

# Optima Rentenfonds

## Halbjahresbericht

vom

1. September 2019 bis 29. Februar 2020

**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  | AT0000A066K2 |
| Thesaurierungsanteil | AT0000A066L0 |

## **Inhaltsübersicht**

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

## Allgemeine Informationen zur Verwaltungsgesellschaft

### Gesellschafter:

Raiffeisenlandesbank Oberösterreich Aktiengesellschaft  
Oberösterreichische Landesbank Aktiengesellschaft  
Oberösterreichische Versicherung Aktiengesellschaft

### Staatskommissäre:

Mag. Jutta Raunig  
Mag. (FH) Eva-Maria Schrittwieser

### Aufsichtsrat:

Mag. Christian Ratz (Vorsitzender)  
Mag. Sonja Ausserer-Stockhamer (Stv. Vorsitzende) (bis 26.02.2020)  
Mag. Thomas Wolfgruber (ab 09.03.2020)  
Mag. Serena Denkmair  
Friedrich Führer  
Gerhard Lauss  
Mag. Othmar Nagl

### Geschäftsführung:

Andreas Lassner-Klein  
Dr. Robert Gründlinger, MBA  
Dr. Michael Bumberger

### Prokuristen:

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

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

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

## Optima Rentenfonds

### Sehr geehrter Anteilinhaber!

Die KEPLER-FONDS Kapitalanlagegesellschaft m.b.H. erlaubt sich, den Halbjahresbericht des Optima Rentenfonds - OGAW gem. §§ 2 iVm 50 InvFG 2011 - vom 1. September 2019 bis 29. Februar 2020 vorzulegen.

In den Subfonds wurde von deren jeweils verwaltenden Verwaltungsgesellschaften Verwaltungsentschädigungen zwischen 0,10 % und 4,00 % per anno verrechnet (exkl. einer allfälligen erfolgsabhängigen Gebühr). Für den Kauf der Anteile wurden keine Ausgabeaufschläge in Rechnung gestellt.

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

| Fondsdetails                                    | per 31.08.2019 | per 29.02.2020 |
|-------------------------------------------------|----------------|----------------|
|                                                 | EUR            | EUR            |
| Fondsvermögen                                   | 152.684.128,96 | 146.315.365,87 |
| errechneter Wert je Ausschüttungsanteil         | 118,75         | 117,71         |
| Ausgabepreis je Ausschüttungsanteil             | 121,71         | 120,65         |
| errechneter Wert je Thesaurierungsanteil        | 149,00         | 148,62         |
| Ausgabepreis je Thesaurierungsanteil            | 152,72         | 152,33         |
| Ausschüttung/Auszahlung je Ausschüttungsanteil  |                | 1,0000         |
| Ausschüttung/Auszahlung je Thesaurierungsanteil |                | 0,3367         |

### Umlaufende Optima Rentenfonds-Anteile zum Berichtsstichtag

|                                             |             |
|---------------------------------------------|-------------|
| <b>Ausschüttungsanteile per 31.08.2019</b>  | 149.901,900 |
| Ausgabe                                     | 8.443,497   |
| Rücknahmen                                  | -9.346,627  |
| <b>Ausschüttungsanteile per 29.02.2020</b>  | 148.998,770 |
| <b>Thesaurierungsanteile per 31.08.2019</b> | 905.229,187 |
| Ausgabe                                     | 29.171,064  |
| Rücknahmen                                  | -67.954,322 |
| <b>Thesaurierungsanteile per 29.02.2020</b> | 866.445,929 |

## Vermögensaufstellung zum 29.02.2020

| ISIN                                                                                    | BEZEICHNUNG                        | STÜCKE/<br>NOMINALE<br>IN TSD | KÄUFE<br>ZUGÄNGE | VERKÄUFE<br>ABGÄNGE | KURS   | KURSWERT<br>IN EUR | ANTEIL<br>IN % |
|-----------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------|-------------------------------|------------------|---------------------|--------|--------------------|----------------|
| <b>Wertpapiervermögen</b>                                                               |                                    |                               |                  |                     |        |                    |                |
| <b>Zum amtlichen Handel oder einem anderen geregelten Markt zugelassene Wertpapiere</b> |                                    |                               |                  |                     |        |                    |                |
| <b>Anleihen</b>                                                                         |                                    |                               |                  |                     |        |                    |                |
| <b>lautend auf EUR</b>                                                                  |                                    |                               |                  |                     |        |                    |                |
| BE6315719490                                                                            | 0,0000 % BELFIUS BK 19/26 MTN      | 100                           |                  |                     | 98,99  | 98.987,00          | 0,07           |
| XS0399353506                                                                            | 0,0000 % EDP FIN. 08/23 ZO MTN     | 100                           |                  |                     | 99,26  | 99.260,00          | 0,07           |
| XS2066706818                                                                            | 0,0000 % ENEL F. INTL 19/24 MTN    | 100                           | 100              |                     | 99,91  | 99.912,50          | 0,07           |
| FR0013444775                                                                            | 0,0000 % ENGIE 19/27 MTN           | 200                           | 200              |                     | 99,86  | 199.715,00         | 0,14           |
| AT000B000476                                                                            | 0,0000 % ERSTE GP BNK AG 06-21 FLR | 100                           |                  |                     | 98,30  | 98.301,50          | 0,07           |
| XS1488418960                                                                            | 0,0000 % HENKEL 16/21 MTN          | 40                            |                  |                     | 100,49 | 40.197,40          | 0,03           |
| XS0245906150                                                                            | 0,0000 % M6 DUBA AUTOP.KONCE.06/25 | 200                           |                  |                     | 97,14  | 45.524,64          | 0,03           |
| FR0013201621                                                                            | 0,0000 % SANOFI 16/22 MTN          | 100                           |                  |                     | 100,74 | 100.744,00         | 0,07           |
| XS2010045271                                                                            | 0,0000 % SCHLUMB.FIN. 19/24        | 100                           | 100              |                     | 100,65 | 100.650,00         | 0,07           |
| AT0000325568                                                                            | 0,0000 % STEIERMARK L.H. 03-43 4   | 200                           |                  |                     | 86,25  | 172.496,00         | 0,12           |
| XS0132424028                                                                            | 0,0260 % HYPO TIROL 01/26FLR MTN   | 200                           |                  |                     | 92,10  | 184.191,50         | 0,13           |
| XS2025468542                                                                            | 0,0400 % CIBC 19/27 MTN            | 400                           |                  |                     | 101,78 | 407.112,00         | 0,28           |
| FR0012558310                                                                            | 0,1000 % REP. FSE 15-25 O.A.T.     | 1.400                         |                  |                     | 106,31 | 1.504.210,73       | 1,03           |
| XS1501560848                                                                            | 0,1250 % AFR. DEV. BK 16/26 MTN    | 200                           |                  |                     | 103,44 | 206.871,00         | 0,14           |
| FR0013432770                                                                            | 0,1250 % BFCM 19/24 MTN            | 100                           |                  |                     | 100,57 | 100.571,50         | 0,07           |
| FR0013444544                                                                            | 0,1250 % DASSAULT SYS 19/26        | 100                           | 100              |                     | 100,65 | 100.653,00         | 0,07           |
| FR0013463650                                                                            | 0,1250 % ESSILORLUXO. 19/25 MTN    | 100                           | 100              |                     | 100,82 | 100.815,00         | 0,07           |
| FR0013482833                                                                            | 0,1250 % LVMH 20/28 MTN            | 200                           | 200              |                     | 99,43  | 198.851,00         | 0,14           |
| XS1492825051                                                                            | 0,1250 % NOVARTIS FIN. 16/23 REGS  | 100                           |                  |                     | 101,36 | 101.356,00         | 0,07           |
| XS1508351357                                                                            | 0,1250 % PKO B.HIPOTECZ. 16/22 MTN | 200                           |                  |                     | 100,83 | 201.650,00         | 0,14           |
| FR0013190188                                                                            | 0,2500 % AGENCE FSE DEV. 16/26 MTN | 400                           |                  |                     | 103,16 | 412.642,00         | 0,28           |
| FR0013453040                                                                            | 0,2500 % ALSTOM 19/26              | 100                           | 100              |                     | 100,28 | 100.277,50         | 0,07           |
| FR0013433596                                                                            | 0,2500 % BQUE POSTALE 19/26 MTN    | 100                           |                  | 100                 | 100,66 | 100.657,00         | 0,07           |
| XS2114852218                                                                            | 0,2500 % COMCAST CORP 20/27        | 100                           | 100              |                     | 100,67 | 100.671,50         | 0,07           |
| FR0013215688                                                                            | 0,2500 % CRE.AGR.PUB.SEC.SCF 16/26 | 100                           |                  |                     | 103,46 | 103.463,00         | 0,07           |
| XS1979262448                                                                            | 0,2500 % DNB BANK 19/24 MTN        | 100                           |                  |                     | 101,41 | 101.413,50         | 0,07           |
| XS1967590180                                                                            | 0,2500 % LLOYDS BANK 19/24 MTN     | 170                           |                  |                     | 102,05 | 173.486,70         | 0,12           |
| XS1569741884                                                                            | 0,2500 % NORD/LB LUX 17/21 MTN     | 100                           |                  |                     | 100,86 | 100.860,50         | 0,07           |
| XS1576693110                                                                            | 0,2500 % OP-ASUNTOLUOTTOP.17/24MTN | 300                           |                  |                     | 102,73 | 308.188,50         | 0,21           |
| FR0013448669                                                                            | 0,2500 % RCI BANQUE 19/23 MTN      | 100                           | 100              |                     | 98,92  | 98.920,50          | 0,07           |
| XS2063247915                                                                            | 0,3000 % BCO SANTAND. 19/26 MTN    | 100                           | 100              |                     | 100,58 | 100.584,00         | 0,07           |
| AT000B023197                                                                            | 0,3200 % SALZBG L.H. 16-22         | 500                           |                  |                     | 100,88 | 504.412,29         | 0,34           |
| XS2049584084                                                                            | 0,3750 % BAWAG P.S.K. 19/27 MTN    | 100                           | 100              |                     | 96,87  | 96.874,00          | 0,07           |
| XS1592881020                                                                            | 0,3750 % BK NOVA SCOTIA 17/22 MTN  | 100                           |                  |                     | 101,11 | 101.110,00         | 0,07           |
| XS1747444245                                                                            | 0,3750 % BMW FIN. NV 18/23 MTN     | 150                           |                  |                     | 101,39 | 152.087,25         | 0,10           |
| FR0013238797                                                                            | 0,3750 % BNP PAR.H.L.SFH 17/24 MTN | 300                           |                  |                     | 103,52 | 310.552,50         | 0,21           |
| XS1594339514                                                                            | 0,3750 % COMMONW.BK AUSTR.17/24MTN | 400                           |                  |                     | 102,78 | 411.132,00         | 0,28           |
| XS1554349297                                                                            | 0,3750 % DBS BANK 17/24 MTN        | 300                           |                  |                     | 102,63 | 307.899,00         | 0,21           |
| XS1725524471                                                                            | 0,3750 % EIKA BOLIGKRED. 17/25 MTN | 500                           |                  |                     | 103,44 | 517.215,00         | 0,35           |
| XS1967003747                                                                            | 0,3750 % EX.IMP.BK.K. 19/24 MTN    | 300                           |                  |                     | 102,44 | 307.308,00         | 0,21           |
| XS1829326716                                                                            | 0,3750 % FEDERAT.CAISSES 18/23 MTN | 210                           |                  |                     | 102,40 | 215.043,15         | 0,15           |
| DE000HSH5Y29                                                                            | 0,3750 % HCOB HPF 16/23            | 200                           |                  |                     | 102,27 | 204.541,00         | 0,14           |
| XS1613238457                                                                            | 0,3750 % HYPO VORARLG BK 17-24 MTN | 500                           |                  |                     | 103,16 | 515.817,50         | 0,35           |
| FR0013232998                                                                            | 0,3750 % LA BANQ.P.HL SFH 17/25MTN | 200                           |                  |                     | 103,66 | 207.310,00         | 0,14           |
| XS2055627538                                                                            | 0,3750 % RAIF.BK INTL 19/26 MTN    | 200                           | 200              |                     | 100,70 | 201.402,00         | 0,14           |
| XS1476654238                                                                            | 0,3750 % SHELL INTL FIN. 16/25 MTN | 100                           |                  |                     | 102,64 | 102.637,00         | 0,07           |
| XS1637099026                                                                            | 0,3750 % SPAREBK 1 BOLIG.17/24 MTN | 400                           |                  |                     | 103,21 | 412.826,00         | 0,28           |
| IT0005212987                                                                            | 0,3750 % UNICREDIT 16/26 MTN       | 580                           |                  |                     | 104,03 | 603.394,30         | 0,41           |
| XS1676933937                                                                            | 0,3750 % WESTPAC BKG 17/23 MTN     | 100                           |                  |                     | 101,41 | 101.414,50         | 0,07           |
| XS1982037696                                                                            | 0,5000 % ABN AMRO BK 19/26 MTN     | 100                           |                  |                     | 103,13 | 103.131,00         | 0,07           |
| XS1755086607                                                                            | 0,5000 % BK NOVA SCOTIA 18/25 MTN  | 200                           |                  |                     | 103,96 | 207.926,00         | 0,14           |
| FR0013434776                                                                            | 0,5000 % BNP PARIBAS 19/25 FLR MTN | 100                           |                  |                     | 100,84 | 100.837,00         | 0,07           |
| XS1717012014                                                                            | 0,5000 % BNZ INTERNAT.FDG 17/23MTN | 100                           |                  |                     | 101,83 | 101.834,50         | 0,07           |
| FR0013455540                                                                            | 0,5000 % BPCE 19/27 MTN            | 100                           | 100              |                     | 100,34 | 100.335,50         | 0,07           |
| DE0001102440                                                                            | 0,5000 % BUNDANL.V.18/28           | 500                           |                  |                     | 109,36 | 546.780,00         | 0,37           |
| XS1458458665                                                                            | 0,5000 % COMMONW.BK AUSTR.16/26MTN | 380                           |                  |                     | 104,40 | 396.725,70         | 0,27           |
| XS1529880368                                                                            | 0,5000 % COVENTRY BLDG 17/24 MTN   | 240                           |                  |                     | 102,83 | 246.788,40         | 0,17           |
| XS2122485845                                                                            | 0,5000 % DOW CHEMICAL 20/27        | 100                           | 100              |                     | 99,48  | 99.477,50          | 0,07           |
| EU000A1G0DV6                                                                            | 0,5000 % EFSF 17/25 MTN            | 500                           |                  |                     | 105,13 | 525.657,50         | 0,36           |
| AT0000A1W509                                                                            | 0,5000 % HYPO TIROL 17/24 MTN      | 200                           |                  |                     | 103,53 | 207.055,00         | 0,14           |

|               |                                    |       |       |        |              |      |
|---------------|------------------------------------|-------|-------|--------|--------------|------|
| XS1513055555  | 0,5000 % MERCK CO. 16/24           | 100   |       | 103,06 | 103.064,00   | 0,07 |
| NL0012650477  | 0,5000 % NAT.-NEDERL.BANK 17/24MTN | 100   |       | 103,66 | 103.662,00   | 0,07 |
| XS1569896498  | 0,5000 % NATIONWIDE BLDG 17/24 MTN | 500   |       | 103,19 | 515.932,50   | 0,35 |
| XS1964577396  | 0,5000 % NIBC BANK 19/27 MTN       | 200   |       | 104,49 | 208.980,00   | 0,14 |
| FR0013201639  | 0,5000 % SANOFI 16/27 MTN          | 100   |       | 104,09 | 104.086,00   | 0,07 |
| XS1788951090  | 0,5000 % SKAND. ENSK. 18/23 MTN    | 100   |       | 101,84 | 101.842,50   | 0,07 |
| XS2080785343  | 0,5000 % TEMASEK FINL 19/31 MTN    | 190   | 190   | 103,97 | 197.535,40   | 0,14 |
| XS2063547041  | 0,5000 % UNICREDIT 19/25 MTN       | 150   | 150   | 99,93  | 149.889,75   | 0,10 |
| XS1615085781  | 0,5000 % WESTPAC BKG 17/24 MTN     | 200   |       | 103,33 | 206.668,00   | 0,14 |
| DE000A2YNQ58  | 0,5000 % WIRECARD AG 19/24REG.S    | 100   | 100   | 94,56  | 94.559,00    | 0,06 |
| FR0013323722  | 0,6000 % HSBC FR 18/23 MTN         | 100   |       | 102,08 | 102.084,00   | 0,07 |
| XS2025466413  | 0,6250 % ABERTIS INF. 19/25 MTN    | 100   | 100   | 99,25  | 99.254,50    | 0,07 |
| XS1936209490  | 0,6250 % ALBERTA 19/26 MTN         | 200   |       | 105,05 | 210.094,00   | 0,14 |
| XS1422919594  | 0,6250 % ANZ NZ(ITL)(LD)16/21 MTN  | 100   |       | 101,12 | 101.115,00   | 0,07 |
| XS1482736185  | 0,6250 % ATLAS COPCO 16/26 MTN     | 100   |       | 104,28 | 104.279,00   | 0,07 |
| XS1548792859  | 0,6250 % BERKSHIRE HATHAWAY 17/23  | 100   |       | 102,19 | 102.192,50   | 0,07 |
| XS1943474483  | 0,6250 % CORP.ANDINA 19/24 MTN     | 300   |       | 101,68 | 305.049,00   | 0,21 |
| XS1559352437  | 0,6250 % DEXIA CL 17/24 MTN        | 500   |       | 103,96 | 519.817,50   | 0,36 |
| LU1556942974  | 0,6250 % GRD-DUCAL LUX. 17/27      | 1.850 |       | 107,48 | 1.988.287,50 | 1,36 |
| DE000A11QTD2  | 0,6250 % K.F.W.ANL.V.15/2025       | 300   |       | 105,53 | 316.585,50   | 0,22 |
| XS1942708873  | 0,6250 % LANSF.HYP. 19/26 MTN      | 400   |       | 105,30 | 421.210,00   | 0,29 |
| XS1599125157  | 0,6250 % NATIONWIDE BLDG 17/23 MTN | 120   |       | 102,37 | 122.839,20   | 0,08 |
| XS1423753463  | 0,6250 % NIBC BANK 16/26 MTN       | 500   |       | 105,35 | 526.727,50   | 0,36 |
| XS1807430811  | 0,6250 % ONTARIO PROV. 18/25 MTN   | 320   |       | 104,76 | 335.217,60   | 0,23 |
| XS1588411188  | 0,6250 % PKO B.HIPOTECZ. 17/23 MTN | 100   |       | 102,37 | 102.369,00   | 0,07 |
| XS1857683335  | 0,6250 % TORONTO-DOM. BK 18/23 MTN | 150   |       | 102,78 | 154.167,75   | 0,11 |
| XS1720642138  | 0,6250 % TOYOTA MOTOR CRED17/24MTN | 130   |       | 103,30 | 134.286,10   | 0,09 |
| ES00000128S2  | 0,6500 % SPANIEN 17-27 FLR         | 500   |       | 111,93 | 563.951,26   | 0,39 |
| FR0013476595  | 0,6640 % VEOLIA ENV. 20/31 MTN     | 100   | 100   | 102,52 | 102.520,50   | 0,07 |
| XS0216258763  | 0,6650 % AUSTRIA 05/20 FLR MTN     | 500   |       | 100,07 | 500.357,50   | 0,34 |
| ES0000012C12  | 0,7000 % SPANIEN 18-33 FLR         | 2.850 | 1.250 | 118,07 | 3.449.578,37 | 2,36 |
| XS1637329639  | 0,7500 % AEGON BK 17/27 MTN 3      | 400   |       | 106,62 | 426.482,00   | 0,29 |
| XS1458405898  | 0,7500 % BANK AMERI. 16/23 MTN     | 100   |       | 102,48 | 102.484,00   | 0,07 |
| PTB CPIOM0057 | 0,7500 % BCO COM. PORT. 17/22      | 400   |       | 102,25 | 408.982,00   | 0,28 |
| IT0005175242  | 0,7500 % BCO POP.DI SONDR. 16-23   | 160   |       | 102,10 | 163.363,20   | 0,11 |
| BE0002483585  | 0,7500 % BELFIUS BK 15/25 MTN      | 400   |       | 105,53 | 422.132,00   | 0,29 |
| XS1394103789  | 0,7500 % BNP PARIBAS 16/22 MTN     | 100   |       | 102,51 | 102.508,50   | 0,07 |
| FR0013230703  | 0,7500 % C.F.FINANC.LOC. 17/27 MTN | 400   |       | 107,16 | 428.626,00   | 0,29 |
| FR0013254273  | 0,7500 % CA HOME LOAN SFH 17/27MTN | 300   |       | 107,30 | 321.910,50   | 0,22 |
| XS1181448561  | 0,7500 % ERSTE GP BNK 15/25 MTN    | 300   |       | 105,57 | 316.723,50   | 0,22 |
| XS1188081936  | 0,7500 % HYPO VORARLG BK 15/25 MTN | 400   |       | 105,53 | 422.104,00   | 0,29 |
| XS1495373505  | 0,7500 % KONINKLIJKE DSM 16/26 MTN | 100   |       | 105,11 | 105.109,50   | 0,07 |
| XS1692485912  | 0,7500 % MUNICIPALITY FIN. 17/27   | 160   |       | 108,40 | 173.437,60   | 0,12 |
| AT0000A28HX3  | 0,7500 % OBERBANK 19/26 MTN        | 100   |       | 102,74 | 102.739,50   | 0,07 |
| XS1795407979  | 0,7500 % PKO B.HIPOTECZ. 18/24 MTN | 400   |       | 103,48 | 413.922,00   | 0,28 |
| XS1871439342  | 0,7500 % RABOBK NEDERLD 18/23 MTN  | 100   |       | 102,60 | 102.603,00   | 0,07 |
| XS1720806774  | 0,7500 % RLBK OBEROEST. 17/23 MTN  | 200   |       | 102,13 | 204.263,00   | 0,14 |
| XS1418786890  | 0,7500 % SOC GENERALE 16/23 MTN    | 100   |       | 102,76 | 102.755,00   | 0,07 |
| XS1827891869  | 0,7500 % SPAREBANK 1 SMN 18/23     | 100   |       | 102,81 | 102.807,50   | 0,07 |
| XS1693281534  | 0,7500 % STAND.CHAR. 17/23 MTN FLR | 150   |       | 101,30 | 151.944,75   | 0,10 |
| DE000A19UR61  | 0,7500 % VONOVIA FINANCE 18/24 MTN | 100   |       | 102,65 | 102.649,50   | 0,07 |
| XS2051362072  | 0,8000 % AT + T INC. 19/30         | 110   | 110   | 99,60  | 109.558,90   | 0,07 |
| AT000B023056  | 0,8000 % SALZBG L.H. 15-21         | 500   |       | 101,52 | 507.615,35   | 0,35 |
| AT000B023205  | 0,8400 % SALZBG L.H. 16-26         | 500   |       | 104,62 | 523.122,87   | 0,36 |
| XS1623404412  | 0,8500 % U.S. BANCORP 2024 MTN     | 100   |       | 103,63 | 103.625,00   | 0,07 |
| XS1647404554  | 0,8750 % ALD 17/22 MTN             | 100   |       | 102,12 | 102.118,50   | 0,07 |
| PTBSRIOE0024  | 0,8750 % BANCO SANT.TO. 17/24 MTN  | 400   |       | 105,15 | 420.606,00   | 0,29 |
| IT0005277451  | 0,8750 % BCO DES.BRIANZA 17/24 MTN | 160   |       | 105,31 | 168.503,20   | 0,12 |
| BE0002586643  | 0,8750 % BNP PAR.FORTIS 18-28 MTN  | 500   |       | 108,58 | 542.885,00   | 0,37 |
| FR0013312493  | 0,8750 % BPCE 18/24 MTN            | 100   |       | 102,73 | 102.725,00   | 0,07 |
| PTCMGTOM0029  | 0,8750 % CAIXA ECO MONTEP.17-22MTN | 200   |       | 102,71 | 205.421,00   | 0,14 |
| FR0013342128  | 0,8750 % CARREFOUR 18/23 MTN       | 100   |       | 102,64 | 102.643,50   | 0,07 |
| XS1553210672  | 0,8750 % CHINA DEV.BK 17/24 MTN    | 250   |       | 103,31 | 258.278,75   | 0,18 |
| XS1799061558  | 0,8750 % DANSKE BK 18/23 MTN       | 100   |       | 101,64 | 101.644,00   | 0,07 |
| XS2032727310  | 0,8750 % ITALGAS 19/30 MTN         | 100   |       | 104,45 | 104.451,50   | 0,07 |
| XS1191309720  | 0,8750 % NATL AUSTR. BK 15/27 MTN  | 300   |       | 107,15 | 321.439,50   | 0,22 |
| DK0009522732  | 0,8750 % NYKREDIT 19/24 MTN        | 100   | 100   | 102,52 | 102.518,00   | 0,07 |
| XS1766477522  | 0,8750 % RABOBK NEDERLD 18/28 MTN  | 400   |       | 108,97 | 435.874,00   | 0,30 |
| XS1756364474  | 0,8750 % RAIF.LABA NO 18/28 MTN    | 200   |       | 108,69 | 217.381,00   | 0,15 |
| XS1195056079  | 0,8750 % ROCHE FIN.EUROPE 15/25MTN | 100   |       | 105,70 | 105.701,00   | 0,07 |
| XS1824235219  | 0,8750 % SANTDR CONS.FIN.18/23 MTN | 100   |       | 102,61 | 102.612,50   | 0,07 |
| XS1586702679  | 0,8750 % SCBC 17/27 MTN            | 550   |       | 107,93 | 593.637,00   | 0,41 |
| XS1523192588  | 0,8750 % URW 16/25 MTN             | 100   |       | 104,76 | 104.756,00   | 0,07 |
| XS1565570212  | 0,8750 % VAN LANSCHOT 17/27 MTN    | 500   |       | 107,38 | 536.910,00   | 0,37 |
| XS1619567677  | 0,9500 % LITAUEN 17/27 MTN         | 240   |       | 107,79 | 258.684,00   | 0,18 |

|              |                                    |       |     |        |              |      |
|--------------|------------------------------------|-------|-----|--------|--------------|------|
| XS1691909920 | 0,9560 % MIZUHO FINL GRP 17/24 MTN | 100   |     | 104,01 | 104.005,00   | 0,07 |
| XS1794196615 | 1,0000 % ARION BANK 18/23 MTN      | 100   |     | 102,01 | 102.012,50   | 0,07 |
| FR0013260361 | 1,0000 % BPCE SFH 17-29 MTN        | 100   |     | 110,91 | 110.909,50   | 0,08 |
| IT0005366288 | 1,0000 % CA ITALIA 19/27 MTN       | 200   |     | 107,73 | 215.455,00   | 0,15 |
| PTCGH1OE0014 | 1,0000 % CAIXA GERAL 15/22 MTN     | 400   |     | 102,47 | 409.860,00   | 0,28 |
| XS1577586321 | 1,0000 % COMP.DE ST.-GOBAIN 17/25  | 100   |     | 104,40 | 104.400,00   | 0,07 |
| CH0483180946 | 1,0000 % CR.SUISSE GR 19/27 FLR    | 100   |     | 102,96 | 102.958,50   | 0,07 |
| FR0013213295 | 1,0000 % EL. FRANCE 16-26 MTN      | 100   |     | 106,70 | 106.700,50   | 0,07 |
| XS1203859415 | 1,0000 % ENAGAS FINANC. 15/23      | 100   |     | 103,30 | 103.300,50   | 0,07 |
| XS1881804006 | 1,0000 % FCA BK(I.BR.) 18/22 MTN   | 100   |     | 101,96 | 101.957,50   | 0,07 |
| XS1401174633 | 1,0000 % HEINEKEN 16/26 MTN        | 180   |     | 105,74 | 190.330,20   | 0,13 |
| IE00BV8C9418 | 1,0000 % IRLAND 2026               | 500   |     | 108,34 | 541.700,00   | 0,37 |
| FR0012674661 | 1,0000 % KLEPIERRE 15-23 MTN       | 100   |     | 103,30 | 103.296,50   | 0,07 |
| XS1397134609 | 1,0000 % LINDE FIN. 16/28 MTN      | 50    |     | 108,63 | 54.315,75    | 0,04 |
| XS1403264374 | 1,0000 % MCDONALDS CORP. 16/23 MTN | 100   |     | 103,98 | 103.982,00   | 0,07 |
| XS2002491517 | 1,0000 % NATWEST MKTS 19/24 MTN    | 100   |     | 103,15 | 103.151,50   | 0,07 |
| XS1486520403 | 1,0000 % NORDEA BK 16/26 FLR MTN   | 100   |     | 101,27 | 101.265,50   | 0,07 |
| XS1734689620 | 1,0000 % OMV AG 17/26 MTN          | 100   |     | 106,65 | 106.646,50   | 0,07 |
| XS1823485039 | 1,0000 % OP YRITYSPANKKI 18/25 MTN | 100   |     | 105,52 | 105.523,50   | 0,07 |
| SI0002103776 | 1,0000 % SLOWENIEN 18-28           | 140   |     | 109,07 | 152.697,30   | 0,10 |
| XS1943561883 | 1,0000 % SPAREBANK 1B 19/29 MTN    | 250   |     | 110,23 | 275.563,75   | 0,19 |
| XS1724873275 | 1,0000 % SUEDZUCKER INTL 17/25     | 150   |     | 101,68 | 152.518,50   | 0,10 |
| XS1241577490 | 1,0000 % UNILEVER 15/23 MTN        | 100   |     | 104,12 | 104.118,00   | 0,07 |
| AT0000A1FQ25 | 1,0600 % RLBK OBEROESTERR.15-23 12 | 700   |     | 103,74 | 726.182,67   | 0,50 |
| IE00BH3SQ895 | 1,1000 % IRLAND 19/29              | 400   |     | 111,49 | 445.942,00   | 0,30 |
| XS1327027998 | 1,1000 % MASTERCARD 15/22          | 100   |     | 103,49 | 103.494,00   | 0,07 |
| XS1716616179 | 1,1000 % WHIRLPOOL F.LUX. 17/27    | 100   |     | 104,82 | 104.815,50   | 0,07 |
| XS1190973559 | 1,1090 % BP CAPITAL MKTS 15/23 MTN | 100   |     | 103,69 | 103.693,00   | 0,07 |
| XS1548458014 | 1,1250 % ABN AMRO 17/32 MTN        | 300   |     | 114,06 | 342.189,00   | 0,23 |
| IT0005340374 | 1,1250 % BANCO BPM 18/23 MTN       | 200   |     | 104,13 | 208.263,00   | 0,14 |
| XS2057069762 | 1,1250 % CK HUT.G.TEL 19/28        | 100   | 100 | 101,99 | 101.993,50   | 0,07 |
| XS1750349190 | 1,1250 % COMMONW.BK AUSTR.18/28MTN | 150   |     | 108,55 | 162.831,00   | 0,11 |
| XS1770927629 | 1,1250 % CORP.ANDINA 18/25 MTN     | 400   |     | 104,46 | 417.844,00   | 0,29 |
| DE000A2LQJ75 | 1,1250 % DEUT.BOERSE ANL 18/28     | 100   |     | 109,69 | 109.687,50   | 0,07 |
| XS1471646965 | 1,1250 % EDP FIN. 16/24 MTN        | 100   |     | 104,45 | 104.448,50   | 0,07 |
| XS1198117670 | 1,1250 % ESSITY 15/25 MTN          | 200   |     | 105,07 | 210.141,00   | 0,14 |
| XS1529559525 | 1,1250 % EUROCLEAR INV. 16/26      | 100   |     | 107,12 | 107.116,50   | 0,07 |
| XS1951313680 | 1,1250 % IMPERIAL BR. 19/23 MTN    | 100   |     | 103,05 | 103.050,00   | 0,07 |
| XS1771838494 | 1,1250 % ING GROEP 18/25 MTN       | 100   |     | 104,32 | 104.319,50   | 0,07 |
| IT0005339210 | 1,1250 % INTESA SAN. 18/25 MTN     | 200   |     | 107,75 | 215.497,00   | 0,15 |
| XS1883352095 | 1,1250 % JTIFS 18/25 MTN           | 100   |     | 105,28 | 105.276,50   | 0,07 |
| XS1829276275 | 1,1250 % LETTLAND 18/28 MTN        | 300   |     | 110,38 | 331.125,00   | 0,23 |
| XS1803247557 | 1,1250 % LUNAR FUNDING V 18/26 MTN | 200   |     | 107,73 | 215.469,00   | 0,15 |
| XS1960678255 | 1,1250 % MEDTR.GLB HD 19/27        | 100   |     | 106,33 | 106.328,00   | 0,07 |
| XS1809240515 | 1,1250 % NIBC BANK 18/23 MTN       | 100   |     | 103,50 | 103.501,50   | 0,07 |
| XS1766612672 | 1,1250 % POLEN 18/26 MTN           | 110   |     | 108,66 | 119.526,00   | 0,08 |
| XS1565699763 | 1,1250 % RYANAIR 17/23 MTN         | 100   |     | 102,84 | 102.841,50   | 0,07 |
| XS1487315860 | 1,1250 % SANTAN.UK GRP 16/23 MTN   | 100   |     | 103,38 | 103.377,00   | 0,07 |
| FR0013409612 | 1,1250 % SOC.GR.PARIS 19/34 MTN    | 300   |     | 113,31 | 339.934,50   | 0,23 |
| XS1582205040 | 1,1250 % STATKRAFT 17/25 MTN       | 100   |     | 105,71 | 105.706,00   | 0,07 |
| XS1395057430 | 1,1250 % TELSTRA CORP. 16/26 MTN   | 100   |     | 106,67 | 106.667,50   | 0,07 |
| XS1412266816 | 1,1500 % JOHNSON + JOHNSON 16/28   | 100   |     | 109,56 | 109.562,50   | 0,07 |
| XS1637162592 | 1,2000 % DH EUROPE FIN. 17/27      | 100   |     | 106,71 | 106.712,50   | 0,07 |
| AT0000A1NWQ1 | 1,2000 % RLBK OBEROESTERR.16-24    | 400   |     | 103,49 | 413.976,16   | 0,28 |
| FR0013233384 | 1,2500 % ACCOR 17/24               | 100   |     | 102,81 | 102.813,50   | 0,07 |
| FR0012766889 | 1,2500 % AIR LIQUIDE FIN.15/25 MTN | 100   |     | 107,32 | 107.315,00   | 0,07 |
| BE0000346552 | 1,2500 % BELGIQUE 18/33 86         | 600   |     | 117,01 | 702.039,00   | 0,48 |
| XS1806124753 | 1,2500 % CK HUTCH.FIN.(18) 18/25   | 100   |     | 104,78 | 104.778,00   | 0,07 |
| XS1433231377 | 1,2500 % DVB BANK MTN.16/23        | 100   |     | 103,82 | 103.819,50   | 0,07 |
| EU000A1G0D0  | 1,2500 % EFSF 17/33 MTN            | 1.000 |     | 117,70 | 1.177.035,00 | 0,80 |
| XS1238901166 | 1,2500 % GENL EL. 15/23            | 110   |     | 103,32 | 113.650,90   | 0,08 |
| XS1887498282 | 1,2500 % HUNGARY 18/25             | 140   |     | 106,74 | 149.432,50   | 0,10 |
| XS1945110606 | 1,2500 % IBM 19/27                 | 100   |     | 107,53 | 107.533,00   | 0,07 |
| FR0013165677 | 1,2500 % KERING 16/26 MTN          | 100   |     | 107,66 | 107.663,00   | 0,07 |
| IT0005315046 | 1,2500 % MADIOBCA 17/29 MTN        | 360   |     | 112,12 | 403.630,20   | 0,28 |
| XS2063268754 | 1,2500 % ROYAL MAIL 19/26          | 100   | 100 | 101,23 | 101.227,50   | 0,07 |
| XS1111559685 | 1,2500 % SANTANDER UK 14/24 MTN    | 250   |     | 107,00 | 267.496,25   | 0,18 |
| XS1955187858 | 1,2500 % SIEMENS FIN 19/31 MTN     | 100   |     | 109,15 | 109.145,00   | 0,07 |
| SI0002103685 | 1,2500 % SLOWENIEN 17-27           | 450   |     | 110,71 | 498.201,75   | 0,34 |
| XS1211040917 | 1,2500 % TEVA PH.F.NL.II 15/23     | 100   |     | 95,13  | 95.129,50    | 0,07 |
| IT0005320665 | 1,2500 % UBI BANCA 18/30 MTN       | 300   |     | 112,21 | 336.636,00   | 0,23 |
| XS1830986326 | 1,2500 % VOLKSWAGEN BK. MTN 18/24  | 100   |     | 103,24 | 103.242,50   | 0,07 |
| IT0005246134 | 1,3000 % B.T.P. 17-28 FLR          | 1.000 |     | 108,34 | 1.111.439,01 | 0,76 |
| XS1577962084 | 1,3000 % BAXTER INTL 17/25         | 100   |     | 105,80 | 105.801,50   | 0,07 |
| XS1963836892 | 1,3490 % MARSH+MCLENN 19/26        | 110   |     | 106,20 | 116.818,90   | 0,08 |

|              |                                    |       |     |        |              |      |
|--------------|------------------------------------|-------|-----|--------|--------------|------|
| DE000A180B80 | 1,3750 % ALLIANZ FIN. II 16/31 MTN | 100   |     | 112,14 | 112.137,50   | 0,08 |
| XS1205616268 | 1,3750 % APT PIPELINES 15/22 MTN   | 100   |     | 103,00 | 102.996,00   | 0,07 |
| FR0013329216 | 1,3750 % AXA BK EUROPE 18/33 MTN   | 300   |     | 117,27 | 351.823,50   | 0,24 |
| XS1330948818 | 1,3750 % BANCO SANTANDER 15/22     | 100   |     | 104,21 | 104.205,50   | 0,07 |
| XS1757394322 | 1,3750 % BARCLAYS 18/26 FLR MTN    | 100   |     | 103,52 | 103.523,00   | 0,07 |
| FR0013222494 | 1,3750 % BOUYGUES 16/27            | 100   |     | 110,47 | 110.465,50   | 0,08 |
| XS1115479559 | 1,3750 % CS AG LDN 14/22 MTN       | 100   |     | 103,08 | 103.075,00   | 0,07 |
| DE000A2RYD91 | 1,3750 % DAIM INT.FI. 19/26 MTN    | 100   |     | 105,50 | 105.496,50   | 0,07 |
| XS1147605791 | 1,3750 % GLAXOSM.CAP. MTN 14/24    | 100   |     | 106,81 | 106.810,00   | 0,07 |
| IT0005156044 | 1,3750 % INTESA SAN. 15/25 MTN     | 100   |     | 109,82 | 109.820,00   | 0,08 |
| XS1409726731 | 1,3750 % LETTLAND 16/36 MTN        | 200   |     | 116,74 | 233.470,00   | 0,16 |
| XS1511787589 | 1,3750 % MORGAN STANLEY 16/26 MTN  | 100   |     | 106,32 | 106.322,50   | 0,07 |
| XS1551446880 | 1,3750 % NATURGY FINANCE 17/27 MTN | 100   |     | 108,10 | 108.100,00   | 0,07 |
| XS1180130939 | 1,3750 % RABOBK NEDERLD 15/27 MTN  | 100   |     | 109,75 | 109.748,50   | 0,08 |
| AT000B093273 | 1,3750 % RLB STEIERMARK 18-33 MTN  | 100   |     | 117,62 | 117.622,00   | 0,08 |
| FR0013324357 | 1,3750 % SANOFI 18/30 MTN          | 100   |     | 112,22 | 112.220,50   | 0,08 |
| XS1874127902 | 1,3750 % SIEMENS FINANC. 18/30 MTN | 100   |     | 110,56 | 110.564,50   | 0,08 |
| XS1652866002 | 1,3750 % TERNA R.E.N. 17/27 MTN    | 200   |     | 108,59 | 217.172,00   | 0,15 |
| XS1202213291 | 1,4000 % PPG INDUSTR. 15/27        | 100   |     | 106,69 | 106.692,50   | 0,07 |
| XS1509942923 | 1,4500 % INMOBIL.COL.SOC.16/24 MTN | 100   |     | 105,71 | 105.714,00   | 0,07 |
| AT000B022728 | 1,4900 % SALZBG L.H. 14-20         | 400   |     | 100,15 | 400.610,00   | 0,27 |
| XS1298431799 | 1,5000 % ABN AMRO 15/30 MTN        | 400   |     | 117,33 | 469.322,00   | 0,32 |
| FR0012206993 | 1,5000 % AEROP.DE PARIS SA 14/25   | 100   |     | 107,91 | 107.905,50   | 0,07 |
| XS1379122101 | 1,5000 % AMERICA MOVIL 16/24       | 100   |     | 105,95 | 105.952,00   | 0,07 |
| XS1197775692 | 1,5000 % APTIV 15/25               | 100   |     | 105,09 | 105.089,50   | 0,07 |
| IT0005090318 | 1,5000 % B.T.P. 15-25              | 500   |     | 105,17 | 525.867,50   | 0,36 |
| IT0005153975 | 1,5000 % BANCO BPM 15-25 MTN       | 300   |     | 107,64 | 322.921,50   | 0,22 |
| FR0011003672 | 1,5000 % CADES 11-21 FLR           | 600   |     | 103,38 | 652.023,44   | 0,45 |
| XS1859010685 | 1,5000 % CITIGROUP 18/26 FLR MTN   | 100   |     | 106,29 | 106.287,00   | 0,07 |
| XS1854532949 | 1,5000 % FRESE.MED.CARE MTN 18/25  | 100   |     | 107,51 | 107.506,00   | 0,07 |
| XS1529515584 | 1,5000 % HEIDEL.CEMENT MTN 16/25   | 100   |     | 105,67 | 105.666,50   | 0,07 |
| XS1681050610 | 1,5000 % LLOYDS BKG GRP 17/27 MTN  | 150   |     | 107,83 | 161.745,00   | 0,11 |
| XS1689185426 | 1,5000 % MAGNA INTL INC. 17/27     | 100   |     | 108,16 | 108.155,50   | 0,07 |
| XS1203941775 | 1,5000 % METRO MTN 15/25           | 120   |     | 104,09 | 124.905,60   | 0,09 |
| XS1395010397 | 1,5000 % MONDI FINANCE 16/24 MTN   | 100   |     | 105,14 | 105.143,00   | 0,07 |
| AT0000A1K9F1 | 1,5000 % OESTERR. 16/47            | 600   |     | 132,67 | 796.008,00   | 0,54 |
| AT0000A1PEF7 | 1,5000 % OESTERR. 16/86            | 300   |     | 150,66 | 451.969,50   | 0,31 |
| FR0013172939 | 1,5000 % PERNOD-RICARD 16/26       | 200   |     | 108,72 | 217.438,00   | 0,15 |
| XS1793224632 | 1,5000 % RELX FIN 18/27            | 150   |     | 108,68 | 163.018,50   | 0,11 |
| FR0012993103 | 1,5000 % REP. FSE 15-31 O.A.T.     | 2.500 |     | 118,88 | 2.971.912,50 | 2,03 |
| XS1405762805 | 1,5000 % TEL.FIN. 16/26            | 100   |     | 108,70 | 108.704,00   | 0,07 |
| SK4120011149 | 1,6000 % VSEOB.UV.BKA. 15-30       | 300   |     | 110,93 | 332.788,50   | 0,23 |
| XS1686846061 | 1,6250 % ANGLO AM. CAP. 17/25 MTN  | 200   |     | 104,44 | 208.876,00   | 0,14 |
| XS1718417717 | 1,6250 % BASF MTN 17/37            | 80    |     | 116,55 | 93.236,00    | 0,06 |
| XS1876076040 | 1,6250 % BCO DE SABADELL 18/24 MTN | 100   |     | 104,85 | 104.848,00   | 0,07 |
| IT0005246415 | 1,6250 % CA ITALIA 17/29 MTN       | 300   |     | 114,56 | 343.675,50   | 0,23 |
| XS1151586945 | 1,6250 % CHILE 14/25               | 100   |     | 107,58 | 107.582,00   | 0,07 |
| AT0000A1LHT0 | 1,6250 % NOVOMATIC 16-23 MTN 1     | 100   |     | 101,84 | 101.838,50   | 0,07 |
| XS1775786574 | 1,6250 % SAMPO 18/28 MTN           | 100   |     | 110,39 | 110.388,50   | 0,08 |
| DE000A2TSTG3 | 1,6250 % SAP SE IS 18/31           | 100   |     | 114,48 | 114.481,00   | 0,08 |
| SK4120011420 | 1,6250 % SLOWAKEI 16-31            | 250   |     | 117,92 | 294.807,50   | 0,20 |
| FR0013445335 | 1,6250 % SUEZ 19/UND. FLR          | 100   | 100 | 100,01 | 100.005,50   | 0,07 |
| XS2002018500 | 1,6250 % VODAFONE GRP 19/30 MTN    | 150   |     | 109,36 | 164.046,00   | 0,11 |
| XS1615079974 | 1,6380 % JPMORGAN CHASE 17/28 FLR  | 100   |     | 108,48 | 108.476,50   | 0,07 |
| XS1792505866 | 1,6940 % GM FINANCIAL 18/25 MTN    | 150   |     | 104,65 | 156.971,25   | 0,11 |
| IE00BV8C9B83 | 1,7000 % IRLAND 17/37              | 400   | 400 | 123,71 | 494.828,00   | 0,34 |
| XS1769041606 | 1,7000 % NOVARTIS FIN. 18/38       | 200   |     | 119,30 | 238.594,00   | 0,16 |
| XS1571982468 | 1,7500 % 2I RETE GAS 17/26 MTN     | 100   |     | 108,15 | 108.146,00   | 0,07 |
| XS1528093799 | 1,7500 % AUTOSTRADA IT. 16/27 MTN  | 100   |     | 96,56  | 96.561,50    | 0,07 |
| FR0013408960 | 1,7500 % BFCM 19/29 MTN            | 100   |     | 110,99 | 110.988,00   | 0,08 |
| XS1346652891 | 1,7500 % CHILE 16/26               | 190   |     | 109,33 | 207.734,60   | 0,14 |
| XS1969600748 | 1,7500 % CNH INDUSTR. 19/27        | 100   |     | 104,48 | 104.483,00   | 0,07 |
| XS1202849086 | 1,7500 % GLENCORE FIN.EU 15/25 MTN | 100   |     | 104,32 | 104.324,00   | 0,07 |
| XS1672151492 | 1,7500 % HOLCIM FIN.LUX. 17/29 MTN | 100   |     | 106,78 | 106.782,00   | 0,07 |
| XS1785340172 | 1,7500 % INTESA SAN. 18/28 MTN     | 100   |     | 106,20 | 106.199,50   | 0,07 |
| XS1788515606 | 1,7500 % ROYAL BK SCOTL 18/26 MTN  | 100   |     | 105,27 | 105.274,00   | 0,07 |
| XS1241581096 | 1,7500 % TENNET HOLDING 15/27      | 100   |     | 112,55 | 112.551,00   | 0,08 |
| XS0234546538 | 1,7523 % BK OF AMERICA 05/20FLRMTN | 700   |     | 100,94 | 706.566,00   | 0,48 |
| XS1602547264 | 1,7760 % BANK AMERI. 17/27 FLR MTN | 100   |     | 108,70 | 108.704,00   | 0,07 |
| XS1843459782 | 1,8000 % INTL FLAV.+FRAG. 18/26    | 100   |     | 106,76 | 106.757,50   | 0,07 |
| XS2055079904 | 1,8230 % WIN.DEA FIN. 19/31        | 100   | 100 | 104,56 | 104.564,00   | 0,07 |
| FR0011008705 | 1,8500 % REP. FSE 11-27 O.A.T.     | 400   |     | 124,60 | 534.642,70   | 0,37 |
| XS1799545329 | 1,8750 % ACS.SERV.COM.EN.18/26 MTN | 100   |     | 107,36 | 107.356,00   | 0,07 |
| XS1382693452 | 1,8750 % BULGARIEN 16/23 MTN       | 200   |     | 106,37 | 212.740,00   | 0,15 |
| AT0000A1LJH1 | 1,8750 % CA IMMO 16-21             | 50    |     | 102,35 | 51.173,50    | 0,03 |

|              |                                    |       |     |        |              |      |
|--------------|------------------------------------|-------|-----|--------|--------------|------|
| XS1317305198 | 1,8750 % CARNIVAL 15/22            | 100   |     | 104,27 | 104.274,00   | 0,07 |
| XS1236685613 | 1,8750 % CHILE 15/30               | 140   |     | 113,81 | 159.331,90   | 0,11 |
| XS1377682676 | 1,8750 % COCA COLA HBC F.16/24 MTN | 200   |     | 109,33 | 218.667,00   | 0,15 |
| FR0013367422 | 1,8750 % COVIVIO HOTELS 18/25      | 100   |     | 107,70 | 107.698,50   | 0,07 |
| XS1538284230 | 1,8750 % CREDIT AGR.LN 16/26 MTN   | 100   |     | 109,80 | 109.799,50   | 0,08 |
| XS1571293684 | 1,8750 % ERICSSON 17/24 MTN        | 100   |     | 106,04 | 106.035,50   | 0,07 |
| XS1824462896 | 1,8750 % G4S INTL FIN. 18/25 MTN   | 100   |     | 105,05 | 105.048,50   | 0,07 |
| XS1721244371 | 1,8750 % IBERDROLA INTL.17/UND.FLR | 100   |     | 103,08 | 103.079,50   | 0,07 |
| XS1708167652 | 1,8750 % VERIZON COMM 17/29        | 100   |     | 113,05 | 113.045,00   | 0,08 |
| XS1586555945 | 1,8750 % VOLKSWAGEN INTL 17/27     | 100   |     | 107,42 | 107.415,50   | 0,07 |
| BE6285455497 | 2,0000 % AB INBEV 16/28 MTN        | 100   |     | 112,27 | 112.274,50   | 0,08 |
| IT0005359507 | 2,0000 % BCA PASCH.SI 19/24 MTN    | 200   | 200 | 106,91 | 213.824,00   | 0,15 |
| XS1968706108 | 2,0000 % CREDIT AGR. 19/29 MTN     | 200   |     | 108,69 | 217.381,00   | 0,15 |
| XS1843435923 | 2,0000 % FID.NATL INF 19/30        | 110   |     | 111,18 | 122.299,65   | 0,08 |
| XS1265805090 | 2,0000 % GOLDM.S.GRP 15/23 MTN     | 100   |     | 106,48 | 106.479,50   | 0,07 |
| XS1861206636 | 2,0000 % GOLDM.S.GRP 18/28 MTN     | 60    |     | 111,30 | 66.781,20    | 0,05 |
| AT000B112552 | 2,0000 % OBERBK 13-23 MTN          | 300   |     | 106,90 | 320.695,50   | 0,22 |
| FR0013368206 | 2,0000 % RENAULT 18-26 MTN         | 100   |     | 101,42 | 101.423,50   | 0,07 |
| XS2062490649 | 2,0450 % EP INFRASTR. 19/28        | 150   | 150 | 104,39 | 156.590,25   | 0,11 |
| IT0005370306 | 2,1000 % ITALIEN 19/26             | 300   |     | 109,06 | 327.184,50   | 0,22 |
| XS1840618216 | 2,1250 % BAYER CAP.CORP. 18/29     | 100   |     | 112,80 | 112.804,50   | 0,08 |
| XS1575640054 | 2,1250 % ENERGA FIN. 17/27 MTN     | 100   |     | 105,59 | 105.593,00   | 0,07 |
| IT0005151854 | 2,1250 % MTE PASCHI SI. 15/25 MTN  | 150   |     | 110,61 | 165.911,25   | 0,11 |
| XS2010045511 | 2,1250 % NGG FINANCE 19/82 FLR     | 100   | 100 | 103,53 | 103.528,00   | 0,07 |
| FR0012881555 | 2,2000 % TERECA 15/25              | 100   |     | 110,31 | 110.305,00   | 0,08 |
| DE000A14J9N8 | 2,2410 % ALLIANZ SUB 2015/2045     | 100   |     | 107,97 | 107.967,00   | 0,07 |
| XS0825855751 | 2,2500 % FORTUM OYJ 12/22 MTN      | 100   |     | 105,87 | 105.870,00   | 0,07 |
| XS1729882024 | 2,2500 % TALANX AG NACHR.ANL 17/47 | 200   |     | 107,13 | 214.268,00   | 0,15 |
| XS1112013666 | 2,2500 % WPP FINANCE 14/26 MTN     | 100   |     | 111,68 | 111.679,50   | 0,08 |
| IT0005004426 | 2,3500 % B.T.P. 14-24 FLR          | 1.900 |     | 111,90 | 2.161.979,11 | 1,48 |
| XS2077670003 | 2,3750 % BAYER AG 2019/2079        | 100   | 100 | 101,68 | 101.680,50   | 0,07 |
| XS1975757789 | 2,3750 % BCA POP.SOND 19/24        | 120   |     | 104,01 | 124.809,60   | 0,09 |
| XS0863484035 | 2,3750 % HETA ASS.RES. 12/22       | 200   |     | 107,51 | 215.011,00   | 0,15 |
| FR0013413887 | 2,3750 % ORANGE 19/UND. FLR MTN    | 100   |     | 105,29 | 105.292,50   | 0,07 |
| XS1403416222 | 2,3750 % TURKIYE VAKIF.BK.16/21MTN | 310   |     | 100,62 | 311.935,95   | 0,21 |
| XS1292352843 | 2,3840 % EESTI ENERGIA 15/23       | 100   |     | 106,94 | 106.941,50   | 0,07 |
| XS1201001572 | 2,5000 % BCO SANTANDER 15/25 MTN   | 100   |     | 108,19 | 108.194,00   | 0,07 |
| DE0001135481 | 2,5000 % BUNDANL.V.12/44           | 400   |     | 165,33 | 661.320,00   | 0,45 |
| XS1071713470 | 2,5000 % CARLSBERG BREW. 14/24 MTN | 100   |     | 110,08 | 110.083,00   | 0,08 |
| EU000A1HBXS7 | 2,5000 % EU EUROP. UNION 12/27 MTN | 200   |     | 122,33 | 244.656,00   | 0,17 |
| NL0010071189 | 2,5000 % NEDERLD 12-33             | 500   |     | 136,83 | 684.147,50   | 0,47 |
| XS1082660744 | 2,5000 % ORLEN CAP. 14/21          | 100   |     | 103,28 | 103.275,00   | 0,07 |
| XS1382368113 | 2,5000 % ROYAL BK SCOTLD 16/23 MTN | 100   |     | 107,02 | 107.022,00   | 0,07 |
| XS1048529041 | 2,5000 % SHELL INTL FIN. 14/26 MTN | 100   |     | 115,58 | 115.579,00   | 0,08 |
| XS0933241456 | 2,5000 % TELENOR ASA 13/25 MTN     | 100   |     | 112,97 | 112.966,50   | 0,08 |
| AT0000A0XP66 | 2,5500 % BKS BANK AG 12-22 8/PP    | 100   |     | 107,54 | 107.544,50   | 0,07 |
| XS1954087695 | 2,5750 % BBVA 19/29 FLR MTN        | 100   |     | 105,39 | 105.386,50   | 0,07 |
| DE000DL19US6 | 2,6250 % DT.BANK MTN 19/26         | 100   |     | 108,76 | 108.761,50   | 0,07 |
| XS0996354956 | 2,6250 % ENI S.P.A. 13/21 MTN      | 100   |     | 104,97 | 104.973,00   | 0,07 |
| XS1935128956 | 2,6250 % IMMOFINANZ 19/23          | 100   |     | 106,40 | 106.398,50   | 0,07 |
| XS1152338072 | 2,6250 % MERCK KGAA SUB.ANL.14/74  | 100   |     | 102,75 | 102.750,00   | 0,07 |
| AT0000A138R4 | 2,6500 % BK TIROL VORARLBG13-23 35 | 200   |     | 110,48 | 220.954,00   | 0,15 |
| XS0876678391 | 2,7500 % ALANDSBANKEN 13/23 MTN    | 500   |     | 108,54 | 542.717,50   | 0,37 |
| AT000B121967 | 2,7500 % VOLKSBANK WIEN 17-27 FLR  | 100   |     | 104,71 | 104.706,00   | 0,07 |
| XS1072249045 | 2,8750 % LBBW MTN.R.746            | 100   |     | 102,97 | 102.971,50   | 0,07 |
| IT0005038283 | 2,8750 % MTE PASCHI SI. 14/24 MTN  | 300   |     | 111,57 | 334.719,00   | 0,23 |
| XS1713462403 | 2,8750 % OMV AG 18-UND. FLR        | 100   |     | 106,70 | 106.695,00   | 0,07 |
| XS0982019126 | 3,0000 % INNOGY FINANCE 13/24 MTN  | 90    |     | 111,94 | 100.743,75   | 0,07 |
| XS1015428821 | 3,0000 % POLEN 14/24 MTN           | 350   |     | 112,98 | 395.412,50   | 0,27 |
| XS1843449395 | 3,0000 % TAKEDA PHARMA.18/30 REGS  | 100   |     | 121,39 | 121.385,50   | 0,08 |
| IT0004988553 | 3,0000 % UNICREDIT 14/24 MTN       | 200   |     | 113,33 | 226.652,00   | 0,15 |
| XS1428953407 | 3,1250 % HSBC HLDGS 16/28 MTN      | 200   |     | 117,03 | 234.061,00   | 0,16 |
| XS1140857316 | 3,1250 % STAND.CHAR. 14/24 MTN     | 100   |     | 112,09 | 112.092,50   | 0,08 |
| BE0002644251 | 3,2500 % AGEAS 19/49 FLR           | 100   |     | 111,34 | 111.335,50   | 0,08 |
| FR0013398229 | 3,2500 % ENGIE 19/UND. FLR         | 100   |     | 109,23 | 109.228,50   | 0,07 |
| XS1843448314 | 3,2500 % MUENCH.RUECK 18/49        | 100   |     | 118,16 | 118.162,50   | 0,08 |
| XS0919581982 | 3,3744 % RZD CAPITAL 13/21         | 100   |     | 104,09 | 104.087,00   | 0,07 |
| XS0906946008 | 3,3890 % GAZ CAPITAL 13/20MTN REGS | 100   |     | 100,18 | 100.182,50   | 0,07 |
| XS0746010908 | 3,6250 % TELIA COMPANY AB 12/24MTN | 100   |     | 114,84 | 114.842,50   | 0,08 |
| XS0953958641 | 3,7500 % SPP INFRA.FIN. 13/20      | 100   |     | 101,51 | 101.514,50   | 0,07 |
| XS1910948675 | 4,1250 % VOLKSWAGEN INTL 18/38     | 100   |     | 133,81 | 133.814,50   | 0,09 |
| AT0000A04967 | 4,1500 % AUSTRIA 2037 MTN 144A     | 150   |     | 170,86 | 256.290,00   | 0,18 |
| IT0004955271 | 4,1500 % CREDITO EMILIANO 13-28    | 300   |     | 125,77 | 377.305,50   | 0,26 |
| FR0010918490 | 4,2470 % VEOLIA ENVIRONN.10/21 MTN | 100   |     | 103,79 | 103.793,50   | 0,07 |
| XS0098449456 | 4,2500 % ITALY(REP.OF) 99/29FLRMTN | 300   |     | 127,22 | 381.673,50   | 0,26 |

|                        |                                    |         |     |        |              |      |
|------------------------|------------------------------------|---------|-----|--------|--------------|------|
| XS0835890350           | 4,2500 % PETROBRAS GBL FIN. 12/23  | 100     |     | 112,13 | 112.133,00   | 0,08 |
| SK4120008665           | 4,4000 % SLOWAKEI 2029             | 300     |     | 140,88 | 422.640,00   | 0,29 |
| IT0004898034           | 4,5000 % B.T.P. 13-23              | 1.000   |     | 113,70 | 1.136.955,00 | 0,78 |
| MT0000012139           | 4,5000 % MALTA 2028 II             | 210     |     | 138,00 | 289.793,70   | 0,20 |
| XS1550988643           | 4,6250 % NN GROUP 17/48 FLR MTN    | 100     |     | 119,59 | 119.591,50   | 0,08 |
| XS1799939027           | 4,6250 % VOLKSWAGEN INTL18/UND.FLR | 100     |     | 112,28 | 112.282,00   | 0,08 |
| XS1568888777           | 4,8750 % PET. MEX. 17/28 MTN       | 100     |     | 107,15 | 107.153,00   | 0,07 |
| IT0004532559           | 5,0000 % B.T.P. 09-40              | 350     | 350 | 154,17 | 539.603,75   | 0,37 |
| FR0011697028           | 5,0000 % EL. FRANCE 14/UND.FLR MTN | 100     |     | 116,63 | 116.628,50   | 0,08 |
| XS1311440082           | 5,5000 % GENERALI 15/47 FLR MTN    | 100     |     | 122,59 | 122.591,00   | 0,08 |
| XS0213101073           | 5,5000 % PET. MEX. 05/25MTN REGS   | 50      |     | 115,09 | 57.547,25    | 0,04 |
| PTOTEQOE0015           | 5,6500 % PORTUGAL 13-24            | 350     |     | 123,41 | 431.924,50   | 0,30 |
| <b>lautend auf CHF</b> |                                    |         |     |        |              |      |
| CH0024015452           | 2,5000 % KOMMUNALKRED.06-22 MTN    | 250     |     | 105,79 | 247.938,76   | 0,17 |
| <b>lautend auf GBP</b> |                                    |         |     |        |              |      |
| XS0429325748           | 10,0000 % BARCLAYS BK 09/21 MTN    | 100     |     | 110,24 | 129.357,30   | 0,09 |
| <b>lautend auf ATS</b> |                                    |         |     |        |              |      |
| AT0000296181           | 7,5000 % 1.GRP BK AG 94-24 5       | 3.000   |     | 123,37 | 268.960,71   | 0,18 |
| <b>lautend auf ITL</b> |                                    |         |     |        |              |      |
| XS0071094667           | 0,0000 % COBA DRES.D.FIN. NK/26    | 200.000 |     | 93,10  | 96.163,24    | 0,07 |
| DE0001342244           | 0,0000 % DT.BANK 96/26ZO           | 250.000 |     | 90,25  | 116.531,40   | 0,08 |
| <b>lautend auf NLG</b> |                                    |         |     |        |              |      |
| NL0000133924           | 6,2500 % AUSTRIA 94-24             | 500     |     | 126,77 | 287.621,78   | 0,20 |
| <b>lautend auf USD</b> |                                    |         |     |        |              |      |
| US912828TE09           | 0,1250 % US TREASURY 2022          | 1.700   |     | 101,30 | 1.613.797,69 | 1,10 |
| US912828WU04           | 0,1250 % US TREASURY 2024          | 800     |     | 102,36 | 745.238,57   | 0,51 |
| US66989HAR93           | 2,2000 % NOVARTIS CAP 20/30        | 100     | 100 | 102,23 | 93.106,10    | 0,06 |
| US89153VAT61           | 2,8290 % TOTAL CA.INT 19/30        | 100     | 100 | 105,69 | 96.260,47    | 0,07 |
| USN27915AS11           | 3,6000 % DT.TELEK.INTL F.17/27REGS | 150     | 150 | 108,35 | 148.019,81   | 0,10 |
| US10373QAE08           | 4,2340 % BP CAP. MARK. AMER. 18/28 | 100     |     | 115,53 | 105.218,12   | 0,07 |
| XS0214754755           | 43,8700 % NM PLC 05/20FLRMTN       | 260     |     | 103,33 | 244.672,62   | 0,17 |
| XS0739988086           | 6,6250 % LITAUEN 12/22 REGS        | 350     |     | 109,58 | 349.287,57   | 0,24 |
| US35177PAL13           | 9,0000 % ORANGE 2031               | 150     |     | 159,42 | 217.781,42   | 0,15 |

#### Strukturierte Produkte

##### lautend auf EUR

|              |                                     |       |  |        |              |      |
|--------------|-------------------------------------|-------|--|--------|--------------|------|
| GRR000000010 | 0,0000 % GRIECHENLAND 12-42 IO GDP  | 493   |  | 0,45   | 2.235,76     | 0,00 |
| IT0006596701 | 0,0000 % WORLD BK 05-25             | 600   |  | 109,40 | 656.421,00   | 0,45 |
| XS0221500571 | 0,6020 % AUSTRIA 05/20 FLR MTN      | 1.000 |  | 109,43 | 1.094.333,33 | 0,75 |
| XS0251226154 | 0,7591 % DEXIA CL 06/21 FLRMTN      | 100   |  | 100,69 | 100.692,00   | 0,07 |
| XS0229808315 | 1,1130 % AUSTRIA 05/25 FLR MTN      | 885   |  | 107,25 | 949.193,48   | 0,65 |
| DE000DXA0MG8 | 1,7243 % LB.HESS.-THR. OP.1337 VAR  | 400   |  | 109,20 | 436.806,27   | 0,30 |
| DE000BLB5GT7 | 12,5000 % BAY.LDSBK.OPF.R.20269 VAR | 100   |  | 178,49 | 178.487,50   | 0,12 |
| XS0211284491 | 2,0000 % RABOBK NEDERLD05/35FLRMTN  | 100   |  | 118,55 | 118.545,50   | 0,08 |
| NL0000116796 | 5,5000 % NM PLC 05-35 FLR           | 240   |  | 116,66 | 279.987,13   | 0,19 |

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

##### Anleihen

##### lautend auf EUR

|              |                                    |     |    |        |            |      |
|--------------|------------------------------------|-----|----|--------|------------|------|
| IT0004167216 | 0,0000 % LAMEZIA TERME,STADT 06-26 | 443 | 27 | 77,71  | 344.558,94 | 0,24 |
| IT0003755722 | 0,0000 % SALERNO, COMUNE 04-24 FLR | 210 | 21 | 97,52  | 204.799,35 | 0,14 |
| XS0767661423 | 4,3362 % LEASEPLAN 12/24 FLR MTN   | 300 |    | 105,38 | 316.125,00 | 0,22 |

#### Strukturierte Produkte

##### lautend auf EUR

|              |                                 |     |  |       |            |      |
|--------------|---------------------------------|-----|--|-------|------------|------|
| XS0623660528 | 0,0000 % COBA 11/23 CL          | 400 |  | 99,31 | 397.240,00 | 0,27 |
| XS0228145917 | 0,0000 % DEXIA CL 05/25 FLR MTN | 200 |  | 93,38 | 186.758,64 | 0,13 |

#### In sonstige Märkte einbezogene Investmentzertifikate

##### Anteile an OGAW und OGA

##### lautend auf EUR

|              |                                             |         |       |        |               |       |
|--------------|---------------------------------------------|---------|-------|--------|---------------|-------|
| AT0000718598 | KEPLER Emerging Markets Rentenfonds (T)     | 40.000  |       | 238,59 | 9.543.600,00  | 6,53  |
| AT0000722541 | KEPLER High Yield Corporate Rentenfonds (T) | 100.000 | 4.000 | 148,30 | 14.830.000,00 | 10,15 |
| AT0000A066J4 | KEPLER Osteuropa Plus Rentenfonds (T)       | 28.000  |       | 144,75 | 4.053.000,00  | 2,77  |

|              |                                      |        |        |               |      |
|--------------|--------------------------------------|--------|--------|---------------|------|
| AT0000600671 | KEPLER Realzins Plus Rentenfonds (T) | 90.000 | 130,59 | 11.753.100,00 | 8,04 |
| LU1390062245 | MUL-LYX.EO 2-10Y I.EX. A             | 77.000 | 95,78  | 7.374.675,00  | 5,05 |

**Summe Wertpapiervermögen** **145.174.025,36** **99,22**

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

## Derivative Produkte

### Devisentermingeschäfte

Abgeschlossen mit Raiffeisenlandesbank Oberösterreich

#### Verkauf

|                                 |    |            |  |  |            |       |
|---------------------------------|----|------------|--|--|------------|-------|
| USD/EUR Laufzeit bis 19.03.2020 | 2) | -3.500.000 |  |  | -49.517,11 | -0,03 |
| USD/EUR Laufzeit bis 19.03.2020 | 2) | -600.000   |  |  | 4.497,10   | 0,00  |

**Summe Derivate** **-45.020,01** **-0,03**

### Bankguthaben/Verbindlichkeiten

|                    |  |  |  |  |            |      |
|--------------------|--|--|--|--|------------|------|
| EUR                |  |  |  |  | 201.118,16 | 0,14 |
| nicht EU-Währungen |  |  |  |  | 17,18      | 0,00 |

**Summe Bankguthaben / Verbindlichkeiten** **201.135,34** **0,14**

### Sonstiges Vermögen

|                                                   |  |  |  |  |              |       |
|---------------------------------------------------|--|--|--|--|--------------|-------|
| Ausstehende Zahlungen                             |  |  |  |  | -49.559,67   | -0,03 |
| Diverse Gebühren                                  |  |  |  |  | -21.244,54   | -0,02 |
| Zinsansprüche                                     |  |  |  |  | 1.056.049,28 | 0,72  |
| Zinsen Anlagekonten (inkl. negativer Habenzinsen) |  |  |  |  | -19,89       | 0,00  |

**Summe sonstiges Vermögen** **985.225,18** **0,67**

**Fondsvermögen** **146.315.365,87** **100,00**

### Devisenkurse

Vermögenswerte in fremder Währung wurden zu folgenden Devisenkursen umgerechnet:

| WÄHRUNG                           | KURS       |
|-----------------------------------|------------|
| Oesterreichischer Schilling (ATS) | 13,7603    |
| Canadische Dollar (CAD)           | 1,4672     |
| Schweizer Franken (CHF)           | 1,0667     |
| Britische Pfund (GBP)             | 0,8522     |
| Italienische Lire (ITL)           | 1.936,2700 |
| Niederländische Gulden (NLG)      | 2,2037     |
| US-Dollar (USD)                   | 1,0980     |

Die Vermögensgegenstände des Sondervermögens sind auf der Grundlage von Kursen bzw. Marktsätzen per 27. Februar 2020 oder letztbekannte bewertet.

### Regeln für die Vermögensbewertung

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

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

Die Kurswerte der Vermögenswerte werden wie folgt ermittelt:

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

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

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

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

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

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

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

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

### Wertpapiervermögen

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

##### Anleihen

##### lautend auf EUR

|              |                                     |     |       |
|--------------|-------------------------------------|-----|-------|
| DE0001030542 | 0,1000 % BUNDANL.V. 12/23 INFL.LKD  |     | 1.100 |
| XS2078532913 | 0,1250 % CHINA 19/26                | 250 | 250   |
| XS1626109968 | 0,1250 % MORE BOLIGKRED. 17/22      |     | 320   |
| ES0000012B70 | 0,1500 % SPANIEN 18-23 FLR          |     | 1.400 |
| XS1418849482 | 0,2500 % AEGON BK 16/23 MTN 2       |     | 300   |
| XS1586704378 | 0,2500 % NATL AUSTR. BK 17/22 MTN   |     | 190   |
| XS1689593389 | 0,2500 % OVERS.-CHIN.BKG. 17/22 MTN |     | 140   |
| XS1591674459 | 0,2500 % WESTPAC SEC.NZ 17/22 MTN   |     | 110   |
| XS1224002474 | 0,2750 % VAN LANSCHOT 15/22 MTN     |     | 250   |
| FR0013141058 | 0,3750 % AXA BK EUROPE 16/23 MTN    |     | 250   |
| XS1401105587 | 0,3750 % TORONTO-DOM. BK 16/23 MTN  |     | 400   |
| XS1594364033 | 0,3750 % YORKSHIRE BLDG 17/23 MTN   |     | 210   |
| XS1551917245 | 0,5000 % ITALGAS 17/22 MTN          |     | 100   |
| XS1759602953 | 0,5000 % SCBC 18/25 MTN             |     | 300   |
| FR0012970713 | 0,6250 % ARKEA HOME LOANS 15/22MTN  |     | 100   |
| XS1758752635 | 0,6800 % MITSUB. UFJ FIN.GRP 18/23  |     | 120   |
| XS1132335248 | 0,7500 % RAIFFEISENBANK 14/19 MTN   |     | 300   |
| FR0013245859 | 0,8750 % ENGIE 17/24 MTN            |     | 100   |
| XS1734533372 | 1,0000 % DEUTSCHE POST MTN.17/27    |     | 100   |
| XS1917591411 | 1,0000 % RAIF.BK INTL 18/23 MTN166  |     | 100   |
| XS1754213947 | 1,0000 % UNICREDIT 18/23 MTN        |     | 250   |
| XS1614722806 | 1,1250 % CAIXABANK 17/24 MTN        |     | 100   |
| XS1578294081 | 1,1250 % ITALGAS 17/24 MTN          |     | 120   |
| XS1557268221 | 1,3750 % BCO SANTANDER 17/22 REGS   |     | 100   |
| XS2050543839 | 1,3750 % ITV 19/26                  | 100 | 100   |
| XS1554112281 | 1,5000 % NIBC BANK 17/22 MTN        |     | 100   |
| XS1907120528 | 1,8000 % AT + T 18/26               |     | 100   |
| AT0000A0Z7H5 | 1,8500 % BK TIROL VORARLBG 13-20    |     | 200   |
| XS1828033834 | 2,0000 % DT.TELEK.INTL F.18/29 MTN  |     | 160   |
| FR0013369493 | 2,0000 % EUTELSAT S.A. 18/25        |     | 100   |
| IT0005028003 | 2,1500 % B.T.P. 14-21               |     | 500   |
| FR0011625409 | 2,2500 % DANONE 13/21 MTN           |     | 100   |
| XS1713463716 | 2,5000 % ENEL S.P.A. 18/78 FLR      |     | 100   |
| XS0920705737 | 2,5000 % ORIGIN ENGY FIN.13/20 MTN  |     | 100   |
| FR0012648590 | 2,5000 % SUEZ 15-UND. FLR           |     | 100   |
| XS0820547825 | 2,7500 % JPMORGAN CHASE 12/22 MTN   |     | 100   |
| IT0005013971 | 2,8750 % MTE PASCHI SI. 14/21 MTN   |     | 194   |
| XS0802174044 | 3,0000 % AMERICA MOVIL 12/21        |     | 150   |
| DE000A11QR65 | 3,0000 % BAYER AG 2014/2075         |     | 100   |
| XS0780267406 | 3,0000 % HYPO NOE LB F.N.U.W.12/22  |     | 150   |
| XS0974877150 | 3,3750 % GLENCORE FIN.EU 13/20 MTN  |     | 100   |
| IE00B4S3JD47 | 3,9000 % IRLAND 2023                |     | 100   |
| XS0210237011 | 4,2500 % UNIT.UTIL.W. 05/20 MTN     |     | 100   |
| XS0715437140 | 5,0000 % IMPER.BRANDS FIN.11/19MTN  |     | 100   |

##### lautend auf USD

|              |                              |  |     |
|--------------|------------------------------|--|-----|
| XS0638326263 | 5,2500 % LETTLAND 11/21 REGS |  | 300 |
|--------------|------------------------------|--|-----|

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

##### Anleihen

##### lautend auf EUR

|              |                                    |     |     |
|--------------|------------------------------------|-----|-----|
| DE000A2YPKE3 | 3,0000 % BAYER AG 2014/2075 RUECKK | 100 | 100 |
|--------------|------------------------------------|-----|-----|

# **In sonstige Märkte einbezogene Investmentzertifikate**

## **Anteile an OGAW und OGA**

### **lautend auf EUR**

|              |                                             |        |
|--------------|---------------------------------------------|--------|
| AT0000653688 | KEPLER High Grade Corporate Rentenfonds (A) | 15.000 |
|--------------|---------------------------------------------|--------|

*BEZEICHNUNG*

*OPENING*  
*KONTRAKTE/NOMINALE*

*CLOSING*  
*KONTRAKTE/NOMINALE*

## **Derivative Produkte**

### **Devisentermingeschäfte**

#### **Abgeschlossen mit Raiffeisenlandesbank Oberösterreich**

#### **Verkauf**

USD/EUR Laufzeit bis 19.09.2019

3.500.000

## Zusammensetzung des Fondsvermögens per 29.02.2020

| Wertpapiervermögen                                                                            | EUR                   | %             |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------|---------------|
| <b>Zum amtlichen Handel oder einem anderen geregelten Markt zugelassene Wertpapiere</b>       |                       |               |
| Anleihen                                                                                      | 92.353.466,46         | 63,12         |
| Strukturierte Produkte                                                                        | 3.816.701,97          | 2,61          |
| <b>Nicht zum amtlichen Handel oder einem anderen geregelten Markt zugelassene Wertpapiere</b> |                       |               |
| Anleihen                                                                                      | 865.483,29            | 0,59          |
| Strukturierte Produkte                                                                        | 583.998,64            | 0,40          |
| <b>In sonstige Märkte einbezogene Investmentzertifikate</b>                                   |                       |               |
| Anteile an OGAW und OGA                                                                       | 47.554.375,00         | 32,50         |
| <b>Summe Wertpapiervermögen</b>                                                               | <b>145.174.025,36</b> | <b>99,22</b>  |
| <hr/>                                                                                         |                       |               |
| <b>Derivative Produkte</b>                                                                    | <b>EUR</b>            | <b>%</b>      |
| <hr/>                                                                                         |                       |               |
| Devisentermingeschäfte                                                                        | -45.020,01            | -0,03         |
| <b>Summe derivative Produkte</b>                                                              | <b>-45.020,01</b>     | <b>-0,03</b>  |
| <hr/>                                                                                         |                       |               |
| <b>Bankguthaben/Verbindlichkeiten</b>                                                         | <b>EUR</b>            | <b>%</b>      |
| <hr/>                                                                                         |                       |               |
| <b>Summe Bankguthaben/Verbindlichkeiten</b>                                                   | <b>201.135,34</b>     | <b>0,14</b>   |
| <hr/>                                                                                         |                       |               |
| <b>Sonstiges Vermögen</b>                                                                     | <b>EUR</b>            | <b>%</b>      |
| <hr/>                                                                                         |                       |               |
| <b>Summe Sonstiges Vermögen</b>                                                               | <b>985.225,18</b>     | <b>0,67</b>   |
| <hr/>                                                                                         |                       |               |
| <b>FOND S V E R M Ö G E N</b>                                                                 | <b>146.315.365,87</b> | <b>100,00</b> |
| <hr/>                                                                                         |                       |               |

Linz, im März 2020

KEPLER-FONDS Kapitalanlagegesellschaft m.b.H.

Andreas Lassner-Klein

Dr. Robert Gründlinger, MBA

Dr. Michael Bumberger