

# KEPLER Ethik Rentenfonds

## Halbjahresbericht

vom

1. September 2023 bis 29. Februar 2024

**Verwaltungsgesellschaft:**

KEPLER-FONDS Kapitalanlagegesellschaft m.b.H.

Europaplatz 1a

4020 Linz

Telefon: (0732) 6596-25314

Telefax: (0732) 6596-25319

www.kepler.at

**Depotbank / Verwahrstelle:**

Raiffeisenlandesbank Oberösterreich Aktiengesellschaft

**Fondsmanagement:**

KEPLER-FONDS Kapitalanlagegesellschaft m.b.H.

**Prüfer:**

KPMG Austria GmbH, Wirtschaftsprüfungs- und Steuerberatungsgesellschaft

**ISIN je Tranche:**

|                            |              |
|----------------------------|--------------|
| Ausschüttungsanteil        | AT0000815006 |
| Thesaurierungsanteil       | AT0000642632 |
| Thesaurierungsanteil IT    | AT0000A1A1F0 |
| Thesaurierungsanteil IT 1  | AT0000A25PL7 |
| Thesaurierungsanteil IT VV | AT0000A2AXM3 |

## **Inhaltsübersicht**

|  |    |
|--|----|
| Allgemeine Informationen zur Verwaltungsgesellschaft | 4  |
| Allgemeine Fondsdaten                                | 5  |
| Vermögensaufstellung                                 | 6  |
| Zusammensetzung des Fondsvermögens                   | 17 |

## Allgemeine Informationen zur Verwaltungsgesellschaft

### Gesellschafter:

Raiffeisenlandesbank Oberösterreich Aktiengesellschaft  
Oberösterreichische Landesbank Aktiengesellschaft  
Oberösterreichische Versicherung Aktiengesellschaft

### Staatskommissäre:

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

### Aufsichtsrat:

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

### Geschäftsführung:

Andreas Lassner-Klein  
Dr. Michael Bumberger

### Prokuristen:

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

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

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

## KEPLER Ethik Rentenfonds

### Sehr geehrter Anteilinhaber!

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

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

| Fondsdetails                                   | per 31.08.2023 | per 29.02.2024 |
|--|----------------|----------------|
|  | EUR            | EUR            |
| Fondsvermögen                                  | 196.499.452,89 | 195.119.365,95 |
| errechneter Wert je Ausschüttungsanteil        | 99,28          | 101,52         |
| Ausgabepreis je Ausschüttungsanteil            | 101,76         | 104,05         |
| errechneter Wert je Thesaurierungsanteil IT    | 148,52         | 153,56         |
| Ausgabepreis je Thesaurierungsanteil IT        | 152,23         | 157,39         |
| errechneter Wert je Thesaurierungsanteil IT 1  | 148,68         | 153,74         |
| Ausgabepreis je Thesaurierungsanteil IT 1      | 152,39         | 157,58         |
| errechneter Wert je Thesaurierungsanteil IT VV | 148,74         | 153,83         |
| Ausgabepreis je Thesaurierungsanteil IT VV     | 152,45         | 157,67         |
| errechneter Wert je Thesaurierungsanteil       | 146,19         | 151,02         |
| Ausgabepreis je Thesaurierungsanteil           | 149,84         | 154,79         |

#### Umlaufende KEPLER Ethik Rentenfonds-Anteile zum Berichtsstichtag

|   |               |
|---|---------------|
| <b>Ausschüttungsanteile per 31.08.2023</b>        | 1.083.437,363 |
| Ausgabe   | 13.307,343    |
| Rücknahmen  | -38.262,982   |
| <b>Ausschüttungsanteile per 29.02.2024</b>        | 1.058.481,724 |
| <b>Thesaurierungsanteile IT per 31.08.2023</b>    | 210.234,000   |
| Ausgabe   | 3.588,000     |
| Rücknahmen  | -16.227,000   |
| <b>Thesaurierungsanteile IT per 29.02.2024</b>    | 197.595,000   |
| <b>Thesaurierungsanteile IT 1 per 31.08.2023</b>  | 30.752,000    |
| Ausgabe   | 0,000         |
| Rücknahmen  | 0,000         |
| <b>Thesaurierungsanteile IT 1 per 29.02.2024</b>  | 30.752,000    |
| <b>Thesaurierungsanteile IT VV per 31.08.2023</b> | 5.531,514     |
| Ausgabe   | 1.008,679     |
| Rücknahmen  | -165,264      |
| <b>Thesaurierungsanteile IT VV per 29.02.2024</b> | 6.374,929     |
| <b>Thesaurierungsanteile per 31.08.2023</b>       | 357.831,437   |
| Ausgabe   | 17.821,692    |
| Rücknahmen  | -33.945,881   |
| <b>Thesaurierungsanteile per 29.02.2024</b>       | 341.707,248   |

## Vermögensaufstellung zum 29.02.2024

| ISIN  | BEZEICHNUNG                         | STÜCKE/<br>NOMINALE<br>IN TSD | KÄUFE<br>ZUGÄNGE | VERKÄUFE<br>ABGÄNGE | KURS   | KURSWERT<br>IN EUR | ANTEIL<br>IN % |
|---|-------------------------------------|-------------------------------|------------------|---------------------|--------|--------------------|----------------|
| <b>Wertpapiervermögen</b>   |                                     |                               |                  |                     |        |                    |                |
| <b>Zum amtlichen Handel oder einem anderen geregelten Markt zugelassene Wertpapiere</b> |                                     |                               |                  |                     |        |                    |                |
| <b>Anleihen</b>   |                                     |                               |                  |                     |        |                    |                |
| <b>lautend auf EUR</b>  |                                     |                               |                  |                     |        |                    |                |
| XS2286044370  | 0,0000 % ABB FIN.B.V. 21/30 MTN     | 230                           |                  |                     | 82,07  | 188.749,50         | 0,10           |
| IT0006526609  | 0,0000 % EIB EUR.INV.BK 99-29       | 1.094                         |                  |                     | 189,13 | 2.069.049,38       | 1,06           |
| IT0006527300  | 0,0000 % EIB EUR.INV.BK 99-29 FLR   | 1.042                         | 150              |                     | 171,25 | 1.784.421,52       | 0,91           |
| XS2308329783  | 0,0000 % KOMMUNEKRED. 21/31 MTN     | 300                           |                  |                     | 81,89  | 245.658,00         | 0,13           |
| DE000A289F29  | 0,0000 % KRED.F.WIED.20/27 MTN      | 750                           |                  | 750                 | 89,82  | 673.665,00         | 0,35           |
| DE000A3E5LU1  | 0,0000 % KRED.F.WIED.21/28 MTN      | 800                           |                  |                     | 87,66  | 701.304,00         | 0,36           |
| CH1111393000  | 0,0000 % ZUER.KB 21/26              | 100                           |                  |                     | 92,64  | 92.636,00          | 0,05           |
| XS2353483733  | 0,0100 % BANK OF NZ 21/28 MTN       | 400                           |                  |                     | 86,56  | 346.248,00         | 0,18           |
| XS2386592138  | 0,0100 % BK NOVA SCOT 21/29 MTN     | 500                           |                  |                     | 83,53  | 417.625,00         | 0,21           |
| FR0013533403  | 0,0100 % BPCE 20/27 MTN             | 300                           |                  |                     | 89,00  | 267.012,00         | 0,14           |
| FR0014005E35  | 0,0100 % BPCE 21/28 MTN             | 600                           |                  |                     | 86,48  | 518.880,00         | 0,27           |
| FR0014001MO8  | 0,0100 % BPCE 21/29 MTN             | 500                           |                  |                     | 85,78  | 428.920,00         | 0,22           |
| FR0013454733  | 0,0100 % BQ POST.H.L. 19/29 MTN     | 300                           |                  |                     | 83,99  | 251.970,00         | 0,13           |
| FR0014001GV5  | 0,0100 % CAISS.FRANC. 21/31 MTN     | 500                           |                  |                     | 80,39  | 401.955,00         | 0,21           |
| FR0014004I65  | 0,0100 % CIE FIN.FONC 21/26 MTN     | 400                           |                  |                     | 92,59  | 370.356,00         | 0,19           |
| XS2113737097  | 0,0100 % DT.A.U.AERZTEBK.MTH 20/29  | 300                           |                  |                     | 86,06  | 258.189,00         | 0,13           |
| DE000A3E5K73  | 0,0100 % DT.PFBR.BANK PF.R.15304    | 300                           |                  |                     | 90,94  | 272.808,00         | 0,14           |
| DE000A289PA7  | 0,0100 % DZ HYP PF.R.1227 MTN       | 400                           |                  |                     | 87,70  | 350.816,00         | 0,18           |
| DE000A289PC3  | 0,0100 % DZ HYP PF.R.1229 MTN       | 300                           |                  |                     | 94,96  | 284.871,00         | 0,15           |
| AT0000A2LUXM1   | 0,0100 % ERSTE GR.BK. 22/28 MTN     | 400                           |                  |                     | 86,97  | 347.864,00         | 0,18           |
| XS2386287762  | 0,0100 % HSBC BK CDA 21/26          | 160                           |                  |                     | 91,92  | 147.073,60         | 0,08           |
| XS2057917366  | 0,0100 % HYPO NOE LB 19/26 MTN      | 300                           |                  |                     | 91,79  | 275.367,00         | 0,14           |
| AT0000A2STT8  | 0,0100 % HYPO NOE LB 21/28          | 400                           |                  |                     | 86,46  | 345.852,00         | 0,18           |
| AT0000A2QDQ2  | 0,0100 % HYPO TIROL 21/31 MTN       | 600                           |                  |                     | 79,59  | 477.516,00         | 0,24           |
| BE0002684653  | 0,0100 % ING BELGIUM 20/30 MTN      | 500                           |                  |                     | 83,25  | 416.270,00         | 0,21           |
| XS2360589217  | 0,0100 % NATL AUSTR.B 21/29 MTN     | 400                           |                  |                     | 85,19  | 340.748,00         | 0,17           |
| AT0000A2SUL3  | 0,0100 % OBEROEST.LBK 21/28 MTN     | 700                           |                  |                     | 86,30  | 604.065,00         | 0,31           |
| XS2104915207  | 0,0100 % ROYAL BK CDA 20/27 MTN     | 500                           |                  |                     | 90,85  | 454.230,00         | 0,23           |
| XS2262802601  | 0,0100 % STADSHYPOTEK 20/28 MTN     | 600                           |                  |                     | 86,17  | 516.990,00         | 0,26           |
| XS2353010593  | 0,0100 % SWED.CV BD 21/30 MTN       | 500                           |                  |                     | 82,74  | 413.715,00         | 0,21           |
| DE000HV2ASU1  | 0,0100 % UC-HVB PF 2064             | 200                           |                  |                     | 89,05  | 178.106,00         | 0,09           |
| SK4000018693  | 0,0100 % VSEOB.UV.BK 21/26          | 300                           |                  |                     | 92,70  | 278.085,00         | 0,14           |
| XS2348324414  | 0,0100 % WESTPAC SEC.NZ 21/28 MTN   | 500                           |                  |                     | 86,55  | 432.750,00         | 0,22           |
| XS2243314528  | 0,0100 % YORKSH.BLDG 20/27 MTN      | 270                           |                  |                     | 88,55  | 239.087,70         | 0,12           |
| DE000AAR0298  | 0,0500 % AAREAL BANK MTN S.311      | 700                           |                  |                     | 84,29  | 590.058,00         | 0,30           |
| XS2069102163  | 0,0500 % KOMMUNALBK 19/29 MTN       | 270                           |                  |                     | 85,18  | 229.983,30         | 0,12           |
| XS2227906034  | 0,0500 % MUNICIP.FIN. 20/35 MTN     | 440                           |                  |                     | 71,07  | 312.703,60         | 0,16           |
| NL0015614611  | 0,0500 % NATL-NEDE.BK 20/35 MTN     | 300                           |                  |                     | 69,63  | 208.890,00         | 0,11           |
| DE000A255CW0  | 0,0500 % NIEDERS.SCH.A.20/35 A.893  | 800                           |                  |                     | 72,66  | 581.264,00         | 0,30           |
| XS2079316753  | 0,0500 % NORDLB LUX 20/25 MTN       | 200                           |                  |                     | 96,49  | 192.984,00         | 0,10           |
| XS2020568734  | 0,0500 % SEB 19/24 MTN              | 500                           |                  |                     | 98,70  | 493.505,00         | 0,25           |
| XS2345317510  | 0,0500 % SVENSKA HDBK 21/28 MTN     | 500                           |                  |                     | 86,25  | 431.225,00         | 0,22           |
| DE0001030567  | 0,1000 % BUNDANL.V. 15/26 INFL.LKD  | 1.250                         |                  |                     | 97,78  | 1.266.540,77       | 0,65           |
| AT0000A2KW37  | 0,1000 % ERSTE GR.BK. 20/28 FLRMTN  | 500                           |                  |                     | 87,73  | 438.655,00         | 0,22           |
| FR0014005NA6  | 0,1250 % AGENCE FR.DV 21/31 MTN     | 700                           |                  |                     | 79,53  | 556.696,00         | 0,29           |
| XS2055663764  | 0,1250 % AUUCKLAND. COUNC.19/29 MTN | 300                           |                  |                     | 85,10  | 255.306,00         | 0,13           |
| XS2199719233  | 0,1250 % BNG BK 20/35 MTN           | 700                           |                  |                     | 72,01  | 504.049,00         | 0,26           |
| XS2332592760  | 0,1250 % BNG BK 21/33 MTN           | 500                           |                  |                     | 77,14  | 385.700,00         | 0,20           |
| FR0014003RH7  | 0,1250 % BPCE 21/30 MTN             | 400                           |                  |                     | 81,79  | 327.140,00         | 0,17           |
| BE0002736172  | 0,1250 % FLAEM.GEM. 20/35 MTN       | 200                           |                  |                     | 69,57  | 139.148,00         | 0,07           |
| AT0000A2RY95  | 0,1250 % HYPO NOE LB 21/31          | 400                           |                  |                     | 79,55  | 318.184,00         | 0,16           |
| XS2013525501  | 0,1250 % LLOYDS BANK 19/26 MTN      | 500                           |                  |                     | 92,78  | 463.895,00         | 0,24           |
| XS2054600718  | 0,1250 % LLOYDS BANK 19/29 MTN      | 280                           |                  |                     | 84,48  | 236.546,80         | 0,12           |
| DE000MHB25J1  | 0,1250 % MUENCH.HYP.BK. MTN-PF1883  | 1.000                         |                  |                     | 71,26  | 712.600,00         | 0,37           |
| XS2086861437  | 0,1250 % RAIF.BK INTL 19/29 MTN     | 300                           |                  |                     | 83,50  | 250.503,00         | 0,13           |
| XS2331216577  | 0,1250 % SANTANDER CB 21/26 MTN     | 200                           |                  |                     | 92,33  | 184.656,00         | 0,09           |
| XS2346986990  | 0,1250 % SBAB BANK 21/26 MTN        | 500                           |                  |                     | 91,91  | 459.550,00         | 0,24           |
| FR0014008066  | 0,1250 % SOCIETE GEN. 22/29 MTN     | 500                           |                  |                     | 86,35  | 431.735,00         | 0,22           |
| XS1995620967  | 0,1250 % SPAREBK 1 B. 19/26 MTN     | 700                           |                  |                     | 93,16  | 652.092,00         | 0,33           |
| FR00140022B3  | 0,1250 % STE GENERALE 21/28 MTN     | 600                           |                  |                     | 87,39  | 524.346,00         | 0,27           |

|              |                                    |       |        |              |      |
|--------------|------------------------------------|-------|--------|--------------|------|
| XS2251330184 | 0,1250 % WORLD BK 20/51 MTN        | 520   | 45,48  | 236.470,00   | 0,12 |
| DE000A289LU4 | 0,2500 % AAREAL BANK MTN S.304     | 400   | 80,53  | 322.100,00   | 0,17 |
| XS2343772724 | 0,2500 % ASB BANK 21/31 MTN        | 500   | 80,26  | 401.310,00   | 0,21 |
| XS1701458017 | 0,2500 % ASFINAG 17/24 MTN         | 170   | 97,85  | 166.343,30   | 0,09 |
| XS2407197545 | 0,2500 % AUCLD COUNC 21/31 MTN     | 500   | 80,44  | 402.190,00   | 0,21 |
| DE000BLB6JG6 | 0,2500 % BAY.LDSBK MTH 19/25       | 350   | 96,99  | 339.451,00   | 0,17 |
| XS2430965538 | 0,2500 % BNG BK 22/32 MTN          | 300   | 80,92  | 242.763,00   | 0,12 |
| FR0014002X43 | 0,2500 % BNP PARIBAS 21/27 FLR MTN | 400   | 92,56  | 370.240,00   | 0,19 |
| DE000CZ45WY7 | 0,2500 % COBA MTH S.P47            | 600   | 80,35  | 482.124,00   | 0,25 |
| XS2230266301 | 0,2500 % ELISA OYJ 20/27           | 200   | 89,45  | 178.898,00   | 0,09 |
| AT0000A2SUH1 | 0,2500 % ERSTE GR.BK. 21/29 MTN    | 300   | 83,30  | 249.909,00   | 0,13 |
| BE0002803840 | 0,2500 % FLUVIUS SYS. 21/28 MTN    | 600   | 87,20  | 523.224,00   | 0,27 |
| XS2192431380 | 0,2500 % ITALGAS 20/25 MTN         | 200   | 95,44  | 190.876,00   | 0,10 |
| XS2327299298 | 0,2500 % LSEG NETHERL 21/28 MTN    | 140   | 88,42  | 123.783,80   | 0,06 |
| XS2384734542 | 0,2500 % NIBC BANK 21/26 MTN       | 300   | 91,24  | 273.714,00   | 0,14 |
| AT0000A2T198 | 0,2500 % OESTERREICH 21/36 MTN     | 620   | 70,89  | 439.536,60   | 0,23 |
| DE000HV2AS10 | 0,2500 % UC-HVB PF 2071            | 230   | 80,56  | 185.278,80   | 0,09 |
| DE000A3MP4U9 | 0,2500 % VONOVIA SE MTN 21/28      | 100   | 84,70  | 84.695,00    | 0,04 |
| XS0577347288 | 0,3000 % UNICR.BK AUS. 11/26 MTN   | 100   | 154,89 | 154.886,00   | 0,08 |
| XS2351073098 | 0,3750 % AEGON BK 21/36 MTN        | 400   | 71,19  | 284.740,00   | 0,15 |
| FR0014002GB5 | 0,3750 % AGENCE FR.DV 21/36 MTN    | 400   | 69,87  | 279.492,00   | 0,14 |
| FR0014005HY8 | 0,3750 % AIR LIQUIDE 21/33 MTN     | 300   | 76,87  | 230.607,00   | 0,12 |
| XS2052998403 | 0,3750 % ANZ N.Z.INTL 19/29 MTN    | 220   | 84,70  | 186.344,40   | 0,10 |
| DE000BHY0SL9 | 0,3750 % BERLIN HYP AG IS 21(31)   | 500   | 76,85  | 384.260,00   | 0,20 |
| XS2435614693 | 0,3750 % BK NOVA SCOT 22/30 MTN    | 600   | 84,07  | 504.396,00   | 0,26 |
| XS2416413339 | 0,3750 % CO. RABOBANK 21/27 FLRMTN | 300   | 91,54  | 274.620,00   | 0,14 |
| XS2171210862 | 0,3750 % LB HESS.-THUER.MTN 20/25  | 500   | 95,50  | 477.510,00   | 0,24 |
| DE000LB125N3 | 0,3750 % LBBW MTN.HYP.19/26        | 500   | 94,65  | 473.250,00   | 0,24 |
| DE000LB2CW16 | 0,3750 % LBBW MTN 21/31            | 500   | 75,79  | 378.965,00   | 0,19 |
| XS2055627538 | 0,3750 % RAIF.BK INTL 19/26 MTN    | 200   | 91,50  | 182.998,00   | 0,09 |
| XS2434412859 | 0,3750 % SPAREBKN V B 22/32 MTN    | 700   | 80,52  | 563.640,00   | 0,29 |
| XS1962535644 | 0,3750 % STADSHYPOTEK 19/26 MTN    | 300   | 94,16  | 282.474,00   | 0,14 |
| BE0002816974 | 0,3750 % WALLONNE 21/31 MTN        | 200   | 81,08  | 162.152,00   | 0,08 |
| XS1978200472 | 0,3750 % WESTPAC BKG 19/26 MTN     | 500   | 93,84  | 469.180,00   | 0,24 |
| BE0000350596 | 0,4000 % BELGIQUE 20/40            | 3.100 | 64,07  | 1.986.232,00 | 1,02 |
| XS0620233097 | 0,4000 % UNICREDIT 11/26 MTN       | 300   | 167,55 | 502.638,00   | 0,26 |
| XS2421006201 | 0,4270 % WESTPAC SEC.NZ 21/26 MTN  | 600   | 91,50  | 549.018,00   | 0,28 |
| FR0013461688 | 0,5000 % AGENCE FR.DV 19/35 MTN    | 800   | 74,09  | 592.752,00   | 0,30 |
| DE000A28RSR6 | 0,5000 % ALL.FIN.II 20/31 MTN      | 200   | 84,00  | 168.000,00   | 0,09 |
| XS2053346297 | 0,5000 % ALSTRIA OFF.RE.ANL.19/25  | 300   | 90,78  | 272.325,00   | 0,14 |
| FR0014001JT3 | 0,5000 % BNP PARIBAS 21/30 MTN     | 500   | 84,90  | 424.485,00   | 0,22 |
| FR0014006CS9 | 0,5000 % BOUYGUES 21/30            | 300   | 84,81  | 254.427,00   | 0,13 |
| FR0013399169 | 0,5000 % BQ POST.H.L. 19/26 MTN    | 500   | 94,68  | 473.380,00   | 0,24 |
| FR0013518024 | 0,5000 % BQUE POSTALE 20/26FLR MTN | 200   | 95,71  | 191.428,00   | 0,10 |
| XS2297549391 | 0,5000 % CAIXABANK 21/29 FLR MTN   | 200   | 87,75  | 175.492,00   | 0,09 |
| AT0000A2STV4 | 0,5000 % CESKA SPORIT 21/28 FLRMTN | 400   | 87,68  | 350.712,00   | 0,18 |
| XS2386186063 | 0,5000 % ELI LILLY 21/33           | 510   | 79,06  | 403.180,50   | 0,21 |
| XS2384273715 | 0,5000 % HOLCIM F.LUX 21/30 MTN    | 600   | 81,19  | 487.164,00   | 0,25 |
| XS2296207116 | 0,5000 % INVESTEC BK 21/27 FLR MTN | 220   | 92,21  | 202.866,40   | 0,10 |
| XS2388449758 | 0,5000 % NATLBK 21/28 MTN          | 200   | 87,11  | 174.210,00   | 0,09 |
| XS1964577396 | 0,5000 % NIBC BANK 19/27 MTN       | 800   | 92,16  | 737.288,00   | 0,38 |
| NL0011819040 | 0,5000 % NIEDERLANDE 16-26         | 500   | 94,72  | 473.605,00   | 0,24 |
| XS2296204444 | 0,5000 % PRO.EUR.FIN. 21/32        | 260   | 77,39  | 201.216,60   | 0,10 |
| AT0000A2CFT1 | 0,5000 % RLB OOE 20/35             | 400   | 74,35  | 297.416,00   | 0,15 |
| SK4000018925 | 0,5000 % TATRA BANKA 21/28 FLR MTN | 500   | 86,97  | 434.825,00   | 0,22 |
| XS2432502008 | 0,5000 % TORON.DOM.BK 22/27 MTN    | 500   | 92,09  | 460.435,00   | 0,24 |
| FR00140045Z3 | 0,5000 % UNEDIC 21/36 MTN          | 500   | 72,87  | 364.360,00   | 0,19 |
| XS2358471246 | 0,5000 % YORKSH.BLDG 21/28 MTN     | 320   | 87,17  | 278.950,40   | 0,14 |
| ES0200002063 | 0,5500 % ADIF-ALTA VE 21/31 MTN    | 300   | 80,04  | 240.105,00   | 0,12 |
| XS2364001078 | 0,6250 % A2A 21/31 MTN             | 500   | 79,21  | 396.035,00   | 0,20 |
| XS1699732704 | 0,6250 % ASB BANK 17/24 MTN        | 750   | 97,94  | 734.535,00   | 0,38 |
| FR0014008E08 | 0,6250 % AXA BANK EU. 22/28 MTN    | 300   | 90,55  | 271.647,00   | 0,14 |
| XS1850289171 | 0,6250 % BNZ INTERNAT.FDG 18/25MTN | 500   | 96,00  | 479.985,00   | 0,25 |
| XS2331271242 | 0,6250 % DT. BAHN FIN. 21/36 MTN   | 390   | 72,96  | 284.524,50   | 0,15 |
| BE0002831122 | 0,6250 % FLUVIUS SYS. 21/31 MTN    | 500   | 80,01  | 400.055,00   | 0,21 |
| XS2084497705 | 0,6250 % FRESE.MED.CARE MTN 19/26  | 400   | 91,69  | 366.776,00   | 0,19 |
| FR0014001IM0 | 0,6250 % ICADE S.A. 21/31          | 200   | 77,58  | 155.156,00   | 0,08 |
| XS2182399274 | 0,6250 % ISLAND 20/26 MTN          | 600   | 93,44  | 560.610,00   | 0,29 |
| FR0013430741 | 0,6250 % KLEPIERRE 19/30 MTN       | 500   | 82,34  | 411.675,00   | 0,21 |
| XS2081058096 | 0,6250 % KOMMUNEKRED. 19/39 MTN    | 1.000 | 69,22  | 692.190,00   | 0,35 |
| XS1821420699 | 0,6250 % OBEROEST.LBK 18-25        | 400   | 96,10  | 384.408,00   | 0,20 |
| FR0013522695 | 0,6250 % RTE RESEAU 20/32 MTN      | 200   | 79,26  | 158.522,00   | 0,08 |
| ES00000128S2 | 0,6500 % SPANIEN 17-27 FLR         | 200   | 98,97  | 204.552,55   | 0,10 |
| DE000A2TR6F7 | 0,7000 % BRANDENBURG LSA 19/34     | 400   | 80,38  | 321.508,00   | 0,16 |
| ES0000012C12 | 0,7000 % SPANIEN 18/33 FLR         | 3.500 | 95,41  | 3.391.071,44 | 1,74 |

|              |                                    |       |       |       |              |      |
|--------------|------------------------------------|-------|-------|-------|--------------|------|
| XS1637329639 | 0,7500 % AEGON BK 17/27 MTN 3      | 700   |       | 92,11 | 644.742,00   | 0,33 |
| FR0013406154 | 0,7500 % AXA BANK EU. 19/29 MTN    | 500   |       | 89,03 | 445.155,00   | 0,23 |
| XS1508404651 | 0,7500 % DE VOLKSBK NV 16/31 MTN   | 1.000 |       | 84,02 | 840.150,00   | 0,43 |
| ES0239140025 | 0,7500 % INMOBIL.COL. 21/29 MTN    | 200   |       | 85,84 | 171.680,00   | 0,09 |
| DK0009526998 | 0,7500 % NYKREDIT 20/27 MTN        | 220   |       | 91,52 | 201.346,20   | 0,10 |
| AT0000A28HX3 | 0,7500 % OBERBANK 19/26 MTN        | 300   | 300   | 91,57 | 274.704,00   | 0,14 |
| XS2271332285 | 0,7500 % SBB TREASURY 20/28 MTN    | 350   |       | 62,25 | 217.875,00   | 0,11 |
| XS2433211310 | 0,7500 % SNAM 22/29 MTN            | 210   |       | 86,24 | 181.093,50   | 0,09 |
| XS2022425024 | 0,7500 % SNCF RESEAU 19/36 MTN     | 200   |       | 73,52 | 147.034,00   | 0,08 |
| XS2356040357 | 0,7500 % STELLANTIS 21/29 MTN      | 200   |       | 87,59 | 175.186,00   | 0,09 |
| DE000A3KNP96 | 0,7500 % TRATON FIN. 21/29 MTN     | 300   |       | 86,50 | 259.494,00   | 0,13 |
| DE000A168528 | 0,8000 % STADT HAMBURG LSA A.1/19  | 500   |       | 81,19 | 405.940,00   | 0,21 |
| XS2407969885 | 0,8000 % STD.CHARTER 21/29 FLR MTN | 340   |       | 86,56 | 294.314,20   | 0,15 |
| XS2200513070 | 0,8230 % NATL GRID E. 20/32        | 270   |       | 79,16 | 213.729,30   | 0,11 |
| AT000B023205 | 0,8400 % RLBK OBEROESTER. 16-26    | 1.500 |       | 93,11 | 1.396.695,15 | 0,72 |
| XS2014382845 | 0,8750 % ALLIANDER 19/32 MTN       | 180   |       | 82,57 | 148.617,00   | 0,08 |
| XS2430998893 | 0,8750 % BBVA 22/29 FLR MTN        | 500   |       | 89,91 | 449.555,00   | 0,23 |
| FR00140009W6 | 0,8750 % BQUE POSTALE 20/31 FLR    | 400   |       | 93,93 | 375.712,00   | 0,19 |
| DE000A2G9HL9 | 0,8750 % DZ HYP PF.R.1210 MTN      | 500   |       | 90,05 | 450.235,00   | 0,23 |
| XS2338570331 | 0,8750 % EQT 21/31 REGS            | 400   |       | 78,36 | 313.428,00   | 0,16 |
| XS2386650274 | 0,8750 % ERG 21/31 MTN             | 130   |       | 79,26 | 103.040,60   | 0,05 |
| BE0002780618 | 0,8750 % FLAEM.GEM. 21/46 MTN      | 500   |       | 58,67 | 293.365,00   | 0,15 |
| XS2229470146 | 0,8750 % KON. KPN 20/32 MTN        | 300   |       | 79,42 | 238.260,00   | 0,12 |
| DE000A2TSTRO | 0,8750 % KRED.F.WIED.19/39 MTN     | 1.050 |       | 73,16 | 768.169,50   | 0,39 |
| XS1793273092 | 0,8750 % LB.HESS.-THR. OMH 18/28   | 500   |       | 91,54 | 457.715,00   | 0,23 |
| AT0000A228U7 | 0,8750 % RLBK OBEROESTERR. 18-28   | 700   |       | 90,13 | 630.889,00   | 0,32 |
| XS2079107830 | 0,8750 % SKF 19/29                 | 500   |       | 85,75 | 428.740,00   | 0,22 |
| XS2117454871 | 0,8750 % TELENOR 20/35 MTN         | 300   |       | 76,72 | 230.151,00   | 0,12 |
| XS2438026440 | 0,8750 % THAMES WATER 22/28 MTN    | 150   |       | 84,23 | 126.339,00   | 0,06 |
| CH1142231690 | 0,8750 % UBS GROUP 21/31 MTN       | 500   |       | 80,17 | 400.870,00   | 0,21 |
| XS1523192588 | 0,8750 % URW 16/25 MTN             | 300   |       | 97,06 | 291.177,00   | 0,15 |
| XS2356311139 | 0,8800 % AIA GROUP 21/33 FLR MTN   | 100   |       | 84,67 | 84.665,00    | 0,04 |
| BE0000347568 | 0,9000 % BELGIQUE 19/29            | 500   |       | 91,11 | 455.560,00   | 0,23 |
| AT0000A2WSC8 | 0,9000 % OESTERREICH 22/32 MTN     | 2.000 | 1.000 | 86,26 | 1.725.260,00 | 0,88 |
| PTOTENO0034  | 0,9000 % PORTUGAL 20/35            | 370   |       | 77,92 | 288.300,30   | 0,15 |
| FR0014006G24 | 1,0000 % ATOS 21/29                | 800   | 300   | 19,39 | 155.128,00   | 0,08 |
| FR0013412343 | 1,0000 % BPCE S.A. 19/25 MTN       | 300   |       | 96,98 | 290.946,00   | 0,15 |
| XS2299135819 | 1,0000 % DANSKE BK 21/31 MTN       | 280   |       | 93,14 | 260.783,60   | 0,13 |
| XS2399933386 | 1,0000 % HERA 21/34 MTN            | 330   |       | 75,65 | 249.645,00   | 0,13 |
| XS2445188852 | 1,0000 % ING BANK 22/37 MTN        | 500   |       | 76,27 | 381.325,00   | 0,20 |
| XS2079079799 | 1,0000 % ING GROEP 19/30 FLR MTN   | 200   |       | 94,48 | 188.952,00   | 0,10 |
| XS2431320378 | 1,0000 % MEOBANCA 22/29 FLR MTN    | 350   |       | 88,83 | 310.898,00   | 0,16 |
| XS2348241048 | 1,0000 % RBANK 21/28 FLR MTN       | 400   |       | 88,52 | 354.092,00   | 0,18 |
| ES00000127C8 | 1,0000 % SPANIEN 15-30 FLR         | 1.000 |       | 99,82 | 1.019.581,09 | 0,52 |
| XS1943561883 | 1,0000 % SPAREBK 1 B. 19/29 MTN    | 800   |       | 90,01 | 720.080,00   | 0,37 |
| FR0014003S72 | 1,0000 % WENDEL 21/31              | 100   |       | 83,07 | 83.070,00    | 0,04 |
| BE0002709906 | 1,0500 % WALLONNE 20/40 MTN        | 700   |       | 67,94 | 475.580,00   | 0,24 |
| DE000NRW0LM8 | 1,1000 % LAND NRW MTN.LSA R.1476   | 700   |       | 84,24 | 589.694,00   | 0,30 |
| XS1548458014 | 1,1250 % ABN AMRO 17/32 MTN        | 500   |       | 86,50 | 432.515,00   | 0,22 |
| FR0014006KD4 | 1,1250 % BFCM 21/31 MTN            | 400   |       | 79,10 | 316.388,00   | 0,16 |
| FR0013310018 | 1,1250 % C.F.FINANC.LOC. 18/33 MTN | 1.000 |       | 84,10 | 840.960,00   | 0,43 |
| DE000A3MP7K3 | 1,1250 % KRED.F.WIED.22/37 MTN     | 1.600 |       | 79,78 | 1.276.400,00 | 0,65 |
| FR0013476090 | 1,1250 % RCI BANQUE 20/27 MTN      | 300   |       | 92,91 | 278.742,00   | 0,14 |
| XS1582205040 | 1,1250 % STATKRAFT 17/25 MTN       | 300   |       | 97,18 | 291.537,00   | 0,15 |
| AT000B101076 | 1,1300 % ALLG.SPARK.OBER.15-27 MTN | 300   |       | 94,08 | 282.225,00   | 0,14 |
| AT0000A1NWQ1 | 1,2000 % RLBK OBEROESTERR.16-24    | 1.000 |       | 97,63 | 976.325,72   | 0,50 |
| XS2451372499 | 1,2500 % ALD 22/26 MTN REGS        | 500   |       | 94,68 | 473.405,00   | 0,24 |
| FR0013296159 | 1,2500 % CIE F.FONCIER 17/32 MTN   | 600   |       | 85,30 | 511.776,00   | 0,26 |
| FR0014007YA9 | 1,2500 % CNP ASSURANC 22/29 MTN    | 400   |       | 87,89 | 351.560,00   | 0,18 |
| AT0000A2VCV4 | 1,2500 % ERSTE BK HU 22/26         | 400   |       | 96,92 | 387.692,00   | 0,20 |
| XS1945110606 | 1,2500 % IBM 19/27                 | 400   |       | 94,33 | 377.300,00   | 0,19 |
| XS2438619343 | 1,2500 % INVESTEC BK 22/26 FLR MTN | 543   |       | 95,22 | 517.050,03   | 0,26 |
| XS1748436356 | 1,2500 % WESTPAC BKG 18/33 MTN     | 500   |       | 83,86 | 419.310,00   | 0,21 |
| DE000A2E4EA2 | 1,3000 % BERLIN, LAND LSA18/33A505 | 750   |       | 87,13 | 653.460,00   | 0,33 |
| XS2411178630 | 1,3750 % BAY.LDSBK.21/32 MTN       | 500   |       | 84,21 | 421.035,00   | 0,22 |
| DE000CZ45WP5 | 1,3750 % COBA FIX-RESET 21/31 SUB. | 400   |       | 89,85 | 359.392,00   | 0,18 |
| XS2428716000 | 1,3750 % DIG.INTR.HO. 22/32        | 210   |       | 80,32 | 168.665,70   | 0,09 |
| XS2024716099 | 1,3750 % DT.TELEKOM MTN 19/34      | 300   |       | 83,80 | 251.409,00   | 0,13 |
| AT0000A2XLD9 | 1,3750 % HYPO TIROL 22/27 MTN      | 300   |       | 94,25 | 282.753,00   | 0,14 |
| XS1784071042 | 1,3750 % NORDEA MORTG.B. 18/33 MTN | 500   |       | 86,30 | 431.490,00   | 0,22 |
| XS1874127902 | 1,3750 % SIEMENS FINANC. 18/30 MTN | 500   |       | 89,38 | 446.920,00   | 0,23 |
| XS2197349645 | 1,3750 % TAKEDA PHARMA. 20/32      | 390   |       | 83,70 | 326.426,10   | 0,17 |
| XS2082429890 | 1,3750 % TELIA CO AB 20/81 FLR     | 180   |       | 93,75 | 168.751,80   | 0,09 |
| XS1652866002 | 1,3750 % TERNA R.E.N. 17/27 MTN    | 600   |       | 93,21 | 559.254,00   | 0,29 |
| XS1195465676 | 1,3750 % TYCO INTL FIN. 15/25      | 200   |       | 97,74 | 195.476,00   | 0,10 |



|              |                                    |       |     |        |              |      |
|--------------|------------------------------------|-------|-----|--------|--------------|------|
| BE0000355645 | 1,4000 % BELGIQUE 22/53            | 1.000 |     | 63,08  | 630.810,00   | 0,32 |
| DE000NRW0M92 | 1,4500 % LAND NRW MTN.LSA R.1531   | 400   |     | 51,21  | 204.828,00   | 0,10 |
| IE00BH3SQB22 | 1,5000 % IRLAND 19/50              | 200   |     | 71,70  | 143.398,00   | 0,07 |
| XS2481491160 | 1,5000 % RAIF.BK INTL 22/27 MTN    | 600   |     | 93,90  | 563.412,00   | 0,29 |
| XS2449928543 | 1,5000 % VE.W.SYS.FIN 22/29 MTN    | 400   |     | 90,50  | 361.996,00   | 0,19 |
| XS1757377400 | 1,6250 % ALLIANDER 18/UND. FLR     | 300   |     | 96,60  | 289.800,00   | 0,15 |
| XS2247936342 | 1,6250 % BCO SANTAND. 20/30 MTN    | 500   |     | 85,06  | 425.305,00   | 0,22 |
| IT0005246415 | 1,6250 % CA ITALIA 17/29 MTN       | 400   |     | 91,89  | 367.572,00   | 0,19 |
| DE000SCB0039 | 1,6250 % DT.KREDITBANK HPF 22/32   | 500   |     | 90,00  | 449.995,00   | 0,23 |
| XS2478521151 | 1,6250 % HYPO VORARL. 22/28 MTN    | 500   |     | 93,37  | 466.830,00   | 0,24 |
| FR00140082Z6 | 1,6250 % JDECAUX SE 22/30          | 100   |     | 87,47  | 87.467,00    | 0,04 |
| XS2288109676 | 1,6250 % TELECOM ITAL 21/29 MTN    | 300   |     | 86,81  | 260.436,00   | 0,13 |
| AT0000A1L5D3 | 1,6600 % RLBK OBEROESTERR.16-26 96 | 2.100 |     | 93,97  | 1.973.341,99 | 1,01 |
| IE00BV8C9B83 | 1,7000 % IRLAND 17/37              | 900   |     | 86,43  | 777.825,00   | 0,40 |
| XS2357754097 | 1,7130 % ASS.GENERALI 21/32 MTN    | 150   |     | 80,94  | 121.408,50   | 0,06 |
| XS1969600748 | 1,7500 % CNH INDUSTR. 19/27        | 300   |     | 94,83  | 284.490,00   | 0,15 |
| XS2202902636 | 1,7500 % DE VOLKSBANK 20/30FLR MTN | 300   |     | 94,99  | 284.976,00   | 0,15 |
| XS2198574209 | 1,7500 % HANN RUECK SUB 2020/2040  | 200   |     | 84,99  | 169.976,00   | 0,09 |
| XS1788515606 | 1,7500 % NATWEST GROUP 18/26 MTN   | 300   |     | 97,75  | 293.262,00   | 0,15 |
| IT0005421703 | 1,8000 % ITALIEN 20/41             | 600   |     | 70,80  | 424.782,00   | 0,22 |
| AT0000A2Y8G4 | 1,8500 % OESTERREICH 22/49 MTN     | 700   |     | 77,69  | 543.795,00   | 0,28 |
| XS2119468572 | 1,8740 % BRIT.TELECOM 20/80 FLR    | 200   |     | 95,88  | 191.750,00   | 0,10 |
| FR0014005X99 | 1,8750 % CNP ASSURANC 21/53 FLRMTN | 300   |     | 77,91  | 233.730,00   | 0,12 |
| XS1377682676 | 1,8750 % COCA COLA HBC F.16/24 MTN | 500   |     | 98,61  | 493.070,00   | 0,25 |
| XS1538284230 | 1,8750 % CREDIT AGR. 16/26 MTN     | 200   |     | 95,41  | 190.812,00   | 0,10 |
| XS1708167652 | 1,8750 % VERIZON COMM 17/29        | 600   |     | 91,73  | 550.404,00   | 0,28 |
| IT0006527524 | 12,0000 % EUR. BK REC.DEV. 99-24   | 156   |     | 174,98 | 272.962,56   | 0,14 |
| FR0013523602 | 2,0000 % CA ASSURAN. 20/30         | 300   |     | 86,89  | 260.673,00   | 0,13 |
| DE000A3MQQV5 | 2,0000 % DEUT.BOERSE SUB.ANL22/48  | 100   |     | 91,72  | 91.717,00    | 0,05 |
| XS1651453729 | 2,0000 % NATIONWIDE BLDG 17/29 FLR | 500   |     | 98,93  | 494.655,00   | 0,25 |
| XS2430287362 | 2,0850 % PROSUS 22/30 MTN REGS     | 200   | 200 | 84,80  | 169.592,00   | 0,09 |
| XS2485152362 | 2,1000 % SWEDBANK 22/27 MTN        | 390   |     | 95,54  | 372.613,80   | 0,19 |
| FR001400CGA2 | 2,1250 % CREDIT AGR. 22/30 MTN     | 500   |     | 94,55  | 472.760,00   | 0,24 |
| XS2472603740 | 2,1250 % ROYAL BK CDA 22/29 MTN    | 500   |     | 93,05  | 465.230,00   | 0,24 |
| XS2489287354 | 2,1250 % SANDVIK 22/27 MTN         | 210   |     | 95,73  | 201.026,70   | 0,10 |
| XS1648462023 | 2,2500 % SNCF RESEAU 17/47 MTN     | 300   |     | 76,44  | 229.332,00   | 0,12 |
| XS1112013666 | 2,2500 % WPP FINANCE 14/26 MTN     | 600   |     | 97,06  | 582.372,00   | 0,30 |
| XS2399851901 | 2,2500 % ZF FINANCE GMBH MTN 21/28 | 200   |     | 91,10  | 182.208,00   | 0,09 |
| XS2526882001 | 2,3470 % NATL AUSTR.B 22/29 MTN    | 500   |     | 95,02  | 475.105,00   | 0,24 |
| XS2207430120 | 2,3740 % TENNET HLDG 20/UND.FLR    | 200   |     | 96,91  | 193.814,00   | 0,10 |
| FR001400CM22 | 2,3750 % CIE FIN.FONC 22/30 MTN    | 500   |     | 95,83  | 479.130,00   | 0,25 |
| XS2529234200 | 2,3750 % KOMMUNEKRED. 22/32 MTN    | 500   |     | 95,90  | 479.515,00   | 0,25 |
| IT0005499543 | 2,3750 % MEDIOBANCA 22/27 MTN      | 400   |     | 96,37  | 385.496,00   | 0,20 |
| FR0013413887 | 2,3750 % ORANGE 19/UND. FLR MTN    | 300   |     | 97,72  | 293.163,00   | 0,15 |
| XS2437854487 | 2,3750 % TERNA R.E.N. 22/UND. FLR  | 270   |     | 91,46  | 246.936,60   | 0,13 |
| IT0005547812 | 2,4000 % ITALIEN 23/39 FLR         | 800   |     | 102,72 | 825.526,54   | 0,42 |
| FR0013378460 | 2,5000 % ATOS 18-28                | 200   | 200 | 19,07  | 38.140,00    | 0,02 |
| DE0001135481 | 2,5000 % BUNDANL.V.12/44           | 300   |     | 97,90  | 293.712,00   | 0,15 |
| XS2475919663 | 2,5000 % ELECTROLUX 22/30 MTN      | 420   |     | 90,27  | 379.121,40   | 0,19 |
| FR0014008JQ4 | 2,5000 % MERCIALYS 22/29           | 400   |     | 92,85  | 371.416,00   | 0,19 |
| DE000MHB10J3 | 2,5000 % MUENCH.HYP.BK. MTN-PF1618 | 250   |     | 97,73  | 244.332,50   | 0,13 |
| NL0015001DQ7 | 2,5000 % NIEDERLANDE 23/30         | 1.000 |     | 99,17  | 991.740,00   | 0,51 |
| FR0014002OL8 | 2,5000 % RENAULT 21/28 MTN         | 400   |     | 94,51  | 378.056,00   | 0,19 |
| AT0000A2YD59 | 2,5000 % RLB OOE 22/29 MTN         | 400   |     | 95,98  | 383.900,00   | 0,20 |
| IT0004545890 | 2,5500 % B.T.P. 09-41 FLR          | 400   |     | 106,50 | 554.724,53   | 0,28 |
| FR001400CK81 | 2,6250 % CCF SFH 22/32 MTN         | 600   |     | 95,75  | 574.488,00   | 0,29 |
| XS2745126792 | 2,6250 % CEB 24/34 MTN             | 700   | 700 | 97,04  | 679.245,00   | 0,35 |
| XS2390510142 | 2,7500 % GOODYEAR EUR 21/28 REGS   | 150   |     | 90,39  | 135.589,50   | 0,07 |
| XS2744125266 | 2,7500 % ING BANK 24/32 MTN        | 500   | 500 | 97,73  | 488.630,00   | 0,25 |
| XS2559401802 | 2,7500 % SVENSK EXPOR 22/28 MTN    | 700   |     | 98,57  | 689.962,00   | 0,35 |
| XS2056730323 | 2,8750 % INFINEON TECH.19/UNBEFR.  | 200   |     | 97,96  | 195.922,00   | 0,10 |
| XS2408458730 | 2,8750 % LUFTHANSA AG MTN 21/27    | 500   |     | 96,40  | 482.000,00   | 0,25 |
| DE000NLB4Y34 | 2,8750 % NORDLB HPF.MTN24/31       | 700   | 700 | 98,35  | 688.464,00   | 0,35 |
| AT0000A32695 | 2,8750 % OBEROEST.LBK 23/27 MTN    | 800   |     | 98,33  | 786.664,00   | 0,40 |
| AT000B049952 | 2,8750 % UNICR.BK AU. 24/28 MTN    | 200   | 200 | 98,28  | 196.568,00   | 0,10 |
| XS2410367747 | 2,8800 % TEL.EUROPE 21/UND. FLR    | 500   |     | 91,59  | 457.930,00   | 0,23 |
| XS2346972263 | 3,0000 % ARCELIK 21/26 REGS        | 170   |     | 96,84  | 164.628,00   | 0,08 |
| XS2310511717 | 3,0000 % ARD.MET.P.F. 21/29 REGS   | 400   |     | 79,49  | 317.952,00   | 0,16 |
| BE0000357666 | 3,0000 % BELGIQUE 23/33            | 400   |     | 100,66 | 402.632,00   | 0,21 |
| DE000A30V5F6 | 3,0000 % DT.BANK MTH 23/30         | 500   |     | 99,61  | 498.050,00   | 0,26 |
| XS2527421668 | 3,0000 % JC INTL/TYCO 22/28        | 110   |     | 98,08  | 107.886,90   | 0,06 |
| XS2752052063 | 3,0000 % RAIF.LABA NO 24/27 MTN    | 400   | 400 | 98,68  | 394.700,00   | 0,20 |
| XS2225204010 | 3,0000 % VODAFONE GRP 20/80 FLR    | 200   |     | 88,96  | 177.922,00   | 0,09 |
| XS2010039894 | 3,0000 % ZF EUROPE FI 19/29        | 100   | 100 | 91,47  | 91.473,00    | 0,05 |
| XS1824277641 | 3,0160 % COMP.DE ST.-GOBAIN 18/33  | 300   |     | 86,40  | 259.212,00   | 0,13 |

|              |                                   |       |       |     |        |              |      |
|--------------|-----------------------------------|-------|-------|-----|--------|--------------|------|
| FR001400CMY0 | 3,1250 % BFCM 22/27 MTN           | 500   |       |     | 98,48  | 492.405,00   | 0,25 |
| XS2380124227 | 3,1250 % CASTELLUM 21/UND. FLR    | 200   |       |     | 85,70  | 171.390,00   | 0,09 |
| XS2335148024 | 3,1250 % CONSTELLIUM 21/29 REGS   | 150   |       |     | 92,67  | 138.997,50   | 0,07 |
| XS2757516005 | 3,1250 % KOMMUNEKRED. 24/38 MTN   | 350   | 350   |     | 99,00  | 346.503,50   | 0,18 |
| FR0013331949 | 3,1250 % LA POSTE 18-UND. FLR     | 200   |       |     | 96,81  | 193.612,00   | 0,10 |
| AT0000A39P66 | 3,1250 % OBERBANK 24/32 MTN       | 300   | 300   |     | 98,35  | 295.035,00   | 0,15 |
| XS2485265214 | 3,1250 % PROL.I.F.II 22/31 MTN    | 500   |       |     | 94,29  | 471.425,00   | 0,24 |
| AT0000A326M6 | 3,1250 % RLB OOE 23/26 MTN        | 400   |       |     | 99,19  | 396.776,00   | 0,20 |
| XS2541314584 | 3,1250 % UNIC.BK CZ+S 22/27       | 600   |       |     | 98,36  | 590.178,00   | 0,30 |
| XS2758930569 | 3,1460 % NATL AUST.BK 24/31 MTN   | 700   | 700   |     | 98,98  | 692.874,00   | 0,36 |
| FR001400EZL5 | 3,2500 % ARK.PUBL.SEC 23/31 MTN   | 400   |       |     | 100,60 | 402.392,00   | 0,21 |
| DE000A3LSYH6 | 3,2500 % M.B.INT.FIN. 24/32 MTN   | 300   | 300   |     | 98,53  | 295.602,00   | 0,15 |
| XS1843448314 | 3,2500 % MUENCH.RUECK 18/49       | 200   |       |     | 95,23  | 190.454,00   | 0,10 |
| XS2525246901 | 3,2500 % NATIONW.BLDG 22/29 MTN   | 600   |       |     | 98,29  | 589.734,00   | 0,30 |
| AT0000A32S78 | 3,2500 % OBERBANK 23/30 MTN       | 400   |       |     | 99,37  | 397.496,00   | 0,20 |
| XS2617256149 | 3,2500 % PROCTER+GAMB 23/31       | 440   |       |     | 100,62 | 442.732,40   | 0,23 |
| CH1210198136 | 3,2500 % SW.LIFE F.I 22/29        | 430   |       |     | 98,35  | 422.905,00   | 0,22 |
| IT0005358806 | 3,3500 % ITALIEN 19/35            | 600   |       |     | 94,77  | 568.644,00   | 0,29 |
| MT0000013889 | 3,3500 % MALTA 24/29              | 500   | 500   |     | 97,48  | 487.400,00   | 0,25 |
| XS2534785865 | 3,3750 % BBVA 22/27 MTN           | 200   |       |     | 99,57  | 199.130,00   | 0,10 |
| XS2757515882 | 3,3750 % COCA C.HBC F 24/28 MTN   | 180   | 180   |     | 99,74  | 179.528,40   | 0,09 |
| XS2755487076 | 3,3750 % DT. BAHN FIN. 23/38 MTN  | 110   | 110   |     | 97,85  | 107.633,90   | 0,06 |
| FR001400IWZ3 | 3,3750 % SAGESS 23/30 MTN         | 200   |       |     | 100,88 | 201.768,00   | 0,10 |
| FR001400D8K2 | 3,3750 % VINCI S.A. 22/32 MTN     | 400   |       |     | 99,03  | 396.132,00   | 0,20 |
| XS2742534287 | 3,4500 % NY LIFE GLBL 24/31       | 290   | 290   |     | 99,69  | 289.106,80   | 0,15 |
| IT0005579997 | 3,5000 % CA ITALIA 24/33 MTN      | 100   | 100   |     | 99,60  | 99.597,00    | 0,05 |
| XS2673564832 | 3,5000 % DANSKE MT BK 23/29 MTN   | 610   |       |     | 101,20 | 617.326,10   | 0,32 |
| FR001400IS66 | 3,5000 % LEGRAND 23/29            | 200   |       |     | 100,92 | 201.832,00   | 0,10 |
| XS2631822868 | 3,5000 % STATKRAFT 23/33 MTN      | 130   |       |     | 100,36 | 130.468,00   | 0,07 |
| IT0005549370 | 3,5000 % UNICREDIT 23/30 MTN      | 500   |       |     | 100,25 | 501.245,00   | 0,26 |
| XS2591848192 | 3,5000 % UNIL.FIN.NED 23/35 MTN   | 320   |       |     | 100,71 | 322.256,00   | 0,17 |
| XS2747596315 | 3,5470 % ASS.GENERALI 24/34 MTN   | 600   | 600   |     | 97,64  | 585.810,00   | 0,30 |
| PTBPIDOM0031 | 3,6250 % BANCO BPI 23/28 MTN      | 400   |       |     | 101,08 | 404.316,00   | 0,21 |
| XS2347397437 | 3,6250 % CITYCON OYJ 21/UND       | 250   |       |     | 70,16  | 175.402,50   | 0,09 |
| FR001400IUI3 | 3,6250 % EDENRED 23/31            | 200   |       |     | 98,84  | 197.686,00   | 0,10 |
| XS2742660157 | 3,6250 % MOTABILITY 24/29 MTN     | 100   | 100   |     | 100,37 | 100.374,00   | 0,05 |
| AT0000A377E6 | 3,6250 % NIEDEROESTER 23/33       | 200   | 500   | 300 | 104,17 | 208.334,00   | 0,11 |
| XS2310951103 | 3,6250 % SAPPY PAPIER 21/28 REGS  | 300   |       |     | 96,53  | 289.590,00   | 0,15 |
| XS2769892600 | 3,6250 % SIEMENS FIN 24/44 MTN    | 300   | 300   |     | 98,27  | 294.816,00   | 0,15 |
| DE000A3LH6U5 | 3,7000 % M.B.INT.FIN. 23/31 MTN   | 700   |       |     | 102,76 | 719.334,00   | 0,37 |
| FR001400KR43 | 3,7500 % AGENCE FR.DV 23/38 MTN   | 200   | 200   |     | 102,95 | 205.896,00   | 0,11 |
| FR001400N6I8 | 3,7500 % BFCM 24/34 MTN           | 200   | 200   |     | 99,24  | 198.480,00   | 0,10 |
| XS2577874782 | 3,7500 % HEIDELB.MAT. MTN 23/32   | 240   |       |     | 99,38  | 238.521,60   | 0,12 |
| XS2731506841 | 3,7500 % MET.LIFE F.I 23/31 MTN   | 220   | 220   |     | 100,99 | 222.186,80   | 0,11 |
| XS2678226114 | 3,8750 % ASSA-ABLOY 23/30 MTN     | 230   | 230   |     | 102,59 | 235.961,60   | 0,12 |
| XS2747065030 | 3,8750 % BBVA 24/34 MTN           | 500   | 500   |     | 100,27 | 501.340,00   | 0,26 |
| FR001400N4L7 | 3,8750 % BPCE 24/29 MTN           | 500   | 500   |     | 99,69  | 498.440,00   | 0,26 |
| XS2541394750 | 3,8750 % DT. BAHN FIN. 22/42 MTN  | 320   |       |     | 104,03 | 332.883,20   | 0,17 |
| SK4000023636 | 3,8750 % SLOVENSK.SPO 23/27 MTN   | 1.000 |       |     | 101,19 | 1.011.900,00 | 0,52 |
| DE000DL19WN3 | 4,0000 % DT.BANK FIXED 22/32 SUB. | 100   |       |     | 95,46  | 95.462,00    | 0,05 |
| BE0002966472 | 4,0000 % FLAEM.GEM. 23/42 MTN     | 400   | 400   |     | 105,45 | 421.804,00   | 0,22 |
| FR001400IIS7 | 4,0000 % LA POSTE 23/35 MTN       | 600   |       |     | 103,78 | 622.668,00   | 0,32 |
| XS0803131282 | 4,0000 % METRO MTN 12/24          | 700   |       |     | 99,31  | 695.198,00   | 0,36 |
| XS2635622595 | 4,0000 % OP YRITYSPA. 23/28 MTN   | 300   |       |     | 101,75 | 305.241,00   | 0,16 |
| BE0002925064 | 4,0000 % PROXIMUS 23/30 MTN       | 400   |       |     | 102,74 | 410.952,00   | 0,21 |
| XS2629470845 | 4,0000 % ROBERT BOSCH MTN.23/35   | 300   |       |     | 102,42 | 307.266,00   | 0,16 |
| FR001400L362 | 4,1250 % ACT.LOG.SER. 23/38 MTN   | 1.000 | 1.000 |     | 105,17 | 1.051.680,00 | 0,54 |
| XS2573569576 | 4,1250 % DANSKE BK 23/31 FLR MTN  | 410   |       |     | 101,82 | 417.470,20   | 0,21 |
| DE000A3LBGG1 | 4,1250 % TRATON FIN. 22/25 MTN    | 200   |       |     | 100,39 | 200.778,00   | 0,10 |
| FR001400MLN4 | 4,1250 % URW 23/30 MTN            | 100   | 100   |     | 100,56 | 100.560,00   | 0,05 |
| IT0005560948 | 4,2000 % ITALIEN 23/34            | 1.000 | 1.000 |     | 102,96 | 1.029.550,00 | 0,53 |
| DE000A0E8203 | 4,2060 % KRED.F.WIED.05/25 MTN    | 562   |       |     | 100,22 | 563.255,13   | 0,29 |
| DE000BLB6JZ6 | 4,2500 % BAY.LDSBK. MTI. 23/27    | 600   |       |     | 99,93  | 599.568,00   | 0,31 |
| XS2676814499 | 4,2500 % CAIXABANK 23/30 MTN      | 500   | 500   |     | 102,86 | 514.280,00   | 0,26 |
| FI4000507132 | 4,2500 % FINNAIR 21/25            | 300   |       |     | 98,69  | 296.067,00   | 0,15 |
| XS2672967234 | 4,2500 % MOLNLYCKE HL 23/28 MTN   | 190   | 190   |     | 101,32 | 192.513,70   | 0,10 |
| XS2592301365 | 4,2500 % TESCO TRE.SV 23/31 MTN   | 600   |       |     | 102,63 | 615.762,00   | 0,32 |
| XS2576067081 | 4,2750 % NATL GRID 23/35 MTN      | 600   |       |     | 101,01 | 606.054,00   | 0,31 |
| XS2590758822 | 4,3000 % AT + T 23/34             | 500   |       |     | 103,17 | 515.845,00   | 0,26 |
| XS0232189331 | 4,3710 % NORDIC INV.BK 05/25MTN   | 800   |       |     | 100,17 | 801.360,00   | 0,41 |
| FR001400M4O2 | 4,3750 % CREDIT AGR. 23/33 MTN    | 100   | 100   |     | 103,52 | 103.522,00   | 0,05 |
| DE000A30WV1  | 4,3750 % DT.PFBR.BANK MTN.35416   | 300   |       |     | 93,03  | 279.081,00   | 0,14 |
| XS2488809612 | 4,3750 % NOKIA 23/31 MTN          | 100   |       |     | 99,84  | 99.836,00    | 0,05 |
| XS2613209670 | 4,3750 % SYDNEY A.FIN 23/33       | 200   |       |     | 103,28 | 206.564,00   | 0,11 |
| XS2406607171 | 4,3750 % TEV.P.F.N.II 21/30       | 540   |       |     | 95,05  | 513.259,20   | 0,26 |

|                        |                                    |            |     |        |              |      |
|------------------------|------------------------------------|------------|-----|--------|--------------|------|
| XS2576550672           | 4,3750 % THAMES WATER 23/31 MTN    | 420        |     | 93,00  | 390.591,60   | 0,20 |
| IT0005518128           | 4,4000 % ITALIEN 22/33             | 1.500      |     | 105,07 | 1.576.110,00 | 0,81 |
| XS0138428684           | 4,4310 % UNICR.BK AUS. 01/31FLRMTN | 600        | 600 | 91,42  | 548.490,00   | 0,28 |
| XS2534976886           | 4,5000 % A2A 22/30 MTN             | 250        |     | 103,27 | 258.180,00   | 0,13 |
| IT0005534141           | 4,5000 % ITALIEN 23/53             | 790        | 290 | 101,40 | 801.083,70   | 0,41 |
| XS2728560959           | 4,5000 % JDE PEETS 23/34 MTN       | 180        | 180 | 102,13 | 183.825,00   | 0,09 |
| XS2489772991           | 4,5000 % LB.HESS.-THR. 22/32 VAR   | 400        |     | 92,63  | 370.532,00   | 0,19 |
| XS2569069375           | 4,5000 % LLOYDS BKG 23/29 FLR MTN  | 300        |     | 102,25 | 306.753,00   | 0,16 |
| XS2644417227           | 4,5000 % SANTANDER CONS. MTN 23/26 | 200        |     | 100,86 | 201.726,00   | 0,10 |
| XS2739054489           | 4,5060 % BARCLAYS 24/33 FLR MTN    | 310        | 310 | 100,38 | 311.190,40   | 0,16 |
| XS0224366608           | 4,5820 % AUSTRIA 05/25 FLR MTN     | 2.523      |     | 100,95 | 2.547.077,82 | 1,31 |
| DE000A30VTT8           | 4,5970 % ALLIANZ MTN 2022/2038     | 400        |     | 100,83 | 403.300,00   | 0,21 |
| DE000A2DASM5           | 4,6000 % DT.PFBR.BANK MTN.35274    | 400        |     | 40,56  | 162.256,00   | 0,08 |
| FR001400MDV4           | 4,6250 % COVIVIO 23/32 MTN         | 200        | 200 | 102,58 | 205.156,00   | 0,11 |
| FR0013522091           | 4,6250 % MERCIALYS 20/27           | 100        |     | 99,01  | 99.005,00    | 0,05 |
| XS1637926137           | 4,6790 % DT.PFBR.BANK MTN.35281VAR | 100        | 100 | 39,64  | 39.640,00    | 0,02 |
| CH1251998238           | 4,8400 % RAIF.SCHWEIZ 23/28        | 500        |     | 103,10 | 515.505,00   | 0,26 |
| XS2621539910           | 4,8560 % HSBC HLDGS 23/33 FLR MTN  | 400        |     | 105,11 | 420.452,00   | 0,22 |
| AT0000A39UM6           | 4,8750 % ERSTE+STE.BK 24/29 FLR    | 100        | 100 | 100,72 | 100.720,00   | 0,05 |
| DE000NLB4RS5           | 4,8750 % NORDLB MTN 23/28          | 400        |     | 104,44 | 417.776,00   | 0,21 |
| XS2671251127           | 4,8750 % SPAREBK 1 SR 23/28 MTN    | 500        |     | 103,85 | 519.270,00   | 0,27 |
| XS2432941693           | 5,0000 % AT+S AUSTR.T.+S. 22-UND.  | 300        |     | 89,04  | 267.105,00   | 0,14 |
| DE000A30VT06           | 5,0000 % DT.BANK MTN 22/30         | 200        |     | 102,56 | 205.110,00   | 0,11 |
| FR001400F0H3           | 5,0000 % JCDECAUX 23/29            | 200        | 200 | 104,80 | 209.598,00   | 0,11 |
| XS2615271629           | 5,0000 % JYSKE BANK 23/28 FLR MTN  | 220        |     | 102,28 | 225.020,40   | 0,12 |
| AT0000A1AXT0           | 5,0000 % RLBK OBEROESTERR. 14-27   | 200        |     | 96,06  | 192.121,19   | 0,10 |
| DE000A30VQB2           | 5,0000 % VONOVIA SE MTN 22/30      | 200        |     | 104,17 | 208.344,00   | 0,11 |
| AT0000A1CB74           | 5,1250 % RLBK OBEROESTERR.15-27 16 | 200        |     | 96,99  | 193.987,62   | 0,10 |
| DE000DK010W7           | 5,1500 % DEKA MTN.S.7782           | 500        | 500 | 94,40  | 471.975,00   | 0,24 |
| XS2725836410           | 5,3750 % ERICSSON 23/28 MTN        | 210        | 210 | 103,88 | 218.154,30   | 0,11 |
| IT0005580102           | 5,3750 % UNICREDIT 24/34 FLR MTN   | 280        | 280 | 101,24 | 283.483,20   | 0,15 |
| DK0030507694           | 5,5000 % NYKREDIT 22/32 FLR MTN    | 500        |     | 102,44 | 512.185,00   | 0,26 |
| XS2676413235           | 5,7370 % CESKA SPORIT 23/28 FLRMTN | 200        | 200 | 103,61 | 207.224,00   | 0,11 |
| XS2250987356           | 5,7500 % LENZING 20/UND. FLR       | 400        |     | 87,48  | 349.908,00   | 0,18 |
| XS2547936984           | 5,7500 % RAIF.BK INTL 22/28 MTN    | 300        |     | 106,10 | 318.288,00   | 0,16 |
| FR001400M2G2           | 5,7500 % TELEPERFORM. 23/31 MTN    | 200        | 200 | 103,18 | 206.364,00   | 0,11 |
| DE000DFK0B39           | 5,7700 % DZ BANK IS.A1429 VAR      | 400        |     | 95,05  | 380.204,00   | 0,19 |
| FR001400L9Q7           | 5,8750 % VALEO 23/29 MTN           | 200        | 200 | 105,57 | 211.136,00   | 0,11 |
| XS2271356201           | 5,8750 % WEBUILD 20/25             | 100        | 300 | 101,88 | 101.880,00   | 0,05 |
| DE000A0B1K12           | 6,0000 % DT.PFBR.BANK 05/25 VAR    | 300        |     | 98,30  | 294.888,00   | 0,15 |
| XS0522550580           | 6,3500 % GEN. CATALUNYA 10/41 MTN  | 200        | 200 | 120,24 | 240.482,00   | 0,12 |
| DE000DXA0RA0           | 6,5000 % LB.HESS.-THR. OP.1468 VAR | 107        | 107 | 105,92 | 113.329,05   | 0,06 |
| XS2555412001           | 6,6930 % CESKA SPORIT 22/25 FLRMTN | 400        |     | 101,59 | 406.352,00   | 0,21 |
| XS2681940297           | 7,0000 % WEBUILD 23/28             | 400        | 400 | 105,65 | 422.616,00   | 0,22 |
| XS2534786590           | 7,3750 % RAIF.BK INTL 22/32FLR MTN | 500        |     | 105,22 | 526.120,00   | 0,27 |
| AT0000A34CN3           | 7,6250 % BCA COM.ROM. 23/27 FLRMTN | 200        |     | 105,75 | 211.490,00   | 0,11 |
| XS2637954582           | 7,8750 % TELECOM ITAL 23/28 MTN    | 100        |     | 110,79 | 110.787,00   | 0,06 |
| XS2675884733           | 7,8750 % VOLKSWAGEN INTL 23/UNDFLR | 200        | 200 | 111,35 | 222.692,00   | 0,11 |
| XS2559379529           | 8,7500 % RAIF.BK ZRT. 22/25 FLRMTN | 200        |     | 103,22 | 206.444,00   | 0,11 |
| XS2566291865           | 9,2500 % INTRUM 22/28 REGS         | 100        | 100 | 74,91  | 74.910,00    | 0,04 |
| <b>lautend auf GBP</b> |                                    |            |     |        |              |      |
| XS0904228557           | 0,0000 % INTU (SGS) FIN. 13/28 MTN | 200        |     | 57,90  | 174.883,37   | 0,09 |
| XS2062666602           | 4,2500 % VIRG.MED.S.F 19/30 REGS   | 200        |     | 86,41  | 201.871,23   | 0,10 |
| FR001400ISF3           | 6,2500 % STE GENERALE 23/33 MTN    | 400        |     | 105,94 | 494.982,01   | 0,25 |
| <b>lautend auf ITL</b> |                                    |            |     |        |              |      |
| DE0001342244           | 0,0000 % DT.BANK 96/26ZO           | 1.000.000  |     | 88,54  | 457.245,12   | 0,23 |
| XS0083662923           | 0,0000 % EUR. BK REC.DEV.98/48ZERO | 12.817.000 |     | 28,87  | 1.910.896,50 | 0,98 |
| XS0071948540           | 0,0000 % UBS FIN. 97/27 ZERO       | 1.175.000  |     | 87,76  | 532.547,89   | 0,27 |
| <b>lautend auf USD</b> |                                    |            |     |        |              |      |
| XS2306847232           | 2,2500 % REC 21/26 MTN             | 300        |     | 91,99  | 254.631,85   | 0,13 |
| XS2622186786           | 2,3300 % WORLD BK 23/26 FLR MTN    | 500        |     | 94,00  | 433.640,89   | 0,22 |
| USU09513JC43           | 2,5500 % BMW US CAP 21/31 REGS     | 100        |     | 85,46  | 78.848,50    | 0,04 |
| US037833EN61           | 3,2500 % APPLE 22/29               | 500        |     | 93,60  | 431.790,92   | 0,22 |
| XS0210976329           | 3,5000 % KBC IFIMA 05/25 FLR MTN   | 400        |     | 96,08  | 354.611,55   | 0,18 |
| USP7088CAC03           | 4,1250 % NATURA COSM. 21/28 REGS   | 47         | 153 | 91,39  | 39.633,86    | 0,02 |
| USL6388GHX18           | 4,5000 % MILLICOM INT 20/31 REGS   | 200        |     | 85,22  | 157.252,26   | 0,08 |
| XS1138687592           | 5,0100 % SPAIN KINGD. 14/44 MTN    | 500        |     | 90,29  | 416.525,19   | 0,21 |
| USU24724AL78           | 5,3000 % DELL IN./EMC 19/29 REGS   | 200        |     | 100,70 | 185.822,11   | 0,10 |
| US013822AE11           | 5,5000 % ALCOA NEDER. 20/27 144A   | 400        |     | 98,10  | 362.070,49   | 0,19 |
| US541624AA07           | 5,8040 % LOMBARDIA, REGION 02/32   | 300        |     | 94,62  | 261.903,49   | 0,13 |
| US05581LAG41           | 5,8940 % BNP PARIBAS 23/34 FLR MTN | 250        | 250 | 102,46 | 236.348,96   | 0,12 |
| US92857WAQ33           | 6,1500 % VODAFONE GRP 07/37        | 300        |     | 104,73 | 289.896,66   | 0,15 |
| XS1055787680           | 6,2500 % NORDLB IS.S.1748 DL       | 400        |     | 99,71  | 367.986,71   | 0,19 |

|              |                                    |     |     |        |            |      |
|--------------|------------------------------------|-----|-----|--------|------------|------|
| US46115HBU05 | 7,0000 % INTESA SANP.22/25MTN 144A | 200 |     | 101,88 | 188.003,32 | 0,10 |
| USU46009AM50 | 7,0000 % IRON MOUNT. 23/29 REGS    | 130 |     | 102,12 | 122.486,44 | 0,06 |
| XS2725962638 | 7,8000 % INTESA SANP. 23/53 MTN    | 300 | 300 | 108,77 | 301.076,77 | 0,15 |
| USU2526DAE95 | 8,1000 % DELL INT./EMC 16/36 REGS  | 250 |     | 120,09 | 277.011,44 | 0,14 |
| US46115HBV87 | 8,2480 % INTESA SANP.22/33 FLR MTN | 300 |     | 108,76 | 301.060,16 | 0,15 |
| XS2695038401 | 8,5000 % ARCELIK 23/28 REGS        | 200 | 200 | 104,35 | 192.561,36 | 0,10 |
| US25156PAC77 | 8,7500 % DT.TELEK.INTL F. 00/30    | 300 |     | 117,87 | 326.268,68 | 0,17 |

#### Strukturierte Produkte

##### lautend auf EUR

|              |                                    |       |    |        |              |      |
|--------------|------------------------------------|-------|----|--------|--------------|------|
| XS0229808315 | 0,0000 % AUSTRIA 05/25 FLR MTN     | 1.450 |    | 96,81  | 1.403.788,50 | 0,72 |
| DE000BLB5GT7 | 0,0000 % BAY.LDSBK.OPF.R.20269 VAR | 350   |    | 97,15  | 340.025,00   | 0,17 |
| XS0224480722 | 0,0000 % EIB EUR.INV.BK 05/30 FLR  | 3.232 | 42 | 88,49  | 2.860.126,08 | 1,47 |
| IT0006592981 | 0,0000 % EUR. BK REC.DEV. 05-25FLR | 1.800 |    | 101,15 | 1.820.610,00 | 0,93 |
| XS0231106799 | 0,0000 % RABOBK NEDERLD05/25FLRMTN | 300   |    | 109,21 | 327.615,00   | 0,17 |
| IT0006596701 | 0,0000 % WORLD BK 05-25            | 932   |    | 101,19 | 943.097,01   | 0,48 |
| XS0224713254 | 1,0000 % AUSTRIA 05/25 FLR MTN     | 1.000 |    | 97,26  | 972.580,00   | 0,50 |

##### lautend auf DEM

|              |                        |     |  |        |            |      |
|--------------|------------------------|-----|--|--------|------------|------|
| DE0002115102 | 9,1120 % LBBW 97/27 DM | 800 |  | 150,02 | 613.627,97 | 0,31 |
|--------------|------------------------|-----|--|--------|------------|------|

##### lautend auf USD

|              |                                    |     |  |       |            |      |
|--------------|------------------------------------|-----|--|-------|------------|------|
| US5394E8CE78 | 0,0000 % LLOYDS BANK 13/33 FLR MTN | 300 |  | 63,10 | 174.671,53 | 0,09 |
|--------------|------------------------------------|-----|--|-------|------------|------|

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

#### Anleihen

##### lautend auf EUR

|              |                                 |       |     |        |              |      |
|--------------|---------------------------------|-------|-----|--------|--------------|------|
| XS0512125849 | 3,9000 % OEBB INFRAST 10/30 MTN | 1.000 |     | 104,72 | 1.047.240,00 | 0,54 |
| AT0000A37CU1 | 4,0000 % KOMM.AUS. 23/25        | 500   | 500 | 100,02 | 500.080,00   | 0,26 |
| MT0000013699 | 4,0000 % MALTA 23/43            | 500   |     | 100,92 | 504.595,00   | 0,26 |

##### lautend auf USD

|              |                                  |     |  |       |            |      |
|--------------|----------------------------------|-----|--|-------|------------|------|
| US013822AG68 | 4,1250 % ALCOA NEDER. 21/29 144A | 200 |  | 91,74 | 169.284,00 | 0,09 |
|--------------|----------------------------------|-----|--|-------|------------|------|

#### Strukturierte Produkte

##### lautend auf USD

|              |                                    |     |  |       |            |      |
|--------------|------------------------------------|-----|--|-------|------------|------|
| US83368WGR60 | 0,0000 % SOC GENERALE 2032 FLR MTN | 500 |  | 63,68 | 293.785,38 | 0,15 |
| US45905UPU24 | 0,0000 % WORLD BK 14/34 FLR MTN    | 300 |  | 62,19 | 172.154,46 | 0,09 |
| US45905UQU15 | 0,0000 % WORLD BK 2034 FLR MTN     | 786 |  | 63,45 | 460.170,44 | 0,24 |

#### Summe Wertpapiervermögen

**186.290.122,68 95,48**

BEZEICHNUNG

NOMINALE/  
KONTRAKTE

OPENING

CLOSING

KURS

KURSWERT  
IN EUR

ANTEIL  
IN %

#### Derivative Produkte

#### Devisentermingeschäfte

##### Abgeschlossen mit Raiffeisenlandesbank Oberösterreich

##### Verkauf

|                                 |    |            |  |  |            |      |
|---------------------------------|----|------------|--|--|------------|------|
| GBP/EUR Laufzeit bis 11.04.2024 | 2) | -700.000   |  |  | -6.955,01  | 0,00 |
| USD/EUR Laufzeit bis 26.04.2024 | 2) | -6.500.000 |  |  | 107.898,79 | 0,05 |

#### Finanzterminkontrakte

##### Zinsterminkontrakte

##### Gekaufte Kontrakte

##### lautend auf EUR

|                            |    |    |    |    |          |      |
|----------------------------|----|----|----|----|----------|------|
| EUR-BUXL FUTURE MAERZ 2024 | 3) | 15 | 25 | 10 | 4.800,00 | 0,00 |
|----------------------------|----|----|----|----|----------|------|

#### Summe Derivate

**105.743,78 0,05**

**Bankguthaben/Verbindlichkeiten**

|   |                     |             |
|---|---------------------|-------------|
| EUR   | 5.167.180,02        | 2,65        |
| nicht EU-Währungen                            | 18.884,45           | 0,01        |
| <b>Summe Bankguthaben / Verbindlichkeiten</b> | <b>5.186.064,47</b> | <b>2,66</b> |

**Sonstiges Vermögen**

|   |                     |             |
|---|---------------------|-------------|
| Ausstehende Zahlungen                             | 886.346,94          | 0,45        |
| Diverse Gebühren                                  | -19.628,19          | -0,01       |
| Einschüsse (Initial/Variation Margins)            | -4.800,00           | 0,00        |
| Zinsansprüche                                     | 2.667.789,70        | 1,37        |
| Zinsen Anlagekonten (inkl. negativer Habenzinsen) | 7.726,57            | 0,00        |
| <b>Summe sonstiges Vermögen</b>                   | <b>3.537.435,02</b> | <b>1,81</b> |

|                      |                       |               |
|----------------------|-----------------------|---------------|
| <b>Fondsvermögen</b> | <b>195.119.365,95</b> | <b>100,00</b> |
|----------------------|-----------------------|---------------|

- 2) Durch den Einsatz dieses Derivats wird das Gesamtrisiko des Fonds vermindert  
3) Durch den Einsatz dieses Derivats wird das Gesamtrisiko des Fonds erhöht

## Devisenkurse

Vermögenswerte in fremder Wahrung wurden zu folgenden Devisenkursen umgerechnet:

| WAHRUNG                | KURS       |
|-------------------------|------------|
| Deutsche Mark (DEM)     | 1,9558     |
| Britische Pfund (GBP)   | 0,8561     |
| Italienische Lire (ITL) | 1.936,2700 |
| US-Dollar (USD)         | 1,0838     |

Die Vermogensgegenstande des Sondervermogens sind auf der Grundlage von Kursen bzw. Marktsatzen per 28. Februar 2024 oder letztbekannte bewertet.

## Regeln fur die Vermogensbewertung

Der Wert eines Anteiles ergibt sich aus der Teilung des Gesamtwertes des Investmentfonds einschlielich der Ertragnisse durch die Zahl der ausgegebenen Anteile. Bei Investmentfonds mit mehreren Anteilschein κατηγοungen ergibt sich der Wert eines Anteiles einer Anteilschein κατηγοung aus der Teilung des Wertes einer Anteilschein κατηγοung einschlielich der Ertragnisse durch die Zahl der ausgegebenen Anteile dieser Anteilschein κατηγοung.

Der Gesamtwert des Investmentfonds ist aufgrund der jeweiligen Kurswerte der im Investmentfonds befindlichen Wertpapiere, Geldmarktinstrumente, Anteile an Investmentfonds und Bezugsrechte zuzuglich des Wertes der zum Investmentfonds gehorenden Finanzanlagen, Geldbetrage, Guthaben, Forderungen und sonstigen Rechte abzuglich Verbindlichkeiten, zu ermitteln.

Die Kurswerte der Vermogenswerte werden wie folgt ermittelt:

- Der Wert von Vermogenswerten, welche an einer Borse oder an einem anderen geregelten Markt notiert oder gehandelt werden, wird grundsatzlich auf der Grundlage des letzten verfugbaren Kurses ermittelt.
- Sofern ein Vermogenswert nicht an einer Borse oder an einem anderen geregelten Markt notiert oder gehandelt wird oder sofern fur einen Vermogenswert, welcher an einer Borse oder an einem anderen geregelten Markt notiert oder gehandelt wird, der Kurs den tatsachlichen Marktwert nicht angemessen widerspiegelt, wird auf die Kurse zuverlassiger Datenprovider oder alternativ auf Marktpreise gleichartiger Wertpapiere oder andere anerkannte Bewertungsmethoden zuruckgegriffen.
- Anteile an einem OGAW, OGA oder AIF werden mit den zuletzt verfugbaren Rucknahmepreisen bewertet bzw. sofern deren Anteile an Borsen oder geregelten Markten gehandelt werden (z.B. ETFs) mit den jeweils zuletzt verfugbaren Schlusskursen.
- Der Liquidationswert von Futures und Optionen, die an einer Borse oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden, wird auf der Grundlage des letzten verfugbaren Abwicklungspreises berechnet.

Zur Preisberechnung des Investmentfonds werden grundsatzlich die jeweils letzten veroffentlichten bzw. verfugbaren Kurse der vom Investmentfonds erworbenen Vermogenswerte herangezogen. Entspricht der letzte veroffentlichte Kurs aufgrund der politischen oder wirtschaftlichen Situation ganz offensichtlich und nicht nur im Einzelfall nicht den tatsachlichen Werten, so kann eine Preisberechnung fur den Investmentfonds unterbleiben, wenn dieser 5 % oder mehr seines Fondsvermogens in Vermogenswerte investiert hat, die keine bzw. keine marktkonformen Kurse aufweisen.

## Angaben zu Wertpapierfinanzierungsgeschaften gem. VO (EU) 2015/2365

In den Fondsbestimmungen des Investmentfonds werden Angaben zu unter diese Verordnung fallende Wertpapierfinanzierungsgeschafte (Pensionsgeschafte und Wertpapierleihgeschafte) gemacht, sodass grundsatzlich die Moglichkeit besteht, derartige Geschafte fur den Investmentfonds zu tatigen.

Die derzeitige Strategie des Investmentfonds sieht jedoch weder die Durchfuhrung von Pensions- oder Wertpapierleihgeschaften noch den Abschluss von Total Return Swaps (Gesamtrenditeswaps) oder vergleichbaren Derivatgeschaften vor.

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

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

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

**Wertpapiervermögen**

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

**Anleihen**

**lautend auf EUR**

|              |                                    |  |     |  |       |
|--------------|------------------------------------|--|-----|--|-------|
| IT0006527185 | 0,0000 % CEB 99-24                 |  |     |  | 2.137 |
| XS2225428809 | 0,0000 % EIB EUR.INV.BK 20/30 MTN  |  |     |  | 750   |
| IT0006527078 | 0,0000 % EUR. BK REC.DEV. 99-24    |  |     |  | 923   |
| XS2102988354 | 0,0000 % WORLD BK 20/27 MTN        |  |     |  | 330   |
| DE000CZ45VS1 | 0,0100 % COBA MTH S.P36            |  |     |  | 300   |
| XS2418730995 | 0,1250 % ING BANK 21/31 MTN        |  |     |  | 600   |
| XS1509009483 | 0,1250 % OBEROEST.LBK 16-23        |  |     |  | 300   |
| XS2055744689 | 0,1500 % EUROFIMA 19/34 MTN        |  |     |  | 1.060 |
| XS2289408440 | 0,1630 % NATL GRID 21/28 MTN       |  |     |  | 260   |
| XS2389757944 | 0,2000 % ANZ N.Z.INTL 21/27 MTN    |  |     |  | 220   |
| CH0520042489 | 0,2500 % UBS GROUP 20/26 FLR       |  |     |  | 220   |
| DK0030484548 | 0,3750 % NYKREDIT 21/28 MTN        |  |     |  | 500   |
| XS1880870602 | 0,3750 % SANTANDER UK 18/23 MTN    |  |     |  | 350   |
| FR0013455540 | 0,5000 % BPCE 19/27 MTN            |  |     |  | 500   |
| XS2171874519 | 0,5000 % NORDEA BANK 20/27 MTN     |  |     |  | 500   |
| DE000DHY4960 | 0,5000 % NORDLB MTN.HPF S.496      |  |     |  | 400   |
| AT0000A269M8 | 0,5000 % OESTERREICH 19/29 MTN     |  |     |  | 500   |
| ES0000012F43 | 0,6000 % SPANIEN 19/29             |  |     |  | 400   |
| XS1482736185 | 0,6250 % ATLAS COPCO 16/26 MTN     |  |     |  | 100   |
| DE000DHY5025 | 0,7500 % NORDLB MTN.HPF S.502      |  |     |  | 750   |
| XS2001737324 | 0,7500 % TELENOR 19/26 MTN         |  |     |  | 230   |
| XS1191309720 | 0,8750 % NATL AUSTR. BK 15/27 MTN  |  |     |  | 500   |
| FR0013457967 | 0,8750 % PRAEMIA HEAL 19/29        |  |     |  | 300   |
| XS1520344745 | 1,0000 % AUCKLAND, COUNC.17/27 MTN |  |     |  | 700   |
| FR0014004UE6 | 1,0000 % VALEO 21/28 MTN           |  |     |  | 300   |
| XS1614722806 | 1,1250 % CAIXABANK 17/24 MTN       |  |     |  | 500   |
| XS2441574089 | 1,1250 % ERICSSON 22/27 MTN        |  |     |  | 350   |
| XS1808482746 | 1,1250 % HANN RUECK NTS 18/28 REGS |  |     |  | 400   |
| PTBSRJOM0023 | 1,2500 % BANCO SANT.TO. 17/27 MTN  |  |     |  | 200   |
| DE000A180B80 | 1,3750 % ALLIANZ FIN. II 16/31 MTN |  |     |  | 400   |
| FR0013518537 | 1,3750 % EDENRED 20/29             |  |     |  | 300   |
| XS2180007549 | 1,6000 % AT + T INC. 20/28         |  |     |  | 200   |
| FR0013378452 | 1,7500 % ATOS 18-25                |  | 200 |  | 200   |
| XS1785340172 | 1,7500 % INTESA SAN. 18/28 MTN     |  |     |  | 100   |
| XS2724532333 | 10,5000 % AMS-OSRAM 23/29 REGS     |  | 100 |  | 100   |
| XS1968706108 | 2,0000 % CREDIT AGR. 19/29 MTN     |  |     |  | 300   |
| DE000NRW0NF8 | 2,0000 % LAND NRW MTN.LSA 22/32    |  |     |  | 450   |
| AT0000A1PLB1 | 3,0500 % RLBK OBEROESTERR.16-23FLR |  |     |  | 500   |
| FR001400L933 | 3,6250 % CIE FIN.FONC 23/29 MTN    |  | 200 |  | 200   |
| XS2537251170 | 3,7500 % AXA S.A. 22/30 MTN        |  |     |  | 330   |
| XS2530444624 | 3,8750 % FRESE.MED.CARE MTN 22/27  |  |     |  | 600   |
| IT0005544082 | 4,3500 % ITALIEN 23/33             |  |     |  | 1.000 |
| FR001400F5F6 | 4,3750 % BQUE POSTALE 23/30 MTN    |  |     |  | 700   |
| XS2532473555 | 4,5650 % SMITH+NEPHEW 22/29        |  |     |  | 100   |
| XS1953271225 | 4,7390 % UNICREDIT 19/29 FLR MTN   |  |     |  | 300   |
| XS2625196352 | 4,8750 % INTESA SANP. 23/30 MTN    |  |     |  | 360   |
| FI4000562202 | 5,1250 % HUHTAMAEMI 23/28          |  | 100 |  | 100   |
| XS2655993033 | 5,2500 % REXEL 23/30               |  | 100 |  | 100   |
| XS2577033553 | 7,1250 % RAIFFEISENBK 23/26FLR MTN |  |     |  | 100   |

**lautend auf DEM**

|              |                            |  |  |  |       |
|--------------|----------------------------|--|--|--|-------|
| DE0004123500 | 6,5000 % OESTERREICH 94/24 |  |  |  | 3.945 |
|--------------|----------------------------|--|--|--|-------|

**lautend auf NLG**

|              |                        |  |  |  |       |
|--------------|------------------------|--|--|--|-------|
| NL0000133924 | 6,2500 % AUSTRIA 94-24 |  |  |  | 1.900 |
|--------------|------------------------|--|--|--|-------|

**lautend auf USD**

|              |                                 |  |  |  |     |
|--------------|---------------------------------|--|--|--|-----|
| US05947LBA52 | 4,3750 % BCO BRADESCO 22/27 MTN |  |  |  | 310 |
|--------------|---------------------------------|--|--|--|-----|

| <i>BEZEICHNUNG</i>   | <i>OPENING</i>            | <i>CLOSING</i>            |
|--|---------------------------|---------------------------|
|  | <i>KONTRAKTE/NOMINALE</i> | <i>KONTRAKTE/NOMINALE</i> |
| <b>Derivative Produkte</b>                                   |                           |                           |
| <b>Devisentermingeschäfte</b>                                |                           |                           |
| <b>Abgeschlossen mit Raiffeisenlandesbank Oberösterreich</b> |                           |                           |
| <b>Verkauf</b>   |                           |                           |
| GBP/EUR Laufzeit bis 15.12.2023                              |                           | 600.000                   |
| USD/EUR Laufzeit bis 20.10.2023                              |                           | 6.400.000                 |
| USD/EUR Laufzeit bis 20.10.2023                              |                           | 700.000                   |
| <b>Finanzterminkontrakte</b>                                 |                           |                           |
| <b>Zinsterminkontrakte</b>                                   |                           |                           |
| <b>Gekaufte Kontrakte</b>                                    |                           |                           |
| <b>lautend auf EUR</b>                                       |                           |                           |
| EUR-BUXL FUTURE DEZEMBER 2023                                | 25                        | 25                        |
| EUR-BUXL FUTURE SEPTEMBER 2023                               |                           | 25                        |



## Zusammensetzung des Fondsvermögens per 29.02.2024

| Wertpapiervermögen  | EUR                   | %             |
|---|-----------------------|---------------|
| <b>Zum amtlichen Handel oder einem anderen geregelten Markt zugelassene Wertpapiere</b>       |                       |               |
| Anleihen  | 173.686.672,31        | 89,02         |
| Strukturierte Produkte  | 9.456.141,09          | 4,85          |
| <b>Nicht zum amtlichen Handel oder einem anderen geregelten Markt zugelassene Wertpapiere</b> |                       |               |
| Anleihen  | 2.221.199,00          | 1,14          |
| Strukturierte Produkte  | 926.110,28            | 0,47          |
| <b>Summe Wertpapiervermögen</b>   | <b>186.290.122,68</b> | <b>95,48</b>  |
| <b>Derivative Produkte</b>  |                       |               |
|   | EUR                   | %             |
| Devisentermingeschäfte  | 100.943,78            | 0,05          |
| Finanzterminkontrakte   | 4.800,00              | 0,00          |
| <b>Summe derivative Produkte</b>  | <b>105.743,78</b>     | <b>0,05</b>   |
| <b>Bankguthaben/Verbindlichkeiten</b>   |                       |               |
|   | EUR                   | %             |
| <b>Summe Bankguthaben/Verbindlichkeiten</b>   | <b>5.186.064,47</b>   | <b>2,66</b>   |
| <b>Sonstiges Vermögen</b>   |                       |               |
|   | EUR                   | %             |
| <b>Summe Sonstiges Vermögen</b>   | <b>3.537.435,02</b>   | <b>1,81</b>   |
| <b>FOND S V E R M Ö G E N</b>   | <b>195.119.365,95</b> | <b>100,00</b> |

KEPLER-FONDS Kapitalanlagegesellschaft m.b.H.

Andreas Lassner-Klein

Dr. Michael Bumberger