



Wien 1, Schwarzenbergplatz 3

Amundi ESG Income 1

Miteigentumsfonds gemäß Investmentfondsgesetz 2011 idgF (InvFG)

Rechenschaftsbericht

über das Rechnungsjahr
1. Juni 2022 - 31. Mai 2023

Inhaltsverzeichnis

Organe der Amundi Austria GmbH	3
Angaben zur Vergütungspolitik	4
Bericht an die Anteilhaber/innen	5
Anlagestrategie	5
Kapitalmarktentwicklung	5
Übersicht über die letzten drei Rechnungsjahre des Fonds	8
Ertragsrechnung und Entwicklung des Fondsvermögens	9
1. Wertentwicklung des Rechnungsjahres (Fonds-Performance).....	9
2. Fondsergebnis.....	11
3. Entwicklung des Fondsvermögens.....	12
Bestätigungsvermerk	26
Steuerliche Behandlung	28
Fondsbestimmungen	29
Anhang Artikel 8 der Offenlegungsverordnung	34

Organe der Amundi Austria GmbH

Aufsichtsrat

Matteo GERMANO (Vorsitzender)
Christophe LEMARIÉ (stv. Vorsitzender) (bis 31.8.2023)
Domenico AIELLO
Eli HANTGAN
Elodie LAUGEL
Marion MORALES ALBINANA-ROSNER
Christianus PELLIS
Mag. Karin PASEKA
Thomas GREINER
Beate SCHEIBER

Staatskommissär

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

Geschäftsführung

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

Depotbank

UniCredit Bank Austria AG, Wien

Prüfer

Deloitte Audit Wirtschaftsprüfungs GmbH

Angaben zur Vergütungspolitik

1.

Anzahl der Mitarbeiter	153
davon Begünstigte (sonstige Risikoträger) gemäß § 20 Abs. 2 Z 5 AIFMG	36
Gesamtsumme der an die Mitarbeiter (inkl. Geschäftsführung) der VWG gezahlten Vergütungen	EUR 16.222.611,97
davon variable Vergütung	EUR 3.052.675,00

2.

Gesamtsumme der variablen Vergütungen an Risikoträger	EUR 2.171.217,00
Gesamtsumme der Vergütungen an Risikoträger	EUR 7.177.153,56
davon Vergütungen an die Geschäftsführung	EUR 1.975.752,23
davon Vergütungen an die Führungskräfte	EUR 1.743.516,46
davon Vergütungen an sonstige Risikoträger	EUR 3.057.917,23
davon Vergütungen an die Mitarbeiter mit Kontrollfunktionen	EUR 399.967,64
davon Vergütungen an die Mitarbeiter, die sich aufgrund ihrer Gesamtvergütung in derselben Einkommensstufe befinden wie Geschäftsführung und Risikoträger	EUR 0,00

Sämtliche Angaben in den Punkten 1 und 2 beziehen sich auf Daten der VERA-Meldung per 31.12.2022.

3.

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

4.

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

5.

Sowohl Vergütungsausschuss als auch Aufsichtsrat haben zuletzt in ihrer Sitzung vom 15.12.2022 die Grundsätze der Vergütungspolitik überprüft. Eine neue Version der Remuneration Policy wurde am 15.12.2022 beschlossen, in der sowohl eine Anpassung an das FMA-Rundschreiben zu den §§ 17a bis 17c InvFG 2011 und § 11 AIFMG vom 3.11.2022 als auch eine Erweiterung der ESG-Ziele erfolgten. *Einzelheiten der aktuellen Vergütungspolitik sind auf der Internet-Seite der Verwaltungsgesellschaft (<http://www.amundi.at>) abrufbar und werden auf Anfrage kostenlos in Papierform zur Verfügung gestellt.*

Bericht an die Anteilhaber/innen

Sehr geehrte Anteilhaber!

Wir legen nachstehend den Bericht des Amundi ESG Income 1, Miteigentumsfonds gemäß Investmentfondsgesetz 2011 idgF (InvFG) über das Rechnungsjahr vom 01.06.2022 bis 31.05.2023 vor.

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

Methode zur Berechnung des Gesamtrisikos:

Commitment-Ansatz (gemäß dem 3. Hauptstück der 4. Derivate-Risikoberechnungs- und MeldeV)

Anlagestrategie

Der Fonds verfolgt eine aktive Veranlagungsstrategie und orientiert sich an keinem Referenzwert. Der Fonds das gesamte Rechnungsjahr hinweg bei Aktien konstant knapp unter 30 % gewichtet. High Yield und Emerging Markets Anleihen wurden reduziert und sind mit 5 % bzw 3 % gewichtet. Das Zinsänderungsrisiko wurde ab April 2023 leicht erhöht. Der Fonds hält weiterhin an ESG Ausschlusskriterien fest, die in Übereinstimmung mit dem Vertriebspartner getroffen wurden.

Im abgelaufenen Rechnungsjahr wurden keine Derivate getätigt, die unter die Berichtspflichten der ESMA Guidelines ESMA/2012/832 fallen. ¹⁾

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

Kapitalmarktentwicklung

Das Jahr 2022 stand ganz im Zeichen der Fortsetzung des Anstiegs der Inflation. Durch den Einmarsch Russlands und den dadurch verursachten Krieg in der Ukraine kam es zusätzlich zu den bestehenden Inflationstreibern zu einer Beschleunigung des Anstiegs der Energiepreise, vor allem bei Gas. Aber auch Nahrungsmittelpreise stiegen deutlich. Die globalen Notenbanken mussten daher ihren Kampf gegen die Inflation intensivieren, um ihre Glaubwürdigkeit beim Thema Inflationsbekämpfung nicht zu verlieren. Das angekündigte Ende des quantitativen Easings und damit eine schrittweise Rücknahme der lockeren Geldpolitik, von der „Risky Assets“ zuvor stark profitiert hatten, wurde von den Kapitalmärkten extrem negativ aufgenommen. 2022 markierte den Beginn der Kehrtwende in der Geldpolitik. Einerseits verlangsamte sich die Dynamik des Wirtschaftswachstums gegenüber den Höchstständen im Jahr 2021, andererseits führten die sich erholende Nachfrage und anhaltende Lieferengpässe – verschärft durch den Krieg in der Ukraine – zu Inflationswerten deutlich über den Zielen der Zentralbanken.

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

Als Reaktion darauf gingen die Zentralbanken vor allem in den USA, in UK und Europa, die zuvor angenommen hatten, die Inflation sei nur ein vorübergehendes Phänomen, dazu über, die Zinsen deutlich zu erhöhen, da die Preiserhöhungen auch bereits zu einem massiven politischen Problem wurden. Stagflationsbefürchtungen nahmen zu, nachdem bei steigenden Preisen die Wachstumsaussichten unter Druck gerieten, was durch geopolitische Spannungen und die Unterbrechungen der europäischen Gasversorgung aus Russland noch verschärft wurde. Die EZB beschloss, ihre Nettokäufe von Vermögenswerten im Rahmen ihres Programms zum Ankauf von Vermögenswerten einzustellen und schuf ein neues Anti-Fragmentierungs-Tool. Im Juni erreichte die Inflation ein 40-Jahreshoch von 9,1 % und hielt die Fed unter Druck. Die Zentralbank erhöhte die Leitzinsen in mehreren Schritten von 0,25 % bis auf 3,25 % im September und wird weiterhin auf einem Straffungskurs bleiben. Zu Jahresende lag die Rendite 10-jähriger US-Staatsanleihen bei fast 3,9 %. Der Druck auf das Wirtschaftswachstum nahm weiter zu, der Einkaufsmanagerindex für das verarbeitende Gewerbe bleibt schwach. Infolgedessen wird die Aufgabe der Fed angesichts ihres doppelten Mandats, Preisstabilität und Wirtschaftswachstum in Einklang zu bringen, schwierig. Trotzdem sorgen starke Arbeitsmärkte und niedrige Arbeitslosenquoten dafür, dass der Gesamtkonsum vorerst robust ist, auch wenn wir einige Wolken am Horizont sehen. Der starke Anstieg der Inflation führte zu steigenden Notenbankzinsen und zu der Erwartung, dass die Notenbanken die Zinsen so lange erhöhen müssen, bis sie die Inflation in den Griff bekommen. Dadurch kamen sämtliche Rentenmärkte extrem unter Druck und die meisten Staatsanleihenmärkte der Industriestaaten erzielten 2022 das mit Abstand schlechteste Ergebnis seit vielen Jahrzehnten. Auch Unternehmensanleihen und High Yield Anleihen korrigierten deutlich. Die Aktienmärkte reagierten – nach dem starken Anstieg 2021 – auf die steigenden Zinsen und auf die Erwartung, dass die Wirtschaftsdynamik deutlich abnehmen wird, mit massiven Kursrückgängen, wobei vor allem Wachstumsaktien, Kommunikationsdienstleistungen und zyklische Konsumaktien sowie Industrieaktien deutlich unter Druck gerieten, defensive Sektoren – vor allem der Energiesektor - konnten outperformen. Das Jahr 2022 war geprägt von marktübergreifenden Divergenzen. Während auf der einen Seite die anhaltende Inflation die Hauptsorge bleibt, kamen im Jahresverlauf auch Sorgen um das Wirtschaftswachstum dazu, insbesondere in Europa und in gewissem Maße in den USA. Der Rückgang der US-amerikanischen und europäischen Aktien ist ein Hinweis auf die Neubewertung, die von Stagflationsbefürchtungen angeführt wird, die sich auf die Verbrauchernachfrage und schließlich auf die Unternehmensgewinne auswirken könnten. Gegen Jahresende kam zwar eine „Bärenmarktrallye“ zustande, aber die starken US-Arbeitsmarktdaten für November schwächten das Markt-Narrativ einer moderateren Notenbankpolitik, sodass sich für die US-Inflation ein gemischtes Bild ergab, da die Dienstleistungskomponenten weiterhin hartnäckig sind. Die Fed verlangsamte das Tempo der Zinserhöhungen, bekräftigte aber, dass ihre Aufgabe noch lange nicht erledigt ist. Die Zentralbanken, einschließlich der EZB, werden sich auf einem schmalen Grat bewegen, bei dem die Gefahr von Fehlern groß ist. Belastend wirkte 2022 auch die Schwäche der Wirtschaft Chinas, hervorgerufen vor allem durch die Null-Covid-Politik und die Immobilienkrise. Gleichzeitig sehen wir zunehmende geopolitische Risiken in Europa und den USA. In den Emerging Markets dürfte jedoch die sich zuletzt abzeichnende Beschleunigung der Wiederöffnung in China früher als erwartet zu einem Aufschwung führen, während sich Europa noch in der Rezession und die USA in einer deutlichen Abschwächung befinden werden. Dies unterstreicht ein wesentliches Merkmal der Aussichten für 2023: die starke regionale Asynchronität der Wirtschaftszyklen. Die Anleihenmärkte standen 2022 im Zeichen der Inflation, der Politik der Zentralbanken und der Wachstumssorgen. Bei Staatsanleihen schauen die Märkte weiterhin auf die Inflation und die Reaktion der Fed, aber die Aufmerksamkeit dürfte sich bald auf das Wachstum und die Rezessionsängste richten. Vorläufig ist die Richtung der Zinsen noch aufwärts. Die Fed hat klargestellt, dass sie nun mit höheren finalen Zinsen rechnet als im September erwartet. Die Frage, wie lange die Zentralbank die Zinsen restriktiv hält, gewinnt an Bedeutung. Die Zentralbanken der Schwellenmärkte setzten ihren Spagat zwischen Wachstum und Inflation ebenso fort wie ihre Pendants der Industriestaaten. Für ausgewählte Schwellenländer wie Indien sind importierte Inflation und steigende Kosten für Rohstoffimporte jedoch ein größeres Problem. In Lateinamerika erhöhten die Zentralbanken von Brasilien, Chile und Peru die Zinsen, um die Inflation zu kontrollieren. Der US-Dollar konnte in den ersten drei Quartalen 2022 gegenüber dem Euro deutlich zulegen. Während Europa stark unter der Energieabhängigkeit von Russland leidet, profitierte der Dollar von der steigenden Zinsdifferenz gegenüber der Eurozone, vom stabileren Wachstum und von Produktivitätsgewinnen in den USA. Im vierten Quartal kam es jedoch zu einer Korrektur beim Dollarkurs. Im ersten Quartal 2023 waren die Themen Inflation und Notenbankpolitik nach wie vor die wichtigsten Treiber der Märkte. Während die Inflation in den USA ihren Rückgang fortsetzte (von 9,1 % im Juni 2022 auf 6 % im Februar 2023), fiel der Rückgang bei der Kerninflation von 6,6 % im September 2022 auf 5,5 % im Februar 2023 deutlich geringer aus. In der Eurozone fiel die Inflation von 10,6 % im Oktober 2022 auf 6,9 % im März 2023 vor allem aufgrund der rückläufigen Energiepreise. Im Gegensatz dazu stieg die Kerninflation im März 2023 auf einen neuen Höchststand von 5,7 %.

Während der Markt Anfang März noch davon ausgegangen war, dass die Fed die Zinsen bis Jahresmitte auf 5,5 % erhöhen würde, brachte der Kollaps der Silicon Valley Bank (sie wurde von der US-Bundeseinlagenversicherungsgesellschaft FDIC unter Zwangsverwaltung gestellt), die Ausweitung der Liquiditätskrise auf die Signature Bank und indirekt auch das Scheitern der Credit Suisse (die von UBS übernommen werden musste) einen kompletten Umschwung bei der erwarteten Notenbankpolitik in den USA. Der Markt begann binnen weniger Tage, die erwarteten Zinserhöhungen der Fed auszupreisen und stattdessen ging der Markt auf einmal davon aus, dass die Fed die Zinsen bis Jahresende 2023 auf 4 % senken könnte. Da die Inflation weiterhin hartnäckig über den Inflationszielen der Notenbanken Federal Reserve und EZB bleibt und der Arbeitsmarkt sich in den USA weiterhin sehr stabil zeigt, sendeten die Notenbanken Signale an die Märkte, dass die Inflationsbekämpfung das oberste Ziel bleibe und dass eine systematische Bankenkrise nicht zu erwarten sei. Obwohl verschiedene Indikatoren in den USA auf ein erhöhtes Rezessionsrisiko hinweisen (inverse Zinsstruktur, Einkaufsmanager-Index des produzierenden Gewerbes, Leading Indicators, Bereitschaft der Banken zur Kreditvergabe, etc.) bietet der stabile Konsum, unterstützt durch die niedrige Arbeitslosenrate, sowie die Wiedereröffnung der chinesischen Wirtschaft, die Normalisierung der Lieferketten und über den Erwartungen liegende Wirtschaftsdaten in der Eurozone (nach dem Rückgang der Gas- und Energiepreise) nach wie vor die Hoffnung auf eine sanfte Landung der US-Wirtschaft. Der Aktienmarkt legte einen fulminanten Start hin, ehe zuerst Befürchtungen einer zu restriktiven Notenbankpolitik und dann die Probleme im Bankensektor zu einer Korrektur führten. Die Maßnahmen zur Stabilisierung des Bankensektors und die damit verbundenen Erwartungen, dass die Fed die Zinsen im Jahresverlauf wieder senken könnte, führten zu einer Fortsetzung der Rallye und die Märkte beendeten das erste Quartal 2023 durchwegs positiv wobei Europa vor den USA und Japan sowie den Emerging Markets lag. Auf Sektorebene konnten zyklische Konsumgüter am stärksten zulegen, gefolgt vom IT-Sektor und Kommunikationsdienstleistungen. Versorger, Energie und defensive Konsumgüter entwickelten sich gegen den Trend leicht negativ. Auf der Rentenseite konnten sowohl Staatsanleihen als auch Unternehmensanleihen bei extrem hoher Volatilität nach dem bisher schlechtesten Rentenjahr 2022 im ersten Quartal 2023 leicht zulegen, High Yield Anleihen lagen vor Emerging Markets Anleihen. Gold war Profiteur der hohen Volatilität und stieg auf Dollarbasis im ersten Quartal 2023 um 8 %.²⁾

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

Übersicht über die letzten drei Rechnungsjahre des Fonds

Fondsvermögen in EUR, Angaben zu den Tranchen in Tranchenwährung

Rechnungsjahre	31.05.2023	31.05.2022	31.05.2021
Fondsvermögen	183.367.680,44	232.713.641,42	246.513.695,24

Ausschüttungsanteile

AT0000822382 in EUR

Rechenwert je Anteil	6,96	7,45	8,21
Anzahl der ausgegebenen Anteile	12.587.479,50	15.210.498,47	14.659.613,36
Ausschüttung je Anteil	0,0695	0,0746	0,2469
Wertentwicklung in %	-5,64	-6,46	8,02

Thesaurierungsanteile mit KEST-Abzug

AT0000801071 in EUR

Rechenwert je Anteil	12,60	13,37	14,50
Anzahl der ausgegebenen Anteile	7.523.825,77	8.846.028,31	8.605.899,88
Zur Thesaurierung verwendeter Ertrag	-0,6017	0,1064	0,9547
Auszahlung gemäß § 58 Abs 2 InvFG	0,00	0,0323	0,1964
Wertentwicklung in %	-5,53	-6,55	8,07

Thesaurierungsanteile ohne KEST-Abzug (Inlandstranche)

AT0000618020 in EUR

Rechenwert je Anteil	14,00	14,82	15,86
Anzahl der ausgegebenen Anteile	66.628,62	82.578,62	83.185,00
Zur Thesaurierung verwendeter Ertrag	-0,6679	0,17	1,26
Wertentwicklung in %	-5,53	-6,56	8,04

Ausschüttungsanteile

AT0000A1X4F7 in USD

Rechenwert je Anteil	7,59	8,25	-
Anzahl der ausgegebenen Anteile	3,00	1.200,00	-
Ausschüttung je Anteil	0,4439	0,0832	-
Wertentwicklung in %	-7,03	-16,75	-

*)

*) Rumpfrechnungsjahr von 21.6.2021 bis 31.5.2022

Ertragsrechnung und Entwicklung des Fondsvermögens

1. Wertentwicklung des Rechnungsjahres (Fonds-Performance)

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

Ausschüttungsanteile AT0000822382	In EUR
Rechenwert am Beginn des Rechnungsjahres	7,45
Ausschüttung am 1.8.2022 von 0,0746 (entspricht 0,01004 Anteilen) (Rechenwert für einen Ausschüttungsanteil am 1.8.2022 (Ex-Tag): 7,43)	
Rechenwert am Ende des Rechnungsjahres	6,96
Gesamtwert inkl. (fiktiv) durch Ausschüttung erworbene Anteile (1,01004 * 6,96)	7,03
Wertentwicklung eines Anteiles im Rechnungsjahr in %	-5,64
Nettoertrag pro Anteil	-0,42

Thesaurierungsanteile mit KEST-Abzug AT0000801071	In EUR
Rechenwert am Beginn des Rechnungsjahres	13,37
Auszahlung (KESt) am 1.8.2022 von 0,0323 (entspricht 0,002403 Anteilen) (Rechenwert für einen Thesaurierungsanteil mit KEST-Abzug am 1.8.2022 (Ex-Tag): 13,44)	
Rechenwert am Ende des Rechnungsjahres	12,60
Gesamtwert inkl. (fiktiv) durch Ausschüttung erworbene Anteile (1,002403 * 12,6)	12,63
Wertentwicklung eines Anteils im Rechnungsjahr in %	-5,53
Nettoertrag pro Anteil	-0,74

Thesaurierungsanteile ohne KEST-Abzug (Inlandstranche) AT0000618020	In EUR
Rechenwert am Beginn des Rechnungsjahres	14,82
Rechenwert am Ende des Rechnungsjahres	14,00
Wertentwicklung eines Anteils im Rechnungsjahr in %	-5,53
Nettoertrag pro Anteil	-0,82

Ausschüttungsanteile AT0000A1X4F7 (USD-Tranche)	In USD
Rechenwert am Beginn des Rechnungsjahres	8,25
Ausschüttung am 1.8.2022 von 0,0832 (entspricht 0,010626 Anteilen) (Rechenwert für einen Ausschüttungsanteil am 1.8.2022 (Ex-Tag): 7,83)	
Rechenwert am Ende des Rechnungsjahres	7,59
Gesamtwert inkl. (fiktiv) durch Ausschüttung erworbene Anteile (1,010626 * 7,59)	7,67
Wertentwicklung eines Anteiles im Rechnungsjahr in %	-7,03
Nettoertrag pro Anteil	-0,58

Die Anteilswertermittlung durch die Depotbank erfolgt getrennt je Anteilscheinklasse. Die Jahresperformannewerte der einzelnen Anteilscheinklassen können voneinander abweichen.

Wertentwicklungen der Vergangenheit lassen keine verlässlichen Rückschlüsse auf die zukünftige Entwicklung eines Investmentfonds zu.

Ausschüttung für Ausschüttungsanteile – AT0000822382

Die Ausschüttung von EUR 0,0695 je Anteil wird ab 1.8.2023 von den depotführenden Banken vorgenommen.

Die kuponauszahlende Bank ist verpflichtet, von der Ausschüttung Kapitalertragsteuer in der Höhe von EUR 0,00 je Anteil einzubehalten, sofern keine Befreiungsgründe vorliegen.

Ausschüttung für Ausschüttungsanteile – AT0000A1X4F7 (USD-Tranche)

Die Ausschüttung von USD 0,4439 je Anteil wird ab 1.8.2023 von den depotführenden Banken vorgenommen.

Die kuponauszahlende Bank ist verpflichtet, von der Ausschüttung Kapitalertragsteuer in der Höhe von USD 0,4439 je Anteil einzubehalten, sofern keine Befreiungsgründe vorliegen.

Auszahlung für Thesaurierungsanteile mit KEST-Abzug – AT0000801071

Die Kapitalertragsteuer beträgt EUR 0,00 je Anteil, daher wird keine Auszahlung vorgenommen.

Auszahlung für Thesaurierungsanteile ohne KEST-Abzug (Inlandstranche) – AT0000618020

Eine allfällige Auszahlung für Thesaurierungsanteile ohne KEST-Abzug (Vollthesaurierer Inlandstranche) entfällt nach Maßgabe des § 58 Abs 2 InvFG.

2. Fondsergebnis

Angaben in EUR

a. Realisiertes Fondsergebnis

Ordentliches Fondsergebnis

Erträge (ohne Kursergebnis) 2.258.790,01

Zinsenerträge (inkl. ordentliche Erträge ausl. Subfonds)	1.198.446,98
Dividendenerträge	1.406.127,47
einbehaltene Quellensteuer Zinsen	-1.159,15
einbehaltene Quellensteuer Dividenden	-324.361,96
	<u>2.279.053,34</u>
Zinsaufwendungen (Sollzinsen)	-13.207,90
Einlageverwahrtgelt	<u>-7.055,43</u>

Aufwendungen

-1.903.471,29

Vergütung an die Verwaltungsgesellschaft	-1.536.285,56
Verwaltungskostenrückvergütung aus Subfonds ¹⁾	54,66
Kosten für den Wirtschaftsprüfer und steuerliche Vertretung	-18.989,60
Publizitätskosten und Aufsichtskosten	-717,36
Kosten für die Depotbank	-342.873,22
Lizenzkosten, Kosten für externe Ratings	<u>-4.660,21</u>

Ordentliches Fondsergebnis (exkl. Ertragsausgleich)

355.318,72

Realisiertes Kursergebnis ^{2) 3)}

Realisierte Gewinne aus Wertpapieren (inkl. außerordentliche agE ausl. Subfonds)	3.703.503,48
Realisierte Gewinne aus derivativen Instrumenten (inkl. Devisengewinne)	11.037.701,91
Realisierte Verluste aus Wertpapieren	-9.551.460,85
Realisierte Verluste aus derivativen Instrumenten (inkl. Devisenverluste)	<u>-15.424.552,54</u>

Realisiertes Kursergebnis (exkl. Ertragsausgleich)

-10.234.808,00

Realisiertes Fondsergebnis (exkl. Ertragsausgleich)

-9.879.489,28

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

Veränderung des nicht realisierten Kursergebnisses	-2.473.616,09
Ergebnis des Rechnungsjahres ⁴⁾	-12.353.105,37

c. Ertragsausgleich

Ertragsausgleich für Erträge des Rechnungsjahres	1.117.197,61
Fondsergebnis gesamt	-11.235.907,76

3. Entwicklung des Fondsvermögens

Fondsvermögen am Beginn des Rechnungsjahres ⁵⁾		232.713.641,42
Ausschüttung/Auszahlung am 1.8.2022 (inkl. Ausschüttungsausgleich)		-1.383.196,18
Ausschüttung (für Ausschüttungsanteile) (AT0000822382)	-1.100.479,11	
Ausschüttung (für Ausschüttungsanteile USD-Tranche) (AT0000A1X4F7)	-97,92	
Auszahlung (für Thesaurierungsanteile mit KEST-Abzug) (AT0000801071)	-282.619,15	
Ausgabe und Rücknahme von Anteilen (inkl. Ausschüttungsausgleich)		-36.726.857,04
Ausgabe von 470.071,54 Anteilen und Rücknahme von 4.432.440,05 Anteilen		
Fondsergebnis gesamt (das Fondsergebnis ist im Detail im Punkt 2. dargestellt)		<u>-11.235.907,76</u>
Fondsvermögen am Ende des Rechnungsjahres ⁶⁾		<u>183.367.680,44</u>

Erläuterungen zu den Wertangaben bezüglich Fondsergebnis und Entwicklung des Fondsvermögens:

- 1) Die Position beinhaltet die marktübliche Einbehaltung von Administrationskosten der Verwaltungsgesellschaft sowie Dritter.
Für Anteile an anderen Investmentfonds, in die der Fonds investiert („Subfonds“), kann eine Verwaltungsvergütung von bis zu 2,50 % des betreffenden in diesen Subfonds veranlagten Fondsvermögens verrechnet werden. Gegebenenfalls kann zusätzlich eine Performance Fee anfallen.
- 2) Realisierte Gewinne und realisierte Verluste sind nicht periodenabgegrenzt und stehen so wie die Veränderung des nicht realisierten Kursergebnisses nicht unbedingt in Beziehung zu der Wertentwicklung des Fonds im Rechnungsjahr.
- 3) Kursergebnis gesamt, ohne Ertragsausgleich (realisiertes Kursergebnis ohne Ertragsausgleich, zuzüglich Veränderung des nicht realisierten Kursergebnisses): EUR -12.708.424,09.
- 4) Das Ergebnis des Rechnungsjahres beinhaltet explizit ausgewiesene Transaktionskosten in Höhe von EUR -79.967,43.
- 5) Anteilsumlauf zu Beginn des Rechnungsjahres: 15.210.498,47 Ausschüttungsanteile, 1.200,00 Ausschüttungsanteile (USD-Tranche), 8.846.028,31 Thesaurierungsanteile mit KEST-Abzug, 82.578,62 Thesaurierungsanteile ohne KEST-Abzug (VTI).
- 6) Anteilsumlauf am Ende des Rechnungsjahres: 12.587.479,50 Ausschüttungsanteile, 3,00 Ausschüttungsanteile (USD-Tranche), 7.523.825,77 Thesaurierungsanteile mit KEST-Abzug, 66.628,62 Thesaurierungsanteile ohne KEST-Abzug (VTI).

Vermögensaufstellung

Gattungsbezeichnung	ISIN	Bestand 31.05.23	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs in WP-Whg	Kurswert in EUR	% des FV
		Stücke / Anteile / Nominale in 1.000					
Wertpapiere							
Börsengehandelte Wertpapiere							
Aktien in EUR							
ACCOR S.A.Actions Port. EO 3	FR0000120404	7.461	7.610	149	30,970000	231.067,17	0,13
adidas AGNamens-Aktien o.N.	DE000A1EWWW0	1.506	499	179	151,500000	228.159,00	0,12
Akzo Nobel N.V.Aandelen aan toonder EO0,5	NL0013267909	2.631	0	439	70,440000	185.327,64	0,10
Allianz SEvink.Namens-Aktien o.N.	DE0008404005	1.478	0	250	199,980000	295.570,44	0,16
Alstom S.A.Actions Port. EO 7	FR0010220475	3.208	863	0	25,740000	82.573,92	0,05
ANDRITZ AGAKTIEN O.N.	AT0000730007	162	162	0	50,150000	8.124,30	0,00
ASML Holding N.V.Aandelen op naam EO -,09	NL0010273215	483	0	83	671,500000	324.334,50	0,18
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AGSTAMMAKTIE EO 1	DE0005190003	2.619	0	452	101,920000	266.928,48	0,15
BNP PARIBAS S.A.Actions Port. EO 2	FR0000131104	4.571	0	789	54,010000	246.879,71	0,13
Cappemini SEActions Port. EO 8	FR0000125338	1.521	0	260	162,800000	247.618,80	0,14
Cie Génle Éts Michelin ScpAActions Nom. EO -,50	FR001400AJ45	1.283	1.283	0	26,560000	34.076,48	0,02
CNH Industrial N.V.Aandelen op naam EO -,01	NL0010545661	19.364	0	3.365	11,950000	231.399,80	0,13
Covestro AGInhaber-Aktien o.N.	DE0006062144	2.103	690	0	36,060000	75.834,18	0,04
CRH PLCRegistered Shares EO -,32	IE0001827041	7.580	0	1.430	44,100000	334.278,00	0,18
DEUTSCHE POST AGNAMENS-AKTIE O.N.	DE0005552004	5.204	0	901	42,050000	218.828,20	0,12
DEUTSCHE TELEKOM AGNAMENS-AKTIE O.N.	DE0005557508	14.649	0	2.543	20,745000	303.893,51	0,17
EssilorLuxottica S.A.Actions Port. EO 0,18	FR0000121667	1.581	33	269	168,440000	266.303,64	0,15
INFINEON TECHNOLOGIES AGNAMENS-AKTIE O.N.	DE0006231004	2.438	836	486	34,730000	84.671,74	0,05
KON. KPN N.V.Aandelen aan toonder EO -,04	NL0000009082	77.500	0	13.484	3,218000	249.395,00	0,14
PUBLICIS GROUPE S.A.Actions Port. EO 0,40	FR0000130577	4.442	0	723	69,320000	307.919,44	0,17
Sanofi S.A.Actions Port. EO 2	FR0000120578	2.183	0	2.232	94,880000	207.123,04	0,11
SAP SEInhaber-Aktien o.N.	DE0007164600	2.350	0	405	122,180000	287.123,00	0,16
Schneider Electric SEActions Port. EO 4	FR0000121972	2.502	71	337	161,340000	403.672,68	0,22
SIEMENS AGNAMENS-AKTIE O.N.	DE0007236101	2.001	0	343	153,340000	306.833,34	0,17
Siemens Energy AGNamens-Aktien o.N.	DE000ENER6Y0	11.980	2.653	1.777	23,740000	284.405,20	0,16
Solaria Energia Y Medio Ambi.Acciones Port. EO -,01	ES0165386014	15.764	14.305	1.722	12,695000	200.123,98	0,11
Stellantis N.V.Aandelen op naam EO -,01	NL00150001Q9	16.022	0	2.785	14,208000	227.640,58	0,12
STMICROELECTRONICS N.V.Aandelen aan toonder EO 1,04	NL0000226223	2.004	532	160	40,595000	81.352,38	0,04
UCB S.A.Actions Nom. o.N.	BE0003739530	2.526	0	971	81,520000	205.919,52	0,11
Valéo S.E.Actions Port. EO 1	FR0013176526	4.235	1.297	0	17,960000	76.060,60	0,04
VERBUND AGINHABERAKTIEN KAT. A O.N.	AT0000746409	3.666	304	1.150	70,550000	258.636,30	0,14
Aktien in AUD							
ANZ Group Holdings Ltd.Registered Shares o.N.	AU000000ANZ3	12.580	13.494	15.424	22,920000	175.028,74	0,10
Aktien in CAD							
Ballard Power Systems Inc.Registered Shares o.N.	CA0585861085	1.600	1.600	0	5,690000	6.282,30	0,00
Aktien in CHF							
LONZA GROUP AGNamens-Aktien SF 1	CH0013841017	457	0	74	569,400000	267.011,24	0,15
Nestlé S.A.Namens-Aktien SF -,10	CH0038863350	4.133	0	2.845	107,900000	457.596,53	0,25
Partners Group Holding AGNamens-Aktien SF -,01	CH0024608827	229	0	29	820,800000	192.871,79	0,11
Aktien in DKK							
Vestas Wind Systems A/SNavne-Aktier DK -,20	DK0061539921	2.963	711	328	198,340000	78.915,72	0,04
Aktien in GBP							
AstraZeneca PLCRegistered Shares DL -,25	GB0009895292	2.659	3.065	406	116,600000	360.427,11	0,20
Britvic PLCRegistered Shares LS -,20	GB00B0N8QD54	22.225	0	3.639	8,840000	228.399,21	0,12
HSBC HOLDINGS PLCRegistered Shares DL -,50	GB0005405286	39.534	0	26.787	5,905000	271.388,36	0,15
ITM Power PLCRegistered Shares LS -,05	GB00B0130H42	8.801	8.801	0	0,692400	7.084,18	0,00
Lloyds Banking Group PLCRegistered Shares LS -,10	GB0008706128	446.298	0	212.365	0,441700	229.167,44	0,12
National Grid PLCReg. Shares LS -,12431289	GB00BDR05C01	21.960	0	3.817	11,060000	282.350,15	0,15
Rentokil Initial PLCRegistered Shares LS 0,01	GB00B082RF11	41.050	0	6.725	6,386000	304.749,24	0,17
Tesco PLCRegistered Shs LS-,0633333	GB00BLGZ9862	107.435	125.783	18.348	2,608000	325.727,13	0,18
Unilever PLCRegistered Shares LS -,031111	GB00B10RZP78	4.910	5.509	8.461	40,290000	229.974,31	0,13
Whitbread PLCReg. Shares LS -,76797385	GB00B1KJJ408	2.218	733	238	32,860000	84.728,53	0,05

Gattungsbezeichnung	ISIN	Bestand 31.05.23	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs in WP-Whg	Kurswert in EUR	% des FV
		Stücke / Anteile / Nominale in 1.000					
Aktien in HKD							
China Suntien Green Energy CrpRegistered Shares H YC 1	CNE100000TW9	22.000	22.000	0	2,960000	7.802,87	0,00
Aktien in JPY							
KURITA WATER INDUSTRIES LTD.Registered Shares o.N.	JP3270000007	9.100	8.000	500	5.710,000000	348.848,26	0,19
Recruit Holdings Co. Ltd.Registered Shares o.N.	JP3970300004	5.100	0	500	4.290,000000	146.888,07	0,08
Aktien in NOK							
Aker Carbon Capture ASANavne-Aksjer NK 1	NO0010890304	17.123	17.123	0	12,440000	17.930,90	0,01
NEL ASANavne-Aksjer NK -,20	NO0010081235	244.298	299.210	54.912	14,070000	289.344,91	0,16
Aktien in SEK							
PowerCell Sweden AB (publ)Namn-Aktier SK-,022	SE0006425815	773	773	0	77,440000	5.159,11	0,00
Aktien in USD							
AbbVie Inc.Registered Shares DL -,01	US00287Y1091	4.959	0	1.611	137,960000	641.725,58	0,35
ADVANCED MICRO DEVICES INC.Registered Shares DL -,01	US0079031078	8.356	4.695	1.095	118,210000	926.519,80	0,51
American Tower Corp.Registered Shares DL -,01	US03027X1000	2.167	2.324	157	184,440000	374.900,55	0,20
AUTODESK INC.Registered Shares o.N.	US0527691069	2.739	544	389	199,390000	512.268,28	0,28
CDW Corp.Registered Shares DL -,01	US12514G1085	2.456	0	421	171,690000	395.526,35	0,22
Cigna Group, TheRegistered Shares DL 1	US1255231003	1.746	1.872	126	247,410000	405.194,50	0,22
Crown Holdings Inc.Registered Shares DL 5	US2283681060	3.930	0	678	76,230000	281.009,19	0,15
Darling Ingredients Inc.Registered Shares DL -,01	US2372661015	9.867	9.994	127	63,380000	586.596,44	0,32
Eli Lilly and CompanyRegistered Shares o.N.	US5324571083	2.130	0	365	429,460000	858.033,77	0,47
First Solar Inc.Registered Shares DL -,001	US3364331070	3.058	2.800	544	202,960000	582.170,23	0,32
Graphic Packaging Holding Co.Registered Shares DL -,01	US3886891015	14.512	0	2.522	23,900000	325.332,33	0,18
Hewlett Packard Enterprise Co.Registered Shares DL -,01	US42824C1099	26.516	0	9.311	14,420000	358.653,71	0,20
Hilton Worldwide Holdings Inc.Registered Shares DL -,01	US43300A2033	2.565	2.997	432	136,120000	327.500,05	0,18
HOME DEPOT INC., THERegistered Shares DL -,05	US4370761029	2.890	678	446	283,450000	768.380,55	0,42
Intercontinental Exchange Inc.Registered Shares DL -,01	US45866F1049	5.697	2.425	692	105,950000	566.173,11	0,31
IQVIA Holdings Inc.Registered Shares DL -,01	US46266C1053	2.163	0	370	196,910000	399.508,80	0,22
JOHNSON CONTR.INTL.DL-,01	IE00BY7QL619	7.606	7.982	376	59,700000	425.924,58	0,23
Linde plcRegistered Shares EO -,001	IE000S9YS762	1.282	1.282	0	353,660000	425.281,04	0,23
Medtronic PLCRegistered Shares DL -,0001	IE00BTN1Y115	5.676	0	1.185	82,760000	440.620,73	0,24
MICROSOFT CORP.Registered Shares DL-,0000625	US5949181045	7.847	490	3.055	328,390000	2.417.105,65	1,32
Mondelez International Inc.Registered Shares Class A o.N.	US6092071058	9.344	0	1.746	73,410000	643.413,41	0,35
Mosaic Co., TheRegistered Shares DL -,01	US61945C1036	7.337	0	1.270	31,960000	219.951,71	0,12
NATIONAL INSTRUMENTS CORP.Registered Shares DL -,01	US6365181022	5.320	12.327	7.007	57,800000	288.430,73	0,16
ProLogis Inc.Registered Shares DL -,01	US74340W1036	5.171	0	832	124,550000	604.115,98	0,33
Pure Storage Inc.Reg.Shares Cl.A DL -,0001	US74624M1027	15.063	15.880	817	28,790000	406.775,88	0,22
S&P Global Inc.Registered Shares DL 1	US78409V1044	1.755	611	195	367,430000	604.858,50	0,33
Sunnova Energy International IRegistered Shares DL -,0001	US86745K1043	646	1.224	578	17,660000	10.701,02	0,01
Trane Technologies PLCRegistered Shares DL 1	IE00BK9ZQ967	2.189	0	449	163,230000	335.156,62	0,18
Xylem Inc.Registered Shares DL -,01	US98419M1009	3.328	0	540	100,200000	312.790,17	0,17
Verzinsliche Wertpapiere in EUR							
Banca Comerciala Româna S.A.EO-FLR Non-Pref.MTN 23(26/27)	AT0000A34CN3	100	100	0	101,338000	101.338,00	0,06
Banca Transilvania S.A.EO-FLR Non-Pr.Bonds 23(26/27)	XS2616733981	150	150	0	102,002000	153.003,00	0,08
Bank Gospodarstwa KrajowegoEO-Medium-Term Nts 2023(33)	XS2589727168	100	100	0	104,073000	104.073,00	0,06
Belden Inc.EO-Notes 2021(21/31) 144A	XS2367228561	185	310	125	86,892000	160.750,20	0,09
Bundesrep.DeutschlandAnl.v.2020 (2030)	DE0001030708	1.541	1.671	130	85,657000	1.319.974,37	0,72
Carnival PLC EO-Notes 2019(29/29)	XS2066744231	514	0	0	53,383000	274.388,62	0,15
Ceská Sportelna ASEO-FLR Non-Pref.MTN 22(24/25)	XS2555412001	100	100	0	101,259000	101.259,00	0,06
Cheplapharm Arzneimittel GmbHAnleihe v.20(20/27) Reg.S	XS2112973107	100	100	0	91,397000	91.397,00	0,05
Cheplapharm Arzneimittel GmbHAnleihe v.23(26/30) 144A	XS2618869445	195	195	0	99,995000	194.990,25	0,11
Constellium SEEO-Notes 2021(21/29) 144A	XS2335148701	305	100	0	84,072000	256.419,60	0,14
Dufry One B.V.EO-Notes 2021(21/28)	XS2333564503	100	0	0	88,511000	88.511,00	0,05

Gattungsbezeichnung	ISIN	Bestand 31.05.23	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs in WP-Whg	Kurswert in EUR	% des FV
		Stücke / Anteile / Nominale in 1.000					
Verzinsliche Wertpapiere in EUR (Fortsetzung)							
Energizer Gamma Acquisition B.EO-Notes 2021(21/29) 144A	XS2353487304	115	0	0	80,056000	92.064,40	0,05
Erste Group Bank AG Additional Tier 2 Notes 2030	XS2083210729	100	100	0	90,580000	90.580,00	0,05
Faurecia SEEO-Notes 2021(21/29)	XS2312733871	423	0	0	81,529000	344.867,67	0,19
Food Service Project S.A.EO-Notes 2022(22/27) Reg.S	XS2432286974	100	0	0	95,212000	95.212,00	0,05
Grünenthal GmbH Anleihe v.21(21/28) 144A	XS2337703610	245	0	0	92,663000	227.024,35	0,12
IHO Verwaltungs GmbH Anleihe v.19(19/27) 144A	XS2004458720	410	0	0	89,093000	365.281,30	0,20
Internat. Cons. Airl. Group SAEO-Bonds 2021(21/29) Ser.B	XS2322423539	400	0	0	86,517000	346.068,00	0,19
Irland EO-Treasury Bonds 2018(31)	IE00BFZRQ242	1.103	993	122	91,045000	1.004.226,35	0,55
Italien, Republik EO-B.T.P. 2021(24)	IT0005454050	411	411	0	97,766000	401.818,26	0,22
Kreditanst.f.Wiederaufbau Med.Term Nts. v.20(28)	XS2209794408	928	928	0	86,341000	801.244,48	0,44
Lune Holdings S.à.r.l.EO-Notes 2021(21/28) 144A	XS2406727409	100	100	0	84,861000	84.861,00	0,05
Nemak S.A.B. de C.V.EO-Notes 2021(21/28) Reg.S	XS2362994068	100	0	100	79,310000	79.310,00	0,04
Nordmazedonien, Republik EO-Bonds 2023(26/27) Reg.S	XS2582522681	200	200	0	102,194000	204.388,00	0,11
Nova Ljubljanska Banka d.d.EO-FLR Pref. Notes 22(24/25)	XS2498964209	100	100	0	98,767000	98.767,00	0,05
Organon/Org.For.De.Co-Issuer EO-Notes 2021(21/28) 144A	XS2332250880	229	0	200	87,275000	199.859,75	0,11
Power Finance Corp. Ltd.EO-Medium-Term Notes 2021(28)	XS2384373341	100	0	0	83,197000	83.197,00	0,05
Powszechna K.O.(PKO)Bk Polski EO-FLR Preferred MTN 23(25/26)	XS2582358789	100	100	0	100,483000	100.483,00	0,05
Raiffeisen Bank Zrt.EO-FLR Pref. MTN 2022(24/25)	XS2559379529	100	100	0	102,723000	102.723,00	0,06
Sappi Papier Holding GmbH Notes 2021/2028 144A	XS2310951103	140	0	0	88,909000	124.472,60	0,07
Sherwood Financing PLC EO-Notes 2021(21/26) 144A	XS2010027295	100	0	0	84,516000	84.516,00	0,05
TAP - Transp.Aér.Port.SGPS SAEO-Obrigações 2019(19/24) Reg.S	PTTAPDOM0005	400	400	0	98,220000	392.880,00	0,21
Ziggo Bond Co. B.V.EO-Notes 2020(20/30) 144A	XS2116386561	395	0	100	72,142000	284.960,90	0,16
Ziggo Bond Co. B.V.EO-Notes 2020(20/30) Reg.S	XS2116386132	125	125	0	72,142000	90.177,50	0,05
Verzinsliche Wertpapiere in BRL							
International Bank Rec. Dev.RB/DL-Medium-Term Nts 2021(26)	XS2288097640	1.100	1.100	0	90,437000	182.184,07	0,10
Verzinsliche Wertpapiere in GBP							
Sherwood Financing PLCLS-Notes 2021(21/26) 144A	XS2010026644	120	0	0	81,901000	114.253,89	0,06
Verzinsliche Wertpapiere in IDR							
European Bank Rec. Dev.RP/DL-Medium-Term Nts.2020(25)	XS2265998430	3.200.000	3.200.000	0	96,842000	193.916,22	0,11
Verzinsliche Wertpapiere in INR							
European Bank Rec. Dev.IR/DL-Medium-Term Nts 2021(24)	XS2301346008	11.000	11.000	0	98,657000	123.040,91	0,07
European Bank Rec. Dev.IR/DL-Medium-Term Nts 2021(26)	XS2286302257	11.000	11.000	0	95,938000	119.649,89	0,07
Verzinsliche Wertpapiere in MXN							
International Finance Corp.MN-Medium-Term Notes 2018(30)	XS1753775730	5.200	5.200	0	93,643000	257.205,95	0,14
Verzinsliche Wertpapiere in RUB							
European Bank Rec. Dev.RL-Zo Med-Term Nts 2016(26)	XS1349367547	23.000	0	0	68,500000	181.941,01	0,10
Verzinsliche Wertpapiere in USD							
AAvant.Loy.IP Ltd./Am.Air.Inc DL-Nts 2021(26-29) 144A	US00253XAB73	100	0	325	95,985000	90.026,56	0,05
Abra Global Finance DL-Notes 2023(28) 144A	US000852AB97	524	649	125	81,149000	398.491,75	0,22
AdaptHealth LLC DL-Notes 2021(21/30) 144A	US00653VAE11	50	0	0	77,889000	36.529,88	0,02
AEGEA Finance S.a.r.l.DL-Notes 2022(22/29) 144A	US00775CAB28	200	0	0	94,319000	176.942,13	0,10
Africa Finance Corp.DL-Med.-Term Nts 2021(28) Reg.S	XS2337067792	250	0	0	82,095000	192.512,43	0,10
African Export-Import Bank DL-Med.-T. Nts 21(26/26) Reg.S	XS2343006958	200	200	210	89,790000	168.445,74	0,09

Gattungsbezeichnung	ISIN	Bestand 31.05.23	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs in WP-Whg	Kurswert in EUR	% des FV
Stücke / Anteile / Nominale in 1.000							
Verzinsliche Wertpapiere in USD (Fortsetzung)							
Altice France S.A.DL-Notes 2021(21/29) 144A	US02156LAF85	200	200	0	71,310000	133.777,32	0,07
American Airlines Inc.DL-Nts 2020(20/25) 144A	US023771S586	300	300	0	109,697000	308.686,80	0,17
AngloGold Ashanti Holdings PLCDL-Notes 2020(20/30)	US03512TAE10	200	0	0	85,905000	161.157,49	0,09
Archrock Pr.LP/Ar.Par.Fi.Corp.DL-Notes 2019(19/27) 144A	US03959KAA88	289	0	200	96,250000	260.915,96	0,14
Argentinien, RepublikDL-Bonds 2020(20/31-35)	US040114HT09	400	400	0	23,455000	88.003,00	0,05
Axis Bank Ltd.DL-FLR Cap.MTN 21(26/Und.)RegS	USY1009XAA73	210	0	0	86,389000	170.168,75	0,09
Banistmo S.A.DL-Notes 2020(20/27) Reg.S	USP15383CD50	200	0	0	93,529000	175.460,09	0,10
Bath & Body Works Inc.DL-Notes 2015(15/35)	US501797AL82	267	0	150	90,887000	227.622,45	0,12
BBVA Bancomer SA(Texas Branch)DL-FLR CAP.NT.18(28/33)Reg.S	USP16259AM84	200	0	0	88,079000	165.235,91	0,09
Beazer Homes USA Inc.DL-Notes 2017(17/27)	US07556QBR56	277	0	236	92,294000	239.803,38	0,13
Braskem Netherlands Fin. B.V.DL-Notes 2023(23/33) Reg.S	USN15516AG70	200	200	0	96,581000	181.185,63	0,10
Brink's Co., TheDL-Notes 2017(17/27) 144A	US109696AA22	440	0	0	93,371000	385.360,10	0,21
Burgan Bank K.P.S.C.DL-FLR Notes 2020(26/31)	XS2265369491	220	0	0	76,666000	158.207,67	0,09
Côte d'Ivoire, RepublikDL-Notes 2017(31- 33) Reg.S	XS1631415400	240	0	0	86,895000	195.617,67	0,11
Clear Channel Outdo.Hldgs Inc.DL-Notes 2021(21/28) 144A	US18453HAC07	390	390	0	74,597000	272.890,25	0,15
Clearwater Paper Corp.DL-Notes 2020(20/28) 144A	US18538RAJ23	263	0	50	89,144000	219.912,50	0,12
Clearway Energy Operating LLCDL-Notes 2021(21/32) 144A	US18539UAE55	220	0	0	82,486000	170.217,80	0,09
Coca Cola Icecek A.S.DL- Sust.Lkd.Bds.22(22/29)Reg.S	XS2434515313	200	0	0	87,663000	164.455,49	0,09
Commercial Metals Co. DL-Notes 2021(21/31)	US201723AP84	180	320	658	84,769000	143.123,72	0,08
Commscope Inc.DL-Notes 2021(21/29) 144A	US203372AX50	177	104	107	78,888000	130.974,36	0,07
Continuum Energy Levanter Pte.DL-Notes 2021(24/21-27) Reg.S *)	USY1753QAB87	200	0	0	83,742780	157.101,17	0,09
Cornerstone Building Brand.IncDL-Notes 2020(20/29) 144A	US21925DAA72	331	0	150	74,369000	230.898,97	0,13
CT TrustDL-Notes 2022(22/32) Reg.S	USG2588BAA29	200	200	0	78,812000	147.851,05	0,08
Delek Logistics Pt.LP/Fin.CorpDL-Notes 2021(21/28) 144A	US24665FAC68	135	0	0	92,725000	117.417,46	0,06
Development Bk of PhilippinesDL-Notes 2021(31) Reg.S	XS2301051541	330	0	240	81,178000	251.277,93	0,14
Eldorado Gold Corp. Ltd.DL-Notes 2021(21/29) 144A	US284902AF02	161	0	89	89,879000	135.733,22	0,07
Falabella S.A.DL-Notes 2021(21/32) Reg.S	USP3984LAA81	210	0	0	78,713000	155.048,59	0,08
Ford Motor Credit Co. LLCDL-Notes 2017(27/27)	US345397YT41	400	400	600	88,944000	333.717,29	0,18
Gap Inc.DL-Notes 2021(21/29) 144A	US364760AP35	95	0	0	70,831000	63.117,39	0,03
Gap Inc.DL-Notes 2021(21/31) 144A	US364760AQ18	55	0	0	69,180000	35.689,90	0,02
GC Treasury Center Co. Ltd.DL-Med.-T.Nts 2022(22/52)Reg.S	US36830DAF87	200	0	0	85,676000	160.727,89	0,09
GeorgienDL-Notes 2021(26) Reg.S	XS2334109423	200	0	0	89,962000	168.768,41	0,09
Global Aircraft Leasing Co.LtdDL-Notes 2019(19/24) 144A	US37960JAA60	509	18	74	89,373000	426.812,45	0,23
Hanwha Life Insurance Co. Ltd.DL-FLR Notes 2022(27/32) Reg.S	USY306AXAD26	210	0	0	89,052000	175.414,31	0,10
Hat Holdings I LLC/Hldg.II LLCDL-Notes 2021(21/26) 144A	US418751AE33	386	101	0	87,586000	317.120,31	0,17
Hillenbrand Inc.DL-Notes 2021(21/31)	US431571AE83	323	0	200	83,469000	252.888,91	0,14
Hilton Domestic Operating Co.DL-Notes 2020(20/29) 144A	US432833AJ07	482	0	100	88,562000	400.402,25	0,22
Iron Mountain Inc.DL-Notes 2020(20/30) 144A	US46284VAJ08	275	205	0	89,600000	231.122,78	0,13
Jeff.Fin.LLC/JFIN Co-Iss.Corp.DL-Notes 2021(21/28) 144A 3C7	US47232MAF95	200	0	0	81,586000	153.055,06	0,08
Kaisa Group Holdings Ltd.DL-Notes 2017(17/22)	XS1627597955	200	0	0	7,733000	14.507,08	0,01
KB HomeDL-Notes 2019(26/27)	US48666KAX72	369	0	0	102,219000	353.801,81	0,19
Kolumbien, RepublikDL-Bonds 2019(19/49)	US195325DQ52	230	0	0	66,994000	144.532,60	0,08
Lamb Weston Holdings Inc.DL-Notes 2021(21/30) 144A	US513272AD65	85	0	0	89,401000	71.279,29	0,04
Lamb Weston Holdings Inc.DL-Notes 2021(21/32) 144A	US513272AE49	85	0	0	88,936000	70.908,55	0,04
Lenovo Group Ltd.DL-Notes 2020(20/30) Reg.S	USY5257YAJ65	200	0	0	84,071000	157.716,91	0,09
Level 3 Financing Inc.DL-Notes 2023(23/30) Reg.S	USU52783AZ71	94	94	0	95,091000	84.130,18	0,05
Light Serv.d.Elet.SA/Lt.Ene.SADL-Notes 2021(21/26) Reg.S	USP62763AB64	210	0	0	39,539000	77.883,78	0,04
Lithia Motors Inc.DL-Notes 2020(20/31) 144A	US536797AF03	260	260	0	85,465000	208.431,67	0,11
M/I Homes Inc.DL-Notes 2020(23/28)	US55305BAS07	85	0	0	93,534000	74.574,52	0,04
MashreqBank PSCDL-FLR Bds 2022(27/33)	XS2548003503	210	210	0	104,638000	206.115,56	0,11
Medline Borrower LPDL-Notes 2021(21/29) 144A	US62482BAB80	40	0	0	86,000000	32.267,14	0,02

*) Kurs inkl. Poolfaktor / Inflationsfaktor

Gattungsbezeichnung	ISIN	Bestand 31.05.23	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs in WP-Whg	Kurswert in EUR	% des FV
Stücke / Anteile / Nominale in 1.000							
Verzinsliche Wertpapiere in USD (Fortsetzung)							
MeituanDL-Notes 2020(20/30) RegS	USG59669AC89	200	0	0	79,354000	148.867,84	0,08
Mercer International Inc.DL-Notes 2021(21/29)	US588056BB60	342	0	0	80,328000	257.688,55	0,14
Mexico City Airport TrustDL-Notes 2017(17/47) Reg.S	USP6629MAD40	320	0	0	77,064000	231.314,89	0,13
MFB Magyar Fejlesztési Bk Zrt.DL-Notes 2023(28)	XS2630760796	200	200	0	100,129000	187.841,67	0,10
Minor International PCLDL-FLR Notes 2021(26/Und.)	XS2362785656	200	0	0	89,911000	168.672,73	0,09
Minsur S.A.DL-Notes 2021(21/31) 144A	US60447KAB61	200	0	0	86,500000	162.273,71	0,09
Namibia, Republic ofDL-Notes 2015(25) Reg.S	XS1311099540	200	0	0	95,162000	178.523,59	0,10
NBK Tier I Financing (2) Ltd.DL-FLR Cap. Secs 2019(25/Und.)	XS2010037922	200	0	0	92,180000	172.929,37	0,09
NCR Corp.DL-Notes 2019(19/29) 144A	US62886EAV02	312	0	150	99,279000	290.545,43	0,16
Novelis Corp.DL-Notes 2021(21/31) 144A	US670001AH91	65	0	0	82,265000	50.156,88	0,03
OneMain Finance Corp.DL-Notes 2021(21/27)	US682691AB63	231	0	64	83,421000	180.754,63	0,10
Ooredoo International FinanceDL-Med.-Term Nts 2021(31)Reg.S	XS2311299957	250	0	0	87,404000	204.962,01	0,11
OTP Bank Nyrt.DL-FLR Med.Term Nts 23(28/33)	XS2586007036	200	200	0	98,599000	184.971,39	0,10
Outfront Media Capit.LLC/Corp.DL-Notes 2020(20/25) 144A	US69007TAD63	329	0	150	100,033000	308.703,28	0,17
Owens-Brockway Glass Cont.Inc.DL-Notes 2023(23/31) 144A	US69073TAU79	80	80	0	101,863000	76.437,86	0,04
Parkland Corp.DL-Notes 2021(21/30) 144A	US70137WAL28	270	0	0	86,595000	219.310,10	0,12
PeruDL-Bonds 2010(50)	US715638BM30	200	0	80	100,386000	188.323,80	0,10
Prime Sec.Serv.Bor.LLC/Fin.IncDL-Notes 2020(20/28) 144A	US74166MAE66	487	0	0	91,948000	420.023,22	0,23
PT Bank Negara Indonesia TBKDL-FLR Notes 2021(27/Und.)	XS2385923722	200	200	0	81,945000	153.728,54	0,08
REC Ltd.DL-Med.-Term Nts 2023(28)Reg.S	US74947MAD48	200	200	0	100,118000	187.821,03	0,10
Royal Caribbean Cruises Ltd.DL-Notes 2021(21/28) 144A	US780153BG60	205	205	0	92,087000	177.073,77	0,10
Royal Caribbean Cruises Ltd.DL-Notes 2022(22/27) 144A	US780153BL55	100	100	0	108,792000	102.046,71	0,06
SeaWorld Parks & Entert. Inc.DL-Notes 2021(21/29) 144A	US81282UAG76	155	0	0	89,768000	130.513,46	0,07
Serbien, RepublikDL-Treasury Nts 2020(30) Reg.S	XS2264555744	300	0	200	75,322000	211.955,73	0,12
Shinhan Card Co. Ltd.DL-Notes 2022(27)	XS2427995001	200	0	0	90,684000	170.122,88	0,09
Singtel Grp Treasury Pte Ltd.DL-Medium-Term Nts 2020(20/30)	XS2185867160	200	0	0	84,264000	158.078,98	0,09
Spectrum Brands Inc.DL-Notes 2020(20/30) 144A	US84762LAW54	241	0	234	91,748000	207.403,32	0,11
Star Ergy Geotherm.(WayangW.)DL-Notes 2018(18/18-33) Reg.S *)	USG84393AC49	221	0	0	79,472994	164.745,63	0,09
Stillwater Mining Co. DL-Notes 2021(25/29) Reg.S	USU85969AF71	210	0	0	79,578000	156.752,46	0,09
Summit Materials LLC/Summit MaDL-Notes 2020(20/29) 144A	US86614RAN70	436	0	50	94,120000	384.919,99	0,21
Suzano Austria GmbHNotes 2021-2032	US86964WAK80	141	0	0	79,396000	105.007,37	0,06
Sweihaan PV Power Company PJSCDL-Bonds 2022(22/22-49) Reg.S *)	XS2382853641	200	0	0	79,003096	148.209,54	0,08
Taylor Morrison Communit.Inc.DL-Notes 2019(19/27) 144A	US87724RAA05	160	0	0	97,630000	146.522,84	0,08
Tencent Holdings Ltd.DL-Med.-T. Nts 21(21/51) Reg.S	US88032XBC74	300	0	0	74,176000	208.730,89	0,11
Tenet Healthcare Corp.DL-Notes 2022(22/30) 144A	US88033GDP28	200	250	50	96,838000	181.667,76	0,10
TopBuild Corp.DL-Notes 2021(21/32) 144A	US89055FAC77	65	0	0	84,322000	51.411,03	0,03
Total Play Telecom. S.A. de C.V.Notes 2020/2025 - 144A	US89157FAA84	400	0	0	68,171000	255.777,13	0,14
TSMC Arizona Corp.DL-Notes 2022(22/52)	US872898AJ06	200	0	0	95,375000	178.923,18	0,10
Uniti G.LP/Fib.HI./G.F.19/CSLDL-Notes 2021(21/30) 144A	US91327AAB89	160	0	0	61,586000	92.428,10	0,05
Uniti G.LP/Fib.HI./G.F.19/CSLDL-Notes 2023(23/28) 144A	US91327TAA97	50	50	0	97,133000	45.555,30	0,02
US Foods Inc.DL-Notes 2021(21/29) 144A	US90290MAD39	450	0	0	91,488000	386.170,15	0,21
Viking Cruises Ltd.DL-Notes 2020(22/25) 144A	US92676XAE76	175	175	0	105,233000	172.739,66	0,09
Western Global Airlines LLCDL-Notes 2020(20/25) 144A	US958278AA10	386	0	0	6,693000	24.233,17	0,01
Windstr.Esc.LLC/Esc.Fin.Corp.DL-Notes 2020(20/28) 144A	US97382WAA18	175	175	0	81,922000	134.474,72	0,07
Andere Wertpapiere in CHF							
ROCHE HOLDING AGInhaber-Genußscheine o.N.	CH0012032048	1.678	62	318	288,200000	496.228,62	0,27
Inflation Linked in EUR							
Bundesrep.DeutschlandInflationsindex. Anl.v.15(26) *)	DE0001030567	490	159	663	121,831288	596.973,31	0,33

*) Kurs inkl. Poolfaktor / Inflationsfaktor

Gattungsbezeichnung	ISIN	Bestand 31.05.23	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs in WP-Whg	Kurswert in EUR	% des FV
		Stücke / Anteile /	Nominale in 1.000				
Zertifikate auf Rohstoffe in EUR							
Amundi Physical Metals PLCETC 23.05.18 Physical Gold	FR0013416716	10.312	4.505	7.682	73,540000	758.344,48	0,41
Summe der börsengehandelten Wertpapiere						56.488.548,43	30,81
Frei handelbare Wertpapiere							
Aktien in EUR							
KERRY GROUP PLCRegistered Shares A EO - ,125	IE0004906560	3.282	848	418	91,180000	299.252,76	0,16
Prysmian S.p.A.Azioni nom. EO 0,10	IT0004176001	2.274	224	0	34,670000	78.839,58	0,04
Snam S.p.A.Azioni nom. o.N.	IT0003153415	15.446	15.446	0	4,890000	75.530,94	0,04
Aktien in AUD							
Bluescope Steel Ltd.Registered Shares o.N.	AU000000BSL0	13.969	0	1.410	18,520000	157.043,66	0,09
Brambles Ltd.Registered Shares o.N.	AU000000BXB1	1.186	1.186	0	13,740000	9.892,03	0,01
CSL LTD.Registered Shares o.N.	AU000000CSL8	1.475	0	300	306,390000	274.334,69	0,15
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD.Registered Shares o.N.	AU000000NAB4	13.735	0	2.246	25,970000	216.528,33	0,12
TRANSURBAN GROUPTriple Stapled Securities o.N.	AU000000TCL6	22.706	0	2.953	14,840000	204.544,90	0,11
Woolworths Group Ltd.Registered Shares o.N.	AU000000WOW2	7.874	0	1.141	37,540000	179.433,61	0,10
Aktien in CAD							
CANADIAN IMPERIAL BK OF COMM.Registered Shares o.N.	CA1360691010	9.200	0	1.400	55,970000	355.328,30	0,19
CANADIAN NATIONAL RAILWAY CO.Registered Shares o.N.	CA1363751027	600	100	0	153,060000	63.372,32	0,03
Aktien in HKD							
AIA Group LtdRegistered Shares o.N.	HK0000069689	26.600	0	3.600	75,100000	239.365,42	0,13
Hongkong Exch. + Clear. Ltd.Registered Shs (BL 100) o.N.	HK0388045442	4.000	0	200	286,600000	137.364,97	0,07
Aktien in JPY							
Astellas Pharma Inc.Registered Shares o.N.	JP3942400007	21.800	0	3.200	2.207,500000	323.084,60	0,18
HITACHI LTD.Registered Shares o.N.	JP3788600009	5.900	900	600	8.046,000000	318.706,63	0,17
KDDI CORP.Registered Shares o.N.	JP3496400007	10.400	0	1.600	4.291,000000	299.606,28	0,16
KOMATSU LTD.Registered Shares o.N.	JP3304200003	11.400	11.400	0	3.292,000000	251.955,44	0,14
KUBOTA CORP.Registered Shares o.N.	JP3266400005	5.200	1.800	0	1.927,000000	67.273,51	0,04
mitsubishi electric corp.Registered Shares o.N.	JP3902400005	24.000	0	4.100	1.819,000000	293.091,35	0,16
MITSUBISHI ESTATE CO. LTD.Registered Shares o.N.	JP3899600005	25.100	4.900	3.600	1.603,000000	270.125,94	0,15
Mitsubishi UFJ Finl Grp Inc.Registered Shares o.N.	JP3902900004	49.000	0	7.600	932,500000	306.763,71	0,17
NINTENDO CO. LTD.Registered Shares o.N.	JP3756600007	6.900	7.300	1.100	5.936,000000	274.980,59	0,15
NIPPON TEL. AND TEL. CORP.Registered Shares o.N.	JP3735400008	11.200	0	1.800	3.955,000000	297.388,09	0,16
SEKISUI HOUSE LTD.Registered Shares o.N.	JP3420600003	13.400	0	1.900	2.723,500000	245.014,19	0,13
Seven & I Holdings Co. Ltd.Registered Shares o.N.	JP3422950000	7.100	0	3.200	5.845,000000	278.613,35	0,15
Sony Group Corp.Registered Shares o.N.	JP3435000009	4.700	200	600	13.160,000000	415.253,02	0,23
Tokio Marine Holdings Inc.Registered Shares o.N.	JP3910660004	11.600	13.200	1.600	3.144,000000	244.849,70	0,13
TOKYO ELECTRON LTD.Registered Shares o.N.	JP3571400005	2.100	1.400	100	19.315,000000	272.315,94	0,15
TOYOTA MOTOR CORP.Registered Shares o.N.	JP3633400001	30.400	0	5.100	1.908,500000	389.515,55	0,21
Aktien in SGD							
DBS GROUP HOLDINGS LTD.Registered Shares SD 1	SG1L01001701	11.200	0	1.600	30,300000	234.948,77	0,13
Aktien in USD							
Adobe Inc.Registered Shares o.N.	US00724F1012	1.744	216	282	417,790000	683.449,73	0,37
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC.Registered Shares DL 1	US0091581068	1.882	280	570	269,140000	475.116,29	0,26
American Water Works Co. Inc.Registered Shares DL -,01	US0304201033	4.331	0	754	144,450000	586.823,89	0,32
AMGEN INC.Registered Shares DL -,0001	US0311621009	2.001	0	343	220,650000	414.145,62	0,23
AT & T Inc.Registered Shares DL 1	US00206R1023	29.466	0	5.124	15,730000	434.762,39	0,24
BANK OF AMERICA CORP.Registered Shares DL 0,01	US0605051046	14.145	0	5.257	27,790000	368.717,33	0,20
BECTON, DICKINSON & CO.Registered Shares DL 1	US0758871091	2.199	0	409	241,760000	498.668,27	0,27
Bk of New York MellonCorp.,TheRegistered Shares DL -,01	US0640581007	13.801	15.167	1.366	40,200000	520.401,65	0,28

Gattungsbezeichnung	ISIN	Bestand 31.05.23	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs in WP-Whg	Kurswert in EUR	% des FV
		Stücke / Anteile / Nominale in 1.000					
Aktien in USD (Fortsetzung)							
BORNGARNER INC.Registered Shares DL -,01	US0997241064	8.981	0	1.657	44,330000	373.443,14	0,20
BOSTON SCIENTIFIC CORP.Registered Shares DL -,01	US1011371077	9.253	9.438	185	51,480000	446.810,28	0,24
CARDINAL HEALTH INC.Registered Shares o.N.	US14149Y1082	5.616	0	2.976	82,300000	433.539,82	0,24
CISCO SYSTEMS INC.Registered Shares DL -,001	US17275R1023	16.002	3.525	2.249	49,670000	745.539,20	0,41
Comcast Corp.Reg. Shares Class A DL -,01	US20030N1019	11.374	11.374	0	39,350000	419.817,00	0,23
CVS Health Corp.Registered Shares DL -,01	US1266501006	3.511	4.118	607	68,030000	224.044,02	0,12
DANAHER CORP.Registered Shares DL -,01	US2358511028	2.450	637	361	229,620000	527.688,77	0,29
DEERE & CO.Registered Shares DL 1	US2441991054	1.674	120	267	345,980000	543.260,97	0,30
EBAY INC.Registered Shares DL -,001	US2786421030	6.168	0	815	42,540000	246.118,30	0,13
ELECTRONIC ARTS INC.Registered Shares DL -,01	US2855121099	4.208	0	728	128,000000	505.228,40	0,28
FEDEX CORP.Registered Shares DL -,10	US31428X1063	2.158	0	370	217,980000	441.235,19	0,24
GILEAD SCIENCES INC.Registered Shares DL -,001	US3755581036	5.876	0	4.919	76,940000	424.068,51	0,23
HARTFORD FINL SVCSGRP INC.,TheRegistered Shares DL -,01	US4165151048	6.797	0	1.178	68,520000	436.854,37	0,24
Hershey Co., TheRegistered Shares DL 1,-	US4278661081	3.016	0	545	259,700000	734.692,06	0,40
INTL BUSINESS MACHINES CORP.Registered Shares DL -,20	US4592001014	4.081	0	1.267	128,590000	492.238,80	0,27
INTL FLAVORS & FRAGRANCES INC.Registered Shares DL -,125	US4595061015	3.433	0	593	77,290000	248.885,25	0,14
JPMorgan Chase & Co.Registered Shares DL 1	US46625H1005	4.414	0	762	135,710000	561.883,44	0,31
LAM RESEARCH CORP.Registered Shares DL -,001	US5128071082	665	0	111	616,700000	384.678,27	0,21
MICRON TECHNOLOGY INC.Registered Shares DL -,10	US5951121038	6.618	0	1.147	68,200000	423.363,29	0,23
NIKE INC.Registered Shares Class B o.N.	US6541061031	3.598	0	623	105,260000	355.243,86	0,19
NVIDIA CORP.Registered Shares DL -,001	US67066G1040	2.181	0	374	378,340000	773.998,26	0,42
PEPSICO INC.Registered Shares DL -,0166	US7134481081	4.845	0	839	182,350000	828.708,14	0,45
PFIZER INC.Registered Shares DL -,05	US7170811035	15.011	0	2.608	38,020000	535.332,73	0,29
QUALCOMM INC.Registered Shares DL -,0001	US7475251036	3.189	0	1.712	113,410000	339.240,68	0,19
Salesforce Inc.Registered Shares DL -,001	US79466L3024	4.429	2.542	615	223,380000	928.008,65	0,51
Stanley Black & Decker Inc.Registered Shares DL 2,50	US8545021011	4.113	1.446	573	74,970000	289.233,29	0,16
STARBUCKS CORP.Reg. Shares DL -,001	US8552441094	4.527	0	783	97,640000	414.610,52	0,23
SYSCO CORP.Registered Shares DL 1	US8718291078	6.704	0	1.161	69,950000	439.869,43	0,24
TARGET CORP.Registered Shares DL -,0833	US87612E1064	3.426	3.807	381	130,930000	420.754,32	0,23
TJX COMPANIES INC.Registered Shares DL 1	US8725401090	6.438	0	3.287	76,790000	463.722,00	0,25
UNION PACIFIC CORP.Registered Shares DL 2,50	US9078181081	2.407	0	414	192,520000	434.664,33	0,24
United Rentals	US9113631090	1.138	0	192	333,790000	356.301,49	0,19
V.F. CORP.Registered Shares o.N.	US9182041080	9.742	5.200	1.308	17,220000	157.356,01	0,09
VERIZON COMMUNICATIONS INC.Registered Shares DL -,10	US92343V1044	13.709	3.503	2.188	35,630000	458.166,84	0,25
VISA Inc.Reg. Shares Class A DL -,0001	US92826C8394	4.383	299	712	221,030000	908.708,84	0,50
Walt Disney Co., TheRegistered Shares DL -,01	US2546871060	8.315	2.683	1.320	87,960000	686.040,15	0,37
Waste Management Inc.Registered Shares DL -,01	US94106L1098	3.536	524	517	161,920000	537.050,11	0,29
Verzinsliche Wertpapiere in EUR							
Nexi S.p.A.EO-Nts 2021(21/29) Reg.S	XS2332590475	476	225	0	84,676000	403.057,76	0,22
Shiba Bidco S.p.A.EO-Notes 2021(21/28) 144A	XS2397065504	120	100	100	86,278000	103.533,60	0,06
Volvo Car ABEO-Med.-Term Nts 2022(22/28)	XS2486825669	225	0	0	94,706000	213.088,50	0,12
Verzinsliche Wertpapiere in USD							
BrasilienDL-Bonds 2014(14/45)	US105756BW95	240	0	0	77,448000	174.350,62	0,10
Chile, RepublikDL-Notes 2020(31/32)	US168863DN50	280	0	0	86,166000	226.305,98	0,12
Dominikanische RepublikDL-Bonds 2015(45) Reg.S	USP3579EBE60	300	100	0	88,854000	250.034,71	0,14
DP World Ltd.DL-Med.-Term Nts 2007(37)Reg.S	XS0308427581	100	0	100	108,643000	101.906,95	0,06
Indian Railway Fin. Corp. Ltd.DL-Notes 2017(27)	XS1733877762	360	0	0	94,680000	319.714,85	0,17
Kolumbien, RepublikDL-Bonds 2006(37)	US195325BK01	140	0	0	93,203000	122.393,96	0,07
MexikoDL-Med.-Term Notes 2012(12/44)	US91086QBB32	440	0	0	84,796000	349.969,42	0,19
Paraguay, RepublikDL-Bonds 2019(19/48-50) Reg.S	USP75744AG08	200	0	0	84,250000	158.052,72	0,09
PeruDL-Bonds 2005(25)	US715638AS19	200	0	0	105,191000	197.337,96	0,11
Teva Pharmac.Fin.NL III B.V.DL-Notes 2016(16/26)	US88167AAE10	100	0	150	89,405000	83.861,74	0,05
Uruguay, RepublikDL-Bonds 2014(48-50)	US760942BA98	190	0	0	98,604000	175.731,73	0,10
Uruguay, RepublikDL-Bonds 2022(22/32-34)	US760942BE11	50	50	0	109,562000	51.384,49	0,03
Uruguay, RepublikDL-Notes 2003(33)	US917288BA96	100	0	40	124,442000	116.726,39	0,06
Summe der frei handelbaren Wertpapiere						32.044.253,45	17,48

Gattungsbezeichnung	ISIN	Bestand 31.05.23	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs in WP-Whg	Kurswert in EUR	% des FV
		Stücke / Anteile / Nominale in 1.000					
Investmentzertifikate in EUR							
AIS-AM.IDX MSCI EUR.SRI PABAct. Nom. DR A EUR Acc. oN	LU1861137484	7.538	7.182	10.028	71,810000	541.303,78	0,30
AIS-AM.IDX MSCI USA SRI PABAct. Nom. DR AH EUR Acc. oN	LU1861136247	15.914	13.788	48.620	88,440000	1.407.434,16	0,77
AIS-Amu.Idx MSCI Japan SRI PABAct.Nom.UC.E.DR EO Acc.oN	LU2233156749	12.385	11.201	15.825	44,550000	551.751,75	0,30
AIS-Amundi MSCI EM SRI PABAct. Nom. IE EUR Acc. oN	LU1861137724	996	956	2.242	1.073,320000	1.069.023,50	0,58
AIS-Amundi MSCI EM SRI PABAct.Nom.U. ETF DR USD Acc. oN	LU1861138961	64.371	0	18.554	47,190000	3.037.667,49	1,66
Amundi Öko Sozial Euro Corp. Bond Miteigentumsanteile - Ausschüttend	AT0000706734	236.625	3.973	58.950	111,530000	26.390.786,25	14,39
Amundi Öko Sozial Euro Govern.Bond Miteigentumsanteile - Thesaurierend	AT0000822671	1.944.630	108.954	330.721	12,850000	24.988.495,50	13,63
Amundi Central & Eastern Europe Bond (T)	AT0000764873	13.070	0	12.655	18,060000	236.041,67	0,13
AMUNDI EURO RENT A	AT0000947643	6.943	10.031	3.088	80,560000	559.328,08	0,31
AMUNDI OEKO SOZ. RENT (T)	AT0000A0FM79	209.381	3.463	37.614	108,120000	22.638.273,72	12,35
AMUNDI OPTIRENDITE(T)	AT0000A05TK3	19.356	17.866	23.836	114,780000	2.221.681,79	1,21
Summe der Investmentzertifikate						83.641.787,69	45,61
Summe Wertpapiervermögen						172.174.589,57	93,90

Derivate

(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen)

Wertpapier-Terminkontrakte

Wertpapier-Terminkontrakte auf Renten

FBTP JUN/23 FT	EUR	-6				-28.800,00	-0,02
FGBL JUN/23 FT	EUR	26				138.060,00	0,08
FGBL JUN/23 FT	EUR	2				-5.920,00	0,00
FGBL JUN/23 FT	EUR	2				-2.360,00	0,00
FGBL JUN/23 FT	EUR	2				1.040,00	0,00
FGBL JUN/23 FT	EUR	2				640,00	0,00
FGBL JUN/23 FT	EUR	2				3.480,00	0,00
FGBM JUN/23 FT	EUR	15				43.650,00	0,02
FGBM JUN/23 FT	EUR	2				-140,00	0,00
FGBM JUN/23 FT	EUR	3				-450,00	0,00
FGBM JUN/23 FT	EUR	3				-2.010,00	0,00
Summe der Wertpapier-Terminkontrakte						147.190,00	0,08

Aktienindex-Derivate

Aktienindex-Terminkontrakte

FESX JUN/23 FT	EUR	-2				-2.810,00	0,00
FESX JUN/23 FT	EUR	-6				-8.640,00	0,00
FESX JUN/23 FT	EUR	-4				-5.700,00	0,00
FESX JUN/23 FT	EUR	-5				-7.125,00	0,00
FESX JUN/23 FT	EUR	-4				-5.700,00	0,00
FESX JUN/23 FT	EUR	-1				-1.415,00	0,00
FESX JUN/23 FT	EUR	-5				-7.075,00	0,00
FESX JUN/23 FT	EUR	-1				-1.420,00	0,00
FESX JUN/23 FT	EUR	-1				-1.430,00	0,00
FESX JUN/23 FT	EUR	-3				-4.305,00	0,00
FESX JUN/23 FT	EUR	-5				-7.175,00	0,00
FESX JUN/23 FT	EUR	-5				-7.175,00	0,00
FESX JUN/23 FT	EUR	-5				-7.175,00	0,00
FESX JUN/23 FT	EUR	-2				-2.890,00	0,00
FESX JUN/23 FT	EUR	-5				-7.225,00	0,00
FESX JUN/23 FT	EUR	-4				-5.750,00	0,00
FESX JUN/23 FT	EUR	-3				-4.342,50	0,00
FESX JUN/23 FT	EUR	-2				-2.855,00	0,00
FESX JUN/23 FT	EUR	-1				-1.417,50	0,00
FESX JUN/23 FT	EUR	-2				-2.910,00	0,00
FESX JUN/23 FT	EUR	-5				-6.975,00	0,00
FESX JUN/23 FT	EUR	-4				-5.540,00	0,00
FESX JUN/23 FT	EUR	-1				-1.385,00	0,00
FESX JUN/23 FT	EUR	-5				-6.875,00	0,00
FESX JUN/23 FT	EUR	-4				-5.500,00	0,00
FESX JUN/23 FT	EUR	-5				-6.875,00	0,00
FESX JUN/23 FT	EUR	-2				-2.735,00	0,00
FESX JUN/23 FT	EUR	-1				-1.380,00	0,00
FESX JUN/23 FT	EUR	-1				-1.377,50	0,00
FESX JUN/23 FT	EUR	-2				-2.730,00	0,00

			Kurswert in EUR	% des FV
Aktienindex-Terminkontrakte (Fortsetzung)				
FESX JUN/23 FT	EUR	-1	-1.370,00	0,00
MSP5 JUN/23 FT	USD	-1	-14.067,63	-0,01
MSP5 JUN/23 FT	USD	-1	-14.051,21	-0,01
MSP5 JUN/23 FT	USD	-1	-14.039,49	-0,01
MSP5 JUN/23 FT	USD	-1	-14.044,18	-0,01
MSP5 JUN/23 FT	USD	-1	-14.034,80	-0,01
MSP5 JUN/23 FT	USD	-1	-14.046,52	-0,01
MSP5 JUN/23 FT	USD	-1	-14.062,94	-0,01
MSP5 JUN/23 FT	USD	-1	-14.032,45	-0,01
MSP5 JUN/23 FT	USD	-2	-28.168,09	-0,02
MSP5 JUN/23 FT	USD	-3	-42.266,20	-0,02
MSP5 JUN/23 FT	USD	-1	-14.053,56	-0,01
MSP5 JUN/23 FT	USD	-1	-14.077,01	-0,01
MSP5 JUN/23 FT	USD	-1	-14.058,25	-0,01
MSP5 JUN/23 FT	USD	-1	-14.065,28	-0,01
MSP5 JUN/23 FT	USD	-1	-14.055,90	-0,01
MSP5 JUN/23 FT	USD	-1	-14.048,87	-0,01
MSP5 JUN/23 FT	USD	-2	-28.083,67	-0,02
MSP5 JUN/23 FT	USD	-2	-28.144,64	-0,02
MSP5 JUN/23 FT	USD	-2	-28.139,95	-0,02
MSP5 JUN/23 FT	USD	-2	-28.158,71	-0,02
MSP5 JUN/23 FT	USD	-2	-28.163,40	-0,02
MSP5 JUN/23 FT	USD	-2	-28.182,16	-0,02
MSP5 JUN/23 FT	USD	-3	-42.259,17	-0,02
MSP5 JUN/23 FT	USD	-1	-13.167,15	-0,01
NKJP JUN/23 FT	JPY	-27	-257.401,55	-0,14
Summe der Aktienindex-Derivate			-886.150,28	-0,48
Devisen-Derivate				
Devisenterminkontrakte (Verkauf)				
Offene Positionen				
USD/EUR 19.00 Mio.			-601.050,09	-0,33
Währungskontrakte				
EUBP JUN/23 FT	GBP	7	-31.685,95	-0,02
URO JUN/23 FT	USD	10	3.224,37	0,00
URO JUN/23 FT	USD	9	2.743,65	0,00
URO JUN/23 FT	USD	26	7.011,54	0,00
URO JUN/23 FT	USD	1	-3.165,74	0,00
URO JUN/23 FT	USD	3	-9.479,65	-0,01
URO JUN/23 FT	USD	4	-19.533,81	-0,01
URO JUN/23 FT	USD	10	-48.893,16	-0,03
URO JUN/23 FT	USD	2	-8.242,66	0,00
URO JUN/23 FT	USD	5	-20.577,34	-0,01
URO JUN/23 FT	USD	7	-25.484,24	-0,01
Summe der Devisen-Derivate			-755.133,08	-0,41
Bankguthaben				
EUR - Guthaben				
	EUR	4.432.310,55	4.432.310,55	2,42
	EUR	1.225.859,55	1.225.859,55	0,67
Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen				
	DKK	3.080.840,47	413.705,00	0,23
	NOK	234.149,68	19.710,40	0,01
	SEK	285.786,20	24.630,37	0,01
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen				
	AUD	92.206,08	55.972,37	0,03
	CAD	167.805,36	115.795,71	0,06
	CHF	364.398,05	373.914,17	0,20
	CNY	16.408,44	2.166,42	0,00
	GBP	212.852,87	247.445,79	0,13
	HKD	1.133.662,56	135.838,74	0,07
	JPY	76.311.090,00	512.326,37	0,28
	MXN	4.592,49	242,58	0,00
	SGD	80.825,17	55.957,61	0,03
	USD	4.547.125,15	4.265.195,71	2,33

		Kurswert in EUR	% des FV
Collaterals ¹⁾			
	EUR	390.000,00	0,21
Summe der Bankguthaben		12.271.071,34	6,69
Swaps			
Credit Default Swap			
CDX-EMS39V1-5Y AUS00136		166.277,17	0,09
CDX-EMS39V1-5Y AUS00136		11.467,40	0,01
CDX-EMS39V1-5Y AUS00136		11.467,40	0,01
CDX-EMS39V1-5Y AUS00136		11.467,40	0,01
CDX-EMS39V1-5Y AUS00136		11.467,40	0,01
CDX-NAHYS40V1-5Y AUS00136		-179.965,04	-0,10
ITRAXX-XOVERS39V1-5Y AUS00136		-160.276,43	-0,09
Summe der Swaps		-128.094,70	-0,07
Sonstige Vermögensgegenstände			
Zinsansprüche	EUR	423.801,05	0,23
Dividendenansprüche	EUR	124.215,69	0,07
Summe sonstige Vermögensstände		548.016,74	0,30
Abgrenzungen Verbindlichkeiten			
Verwaltungsvergütung		-3.809,15	0,00
Summe der Abgrenzungen Verbindlichkeiten		-3.809,15	0,00
Fondsvermögen		183.367.680,44	100,00
Ausschüttungsanteile AT0000A1X4F7 (USD-Tranche)	STK	3,00	
Anteilswert	USD	7,59	
Ausschüttungsanteile AT0000822382	STK	12.587.479,50	
Anteilswert	EUR	6,96	
Thesaurierungsanteile mit KESSt-Abzug AT0000801071	STK	7.523.825,77	
Anteilswert	EUR	12,60	
Thesaurierungsanteile ohne KESSt-Abzug AT0000618020	STK	66.628,62	
Anteilswert	EUR	14,00	

Erläuterungen zur Vermögensaufstellung:

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

1) Erläuterung zum Ausweis gemäß der delegierten Verordnung (EU) Nr. 2016/2251 zur Ergänzung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 des Europäischen Parlaments und des Rates über OTC-Derivate, zentrale Gegenparteien und Transaktionsregister durch technische Regulierungsstandards zu Risikominderungstechniken für nicht durch eine zentrale Gegenpartei geclearte OTC-Derivatekontrakte:

In Höhe der positiven Bewertung der OTC-Derivate hält der Fonds Sicherheiten in Form von Barmitteln von der BOFA Sec. Europe SA Paris (Bank).

Devisenkurse			per 1.6.2023
Australischer Dollar	AUD	1,647350	= 1 Euro (EUR)
Real	BRL	5,460450	= 1 Euro (EUR)
Kanadischer Dollar	CAD	1,449150	= 1 Euro (EUR)
Schweizer Franken	CHF	0,974550	= 1 Euro (EUR)
Renminbi Yuan	CNY	7,574000	= 1 Euro (EUR)
Dänische Krone	DKK	7,446950	= 1 Euro (EUR)
Pfund Sterling	GBP	0,860200	= 1 Euro (EUR)
Hongkong-Dollar	HKD	8,345650	= 1 Euro (EUR)
Rupiah	IDR	15.980,839500	= 1 Euro (EUR)
Indische Rupie	INR	88,200500	= 1 Euro (EUR)
Yen	JPY	148,950150	= 1 Euro (EUR)
Mexikanischer Peso	MXN	18,932050	= 1 Euro (EUR)
Norwegische Krone	NOK	11,879500	= 1 Euro (EUR)
Rubel	RUB	86,594000	= 1 Euro (EUR)
Schwedische Krone	SEK	11,603000	= 1 Euro (EUR)
Singapur-Dollar	SGD	1,444400	= 1 Euro (EUR)
US-Dollar	USD	1,066100	= 1 Euro (EUR)

Risikohinweis:

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

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

Das Nettovermögen wird nach folgenden Grundsätzen ermittelt:

- 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.

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

Gattungsbezeichnung	ISIN	Whg.	Käufe/Zugänge Stücke / Anteile / Nominale in 1.000	Verkäufe/Abgänge
Aktien				
ANZ Group Holdings Ltd.Registered Shares Def. o.N.	AU0000261372	AUD	13.494	13.494
CHINA OV.LAND & INV. LTD.Registered Shares o.N.	HK0688002218	HKD	103.500	103.500
Linde plcRegistered Shares EO -,001	IE000S9YS762	EUR	1.282	1.282
PNC FINANCIAL SERVICES GROUPRegistered Shares DL 5	US6934751057	USD	2.521	2.521
Truist Financial Corp.Registered Shares DL 5	US89832Q1094	USD	10.991	10.991
AIR LIQUIDE-SA ET.EXPL.P.G.CL.Actions Port. EO 5,50	FR0000120073	EUR	81	453
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN S.A.Actions au Porteur (C.R.) EO 4	FR0000125007	EUR	359	1.443
EuroAPI SASActions Nom. EO 1	FR0014008VX5	EUR	0	1
Koninklijke Philips N.V.Aandelen aan toonder EO 0,20	NL0000009538	EUR	0	7.847
Linde PLCRegistered Shares EO 0,001	IE00BZ12WP82	EUR	73	1.585
Siemens Gamesa Renew. En. S.A.Acciones Port. EO -,17	ES0143416115	EUR	1.082	4.462
UBS GROUP AG SF -,10	CH0244767585	CHF	0	19.206
GN STORE NORD ASNavne-Aktier DK 1	DK0010272632	DKK	0	4.893
Orsted A/SIndehaver Aktier DK 10	DK0060094928	DKK	210	3.291
PERSIMMON PLCRegistered Shares LS -,10	GB0006825383	GBP	0	9.188
Link Real Estate Investment TrRegistered Units o.N.	HK0823032773	HKD	0	40.400
FUJITSU LTD.Registered Shares o.N.	JP3818000006	JPY	0	2.300
Sumitomo Mitsui Financ. GroupRegistered Shares o.N.	JP3890350006	JPY	0	8.100
Yamato Holdings Co. Ltd.Registered Shares o.N.	JP3940000007	JPY	0	11.600
AFFILIATED MANAGERS GROUP INC.Registered Shares o.N.	US0082521081	USD	0	3.287
Apple Inc.Registered Shares o.N.	US0378331005	USD	0	19.309
Bright Horizons Family Sol.IncRegistered Shares DL -,001	US1091941005	USD	0	3.870
CATERPILLAR INC.Registered Shares DL 1	US1491231015	USD	0	3.544
CHUBB LTD. SF 24,77	CH0044328745	USD	0	3.595
Citigroup Inc.Registered Shares DL -,01	US1729674242	USD	0	7.383
DARDEN RESTAURANTS INC.Registered Shares o.N.	US2371941053	USD	0	2.814
Elevance Health Inc.Registered Shares DL -,01	US0367521038	USD	0	1.686
General Motors Co.Registered Shares DL -,01	US37045V1008	USD	0	9.996
Live Nation Entertainment Inc.Registered Shares DL -,01	US5380341090	USD	0	6.370
MKS INSTRUMENTS INC.Registered Shares o.N.	US55306N1046	USD	467	3.725
Morgan StanleyRegistered Shares DL -,01	US6174464486	USD	0	4.441
Motorola Solutions Inc.Registered Shares DL -,01	US6200763075	USD	0	2.317
Zendesk Inc.Registered Shares DL -,01	US98936J1016	USD	0	2.865
Verzinsliche Wertpapiere				
Bank Gospodarstwa KrajowegoEO-Medium-Term Nts 2016(26)	XS1403619411	EUR	200	200
Diebold Nixdorf Dutch Hldg BVEO-Notes 2022(22/25) 144A	XS2572122971	EUR	371	371
Diebold Nixdorf Inc.DL-Notes 2022(22/25) Reg.S	USU25317AB13	USD	165	165
Neinor Homes SAEO-Notes 2021(21/26) Reg.S	XS2332219612	EUR	307	307
Organon Finance 1 LLC DL-Notes 2021(21/31) 144A	US68622TAB70	USD	200	200
OTP Bank Nyrt.EO-FLR Preferred MTN 22(25/26)	XS2560693181	EUR	100	100
Polen, RepublikDL-Notes 2022(27)	US857524AD47	USD	134	134
South Africa, Republic ofDL-Notes 2022(32)	US836205BC70	USD	200	200
Sunoco L.P./Sunoco Fin. Corp.DL-Notes 2022(22/30)	US86765LAZ04	USD	135	135
ADLER Real Estate AGAnleihe v.2018(2018/2026)	XS1713464524	EUR	0	100
Arcelik A.S.EO-Notes 2021(21/26) Reg.S	XS2346972263	EUR	0	100
ContourGlobal Power Hldgs S.A.EO-Notes 2020(20/26) 144A	XS2274815872	EUR	0	250
Diebold Nixdorf Dutch Hldg BVEO-Notes 2020(20/25) 144A	XS2206383080	EUR	0	360
Grifols Escrow Issuer S.A.EO-Notes 2021(21/28) 144A	XS2393002519	EUR	100	350
Kroatien, RepublikEO-Notes 2019(29)	XS1843434876	EUR	0	320
Neinor Homes SAEO-Notes 2021(21/26) 144A	XS2332219703	EUR	0	307
Nordmazedonien, RepublikEO-Bonds 2021(27/28) Reg.S	XS2310118893	EUR	0	260
European Investment BankYC-Medium-Term Notes 2021(24)	XS2332164966	CNY	0	2.000
Kreditanst.f.WiederaufbauYC-Med.Term Nts. v.21(24)	XS2322827382	CNY	0	3.000
European Bank Rec. Dev.RP/DL-Medium-Term Nts 2017(22)	XS1734550897	IDR	0	3.100.000
Inter-American Dev. BankRP/DL-Med.-Term Notes 2016(23)	XS1377496457	IDR	0	3.000.000
Adani Green Energy (UP) Ltd.DL-Notes 2019(19/24) Reg.S	XS1854172043	USD	0	200
Alb.Cos LLC/Safe.Inc/N.A.I./A.DL-Notes 2020(20/29) 144A	US013092AG61	USD	0	233
American Axle & Mfg Inc.DL-Notes 2018(18/27)	US02406PAU49	USD	0	442
Anadolu Efes Birac.M.ve G.S.ASDL-Notes 2021(21/28) Reg.S	XS2355105292	USD	0	200
Artera Services LLC DL-Notes 2020(20/25) 144A	US73939VAA26	USD	0	535
Asbury Automotive Group Inc.DL-Notes 2020(20/30)	US043436AV64	USD	0	437
B3 S.A. - Brasil Bolsa BalcaoDL-Notes 2021(21/31) 144A	US11778EAA47	USD	0	275
Bombardier Inc.DL-Notes 2021(21/26) 144A	US097751BV25	USD	0	55
BoS Funding Ltd.DL-Medium-Term Notes 2019(24)	XS2052951600	USD	0	250
BrasilienDL-Bonds 2020(20/30)	US105756CC23	USD	0	200
Braskem Idesa S.A.P.I.DL-Notes 2021(21/32) Reg.S	USP1850NAB75	USD	0	200
Cathay Pacif.MTN Fin.(HK) Ltd.DL-Medium-Term Notes 2021(26)	XS2333657422	USD	0	210
CDI Escrow Issuer Inc.DL-Notes 2022(22/30) 144A	US12511VAA61	USD	0	105
Cencosud S.A.DL-Notes 2015(15/25) Reg.S	USP2205JAK62	USD	0	250

Gattungsbezeichnung	ISIN	Whg.	Käufe/Zugänge Stücke / Anteile / Nominale in 1.000	Verkäufe/Abgänge
Verzinsliche Wertpapiere (Fortsetzung)				
CHS/Commun.Health Systems Inc.DL-Notes 2020(20/27) 144A	US12543DBG43	USD	0	239
CJSC Dvlpmnt Bk of KazakhstanDL-Med.-Term Nts 2021(31)Reg.S	XS2337670694	USD	0	200
Corp.Nacion.del Cobre de ChileDL-Notes 2020(20/30) Reg.S	USP3143NBH63	USD	0	230
Delta Air Lines Inc.DL-Notes 2019(29/29)	US247361ZT81	USD	0	266
Diebold Nixdorf Inc.DL-Notes 2020(20/25) 144A	US253657AA82	USD	0	160
Edgewell Personal Care Co.DL-Notes 2020(20/28) 144A	US28035QAA04	USD	0	135
Far East Horizon LtdDL-Medium-Term Notes 2021(26)	XS2393797530	USD	0	200
Fortune Star (BVI) Ltd.DL-Notes 2020(23/24)	XS2132420758	USD	0	200
Gol Finance S.A.DL-Notes 2020(22/26) 144A	US36254VAC28	USD	0	600
Greenko Dutch B.V.DL-Notes 2021(23/22-26) Reg.S	USN3700LAD75	USD	0	200
Industrias Peñoles S.A.B.de CVDL-Notes 2020(20/50) Reg.S	USP55409AC34	USD	0	240
Inversiones CMPC S.A.DL-Notes 2020(20/30) Reg.S	USP58072AS10	USD	0	200
JD.com Inc.DL-Notes 2016(16/26)	US47215PAC05	USD	0	250
Joseph T. Ryerson & Son Inc.DL-Notes 2020(20/28) 144A	US48088LAB36	USD	0	307
JSC NC Kazakhstan Temir ZholyDL-Notes 2012(42) Reg.S	XS0799658637	USD	0	200
Klabn Austrai GmbHAnleihe 2019-2029	USA35155AA77	USD	0	200
Kolumbien, RepublikDL-Bonds 2004(24)	US195325BD67	USD	0	200
Koppers Inc.DL-Notes 2017(17/25) 144A	US500605AH33	USD	0	390
Logan Merger Sub Inc.DL-Notes 2020(23/27) 144A	US541056AA53	USD	0	494
Lumen Technologies Inc.DL-Debts 1998(98/28) Ser.G	US156686AM96	USD	0	139
MARB BondCo PLCDL-Notes 2021(26/31) Reg.S	USG5825AAC65	USD	0	200
Millicom Intl Cellular S.A.DL-Notes 2020(20/31) Reg.S	USL6388GHX18	USD	0	200
Mineral Resources Ltd.DL-Notes 2022(22/27) 144A	US603051AC70	USD	0	55
Mineral Resources Ltd.DL-Notes 2022(22/30) 144A	US603051AD53	USD	0	60
Minerva Luxembourg S.A.DL-Notes 2021(21/31) 144A	US603374AF69	USD	0	400
Minerva Luxembourg S.A.DL-Notes 2021(21/31) Reg.S	USL6401PAJ23	USD	0	200
MTN (Mauritius) Invest. Ltd.DL-Notes 2014(24) Reg.S	XS1128996425	USD	0	200
Natura & Co Lux.Holdings SàrlDL-Notes 2022(22/29) Reg.S	USL6S52VAA02	USD	0	200
Network i2i Ltd.DL-FLR Secs 2021(26/Und.)Reg.S	USV6703DAC84	USD	0	250
Nielsen Finance LLC/Co.DL-Notes 2021(21/29) 144A	US65409QBH48	USD	0	75
Nielsen Finance LLC/Co.DL-Notes 2021(21/31) 144A	US65409QBK76	USD	0	75
Prosus N.V.DL-Notes 2020(20/51) Reg.S	USN7163RAQ67	USD	0	220
PT Bank Mandiri (Persero) TBKDL-Medium-Term Notes 2019(24)	XS1978319108	USD	0	200
PT Pelabuhan IndonesiaDL-Notes 2015(25) Reg.S	USY7133MAC39	USD	0	200
PT.Hyundai Motor Man.IndonesiaDL-Notes 2021(26)	XS2338042828	USD	0	200
QNB Finance Ltd.DL-Medium-Term Notes 2020(25)	XS2233188353	USD	0	220
Renewable Energy Group Inc.DL-Notes 2021(24/28) 144A	US75972AAD54	USD	0	280
Royal Capital B.V.DL-FLR Notes 2020(26/Und.)	XS2202749003	USD	0	200
Royal Caribbean Cruises Ltd.DL-Notes 2020(20/25) 144A	US780153AZ50	USD	0	217
Safehold Inc.DL-Notes 2019(19/24)	US45031UCF66	USD	0	393
Sigma Alimentos S.A.DL-Notes 2016(16/26) Reg.S	USP8674JAE93	USD	0	200
South Africa, Republic ofDL-Notes 2017(47)	US836205AX27	USD	0	230
Starwood Property Trust Inc.DL-Notes 2021(21/24) 144A	US85571BAW54	USD	0	28
Sunoco L.P./Sunoco Fin. Corp.DL-Notes 2021(21/30) 144A	US86765LAU17	USD	0	85
TBC Bank JSCDL-Notes 2019(24) Reg.S	XS1843434363	USD	0	200
Tupy Overseas S.A.DL-Notes 2021(21/31) Reg.S	USL9326VAB29	USD	0	200
Twitter Inc.DL-Notes 2022(22/30) 144A	US90184LAP76	USD	0	180
United Overseas Bank Ltd.DL-FLR Med.-T.Nts 17(23/Und.)	XS1699845068	USD	0	200
Andere Wertpapiere				
Australia & N. Z. Bkg Grp Ltd. Anrechte	AU0000232860	AUD	967	967
Koninklijke Philips N.V. Anrechte	NL0015000VF4	EUR	0	7.847

Wien, am 20. September 2023

Amundi Austria GmbH

Franck Jochaud du Plessix

Christian Mathern

Hannes Roubik

Alois Steinböck

Bestätigungsvermerk

Prüfungsurteil

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

Amundi ESG Income 1,
Miteigentumsfonds gemäß Investmentfondsgesetz 2011 idgF (InvFG)

bestehend aus der Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2023, der Ertragsrechnung für das an diesem Stichtag endende Rechnungsjahr und den sonstigen in Anlage I Schema B Investmentfondsgesetz 2011 (InvFG 2011) vorgesehenen Angaben, geprüft.

Nach unserer Beurteilung entspricht der Rechenschaftsbericht den gesetzlichen Vorschriften und vermittelt ein möglichst getreues Bild der Vermögens- und Finanzlage zum 31. Mai 2023 sowie der Ertragslage des Fonds für das an diesem Stichtag endende Rechnungsjahr in Übereinstimmung mit den österreichischen unternehmensrechtlichen Vorschriften und den Bestimmungen des InvFG 2011.

Grundlage für das Prüfungsurteil

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

Sonstige Informationen

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

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

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

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

Verantwortlichkeiten der gesetzlichen Vertreter und des Aufsichtsrats für den Rechenschaftsbericht

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

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

Verantwortlichkeiten des Abschlussprüfers für die Prüfung des Rechenschaftsberichts

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

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

Darüber hinaus gilt:

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

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

Wien, am 28. September 2023

Deloitte Audit Wirtschaftsprüfungs GmbH

Mag. Robert Pejhovský
Wirtschaftsprüfer

Steuerliche Behandlung

des Amundi ESG Income 1

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

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

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

Fondsbestimmungen

Fondsbestimmungen für den

Amundi ESG Income 1

gemäß InvFG 2011

Die Fondsbestimmungen für den Investmentfonds **Amundi ESG Income 1**, Miteigentumsfonds gemäß **Investmentfondsgesetz 2011 idgF** (InvFG), wurden von der Finanzmarktaufsicht (FMA) genehmigt.

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

Artikel 1 Miteigentumsanteile

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

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

Artikel 2 Depotbank (Verwahrstelle)

Die für den Investmentfonds bestellte Depotbank (Verwahrstelle) ist die UniCredit Bank Austria AG, Wien.

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

Artikel 3 Veranlagungsinstrumente und -grundsätze

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

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

Beschreibung des Veranlagungsschwerpunktes

Der Investmentfonds veranlagt hauptsächlich, das heißt zu **mindestens 66 vH** des Fondsvermögens direkt oder indirekt über Investmentfonds in Anleihen (in Form von Wertpapieren und/oder Geldmarktinstrumenten), Aktien und diesen gleichwertigen Wertpapieren, welche die Kriterien eines nachhaltigen Investments erfüllen müssen. Dies wird dadurch gewährleistet, dass aufgrund von vordefinierten Ausschlusskriterien bestimmte Titel von der Veranlagung absolut ausgeschlossen werden und im Übrigen die Titelauswahl aufgrund der Bewertung nach Umwelt-, Sozial- und Governance – Kriterien (ESG) erfolgt, aus denen eine Gesamtbewertung ermittelt wird.

Die durch Direktanlagen in Aktien und aktienähnliche begebare Wertpapiere, über Derivate sowie indirekt über Investmentfonds repräsentierte Aktienquote beträgt je nach Markteinschätzung **bis zu 35 vH** des Fondsvermögens.

Zu Diversifikationszwecken kann bis zu **maximal 10 vH** des Fondsvermögens in Gold-Zertifikate veranlagt werden, wenn diese dem Erwerber keinen Herausgabeanspruch auf physisches Gold, sondern lediglich einen entsprechenden Zahlungsanspruch gegenüber dem Emittenten vermitteln.

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

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

3.1. Wertpapiere

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

3.2. Geldmarktinstrumente

Geldmarktinstrumente dürfen **bis zu 100 vH** des Fondsvermögens erworben werden.

3.3. Wertpapiere und Geldmarktinstrumente

Der Erwerb nicht voll eingezahlter Wertpapiere oder Geldmarktinstrumente und von Bezugsrechten auf solche Instrumente oder von nicht voll eingezahlten anderen Finanzinstrumenten ist zulässig.

Wertpapiere und Geldmarktinstrumente dürfen erworben werden, wenn sie den Kriterien betreffend die Notiz oder den Handel an einem geregelten Markt oder einer Wertpapierbörse gemäß InvFG entsprechen.

Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die die im vorstehenden Absatz genannten Kriterien nicht erfüllen, dürfen insgesamt **bis zu 10 vH** des Fondsvermögens erworben werden.

3.4. Anteile an Investmentfonds

Anteile an Investmentfonds (OGAW, OGA) dürfen **jeweils bis zu 20 vH** des Fondsvermögens und **insgesamt bis zu 100 vH** des Fondsvermögens erworben werden, sofern diese (OGAW bzw. OGA) ihrerseits jeweils zu nicht mehr als 10 vH des Fondsvermögens in Anteile anderer Investmentfonds investieren.

Anteile an OGA dürfen **insgesamt bis zu 30 vH** des Fondsvermögens erworben werden.

3.5. Derivative Instrumente

Derivative Instrumente dürfen als Teil der Anlagestrategie **bis zu 34 vH** des Fondsvermögens (berechnet auf Basis der aktuellen Marktpreise) und zur Absicherung eingesetzt werden.

3.6. Risiko-Messmethode des Investmentfonds

Der Investmentfonds wendet folgende Risikomessmethode an:

Commitment Ansatz

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

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

3.7. Sichteinlagen oder kündbare Einlagen

Sichteinlagen und kündbare Einlagen mit einer Laufzeit von höchstens 12 Monaten dürfen **bis zu 34 vH** des Fondsvermögens gehalten werden.

Es ist kein Mindestbankguthaben zu halten.

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

3.8. Vorübergehend aufgenommene Kredite

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

3.9. Pensionsgeschäfte

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

3.10. Wertpapierleihe

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

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

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

Artikel 4 Modalitäten der Ausgabe und Rücknahme

Die Berechnung des Anteilswertes erfolgt in EUR.

Es liegt im Ermessen der Verwaltungsgesellschaft, auch Anteilsscheinklassen in anderen Währungen aufzulegen.

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

4.1. Ausgabe und Ausgabeaufschlag

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

Der Ausgabepreis ergibt sich aus dem Anteilswert zuzüglich eines Aufschlages pro Anteil in Höhe von **bis zu 3,00 vH** zur Deckung der Ausgabekosten der Verwaltungsgesellschaft.

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

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

4.2. Rücknahme und Rücknahmeabschlag

Die Berechnung des Rücknahmepreises bzw. die Rücknahme erfolgt an jedem österreichischen Börsentag mit Ausnahme von Bankfeiertagen.

Der Rücknahmepreis ergibt sich aus dem Anteilswert. Es fällt kein Rücknahmeabschlag an.

Auf Verlangen eines Anteilinhabers ist diesem sein Anteil an dem Investmentfonds zum jeweiligen Rücknahmepreis gegen Rückgabe des Anteilscheines auszuführen.

Artikel 5 Rechnungsjahr

Das Rechnungsjahr des Investmentfonds ist die Zeit vom 01.06. bis zum 31.05.

Artikel 6 Anteilsgattungen und Ertragnisverwendung

Für den Investmentfonds können sowohl Ausschüttungsanteilscheine und/oder Thesaurierungsanteilscheine mit KEST-Auszahlung als auch Thesaurierungsanteilscheine ohne KEST-Auszahlung und zwar jeweils über ein Stück oder Bruchteile davon ausgegeben werden.

Für diesen Investmentfonds können verschiedene Gattungen von Anteilscheinen ausgegeben werden. Die Bildung der Anteilsgattungen sowie die Ausgabe von Anteilen einer Anteilsgattung liegen im Ermessen der Verwaltungsgesellschaft.

6.1. Ertragnisverwendung bei Ausschüttungsanteilscheinen (Ausschütter)

Die während des Rechnungsjahres vereinnahmten Erträge (Zinsen und Dividenden) können nach Deckung der Kosten nach dem Ermessen der Verwaltungsgesellschaft ausgeschüttet werden. Eine Ausschüttung kann unter Berücksichtigung der Interessen der Anteilhaber unterbleiben. Ebenso steht die Ausschüttung von Erträgen aus der Veräußerung von Vermögenswerten des Investmentfonds einschließlich von Bezugsrechten im Ermessen der Verwaltungsgesellschaft. Eine Ausschüttung aus der Fondssubstanz sowie Zwischenausschüttungen sind zulässig.

Das Fondsvermögen darf durch Ausschüttungen in keinem Fall das im Gesetz vorgesehene Mindestvolumen für eine Kündigung unterschreiten.

Die Beträge sind an die Inhaber von Ausschüttungsanteilscheinen ab 01.08. des folgenden Rechnungsjahres auszuschütten, der Rest wird auf neue Rechnung vorgetragen.

Jedenfalls ist ab dem 01.08. der gemäß InvFG ermittelte Betrag auszuführen, der zutreffendenfalls zur Deckung einer auf den ausschüttungsgleichen Ertrag des Anteilscheines entfallenden Kapitalertragsteuerabfuhrpflicht zu verwenden ist.

6.2. Ertragnisverwendung bei Thesaurierungsanteilscheinen mit KEST-Auszahlung (Thesaurierer)

Die während des Rechnungsjahres vereinnahmten Erträge nach Deckung der Kosten werden nicht ausgeschüttet. Es ist bei Thesaurierungsanteilscheinen ab 01.08. der gemäß InvFG ermittelte Betrag auszuführen, der zutreffendenfalls zur Deckung einer auf den ausschüttungsgleichen Ertrag des Anteilscheines entfallenden Kapitalertragsteuerabfuhrpflicht zu verwenden ist.

6.3. Ertragnisverwendung bei Thesaurierungsanteilscheinen ohne KEST-Auszahlung (Vollthesaurierer)

Die während des Rechnungsjahres vereinnahmten Erträge nach Deckung der Kosten werden nicht ausgeschüttet. Es wird keine Auszahlung gemäß InvFG vorgenommen. Der für das Unterbleiben der KEST-Auszahlung auf den Jahresertrag gemäß InvFG maßgebliche Zeitpunkt ist jeweils der 01.08. des folgenden Rechnungsjahres.

Die Verwaltungsgesellschaft stellt durch Erbringung entsprechender Nachweise von den depotführenden Stellen sicher, dass die Anteilscheine im Auszahlungszeitpunkt nur von Anteilhabern gehalten werden können, die entweder nicht der inländischen Einkommen- oder Körperschaftsteuer unterliegen oder bei denen die Voraussetzungen für eine Befreiung gemäß § 94 des Einkommensteuergesetzes bzw. für eine Befreiung von der Kapitalertragsteuer vorliegen.

Werden diese Voraussetzungen zum Auszahlungszeitpunkt nicht erfüllt, ist der gemäß InvFG ermittelte Betrag durch Gutschrift des jeweils depotführenden Kreditinstituts auszuführen.

6.4. Ertragnisverwendung bei Thesaurierungsanteilscheinen ohne KEST-Auszahlung (Vollthesaurierer Auslandstranche)

Der Vertrieb der Thesaurierungsanteilscheine ohne KEST-Auszahlung erfolgt ausschließlich im Ausland.

Die während des Rechnungsjahres vereinnahmten Erträge nach Deckung der Kosten werden nicht ausgeschüttet. Es wird keine Auszahlung gemäß InvFG vorgenommen.

Die Verwaltungsgesellschaft stellt durch Erbringung entsprechender Nachweise sicher, dass die Anteilscheine im Auszahlungszeitpunkt nur von Anteilhabern gehalten werden können, die entweder nicht der inländischen Einkommen- oder Körperschaftsteuer unterliegen oder bei denen die Voraussetzungen für eine Befreiung gemäß § 94 des Einkommensteuergesetzes bzw. für eine Befreiung von der Kapitalertragsteuer vorliegen.

Artikel 7 Verwaltungsgebühr, Ersatz von Aufwendungen, Abwicklungsgebühr

Die Verwaltungsgesellschaft erhält für ihre Verwaltungstätigkeit eine jährliche Vergütung bis zu einer Höhe von **1,00 vH** des Fondsvermögens, die aufgrund des **Durchschnitts** der Fondsvermögenswerte je Preisberechnungstag bereinigt um allfällige dafür vorgenommene Abgrenzungen errechnet und monatlich in 12 Teilbeträgen angelastet wird.

Es liegt im Ermessen der Verwaltungsgesellschaft, eine Staffelung der Verwaltungsgebühr vorzunehmen.

Die Verwaltungsgesellschaft hat Anspruch auf Ersatz aller durch die Verwaltung entstandenen Aufwendungen, wie insbesondere Kosten für Pflichtveröffentlichungen, Depotgebühren, Aufwendungen für administrative Tätigkeiten gemäß § 5 Abs 2 Z 1 lit b) InvFG sowie Prüfungs-, Beratungs- und Abschlusskosten.

Die Kosten bei Einführung neuer Anteilsgattungen für bestehende Sondervermögen werden zu Lasten der Anteilspreise der neuen Anteilsgattungen in Rechnung gestellt.

Bei Abwicklung des Investmentfonds erhält die abwickelnde Stelle eine Vergütung von **0,5 vH** des Fondsvermögens.

Nähere Angaben und Erläuterungen zu diesem Investmentfonds finden sich im Prospekt.

Anhang

Liste der Börsen mit amtlichem Handel und von organisierten Märkten

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

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

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

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

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

https://registers.esma.europa.eu/publication/searchRegister?core=esma_registers_upreg¹

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

1.2.1. Luxemburg Euro MTF Luxemburg

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

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

2. Börsen in europäischen Ländern außerhalb der Mitgliedstaaten des EWR

2.1.	Bosnien Herzegowina:	Sarajevo, Banja Luka
2.2.	Montenegro:	Podgorica
2.3.	Russland:	Moscow Exchange
2.4.	Schweiz	SIX Swiss Exchange AG, BX Swiss AG
2.5.	Serbien:	Belgrad
2.6.	Türkei:	Istanbul (betr. Stock Market nur "National Market")
2.7.	Vereinigtes Königreich Großbritannien und Nordirland	Cboe Europe Equities Regulated Market – Integrated Book Segment, London Metal Exchange, Cboe Europe Equities Regulated Market – Reference Price Book Segment, Cboe Europe Equities Regulated Market – Off-Book Segment, London Stock Exchange Regulated Market (derivatives), NEX Exchange Main Board (non-equity), London Stock Exchange Regulated Market, NEX Exchange Main Board (equity), Euronext London Regulated Market, ICE FUTURES EUROPE, ICE FUTURES EUROPE - AGRICULTURAL PRODUCTS DIVISION, ICE FUTURES EUROPE - FINANCIAL PRODUCTS DIVISION, ICE FUTURES EUROPE - EQUITY PRODUCTS DIVISION und Gibraltar Stock Exchange

3. Börsen in außereuropäischen Ländern

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

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

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

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

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

5. Börsen mit Futures und Options Märkten

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

Anhang Artikel 8 der Offenlegungsverordnung

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

Name des Produkts: Amundi ESG Income 1

Unternehmenskennung (LEI-Code): 213800PPS7BWX3RHBI89

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?



Ja



Nein



Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: _____



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



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



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



Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt Es 47,45% an nachhaltigen Investitionen



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



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



mit einem sozialen Ziel



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

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

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



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

Ja, die beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale wurden erfüllt. Der Fonds fördert ökologische und/oder soziale Merkmale, indem er mindestens ein ESG-Durchschnittsrating von D anstrebt. Zur Ermittlung des ESG-Scores des Fonds wird die ESG-Performance durch den Vergleich der durchschnittlichen Performance eines Wertpapiers mit der Branche des Wertpapieremittenten in Bezug auf jedes der drei ESG Merkmale Umwelt, Soziales und Unternehmensführung beurteilt.

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

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

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

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

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

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

Am Ende des Berichtszeitraums:

- beträgt das gewichtete durchschnittliche ESG-Score des Portfolios **0,81 (dies entspricht einem ESG Rating von C)**

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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



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

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

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

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

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

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



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

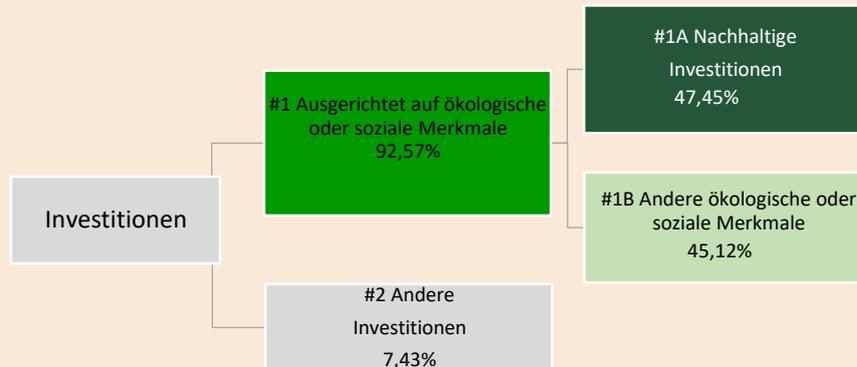
Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: **Von 01/06/2022 bis 31/05/2023**

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
AMUNDI OKO SOZIAL EURO CORPORATE BOND	Investmentfonds	14,38%	AUT
AMUNDI OKO SOZIAL EURO GOVERNMENT BOND	Investmentfonds	13,61%	AUT
AM OKO SOZIAL EURO AGGREGATE BOND T	Investmentfonds	12,33%	AUT
AMND MSCI EM SRI ETF(PAR)	Investmentfonds	1,65%	LUX
MICROSOFT CORP	Software	1,32%	USA
AMUNDI OKO SOZIAL EURO SHORT BD	Investmentfonds	1,21%	AUT
AMU INDEX MSCI USA SRI - UCITS ETF	Investmentfonds	0,77%	LUX
DBR % 08/30 G	Schatzanleihen	0,72%	DEU
IRELAND 1.35% 03/31	Schatzanleihen	0,55%	IRL
AMU IDX MSCI EMERG MKTS SRI PAB IEC	Investmentfonds	0,54%	LUX
SALESFORCE COM	Software	0,51%	USA
ADVANCED MICRO DEVICES	Halbleiter & Halbleiterausrüstung	0,50%	USA
VISA INC -A	Finanzdienstleistung	0,50%	USA
ELI LILLY & CO	Arzneimittel	0,47%	USA
PEPSICO INC	Getränke	0,45%	USA



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Wie sah die Vermögensallokation aus?



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

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

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

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

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Sektor	In % der Vermögenswerte
Aktien	34,09%
Informationstechnologie	6,83%
Gesundheitswesen	5,12%
Industriewerte	4,60%
Finanzwesen	4,55%
Zykl. Konsumgüter	3,52%
Nicht-Zykl. Konsumgüter	3,46%
Telekommunikation	2,60%
Materialien	1,76%
Verbraucher	0,85%
Immobilien	0,79%
Energiewerte	0,01%
Anleihen	60,41%
Unternehmensanleihen	30,34%
Staatsnahe Anleihen	15,74%
Staatsanleihen	12,96%
besicherte Anleihen	1,37%
Bargeld	5,50%

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

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

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

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

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



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

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

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



Ja:



In fossiles Gas



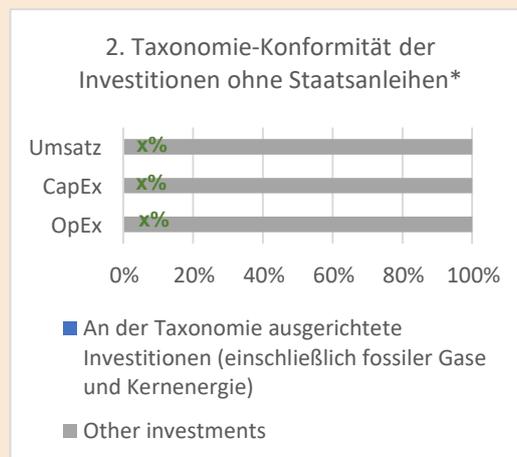
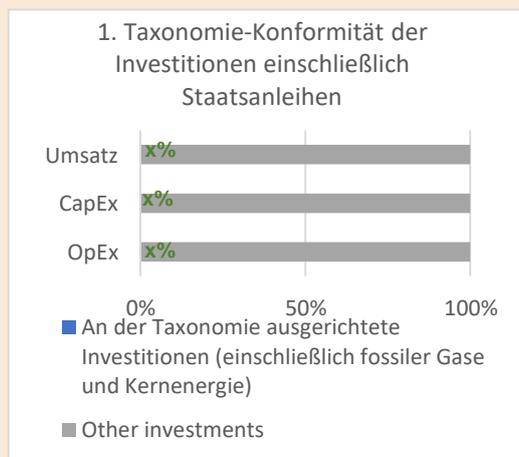
In Kernenergie



Nein

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

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



Noch keine Daten verfügbar

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

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen we-

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

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

sentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen..

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

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

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

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

Am Ende des Berichtszeitraums, betrug der Anteil der nachhaltigen Investitionen mit nicht an der Taxonomie ausgerichteten Umweltzielen **40,98%**.

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

- **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

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

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

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



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

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

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

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

Im Berichtszeitraum wurden alle Artikel 6 Subfonds, die in Komponenten mit einem Amundi G Rating investierten, mit Artikel 8 Subfonds ersetzt. Des Weiteren wurden Green Bonds Staatsanleihen aus der

Eurozone gekauft. Im Aktienbereich investierten wir in einen Hydrogen Aktiensubfonds. Ebenfalls ist der Großteil der Unternehmensanleihen mittels nachhaltiger Subfonds investiert.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

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

Dieses Produkt hat keinen ESG-Vergleichsmaßstab

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

Dieses Produkt hat keinen ESG-Vergleichsmaßstab

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

Dieses Produkt hat keinen ESG-Vergleichsmaßstab.

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

Dieses Produkt hat keinen ESG-Vergleichsmaßstab

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

Dieses Produkt hat keinen ESG-Vergleichsmaßstab