

Raiffeisen-Nachhaltigkeit-ShortTerm

Halbjahresbericht

Berichtszeitraum 01.09.2021 – 28.02.2022

Inhaltsverzeichnis

Allgemeine Fondsdaten	3
Fondscharakteristik	3
Rechtlicher Hinweis	4
Fondsdetails	5
Umlaufende Anteile	6
Bericht zur Anlagepolitik des Fonds	6
Zusammensetzung des Fondsvermögens in EUR	7
Vermögensaufstellung in EUR per 28.02.2022	8
Anhang	19

Bericht über den Berichtszeitraum vom 01.09.2021 bis 28.02.2022

Allgemeine Fondsdaten

ISIN	Tranche	Ertragstyp	Währung	Aufledgedatum
AT0000A190Z8	Raiffeisen-Nachhaltigkeit-ShortTerm (R) A	Ausschüttung	EUR	01.10.2014
AT0000A1U7C0	Raiffeisen-Nachhaltigkeit-ShortTerm (RZ) A	Ausschüttung	EUR	03.04.2017
AT0000A0ALQ3	Raiffeisen-Nachhaltigkeit-ShortTerm (I) T	Thesaurierung	EUR	15.09.2008
AT0000A190X3	Raiffeisen-Nachhaltigkeit-ShortTerm (R) T	Thesaurierung	EUR	01.10.2014
AT0000A1U7B2	Raiffeisen-Nachhaltigkeit-ShortTerm (RZ) T	Thesaurierung	EUR	03.04.2017
AT0000A296K5	Raiffeisen-Nachhaltigkeit-ShortTerm (SZ) T ¹	Thesaurierung	EUR	02.09.2019
AT0000A0ALR1	Raiffeisen-Nachhaltigkeit-ShortTerm (I) VTA	Vollthesaurierung Ausland	EUR	15.09.2008
AT0000A19HM5	Raiffeisen-Nachhaltigkeit-ShortTerm (R) VTA	Vollthesaurierung Ausland	EUR	01.10.2014
AT0000A1U7D8	Raiffeisen-Nachhaltigkeit-ShortTerm (RZ) VTA	Vollthesaurierung Ausland	EUR	03.04.2017
AT0000A1ARZ9	Raiffeisen-Nachhaltigkeit-ShortTerm (R) VTI	Vollthesaurierung Inland	EUR	01.12.2014

¹ Die gegenständliche Tranche SZ ist ausschließlich für Veranlagungen im Zuge der nachhaltigen Vermögensverwaltung der Raiffeisen Bankengruppe vorgesehen.

Fondscharakteristik

Fondswährung	EUR
Rechnungsjahr	01.09. – 31.08.
Ausschüttungs- / Auszahlungs- / Wieder- veranlagungstag	15.11.
Fondsbezeichnung	Investmentfonds gemäß § 2 InvFG (OGAW)
effektive Verwaltungsgebühr des Fonds	I-Tranche (EUR): 0,150 % R-Tranche (EUR): 0,360 % RZ-Tranche (EUR): 0,150 % SZ-Tranche (EUR): 0,098 %
Depotbank	Raiffeisen Bank International AG
Verwaltungsgesellschaft	Raiffeisen Kapitalanlage-Gesellschaft m.b.H. Mooslackengasse 12, A-1190 Wien Tel. +43 1 71170-0 Fax +43 1 71170-761092 www.rcm.at Firmenbuchnummer: 83517 w
Fondsmanagement	Raiffeisen Kapitalanlage-Gesellschaft m.b.H.
Abschlussprüfer	KPMG Austria GmbH

Der Fonds wird aktiv ohne Bezugnahme zu einem Referenzwert verwaltet.

Rechtlicher Hinweis

Die verwendete Software rechnet mit mehr als den angezeigten zwei Kommastellen. Durch weitere Berechnungen mit ausgewiesenen Ergebnissen können geringfügige Abweichungen nicht ausgeschlossen werden.

Der Wert eines Anteiles ergibt sich aus der Teilung des Gesamtwertes des Investmentfonds einschließlich der Erträge durch die Zahl der Anteile. Der Gesamtwert des Investmentfonds 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.

Die Wertentwicklung wird von der Raiffeisen KAG auf Basis der veröffentlichten Fondspreise nach der OeKB-Methode berechnet. Bei der Berechnung der Wertentwicklung werden individuelle Kosten, wie beispielsweise Transaktionsgebühren, Ausgabeaufschlag (maximal 0,00 %), Rücknahmeabschlag (maximal 0,00 %), Depotgebühren des Anlegers sowie Steuern nicht berücksichtigt. Diese würden sich bei Berücksichtigung mindernd auf die Wertentwicklung auswirken. Die Wertentwicklung der Vergangenheit lässt keine verlässlichen Rückschlüsse auf die zukünftige Entwicklung des Fonds zu.

Sehr geehrte Anteilshaber!

Die Raiffeisen Kapitalanlage-Gesellschaft m.b.H. erlaubt sich den Halbjahresbericht des Raiffeisen-Nachhaltigkeit-ShortTerm für den Berichtszeitraum vom 01.09.2021 bis 28.02.2022 vorzulegen. Dem Rechnungsabschluss wurde die Preisberechnung vom 28.02.2022 zu Grunde gelegt.

Fondsdetails

	31.08.2021	28.02.2022
Fondsvermögen gesamt in EUR	116.515.655,45	142.778.346,42
errechneter Wert / Ausschüttungsanteile (R) (AT0000A190Z8) in EUR	91,25	89,01
Ausgabepreis / Ausschüttungsanteile (R) (AT0000A190Z8) in EUR	91,25	89,01
errechneter Wert / Ausschüttungsanteile (RZ) (AT0000A1U7C0) in EUR	96,47	94,21
Ausgabepreis / Ausschüttungsanteile (RZ) (AT0000A1U7C0) in EUR	96,47	94,21
errechneter Wert / Thesaurierungsanteile (I) (AT0000A0ALQ3) in EUR	102,54	101,14
Ausgabepreis / Thesaurierungsanteile (I) (AT0000A0ALQ3) in EUR	102,54	101,14
errechneter Wert / Thesaurierungsanteile (R) (AT0000A190X3) in EUR	97,44	96,01
Ausgabepreis / Thesaurierungsanteile (R) (AT0000A190X3) in EUR	97,44	96,01
errechneter Wert / Thesaurierungsanteile (RZ) (AT0000A1U7B2) in EUR	99,43	98,08
Ausgabepreis / Thesaurierungsanteile (RZ) (AT0000A1U7B2) in EUR	99,43	98,08
errechneter Wert / Thesaurierungsanteile (SZ) (AT0000A296K5) in EUR	99,59	98,37
Ausgabepreis / Thesaurierungsanteile (SZ) (AT0000A296K5) in EUR	99,59	98,37
errechneter Wert / Vollthesaurierungsanteile (I) (AT0000A0ALR1) in EUR	106,44	104,99
Ausgabepreis / Vollthesaurierungsanteile (I) (AT0000A0ALR1) in EUR	106,44	104,99
errechneter Wert / Vollthesaurierungsanteile (R) (AT0000A19HM5) in EUR	97,65	96,22
Ausgabepreis / Vollthesaurierungsanteile (R) (AT0000A19HM5) in EUR	97,65	96,22
errechneter Wert / Vollthesaurierungsanteile (RZ) (AT0000A1U7D8) in EUR	99,53	98,17
Ausgabepreis / Vollthesaurierungsanteile (RZ) (AT0000A1U7D8) in EUR	99,53	98,17
errechneter Wert / Vollthesaurierungsanteile (R) (AT0000A1ARZ9) in EUR	97,72	96,29
Ausgabepreis / Vollthesaurierungsanteile (R) (AT0000A1ARZ9) in EUR	97,72	96,29

Umlaufende Anteile

	Umlaufende Anteile am 31.08.2021	Absätze	Rücknahmen	Umlaufende Anteile am 28.02.2022
AT0000A190Z8 (R) A	79.238,463	1.444,428	-2.340,808	78.342,083
AT0000A1U7C0 (RZ) A	2.991,495	242,301	-83,379	3.150,417
AT0000A0ALQ3 (I) T	739.348,000	667.372,000	-392.086,000	1.014.634,000
AT0000A190X3 (R) T	106.936,289	1.176,816	-8.289,446	99.823,659
AT0000A1U7B2 (RZ) T	32.979,784	1.640,402	-3.014,313	31.605,873
AT0000A296K5 (SZ) T	21.578,806	40.303,990	-61.867,780	15,016
AT0000A0ALR1 (I) VTA	106.963,485	26.733,849	-9.580,544	124.116,790
AT0000A19HM5 (R) VTA	57.592,726	23.864,041	-10.270,971	71.185,796
AT0000A1U7D8 (RZ) VTA	10,000	0,000	0,000	10,000
AT0000A1ARZ9 (R) VTI	3.310,253	0,000	-28,000	3.282,253
Gesamt umlaufende Anteile				1.426.165,887

Bericht zur Anlagepolitik des Fonds

Der Fonds war im Berichtszeitraum ausschließlich in Anleihen von in unserer Einschätzung verantwortungsvoll und zukunftsfähig agierenden Unternehmen und Staaten mit guter Bonität und Laufzeiten bis maximal 5 Jahren investiert. Staaten wie Frankreich, Finnland, Großbritannien und Slowakei sind derzeit weiterhin aus Nachhaltigkeitsaspekten ausgeschlossen und wir tätigen entsprechend keine Investitionen in Staatsanleihen dieser Länder. In der 1. Hälfte des Rechnungsjahres musste für den Fonds ein klarer Rückgang des Anteilswertes verzeichnet werden. Überraschend hohe Inflationsraten bewogen die Zentralbanken in den USA und Europa baldige Leitzinsanhebungen in den Raum zu stellen. Die kurz laufenden Papiere im Fonds gaben in diesem Umfeld im Preis leicht nach, jedoch nicht so stark wie Anleihen mit einer deutlich längeren Laufzeit. Positiv machten sich in diesem Marktumfeld die Absicherungsgeschäfte, die für den Fonds durch den Verkauf von börsengehandelten Futures-Kontrakten umgesetzt worden waren, bemerkbar und die negative Wertentwicklung konnte etwas gedämpft werden. Gegen Ende der Berichtsperiode bestimmte die Invasion Russlands in der Ukraine das Marktgeschehen. In dieser Marktphase verloren russische Staatsanleihen sowie Anleihen von russischen Unternehmungen beträchtlich an Wert. Der Fonds war davon jedoch nicht betroffen, nicht zuletzt waren derartige Titel aus ESG-Überlegungen nicht Gegenstand der Veranlagung. Die Risikoaufschläge für die Unternehmensanleihen im Fonds stiegen in diesem Umfeld etwas an und mussten somit im Schnitt etwas höhere Kurseinbußen registrieren als vergleichbare Staatstitel. Renditen von europäischen Staatsanleihen stiegen wie zum Beispiel 5jährige deutsche Staatsanleihen von anfangs knapp -0,7 % p. a. auf eine Rendite von -0,15 %. Risikoprämien bei Unternehmensanleihen mit einer Laufzeit bis 5 Jahren waren anfangs bei etwa 70 Basispunkten und erhöhten sich bis zum Ende der Berichtsperiode auf etwa 130 Basispunkte gegenüber dem risikolosen Zinssatz. Die grundsätzliche Portfolioausrichtung blieb weitgehend unverändert. In einigen Positionen wurden Gewinne mitgenommen und durch attraktiv bewertete Anleihen ersetzt. Zusätzlich nahm der Fonds bei günstigen Neuemissionen teil. Der Anteil an Staatsanleihen sowie staatsnahen Emittenten von Peripheriestaaten im Fonds schwankte zwischen 50 % und 60 %. Die Gewichtung von Unternehmensanleihen und Pfandbriefen lag im Aggregat zwischen 40 % bis 49 % des Fonds. Unternehmensanleihen von Nicht-Finanz-Unternehmen wurden gegenüber Bankanleihen bevorzugt. Die durchschnittliche Zinsbindungsdauer des Fonds bewegte sich im Bereich von 1,00 bis 1,50 Jahre. Der Fonds hat ein Durchschnittsrating von A+.

Um Zusatzgewinne zu erwirtschaften, wurden Wertpapierleihegeschäfte getätigt.

Zusammensetzung des Fondsvermögens in EUR

Allfällige Abweichungen beim Kurswert sowie beim Anteil am Fondsvermögen ergeben sich aus Rundungsdifferenzen.

OGAW bezieht sich auf Anteile an einem Organismus zur gemeinsamen Veranlagung in Wertpapieren

§ 166 InvFG bezieht sich auf Anteile an Investmentfonds in der Form von "Anderen Sondervermögen"

§ 166 Abs 1 Z 2 InvFG bezieht sich auf Anteile an Spezialfonds

§ 166 Abs 1 Z 3 InvFG bezieht sich auf Anteile an Organismen für gemeinsame Anlagen gemäß § 166 Abs. 1 Z 3 InvFG
(beispielsweise Alternative Investments/Hedgefonds)

§ 166 Abs 1 Z 4 InvFG bezieht sich auf Anteile an Immobilienfonds

Wertpapierart	OGAW/§ 166	Währung	Kurswert in EUR	Anteil am Fondsvermögen
Anleihen fix		EUR	128.804.548,80	90,21 %
Summe Anleihen fix			128.804.548,80	90,21 %
Anleihen variabel		EUR	7.838.297,00	5,49 %
Summe Anleihen variabel			7.838.297,00	5,49 %
Summe Wertpapiervermögen			136.642.845,80	95,70 %
Derivative Produkte				
Bewertung Finanzterminkontrakte			416.925,00	0,29 %
Summe Derivative Produkte			416.925,00	0,29 %
Bankguthaben/-verbindlichkeiten				
Bankguthaben/-verbindlichkeiten in Fondswährung			5.388.829,97	3,77 %
Summe Bankguthaben/-verbindlichkeiten			5.388.829,97	3,77 %
Abgrenzungen				
Zinsenansprüche (aus Wertpapieren und Bankguthaben)			367.436,28	0,26 %
Summe Abgrenzungen			367.436,28	0,26 %
Sonstige Verrechnungsposten				
Diverse Gebühren			-37.690,63	-0,03 %
Summe Sonstige Verrechnungsposten			-37.690,63	-0,03 %
Summe Fondsvermögen			142.778.346,42	100,00 %

Vermögensaufstellung in EUR per 28.02.2022

Die bei den Wertpapieren angeführten Jahreszahlen beziehen sich jeweils auf Emissions- sowie Tilgungszeitpunkt, wobei ein allfälliges vorzeitiges Tilgungsrecht des Emittenten nicht ausgewiesen wird.

Die mit "Y" gekennzeichneten Wertpapiere weisen auf eine offene Laufzeit hin (is perpetual). Der Kurs von Devisentermingeschäften wird in der entsprechenden Gegenwährung zur Währung angegeben.

Allfällige Abweichungen beim Kurswert sowie beim Anteil am Fondsvermögen ergeben sich aus Rundungsdifferenzen.

OGAW bezieht sich auf Anteile an einem Organismus zur gemeinsamen Veranlagung in Wertpapieren

§ 166 InvFG bezieht sich auf Anteile an Investmentfonds in der Form von "Anderen Sondervermögen"

§ 166 Abs 1 Z 2 InvFG bezieht sich auf Anteile an Spezialfonds

§ 166 Abs 1 Z 3 InvFG bezieht sich auf Anteile an Organismen für gemeinsame Anlagen gemäß § 166 Abs. 1 Z 3 InvFG (beispielsweise Alternative Investments/Hedgefonds)

§ 166 Abs 1 Z 4 InvFG bezieht sich auf Anteile an Immobilienfonds

Wertpapierart	OGAW/§ 166	ISIN	Wertpapierbezeichnung	Währung	Bestand Stk./Nom.	Käufe im Berichtszeitraum Stk./Nom.	Verkäufe im Berichtszeitraum Stk./Nom.	Pool-/ILB-Faktor	Kurs	Kurswert in EUR	Anteil am Fondsvermögen
Anleihen fix		XS2017324844	ALFA LAVAL TREASURY INTL ALFASS 0 1/4 06/25/24	EUR	400.000				99,232000	396.928,00	0,28 %
Anleihen fix		DE000A3KY342	ALLIANZ FINANCE II B.V. ALVGR 0 11/22/26	EUR	400.000	400.000			96,521050	386.084,20	0,27 %
Anleihen fix		XS2159791990	AMERICAN HONDA FINANCE HNDA 1.95 10/18/24	EUR	600.000				103,632320	621.793,92	0,44 %
Anleihen fix		XS2328980979	ASAHI GROUP HOLDINGS LTD ASABRE 0.01 04/19/24	EUR	600.000	200.000			98,787860	592.727,16	0,42 %
Anleihen fix		XS1799545758	BANK OF NOVA SCOTIA BNS 0 1/4 09/28/22	EUR	100.000				100,401000	100.401,00	0,07 %
Anleihen fix		XS1377941106	BANK OF NOVA SCOTIA BNS 0 3/8 03/10/23	EUR	500.000				100,698500	503.492,50	0,35 %
Anleihen fix		FR0013386539	BANQUE FED CRED MUTUEL BFCM 0 3/4 06/15/23	EUR	400.000				100,851010	403.404,04	0,28 %
Anleihen fix		FR0014006XE5	BANQUE FED CRED MUTUEL BFCM 0.01 03/07/25	EUR	1.000.000	1.000.000			97,703840	977.038,40	0,68 %
Anleihen fix		XS1998215393	BAXTER INTERNATIONAL INC BAX 0.4 05/15/24	EUR	300.000				99,635610	298.906,83	0,21 %
Anleihen fix		XS2375836553	BECTON DICKINSON AND CO BDX 0.034 08/13/25	EUR	500.000	150.000			96,952620	484.763,10	0,34 %
Anleihen fix		BE6324720299	BELFIUS BANK SA/NV CCBGBB 0.01 10/15/25	EUR	400.000				96,896530	387.586,12	0,27 %
Anleihen fix		BE0000342510	BELGIUM KINGDOM BGB 0 1/2 10/22/24	EUR	1.400.000	300.000			101,909000	1.426.726,00	1,00 %
Anleihen fix		BE0000339482	BELGIUM KINGDOM BGB 0.2 10/22/23	EUR	1.400.000	700.000			101,043000	1.414.602,00	0,99 %
Anleihen fix		XS2447561403	BMW FINANCE NV BMW 0 1/2 02/22/25	EUR	1.000.000	1.000.000			99,656000	996.560,00	0,70 %
Anleihen fix		XS1547407830	BNP PARIBAS BNP 1 1/8 10/10/23	EUR	2.500.000	2.100.000	500.000		101,300570	2.532.514,25	1,77 %
Anleihen fix		ES0000012F92	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO SPGB 0 01/31/25	EUR	2.400.000	2.100.000			99,628220	2.391.077,28	1,67 %
Anleihen fix		ES0000012G91	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO SPGB 0 01/31/26	EUR	800.000	800.000			98,502070	788.016,56	0,55 %
Anleihen fix		ES0000012B62	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO SPGB 0.35 07/30/23	EUR	2.200.000	500.000			100,878620	2.219.329,64	1,55 %
Anleihen fix		ES0000012A97	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO SPGB 0.45 10/31/22	EUR	1.900.000				100,650000	1.912.350,00	1,34 %
Anleihen fix		ES00000124W3	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO SPGB 3.8 04/30/24	EUR	700.000				108,387940	758.715,58	0,53 %
Anleihen fix		FR0013464930	BPCE SA BPCEGP 0 1/8 12/04/24	EUR	1.500.000	1.100.000	500.000		98,758910	1.481.383,65	1,04 %
Anleihen fix		FR0013509726	BPCE SA BPCEGP 0 5/8 04/28/25	EUR	500.000	600.000	500.000		99,439840	497.199,20	0,35 %
Anleihen fix		FR0014007QS7	BPCE SFH - SOCIETE DE FI BPCECB 0.01 01/21/27	EUR	800.000	800.000			97,181230	777.449,84	0,54 %
Anleihen fix		XS1886402814	BRITISH TELECOMMUNICATIO BRITEL 0 7/8 09/26/23	EUR	300.000				100,640420	301.921,26	0,21 %
Anleihen fix		DE0001102374	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND DBR 0 1/2 02/15/25	EUR	2.300.000	1.500.000			102,355000	2.354.165,00	1,65 %
Anleihen fix		DE0001102309	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND DBR 1 1/2 02/15/23	EUR	2.000.000				102,001000	2.040.020,00	1,43 %
Anleihen fix		DE0001102333	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND DBR 1 3/4 02/15/24	EUR	1.000.000	1.000.000			104,404000	1.044.040,00	0,73 %
Anleihen fix		IT0005437147	BUONI POLIENNALI DEL TES BTPS 0 04/01/26	EUR	2.000.000	800.000	500.000		96,614880	1.932.297,60	1,35 %
Anleihen fix		IT0005452989	BUONI POLIENNALI DEL TES BTPS 0 08/15/24	EUR	3.000.000	3.500.000	500.000		99,129900	2.973.897,00	2,08 %
Anleihen fix		IT0005386245	BUONI POLIENNALI DEL TES BTPS 0.35 02/01/25	EUR	3.500.000	600.000			99,627830	3.486.974,05	2,44 %
Anleihen fix		IT0005325946	BUONI POLIENNALI DEL TES BTPS 0.95 03/01/23	EUR	2.600.000	1.500.000			101,355260	2.635.236,76	1,85 %

Berichtszeitraum 01.09.2021 – 28.02.2022

Raiffeisen-Nachhaltigkeit-ShortTerm

Wertpapierart	OGAW/§ 166	ISIN	Wertpapierbezeichnung	Wahrung	Bestand Stk./Nom.	Kufe im Berichtszeitraum Stk./Nom.	Verkufe im Berichtszeitraum Stk./Nom.	Pool-/ILB-Faktor	Kurs	Kurswert in EUR	Anteil am Fondsvermogen
Anleihen fix		XS2248827771	CA IMMOBILIEN ANLAGEN AG CAIAV 1 10/27/25	EUR	400.000	200.000			96,369000	385.476,00	0,27 %
Anleihen fix		FR0013344181	CAISSE D'AMORT DETTE SOC CADES 0 1/8 10/25/23	EUR	2.000.000				100,604000	2.012.080,00	1,41 %
Anleihen fix		FR0014003RL9	CAISSE DES DEPOTS ET CON CDCEPS 0.01 06/01/26	EUR	600.000				98,853000	593.118,00	0,42 %
Anleihen fix		XS1991125896	CANADIAN IMPERIAL BANK CM 0 3/8 05/03/24	EUR	500.000	300.000			99,490420	497.452,10	0,35 %
Anleihen fix		XS2393661397	CANADIAN IMPERIAL BANK CM 0.01 10/07/26	EUR	600.000	600.000			97,213740	583.282,44	0,41 %
Anleihen fix		XS1677902162	CARLSBERG BREWERIES A/S CARLB 0 1/2 09/06/23	EUR	400.000				100,294520	401.178,08	0,28 %
Anleihen fix		FR0013342128	CARREFOUR SA CAFP 0 7/8 06/12/23	EUR	100.000				100,573830	100.573,83	0,07 %
Anleihen fix		XS1881574591	CIE DE SAINT-GOBAIN SGOPF 0 7/8 09/21/23	EUR	200.000				101,196970	202.393,94	0,14 %
Anleihen fix		FR0013328218	CIE FINANCEMENT FONCIER CFF 0 1/4 04/11/23	EUR	600.000	500.000			100,572410	603.434,46	0,42 %
Anleihen fix		DE000CZ40NG4	COMMERZBANK AG CMZB 1 1/4 10/23/23	EUR	300.000				101,085650	303.256,95	0,21 %
Anleihen fix		ES0000101842	COMMUNITY OF MADRID SPAI MADRID 0.747 04/30/22	EUR	1.100.000				100,183000	1.102.013,00	0,77 %
Anleihen fix		ES0000101693	COMMUNITY OF MADRID SPAI MADRID 1.189 05/08/22	EUR	800.000				100,298000	802.384,00	0,56 %
Anleihen fix		XS2169281131	CRH FINLAND SERVICES OYJ CRHID 0 7/8 11/05/23	EUR	100.000				100,862780	100.862,78	0,07 %
Anleihen fix		XS1328173080	CRH FUNDING CRHID 1 7/8 01/09/24	EUR	500.000				102,441820	512.209,10	0,36 %
Anleihen fix		XS0750894577	CZECH REPUBLIC CZECH 3 7/8 05/24/22	EUR	800.000				100,768000	806.144,00	0,56 %
Anleihen fix		XS2332689418	DANFOSS FIN I BV DNFSDC 0 1/8 04/28/26	EUR	500.000	200.000	300.000		96,314070	481.570,35	0,34 %
Anleihen fix		XS2356091269	DE VOLKSBANK NV DEVOBA 0 1/4 06/22/26	EUR	600.000	200.000			95,489790	572.938,74	0,40 %
Anleihen fix		DE000A289NE4	DEUTSCHE WOHNEN SE DWNIGY 1 04/30/25	EUR	500.000				99,869340	499.346,70	0,35 %
Anleihen fix		XS2079723552	DNB BANK ASA DNBNO 0.05 11/14/23	EUR	500.000	500.000			99,715110	498.575,55	0,35 %
Anleihen fix		XS0759310930	DNB BOLIGKREDITT AS DNBNO 2 3/4 03/21/22	EUR	200.000				100,155000	200.310,00	0,14 %
Anleihen fix		EU000A1G0EC4	EFSF EFSF 0 04/19/24	EUR	4.000.000	3.000.000			100,119000	4.004.760,00	2,80 %
Anleihen fix		EU000A1G0EN1	EFSF EFSF 0 07/20/26	EUR	500.000	500.000			98,543000	492.715,00	0,35 %
Anleihen fix		EU000A1G0DC6	EFSF EFSF 0 1/2 01/20/23	EUR	1.500.000				100,906000	1.513.590,00	1,06 %
Anleihen fix		AT0000A2JAF6	ERSTE GROUP BANK AG ERSTBK 0.05 09/16/25	EUR	500.000				96,893350	484.466,75	0,34 %
Anleihen fix		EU000A1Z9M6	EURO STABILITY MECHANISM ESM 0 12/16/24	EUR	3.000.000	4.500.000	1.500.000		99,691000	2.990.730,00	2,09 %
Anleihen fix		XS2120068403	EUROPEAN INVESTMENT BANK EIB 0 03/25/25	EUR	400.000	400.000			99,457000	397.828,00	0,28 %
Anleihen fix		XS1489409679	EUROPEAN INVESTMENT BANK EIB 0 10/16/23	EUR	700.000		1.300.000		100,307000	702.149,00	0,49 %
Anleihen fix		XS1271698612	EUROPEAN INVESTMENT BANK EIB 0 3/8 03/15/22	EUR	800.000				100,033000	800.264,00	0,56 %
Anleihen fix		XS1247736793	EUROPEAN INVESTMENT BANK EIB 0 7/8 09/13/24	EUR	800.000				102,037000	816.296,00	0,57 %
Anleihen fix		EU000A3KNYF7	EUROPEAN UNION EU 0 03/04/26	EUR	700.000	600.000	3.900.000		99,169000	694.183,00	0,49 %
Anleihen fix		ES0378641338	FADE FADE 0 1/2 06/17/23	EUR	300.000				100,822000	302.466,00	0,21 %
Anleihen fix		ES0378641346	FADE FADE 0.05 09/17/24	EUR	300.000				99,697000	299.091,00	0,21 %
Anleihen fix		XS1732400319	FERROVIE DELLO STATO FERROV 0 7/8 12/07/23	EUR	300.000				101,207000	303.621,00	0,21 %
Anleihen fix		XS2085547433	FIDELITY NATL INFO SERV FIS 0 1/8 12/03/22	EUR	300.000				100,156000	300.468,00	0,21 %
Anleihen fix		DE000A2AASV2	GEMEINSAME BUNDESLAENDER LANDER 0 1/8 04/14/23	EUR	1.000.000				100,472000	1.004.720,00	0,70 %
Anleihen fix		XS2405467528	GENERAL MILLS INC GIS 0 1/8 11/15/25	EUR	550.000	550.000			97,404250	535.723,38	0,38 %
Anleihen fix		BE0002280494	GRP BRUXELLES LAMBERT SA GBLBBB 1 3/8 05/23/24	EUR	1.000.000	400.000	400.000		102,202790	1.022.027,90	0,72 %
Anleihen fix		XS1069552393	HEATHROW FUNDING LTD HTHROW 1 7/8 05/23/22	EUR	200.000				100,478000	200.956,00	0,14 %
Anleihen fix		XS2397239000	HEIMSTADEN BOSTAD TRESRY HEIBOS 0 1/4 10/13/24	EUR	700.000	700.000			98,090850	686.635,95	0,48 %
Anleihen fix		XS2147977479	HEINEKEN NV HEIANA 1 5/8 03/30/25	EUR	1.000.000	300.000			102,681780	1.026.817,80	0,72 %
Anleihen fix		XS2193956716	HYPONOE LB NOE WIEN AG HYNOE 0 3/8 06/25/24	EUR	200.000				99,127500	198.255,00	0,14 %
Anleihen fix		XS1685589027	HYPONOE LB NOE WIEN AG HYNOE 0 3/8 06/25/24	EUR	300.000				100,270000	300.810,00	0,21 %
Anleihen fix		XS1944456109	IBM CORP IBM 0 7/8 01/31/25	EUR	500.000	300.000			100,838630	504.193,15	0,35 %
Anleihen fix		XS2194282948	INFINEON TECHNOLOGIES AG IFXGR 0 3/4 06/24/23	EUR	1.000.000	400.000			100,816620	1.008.166,20	0,71 %
Anleihen fix		XS2413696761	ING GROEP NV INTNED 0 1/8 11/29/25	EUR	1.200.000	1.200.000			97,458150	1.169.497,80	0,82 %
Anleihen fix		XS1576220484	ING GROEP NV INTNED 0 3/4 03/09/22	EUR	200.000				100,017000	200.034,00	0,14 %
Anleihen fix		XS1771838494	ING GROEP NV INTNED 1 1/8 02/14/25	EUR	700.000	700.000			100,672910	704.710,37	0,49 %
Anleihen fix		DE000A1KRJR4	ING-DIBA AG INGDI 0 1/4 10/09/23	EUR	600.000	500.000			100,493750	602.962,50	0,42 %
Anleihen fix		XS2089368596	INTESA SANPAOLO SPA ISPIM 0 3/4 12/04/24	EUR	400.000	100.000			99,596680	398.386,72	0,28 %
Anleihen fix		XS2022425297	INTESA SANPAOLO SPA ISPIM 1 07/04/24	EUR	100.000				100,499490	100.499,49	0,07 %

Wertpapierart	OGAW/§ 166	ISIN	Wertpapierbezeichnung	Währung	Bestand Stk./Nom.	Käufe im Berichtszeitraum Stk./Nom.	Verkäufe im Berichtszeitraum Stk./Nom.	Pool-/ILB-Faktor	Kurs	Kurswert in EUR	Anteil am Fondsvermögen
Anleihen fix		XS1197351577	INTESA SANPAOLO SPA ISPIM 1 1/8 03/04/22	EUR	200.000				99,975000	199.950,00	0,14 %
Anleihen fix		IE00BDHDPQ37	IRELAND GOVERNMENT BOND IRISH 0 10/18/22	EUR	150.000				100,370780	150.556,17	0,11 %
Anleihen fix		XS2150006133	JOHN DEERE CASH MANAGEME DE 1 3/8 04/02/24	EUR	330.000				102,117850	336.988,91	0,24 %
Anleihen fix		XS2243666125	JYSKE BANK A/S JYBC 0 3/8 10/15/25	EUR	700.000				98,598480	690.189,36	0,48 %
Anleihen fix		BE0002272418	KBC GROUP NV KBCBB 0 3/4 03/01/22	EUR	200.000				100,002000	200.004,00	0,14 %
Anleihen fix		BE0002645266	KBC GROUP NV KBCBB 0 5/8 04/10/25	EUR	400.000				99,186410	396.745,64	0,28 %
Anleihen fix		DE000A2DAR24	KFW KFW 0 1/8 01/15/24	EUR	2.000.000	800.000			100,611000	2.012.220,00	1,41 %
Anleihen fix		DE000A3E5XK7	KFW KFW 0 11/15/24	EUR	700.000	700.000			100,007000	700.049,00	0,49 %
Anleihen fix		XS1756338551	KINGDOM OF SWEDEN SWED 0 1/8 04/24/23	EUR	700.000				100,500000	703.500,00	0,49 %
Anleihen fix		XS2149368529	KONINKLIJKE PHILIPS NV PHIANA 1 3/8 03/30/25	EUR	600.000				101,680580	610.083,48	0,43 %
Anleihen fix		XS2393768788	KOOKMIN BANK CITNAT 0.048 10/19/26	EUR	600.000	600.000			96,995390	581.972,34	0,41 %
Anleihen fix		XS2199348231	KOOKMIN BANK CITNAT 0.052 07/15/25	EUR	1.000.000				98,206500	982.065,00	0,69 %
Anleihen fix		DE000A14J3F7	LAND BERLIN BERGER 0 1/4 04/22/25	EUR	700.000				99,807000	698.649,00	0,49 %
Anleihen fix		DE000A161WS6	LAND BERLIN BERGER 0 3/4 09/08/23	EUR	500.000				101,371000	506.855,00	0,35 %
Anleihen fix		DE000A1RQD68	LAND HESSEN HESSEN 0 08/11/25	EUR	400.000				98,807000	395.228,00	0,28 %
Anleihen fix		DE000A1RQC85	LAND HESSEN HESSEN 0 1/8 04/27/23	EUR	1.000.000				100,505000	1.005.050,00	0,70 %
Anleihen fix		DE000A2AAKB1	LAND NIEDERSACHSEN NIESA 0 3/8 01/19/23	EUR	1.600.000				100,716000	1.611.456,00	1,13 %
Anleihen fix		DE000A2E4HV1	LAND NIEDERSACHSEN NIESA 0.05 11/10/22	EUR	600.000				100,352000	602.112,00	0,42 %
Anleihen fix		DE000NRW0L93	LAND NORDRHEIN-WESTFALEN NRW 0 04/02/24	EUR	400.000				99,821000	399.284,00	0,28 %
Anleihen fix		XS2171210862	LANDBK HESSEN-THUERINGEN HESLAN 0 3/8 05/12/25	EUR	900.000				98,757710	888.819,39	0,62 %
Anleihen fix		DE000LB1DVL8	LB BADEN-WUERTEMBERG LBBW 0 1/2 06/07/22	EUR	100.000				100,156000	100.156,00	0,07 %
Anleihen fix		DE000LB2CHW4	LB BADEN-WUERTEMBERG LBBW 0 3/8 05/24/24	EUR	1.300.000	900.000	300.000		99,419930	1.292.459,09	0,91 %
Anleihen fix		FR0013482817	LVMH MOET HENNESSY VUITT MCFP 0 02/11/24	EUR	300.000				99,457150	298.371,45	0,21 %
Anleihen fix		FR0013257623	LVMH MOET HENNESSY VUITT MCFP 0 3/4 05/26/24	EUR	400.000				100,751660	403.006,64	0,28 %
Anleihen fix		XS2238787415	MEDTRONIC GLOBAL HLDINGS MDT 0 10/15/25	EUR	500.000				97,121470	485.607,35	0,34 %
Anleihen fix		XS2023643146	MERCK FIN SERVICES GMBH MRKGR 0.005 12/15/23	EUR	600.000				99,801870	598.811,22	0,42 %
Anleihen fix		XS2241387252	MIZUHO FINANCIAL GROUP MIZUHO 0.214 10/07/25	EUR	400.000				96,955860	387.823,44	0,27 %
Anleihen fix		XS1317732771	MOLNLYCKE HOLDING AB MOLNLY 1 3/4 02/28/24	EUR	700.000	100.000			102,235180	715.646,26	0,50 %
Anleihen fix		XS2355599197	NATWEST MARKETS PLC NWG 0 1/8 06/18/26	EUR	400.000				95,200180	380.800,72	0,26 %
Anleihen fix		NL0010418810	NETHERLANDS GOVERNMENT NETHER 1 3/4 07/15/23	EUR	1.900.000	700.000			103,238000	1.961.522,00	1,37 %
Anleihen fix		XS2323295563	NIDEC CORP NIDEC 0.046 03/30/26	EUR	700.000	700.000			95,883890	671.187,23	0,47 %
Anleihen fix		XS2348030268	NOVO NORDISK FINANCE NL NOVOB 0 06/04/24	EUR	200.000				98,969550	197.939,10	0,14 %
Anleihen fix		XS2305026762	NTT FINANCE CORP NTT 0.01 03/03/25	EUR	1.000.000	400.000			98,213710	982.137,10	0,69 %
Anleihen fix		XS2411311579	NTT FINANCE CORP NTT 0.082 12/13/25	EUR	400.000	400.000			97,373730	389.494,92	0,27 %
Anleihen fix		PTOTEQOEO015	OBRIGACOES DO TESOURO PGB 5.65 02/15/24	EUR	1.300.000	300.000			111,469730	1.449.106,49	1,01 %
Anleihen fix		XS1629737625	ONTARIO (PROVINCE OF) ONT 0 3/8 06/14/24	EUR	800.000	800.000			100,228000	801.824,00	0,56 %
Anleihen fix		XS2197342129	OP CORPORATE BANK PLC OPBANK 0 1/8 07/01/24	EUR	2.000.000	1.300.000			99,220460	1.984.409,20	1,39 %
Anleihen fix		FR0013396512	ORANGE SA ORAFP 1 1/8 07/15/24	EUR	600.000				101,597180	609.583,08	0,43 %
Anleihen fix		XS1900750107	PROCTER & GAMBLE CO/THE PG 0 5/8 10/30/24	EUR	400.000				100,609550	402.438,20	0,28 %
Anleihen fix		XS2156776309	PROVINCE OF ALBERTA ALTA 0 1/2 04/16/25	EUR	1.100.000	500.000			100,261000	1.102.871,00	0,77 %
Anleihen fix		XS1808478710	PROVINCE OF ALBERTA ALTA 0 5/8 04/18/25	EUR	2.474.000	2.474.000			100,578000	2.488.299,72	1,74 %
Anleihen fix		XS1019493896	PROVINCE OF QUEBEC Q 2 3/8 01/22/24	EUR	700.000				104,252000	729.764,00	0,51 %
Anleihen fix		XS2106056653	RAIFFEISEN BANK INTL RBLAV 0 1/4 01/22/25	EUR	700.000				96,665970	676.661,79	0,47 %
Anleihen fix		XS1917591411	RAIFFEISEN BANK INTL RBLAV 1 12/04/23	EUR	1.000.000	900.000			99,938860	999.388,60	0,70 %
Anleihen fix		FR0013412699	RCI BANQUE SA RENAUL 0 3/4 04/10/23	EUR	200.000				100,299160	200.598,32	0,14 %
Anleihen fix		AT0000A2EJZ6	REPUBLIC OF AUSTRIA RAGB 0 04/20/23	EUR	1.700.000				100,584000	1.709.928,00	1,20 %
Anleihen fix		AT0000A2QRW0	REPUBLIC OF AUSTRIA RAGB 0 04/20/25	EUR	1.700.000	1.500.000	200.000		100,198000	1.703.366,00	1,19 %
Anleihen fix		AT0000A1FAP5	REPUBLIC OF AUSTRIA RAGB 1.2 10/20/25	EUR	500.000		700.000		104,498000	522.490,00	0,37 %
Anleihen fix		XS2156474392	REPUBLIC OF LATVIA LATVIA 0 1/8 04/14/23	EUR	300.000				99,665000	298.995,00	0,21 %
Anleihen fix		XS2031862076	ROYAL BANK OF CANADA RY 0 1/8 07/23/24	EUR	600.000				98,829380	592.976,28	0,42 %

Wertpapierart	OGAW/§ 166	ISIN	Wertpapierbezeichnung	Währung	Bestand Stk./Nom.	Käufe im Berichtszeitraum Stk./Nom.	Verkäufe im Berichtszeitraum Stk./Nom.	Pool-/ILB-Faktor	Kurs	Kurswert in EUR	Anteil am Fondsvermögen
Anleihen fix		XS1956025651	SANTAN CONSUMER FINANCE SANSFC 1 02/27/24	EUR	400.000				101,021400	404.085,60	0,28 %
Anleihen fix		XS2441296923	SANTANDER CONSUMER BANK SCBNOR 0 1/2 08/11/25	EUR	700.000	700.000			98,435000	689.045,00	0,48 %
Anleihen fix		DE000A2TSTD0	SAP SE SAPGR 0 1/4 03/10/22	EUR	100.000				100,006000	100.006,00	0,07 %
Anleihen fix		XS1837975736	SBAB BANK AB SBAB 0 3/4 06/14/23	EUR	200.000				100,788250	201.576,50	0,14 %
Anleihen fix		XS2182055181	SIEMENS FINANCIERINGSMAT SIEGR 0 1/4 06/05/24	EUR	600.000	200.000			99,845550	599.073,30	0,42 %
Anleihen fix		XS2300208928	SNAM SPA SRGIM 0 08/15/25	EUR	600.000				97,132960	582.797,76	0,41 %
Anleihen fix		FR0014006UI2	SOCIETE GENERALE SFH SOCSFH 0.01 12/02/26	EUR	600.000	600.000			97,381720	584.290,32	0,41 %
Anleihen fix		XS2156787090	SSE PLC SSELN 1 1/4 04/16/25	EUR	700.000	400.000			101,203870	708.427,09	0,50 %
Anleihen fix		XS1582205040	STATKRAFT AS STATK 1 1/8 03/20/25	EUR	200.000	200.000			101,259610	202.519,22	0,14 %
Anleihen fix		XS0858366684	STATKRAFT AS STATK 2 1/2 11/28/22	EUR	500.000				102,031000	510.155,00	0,36 %
Anleihen fix		XS2407985220	STEDIN HOLDING NV STEDIN 0 11/16/26	EUR	300.000	300.000			95,681340	287.044,02	0,20 %
Anleihen fix		XS2404629235	SVENSKA HANDELSBANKEN AB SHBASS 0 1/8 11/03/26	EUR	400.000	400.000			96,459890	385.839,56	0,27 %
Anleihen fix		XS2056395606	TELENOR ASA TELNO 0 09/25/23	EUR	400.000				99,759850	399.039,40	0,28 %
Anleihen fix		XS0933241456	TELENOR ASA TELNO 2 1/2 05/22/25	EUR	300.000				105,707910	317.123,73	0,22 %
Anleihen fix		XS0746010908	TELIA CO AB TELIAS 3 5/8 02/14/24	EUR	300.000				106,529300	319.587,90	0,22 %
Anleihen fix		XS0706229555	TELSTRA CORP LTD TLSAU 3 3/4 05/16/22	EUR	200.000				100,827000	201.654,00	0,14 %
Anleihen fix		XS1082971588	TESCO CORP TREASURY SERV TSCOLN 2 1/2 07/01/24	EUR	600.000				104,000000	624.000,00	0,44 %
Anleihen fix		XS2407913586	THERMO FISHER SC FNCE I TMO 0 11/18/23	EUR	1.500.000	1.500.000			99,529150	1.492.937,25	1,05 %
Anleihen fix		XS1985806600	TORONTO-DOMINION BANK TD 0 3/8 04/25/24	EUR	1.100.000	600.000			99,534650	1.094.881,15	0,77 %
Anleihen fix		XS2430285077	TOYOTA FINANCE AUSTRALIA TOYOTA 0.064 01/13/25	EUR	1.000.000	1.000.000			98,618920	986.189,20	0,69 %
Anleihen fix		XS2400997131	TOYOTA MOTOR FINANCE BV TOYOTA 0 10/27/25	EUR	500.000	500.000			97,231000	486.155,00	0,34 %
Anleihen fix		XS1109744778	TRANSURBAN FINANCE CO TCLAU 1 7/8 09/16/24	EUR	300.000				102,805060	308.415,18	0,22 %
Anleihen fix		XS2326546434	UBS AG LONDON UBS 0.01 03/31/26	EUR	600.000				95,947460	575.684,76	0,40 %
Anleihen fix		FR0011462746	UNEDIC UNEDIC 2 1/4 04/05/23	EUR	1.200.000				102,890000	1.234.680,00	0,86 %
Anleihen fix		XS2402009539	VOLVO TREASURY AB VLVY 0 05/09/24	EUR	1.000.000	1.000.000			98,991670	989.916,70	0,69 %
Anleihen fix		DE000A28VQC4	VONOVIA FINANCE BV ANNGR 1 5/8 04/07/24	EUR	600.000				101,590500	609.543,00	0,43 %
Anleihen fix		DE000A3MP4T1	VONOVIA SE ANNGR 0 12/01/25	EUR	1.000.000	500.000			95,721770	957.217,70	0,67 %
Anleihen variabel		XS1767087940	ACEA SPA ACEIM FLOAT 02/08/23	EUR	200.000				100,101000	200.202,00	0,14 %
Anleihen variabel		XS2342059784	BARCLAYS PLC BACR FLOAT 05/12/26	EUR	600.000	300.000			100,732000	604.392,00	0,42 %
Anleihen variabel		XS1756434194	BNP PARIBAS BNP FLOAT 01/19/23	EUR	900.000				100,225000	902.025,00	0,63 %
Anleihen variabel		FR00113342664	CARREFOUR BANQUE CAFP FLOAT 06/15/22	EUR	200.000				100,003000	200.006,00	0,14 %
Anleihen variabel		XS1787278008	CREDIT AGRICOLE LONDON ACAFP FLOAT 03/06/23	EUR	1.000.000	1.000.000	1.000.000		100,346000	1.003.460,00	0,70 %
Anleihen variabel		XS2388490802	HSBC HOLDINGS PLC HSBC FLOAT 09/24/26	EUR	500.000	500.000			100,736000	503.680,00	0,35 %
Anleihen variabel		DE000A2GSCY9	MERCEDES-BENZ GROUP AG DAIGR FLOAT 07/03/24	EUR	2.000.000	1.300.000	300.000		100,276000	2.005.520,00	1,40 %
Anleihen variabel		DE000A19UNN9	MERCEDES-BENZ INT FINCE DAIGR FLOAT 01/11/23	EUR	200.000				100,165000	200.330,00	0,14 %
Anleihen variabel		DK0030486246	NYKREDIT REALKREDIT AS NYKRE FLOAT 03/25/24	EUR	600.000				101,163000	606.978,00	0,43 %
Anleihen variabel		XS1705553417	STEDIN HOLDING NV STEDIN FLOAT 10/24/22	EUR	600.000				100,145000	600.870,00	0,42 %
Anleihen variabel		XS2305049897	TOYOTA MOTOR FINANCE BV TOYOTA FLOAT 02/22/24	EUR	800.000				101,306000	810.448,00	0,57 %
Anleihen variabel		DE000A19X793	VONOVIA FINANCE BV ANNGR FLOAT 12/22/22	EUR	200.000				100,193000	200.386,00	0,14 %
Summe der zum amtlichen Handel oder einem anderen geregelten Markt zugelassenen Wertpapiere										136.642.845,80	95,70 %
Summe Wertpapiervermögen										136.642.845,80	95,70 %
Anleihenfutures		FGBM20220308	EURO-BOBL FUTURE Mar22 OEH2	EUR	-120				131,120000	375.600,00	0,26 %
Anleihenfutures		FGBM20220308	EURO-BOBL FUTURE Mar22 OEH2	EUR	-20				131,120000	30.800,00	0,02 %

Wertpapierart	OGAW/§ 166	ISIN	Wertpapierbezeichnung	Währung	Bestand Stk./Nom.	Käufe im Berichtszeitraum Stk./Nom.	Verkäufe im Berichtszeitraum Stk./Nom.	Pool-/ILB-Faktor	Kurs	Kurswert in EUR	Anteil am Fondsvermögen
Anleihenfutures		FGBM20220308	EURO-BOBL FUTURE Mar22 OEH2	EUR	-15				131,120000	-1.200,00	-0,00 %
Anleihenfutures		FGBS20220308	EURO-SCHATZ FUT Mar22 DUH2	EUR	-25				111,755000	-7.625,00	-0,01 %
Anleihenfutures		FGBS20220308	EURO-SCHATZ FUT Mar22 DUH2	EUR	-45				111,755000	19.350,00	0,01 %
Summe Finanzterminkontrakte ¹										416.925,00	0,29 %
Bankguthaben/-verbindlichkeiten				EUR						5.388.829,97	3,77 %
Summe Bankguthaben/-verbindlichkeiten										5.388.829,97	3,77 %
Abgrenzungen											
Zinsenansprüche (aus Wertpapieren und Bankguthaben)										367.436,28	0,26 %
Summe Abgrenzungen										367.436,28	0,26 %
Sonstige Verrechnungsposten											
Diverse Gebühren										-37.690,63	-0,03 %
Summe Sonstige Verrechnungsposten										-37.690,63	-0,03 %
Summe Fondsvermögen										142.778.346,42	100,00 %

ISIN	Ertragstyp		Währung	Errechneter Wert je Anteil	Umlaufende Anteile in Stück
AT0000A190Z8	R	Ausschüttung	EUR	89,01	78.342,083
AT0000A1U7C0	RZ	Ausschüttung	EUR	94,21	3.150,417
AT0000A0ALQ3	I	Thesaurierung	EUR	101,14	1.014.634,000
AT0000A190X3	R	Thesaurierung	EUR	96,01	99.823,659
AT0000A1U7B2	RZ	Thesaurierung	EUR	98,08	31.605,873
AT0000A296K5	SZ	Thesaurierung	EUR	98,37	15,016
AT0000A0ALR1	I	Vollthesaurierung Ausland	EUR	104,99	124.116,790
AT0000A19HM5	R	Vollthesaurierung Ausland	EUR	96,22	71.185,796
AT0000A1U7D8	RZ	Vollthesaurierung Ausland	EUR	98,17	10,000
AT0000A1ARZ9	R	Vollthesaurierung Inland	EUR	96,29	3.282,253

In der Vermögensaufstellung gesperrte Wertpapiere (Wertpapierleihgeschäfte)

ISIN	Wertpapierbezeichnung	Währung	Bestand per 28.02.2022
PTOTEQOE0015	OBRIGACOES DO TESOURO PGB 5.65 02/15/24	EUR	1.000.000

Während des Berichtszeitraumes getätigte Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, soweit sie nicht in der Vermögensaufstellung genannt sind:

Wertpapierart	OGAW/§ 166	ISIN	Wertpapierbezeichnung	Währung	Käufe Zugänge	Verkäufe Abgänge
Anleihen fix		FR0013220902	AGENCE FRANCAISE DEVELOP AGFRNC 0 3/8 04/30/24	EUR		300.000
Anleihen fix		FR0013182839	AIR LIQUIDE FINANCE AIFP 0 3/4 06/13/24	EUR		100.000
Anleihen fix		FR0013505559	AIR LIQUIDE FINANCE AIFP 1 04/02/25	EUR		100.000
Anleihen fix		XS1405774990	ASML HOLDING NV ASML 0 5/8 07/07/22	EUR		200.000

Berichtszeitraum 01.09.2021 – 28.02.2022

Raiffeisen-Nachhaltigkeit-ShortTerm

Wertpapierart	OGAW/§ 166	ISIN	Wertpapierbezeichnung	Währung		Käufe Zugänge	Verkäufe Abgänge
Anleihen fix		DE000A0Z1TZ0	BAYERISCHE LANDESBODEN BYLABO 2 1/2 02/09/22	EUR			600.000
Anleihen fix		XS1823246712	BMW FINANCE NV BMW 0 1/2 11/22/22	EUR			100.000
Anleihen fix		XS1823532640	BNP PARIBAS BNP 1 1/8 11/22/23	EUR			100.000
Anleihen fix		FR0013111903	BPCE SFH - SOCIETE DE FI BPCECB 0 3/8 02/10/23	EUR			200.000
Anleihen fix		DE0001135465	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND DBR 2 01/04/22	EUR			1.000.000
Anleihen fix		FR0013507837	CAPGEMINI SE CAPFP 1 1/4 04/15/22	EUR			300.000
Anleihen fix		DE000CB0HRY3	COMMERZBANK AG CMZB 0.1 09/11/25	EUR			300.000
Anleihen fix		FR0013385515	CREDIT AGRICOLE LONDON ACAFP 0 3/4 12/05/23	EUR			200.000
Anleihen fix		DE000A3T0X97	DEUT PFANDBRIEFBANK AG PBBGR 0 1/4 01/17/25	EUR		400.000	400.000
Anleihen fix		DE000A3T0X22	DEUT PFANDBRIEFBANK AG PBBGR 0 1/4 10/27/25	EUR		400.000	400.000
Anleihen fix		DE000A2LQNQ6	DEUT PFANDBRIEFBANK AG PBBGR 0 3/4 02/07/23	EUR			300.000
Anleihen fix		XS2310747915	EATON CAPITAL UNLIMITED ETN 0.128 03/08/26	EUR		200.000	600.000
Anleihen fix		XS1982725159	ERSTE GROUP BANK AG ERSTBK 0 3/8 04/16/24	EUR			100.000
Anleihen fix		XS1584122680	ESSITY AB ESSITY 0 5/8 03/28/22	EUR			200.000
Anleihen fix		XS1584122177	ESSITY AB ESSITY 1 1/8 03/27/24	EUR			1.100.000
Anleihen fix		EU000A1Z99G8	EURO STABILITY MECHANISM ESM 0 01/17/22	EUR			800.000
Anleihen fix		EU000A1Z99E3	EURO STABILITY MECHANISM ESM 0.1 07/31/23	EUR			2.100.000
Anleihen fix		DK0030485271	EURONEXT NV ENXFP 0 1/8 05/17/26	EUR			400.000
Anleihen fix		XS2170609403	GLAXOSMITHKLINE CAPITAL GSK 0 1/8 05/12/23	EUR			500.000
Anleihen fix		XS1863994981	HEIDELBERGCEMENT FIN LUX HEIGR 0 1/2 08/09/22	EUR			500.000
Anleihen fix		XS1420337633	HOLCIM FINANCE LUX SA HOLNSW 1 3/8 05/26/23	EUR			200.000
Anleihen fix		XS1112184715	HYPO NOE LB NOE WIEN AG HYN0E 0 3/4 09/22/21	EUR			100.000
Anleihen fix		XS1944456018	IBM CORP IBM 0 3/8 01/31/23	EUR			100.000
Anleihen fix		XS1145526825	ISS GLOBAL A/S ISSDC 2 1/8 12/02/24	EUR			300.000
Anleihen fix		XS1580476759	JOHNSON CONTROLS INTL PL JCI 1 09/15/23	EUR			600.000
Anleihen fix		DE000A0PM5F0	KFW KFW 4 5/8 01/04/23	EUR			500.000
Anleihen fix		DE000LB1M214	LB BADEN-WUERTEMBERG LBBW 0.2 12/13/21	EUR			400.000
Anleihen fix		XS2391860843	LINDE PLC LIN 0 09/30/26	EUR		500.000	500.000
Anleihen fix		XS1001749107	MICROSOFT CORP MSFT 2 1/8 12/06/21	EUR			200.000
Anleihen fix		XS1244539760	MOTABILITY OPERATIONS GR MOTOPG 1 5/8 06/09/23	EUR			500.000
Anleihen fix		XS1188094673	NATIONAL GRID NA INC NGGLN 0 3/4 02/11/22	EUR			200.000
Anleihen fix		XS1864037541	NATIONAL GRID NA INC NGGLN 0 3/4 08/08/23	EUR		200.000	800.000
Anleihen fix		NL0010060257	NETHERLANDS GOVERNMENT NETHER 2 1/4 07/15/22	EUR			1.100.000
Anleihen fix		XS1956022716	OP CORPORATE BANK PLC OPBANK 0 3/8 02/26/24	EUR			150.000
Anleihen fix		XS0827999318	ORANGE SA ORAFP 2 1/2 03/01/23	EUR			200.000
Anleihen fix		BE0002273424	PROXIMUS SADP PROXBB 0 1/2 03/22/22	EUR			300.000
Anleihen fix		FR0014007KL5	RCI BANQUE SA RENAUL 0 1/2 07/14/25	EUR		100.000	100.000
Anleihen fix		XS2126161681	RELX FINANCE BV RELLN 0 03/18/24	EUR			210.000
Anleihen fix		XS1536786939	REPUBLIC OF POLAND POLAND 0 1/2 12/20/21	EUR			600.000
Anleihen fix		XS1766612672	REPUBLIC OF POLAND POLAND 1 1/8 08/07/26	EUR			200.000
Anleihen fix		SI0002103974	REPUBLIKA SLOVENIJA SLOREP 0.2 03/31/23	EUR			800.000
Anleihen fix		XS1720806774	RLB OBEROESTERREICH RFLBOB 0 3/4 05/22/23	EUR			100.000
Anleihen fix		FR0013324332	SANOFI SANFP 0 1/2 03/21/23	EUR			500.000
Anleihen fix		FR0013517711	SCHNEIDER ELECTRIC SE SUPP 0 06/12/23	EUR			300.000
Anleihen fix		XS1874127811	SIEMENS FINANCIERINGSMAT SIEGR 0 3/8 09/06/23	EUR			200.000
Anleihen fix		XS1955187692	SIEMENS FINANCIERINGSMAT SIEGR 0.3 02/28/24	EUR			100.000
Anleihen fix		XS2020568734	SKANDINAVISKA ENSKILDA SEB 0.05 07/01/24	EUR			200.000
Anleihen fix		FR0014006IU2	SOCIETE GENERALE SOCGEN 0 1/8 11/17/26	EUR		400.000	400.000
Anleihen fix		FR0013403441	SOCIETE GENERALE SOCGEN 1 1/4 02/15/24	EUR		200.000	700.000
Anleihen fix		XS1839386908	SPAREBANK 1 BOLIGKREDIT SPABOL 0 3/8 06/19/23	EUR			200.000
Anleihen fix		XS1368543135	STADSHYPOTEK AB SHBASS 0 3/8 02/22/23	EUR			200.000
Anleihen fix		XS1051076922	SWISSCOM AG (LUNAR FUNDI SCMNFX 1 7/8 09/08/21	EUR			100.000

Wertpapierart	OGAW/§ 166	ISIN	Wertpapierbezeichnung	Währung		Käufe Zugänge	Verkäufe Abgänge
Anleihen fix		XS0999667263	TELEKOM FINANZMANAGEMENT TKA AV 3 1/8 12/03/21	EUR			100.000
Anleihen fix		XS1857683335	TORONTO-DOMINION BANK TD 0 5/8 07/20/23	EUR			100.000
Anleihen fix		XS1884740041	TOYOTA MOTOR FINANCE BV TOYOTA 0 5/8 09/26/23	EUR			100.000
Anleihen fix		XS1239502328	TRANSURBAN FINANCE CO TCLAU 2 08/28/25	EUR		200.000	200.000
Anleihen fix		XS1746107975	UBS AG LONDON UBS 0 1/4 01/10/22	EUR			100.000
Anleihen fix		FR0013332988	UNIBAIL-RODAMCO SE ULFP 1 1/8 09/15/25	EUR			200.000
Anleihen fix		XS2147133495	UNILEVER FINANCE UNANA 1 1/4 03/25/25	EUR			400.000
Anleihen fix		FR0013394681	VEOLIA ENVIRONNEMENT SA VIEFP 0.892 01/14/24	EUR			300.000
Anleihen fix		XS1197336263	VESTAS WIND SYSTEMS A/S VWSDC 2 3/4 03/11/22	EUR			200.000
Anleihen fix		FR0013424850	VIVENDI SA VIVFP 0 06/13/22	EUR			200.000
Anleihen variabel		XS1608362379	BANCO SANTANDER SA SANTAN FLOAT 01/05/23	EUR			200.000
Anleihen variabel		XS2122422921	BMW FINANCE NV BMW FLOAT 02/18/22	EUR			300.000
Anleihen variabel		CH0591979635	CREDIT SUISSE GROUP AG CS FLOAT 01/16/26	EUR			400.000
Anleihen variabel		XS1681855539	HSBC HOLDINGS PLC HSBC FLOAT 10/05/23	EUR			200.000
Anleihen variabel		XS1726323436	JYSKE BANK A/S JYBC FLOAT 12/01/22	EUR			100.000
Anleihen variabel		CH0359915425	UBS GROUP AG UBS FLOAT 09/20/22	EUR			400.000

1 Kursgewinne und -verluste zum Stichtag.

Zusätzliche Angaben zu Wertpapierleihegeschäften

- Angaben zum Gesamtrisiko (Exposure) (zum Stichtag verliehener Wertpapierbestand im Verhältnis zum Fondsvolumen):

0,78 %

Betrag der verliehenen Wertpapiere: 1.116.709,63 EUR

Anteil an den verleihbaren Vermögenswerten: 0,82 %

Zum Stichtag 28.02.2022 waren folgende Wertpapiere verliehen:

ISIN	Wertpapierbezeichnung	Geregelter Markt	Währung	Assetklasse	Emittent	Rating	Bestand per 28.02.2022	Kurswert (inkl. allfälliger Stückzinsen) 28.02.2022	Anteil am Fondsvermögen
PTOTEQOE0015	OBRIGACOES DO TESOURO PGB 5.65 02/15/24	LISTED	EUR	Anleihen	Portuguese Republic	bbb	1.000.000	1.116.709,63	0,78 %

- Angaben zu der Identität der Gegenparteien der Wertpapierleihegeschäfte:

Raiffeisen Bank International AG (als anerkanntes Wertpapierleihesystem im Sinne des § 84 InvFG)

- Angaben über Art und Höhe der vom Investmentfonds erhaltenen Sicherheiten, die auf das Gegenparteienrisiko anrechenbar sind:

Gemäß dem zwischen der Verwaltungsgesellschaft und der Raiffeisen Bank International AG abgeschlossenen Rahmenvertrag für Wertpapierleihegeschäfte ist die Raiffeisen Bank International AG verpflichtet, für die entliehenen Wertpapiere Sicherheiten zu liefern. Zulässige Sicherheiten sind Anleihen, Aktien und Anteile an Investmentfonds. Die Emittenten der als Sicherheiten eingesetzten Anleihen können unter anderem Staaten, supranationale Emittenten und/oder Unternehmen sein, wobei es keine Vorgaben bezüglich der Laufzeiten dieser Anleihen gibt. Im Zuge der Sicherheitenbestellung wird gemäß § 4 der Verordnung zu Wertpapierleih- und Pensionsgeschäften (WPV) sowohl hinsichtlich Diversifizierung und Korrelation auf eine insbesondere durch quantitative Emittentengrenzen erzielte Risikostreuung als auch auf entsprechende Liquidität der Sicherheiten im Sinne der Handel- und Verwertbarkeit geachtet. Die Sicherheiten werden auf bankarbeitstäglicher Basis bewertet und gegenüber der Bewertung der aus dem Fonds verliehenen Wertpapiere unter Anwendung von Bestimmungen der EU Verordnung 575/2013 (CRR) mit einem Aufschlag versehen, der bei Anleihen aufgrund der Bonität des Emittenten und der Restlaufzeit der Anleihe festgelegt wird und mindestens 0,5 v. H. beträgt. Bei Aktien und Anteilen an Investmentfonds beträgt der Aufschlag 10,607 %. Der auf diese Art ermittelte Wert der zu leistenden Sicherheiten führt zu einer laufenden Übersicherung der offenen Wertpapierleihepositionen des Fonds.

Zum Stichtag setzten sich die Sicherheiten wie folgt zusammen:

ISIN	Wertpapierbezeichnung	Geregelter Markt	Währung	Assetklasse	Emittent	Rating	Bestand per 28.02.2022	Kurswert in Portfoliwährung
XS2156776309	PROVINCE OF ALBERTA ALTA 0 1/2 04/16/25	LISTED	EUR	Anleihen	Province of Alberta Canada	aa	3.000.000	3.007.830,00

Der Investmentfonds wird hinsichtlich der Wertpapierleihegeschäfte nicht vollständig durch Wertpapiere besichert, die von einem Mitgliedstaat des EWR begeben oder garantiert werden.

Laufzeit der Sicherheiten: unbefristet

Laufzeit der Wertpapierleihe:

Laufzeit / Tage	< 1 Tag	1-7 Tage	7-30 Tage	30-90 Tage	90-360 Tage
	0 %	0 %	0 %	0 %	100 %

Land der Gegenpartei (Raiffeisen Bank International AG): Österreich

Abwicklung: bilateral

- Angaben zur Weiterverwendung von Sicherheiten:

Die erhaltenen Sicherheiten werden nicht weiterverwendet.

- Verwahrung von Sicherheiten, die der Investmentfonds im Rahmen von Wertpapierleihegeschäften erhalten hat:

Die Sicherheiten werden für jeden Fonds auf einem gesonderten Subdepot bei der Depotbank/Verwahrstelle verwahrt.

- Verwahrung von Sicherheiten, die der Investmentfonds im Rahmen von Wertpapierleihegeschäften gestellt hat:

Im Rahmen der gesetzlichen Vorgaben (§ 84 InvFG) ist die Verwaltungsgesellschaft lediglich berechtigt, Wertpapiere an Dritte zu verleihen. Sie ist jedoch nicht berechtigt, Wertpapiere zu entleihen. Daher werden vom Investmentfonds im Rahmen von Wertpapierleihegeschäften keine Sicherheiten gestellt.

Zusätzliche Angaben zu Pensionsgeschäften

Im Berichtszeitraum wurden keine Pensionsgeschäfte für den Fonds durchgeführt. Dementsprechend sind die in § 8 Wertpapierleih- und Pensionsgeschäfteverordnung sowie Art. 13 VO (EU) 2015/2365 vorgesehenen näheren Angaben zu Pensionsgeschäften nicht erforderlich.

Total Return Swaps oder vergleichbare derivative Instrumente

Ein Total Return Swap (Gesamtrendite-Swap) ist ein Kreditderivat, bei dem die Erträge und Wertschwankungen des zu Grunde liegenden Finanzinstruments (Basiswert oder Referenzaktivum) gegen fest vereinbarte Zinszahlungen getauscht werden.

Total Return Swaps oder vergleichbare derivative Instrumente wurden im Berichtszeitraum nicht eingesetzt.

Die Raiffeisen Kapitalanlage-Gesellschaft m.b.H. berücksichtigt den Code of Conduct der österreichischen Investmentfondsindustrie 2012.

Wien, am 12. April 2022

Raiffeisen Kapitalanlage-Gesellschaft m.b.H.


Mag. Rainer Schnabl


Mag. (FH) Dieter Aigner


Ing. Michal Kustra

Anhang

Impressum

Eigentümer, Herausgeber und Verleger:
Raiffeisen Kapitalanlage-Gesellschaft m.b.H.
Mooslackengasse 12, A-1190 Wien

Für den Inhalt verantwortlich:
Raiffeisen Kapitalanlage-Gesellschaft m.b.H.
Mooslackengasse 12, A-1190 Wien

Copyright beim Herausgeber, Versandort: Wien

Raiffeisen Capital Management ist die Dachmarke der Unternehmen:

Raiffeisen Kapitalanlage-Gesellschaft m.b.H.
Raiffeisen Immobilien Kapitalanlage-Gesellschaft m.b.H.
Raiffeisen Salzburg Invest GmbH