

Raiffeisen-GlobalAllocation-StrategiesPlus

Halbjahresbericht

Berichtszeitraum 01.04.2020 – 30.09.2020

Inhaltsverzeichnis

Allgemeine Fondsdaten	3
Fondscharakteristik	3
Besondere Hinweise im Verlauf des Berichtszeitraumes	3
Rechtlicher Hinweis	4
Fondsdetails	5
Umlaufende Anteile	5
Bericht zur Anlagepolitik des Fonds	6
Zusammensetzung des Fondsvermögens in EUR	7
Vermögensaufstellung in EUR per 30.09.2020	9
Anhang	25

Bericht über den Berichtszeitraum vom 01.04.2020 bis 30.09.2020

Allgemeine Fondsdaten

ISIN	Tranche	Ertragstyp	Währung	Auflegedatum
AT0000A0SE09	Raiffeisen-GlobalAllocation-StrategiesPlus (R) A	Ausschüttung	EUR	16.01.2012
AT0000A1Z3C4	Raiffeisen-GlobalAllocation-StrategiesPlus (RZ) A	Ausschüttung	EUR	01.12.2017
AT0000A0SDY6	Raiffeisen-GlobalAllocation-StrategiesPlus (I) T	Thesaurierung	EUR	16.01.2012
AT0000A090H8	Raiffeisen-GlobalAllocation-StrategiesPlus (S) T	Thesaurierung	EUR	04.04.2008
AT0000A0SE17	Raiffeisen-GlobalAllocation-StrategiesPlus (R) T	Thesaurierung	EUR	16.01.2012
AT0000A1Z3D2	Raiffeisen-GlobalAllocation-StrategiesPlus (RZ) T	Thesaurierung	EUR	01.12.2017
AT0000A0SDZ3	Raiffeisen-GlobalAllocation-StrategiesPlus (I) VTA	Vollthesaurierung Ausland	EUR	16.01.2012
AT0000A0SE25	Raiffeisen-GlobalAllocation-StrategiesPlus (R) VTA	Vollthesaurierung Ausland	EUR	16.01.2012
AT0000A1YBX8	Raiffeisen-GlobalAllocation-StrategiesPlus (RZ) VTA	Vollthesaurierung Ausland	EUR	01.12.2017

Fondscharakteristik

Fondswährung	EUR
Rechnungsjahr	01.04. – 31.03.
Ausschüttungs- / Auszahlungs- / Wieder- veranlagungstag	15.06.
Fondsbezeichnung	Investmentfonds gemäß § 2 InvFG (OGAW)
effektive Verwaltungsgebühr des Fonds	I-Tranche (EUR): 0,900 % (exklusiv einer allfälligen erfolgsabhängigen Gebühr) S-Tranche (EUR): 1,100 % R-Tranche (EUR): 1,800 % (exklusiv einer allfälligen erfolgsabhängigen Gebühr) RZ-Tranche (EUR): 0,900 % (exklusiv einer allfälligen erfolgsabhängigen Gebühr) Performanceabhängige Verwaltungsgebühren: Details siehe unten
max. Verwaltungsgebühr der Subfonds	1,750 % (exklusiv einer allfälligen erfolgsabhängigen Gebühr)
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

Besondere Hinweise im Verlauf des Berichtszeitraumes

Änderung bei Segmenten	31.07.2020: Auflösung Raiffeisen-GlobalAllocation-StrategiesPlus Segment EMA
------------------------	--

Performanceabhängige Verwaltungsgebühren

Zusätzlich erhält die Verwaltungsgesellschaft für die Anteilscheingattungen Tranche R, RZ und I jährlich eine variable Erfolgsgebühr. Die variable Erfolgsgebühr beträgt unter Berücksichtigung einer sogenannten „High-Water-Mark“ maximal 15 v. H. jener Wertentwicklung des Fonds, die über dem ICE BofA German Government Bill Index (vormals Merrill Lynch German Government Bill Index) plus drei Prozent (wobei diese Prozentangabe absolut zu verstehen ist und von der Wertentwicklung des Fonds, die über dem Index liegt, in Abzug zu bringen ist) liegt. Die „High-Water-Mark“ entspricht dabei dem Anteilswert an jenem Rechnungsjahresende, zu dem zuletzt eine variable Erfolgsgebühr ausbezahlt wurde. Für eine Wertentwicklung, die unter der „High-Water-Mark“ liegt, wird keine variable Erfolgsgebühr verrechnet.

Diese variable Erfolgsgebühr wird auf Basis des durchschnittlichen Fondsvolumens täglich abgegrenzt und beeinflusst erfolgswirksam den täglich ermittelten Rechenwert. Während des Rechnungsjahres kommt es je nach Performanceverlauf des Fonds auf einem Abgrenzungskonto zu Zu- und Abbuchungen, wobei die Summe der Abbuchungen im Rechnungsjahr die Summe der Zubuchungen nicht übersteigen darf. Bei der Ermittlung des Rechenwertes und der Wertentwicklung wird die OEKB-Methode angewandt, die von einer Wiederveranlagung eventueller Auszahlungen oder Ausschüttungen ausgeht. Die liquiditätswirksame Auszahlung der variablen Erfolgsgebühr erfolgt durch den Fonds jährlich nach Ende des Rechnungsjahres zum Monatsultimo des Folgemonats.

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 Performance wird von der Raiffeisen KAG entsprechend der OeKB-Methode, basierend auf Daten der Depotbank, berechnet (bei der Aussetzung der Auszahlung des Rückgabepreises unter Rückgriff auf allfällige, indikative Werte). Bei der Berechnung der Wertentwicklung werden individuelle Kosten, und zwar der Ausgabeaufschlag (maximal 5,00 % des investierten Betrages) bzw. ein allfälliger Rücknahmeabschlag (maximal 0,00 % des verkauften Betrages), nicht berücksichtigt. Diese wirken sich bei Berücksichtigung in Abhängigkeit der konkreten Höhe entsprechend mindernd auf die Wertentwicklung aus. Performanceergebnisse der Vergangenheit lassen 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-GlobalAllocation-StrategiesPlus für den Berichtszeitraum vom 01.04.2020 bis 30.09.2020 vorzulegen. Dem Rechnungsabschluss wurde die Preisberechnung vom 30.09.2020 zu Grunde gelegt.

Fondsdetails

	31.03.2020	30.09.2020
Fondsvermögen gesamt in EUR	148.406.724,89	83.052.418,73
errechneter Wert / Ausschüttungsanteile (R) (AT0000A0SE09) in EUR	135,07	146,19
Ausgabepreis / Ausschüttungsanteile (R) (AT0000A0SE09) in EUR	141,82	153,50
errechneter Wert / Ausschüttungsanteile (RZ) (AT0000A1Z3C4) in EUR	98,78	106,75
Ausgabepreis / Ausschüttungsanteile (RZ) (AT0000A1Z3C4) in EUR	98,78	106,75
errechneter Wert / Thesaurierungsanteile (I) (AT0000A0SDY6) in EUR	153,30	168,14
Ausgabepreis / Thesaurierungsanteile (I) (AT0000A0SDY6) in EUR	160,97	176,55
errechneter Wert / Thesaurierungsanteile (S) (AT0000A090H8) in EUR	151,39	167,79
Ausgabepreis / Thesaurierungsanteile (S) (AT0000A090H8) in EUR	158,96	176,18
errechneter Wert / Thesaurierungsanteile (R) (AT0000A0SE17) in EUR	143,99	157,31
Ausgabepreis / Thesaurierungsanteile (R) (AT0000A0SE17) in EUR	151,19	165,18
errechneter Wert / Thesaurierungsanteile (RZ) (AT0000A1Z3D2) in EUR	100,27	109,86
Ausgabepreis / Thesaurierungsanteile (RZ) (AT0000A1Z3D2) in EUR	100,27	109,86
errechneter Wert / Vollthesaurierungsanteile (I) (AT0000A0SDZ3) in EUR	153,96	168,76
Ausgabepreis / Vollthesaurierungsanteile (I) (AT0000A0SDZ3) in EUR	161,66	177,20
errechneter Wert / Vollthesaurierungsanteile (R) (AT0000A0SE25) in EUR	143,07	156,01
Ausgabepreis / Vollthesaurierungsanteile (R) (AT0000A0SE25) in EUR	150,22	163,81
errechneter Wert / Vollthesaurierungsanteile (RZ) (AT0000A1YBX8) in EUR	100,41	110,13
Ausgabepreis / Vollthesaurierungsanteile (RZ) (AT0000A1YBX8) in EUR	100,41	110,13

Umlaufende Anteile

	Umlaufende Anteile am 31.03.2020	Absätze	Rücknahmen	Umlaufende Anteile am 30.09.2020
AT0000A0SE09 (R) A	3.904,151	70,069	0,000	3.974,220
AT0000A1Z3C4 (RZ) A	704,688	8.328,803	0,000	9.033,491
AT0000A0SDY6 (I) T	730,834	0,000	0,000	730,834
AT0000A090H8 (S) T	753.342,663	11.090,040	-536.545,330	227.887,373
AT0000A0SE17 (R) T	72.304,377	2.526,742	-1.027,162	73.803,957
AT0000A1Z3D2 (RZ) T	27,422	8,840	0,000	36,262
AT0000A0SDZ3 (I) VTA	131.419,460	26.030,844	-4.970,797	152.479,507
AT0000A0SE25 (R) VTA	20.928,166	17.902,906	-1.672,565	37.158,507
AT0000A1YBX8 (RZ) VTA	10,000	0,000	0,000	10,000
Gesamt umlaufende Anteile				505.114,151

Bericht zur Anlagepolitik des Fonds

In der strategischen Ausrichtung des Fonds erfolgten folgende wesentliche Änderungen: Im April 2020 wurden italienische Staatsanleihen ins Portfolio aufgenommen und nach starker Performance teilweise im Juni 2020 und gänzlich im September 2020 verkauft.

Außerdem erfolgte Ende des 2. Quartals 2020 eine spürbare Reduktion des Aktienexposures sowie eine geringfügige Absenkung des Gewichts von Schwellenländeranleihen sowie von schlechter gerateten Unternehmensanleihen (High-Yield). Weiters wurde eine geringfügige Reduktion der Zielgewichtung bei Rohstofffutures sowie bei inflationsgeschützten Anleihen umgesetzt.

Ende des 3. Quartals 2020 wurden neuerlich Rohstofffutures geringfügig reduziert. Im Gegenzug wurde bei inflationsgeschützten Anleihen eine Aufstockung vorgenommen.

Durch die kürzerfristig orientierten aktiven Strategien schwankte die Gesamtaktienquote des Fonds zwischen ca. 15 % und 34 %.

Um Zusatzerträge 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	9.960.346,41	11,99 %
Anleihen fix		USD	7.701.092,49	9,27 %
Summe Anleihen fix			17.661.438,90	21,27 %
Exchange-traded-funds	OGAW	EUR	1.108.903,23	1,34 %
Summe Exchange-traded-funds			1.108.903,23	1,34 %
Investmentzertifikate Raiffeisen KAG	OGAW	EUR	840.526,40	1,01 %
Summe Investmentzertifikate Raiffeisen KAG			840.526,40	1,01 %
Investmentzertifikate extern	OGAW	EUR	4.490.554,45	5,41 %
Summe Investmentzertifikate extern			4.490.554,45	5,41 %
Strukturierte Produkte - Inflationsgebundene Anleihen		EUR	28.343.646,58	34,13 %
Strukturierte Produkte - Inflationsgebundene Anleihen		USD	12.671.827,47	15,26 %
Summe Strukturierte Produkte - Inflationsgebundene Anleihen			41.015.474,05	49,39 %
Summe Wertpapiervermögen			65.116.897,03	78,40 %
Derivative Produkte				
Bewertung Finanzterminkontrakte			-897.654,85	-1,08 %
Bewertung Devisentermingeschäfte			-137.638,36	-0,17 %
Optionen			169.556,09	0,21 %
Summe Derivative Produkte			-865.737,12	-1,04 %
Bankguthaben/-verbindlichkeiten				
Bankguthaben/-verbindlichkeiten in Fondswährung			11.456.242,51	13,79 %
Bankguthaben/-verbindlichkeiten in Fremdwährung			3.642.335,19	4,38 %
Festgeld in Fondswährung			4.000.000,00	4,82 %
Summe Bankguthaben/-verbindlichkeiten			19.098.577,70	23,00 %

Wertpapierart	OGAW/§ 166	Währung	Kurswert in EUR	Anteil am Fondsvermögen
Abgrenzungen				
Zinsenansprüche (aus Wertpapieren und Bankguthaben)			107.230,94	0,13 %
Cash Collateral Zinsen gegeben			68,54	0,00 %
Cash Collateral Zinsen erhalten			-103,83	-0,00 %
Dividendenforderungen			19.871,15	0,02 %
Summe Abgrenzungen			127.066,80	0,15 %
Sonstige Verrechnungsposten				
Diverse Gebühren			-584.385,69	-0,70 %
Summe Sonstige Verrechnungsposten			-584.385,69	-0,70 %
Cash Collateral				
Forderungen aus gegebenen Sicherheiten			160.000,00	0,19 %
Summe Cash Collateral			160.000,00	0,19 %
Summe Fondsvermögen			83.052.418,73	100,00 %

Vermögensaufstellung in EUR per 30.09.2020

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 Stk./Nom.	Pool-/ILB-Faktor	Kurs	Kurswert in EUR	Anteil am Fondsvermögen
Anleihen fix		XS2055646918	ABBVIE INC ABBV 0 3/4 11/18/27	EUR	100.000				102,203760	102.203,76	0,12 %
Anleihen fix		XS2025480596	ABERTIS INFRAESTRUCTURAS ABESM 1 5/8 07/15/29	EUR	100.000				97,740010	97.740,01	0,12 %
Anleihen fix		FR0013505559	AIR LIQUIDE FINANCE AIFP 1 04/02/25	EUR	100.000				104,724500	104.724,50	0,13 %
Anleihen fix		XS2166122486	AIR PRODUCTS & CHEMICALS APD 0.8 05/05/32	EUR	100.000	100.000			102,409050	102.409,05	0,12 %
Anleihen fix		XS2017324844	ALFA LAVAL TREASURY INTL ALFASS 0 1/4 06/25/24	EUR	100.000				99,279000	99.279,00	0,12 %
Anleihen fix		FR0013453040	ALSTOM SA ALOFP 0 1/4 10/14/26	EUR	100.000	100.000			98,778500	98.778,50	0,12 %
Anleihen fix		XS2123371887	AMERICAN HONDA FINANCE HND A 1.6 04/20/22	EUR	100.000	100.000			102,462500	102.462,50	0,12 %
Anleihen fix		XS1686846061	ANGLO AMERICAN CAPITAL AALLN 1 5/8 09/18/25	EUR	100.000				104,669600	104.669,60	0,13 %
Anleihen fix		BE6320936287	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/ ABIBB 3.7 04/02/40	EUR	100.000	200.000	100.000		127,992670	127.992,67	0,15 %
Anleihen fix		XS2079716937	APPLE INC AAPL 0 1/2 11/15/31	EUR	100.000				103,617360	103.617,36	0,12 %
Anleihen fix		XS1196380031	AT&T INC T 2.45 03/15/35	EUR	100.000				111,194110	111.194,11	0,13 %
Anleihen fix		XS2063247915	BANCO SANTANDER SA SANTAN 0.3 10/04/26	EUR	100.000				100,706670	100.706,67	0,12 %
Anleihen fix		XS1458405898	BANK OF AMERICA CORP BAC 0 3/4 07/26/23	EUR	100.000				101,918580	101.918,58	0,12 %
Anleihen fix		DE000A289DC9	BASF SE BASGR 0 1/4 06/05/27	EUR	100.000	100.000			101,256610	101.256,61	0,12 %
Anleihen fix		XS2153597518	BAT NETHERLANDS FINANCE BATSLN 3 1/8 04/07/28	EUR	100.000	200.000	100.000		114,555580	114.555,58	0,14 %
Anleihen fix		XS2199266698	BAYER AG BAYNGR 1 3/8 07/06/32	EUR	100.000	100.000			102,152000	102.152,00	0,12 %
Anleihen fix		XS1139688268	BG ENERGY CAPITAL PLC BGGRP 1 1/4 11/21/22	EUR	100.000				102,073600	102.073,60	0,12 %
Anleihen fix		XS1309436753	BHP BILLITON FINANCE LTD BHP 4 3/4 04/22/76	EUR	100.000				102,036000	102.036,00	0,12 %
Anleihen fix		XS2055728054	BMW FINANCE NV BMW 0 3/8 09/24/27	EUR	100.000				100,870500	100.870,50	0,12 %
Anleihen fix		FR0013398070	BNP PARIBAS BNP 2 1/8 01/23/27	EUR	100.000				108,353030	108.353,03	0,13 %
Anleihen fix		XS2193662728	BP CAPITAL MARKETS PLC BPLN 3 5/8 PERP	Y EUR	100.000	100.000			102,687500	102.687,50	0,12 %
Anleihen fix		XS1881574591	CIE DE SAINT-GOBAIN SGOPF 0 7/8 09/21/23	EUR	100.000				102,545940	102.545,94	0,12 %
Anleihen fix		XS2233154538	COCA-COLA CO/THE KO 0 1/8 03/15/29	EUR	100.000	100.000			99,285000	99.285,00	0,12 %
Anleihen fix		XS2114852218	COMCAST CORP CMCSA 0 1/4 05/20/27	EUR	100.000				100,106980	100.106,98	0,12 %
Anleihen fix		FR0013508512	CREDIT AGRICOLE SA ACAFP 1 04/22/26	EUR	100.000	200.000	100.000		102,682310	102.682,31	0,12 %
Anleihen fix		XS2169281487	CRH FUNDING CRHID 1 5/8 05/05/30	EUR	100.000	100.000			108,860670	108.860,67	0,13 %
Anleihen fix		FR0013264421	CTE CO TRANSP ELEC CTEFRA 1 1/2 07/29/28	EUR	100.000				108,392930	108.392,93	0,13 %
Anleihen fix		DE000A2R9ZT1	DAIMLER INTL FINANCE BV DAIGR 0 1/4 11/06/23	EUR	100.000				99,828020	99.828,02	0,12 %
Anleihen fix		XS2010039035	DEUTSCHE BAHN FIN GMBH DBHNGR 0.95 PERP	Y EUR	100.000				98,349670	98.349,67	0,12 %
Anleihen fix		XS1734533372	DEUTSCHE POST AG DPWGR 1 12/13/27	EUR	50.000				105,767500	52.883,75	0,06 %
Anleihen fix		XS1858856740	DEUTSCHE TELEKOM INT FIN DT 2.2 07/25/33	EUR	100.000				112,809000	112.809,00	0,14 %

Berichtszeitraum 01.04.2020 – 30.09.2020

Raiffeisen-GlobalAllocation-StrategiesPlus

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		XS2050404636	DH EUROPE FINANCE DHR 0.2 03/18/26	EUR	100.000				99,641130	99.641,13	0,12 %
Anleihen fix		XS1896660989	DIAGEO FINANCE PLC DGELN 1 04/22/25	EUR	100.000				104,801300	104.801,30	0,13 %
Anleihen fix		XS1979262448	DNB BANK ASA DNBNO 0 1/4 04/09/24	EUR	100.000				101,231100	101.231,10	0,12 %
Anleihen fix		XS2077546682	E.ON SE EOANGR 0 5/8 11/07/31	EUR	100.000				101,107050	101.107,05	0,12 %
Anleihen fix		XS2075938006	ELI LILLY & CO LLY 1.7 11/01/49	EUR	100.000				109,260010	109.260,01	0,13 %
Anleihen fix		BE0002276450	ELJA TRANSMISSION BE ELIATB 1 3/8 04/07/27	EUR	100.000				105,861000	105.861,00	0,13 %
Anleihen fix		XS1044811591	ENBW ENBW 3 5/8 04/02/76	EUR	100.000	100.000			101,470000	101.470,00	0,12 %
Anleihen fix		XS2066706818	ENEL FINANCE INTL NV ENELIM 0 06/17/24	EUR	100.000				99,769950	99.769,95	0,12 %
Anleihen fix		FR0013245859	ENGIE SA ENGIFP 0 7/8 03/27/24	EUR	100.000				103,242120	103.242,12	0,12 %
Anleihen fix		XS2034622048	EP INFRASTRUCTURE AS ENAPHO 1.698 07/30/26	EUR	100.000				100,950980	100.950,98	0,12 %
Anleihen fix		FR0013516077	ESSILORLUXOTTICA EFFP 0 1/2 06/05/28	EUR	100.000	100.000			102,169330	102.169,33	0,12 %
Anleihen fix		XS2196322312	EXXON MOBIL CORPORATION XOM 0.524 06/26/28	EUR	100.000	100.000			100,485000	100.485,00	0,12 %
Anleihen fix		XS2231792586	FCA BANK SPA IRELAND FCABNK 0 1/2 09/18/23	EUR	100.000	100.000			99,863000	99.863,00	0,12 %
Anleihen fix		XS1843435923	FIDELITY NATL INFO SERV FIS 2 05/21/30	EUR	100.000	100.000			110,398860	110.398,86	0,13 %
Anleihen fix		XS2101357072	FRESENIUS SE & CO KGAA FREGR 0 3/4 01/15/28	EUR	100.000				100,537500	100.537,50	0,12 %
Anleihen fix		XS1612542826	GENERAL ELECTRIC CO GE 0 7/8 05/17/25	EUR	100.000				99,412030	99.412,03	0,12 %
Anleihen fix		XS2170609403	GLAXOSMITHKLINE CAPITAL GSK 0 1/8 05/12/23	EUR	100.000	300.000	200.000		100,715970	100.715,97	0,12 %
Anleihen fix		XS2228892860	GLENCORE CAP FIN DAC GLENLN 1 1/8 03/10/28	EUR	100.000	100.000			99,151000	99.151,00	0,12 %
Anleihen fix		XS1810653540	HEIDELBERGCEMENT FIN LUX HEIGR 1 3/4 04/24/28	EUR	100.000				105,163880	105.163,88	0,13 %
Anleihen fix		XS2168630205	HEINEKEN NV HEIANA 1 3/4 05/07/40	EUR	130.000	130.000			104,882500	136.347,25	0,16 %
Anleihen fix		XS1685589027	HYPO VORARLBERG BANK AG VORHYP 0 5/8 09/19/22	EUR	100.000				100,262000	100.262,00	0,12 %
Anleihen fix		XS1721244371	IBERDROLA INTL BV IBESM 1 7/8 PERP	Y EUR	100.000	200.000	100.000		100,408330	100.408,33	0,12 %
Anleihen fix		XS1797138960	IBERDROLA INTL BV IBESM 2 5/8 PERP	Y EUR	100.000	100.000			103,411670	103.411,67	0,12 %
Anleihen fix		XS2115091808	IBM CORP IBM 0.65 02/11/32	EUR	100.000				99,970550	99.970,55	0,12 %
Anleihen fix		XS1935128956	IMMOFINANZ AG IIAAV 2 5/8 01/27/23	EUR	100.000				100,831670	100.831,67	0,12 %
Anleihen fix		XS1951313763	IMPERIAL BRANDS FIN PLC IMBLN 2 1/8 02/12/27	EUR	100.000				106,244090	106.244,09	0,13 %
Anleihen fix		XS2194283839	INFINEON TECHNOLOGIES AG IFXGR 1 5/8 06/24/29	EUR	100.000	100.000			104,046500	104.046,50	0,13 %
Anleihen fix		XS1595704872	INNOGY FINANCE BV IGYGY 1 04/13/25	EUR	100.000				104,212300	104.212,30	0,13 %
Anleihen fix		XS2123320033	JPMORGAN CHASE & CO JPM 0.389 02/24/28	EUR	100.000	200.000	100.000		98,806760	98.806,76	0,12 %
Anleihen fix		XS2042667944	KERRY GROUP FIN SERVICES KYGID 0 5/8 09/20/29	EUR	100.000				101,251500	101.251,50	0,12 %
Anleihen fix		XS2150015555	KONINKLIJKE AHOLD DLHAIZE ADNA 1 3/4 04/02/27	EUR	100.000				109,900000	109.900,00	0,13 %
Anleihen fix		XS2149368529	KONINKLIJKE PHILIPS NV PHIANA 1 3/8 03/30/25	EUR	100.000				105,517500	105.517,50	0,13 %
Anleihen fix		XS1072249045	LB BADEN-WUERTTEMBERG LBBW 2 7/8 05/27/26	EUR	100.000				99,409000	99.409,00	0,12 %
Anleihen fix		XS1362384262	LINDE INC/CT LIN 1.2 02/12/24	EUR	100.000				104,488130	104.488,13	0,13 %
Anleihen fix		FR0013257615	LVMH MOET HENNESSY VUITT MCFP 0 3/8 05/26/22	EUR	100.000				100,756890	100.756,89	0,12 %
Anleihen fix		XS1403264374	MCDONALD'S CORP MCD 1 11/15/23	EUR	100.000				103,426600	103.426,60	0,12 %
Anleihen fix		XS2238789460	MEDTRONIC GLOBAL HLDINGS MDT 0 3/8 10/15/28	EUR	100.000	100.000			100,229000	100.229,00	0,12 %
Anleihen fix		XS2023644201	MERCK FIN SERVICES GMBH MRKGR 0 3/8 07/05/27	EUR	100.000				101,829220	101.829,22	0,12 %
Anleihen fix		FR0013425139	MMS USA INVESTMENTS INC PUBFP 0 5/8 06/13/25	EUR	100.000				100,519260	100.519,26	0,12 %
Anleihen fix		XS0764278528	MUNICH RE MUNRE 6 1/4 05/26/42	EUR	100.000				109,051320	109.051,32	0,13 %
Anleihen fix		XS2170362912	NESTLE FINANCE INTL LTD NESNVX 0 3/8 05/12/32	EUR	100.000	100.000			101,896420	101.896,42	0,12 %
Anleihen fix		XS2235996217	NOVARTIS FINANCE SA NOVNVX 0 09/23/28	EUR	100.000	100.000			99,600000	99.600,00	0,12 %
Anleihen fix		XS1294342792	OMV AG OMVAV 5 1/4 PERP	Y EUR	100.000	100.000	50.000		104,483470	104.483,47	0,13 %
Anleihen fix		XS2013539635	OPTUS FINANCE PTY LTD SGTPT 1 06/20/29	EUR	100.000				103,381500	103.381,50	0,12 %
Anleihen fix		FR0013359197	ORANGE SA ORAFP 1 09/12/25	EUR	100.000				104,418320	104.418,32	0,13 %
Anleihen fix		XS2035474126	PHILIP MORRIS INTL INC PM 0.8 08/01/31	EUR	100.000				98,749280	98.749,28	0,12 %
Anleihen fix		FR0013448669	RCI BANQUE SA RENAUL 0 1/4 03/08/23	EUR	100.000				97,526000	97.526,00	0,12 %
Anleihen fix		FR0013409844	SANOFI SANFP 0 7/8 03/21/29	EUR	100.000				107,109430	107.109,43	0,13 %
Anleihen fix		DE000A2G8VT5	SAP SE SAPGR 1 03/13/26	EUR	100.000				105,714510	105.714,51	0,13 %
Anleihen fix		XS2170384130	SHELL INTERNATIONAL FIN RDSALN 0 1/2 05/11/24	EUR	100.000	100.000			102,154500	102.154,50	0,12 %

Wertpapierart	OGAW/§ 166	ISIN	Wertpapierbezeichnung	Währung	Bestand Stk./Nom.	Käufe im Berichtszeitraum Stk./Nom.	Verkäufe	Pool-/ILB-Faktor	Kurs	Kurswert in EUR	Anteil am Fondsvermögen
Anleihen fix		XS2182054887	SIEMENS FINANCIERINGSMAT SIEGR 0 3/8 06/05/26	EUR	100.000	100.000			102,066190	102.066,19	0,12 %
Anleihen fix		FR0013430733	SOCIETE GENERALE SOCGEN 0 7/8 07/01/26	EUR	100.000				100,809210	100.809,21	0,12 %
Anleihen fix		BE6282459609	SOLVAY SA SOLBBB 1 5/8 12/02/22	EUR	100.000				103,100420	103.100,42	0,12 %
Anleihen fix		XS1582205040	STATKRAFT AS STATK 1 1/8 03/20/25	EUR	100.000				104,611010	104.611,01	0,13 %
Anleihen fix		XS2197349645	TAKEDA PHARMACEUTICAL TACHEM 1 3/8 07/09/32	EUR	100.000	100.000			103,600310	103.600,31	0,12 %
Anleihen fix		XS2197675288	TELEFONICA EMISIONES SAU TELEFO 1.864 07/13/40	EUR	100.000	100.000			104,049150	104.049,15	0,13 %
Anleihen fix		XS1953240261	TELIA CO AB TELIAS 2 1/8 02/20/34	EUR	100.000				115,037190	115.037,19	0,14 %
Anleihen fix		XS1828037587	TENNET HOLDING BV TENN 1 3/8 06/05/28	EUR	100.000				109,443690	109.443,69	0,13 %
Anleihen fix		XS1651071877	THERMO FISHER SCIENTIFIC TMO 1.4 01/23/26	EUR	100.000				106,311250	106.311,25	0,13 %
Anleihen fix		XS1974787480	TOTAL SE TOTAL 1 3/4 PERP	Y EUR	200.000	200.000	200.000		100,173330	200.346,66	0,24 %
Anleihen fix		XS1884740041	TOYOTA MOTOR FINANCE BV TOYOTA 0 5/8 09/26/23	EUR	100.000				102,018100	102.018,10	0,12 %
Anleihen fix		XS2147133495	UNILEVER NV UNANA 1 1/4 03/25/25	EUR	100.000				105,817330	105.817,33	0,13 %
Anleihen fix		XS2133390521	VATTENFALL AB VATFAL 0.05 10/15/25	EUR	100.000				100,102020	100.102,02	0,12 %
Anleihen fix		XS2152062209	VOLKSWAGEN FIN SERV AG VW 3 04/06/25	EUR	150.000	250.000	100.000		109,616200	164.424,30	0,20 %
Anleihen fix		US045167ER09	ASIAN DEVELOPMENT BANK ASIA 1 7/8 01/24/30	USD	1.000.000	1.000.000			109,414000	932.691,16	1,12 %
Anleihen fix		US045167EJ82	ASIAN DEVELOPMENT BANK ASIA 3 1/8 09/26/28	USD	2.790.000		1.400.000		118,714000	2.823.391,53	3,40 %
Anleihen fix		US298785HM16	EUROPEAN INVESTMENT BANK EIB 2 3/8 05/24/27	USD	1.700.000				111,720000	1.618.992,41	1,95 %
Anleihen fix		US4581X0DC96	INTER-AMERICAN DEVEL BK IADB 3 1/8 09/18/28	USD	2.300.000	2.300.000			118,637000	2.326.017,39	2,80 %
Exchange-traded-funds	OGAW	IE00B66F4759	ISHARES PLC - ISHARES € HIGH YIELD CORP BOND UCITS ETF EUR	EUR	11.408		14.500		97,204000	1.108.903,23	1,34 %
Investmentzertifikate Raiffeisen KAG	OGAW	AT0000796537	RAIFFEISEN-EUROPA-HIGHYIELD (R) T	EUR	3.976	8.489	4.513		211,400000	840.526,40	1,01 %
Investmentzertifikate extern	OGAW	LU0511407297	AB FCP I - EMERGING MARKETS DEBT PORTFOLIO I2 EUR H	EUR	183.903	11.051	344.679		22,050000	4.055.061,15	4,88 %
Investmentzertifikate extern	OGAW	LU1672644330	BAKERSTEEL GLOBAL FUNDS SICAV - PRECIOUS METALS FUND D3 ACC	EUR	2.090	2.090			208,370000	435.493,30	0,52 %
Strukturierte Produkte - Inflationsgebundene Anleihen		IT0005246134	BUONI POLIENNALI DEL TES BTPS 1.3 05/15/28	EUR	2.900.000		2.900.000	1,045710	107,561230	3.261.857,76	3,93 %
Strukturierte Produkte - Inflationsgebundene Anleihen		IT0004735152	BUONI POLIENNALI DEL TES BTPS 3.1 09/15/26	EUR	3.500.000	6.700.000	3.200.000	1,110460	118,108790	4.590.428,04	5,53 %
Strukturierte Produkte - Inflationsgebundene Anleihen		DE0001030559	DEUTSCHLAND I/L BOND DBRI 0 1/2 04/15/30	EUR	2.900.000	100.000	3.000.000	1,058060	117,756240	3.613.201,85	4,35 %
Strukturierte Produkte - Inflationsgebundene Anleihen		DE0001030542	DEUTSCHLAND I/L BOND DBRI 0.1 04/15/23	EUR	4.350.000	350.000	4.600.000	1,084220	102,072500	4.814.103,50	5,80 %
Strukturierte Produkte - Inflationsgebundene Anleihen		DE0001030567	DEUTSCHLAND I/L BOND DBRI 0.1 04/15/26	EUR	3.550.000	250.000	12.900.000	1,055260	107,086300	4.011.638,06	4,83 %
Strukturierte Produkte - Inflationsgebundene Anleihen		FR0011982776	FRANCE (GOVT OF) FRTR 0.7 07/25/30	EUR	3.200.000	100.000	3.300.000	1,050030	118,570810	3.984.093,04	4,80 %
Strukturierte Produkte - Inflationsgebundene Anleihen		FR0011008705	FRANCE (GOVT OF) FRTR 1.85 07/25/27	EUR	3.000.000	3.000.000		1,119360	121,150310	4.068.324,33	4,90 %
Strukturierte Produkte - Inflationsgebundene Anleihen		US912828UH11	TSY INFL IX N/B TII 0 1/8 01/15/23	USD	1.600.000	200.000	1.800.000	1,122330	103,078125	1.577.872,95	1,90 %
Strukturierte Produkte - Inflationsgebundene Anleihen		US912828Z377	TSY INFL IX N/B TII 0 1/8 01/15/30	USD	3.500.000	3.500.000		1,006890	110,726563	3.326.341,67	4,01 %
Strukturierte Produkte - Inflationsgebundene Anleihen		US912828WU04	TSY INFL IX N/B TII 0 1/8 07/15/24	USD	2.500.000	200.000	7.700.000	1,091020	105,828125	2.460.587,35	2,96 %
Strukturierte Produkte - Inflationsgebundene Anleihen		US912828S505	TSY INFL IX N/B TII 0 1/8 07/15/26	USD	2.500.000	2.500.000		1,080750	108,546875	2.500.043,37	3,01 %
Strukturierte Produkte - Inflationsgebundene Anleihen		US912828W563	TSY INFL IX N/B TII 0 7/8 01/15/29	USD	2.750.000	100.000	5.700.000	1,025960	116,710938	2.806.982,13	3,38 %
Summe der zum amtlichen Handel oder einem anderen geregelten Markt zugelassenen Wertpapiere sowie Investmentzertifikate										65.116.897,03	78,40 %
Summe Wertpapiervermögen										65.116.897,03	78,40 %
Aktienindex Futures		FESX20201218	EURO STOXX 50 Dec20 VGZ0	EUR	-13				3.203,000000	-4.680,00	-0,01 %
Aktienindex Futures		FESX20201218	EURO STOXX 50 Dec20 VGZ0	EUR	-10				3.203,000000	12.550,00	0,02 %
Aktienindex Futures		FESX20201218	EURO STOXX 50 Dec20 VGZ0	EUR	178				3.203,000000	-219.830,00	-0,26 %
Aktienindex Futures		FESX20201218	EURO STOXX 50 Dec20 VGZ0	EUR	-117				3.203,000000	146.835,00	0,18 %
Aktienindex Futures		FMWN20201218	MSCI Wor NTR Inde Dec20 RSWZ0	EUR	39				305,200000	-17.527,93	-0,02 %
Aktienindex Futures		FSTS20201218	STOXX 600 BAS Dec20 JSZ0	EUR	33				404,000000	-43.230,00	-0,05 %
Aktienindex Futures		FTSE20201218	FTSE 100 IDX FUT Dec20 Z Z0	GBP	-4				5.871,000000	8.800,83	0,01 %
Aktienindex Futures		FTSE20201218	FTSE 100 IDX FUT Dec20 Z Z0	GBP	68				5.871,000000	-150.358,49	-0,18 %
Aktienindex Futures		FSNK20201210	NIKKEI 225 (SGX) Dec20 NIZ0 PIT	JPY	-3				23.505,000000	-5.940,24	-0,01 %
Aktienindex Futures		FTSP20201210	TOPIX INDX FUTR Dec20 TPZ0 PIT	JPY	27				1.659,000000	131.749,87	0,16 %

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
Aktienindex Futures		FTSP20201210	TOPIX INDX FUTR Dec20 TPZ0 PIT	JPY	-10				1.659,000000	-31.624,71	-0,04 %
Aktienindex Futures		FEMI20201218	MSCI EmgMkt Dec20 MESZ0	USD	-51				1.071,100000	4.120,66	0,00 %
Aktienindex Futures		FEMI20201218	MSCI EmgMkt Dec20 MESZ0	USD	108				1.071,100000	-214.968,89	-0,26 %
Aktienindex Futures		FMWE20201218	MSCI Energy Index Dec20 MEWZ0	USD	79				173,267000	-102.980,82	-0,12 %
Aktienindex Futures		0FES20201218	S&P500 EMINI FUT Dec20 ESZ0	USD	-10				3.333,750000	-42.827,90	-0,05 %
Aktienindex Futures		0FES20201218	S&P500 EMINI FUT Dec20 ESZ0	USD	6				3.333,750000	-15.714,78	-0,02 %
Aktienindex Futures		0FES20201218	S&P500 EMINI FUT Dec20 ESZ0	USD	-3				3.333,750000	7.850,99	0,01 %
Anleihenfutures		FCGB20201218	CAN 10YR BOND FUT Dec20 CNZ0	CAD	17				152,260000	9.511,09	0,01 %
Anleihenfutures		FGBM20201208	EURO-BOBL FUTURE Dec20 OEZ0	EUR	-114				135,280000	-17.100,00	-0,02 %
Anleihenfutures		FGBM20201208	EURO-BOBL FUTURE Dec20 OEZ0	EUR	-39				135,280000	-5.850,00	-0,01 %
Anleihenfutures		FBTP20201208	Euro-BTP Future Dec20 IKZ0	EUR	-22				148,090000	-55.880,00	-0,07 %
Anleihenfutures		FBTP20201208	Euro-BTP Future Dec20 IKZ0	EUR	9				148,090000	22.770,00	0,03 %
Anleihenfutures		FGBL20201208	EURO-BUND FUTURE Dec20 RXZ0	EUR	23				174,870000	10.185,53	0,01 %
Anleihenfutures		FGBL20201208	EURO-BUND FUTURE Dec20 RXZ0	EUR	-21				174,870000	-20.160,00	-0,02 %
Anleihenfutures		FGBL20201208	EURO-BUND FUTURE Dec20 RXZ0	EUR	-3				174,870000	-2.880,00	-0,00 %
Anleihenfutures		FGBL20201208	EURO-BUND FUTURE Dec20 RXZ0	EUR	-22				174,870000	-21.120,00	-0,03 %
Anleihenfutures		FOAT20201208	Euro-OAT Future Dec20 OATZ0	EUR	-39				169,010000	-53.820,00	-0,06 %
Anleihenfutures		FGBS20201208	EURO-SCHATZ FUT Dec20 DUZ0	EUR	-18				112,305000	-270,00	-0,00 %
Anleihenfutures		FLGR20201229	LONG GILT FUTURE Dec20 G Z0	GBP	35				136,560000	65.513,65	0,08 %
Anleihenfutures		FTNU20201221	US 10yr Ultra Fut Dec20 UXYZ0 PIT	USD	-3				160,390625	-3.516,32	-0,00 %
Anleihenfutures		FTNU20201221	US 10yr Ultra Fut Dec20 UXYZ0 PIT	USD	50				160,390625	35.629,42	0,04 %
Anleihenfutures		FTNU20201221	US 10yr Ultra Fut Dec20 UXYZ0 PIT	USD	-39				160,390625	-28.050,68	-0,03 %
Anleihenfutures		FTNU20201221	US 10yr Ultra Fut Dec20 UXYZ0 PIT	USD	7				160,390625	6.340,03	0,01 %
Anleihenfutures		FTN520201231	US 5YR NOTE (CBT) Dec20 FVZ0 PIT	USD	-2				126,132813	-266,39	-0,00 %
Anleihenfutures		FTN520201231	US 5YR NOTE (CBT) Dec20 FVZ0 PIT	USD	-44				126,132813	-9.962,94	-0,01 %
Anleihenfutures		FTN520201231	US 5YR NOTE (CBT) Dec20 FVZ0 PIT	USD	89				126,132813	19.559,59	0,02 %
Rohstoffindex Futures		XLEN20201218	BCOMEN Energy XL Dec20 XLBZ0	USD	130				19,830000	-12.717,41	-0,02 %
Rohstoffindex Futures		XLEN20201218	BCOMEN Energy XL Dec20 XLBZ0	USD	-188				19,830000	16.605,73	0,02 %
Rohstoffindex Futures		XLEN20201218	BCOMEN Energy XL Dec20 XLBZ0	USD	150				19,830000	-14.673,94	-0,02 %
Rohstoffindex Futures		FCIN20201218	BCOMIN Ind Mets Dec20 FCIZ0	USD	4				115,420000	-2.241,93	-0,00 %
Rohstoffindex Futures		FCIN20201218	BCOMIN Ind Mets Dec20 FCIZ0	USD	85				115,420000	-66.858,60	-0,08 %
Rohstoffindex Futures		FCIN20201218	BCOMIN Ind Mets Dec20 FCIZ0	USD	50				115,420000	-39.328,58	-0,05 %
Rohstoffindex Futures		FCPR20201218	BCOMPR PRECIOUS Dec20 UBPZ0	USD	32				229,860000	-89.736,64	-0,11 %
Rohstoffindex Futures		FCPR20201218	BCOMPR PRECIOUS Dec20 UBPZ0	USD	94				229,860000	-263.601,37	-0,32 %
Währungsfutures		0FCD20201215	C\$ CURRENCY FUT Dec20 CDZ0 PIT	USD	13				0,745960	-15.370,39	-0,02 %
Währungsfutures		0FEC20201214	EURO FX CURR FUT Dec20 ECZ0 PIT	USD	-13				1,175060	11.414,20	0,01 %
Währungsfutures		0FEC20201214	EURO FX CURR FUT Dec20 ECZ0 PIT	USD	-26				1,175060	22.828,40	0,03 %
Rendite Futures		FTCB20201215	AUST 10Y BOND FUT Dec20 XMZ0 PIT	AUD	3				99,170000	661,50	0,00 %
Rendite Futures		FTCB20201215	AUST 10Y BOND FUT Dec20 XMZ0 PIT	AUD	18				99,170000	17.247,54	0,02 %
Rendite Futures		FTCB20201215	AUST 10Y BOND FUT Dec20 XMZ0 PIT	AUD	5				99,170000	1.652,68	0,00 %
Rendite Futures		FTCB20201215	AUST 10Y BOND FUT Dec20 XMZ0 PIT	AUD	129				99,170000	123.607,39	0,15 %
Summe Finanzterminkontrakte ¹										-897.654,85	-1,08 %
Devisentermingeschäfte			Forward / BOUGHT MXN / SOLD USD / Raiffeisen Bank International AG	MXN	51.800.000				26,368357	6.412,21	0,01 %
Devisentermingeschäfte			Forward / BOUGHT NOK / SOLD EUR / Raiffeisen Bank International AG	NOK	7.800.000				11,071712	-32.962,25	-0,04 %
Devisentermingeschäfte			Forward / BOUGHT RUB / SOLD USD / Raiffeisen Bank International AG	RUB	168.800.000				93,419431	-143.457,44	-0,17 %
Devisentermingeschäfte			Forward / BOUGHT USD / SOLD EUR / Raiffeisen Bank International AG	USD	800.000				1,174007	-1.563,37	-0,00 %
Devisentermingeschäfte			Forward / SOLD USD / BOUGHT EUR / Raiffeisen Bank International AG	USD	-12.800.000				1,174007	-37.507,15	-0,05 %
Devisentermingeschäfte			Forward / SOLD USD / BOUGHT EUR / Raiffeisen Bank International AG	USD	-800.000				1,174007	-10.655,53	-0,01 %

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
Devisentermingeschäfte			Forward / SOLD USD / BOUGHT EUR / Raiffeisen Bank International AG	USD	-1.200.000				1,174007	-15.901,45	-0,02 %
Devisentermingeschäfte			Forward / SOLD USD / BOUGHT EUR / Raiffeisen Bank International AG	USD	-800.000				1,173120	1.584,57	0,00 %
Devisentermingeschäfte			Forward / BOUGHT ZAR / SOLD USD / Raiffeisen Bank International AG	ZAR	40.500.000				20,011991	62.757,91	0,08 %
FX NDF			Forward / BOUGHT IDR / SOLD USD / Raiffeisen Bank International AG	IDR	33.500.000.000				17.559,223211	-2.517,27	-0,00 %
FX NDF			Forward / BOUGHT INR / SOLD USD / Raiffeisen Bank International AG	INR	172.200.000				87,038434	36.171,42	0,04 %
Summe Devisentermingeschäfte ¹										-137.638,36	-0,17 %
Optionen auf Währungsfutures		OEUU0L000114	Euro Curr 9am Dec20C 1.14 UEAZ0C 1.14 PIT	USD	39				0,039500	164.148,41	0,20 %
Optionen auf Währungsfutures		OEUU0X000106	Euro Curr 9am Dec20P 1.06 UEAZ0P 1.06 PIT	USD	145				0,000350	5.407,68	0,00 %
Summe Optionen ¹										169.556,09	0,20 %
Bankguthaben/-verbindlichkeiten											
				EUR						11.456.242,51	13,79 %
				AUD						287.910,03	0,35 %
				CAD						630.637,35	0,76 %
				CHF						294.611,20	0,35 %
				GBP						-658.311,43	-0,79 %
				JPY						476.287,49	0,57 %
				SEK						27.334,07	0,03 %
				USD						2.583.866,48	3,11 %
Festgeld in Fondswährung										4.000.000,00	4,82 %
Summe Bankguthaben/-verbindlichkeiten										19.098.577,70	23,00 %
Abgrenzungen											
Zinsenansprüche (aus Wertpapieren und Bankguthaben)										107.230,94	0,13 %
Cash Collateral Zinsen gegeben										68,54	0,00 %
Cash Collateral Zinsen erhalten										-103,83	-0,00 %
Dividendenforderungen										19.871,15	0,02 %
Summe Abgrenzungen										127.066,80	0,15 %
Sonstige Verrechnungsposten											
Diverse Gebühren										-584.385,69	-0,70 %
Summe Sonstige Verrechnungsposten										-584.385,69	-0,70 %
Cash Collateral											
Forderungen aus gegebenen Sicherheiten										160.000,00	0,19 %
Summe Cash Collateral										160.000,00	0,19 %
Summe Fondsvermögen										83.052.418,73	100,00 %

ISIN	Ertragstyp	Währung	Errechneter Wert je Anteil	Umlaufende Anteile in Stück
AT0000A0SE09	R Ausschüttung	EUR	146,19	3.974,220
AT0000A1Z3C4	RZ Ausschüttung	EUR	106,75	9.033,491
AT0000A0SDY6	I Thesaurierung	EUR	168,14	730,834
AT0000A090H8	S Thesaurierung	EUR	167,79	227.887,373
AT0000A0SE17	R Thesaurierung	EUR	157,31	73.803,957
AT0000A1Z3D2	RZ Thesaurierung	EUR	109,86	36,262
AT0000A0SDZ3	I Vollthesaurierung Ausland	EUR	168,76	152.479,507
AT0000A0SE25	R Vollthesaurierung Ausland	EUR	156,01	37.158,507
AT0000A1YBX8	RZ Vollthesaurierung Ausland	EUR	110,13	10,000

In der Vermögensaufstellung gesperrte Wertpapiere (Wertpapierleihegeschäfte)

ISIN	Wertpapierbezeichnung	Währung	Bestand per 30.09.2020
DE0001030542	DEUTSCHLAND I/L BOND DBRI 0.1 04/15/23	EUR	3.500.000
DE0001030567	DEUTSCHLAND I/L BOND DBRI 0.1 04/15/26	EUR	3.350.000
FR0011982776	FRANCE (GOVT OF) FRTR 0.7 07/25/30	EUR	3.100.000
FR0011008705	FRANCE (GOVT OF) FRTR 1.85 07/25/27	EUR	2.800.000

Devisenkurse

Vermögenswerte in fremder Währung wurden zu den Devisenkursen per 29.09.2020 in EUR umgerechnet

Währung	Kurs (1 EUR =)
Australische Dollar	AUD 1,648200
Kanadische Dollar	CAD 1,572900
Schweizer Franken	CHF 1,081200
Britische Pfund	GBP 0,913550
Japanische Yen	JPY 123,984950
Schwedische Kronen	SEK 10,521650
Amerikanische Dollar	USD 1,173100

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
Aktien		BRB3SAACNOR6	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO B3SA3	BRL		4.200
Aktien		BRBBDACNPR8	BANCO BRADESCO SA-PREF BBDC4	BRL	893	9.825
Aktien		BRBBASACNOR3	BANCO DO BRASIL S.A. BBAS3	BRL		4.300
Aktien		BRSANBCDAM13	BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT SANB11	BRL		7.200
Aktien		BRCCROACNOR2	CCR SA CCRO3	BRL		8.600
Aktien		BRPCARACNOR3	CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUIC PCAR3	BRL		1.400
Aktien		BRCOGNACNOR2	COGNA EDUCACAO COGN3	BRL		26.100
Aktien		BREQTLACNOR0	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD EQTL3	BRL		10.200
Aktien		BRITUBACNPR1	ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF ITUB4	BRL		6.700
Aktien		BRRENTACNOR4	LOCALIZA RENT A CAR RENT3	BRL		5.308
Aktien		BRLRENACNOR1	LOJAS RENNER S.A. LREN3	BRL		3.186
Aktien		BRPETRACNPR6	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR PETR4	BRL		10.700
Aktien		BRSUZBACNOR0	SUZANO SA SUZB3	BRL		9.700
Aktien		BRVIVTACNPR7	TELEFONICA BRASIL S.A.-PREF VIVT4	BRL		2.000
Aktien		BRTIMPACNOR1	TIM PARTICIPACOES SA TIMP3	BRL		8.700
Aktien		BRVALEACNOR0	VALE SA VALE3	BRL		7.394

Wertpapierart	OGAW/§ 166	ISIN	Wertpapierbezeichnung	Währung		Käufe Zugänge	Verkäufe Abgänge
Aktien		CZ0008040318	MONETA MONEY BANK AS MONET	CZK			8.360
Aktien		GB00BKDRYJ47	AIRTEL AFRICA PLC AAF	GBP			30.700
Aktien		JE00B6T5S470	POLYMETAL INTERNATIONAL PLC POLY	GBP		1.200	1.200
Aktien		BMG0171K1018	ALIBABA HEALTH INFORMATION T 241	HKD			40.000
Aktien		CNE1000001Z5	BANK OF CHINA LTD-H 3988	HKD			216.300
Aktien		CNE1000002H1	CHINA CONSTRUCTION BANK-H 939	HKD			215.000
Aktien		BMG2109G1033	CHINA GAS HOLDINGS LTD 384	HKD			13.500
Aktien		CNE1000002M1	CHINA MERCHANTS BANK-H 3968	HKD			16.900
Aktien		HK0941009539	CHINA MOBILE LTD 941	HKD			17.000
Aktien		CNE1000002Q2	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H 386	HKD			59.900
Aktien		KYG2108Y1052	CHINA RESOURCES LAND LTD 1109	HKD			14.200
Aktien		KYG2140A1076	CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD 884	HKD			42.000
Aktien		KYG2453A1085	COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD 6098	HKD			14.200
Aktien		HK1093012172	CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT 1093	HKD			16.000
Aktien		KYG3066L1014	ENN ENERGY HOLDINGS LTD 2688	HKD			5.600
Aktien		BMG423131256	HAIER ELECTRONICS GROUP CO 1169	HKD			15.000
Aktien		CNE1000003G1	IND & COMM BK OF CHINA-H 1398	HKD			163.800
Aktien		KYG5496K1242	LI NING CO LTD 2331	HKD			15.100
Aktien		KYG5635P1090	LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD 960	HKD			12.500
Aktien		KYG596691041	MEITUAN DIANPING-CLASS B 3690	HKD		800	4.700
Aktien		CNE100000593	PICC PROPERTY & CASUALTY-H 2328	HKD			40.900
Aktien		KYG711391022	PING AN HEALTHCARE AND TECHN 1833	HKD		3.000	3.000
Aktien		CNE1000003X6	PING AN INSURANCE GROUP CO-H 2318	HKD			12.900
Aktien		KYG8020E1199	SEMICONDUCTOR MANUFACTURING 981	HKD		4.000	20.100
Aktien		BMG8086V1467	SHENZHEN INTL HOLDINGS 152	HKD			24.000
Aktien		KYG8087W1015	SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP 2313	HKD			4.700
Aktien		HK0000083920	SUN ART RETAIL GROUP LTD 6808	HKD			38.000
Aktien		KYG8569A1067	SUNAC CHINA HOLDINGS LTD 1918	HKD			11.600
Aktien		KYG8586D1097	SUNNY OPTICAL TECH 2382	HKD		600	3.000
Aktien		KYG875721634	TENCENT HOLDINGS LTD 700	HKD			10.558
Aktien		KYG9431R1039	WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD 151	HKD			52.500
Aktien		CNE1000004L9	WEICHAI POWER CO LTD-H 2338	HKD		15.000	15.000
Aktien		KYG970081090	WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC 2269	HKD			3.100
Aktien		KYG9829N1025	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD 968	HKD			62.800
Aktien		HU0000153937	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL MOL	HUF			3.632
Aktien		ID1000122807	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT ASII	IDR			43.500
Aktien		ID1000118201	BANK RAKYAT INDONESIA PERSER BBRI	IDR			212.900
Aktien		ID1000116700	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T ICBP	IDR			36.500
Aktien		ID1000135700	MITRA KELUARGA KARYASEHAT TB MIKA	IDR			138.000
Aktien		ID1000129000	TELEKOMUNIKASI INDONESIA PER TLKM	IDR			171.870
Aktien		INE397D01024	BHARTI AIRTEL LTD BHARTI	INR		1.400	10.000
Aktien		INE059A01026	CIPLA LTD CIPLA	INR		5.500	5.500
Aktien		INE860A01027	HCL TECHNOLOGIES LTD HCLT	INR			19.808
Aktien		INE001A01036	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE HDFC	INR			3.460
Aktien		INE090A01021	ICICI BANK LTD ICICIBC	INR			25.670
Aktien		INE018A01030	LARSEN & TOUBRO LTD LT	INR			5.850
Aktien		INE002A01018	RELIANCE INDUSTRIES LTD RIL	INR			5.160
Aktien		INE647A01010	SRF LTD SRF	INR			2.100
Aktien		INE195A01028	SUPREME INDUSTRIES LTD SI	INR			4.916
Aktien		INE467B01029	TATA CONSULTANCY SVCS LTD TCS	INR			2.800
Aktien		KR7030000004	CHEIL WORLDWIDE INC 030000	KRW			2.070
Aktien		KR7008770000	HOTEL SHILLA CO LTD 008770	KRW			800

Wertpapierart	OGAW/§ 166	ISIN	Wertpapierbezeichnung	Währung		Käufe Zugänge	Verkäufe Abgänge
Aktien		KR7086280005	HYUNDAI GLOVIS CO LTD 086280	KRW			410
Aktien		KR7105560007	KB FINANCIAL GROUP INC 105560	KRW			960
Aktien		KR7051900009	LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE 051900	KRW			50
Aktien		KR7035420009	NAVER CORP 035420	KRW			430
Aktien		KR7005490008	POSCO 005490	KRW			270
Aktien		KR7005930003	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD 005930	KRW			10.350
Aktien		KR7005931001	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF 005935	KRW			2.390
Aktien		KR7006400006	SAMSUNG SDI CO LTD 006400	KRW			250
Aktien		KR7055550008	SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD 055550	KRW			1.720
Aktien		KR7034730002	SK HOLDINGS CO LTD 034730	KRW			250
Aktien		KR7000660001	SK HYNIX INC 000660	KRW			1.390
Aktien		MXP001691213	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L AMXL	MXN			63.000
Aktien		MXP320321310	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD FEMSAUBD	MXN			3.400
Aktien		MXP370841019	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B GMEXICOB	MXN			15.800
Aktien		MX01WA000038	WALMART DE MEXICO SAB DE CV WALMEX*	MXN			20.200
Aktien		MYL727700006	DIALOG GROUP BHD DLG	MYR			40.100
Aktien		MYL318200002	GENTING BHD GENT	MYR			18.700
Aktien		MYL501400005	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD MAHB	MYR			9.800
Aktien		MYL518300008	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD PCHEM	MYR			14.200
Aktien		MYL129500004	PUBLIC BANK BERHAD PBK	MYR			8.600
Aktien		MYL419700009	SIME DARBY BERHAD SIME	MYR			34.800
Aktien		MYL534700009	TENAGA NASIONAL BHD TNB	MYR			12.500
Aktien		PHY0486V1154	AYALA CORPORATION AC	PHP			2.600
Aktien		PHY0488F1004	AYALA LAND INC ALI	PHP			44.200
Aktien		PHY0967S1694	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN BPI	PHP			26.400
Aktien		PLCFRPT00013	CYFROWY POLSAT SA CPS	PLN			8.369
Aktien		PLPZU0000011	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE PZU	PLN			3.100
Aktien		ROELECACNOR5	SOCIETATEA ENERGETICA ELECTR EL	RON			19.308
Aktien		RU0007661625	GAZPROM PJSC GAZP	RUB			20.400
Aktien		RU0009024277	LUKOIL PJSC LKOH	RUB			715
Aktien		RU0007288411	MMC NORILSK NICKEL PJSC GMKN	RUB		100	100
Aktien		RU000A0DKVS5	NOVATEK PJSC NVTK	RUB			1.200
Aktien		RU0009029540	SBERBANK OF RUSSIA PJSC SBER	RUB			30.800
Aktien		RU000A0JP5V6	VTB BANK PJSC VTBR	RUB			45.901.200
Aktien		TH0268010R11	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR ADVANC-R	THB		4.400	4.400
Aktien		TH0765010R16	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR AOT-R	THB			15.800
Aktien		TH0001010R16	BANGKOK BANK PUBLIC CO-NVDR BBL-R	THB			8.500
Aktien		TH6999010R15	BANGKOK EXPRESSWAY-NVDR BEM-R	THB			116.600
Aktien		TH0737010R15	CP ALL PCL-NVDR CPALL-R	THB			18.000
Aktien		TH0143010R16	LAND & HOUSES PUB - NVDR LH-R	THB			94.300
Aktien		TH0355010R16	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR PTTEP-R	THB			10.700
Aktien		TH0646010R18	PTT PCL-NVDR PTT-R	THB			34.700
Aktien		TRATHYAO91M5	TURK HAVA YOLLARI AO THYAO	TRY			20
Aktien		TRAGARAN91N1	TURKIYE GARANTI BANKASI GARAN	TRY			49.000
Aktien		TW0001102002	ASIA CEMENT CORP 1102	TWD			17.800
Aktien		KYG202881093	CHAILEASE HOLDING CO LTD 5871	TWD			7.014
Aktien		TW0002412004	CHUNGHWA TELECOM CO LTD 2412	TWD			20.000
Aktien		TW0002891009	CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT 2891	TWD			72.500
Aktien		TW0002884004	E.SUN FINANCIAL HOLDING CO 2884	TWD			49.665
Aktien		TW0001476000	ECLAT TEXTILE COMPANY LTD 1476	TWD			1.300
Aktien		TW0001326007	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE 1326	TWD			13.500
Aktien		TW0001301000	FORMOSA PLASTICS CORP 1301	TWD			8.000

Wertpapierart	OGAW/§ 166	ISIN	Wertpapierbezeichnung	Währung		Käufe Zugänge	Verkäufe Abgänge
Aktien		TW0006488000	GLOBALWAFERS CO LTD 6488	TWD			2.500
Aktien		TW0002049004	HIWIN TECHNOLOGIES CORP 2049	TWD			2.000
Aktien		TW0002317005	HON HAI PRECISION INDUSTRY 2317	TWD			21.840
Aktien		TW0003008009	LARGAN PRECISION CO LTD 3008	TWD			300
Aktien		TW0002301009	LITE-ON TECHNOLOGY CORP 2301	TWD			22.300
Aktien		TW0002886009	MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT 2886	TWD			26.700
Aktien		TW0001303006	NAN YA PLASTICS CORP 1303	TWD			8.900
Aktien		TW0003034005	NOVATEK MICROELECTRONICS COR 3034	TWD			5.300
Aktien		TW0002912003	PRESIDENT CHAIN STORE CORP 2912	TWD			4.000
Aktien		TW0003045001	TAIWAN MOBILE CO LTD 3045	TWD			5.000
Aktien		TW0002330008	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC 2330	TWD			44.300
Aktien		TW0001216000	UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO 1216	TWD			17.800
Aktien		BMG2519Y1084	CREDICORP LTD BAP	USD			200
Aktien		ZAE000013181	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD AMS	ZAR			520
Aktien		ZAE000035861	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD CPI	ZAR		800	1.200
Aktien		ZAE000066304	FIRSTRAND LTD FSR	ZAR			12.448
Aktien		ZAE000018123	GOLD FIELDS LTD GFI	ZAR			8.350
Aktien		ZAE000179420	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD GRT	ZAR			17.400
Aktien		ZAE000083648	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD IMP	ZAR			4.350
Aktien		ZAE000015889	NASPERS LTD-N SHS NPN	ZAR			1.040
Aktien		ZAE000109815	STANDARD BANK GROUP LTD SBK	ZAR			3.200
Aktien		ZAE000063863	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD WHL	ZAR			6.200
Aktien ADR		US01609W1027	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR BABA	USD			3.380
Aktien ADR		US0567521085	BAIDU INC - SPON ADR BIDU	USD			300
Aktien ADR		US47215P1066	JD.COM INC-ADR JD	USD			2.200
Aktien ADR		US55315J1025	MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR MNOD	USD			1.100
Aktien ADR		US64110W1027	NETEASE INC-ADR NTES	USD			250
Aktien ADR		US6475811070	NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR EDU	USD			700
Aktien ADR		US7223041028	PINDUODUO INC-ADR PDD	USD		800	800
Aktien ADR		US8336351056	QUIMICA Y MINERA CHIL-SP ADR SQM	USD			700
Aktien ADR		US98980A1051	ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR ZTO	USD		350	1.660
Anleihen fix		XS1883354620	ABBOTT IRELAND FINANCING ABT 0 7/8 09/27/23	EUR			100.000
Anleihen fix		FR0013505625	AEROPORTS DE PARIS ADPPF 2 1/8 10/02/26	EUR			100.000
Anleihen fix		XS2156598281	AKZO NOBEL NV AKZANA 1 5/8 04/14/30	EUR		100.000	100.000
Anleihen fix		XS2014382845	ALLIANDER NV ALLRNV 0 7/8 06/24/32	EUR		100.000	100.000
Anleihen fix		DE000A2YPFA1	ALLIANZ SE ALVGR 1.301 09/25/49	EUR		100.000	100.000
Anleihen fix		XS1369278251	AMGEN INC AMGN 1 1/4 02/25/22	EUR			100.000
Anleihen fix		BE6312821612	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/ ABIBB 1 1/8 07/01/27	EUR			200.000
Anleihen fix		BE6320935271	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/ ABIBB 2 7/8 04/02/32	EUR		200.000	200.000
Anleihen fix		XS2079716853	APPLE INC AAPL 0 11/15/25	EUR			100.000
Anleihen fix		XS1875331636	ARGENTUM (GIVAUDAN) GIVNVX 1 1/8 09/17/25	EUR			100.000
Anleihen fix		XS1577953760	ASAHI GROUP HOLDINGS LTD ASABRE 0.321 09/19/21	EUR		100.000	100.000
Anleihen fix		XS2010032378	ASML HOLDING NV ASML 0 1/4 02/25/30	EUR			100.000
Anleihen fix		XS1411404855	ASTRAZENECA PLC AZN 0 3/4 05/12/24	EUR			100.000
Anleihen fix		FR0013510179	AUCHAN HOLDING SA AUCHAN 2 7/8 01/29/26	EUR		100.000	100.000
Anleihen fix		XS2168647357	BANCO SANTANDER SA SANTAN 1 3/8 01/05/26	EUR		100.000	100.000
Anleihen fix		XS1718418103	BASF SE BASGR 0 7/8 11/15/27	EUR			100.000
Anleihen fix		XS1203859928	BAT INTL FINANCE PLC BATSLN 1 1/4 03/13/27	EUR			100.000
Anleihen fix		XS2049584084	BAWAG P.S.K. BAWAG 0 3/8 09/03/27	EUR			100.000
Anleihen fix		XS2199265617	BAYER AG BAYNGR 0 3/8 07/06/24	EUR		100.000	100.000
Anleihen fix		XS1840618059	BAYER CAPITAL CORP BV BAYNGR 1 1/2 06/26/26	EUR			100.000
Anleihen fix		XS2149280948	BERTELSMANN SE & CO KGAA BERTEL 2 04/01/28	EUR			100.000

Wertpapierart	OGAW/§ 166	ISIN	Wertpapierbezeichnung	Währung		Käufe Zugänge	Verkäufe Abgänge
Anleihen fix		XS2102357014	BMW FINANCE NV BMW 0 3/8 01/14/27	EUR			100.000
Anleihen fix		FR0013507654	BOUYGUES SA ENFP 1 1/8 07/24/28	EUR		100.000	100.000
Anleihen fix		XS1992931508	BP CAPITAL MARKETS PLC BPLN 0.831 11/08/27	EUR			100.000
Anleihen fix		XS2135799679	BP CAPITAL MARKETS PLC BPLN 2.519 04/07/28	EUR		180.000	180.000
Anleihen fix		FR0013509726	BPCE SA BPCEGP 0 5/8 04/28/25	EUR		200.000	200.000
Anleihen fix		XS2051494495	BRITISH TELECOMMUNICATIO BRITEL 1 1/8 09/12/29	EUR			100.000
Anleihen fix		DE0001102465	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND DBR 0 1/4 02/15/29	EUR		450.000	600.000
Anleihen fix		XS2099128055	CA IMMOBILIEN ANLAGEN AG CAIAV 0 7/8 02/05/27	EUR		100.000	100.000
Anleihen fix		XS2133071774	CARLSBERG BREWERIES A/S CARLB 0 5/8 03/09/30	EUR		150.000	150.000
Anleihen fix		FR0013505260	CARREFOUR SA CAFF 2 5/8 12/15/27	EUR			100.000
Anleihen fix		XS2150054372	CIE DE SAINT-GOBAIN SGOFF 2 3/8 10/04/27	EUR		100.000	100.000
Anleihen fix		XS1457608013	CITIGROUP INC C 0 3/4 10/26/23	EUR			100.000
Anleihen fix		XS2167003685	CITIGROUP INC C 1 1/4 07/06/26	EUR		150.000	150.000
Anleihen fix		XS1197832915	COCA-COLA CO/THE KO 0 3/4 03/09/23	EUR			100.000
Anleihen fix		XS2134245138	COCA-COLA EUROPEAN PARTN CCE 1 3/4 03/27/26	EUR			100.000
Anleihen fix		XS1956955980	COOPERATIEVE RABOBANK UA RABOBK 0 5/8 02/27/24	EUR			100.000
Anleihen fix		XS2067135421	CREDIT AGRICOLE SA ACAFP 0 3/8 10/21/25	EUR		200.000	200.000
Anleihen fix		CH0537261858	CREDIT SUISSE GROUP AG CS 3 1/4 04/02/26	EUR		200.000	200.000
Anleihen fix		DE000A2YPFU9	DAIMLER AG DAIGR 1 1/8 11/06/31	EUR			100.000
Anleihen fix		DE000A2R9ZU9	DAIMLER INTL FINANCE BV DAIGR 0 5/8 05/06/27	EUR			100.000
Anleihen fix		FR0013216900	DANONE SA BNFP 0.424 11/03/22	EUR			100.000
Anleihen fix		XS1936139770	DEUTSCHE BAHN FIN GMBH DBHNGR 1 1/8 12/18/28	EUR			100.000
Anleihen fix		XS2156768546	DEUTSCHE BAHN FIN GMBH DBHNGR 1 3/8 04/16/40	EUR		100.000	100.000
Anleihen fix		DE000DL19U23	DEUTSCHE BANK AG DB 1 5/8 01/20/27	EUR			100.000
Anleihen fix		DE000A161W62	DEUTSCHE BOERSE AG DBOERS 2 3/4 02/05/41	EUR			50.000
Anleihen fix		XS1828032513	DEUTSCHE TELEKOM INT FIN DT 0 5/8 12/01/22	EUR			100.000
Anleihen fix		XS2122486066	DOW CHEMICAL CO/THE DOW 1 1/8 03/15/32	EUR			100.000
Anleihen fix		XS2051777873	DS SMITH PLC SMDSLN 0 7/8 09/12/26	EUR			100.000
Anleihen fix		XS1893621026	EDP FINANCE BV EDPL 1 7/8 10/13/25	EUR			100.000
Anleihen fix		FR0013213295	ELECTRICITE DE FRANCE SA EDF 1 10/13/26	EUR		200.000	200.000
Anleihen fix		XS2156607702	ENBW INTL FINANCE BV ENBW 0 5/8 04/17/25	EUR		200.000	200.000
Anleihen fix		FR0013398229	ENGIE SA ENGIFF 3 1/4 PERP	EUR			100.000
Anleihen fix		XS2176785447	ENI SPA ENIIM 2 05/18/31	EUR		100.000	100.000
Anleihen fix		XS1679781424	EQUINIX INC EQIX 2 7/8 10/01/25	EUR		100.000	100.000
Anleihen fix		FR0013463650	ESSILORLUXOTTICA EFFP 0 1/8 05/27/25	EUR			100.000
Anleihen fix		XS1584122680	ESSITY AB ESSITY 0 5/8 03/28/22	EUR			100.000
Anleihen fix		XS2001270995	FCA BANK SPA IRELAND FCABNK 0 5/8 11/24/22	EUR			100.000
Anleihen fix		XS1319814577	FEDEX CORP FDX 1 01/11/23	EUR			100.000
Anleihen fix		XS2085547433	FIDELITY NATL INFO SERV FIS 0 1/8 12/03/22	EUR			100.000
Anleihen fix		XS2085608326	FIDELITY NATL INFO SERV FIS 0 5/8 12/03/25	EUR		100.000	100.000
Anleihen fix		XS1843436145	FIDELITY NATL INFO SERV FIS 2.95 05/21/39	EUR			100.000
Anleihen fix		XS2152329053	FRESENIUS SE & CO KGAA FREGR 1 5/8 10/08/27	EUR		100.000	100.000
Anleihen fix		XS2126170161	GIVAUDAN FIN EUROPE GIVNVX 1 5/8 04/22/32	EUR		100.000	100.000
Anleihen fix		XS1822828122	GLAXOSMITHKLINE CAPITAL GSK 1 1/4 05/21/26	EUR			100.000
Anleihen fix		XS1981823542	GLENCORE FINANCE EUROPE GLENLN 1 1/2 10/15/26	EUR			100.000
Anleihen fix		XS1614198262	GOLDMAN SACHS GROUP INC GS 1 3/8 05/15/24	EUR		50.000	100.000
Anleihen fix		XS2147977479	HEINEKEN NV HEIANA 1 5/8 03/30/25	EUR			100.000
Anleihen fix		XS1672151492	HOLCIM FINANCE LUX SA LHNXX 1 3/4 08/29/29	EUR			100.000
Anleihen fix		XS1847692636	IBERDROLA FINANZAS SAU IBESM 1 1/4 10/28/26	EUR			100.000
Anleihen fix		XS2068065163	INFORMA PLC INFLN 1 1/4 04/22/28	EUR			100.000
Anleihen fix		XS2022424993	INTESA SANPAOLO SPA ISPIM 1 3/4 07/04/29	EUR			100.000
Anleihen fix		XS2150006133	JOHN DEERE CASH MANAGEME DE 1 3/8 04/02/24	EUR			100.000

Wertpapierart	OGAW/§ 166	ISIN	Wertpapierbezeichnung	Währung		Käufe Zugänge	Verkäufe Abgänge
Anleihen fix		XS1815116568	KONINKLIJKE PHILIPS NV PHIANA 0 3/4 05/02/24	EUR			100.000
Anleihen fix		FR0013508686	LA POSTE SA FRPTT 0 5/8 10/21/26	EUR		200.000	200.000
Anleihen fix		XS2171210862	LANDBK HESSEN-THUERINGEN HESLAN 0 3/8 05/12/25	EUR		200.000	200.000
Anleihen fix		XS1749378342	LLOYDS BANKING GROUP PLC LLOYDS 0 5/8 01/15/24	EUR			100.000
Anleihen fix		XS2151069775	LLOYDS BK CORP MKTS PLC LLOYDS 2 3/8 04/09/26	EUR		200.000	200.000
Anleihen fix		FR0013482833	LVMH MOET HENNESSY VUITT MCFP 0 1/8 02/11/28	EUR			100.000
Anleihen fix		XS2020670779	MEDTRONIC GLOBAL HLDINGS MDT 0 1/4 07/02/25	EUR			100.000
Anleihen fix		XS2151059206	MONDI FINANCE EUROPE MNDILN 2 3/8 04/01/28	EUR		100.000	100.000
Anleihen fix		XS1864037541	NATIONAL GRID NA INC NGGLN 0 3/4 08/08/23	EUR			100.000
Anleihen fix		XS2083976139	NATURGY FINANCE BV NTGYSM 0 3/4 11/28/29	EUR			100.000
Anleihen fix		XS2150006646	NATWEST MARKETS PLC NWG 2 3/4 04/02/25	EUR			100.000
Anleihen fix		XS2148372696	NESTLE FINANCE INTL LTD NESNVX 1 1/8 04/01/26	EUR			100.000
Anleihen fix		XS1769040111	NOVARTIS FINANCE SA NOVNVX 0 1/2 08/14/23	EUR			100.000
Anleihen fix		XS1769041192	NOVARTIS FINANCE SA NOVNVX 1 3/8 08/14/30	EUR		200.000	200.000
Anleihen fix		AT0000A28HX3	OBERBANK AG OBERBK 0 3/4 06/19/26	EUR			100.000
Anleihen fix		XS2154347293	OMV AG OMVAV 1 1/2 04/09/24	EUR		300.000	300.000
Anleihen fix		FR0013444684	ORANGE SA ORAFP 0 1/2 09/04/32	EUR			100.000
Anleihen fix		FR0013447877	ORANGE SA ORAFP 1 3/4 PERP	EUR		200.000	300.000
Anleihen fix		FR0013506300	ORANGE SA ORAFP 1 5/8 04/07/32	EUR		100.000	100.000
Anleihen fix		XS2168625460	PEPSICO INC PEP 0 1/4 05/06/24	EUR		200.000	200.000
Anleihen fix		XS1900752905	PROCTER & GAMBLE CO/THE PG 1 7/8 10/30/38	EUR			100.000
Anleihen fix		XS2154441120	RED ELECTRICA CORP REESM 0 7/8 04/14/25	EUR		200.000	200.000
Anleihen fix		XS2156581394	REPSOL INTL FINANCE REPSM 2 12/15/25	EUR		100.000	100.000
Anleihen fix		XS1720806774	RLB OBEROESTERREICH RFLBOB 0 3/4 05/22/23	EUR			100.000
Anleihen fix		XS2153459123	ROYAL SCHIPHOL GROUP NV LUCSHI 2 04/06/29	EUR		100.000	100.000
Anleihen fix		FR0013505104	SANOFI SANFP 1 04/01/25	EUR			100.000
Anleihen fix		XS2166754957	SCHLUMBERGER FINANCE BV SLB 1 3/8 10/28/26	EUR		100.000	100.000
Anleihen fix		XS2078735276	SHELL INTERNATIONAL FIN RDSALN 0 1/2 11/08/31	EUR			100.000
Anleihen fix		XS1135276332	SHELL INTERNATIONAL FIN RDSALN 1 04/06/22	EUR			100.000
Anleihen fix		XS2154419118	SHELL INTERNATIONAL FIN RDSALN 1 7/8 04/07/32	EUR		200.000	200.000
Anleihen fix		XS2049616894	SIEMENS FINANCIERINGSMAT SIEGR 0 1/2 09/05/34	EUR			300.000
Anleihen fix		XS2118276026	SIEMENS FINANCIERINGSMAT SIEGR 0 1/4 02/20/29	EUR			100.000
Anleihen fix		XS2156787090	SSE PLC SSELN 1 1/4 04/16/25	EUR		100.000	100.000
Anleihen fix		XS2156787173	SSE PLC SSELN 1 3/4 04/16/30	EUR		100.000	100.000
Anleihen fix		FR0013505542	SUEZ SEVFP 1 1/4 04/02/27	EUR			100.000
Anleihen fix		XS1843449395	TAKEDA PHARMACEUTICAL TACHEM 3 11/21/30	EUR			100.000
Anleihen fix		XS1907150350	TELE2 AB TELBSS 1 1/8 05/15/24	EUR			100.000
Anleihen fix		XS2020583618	TELEFONICA EMISIONES SAU TELEFO 1.957 07/01/39	EUR			100.000
Anleihen fix		XS2001737324	TELENOR ASA TELNO 0 3/4 05/31/26	EUR			100.000
Anleihen fix		XS2160857798	TELSTRA CORP LTD TLSAU 1 04/23/30	EUR		100.000	100.000
Anleihen fix		XS0903136736	TELSTRA CORP LTD TLSAU 2 1/2 09/15/23	EUR			100.000
Anleihen fix		XS2002491863	TENNET HOLDING BV TENN 1 1/2 06/03/39	EUR		200.000	200.000
Anleihen fix		XS2086868010	TESCO CORP TREASURY SERV TSCOLN 0 7/8 05/29/26	EUR		100.000	100.000
Anleihen fix		XS2153406868	TOTAL CAPITAL INTL SA TOTAL 1.491 04/08/27	EUR		200.000	200.000
Anleihen fix		XS1413581205	TOTAL SE TOTAL 3 7/8 PERP	EUR		100.000	100.000
Anleihen fix		XS2156236296	TOYOTA FINANCE AUSTRALIA TOYOTA 2.004 10/21/24	EUR		100.000	100.000
Anleihen fix		XS2149270477	UBS AG LONDON UBS 0 3/4 04/21/23	EUR		200.000	200.000
Anleihen fix		FR0013394681	VEOLIA ENVIRONNEMENT SA VIEFP 0.892 01/14/24	EUR			100.000
Anleihen fix		FR0013507704	VEOLIA ENVIRONNEMENT SA VIEFP 1 1/4 04/15/28	EUR		100.000	100.000
Anleihen fix		XS1979280853	VERIZON COMMUNICATIONS VZ 0 7/8 04/08/27	EUR			150.000
Anleihen fix		FR0013424876	VIVENDI SA VIVFP 1 1/8 12/11/28	EUR			100.000
Anleihen fix		XS2002018500	VODAFONE GROUP PLC VOD 1 5/8 11/24/30	EUR			100.000

Wertpapierart	OGAW/§ 166	ISIN	Wertpapierbezeichnung	Währung		Käufe Zugänge	Verkäufe Abgänge
Anleihen fix		AT0000A27LQ1	VOESTALPINE AG VOEAV 1 3/4 04/10/26	EUR			100.000
Anleihen fix		XS1972548231	VOLKSWAGEN FIN SERV AG VW 1 1/2 10/01/24	EUR			150.000
Anleihen fix		XS1799938995	VOLKSWAGEN INTL FIN NV VW 3 3/8 PERP	EUR		100.000	100.000
Anleihen fix		XS2014291616	VOLKSWAGEN LEASING GMBH VW 1 1/2 06/19/26	EUR			100.000
Anleihen fix		DE000A28VQC4	VONOVIA FINANCE BV ANNGR 1 5/8 04/07/24	EUR		100.000	100.000
Anleihen fix		XS2167007249	WELLS FARGO & COMPANY WFC 1.338 05/04/25	EUR		150.000	150.000
Anleihen fix		XS2054210252	WINTERSHALL DEA FINANCE WNTRDE 1.332 09/25/28	EUR			100.000
Anleihen fix		XS2010039381	ZF EUROPE FINANCE BV ZFFNGR 2 02/23/26	EUR			100.000
Bezugsrechte		INE002A20018	RELIANCE INDUSTRIES LTD-RTS RILR	INR		254	254
Investmentzertifikate extern	OGAW	CH0002783535	SPROTT-FALCON GOLD EQUITY FUND A USD	USD			4.494
Strukturierte Produkte - Inflationsgebundene Anleihen		FR0010585901	FRANCE (GOVT OF) FRTR 2.1 07/25/23	EUR			6.300.000
Strukturierte Produkte - Inflationsgebundene Anleihen		US912828Y388	TSY INFL IX N/B TII 0 3/4 07/15/28	USD			4.150.000

1 Kursgewinne und -verluste zum Stichtag.

Zusätzliche Angaben zu Wertpapierleihegeschäften

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

18,46 %

Betrag der verliehenen Wertpapiere: 15.333.939,49 EUR

Anteil an den verleihbaren Vermögenswerten: 23,96 %

Zum Stichtag 30.09.2020 waren folgende Wertpapiere verliehen:

ISIN	Wertpapierbezeichnung	Geregelter Markt	Währung	Assetklasse	Emittent	Rating	Bestand per 30.09.2020	Kurswert (inkl. allfälliger Stückzinsen) 30.09.2020	Anteil am Fondsvermögen
DE0001030542	DEUTSCHLAND I/L BOND DBRI 0.1 04/15/23	LISTED	EUR	Anleihen	Federal Republic of Germany	aaa	3.500.000	3.875.163,25	4,67 %
DE0001030567	DEUTSCHLAND I/L BOND DBRI 0.1 04/15/26	LISTED	EUR	Anleihen	Federal Republic of Germany	aaa	3.350.000	3.787.257,41	4,56 %
FR0011008705	FRANCE (GOVT OF) FRTR 1.85 07/25/27	LISTED	EUR	Anleihen	French Republic	aa	2.800.000	3.807.746,13	4,58 %
FR0011982776	FRANCE (GOVT OF) FRTR 0.7 07/25/30	LISTED	EUR	Anleihen	French Republic	aa	3.100.000	3.863.772,70	4,65 %

- 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 Gegenparteiensrisiko 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 30.09.2020	Kurswert in Portfoliwährung
XS1785829760	BANK OF CHINA/HONG KONG BCHINA 4 03/08/28	LISTED	USD	Anleihen	Bank of China Ltd/Hong Kong	a	13.600.000	13.240.610,35
XS2103230152	POSCO POHANG 0 1/2 01/17/24	LISTED	EUR	Anleihen	POSCO	bbb	10.000.000	9.880.814,00

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.

Zusätzliche Angaben zu Sicherheiten bei OTC-Derivaten

Entsprechend den Anforderungen der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 des Europäischen Parlaments und des Rates über OTC-Derivate, zentrale Gegenparteien und Transaktionsregister („EMIR“) werden OTC-Derivate mit Ausnahme eines Mindesttransferbetrages („Minimum Transfer Amount“) besichert, wodurch das Ausfallsrisiko der Gegenpartei des OTC-Derivates reduziert wird. Als Sicherheiten wurden in der Berichtsperiode ausschließlich Sichteinlagen eingesetzt, die auf einem bei einer von der Gegenpartei unabhängigen Kreditinstitut geführten Konto eingezahlt werden. Zuschläge (sogenannter „Haircut“) werden dabei nicht berücksichtigt. Die als Sicherheit erhaltenen Sichteinlagen werden nicht für den Kauf weiterer Vermögenswerte für das Fondsvermögen eingesetzt bzw. auch sonst nicht wiederverwendet.

Am Stichtag 30. September 2020 waren ausschließlich OTC-Derivate (Devisentermingeschäfte) mit der Raiffeisen Bank International AG als Gegenpartei offen. Zur Besicherung dieser offenen Positionen war zum genannten Stichtag von der Verwaltungsgesellschaft ein Betrag in der Höhe von 160.000,00 EUR aus dem Fondsvermögen bei der Raiffeisen Bank International AG erlegt.

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 6. November 2020

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