

Raiffeisen-Nachhaltigkeit-Diversified

Halbjahresbericht

Berichtszeitraum 01.04.2022 – 30.09.2022

Inhaltsverzeichnis

Allgemeine Fondsdaten	3
Fondscharakteristik.....	3
Rechtlicher Hinweis	4
Fondsdetails.....	5
Umlaufende Anteile.....	6
Bericht zur Anlagepolitik des Fonds	7
Zusammensetzung des Fondsvermögens in EUR	8
Vermögensaufstellung in EUR per 30.09.2022	10
Anhang	16

Bericht über den Berichtszeitraum vom 01.04.2022 bis 30.09.2022

Allgemeine Fondsdaten

ISIN	Tranche	Ertragstyp	Währung	Auflegedatum
AT0000A10071	Raiffeisen-Nachhaltigkeit-Diversified (I) A	Ausschüttung	EUR	26.04.2013
AT0000A2E0B6	Raiffeisen-Nachhaltigkeit-Diversified (S) A	Ausschüttung	EUR	01.04.2020
AT0000A2SR10	Raiffeisen-Nachhaltigkeit-Diversified (R) A	Ausschüttung	EUR	01.10.2021
AT0000A2SR36	Raiffeisen-Nachhaltigkeit-Diversified (RZ) A	Ausschüttung	EUR	01.10.2021
AT0000A10089	Raiffeisen-Nachhaltigkeit-Diversified (I) T	Thesaurierung	EUR	26.04.2013
AT0000A2SR02	Raiffeisen-Nachhaltigkeit-Diversified (R) T	Thesaurierung	EUR	01.10.2021
AT0000A2SR28	Raiffeisen-Nachhaltigkeit-Diversified (RZ) T	Thesaurierung	EUR	01.10.2021
AT0000A10097	Raiffeisen-Nachhaltigkeit-Diversified (I) VTA	Vollthesaurierung Ausland	EUR	26.04.2013
AT0000A105C5	Raiffeisen-Nachhaltigkeit-Diversified (R) VTA	Vollthesaurierung Ausland	EUR	02.05.2013
AT0000A1YC02	Raiffeisen-Nachhaltigkeit-Diversified (RZ) VTA	Vollthesaurierung Ausland	EUR	01.12.2017

Fondscharakteristik

Fondswährung	EUR
Rechnungsjahr	01.04. – 31.03.
Ausschüttungs- / Auszahlungs- / Wieder- veranlagungstag	01.06.
Fondsbezeichnung	Investmentfonds gemäß § 2 InvFG (OGAW)
effektive Verwaltungsgebühr des Fonds	I-Tranche (EUR): 0,500 % S-Tranche (EUR): 1,500 % R-Tranche (EUR): 1,000 % RZ-Tranche (EUR): 0,500 %
max. Verwaltungsgebühr der Subfonds	1,000 %
Depotbank	Raiffeisen Bank International AG
Verwaltungsgesellschaft	Raiffeisen Kapitalanlage-Gesellschaft m.b.H. Mooslackengasse 12, A-1190 Wien Tel. +43 1 71170-0 Fax +43 1 71170-761092 www.rcm.at Firmenbuchnummer: 83517 w
Fondsmanagement	Raiffeisen Kapitalanlage-Gesellschaft m.b.H.
Abschlussprüfer	KPMG Austria GmbH

Der Fonds wird aktiv ohne Bezugnahme zu einem Referenzwert verwaltet.

Rechtlicher Hinweis

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

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

Das Nettovermögen wird nach folgenden Grundsätzen ermittelt:

- a) Der Wert von Vermögenswerten, welche an einer Börse oder an einem anderen geregelten Markt notiert oder gehandelt werden, wird grundsätzlich auf der Grundlage des letzten verfügbaren Kurses ermittelt.
- b) Sofern ein Vermögenswert nicht an einer Börse oder an einem anderen geregelten Markt notiert oder gehandelt wird oder sofern für einen Vermögenswert, welcher an einer Börse oder an einem anderen geregelten Markt notiert oder gehandelt wird, der Kurs den tatsächlichen Marktwert nicht angemessen widerspiegelt, wird auf die Kurse zuverlässiger Datenprovider oder alternativ auf Marktpreise gleichartiger Wertpapiere oder andere anerkannte Bewertungsmethoden zurückgegriffen.

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

Sehr geehrte Anteilshaber!

Die Raiffeisen Kapitalanlage-Gesellschaft m.b.H. erlaubt sich den Halbjahresbericht des Raiffeisen-Nachhaltigkeit-Diversified für den Berichtszeitraum vom 01.04.2022 bis 30.09.2022 vorzulegen. Dem Rechnungsabschluss wurde die Preisberechnung vom 30.09.2022 zu Grunde gelegt.

Fondsdetails

	31.03.2022	30.09.2022
Fondsvermögen gesamt in EUR	235.318.709,38	240.961.169,26
errechneter Wert / Ausschüttungsanteile (I) (AT0000A10071) in EUR	103,61	95,28
Ausgabepreis / Ausschüttungsanteile (I) (AT0000A10071) in EUR	103,61	95,28
errechneter Wert / Ausschüttungsanteile (S) (AT0000A2E0B6) in EUR	108,82	99,56
Ausgabepreis / Ausschüttungsanteile (S) (AT0000A2E0B6) in EUR	108,82	99,56
errechneter Wert / Ausschüttungsanteile (R) (AT0000A2SR10) in EUR	99,20	90,99
Ausgabepreis / Ausschüttungsanteile (R) (AT0000A2SR10) in EUR	99,20	90,99
errechneter Wert / Ausschüttungsanteile (RZ) (AT0000A2SR36) in EUR	99,45	91,46
Ausgabepreis / Ausschüttungsanteile (RZ) (AT0000A2SR36) in EUR	99,45	91,46
errechneter Wert / Thesaurierungsanteile (I) (AT0000A10089) in EUR	112,66	104,43
Ausgabepreis / Thesaurierungsanteile (I) (AT0000A10089) in EUR	112,66	104,43
errechneter Wert / Thesaurierungsanteile (R) (AT0000A2SR02) in EUR	99,20	91,81
Ausgabepreis / Thesaurierungsanteile (R) (AT0000A2SR02) in EUR	99,20	91,81
errechneter Wert / Thesaurierungsanteile (RZ) (AT0000A2SR28) in EUR	99,44	92,19
Ausgabepreis / Thesaurierungsanteile (RZ) (AT0000A2SR28) in EUR	99,44	92,19
errechneter Wert / Vollthesaurierungsanteile (I) (AT0000A10097) in EUR	116,98	108,68
Ausgabepreis / Vollthesaurierungsanteile (I) (AT0000A10097) in EUR	116,98	108,68
errechneter Wert / Vollthesaurierungsanteile (R) (AT0000A105C5) in EUR	108,36	100,41
Ausgabepreis / Vollthesaurierungsanteile (R) (AT0000A105C5) in EUR	108,36	100,41
errechneter Wert / Vollthesaurierungsanteile (RZ) (AT0000A1YC02) in EUR	111,49	103,58
Ausgabepreis / Vollthesaurierungsanteile (RZ) (AT0000A1YC02) in EUR	111,49	103,58

Umlaufende Anteile

	Umlaufende Anteile am 31.03.2022	Absätze	Rücknahmen	Umlaufende Anteile am 30.09.2022
AT0000A10071 (I) A	86.182,603	20.970,378	0,000	107.152,981
AT0000A2E0B6 (S) A	12.277,510	14.669,620	-44,039	26.903,091
AT0000A2SR10 (R) A	2.815,489	198,251	-27,734	2.986,006
AT0000A2SR36 (RZ) A	7.981,566	7.991,171	-10,000	15.962,737
AT0000A10089 (I) T	1.467.968,099	138.588,000	-162.090,000	1.444.466,099
AT0000A2SR02 (R) T	30.470,040	5.350,491	-9.174,026	26.646,505
AT0000A2SR28 (RZ) T	163.676,838	185.588,220	-8.075,844	341.189,214
AT0000A10097 (I) VTA	91.963,408	10.441,121	-13.795,820	88.608,709
AT0000A105C5 (R) VTA	262.753,772	77.566,102	-22.704,915	317.614,959
AT0000A1YC02 (RZ) VTA	506,831	0,000	0,000	506,831
Gesamt umlaufende Anteile				2.372.037,132

Bericht zur Anlagepolitik des Fonds

Unter dem Eindruck steigender Inflationsraten und Anleiherenditen musste der Fonds im abgelaufenen Berichtszeitraum negative Performancebeiträge aller wesentlichen Assetklassen – mit Ausnahme von positiven FX-Beiträgen – hinnehmen.

Innerhalb des Berichtszeitraums erfolgten folgende wesentliche Änderungen in der strategischen Ausrichtung des Fonds: Einerseits wurden Gewinne beim Inflationsthema (v. a. bei inflationsgeschützten Anleihen) mitgenommen, andererseits das Zinsrisiko und Spreadrisiko des Fonds erhöht.

Durch die kürzerfristig orientierten aktiven Strategien schwankte die Gesamtaktienquote des Fonds zwischen ca. 8 % und 15 %. Im Durchschnitt lag die Aktienquote bei rund 11 %.

Das Aktiensegment des Raiffeisen-Nachhaltigkeit-Diversified zeigt in der Berichtsperiode eine negative Entwicklung. Die besten Ergebnisse auf Einzeltitelebene erzielte das Segment unter anderem mit dem weltweit größten Anbieter von Catering-Dienstleistungen der britischen Compass Group oder durch die deutsche Rückversicherungs-Gesellschaft Munich Re. Die schwächsten Ergebnisse auf der Einzeltitelebene wurden unter anderem beim schwedischen Spezialisten für Cloud-Kommunikationsplattform-Lösungen Sinch und bei dem Versorger Scatec, der Solar-, Wind- und Wasserkraftwerke entwickelt, baut, besitzt und betreibt, verzeichnet. Der Fonds ist in Energiewerten aufgrund von nachhaltigen Risiken nicht investiert, jedoch ist das Segment in erneuerbare Energien unter anderem durch den weltgrößten Hersteller von Windkraftanlagen Vestas Wind positioniert. Die Sektor- und Ländergewichtung ergab sich aus dem Bottom-up-Ansatz. Das Segment investiert in Unternehmen mit einer hohen Nachhaltigkeitsbewertung in den Bereichen Umwelt, Soziales und verantwortungsvolle Unternehmensführung und dabei wird auch auf die finanzielle Qualität geachtet.

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
Aktien		CHF	1.946.001,98	0,81 %
Aktien		DKK	2.716.546,84	1,13 %
Aktien		EUR	13.501.508,74	5,60 %
Aktien		GBP	3.373.460,93	1,40 %
Aktien		JPY	4.092.808,39	1,70 %
Aktien		NOK	1.518.421,73	0,63 %
Aktien		SEK	818.792,94	0,34 %
Summe Aktien			27.967.541,55	11,61 %
Anleihen fix		AUD	33.180.722,39	13,77 %
Anleihen fix		CAD	26.970.998,74	11,19 %
Anleihen fix		EUR	14.700.568,35	6,10 %
Anleihen fix		GBP	10.924.192,75	4,53 %
Anleihen fix		NOK	4.135.544,68	1,72 %
Anleihen fix		USD	34.003.838,32	14,11 %
Summe Anleihen fix			123.915.865,23	51,43 %
Investmentzertifikate Raiffeisen KAG	OGAW	EUR	22.022.887,42	9,14 %
Summe Investmentzertifikate Raiffeisen KAG			22.022.887,42	9,14 %
Strukturierte Produkte - Inflationsgebundene Anleihen		EUR	40.757.582,85	16,91 %
Summe Strukturierte Produkte - Inflationsgebundene Anleihen			40.757.582,85	16,91 %
Summe Wertpapiervermögen			214.663.877,05	89,09 %
Derivative Produkte				
Bewertung Finanzterminkontrakte			2.670.049,77	1,11 %
Bewertung Devisentermingeschäfte			-289.632,35	-0,12 %
Summe Derivative Produkte			2.380.417,42	0,99 %

Wertpapierart	OGAW/§ 166	Währung	Kurswert in EUR	Anteil am Fondsvermögen
Bankguthaben/-verbindlichkeiten				
Bankguthaben/-verbindlichkeiten in Fondswährung			22.621.255,27	9,39 %
Bankguthaben/-verbindlichkeiten in Fremdwährung			270.213,24	0,10 %
Summe Bankguthaben/-verbindlichkeiten			22.891.468,51	9,50 %
Abgrenzungen				
Zinsenansprüche (aus Wertpapieren und Bankguthaben)			1.134.179,44	0,47 %
Cash Collateral Zinsen gegeben			-75,73	-0,00 %
Cash Collateral Zinsen erhalten			-133,17	-0,00 %
Dividendenforderungen			51.393,44	0,02 %
Summe Abgrenzungen			1.185.363,98	0,49 %
Sonstige Verrechnungsposten				
Diverse Gebühren			-159.957,71	-0,07 %
Summe Sonstige Verrechnungsposten			-159.957,71	-0,07 %
Summe Fondsvermögen			240.961.169,26	100,00 %

Vermögensaufstellung in EUR per 30.09.2022

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

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

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

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

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

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

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

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

Wertpapierart	OGAW/§ 166	ISIN	Wertpapierbezeichnung	Währung	Bestand Stk./Nom.	Käufe im Berichtszeitraum Stk./Nom.	Verkäufe Stk./Nom.	Pool-/ILB-Faktor	Kurs	Kurswert in EUR	Anteil am Fondsvermögen
Aktien		CH0030170408	GEBERIT AG-REG GEBN	CHF	1.345				411,500000	577.671,95	0,24 %
Aktien		CH0012032048	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN ROG	CHF	2.148				320,250000	717.980,38	0,30 %
Aktien		CH0002497458	SGS SA-REG SGSN	CHF	300				2.077,000000	650.349,65	0,27 %
Aktien		DK0060448595	COLOPLAST-B COLOB	DKK	6.060				756,000000	616.084,72	0,26 %
Aktien		DK0060534915	NOVO NORDISK A/S-B NOVOB	DKK	8.435				764,700000	867.405,55	0,36 %
Aktien		DK0060336014	NOVOZYMES A/S-B SHARES NZYMB	DKK	13.834				374,700000	697.071,75	0,29 %
Aktien		DK0061539921	VESTAS WIND SYSTEMS A/S VWS	DKK	28.699				138,880000	535.984,82	0,22 %
Aktien		FR0000120404	ACCOR SA AC	EUR	26.795				21,440000	574.484,80	0,24 %
Aktien		NL0013267909	AKZO NOBEL N.V. AKZA	EUR	9.765				56,800000	554.652,00	0,23 %
Aktien		NL0010273215	ASML HOLDING NV ASML	EUR	1.361				431,900000	587.815,90	0,24 %
Aktien		FR0000125338	CAPGEMINI SE CAP	EUR	4.223				159,650000	674.201,95	0,28 %
Aktien		FI0009007884	ELISA OYJ ELISA	EUR	14.698				47,860000	703.446,28	0,29 %
Aktien		FR0000121667	ESSILORLUXOTTICA EL	EUR	4.857				141,000000	684.837,00	0,28 %
Aktien		DE0008402215	HANNOVER RUECK SE HNR1	EUR	5.010				153,000000	766.530,00	0,32 %
Aktien		DE0006048432	HENKEL AG & CO KGAA VOR-PREF HEN3	EUR	11.493				60,360000	693.717,48	0,29 %
Aktien		BE0003565737	KBC GROUP NV KBC	EUR	12.211				49,040000	598.827,44	0,25 %
Aktien		IE0004906560	KERRY GROUP PLC-A KYG	EUR	7.637				90,080000	687.940,96	0,29 %
Aktien		NL0000009082	KONINKLIJKE KPN NV KPN	EUR	252.440				2,781000	702.035,64	0,29 %
Aktien		DE0006599905	MERCK KGAA MRK	EUR	4.283				163,600000	700.698,80	0,29 %
Aktien		FR001400AJ45	MICHELIN (CGDE) ML	EUR	26.204	26.204			22,450000	588.279,80	0,24 %
Aktien		DE0008430026	MUENCHENER RUECKVER AG-REG MUV2	EUR	3.119				245,500000	765.714,50	0,32 %
Aktien		GB00B2B0DG97	RELX PLC REN	EUR	29.325				24,820000	727.846,50	0,30 %
Aktien		DE0007164600	SAP SE SAP	EUR	7.421				81,870000	607.557,27	0,25 %
Aktien		FR0000121972	SCHNEIDER ELECTRIC SE SU	EUR	5.226				114,160000	596.600,16	0,25 %
Aktien		BE0974320526	UMICORE UMI	EUR	20.962				29,470000	617.750,14	0,26 %
Aktien		FR0013326246	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD URW	EUR	12.268				40,290000	494.277,72	0,21 %
Aktien		AT0000746409	VERBUND AG VER	EUR	8.072				86,750000	700.246,00	0,29 %
Aktien		AT0000937503	VOESTALPINE AG VOE	EUR	27.370				17,320000	474.048,40	0,20 %
Aktien		GB00B0744B38	BUNZL PLC BNZL	GBP	22.438				27,470000	696.386,69	0,29 %
Aktien		GB00BD6K4575	COMPASS GROUP PLC CPG	GBP	37.441				18,090000	765.232,96	0,32 %
Aktien		GB00BJFFLV09	CRODA INTERNATIONAL PLC CRDA	GBP	9.067				63,160000	647.013,58	0,27 %

Berichtszeitraum 01.04.2022 – 30.09.2022

Raiffeisen-Nachhaltigkeit-Diversified

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
Aktien		GB00BZ4BQC70	JOHNSON MATTHEY PLC JMAT	GBP	32.836				18,215000	675.751,60	0,28 %
Aktien		GB00BDR05C01	NATIONAL GRID PLC NG/	GBP	55.621				9,374000	589.076,10	0,24 %
Aktien		JP3942400007	ASTELLAS PHARMA INC 4503	JPY	51.400				1.905,000000	693.371,35	0,29 %
Aktien		JP3551500006	DENSO CORP 6902	JPY	13.960				7.015,000000	693.459,15	0,29 %
Aktien		JP3197800000	OMRON CORP 6645	JPY	12.800				6.726,000000	609.641,64	0,25 %
Aktien		JP3419400001	SEKISUI CHEMICAL CO LTD 4204	JPY	56.160				1.773,000000	705.088,49	0,29 %
Aktien		JP3892100003	SUMITOMO MITSUI TRUST HOLDIN 8309	JPY	24.600				4.157,000000	724.140,64	0,30 %
Aktien		JP3351100007	SYSMEX CORP 6869	JPY	11.500				8.192,000000	667.107,12	0,28 %
Aktien		NO0010657505	BORREGAARD ASA BRG	NOK	40.838				125,600000	488.488,64	0,20 %
Aktien		NO0010715139	SCATEC ASA SCATC	NOK	51.955				82,280000	407.119,58	0,17 %
Aktien		NO0012470089	TOMRA SYSTEMS ASA TOM	NOK	35.662	35.662			183,380000	622.813,51	0,26 %
Aktien		SE0009922164	ESSITY AKTIEBOLAG-B ESSITYB	SEK	34.187				219,000000	683.459,13	0,28 %
Aktien		SE0016101844	SINCH AB SINCH	SEK	105.397				14,066000	135.333,81	0,06 %
Anleihen fix		AU3SG0001571	NEW S WALES TREASURY CRP NSWTC 3 02/20/30	AUD	18.400.000	2.700.000			91,214000	11.128.083,81	4,62 %
Anleihen fix		AU000XQLQAB5	QUEENSLAND TREASURY CORP QTC 3 1/4 07/21/28	AUD	17.900.000	2.400.000			94,993000	11.274.199,05	4,68 %
Anleihen fix		AU3SG0001175	TREASURY CORP VICTORIA TCV 4 1/4 12/20/32	AUD	16.750.000	2.800.000			97,051000	10.778.439,53	4,47 %
Anleihen fix		CA135087E679	CANADIAN GOVERNMENT CAN 1 1/2 06/01/26	CAD	2.550.000				93,257500	1.775.405,02	0,74 %
Anleihen fix		CA135087K379	CANADIAN GOVERNMENT CAN 1 1/4 06/01/30	CAD	12.200.000				86,787000	7.904.747,47	3,28 %
Anleihen fix		CA68333ZAJ62	ONTARIO (PROVINCE OF) ONT 1.85 02/01/27	CAD	10.000.000				92,193000	6.882.899,70	2,86 %
Anleihen fix		CA748148SA23	PROVINCE OF QUEBEC Q 1.85 02/13/27	CAD	15.100.000				92,324000	10.407.946,55	4,32 %
Anleihen fix		XS2468223107	ASSICURAZIONI GENERALI ASSGEN 5 8 07/06/32	EUR	800.000	800.000			94,257500	754.060,00	0,31 %
Anleihen fix		ES00000123U9	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO SPGB 5 4 01/31/23	EUR	11.000.000				101,365000	11.150.150,00	4,63 %
Anleihen fix		XS2010039548	DEUTSCHE BAHN FIN GMBH DBHNGR 1 6 PERP	Y EUR	500.000	500.000			73,822670	369.113,35	0,15 %
Anleihen fix		AT0000A2L583	ERSTE GROUP BANK AG ERSTBK 4 1/4 PERP	Y EUR	1.000.000	1.000.000			71,422000	714.220,00	0,30 %
Anleihen fix		XS2439704318	SSE PLC SSELN 4 PERP	Y EUR	1.000.000	1.000.000			87,407700	874.077,00	0,36 %
Anleihen fix		XS2437854487	TERNA RETE ELETTRICA TRNIM 2 3/8 PERP	Y EUR	1.100.000	1.100.000			76,268000	838.948,00	0,35 %
Anleihen fix		XS0138038624	KFW KFW 5 3/4 06/07/32	GBP	4.300.000	4.300.000			108,912000	5.291.171,62	2,20 %
Anleihen fix		XS1222743061	TRANSPORT FOR LONDON TRANLN 2 1/8 04/24/25	GBP	5.550.000				89,834000	5.633.021,13	2,34 %
Anleihen fix		NO0010646813	NORWEGIAN GOVERNMENT NGB 2 05/24/23	NOK	43.700.000				99,369000	4.135.544,68	1,72 %
Anleihen fix		US045167EC30	ASIAN DEVELOPMENT BANK ASIA 2 3/8 08/10/27	USD	2.300.000				92,025000	2.167.178,62	0,90 %
Anleihen fix		US045167EJ82	ASIAN DEVELOPMENT BANK ASIA 3 1/8 09/26/28	USD	3.700.000				94,234000	3.570.017,92	1,48 %
Anleihen fix		XS2436433333	CAISSE D'AMORT DETTE SOC CADES 2 1/8 01/26/32	USD	8.000.000	8.000.000			84,458000	6.918.179,49	2,87 %
Anleihen fix		US298785HM16	EUROPEAN INVESTMENT BANK EIB 2 3/8 05/24/27	USD	7.650.000				92,614000	7.254.360,31	3,01 %
Anleihen fix		US45905URL07	INTL BK RECON & DEVELOP IBRD 2 1/8 03/03/25	USD	2.960.000				95,007000	2.879.442,17	1,19 %
Anleihen fix		XS1188118100	KOMMUNALBANKEN AS KBN 2 1/8 02/11/25	USD	1.950.000				95,007000	1.896.929,81	0,79 %
Anleihen fix		XS1386139841	NEDER WATERSCHAPSBANK NEDWBK 2 3/8 03/24/26	USD	9.738.000				93,450000	9.317.730,00	3,87 %
Investmentzertifikate Raiffeisen KAG	OGAW	AT0000A1TB67	RAIFFEISEN-NACHHALTIGKEIT-EMERGINGMARKETS-AKTIEN (I) T	EUR	53.444	17.322	5.822		117,920000	6.302.116,48	2,62 %
Investmentzertifikate Raiffeisen KAG	OGAW	AT0000805221	RAIFFEISEN-NACHHALTIGKEIT-RENT (R) T	EUR	1.394.922	170.881	93.767		11,270000	15.720.770,94	6,52 %
Strukturierte Produkte - Inflationsgebundene Anleihen		IT0005387052	BUONI POLIENNALI DEL TES BTPS 0 4 05/15/30	EUR	9.400.000	9.400.000		1,128480	87,101225	9.239.447,10	3,83 %
Strukturierte Produkte - Inflationsgebundene Anleihen		DE0001030559	DEUTSCHLAND I/L BOND DBRI 0 1/2 04/15/30	EUR	7.250.000	600.000	5.100.000	1,178200	104,577865	8.932.988,94	3,71 %
Strukturierte Produkte - Inflationsgebundene Anleihen		DE0001030542	DEUTSCHLAND I/L BOND DBRI 0 1 04/15/23	EUR	3.900.000			1,207330	102,227040	4.813.449,12	2,00 %
Strukturierte Produkte - Inflationsgebundene Anleihen		DE0001030567	DEUTSCHLAND I/L BOND DBRI 0 1 04/15/26	EUR	13.650.000	800.000		1,175080	102,384120	16.422.251,08	6,82 %
Strukturierte Produkte - Inflationsgebundene Anleihen		DE0001030583	DEUTSCHLAND I/L BOND DBRI 0 1 04/15/33	EUR	1.200.000	1.200.000		1,118220	100,565080	1.349.446,61	0,56 %
Summe der zum amtlichen Handel oder einem anderen geregelten Markt zugelassenen Wertpapiere sowie Investmentzertifikate										214.663.877,05	89,09 %
Summe Wertpapiervermögen										214.663.877,05	89,09 %

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
Aktienindex Futures		FESX20221216	EURO STOXX 50 Dec22 VGZ2	EUR	-265				3.268,000000	1.046.750,00	0,43 %
Aktienindex Futures		FSNK20221208	NIKKEI 225 (SGX) Dec22 NIZ2 PIT	JPY	-3				26.320,000000	12.034,53	0,00 %
Aktienindex Futures		FSNK20221208	NIKKEI 225 (SGX) Dec22 NIZ2 PIT	JPY	-29				26.320,000000	-513,39	-0,00 %
Aktienindex Futures		FEMI20221216	MSCI EmgMkt Dec22 MESZ2	USD	-75				875,100000	440.007,57	0,18 %
Anleihenfutures		FGBL20221208	EURO-BUND FUTURE Dec22 RXZ2	EUR	-132				137,500000	964.920,00	0,40 %
Rohstoffindex Futures		XLEN20221216	BCOMEN Energy XL Dec22 XLBZ2	USD	-12				47,200000	64.089,62	0,03 %
Rohstoffindex Futures		FCIN20221216	BCOMIN Ind Mets Dec22 FCIZ2	USD	80				145,940000	-197.647,45	-0,08 %
Rohstoffindex Futures		FCPR20221216	BCOMPR PRECIOUS Dec22 UBPZ2	USD	110				190,290000	-248.067,37	-0,10 %
Währungsfutures		FEBP20221219	EURO/GBP FUTURE Dec22 RPZ2 PIT	GBP	125				0,889040	279.629,42	0,12 %
Währungsfutures		FEJY20221219	EURO/JPY FUTURE Dec22 RYZ2	JPY	30				141,030800	-52.291,23	-0,02 %
Währungsfutures		FAUD20221219	AUDUSD Crncy Fut Dec22 ADZ2 PIT	USD	-524				0,649940	1.332.735,37	0,55 %
Währungsfutures		0FCD20221220	C\$ CURRENCY FUT Dec22 CDZ2 PIT	USD	-368				0,730640	1.033.180,77	0,43 %
Währungsfutures		0FEC20221219	EURO FX CURR FUT Dec22 ECZ2 PIT	USD	714				0,984420	-2.004.778,07	-0,83 %
Summe Finanzterminkontrakte¹										2.670.049,77	1,11 %
Devisentermingeschäfte			Forward / BOUGHT HUF / SOLD USD / Raiffeisen Bank International AG	HUF	1.383.000.000				427,035348	-164.135,24	-0,07 %
Devisentermingeschäfte			Forward / BOUGHT MXN / SOLD USD / Raiffeisen Bank International AG	MXN	69.100.000				19,929107	-18.776,41	-0,01 %
Devisentermingeschäfte			Forward / BOUGHT TRY / SOLD USD / Raiffeisen Bank International AG	TRY	61.800.000				19,001211	44.193,94	0,02 %
FX NDF			Forward / BOUGHT BRL / SOLD USD / Raiffeisen Bank International AG	BRL	17.600.000				5,345781	-103.091,69	-0,04 %
FX NDF			Forward / BOUGHT CLP / SOLD USD / Raiffeisen Bank International AG	CLP	3.173.000.000				955,545137	-47.822,94	-0,02 %
Summe Devisentermingeschäfte¹										-289.632,35	-0,12 %
Bankguthaben/-verbindlichkeiten											
				EUR						22.621.255,27	9,39 %
				AUD						602,49	0,00 %
				CAD						137,19	0,00 %
				CHF						14.769,29	0,01 %
				GBP						740.164,87	0,31 %
				JPY						55.618,20	0,02 %
				MXN						35.132,98	0,01 %
				RUB						10,73	0,00 %
				TRY						9.689,23	0,00 %
				USD						-619.683,58	-0,26 %
				ZAR						33.771,84	0,01 %
Summe Bankguthaben/-verbindlichkeiten										22.891.468,51	9,50 %
Abgrenzungen											
Zinsenansprüche (aus Wertpapieren und Bankguthaben)										1.134.179,44	0,47 %
Cash Collateral Zinsen gegeben										-75,73	-0,00 %
Cash Collateral Zinsen erhalten										-133,17	-0,00 %
Dividendenforderungen										51.393,44	0,02 %
Summe Abgrenzungen										1.185.363,98	0,49 %

Berichtszeitraum 01.04.2022 – 30.09.2022

Raiffeisen-Nachhaltigkeit-Diversified

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
Sonstige Verrechnungsposten											
Diverse Gebühren										-159.957,71	-0,07 %
Summe Sonstige Verrechnungsposten										-159.957,71	-0,07 %
Summe Fondsvermögen										240.961.169,26	100,00 %

ISIN	Ertragstyp	Währung	Errechneter Wert je Anteil	Umlaufende Anteile in Stück
AT0000A10071	I Ausschüttung	EUR	95,28	107.152,981
AT0000A2E0B6	S Ausschüttung	EUR	99,56	26.903,091
AT0000A2SR10	R Ausschüttung	EUR	90,99	2.986,006
AT0000A2SR36	RZ Ausschüttung	EUR	91,46	15.962,737
AT0000A10089	I Thesaurierung	EUR	104,43	1.444.466,099
AT0000A2SR02	R Thesaurierung	EUR	91,81	26.646,505
AT0000A2SR28	RZ Thesaurierung	EUR	92,19	341.189,214
AT0000A10097	I Vollthesaurierung Ausland	EUR	108,68	88.608,709
AT0000A105C5	R Vollthesaurierung Ausland	EUR	100,41	317.614,959
AT0000A1YC02	RZ Vollthesaurierung Ausland	EUR	103,58	506,831

Devisenkurse

Vermögenswerte in fremder Währung wurden zu den Devisenkursen per 29.09.2022 in EUR umgerechnet

Währung	Kurs (1 EUR =)
Australische Dollar	AUD 1,508200
Kanadische Dollar	CAD 1,339450
Schweizer Franken	CHF 0,958100
Dänische Krone	DKK 7,436250
Britische Pfund	GBP 0,885100
Japanische Yen	JPY 141,218700
Mexikanische Pesos	MXN 19,739350
Norwegische Krone	NOK 10,500250
Russische Rubel	RUB 57,036400
Schwedische Kronen	SEK 10,954500
Türkische Lire	TRY 18,090000
Amerikanische Dollar	USD 0,976650
Südafrikanische Rand	ZAR 17,611450

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		FR0000121261	MICHELIN (CGDE) ML	EUR			6.551
Aktien		NO0005668905	TOMRA SYSTEMS ASA TOM	NOK			17.831
Anleihen fix		AT0000A1XM92	REPUBLIC OF AUSTRIA RAGB 0 09/20/22	EUR			7.300.000
Anleihen fix		AT0000A0N9A0	REPUBLIC OF AUSTRIA RAGB 3.65 04/20/22	EUR			1.500.000
Bezugsrechte		FR0014009LO3	ESSILORLUXOTTICA SA-SCRIP 2067556D	EUR		4.857	4.857
Investmentzertifikate Raiffeisen KAG	OGAW	AT0000A0ALQ3	RAIFFEISEN-NACHHALTIGKEIT-SHORTTERM (I) T	EUR			9.995

1 Kursgewinne und -verluste zum Stichtag.

Angaben zu Wertpapierleihegeschäften und Pensionsgeschäften

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

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 2022 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 0,00 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 10. November 2022

Raiffeisen Kapitalanlage-Gesellschaft m.b.H.

Mag. Rainer Schnabl

Mag. (FH) Dieter Aigner

Ing. Michal Kustra

Anhang

Impressum

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

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

Copyright beim Herausgeber, Versandort: Wien

Raiffeisen Capital Management ist die Dachmarke der Unternehmen:

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