1,9500 % PERU 21/36                 | 1.050 |       | 75,69  | 794.787,00   | 0,12         |      |
| XS2539425095 | 10,0000 % BK VALLETTA 22/27 FLR MTN | 1.230 |       | 109,61 | 1.348.215,30 | 0,20         |      |
| XS2724532333 | 10,5000 % AMS-OSRAM 23/29 REGS      | 300   | 300   | 99,82  | 299.448,00   | 0,05         |      |
| XS1829261087 | 2,0000 % BK GOSPOD.KRAJ. 18/30 MTN  | 850   |       | 89,89  | 764.090,50   | 0,11         |      |
| SK4120013400 | 2,0000 % SLOWAKEI 17-47             | 2.530 |       | 70,51  | 1.783.776,50 | 0,27         |      |
| CH1170565753 | 2,0200 % ZUER.KB 22/28 FLR          | 860   |       | 94,75  | 814.824,20   | 0,12         |      |
| AT0000A1XML2 | 2,1000 % AUSTRIA 17/2117 MTN        | 4.700 |       | 73,96  | 3.476.073,00 | 0,52         |      |
| XS2487342649 | 2,1250 % LITAUEN 22/32 MTN          | 2.500 |       | 90,30  | 2.257.525,00 | 0,34         |      |
| IT0005441883 | 2,1500 % ITALIEN 21/72              | 2.550 |       | 61,50  | 1.568.275,50 | 0,24         |      |
| DE000NRW0LQ9 | 2,1500 % LAND NRW SCHATZ 19 R1479   | 950   |       | 71,19  | 676.257,50   | 0,10         |      |
| XS2206379567 | 2,2500 % AMCO 20/27 MTN             | 1.000 |       | 95,08  | 950.820,00   | 0,14         |      |
| XS2388910270 | 2,2500 % BRANICKS GRP ANL 21/26     | 2.100 | 500   | 33,04  | 693.903,00   | 0,10         |      |
| XS2363910436 | 2,2500 % MEXIKO 21/36               | 1.000 |       | 77,79  | 777.880,00   | 0,12         |      |
| XS2114871945 | 2,2500 % SAMHALLSBYG. 20/27 MTN     | 1.000 |       | 67,51  | 675.050,00   | 0,10         |      |
| XS2418392143 | 2,3750 % UNIQA INSUR. 21/41 FLR     | 700   |       | 84,10  | 588.665,00   | 0,09         |      |
| MT0000012725 | 2,4000 % MALTA 2041 I               | 990   |       | 80,94  | 800.930,99   | 0,12         |      |
| XS2367164576 | 2,4500 % BULG EN EAD 21/28          | 570   |       | 89,39  | 509.494,50   | 0,08         |      |
| IT0005398406 | 2,4500 % ITALIEN 19/50              | 1.850 |       | 72,21  | 1.335.848,00 | 0,20         |      |
| XS1795409082 | 2,5000 % GAZ CAPITAL 18/26 MTN      | 600   |       | 69,50  | 417.000,00   | 0,06         |      |
| XS2243564478 | 2,5000 % IMMOFINANZ 20/27           | 1.500 |       | 79,93  | 1.198.935,00 | 0,18         |      |
| MT0000012642 | 2,5000 % MALTA 2036 I               | 150   |       | 87,44  | 131.156,50   | 0,02         |      |
| IT0004545890 | 2,5500 % B.T.P. 09-41 FLR           | 7.000 |       | 108,78 | 9.115.864,54 | 1,36         |      |
| XS2050982755 | 2,5500 % MONTENEGRO 19/29 REGS      | 580   |       | 86,46  | 501.450,60   | 0,08         |      |
| XS2294495838 | 2,6250 % ATRIUM FINANCE 21/27 MTN   | 1.300 |       | 81,05  | 1.053.585,00 | 0,16         |      |
| XS2288824969 | 2,7500 % BOAD 21/33 REGS            | 1.910 |       | 77,54  | 1.480.994,90 | 0,22         |      |
| XS1744744191 | 2,7500 % NORDMAZEDONIEN 18/25 REGS  | 350   |       | 98,20  | 343.682,50   | 0,05         |      |
| FR0013134897 | 2,8500 % CREDIT AGRI. 16-26         | 550   |       | 97,64  | 537.009,00   | 0,08         |      |
| XS2238783778 | 2,8750 % JTIFS 20/83 FLR MTN        | 430   |       | 93,90  | 403.782,90   | 0,06         |      |
| XS1420357318 | 2,8750 % RUMAENIEN 16/28 MTN REGS   | 450   |       | 93,78  | 422.023,50   | 0,06         |      |
| XS1892141620 | 2,8750 % RUMAENIEN 18/29 MTN REGS   | 1.730 |       | 92,03  | 1.592.119,00 | 0,24         |      |
| XS2364200514 | 2,8750 % RUMAENIEN 21/42 MTN REGS   | 500   |       | 65,86  | 329.285,00   | 0,05         |      |
| CH1174335740 | 2,8750 % UBS GROUP 22/32 FLR MTN    | 1.800 |       | 92,93  | 1.672.812,00 | 0,25         |      |
| XS1721422902 | 2,8750 % VODAFONE GRP 17/37 MTN     | 500   |       | 89,60  | 447.975,00   | 0,07         |      |
| DE000A0DEN75 | 2,9440 % D.POSTBANK FDG TR.04/UND.  | 200   |       | 83,10  | 166.190,00   | 0,02         |      |
| XS2177365363 | 3,0000 % ARGENTINA 20/41            | 5.500 |       | 38,55  | 2.120.470,00 | 0,32         |      |
| EU000A3K4DY4 | 3,0000 % EU 22/53 MTN               | 600   | 600   | 93,28  | 559.686,00   | 0,08         |      |
| DE000SLB4360 | 3,0000 % LDSBK.SAAR OPF A436        | 500   | 500   | 98,65  | 493.255,00   | 0,07         |      |
| MT0000012519 | 3,0000 % MALTA 2040 I               | 200   |       | 89,36  | 178.712,00   | 0,03         |      |
| BE6275292710 | 3,0000 % ORES 15/45                 | 700   | 200   | 78,66  | 550.627,00   | 0,08         |      |
| XS1091799061 | 3,0000 % PGE SWEDEN 14/29 MTN       | 1.900 |       | 90,36  | 1.716.802,00 | 0,26         |      |
| XS1824277641 | 3,0160 % COMP.DE ST.-GOBAIN 18/33   | 700   |       | 86,17  | 603.162,00   | 0,09         |      |
| IT0003874523 | 3,0850 % ITALIEN 05/35 MTN          | 500   |       | 82,69  | 413.425,00   | 0,06         |      |
| XS1731657497 | 3,0880 % LAZIO, REGION 17/43        | 420   |       | 90,48  | 310.676,59   | 0,05         |      |
| XS2802866728 | 3,1250 % ALBERTA 24/34 MTN          | 580   | 580   | 98,85  | 573.335,80   | 0,09         |      |
| XS1843443786 | 3,1250 % ALTRIA GRP 19/31           | 770   |       | 92,50  | 712.234,60   | 0,11         |      |
| XS2170186923 | 3,1250 % SERBIEN 20/27 REGS         | 320   |       | 95,79  | 306.537,60   | 0,05         |      |
| SI0002103552 | 3,1250 % SLOWENIEN 15-45            | 1.000 |       | 94,83  | 948.250,00   | 0,14         |      |
| AT0000A0VRQ6 | 3,1500 % AUSTRIA 12/44 MTN          | 1.000 |       | 99,57  | 995.660,00   | 0,15         |      |
| XS2740429076 | 3,2500 % ESTLAND 24/34 MTN          | 2.100 | 2.100 | 96,80  | 2.032.779,00 | 0,31         |      |
| LU2591861021 | 3,2500 % LUXEMBURG 23/43            | 3.200 |       | 100,94 | 3.230.208,00 | 0,49         |      |
| FR0013407418 | 3,3750 % CR.MUT.ARKEA 19/31 MTN     | 1.000 |       | 93,78  | 937.750,00   | 0,14         |      |
| XS2367103780 | 3,3750 % DOVALUE 21/26 REGS         | 400   |       | 88,67  | 354.684,00   | 0,05         |      |
| EU000A3K4D74 | 3,3750 % EU 23/38 MTN               | 870   |       | 101,66 | 884.476,80   | 0,13         |      |
| GR0124040743 | 3,3750 % GRIECHENLAND 24/34         | 1.900 | 1.900 | 98,80  | 1.877.276,00 | 0,28         |      |
| XS2263659158 | 3,3750 % HOIST FIN. 20/24 MTN       | 300   |       | 98,30  | 294.894,00   | 0,04         |      |
| XS2203802462 | 3,3750 % NE PROPERTY 20/27 MTN      | 870   |       | 96,31  | 837.923,10   | 0,13         |      |
| XS1589970968 | 3,5000 % DISTR.INTL DE ALIM. 17/26  | 1.900 |       | 80,00  | 1.539.990,74 | 0,23         |      |
| XS2765498717 | 3,5000 % LITAUEN 24/34 MTN          | 1.100 | 1.100 | 98,35  | 1.081.839,00 | 0,16         |      |
| XS0926478628 | 3,5000 % TEOLLIS.VOIMA OYJ13/30MTN  | 2.000 |       | 92,86  | 1.857.120,00 | 0,28         |      |
| XS0911388832 | 3,5000 % VOLKSWAGEN INTL 13/43 MTN  | 600   |       | 83,15  | 498.900,00   | 0,07         |      |
| XS2471770862 | 3,6250 % BPP EU.HLDG. 22/29 MTN     | 300   |       | 94,75  | 284.247,00   | 0,04         |      |
| XS2763029571 | 3,6250 % CORP.ANDINA 24/30 MTN      | 1.640 | 1.640 | 99,40  | 1.630.094,40 | 0,25         |      |
| XS1879567144 | 3,6400 % AROUNDTOWN 18/30 FLR       | 1.400 |       | 76,80  | 1.075.263,00 | 0,16         |      |
| XS2177365017 | 3,7500 % ARGENTINA 20/38            | 1.250 |       | 43,98  | 549.787,50   | 0,08         |      |
| XS0928529899 | 3,7500 % AUTOSTRADE IT. 13/33 MTN   | 1.600 |       | 89,64  | 1.434.160,00 | 0,22         |      |
| XS1373156618 | 3,7500 % PERU 16/30                 | 360   |       | 98,31  | 353.919,60   | 0,05         |      |
| SK4000022539 | 3,7500 % SLOWAKEI 23/35             | 4.100 | 3.600 | 3.000  | 100,07       | 4.102.952,00 | 0,62 |
| XS1090107159 | 3,7500 % SOUTH AFR. 14/26           | 750   |       | 97,45  | 730.867,50   | 0,11         |      |
| IT0005363111 | 3,8500 % ITALIEN 19/49              | 3.100 |       | 93,77  | 2.906.777,00 | 0,44         |      |
| XS1385239006 | 3,8750 % COLOMBIA 16/26             | 200   |       | 98,71  | 197.426,00   | 0,03         |      |
| XS2604821228 | 3,8750 % LITAUEN 23/33 MTN          | 240   |       | 102,03 | 244.869,60   | 0,04         |      |
| XS1313004928 | 3,8750 % RUMAENIEN 15/35 MTN REGS   | 1.500 |       | 84,40  | 1.266.045,00 | 0,19         |      |
| XS0850228577 | 3,8750 % TEOLLIS.VOIMA OY 12/32MTN  | 500   |       | 81,47  | 407.360,00   | 0,06         |      |
| XS2187689380 | 3,8750 % VW INTL.FIN 20/UND. FLR    | 600   |       | 92,57  | 555.420,00   | 0,08         |      |

|               |                                    |       |       |        |              |      |
|---------------|------------------------------------|-------|-------|--------|--------------|------|
| XS0768450933  | 3,9500 % LANXESS AG 12/27 MTN      | 300   | 300   | 98,58  | 295.725,00   | 0,04 |
| XS2530208490  | 4,0000 % BKRAJOWEGO 22/27 MTN      | 1.350 |       | 100,70 | 1.359.477,00 | 0,20 |
| DE000DL19WN3  | 4,0000 % DT.BANK FIXED 22/32 SUB.  | 400   |       | 96,42  | 385.692,00   | 0,06 |
| XS1218289103  | 4,0000 % MEXICO 15/2115 MTN        | 1.000 |       | 77,20  | 772.030,00   | 0,12 |
| SK4000022547  | 4,0000 % SLOWAKEI 23/43            | 500   |       | 100,63 | 503.170,00   | 0,08 |
| XS0236470521  | 4,0220 % SARDINIEN REG. 05/35 MTN  | 900   |       | 96,05  | 470.705,41   | 0,07 |
| PTOTE5OE0007  | 4,1000 % PORTUGAL 06-37            | 750   |       | 108,61 | 814.597,50   | 0,12 |
| XS2645248225  | 4,1250 % CHILE 23/34               | 2.155 |       | 101,30 | 2.182.635,40 | 0,33 |
| GR0138018842  | 4,1250 % GRIECHENLAND 24/54        | 800   | 800   | 100,45 | 803.584,00   | 0,12 |
| XS1910948675  | 4,1250 % VOLKSWAGEN INTL 18/38     | 800   |       | 101,25 | 809.968,00   | 0,12 |
| DE000WBP0A20  | 4,1250 % WUESTENROT BAUSPK.17/27   | 500   |       | 97,67  | 488.342,50   | 0,07 |
| DE000A0E8203  | 4,1650 % KRED.F.WIED.05/25 MTN     | 170   |       | 100,07 | 170.116,17   | 0,03 |
| FI4000507132  | 4,2500 % FINNAIR 21/25             | 1.450 |       | 99,76  | 1.446.447,50 | 0,22 |
| XS2586944147  | 4,2500 % POLEN 23/43 MTN           | 2.190 |       | 101,80 | 2.229.441,90 | 0,34 |
| XS0132424028  | 4,2680 % HYPO TIROL 01/26FLR MTN   | 1.650 | 50    | 98,32  | 1.622.205,75 | 0,24 |
| GR0128012698  | 4,3000 % GRIECHENLAND 12-25 3      | 1     |       | 100,29 | 887,58       | 0,00 |
| GR0128013704  | 4,3000 % GRIECHENLAND 12-26 4      | 8     |       | 101,01 | 8.196,64     | 0,00 |
| GR0128014710  | 4,3000 % GRIECHENLAND 12-27 5      | 1     |       | 102,59 | 1.123,31     | 0,00 |
| XS0136314415  | 4,3540 % UNICR.BK AUS. 01/31MTNFLR | 700   |       | 94,06  | 658.399,00   | 0,10 |
| DE000A30WVFV1 | 4,3750 % DT.PFBR.BANK MTN.35416    | 500   | 500   | 94,17  | 470.840,00   | 0,07 |
| XS2778274410  | 4,3750 % GOSPO.KRAJO. 24/39 MTN    | 1.880 | 1.880 | 99,60  | 1.872.404,80 | 0,28 |
| XS2629470761  | 4,3750 % ROBERT BOSCH MTN.23/43    | 600   |       | 103,06 | 618.354,00   | 0,09 |
| XS2406607171  | 4,3750 % TEV.P.F.N.II 21/30        | 1.170 |       | 95,89  | 1.121.924,70 | 0,17 |
| XS2576550672  | 4,3750 % THAMES WATER 23/31 MTN    | 600   | 600   | 86,90  | 521.418,00   | 0,08 |
| XS1980276858  | 4,3750 % ZAVAGLAV 19/49 FLR        | 1.200 |       | 83,09  | 997.080,00   | 0,15 |
| XS0822571799  | 4,3830 % CEZ AS 12/47 MTN          | 2.000 |       | 88,77  | 1.775.420,00 | 0,27 |
| IT0005518128  | 4,4000 % ITALIEN 22/33             | 4.000 |       | 105,43 | 4.217.280,00 | 0,63 |
| XS0140838474  | 4,4190 % UNICR.BK AUS. 01/29FLRMTN | 200   |       | 95,96  | 191.927,00   | 0,03 |
| XS0247541971  | 4,4250 % C.C.T. 06-36 FLR          | 3.500 |       | 100,37 | 3.512.775,00 | 0,53 |
| MT0000012337  | 4,4500 % MALTA 2032 II             | 100   |       | 105,49 | 105.491,67   | 0,02 |
| XS0134061893  | 4,4530 % UNICR.BK AUS. 01/33FLRMTN | 700   |       | 90,10  | 630.686,00   | 0,09 |
| XS2385150177  | 4,5000 % BUEN.AIR.PRO 21/37 REGS   | 6.040 | 228   | 32,95  | 1.990.277,17 | 0,30 |
| XS2385150508  | 4,5000 % BUEN.AIR.PRO 21/37 REGS   | 985   |       | 36,59  | 353.677,97   | 0,05 |
| IT0005534141  | 4,5000 % ITALIEN 23/53             | 3.920 | 1.920 | 102,82 | 4.030.465,60 | 0,61 |
| DE000A2DASM5  | 4,6000 % DT.PFBR.BANK MTN.35274    | 1.700 |       | 59,45  | 1.010.667,00 | 0,15 |
| XS2536817484  | 4,6250 % BULGARIEN 22/34 MTN       | 3.380 |       | 105,83 | 3.577.087,80 | 0,54 |
| XS1968706876  | 4,6250 % RUMAENIEN 19/49 MTN REGS  | 2.150 |       | 83,69  | 1.799.399,50 | 0,27 |
| XS1637926137  | 4,6790 % DT.PFBR.BANK MTN.35281VAR | 1.200 | 1.500 | 59,27  | 711.276,00   | 0,11 |
| XS1824424706  | 4,7500 % PET. MEX. 18/29 MTN       | 650   |       | 85,54  | 555.990,50   | 0,08 |
| XS1790104530  | 4,7500 % SENEGAL, REP. 18/28 REGS  | 1.000 |       | 92,17  | 921.720,00   | 0,14 |
| XS2332900682  | 4,7500 % SRPSKA, REP. 21/26 REGS   | 500   |       | 95,42  | 477.095,00   | 0,07 |
| XS0789521480  | 4,8000 % AUTOSTRADE IT. 12/32 MTN  | 100   |       | 98,64  | 98.641,00    | 0,01 |
| CH1251998238  | 4,8400 % RAIF.SCHWEIZ 23/28        | 1.000 |       | 103,27 | 1.032.680,00 | 0,16 |
| XS2716887844  | 4,8750 % BULGARIEN 23/36 MTN       | 1.080 | 1.080 | 106,66 | 1.151.971,20 | 0,17 |
| FR001400EHH1  | 4,8750 % ELO 22/28 MTN             | 500   |       | 96,09  | 480.445,00   | 0,07 |
| XS1568888777  | 4,8750 % PET. MEX. 17/28 MTN       | 750   |       | 88,98  | 667.365,00   | 0,10 |
| XS2366832496  | 4,9500 % BENIN, REP. 21/35 REGS    | 520   |       | 81,15  | 421.985,20   | 0,06 |
| SK4000025201  | 4,9710 % TATRA BANKA 24/30 FLR MTN | 100   | 100   | 100,86 | 100.858,00   | 0,02 |
| FR0011697028  | 5,0000 % EL. FRANCE 14/UND.FLR MTN | 200   |       | 99,55  | 199.098,00   | 0,03 |
| AT000B088232  | 5,0000 % RLB STEIERM. 16-26 3PP    | 500   |       | 100,81 | 504.055,00   | 0,08 |
| AT0000A1LM21  | 5,0000 % RLBK OBEROESTERR.16-28 51 | 700   |       | 94,28  | 659.946,54   | 0,10 |
| XS2589727168  | 5,1250 % BKRAJOWEGO 23/33 MTN      | 1.230 |       | 107,73 | 1.325.042,10 | 0,20 |
| AT0000A1CB74  | 5,1250 % RLBK OBEROESTERR.15-27 16 | 1.000 |       | 95,99  | 959.917,32   | 0,14 |
| DE000DK010W7  | 5,1500 % DEKA MTN.S.7782           | 1.100 | 600   | 94,34  | 1.037.685,00 | 0,16 |
| AT000B121967  | 5,1920 % VOLKSBANK WIEN 17-27 FLR  | 800   |       | 100,85 | 806.784,00   | 0,12 |
| XS2333676133  | 5,3750 % SENEGAL, REP. 21/37 REGS  | 1.000 | 500   | 74,95  | 749.530,00   | 0,11 |
| XS2680932907  | 5,3750 % UNGARN 23/33              | 1.400 | 1.400 | 103,88 | 1.454.264,00 | 0,22 |
| XS1807305328  | 5,6250 % AEGYPTEN 18/30 MTN REGS   | 2.000 |       | 80,57  | 1.611.340,00 | 0,24 |
| XS1963478018  | 5,7500 % BENIN, REP. 19/26 REGS    | 1.010 |       | 100,16 | 674.403,93   | 0,10 |
| XS2250987356  | 5,7500 % LENZING 20/UND. FLR       | 2.100 |       | 87,81  | 1.844.010,00 | 0,28 |
| XS2360598630  | 5,9500 % KAMEREPUBLIK 21/32 REGS   | 1.750 |       | 78,55  | 1.374.660,00 | 0,21 |
| PTCGHFOM0006  | 5,9800 % CAIXA GERAL 08/28 MTN     | 800   |       | 99,49  | 795.904,00   | 0,12 |
| XS2719137965  | 6,0000 % HU.EX.IMP.BK 23/29        | 410   | 410   | 104,98 | 430.405,70   | 0,06 |
| XS0526718761  | 6,2759 % INST.CRED.OF.10/25FLRMTN  | 2.090 |       | 101,01 | 2.111.042,56 | 0,32 |
| XS0522550580  | 6,3500 % GEN. CATALUNYA 10/41 MTN  | 1.100 |       | 120,91 | 1.330.021,00 | 0,20 |
| XS1980255936  | 6,3750 % AEGYPTEN 19/31 MTN REGS   | 1.700 |       | 81,55  | 1.386.367,00 | 0,21 |
| XS2023698553  | 6,3750 % BQE TUNISIE 19/26 REGS    | 4.000 |       | 83,94  | 3.357.760,00 | 0,50 |
| XS2619991883  | 6,5000 % SAN MARINO 23/27          | 230   |       | 101,86 | 234.284,90   | 0,04 |
| XS2628821790  | 6,6250 % ATHORA HLDG 23/28         | 1.000 |       | 105,51 | 1.055.100,00 | 0,16 |
| XS1796266754  | 6,6250 % COTE D'IVOIRE 18/48 REGS  | 3.100 |       | 79,24  | 2.456.564,00 | 0,37 |
| XS2538441598  | 6,6250 % RUMAENIEN 22/29 MTN REGS  | 1.220 |       | 107,58 | 1.312.415,00 | 0,20 |
| XS1843432821  | 6,7500 % AIR BALTIC C 19/24 REGS   | 2.500 |       | 96,49  | 2.412.300,00 | 0,36 |
| XS2286298711  | 6,8750 % BENIN, REP. 21/52 REGS    | 500   |       | 81,97  | 409.850,00   | 0,06 |
| XS2064786911  | 6,8750 % COTE IVOIRE 19/40 REGS    | 400   |       | 84,58  | 338.332,00   | 0,05 |
| XS2656464844  | 6,8750 % ENE.GR.ROI.H 23/28 REGS   | 500   |       | 103,51 | 517.550,00   | 0,08 |

|                        |                                    |           |       |        |              |      |
|------------------------|------------------------------------|-----------|-------|--------|--------------|------|
| XS2582522681           | 6,9600 % NORDMAZEDON. 23/27 REGS   | 200       |       | 104,71 | 209.414,00   | 0,03 |
| XS2681940297           | 7,0000 % WEBUILD 23/28             | 510       | 100   | 107,47 | 548.091,90   | 0,08 |
| XS2620752811           | 7,2500 % ARION BANK 23/26 MTN      | 490       |       | 104,94 | 514.191,30   | 0,08 |
| XS2576365188           | 7,2500 % LUMINOR BANK 23/26FLR MTN | 470       |       | 101,89 | 478.887,70   | 0,07 |
| XS2553604690           | 7,3750 % ISLANDSBANKI 23/26 MTN    | 410       |       | 104,69 | 429.237,20   | 0,06 |
| XS2534786590           | 7,3750 % RAIF.BK INTL 22/32FLR MTN | 1.000     |       | 103,50 | 1.034.950,00 | 0,16 |
| XS2348767083           | 7,5000 % BOI FINANCE 22/27 REGS    | 1.700     |       | 95,18  | 1.618.111,00 | 0,24 |
| XS2633112565           | 7,7500 % LUMINOR BANK 23/27FLR MTN | 760       |       | 106,77 | 811.482,40   | 0,12 |
| XS0161100515           | 7,7500 % TELECOM ITAL 03/33 MTN    | 1.450     |       | 111,26 | 1.613.226,50 | 0,24 |
| XS2695009998           | 7,8750 % GRENKE FIN. 23/27 MTN     | 2.500     |       | 107,13 | 2.678.150,00 | 0,40 |
| XS2630490394           | 7,8750 % RAIFF.BK AUS 23/27 FLRMTN | 800       |       | 106,07 | 848.560,00   | 0,13 |
| XS2658230094           | 7,9000 % VIVION INV. 23/28 MTN     | 700       |       | 84,82  | 597.875,03   | 0,09 |
| XS2566291865           | 9,2500 % INTRUM 22/28 REGS         | 800       | 800   | 67,36  | 538.856,00   | 0,08 |
| XS2684974046           | 9,8750 % BK MILLENNI. 23/27 FLR    | 700       |       | 106,63 | 746.410,00   | 0,11 |
| <b>lautend auf GBP</b> |                                    |           |       |        |              |      |
| XS0904228557           | 0,0000 % INTU (SGS) FIN. 13/28 MTN | 1.094     |       | 53,85  | 892.412,46   | 0,13 |
| XS0609017917           | 0,0000 % RZD CAPITAL 11/31         | 238       |       | 70,50  | 196.530,64   | 0,03 |
| XS1404981141           | 4,8700 % RAC BOND CO 16/46MTN REGS | 350       |       | 97,72  | 400.592,09   | 0,06 |
| FR0011710284           | 6,0000 % EL. FRANCE 2114 MTN       | 1.200     |       | 93,15  | 1.309.295,35 | 0,20 |
| XS2707822644           | 8,2500 % THAMES WATER 23/40 MTN    | 500       |       | 99,71  | 583.922,88   | 0,09 |
| <b>lautend auf ATS</b> |                                    |           |       |        |              |      |
| AT0000296181           | 7,5000 % 1.GRP BK AG 94-24 5       | 7.500     |       | 100,18 | 546.016,50   | 0,08 |
| <b>lautend auf ITL</b> |                                    |           |       |        |              |      |
| XS0071094667           | 0,0000 % COBA DRES.D.FIN. NK/26    | 1.890.000 |       | 89,09  | 869.571,60   | 0,13 |
| XS0071996515           | 0,0000 % JP MORG.CH. 97/27 ZO      | 2.075.000 |       | 89,07  | 954.559,80   | 0,14 |
| XS0071948540           | 0,0000 % UBS FIN. 97/27 ZERO       | 6.540.000 |       | 87,82  | 2.966.300,57 | 0,45 |
| <b>lautend auf NLG</b> |                                    |           |       |        |              |      |
| NL0000121416           | 1,4250 % AEGON 96-UND. FLR         | 2.405     | 265   | 75,39  | 822.805,95   | 0,12 |
| <b>lautend auf USD</b> |                                    |           |       |        |              |      |
| XS1151974877           | 0,0000 % AETHIOPIEN 14/24 REGS     | 2.300     |       | 70,95  | 1.521.460,94 | 0,23 |
| XS2106834299           | 0,0000 % CHINA EVERG. 20/23        | 800       |       | 1,59   | 11.873,95    | 0,00 |
| XS2106834372           | 0,0000 % CHINA EVERG. 20/24        | 2.300     |       | 1,57   | 33.751,63    | 0,01 |
| XS1974522937           | 0,0000 % COUNTRY GARD 19/26        | 1.000     |       | 6,04   | 56.283,80    | 0,01 |
| XS2214239506           | 0,0000 % ECUADOR 20/30 ZO REGS     | 224       |       | 54,68  | 114.338,76   | 0,02 |
| XS2325742166           | 0,0000 % GHANA 21/25 MTN REGS      | 3.480     | 1.500 | 40,96  | 1.329.025,17 | 0,20 |
| XS1968714540           | 0,0000 % GHANA, REP. 19/32 MTN     | 2.150     |       | 49,22  | 986.622,69   | 0,15 |
| XS0793155911           | 0,0000 % LIBANON 12/25 MTN REGS    | 3.250     | 50    | 6,61   | 200.405,56   | 0,03 |
| XS1196417569           | 0,0000 % LIBANON 15/25 MTN REGS    | 3.450     |       | 6,61   | 212.513,05   | 0,03 |
| XS1419879504           | 0,0000 % LIBANON 16/22 MTN         | 550       | 50    | 6,64   | 34.042,98    | 0,01 |
| USP7354PAA23           | 0,0000 % OI 18/25 REGS             | 2.000     |       | 1,11   | 20.604,14    | 0,00 |
| XS2365120885           | 0,0000 % RAIL CAP.MR. 21/26        | 2.090     |       | 60,24  | 1.173.817,73 | 0,18 |
| XS1267081575           | 0,0000 % SAMBIA, REP. 15/27 REGS   | 1.800     |       | 73,90  | 1.240.197,65 | 0,19 |
| XS1163722587           | 0,0000 % SINO-OCEAN LD.T.F.2 15/27 | 3.100     |       | 6,89   | 199.075,14   | 0,03 |
| USY8137FAP37           | 0,0000 % SRI LANKA 19/29 REGS      | 3.500     |       | 56,50  | 1.843.487,79 | 0,28 |
| US040114HX11           | 1,0000 % ARGENTINA 20/29           | 2.500     |       | 59,46  | 1.385.768,23 | 0,21 |
| XS2730249997           | 10,5000 % ISTANBUL M. 23/28 REGS   | 1.000     | 1.000 | 107,35 | 1.000.848,41 | 0,15 |
| XS2468421248           | 10,7500 % ISTANBUL M. 22/27 REGS   | 1.500     |       | 107,21 | 1.499.272,80 | 0,23 |
| US03216KAF93           | 2,2500 % EXP.-IMP BK 21/31MTN REGS | 600       |       | 80,93  | 452.707,44   | 0,07 |
| XS2622186786           | 2,3300 % WORLD BK 23/26 FLR MTN    | 376       |       | 93,91  | 329.187,54   | 0,05 |
| USU3149FAB59           | 2,3750 % FRES.MED.III 20/31 REGS   | 600       |       | 77,85  | 435.483,87   | 0,07 |
| XS1080330704           | 2,5000 % ECUADOR 14/40 REGS        | 9.781     | 3.763 | 37,15  | 3.087.480,55 | 0,46 |
| XS1535071986           | 2,5000 % ECUADOR 16/40 REGS        | 1.409     |       | 37,74  | 451.794,12   | 0,07 |
| XS1755429732           | 2,5000 % ECUADOR 18/40 REGS        | 3.800     |       | 37,74  | 1.218.465,34 | 0,18 |
| XS2214239175           | 2,5000 % ECUADOR 20/40 REGS        | 869       |       | 50,44  | 408.710,36   | 0,06 |
| XS2337067792           | 2,8750 % AFRICA FIN.21/28 MTN REGS | 1.650     |       | 87,72  | 1.349.412,64 | 0,20 |
| US904311AA54           | 3,2500 % UNDER ARMOUR 2026         | 300       |       | 94,33  | 263.827,15   | 0,04 |
| PAL634445XA3           | 3,3620 % PANAMA, REP 21/31         | 1.900     |       | 78,78  | 1.395.453,10 | 0,21 |
| XS2355105292           | 3,3750 % ANADOLU E.B. 21/28 REGS   | 1.000     |       | 86,87  | 809.929,14   | 0,12 |
| XS2018639539           | 3,5000 % BLACK SEA T. 19/24 MTN    | 300       |       | 98,64  | 275.884,77   | 0,04 |
| XS2214238441           | 3,5000 % ECUADOR 20/35 REGS        | 2.633     |       | 55,02  | 1.350.429,48 | 0,20 |
| XS0210976329           | 3,5000 % KBC IFIMA 05/25 FLR MTN   | 200       |       | 97,24  | 181.314,56   | 0,03 |
| XS0909427782           | 3,8000 % E.ON INT F. 13/33 MTN DL  | 1.400     |       | 81,92  | 1.069.265,34 | 0,16 |
| XS1711550373           | 4,2500 % HUARONG FIN.2017 17/27MTN | 600       |       | 90,90  | 508.456,09   | 0,08 |
| USP37878AC26           | 4,5000 % BOLIVIEN 17/28 REGS       | 1.000     |       | 57,27  | 533.936,23   | 0,08 |
| US698299BS24           | 4,5000 % PANAMA, REP 22/63         | 400       | 400   | 62,08  | 231.512,21   | 0,03 |
| USP7808BAA54           | 4,7500 % PETROPERU 17/32 REGS      | 500       |       | 74,83  | 348.801,98   | 0,05 |
| XS2242418957           | 4,8500 % NAT.BK UZBE. 20/25        | 1.210     |       | 96,22  | 1.085.435,20 | 0,16 |
| USU1569XAB11           | 4,8750 % CITADEL 19/27 REGS        | 1.200     |       | 96,73  | 1.082.159,24 | 0,16 |
| XS1711992716           | 4,9500 % HUARONG FIN.2017 17/47MTN | 700       |       | 77,07  | 502.987,13   | 0,08 |
| XS1505143393           | 5,0000 % COMISION FED. EL. 16/36   | 3.500     |       | 87,40  | 2.013.475,67 | 0,30 |
| XS1138687592           | 5,0100 % SPAIN KINGD. 14/44 MTN    | 3.700     |       | 87,56  | 3.020.332,84 | 0,45 |
| US03349MAD74           | 5,1250 % MARATHON PETROL. 18/26    | 1.300     |       | 93,99  | 1.139.166,51 | 0,17 |
| XS1953915136           | 5,3750 % USBEKISTAN,R 19/29 REGS   | 750       |       | 91,72  | 641.352,79   | 0,10 |

|              |                                    |       |       |        |              |              |      |
|--------------|------------------------------------|-------|-------|--------|--------------|--------------|------|
| XS2386558113 | 5,5000 % VAKIFBANK 21/26 MTN REGS  | 570   |       | 96,55  | 513.069,08   | 0,08         |      |
| USP7808BAB38 | 5,6250 % PETROPERU 17/47 REGS      | 1.200 |       | 61,21  | 684.758,53   | 0,10         |      |
| USP6480JAH07 | 5,7500 % MENDOZA, PROV 20/29 REGS  | 1.000 |       | 81,06  | 581.326,47   | 0,09         |      |
| XS2332876106 | 5,7500 % TUERK.EXP.KB 21/26 REGS   | 290   |       | 97,49  | 263.592,86   | 0,04         |      |
| USP3579ECG00 | 5,8750 % DOMINIK.REP 20/60 REGS    | 800   |       | 82,38  | 614.424,76   | 0,09         |      |
| USP78625EA73 | 5,9500 % PET. MEX. 20/31 MTN REGS  | 1.100 |       | 74,19  | 760.855,29   | 0,11         |      |
| XS0334989000 | 6,0000 % KONGO REP. 07/29          | 2.800 | 2.800 | 84,42  | 858.336,57   | 0,13         |      |
| US900123BJ84 | 6,0000 % TURKEY 11/41              | 1.750 |       | 81,23  | 1.325.242,40 | 0,20         |      |
| US472319AC60 | 6,2500 % JEFFERIES FI 2036         | 1.000 |       | 100,13 | 933.488,72   | 0,14         |      |
| USP3143NBT02 | 6,4400 % CORP.NAC.CH. 24/36 REGS   | 310   | 310   | 99,66  | 288.031,79   | 0,04         |      |
| XS2595028700 | 6,5000 % MAROKKO 23/33 REGS        | 1.250 |       | 100,72 | 1.173.725,06 | 0,18         |      |
| US70645KBM09 | 6,6250 % PET. MEX. 08/38 MTN       | 3.425 |       | 62,26  | 1.988.165,63 | 0,30         |      |
| US71643VAB18 | 6,7000 % PEMEX 22/32               | 259   |       | 82,18  | 198.427,42   | 0,03         |      |
| XS1750114396 | 6,7500 % OMAN 18/48 REGS           | 300   |       | 99,49  | 278.259,37   | 0,04         |      |
| US71654QCC42 | 6,7500 % PET. MEX. 2047 MTN        | 500   |       | 64,50  | 300.661,94   | 0,05         |      |
| XS1790134362 | 6,7500 % SENEGAL, REP. 18/48 REGS  | 500   |       | 74,79  | 348.620,18   | 0,05         |      |
| USP78625DX85 | 6,8400 % PEMEX 19/30 REGS          | 800   |       | 81,53  | 608.124,41   | 0,09         |      |
| US500472AC95 | 6,8750 % KONINKL. PHILIPS 2038     | 500   |       | 106,52 | 496.545,78   | 0,07         |      |
| PTAVDAOT0001 | 6,9270 % AVENIR IS.II 20/27 MTN    | 3.000 |       | 96,54  | 1.157.202,80 | 0,17         |      |
| US268317AC80 | 6,9500 % ELEC.DE FRANCE 2039 144A  | 850   |       | 106,91 | 847.194,67   | 0,13         |      |
| XS2407752711 | 7,0000 % GABUN 21/31 REGS          | 500   |       | 79,74  | 371.690,29   | 0,06         |      |
| XS2288906857 | 7,0000 % OMAN 21/51 MTN REGS       | 1.000 |       | 102,67 | 957.178,82   | 0,14         |      |
| XS1676401414 | 7,1250 % TADSCHIKISTAN 17/27 REGS  | 3.000 |       | 91,71  | 2.565.187,40 | 0,39         |      |
| US345397C684 | 7,3500 % FORD MOTO.CR 23/30        | 1.000 |       | 104,53 | 974.575,80   | 0,15         |      |
| XS1577950311 | 7,3750 % JORDAN 17/47 REGS         | 700   |       | 85,15  | 555.679,66   | 0,08         |      |
| XS2384701020 | 7,3750 % NIGERIA BR 21/33 MTN REGS | 500   |       | 84,37  | 393.305,99   | 0,06         |      |
| USP37878AE81 | 7,5000 % BOLIVIEN 22/30 REGS       | 400   | 400   | 60,01  | 223.803,84   | 0,03         |      |
| US47233JBW71 | 7,5000 % JEFF.GR./CAP 19/39 FLR    | 1.289 |       | 84,10  | 1.010.650,03 | 0,15         |      |
| XS2750476603 | 7,5000 % TUERK.EXP.KB 24/28 REGS   | 250   | 250   | 99,90  | 232.854,75   | 0,04         |      |
| US87927VAV09 | 7,7210 % TELECOM ITAL.CAP. 08/38   | 500   |       | 94,81  | 441.977,44   | 0,07         |      |
| XS2725962638 | 7,8000 % INTESA SANP. 23/53 MTN    | 1.330 | 1.330 | 108,46 | 1.344.817,73 | 0,20         |      |
| US172967AL52 | 7,8750 % CITIGROUP INC. 2025       | 739   |       | 102,08 | 703.297,05   | 0,11         |      |
| US29244TAA97 | 7,8750 % ENEL GENERACION CL 2027   | 990   |       | 105,45 | 973.321,56   | 0,15         |      |
| USY6142NAH18 | 7,8750 % MONGOLEI 23/29 REGS       | 200   | 200   | 101,33 | 188.939,03   | 0,03         |      |
| USP68788AC53 | 7,9500 % REP.SURINAME 23/33 REGS   | 2.138 | 2.338 | 200    | 92,11        | 1.835.667,45 | 0,28 |
| XS0471464023 | 8,0000 % SEYCHELLEN 10/26          | 4.041 |       | 99,59  | 750.462,55   | 0,11         |      |
| US46115HBV87 | 8,2480 % INTESA SANP.22/33 FLR MTN | 1.000 |       | 109,07 | 1.016.856,24 | 0,15         |      |
| XS1781710626 | 8,2500 % KENIA, REPUBLIK18/48 REGS | 1.000 |       | 85,42  | 796.410,59   | 0,12         |      |
| US25272KAR41 | 8,3500 % DELL INT./EMC 2046 144A   | 107   | 143   | 115,66 | 115.381,25   | 0,02         |      |
| US195325AL92 | 8,3750 % COLOMBIA 2027             | 200   |       | 105,96 | 197.572,25   | 0,03         |      |
| USY6142NAG35 | 8,6500 % MONGOLEI 23/28 REGS       | 400   |       | 103,11 | 384.523,59   | 0,06         |      |
| US195325EM30 | 8,7500 % KOLUMBIEN 23/53           | 400   | 400   | 104,02 | 387.932,13   | 0,06         |      |
| XS2322321964 | 8,8750 % PAKISTAN 21/51 REGS       | 3.000 |       | 77,52  | 2.168.049,60 | 0,33         |      |
| USP06518AH06 | 8,9500 % BAHAMAS COM. 20/32 REGS   | 1.750 |       | 96,70  | 1.577.741,00 | 0,24         |      |
| USP01012CC84 | 9,5000 % EL SALVADOR 20/52 REGS    | 2.600 |       | 80,05  | 1.940.497,86 | 0,29         |      |
| US900123DF45 | 9,8750 % TUERKEI 22/28             | 2.500 |       | 110,07 | 2.565.401,83 | 0,39         |      |

**Zertifikate/Indexzertifikate****lautend auf USD**

|              |                       |       |       |       |            |      |
|--------------|-----------------------|-------|-------|-------|------------|------|
| US17328YGL20 | CITIGRP GL.M N41 BSKT | 6.000 | 6.000 | 58,86 | 329.256,01 | 0,05 |
|--------------|-----------------------|-------|-------|-------|------------|------|

**Strukturierte Produkte****lautend auf EUR**

|              |                                    |       |     |        |              |      |
|--------------|------------------------------------|-------|-----|--------|--------------|------|
| XS0229808315 | 0,0000 % AUSTRIA 05/25 FLR MTN     | 1.714 |     | 99,43  | 1.704.201,63 | 0,26 |
| FR0010212977 | 0,0000 % C.F.FINANC.LOC. 05/25 FLR | 700   |     | 96,22  | 673.533,00   | 0,10 |
| XS0218189925 | 0,0000 % DEXIA SA 05/25 FLR MTN    | 3.920 |     | 95,59  | 3.747.049,60 | 0,56 |
| GRR000000010 | 0,0000 % GRIECHENLAND 12-42 IO GDP | 1.543 |     | 0,29   | 4.398,12     | 0,00 |
| NL0000116796 | 0,7726 % NM PLC 05-35 FLR          | 1.724 |     | 83,18  | 1.433.961,03 | 0,22 |
| XS0224713254 | 1,0000 % AUSTRIA 05/25 FLR MTN     | 4.561 |     | 97,36  | 4.440.619,98 | 0,67 |
| XS0213297541 | 1,4905 % BK SCOTLAND 05/25FLR MTN  | 800   |     | 96,84  | 774.720,97   | 0,12 |
| XS0211284491 | 2,0000 % RABOBK NEDERLD05/35FLRMTN | 1.302 |     | 89,46  | 1.164.743,16 | 0,18 |
| XS0211568331 | 2,5000 % BK SCOTLAND 05/35FLR MTN  | 2.298 |     | 88,22  | 2.027.295,60 | 0,30 |
| XS0210781828 | 2,8500 % NIBC BANK 05/40 FLR MTN   | 1.357 | 832 | 68,25  | 926.193,21   | 0,14 |
| XS0210578869 | 3,0000 % INTESA SAN.05/35 FLR MTN  | 500   |     | 86,83  | 434.150,00   | 0,07 |
| XS0235236550 | 5,0700 % UBS AG 05/25 FLR MTN      | 800   |     | 108,28 | 866.256,66   | 0,13 |
| XS0294089981 | 6,4216 % UNICREDIT 07/27 MTNFLR    | 460   |     | 106,53 | 490.032,33   | 0,07 |

**lautend auf USD**

|              |                                    |       |  |       |            |      |
|--------------|------------------------------------|-------|--|-------|------------|------|
| US06048WEJ53 | 0,0000 % BANK AMERI. 10/30 MTN FLR | 826   |  | 68,86 | 530.269,51 | 0,08 |
| US06048WET36 | 0,0000 % BANK AMERI. 2030 MTN FLR  | 115   |  | 68,19 | 73.114,95  | 0,01 |
| US06048WNZ94 | 0,0000 % BANK AMERI. 2033 MTN FLR  | 1.350 |  | 65,55 | 825.040,56 | 0,12 |
| US06048WPC81 | 0,0000 % BANK AMERI. 2033 MTN FLR  | 112   |  | 63,75 | 66.571,40  | 0,01 |
| US06048WPN47 | 0,0000 % BANK AMERI. 2034 MTN FLR  | 410   |  | 61,00 | 233.187,02 | 0,04 |

|              |                                    |       |       |       |              |            |      |
|--------------|------------------------------------|-------|-------|-------|--------------|------------|------|
| US06741TRR04 | 0,0000 % BARCLAYS BK 2028 FLR      | 742   |       | 81,49 | 563.714,31   | 0,08       |      |
| US06741TVK05 | 0,0000 % BARCLAYS BK 2033 FLR      | 390   |       | 58,59 | 213.023,77   | 0,03       |      |
| US064159DF05 | 0,0000 % BK NOVA SCOTIA 2034 FLR   | 601   |       | 60,74 | 340.361,22   | 0,05       |      |
| US1730T0SM26 | 0,0000 % CITIGROUP 13/33 FLR MTN   | 507   |       | 60,48 | 285.883,53   | 0,04       |      |
| US1730T0E963 | 0,0000 % CITIGROUP 14/34 FLR MTN   | 500   |       | 64,24 | 299.477,90   | 0,05       |      |
| US1730T0KZ11 | 0,0000 % CITIGROUP 2030 FLR MTN    | 251   |       | 70,13 | 164.102,42   | 0,02       |      |
| US38141GGV05 | 0,0000 % GOLDMAN S.GRP 2027FLR MTN | 170   |       | 81,89 | 129.782,30   | 0,02       |      |
| US38141GTW41 | 0,0000 % GOLDMAN S.GRP 2028FLR MTN | 1.262 |       | 79,31 | 933.134,05   | 0,14       |      |
| US38141GQW77 | 0,0000 % GOLDMAN S.GRP 2028FLR MTN | 505   |       | 79,35 | 373.603,95   | 0,06       |      |
| US38141GMD33 | 0,0000 % GOLDMAN S.GRP 2028FLR MTN | 308   |       | 80,11 | 230.049,52   | 0,03       |      |
| US38141GSM77 | 0,0000 % GOLDMAN S.GRP 2028FLR MTN | 899   |       | 79,53 | 666.539,02   | 0,10       |      |
| US38141GPU21 | 0,0000 % GOLDMAN S.GRP 2028FLR MTN | 1.663 |       | 79,64 | 1.234.784,48 | 0,19       |      |
| US47233JBB35 | 0,0000 % JEFF.GRP/CAP.FI. 2037 FLR | 188   |       | 59,44 | 104.184,64   | 0,02       |      |
| US47233JQA13 | 0,0000 % JEFF.GRP/CAP.FI. 2037 FLR | 656   |       | 55,37 | 338.626,52   | 0,05       |      |
| US47233JAY47 | 0,0000 % JEFF.GRP/CAP.FI. 2037 FLR | 1.673 |       | 59,99 | 935.739,82   | 0,14       |      |
| US47233JAV08 | 0,0000 % JEFF.GRP/CAP.FI. 2037 FLR | 500   |       | 59,52 | 277.470,63   | 0,04       |      |
| US47233JES33 | 0,0000 % JEFF.GRP/CAP.FI.21/37 FLR | 750   |       | 55,75 | 389.823,79   | 0,06       |      |
| US5394E8CE78 | 0,0000 % LLOYDS BANK 13/33 FLR MTN | 1.330 |       | 61,38 | 761.073,47   | 0,11       |      |
| US5394E8BV03 | 0,0000 % LLOYDS BANK 13/33 FLR MTN | 215   |       | 59,28 | 118.829,29   | 0,02       |      |
| US5394E8BK48 | 0,0000 % LLOYDS BANK 2033 FLR      | 700   |       | 59,29 | 386.931,75   | 0,06       |      |
| US5394E8BN86 | 0,0000 % LLOYDS BANK 2033 FLR MTN  | 2.352 |       | 59,13 | 1.296.662,60 | 0,19       |      |
| US61760QCV41 | 0,0000 % MORGAN STANLEY 13/28 FLR  | 137   |       | 77,52 | 99.019,09    | 0,01       |      |
| US61760QDB77 | 0,0000 % MORGAN STANLEY 13/33 FLR  | 121   |       | 61,03 | 68.851,32    | 0,01       |      |
| US61760QCS12 | 0,0000 % MORGAN STANLEY 2028 FLR   | 1.050 |       | 80,09 | 784.021,82   | 0,12       |      |
| US63873HKA13 | 0,0000 % NATIXIS US M. 2028 FLR    | 1.000 |       | 76,41 | 712.399,78   | 0,11       |      |
| US65539ABC36 | 0,0000 % NOMURA AM.FIN.14/34FLRMTN | 314   |       | 55,84 | 163.472,63   | 0,02       |      |
| US65539ABB52 | 0,0000 % NOMURA AM.FIN.14/34FLRMTN | 641   |       | 56,11 | 335.338,74   | 0,05       |      |
| US78010UEA16 | 0,0000 % ROYAL BK CDA 2034 FLR MTN | 470   |       | 64,27 | 281.601,25   | 0,04       |      |
| US83368WCZ23 | 0,0000 % SOC GENERALE 2033 FLR MTN | 500   |       | 63,63 | 296.629,68   | 0,04       |      |
| USP68788AD37 | 0,0000 % SURINAME, REP. 23/50 REGS | 1.033 | 1.034 | 1     | 73,62        | 708.990,87 | 0,11 |
| XS0540411526 | 4,0000 % MERRILL LYNCH 10/25FLRMTN | 750   |       | 98,56 | 689.186,81   | 0,10       |      |

**Nicht zum amtlichen Handel oder einem anderen geregelten Markt zugelassene Wertpapiere****Anleihen****lautend auf EUR**

|              |                                                |       |    |          |              |      |
|--------------|------------------------------------------------|-------|----|----------|--------------|------|
| XS0089370521 | 0,0000 % COBA 98/28 MTN                        | 1.000 |    | 81,87    | 818.720,00   | 0,12 |
| AT0000355326 | 0,0000 % HETA ASS.RES. 03-15 FLR               | 911   |    | 0,00     | 9,11         | 0,00 |
| QOXDBA048838 | 0,0000 % HETA CAPP                             | 200   |    | 7,30     | 14.614,60    | 0,00 |
| AT0000327382 | 0,0000 % HYPO ALPE-AD 99-14 FLR                | 500   |    | 0,00     | 5,00         | 0,00 |
| XS0125233436 | 0,0000 % ITALY (REP.OF) 02.31 INT              | 558   |    | 76,26    | 425.502,90   | 0,06 |
| XS0125234590 | 0,0000 % ITALY (REP.OF) 02.31 INT              | 860   |    | 2.935,93 | 2.524.903,07 | 0,38 |
| QOXDBA048960 | 0,0000 % Steinhoff PIK Loan A2 - non preferred | 962   |    | 42,00    | 404.131,33   | 0,06 |
| QOXDBA051386 | 0,0000 % Steinhoff PIK Loan B2 - non preferred | 144   |    | 33,50    | 48.166,17    | 0,01 |
| IT0004167216 | 3,9770 % LAMEZIA TERME,STADT 06-26             | 452   | 70 | 92,12    | 416.043,12   | 0,06 |
| MT0000013699 | 4,0000 % MALTA 23/43                           | 900   |    | 100,50   | 904.500,00   | 0,14 |
| IT0003755722 | 4,3620 % SALERNO, COMUNE 04-24 FLR             | 174   | 87 | 99,90    | 173.826,00   | 0,03 |
| DE0006060859 | 4,4420 % SPK KOELNBONN IS.402 VAR              | 500   |    | 92,34    | 461.675,00   | 0,07 |
| XS2032657608 | 7,0000 % CREDIT ANDO. 19/29 FLR                | 2.100 |    | 94,41    | 1.982.610,00 | 0,30 |

**lautend auf USD**

|              |                                    |       |  |       |            |      |
|--------------|------------------------------------|-------|--|-------|------------|------|
| XS1760804184 | 0,0000 % BELARUS 18/30 REGS        | 1.500 |  | 38,00 | 531.418,98 | 0,08 |
| XS0545825951 | 0,0000 % COMMONW.BK AUSTR.10/25 ZO | 1.000 |  | 70,10 | 653.554,16 | 0,10 |
| XS0828779594 | 0,0000 % SAMBIA, REP. 12/22 REGS   | 1.000 |  | 66,48 | 619.802,35 | 0,09 |

**Strukturierte Produkte****lautend auf EUR**

|              |                                    |     |  |       |            |      |
|--------------|------------------------------------|-----|--|-------|------------|------|
| XS1291207469 | 0,0000 % BNP P.F.FDG 15/24 FLR MTN | 269 |  | 97,72 | 262.873,64 | 0,04 |
| XS0228145917 | 0,0000 % DEXIA SA 05/25 FLR MTN    | 400 |  | 95,48 | 381.913,53 | 0,06 |

**lautend auf USD**

|              |                                    |       |  |       |            |      |
|--------------|------------------------------------|-------|--|-------|------------|------|
| US064159CD65 | 0,0000 % BK NOVA SCOTIA 13/33 FLR  | 800   |  | 59,43 | 443.244,45 | 0,07 |
| US064159CP95 | 0,0000 % BK NOVA SCOTIA 2033 FLR   | 100   |  | 59,92 | 55.864,26  | 0,01 |
| US064159FT80 | 0,0000 % BK NOVA SCOTIA 2034 FLR   | 244   |  | 59,74 | 135.899,31 | 0,02 |
| US5394E8BY42 | 0,0000 % LLOYDS BANK 2033 FLR MTN  | 1.080 |  | 59,47 | 598.752,56 | 0,09 |
| US5394E8CC13 | 0,0000 % LLOYDS BANK 2033 FLR MTN  | 245   |  | 59,29 | 135.426,11 | 0,02 |
| US78010UVT14 | 0,0000 % ROYAL BK CDA 2034 FLR MTN | 252   |  | 61,97 | 145.582,51 | 0,02 |

**Summe Wertpapiervermögen****654.840.483,47 98,44**

| BEZEICHNUNG                                                                                                                                 |    | NOMINALE/<br>KONTRAKTE | OPENING | CLOSING | KURS | KURSWERT<br>IN EUR    | ANTEIL<br>IN % |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----|------------------------|---------|---------|------|-----------------------|----------------|
| <b>Derivative Produkte</b>                                                                                                                  |    |                        |         |         |      |                       |                |
| <b>Devisentermingeschäfte</b>                                                                                                               |    |                        |         |         |      |                       |                |
| Abgeschlossen mit Raiffeisenlandesbank Oberösterreich                                                                                       |    |                        |         |         |      |                       |                |
| <b>Verkauf</b>                                                                                                                              |    |                        |         |         |      |                       |                |
| GBP/EUR Laufzeit bis 12.09.2024                                                                                                             | 2) | -3.500.000             |         |         |      | -10.660,04            | 0,00           |
| USD/EUR Laufzeit bis 17.05.2024                                                                                                             | 2) | -124.000.000           |         |         |      | -2.106.186,48         | -0,32          |
| <b>Finanzterminkontrakte</b>                                                                                                                |    |                        |         |         |      |                       |                |
| <b>Zinsterminkontrakte</b>                                                                                                                  |    |                        |         |         |      |                       |                |
| <b>Verkaufte Kontrakte</b>                                                                                                                  |    |                        |         |         |      |                       |                |
| <b>lautend auf EUR</b>                                                                                                                      |    |                        |         |         |      |                       |                |
| EUR-BUXL FUTURE JUNI 2024                                                                                                                   | 2) | -100                   | 140     | 40      |      | 276.000,00            | 0,04           |
| <b>lautend auf USD</b>                                                                                                                      |    |                        |         |         |      |                       |                |
| USD-TY TREASURY FUTURE JUNI 2024                                                                                                            | 2) | -30                    | 30      |         |      | 74.730,79             | 0,01           |
| <b>Summe Derivate</b>                                                                                                                       |    |                        |         |         |      | <b>-1.766.115,73</b>  | <b>-0,27</b>   |
| <b>Sicherheiten im Zusammenhang mit OTC-Derivaten*</b>                                                                                      |    |                        |         |         |      |                       |                |
| <b>Geleistete Sicherheiten</b>                                                                                                              |    |                        |         |         |      |                       |                |
| Raiffeisenlandesbank Oberösterreich                                                                                                         |    |                        |         |         |      | 2.370.000,00          | 0,36           |
| <b>Summe Geleistete Sicherheiten</b>                                                                                                        |    |                        |         |         |      | <b>2.370.000,00</b>   | <b>0,36</b>    |
| *) Es werden nur Barsicherheiten in Form von Sichteinlagen ausgetauscht. Entgegengenommene Sicherheiten sind nicht Teil des Fondsvermögens. |    |                        |         |         |      |                       |                |
| <b>Bankguthaben/Verbindlichkeiten</b>                                                                                                       |    |                        |         |         |      |                       |                |
| EUR                                                                                                                                         |    |                        |         |         |      | 555.322,53            | 0,08           |
| nicht EU-Währungen                                                                                                                          |    |                        |         |         |      | 189.221,21            | 0,03           |
| <b>Summe Bankguthaben / Verbindlichkeiten</b>                                                                                               |    |                        |         |         |      | <b>744.543,74</b>     | <b>0,11</b>    |
| <b>Sonstiges Vermögen</b>                                                                                                                   |    |                        |         |         |      |                       |                |
| Ausstehende Zahlungen                                                                                                                       |    |                        |         |         |      | -626.742,36           | -0,09          |
| Diverse Gebühren                                                                                                                            |    |                        |         |         |      | -61.148,20            | -0,01          |
| Dividendenansprüche                                                                                                                         |    |                        |         |         |      | 899.518,70            | 0,14           |
| Einschüsse (Initial/Variation Margins)                                                                                                      |    |                        |         |         |      | -350.730,79           | -0,05          |
| Zinsansprüche                                                                                                                               |    |                        |         |         |      | 9.168.936,50          | 1,37           |
| Zinsen Anlagekonten (inkl. negativer Habenzinsen)                                                                                           |    |                        |         |         |      | 4.732,97              | 0,00           |
| <b>Summe sonstiges Vermögen</b>                                                                                                             |    |                        |         |         |      | <b>9.034.566,82</b>   | <b>1,36</b>    |
| <b>Fondsvermögen</b>                                                                                                                        |    |                        |         |         |      | <b>665.223.478,30</b> | <b>100,00</b>  |

## Devisenkurse

Vermögenswerte in fremder Währung wurden zu folgenden Devisenkursen umgerechnet:

| WÄHRUNG                           | KURS       |
|-----------------------------------|------------|
| Oesterreichischer Schilling (ATS) | 13,7603    |
| Australische Dollar (AUD)         | 1,6328     |
| Canadische Dollar (CAD)           | 1,4641     |
| Schweizer Franken (CHF)           | 0,9759     |
| Daenische Kronen (DKK)            | 7,4578     |
| Britische Pfund (GBP)             | 0,8538     |
| Hongkong Dollar (HKD)             | 8,3937     |
| Italienische Lire (ITL)           | 1.936,2700 |
| Japanische Yen (JPY)              | 167,1500   |
| Suedkoreanische Won (KRW)         | 1.477,8100 |
| Niederlaendische Gulden (NLG)     | 2,2037     |
| Norwegische Kronen (NOK)          | 11,7769    |
| Zloty (Polen) (PLN)               | 4,3161     |
| Schwedische Kronen (SEK)          | 11,7138    |
| US-Dollar (USD)                   | 1,0726     |
| Suedafrikanische Rand (ZAR)       | 19,9781    |

Die Vermögensgegenstände des Sondervermögens sind auf der Grundlage von Kursen bzw. Marktsätzen per 29. April 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****Aktien****lautend auf EUR**

|              |                           |           |           |
|--------------|---------------------------|-----------|-----------|
| AT0000969985 | AT+S AUSTR.T.+SYSTEMT.    |           | 71.604    |
| FR0000125585 | CASINO, GUICH.INH. EO0,01 | 1.005.405 | 1.005.405 |
| FR001400MX07 | ORPEA ACT.NOM. ANR.       | 6.590.719 | 6.590.719 |
| FR0000184798 | ORPEA ACT.NOM. EO 0,01    | 6.590.719 | 6.590.719 |
| FR001400NLM4 | ORPEA ACT.NOM. EO 10,-    | 6.591     | 6.591     |
| BE0003739530 | UCB S.A.                  |           | 15.816    |

**lautend auf CAD**

|              |                        |  |        |
|--------------|------------------------|--|--------|
| CA39138C1068 | GREAT-WEST LIFECO INC. |  | 74.347 |
|--------------|------------------------|--|--------|

**lautend auf HKD**

|              |                          |        |        |
|--------------|--------------------------|--------|--------|
| KYG4R39T1073 | HORIZON CONSTR.DEVELOPM. | 65.519 | 65.519 |
|--------------|--------------------------|--------|--------|

**lautend auf JPY**

|              |               |  |        |
|--------------|---------------|--|--------|
| JP3148800000 | IBIDEN CO.LTD |  | 24.400 |
| JP3420600003 | SEKISUI HOUSE |  | 68.500 |

**lautend auf USD**

|              |                           |       |        |
|--------------|---------------------------|-------|--------|
| US24703L2025 | DELL TECHS INC. C DL-,01  | 1.070 | 37.560 |
| US75886F1075 | REGENERON PHARMAC.DL-,001 | 90    | 3.478  |
| US8807701029 | TERADYNE INC. DL-,125     |       | 17.000 |
| US9113631090 | UNITED RENTALS INC.DL-,01 | 190   | 6.651  |
| US91324P1021 | UNITEDHEALTH GROUP DL-,01 |       | 7.173  |

**Anleihen****lautend auf EUR**

|              |                                  |     |       |
|--------------|----------------------------------|-----|-------|
| FR0011765825 | 0,0000 % CASINO 14/24 MTN        |     | 400   |
| FR0012074284 | 0,0000 % CASINO 14/26 MTN        |     | 900   |
| EU000A3KSXE1 | 0,0000 % EU 21/31 MTN            |     | 410   |
| IT0006527078 | 0,0000 % EUR. BK REC.DEV. 99-24  |     | 710   |
| XS1911645049 | 0,0000 % GAZ CAPITAL 18/24 MTN   |     | 800   |
| XS2265801238 | 0,0000 % LUMINOR BANK 20/24 MTN  |     | 300   |
| XS2381671671 | 0,2500 % CS AG 21/28 MTN         |     | 1.000 |
| EU000A284469 | 0,3000 % EU 20/50 MTN            |     | 700   |
| XS2181689659 | 1,7500 % UNGARN 20/35            |     | 500   |
| AT0000A1TBC2 | 1,8750 % CA IMMO 17-24           |     | 800   |
| IT0006527524 | 12,0000 % EUR. BK REC.DEV. 99-24 |     | 405   |
| FR0013322187 | 2,6250 % ORPEA 18-25             |     | 400   |
| XS1315181708 | 2,7500 % PERU 15/26              |     | 800   |
| XS1807201899 | 3,3750 % MONTENEGRO 18/25 REGS   |     | 1.000 |
| XS2788435050 | 3,5000 % ISLAND, REP. 24/34 MTN  | 650 | 650   |
| XS2310951103 | 3,6250 % SAPPI PAPIER 21/28 REGS |     | 200   |
| XS2102392276 | 3,6250 % WEBUILD S.P.A. 20/27    |     | 500   |
| XS2437324333 | 3,8750 % WEBUILD 22/26           |     | 610   |
| DE000CZ40LD5 | 4,0000 % COBA T2 NACHRANG 16/26  |     | 300   |
| AT0000A32RP0 | 4,1250 % HYPO VORARL. 23/26 MTN  |     | 300   |
| XS2010026214 | 4,2500 % UNGARN 22/31 REGS       |     | 1.000 |
| XS1005342313 | 5,0000 % TUERKIYE GAR.BK 13/23   |     | 700   |
| XS1909184753 | 5,2000 % TURKEY 18/26 INTL       |     | 700   |
| AT0000351119 | 5,4300 % BAWAG P.S.K. 04-24      |     | 400   |
| XS2499691330 | 5,5000 % OTP BNK 22/25 FLRMTN    |     | 700   |
| XS1567439689 | 5,6250 % BQE C.TUNISIE 17/24     |     | 850   |
| XS0997355036 | 5,8750 % RAIF.LABA NO 13/23 MTN  |     | 400   |
| CH1214797172 | 7,7500 % UBS GROUP 22/29 FLRMTN  |     | 450   |

**lautend auf GBP**

|              |                                 |  |     |
|--------------|---------------------------------|--|-----|
| XS0096272355 | 5,2500 % SPAIN KINGD. 99/29 MTN |  | 400 |
|--------------|---------------------------------|--|-----|

**lautend auf USD**

|              |                            |  |     |
|--------------|----------------------------|--|-----|
| US05526DBB01 | 3,5570 % B.A.T. CAP. 18/27 |  | 237 |
|--------------|----------------------------|--|-----|

|              |                              |       |
|--------------|------------------------------|-------|
| XS1055787680 | 6,2500 % NORDLB IS.S.1748 DL | 400   |
| US900123CZ18 | 6,3750 % TUERKEI 20/25       | 1.560 |

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

**Anleihen**

**lautend auf EUR**

|              |                                  |       |
|--------------|----------------------------------|-------|
| FR0012369122 | 0,0000 % CASINO 14/25 MTN        | 1.800 |
| XS0767661423 | 4,6676 % LEASEPLAN 12/24 FLR MTN | 800   |

**lautend auf USD**

|              |                                    |       |
|--------------|------------------------------------|-------|
| USP68788AA97 | 0,0000 % SURINAME, REP. 16/26 REGS | 2.250 |
| PTAVBBOT0002 | 10,1633 % AVENIR II 18/23          | 3.000 |

**Strukturierte Produkte**

**lautend auf USD**

|              |                                    |       |
|--------------|------------------------------------|-------|
| XS1720480489 | 0,0000 % BNP PAR.ISS. SX5E CT18/24 | 1.000 |
|--------------|------------------------------------|-------|

BEZEICHNUNG

OPENING  
KONTRAKTE/NOMINALE

CLOSING  
KONTRAKTE/NOMINALE

**Derivative Produkte**

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

**Optionsscheine**

**lautend auf EUR**

|                          |           |
|--------------------------|-----------|
| CASINO, GUICH.INH. BDS29 | 2.010.810 |
|--------------------------|-----------|

**Devisentermingeschäfte**

**Abgeschlossen mit Raiffeisenlandesbank Oberösterreich**

**Verkauf**

|                                 |             |
|---------------------------------|-------------|
| GBP/EUR Laufzeit bis 14.03.2024 | 3.000.000   |
| USD/EUR Laufzeit bis 19.01.2024 | 117.000.000 |

**Finanzterminkontrakte**

**Zinsterminkontrakte**

**Verkaufte Kontrakte**

**lautend auf EUR**

|                               |     |
|-------------------------------|-----|
| EUR-BUXL FUTURE DEZEMBER 2023 | 75  |
| EUR-BUXL FUTURE MAERZ 2024    | 140 |

**lautend auf USD**

|                                      |    |
|--------------------------------------|----|
| USD-TY TREASURY FUTURE DEZEMBER 2023 | 30 |
| USD-TY TREASURY FUTURE MAERZ 2024    | 30 |

## Zusammensetzung des Fondsvermögens per 30.04.2024

| Wertpapiervermögen                                                                            | EUR                   | %             |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------|---------------|
| <b>Zum amtlichen Handel oder einem anderen geregelten Markt zugelassene Wertpapiere</b>       |                       |               |
| Aktien                                                                                        | 229.889.108,50        | 34,56         |
| Anleihen                                                                                      | 377.884.431,10        | 56,81         |
| Zertifikate/Indexzertifikate                                                                  | 329.256,01            | 0,05          |
| Strukturierte Produkte                                                                        | 34.598.649,70         | 5,20          |
| <b>Nicht zum amtlichen Handel oder einem anderen geregelten Markt zugelassene Wertpapiere</b> |                       |               |
| Anleihen                                                                                      | 9.979.481,79          | 1,50          |
| Strukturierte Produkte                                                                        | 2.159.556,37          | 0,32          |
| <b>Summe Wertpapiervermögen</b>                                                               | <b>654.840.483,47</b> | <b>98,44</b>  |
| <b>Derivative Produkte</b>                                                                    |                       |               |
| <b>EUR %</b>                                                                                  |                       |               |
| Devisentermingeschäfte                                                                        | -2.116.846,52         | -0,32         |
| Finanzterminkontrakte                                                                         | 350.730,79            | 0,05          |
| <b>Summe derivative Produkte</b>                                                              | <b>-1.766.115,73</b>  | <b>-0,27</b>  |
| <b>Geleistete Sicherheiten</b>                                                                |                       |               |
| <b>EUR %</b>                                                                                  |                       |               |
| <b>Summe Geleistete Sicherheiten</b>                                                          | <b>2.370.000,00</b>   | <b>0,36</b>   |
| <b>Bankguthaben/Verbindlichkeiten</b>                                                         |                       |               |
| <b>EUR %</b>                                                                                  |                       |               |
| <b>Summe Bankguthaben/Verbindlichkeiten</b>                                                   | <b>744.543,74</b>     | <b>0,11</b>   |
| <b>Sonstiges Vermögen</b>                                                                     |                       |               |
| <b>EUR %</b>                                                                                  |                       |               |
| <b>Summe Sonstiges Vermögen</b>                                                               | <b>9.034.566,82</b>   | <b>1,36</b>   |
| <b>FOND S V E R M Ö G E N</b>                                                                 | <b>665.223.478,30</b> | <b>100,00</b> |

KEPLER-FONDS Kapitalanlagegesellschaft m.b.H.

Andreas Lassner-Klein

Dr. Michael Bumberger