

ZWISCHENBERICHT UND UNGEPRÜFTER ABSCHLUSS  
SOCIÉTÉ D'INVESTISSEMENT À CAPITAL VARIABLE  
30. SEPTEMBER 2020

## THREADNEEDLE (LUX)

## Inhalt

<b>Informationen zur Gesellschaft</b>	<b>4</b>	Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	<b>48</b>
<b>Shariah-Prüfbericht</b>	<b>5</b>	Threadneedle (Lux) - European Select	<b>50</b>
<b>Abschluss:</b>		Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	<b>52</b>
Konsolidierter Jahresabschluss für Threadneedle (Lux)	<b>7</b>	Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	<b>53</b>
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	<b>8</b>	Threadneedle (Lux) - Global Technology	<b>54</b>
Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	<b>10</b>	Threadneedle (Lux) - UK Equities	<b>55</b>
Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	<b>11</b>	Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	<b>57</b>
Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond	<b>13</b>	Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity	<b>59</b>
Threadneedle (Lux) - European Social Bond	<b>14</b>	Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	<b>60</b>
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	<b>15</b>	Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	<b>61</b>
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	<b>16</b>	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	<b>63</b>
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	<b>17</b>	Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	<b>65</b>
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	<b>18</b>	Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	<b>66</b>
Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	<b>19</b>	Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	<b>67</b>
Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	<b>20</b>	Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	<b>68</b>
Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	<b>21</b>	Threadneedle (Lux) - Gatehouse Shariah Global Equity	<b>70</b>
Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	<b>22</b>	<b>Portfolioaufstellungen</b>	
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	<b>23</b>	Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	<b>71</b>
Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities*	<b>25</b>	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	<b>79</b>
Threadneedle (Lux) - Global Focus	<b>26</b>	Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	<b>84</b>
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	<b>28</b>	Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond	<b>92</b>
Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	<b>29</b>	Threadneedle (Lux) - European Social Bond	<b>96</b>
Threadneedle (Lux) - Global Select	<b>31</b>	Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	<b>104</b>
Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	<b>32</b>	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	<b>112</b>
Threadneedle (Lux) - American	<b>33</b>	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	<b>116</b>
Threadneedle (Lux) - American Select	<b>35</b>	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	<b>121</b>
Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	<b>37</b>	Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	<b>126</b>
Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	<b>38</b>	Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	<b>137</b>
Threadneedle (Lux) - Asia Equities	<b>39</b>	Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	<b>141</b>
Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	<b>40</b>	Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	<b>142</b>
Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	<b>41</b>	Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	<b>145</b>
Threadneedle (Lux) - Pan European Equities	<b>43</b>	Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities*	<b>160</b>
Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	<b>45</b>		
Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	<b>47</b>		

## Inhalt

(Fortsetzung)

Threadneedle (Lux) - Global Focus	162	Threadneedle (Lux) - Gatehouse Shariah Global Equity	219
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	164	<b>Erläuterungen zum Abschluss</b>	<b>221</b>
Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	167	<b>Informationen für Anteilinhaber</b>	<b>317</b>
Threadneedle (Lux) - Global Select	169	<b>Informationen für Anleger in der Schweiz</b>	<b>318</b>
Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	171	<b>Verordnung über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte</b>	<b>319</b>
Threadneedle (Lux) - American	173	<b>Adressverzeichnis</b>	<b>321</b>
Threadneedle (Lux) - American Select	174		
Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	175		
Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	176		
Threadneedle (Lux) - Asia Equities	178		
Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	180		
Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	182		
Threadneedle (Lux) - Pan European Equities	184		
Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	186		
Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	188		
Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	191		
Threadneedle (Lux) - European Select	193		
Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	194		
Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	196		
Threadneedle (Lux) - Global Technology	198		
Threadneedle (Lux) - UK Equities	200		
Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	201		
Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity	202		
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	203		
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	204		
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	210		
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	214		
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	215		
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	216		
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	218		

\*Siehe Erläuterung 1.

Zeichnungen werden nicht auf der Grundlage der Finanzberichte entgegengenommen. Zeichnungen sind nur gültig, wenn sie auf der Grundlage des Verkaufsprospekts in Verbindung mit dem letzten Jahresbericht und dem letzten Halbjahresbericht, falls dieser nach dem Jahresbericht veröffentlicht wurde, erfolgen.

Bei diesem Bericht handelt es sich um eine Übersetzung der englischen Originalversion. Bei etwaigen Unklarheiten hat die englische Sprachversion Vorrang, soweit nach anwendbarem Recht zulässig.

## Informationen zur Gesellschaft

### **Gesellschaft**

Threadneedle (Lux)  
R.C.S. Luxemburg B-50.216

### **Eingetragener Firmensitz**

31 Z.A. Bourmicht  
L-8070 Bertrange  
Großherzogtum Luxemburg

### **Verwaltungsgesellschaft**

Threadneedle Management Luxembourg S.A.  
44, rue de la Vallée  
L-2661 Luxemburg  
Großherzogtum Luxemburg

### **Verwaltungsrat**

Jon Allen  
Leitender Angestellter der Region Asien-Pazifik  
Columbia Threadneedle Investments  
Singapur

Marie-Jeanne Chèvremont-Lorenzini  
Unabhängiger Direktor  
Luxemburg  
Großherzogtum Luxemburg

Claude Kremer  
Unabhängiger Direktor  
Luxemburg  
Großherzogtum Luxemburg

Julie Griffiths  
Chief Risk Officer, EMEA und Region Asien-Pazifik  
Columbia Threadneedle Investments  
London  
Vereinigtes Königreich



GATEHOUSE BANK



### Shariah-Prüfbericht

Der Verwaltungsrat  
Threadneedle Management Luxembourg S.A.  
44, Rue de la Vallée  
L-2661 Luxemburg  
Großherzogtum Luxemburg

Sehr geehrte Damen und Herren,

As-salaamu Alaikum,

wir sind gemäß einem am 30. März 2017 zwischen Threadneedle Management Luxembourg S.A. in ihrer Eigenschaft als Verwaltungsgesellschaft von Threadneedle (Lux) (die **Verwaltungsgesellschaft** bzw. die **SICAV**), und Gatehouse Bank Plc (der **Shariah-Berater**) in Bezug auf den Threadneedle (Lux) - Gatehouse Shariah Global Equity (der „**Shariah-Teilfonds**“) zur Vorlage dieses Shariah-Prüfberichts verpflichtet.

Die im Shariah-Beratungsvertrag definierten Begriffe haben in diesem Bericht dieselbe Bedeutung.

Wir haben eine Shariah-Prüfung durchgeführt und in diesem Zusammenhang die Anlagen untersucht, die während des Berichtszeitraums vom **01. April 2020 bis 30. June 2020** vom Shariah-Teilfonds getätigt wurden (die „**Shariah-Prüfung**“). Das Gremium hat bestätigt, dass die Anlagen und die Berechnung der zu reinigenden Erträge innerhalb der vereinbarten Shariah-Richtlinien und -Parameter liegen.

Nach der Shariah-Prüfung empfiehlt der Shariah-Berater dem Shariah-Teilfonds die Reinigung eines Betrags von 974,84 USD in Bezug auf die im obigen Berichtszeitraum erhaltenen Dividenden und eine Spende für wohltätige Zwecke, die mit dem Shariah-Aufsichtsgremium abzustimmen ist. Es wird nicht erwartet, dass der Shariah-Teilfonds während dieses Berichtszeitraums eine Reinigung der Kapitalgewinne vornehmen wird.

Und Allah weiß es am besten.

Datiert: 24. Juli 2020

**Unterzeichnet für und im Namen des Shariah-Beraters**

Abdirahman Sh. Osman Ali

GATEHOUSE BANK PLC | THE HELICON | ONE SOUTH PLACE | LONDON | EC2M 2RB  
T +44 (0) 20 7070 6000 W www.gatehousebank.com



GATEHOUSE BANK



### Shariah-Prüfbericht

Der Verwaltungsrat  
Threadneedle Management Luxembourg S.A.  
44, Rue de la Vallée  
L-2661 Luxemburg  
Großherzogtum Luxemburg

Sehr geehrte Damen und Herren,

As-salaamu Alaikum,

wir sind gemäß einem am 30. März 2017 zwischen Threadneedle Management Luxembourg S.A. in ihrer Eigenschaft als Verwaltungsgesellschaft von Threadneedle (Lux) (die **Verwaltungsgesellschaft** bzw. die **SICAV**), und Gatehouse Bank Plc (der **Shariah-Berater**) in Bezug auf den Threadneedle (Lux) - Gatehouse Shariah Global Equity (der „**Shariah-Teilfonds**“) zur Vorlage dieses Shariah-Prüfberichts verpflichtet.

Die im Shariah-Beratungsvertrag definierten Begriffe haben in diesem Bericht dieselbe Bedeutung.

Wir haben eine Shariah-Prüfung durchgeführt und in diesem Zusammenhang die Anlagen untersucht, die während des Berichtszeitraums vom **01. Juli 2020 bis 30. September 2020** vom Shariah-Teilfonds getätigt wurden (die „**Shariah-Prüfung**“). Das Gremium hat bestätigt, dass die Anlagen und die Berechnung der zu reinigenden Erträge innerhalb der vereinbarten Shariah-Richtlinien und -Parameter liegen.

Nach der Shariah-Prüfung empfiehlt der Shariah-Berater dem Shariah-Teilfonds die Reinigung eines Betrags von 562,60 USD in Bezug auf die im obigen Berichtszeitraum erhaltenen Dividenden und eine Spende für wohltätige Zwecke, die mit dem Shariah-Aufsichtsgremium abzustimmen ist. Es wird nicht erwartet, dass der Shariah-Teilfonds während dieses Berichtszeitraums eine Reinigung der Kapitalgewinne vornehmen wird.

Und Allah weiß es am besten.

Datiert: 3. November 2020

**Unterzeichnet für und im Namen des Shariah-Beraters**

.....  
**Abdirahman Sh. Osman Ali**

GATEHOUSE BANK PLC | THE HELICON | ONE SOUTH PLACE | LONDON | EC2M 2RB  
T +44 (0) 20 7070 6000 W [www.gatehousebank.com](http://www.gatehousebank.com)

## Konsolidierter Jahresabschluss für Threadneedle (Lux)

### AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2020

	Erläuterungen	2020 USD
<b>Aktiva</b>		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2, 18	18.024.528.006
Bankguthaben	2	237.099.688
Termineinlagen	2, 19	34.750.649
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		41.981.645
Forderungen aus Zeichnungen		39.447.611
Erhaltene Rückvergütungen von Anlageverwaltungsgebühren	2	28
Zinsforderungen aus Swaps	2	7.828.388
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		43.087.660
Vorauszahlung aus Swaps	2	221.221
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	5.110.473
Nicht realisierter Nettogewinn aus Swaps	2, 10	1.645.479
Nicht realisierter Nettogewinn aus Finanztermingeschäften	2, 11	285.836
Sonstige Vermögenswerte	20	16.063.413
<b>Aktiva, insgesamt</b>		<b>18.452.050.097</b>
<b>Passiva</b>		
Überziehungskredite		(3.593.978)
Zum Marktwert verkaufte Optionen	2, 12	(148.690)
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(59.224.274)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(70.171.028)
Zinsverbindlichkeiten aus Swaps	2	(5.009.648)
Dividendenverbindlichkeiten aus Swaps	2	(491.808)
Eingegangene Vorauszahlung aus Swaps	2	(158.910)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(14.226.886)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Swaps	2, 10	(36.207.706)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Finanztermingeschäften	2, 11	(4.020.575)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(14.377.803)
Verbindlichkeiten aus Performancegebühren	8	(1.208.170)
Nicht realisierte Kapitalertragsteuer auf Anlage		(913.578)
Andere Verbindlichkeiten		(2.805.868)
<b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>		<b>(212.558.922)</b>
<b>Nettovermögen, insgesamt</b>		<b>18.239.491.175</b>

### ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2020 bis 30. September 2020

	Erläuterungen	2020 USD
<b>Nettovermögen zu Beginn der Berichtsperiode</b>		<b>14.111.060.670</b>
<b>Erträge</b>		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	85.883.268
Zinsen aus Anleihen, netto	2	61.141.206
Zinsen aus Bankguthaben	2	1.119.844
Zinsen aus Swaps		8.411.642
Zinsen aus Finanztermingeschäften		6.255
Rückvergütungen von Anlageverwaltungsgebühren	2	14.847
<b>Erträge, insgesamt</b>		<b>156.577.062</b>
<b>Aufwand</b>		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(81.254.985)
Performancegebühren	8	(1.208.165)
Zinsen aus Bankguthaben	2	(1.589.681)
Dividendenaufwand aus Swaps		(2.095.297)
Zinsaufwand aus Swaps		(21.272.718)
Zinsaufwand aus Finanztermingeschäften		(779.959)
Betriebskosten	5	(15.216.109)
Sonstige Gebühren	4	(9.543)
<b>Aufwand, insgesamt</b>		<b>(123.426.457)</b>
<b>Nettoertrag aus Anlagen</b>		<b>33.150.605</b>
Realisierter Nettogewinn aus dem Verkauf von Anlagen		148.774.656
Realisierter Nettogewinn aus Swaps		31.872.599
Realisierter Netto(verlust) aus Optionen		(3.063.697)
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		76.863.191
Realisierter Netto(verlust) aus Finanztermingeschäften		(22.153.643)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(2.947.740)
Realisierter Nettogewinn aus Kapitalertragsteuer		945
Realisierter Nettogewinn aus Steuerrückforderung		194
<b>Realisierter Nettogewinn</b>		<b>229.346.505</b>
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		3.246.527.196
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Swaps		(48.969.235)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Optionen		941.348
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Devisenterminkontrakten		7.937.512
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Finanztermingeschäften		5.165.064
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Kapitalertragsteuer		(913.578)
<b>Nettoänderung bei nicht realisiertem Nettogewinn</b>		<b>3.210.688.307</b>
<b>Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit</b>		<b>3.473.185.417</b>
<b>Kapitalbewegungen</b>		
Zeichnungen von Anteilen		3.366.565.436
Anteilrücknahmen		(3.266.913.443)
Dividenden	7	(17.199.105)
<b>Kapitalbewegungen, insgesamt</b>		<b>82.452.888</b>
Wechselkursdifferenzen	2	579.092.695
Änderung der Überkreuzbeteiligungen in Portfolios	18	(6.300.495)
<b>Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode</b>		<b>18.239.491.175</b>

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond

### AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2020

	Erläuterungen	2020 USD
<b>Aktiva</b>		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	381.853.787
Bankguthaben	2	13.321.476
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		236.201
Forderungen aus Zeichnungen		751.156
Zinsforderungen aus Swaps	2	35.688
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		2.846.490
Vorauszahlung aus Swaps	2	14.137
Sonstige Vermögenswerte		830
<b>Aktiva, insgesamt</b>		<b>399.059.765</b>
<b>Passiva</b>		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(1.550.598)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(5.264.596)
Zinsverbindlichkeiten aus Swaps	2	(63.066)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(769.595)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Swaps	2, 10	(1.530.271)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Finanztermingeschäften	2, 11	(220.968)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(88.167)
Andere Verbindlichkeiten		(52.009)
<b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>		<b>(9.539.270)</b>
<b>Nettovermögen, insgesamt</b>		<b>389.520.495</b>

### ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AEC	704.644,559
Klasse AEH	625.150,349
Klasse AKH	163,000
Klasse ANH	1.000,000
Klasse AU	1.050.354,554
Klasse AUP	59.889,239
Klasse DEC	45.625,457
Klasse DEH	214.357,750
Klasse DU	112.971,456
Klasse DUP	40.350,468
Klasse IEC	13.582,887
Klasse IEH	1.011.179,899
Klasse IEP	100,000
Klasse IGC	178.129,464
Klasse IGH	1.790.587,839
Klasse IKH	2.230,161
Klasse INH	1.000,000
Klasse IU	1.243.516,961
Klasse IUP	77.245,777
Klasse NEC	199.515,000
Klasse NEH	125.023,495
Klasse NGC	6.760.092,631
Klasse NGH	916.787,489
Klasse NU	1.242.563,402
Klasse NUP	42.204,874
Klasse XGH	9.194.615,226
Klasse ZEH	621.485,401
Klasse ZGH	26.149,651
Klasse ZU	938.996,895

### ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2020 bis 30. September 2020

	Erläuterungen	2020 USD
<b>Nettovermögen zu Beginn der Berichtsperiode</b>		<b>231.720.967</b>
<b>Erträge</b>		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	9.752
Zinsen aus Anleihen, netto	2	4.383.808
Zinsen aus Bankguthaben	2	7.314
Zinsen aus Swaps		454.259
Zinsen aus Finanztermingeschäften		2.153
<b>Erträge, insgesamt</b>		<b>4.857.286</b>
<b>Aufwand</b>		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(414.403)
Zinsen aus Bankguthaben	2	(11.469)
Zinsaufwand aus Swaps		(874.176)
Zinsaufwand aus Finanztermingeschäften		(12.344)
Betriebskosten	5	(261.850)
<b>Aufwand, insgesamt</b>		<b>(1.574.242)</b>
<b>Nettoertrag aus Anlagen</b>		<b>3.283.044</b>
Realisierter Nettogewinn aus dem Verkauf von Anlagen		11.022.938
Realisierter Nettogewinn aus Swaps		1.598.226
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		354.608
Realisierter Nettogewinn aus Finanztermingeschäften		443.445
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(1.231.410)
<b>Realisierter Nettogewinn</b>		<b>12.187.807</b>
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		30.053.814
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Swaps		(2.206.257)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(1.130.157)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Finanztermingeschäften		(1.146.888)
<b>Nettoänderung bei nicht realisiertem Nettogewinn</b>		<b>25.570.512</b>
<b>Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit</b>		<b>41.041.363</b>
<b>Kapitalbewegungen</b>		
Zeichnungen von Anteilen		162.505.931
Anteilrücknahmen		(44.429.100)
Dividenden	7	(1.318.666)
<b>Kapitalbewegungen, insgesamt</b>		<b>116.758.165</b>
<b>Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode</b>		<b>389.520.495</b>

### GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2020	31. März 2020	31. März 2019
USD	389.520.495	231.720.967	185.075.332

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.



## Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond

### AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2020	31. März 2020	31. März 2019
Klasse AEC	11,0402 <sup>1</sup>	10,1688 <sup>1</sup>	10,26 <sup>1</sup>
Klasse AEH	12,1660 <sup>1</sup>	11,0413 <sup>1</sup>	10,81 <sup>1</sup>
Klasse AKH	121,7929 <sup>2</sup>	110,4036 <sup>2</sup>	107,96 <sup>2</sup>
Klasse ANH	10,7714 <sup>3</sup>	9,7591 <sup>3</sup>	–
Klasse AU	13,6287	12,3096	11,71
Klasse AUP	12,4705	11,4274	11,22
Klasse DEC	10,1429 <sup>1</sup>	9,3773 <sup>1</sup>	9,56 <sup>1</sup>
Klasse DEH	11,7272 <sup>1</sup>	10,6831 <sup>1</sup>	10,54 <sup>1</sup>
Klasse DU	11,9632	10,8459	10,40
Klasse DUP	11,1791	10,2875	10,18
Klasse IEC	10,8318 <sup>1</sup>	9,9649 <sup>1</sup>	10,06 <sup>1</sup>
Klasse IEH	12,4642 <sup>1</sup>	11,3035 <sup>1</sup>	11,06 <sup>1</sup>
Klasse IEP	11,5554 <sup>1</sup>	11,3172 <sup>1</sup>	10,84 <sup>1</sup>
Klasse IGC	11,0327 <sup>4</sup>	10,1319 <sup>4</sup>	10,15 <sup>4</sup>
Klasse IGH	13,1711 <sup>4</sup>	11,9152 <sup>4</sup>	11,55 <sup>4</sup>
Klasse IKH	124,5656 <sup>2</sup>	112,7923 <sup>2</sup>	110,17 <sup>2</sup>
Klasse INH	10,8102 <sup>3</sup>	9,7783 <sup>3</sup>	–
Klasse IU	13,9545	12,5914	11,95
Klasse IUP	11,5456	10,5721	10,34
Klasse NEC	10,8996 <sup>1</sup>	10,0163 <sup>1</sup>	10,08 <sup>1</sup>
Klasse NEH	11,3080 <sup>1</sup>	10,2441 <sup>1</sup>	10,00 <sup>1</sup>
Klasse NGC	10,7723 <sup>4</sup>	9,8807 <sup>4</sup>	9,84 <sup>4</sup>
Klasse NGH	11,5854 <sup>4</sup>	10,4701 <sup>4</sup>	10,13 <sup>4</sup>
Klasse NU	12,1134	10,9192	10,34
Klasse NUP	11,6154	10,6268	10,38
Klasse XGH	11,3902 <sup>4</sup>	10,2784 <sup>4</sup>	–
Klasse ZEH	11,4264 <sup>1</sup>	10,3599 <sup>1</sup>	10,13 <sup>1</sup>
Klasse ZGH	13,1204 <sup>4</sup>	11,8664 <sup>4</sup>	11,50 <sup>4</sup>
Klasse ZU	13,9203	12,5574	11,91

<sup>1</sup>Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

<sup>2</sup>Die Klasse lautet auf SEK. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

<sup>3</sup>Die Klasse lautet auf NOK. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

<sup>4</sup>Die Klasse lautet auf GBP. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

## Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond

### AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2020

	Erläuterungen	2020 EUR
<b>Aktiva</b>		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	143.518.097
Bankguthaben	2	3.506.698
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		201.425
Forderungen aus Zeichnungen		82.781
Zinsforderungen aus Swaps	2	19.556
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		927.067
<b>Aktiva, insgesamt</b>		<b>148.255.624</b>
<b>Passiva</b>		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(1.704.026)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(5.776)
Zinsverbindlichkeiten aus Swaps	2	(36.398)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(41.377)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Swaps	2, 10	(1.232.727)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Finanztermingeschäften	2, 11	(107.131)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(44.816)
Andere Verbindlichkeiten		(13.406)
<b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>		<b>(3.185.657)</b>
<b>Nettovermögen, insgesamt</b>		<b>145.069.967</b>

### ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AE	34.572,826
Klasse ANH	1.000,000
Klasse IE	2.593.060,914
Klasse INH	1.000,000
Klasse ZE	100,000
Klasse 1E	6.494.775,053
Klasse 1G	216.277,451
Klasse 2E	5.918.557,745
Klasse 2G	100,000
Klasse 3G	852.548,716
Klasse 4E	264.742,580
Klasse 4G	2.978.519,751
Klasse 8E	894.929,463
Klasse 8G	101.301,100
Klasse 9G	13.756,467

### AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2020	31. März 2020	31. März 2019
Klasse AE	10,6515	9,9041	10,19
Klasse ANH	10,2418 <sup>1</sup>	9,4949 <sup>1</sup>	–
Klasse IE	10,7783	9,9912	10,22
Klasse INH	10,2957 <sup>1</sup>	9,5194 <sup>1</sup>	–
Klasse ZE	10,7575	9,9786	10,22
Klasse 1E	1,4528	1,3507	1,39
Klasse 1G	1,2129 <sup>2</sup>	1,1002 <sup>2</sup>	1,10 <sup>2</sup>
Klasse 2E	10,7871	9,9984	10,23
Klasse 2G	10,8833 <sup>2</sup>	9,8457 <sup>2</sup>	9,81 <sup>2</sup>
Klasse 3G	1,3559 <sup>2</sup>	1,2267 <sup>2</sup>	1,22 <sup>2</sup>
Klasse 4E <sup>2</sup>	10,8113	–	–
Klasse 4G	11,2911 <sup>2</sup>	10,1845 <sup>2</sup>	–
Klasse 8E	1,8083	1,6764	1,72
Klasse 8G	1,6420 <sup>2</sup>	1,4850 <sup>2</sup>	1,48 <sup>2</sup>
Klasse 9G	10,8751 <sup>2</sup>	9,8373 <sup>2</sup>	9,81 <sup>2</sup>

<sup>1</sup>Die Klasse lautet auf NOK. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.<sup>2</sup>Die Klasse lautet auf GBP. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.<sup>3</sup>Siehe Erläuterung 1.

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

### ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2020 bis 30. September 2020

	Erläuterungen	2020 EUR
<b>Nettovermögen zu Beginn der Berichtsperiode</b>		<b>127.139.343</b>
<b>Erträge</b>		
Zinsen aus Anleihen, netto	2	1.169.621
Zinsen aus Bankguthaben	2	345
Zinsen aus Swaps		130.266
Zinsen aus Finanztermingeschäften		1
<b>Erträge, insgesamt</b>		<b>1.300.233</b>
<b>Aufwand</b>		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(264.907)
Zinsen aus Bankguthaben	2	(13.573)
Zinsaufwand aus Swaps		(336.396)
Zinsaufwand aus Finanztermingeschäften		(3.984)
Betriebskosten	5	(77.053)
<b>Aufwand, insgesamt</b>		<b>(695.913)</b>
<b>Nettoertrag aus Anlagen</b>		<b>604.320</b>
Realisierter Nettogewinn aus dem Verkauf von Anlagen		800.912
Realisierter Nettogewinn aus Swaps		847.731
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		422.324
Realisierter Netto(verlust) aus Finanztermingeschäften		(325.266)
Realisierter Nettogewinn aus Devisengeschäften		9.205
<b>Realisierter Nettogewinn</b>		<b>1.754.906</b>
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		8.921.806
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Swaps		(1.273.867)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Devisenterminkontrakten		165.827
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Finanztermingeschäften		90.312
<b>Nettoänderung bei nicht realisiertem Nettogewinn</b>		<b>7.904.078</b>
<b>Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit</b>		<b>10.263.304</b>
<b>Kapitalbewegungen</b>		
Zeichnungen von Anteilen		25.422.689
Anteilrücknahmen		(17.755.369)
<b>Kapitalbewegungen, insgesamt</b>		<b>7.667.320</b>
<b>Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode</b>		<b>145.069.967</b>

### GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2020	31. März 2020	31. März 2019
EUR	145.069.967	127.139.343	125.657.326

## Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond

### AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2020

	Erläuterungen	2020 EUR
<b>Aktiva</b>		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	509.736.616
Bankguthaben	2	3.341.774
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		3.311.773
Forderungen aus Zeichnungen		702.644
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		6.698.082
Sonstige Vermögenswerte		460
<b>Aktiva, insgesamt</b>		<b>523.791.349</b>
<b>Passiva</b>		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(1.532.651)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(449.930)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(674.489)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(335.904)
Andere Verbindlichkeiten		(69.648)
<b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>		<b>(3.062.622)</b>
<b>Nettovermögen, insgesamt</b>		<b>520.728.727</b>

### ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AE	100,000
Klasse AKH	100,000
Klasse ANH	1.000,000
Klasse IE	4.441.117,935
Klasse IEP	4.853.826,565
Klasse IKH	100,000
Klasse INH	1.000,000
Klasse XE	3.960.692,109
Klasse ZE	212.156,677
Klasse ZEP	334.110,000
Klasse 1E	15.560.641,032
Klasse 1EP	1.239.144,885
Klasse 1G	320.469,953
Klasse 1GP	24.631,439
Klasse 1UT	262.950,950
Klasse 2E	2.281.770,675
Klasse 2EP	100,000
Klasse 2FH	6.851,346
Klasse 2G	55.371,233
Klasse 2GP	100,000
Klasse 3E	2.835.850,793
Klasse 3EP	3.099.249,348
Klasse 3FC	13.083,825
Klasse 3FH	51.160,975
Klasse 3G	1.051.986,262
Klasse 3GP	96.572,674
Klasse 4E	145.142,637
Klasse 4G	1.826.414,501
Klasse 8E	1.721.520,574
Klasse 8EP	5.555.440,634
Klasse 8FH	31.502,153
Klasse 8G	10.949,022
Klasse 8GP	5.272,069
Klasse 9E	388.457,149
Klasse 9EP	7.590,873
Klasse 9FC	7.591,530
Klasse 9FH	2.323,914
Klasse 9G	100,000
Klasse 9GP	100,000

### ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2020 bis 30. September 2020

	Erläuterungen	2020 EUR
<b>Nettovermögen zu Beginn der Berichtsperiode</b>		<b>476.354.207</b>
<b>Erträge</b>		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	76.248
Zinsen aus Anleihen, netto	2	10.020.368
Zinsen aus Bankguthaben	2	1.830
<b>Erträge, insgesamt</b>		<b>10.098.446</b>
<b>Aufwand</b>		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(2.064.193)
Zinsen aus Bankguthaben	2	(17.590)
Zinsaufwand aus Finanztermingeschäften		(4.827)
Betriebskosten	5	(420.546)
Sonstige Gebühren		(2)
<b>Aufwand, insgesamt</b>		<b>(2.507.158)</b>
<b>Nettoertrag aus Anlagen</b>		<b>7.591.288</b>
Realisierter Netto(verlust) aus dem Verkauf von Anlagen		(6.912.505)
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		3.166.802
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(96.096)
<b>Realisierter Netto(verlust)</b>		<b>(3.841.799)</b>
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		52.421.002
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Devisenterminkontrakten		1.046.032
<b>Nettoänderung bei nicht realisiertem Nettogewinn</b>		<b>53.467.034</b>
<b>Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit</b>		<b>57.216.523</b>
<b>Kapitalbewegungen</b>		
Zeichnungen von Anteilen		112.962.916
Anteilrücknahmen		(125.759.828)
Dividenden	7	(45.091)
<b>Kapitalbewegungen, insgesamt</b>		<b>(12.842.003)</b>
<b>Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode</b>		<b>520.728.727</b>

### GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2020	31. März 2020	31. März 2019
EUR	520.728.727	476.354.207	542.502.367

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond

### AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2020	31. März 2020	31. März 2019
Klasse AE <sup>1</sup>	10,6199	–	–
Klasse AKH	99,2290 <sup>1</sup>	88,6643 <sup>1</sup>	–
Klasse ANH	9,9537 <sup>2</sup>	8,8954 <sup>2</sup>	–
Klasse IE	10,5334	9,3892	10,20
Klasse IEP	9,7668	8,7058	9,93
Klasse IKH	99,7947 <sup>1</sup>	88,9089 <sup>1</sup>	–
Klasse INH	10,0190 <sup>2</sup>	8,9222 <sup>2</sup>	–
Klasse XE	10,1639	9,0281	–
Klasse ZE	10,5183	9,3780	10,19
Klasse ZEP	9,7594	8,7007	9,93
Klasse 1E	10,4176	9,3105	10,16
Klasse 1EP	9,6747	8,6466	9,90
Klasse 1G	10,5020 <sup>3</sup>	9,1568 <sup>3</sup>	9,73 <sup>3</sup>
Klasse 1GP	9,7745 <sup>3</sup>	8,5225 <sup>3</sup>	9,51 <sup>3</sup>
Klasse 1UT	10,0447 <sup>4</sup>	9,1107 <sup>4</sup>	10,09 <sup>4</sup>
Klasse 2E	10,5393	9,3929	10,20
Klasse 2EP	9,8023	8,7357	9,94
Klasse 2FH	10,4467 <sup>5</sup>	9,3252 <sup>5</sup>	10,17 <sup>5</sup>
Klasse 2G	10,6321 <sup>3</sup>	9,2443 <sup>3</sup>	9,77 <sup>3</sup>
Klasse 2GP	9,8882 <sup>3</sup>	8,5956 <sup>3</sup>	9,52 <sup>3</sup>
Klasse 3E	10,5529	9,4027	10,20
Klasse 3EP	9,8647	8,7895	10,00
Klasse 3FC	9,7382 <sup>5</sup>	8,6906 <sup>5</sup>	9,92 <sup>5</sup>
Klasse 3FH	10,4581 <sup>5</sup>	9,3331 <sup>5</sup>	10,17 <sup>5</sup>
Klasse 3G	10,6376 <sup>3</sup>	9,2468 <sup>3</sup>	9,77 <sup>3</sup>
Klasse 3GP	9,8233 <sup>3</sup>	8,5390 <sup>3</sup>	9,47 <sup>3</sup>
Klasse 4E	10,7069	9,5067	10,24
Klasse 4G	11,0409 <sup>3</sup>	9,5632 <sup>3</sup>	10,03 <sup>3</sup>
Klasse 4GP <sup>#</sup>	–	8,7170 <sup>3</sup>	9,59 <sup>3</sup>
Klasse 8E	10,5301	9,3866	10,19
Klasse 8EP	9,8157	8,7498	9,97
Klasse 8FH	10,4368 <sup>5</sup>	9,3179 <sup>5</sup>	10,16 <sup>5</sup>
Klasse 8G	10,6176 <sup>3</sup>	9,2336 <sup>3</sup>	9,76 <sup>3</sup>
Klasse 8GP	9,8933 <sup>3</sup>	8,6037 <sup>3</sup>	9,55 <sup>3</sup>
Klasse 9E	10,5588	9,4061	10,20
Klasse 9EP	9,8744	8,7964	10,01
Klasse 9FC	9,8079 <sup>5</sup>	8,7510 <sup>5</sup>	9,99 <sup>5</sup>
Klasse 9FH	10,4705 <sup>5</sup>	9,3420 <sup>5</sup>	10,18 <sup>5</sup>
Klasse 9G	10,6505 <sup>3</sup>	9,2545 <sup>3</sup>	9,77 <sup>3</sup>
Klasse 9GP	9,8995 <sup>3</sup>	8,6021 <sup>3</sup>	9,53 <sup>3</sup>

<sup>1</sup>Die Klasse lautet auf SEK. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

<sup>2</sup>Die Klasse lautet auf NOK. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

<sup>3</sup>Die Klasse lautet auf GBP. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

<sup>4</sup>Die Klasse lautet auf USD. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

<sup>5</sup>Die Klasse lautet auf CHF. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

<sup>#</sup>Siehe Erläuterung 1.

## Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond

### AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2020

	Erläuterungen	2020 EUR
<b>Aktiva</b>		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	70.582.300
Bankguthaben	2	964.368
Termineinlagen	2, 19	3.199.419
Forderungen aus Zeichnungen		307.575
Zinsforderungen aus Swaps	2	1.750
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		817.301
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	1.176.340
Nicht realisierter Nettogewinn aus Swaps	2, 10	47.949
Sonstige Vermögenswerte		72
<b>Aktiva, insgesamt</b>		<b>77.097.074</b>
<b>Passiva</b>		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(960.892)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(383)
Andere Verbindlichkeiten		(6.168)
<b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>		<b>(967.443)</b>
<b>Nettovermögen, insgesamt</b>		<b>76.129.631</b>

### ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AE	1.296,432
Klasse AEP	10,000
Klasse AKH	100,000
Klasse ANH	100,000
Klasse IE	9.330,410
Klasse IEP	10,000
Klasse IGC	10,000
Klasse IGH	10,000
Klasse IKH	100,000
Klasse INH	1.000,000
Klasse XE	37.061,425
Klasse XGC	106.856,058
Klasse XGH	532.773,054
Klasse ZE	100,200

### AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2020	31. März 2020
Klasse AE	99,8734	89,6665
Klasse AEP	97,3560	87,4074
Klasse AKH	100,0119 <sup>1</sup>	89,7046 <sup>1</sup>
Klasse ANH	100,9539 <sup>2</sup>	90,4760 <sup>2</sup>
Klasse IE	100,3568	89,9208
Klasse IEP	97,7760	87,6410
Klasse IGC	98,5750 <sup>3</sup>	88,1422 <sup>3</sup>
Klasse IGH	101,0404 <sup>3</sup>	90,3604 <sup>3</sup>
Klasse IKH	99,9731 <sup>1</sup>	89,4959 <sup>1</sup>
Klasse INH	10,0495 <sup>2</sup>	8,9899 <sup>2</sup>
Klasse XE	100,8452	90,1780
Klasse XGC	98,9551 <sup>3</sup>	88,3048 <sup>3</sup>
Klasse XGH	101,5576 <sup>3</sup>	90,6104 <sup>3</sup>
Klasse ZE	100,3015	89,8970

<sup>1</sup>Die Klasse lautet auf SEK. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.<sup>2</sup>Die Klasse lautet auf NOK. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.<sup>3</sup>Die Klasse lautet auf GBP. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

### ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2020 bis 30. September 2020

	Erläuterungen	2020 EUR
<b>Nettovermögen zu Beginn der Berichtsperiode</b>		<b>46.407.346</b>
<b>Erträge</b>		
Zinsen aus Anleihen, netto	2	996.744
Zinsen aus Bankguthaben	2	394
Zinsen aus Swaps		32.508
<b>Erträge, insgesamt</b>		<b>1.029.646</b>
<b>Aufwand</b>		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(7.897)
Zinsen aus Bankguthaben	2	(10.724)
Betriebskosten	5	(28.101)
<b>Aufwand, insgesamt</b>		<b>(46.722)</b>
<b>Nettoertrag aus Anlagen</b>		<b>982.924</b>
Realisierter Netto(verlust) aus dem Verkauf von Anlagen		(1.026.405)
Realisierter Netto(verlust) aus Swaps		(12.667)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(823.150)
Realisierter Nettogewinn aus Devisengeschäften		162.783
<b>Realisierter Netto(verlust)</b>		<b>(1.699.439)</b>
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		3.565.083
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Swaps		26.415
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Devisenterminkontrakten		310.100
<b>Nettoänderung bei nicht realisiertem Nettogewinn</b>		<b>3.901.598</b>
<b>Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit</b>		<b>3.185.083</b>
<b>Kapitalbewegungen</b>		
Zeichnungen von Anteilen		40.980.477
Anteilrücknahmen		(14.443.275)
<b>Kapitalbewegungen, insgesamt</b>		<b>26.537.202</b>
<b>Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode</b>		<b>76.129.631</b>

### GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2020	31. März 2020
EUR	76.129.631	46.407.346

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - European Social Bond

### AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2020

	Erläuterungen	2020 EUR
<b>Aktiva</b>		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	198.347.244
Bankguthaben	2	1.652.293
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		657.742
Forderungen aus Zeichnungen		1.523.881
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		1.196.692
<b>Aktiva, insgesamt</b>		<b>203.377.852</b>
<b>Passiva</b>		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(1.639.018)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(42.592)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(486.625)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Finanztermingeschäften	2, 11	(63.862)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(48.546)
Andere Verbindlichkeiten		(18.264)
<b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>		<b>(2.298.907)</b>
<b>Nettovermögen, insgesamt</b>		<b>201.078.945</b>

### ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AE	100,000
Klasse AEP	100,000
Klasse ID	8.109.764,113
Klasse IE	1.917.228,401
Klasse IEP	2.316.400,342
Klasse IFH	327,000
Klasse IKH	100,000
Klasse INH	1.000,000
Klasse LE	2.769.662,256
Klasse NEP	81.780,256
Klasse ZD	7.967.846,591
Klasse ZE	1.596.971,298
Klasse ZEP	298.342,891
Klasse ZFH	327,000
Klasse ZGC	100,000
Klasse ZGH	100,000
Klasse ZUH	100,000

### AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2020	31. März 2020	31. März 2019
Klasse AE <sup>f</sup>	9,9879	–	–
Klasse AEP <sup>f</sup>	9,9859	–	–
Klasse ID	10,10631	9,5778 <sup>1</sup>	–
Klasse IE	10,7667	10,1785	10,27
Klasse IEP	10,2756	9,7761	10,01
Klasse IFH	10,5213 <sup>2</sup>	9,9642 <sup>2</sup>	10,11 <sup>2</sup>
Klasse IKH	100,6973 <sup>3</sup>	95,0380 <sup>3</sup>	–
Klasse INH	10,1983 <sup>4</sup>	9,6122 <sup>4</sup>	–
Klasse LE	10,8003	10,2060	10,30
Klasse NEP	1.035,4438	984,7206	1.007,53
Klasse ZD	10,0990 <sup>1</sup>	9,5733 <sup>1</sup>	–
Klasse ZE	10,7424	10,1580	10,26
Klasse ZEP	10,2319	9,7334	–
Klasse ZFH	10,5142 <sup>2</sup>	9,9581 <sup>2</sup>	10,10 <sup>2</sup>
Klasse ZGC <sup>f</sup>	10,5393 <sup>5</sup>	–	–
Klasse ZGH <sup>f</sup>	10,6064 <sup>5</sup>	–	–
Klasse ZUH <sup>f</sup>	10,2157 <sup>6</sup>	–	–

<sup>1</sup>Die Klasse lautet auf DKK. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.<sup>2</sup>Die Klasse lautet auf CHF. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.<sup>3</sup>Die Klasse lautet auf SEK. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.<sup>4</sup>Die Klasse lautet auf NOK. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.<sup>5</sup>Die Klasse lautet auf GBP. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.<sup>6</sup>Die Klasse lautet auf USD. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.<sup>f</sup>Siehe Erläuterung 1.

### ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2020 bis 30. September 2020

	Erläuterungen	2020 EUR
<b>Nettovermögen zu Beginn der Berichtsperiode</b>		<b>154.103.742</b>
<b>Erträge</b>		
Zinsen aus Anleihen, netto	2	1.191.528
Zinsen aus Bankguthaben	2	639
<b>Erträge, insgesamt</b>		<b>1.192.167</b>
<b>Aufwand</b>		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(303.250)
Zinsen aus Bankguthaben	2	(8.303)
Zinsaufwand aus Finanztermingeschäften		(4.300)
Betriebskosten	5	(96.774)
<b>Aufwand, insgesamt</b>		<b>(412.627)</b>
<b>Nettoertrag aus Anlagen</b>		<b>779.540</b>
Realisierter Nettogewinn aus dem Verkauf von Anlagen		57.454
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		1.493.983
Realisierter Netto(verlust) aus Finanztermingeschäften		(132.922)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(3.300)
<b>Realisierter Nettogewinn</b>		<b>1.415.215</b>
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		8.128.513
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(458.156)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Finanztermingeschäften		(115.170)
<b>Nettoänderung bei nicht realisiertem Nettogewinn</b>		<b>7.555.187</b>
<b>Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit</b>		<b>9.749.942</b>
<b>Kapitalbewegungen</b>		
Zeichnungen von Anteilen		41.286.400
Anteilrücknahmen		(3.359.980)
Dividenden	7	(701.159)
<b>Kapitalbewegungen, insgesamt</b>		<b>37.225.261</b>
<b>Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode</b>		<b>201.078.945</b>

### GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2020	31. März 2020	31. März 2019
EUR	201.078.945	154.103.742	29.456.674

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond

### AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2020

	Erläuterungen	2020 EUR
<b>Aktiva</b>		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	174.048.216
Bankguthaben	2	7.873.859
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		1.361.428
Forderungen aus Zeichnungen		305.286
Zinsforderungen aus Swaps	2	23.915
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		1.779.258
<b>Aktiva, insgesamt</b>		<b>185.391.962</b>
<b>Passiva</b>		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(792.956)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(229.770)
Zinsverbindlichkeiten aus Swaps	2	(61.338)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(169.582)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Swaps	2, 10	(1.864.325)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Finanztermingeschäften	2, 11	(381.469)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(123.558)
Andere Verbindlichkeiten		(31.894)
<b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>		<b>(3.654.892)</b>
<b>Nettovermögen, insgesamt</b>		<b>181.737.070</b>

### ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AE	2.428.116,516
Klasse AEP	493.146,279
Klasse AKH	100,000
Klasse ANH	1.000,000
Klasse AUH	100,000
Klasse DE	937.489,393
Klasse DEP	810.440,862
Klasse DUH	100,000
Klasse IE	2.112.991,271
Klasse INH	1.000,000

### AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2020	31. März 2020	31. März 2019
Klasse AE	30,3260	27,7686	28,63
Klasse AEP	15,2381	14,1492	14,89
Klasse AKH	103,2329 <sup>1</sup>	94,4608 <sup>1</sup>	–
Klasse ANH	10,3942 <sup>2</sup>	9,5087 <sup>2</sup>	–
Klasse AUH	11,3528 <sup>3</sup>	10,3501 <sup>3</sup>	10,38 <sup>3</sup>
Klasse DE	28,5019	26,1701	27,13
Klasse DEP	11,4639	10,6750	11,30
Klasse DUH	11,1956 <sup>3</sup>	10,2405 <sup>3</sup>	10,34 <sup>3</sup>
Klasse IE	30,5593	27,8985	28,59
Klasse INH	10,4713 <sup>2</sup>	9,5432 <sup>2</sup>	–
Klasse W <sup>#</sup>	–	58,8490	60,67

<sup>1</sup>Die Klasse lautet auf SEK. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.<sup>2</sup>Die Klasse lautet auf NOK. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.<sup>3</sup>Die Klasse lautet auf USD. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.<sup>#</sup>Siehe Erläuterung 1.

### ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2020 bis 30. September 2020

	Erläuterungen	2020 EUR
<b>Nettovermögen zu Beginn der Berichtsperiode</b>		<b>165.029.205</b>
<b>Erträge</b>		
Zinsen aus Anleihen, netto	2	2.565.415
Zinsen aus Bankguthaben	2	3.171
Zinsen aus Swaps		728.137
Zinsen aus Finanztermingeschäften		154
<b>Erträge, insgesamt</b>		<b>3.296.877</b>
<b>Aufwand</b>		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(721.223)
Zinsen aus Bankguthaben	2	(20.700)
Zinsaufwand aus Swaps		(1.153.448)
Zinsaufwand aus Finanztermingeschäften		(19.786)
Betriebskosten	5	(187.599)
<b>Aufwand, insgesamt</b>		<b>(2.102.756)</b>
<b>Nettoertrag aus Anlagen</b>		<b>1.194.121</b>
Realisierter Nettogewinn aus dem Verkauf von Anlagen		666.294
Realisierter Nettogewinn aus Swaps		1.776.330
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		5.974.654
Realisierter Nettogewinn aus Finanztermingeschäften		424.131
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(342.732)
<b>Realisierter Nettogewinn</b>		<b>8.498.677</b>
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		11.841.290
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Swaps		(3.141.250)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(2.418.120)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Finanztermingeschäften		(722.996)
<b>Nettoänderung bei nicht realisiertem Nettogewinn</b>		<b>5.558.924</b>
<b>Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit</b>		<b>15.251.722</b>
<b>Kapitalbewegungen</b>		
Zeichnungen von Anteilen		30.631.674
Anteilrücknahmen		(28.957.419)
Dividenden	7	(218.112)
<b>Kapitalbewegungen, insgesamt</b>		<b>1.456.143</b>
<b>Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode</b>		<b>181.737.070</b>

### GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2020	31. März 2020	31. März 2019
EUR	181.737.070	165.029.205	97.043.105

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds

### AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2020

	Erläuterungen	2020 USD
<b>Aktiva</b>		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	42.028.512
Bankguthaben	2	898.372
Forderungen aus Zeichnungen		34.160
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		515.178
<b>Aktiva, insgesamt</b>		<b>43.476.222</b>
<b>Passiva</b>		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(199.356)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(1.289)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(421.316)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(40.496)
Andere Verbindlichkeiten		(9.650)
<b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>		<b>(672.107)</b>
<b>Nettovermögen, insgesamt</b>		<b>42.804.115</b>

### ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AEC	461.128,869
Klasse AEH	248.668,354
Klasse AKH	100,000
Klasse ANH	1.000,000
Klasse ASH	11.707,162
Klasse AU	99.310,251
Klasse AUP	785.475,272
Klasse DEC	41.340,135
Klasse DEH	132.790,513
Klasse DU	202.247,813
Klasse IEH	362.483,056
Klasse IU	4.600,000
Klasse W	8.848,157
Klasse WEH	7.260,489
Klasse XUP	100,000

### AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2020	31. März 2020	31. März 2019
Klasse AEC	12,9720 <sup>1</sup>	11,4485 <sup>1</sup>	13,23 <sup>1</sup>
Klasse AEH	22,0513 <sup>1</sup>	19,0129 <sup>1</sup>	20,89 <sup>1</sup>
Klasse AKH	103,6122 <sup>2</sup>	89,1452 <sup>2</sup>	–
Klasse ANH	10,4332 <sup>3</sup>	8,9692 <sup>3</sup>	–
Klasse ASH	14,5567 <sup>4</sup>	12,5045 <sup>4</sup>	13,44 <sup>4</sup>
Klasse AU	23,1720	19,8691	21,18
Klasse AUP	8,2868	7,2747	8,16
Klasse DEC	9,4088 <sup>1</sup>	8,3093 <sup>1</sup>	9,61 <sup>1</sup>
Klasse DEH	16,9379 <sup>1</sup>	14,6111 <sup>1</sup>	16,07 <sup>1</sup>
Klasse DU	18,0662	15,4989	16,54
Klasse IEH	30,9522 <sup>1</sup>	26,5802 <sup>1</sup>	28,96 <sup>1</sup>
Klasse IU	11,7314	10,0191	10,61
Klasse W	31,5944	27,0437	28,73
Klasse WEH	21,5071 <sup>1</sup>	18,5115 <sup>1</sup>	20,26 <sup>1</sup>
Klasse XUP	11,5824	10,0921	11,18

<sup>1</sup>Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.<sup>2</sup>Die Klasse lautet auf SEK. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.<sup>3</sup>Die Klasse lautet auf NOK. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.<sup>4</sup>Die Klasse lautet auf SGD. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

### ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2020 bis 30. September 2020

	Erläuterungen	2020 USD
<b>Nettovermögen zu Beginn der Berichtsperiode</b>		<b>33.146.518</b>
<b>Erträge</b>		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	4.434
Zinsen aus Anleihen, netto	2	923.597
Zinsen aus Bankguthaben	2	23.949
<b>Erträge, insgesamt</b>		<b>951.980</b>
<b>Aufwand</b>		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(221.621)
Zinsen aus Bankguthaben	2	(24.378)
Betriebskosten	5	(52.119)
<b>Aufwand, insgesamt</b>		<b>(298.118)</b>
<b>Nettoertrag aus Anlagen</b>		<b>653.862</b>
<b>Nettoertrag aus Anlagen</b>		
Realisierter Netto(verlust) aus dem Verkauf von Anlagen		(141.158)
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		1.588.008
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(6.300)
<b>Realisierter Nettogewinn</b>		<b>1.440.550</b>
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		5.100.147
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Devisenterminkontrakten		77.148
<b>Nettoänderung bei nicht realisiertem Nettogewinn</b>		<b>5.177.295</b>
<b>Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit</b>		<b>7.271.707</b>
<b>Kapitalbewegungen</b>		
Zeichnungen von Anteilen		4.585.400
Anteilrücknahmen		(1.897.661)
Dividenden	7	(301.849)
<b>Kapitalbewegungen, insgesamt</b>		<b>2.385.890</b>
<b>Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode</b>		<b>42.804.115</b>

### GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2020	31. März 2020	31. März 2019
USD	42.804.115	33.146.518	38.306.644

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.



## Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt

### AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2020

	Erläuterungen	2020 USD
<b>Aktiva</b>		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	47.663.212
Bankguthaben	2	1.045.528
Forderungen aus Zeichnungen		3.048
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		547.674
<b>Aktiva, insgesamt</b>		<b>49.259.462</b>
<b>Passiva</b>		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(397.002)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(4.118)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(19.788)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(54.843)
Andere Verbindlichkeiten		(12.230)
<b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>		<b>(487.981)</b>
<b>Nettovermögen, insgesamt</b>		<b>48.771.481</b>

### ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AEC	82.712,380
Klasse AEH	13.151,992
Klasse AKH	100,000
Klasse ANH	1.000,000
Klasse ASH	4.262,436
Klasse AU	63.173,881
Klasse AUP	3.394.877,588
Klasse DEH	16.839,346
Klasse DU	21.390,875
Klasse IEH	22.372,438
Klasse IU	100,000
Klasse SU	1.280,266
Klasse SUP	58.821,547
Klasse W	12.392,111
Klasse XUP	100,000
Klasse ZU	200,000

### AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2020	31. März 2020	31. März 2019
Klasse AEC	9,3322 <sup>1</sup>	8,1700 <sup>1</sup>	9,97 <sup>1</sup>
Klasse AEH	26,5310 <sup>1</sup>	22,6402 <sup>1</sup>	26,10 <sup>1</sup>
Klasse AKH	99,5471 <sup>2</sup>	84,8443 <sup>2</sup>	–
Klasse ANH	9,9910 <sup>3</sup>	8,5211 <sup>3</sup>	–
Klasse ASH	12,4165 <sup>4</sup>	10,5597 <sup>4</sup>	11,91 <sup>4</sup>
Klasse AU	77,8291	66,0483	73,87
Klasse AUP	11,3924	9,9193	11,75
Klasse DEH	19,7304 <sup>1</sup>	16,8452 <sup>1</sup>	19,44 <sup>1</sup>
Klasse DU	55,3753	47,0167	52,64
Klasse IEH	28,9155 <sup>1</sup>	24,5729 <sup>1</sup>	28,11 <sup>1</sup>
Klasse IU	10,6426	9,0048	–
Klasse SU	31,2788	26,5644	29,75
Klasse SUP	10,9602	9,5489	11,32
Klasse W	64,6658	54,7816	61,05
Klasse XUP	10,8849	9,3824	10,96
Klasse ZU	12,4155	10,4968	11,65

<sup>1</sup>Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.<sup>2</sup>Die Klasse lautet auf SEK. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.<sup>3</sup>Die Klasse lautet auf NOK. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.<sup>4</sup>Die Klasse lautet auf SGD. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

### ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2020 bis 30. September 2020

	Erläuterungen	2020 USD
<b>Nettovermögen zu Beginn der Berichtsperiode</b>		<b>45.432.000</b>
<b>Erträge</b>		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	7.800
Zinsen aus Anleihen, netto	2	1.163.809
Zinsen aus Bankguthaben	2	178
<b>Erträge, insgesamt</b>		<b>1.171.787</b>
<b>Aufwand</b>		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(327.072)
Zinsen aus Bankguthaben	2	(166)
Betriebskosten	5	(72.916)
<b>Aufwand, insgesamt</b>		<b>(400.154)</b>
<b>Nettoertrag aus Anlagen</b>		<b>771.633</b>
Realisierter Nettogewinn aus dem Verkauf von Anlagen		95.884
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		257.553
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(9.510)
<b>Realisierter Nettogewinn</b>		<b>343.927</b>
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		6.168.866
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(213.673)
<b>Nettoänderung bei nicht realisiertem Nettogewinn</b>		<b>5.955.193</b>
<b>Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit</b>		<b>7.070.753</b>
<b>Kapitalbewegungen</b>		
Zeichnungen von Anteilen		580.211
Anteilrücknahmen		(3.271.956)
Dividenden	7	(1.039.527)
<b>Kapitalbewegungen, insgesamt</b>		<b>(3.731.272)</b>
<b>Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode</b>		<b>48.771.481</b>

### GESAMTNETTOINVENTARWERT

USD	30. September 2020	31. März 2020	31. März 2019
	48.771.481	45.432.000	57.760.204

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds

### AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2020

	Erläuterungen	2020 USD
<b>Aktiva</b>		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	102.141.935
Bankguthaben	2	1.181.833
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		400.087
Forderungen aus Zeichnungen		3.214
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		1.402.588
<b>Aktiva, insgesamt</b>		<b>105.129.657</b>
<b>Passiva</b>		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(1.197.646)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(124.086)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(405.771)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Finanztermingeschäften	2, 11	(6.578)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(49.950)
Andere Verbindlichkeiten		(18.298)
<b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>		<b>(1.802.329)</b>
<b>Nettovermögen, insgesamt</b>		<b>103.327.328</b>

### ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AEC	902.490,823
Klasse AEH	272.278,369
Klasse AKH	100,000
Klasse ANH	1.000,000
Klasse ASC	44.417,476
Klasse ASH	26.187,473
Klasse AU	621.956,215
Klasse AUP	1.833.895,945
Klasse DEH	157.396,109
Klasse DU	172.347,510
Klasse IE	104.405,540
Klasse IEH	770.317,167
Klasse XU	3.532.723,639
Klasse XUP	1.133.958,032
Klasse ZEH	20.089,181

### AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2020	31. März 2020	31. März 2019
Klasse AEC	5,3307 <sup>1</sup>	4,8028 <sup>1</sup>	5,86 <sup>1</sup>
Klasse AEH	14,9533 <sup>1</sup>	13,1271 <sup>1</sup>	15,12 <sup>1</sup>
Klasse AKH	97,8610 <sup>2</sup>	85,8647 <sup>2</sup>	–
Klasse ANH	9,8886 <sup>3</sup>	8,6667 <sup>3</sup>	–
Klasse ASC	7,2048 <sup>4</sup>	6,4712 <sup>4</sup>	7,72 <sup>4</sup>
Klasse ASH	11,1099 <sup>4</sup>	9,7217 <sup>4</sup>	10,96 <sup>4</sup>
Klasse AU	18,0219	15,7370	17,60
Klasse AUP	5,6234	5,0421	5,97
Klasse DEH	11,6590 <sup>1</sup>	10,2427 <sup>1</sup>	11,82 <sup>1</sup>
Klasse DU	14,0376	12,2671	13,75
Klasse IE	9,5201 <sup>1</sup>	8,8511 <sup>1</sup>	–
Klasse IEH	17,0104 <sup>1</sup>	14,8774 <sup>1</sup>	17,01 <sup>1</sup>
Klasse XU	10,9469	9,4901	10,46
Klasse XUP	9,6191	8,5602	10,00
Klasse ZEH	10,9247 <sup>1</sup>	9,5569 <sup>1</sup>	10,94 <sup>1</sup>

<sup>1</sup>Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.<sup>2</sup>Die Klasse lautet auf SEK. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.<sup>3</sup>Die Klasse lautet auf NOK. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.<sup>4</sup>Die Klasse lautet auf SGD. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

### ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2020 bis 30. September 2020

	Erläuterungen	2020 USD
<b>Nettovermögen zu Beginn der Berichtsperiode</b>		<b>107.744.487</b>
<b>Erträge</b>		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	16.577
Zinsen aus Anleihen, netto	2	2.658.594
Zinsen aus Bankguthaben	2	115.517
Zinsen aus Finanztermingeschäften		32
<b>Erträge, insgesamt</b>		<b>2.790.720</b>
<b>Aufwand</b>		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(306.041)
Zinsen aus Bankguthaben	2	(116.092)
Zinsaufwand aus Finanztermingeschäften		(52)
Betriebskosten	5	(110.403)
<b>Aufwand, insgesamt</b>		<b>(532.588)</b>
<b>Nettoertrag aus Anlagen</b>		<b>2.258.132</b>
Realisierter Netto(verlust) aus dem Verkauf von Anlagen		(2.267.119)
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		1.631.120
Realisierter Nettogewinn aus Finanztermingeschäften		362.811
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(14.206)
<b>Realisierter Netto(verlust)</b>		<b>(287.394)</b>
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		12.143.244
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Devisenterminkontrakten		177.483
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Finanztermingeschäften		(352.703)
<b>Nettoänderung bei nicht realisiertem Nettogewinn</b>		<b>11.968.024</b>
<b>Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit</b>		<b>13.938.762</b>
<b>Kapitalbewegungen</b>		
Zeichnungen von Anteilen		10.798.925
Anteilrücknahmen		(28.467.793)
Dividenden	7	(687.053)
<b>Kapitalbewegungen, insgesamt</b>		<b>(18.355.921)</b>
<b>Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode</b>		<b>103.327.328</b>

### GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2020	31. März 2020	31. März 2019
USD	103.327.328	107.744.487	123.851.972

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

### AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2020

	Erläuterungen	2020 USD
<b>Aktiva</b>		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	192.106.721
Bankguthaben	2	3.376.772
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		107.155
Forderungen aus Zeichnungen		1.044
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		2.596.117
Sonstige Vermögenswerte		151
<b>Aktiva, insgesamt</b>		<b>198.187.960</b>
<b>Passiva</b>		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(1.717.643)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(26.815)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(993.419)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(96.606)
Andere Verbindlichkeiten		(18.611)
<b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>		<b>(2.853.094)</b>
<b>Nettovermögen, insgesamt</b>		<b>195.334.866</b>

### ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AEC	32.958,643
Klasse AEH	24.604,136
Klasse AKH	100,000
Klasse ANH	1.000,000
Klasse ASH	31.775,639
Klasse AU	129.341,431
Klasse AUP	301.047,544
Klasse DEC	30.063,160
Klasse DEH	27.606,975
Klasse DU	57.363,909
Klasse IEC	100,000
Klasse IEH	1.879.445,399
Klasse IKH	100,000
Klasse INH	1.000,000
Klasse IU	9.995.107,297
Klasse TEH	5.629,139
Klasse XUP	100,000
Klasse ZFH	100,000
Klasse ZGH	100,000
Klasse ZU	168.672,000

### AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2020	31. März 2020	31. März 2019
Klasse AEC	12,2479 <sup>1</sup>	11,1930 <sup>1</sup>	12,86 <sup>1</sup>
Klasse AEH	31,2074 <sup>1</sup>	27,7754 <sup>1</sup>	30,28 <sup>1</sup>
Klasse AKH	99,5615 <sup>2</sup>	88,5458 <sup>2</sup>	–
Klasse ANH	9,9732 <sup>3</sup>	8,8652 <sup>3</sup>	–
Klasse ASH	14,5261 <sup>4</sup>	12,8841 <sup>4</sup>	13,76 <sup>4</sup>
Klasse AU	36,3533	32,1520	34,04
Klasse AUP	13,0260	11,8329	13,20
Klasse DEC	9,2547 <sup>1</sup>	8,4645 <sup>1</sup>	9,74 <sup>1</sup>
Klasse DEH	22,5026 <sup>1</sup>	20,0462 <sup>1</sup>	21,90 <sup>1</sup>
Klasse DU	26,1689	23,1677	24,57
Klasse IEC	8,9234 <sup>1</sup>	8,1216 <sup>1</sup>	9,24 <sup>1</sup>
Klasse IEH	30,8520 <sup>1</sup>	27,3364 <sup>1</sup>	29,55 <sup>1</sup>
Klasse IKH	100,4887 <sup>2</sup>	88,9411 <sup>2</sup>	–
Klasse INH	10,0699 <sup>3</sup>	8,9074 <sup>3</sup>	–
Klasse IU	11,2208	9,8795	10,36
Klasse TEH	11,0129 <sup>1</sup>	9,7602 <sup>1</sup>	10,54 <sup>1</sup>
Klasse XUP	10,6314	9,6033	10,65
Klasse ZFH	10,5536 <sup>5</sup>	9,3762 <sup>5</sup>	10,20 <sup>5</sup>
Klasse ZGH	11,5656 <sup>6</sup>	10,2390 <sup>6</sup>	11,02 <sup>6</sup>
Klasse ZU	13,1216	11,5675	12,17

<sup>1</sup>Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.<sup>2</sup>Die Klasse lautet auf SEK. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.<sup>3</sup>Die Klasse lautet auf NOK. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.<sup>4</sup>Die Klasse lautet auf SGD. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.<sup>5</sup>Die Klasse lautet auf CHF. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.<sup>6</sup>Die Klasse lautet auf GBP. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

### ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2020 bis 30. September 2020

	Erläuterungen	2020 USD
<b>Nettovermögen zu Beginn der Berichtsperiode</b>		<b>109.192.138</b>
<b>Erträge</b>		
Zinsen aus Anleihen, netto	2	4.487.183
Zinsen aus Bankguthaben	2	130.257
<b>Erträge, insgesamt</b>		<b>4.617.440</b>
<b>Aufwand</b>		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(496.898)
Zinsen aus Bankguthaben	2	(132.597)
Betriebskosten	5	(96.381)
<b>Aufwand, insgesamt</b>		<b>(725.876)</b>
<b>Nettoertrag aus Anlagen</b>		<b>3.891.564</b>
Realisierter Netto(verlust) aus dem Verkauf von Anlagen		(1.734.914)
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		3.854.008
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(24.587)
<b>Realisierter Nettogewinn</b>		<b>2.094.507</b>
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		15.119.236
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Devisenterminkontrakten		227.235
<b>Nettoänderung bei nicht realisiertem Nettogewinn</b>		<b>15.346.471</b>
<b>Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit</b>		<b>21.332.542</b>
<b>Kapitalbewegungen</b>		
Zeichnungen von Anteilen		70.221.339
Anteilrücknahmen		(5.288.080)
Dividenden	7	(123.073)
<b>Kapitalbewegungen, insgesamt</b>		<b>64.810.186</b>
<b>Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode</b>		<b>195.334.866</b>

### GESAMTNETTOINVENTARWERT

USD	30. September 2020	31. März 2020	31. März 2019
	195.334.866	109.192.138	218.412.478

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond

### AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2020

	Erläuterungen	2020 USD
<b>Aktiva</b>		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	51.134.286
Bankguthaben	2	3.980.112
Termineinlagen	2, 19	1.500.000
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		4.755.178
Forderungen aus Zeichnungen		125.781
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		517.204
<b>Aktiva, insgesamt</b>		<b>62.012.561</b>
<b>Passiva</b>		
Überziehungskredite		(1.632.769)
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(5.037.888)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(11.661)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(108.882)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(15.163)
Andere Verbindlichkeiten		(24.032)
<b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>		<b>(6.830.395)</b>
<b>Nettovermögen, insgesamt</b>		<b>55.182.166</b>

### ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AEH	46.158,264
Klasse AKH	100,000
Klasse AS	17.808,440
Klasse ASC	12.973,616
Klasse ASH	68.155,564
Klasse AU	129.874,229
Klasse AUP	648.561,578
Klasse AVC	100,000
Klasse AVH	100,000
Klasse DEH	33.489,577
Klasse IEH	675.365,320
Klasse IGH	200,000
Klasse ISH	250,000
Klasse IU	250,000
Klasse XU	2.623.823,342
Klasse ZU	250,000
Klasse ZUP	100,000

### AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2020	31. März 2020	31. März 2019
Klasse AEH	11,8899 <sup>1</sup>	10,5231 <sup>1</sup>	11,22 <sup>1</sup>
Klasse AKH	102,1229 <sup>2</sup>	90,2578 <sup>2</sup>	–
Klasse AS	11,7015 <sup>3</sup>	10,7399 <sup>3</sup>	10,57 <sup>3</sup>
Klasse ASC	10,9654 <sup>3</sup>	9,8642 <sup>3</sup>	10,70 <sup>3</sup>
Klasse ASH	13,0001 <sup>3</sup>	11,4606 <sup>3</sup>	11,96 <sup>3</sup>
Klasse AU	13,2865	11,6914	12,10
Klasse AUP	11,4335	10,2697	11,06
Klasse AVC	10,5085 <sup>4</sup>	9,4610 <sup>4</sup>	10,34 <sup>4</sup>
Klasse AVH	11,5201 <sup>4</sup>	10,1653 <sup>4</sup>	10,69 <sup>4</sup>
Klasse DEH	11,5999 <sup>1</sup>	10,2773 <sup>1</sup>	10,98 <sup>1</sup>
Klasse IEH	12,3607 <sup>1</sup>	10,9001 <sup>1</sup>	11,53 <sup>1</sup>
Klasse IGH	13,0270 <sup>5</sup>	11,4570 <sup>5</sup>	12,02 <sup>5</sup>
Klasse ISH	13,5642 <sup>3</sup>	11,9152 <sup>3</sup>	12,34 <sup>3</sup>
Klasse IU	13,8365	12,1334	12,46
Klasse XU	13,0460	11,3998	11,63
Klasse ZU	13,8554	12,1566	12,50
Klasse ZUP	10,9449	9,8031	10,50

<sup>1</sup>Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.<sup>2</sup>Die Klasse lautet auf SEK. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.<sup>3</sup>Die Klasse lautet auf SGD. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.<sup>4</sup>Die Klasse lautet auf AUD. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.<sup>5</sup>Die Klasse lautet auf GBP. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

### ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2020 bis 30. September 2020

	Erläuterungen	2020 USD
<b>Nettovermögen zu Beginn der Berichtsperiode</b>		<b>47.684.339</b>
<b>Erträge</b>		
Zinsen aus Anleihen, netto	2	1.001.833
Zinsen aus Bankguthaben	2	466
<b>Erträge, insgesamt</b>		<b>1.002.299</b>
<b>Aufwand</b>		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(64.118)
Zinsen aus Bankguthaben	2	(204)
Betriebskosten	5	(43.347)
<b>Aufwand, insgesamt</b>		<b>(107.669)</b>
<b>Nettoertrag aus Anlagen</b>		<b>894.630</b>
Realisierter Nettogewinn aus dem Verkauf von Anlagen		844.881
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		1.090.889
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(5.736)
<b>Realisierter Nettogewinn</b>		<b>1.930.034</b>
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		3.854.390
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Devisenterminkontrakten		98.912
<b>Nettoänderung bei nicht realisiertem Nettogewinn</b>		<b>3.953.302</b>
<b>Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit</b>		<b>6.777.966</b>
<b>Kapitalbewegungen</b>		
Zeichnungen von Anteilen		10.312.758
Anteilrücknahmen		(9.540.497)
Dividenden	7	(52.400)
<b>Kapitalbewegungen, insgesamt</b>		<b>719.861</b>
<b>Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode</b>		<b>55.182.166</b>

### GESAMTNETTOINVENTARWERT

USD	30. September 2020	31. März 2020	31. März 2019
	55.182.166	47.684.339	38.976.738

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return

### AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2020

	Erläuterungen	2020 EUR
<b>Aktiva</b>		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	24.505.010
Bankguthaben	2	387.362
Termineinlagen	2, 19	1.798.445
Forderungen aus Zeichnungen		4.341
Erhaltene Rückvergütungen von Anlageverwaltungsgebühren	2	24
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		860
Sonstige Vermögenswerte		544
<b>Aktiva, insgesamt</b>		<b>26.696.586</b>
<b>Passiva</b>		
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(2.011)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(10.388)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Finanztermingeschäften	2, 11	(9.837)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(11.665)
Andere Verbindlichkeiten		(4.370)
<b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>		<b>(38.271)</b>
<b>Nettovermögen, insgesamt</b>		<b>26.658.315</b>

### ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AE	14.212,843
Klasse AEP	100,265
Klasse DE	2.114,227
Klasse IE	508.010,421
Klasse IEP	100,925
Klasse LE	1.980.190,610
Klasse LEP	100,870
Klasse ZE	100,748
Klasse ZEP	100,538

### AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2020	31. März 2020	31. März 2019
Klasse AE	10,4324	9,1419	10,03
Klasse AEP	10,3482	9,0786	9,99
Klasse DE	10,2433	9,0100	9,96
Klasse IE	10,6118	9,2667	10,10
Klasse IEP	10,5260	9,2021	10,05
Klasse LE	10,6516	9,2945	10,11
Klasse LEP	10,5675	9,2290	10,07
Klasse ZE	10,5593	9,2308	10,08
Klasse ZEP	10,4782	9,1673	10,03

### ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2020 bis 30. September 2020

	Erläuterungen	2020 EUR
<b>Nettovermögen zu Beginn der Berichtsperiode</b>		<b>26.502.999</b>
<b>Erträge</b>		
Zinsen aus Anleihen, netto	2	18.014
Zinsen aus Bankguthaben	2	138
Zinsen aus Finanztermingeschäften		22
Rückvergütungen von Anlageverwaltungsgebühren	2	1.549
<b>Erträge, insgesamt</b>		<b>19.723</b>
<b>Aufwand</b>		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(79.751)
Zinsen aus Bankguthaben	2	(6.149)
Zinsaufwand aus Finanztermingeschäften		(7.172)
Betriebskosten	5	(28.785)
<b>Aufwand, insgesamt</b>		<b>(121.857)</b>
<b>Netto(verlust) aus Anlagen</b>		<b>(102.134)</b>
Realisierter Netto(verlust) aus dem Verkauf von Anlagen		(67.631)
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		236.251
Realisierter Nettogewinn aus Finanztermingeschäften		677.560
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(24.507)
<b>Realisierter Nettogewinn</b>		<b>821.673</b>
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		3.089.295
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(100.689)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Finanztermingeschäften		95.856
<b>Nettoänderung bei nicht realisiertem Nettogewinn</b>		<b>3.084.462</b>
<b>Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit</b>		<b>3.804.001</b>
<b>Kapitalbewegungen</b>		
Zeichnungen von Anteilen		1.292.718
Anteilrücknahmen		(4.941.399)
Dividenden	7	(4)
<b>Kapitalbewegungen, insgesamt</b>		<b>(3.648.685)</b>
<b>Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode</b>		<b>26.658.315</b>

### GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2020	31. März 2020	31. März 2019
EUR	26.658.315	26.502.999	22.759.479

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return

### AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2020

	Erläuterungen	2020 USD
<b>Aktiva</b>		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	46.881.496
Bankguthaben	2	4.448.079
Termineinlagen	2, 19	5.400.135
Forderungen aus Zeichnungen		20.938
Zinsforderungen aus Swaps	2	13.731
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		30.131
Nicht realisierter Nettogewinn aus Swaps	2, 10	382.894
Nicht realisierter Nettogewinn aus Finanztermingeschäften	2, 11	130.186
Sonstige Vermögenswerte		7.444
<b>Aktiva, insgesamt</b>		<b>57.315.034</b>
<b>Passiva</b>		
Überziehungskredite		(1.857)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(18.725)
Zinsverbindlichkeiten aus Swaps	2	(6.787)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(217.546)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(61.878)
Andere Verbindlichkeiten		(13.219)
<b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>		<b>(320.012)</b>
<b>Nettovermögen, insgesamt</b>		<b>56.995.022</b>

### ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AEC	89.317,190
Klasse AEH	344.022,362
Klasse AKH	100,000
Klasse AU	378.952,634
Klasse AUP	430.695,081
Klasse DEH	111.357,478
Klasse DU	225.043,911
Klasse IEH	100,000
Klasse IGH	12.209,135
Klasse IU	391.097,603
Klasse W	26.123,425

### AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2020	31. März 2020	31. März 2019
Klasse AEC	13,4060 <sup>1</sup>	11,8961 <sup>1</sup>	12,83 <sup>1</sup>
Klasse AEH	27,2478 <sup>1</sup>	23,9870 <sup>1</sup>	25,52 <sup>1</sup>
Klasse AKH	106,2229 <sup>2</sup>	93,4570 <sup>2</sup>	–
Klasse AU	40,6747	35,5588	36,74
Klasse AUP	15,4288	13,5959	14,24
Klasse DEH	19,7366 <sup>1</sup>	17,4306 <sup>1</sup>	18,66 <sup>1</sup>
Klasse DU	26,7452	23,4573	24,40
Klasse IEH	10,6407 <sup>1</sup>	9,3386 <sup>1</sup>	–
Klasse IGH	27,6520 <sup>3</sup>	24,2056 <sup>3</sup>	25,36 <sup>3</sup>
Klasse IU	30,0544	26,1826	26,86
Klasse W	67,0125	58,6132	60,62

<sup>1</sup>Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.<sup>2</sup>Die Klasse lautet auf SEK. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.<sup>3</sup>Die Klasse lautet auf GBP. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

### ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2020 bis 30. September 2020

	Erläuterungen	2020 USD	
<b>Nettovermögen zu Beginn der Berichtsperiode</b>		<b>49.565.024</b>	
<b>Erträge</b>			
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	163.310	
Zinsen aus Anleihen, netto	2	79.866	
Zinsen aus Bankguthaben	2	12.993	
Zinsen aus Swaps		151.180	
Zinsen aus Finanztermingeschäften		907	
Rückvergütungen von Anlageverwaltungsgebühren	2	1.205	
<b>Erträge, insgesamt</b>		<b>409.461</b>	
<b>Aufwand</b>			
Anlageverwaltungsgebühren	5	(361.335)	
Zinsen aus Bankguthaben	2	(15.558)	
Zinsaufwand aus Swaps		(36.992)	
Zinsaufwand aus Finanztermingeschäften		(5.451)	
Betriebskosten	5	(76.764)	
<b>Aufwand, insgesamt</b>		<b>(496.100)</b>	
<b>Netto(verlust) aus Anlagen</b>		<b>(86.639)</b>	
Realisierter Nettogewinn aus dem Verkauf von Anlagen		463.508	
Realisierter Netto(verlust) aus Swaps		(168.433)	
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		1.041.179	
Realisierter Netto(verlust) aus Finanztermingeschäften		(1.198.584)	
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(3.395)	
Realisierter Nettogewinn aus Steuerrückforderung		8	
<b>Realisierter Nettogewinn</b>		<b>134.283</b>	
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		8.309.242	
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Swaps		493.802	
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(36.475)	
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Finanztermingeschäften		(727.589)	
<b>Nettoänderung bei nicht realisiertem Nettogewinn</b>		<b>8.038.980</b>	
<b>Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit</b>		<b>8.086.624</b>	
<b>Kapitalbewegungen</b>			
Zeichnungen von Anteilen		3.277.168	
Anteilrücknahmen		(3.868.361)	
Dividenden	7	(65.433)	
<b>Kapitalbewegungen, insgesamt</b>		<b>(656.626)</b>	
<b>Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode</b>		<b>56.995.022</b>	
<b>GESAMTNETTOINVENTARWERT</b>			
	30. September 2020	31. März 2020	31. März 2019
USD	56.995.022	49.565.024	59.178.404

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

## AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2020

	Erläuterungen	2020 USD
<b>Aktiva</b>		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	183.622.171
Bankguthaben	2	9.982.137
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		2.707.777
Forderungen aus Zeichnungen		92.520
Zinsforderungen aus Swaps	2	1.424
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		1.086.886
Sonstige Vermögenswerte		12.764
<b>Aktiva, insgesamt</b>		<b>197.505.679</b>
<b>Passiva</b>		
Zum Marktwert verkaufte Optionen	2, 12	(148.690)
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(1.023.140)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(722.956)
Zinsverbindlichkeiten aus Swaps	2	(1.968)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(1.762.880)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Swaps	2, 10	(30.233)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Finanztermingeschäften	2, 11	(8.630)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(244.666)
Andere Verbindlichkeiten		(53.871)
<b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>		<b>(3.997.034)</b>
<b>Nettovermögen, insgesamt</b>		<b>193.508.645</b>

## ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AE	70.431,079
Klasse AEC	6.932.372,907
Klasse AEH	1.080.642,069
Klasse AEP	2.038.289,628
Klasse AQ	100,000
Klasse AQM	100,000
Klasse AS	100,000
Klasse ASC	11.926,384
Klasse ASH	544,764
Klasse ASP	16.991,339
Klasse AU	695.389,072
Klasse AUM	40.754,701
Klasse AUP	1.354.757,087
Klasse DEC	3.815.449,077
Klasse DEH	414.422,884
Klasse DEP	499.592,332
Klasse DU	519.285,328
Klasse DUP	2.180.541,692
Klasse ZE	115.117,164
Klasse ZEC	100,000
Klasse ZEH	8.496,634
Klasse ZFH	100,000
Klasse ZU	1.536,781
Klasse ZUP	100,000

## ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2020 bis 30. September 2020

	Erläuterungen	2020 USD
<b>Nettovermögen zu Beginn der Berichtsperiode</b>		<b>191.964.823</b>
<b>Erträge</b>		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	1.697.582
Zinsen aus Anleihen, netto	2	1.704.556
Zinsen aus Bankguthaben	2	71.789
Zinsen aus Swaps		9.964
Zinsen aus Finanztermingeschäften		2.284
Rückvergütungen von Anlageverwaltungsgebühren	2	11.826
<b>Erträge, insgesamt</b>		<b>3.498.001</b>
<b>Aufwand</b>		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(1.495.666)
Zinsen aus Bankguthaben	2	(75.237)
Zinsaufwand aus Swaps		(20.770)
Zinsaufwand aus Finanztermingeschäften		(10.850)
Betriebskosten	5	(299.743)
Sonstige Gebühren		(3)
<b>Aufwand, insgesamt</b>		<b>(1.902.269)</b>
<b>Nettoertrag aus Anlagen</b>		<b>1.595.732</b>
Realisierter Netto(verlust) aus dem Verkauf von Anlagen		(10.109.744)
Realisierter Nettogewinn aus Swaps		6.883
Realisierter Netto(verlust) aus Optionen		(4.055.579)
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		3.153.157
Realisierter Nettogewinn aus Finanztermingeschäften		542.018
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(103.927)
<b>Realisierter Netto(verlust)</b>		<b>(10.567.192)</b>
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		42.608.218
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Swaps		(30.233)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Optionen		880.617
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(706.794)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Finanztermingeschäften		(224.028)
<b>Nettoänderung bei nicht realisiertem Nettogewinn</b>		<b>42.527.780</b>
<b>Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit</b>		<b>33.556.320</b>
<b>Kapitalbewegungen</b>		
Zeichnungen von Anteilen		3.760.831
Anteilrücknahmen		(31.961.032)
Dividenden	7	(3.812.297)
<b>Kapitalbewegungen, insgesamt</b>		<b>(32.012.498)</b>
<b>Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode</b>		<b>193.508.645</b>

## GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2020	31. März 2020	31. März 2019
USD	193.508.645	191.964.823	281.201.768

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

### AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2020	31. März 2020	31. März 2019
Klasse AE	9,9358 <sup>1</sup>	9,2855 <sup>1</sup>	10,48 <sup>1</sup>
Klasse AEC	7,4894 <sup>1</sup>	6,7662 <sup>1</sup>	8,48 <sup>1</sup>
Klasse AEH	16,1057 <sup>1</sup>	14,1869 <sup>1</sup>	16,86 <sup>1</sup>
Klasse AEP	8,4851 <sup>1</sup>	8,1331 <sup>1</sup>	9,68 <sup>1</sup>
Klasse AQ	92,6228 <sup>2</sup>	81,0335 <sup>2</sup>	–
Klasse AQM	89,2368 <sup>2</sup>	80,0166 <sup>2</sup>	–
Klasse AS	10,0156 <sup>3</sup>	9,1444 <sup>3</sup>	10,08 <sup>3</sup>
Klasse ASC	8,6978 <sup>3</sup>	7,8280 <sup>3</sup>	9,62 <sup>3</sup>
Klasse ASH	9,8355 <sup>3</sup>	8,6294 <sup>3</sup>	10,07 <sup>3</sup>
Klasse ASP	8,7554 <sup>3</sup>	8,1919 <sup>3</sup>	9,49 <sup>3</sup>
Klasse AU	18,1494	15,8709	18,33
Klasse AUM	9,2472	8,2835	–
Klasse AUP	8,7447	7,8434	9,55
Klasse DEC	7,1584 <sup>1</sup>	6,4921 <sup>1</sup>	8,19 <sup>1</sup>
Klasse DEH	9,2733 <sup>1</sup>	8,1990 <sup>1</sup>	9,82 <sup>1</sup>
Klasse DEP	8,0417 <sup>1</sup>	7,7380 <sup>1</sup>	9,28 <sup>1</sup>
Klasse DU	11,2807	9,9014	11,52
Klasse DUP	8,0225	7,2225	8,86
Klasse ZE	10,1142 <sup>1</sup>	9,4286 <sup>1</sup>	10,58 <sup>1</sup>
Klasse ZEC	8,2397 <sup>1</sup>	7,4323 <sup>1</sup>	9,26 <sup>1</sup>
Klasse ZEH	9,6640 <sup>1</sup>	8,4917 <sup>1</sup>	10,05 <sup>1</sup>
Klasse ZFH	9,5644 <sup>4</sup>	8,4161 <sup>4</sup>	9,99 <sup>4</sup>
Klasse ZU	10,5549	9,2068	10,58
Klasse ZUP	8,7471	7,8321	9,50

<sup>1</sup>Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

<sup>2</sup>Die Klasse lautet auf HKD. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

<sup>3</sup>Die Klasse lautet auf SGD. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

<sup>4</sup>Die Klasse lautet auf CHF. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.



## Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities\*

### AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2020

	Erläuterungen	2020 USD
<b>Aktiva</b>		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	4.965.460
Bankguthaben	2	224.139
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		1.345
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	26
<b>Aktiva, insgesamt</b>		<b>5.190.970</b>
<b>Passiva</b>		
Überziehungskredite		(25.265)
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(11.579)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(722)
Andere Verbindlichkeiten		(289)
<b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>		<b>(37.855)</b>
<b>Nettovermögen, insgesamt</b>		<b>5.153.115</b>

### ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AE	100,000
Klasse AEC	100,000
Klasse AEH	100,000
Klasse AU	100,000
Klasse AUP	100,000
Klasse IE	100,000
Klasse IEH	100,000
Klasse IG	100,000
Klasse IU	100,000
Klasse LE	100,000
Klasse LG	100,000
Klasse XU	100,000
Klasse ZE	100,000
Klasse ZEC	100,000
Klasse ZEH	100,000
Klasse ZU	498.187,100
Klasse ZUP	100,000

### AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

30. September 2020

Klasse AE <sup>#</sup>	10,2585 <sup>1</sup>
Klasse AEC <sup>#</sup>	10,3027 <sup>1</sup>
Klasse AEH <sup>#</sup>	10,3027 <sup>1</sup>
Klasse AU <sup>#</sup>	10,3049
Klasse AUP <sup>#</sup>	10,3049
Klasse IE <sup>#</sup>	10,2607 <sup>1</sup>
Klasse IEH <sup>#</sup>	10,3052 <sup>1</sup>
Klasse IG <sup>#</sup>	10,1747 <sup>2</sup>
Klasse IU <sup>#</sup>	10,3069
Klasse LE <sup>#</sup>	10,2613 <sup>1</sup>
Klasse LG <sup>#</sup>	10,1754 <sup>2</sup>
Klasse XU <sup>#</sup>	10,3081
Klasse ZE <sup>#</sup>	10,2601 <sup>1</sup>
Klasse ZEC <sup>#</sup>	10,3046 <sup>1</sup>
Klasse ZEH <sup>#</sup>	10,3046 <sup>1</sup>
Klasse ZU <sup>#</sup>	10,3063
Klasse ZUP <sup>#</sup>	10,3063

<sup>1</sup>Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.<sup>2</sup>Die Klasse lautet auf GBP. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.<sup>#</sup>Siehe Erläuterung 1.

### ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 24. September 2020 bis 30. September 2020

	Erläuterungen	2020 USD
<b>Nettovermögen zu Beginn der Berichtsperiode</b>		–
<b>Erträge</b>		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	1.357
Zinsen aus Bankguthaben	2	1
<b>Erträge, insgesamt</b>		<b>1.358</b>
<b>Aufwand</b>		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(722)
Zinsen aus Bankguthaben	2	(16)
Betriebskosten	5	(289)
<b>Aufwand, insgesamt</b>		<b>(1.027)</b>
<b>Nettoertrag aus Anlagen</b>		<b>331</b>
Realisierter Nettogewinn aus dem Verkauf von Anlagen		5.553
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(1.388)
<b>Realisierter Nettogewinn</b>		<b>4.165</b>
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		148.663
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Devisenterminkontrakten		26
<b>Nettoänderung bei nicht realisiertem Nettogewinn</b>		<b>148.689</b>
<b>Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit</b>		<b>153.185</b>
<b>Kapitalbewegungen</b>		
Zeichnungen von Anteilen		4.999.930
<b>Kapitalbewegungen, insgesamt</b>		<b>4.999.930</b>
<b>Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode</b>		<b>5.153.115</b>

### GESAMTNETTOINVENTARWERT

30. September 2020

USD 5.153.115

\*Siehe Erläuterung 1.

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Global Focus

### AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2020

	Erläuterungen	2020 USD
<b>Aktiva</b>		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	1.371.225.517
Bankguthaben	2	5.394.870
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		1.092.967
Forderungen aus Zeichnungen		3.121.564
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		729.056
Sonstige Vermögenswerte		111.974
<b>Aktiva, insgesamt</b>		<b>1.381.675.948</b>
<b>Passiva</b>		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(6.751.107)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(831.665)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(2.167.820)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(1.175.910)
Andere Verbindlichkeiten		(293.960)
<b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>		<b>(11.220.462)</b>
<b>Nettovermögen, insgesamt</b>		<b>1.370.455.486</b>

### ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AEH	1.119.496,597
Klasse AEP	888.387,810
Klasse AU	5.516.055,065
Klasse AUP	20.227,265
Klasse DEH	247.537,113
Klasse DU	868.513,144
Klasse IE	4.484.083,866
Klasse IEH	4.837.514,870
Klasse IU	13.513.176,914
Klasse IUP	3.553,849
Klasse W	18.014,468
Klasse XU	5.926.313,853
Klasse ZE	1.904.611,262
Klasse ZEH	100,000
Klasse ZEP	1.004.399,208
Klasse ZFH	100,000
Klasse ZG	648.259,363
Klasse ZU	7.377.186,422

### ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2020 bis 30. September 2020

	Erläuterungen	2020 USD
<b>Nettovermögen zu Beginn der Berichtsperiode</b>		<b>781.859.426</b>
<b>Erträge</b>		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	4.316.763
Zinsen aus Bankguthaben	2	207.434
<b>Erträge, insgesamt</b>		<b>4.524.197</b>
<b>Aufwand</b>		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(6.017.307)
Zinsen aus Bankguthaben	2	(210.033)
Betriebskosten	5	(1.513.284)
<b>Aufwand, insgesamt</b>		<b>(7.740.624)</b>
<b>Netto(verlust) aus Anlagen</b>		<b>(3.216.427)</b>
Realisierter Nettogewinn aus dem Verkauf von Anlagen		28.233.707
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		7.891.487
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(489.130)
<b>Realisierter Nettogewinn</b>		<b>35.636.064</b>
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		264.226.088
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(906.148)
<b>Nettoänderung bei nicht realisiertem Nettogewinn</b>		<b>263.319.940</b>
<b>Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit</b>		<b>295.739.577</b>
<b>Kapitalbewegungen</b>		
Zeichnungen von Anteilen		620.049.635
Anteilrücknahmen		(327.056.347)
Dividenden	7	(136.805)
<b>Kapitalbewegungen, insgesamt</b>		<b>292.856.483</b>
<b>Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode</b>		<b>1.370.455.486</b>

### GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2020	31. März 2020	31. März 2019
USD	1.370.455.486	781.859.426	640.308.193

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Global Focus

### AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2020	31. März 2020	31. März 2019
Klasse AEH	51,6119 <sup>1</sup>	39,4473 <sup>1</sup>	39,72 <sup>1</sup>
Klasse AEP	17,1465 <sup>1</sup>	13,9549 <sup>1</sup>	13,51 <sup>1</sup>
Klasse AU	86,2303	65,4043	64,03
Klasse AUP	13,8275	10,5256	10,43
Klasse DEH	37,3987 <sup>1</sup>	28,6905 <sup>1</sup>	29,11 <sup>1</sup>
Klasse DU	44,9905	34,2524	33,79
Klasse IE	16,3327 <sup>1</sup>	13,1834 <sup>1</sup>	12,50 <sup>1</sup>
Klasse IEH	13,8415 <sup>1</sup>	10,5330 <sup>1</sup>	10,51 <sup>1</sup>
Klasse IU	17,5349	13,2437	12,86
Klasse IUP	14,0966	10,6770	10,49
Klasse W	131,6921	99,8614	97,72
Klasse XU	20,2888	15,2627	14,70
Klasse ZE	18,4259 <sup>1</sup>	14,8804 <sup>1</sup>	14,13 <sup>1</sup>
Klasse ZEH <sup>†</sup>	9,9667 <sup>1</sup>	–	–
Klasse ZEP	17,5756 <sup>1</sup>	14,2420 <sup>1</sup>	13,68 <sup>1</sup>
Klasse ZFH <sup>†</sup>	9,9640 <sup>2</sup>	–	–
Klasse ZG	19,5225 <sup>3</sup>	15,3810 <sup>3</sup>	14,22 <sup>3</sup>
Klasse ZU	21,2475	16,0557	15,60

<sup>1</sup>Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

<sup>2</sup>Die Klasse lautet auf CHF. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

<sup>3</sup>Die Klasse lautet auf GBP. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

<sup>†</sup>Siehe Erläuterung 1.

## Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities

### AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2020

	Erläuterungen	2020 USD
<b>Aktiva</b>		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	116.121.922
Bankguthaben	2	1.424.525
Forderungen aus Zeichnungen		78.485
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		123.818
Sonstige Vermögenswerte		12.245
<b>Aktiva, insgesamt</b>		<b>117.760.995</b>
<b>Passiva</b>		
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(19.212)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(30.728)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(91.776)
Nicht realisierte Kapitalertragsteuer auf Anlage		(345.328)
Andere Verbindlichkeiten		(16.741)
<b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>		<b>(503.785)</b>
<b>Nettovermögen, insgesamt</b>		<b>117.257.210</b>

### ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AEH	7.972,965
Klasse AU	12.508,344
Klasse DEH	42.145,090
Klasse DU	61.197,283
Klasse IE	100,000
Klasse IEH	23.043,528
Klasse IU	4.676.205,000
Klasse ZU	14.999,082
Klasse 1E	2.921.971,488
Klasse 1U	3.501.849,567
Klasse 2E	2.016.150,894
Klasse 2U	100,000
Klasse 8E	1.156.290,447
Klasse 8U	1.657.148,374

### AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2020	31. März 2020	31. März 2019
Klasse AEH	34,7331 <sup>1</sup>	23,6114 <sup>1</sup>	28,73 <sup>1</sup>
Klasse AU	55,6730	37,5590	44,39
Klasse DEH	24,8489 <sup>1</sup>	16,9558 <sup>1</sup>	20,77 <sup>1</sup>
Klasse DU	39,1020	26,4784	31,53
Klasse IE <sup>#</sup>	12,6102 <sup>1</sup>	–	–
Klasse IEH	20,8233 <sup>1</sup>	14,0970 <sup>1</sup>	17,00 <sup>1</sup>
Klasse IU	13,2041	8,8704	–
Klasse ZU	12,6485	8,5014	9,97
Klasse 1E	1,5345 <sup>1</sup>	1,1059 <sup>1</sup>	1,28 <sup>1</sup>
Klasse 1U	1,7992	1,2133	1,43
Klasse 2E	13,9749 <sup>1</sup>	10,0408 <sup>1</sup>	11,51 <sup>1</sup>
Klasse 2U	14,4576	9,7175	11,40
Klasse 8E	1,6719 <sup>1</sup>	1,2015 <sup>1</sup>	1,38 <sup>1</sup>
Klasse 8U	1,9607	1,3184	1,55

<sup>1</sup>Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.<sup>#</sup>Siehe Erläuterung 1.

### ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2020 bis 30. September 2020

	Erläuterungen	2020 USD
<b>Nettovermögen zu Beginn der Berichtsperiode</b>		<b>79.154.413</b>
<b>Erträge</b>		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	656.634
Zinsen aus Bankguthaben	2	2.774
<b>Erträge, insgesamt</b>		<b>659.408</b>
<b>Aufwand</b>		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(490.490)
Zinsen aus Bankguthaben	2	(2.764)
Betriebskosten	5	(88.750)
<b>Aufwand, insgesamt</b>		<b>(582.004)</b>
<b>Nettoertrag aus Anlagen</b>		<b>77.404</b>
Realisierter Nettogewinn aus dem Verkauf von Anlagen		1.047.905
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		91.638
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(5.672)
Realisierter Nettogewinn aus Kapitalertragsteuer		358
<b>Realisierter Nettogewinn</b>		<b>1.134.229</b>
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		37.630.549
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(8.727)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Kapitalertragsteuer		(345.328)
<b>Nettoänderung bei nicht realisiertem Nettogewinn</b>		<b>37.276.494</b>
<b>Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit</b>		<b>38.488.127</b>
<b>Kapitalbewegungen</b>		
Zeichnungen von Anteilen		1.994.887
Anteilrücknahmen		(2.380.217)
<b>Kapitalbewegungen, insgesamt</b>		<b>(385.330)</b>
<b>Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode</b>		<b>117.257.210</b>

### GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2020	31. März 2020	31. März 2019
USD	117.257.210	79.154.413	47.448.924

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Global Equity Income

### AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2020

	Erläuterungen	2020 USD
<b>Aktiva</b>		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	200.333.739
Bankguthaben	2	803.261
Forderungen aus Zeichnungen		49.382
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		319.881
Sonstige Vermögenswerte		249
<b>Aktiva, insgesamt</b>		<b>201.506.512</b>
<b>Passiva</b>		
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(257.471)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(15.432)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(166.663)
Andere Verbindlichkeiten		(29.041)
<b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>		<b>(468.607)</b>
<b>Nettovermögen, insgesamt</b>		<b>201.037.905</b>

### ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AEC	3.100,000
Klasse AUP	100,000
Klasse DEC	100,000
Klasse DUP	100,000
Klasse IU	100,000
Klasse TE	100,000
Klasse ZU	100,000
Klasse 1E	2.136.804,926
Klasse 1EP	1.661.066,209
Klasse 1SC	568.396,744
Klasse 1SH	30.910,084
Klasse 1ST	112.394,129
Klasse 1U	564.033,432
Klasse 1UP	515.447,017
Klasse 1VT	7.711,441
Klasse 2E	1.072.280,598
Klasse 2EP	100,000
Klasse 2U	100,000
Klasse 2UP	100,000
Klasse 3E	189.322,512
Klasse 3EP	11.202.196,655
Klasse 3U	27.155,767
Klasse 3UP	43.800,332
Klasse 8E	127.404,444
Klasse 8EP	165,977
Klasse 8U	13.158,578
Klasse 8UP	71.308,213
Klasse 9E	100,000
Klasse 9EP	100,000
Klasse 9U	100,000
Klasse 9UP	100,000

### ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2020 bis 30. September 2020

	Erläuterungen	2020 USD
<b>Nettovermögen zu Beginn der Berichtsperiode</b>		<b>302.458.662</b>
<b>Erträge</b>		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	4.107.504
Zinsen aus Bankguthaben	2	624
<b>Erträge, insgesamt</b>		<b>4.108.128</b>
<b>Aufwand</b>		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(1.247.688)
Zinsen aus Bankguthaben	2	(172)
Betriebskosten	5	(193.105)
<b>Aufwand, insgesamt</b>		<b>(1.440.965)</b>
<b>Nettoertrag aus Anlagen</b>		<b>2.667.163</b>
Realisierter Netto(verlust) aus dem Verkauf von Anlagen		(18.789.747)
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		199.677
Realisierter Nettogewinn aus Devisengeschäften		116.829
<b>Realisierter Netto(verlust)</b>		<b>(18.473.241)</b>
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		64.447.565
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Devisenterminkontrakten		9.948
<b>Nettoänderung bei nicht realisiertem Nettogewinn</b>		<b>64.457.513</b>
<b>Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit</b>		<b>48.651.435</b>
<b>Kapitalbewegungen</b>		
Zeichnungen von Anteilen		5.697.511
Anteilrücknahmen		(152.016.503)
Dividenden	7	(3.753.200)
<b>Kapitalbewegungen, insgesamt</b>		<b>(150.072.192)</b>
<b>Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode</b>		<b>201.037.905</b>

### GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2020	31. März 2020	31. März 2019
USD	201.037.905	302.458.662	896.154.687

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Global Equity Income

### AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2020	31. März 2020	31. März 2019
Klasse AEC	8,9940 <sup>1</sup>	7,7949 <sup>1</sup>	10,11 <sup>1</sup>
Klasse AUP	9,4761	8,1529	10,27
Klasse DEC	8,9119 <sup>1</sup>	7,7468 <sup>1</sup>	10,09 <sup>1</sup>
Klasse DUP	9,3730	8,0829	10,24
Klasse IU	10,3752	8,7152	10,45
Klasse TE	10,1196 <sup>1</sup>	9,0928 <sup>1</sup>	10,66 <sup>1</sup>
Klasse ZU	10,3661	8,7095	10,45
Klasse 1E	10,0115 <sup>1</sup>	9,0161 <sup>1</sup>	10,64 <sup>1</sup>
Klasse 1EP	9,3008 <sup>1</sup>	8,5463 <sup>1</sup>	10,51 <sup>1</sup>
Klasse 1SC	9,3059 <sup>2</sup>	8,0406 <sup>2</sup>	10,25 <sup>2</sup>
Klasse 1SH	10,0272 <sup>2</sup>	8,4957 <sup>2</sup>	10,38 <sup>2</sup>
Klasse 1ST	9,3248 <sup>2</sup>	8,0568 <sup>2</sup>	10,25 <sup>2</sup>
Klasse 1U	10,2472	8,6349	10,43
Klasse 1UP	9,5083	8,1749	10,29
Klasse 1VT	9,1247 <sup>3</sup>	7,9347 <sup>3</sup>	10,24 <sup>3</sup>
Klasse 2E	10,3170 <sup>1</sup>	9,2630 <sup>1</sup>	10,86 <sup>1</sup>
Klasse 2EP	9,4211 <sup>1</sup>	8,6258 <sup>1</sup>	10,54 <sup>1</sup>
Klasse 2U	10,3669	8,7103	10,45
Klasse 2UP	9,6430	8,2624	10,33
Klasse 3E	10,1580 <sup>1</sup>	9,1138 <sup>1</sup>	10,67 <sup>1</sup>
Klasse 3EP	9,4333 <sup>1</sup>	8,6418 <sup>1</sup>	10,54 <sup>1</sup>
Klasse 3U	10,3970	8,7285	10,46
Klasse 3UP	9,6694	8,2797	10,34
Klasse 8E	10,1184 <sup>1</sup>	9,0865 <sup>1</sup>	10,66 <sup>1</sup>
Klasse 8EP	9,3812 <sup>1</sup>	8,5947 <sup>1</sup>	10,51 <sup>1</sup>
Klasse 8U	10,3593	8,7047	10,45
Klasse 8UP	9,6217	8,2462	10,32
Klasse 9E	10,1812 <sup>1</sup>	9,1275 <sup>1</sup>	10,68 <sup>1</sup>
Klasse 9EP	9,4500 <sup>1</sup>	8,6420 <sup>1</sup>	10,52 <sup>1</sup>
Klasse 9U	10,4237	8,7456	10,46
Klasse 9UP	9,6628	8,2711	10,31

<sup>1</sup>Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

<sup>2</sup>Die Klasse lautet auf SGD. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

<sup>3</sup>Die Klasse lautet auf AUD. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

## Threadneedle (Lux) - Global Select

### AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2020

	Erläuterungen	2020 USD
<b>Aktiva</b>		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	503.019.605
Bankguthaben	2	2.996.974
Forderungen aus Zeichnungen		933.584
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		406.849
Sonstige Vermögenswerte		43.614
<b>Aktiva, insgesamt</b>		<b>507.400.626</b>
<b>Passiva</b>		
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(78.488)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(561.010)
Andere Verbindlichkeiten		(68.725)
<b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>		<b>(708.223)</b>
<b>Nettovermögen, insgesamt</b>		<b>506.692.403</b>

### ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse IU	48.739,869
Klasse ZU	100,000
Klasse 1E	28.150.496,779
Klasse 1U	72.601.316,362
Klasse 2E	100,000
Klasse 2U	250.918,317
Klasse 3U	7.192.943,036
Klasse 8E	111.237,592
Klasse 8U	17.568.597,821
Klasse 9U	75.598,379

### AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2020	31. März 2020	31. März 2019
Klasse IU	13,4646	10,4063	10,66
Klasse ZU	13,4477	10,3985	10,66
Klasse 1E	3,1909 <sup>1</sup>	2,6451 <sup>1</sup>	2,67 <sup>1</sup>
Klasse 1U	3,7412	2,9019	2,99
Klasse 2E	13,0730 <sup>1</sup>	10,8024 <sup>1</sup>	10,82 <sup>1</sup>
Klasse 2U	13,4453	10,3974	10,66
Klasse 3U	3,9462	3,0491	3,12
Klasse 8E	4,6460 <sup>1</sup>	3,8404 <sup>1</sup>	3,85 <sup>1</sup>
Klasse 8U	5,4472	4,2132	4,32
Klasse 9U	13,4915	10,4222	10,66

<sup>1</sup>Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

### ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2020 bis 30. September 2020

	Erläuterungen	2020 USD
<b>Nettovermögen zu Beginn der Berichtsperiode</b>		<b>365.150.642</b>
<b>Erträge</b>		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	2.367.625
Zinsen aus Bankguthaben	2	2.049
<b>Erträge, insgesamt</b>		<b>2.369.674</b>
<b>Aufwand</b>		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(3.032.688)
Zinsen aus Bankguthaben	2	(155)
Betriebskosten	5	(367.994)
<b>Aufwand, insgesamt</b>		<b>(3.400.837)</b>
<b>Netto(verlust) aus Anlagen</b>		<b>(1.031.163)</b>
Realisierter Netto(verlust) aus dem Verkauf von Anlagen		(1.730.210)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(876)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(4.136)
Realisierter Nettogewinn aus Steuerrückforderung		172
<b>Realisierter Netto(verlust)</b>		<b>(1.735.050)</b>
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		110.479.969
<b>Nettoänderung bei nicht realisiertem Nettogewinn</b>		<b>110.479.969</b>
<b>Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit</b>		<b>107.713.756</b>
<b>Kapitalbewegungen</b>		
Zeichnungen von Anteilen		79.677.553
Anteilrücknahmen		(45.849.548)
<b>Kapitalbewegungen, insgesamt</b>		<b>33.828.005</b>
<b>Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode</b>		<b>506.692.403</b>

### GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2020	31. März 2020	31. März 2019
USD	506.692.403	365.150.642	441.869.956

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies

### AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2020

	Erläuterungen	2020 EUR
<b>Aktiva</b>		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	1.134.307.998
Bankguthaben	2	1.482.019
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		1.048.108
Forderungen aus Zeichnungen		10.951.938
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		374.332
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	35.218
Sonstige Vermögenswerte		14.044
<b>Aktiva, insgesamt</b>		<b>1.148.213.657</b>
<b>Passiva</b>		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(2.015.408)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(668.030)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(770.448)
Andere Verbindlichkeiten		(237.692)
<b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>		<b>(3.691.578)</b>
<b>Nettovermögen, insgesamt</b>		<b>1.144.522.079</b>

### ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AE	6.742.515,363
Klasse AEP	4.760.192,193
Klasse AK	649.546,005
Klasse AUP	10.175,901
Klasse DE	799.832,723
Klasse IE	8.075.586,223
Klasse IEP	998.050,000
Klasse NE	10.417.564,000
Klasse XE	3.181.794,754
Klasse XG	100,000
Klasse XGH	100,000
Klasse ZE	823.317,635
Klasse ZFH	1.108.703,027
Klasse ZG	311.239,778
Klasse ZGH	37.824,393
Klasse ZU	9.493.090,902

### AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2020	31. März 2020	31. März 2019
Klasse AE	39,2513	28,8263	29,93
Klasse AEP	13,0117	9,5558	10,06
Klasse AK	107,8527 <sup>1</sup>	82,0449 <sup>1</sup>	–
Klasse AUP	12,9552 <sup>2</sup>	8,9026 <sup>2</sup>	9,59 <sup>2</sup>
Klasse DE	30,0068	22,0920	23,05
Klasse IE	56,6101	41,3989	42,61
Klasse IEP <sup>#</sup>	10,8615	–	–
Klasse NE	12,4041	9,0621	–
Klasse XE	14,2561	10,3840	10,60
Klasse XG	14,7106 <sup>3</sup>	10,4565 <sup>3</sup>	10,41 <sup>3</sup>
Klasse XGH	19,2587 <sup>3</sup>	14,0424 <sup>3</sup>	14,34 <sup>3</sup>
Klasse ZE	13,9456	10,2035	10,51
Klasse ZFH	13,7939 <sup>4</sup>	10,1002 <sup>4</sup>	10,45 <sup>4</sup>
Klasse ZG	14,4160 <sup>3</sup>	10,2901 <sup>3</sup>	10,32 <sup>3</sup>
Klasse ZGH	40,4022 <sup>3</sup>	29,5931 <sup>3</sup>	30,48 <sup>3</sup>
Klasse ZU	13,8661 <sup>2</sup>	9,4930 <sup>2</sup>	10,01 <sup>2</sup>

<sup>1</sup>Die Klasse lautet auf SEK. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.<sup>2</sup>Die Klasse lautet auf USD. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.<sup>3</sup>Die Klasse lautet auf GBP. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.<sup>4</sup>Die Klasse lautet auf CHF. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.<sup>#</sup>Siehe Erläuterung 1.

### ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2020 bis 30. September 2020

	Erläuterungen	2020 EUR
<b>Nettovermögen zu Beginn der Berichtsperiode</b>		<b>467.243.010</b>
<b>Erträge</b>		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	2.712.471
Zinsen aus Bankguthaben	2	46.120
<b>Erträge, insgesamt</b>		<b>2.758.591</b>
<b>Aufwand</b>		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(3.477.540)
Zinsen aus Bankguthaben	2	(46.533)
Betriebskosten	5	(887.280)
<b>Aufwand, insgesamt</b>		<b>(4.411.353)</b>
<b>Netto(verlust) aus Anlagen</b>		<b>(1.652.762)</b>
Realisierter Nettogewinn aus dem Verkauf von Anlagen		25.968.085
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(355.514)
Realisierter Nettogewinn aus Devisengeschäften		26.838
<b>Realisierter Nettogewinn</b>		<b>25.639.409</b>
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		173.204.551
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Devisenterminkontrakten		67.571
<b>Nettoänderung bei nicht realisiertem Nettogewinn</b>		<b>173.272.122</b>
<b>Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit</b>		<b>197.258.769</b>
<b>Kapitalbewegungen</b>		
Zeichnungen von Anteilen		585.532.112
Anteilrücknahmen		(105.511.812)
<b>Kapitalbewegungen, insgesamt</b>		<b>480.020.300</b>
<b>Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode</b>		<b>1.144.522.079</b>

### GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2020	31. März 2020	31. März 2019
EUR	1.144.522.079	467.243.010	196.527.339

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.



## Threadneedle (Lux) - American

### AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2020

	Erläuterungen	2020 USD
<b>Aktiva</b>		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	1.014.521.309
Bankguthaben	2	8.650.715
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		8.667.415
Forderungen aus Zeichnungen		428.359
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		341.044
Sonstige Vermögenswerte		264
<b>Aktiva, insgesamt</b>		<b>1.032.609.106</b>
<b>Passiva</b>		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(3.784.379)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(8.112.256)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(1.684.260)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(882.358)
Andere Verbindlichkeiten		(152.335)
<b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>		<b>(14.615.588)</b>
<b>Nettovermögen, insgesamt</b>		<b>1.017.993.518</b>

### ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AEH	1.117.520,659
Klasse AU	304.253,830
Klasse DEH	53.960,415
Klasse DU	582.636,426
Klasse IEH	453.628,075
Klasse IU	6.689.737,513
Klasse W	1.591,035
Klasse ZE	100,000
Klasse ZEH	1.287.302,466
Klasse ZU	100,000
Klasse 1E	3.292.462,546
Klasse 1EH	220.387,580
Klasse 1EP	331.805,200
Klasse 1U	13.939.383,573
Klasse 2E	967.238,270
Klasse 2U	9.718.620,747
Klasse 3EH	10.625,846
Klasse 3U	622.634,002
Klasse 8E	1.553.822,915
Klasse 8U	3.705.269,375
Klasse 9EH	100,000
Klasse 9U	716.095,123

### ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2020 bis 30. September 2020

	Erläuterungen	2020 USD
<b>Nettovermögen zu Beginn der Berichtsperiode</b>		<b>845.435.297</b>
<b>Erträge</b>		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	5.331.846
Zinsen aus Bankguthaben	2	64.971
<b>Erträge, insgesamt</b>		<b>5.396.817</b>
<b>Aufwand</b>		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(5.059.655)
Zinsen aus Bankguthaben	2	(67.109)
Betriebskosten	5	(864.257)
<b>Aufwand, insgesamt</b>		<b>(5.991.021)</b>
<b>Netto(verlust) aus Anlagen</b>		<b>(594.204)</b>
Realisierter Nettogewinn aus dem Verkauf von Anlagen		37.393.114
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		7.083.740
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(180.345)
<b>Realisierter Nettogewinn</b>		<b>44.296.509</b>
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		224.314.364
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(58.872)
<b>Nettoänderung bei nicht realisiertem Nettogewinn</b>		<b>224.255.492</b>
<b>Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit</b>		<b>267.957.797</b>
<b>Kapitalbewegungen</b>		
Zeichnungen von Anteilen		53.040.911
Anteilrücknahmen		(148.440.487)
<b>Kapitalbewegungen, insgesamt</b>		<b>(95.399.576)</b>
<b>Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode</b>		<b>1.017.993.518</b>

### GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2020	31. März 2020	31. März 2019
USD	1.017.993.518	845.435.297	907.780.896

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - American

### AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2020	31. März 2020	31. März 2019
Klasse AEH	52,1153 <sup>1</sup>	39,8500 <sup>1</sup>	43,59 <sup>1</sup>
Klasse AU	89,2979	67,7834	72,16
Klasse DEH	38,6335 <sup>1</sup>	29,5927 <sup>1</sup>	32,49 <sup>1</sup>
Klasse DU	34,7962	26,4589	28,27
Klasse IEH	55,9438 <sup>1</sup>	42,5805 <sup>1</sup>	46,17 <sup>1</sup>
Klasse IU	60,6591	45,8385	48,36
Klasse W	118,6337	89,9169	95,43
Klasse ZE	12,5527 <sup>1</sup>	10,1443 <sup>1</sup>	10,47 <sup>1</sup>
Klasse ZEH	11,9105 <sup>1</sup>	9,0706 <sup>1</sup>	9,84 <sup>1</sup>
Klasse ZU	12,7217	9,6205	10,16
Klasse 1E	12,1410 <sup>1</sup>	9,8427 <sup>1</sup>	10,23 <sup>1</sup>
Klasse 1EH	11,6900 <sup>1</sup>	8,9324 <sup>1</sup>	9,76 <sup>1</sup>
Klasse 1EP	11,8165 <sup>1</sup>	9,5797 <sup>1</sup>	10,16 <sup>1</sup>
Klasse 1U	12,2957	9,3272	9,92
Klasse 2E	12,2905 <sup>1</sup>	9,9337 <sup>1</sup>	10,26 <sup>1</sup>
Klasse 2U	12,4451	9,4120	9,95
Klasse 3EH	11,8685 <sup>1</sup>	9,0365 <sup>1</sup>	9,80 <sup>1</sup>
Klasse 3U	12,4892	9,4368	9,95
Klasse 8E	12,2796 <sup>1</sup>	9,9269 <sup>1</sup>	10,25 <sup>1</sup>
Klasse 8U	12,4317	9,4037	9,94
Klasse 9EH	11,8833 <sup>1</sup>	9,0418 <sup>1</sup>	9,80 <sup>1</sup>
Klasse 9U	12,4938	9,4383	9,95

<sup>1</sup>Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

## Threadneedle (Lux) - American Select

### AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2020

	Erläuterungen	2020 USD
<b>Aktiva</b>		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	394.333.735
Bankguthaben	2	1.973.978
Forderungen aus Zeichnungen		112.906
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		70.356
Sonstige Vermögenswerte		3.674
<b>Aktiva, insgesamt</b>		<b>396.494.649</b>
<b>Passiva</b>		
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(845.415)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(53.093)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(447.445)
Andere Verbindlichkeiten		(53.062)
<b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>		<b>(1.399.015)</b>
<b>Nettovermögen, insgesamt</b>		<b>395.095.634</b>

### ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AD	1.000,000
Klasse AEH	23.984,034
Klasse AN	1.000,000
Klasse AU	130.641,747
Klasse DEH	13.741,897
Klasse DU	94.754,571
Klasse ID	1.000,000
Klasse IE	100,000
Klasse IEH	27.168,323
Klasse IN	1.000,000
Klasse W	11.984,266
Klasse ZEH	1.174,458
Klasse ZU	34.610,000
Klasse 1E	14.414.559,972
Klasse 1EH	63.091,644
Klasse 1EP	483.745,642
Klasse 1U	43.020.506,937
Klasse 2EH	100,000
Klasse 2U	100,000
Klasse 3E	8.194.928,094
Klasse 3U	4.963.048,281
Klasse 8EH	296.380,558
Klasse 8U	2.944.473,388
Klasse 9E	100,000
Klasse 9U	100,000

### ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2020 bis 30. September 2020

	Erläuterungen	2020 USD
<b>Nettovermögen zu Beginn der Berichtsperiode</b>		<b>315.353.771</b>
<b>Erträge</b>		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	1.010.018
Zinsen aus Bankguthaben	2	51.137
<b>Erträge, insgesamt</b>		<b>1.061.155</b>
<b>Aufwand</b>		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(2.578.244)
Zinsen aus Bankguthaben	2	(51.060)
Betriebskosten	5	(306.354)
<b>Aufwand, insgesamt</b>		<b>(2.935.658)</b>
<b>Netto(verlust) aus Anlagen</b>		<b>(1.874.503)</b>
Realisierter Nettogewinn aus dem Verkauf von Anlagen		4.050.728
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		240.843
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(7.517)
<b>Realisierter Nettogewinn</b>		<b>4.284.054</b>
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		99.562.779
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(2.086)
<b>Nettoänderung bei nicht realisiertem Nettogewinn</b>		<b>99.560.693</b>
<b>Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit</b>		<b>101.970.244</b>
<b>Kapitalbewegungen</b>		
Zeichnungen von Anteilen		16.334.198
Anteilrücknahmen		(38.562.579)
<b>Kapitalbewegungen, insgesamt</b>		<b>(22.228.381)</b>
<b>Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode</b>		<b>395.095.634</b>

### GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2020	31. März 2020	31. März 2019
USD	395.095.634	315.353.771	363.379.073

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - American Select

### AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2020	31. März 2020	31. März 2019
Klasse AD	11,8833 <sup>1</sup>	9,5986 <sup>1</sup>	–
Klasse AEH	34,2515 <sup>2</sup>	26,0234 <sup>2</sup>	28,15 <sup>2</sup>
Klasse AN	13,5298 <sup>3</sup>	11,4489 <sup>3</sup>	–
Klasse AU	31,0784	23,4327	24,67
Klasse DEH	23,5160 <sup>2</sup>	17,9318 <sup>2</sup>	19,54 <sup>2</sup>
Klasse DU	27,5042	20,8155	22,08
Klasse ID	11,9970 <sup>1</sup>	9,6523 <sup>1</sup>	–
Klasse IE	12,0386 <sup>2</sup>	9,6644 <sup>2</sup>	–
Klasse IEH	36,1987 <sup>2</sup>	27,3895 <sup>2</sup>	29,40 <sup>2</sup>
Klasse IN	13,6540 <sup>3</sup>	11,5094 <sup>3</sup>	–
Klasse W	32,8607	24,7704	26,07
Klasse ZEH	12,2125 <sup>2</sup>	9,2429 <sup>2</sup>	9,92 <sup>2</sup>
Klasse ZU	13,0326	9,7922	10,24
Klasse 1E	4,5474 <sup>2</sup>	3,6619 <sup>2</sup>	3,76 <sup>2</sup>
Klasse 1EH	3,6266 <sup>2</sup>	2,7534 <sup>2</sup>	2,98 <sup>2</sup>
Klasse 1EP	4,4627 <sup>2</sup>	3,5938 <sup>2</sup>	3,74 <sup>2</sup>
Klasse 1U	5,3323	4,0179	4,23
Klasse 2EH	12,6095 <sup>2</sup>	9,5434 <sup>2</sup>	10,24 <sup>2</sup>
Klasse 2U	13,2203	9,9304	10,38
Klasse 3E	3,6874 <sup>2</sup>	2,9575 <sup>2</sup>	3,01 <sup>2</sup>
Klasse 3U	4,3239	3,2451	3,38
Klasse 8EH	3,1708 <sup>2</sup>	2,4004 <sup>2</sup>	2,58 <sup>2</sup>
Klasse 8U	6,1126	4,5928	4,80
Klasse 9E	12,8615 <sup>2</sup>	10,3117 <sup>2</sup>	10,51 <sup>2</sup>
Klasse 9U	13,2874	9,9683	10,39

<sup>1</sup>Die Klasse lautet auf DKK. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

<sup>2</sup>Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

<sup>3</sup>Die Klasse lautet auf NOK. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

## Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies

### AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2020

	Erläuterungen	2020 USD
<b>Aktiva</b>		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	201.544.653
Bankguthaben	2	168.676
Forderungen aus Zeichnungen		71.656
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		105.271
<b>Aktiva, insgesamt</b>		<b>201.890.256</b>
<b>Passiva</b>		
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(153.888)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(789)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(196.753)
Andere Verbindlichkeiten		(25.695)
<b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>		<b>(377.125)</b>
<b>Nettovermögen, insgesamt</b>		<b>201.513.131</b>

### ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AEH	100,000
Klasse AU	100,000
Klasse DEH	100,000
Klasse DU	3.375,394
Klasse IE	100,000
Klasse IU	100,000
Klasse ZU	100,000
Klasse 1E	238.585,084
Klasse 1EP	711.111,842
Klasse 1U	7.839.532,096
Klasse 2U	1.807.320,790
Klasse 3EH	3.961,863
Klasse 3U	1.459.762,780
Klasse 8U	1.266.755,641
Klasse 9EH	100,000
Klasse 9U	3.695.794,182

### AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2020	31. März 2020	31. März 2019
Klasse AEH	11,0578 <sup>1</sup>	8,2252 <sup>1</sup>	10,53 <sup>1</sup>
Klasse AU	11,6394	8,5873	10,69
Klasse DEH	10,9510 <sup>1</sup>	8,1660 <sup>1</sup>	10,51 <sup>1</sup>
Klasse DU	11,5322	8,5270	10,66
Klasse IE	10,4897 <sup>1</sup>	8,2360 <sup>1</sup>	–
Klasse IU	11,8371	8,6950	10,72
Klasse ZU	11,8226	8,6865	10,72
Klasse 1E	11,4237 <sup>1</sup>	8,9994 <sup>1</sup>	10,92 <sup>1</sup>
Klasse 1EP	11,0651 <sup>1</sup>	8,7169 <sup>1</sup>	10,84 <sup>1</sup>
Klasse 1U	11,6776	8,6079	10,69
Klasse 2U	11,8169	8,6842	10,72
Klasse 3EH	11,2537 <sup>1</sup>	8,3303 <sup>1</sup>	10,57 <sup>1</sup>
Klasse 3U	11,8462	8,6996	10,73
Klasse 8U	11,8133	8,6833	10,72
Klasse 9EH	11,2836 <sup>1</sup>	8,3502 <sup>1</sup>	10,58 <sup>1</sup>
Klasse 9U	11,8592	8,7074	10,73

<sup>1</sup>Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

### ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2020 bis 30. September 2020

	Erläuterungen	2020 USD
<b>Nettovermögen zu Beginn der Berichtsperiode</b>		<b>172.396.358</b>
<b>Erträge</b>		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	1.046.804
Zinsen aus Bankguthaben	2	774
<b>Erträge, insgesamt</b>		<b>1.047.578</b>
<b>Aufwand</b>		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(1.150.630)
Zinsen aus Bankguthaben	2	(25)
Betriebskosten	5	(149.893)
<b>Aufwand, insgesamt</b>		<b>(1.300.548)</b>
<b>Netto(verlust) aus Anlagen</b>		<b>(252.970)</b>
Realisierter Nettogewinn aus dem Verkauf von Anlagen		6.372.206
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		3.276
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(3.169)
<b>Realisierter Nettogewinn</b>		<b>6.372.313</b>
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		51.790.868
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(97)
<b>Nettoänderung bei nicht realisiertem Nettogewinn</b>		<b>51.790.771</b>
<b>Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit</b>		<b>57.910.114</b>
<b>Kapitalbewegungen</b>		
Zeichnungen von Anteilen		14.969.501
Anteilrücknahmen		(43.762.842)
<b>Kapitalbewegungen, insgesamt</b>		<b>(28.793.341)</b>
<b>Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode</b>		<b>201.513.131</b>

### GESAMTNETTOINVENTARWERT

USD	30. September 2020	31. März 2020	31. März 2019
	201.513.131	172.396.358	256.158.593

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity

### AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2020

	Erläuterungen	2020 USD
<b>Aktiva</b>		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	163.921.444
Bankguthaben	2	1.554.281
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		30.847
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		251.899
Sonstige Vermögenswerte	20	1.590.608
<b>Aktiva, insgesamt</b>		<b>167.349.079</b>
<b>Passiva</b>		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(411.734)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(2.001)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(2.541)
Nicht realisierte Kapitalertragsteuer auf Anlage		(247.758)
Andere Verbindlichkeiten		(20.881)
<b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>		<b>(684.915)</b>
<b>Nettovermögen, insgesamt</b>		<b>166.664.164</b>

### ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AE	544,776
Klasse AF	100,000
Klasse AS	25.363,926
Klasse ASH	58.871,509
Klasse AU	13.251,269
Klasse DE	4.798,607
Klasse IF	100,000
Klasse ISH	630,000
Klasse IU	3.499,244
Klasse XU	8.154.552,449
Klasse XUP	4.693.125,078
Klasse ZE	59.428,000
Klasse ZEH	360,000
Klasse ZF	100,000
Klasse ZG	100,000
Klasse ZU	40.336,939

### AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2020	31. März 2020	31. März 2019
Klasse AE	14,9673 <sup>1</sup>	11,6808 <sup>1</sup>	13,82 <sup>1</sup>
Klasse AF	14,8649 <sup>2</sup>	11,4321 <sup>2</sup>	14,25 <sup>2</sup>
Klasse AS	11,8408 <sup>3</sup>	9,0235 <sup>3</sup>	10,41 <sup>3</sup>
Klasse ASH	14,6636 <sup>3</sup>	10,7767 <sup>3</sup>	13,21 <sup>3</sup>
Klasse AU	15,3168	11,1870	13,55
Klasse DE	14,3242 <sup>1</sup>	11,2228 <sup>1</sup>	13,38 <sup>1</sup>
Klasse IE	–	–	14,19 <sup>1</sup>
Klasse IF	15,4378 <sup>2</sup>	11,8248 <sup>2</sup>	14,62 <sup>2</sup>
Klasse ISH	15,4337 <sup>3</sup>	11,2943 <sup>3</sup>	13,72 <sup>3</sup>
Klasse IU	16,0830	11,6971	14,04
Klasse XU	12,1218	8,7810	–
Klasse XUP	13,8213	10,1785	12,51
Klasse ZE	15,5346 <sup>1</sup>	12,0806 <sup>1</sup>	14,19 <sup>1</sup>
Klasse ZEH	14,3248 <sup>1</sup>	10,5075 <sup>1</sup>	13,00 <sup>1</sup>
Klasse ZF	15,4368 <sup>2</sup>	11,8269 <sup>2</sup>	14,63 <sup>2</sup>
Klasse ZG	10,5391 <sup>4</sup>	7,9962 <sup>4</sup>	9,14 <sup>4</sup>
Klasse ZU	16,0490	11,6781	14,03

<sup>1</sup>Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.<sup>2</sup>Die Klasse lautet auf CHF. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.<sup>3</sup>Die Klasse lautet auf SGD. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.<sup>4</sup>Die Klasse lautet auf GBP. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

### ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2020 bis 30. September 2020

	Erläuterungen	2020 USD
<b>Nettovermögen zu Beginn der Berichtsperiode</b>		<b>124.384.661</b>
<b>Erträge</b>		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	2.429.760
Zinsen aus Bankguthaben	2	31.067
<b>Erträge, insgesamt</b>		<b>2.460.827</b>
<b>Aufwand</b>		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(12.142)
Zinsen aus Bankguthaben	2	(31.103)
Betriebskosten	5	(117.666)
<b>Aufwand, insgesamt</b>		<b>(160.911)</b>
<b>Nettoertrag aus Anlagen</b>		<b>2.299.916</b>
Realisierter Nettogewinn aus dem Verkauf von Anlagen		5.800.686
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		16.969
Realisierter Nettogewinn aus Kapitalertragsteuer		256
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(49.647)
<b>Realisierter Nettogewinn</b>		<b>5.768.264</b>
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		39.528.677
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(765)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Kapitalertragsteuer		(247.758)
<b>Nettoänderung bei nicht realisiertem Nettogewinn</b>		<b>39.280.154</b>
<b>Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit</b>		<b>47.348.334</b>
<b>Kapitalbewegungen</b>		
Zeichnungen von Anteilen		31.213.849
Anteilrücknahmen		(35.236.113)
Dividenden	7	(1.046.567)
<b>Kapitalbewegungen, insgesamt</b>		<b>(5.068.831)</b>
<b>Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode</b>		<b>166.664.164</b>

### GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2020	31. März 2020	31. März 2019
USD	166.664.164	124.384.661	185.676.126

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Asia Equities

### AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2020

	Erläuterungen	2020 USD
<b>Aktiva</b>		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	267.174.993
Bankguthaben	2	2.305.141
Forderungen aus Zeichnungen		73.834
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		478.735
Sonstige Vermögenswerte	20	2.396.426
<b>Aktiva, insgesamt</b>		<b>272.429.129</b>
<b>Passiva</b>		
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(103.165)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(255.539)
Nicht realisierte Kapitalertragsteuer auf Anlage		(320.492)
Andere Verbindlichkeiten		(29.497)
<b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>		<b>(708.693)</b>
<b>Nettovermögen, insgesamt</b>		<b>271.720.436</b>

### ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse IE	310.100,000
Klasse IU	198.271,606
Klasse ZU	100,000
Klasse 1E	1.436.892,867
Klasse 1U	24.062.370,680
Klasse 2E	9.204.616,512
Klasse 2U	1.784.398,718
Klasse 3U	1.687.047,301
Klasse 8E	474,483
Klasse 8U	2.155.770,705
Klasse 9U	161.642,940

### AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2020	31. März 2020	31. März 2019
Klasse IE	11,8098 <sup>1</sup>	9,0252 <sup>1</sup>	–
Klasse IU	13,0156	9,3071	10,72
Klasse ZU	12,9995	9,3012	10,72
Klasse 1E	2,9886 <sup>1</sup>	2,2925 <sup>1</sup>	2,60 <sup>1</sup>
Klasse 1U	3,5043	2,5152	2,92
Klasse 2E	12,6318 <sup>1</sup>	9,6601 <sup>1</sup>	10,88 <sup>1</sup>
Klasse 2U	12,9958	9,2995	10,72
Klasse 3U	3,1249	2,2346	2,57
Klasse 8E	3,3890 <sup>1</sup>	2,5930 <sup>1</sup>	2,92 <sup>1</sup>
Klasse 8U	3,9757	2,8455	3,28
Klasse 9U	13,0350	9,3192	10,72

<sup>1</sup>Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

### ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2020 bis 30. September 2020

	Erläuterungen	2020 USD
<b>Nettovermögen zu Beginn der Berichtsperiode</b>		<b>195.909.991</b>
<b>Erträge</b>		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	2.703.528
Zinsen aus Bankguthaben	2	947
<b>Erträge, insgesamt</b>		<b>2.704.475</b>
<b>Aufwand</b>		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(1.404.439)
Zinsen aus Bankguthaben	2	(13)
Betriebskosten	5	(162.093)
<b>Aufwand, insgesamt</b>		<b>(1.566.545)</b>
<b>Nettoertrag aus Anlagen</b>		<b>1.137.930</b>
Realisierter Nettogewinn aus dem Verkauf von Anlagen		8.304.009
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		34.520
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(50.142)
Realisierter Nettogewinn aus Kapitalertragsteuer		331
<b>Realisierter Nettogewinn</b>		<b>8.288.718</b>
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		68.423.532
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Kapitalertragsteuer		(320.492)
<b>Nettoänderung bei nicht realisiertem Nettogewinn</b>		<b>68.103.040</b>
<b>Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit</b>		<b>77.529.688</b>
<b>Kapitalbewegungen</b>		
Zeichnungen von Anteilen		4.257.800
Anteilrücknahmen		(5.977.043)
<b>Kapitalbewegungen, insgesamt</b>		<b>(1.719.243)</b>
<b>Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode</b>		<b>271.720.436</b>

### GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2020	31. März 2020	31. März 2019
USD	271.720.436	195.909.991	235.034.331

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities

### AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2020

	Erläuterungen	2020 USD
<b>Aktiva</b>		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	425.456.521
Bankguthaben	2	2.368.872
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		3.238.212
Forderungen aus Zeichnungen		8.413
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		339.178
Sonstige Vermögenswerte		48
<b>Aktiva, insgesamt</b>		<b>431.411.244</b>
<b>Passiva</b>		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(866.087)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(69.436)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(399.855)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(215.987)
Andere Verbindlichkeiten		(87.476)
<b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>		<b>(1.638.841)</b>
<b>Nettovermögen, insgesamt</b>		<b>429.772.403</b>

### ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AEC	41,151
Klasse AEH	12.807,953
Klasse AU	127.140,527
Klasse AUP	15.032,819
Klasse DU	8.671,446
Klasse IU	3.882.142,635
Klasse XS	100,000
Klasse XSH	9.497.895,186
Klasse ZEH	482.469,951
Klasse ZFH	200,000
Klasse ZGH	200,000
Klasse ZU	4.179.135,769

### AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2020	31. März 2020	31. März 2019
Klasse AEC	14,5993 <sup>1</sup>	11,3591 <sup>1</sup>	12,75 <sup>1</sup>
Klasse AEH	23,7024 <sup>1</sup>	18,3280 <sup>1</sup>	20,19 <sup>1</sup>
Klasse AU	42,9663	32,9720	35,32
Klasse AUP	15,8740	12,2618	13,41
Klasse DU	21,4974	16,5381	17,81
Klasse IU	61,4942	47,0024	49,95
Klasse XS	14,9463 <sup>2</sup>	11,8570 <sup>2</sup>	11,87 <sup>2</sup>
Klasse XSH	15,0355 <sup>2</sup>	11,4988 <sup>2</sup>	12,24 <sup>2</sup>
Klasse ZEH	15,3173 <sup>1</sup>	11,8015 <sup>1</sup>	12,89 <sup>1</sup>
Klasse ZFH	15,0185 <sup>3</sup>	11,5719 <sup>3</sup>	12,68 <sup>3</sup>
Klasse ZGH	15,8374 <sup>4</sup>	12,2135 <sup>4</sup>	13,32 <sup>4</sup>
Klasse ZU	17,0604	13,0432	13,87

<sup>1</sup>Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.<sup>2</sup>Die Klasse lautet auf SGD. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.<sup>3</sup>Die Klasse lautet auf CHF. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.<sup>4</sup>Die Klasse lautet auf GBP. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

### ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2020 bis 30. September 2020

	Erläuterungen	2020 USD
<b>Nettovermögen zu Beginn der Berichtsperiode</b>		<b>462.376.758</b>
<b>Erträge</b>		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	2.709.748
Zinsen aus Bankguthaben	2	259.927
<b>Erträge, insgesamt</b>		<b>2.969.675</b>
<b>Aufwand</b>		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(1.350.661)
Zinsen aus Bankguthaben	2	(260.632)
Betriebskosten	5	(543.919)
<b>Aufwand, insgesamt</b>		<b>(2.155.212)</b>
<b>Nettoertrag aus Anlagen</b>		<b>814.463</b>
Realisierter Nettogewinn aus dem Verkauf von Anlagen		38.095.807
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		4.764.607
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(364.983)
<b>Realisierter Nettogewinn</b>		<b>42.495.431</b>
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		82.680.408
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Devisenterminkontrakten		136.427
<b>Nettoänderung bei nicht realisiertem Nettogewinn</b>		<b>82.816.835</b>
<b>Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit</b>		<b>126.126.729</b>
<b>Kapitalbewegungen</b>		
Zeichnungen von Anteilen		56.439.822
Anteilrücknahmen		(215.169.385)
Dividenden	7	(1.521)
<b>Kapitalbewegungen, insgesamt</b>		<b>(158.731.084)</b>
<b>Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode</b>		<b>429.772.403</b>

### GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2020	31. März 2020	31. März 2019
USD	429.772.403	462.376.758	607.510.212

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.



## Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities

### AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2020

	Erläuterungen	2020 USD
<b>Aktiva</b>		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	4.475.823
Bankguthaben	2	14.146
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		3.893
<b>Aktiva, insgesamt</b>		<b>4.493.862</b>
<b>Passiva</b>		
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(453)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(1.384)
Andere Verbindlichkeiten		(485)
<b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>		<b>(2.322)</b>
<b>Nettovermögen, insgesamt</b>		<b>4.491.540</b>

### ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AE	1.625,544
Klasse AEH	175,100
Klasse AU	44.973,571
Klasse AUP	49.330,640
Klasse DE	9.126,406
Klasse DEH	1.317,987
Klasse DU	52.324,659
Klasse IE	175,100
Klasse IEC	175,100
Klasse IEH	175,100
Klasse IFH	161,100
Klasse IG	100,000
Klasse IU	52.716,576
Klasse NE	100,000
Klasse NG	100,000
Klasse NU	100,000
Klasse XG	80.100,000
Klasse ZEH	175,100
Klasse ZFH	161,100
Klasse ZU	52.574,002

### ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2020 bis 30. September 2020

	Erläuterungen	2020 USD
<b>Nettovermögen zu Beginn der Berichtsperiode</b>		<b>5.455.757</b>
<b>Erträge</b>		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	43.710
Zinsen aus Bankguthaben	2	1
<b>Erträge, insgesamt</b>		<b>43.711</b>
<b>Aufwand</b>		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(11.554)
Zinsen aus Bankguthaben	2	(72)
Betriebskosten	5	(3.940)
<b>Aufwand, insgesamt</b>		<b>(15.566)</b>
<b>Nettoertrag aus Anlagen</b>		<b>28.145</b>
Realisierter Nettogewinn aus dem Verkauf von Anlagen		565.631
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		1.820
Realisierter Nettogewinn aus Devisengeschäften		62.683
<b>Realisierter Nettogewinn</b>		<b>630.134</b>
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		761.869
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Devisenterminkontrakten		45
<b>Nettoänderung bei nicht realisiertem Nettogewinn</b>		<b>761.914</b>
<b>Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit</b>		<b>1.420.193</b>
<b>Kapitalbewegungen</b>		
Zeichnungen von Anteilen		13.053.098
Anteilrücknahmen		(15.431.368)
Dividenden	7	(6.140)
<b>Kapitalbewegungen, insgesamt</b>		<b>(2.384.410)</b>
<b>Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode</b>		<b>4.491.540</b>

### GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2020	31. März 2020	31. März 2019
USD	4.491.540	5.455.757	6.080.103

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities

### AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2020	31. März 2020	31. März 2019
Klasse AE	12,4162 <sup>1</sup>	10,9422 <sup>1</sup>	12,11 <sup>1</sup>
Klasse AEH	11,9970 <sup>1</sup>	9,9686 <sup>1</sup>	11,61 <sup>1</sup>
Klasse AU	13,0596	10,7691	12,19
Klasse AUP	12,1817	10,1509	11,77
Klasse DE	12,3293 <sup>1</sup>	10,8764 <sup>1</sup>	12,06 <sup>1</sup>
Klasse DEH	11,9202 <sup>1</sup>	9,9148 <sup>1</sup>	11,57 <sup>1</sup>
Klasse DU	12,9739	10,7091	12,15
Klasse IE	12,5384 <sup>1</sup>	11,0332 <sup>1</sup>	12,17 <sup>1</sup>
Klasse IEC	11,3052 <sup>1</sup>	9,4747 <sup>1</sup>	11,26 <sup>1</sup>
Klasse IEH	12,1217 <sup>1</sup>	10,0566 <sup>1</sup>	11,67 <sup>1</sup>
Klasse IFH	12,0302 <sup>2</sup>	9,9810 <sup>2</sup>	11,61 <sup>2</sup>
Klasse IG	10,7248 <sup>3</sup>	9,2032 <sup>3</sup>	–
Klasse IU	13,2110	10,8750	12,27
Klasse NE <sup>#</sup>	10,0639 <sup>1</sup>	–	–
Klasse NG <sup>#</sup>	10,0114 <sup>3</sup>	–	–
Klasse NU <sup>#</sup>	9,9951	–	–
Klasse XG <sup>#</sup>	10,0457 <sup>3</sup>	–	–
Klasse ZEH	12,0941 <sup>1</sup>	10,0367 <sup>1</sup>	11,66 <sup>1</sup>
Klasse ZFH	11,9766 <sup>2</sup>	9,9435 <sup>2</sup>	11,58 <sup>2</sup>
Klasse ZU	13,1675	10,8446	12,25

<sup>1</sup>Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

<sup>2</sup>Die Klasse lautet auf CHF. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

<sup>3</sup>Die Klasse lautet auf GBP. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

<sup>#</sup>Siehe Erläuterung 1.

## Threadneedle (Lux) - Pan European Equities

### AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2020

	Erläuterungen	2020 EUR
<b>Aktiva</b>		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	203.089.004
Bankguthaben	2	930.782
Forderungen aus Zeichnungen		9.427
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		27.539
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	35.632
Sonstige Vermögenswerte		506.242
<b>Aktiva, insgesamt</b>		<b>204.598.626</b>
<b>Passiva</b>		
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(148.786)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(151.787)
Andere Verbindlichkeiten		(24.543)
<b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>		<b>(325.116)</b>
<b>Nettovermögen, insgesamt</b>		<b>204.273.510</b>

### ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AE	142.797,089
Klasse ASH	248.037,729
Klasse AUH	6.387,590
Klasse DE	142.985,398
Klasse IE	94.415,506
Klasse W	38.798,531
Klasse XE	676.661,548
Klasse ZUH	200,000
Klasse 1E	3.157.708,582
Klasse 1EP	100,000
Klasse 1G	212.429,406
Klasse 1GP	100,000
Klasse 2E	7.910.680,886
Klasse 2G	528.764,230
Klasse 2U	100,000
Klasse 3E	363.000,692
Klasse 3G	293.501,023
Klasse 3GP	100,000
Klasse 4E	836.534,914
Klasse 4G	100,000
Klasse 8E	352.078,376
Klasse 8G	34.059,216
Klasse 8U	100,000
Klasse 9E	100,000
Klasse 9G	100,000
Klasse 9GP	100,000

### ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2020 bis 30. September 2020

	Erläuterungen	2020 EUR
<b>Nettovermögen zu Beginn der Berichtsperiode</b>		<b>169.655.099</b>
<b>Erträge</b>		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	2.240.665
<b>Erträge, insgesamt</b>		<b>2.240.665</b>
<b>Aufwand</b>		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(893.500)
Zinsen aus Bankguthaben	2	(2.633)
Betriebskosten	5	(139.354)
<b>Aufwand, insgesamt</b>		<b>(1.035.487)</b>
<b>Nettoertrag aus Anlagen</b>		<b>1.205.178</b>
Realisierter Netto(verlust) aus dem Verkauf von Anlagen		(1.357.849)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(87.418)
Realisierter Nettogewinn aus Devisengeschäften		17.247
<b>Realisierter Netto(verlust)</b>		<b>(1.428.020)</b>
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		30.463.531
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(18.581)
<b>Nettoänderung bei nicht realisiertem Nettogewinn</b>		<b>30.444.950</b>
<b>Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit</b>		<b>30.222.108</b>
<b>Kapitalbewegungen</b>		
Zeichnungen von Anteilen		11.794.694
Anteilrücknahmen		(7.398.391)
<b>Kapitalbewegungen, insgesamt</b>		<b>4.396.303</b>
<b>Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode</b>		<b>204.273.510</b>

### GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2020	31. März 2020	31. März 2019
EUR	204.273.510	169.655.099	196.368.240

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Pan European Equities

### AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2020	31. März 2020	31. März 2019
Klasse AE	65,6317	55,8171	59,63
Klasse ASH	18,6693 <sup>1</sup>	15,8502 <sup>1</sup>	16,69 <sup>1</sup>
Klasse AUH	22,3356 <sup>2</sup>	18,8909 <sup>2</sup>	19,69 <sup>2</sup>
Klasse DE	23,7205	20,2086	21,67
Klasse IE	46,0732	39,0176	41,33
Klasse W	55,1604	46,8999	50,08
Klasse XE	53,2697	44,9324	47,21
Klasse ZUH	14,5116 <sup>2</sup>	12,2253 <sup>2</sup>	12,65 <sup>2</sup>
Klasse 1E	10,4465	8,8812	9,48
Klasse 1EP	10,4318	8,8718	9,47
Klasse 1G	10,5311 <sup>3</sup>	8,7345 <sup>3</sup>	9,08 <sup>3</sup>
Klasse 1GP	10,5195 <sup>3</sup>	8,7278 <sup>3</sup>	9,08 <sup>3</sup>
Klasse 2E	10,5908	8,9747	9,52
Klasse 2G	10,6757 <sup>3</sup>	8,8258 <sup>3</sup>	9,12 <sup>3</sup>
Klasse 2U	10,6375 <sup>2</sup>	8,4323 <sup>2</sup>	9,14 <sup>2</sup>
Klasse 3E	10,6205	8,9937	9,53
Klasse 3G	10,7061 <sup>3</sup>	8,8448 <sup>3</sup>	9,12 <sup>3</sup>
Klasse 3GP	10,6976 <sup>3</sup>	8,8385 <sup>3</sup>	9,12 <sup>3</sup>
Klasse 4E	10,8138	9,1182	9,57
Klasse 4G	10,9103 <sup>3</sup>	8,9746 <sup>3</sup>	9,17 <sup>3</sup>
Klasse 8E	10,5775	8,9653	9,51
Klasse 8G	10,6674 <sup>3</sup>	8,8207 <sup>3</sup>	9,11 <sup>3</sup>
Klasse 8U	10,6202 <sup>2</sup>	8,4188 <sup>2</sup>	9,14 <sup>2</sup>
Klasse 9E	10,6553	9,0171	9,53
Klasse 9G	10,7418 <sup>3</sup>	8,8664 <sup>3</sup>	9,13 <sup>3</sup>
Klasse 9GP	10,7418 <sup>3</sup>	8,8664 <sup>3</sup>	9,13 <sup>3</sup>

<sup>1</sup>Die Klasse lautet auf SGD. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

<sup>2</sup>Die Klasse lautet auf USD. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

<sup>3</sup>Die Klasse lautet auf GBP. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

## Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend

### AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2020

	Erläuterungen	2020 EUR
<b>Aktiva</b>		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	42.929.704
Bankguthaben	2	101.402
Forderungen aus Zeichnungen		7.856
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		85.885
Sonstige Vermögenswerte		248.732
<b>Aktiva, insgesamt</b>		<b>43.373.579</b>
<b>Passiva</b>		
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(28.229)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(34.277)
Andere Verbindlichkeiten		(5.243)
<b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>		<b>(67.749)</b>
<b>Nettovermögen, insgesamt</b>		<b>43.305.830</b>

### ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AE	445,301
Klasse AEP	4.252,757
Klasse AUP	100,000
Klasse DE	100,000
Klasse DEP	2.209,240
Klasse IE	100,000
Klasse IEP	6.797,165
Klasse ZE	35.037,221
Klasse ZEP	100,000
Klasse 1E	3.925.347,799
Klasse 1EP	11.876.608,355
Klasse 1G	176.980,015
Klasse 1GP	377.942,724
Klasse 2E	1.013.929,004
Klasse 2EP	100,000
Klasse 2G	100,000
Klasse 2GP	100,000
Klasse 3EP	70.800,006
Klasse 3G	134.936,386
Klasse 3GP	939.837,305
Klasse 4GP	8.493.338,510
Klasse 8E	289.950,001
Klasse 8EP	1.007.032,357
Klasse 8G	45.695,186
Klasse 8GP	445.638,476
Klasse 9EP	100,000
Klasse 9G	100,000
Klasse 9GP	100,000

### ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2020 bis 30. September 2020

	Erläuterungen	2020 EUR
<b>Nettovermögen zu Beginn der Berichtsperiode</b>		<b>40.776.458</b>
<b>Erträge</b>		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	1.019.970
<b>Erträge, insgesamt</b>		<b>1.019.970</b>
<b>Aufwand</b>		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(204.074)
Zinsen aus Bankguthaben	2	(1.654)
Betriebskosten	5	(31.444)
<b>Aufwand, insgesamt</b>		<b>(237.172)</b>
<b>Nettoertrag aus Anlagen</b>		<b>782.798</b>
Realisierter Netto(verlust) aus dem Verkauf von Anlagen		(2.286.821)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(8.331)
<b>Realisierter Netto(verlust)</b>		<b>(2.295.152)</b>
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		8.768.617
<b>Nettoänderung bei nicht realisiertem Nettogewinn</b>		<b>8.768.617</b>
<b>Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit</b>		<b>7.256.263</b>
<b>Kapitalbewegungen</b>		
Zeichnungen von Anteilen		706.051
Anteilrücknahmen		(4.830.673)
Dividenden	7	(602.269)
<b>Kapitalbewegungen, insgesamt</b>		<b>(4.726.891)</b>
<b>Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode</b>		<b>43.305.830</b>

### GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2020	31. März 2020	31. März 2019
EUR	43.305.830	40.776.458	59.715.336

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend

### AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2020	31. März 2020	31. März 2019
Klasse AE	9,9721	8,4207	10,19
Klasse AEP	9,2142	7,9601	10,09
Klasse AUP	9,8272 <sup>1</sup>	7,9466 <sup>1</sup>	10,31 <sup>1</sup>
Klasse DE	9,9013	8,3747	10,17
Klasse DEP	9,1467	7,9168	10,07
Klasse IE	10,1358	8,5228	10,23
Klasse IEP	9,3697	8,0572	10,13
Klasse ZE	10,1254	8,5167	10,23
Klasse ZEP	9,3497	8,0497	10,13
Klasse 1E	1,6256	1,3718	1,66
Klasse 1EP	0,9140	0,7893	1,00
Klasse 1G	1,4744 <sup>2</sup>	1,2138 <sup>2</sup>	1,43 <sup>2</sup>
Klasse 1GP	0,8298 <sup>2</sup>	0,6989 <sup>2</sup>	0,86 <sup>2</sup>
Klasse 2E	10,1164	8,5107	10,22
Klasse 2EP	9,3571	8,0536	10,13
Klasse 2G	10,4383 <sup>2</sup>	8,5638 <sup>2</sup>	10,01 <sup>2</sup>
Klasse 2GP	9,6432 <sup>2</sup>	8,0970 <sup>2</sup>	9,91 <sup>2</sup>
Klasse 3EP	1,4759	1,2698	1,60
Klasse 3G	1,4151 <sup>2</sup>	1,1606 <sup>2</sup>	1,36 <sup>2</sup>
Klasse 3GP	1,3310 <sup>2</sup>	1,1214 <sup>2</sup>	1,38 <sup>2</sup>
Klasse 4GP	1,1703 <sup>2</sup>	0,9796 <sup>2</sup>	1,19 <sup>2</sup>
Klasse 8E	1,7821	1,4996	1,80
Klasse 8EP	0,9882	0,8512	1,07
Klasse 8G	1,6178 <sup>2</sup>	1,3280 <sup>2</sup>	1,55 <sup>2</sup>
Klasse 8GP	0,8959 <sup>2</sup>	0,7528 <sup>2</sup>	0,92 <sup>2</sup>
Klasse 9EP	9,4009	8,0816	10,14
Klasse 9G	10,4651 <sup>2</sup>	8,5782 <sup>2</sup>	10,02 <sup>2</sup>
Klasse 9GP	9,6745 <sup>2</sup>	8,1121 <sup>2</sup>	9,93 <sup>2</sup>

<sup>1</sup>Die Klasse lautet auf USD. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

<sup>2</sup>Die Klasse lautet auf GBP. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

## Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities

### AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2020

	Erläuterungen	2020 EUR
<b>Aktiva</b>		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	733.274.701
Bankguthaben	2	2.680.622
Forderungen aus Zeichnungen		1.384.218
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		111.465
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	129.434
Sonstige Vermögenswerte		328.235
<b>Aktiva, insgesamt</b>		<b>737.908.675</b>
<b>Passiva</b>		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(855.275)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(825.742)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(696.760)
Andere Verbindlichkeiten		(191.954)
<b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>		<b>(2.569.731)</b>
<b>Nettovermögen, insgesamt</b>		<b>735.338.944</b>

### ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AE	5.964.885,313
Klasse ASH	551.775,477
Klasse AUH	23.580,106
Klasse DE	1.201.115,614
Klasse DUH	100,000
Klasse IE	3.223.551,270
Klasse W	9.097,330
Klasse ZE	18.467.578,830
Klasse ZFH	39.019,140

### AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2020	31. März 2020	31. März 2019
Klasse AE	45,9577	34,7061	37,96
Klasse ASH	31,1978 <sup>1</sup>	23,5023 <sup>1</sup>	25,32 <sup>1</sup>
Klasse AUH	12,0009 <sup>2</sup>	9,0044 <sup>2</sup>	9,61 <sup>2</sup>
Klasse DE	41,6247	31,5752	34,85
Klasse DUH	11,7609 <sup>2</sup>	8,8604 <sup>2</sup>	9,54 <sup>2</sup>
Klasse IE	57,5284	43,2819	46,99
Klasse W	76,8954	58,0840	63,57
Klasse ZE	11,5697	8,7046	9,45
Klasse ZFH	11,1683 <sup>3</sup>	8,4083 <sup>3</sup>	9,16 <sup>3</sup>

<sup>1</sup>Die Klasse lautet auf SGD. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.<sup>2</sup>Die Klasse lautet auf USD. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.<sup>3</sup>Die Klasse lautet auf CHF. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

### ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2020 bis 30. September 2020

	Erläuterungen	2020 EUR
<b>Nettovermögen zu Beginn der Berichtsperiode</b>		<b>435.284.977</b>
<b>Erträge</b>		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	3.335.565
Zinsen aus Bankguthaben	2	3
<b>Erträge, insgesamt</b>		<b>3.335.568</b>
<b>Aufwand</b>		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(3.662.666)
Zinsen aus Bankguthaben	2	(16.021)
Betriebskosten	5	(980.468)
<b>Aufwand, insgesamt</b>		<b>(4.659.155)</b>
<b>Netto(verlust) aus Anlagen</b>		<b>(1.323.587)</b>
Realisierter Netto(verlust) aus dem Verkauf von Anlagen		(4.776.916)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(275.996)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(167.626)
<b>Realisierter Netto(verlust)</b>		<b>(5.220.538)</b>
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		159.131.296
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Devisenterminkontrakten		23.795
<b>Nettoänderung bei nicht realisiertem Nettogewinn</b>		<b>159.155.091</b>
<b>Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit</b>		<b>152.610.966</b>
<b>Kapitalbewegungen</b>		
Zeichnungen von Anteilen		230.470.707
Anteilrücknahmen		(83.027.706)
<b>Kapitalbewegungen, insgesamt</b>		<b>147.443.001</b>
<b>Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode</b>		<b>735.338.944</b>

### GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2020	31. März 2020	31. März 2019
EUR	735.338.944	435.284.977	561.444.617

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies

### AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2020

	Erläuterungen	2020 EUR
<b>Aktiva</b>		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	1.286.821.371
Bankguthaben	2	36.228.881
Forderungen aus Zeichnungen		4.086.370
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		209.107
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	299.957
Sonstige Vermögenswerte		2.392.493
<b>Aktiva, insgesamt</b>		<b>1.330.038.179</b>
<b>Passiva</b>		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(2.059.006)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(36.113.697)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(935.443)
Andere Verbindlichkeiten		(146.682)
<b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>		<b>(39.254.828)</b>
<b>Nettovermögen, insgesamt</b>		<b>1.290.783.351</b>

### ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse IE	61.698,182
Klasse ZE	1.298.932,441
Klasse 1E	28.497.513,736
Klasse 1EP	395.687,056
Klasse 1FH	153.333,210
Klasse 1G	807.203,593
Klasse 1UH	1.787.384,267
Klasse 2E	14.639.972,783
Klasse 2G	100,000
Klasse 3E	24.287.880,472
Klasse 3EP	958.675,615
Klasse 3FH	132.369,253
Klasse 3G	1.916.195,582
Klasse 3GP	15.525,141
Klasse 3UH	464.847,107
Klasse 4E	8.468.397,132
Klasse 4G	1.858.494,377
Klasse 8E	7.620.850,479
Klasse 8G	508.350,139
Klasse 9E	22.570.837,597
Klasse 9EP	100,000
Klasse 9FH	10.619,296
Klasse 9G	933.765,866
Klasse 9GP	100,000
Klasse 9UH	401.544,875

### ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2020 bis 30. September 2020

	Erläuterungen	2020 EUR
<b>Nettovermögen zu Beginn der Berichtsperiode</b>		<b>922.670.066</b>
<b>Erträge</b>		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	6.483.951
Zinsen aus Bankguthaben	2	30
<b>Erträge, insgesamt</b>		<b>6.483.981</b>
<b>Aufwand</b>		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(5.137.404)
Zinsen aus Bankguthaben	2	(11.419)
Betriebskosten	5	(801.555)
<b>Aufwand, insgesamt</b>		<b>(5.950.378)</b>
<b>Nettoertrag aus Anlagen</b>		<b>533.603</b>
Realisierter Netto(verlust) aus dem Verkauf von Anlagen		(5.161.174)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(1.477.318)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(133.860)
<b>Realisierter Netto(verlust)</b>		<b>(6.772.352)</b>
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		274.616.458
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(83.423)
<b>Nettoänderung bei nicht realisiertem Nettogewinn</b>		<b>274.533.035</b>
<b>Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit</b>		<b>268.294.286</b>
<b>Kapitalbewegungen</b>		
Zeichnungen von Anteilen		274.749.396
Anteilrücknahmen		(174.930.397)
<b>Kapitalbewegungen, insgesamt</b>		<b>99.818.999</b>
<b>Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode</b>		<b>1.290.783.351</b>

### GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2020	31. März 2020	31. März 2019
EUR	1.290.783.351	922.670.066	1.381.828.793

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.



## Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies

### AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2020	31. März 2020	31. März 2019
Klasse IE	11,2000	8,6065	–
Klasse ZE	10,8964	8,3794	9,32
Klasse 1E	10,7594	8,2996	9,29
Klasse 1EP	10,4632	8,0712	9,26
Klasse 1FH	10,6991 <sup>1</sup>	8,2583 <sup>1</sup>	9,27 <sup>1</sup>
Klasse 1G	10,8439 <sup>2</sup>	8,1606 <sup>2</sup>	8,90 <sup>2</sup>
Klasse 1UH	11,2808 <sup>3</sup>	8,6456 <sup>3</sup>	9,44 <sup>3</sup>
Klasse 2E	10,9041	8,3840	9,33
Klasse 2G	10,9987 <sup>2</sup>	8,2490 <sup>2</sup>	8,93 <sup>2</sup>
Klasse 3E	10,9421	8,4066	9,34
Klasse 3EP	10,6421	8,1761	9,30
Klasse 3FH	10,8829 <sup>1</sup>	8,3663 <sup>1</sup>	9,31 <sup>1</sup>
Klasse 3G	11,0269 <sup>2</sup>	8,2649 <sup>2</sup>	8,94 <sup>2</sup>
Klasse 3GP	10,7243 <sup>2</sup>	8,0380 <sup>2</sup>	8,91 <sup>2</sup>
Klasse 3UH	11,4706 <sup>3</sup>	8,7556 <sup>3</sup>	9,48 <sup>3</sup>
Klasse 4E	11,1356	8,5195	9,38
Klasse 4G	12,5599 <sup>2</sup>	9,3745 <sup>2</sup>	10,05 <sup>2</sup>
Klasse 8E	10,8971	8,3804	9,32
Klasse 8G	10,9827 <sup>2</sup>	8,2400 <sup>2</sup>	8,93 <sup>2</sup>
Klasse 9E	10,9526	8,4130	9,34
Klasse 9EP	10,6530	8,1797	9,29
Klasse 9FH	10,8928 <sup>1</sup>	8,3720 <sup>1</sup>	9,32 <sup>1</sup>
Klasse 9G	11,0400 <sup>2</sup>	8,2730 <sup>2</sup>	8,94 <sup>2</sup>
Klasse 9GP	10,7444 <sup>2</sup>	8,0468 <sup>2</sup>	8,90 <sup>2</sup>
Klasse 9UH	11,4861 <sup>3</sup>	8,7665 <sup>3</sup>	9,49 <sup>3</sup>

<sup>1</sup>Die Klasse lautet auf CHF. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

<sup>2</sup>Die Klasse lautet auf GBP. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

<sup>3</sup>Die Klasse lautet auf USD. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

## Threadneedle (Lux) - European Select

### AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2020

	Erläuterungen	2020 EUR
<b>Aktiva</b>		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	1.532.799.026
Bankguthaben	2	849.215
Forderungen aus Zeichnungen		2.769.019
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	364.306
Sonstige Vermögenswerte		3.147.367
<b>Aktiva, insgesamt</b>		<b>1.539.928.933</b>
<b>Passiva</b>		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(2.521.317)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(680.077)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(1.593.691)
Andere Verbindlichkeiten		(169.619)
<b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>		<b>(4.964.704)</b>
<b>Nettovermögen, insgesamt</b>		<b>1.534.964.229</b>

### ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AE	157.648,376
Klasse AGH	262,732
Klasse AUH	13.682,207
Klasse DUH	100,000
Klasse IE	1.511.962,216
Klasse ZG	14.554,355
Klasse ZGH	313.472,681
Klasse 1E	78.293.835,588
Klasse 1EP	680.060,403
Klasse 1SH	1.564.043,539
Klasse 1U	41.668,132
Klasse 1UH	224.916,320
Klasse 2E	11.702.671,225
Klasse 2EP	100,000
Klasse 3E	4.896.408,146
Klasse 3U	570.337,933
Klasse 8E	3.897.692,368
Klasse 8EP	237.247,014
Klasse 9E	14.401.998,928
Klasse 9U	100,000

### ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2020 bis 30. September 2020

	Erläuterungen	2020 EUR
<b>Nettovermögen zu Beginn der Berichtsperiode</b>		<b>1.246.832.227</b>
<b>Erträge</b>		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	11.083.517
Zinsen aus Bankguthaben	2	1.566
<b>Erträge, insgesamt</b>		<b>11.085.083</b>
<b>Aufwand</b>		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(9.138.244)
Zinsen aus Bankguthaben	2	(12.571)
Betriebskosten	5	(955.639)
<b>Aufwand, insgesamt</b>		<b>(10.106.454)</b>
<b>Nettoertrag aus Anlagen</b>		<b>978.629</b>
Realisierter Nettogewinn aus dem Verkauf von Anlagen		1.814.192
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(477.681)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(65.312)
<b>Realisierter Nettogewinn</b>		<b>1.271.199</b>
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		266.900.059
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(113.830)
<b>Nettoänderung bei nicht realisiertem Nettogewinn</b>		<b>266.786.229</b>
<b>Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit</b>		<b>269.036.057</b>
<b>Kapitalbewegungen</b>		
Zeichnungen von Anteilen		104.488.838
Anteilrücknahmen		(85.392.893)
<b>Kapitalbewegungen, insgesamt</b>		<b>19.095.945</b>
<b>Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode</b>		<b>1.534.964.229</b>

### GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2020	31. März 2020	31. März 2019
EUR	1.534.964.229	1.246.832.227	1.440.832.024

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - European Select

### AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2020	31. März 2020	31. März 2019
Klasse AE	26,4168	21,7556	22,18
Klasse AGH	28,1018 <sup>1</sup>	23,1092 <sup>1</sup>	23,48 <sup>1</sup>
Klasse AUH	29,4999 <sup>2</sup>	24,1474 <sup>2</sup>	24,02 <sup>2</sup>
Klasse DUH	12,4171 <sup>2</sup>	10,1924 <sup>2</sup>	10,20 <sup>2</sup>
Klasse IE	37,9041	31,0840	31,41
Klasse ZG	13,5870 <sup>1</sup>	10,8756 <sup>1</sup>	10,71 <sup>1</sup>
Klasse ZGH	28,6947 <sup>1</sup>	23,5152 <sup>1</sup>	23,71 <sup>1</sup>
Klasse 1E	12,5786	10,3514	10,53
Klasse 1EP	12,2508	10,0817	10,50
Klasse 1SH	12,9217 <sup>3</sup>	10,6075 <sup>3</sup>	10,63 <sup>3</sup>
Klasse 1U	12,7377 <sup>2</sup>	9,8084 <sup>2</sup>	10,21 <sup>2</sup>
Klasse 1UH	13,1552 <sup>2</sup>	10,7592 <sup>2</sup>	10,68 <sup>2</sup>
Klasse 2E	12,7238	10,4401	10,56
Klasse 2EP	12,3992	10,1699	10,52
Klasse 3E	12,7690	10,4678	10,57
Klasse 3U	12,9287 <sup>2</sup>	9,9173 <sup>2</sup>	10,25 <sup>2</sup>
Klasse 8E	12,7144	10,4345	10,56
Klasse 8EP	12,3960	10,1732	10,54
Klasse 9E	12,7782	10,4732	10,57
Klasse 9U	12,9505 <sup>2</sup>	9,9286 <sup>2</sup>	10,25 <sup>2</sup>

<sup>1</sup>Die Klasse lautet auf GBP. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

<sup>2</sup>Die Klasse lautet auf USD. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

<sup>3</sup>Die Klasse lautet auf SGD. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

## Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies

### AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2020

	Erläuterungen	2020 EUR
<b>Aktiva</b>		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	1.773.530.500
Bankguthaben	2	690.430
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		1.214.949
Forderungen aus Zeichnungen		1.143.286
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		165.915
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	2.595
Sonstige Vermögenswerte		2.967.720
<b>Aktiva, insgesamt</b>		<b>1.779.715.395</b>
<b>Passiva</b>		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(2.532.214)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(4.228.455)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(1.866.335)
Andere Verbindlichkeiten		(276.065)
<b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>		<b>(8.903.069)</b>
<b>Nettovermögen, insgesamt</b>		<b>1.770.812.326</b>

### ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse IE	46.630,851
Klasse ZE	547.786,766
Klasse 1E	96.879.559,983
Klasse 1EP	1.541.953,336
Klasse 1FH	47.999,998
Klasse 2E	9.901.052,028
Klasse 3E	9.625.295,481
Klasse 3EP	2.306.702,001
Klasse 3FH	529.594,474
Klasse 8E	9.134.775,632
Klasse 9E	10.097.756,414
Klasse 9EP	279.354,000
Klasse 9FH	145,000

### AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2020	31. März 2020	31. März 2019
Klasse IE	11,3734	8,4587	–
Klasse ZE	12,6762	9,4347	10,64
Klasse 1E	12,5261	9,3519	10,61
Klasse 1EP	12,2204	9,1237	10,60
Klasse 1FH	12,4687 <sup>1</sup>	9,3161 <sup>1</sup>	10,60 <sup>1</sup>
Klasse 2E	12,6868	9,4412	10,64
Klasse 3E	12,6908	9,4377	10,62
Klasse 3EP	12,4015	9,2225	10,62
Klasse 3FH	12,6642 <sup>1</sup>	9,4251 <sup>1</sup>	10,64 <sup>1</sup>
Klasse 8E	12,6793	9,4375	10,64
Klasse 9E	12,7284	9,4637	10,65
Klasse 9EP	12,4132	9,2293	10,63
Klasse 9FH	12,6628 <sup>1</sup>	9,4226 <sup>1</sup>	10,64 <sup>1</sup>

<sup>1</sup>Die Klasse lautet auf CHF. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

### ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2020 bis 30. September 2020

	Erläuterungen	2020 EUR
<b>Nettovermögen zu Beginn der Berichtsperiode</b>		<b>1.390.747.109</b>
<b>Erträge</b>		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	12.053.464
<b>Erträge, insgesamt</b>		<b>12.053.464</b>
<b>Aufwand</b>		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(10.674.177)
Zinsen aus Bankguthaben	2	(14.371)
Betriebskosten	5	(1.581.453)
<b>Aufwand, insgesamt</b>		<b>(12.270.001)</b>
<b>Netto(verlust) aus Anlagen</b>		<b>(216.537)</b>
Realisierter Netto(verlust) aus dem Verkauf von Anlagen		(4.478.238)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(126.737)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(10.892)
<b>Realisierter Netto(verlust)</b>		<b>(4.615.867)</b>
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		467.563.690
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Devisenterminkontrakten		27.443
<b>Nettoänderung bei nicht realisiertem Nettogewinn</b>		<b>467.591.133</b>
<b>Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit</b>		<b>462.758.729</b>
<b>Kapitalbewegungen</b>		
Zeichnungen von Anteilen		104.738.602
Anteilrücknahmen		(187.432.114)
<b>Kapitalbewegungen, insgesamt</b>		<b>(82.693.512)</b>
<b>Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode</b>		<b>1.770.812.326</b>

### GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2020	31. März 2020	31. März 2019
EUR	1.770.812.326	1.390.747.109	1.875.264.870

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income

### AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2020

	Erläuterungen	2020 USD
<b>Aktiva</b>		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	47.136.708
Bankguthaben	2	909.213
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		891.042
Forderungen aus Zeichnungen		175.820
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		248.157
Sonstige Vermögenswerte	20	526.297
<b>Aktiva, insgesamt</b>		<b>49.887.237</b>
<b>Passiva</b>		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(1.210.403)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(116)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(11.161)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(14.731)
Andere Verbindlichkeiten		(8.376)
<b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>		<b>(1.244.787)</b>
<b>Nettovermögen, insgesamt</b>		<b>48.642.450</b>

### ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AEH	7.877,465
Klasse AU	75.507,054
Klasse AUP	6.419,125
Klasse DEH	14.048,278
Klasse DU	21.234,167
Klasse DUP	357,406
Klasse IEP	100,000
Klasse IU	100,000
Klasse W	27.803,117
Klasse XU	1.754.392,866
Klasse XUP	1.398.054,818
Klasse ZG	100,000
Klasse ZGH	6.891,198
Klasse ZGP	100,000
Klasse ZUP	3.452,018

### AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2020	31. März 2020	31. März 2019
Klasse AEH	38,0114 <sup>1</sup>	28,5781 <sup>1</sup>	35,16 <sup>1</sup>
Klasse AU	94,2384	70,3078	84,02
Klasse AUP	11,6428	8,9182	11,18
Klasse DEH	27,1340 <sup>1</sup>	20,4762 <sup>1</sup>	25,38 <sup>1</sup>
Klasse DU	46,0494	34,4843	41,52
Klasse DUP	11,4665	8,7791	11,09
Klasse IEP	11,3261 <sup>1</sup>	9,1986 <sup>1</sup>	11,17 <sup>1</sup>
Klasse IU	10,7584	7,9943	–
Klasse W	69,8573	52,1698	62,47
Klasse XU	11,8769	8,7885	–
Klasse XUP	11,9106	8,9896	11,08
Klasse ZG	11,5258 <sup>2</sup>	8,9304 <sup>2</sup>	10,08 <sup>2</sup>
Klasse ZGH	21,2969 <sup>2</sup>	15,9734 <sup>2</sup>	19,44 <sup>2</sup>
Klasse ZGP	10,6289 <sup>2</sup>	8,4224 <sup>2</sup>	9,97 <sup>2</sup>
Klasse ZUP	13,3973	10,1806	12,66

<sup>1</sup>Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.<sup>2</sup>Die Klasse lautet auf GBP. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

### ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2020 bis 30. September 2020

	Erläuterungen	2020 USD
<b>Nettovermögen zu Beginn der Berichtsperiode</b>		<b>41.795.505</b>
<b>Erträge</b>		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	1.005.372
Zinsen aus Bankguthaben	2	18.709
<b>Erträge, insgesamt</b>		<b>1.024.081</b>
<b>Aufwand</b>		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(82.838)
Zinsen aus Bankguthaben	2	(18.772)
Betriebskosten	5	(43.672)
<b>Aufwand, insgesamt</b>		<b>(145.282)</b>
<b>Nettoertrag aus Anlagen</b>		<b>878.799</b>
Realisierter Nettogewinn aus dem Verkauf von Anlagen		1.694.054
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		58.289
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(9.374)
<b>Realisierter Nettogewinn</b>		<b>1.742.969</b>
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		10.808.629
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Devisenterminkontrakten		112
<b>Nettoänderung bei nicht realisiertem Nettogewinn</b>		<b>10.808.741</b>
<b>Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit</b>		<b>13.430.509</b>
<b>Kapitalbewegungen</b>		
Zeichnungen von Anteilen		9.876.546
Anteilrücknahmen		(16.135.643)
Dividenden	7	(324.467)
<b>Kapitalbewegungen, insgesamt</b>		<b>(6.583.564)</b>
<b>Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode</b>		<b>48.642.450</b>

### GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2020	31. März 2020	31. März 2019
USD	48.642.450	41.795.505	60.801.683

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Global Technology

### AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2020

	Erläuterungen	2020 USD
<b>Aktiva</b>		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	360.650.039
Bankguthaben	2	1.010.001
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		556.621
Forderungen aus Zeichnungen		419.649
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		121.439
<b>Aktiva, insgesamt</b>		<b>362.757.749</b>
<b>Passiva</b>		
Überziehungskredite		(670.609)
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(1.547.392)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(299.032)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(663.257)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(433.528)
Andere Verbindlichkeiten		(87.104)
<b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>		<b>(3.700.922)</b>
<b>Nettovermögen, insgesamt</b>		<b>359.056.827</b>

### ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AEH	543.360,036
Klasse AS	196.708,882
Klasse AU	2.896.182,709
Klasse AUP	14.164,773
Klasse BU	60.218,276
Klasse DEH	34.634,090
Klasse DU	448.028,211
Klasse IE	479.328,663
Klasse IEH	652.773,312
Klasse IG	100,000
Klasse IU	71.699,000
Klasse ZEH	123.051,910
Klasse ZFH	114.750,000
Klasse ZG	100,000
Klasse ZU	2.671.146,112

### AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2020	31. März 2020	31. März 2019
Klasse AEH	47,7619 <sup>1</sup>	34,4250 <sup>1</sup>	35,64 <sup>1</sup>
Klasse AS	16,4605 <sup>2</sup>	12,2847 <sup>2</sup>	11,77 <sup>2</sup>
Klasse AU	62,5454	44,7525	45,07
Klasse AUP	13,5695	9,7092	10,10
Klasse BU	79,4268	56,9448	57,58
Klasse DEH	13,7743 <sup>1</sup>	9,9444 <sup>1</sup>	10,33 <sup>1</sup>
Klasse DU	92,2026	66,0879	66,79
Klasse IE	10,3462 <sup>1</sup>	7,8762 <sup>1</sup>	–
Klasse IEH	16,0270 <sup>1</sup>	11,5005 <sup>1</sup>	11,80 <sup>1</sup>
Klasse IG	14,8472 <sup>3</sup>	11,0263 <sup>3</sup>	10,47 <sup>3</sup>
Klasse IU	10,9292	7,7851	–
Klasse ZEH	13,3080 <sup>1</sup>	9,5567 <sup>1</sup>	9,81 <sup>1</sup>
Klasse ZFH	15,5842 <sup>4</sup>	11,1832 <sup>4</sup>	11,50 <sup>4</sup>
Klasse ZG	14,8263 <sup>3</sup>	11,0168 <sup>3</sup>	10,47 <sup>3</sup>
Klasse ZU	28,2754	20,1512	20,13

<sup>1</sup>Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.<sup>2</sup>Die Klasse lautet auf SGD. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.<sup>3</sup>Die Klasse lautet auf GBP. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.<sup>4</sup>Die Klasse lautet auf CHF. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

### ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2020 bis 30. September 2020

	Erläuterungen	2020 USD
<b>Nettovermögen zu Beginn der Berichtsperiode</b>		<b>275.490.723</b>
<b>Erträge</b>		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	1.247.918
Zinsen aus Bankguthaben	2	2.659
<b>Erträge, insgesamt</b>		<b>1.250.577</b>
<b>Aufwand</b>		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(2.530.639)
Zinsen aus Bankguthaben	2	(825)
Betriebskosten	5	(512.970)
<b>Aufwand, insgesamt</b>		<b>(3.044.434)</b>
<b>Netto(verlust) aus Anlagen</b>		<b>(1.793.857)</b>
Realisierter Nettogewinn aus dem Verkauf von Anlagen		28.180.409
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		3.022.237
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(79.853)
<b>Realisierter Nettogewinn</b>		<b>31.122.793</b>
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		85.040.797
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(112.646)
<b>Nettoänderung bei nicht realisiertem Nettogewinn</b>		<b>84.928.151</b>
<b>Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit</b>		<b>114.257.087</b>
<b>Kapitalbewegungen</b>		
Zeichnungen von Anteilen		53.493.935
Anteilrücknahmen		(84.184.918)
<b>Kapitalbewegungen, insgesamt</b>		<b>(30.690.983)</b>
<b>Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode</b>		<b>359.056.827</b>

### GESAMTNETTOINVENTARWERT

USD	30. September 2020	31. März 2020	31. März 2019
	359.056.827	275.490.723	240.513.696

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - UK Equities

### AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2020

	Erläuterungen	2020 GBP
<b>Aktiva</b>		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	193.563.332
Bankguthaben	2	1.175.162
Forderungen aus Zeichnungen		193.478
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		295.022
Sonstige Vermögenswerte		107
<b>Aktiva, insgesamt</b>		<b>195.227.101</b>
<b>Passiva</b>		
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(407.866)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(124.174)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(128.694)
Andere Verbindlichkeiten		(27.945)
<b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>		<b>(688.679)</b>
<b>Nettovermögen, insgesamt</b>		<b>194.538.422</b>

### ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AE	110.981,589
Klasse AEH	98.418,517
Klasse AFH	12.900,000
Klasse AG	374.686,484
Klasse AGP	366.248,618
Klasse DEH	42.065,584
Klasse DG	9.480,629
Klasse IE	100,000
Klasse IEH	64.986,320
Klasse IG	1.256.653,244
Klasse IGP	987.658,067
Klasse ZE	3.025,058
Klasse ZEH	47.376,069
Klasse ZFH	5.850,000
Klasse ZG	520.802,312
Klasse ZGP	1.279.275,264
Klasse 3EH	1.759.855,592
Klasse 3UH	943.697,546
Klasse 9EH	11.567,000
Klasse 9EP	1.986.463,979
Klasse 9FH	6.100,000
Klasse 9G	8.048.783,700
Klasse 9UH	794,000

### ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2020 bis 30. September 2020

	Erläuterungen	2020 GBP
<b>Nettovermögen zu Beginn der Berichtsperiode</b>		<b>206.285.143</b>
<b>Erträge</b>		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	2.629.688
Zinsen aus Bankguthaben	2	12.112
<b>Erträge, insgesamt</b>		<b>2.641.800</b>
<b>Aufwand</b>		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(820.389)
Zinsen aus Bankguthaben	2	(12.857)
Betriebskosten	5	(183.297)
<b>Aufwand, insgesamt</b>		<b>(1.016.543)</b>
<b>Nettoertrag aus Anlagen</b>		<b>1.625.257</b>
Realisierter Netto(verlust) aus dem Verkauf von Anlagen		(12.719.313)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(58.400)
Realisierter Nettogewinn aus Devisengeschäften		57.343
<b>Realisierter Netto(verlust)</b>		<b>(12.720.370)</b>
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		28.740.296
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Devisenterminkontrakten		404.883
<b>Nettoänderung bei nicht realisiertem Nettogewinn</b>		<b>29.145.179</b>
<b>Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit</b>		<b>18.050.066</b>
<b>Kapitalbewegungen</b>		
Zeichnungen von Anteilen		30.981.982
Anteilrücknahmen		(59.847.524)
Dividenden	7	(931.245)
<b>Kapitalbewegungen, insgesamt</b>		<b>(29.796.787)</b>
<b>Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode</b>		<b>194.538.422</b>

### GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2020	31. März 2020	31. März 2019
GBP	194.538.422	206.285.143	213.779.407

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - UK Equities

### AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2020	31. März 2020	31. März 2019
Klasse AE	7,1959 <sup>1</sup>	6,8397 <sup>1</sup>	–
Klasse AEH	16,6914 <sup>1</sup>	15,5141 <sup>1</sup>	19,80 <sup>1</sup>
Klasse AFH	8,1387 <sup>2</sup>	7,5610 <sup>2</sup>	9,68 <sup>2</sup>
Klasse AG	23,0910	21,4122	27,27
Klasse AGP	17,5384	16,5430	21,99
Klasse DEH	7,9629 <sup>1</sup>	7,4306 <sup>1</sup>	9,56 <sup>1</sup>
Klasse DG	8,1618	7,5987	9,75
Klasse IE	7,5857 <sup>1</sup>	7,1738 <sup>1</sup>	–
Klasse IEH	24,9259 <sup>1</sup>	23,0551 <sup>1</sup>	29,15 <sup>1</sup>
Klasse IG	33,2814	30,7157	38,74
Klasse IGP	25,5426	23,9808	31,51
Klasse ZE	7,2295 <sup>1</sup>	6,8468 <sup>1</sup>	–
Klasse ZEH	10,2347 <sup>1</sup>	9,4773 <sup>1</sup>	12,01 <sup>1</sup>
Klasse ZFH	9,9175 <sup>2</sup>	9,1823 <sup>2</sup>	11,66 <sup>2</sup>
Klasse ZG	22,1300	20,4444	25,84
Klasse ZGP	9,2075	8,6352	11,37
Klasse ZUH <sup>f</sup>	–	10,3032 <sup>3</sup>	12,63 <sup>3</sup>
Klasse 3EH	1,4556 <sup>1</sup>	1,3466 <sup>1</sup>	1,70 <sup>1</sup>
Klasse 3EP	–	–	1,63 <sup>1</sup>
Klasse 3FH	–	–	1,79 <sup>2</sup>
Klasse 3UH	1,7729 <sup>3</sup>	1,6280 <sup>3</sup>	2,01 <sup>3</sup>
Klasse 9EH	8,7163 <sup>1</sup>	8,0642 <sup>1</sup>	10,20 <sup>1</sup>
Klasse 9EP	7,8993 <sup>1</sup>	7,5850 <sup>1</sup>	10,25 <sup>1</sup>
Klasse 9FH	8,6987 <sup>2</sup>	8,0444 <sup>2</sup>	10,19 <sup>2</sup>
Klasse 9G	8,2563	7,6191	–
Klasse 9UH	9,1159 <sup>3</sup>	8,3708 <sup>3</sup>	10,32 <sup>3</sup>

<sup>1</sup>Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist GBP.

<sup>2</sup>Die Klasse lautet auf CHF. Die Basiswährung des Portfolios ist GBP.

<sup>3</sup>Die Klasse lautet auf USD. Die Basiswährung des Portfolios ist GBP.

<sup>f</sup>Siehe Erläuterung 1.



## Threadneedle (Lux) - UK Equity Income

### AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2020

	Erläuterungen	2020 GBP
<b>Aktiva</b>		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	146.243.925
Bankguthaben	2	761.944
Forderungen aus Zeichnungen		35.338
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		190.277
<b>Aktiva, insgesamt</b>		<b>147.231.484</b>
<b>Passiva</b>		
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(217.187)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(96.945)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(90.719)
Andere Verbindlichkeiten		(25.701)
<b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>		<b>(430.552)</b>
<b>Nettovermögen, insgesamt</b>		<b>146.800.932</b>

### ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AE	2.408.182,033
Klasse AEC	4.457,613
Klasse AEH	9.255,210
Klasse AG	498.896,399
Klasse ASC	2.968,568
Klasse AUC	128,700
Klasse DE	10.672,019
Klasse DEC	114,600
Klasse DEH	3.458,502
Klasse DG	10.871,714
Klasse DGP	100,000
Klasse IE	1.454.633,437
Klasse IEH	200.440,516
Klasse IG	1.283.686,783
Klasse IGP	1.127.647,691
Klasse IU	279.892,900
Klasse IUH	100,000
Klasse LG	514.289,931
Klasse LGP	7.318.603,639
Klasse ZE	114,601
Klasse ZEH	114,600
Klasse ZFH	22.460,172
Klasse ZG	84.721,758
Klasse ZGP	4.812,000
Klasse ZUH	4.132,141
Klasse 1EH	50.764,466
Klasse 1FH	29.076,102
Klasse 1UH	48.280,604
Klasse 3EH	199.836,332
Klasse 3FH	25.820,350
Klasse 3UH	209.850,228
Klasse 9EH	17.600,000
Klasse 9FH	100,000
Klasse 9G	965.692,859
Klasse 9UH	100,000

### ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2020 bis 30. September 2020

	Erläuterungen	2020 GBP
<b>Nettovermögen zu Beginn der Berichtsperiode</b>		<b>149.344.890</b>
<b>Erträge</b>		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	2.270.220
Zinsen aus Bankguthaben	2	206
<b>Erträge, insgesamt</b>		<b>2.270.426</b>
<b>Aufwand</b>		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(577.139)
Zinsen aus Bankguthaben	2	(187)
Betriebskosten	5	(160.819)
<b>Aufwand, insgesamt</b>		<b>(738.145)</b>
<b>Nettoertrag aus Anlagen</b>		<b>1.532.281</b>
Realisierter Netto(verlust) aus dem Verkauf von Anlagen		(37.656)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(3.437)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(21.058)
<b>Realisierter Netto(verlust)</b>		<b>(62.151)</b>
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		10.438.458
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Devisenterminkontrakten		27.383
<b>Nettoänderung bei nicht realisiertem Nettogewinn</b>		<b>10.465.841</b>
<b>Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit</b>		<b>11.935.971</b>
<b>Kapitalbewegungen</b>		
Zeichnungen von Anteilen		16.414.238
Anteilrücknahmen		(29.755.787)
Dividenden	7	(1.138.380)
<b>Kapitalbewegungen, insgesamt</b>		<b>(14.479.929)</b>
<b>Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode</b>		<b>146.800.932</b>

### GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2020	31. März 2020	31. März 2019
GBP	146.800.932	149.344.890	139.659.238

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - UK Equity Income

### AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2020	31. März 2020	31. März 2019
Klasse AE	9,2305 <sup>1</sup>	8,7982 <sup>1</sup>	10,70 <sup>1</sup>
Klasse AEC	7,9880 <sup>1</sup>	7,5630 <sup>1</sup>	9,40 <sup>1</sup>
Klasse AEH	9,1562 <sup>1</sup>	8,5501 <sup>1</sup>	10,18 <sup>1</sup>
Klasse AG	9,5201	8,8527	10,49
Klasse ASC	8,2384 <sup>2</sup>	7,8020 <sup>2</sup>	9,54 <sup>2</sup>
Klasse AUC	8,6194 <sup>3</sup>	8,1166 <sup>3</sup>	9,83 <sup>3</sup>
Klasse DE	8,9597 <sup>1</sup>	8,5721 <sup>1</sup>	10,51 <sup>1</sup>
Klasse DEC	7,7231 <sup>1</sup>	7,3487 <sup>1</sup>	9,22 <sup>1</sup>
Klasse DEH	8,8849 <sup>1</sup>	8,3235 <sup>1</sup>	9,98 <sup>1</sup>
Klasse DG	9,2436	8,6278	10,30
Klasse DGP	8,3600	7,9234	9,88
Klasse IE	9,5826 <sup>1</sup>	9,0906 <sup>1</sup>	10,95 <sup>1</sup>
Klasse IEH	9,5069 <sup>1</sup>	8,8310 <sup>1</sup>	10,42 <sup>1</sup>
Klasse IG	9,9035	9,1656	10,76
Klasse IGP	8,6195	8,0999	9,92
Klasse IU	10,0316 <sup>3</sup>	8,9046 <sup>3</sup>	10,98 <sup>3</sup>
Klasse IUH	9,9370 <sup>3</sup>	9,1572 <sup>3</sup>	10,52 <sup>3</sup>
Klasse LG	9,9582	9,2094	10,79
Klasse LGP	8,6423	8,1168	9,92
Klasse ZE	9,5121 <sup>1</sup>	9,0335 <sup>1</sup>	10,91 <sup>1</sup>
Klasse ZEH	9,4383 <sup>1</sup>	8,7774 <sup>1</sup>	10,37 <sup>1</sup>
Klasse ZFH	9,3082 <sup>4</sup>	8,6609 <sup>4</sup>	10,27 <sup>4</sup>
Klasse ZG	9,8165	9,0942	10,69
Klasse ZGP	8,9800	8,4466	10,35
Klasse ZUH	10,2386 <sup>3</sup>	9,5384 <sup>3</sup>	10,97 <sup>3</sup>
Klasse 1EH	9,0511 <sup>1</sup>	8,4410 <sup>1</sup>	10,04 <sup>1</sup>
Klasse 1FH	9,0092 <sup>4</sup>	8,4075 <sup>4</sup>	10,03 <sup>4</sup>
Klasse 1UH	9,4779 <sup>3</sup>	8,7794 <sup>3</sup>	10,18 <sup>3</sup>
Klasse 3EH	9,1915 <sup>1</sup>	8,5370 <sup>1</sup>	10,07 <sup>1</sup>
Klasse 3FH	9,1435 <sup>4</sup>	8,5004 <sup>4</sup>	10,06 <sup>4</sup>
Klasse 3UH	9,6253 <sup>3</sup>	8,8809 <sup>3</sup>	10,21 <sup>3</sup>
Klasse 9EH	9,1921 <sup>1</sup>	8,5371 <sup>1</sup>	10,08 <sup>1</sup>
Klasse 9FH	9,1416 <sup>4</sup>	8,4985 <sup>4</sup>	10,06 <sup>4</sup>
Klasse 9G	8,8508	8,1909	–
Klasse 9UH	9,6237 <sup>3</sup>	8,8800 <sup>3</sup>	10,21 <sup>3</sup>

<sup>1</sup>Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist GBP.

<sup>2</sup>Die Klasse lautet auf SGD. Die Basiswährung des Portfolios ist GBP.

<sup>3</sup>Die Klasse lautet auf USD. Die Basiswährung des Portfolios ist GBP.

<sup>4</sup>Die Klasse lautet auf CHF. Die Basiswährung des Portfolios ist GBP.

## Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity

### AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2020

	Erläuterungen	2020 USD
<b>Aktiva</b>		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	6.280.362
Bankguthaben	2	88.989
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		7.017
<b>Aktiva, insgesamt</b>		<b>6.376.368</b>
<b>Passiva</b>		
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(6.539)
Andere Verbindlichkeiten		(1.839)
<b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>		<b>(8.378)</b>
<b>Nettovermögen, insgesamt</b>		<b>6.367.990</b>

### ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse IU	1.811.414,355
Klasse ZU	49.407,602

### AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2020	31. März 2020	31. März 2019
Klasse IU	3,4221	2,9775	3,87
Klasse ZU	3,4226	2,9779	3,87

### ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2020 bis 30. September 2020

	Erläuterungen	2020 USD
<b>Nettovermögen zu Beginn der Berichtsperiode</b>		<b>5.920.259</b>
<b>Erträge</b>		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	197.583
Zinsen aus Bankguthaben	2	2.606
<b>Erträge, insgesamt</b>		<b>200.189</b>
<b>Aufwand</b>		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(40.081)
Zinsen aus Bankguthaben	2	(2.585)
Betriebskosten	5	(11.223)
<b>Aufwand, insgesamt</b>		<b>(53.889)</b>
<b>Nettoertrag aus Anlagen</b>		<b>146.300</b>
Realisierter Nettogewinn aus dem Verkauf von Anlagen		85.841
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(331)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(9.120)
<b>Realisierter Nettogewinn</b>		<b>76.390</b>
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		645.987
<b>Nettoänderung bei nicht realisiertem Nettogewinn</b>		<b>645.987</b>
<b>Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit</b>		<b>868.677</b>
<b>Kapitalbewegungen</b>		
Zeichnungen von Anteilen		60.000
Anteilrücknahmen		(480.946)
<b>Kapitalbewegungen, insgesamt</b>		<b>(420.946)</b>
<b>Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode</b>		<b>6.367.990</b>

### GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2020	31. März 2020	31. März 2019
USD	6.367.990	5.920.259	7.921.925

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha

### AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2020

	Erläuterungen	2020 USD
<b>Aktiva</b>		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	83.684.549
Bankguthaben	2	4.472.615
Forderungen aus Zeichnungen		91.270
Zinsforderungen aus Swaps	2	962
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		10.381
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	356.229
Nicht realisierter Nettogewinn aus Finanztermingeschäften	2, 11	155.650
<b>Aktiva, insgesamt</b>		<b>88.771.656</b>
<b>Passiva</b>		
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(44.261)
Dividendenverbindlichkeiten aus Swaps	2	(105.875)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Swaps	2, 10	(854.730)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(13.715)
Andere Verbindlichkeiten		(13.054)
<b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>		<b>(1.031.635)</b>
<b>Nettovermögen, insgesamt</b>		<b>87.740.021</b>

### ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AEH	48.703,931
Klasse AFH	620,000
Klasse AGH	1.325,652
Klasse AU	196.495,046
Klasse DEH	11.999,337
Klasse DU	102.985,000
Klasse IEH	61.558,453
Klasse IGH	78.462,636
Klasse IU	66.858,776
Klasse XGH	5.715.599,285
Klasse ZE	100,000
Klasse ZEH	100,000
Klasse ZGH	5.510,371
Klasse ZU	100,000

### AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2020	31. März 2020	31. März 2019
Klasse AEH	15,3544 <sup>1</sup>	14,9909 <sup>1</sup>	15,94 <sup>1</sup>
Klasse AFH	14,0003 <sup>2</sup>	13,6841 <sup>2</sup>	14,60 <sup>2</sup>
Klasse AGH	16,3370 <sup>3</sup>	15,9091 <sup>3</sup>	16,75 <sup>3</sup>
Klasse AU	17,1776	16,6795	17,25
Klasse DEH	11,9294 <sup>1</sup>	11,6756 <sup>1</sup>	12,47 <sup>1</sup>
Klasse DU	13,2452	12,8939	13,40
Klasse IEH	22,1526 <sup>1</sup>	21,5363 <sup>1</sup>	22,70 <sup>1</sup>
Klasse IGH	23,3888 <sup>3</sup>	22,6795 <sup>3</sup>	23,69 <sup>3</sup>
Klasse IU	24,5382	23,7275	24,33
Klasse XGH	10,3109 <sup>3</sup>	9,9603 <sup>3</sup>	10,32 <sup>3</sup>
Klasse ZE	10,0339 <sup>1</sup>	10,3731 <sup>1</sup>	10,401
Klasse ZEH	9,6772 <sup>1</sup>	9,4119 <sup>1</sup>	9,921
Klasse ZGH	16,0291 <sup>3</sup>	15,5508 <sup>3</sup>	16,26 <sup>3</sup>
Klasse ZU	10,2299	9,8971	10,16

<sup>1</sup>Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.<sup>2</sup>Die Klasse lautet auf CHF. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.<sup>3</sup>Die Klasse lautet auf GBP. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

### ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2020 bis 30. September 2020

	Erläuterungen	2020 USD
<b>Nettovermögen zu Beginn der Berichtsperiode</b>		<b>180.468.553</b>
<b>Erträge</b>		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	194.276
Zinsen aus Bankguthaben	2	3.841
Zinsen aus Swaps		75.223
Zinsen aus Finanztermingeschäften		327
<b>Erträge, insgesamt</b>		<b>273.667</b>
<b>Aufwand</b>		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(91.144)
Zinsen aus Bankguthaben	2	(598)
Dividendenaufwand aus Swaps		(375.979)
Zinsaufwand aus Swaps		(134.269)
Zinsaufwand aus Finanztermingeschäften		(1.914)
Betriebskosten	5	(91.192)
<b>Aufwand, insgesamt</b>		<b>(695.096)</b>
<b>Netto(verlust) aus Anlagen</b>		<b>(421.429)</b>
Realisierter Nettogewinn aus dem Verkauf von Anlagen		5.768.717
Realisierter Netto(verlust) aus Swaps		(13.880.316)
Realisierter Nettogewinn aus Optionen		991.882
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		3.881.379
Realisierter Netto(verlust) aus Finanztermingeschäften		(3.956.964)
Realisierter Nettogewinn aus Devisengeschäften		656.753
<b>Realisierter Netto(verlust)</b>		<b>(6.538.549)</b>
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		19.386.855
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Swaps		1.751.762
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Optionen		60.731
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(920.860)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Finanztermingeschäften		(3.366.862)
<b>Nettoänderung bei nicht realisiertem Nettogewinn</b>		<b>16.911.626</b>
<b>Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit</b>		<b>9.951.648</b>
<b>Kapitalbewegungen</b>		
Zeichnungen von Anteilen		692.858
Anteilrücknahmen		(103.373.038)
<b>Kapitalbewegungen, insgesamt</b>		<b>(102.680.180)</b>
<b>Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode</b>		<b>87.740.021</b>

### GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2020	31. März 2020	31. März 2019
USD	87.740.021	180.468.553	197.738.046

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities

### AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2020

	Erläuterungen	2020 EUR
<b>Aktiva</b>		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	1.122.771.871
Bankguthaben	2	56.824.990
Termineinlagen	2, 19	14.997.863
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		7.811.734
Forderungen aus Zeichnungen		634.486
Zinsforderungen aus Swaps	2	291.611
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		12.046.397
Vorauszahlung aus Swaps	2	134.665
Sonstige Vermögenswerte		376
<b>Aktiva, insgesamt</b>		<b>1.215.513.993</b>
<b>Passiva</b>		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(4.660.830)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(821.906)
Zinsverbindlichkeiten aus Swaps	2	(764.472)
Eingegangene Vorauszahlung aus Swaps	2	(135.514)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(2.166.123)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Swaps	2, 10	(22.038.870)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Finanztermingeschäften	2, 11	(2.518.489)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(561.814)
Andere Verbindlichkeiten		(87.365)
<b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>		<b>(33.755.383)</b>
<b>Nettovermögen, insgesamt</b>		<b>1.181.758.610</b>

### ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse ZE	579.347,191
Klasse 1E	17.281.778,396
Klasse 1EP	95.336,726
Klasse 1GH	168.795,286
Klasse 1UH	626.019,268
Klasse 2E	64.631.667,438
Klasse 2EP	100,000
Klasse 2GC	100,000
Klasse 2GH	14.074,782
Klasse 4GH	242.133,138
Klasse 8E	31.909.779,967
Klasse 8EP	118.475,811
Klasse 8GC	64.527,895
Klasse 8GH	1.861.149,599

### ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2020 bis 30. September 2020

	Erläuterungen	2020 EUR
<b>Nettovermögen zu Beginn der Berichtsperiode</b>		<b>1.551.456.289</b>
<b>Erträge</b>		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	37.678
Zinsen aus Anleihen, netto	2	20.995.783
Zinsen aus Bankguthaben	2	13.005
Zinsen aus Swaps		4.975.683
<b>Erträge, insgesamt</b>		<b>26.022.149</b>
<b>Aufwand</b>		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(3.873.564)
Zinsen aus Bankguthaben	2	(251.900)
Zinsaufwand aus Swaps		(13.914.759)
Zinsaufwand aus Finanztermingeschäften		(572.119)
Betriebskosten	5	(604.697)
<b>Aufwand, insgesamt</b>		<b>(19.217.039)</b>
<b>Nettoertrag aus Anlagen</b>		<b>6.805.110</b>
Realisierter Netto(verlust) aus dem Verkauf von Anlagen		(4.430.977)
Realisierter Nettogewinn aus Swaps		20.398.014
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		20.215.982
Realisierter Netto(verlust) aus Finanztermingeschäften		(16.328.243)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(135.229)
<b>Realisierter Nettogewinn</b>		<b>19.719.547</b>
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		78.869.256
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Swaps		(48.742.501)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Devisenterminkontrakten		11.325.436
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Finanztermingeschäften		9.982.746
<b>Nettoänderung bei nicht realisiertem Nettogewinn</b>		<b>51.434.937</b>
<b>Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit</b>		<b>77.959.594</b>
<b>Kapitalbewegungen</b>		
Zeichnungen von Anteilen		94.736.114
Anteilrücknahmen		(542.393.387)
<b>Kapitalbewegungen, insgesamt</b>		<b>(447.657.273)</b>
<b>Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode</b>		<b>1.181.758.610</b>

### GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2020	31. März 2020	31. März 2019
EUR	1.181.758.610	1.551.456.289	1.710.173.003

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities

### AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2020	31. März 2020	31. März 2019
Klasse ZE	10,0011	9,3241	9,95
Klasse 1E	9,9272	9,2723	9,93
Klasse 1EP	9,3807	8,7619	9,73
Klasse 1GH	10,1076 <sup>1</sup>	9,4190 <sup>1</sup>	9,99 <sup>1</sup>
Klasse 1UH	10,3962 <sup>2</sup>	9,6685 <sup>2</sup>	10,08 <sup>2</sup>
Klasse 2E	10,0552	9,3632	9,96
Klasse 2EP	9,4884	8,8321	9,73
Klasse 2GC	9,6306 <sup>1</sup>	8,9432 <sup>1</sup>	9,78 <sup>1</sup>
Klasse 2GH	10,2384 <sup>1</sup>	9,5119 <sup>1</sup>	10,02 <sup>1</sup>
Klasse 4GH	10,3474 <sup>1</sup>	9,5888 <sup>1</sup>	10,05 <sup>1</sup>
Klasse 8E	10,0428	9,3536	9,96
Klasse 8EP	9,5243	8,8706	9,79
Klasse 8GC	9,6708 <sup>1</sup>	8,9861 <sup>1</sup>	9,83 <sup>1</sup>
Klasse 8GH	10,2322 <sup>1</sup>	9,5069 <sup>1</sup>	10,02 <sup>1</sup>

<sup>1</sup>Die Klasse lautet auf GBP. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

<sup>2</sup>Die Klasse lautet auf USD. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

## Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities

### AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2020

	Erläuterungen	2020 EUR
<b>Aktiva</b>		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	46.897.410
Bankguthaben	2	3.065.665
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		552.138
Forderungen aus Zeichnungen		1.422
Zinsforderungen aus Swaps	2	15.150
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		441.470
Vorauszahlung aus Swaps	2	41.930
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	683.128
<b>Aktiva, insgesamt</b>		<b>51.698.313</b>
<b>Passiva</b>		
Zinsverbindlichkeiten aus Swaps	2	(35.190)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Swaps	2, 10	(946.832)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Finanztermingeschäften	2, 11	(146.432)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(861)
Andere Verbindlichkeiten		(6.354)
<b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>		<b>(1.135.669)</b>
<b>Nettovermögen, insgesamt</b>		<b>50.562.644</b>

### ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AE	100,002
Klasse AFH	189,200
Klasse AKH	100,000
Klasse ANH	1.000,000
Klasse AUH	100,000
Klasse DE	9.393,929
Klasse IE	196.931,247
Klasse IEP	99,999
Klasse IGH	140,800
Klasse INH	1.000,000
Klasse IU	100,000
Klasse IUH	100,000
Klasse JE	99,997
Klasse JGH	140,800
Klasse JUH	100,000
Klasse LE	26.441,001
Klasse LEP	78.600,320
Klasse LGH	140,800
Klasse XE	290.852,554
Klasse XGH	3.813.980,912
Klasse XUH	191.198,625
Klasse YE	100,001
Klasse YGH	140,800
Klasse YUH	100,000
Klasse ZE	99,997
Klasse ZFH	189,200
Klasse ZGH	140,800
Klasse ZUH	100,000

### ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2020 bis 30. September 2020

	Erläuterungen	2020 EUR
<b>Nettovermögen zu Beginn der Berichtsperiode</b>		<b>65.678.771</b>
<b>Erträge</b>		
Zinsen aus Anleihen, netto	2	861.071
Zinsen aus Bankguthaben	2	825
Zinsen aus Swaps		351.618
<b>Erträge, insgesamt</b>		<b>1.213.514</b>
<b>Aufwand</b>		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(11.905)
Zinsen aus Bankguthaben	2	(9.829)
Zinsaufwand aus Swaps		(714.451)
Zinsaufwand aus Finanztermingeschäften		(25.891)
Betriebskosten	5	(46.295)
<b>Aufwand, insgesamt</b>		<b>(808.371)</b>
<b>Nettoertrag aus Anlagen</b>		<b>405.143</b>
Realisierter Nettogewinn aus dem Verkauf von Anlagen		248.870
Realisierter Nettogewinn aus Swaps		360.035
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		184.475
Realisierter Netto(verlust) aus Finanztermingeschäften		(760.441)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(60.995)
<b>Realisierter Netto(verlust)</b>		<b>(28.056)</b>
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		3.716.012
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Swaps		(2.020.143)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Devisenterminkontrakten		333.387
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Finanztermingeschäften		364.032
<b>Nettoänderung bei nicht realisiertem Nettogewinn</b>		<b>2.393.288</b>
<b>Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit</b>		<b>2.770.375</b>
<b>Kapitalbewegungen</b>		
Zeichnungen von Anteilen		6.351.895
Anteilrücknahmen		(24.223.576)
Dividenden	7	(14.821)
<b>Kapitalbewegungen, insgesamt</b>		<b>(17.886.502)</b>
<b>Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode</b>		<b>50.562.644</b>

### GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2020	31. März 2020	31. März 2019
EUR	50.562.644	65.678.771	50.389.420

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities

### AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2020	31. März 2020	31. März 2019
Klasse AE	10,0477	9,4969	9,96
Klasse AFH	9,9445 <sup>1</sup>	9,4156 <sup>1</sup>	9,92 <sup>1</sup>
Klasse AKH	100,2680 <sup>2</sup>	94,6358 <sup>2</sup>	–
Klasse ANH	10,1358 <sup>3</sup>	9,5560 <sup>3</sup>	–
Klasse AUH	10,6531 <sup>4</sup>	10,0302 <sup>4</sup>	10,24 <sup>4</sup>
Klasse DE	9,8974	9,3822	9,90
Klasse IE	10,2048	9,6157	10,02
Klasse IEP	9,4260	9,0726	9,72
Klasse IGH	10,4324 <sup>5</sup>	9,8133 <sup>5</sup>	10,12 <sup>5</sup>
Klasse INH	10,1449 <sup>3</sup>	9,5374 <sup>3</sup>	–
Klasse IU	10,6182 <sup>4</sup>	9,3587 <sup>4</sup>	–
Klasse IUH	10,8127 <sup>4</sup>	10,1441 <sup>4</sup>	10,29 <sup>4</sup>
Klasse JE	10,2001	9,6164	10,03
Klasse JGH	10,4413 <sup>5</sup>	9,8127 <sup>5</sup>	10,14 <sup>5</sup>
Klasse JUH	10,7695 <sup>4</sup>	10,1046 <sup>4</sup>	10,29 <sup>4</sup>
Klasse LE	10,2436	9,6450	10,03
Klasse LEP	9,5021	9,1359	9,77
Klasse LGH	10,4661 <sup>5</sup>	9,8349 <sup>5</sup>	10,14 <sup>5</sup>
Klasse XE <sup>6</sup>	10,5266	–	–
Klasse XGH	10,1392 <sup>5</sup>	9,5116 <sup>5</sup>	–
Klasse XUH <sup>6</sup>	10,5659 <sup>4</sup>	–	–
Klasse YE	10,1783	9,5989	10,02
Klasse YGH	10,3981 <sup>5</sup>	9,7812 <sup>5</sup>	10,12 <sup>5</sup>
Klasse YUH	10,7350 <sup>4</sup>	10,0801 <sup>4</sup>	10,27 <sup>4</sup>
Klasse ZE	10,1624	9,5865	10,01
Klasse ZFH	10,0561 <sup>1</sup>	9,4998 <sup>1</sup>	9,96 <sup>1</sup>
Klasse ZGH	10,4068 <sup>5</sup>	9,7911 <sup>5</sup>	10,12 <sup>5</sup>
Klasse ZUH	10,7770 <sup>4</sup>	10,1215 <sup>4</sup>	10,28 <sup>4</sup>

<sup>1</sup>Die Klasse lautet auf CHF. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

<sup>2</sup>Die Klasse lautet auf SEK. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

<sup>3</sup>Die Klasse lautet auf NOK. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

<sup>4</sup>Die Klasse lautet auf USD. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

<sup>5</sup>Die Klasse lautet auf GBP. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

<sup>6</sup>Siehe Erläuterung 1.



## Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha

### AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2020

	Erläuterungen	2020 EUR
<b>Aktiva</b>		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	181.139.601
Bankguthaben	2	4.589.019
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		297.567
Forderungen aus Zeichnungen		1.534.435
Zinsforderungen aus Swaps	2	6.243.503
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	1.166.927
Sonstige Vermögenswerte		61.465
<b>Aktiva, insgesamt</b>		<b>195.032.517</b>
<b>Passiva</b>		
Überziehungskredite		(1.077.455)
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(7.309.805)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(63.525)
Zinsverbindlichkeiten aus Swaps	2	(3.206.104)
Dividendenverbindlichkeiten aus Swaps	2	(208.411)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Swaps	2, 10	(511.491)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(89.954)
Verbindlichkeiten aus Performancegebühren	8	(1.030.290)
Andere Verbindlichkeiten		(31.723)
<b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>		<b>(13.528.758)</b>
<b>Nettovermögen, insgesamt</b>		<b>181.503.759</b>

### ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AE	4.243.873,455
Klasse AEP	21.366,360
Klasse AUH	2.430,000
Klasse DE	1.309.145,863
Klasse IE	1.776.026,757
Klasse IGH	156.987,536
Klasse LE	1.469.988,591
Klasse XGH	3.863.775,566
Klasse ZE	405.440,030
Klasse ZF	100,000
Klasse ZFH	2.820,000
Klasse ZGH	200,000

### AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2020	31. März 2020	31. März 2019
Klasse AE	12,5858	11,8815	10,93
Klasse AEP	12,9138	12,2004	11,06
Klasse AUH	13,4381 <sup>1</sup>	12,6049 <sup>1</sup>	11,38 <sup>1</sup>
Klasse DE	12,3483	11,6749	10,78
Klasse IE	13,0070	12,2490	11,08
Klasse IGH	13,2082 <sup>2</sup>	12,4217 <sup>2</sup>	11,27 <sup>2</sup>
Klasse LE	13,1310	12,3472	11,23
Klasse XGH	14,4641 <sup>2</sup>	13,3602 <sup>2</sup>	11,81 <sup>2</sup>
Klasse ZE	13,0334	12,2555	11,14
Klasse ZF	12,4402 <sup>3</sup>	11,4828 <sup>3</sup>	11,04 <sup>3</sup>
Klasse ZFH	12,3095 <sup>3</sup>	11,6341 <sup>3</sup>	10,72 <sup>3</sup>
Klasse ZGH	13,1696 <sup>2</sup>	12,3878 <sup>2</sup>	11,24 <sup>2</sup>

<sup>1</sup>Die Klasse lautet auf USD. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.<sup>2</sup>Die Klasse lautet auf GBP. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.<sup>3</sup>Die Klasse lautet auf CHF. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

### ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2020 bis 30. September 2020

	Erläuterungen	2020 EUR
<b>Nettovermögen zu Beginn der Berichtsperiode</b>		<b>145.122.405</b>
<b>Erträge</b>		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	1.059.060
Zinsen aus Bankguthaben	2	4.919
Zinsen aus Swaps		191.249
<b>Erträge, insgesamt</b>		<b>1.255.228</b>
<b>Aufwand</b>		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(408.343)
Performancegebühren	8	(1.030.286)
Zinsen aus Bankguthaben	2	(23.532)
Dividendenaufwand aus Swaps		(1.137.028)
Zinsaufwand aus Swaps		(375.625)
Betriebskosten	5	(149.616)
Sonstige Gebühren	4	(8.134)
<b>Aufwand, insgesamt</b>		<b>(3.132.564)</b>
<b>Netto(verlust) aus Anlagen</b>		<b>(1.877.336)</b>
Realisierter Nettogewinn aus dem Verkauf von Anlagen		9.494.577
Realisierter Netto(verlust) aus Swaps		(21.118.548)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(144.312)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(156.911)
<b>Realisierter Netto(verlust)</b>		<b>(11.925.194)</b>
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		22.012.696
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Swaps		922.052
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(890.945)
<b>Nettoänderung bei nicht realisiertem Nettogewinn</b>		<b>22.043.803</b>
<b>Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit</b>		<b>8.241.273</b>
<b>Kapitalbewegungen</b>		
Zeichnungen von Anteilen		61.751.740
Anteilrücknahmen		(33.611.659)
<b>Kapitalbewegungen, insgesamt</b>		<b>28.140.081</b>
<b>Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode</b>		<b>181.503.759</b>

### GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2020	31. März 2020	31. März 2019
EUR	181.503.759	145.122.405	62.685.309

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha

### AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2020

	Erläuterungen	2020 USD
<b>Aktiva</b>		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	106.446.065
Bankguthaben	2	2.307.490
Forderungen aus Zeichnungen		14.633
Zinsforderungen aus Swaps	2	35.343
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		18.241
Nicht realisierter Nettogewinn aus Swaps	2, 10	501.141
Sonstige Vermögenswerte		806
<b>Aktiva, insgesamt</b>		<b>109.323.719</b>
<b>Passiva</b>		
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(269.964)
Zinsverbindlichkeiten aus Swaps	2	(93.800)
Dividendenverbindlichkeiten aus Swaps	2	(52.912)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(51.731)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(123.887)
Andere Verbindlichkeiten		(16.533)
<b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>		<b>(608.827)</b>
<b>Nettovermögen, insgesamt</b>		<b>108.714.892</b>

### ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AEH	100,000
Klasse AU	5.886,619
Klasse DEH	100,000
Klasse DU	376,880
Klasse IU	28.645,000
Klasse ZU	100,000
Klasse 1E	4.224.255,724
Klasse 1EH	706.207,805
Klasse 1U	5.600.059,824
Klasse 2E	487,000
Klasse 2U	100,000
Klasse 3U	45.000,000
Klasse 8E	1.169.316,253
Klasse 8U	3.937.229,375
Klasse 9U	100,000

### AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2020	31. März 2020	31. März 2019
Klasse AEH	12,5788 <sup>1</sup>	9,6105 <sup>1</sup>	10,31 <sup>1</sup>
Klasse AU	13,0931	9,9317	10,36
Klasse DEH	12,4753 <sup>1</sup>	9,5551 <sup>1</sup>	10,30 <sup>1</sup>
Klasse DU	12,9746	9,8657	10,35
Klasse IU	13,2939	10,0392	10,38
Klasse ZU	13,2576	10,0184	10,38
Klasse 1E	5,7861 <sup>1</sup>	4,6882 <sup>1</sup>	4,77 <sup>1</sup>
Klasse 1EH	4,5744 <sup>1</sup>	3,4943 <sup>1</sup>	3,74 <sup>1</sup>
Klasse 1U	6,7838	5,1432	5,36
Klasse 2E	12,9343 <sup>1</sup>	10,4354 <sup>1</sup>	10,54 <sup>1</sup>
Klasse 2U	13,3177	10,0509	10,38
Klasse 3U	3,7942	2,8659	2,98
Klasse 8E	6,3135 <sup>1</sup>	5,0947 <sup>1</sup>	5,18 <sup>1</sup>
Klasse 8U	7,3580	5,5557	5,82
Klasse 9U	13,3039	10,0466	10,38

<sup>1</sup>Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

### ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2020 bis 30. September 2020

	Erläuterungen	2020 USD
<b>Nettovermögen zu Beginn der Berichtsperiode</b>		<b>107.950.260</b>
<b>Erträge</b>		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	310.834
Zinsen aus Bankguthaben	2	1.128
Zinsen aus Swaps		49.852
Zinsen aus Finanztermingeschäften		344
<b>Erträge, insgesamt</b>		<b>362.158</b>
<b>Aufwand</b>		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(764.231)
Zinsen aus Bankguthaben	2	(106)
Dividendenaufwand aus Swaps		(153.046)
Zinsaufwand aus Swaps		(154.260)
Zinsaufwand aus Finanztermingeschäften		(1.106)
Betriebskosten	5	(102.212)
<b>Aufwand, insgesamt</b>		<b>(1.174.961)</b>
<b>Netto(verlust) aus Anlagen</b>		<b>(812.803)</b>
Realisierter Nettogewinn aus dem Verkauf von Anlagen		5.472.733
Realisierter Nettogewinn aus Swaps		34.932
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		231.640
Realisierter Nettogewinn aus Finanztermingeschäften		938.072
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(37.692)
<b>Realisierter Nettogewinn</b>		<b>6.639.685</b>
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		27.074.381
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Swaps		721.908
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Devisenterminkontrakten		368
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Finanztermingeschäften		(385.450)
<b>Nettoänderung bei nicht realisiertem Nettogewinn</b>		<b>27.411.207</b>
<b>Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit</b>		<b>33.238.089</b>
<b>Kapitalbewegungen</b>		
Zeichnungen von Anteilen		11.422.679
Anteilrücknahmen		(43.896.136)
<b>Kapitalbewegungen, insgesamt</b>		<b>(32.473.457)</b>
<b>Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode</b>		<b>108.714.892</b>

### GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2020	31. März 2020	31. März 2019
USD	108.714.892	107.950.260	130.515.247

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha

### AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2020

	Erläuterungen	2020 USD
<b>Aktiva</b>		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	186.274.287
Bankguthaben	2	1.572.690
Termineinlagen	2, 19	4.402.524
Forderungen aus Zeichnungen		533.732
Zinsforderungen aus Swaps	2	7.044
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		155.813
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	285
Nicht realisierter Nettogewinn aus Swaps	2, 10	705.217
Sonstige Vermögenswerte		14.202
<b>Aktiva, insgesamt</b>		<b>193.665.794</b>
<b>Passiva</b>		
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(98.406)
Zinsverbindlichkeiten aus Swaps	2	(5.514)
Dividendenverbindlichkeiten aus Swaps	2	(88.628)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(200.856)
Andere Verbindlichkeiten		(25.110)
<b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>		<b>(418.514)</b>
<b>Nettovermögen, insgesamt</b>		<b>193.247.280</b>

### ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AEH	97.756,195
Klasse AU	19.985,536
Klasse DEH	3.513,435
Klasse DU	100,000
Klasse IU	58.887,467
Klasse ZU	100,000
Klasse 1E	24.970.153,454
Klasse 1U	1.068.600,453
Klasse 2E	44.054,110
Klasse 2U	3.387.444,230
Klasse 8E	982.928,135
Klasse 8U	227.611,411

### AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2020	31. März 2020	31. März 2019
Klasse AEH	13,3228 <sup>1</sup>	10,3913 <sup>1</sup>	10,74 <sup>1</sup>
Klasse AU	13,8091	10,7050	10,79
Klasse DEH	13,3107 <sup>1</sup>	10,4242 <sup>1</sup>	10,73 <sup>1</sup>
Klasse DU	13,7645	10,6942	10,78
Klasse IU	14,1611	10,9288	10,80
Klasse ZU	14,0291	10,8327	10,80
Klasse 1E	4,4314 <sup>1</sup>	3,6694 <sup>1</sup>	3,58 <sup>1</sup>
Klasse 1U	5,2045	4,0324	4,02
Klasse 2E	13,6476 <sup>1</sup>	11,2523 <sup>1</sup>	10,94 <sup>1</sup>
Klasse 2U	14,0554	10,8434	10,78
Klasse 8E	4,8607 <sup>1</sup>	4,0084 <sup>1</sup>	3,89 <sup>1</sup>
Klasse 8U	5,7722	4,4540	4,37

<sup>1</sup>Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

### ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2020 bis 30. September 2020

	Erläuterungen	2020 USD
<b>Nettovermögen zu Beginn der Berichtsperiode</b>		<b>163.281.752</b>
<b>Erträge</b>		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	891.869
Zinsen aus Bankguthaben	2	1.184
Zinsen aus Swaps		145.765
<b>Erträge, insgesamt</b>		<b>1.038.818</b>
<b>Aufwand</b>		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(1.200.344)
Zinsen aus Bankguthaben	2	(320)
Dividendenaufwand aus Swaps		(232.936)
Zinsaufwand aus Swaps		(411.659)
Betriebskosten	5	(150.458)
<b>Aufwand, insgesamt</b>		<b>(1.995.717)</b>
<b>Netto(verlust) aus Anlagen</b>		<b>(956.899)</b>
Realisierter Nettogewinn aus dem Verkauf von Anlagen		5.011.263
Realisierter Nettogewinn aus Swaps		4.561.671
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		21.817
Realisierter Nettogewinn aus Devisengeschäften		40.881
Realisierter Nettogewinn aus Steuerrückforderung		7
<b>Realisierter Nettogewinn</b>		<b>9.635.639</b>
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		38.884.598
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Swaps		(122.662)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Devisenterminkontrakten		1.143
<b>Nettoänderung bei nicht realisiertem Nettogewinn</b>		<b>38.763.079</b>
<b>Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit</b>		<b>47.441.819</b>
<b>Kapitalbewegungen</b>		
Zeichnungen von Anteilen		15.753.092
Anteilrücknahmen		(33.229.383)
<b>Kapitalbewegungen, insgesamt</b>		<b>(17.476.291)</b>
<b>Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode</b>		<b>193.247.280</b>

### GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2020	31. März 2020	31. März 2019
USD	193.247.280	163.281.752	170.492.979

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities

### AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2020

	Erläuterungen	2020 USD
<b>Aktiva</b>		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	345.258.802
Bankguthaben	2	11.089.741
Forderungen aus Zeichnungen		2.163.922
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		201
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	188.177
Sonstige Vermögenswerte		1.384
<b>Aktiva, insgesamt</b>		<b>358.702.227</b>
<b>Passiva</b>		
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(47.546)
Zinsverbindlichkeiten aus Swaps	2	(26.541)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Swaps	2, 10	(2.606.730)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(120.041)
Andere Verbindlichkeiten		(52.142)
<b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>		<b>(2.853.000)</b>
<b>Nettovermögen, insgesamt</b>		<b>355.849.227</b>

### ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AEH	205.778,141
Klasse AFH	167.108,729
Klasse AGH	32.360,044
Klasse ASH	174.506,472
Klasse AU	677.575,613
Klasse DEH	201.372,364
Klasse DU	156.582,942
Klasse IEH	675.315,837
Klasse IG	100,000
Klasse IGH	5.389.334,505
Klasse IU	3.522.234,404
Klasse NG	3.947.326,959
Klasse XU	12.434.136,967
Klasse ZEH	38.202,000
Klasse ZFH	5.110,000
Klasse ZGH	47.192,178
Klasse ZU	50.600,484

### ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2020 bis 30. September 2020

	Erläuterungen	2020 USD
<b>Nettovermögen zu Beginn der Berichtsperiode</b>		<b>292.751.295</b>
<b>Erträge</b>		
Zinsen aus Anleihen, netto	2	390.045
Zinsen aus Bankguthaben	2	4.039
Zinsen aus Swaps		9.344
<b>Erträge, insgesamt</b>		<b>403.428</b>
<b>Aufwand</b>		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(651.135)
Zinsen aus Bankguthaben	2	(2.539)
Zinsaufwand aus Swaps		(298.106)
Betriebskosten	5	(287.658)
<b>Aufwand, insgesamt</b>		<b>(1.239.438)</b>
<b>Netto(verlust) aus Anlagen</b>		<b>(836.010)</b>
Realisierter Nettogewinn aus dem Verkauf von Anlagen		108.635
Realisierter Nettogewinn aus Swaps		37.080.124
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		3.682.098
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(8.851)
<b>Realisierter Nettogewinn</b>		<b>40.862.006</b>
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(310.269)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Swaps		14.014.427
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(59.831)
<b>Nettoänderung bei nicht realisiertem Nettogewinn</b>		<b>13.644.327</b>
<b>Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit</b>		<b>53.670.323</b>
<b>Kapitalbewegungen</b>		
Zeichnungen von Anteilen		19.893.976
Anteilrücknahmen		(10.466.367)
<b>Kapitalbewegungen, insgesamt</b>		<b>9.427.609</b>
<b>Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode</b>		<b>355.849.227</b>

### GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2020	31. März 2020	31. März 2019
USD	355.849.227	292.751.295	446.269.011

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities

### AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2020	31. März 2020	31. März 2019
Klasse AEH	7,3659 <sup>1</sup>	6,3865 <sup>1</sup>	8,48 <sup>1</sup>
Klasse AFH	5,4481 <sup>2</sup>	4,7274 <sup>2</sup>	6,30 <sup>2</sup>
Klasse AGH	7,8687 <sup>3</sup>	6,8077 <sup>3</sup>	8,98 <sup>3</sup>
Klasse ASH	4,1188 <sup>4</sup>	3,5575 <sup>4</sup>	4,63 <sup>4</sup>
Klasse AU	8,6304	7,4279	9,58
Klasse DEH	5,6062 <sup>1</sup>	4,8729 <sup>1</sup>	6,50 <sup>1</sup>
Klasse DU	6,5703	5,6690	7,35
Klasse IEH	10,7800 <sup>1</sup>	9,2968 <sup>1</sup>	12,21 <sup>1</sup>
Klasse IFH	—	—	9,06 <sup>2</sup>
Klasse IG	9,2015 <sup>3</sup>	8,2193 <sup>3</sup>	10,00 <sup>3</sup>
Klasse IGH	11,4889 <sup>3</sup>	9,8874 <sup>3</sup>	12,90 <sup>3</sup>
Klasse IU	12,6149	10,8005	13,79
Klasse NG	8,8366 <sup>3</sup>	7,8743 <sup>3</sup>	9,53 <sup>3</sup>
Klasse XU	13,2715	11,3145	14,32
Klasse ZEH	4,5538 <sup>1</sup>	3,9285 <sup>1</sup>	5,16 <sup>1</sup>
Klasse ZFH	4,4135 <sup>2</sup>	3,8109 <sup>2</sup>	5,02 <sup>2</sup>
Klasse ZGH	6,5801 <sup>3</sup>	5,6644 <sup>3</sup>	7,40 <sup>3</sup>
Klasse ZU	5,2044	4,4569	5,69

<sup>1</sup>Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

<sup>2</sup>Die Klasse lautet auf CHF. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

<sup>3</sup>Die Klasse lautet auf GBP. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

<sup>4</sup>Die Klasse lautet auf SGD. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

## Threadneedle (Lux) - Gatehouse Shariah Global Equity

**AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS**

zum 30. September 2020

	Erläuterungen	2020 USD
<b>Aktiva</b>		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	8.141.698
Bankguthaben	2	250.900
Forderungen aus Dividenden, netto		8.287
Sonstige Vermögenswerte		3.407
<b>Aktiva, insgesamt</b>		<b>8.404.292</b>
<b>Passiva</b>		
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(10.232)
Andere Verbindlichkeiten		(3.190)
<b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>		<b>(13.422)</b>
<b>Nettovermögen, insgesamt</b>		<b>8.390.870</b>

**ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN**

Klasse AU	558.233,054
-----------	-------------

**AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL**

	30. September 2020	31. März 2020	31. März 2019
Klasse AU	15,0311	11,4255	11,56
Klasse XU <sup>#</sup>	–	11,7913	11,74

<sup>#</sup>Siehe Erläuterung 1.**ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG  
DES NETTOVERMÖGENS**

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2020 bis 30. September 2020

	Erläuterungen	2020 USD
<b>Nettovermögen zu Beginn der Berichtsperiode</b>		<b>12.190.122</b>
<b>Erträge</b>		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	49.762
<b>Erträge, insgesamt</b>		<b>49.762</b>
<b>Aufwand</b>		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(56.545)
Betriebskosten	5	(18.698)
<b>Aufwand, insgesamt</b>		<b>(75.243)</b>
<b>Netto(verlust) aus Anlagen</b>		<b>(25.481)</b>
Realisierter Nettogewinn aus dem Verkauf von Anlagen		1.393.201
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(46)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(11.111)
Realisierter Nettogewinn aus Steuerrückforderung		7
<b>Realisierter Nettogewinn</b>		<b>1.382.051</b>
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		2.165.029
<b>Nettoänderung bei nicht realisiertem Nettogewinn</b>		<b>2.165.029</b>
<b>Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit</b>		<b>3.521.599</b>
<b>Kapitalbewegungen</b>		
Zeichnungen von Anteilen		108.814
Anteilrücknahmen		(7.429.665)
<b>Kapitalbewegungen, insgesamt</b>		<b>(7.320.851)</b>
<b>Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode</b>		<b>8.390.870</b>

**GESAMTNETTOINVENTARWERT**

	30. September 2020	31. März 2020	31. März 2019
USD	8.390.870	12.190.122	12.383.414

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond

### Portfolioaufstellung

zum 30. September 2020

	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts		Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung</b>					<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				
<b>Anleihen</b>					<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				
<b>AUSTRALIEN</b>					<b>DÄNEMARK</b>				
EUR	1.677.000	APT Pipelines Limited 2.00% 15/07/2030	2.134.053	0,55	EUR	2.924.000	Danske Bank A/S 0.63% 26/05/2025	3.502.902	0,90
EUR	2.170.000	Aurizon Network Pty Limited 3.13% 01/06/2026	2.863.243	0,74	<b>Dänemark, insgesamt</b>				
USD	1.508.000	Ausgrid Finance Pty Limited 4.35% 01/08/2028	1.732.777	0,44	<b>3.502.902 0,90</b>				
EUR	1.439.000	AusNet Services Holdings Pty Limited 0.63% 25/08/2030	1.729.972	0,44	<b>FINNLAND</b>				
EUR	1.290.000	Goodman Australia 1.38% 27/09/2025	1.561.379	0,40	EUR	946.000	Nordea Bank Abp 0.50% 14/05/2027	1.143.476	0,29
USD	2.215.000	SGSP Australia Assets Pty Limited 3.50% 07/07/2027	2.454.991	0,63	EUR	630.000	OP Corporate Bank plc FRN 09/06/2030	755.109	0,19
<b>Australien, insgesamt</b>			<b>12.476.415</b>	<b>3,20</b>	<b>Finnland, insgesamt</b>				
					<b>1.898.585 0,48</b>				
<b>BELGIEN</b>					<b>FRANKREICH</b>				
EUR	835.000	Anheuser-Busch Inbev SA 3.70% 02/04/2040	1.255.868	0,32	EUR	1.500.000	Auchan Holding SA 3.25% 23/07/2027	1.884.957	0,49
EUR	250.000	Anheuser-Busch Inbev SA 3.70% 02/04/2040	376.008	0,10	EUR	1.000.000	Carrefour SA 2.63% 15/12/2027	1.339.592	0,34
<b>Belgien, insgesamt</b>			<b>1.631.876</b>	<b>0,42</b>	EUR	600.000	Credit Agricole SA FRN 05/06/2030	721.220	0,19
<b>BERMUDAS</b>					USD	903.000	Credit Agricole SA Perp FRN	972.837	0,25
USD	1.630.000	Bacardi Limited 5.30% 15/05/2048	2.052.012	0,53	EUR	700.000	Electricite de France SA 2.00% 09/12/2049	847.591	0,22
<b>Bermudas, insgesamt</b>			<b>2.052.012</b>	<b>0,53</b>	EUR	300.000	Holding d'Infrastructures de Transport SASU 1.63% 18/09/2029	353.813	0,09
<b>KANADA</b>					EUR	1.200.000	RTE Reseau de Transport d'Electricite SADIR 1.13% 08/07/2040	1.479.359	0,38
USD	1.865.000	Canadian Natural Resources Limited 2.95% 15/07/2030	1.881.540	0,48	EUR	1.000.000	Sanef SA 1.88% 16/03/2026	1.228.621	0,32
<b>Kanada, insgesamt</b>			<b>1.881.540</b>	<b>0,48</b>	USD	792.000	Total Capital International 2.99% 29/06/2041	825.041	0,21
<b>KAIMANINSELN</b>					<b>FRANKREICH, insgesamt</b>				
USD	732.000	Alibaba Group Holding Limited 4.00% 06/12/2037	870.621	0,22	<b>9.653.031 2,49</b>				
GBP	2.572.000	Southern Water Services Finance Limited 3.00% 28/05/2037	3.528.824	0,91	<b>DEUTSCHLAND</b>				
USD	2.430.000	Tencent Holdings Limited 3.60% 19/01/2028	2.676.024	0,69	EUR	600.000	Adler Real Estate AG 1.88% 27/04/2023	680.914	0,17
USD	200.000	Tencent Holdings Limited 3.93% 19/01/2038	228.786	0,06	EUR	400.000	Adler Real Estate AG 3.00% 27/04/2026	461.865	0,12
<b>Kaimaninseln, insgesamt</b>			<b>7.304.255</b>	<b>1,88</b>	EUR	1.000.000	Alstria Office REIT-AG 0.50% 26/09/2025	1.155.801	0,30
					EUR	2.300.000	Bayer AG 1.13% 06/01/2030	2.741.936	0,71
					EUR	1.015.000	Commerzbank AG 0.50% 04/12/2026	1.199.853	0,31
					EUR	2.654.000	Commerzbank AG 1.00% 04/03/2026	3.217.634	0,83
					EUR	1.588.000	Deutsche Bank FRN 18/09/2024	1.236.371	0,32
					USD	1.230.000	Deutsche Bank AG FRN 10/06/2026	1.943.908	0,50

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond

### Portfolioaufstellung

(Fortsetzung)

	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts		Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>					<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>					<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				
<b>DEUTSCHLAND (Fortsetzung)</b>					<b>ITALIEN (Fortsetzung)</b>				
EUR	1.100.000	Eurogrid GmbH 1.11% 15/05/2032	1.381.892	0,35	EUR	375.000	Banco BPM SpA 1.75% 24/04/2023	445.236	0,11
EUR	1.200.000	Volkswagen Bank GmbH 1.25% 10/06/2024	1.435.738	0,37	EUR	951.000	Banco BPM SpA 2.00% 08/03/2022	1.130.660	0,29
EUR	491.000	Volkswagen Financial Services AG 3.38% 06/04/2028	669.714	0,17	EUR	1.508.000	FCA Bank SpA 0.50% 13/09/2024	1.761.132	0,45
EUR	600.000	Volkswagen Leasing GmbH 1.63% 15/08/2025	731.896	0,19	<b>Italien, insgesamt</b>				
<b>Deutschland, insgesamt</b>					<b>5.816.261 1,49</b>				
<b>HONGKONG</b>					<b>LUXEMBURG</b>				
USD	450.000	Swire Pacific MTN Financing HK Limited 2.88% 30/01/2030	473.845	0,12	EUR	1.000.000	Aroundtown SA 1.45% 09/07/2028	1.192.224	0,31
<b>Hongkong, insgesamt</b>					<b>473.845 0,12</b>				
<b>INDIEN</b>					<b>GBP</b>				
USD	1.430.000	Adani Ports & Special Economic Zone Limited 4.38% 03/07/2029	1.442.744	0,37	GBP	400.000	Aroundtown SA 3.00% 16/10/2029	532.048	0,14
USD	1.535.000	Bharti Airtel Limited 4.38% 10/06/2025	1.625.439	0,42	GBP	700.000	Aroundtown SA 3.25% 18/07/2027	963.786	0,25
USD	1.180.000	GMR Hyderabad International Airport Limited 4.25% 27/10/2027	1.051.236	0,27	USD	1.031.000	Aroundtown SA 5.38% 21/03/2029	1.203.951	0,31
USD	310.000	GMR Hyderabad International Airport Limited 5.38% 10/04/2024	304.118	0,08	EUR	2.335.000	Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1.21% 04/06/2026	2.813.975	0,73
<b>Indien, insgesamt</b>					<b>EUR</b>				
<b>4.423.537 1,14</b>					155.000				
<b>IRLAND</b>					CPI Property Group SA 1.63% 23/04/2027				
EUR	2.100.000	AIB Group plc FRN 19/11/2029	2.384.143	0,61	EUR	718.000	CPI Property Group SA 2.75% 12/05/2026	816.232	0,21
EUR	725.000	Bank of Ireland Group plc FRN 14/10/2029	839.700	0,22	EUR	2.000.000	Grand City Properties SA 1.50% 17/04/2025	2.457.602	0,63
USD	2.625.000	GE Capital International Funding Company 4.42% 15/11/2035	2.773.361	0,71	EUR	1.994.000	Medtronic Global Holdings SCA 1.38% 15/10/2040	2.396.033	0,61
EUR	340.000	Zurich Finance Ireland Designated Activity Company 1.63% 17/06/2039	457.654	0,12	EUR	2.066.000	Novartis Finance SA 0.00% 23/09/2028	2.420.577	0,62
<b>Irland, insgesamt</b>					<b>EUR</b>				
<b>6.454.858 1,66</b>					1.039.000				
<b>ITALIEN</b>					Prologis International Funding II SA 1.63% 17/06/2032				
EUR	808.000	Aeroporti di Roma SpA 1.63% 08/06/2027	929.853	0,24	<b>Luxemburg, insgesamt</b>				
EUR	375.000	Assicurazioni Generali SpA 5.00% 08/06/2048	508.420	0,13	<b>16.308.231 4,20</b>				
EUR	950.000	Autostrade per l'Italia SpA 1.88% 26/09/2029	1.040.960	0,27	<b>MEXIKO</b>				
					EUR				
					801.000				
					Petroleos Mexicanos 3.75% 16/04/2026				
					825.673 0,21				
					<b>Mexiko, insgesamt</b>				
					<b>825.673 0,21</b>				
					<b>NIEDERLANDE</b>				
					EUR				
					2.600.000				
					ABN Amro Bank NV 1.25% 28/05/2025				
					3.184.560 0,82				
					USD				
					1.172.000				
					Aegon NV FRN 11/04/2048				
					1.291.647 0,33				
					EUR				
					102.000				
					Airbus SE 2.38% 09/06/2040				
					121.878 0,03				
					USD				
					1.250.000				
					Braskem Netherlands Finance BV 4.50% 10/01/2028				
					1.206.250 0,31				
					EUR				
					300.000				
					Cooperatieve Rabobank UA FRN 05/05/2028				
					365.942 0,09				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.



## Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond

### Portfolioaufstellung

(Fortsetzung)

	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts		Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>					<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>					<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				
<b>NIEDERLANDE (Fortsetzung)</b>					<b>SCHWEDEN</b>				
EUR	1.700.000	Cooperatieve Rabobank UA FRN 05/05/2028	2.073.671	0,53	EUR	3.220.000	Akelius Residential Property AB 1.75% 07/02/2025	3.943.330	1,01
EUR	382.000	Digital Dutch Finco BV 1.50% 15/03/2030	468.875	0,12	EUR	2.133.000	Sagax AB 1.13% 30/01/2027	2.454.557	0,62
EUR	1.127.000	Enexis Holding NV 0.75% 02/07/2031	1.388.447	0,36	EUR	573.000	Sagax AB 2.00% 17/01/2024	693.809	0,18
EUR	1.029.000	Heineken NV 1.25% 07/05/2033	1.250.882	0,32	<b>Schweden, insgesamt</b>				
EUR	800.000	ING Groep NV FRN 26/05/2031	975.980	0,25	<b>7.091.696 1,81</b>				
GBP	2.084.000	Innogy Finance BV 6.25% 03/06/2030	3.807.292	0,99	<b>SCHWEIZ</b>				
EUR	1.612.000	NE Property BV 1.88% 09/10/2026	1.753.178	0,45	EUR	435.000	Credit Suisse Group AG FRN 02/04/2026	570.988	0,15
EUR	480.000	NE Property BV 3.38% 14/07/2027	567.896	0,15	USD	1.000.000	Credit Suisse Group AG FRN 01/04/2031	1.155.497	0,30
EUR	700.000	Redexis Gas Finance Sarl 1.88% 28/05/2025	859.363	0,22	USD	330.000	Credit Suisse Group AG Perp FRN	360.377	0,09
EUR	1.085.000	Relx Finance BV 0.50% 10/03/2028	1.278.040	0,32	USD	823.000	UBS AG 5.13% 15/05/2024	907.360	0,24
EUR	1.600.000	Syngenta Finance NV 3.38% 16/04/2026	2.019.134	0,52	USD	530.000	UBS Group AG Perp FRN	543.784	0,14
USD	2.302.000	Syngenta Finance NV 4.89% 24/04/2025	2.497.707	0,64	USD	700.000	UBS Group AG Perp FRN	780.380	0,20
EUR	500.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	937.508	0,24	USD	768.000	UBS Group Funding Switzerland AG Perp FRN	821.635	0,21
EUR	800.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	619.692	0,16	<b>Schweiz, insgesamt</b>				
EUR	3.083.000	TenneT Holding BV Perp FRN	3.668.965	0,95	<b>5.140.021 1,33</b>				
EUR	300.000	Volkswagen International Finance NV 4.13% 16/11/2038	476.308	0,12	<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH</b>				
EUR	2.300.000	Vonovia Finance BV 1.00% 09/07/2030	2.749.851	0,70	USD	767.000	Anglo American Capital plc 3.95% 10/09/2050	783.952	0,20
<b>Niederlande, insgesamt</b>				<b>8,62</b>	USD	1.549.000	BAE Systems plc 3.40% 15/04/2030	1.738.335	0,44
<b>NORWEGEN</b>					EUR	180.000	BP Capital Markets plc 2.52% 07/04/2028	240.488	0,06
EUR	1.920.000	Dnb Bank ASA 0.05% 14/11/2023	2.264.633	0,58	USD	2.665.000	BP Capital Markets plc Perp FRN	2.784.092	0,71
EUR	1.125.000	Dnb Bank ASA 0.25% 09/04/2024	1.336.528	0,34	GBP	490.416	Broadgate Financing plc 5.10% 05/04/2033	765.417	0,20
<b>Norwegen, insgesamt</b>				<b>0,92</b>	GBP	870.000	BUFA Finance plc 4.13% 14/06/2035	1.195.023	0,31
<b>SINGAPUR</b>					GBP	1.506.000	BUFA Finance plc 5.00% 08/12/2026	2.226.176	0,57
USD	1.653.000	SingTel Group Treasury Pte Limited 1.88% 10/06/2030	1.679.389	0,43	EUR	507.000	Cadent Finance plc 0.75% 11/03/2032	593.616	0,15
<b>Singapur, insgesamt</b>				<b>0,43</b>	EUR	3.893.000	DS Smith plc 0.88% 12/09/2026	4.558.796	1,17
<b>SPANIEN</b>					GBP	385.000	Eversholt Funding plc 2.74% 30/06/2040	853.109	0,22
EUR	1.400.000	CaixaBank SA 0.38% 03/02/2025	1.643.952	0,42	GBP	631.000	Eversholt Funding plc 3.53% 07/08/2042	554.196	0,14
EUR	309.000	Nortegas Energia Distribucion SAU 2.07% 28/09/2027	392.280	0,10	GBP	1.940.000	First Hydro Finance plc 9.00% 31/07/2021	2.661.887	0,68
<b>Spanien, insgesamt</b>				<b>0,52</b>	EUR	2.006.000	G4S International Finance plc 1.88% 24/05/2025	2.370.137	0,61

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond

### Portfolioaufstellung

(Fortsetzung)

	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts		Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>					<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>					<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				
<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH (Fortsetzung)</b>					<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH (Fortsetzung)</b>				
GBP	425.000	GKN Holdings plc 4.63% 12/05/2032	899.426	0,23	EUR	1.463.000	Vodafone Group plc FRN 27/08/2080	1.710.187	0,44
GBP	719.000	GKN Holdings plc 5.38% 19/09/2022	570.825	0,15	GBP	720.000	Western Power Distribution plc 3.50% 16/10/2026	1.028.554	0,26
EUR	28.000	HBOS plc FRN 18/03/2030	36.306	0,01	<b>Vereinigtes Königreich, insgesamt</b>				
EUR	424.000	HBOS plc FRN 18/03/2030	549.783	0,14	<b>45.815.462 11,76</b>				
GBP	904.000	HSBC Bank plc 5.38% 22/08/2033	1.541.080	0,40	<b>VEREINIGTE STAATEN</b>				
USD	850.000	Imperial Brands Finance plc 3.50% 26/07/2026	921.817	0,24	USD	967.000	AbbVie Inc. 4.88% 14/11/2048	1.228.503	0,32
GBP	453.000	Imperial Brands Finance plc 5.50% 28/09/2026	708.516	0,18	USD	981.000	Amazon.com Inc. 2.70% 03/06/2060	1.011.962	0,26
GBP	278.000	Legal & General Group plc FRN 01/11/2050	391.051	0,10	USD	569.000	American International Group Inc. 3.40% 30/06/2030	629.700	0,16
GBP	170.000	Legal & General Group plc FRN 27/06/2064	259.936	0,07	USD	609.000	American International Group Inc. 3.90% 01/04/2026	693.315	0,18
GBP	750.000	Lloyds Bank Corporate Markets plc 1.75% 11/07/2024	993.935	0,26	EUR	928.000	American Tower Corp. 1.00% 15/01/2032	1.085.876	0,28
GBP	425.000	Lloyds Bank plc 6.50% 17/09/2040	969.315	0,25	USD	805.000	Amgen Inc. 3.15% 21/02/2040	858.058	0,22
EUR	780.000	National Grid Electricity Transmission plc 0.82% 07/07/2032	934.436	0,24	USD	2.012.000	Anheuser-Busch Companies LLC 4.70% 01/02/2036	2.418.793	0,62
EUR	690.000	Natwest Group plc FRN 02/03/2026	837.281	0,21	USD	949.000	Anheuser-Busch Inbev Worldwide Inc. 5.45% 23/01/2039	1.230.560	0,32
USD	500.000	Natwest Group plc FRN 22/05/2028	527.896	0,14	USD	1.708.000	Apple Inc. 2.65% 11/05/2050	1.777.951	0,46
USD	1.255.000	Natwest Group plc FRN 08/05/2030	1.447.226	0,37	USD	331.000	Apple Inc. 4.50% 23/02/2036	443.002	0,11
EUR	607.000	NatWest Markets plc 1.00% 28/05/2024	722.561	0,19	USD	786.000	Arizona Public Service Company 3.35% 15/05/2050	866.419	0,22
EUR	821.000	NGG Finance plc FRN 05/09/2082	945.110	0,24	EUR	250.000	AT&T Inc. 2.05% 19/05/2032	319.093	0,08
GBP	255.000	Pension Insurance Corp plc 5.63% 20/09/2030	387.635	0,10	USD	731.000	AT&T Inc. 2.30% 01/06/2027	767.455	0,20
GBP	483.000	Phoenix Group 5.63% 28/04/2031	713.427	0,18	USD	733.000	AT&T Inc. 3.10% 01/02/2043	717.051	0,18
GBP	270.000	Santander UK plc Perp 10.06%	563.144	0,14	USD	535.000	AT&T Inc. 3.50% 01/06/2041	563.177	0,14
EUR	921.000	SSE plc Perp FRN	1.106.047	0,28	CAD	1.500.000	AT&T Inc. 4.00% 25/11/2025	1.257.088	0,32
GBP	475.000	Telereal FRN 10/12/2033	629.163	0,16	USD	1.972.000	AT&T Inc. 4.90% 15/08/2037	2.387.061	0,61
GBP	146.623	Telereal 4.97% 10/09/2027	214.717	0,06	USD	2.417.000	Bank of America Corp. FRN 13/02/2031	2.532.496	0,65
GBP	436.185	Tesco Property Finance 7.62% 13/07/2039	841.691	0,22	USD	1.933.000	Bank of America Corp. FRN 29/04/2031	2.044.792	0,52
GBP	844.144	Tesco Property Finance 3 plc 5.74% 13/04/2040	1.453.334	0,37	USD	1.198.000	Bank of America Corp. FRN 23/07/2030	1.325.037	0,34
GBP	509.253	Tesco Property Finance 5 plc 5.66% 13/10/2041	880.815	0,23	USD	1.998.000	BAT Capital Corp. 4.70% 02/04/2027	2.293.542	0,59
GBP	558.000	Thames Water Utilities Finance plc 2.38% 22/04/2040	749.137	0,19	EUR	1.052.000	Becton Dickinson & Company 1.90% 15/12/2026	1.314.307	0,34
GBP	729.000	Tsb Banking Group plc FRN 06/05/2026	955.887	0,25	GBP	1.298.000	Becton Dickinson & Company 3.02% 24/05/2025	1.803.915	0,46
					USD	844.000	Berkshire Hathaway Finance Corp 4.25% 15/01/2049	1.096.034	0,28
					USD	450.000	Boeing Company 3.95% 01/08/2059	419.043	0,11

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond

### Portfolioaufstellung

(Fortsetzung)

	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts		Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>					<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>					<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				
<b>VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)</b>					<b>VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)</b>				
USD	750.000	Boeing Company 5.93% 01/05/2060	927.949	0,24	EUR	454.000	Fidelity National Information Services Inc. 2.00% 21/05/2030	1.643.758	0,42
USD	1.027.000	Broadcom Cayman Finance 3.50% 15/01/2028	1.113.730	0,29	EUR	917.000	Fidelity National Information Services Inc. 2.00% 21/05/2030	635.206	0,16
USD	1.002.000	Broadcom Inc. 4.15% 15/11/2030	1.122.854	0,29	EUR	1.268.000	Fidelity National Information Services Inc. 2.95% 21/05/2039	646.495	0,17
USD	530.000	Burlington Northern Santa Fe LLC 4.38% 01/09/2042	669.130	0,17	EUR	1.015.000	Fiserv Inc. 1.13% 01/07/2027	609.678	0,16
USD	398.000	CenterPoint Energy Houston Electric LLC 2.90% 01/07/2050	421.045	0,11	EUR	500.000	Fiserv Inc. 1.63% 01/07/2030	1.274.062	0,33
USD	1.084.000	Charter Communications Operating LLC FRN 01/02/2024	542.659	0,14	EUR	202.000	General Electric Company 2.13% 17/05/2037	231.184	0,06
USD	530.000	Charter Communications Operating LLC 4.80% 01/03/2050	1.238.392	0,32	USD	491.000	Georgia Power Company 3.70% 30/01/2050	550.418	0,14
EUR	1.060.000	Chubb Ina Holdings I 0.88% 15/12/2029	1.274.236	0,33	EUR	1.192.000	Honeywell Internation 0.75% 10/03/2032	1.409.802	0,36
USD	744.000	Cigna Corp. 4.90% 15/12/2048	967.187	0,25	USD	849.000	Intel Corp. 4.75% 25/03/2050	1.166.609	0,29
USD	1.100.000	Citigroup Inc. FRN 06/07/2026	1.233.119	0,32	EUR	800.000	International Business Machines Corp. 1.75% 31/01/2031	1.058.565	0,27
EUR	1.012.000	Citigroup Inc. FRN 31/03/2031	1.319.918	0,34	USD	1.059.000	International Business Machines Corp. 1.95% 15/05/2030	1.092.683	0,28
USD	895.000	Comcast Corp. 2.65% 15/08/2062	849.354	0,22	EUR	330.000	IQVIA Inc. 2.88% 15/09/2025	390.359	0,10
USD	303.000	Consolidated Edison Co of NY 3.95% 01/04/2050	364.468	0,09	EUR	360.000	IQVIA Inc. 3.25% 15/03/2025	425.890	0,11
USD	562.000	Consumers Energy Company 2.50% 01/05/2060	529.770	0,14	USD	955.000	Johnson & Johnson 2.10% 01/09/2040	954.158	0,24
USD	1.136.000	CSX Corp. 3.80% 01/11/2046	174.409	0,04	USD	945.000	Johnson & Johnson 2.45% 01/09/2060	947.539	0,24
USD	150.000	CSX Corp. 3.80% 15/04/2050	1.356.053	0,35	USD	2.381.000	JPMorgan Chase & Company FRN 22/04/2041	2.595.275	0,67
USD	870.000	CVS Health Corp. 2.70% 21/08/2040	832.102	0,21	USD	1.542.000	JPMorgan Chase & Company FRN 24/07/2038	1.824.359	0,47
USD	701.000	CVS Health Corp. 5.05% 25/03/2048	893.477	0,23	USD	1.173.000	Kinder Morgan Energy Partners LP 5.00% 01/03/2043	1.306.662	0,33
EUR	2.184.000	Digital Euro Finco LLC 2.50% 16/01/2026	2.816.907	0,72	GBP	2.397.000	Kraft Heinz Foods Company 4.13% 01/07/2027	3.362.327	0,87
USD	561.000	Discovery Communications LLC 5.30% 15/05/2049	688.880	0,18	USD	965.000	Kraft Heinz Foods Company 4.38% 01/06/2046	985.506	0,25
USD	1.525.000	DTE Energy Company 1.05% 01/06/2025	1.529.191	0,39	USD	1.360.000	Merck & Company Inc. 2.35% 24/06/2040	1.382.723	0,35
USD	1.979.000	Duke Energy Carolinas LLC 3.20% 15/08/2049	2.196.416	0,57	USD	2.018.000	Microsoft Corp. 4.10% 06/02/2037	2.628.146	0,67
USD	925.000	Duke Energy Progress Inc. 4.20% 15/08/2045	1.157.704	0,30	USD	740.000	Mondelez International Inc. 2.63% 04/09/2050	713.137	0,18
USD	776.000	Enterprise Products Operating LLC 3.70% 31/01/2051	765.747	0,20	USD	350.000	Nevada Power Company 6.65% 01/04/2036	524.141	0,13
EUR	1.315.000	Equinix Inc. 2.88% 01/10/2025	1.566.525	0,40	USD	925.000	Nisource Finance Corp. 4.38% 15/05/2047	1.145.850	0,29
USD	580.000	Eversholt Funding plc 3.45% 15/01/2050	646.600	0,17	USD	2.687.000	Nisource Finance Corp. 4.80% 15/02/2044	3.367.973	0,86
USD	335.000	Fedex Corp. 4.95% 17/10/2048	430.458	0,11					
EUR	700.000	Fidelity National Information SE 1.50% 21/05/2027	874.357	0,22					
EUR	490.000	Fidelity National Information Services Inc. 1.50% 21/05/2027	1.145.407	0,29					

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.



## Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond

### Portfolioaufstellung

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts		
<b>Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere</b>				<b>Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere (Fortsetzung)</b>					
<b>Anleihen</b>				<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>					
<b>FRANKREICH</b>				<b>VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)</b>					
USD	1.516.000	BPCE SA 2.70% 01/10/2029	1.632.289	0,42	USD	501.000	Transcontinental Gas Pipe Line LLC 3.25% 15/05/2030	541.664	0,14
<b>Frankreich, insgesamt</b>			<b>1.632.289</b>	<b>0,42</b>	<b>Vereinigte Staaten, insgesamt</b>			<b>15.290.918</b>	<b>3,92</b>
<b>NIEDERLANDE</b>				<b>Anleihen, insgesamt</b>				<b>17.720.532</b>	<b>4,54</b>
USD	249.000	E.ON International Finance BV 6.65% 30/04/2038	358.189	0,09	<b>Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere, insgesamt</b>				
USD	409.000	Vonovia Finance BV 5.00% 02/10/2023	439.136	0,11	<b>17.720.532</b>			<b>4,54</b>	
<b>Niederlande, insgesamt</b>			<b>797.325</b>	<b>0,20</b>	<b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>				
<b>VEREINIGTE STAATEN</b>				<b>Anleihen</b>					
USD	2.059.000	AbbVie Inc. 4.25% 21/11/2049	2.433.819	0,63	<b>AUSTRALIEN</b>				
USD	481.000	Appalachian Power Company 3.70% 01/05/2050	549.324	0,14	USD	1.307.000	APT Pipelines Limited 4.25% 15/07/2027	1.477.771	0,38
USD	322.000	Appalachian Power Company 4.40% 15/05/2044	388.517	0,10	USD	1.113.000	Sydney Airport Finance Company Pty Limited 3.63% 28/04/2026	1.198.666	0,30
USD	2.181.000	AT&T Inc. 3.50% 15/09/2053	2.112.995	0,54	USD	3.408.000	Woodside Finance Limited 4.50% 04/03/2029	3.815.087	0,99
USD	630.000	Broadcom Inc. 5.00% 15/04/2030	744.243	0,19	<b>Australien, insgesamt</b>			<b>6.491.524</b>	<b>1,67</b>
USD	2.713.000	Carrier Global Corp. 2.72% 15/02/2030	2.837.143	0,73	<b>BERMUDAS</b>				
USD	343.000	Commonwealth Edison Company 4.00% 01/03/2049	425.294	0,11	USD	3.606.000	Bacardi Limited 4.45% 15/05/2025	4.022.837	1,03
USD	500.000	Enterprise Products Operating LLC 3.20% 15/02/2052	456.081	0,12	<b>Bermudas, insgesamt</b>			<b>4.022.837</b>	<b>1,03</b>
USD	212.000	Erac USA Finance LLC P.P. 144A 4.50% 15/02/2045	251.399	0,06	<b>KAIMANINSELN</b>				
USD	568.000	Guardian Life Insurance Company of America 4.85% 24/01/2077	738.183	0,19	USD	101.000	Noble Holding International Limited 8.95% 01/04/2045	1.010	0,00
USD	676.000	Indiana Michigan Power Company 3.75% 01/07/2047	786.470	0,20	<b>Kaimaninseln, insgesamt</b>			<b>1.010</b>	<b>0,00</b>
USD	81.000	Indiana Michigan Power Company 6.05% 15/03/2037	113.292	0,03	<b>ITALIEN</b>				
USD	410.000	Metropolitan Edison Company 4.30% 15/01/2029	479.329	0,12	USD	300.000	Intesa Sanpaolo SpA 4.00% 23/09/2029	327.375	0,08
USD	393.000	New York Life Insurance Company 4.45% 04/04/2069	482.174	0,12	<b>Italien, insgesamt</b>			<b>327.375</b>	<b>0,08</b>
USD	394.000	Northwestern Mutual 3.85% 30/09/2047	448.856	0,12	<b>NORWEGEN</b>				
USD	437.000	Southwestern Public Service Company 3.15% 01/05/2050	471.910	0,12	USD	2.117.000	Dnb Bank ASA 144A 1.13% 16/09/2026	2.116.133	0,54
USD	289.000	Teachers Insurance & Annuity Association America 4.90% 15/09/2044	365.198	0,09	<b>Norwegen, insgesamt</b>			<b>2.116.133</b>	<b>0,54</b>
USD	567.000	Teachers Insurance & Annuity Association of America 4.27% 15/05/2047	665.027	0,17					

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond

### Portfolioaufstellung

(Fortsetzung)

	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts
<b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente (Fortsetzung)</b>				
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				
<b>PORTUGAL</b>				
EUR	200.000	Banco Espirito Santo SA 4.00% 21/01/2021	50.837	0,01
		<b>Portugal, insgesamt</b>	<b>50.837</b>	<b>0,01</b>
<b>VEREINIGTE STAATEN</b>				
USD	495.000	Peachtree Fund Trust 3.98% 15/02/2025	543.958	0,14
		<b>Vereinigte Staaten, insgesamt</b>	<b>543.958</b>	<b>0,14</b>
		<b>Anleihen, insgesamt</b>	<b>13.553.674</b>	<b>3,47</b>
		<b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, insgesamt</b>	<b>13.553.674</b>	<b>3,47</b>
<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren</b>				
<b>Fonds</b>				
<b>IRLAND</b>				
	15.926.632	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	15.926.632	4,09
		<b>Irland, insgesamt</b>	<b>15.926.632</b>	<b>4,09</b>
		<b>Fonds, insgesamt</b>	<b>15.926.632</b>	<b>4,09</b>
		<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren, insgesamt</b>	<b>15.926.632</b>	<b>4,09</b>
		<b>Wert der Anlagen, insgesamt</b>	<b>381.853.787</b>	<b>98,03</b>
<b>(Gesamtkosten: USD 358.684.838)</b>				



## Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond

### Portfolioaufstellung

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Nettoinven- tarwerts	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Nettoinven- tarwerts		
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>					
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>					
<b>DEUTSCHLAND (Fortsetzung)</b>				<b>LUXEMBURG (Fortsetzung)</b>					
EUR	800.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0.00% 30/06/2022	808.936	0,56	EUR	1.467.000	Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1.21% 04/06/2026	1.507.631	1,04
EUR	500.000	Vier Gas Transport GmbH 0.50% 10/09/2034	495.190	0,34	EUR	489.000	CPI Property Group SA 1.63% 23/04/2027	474.056	0,33
EUR	800.000	Volkswagen Bank GmbH 1.25% 10/06/2024	816.236	0,56	EUR	1.000.000	Grand City Properties SA 1.38% 03/08/2026	1.045.106	0,72
EUR	265.000	Volkswagen Financial Services AG 3.38% 06/04/2028	308.237	0,21	EUR	713.000	Medtronic Global Holdings SCA 0.00% 15/03/2023	715.110	0,49
		<b>Deutschland, insgesamt</b>	<b>12.235.657</b>	<b>8,43</b>	EUR	1.029.000	Medtronic Global Holdings SCA 1.38% 15/10/2040	1.054.423	0,72
					EUR	904.000	Novartis Finance SA 0.00% 23/09/2028	903.210	0,62
<b>IRLAND</b>					EUR	493.000	Prologis International Funding II SA 1.63% 17/06/2032	535.678	0,37
EUR	920.000	AIB Group plc FRN 19/11/2029	890.702	0,61	EUR	526.000	Selp Finance Sarl 1.25% 25/10/2023	538.036	0,37
EUR	493.000	Bank of Ireland Group plc FRN 14/10/2029	486.928	0,34			<b>Luxemburg, insgesamt</b>	<b>8.306.962</b>	<b>5,71</b>
EUR	417.000	Zurich Finance Ireland Designated Activity Company 1.63% 17/06/2039	478.658	0,33	<b>MEXIKO</b>				
		<b>Irland, insgesamt</b>	<b>1.856.288</b>	<b>1,28</b>	EUR	300.000	Petroleos Mexicanos 4.75% 26/02/2029	258.015	0,18
<b>ITALIEN</b>							<b>Mexiko, insgesamt</b>	<b>258.015</b>	<b>0,18</b>
EUR	942.000	Aeroporti di Roma SpA 1.63% 08/06/2027	924.455	0,64	<b>NIEDERLANDE</b>				
EUR	283.000	Assicurazioni Generali SpA 5.00% 08/06/2048	327.197	0,23	EUR	200.000	ABN Amro Bank NV 0.60% 15/01/2027	203.273	0,14
EUR	420.000	Autostrade per l'Italia SpA 1.75% 01/02/2027	396.149	0,27	EUR	1.300.000	ABN Amro Bank NV 1.25% 28/05/2025	1.357.848	0,94
EUR	911.000	FCA Bank SpA 0.50% 13/09/2024	907.279	0,63	EUR	749.000	Achmea BV 1.50% 26/05/2027	791.541	0,55
		<b>Italien, insgesamt</b>	<b>2.555.080</b>	<b>1,77</b>	EUR	260.000	Airbus SE 2.38% 07/04/2032	282.296	0,19
<b>JAPAN</b>					EUR	100.000	Airbus SE 2.38% 09/06/2040	101.896	0,07
EUR	1.400.000	Sumitomo Mitsui Banking Corp. 0.01% 10/09/2025	1.414.138	0,97	EUR	300.000	Cooperatieve Rabobank UA FRN 05/05/2028	312.064	0,22
		<b>Japan, insgesamt</b>	<b>1.414.138</b>	<b>0,97</b>	EUR	900.000	Cooperatieve Rabobank UA FRN 05/05/2028	936.192	0,65
<b>JERSEY – KANALINSELN</b>					EUR	412.000	Digital Dutch Finco BV 1.50% 15/03/2030	431.243	0,30
GBP	349.000	Glencore Finance Europe Limited 3.13% 26/03/2026	407.218	0,28	EUR	482.000	Enexis Holding NV 0.63% 17/06/2032	500.592	0,35
EUR	487.000	Heathrow Funding Limited 1.88% 14/03/2034	455.274	0,31	EUR	118.000	Enexis Holding NV 0.63% 17/06/2032	122.552	0,08
		<b>Jersey – Kanalinseln, insgesamt</b>	<b>862.492</b>	<b>0,59</b>	EUR	790.000	Enexis Holding NV 0.75% 02/07/2031	829.973	0,57
<b>LUXEMBURG</b>					EUR	576.000	Heineken NV 1.25% 07/05/2033	597.111	0,41
EUR	900.000	Aroundtown SA 1.45% 09/07/2028	915.024	0,62	EUR	900.000	ING Groep NV FRN 26/05/2031	936.321	0,65
EUR	600.000	Aroundtown SA 1.63% 31/01/2028	618.688	0,43	EUR	750.000	NE Property BV 1.88% 09/10/2026	695.591	0,48

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.



## Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond

### Portfolioaufstellung

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Nettoinven- tarwerts	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Nettoinven- tarwerts		
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>					
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>					
<b>NIEDERLANDE (Fortsetzung)</b>				<b>SCHWEIZ</b>					
EUR	215.000	NE Property BV 3.38% 14/07/2027	216.919	0,15	EUR	630.000	Credit Suisse AG 0.45% 19/05/2025	644.425	0,44
EUR	400.000	Redexis Gas Finance Sarl 1.88% 28/05/2025	418.765	0,29	EUR	533.000	Credit Suisse Group AG FRN 02/04/2026	596.618	0,41
EUR	1.417.000	Relx Finance BV 0.50% 10/03/2028	1.423.364	0,98	<b>Schweiz, insgesamt</b>				
EUR	345.000	Shell International Finance Bv 1.88% 07/04/2032	390.345	0,27	<b>1.241.043 0,85</b>				
EUR	780.000	Stedin Holding NV 0.50% 14/11/2029	792.592	0,55	<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH</b>				
EUR	984.000	Stedin Holding NV Perp FRN	1.006.546	0,69	EUR	340.000	BAT International Finance plc 1.25% 13/03/2027	347.931	0,24
EUR	600.000	Syngenta Finance NV 1.25% 10/09/2027	576.841	0,40	EUR	520.000	BAT International Finance plc 2.75% 25/03/2025	574.715	0,40
EUR	775.000	Syngenta Finance NV 3.38% 16/04/2026	834.024	0,57	EUR	1.451.000	BP Capital Markets plc 0.83% 08/11/2027	1.486.477	1,03
EUR	1.300.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	1.373.981	0,94	EUR	864.000	BP Capital Markets plc Perp FRN	890.195	0,61
EUR	855.000	TenneT Holding BV Perp FRN	867.696	0,60	EUR	440.000	British Telecommunications plc 1.50% 23/06/2027	459.574	0,32
EUR	481.000	TenneT Holding BV Perp FRN	501.349	0,35	EUR	1.278.000	Cadent Finance plc 0.63% 22/09/2024	1.304.583	0,90
EUR	443.000	Upjohn Finance BV 1.91% 23/06/2032	461.985	0,32	EUR	252.000	Cadent Finance plc 0.75% 11/03/2032	251.611	0,17
EUR	700.000	Volkswagen International Finance NV 4.13% 16/11/2038	947.756	0,66	GBP	628.509	Delamare Finance plc 5.55% 19/02/2029	797.230	0,55
<b>Niederlande, insgesamt</b>			<b>17.910.656</b>	<b>12,37</b>	EUR	1.712.000	DS Smith plc 0.88% 12/09/2026	1.709.626	1,18
<b>NORWEGEN</b>				EUR 598.000 Experian Finance plc 1.38% 25/06/2026				631.207	0,44
EUR	2.301.000	Dnb Bank ASA 0.25% 09/04/2024	2.331.170	1,60	GBP	850.000	First Hydro Finance plc 9.00% 31/07/2021	994.576	0,68
EUR	940.000	Dnb Bank ASA FRN 20/03/2028	957.297	0,66	EUR	1.125.000	G4S International Finance plc 1.50% 02/06/2024	1.132.242	0,78
<b>Norwegen, insgesamt</b>			<b>3.288.467</b>	<b>2,26</b>	EUR	100.000	G4S International Finance plc 1.88% 24/05/2025	100.757	0,07
<b>SPANIEN</b>				GBP 529.000 GKN Holdings plc 5.38% 19/09/2022				605.900	0,42
EUR	400.000	Abertis Infraestructuras SA 3.00% 27/03/2031	432.311	0,30	EUR	735.000	HBOS plc FRN 18/03/2030	812.726	0,56
EUR	700.000	Bankia SA FRN 15/02/2029	741.590	0,51	EUR	738.000	Imperial Brands Finance plc 1.13% 14/08/2023	755.800	0,52
EUR	300.000	Caixabank SA 1.13% 17/05/2024	309.300	0,21	EUR	978.000	Imperial Brands Finance plc 3.38% 26/02/2026	1.104.030	0,76
EUR	1.200.000	CaixaBank SA 0.38% 03/02/2025	1.201.639	0,83	EUR	368.000	National Grid Electricity Transmission plc 0.82% 07/07/2032	375.954	0,26
EUR	195.000	Nortegas Energia Distribucion SAU 2.07% 28/09/2027	211.107	0,15	EUR	872.000	Nationwide Building Society 0.25% 22/07/2025	871.010	0,60
<b>Spanien, insgesamt</b>			<b>2.895.947</b>	<b>2,00</b>	EUR	610.000	Natwest Group plc FRN 02/03/2026	631.224	0,44
<b>SCHWEDEN</b>				EUR 997.000 NatWest Markets plc 1.00% 28/05/2024				1.012.075	0,70
EUR	2.050.000	Akelius Residential Property AB 1.75% 07/02/2025	2.140.882	1,47	<b>Schweden, insgesamt</b>				
EUR	350.000	Essity AB 1.63% 30/03/2027	380.667	0,26	<b>3.821.123 2,63</b>				
EUR	633.000	Sagax AB 1.13% 30/01/2027	621.180	0,43					
EUR	657.000	Sagax AB 2.00% 17/01/2024	678.394	0,47					

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.



## Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond

### Portfolioaufstellung

(Fortsetzung)

Nennwert		Anlage	Marktwert EUR	% des Nettoinven- tarwerts	Nennwert		Anlage	Marktwert EUR	% des Nettoinven- tarwerts
<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)</b>					<b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>				
<b>SUPRANATIONAL</b>					<b>Anleihen</b>				
EUR	1.000.000	EBRD 0.00% 10/01/2024	1.016.541	0,70	<b>BERMUDAS</b>				
EUR	2.700.000	European Investment Bank 0.50% 15/11/2023	2.799.406	1,93	USD	340.000	Bacardi Limited 4.45% 15/05/2025	323.457	0,22
<b>Supranational, insgesamt</b>			<b>3.815.947</b>	<b>2,63</b>	<b>Bermudas, insgesamt</b>				
					<b>323.457 0,22</b>				
<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente, insgesamt</b>					<b>ITALIEN</b>				
			<b>7.556.718</b>	<b>5,21</b>	USD	500.000	Intesa Sanpaolo SpA 4.00% 23/09/2029	465.292	0,32
<b>Wandelanleihen</b>					<b>Italien, insgesamt</b>				
					<b>465.292 0,32</b>				
<b>FRANKREICH</b>					<b>PORTUGAL</b>				
GBP	100.000	Orange SA 0.38% 27/06/2021	109.640	0,08	EUR	600.000	Banco Espirito Santo SA 4.00% 21/01/2021	130.057	0,09
<b>Frankreich, insgesamt</b>			<b>109.640</b>	<b>0,08</b>	<b>Portugal, insgesamt</b>				
					<b>130.057 0,09</b>				
<b>WandelAnleihen, insgesamt</b>					<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH</b>				
			<b>109.640</b>	<b>0,08</b>	GBP	300.000	Cattles Limited 7.13% 05/07/2047	364	0,00
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt</b>					<b>Lehman Brothers UK Capital Funding III LP Perp 3.88%*</b>				
			<b>135.518.808</b>	<b>93,43</b>	EUR	350.000		0	0,00
<b>Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere</b>					<b>Vereinigtes Königreich, insgesamt</b>				
					<b>364 0,00</b>				
<b>Anleihen</b>					<b>Anleihen, insgesamt</b>				
					<b>919.170 0,63</b>				
<b>BERMUDAS</b>					<b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, insgesamt</b>				
USD	750.000	Bacardi Limited 4.70% 15/05/2028	742.961	0,51	<b>919.170 0,63</b>				
<b>Bermudas, insgesamt</b>			<b>742.961</b>	<b>0,51</b>	<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren</b>				
<b>FRANKREICH</b>					<b>Fonds</b>				
USD	1.350.000	BPCE SA 2.70% 01/10/2029	1.239.547	0,85	<b>IRLAND</b>				
<b>Frankreich, insgesamt</b>			<b>1.239.547</b>	<b>0,85</b>	40.772	BlackRock Institutional Cash Series Euro Liquidity Fund Premier		4.044.667	2,79
<b>NIEDERLANDE</b>					<b>Irland, insgesamt</b>				
USD	1.150.000	Vonovia Finance BV 5.00% 02/10/2023	1.052.944	0,72	<b>4.044.667 2,79</b>				
<b>Niederlande, insgesamt</b>			<b>1.052.944</b>	<b>0,72</b>	<b>Fonds, insgesamt</b>				
					<b>4.044.667 2,79</b>				
<b>Anleihen, insgesamt</b>					<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren, insgesamt</b>				
			<b>3.035.452</b>	<b>2,08</b>	<b>4.044.667 2,79</b>				
<b>Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere, insgesamt</b>					<b>Wert der Anlagen, insgesamt</b>				
			<b>3.035.452</b>	<b>2,08</b>	<b>143.518.097 98,93</b>				
					<b>(Gesamtkosten: EUR 139.284.175)</b>				
					<i>*Wertpapiere zum beizulegenden Zeitwert.</i>				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond

### Portfolioaufstellung

zum 30. September 2020

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Nettoinven- tarwerts	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Nettoinven- tarwerts
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>			
<b>Anleihen</b>				<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>			
<b>BELGIEN</b>				<b>FRANKREICH (Fortsetzung)</b>			
EUR	3.100.000	Belfius Bank SA Perp FRN	3.177.499	0,61	EUR	2.300.000	Casino Guichard-Perrachon SA
EUR	1.771.000	House of Finance NV 4.38% 15/07/2026	1.631.090	0,31	EUR	414.000	4.50% 07/03/2024
EUR	1.000.000	Solvay SA Perp FRN	985.946	0,19	EUR	830.000	CMA CGM SA 6.50% 15/07/2022
EUR	200.000	Solvay SA Perp FRN	210.874	0,04	EUR	2.549.000	Credit Agricole SA Perp FRN
		<b>Belgien, insgesamt</b>	<b>6.005.409</b>	<b>1,15</b>	EUR	2.549.000	Crown European Holdings SA
					EUR	687.000	2.63% 30/09/2024
					EUR	850.000	Crown European Holdings SA
					EUR	2.000.000	2.88% 01/02/2026
					EUR	800.000	Crown European Holdings SA
					EUR	1.800.000	3.38% 15/05/2025
					EUR	3.400.000	Electricite de France SA Perp
					EUR	2.100.000	FRN
					EUR	1.400.000	Electricite de France SA Perp
					EUR	1.200.000	FRN
					EUR	2.200.000	Electricite de France SA Perp
					EUR	1.600.000	FRN
					EUR	356.000	Electricite de France SA Perp
					EUR	1.537.000	FRN
					EUR	435.000	Electricite de France SA Perp
					EUR	715.000	FRN
					EUR	949.000	1.780.060
					EUR	480.000	0,34
					EUR	2.093.000	1.306.020
					EUR	809.000	0,25
					EUR	1.340.000	1.117.727
					EUR	1.009.000	0,21
					EUR	1.083.000	2.168.910
					EUR	905.000	0,42
					EUR	2.097.000	1.624.256
					EUR	507.000	0,31
					EUR	183.000	153.875
					EUR	1.102.000	0,03
					EUR	425.000	1.454.098
					EUR	425.000	0,28
					EUR	425.000	429.652
					EUR	425.000	0,08
					EUR	425.000	712.427
					EUR	425.000	0,14
					EUR	425.000	946.167
					EUR	425.000	0,18
					EUR	425.000	447.706
					EUR	425.000	0,09
					EUR	425.000	1.777.686
					EUR	425.000	0,34
					EUR	425.000	689.395
					EUR	425.000	0,13
					EUR	425.000	1.280.810
					EUR	425.000	0,25
					EUR	425.000	998.910
					EUR	425.000	0,19
					EUR	425.000	1.080.829
					EUR	425.000	0,21
					EUR	425.000	818.558
					EUR	425.000	0,16
					EUR	425.000	2.000.856
					EUR	425.000	0,38
					EUR	425.000	486.239
					EUR	425.000	0,09
					EUR	425.000	189.709
					EUR	425.000	0,04
					EUR	425.000	1.304.657
					EUR	425.000	0,25
					EUR	425.000	492.896
					EUR	425.000	0,09

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.



## Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond

### Portfolioaufstellung

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Nettoinven- tarwerts	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Nettoinven- tarwerts		
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>					
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>					
<b>ISLE OF MAN</b>				<b>ITALIEN (Fortsetzung)</b>					
EUR	1.357.000	Playtech plc 3.75% 12/10/2023	1.357.598	0,26	EUR	375.000	Telecom Italia SpA 3.25% 16/01/2023	393.051	0,08
EUR	584.000	Playtech plc 4.25% 07/03/2026	588.681	0,11	EUR	2.106.000	Telecom Italia SpA 3.63% 25/05/2026	2.262.568	0,43
		<b>Isle of Man, insgesamt</b>	<b>1.946.279</b>	<b>0,37</b>	EUR	446.000	Telecom Italia SpA 4.00% 11/04/2024	474.437	0,09
<b>ITALIEN</b>				EUR	600.000	Telecom Italia SpA 5.25% 10/02/2022	638.171	0,12	
EUR	687.000	Atlantia SpA 1.63% 03/02/2025	654.897	0,12	EUR	600.000	Telecom Italia SpA 5.25% 17/03/2025	706.898	0,14
EUR	656.000	Atlantia SpA 1.88% 13/07/2027	617.126	0,12			<b>Italien, insgesamt</b>	<b>34.602.009</b>	<b>6,64</b>
EUR	487.000	Autostrade per l'Italia SpA 1.13% 04/11/2021	474.086	0,09	<b>JAPAN</b>				
EUR	1.109.000	Autostrade per l'Italia SpA 1.63% 12/06/2023	1.081.058	0,21	EUR	830.000	SoftBank Group Corp 4.00% 20/04/2023	860.988	0,17
EUR	624.000	Autostrade per l'Italia SpA 1.63% 12/06/2023	608.278	0,12	EUR	4.128.000	SoftBank Group Corp 5.00% 15/04/2028	4.391.285	0,84
EUR	189.000	Autostrade per l'Italia SpA 1.75% 26/06/2026	179.760	0,03			<b>Japan, insgesamt</b>	<b>5.252.273</b>	<b>1,01</b>
EUR	1.910.000	Autostrade per l'Italia SpA 1.88% 04/11/2025	1.841.852	0,36	<b>JERSEY – KANALINSELN</b>				
EUR	1.165.000	Autostrade per l'Italia SpA 4.38% 16/09/2025	1.269.918	0,24	EUR	1.114.000	Adient Global Holdings Limited 3.50% 15/08/2024	1.029.170	0,20
EUR	1.600.000	Autostrade per l'Italia SpA 5.88% 09/06/2024	1.787.952	0,34	EUR	2.959.000	Avis Budget Finance plc 4.75% 30/01/2026	2.538.541	0,49
GBP	433.000	Autostrade per l'Italia SpA 6.25% 09/06/2022	504.611	0,10	GBP	630.000	CPUK Finance Limited 6.50% 28/08/2026	685.090	0,13
EUR	2.323.000	Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 2.63% 28/04/2025	2.307.470	0,44	EUR	3.522.444	Lhc3 plc 4.13% 15/08/2024	3.535.653	0,68
EUR	1.228.000	Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 3.63% 24/09/2024	1.266.605	0,24			<b>Jersey – Kanalinseln, insgesamt</b>	<b>7.788.454</b>	<b>1,50</b>
EUR	622.000	Enel SpA FRN 24/05/2080	661.030	0,13	<b>LUXEMBURG</b>				
EUR	201.000	Enel SpA FRN 10/01/2074	225.068	0,04	EUR	1.700.000	ADO Properties SA 3.25% 05/08/2025	1.719.717	0,33
GBP	1.187.000	Enel SpA FRN 15/09/2076	1.373.566	0,26	EUR	987.000	Altice Financing SA 2.25% 15/01/2025	946.544	0,18
EUR	492.000	Enel SpA Perp FRN	492.239	0,09	EUR	2.530.000	Altice Financing SA 3.00% 15/01/2028	2.355.821	0,44
EUR	2.001.000	Infrastrutture Wireless Italiane SpA 1.88% 08/07/2026	2.028.128	0,39	EUR	2.511.000	Altice Finco SA 4.75% 15/01/2028	2.282.874	0,43
EUR	1.618.000	International Design Group SPA 6.50% 15/11/2025	1.537.561	0,30	EUR	1.045.000	Altice France Holding SA 4.00% 15/02/2028	954.822	0,18
EUR	378.000	Leonardo SpA 1.50% 07/06/2024	377.052	0,07	EUR	1.462.000	Aramark International Finance 3.13% 01/04/2025	1.402.514	0,27
EUR	1.007.000	Leonardo SpA 2.38% 08/01/2026	999.426	0,19	EUR	100.000	ArcelorMittal SA 1.00% 19/05/2023	98.541	0,02
EUR	894.000	Leonardo SpA 4.88% 24/03/2025	1.001.683	0,20	EUR	1.325.000	ArcelorMittal SA 2.25% 17/01/2024	1.348.301	0,26
EUR	1.179.000	Lkq Italia Bondco 3.88% 01/04/2024	1.240.582	0,24					
EUR	1.453.000	Nexi SpA 1.75% 31/10/2024	1.436.490	0,28					
EUR	2.115.000	Rossini Sarl 6.75% 30/10/2025	2.231.737	0,43					
EUR	1.193.000	Telecom Italia SpA 2.50% 19/07/2023	1.226.054	0,24					
EUR	2.341.000	Telecom Italia SpA 2.75% 15/04/2025	2.417.957	0,46					
EUR	275.000	Telecom Italia SpA 2.88% 28/01/2026	284.698	0,05					

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond

### Portfolioaufstellung

(Fortsetzung)

	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Nettoinven- tarwerts		Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Nettoinven- tarwerts	
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>					<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>					
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>					<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>					
<b>LUXEMBURG (Fortsetzung)</b>					<b>MEXIKO</b>					
EUR	2.233.292	ARD Finance SA 5.00% 30/06/2027	2.193.204	0,42	EUR	900.000	Cemex SAB de CV 2.75% 05/12/2024	895.440	0,17	
EUR	1.146.000	Ardagh Packaging Finance plc 2.13% 15/08/2026	1.115.509	0,21	EUR	300.000	Cemex SAB de CV 3.13% 19/03/2026	302.173	0,06	
GBP	1.947.000	B&M European Value Retail SA 3.63% 15/07/2025	2.190.042	0,43	USD	726.000	Cemex SAB De CV 7.75% 16/04/2026	652.256	0,13	
EUR	757.000	Cirsa Finance International Sarl 4.75% 22/05/2025	660.999	0,13	EUR	2.660.000	Petroleos Mexicanos 2.75% 21/04/2027	2.127.308	0,41	
EUR	1.352.000	Cirsa Finance International Sarl 6.25% 20/12/2023	1.237.778	0,24	EUR	2.516.000	Petroleos Mexicanos 4.75% 26/02/2029	2.163.886	0,42	
EUR	638.000	Codere Finance 2 Luxembourg SA 6.75% 01/11/2021	360.869	0,07	EUR	2.948.000	Petroleos Mexicanos 4.88% 21/02/2028	2.591.976	0,49	
EUR	840.000	CPI Property Group SA Perp FRN	830.495	0,16	USD	3.357.000	Petroleos Mexicanos 5.35% 12/02/2028	2.470.060	0,47	
EUR	843.000	CPI Property Group SA Perp FRN	827.487	0,16	USD	1.206.000	Petroleos Mexicanos 6.50% 23/01/2029	923.025	0,18	
EUR	1.340.000	Crystal Almond Sarl 4.25% 15/10/2024	1.320.893	0,25	<b>Mexiko, insgesamt</b>				<b>12.126.124</b>	<b>2,33</b>
EUR	1.547.000	Garfunkelux Holdco 3 SA 7.50% 01/08/2022	1.440.008	0,28	<b>NIEDERLANDE</b>					
GBP	1.761.000	Garfunkelux Holdco 3 SA 8.50% 01/11/2022	1.794.151	0,34	EUR	1.533.000	Ashland Services BV 2.00% 30/01/2028	1.464.382	0,28	
EUR	795.000	Gestamp Fund Lux 3.50% 15/05/2023	764.518	0,15	EUR	545.000	Constellium SE 4.25% 15/02/2026	544.702	0,11	
EUR	957.000	Groupe Ecore Holding SAS FRN 15/11/2023	687.457	0,13	EUR	2.729.000	Darling Global Finance BV 3.63% 15/05/2026	2.786.491	0,53	
EUR	1.808.000	Hanesbrands Inc. 3.50% 15/06/2024	1.884.321	0,36	EUR	455.000	Diebold Nixdorf Dutch Holding BV 9.00% 15/07/2025	470.035	0,09	
EUR	912.000	Holcim Finance Luxembourg SA Perp FRN	934.139	0,18	EUR	735.000	Dufry One BV 2.00% 15/02/2027	617.827	0,12	
EUR	550.000	Ineos Group Holdings SA 5.38% 01/08/2024	550.775	0,11	EUR	400.000	Dufry One BV 2.50% 15/10/2024	347.603	0,07	
EUR	2.205.000	Lincoln Financing SARL 3.63% 01/04/2024	2.125.235	0,41	EUR	767.000	Fiat Chrysler Automobiles NV 3.75% 29/03/2024	809.595	0,16	
EUR	1.736.000	Matterhorn Telecom SA 3.13% 15/09/2026	1.661.905	0,32	EUR	663.000	Fiat Chrysler Automobiles NV 3.88% 05/01/2026	717.910	0,14	
EUR	1.617.000	Motion Finco Sarl 7.00% 15/05/2025	1.601.022	0,31	EUR	2.553.000	Fiat Chrysler Automobiles NV 3.88% 05/01/2026	2.764.441	0,52	
EUR	670.000	PLT VII Finance Sarl 4.63% 05/01/2026	682.594	0,13	EUR	731.000	Fiat Chrysler Automobiles NV 4.50% 07/07/2028	833.972	0,16	
EUR	300.000	PLT VII Finance Sarl 4.63% 05/01/2026	305.639	0,06	EUR	1.155.000	Fiat Chrysler Automobiles NV 4.50% 07/07/2028	1.317.699	0,25	
EUR	2.599.000	Sig Combibloc Purchaseco Sarl 2.13% 18/06/2025	2.675.286	0,52	EUR	2.554.000	Intertrust Group BV 3.38% 15/11/2025	2.611.544	0,50	
EUR	1.318.000	Telecom Italia Finance SA 7.75% 24/01/2033	1.904.395	0,37	EUR	400.000	Kongsberg Actuation Systems BV 5.00% 15/07/2025	322.599	0,06	
EUR	1.600.000	Telenet Finance Luxembourg Notes Sarl 3.50% 01/03/2028	1.655.088	0,32	EUR	1.500.000	Koninklijke KPN NV Perp FRN	1.473.984	0,28	
			<b>42.512.943</b>	<b>8,17</b>	EUR	1.932.000	LKQ Euro Holdings 3.63% 01/04/2026	1.956.216	0,39	
					EUR	400.000	Lkq European Holdings BV 4.13% 01/04/2028	425.978	0,08	

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond

### Portfolioaufstellung

(Fortsetzung)

	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Nettoinven- tarwerts		Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Nettoinven- tarwerts
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>					<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>					<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				
<b>NIEDERLANDE (Fortsetzung)</b>					<b>NIEDERLANDE (Fortsetzung)</b>				
EUR	714.000	Oci NV 3.13% 01/11/2024	712.198	0,14	EUR	915.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 4.50% 01/03/2025	891.570	0,17
EUR	1.400.000	Phoenix Pharmahandel 2.38% 05/08/2025	1.413.300	0,27	EUR	1.042.000	Trivium Packaging Finance BV 3.75% 15/08/2026	1.030.977	0,20
EUR	1.484.000	PPF Telecom Group BV 2.13% 31/01/2025	1.452.059	0,28	EUR	1.603.000	United Group BV 3.13% 15/02/2026	1.515.423	0,29
EUR	400.000	PPF Telecom Group BV 3.13% 27/03/2026	403.998	0,08	EUR	1.207.000	United Group BV 3.63% 15/02/2028	1.138.795	0,22
EUR	1.744.000	PPF Telecom Group BV 3.25% 29/09/2027	1.737.191	0,33	EUR	641.000	United Group BV 4.88% 01/07/2024	649.044	0,12
EUR	712.000	PPF Telecom Group BV 3.50% 20/05/2024	732.454	0,14	EUR	991.000	UPC Holding BV 3.88% 15/06/2029	964.373	0,19
EUR	922.000	Q-Park Holding I BV 1.50% 01/03/2025	844.578	0,16	EUR	1.187.000	VZ Vendor Financing BV 2.50% 31/01/2024	1.169.449	0,22
EUR	2.427.000	Q-Park Holding I BV 2.00% 01/03/2027	2.178.754	0,42	EUR	1.038.000	Ziggo BV 2.88% 15/01/2030	1.017.204	0,20
EUR	1.037.000	Repsol International Finance BV FRN 25/03/2075	1.092.609	0,21	EUR	699.300	Ziggo BV 4.25% 15/01/2027	728.462	0,14
EUR	462.000	Repsol International Finance BV Perp FRN	466.221	0,09	<b>Niederlande, insgesamt</b>			<b>71.254.550</b>	<b>13,71</b>
EUR	1.003.000	Saipem Finance International BV 3.38% 15/07/2026	978.034	0,18	<b>PORTUGAL</b>				
EUR	3.732.000	Schaeffler Finance BV 3.25% 15/05/2025	3.739.911	0,73	EUR	100.000	Edp - Energias de Portugal SA FRN 30/04/2079	108.206	0,02
EUR	1.280.128	Summer BidCo BV 9.00% 15/11/2025	1.291.377	0,25	EUR	1.600.000	EDP - Energias de Portugal SA FRN 20/07/2080	1.542.238	0,30
EUR	1.316.741	Summer BidCo BV 9.75% 15/11/2025	1.328.311	0,26	<b>Portugal, insgesamt</b>			<b>1.650.444</b>	<b>0,32</b>
EUR	300.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	299.804	0,06	<b>RUMÄNIEN</b>				
EUR	3.200.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	3.259.536	0,63	EUR	1.500.000	RCS & RDS SA 3.25% 05/02/2028	1.436.507	0,28
EUR	4.300.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	4.406.076	0,85	<b>Rumänien, insgesamt</b>			<b>1.436.507</b>	<b>0,28</b>
EUR	4.500.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	4.756.087	0,92	<b>SPANIEN</b>				
EUR	1.500.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	1.653.918	0,32	EUR	500.000	Cellnex Telecom SA 1.00% 20/04/2027	495.013	0,10
EUR	1.509.000	TenneT Holding BV Perp FRN	1.531.407	0,29	EUR	500.000	Cellnex Telecom SA 1.88% 26/06/2029	511.196	0,10
EUR	2.288.000	TenneT Holding BV Perp FRN	2.384.796	0,46	EUR	1.200.000	Cellnex Telecom SA 2.38% 16/01/2024	1.265.986	0,24
EUR	2.352.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 1.13% 15/10/2024	2.040.698	0,39	EUR	700.000	Cellnex Telecom SA 2.88% 18/04/2025	759.644	0,15
EUR	2.216.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 1.25% 31/03/2023	2.055.601	0,39	EUR	1.056.000	Grifols SA 1.63% 15/02/2025	1.045.255	0,20
EUR	460.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 1.63% 15/10/2028	364.875	0,07	EUR	2.294.000	Grifols SA 2.25% 15/11/2027	2.282.117	0,44
EUR	725.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 1.88% 31/03/2027	611.599	0,12	EUR	2.559.000	Grifols SA 3.20% 01/05/2025	2.573.695	0,49
EUR	949.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 3.25% 15/04/2022	948.883	0,18	<b>Spanien, insgesamt</b>			<b>8.932.906</b>	<b>1,72</b>

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.







## Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond

### Portfolioaufstellung

(Fortsetzung)

Nennwert		Anlage	Marktwert EUR	% des Nettoinven- tarwerts	Nennwert		Anlage	Marktwert EUR	% des Nettoinven- tarwerts		
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>					<b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente (Fortsetzung)</b>						
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>					<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>						
<b>VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)</b>					<b>PORTUGAL</b>						
EUR	2.272.000	Silgan Holdings Inc. 3.25% 15/03/2025	2.304.918	0,44	EUR	1.000.000	Banco Espirito Santo SA 2.63% 31/12/2049	183.568	0,04		
EUR	2.941.000	Spectrum Brands Inc. 4.00% 01/10/2026	3.016.902	0,58	EUR	6.900.000	Banco Espirito Santo SA 4.00% 21/01/2021	1.495.650	0,29		
EUR	1.215.000	Tenneco Inc. 4.88% 15/04/2022	1.169.785	0,22	EUR	1.400.000	Banco Espirito Santo SA 4.75% 15/01/2021	301.421	0,06		
EUR	1.785.000	UGI International LLC 3.25% 01/11/2025	1.811.605	0,35	<b>Portugal, insgesamt</b>						
EUR	1.400.000	ZF North America Capital 2.75% 27/04/2023	1.399.200	0,27	<b>1.980.639 0,39</b>						
<b>Vereinigte Staaten, insgesamt</b>			<b>67.161.177</b>	<b>12,89</b>	<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH</b>						
<b>Anleihen, insgesamt</b>				<b>475.534.777</b>	<b>91,31</b>	GBP	1.705.000	Pinewood Finance Company Limited 3.25% 30/09/2025	1.879.798	0,37	
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt</b>					<b>475.534.777</b>	<b>91,31</b>	GBP	520.000	Stonegate Pub 8.25% 31/07/2025	530.818	0,10
<b>Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere</b>					<b>Anleihen, insgesamt</b>						
<b>Anleihen</b>					<b>11.661.912 2,26</b>						
<b>VEREINIGTE STAATEN</b>					<b>Aktien</b>						
USD	1.648.000	Adient US LLC 9.00% 15/04/2025	1.552.048	0,29	<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH</b>						
USD	519.000	Catalent Pharma Solutions Inc. 5.00% 15/07/2027	463.057	0,09	434	Nv Profit Share Limited	0	0,00			
USD	640.000	Cott Holdings Inc. 5.50% 01/04/2025	560.529	0,11	<b>Vereinigtes Königreich, insgesamt</b>						
<b>Vereinigte Staaten, insgesamt</b>			<b>2.575.634</b>	<b>0,49</b>	<b>0 0,00</b>						
<b>Anleihen, insgesamt</b>				<b>2.575.634</b>	<b>0,49</b>	<b>Aktien, insgesamt</b>					
<b>Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere, insgesamt</b>					<b>0 0,00</b>						
<b>2.575.634 0,49</b>					<b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, insgesamt</b>						
<b>11.661.912 2,26</b>					<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren</b>						
<b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>					<b>Fonds</b>						
<b>Anleihen</b>					<b>IRLAND</b>						
<b>LUXEMBURG</b>					4.520.344	BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund	4.983.499	0,96			
EUR	4.343.000	Altice France Holding SA 8.00% 15/05/2027	4.617.409	0,89	139.794	BlackRock Institutional Cash Series Euro Liquidity Fund Premier	13.868.003	2,66			
<b>Luxemburg, insgesamt</b>			<b>4.617.409</b>	<b>0,89</b>	1.009.370	Insight Liquidity Funds plc	1.112.791	0,21			
<b>NIEDERLANDE</b>					<b>Irland, insgesamt</b>						
EUR	2.866.497	Boats Investments Netherlands BV 11.00% 23/09/2099*	766.788	0,15	<b>19.964.293 3,83</b>						
<b>Niederlande, insgesamt</b>			<b>766.788</b>	<b>0,15</b>	<b>Fonds, insgesamt</b>						
<b>19.964.293 3,83</b>					<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren, insgesamt</b>						
<b>509.736.616 97,89</b>					<b>Wert der Anlagen, insgesamt</b>						
<b>(Gesamtkosten: EUR 516.840.166)</b>					<b>509.736.616 97,89</b>						
<b>*Wertpapiere zum beizulegenden Zeitwert.</b>											

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond

## Portfolioaufstellung

zum 30. September 2020

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Nettoinven- tarwerts	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Nettoinven- tarwerts		
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>					
<b>Anleihen</b>				<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>					
<b>ÖSTERREICH</b>				<b>FRANKREICH (Fortsetzung)</b>					
EUR	100.000	Sappi Papier Holding GmbH 4.00% 01/04/2023	91.651	0,12	EUR	633.000	Louvre Bidco SAS 4.25% 30/09/2024	605.040	0,79
		<b>Österreich, insgesamt</b>	<b>91.651</b>	<b>0,12</b>	EUR	100.000	Louvre Bidco SAS 6.50% 30/09/2024	99.800	0,13
<b>KANADA</b>					EUR	300.000	Loxam SAS 3.50% 15/04/2022	298.509	0,39
EUR	420.000	Bausch Health Cos Inc. 4.50% 15/05/2023	417.540	0,55	EUR	300.000	Loxam SAS 3.50% 03/05/2023	294.786	0,39
EUR	200.000	Primo Water Corp. 5.50% 01/07/2024	204.032	0,27	EUR	100.000	Orano SA 3.13% 20/03/2023	102.989	0,14
		<b>Kanada, insgesamt</b>	<b>621.572</b>	<b>0,82</b>	EUR	450.000	Orano SA 3.50% 22/03/2021	456.255	0,59
<b>DÄNEMARK</b>					EUR	138.000	Parts Europe SA 6.50% 16/07/2025	139.585	0,18
EUR	150.000	Dkt Finance Aps 7.00% 17/06/2023	151.855	0,20	EUR	250.000	Picard Groupe SAS FRN 30/11/2023	243.290	0,32
EUR	486.000	TDC A/S 5.00% 02/03/2022	509.875	0,67	EUR	1.014.000	Rexel SA 2.63% 15/06/2024	1.016.554	1,34
		<b>Dänemark, insgesamt</b>	<b>661.730</b>	<b>0,87</b>	EUR	200.000	Spie SA 3.13% 22/03/2024	203.814	0,27
<b>FINNLAND</b>					EUR	700.000	Valeo SA 3.25% 22/01/2024	737.951	0,97
EUR	143.000	Nokia Oyj 1.00% 15/03/2021	143.468	0,19	EUR	250.000	Vallourec SA 6.63% 15/10/2022	144.267	0,19
		<b>Finnland, insgesamt</b>	<b>143.468</b>	<b>0,19</b>			<b>Frankreich, insgesamt</b>	<b>9.574.524</b>	<b>12,56</b>
<b>FRANKREICH</b>					<b>DEUTSCHLAND</b>				
EUR	316.000	Altice France SA 2.13% 15/02/2025	298.705	0,39	EUR	200.000	Adler Real Estate AG 1.50% 06/12/2021	196.728	0,26
EUR	443.000	Altice France SA 2.50% 15/01/2025	423.531	0,56	EUR	400.000	Adler Real Estate AG 1.50% 17/04/2022	389.433	0,51
EUR	100.000	Banjay Entertainment Sasu 3.50% 01/03/2025	98.121	0,13	EUR	800.000	Adler Real Estate AG 1.88% 27/04/2023	774.217	1,02
EUR	400.000	Casino Guichard Perrachon SA 1.87% 13/06/2022	375.620	0,49	EUR	636.000	Consus Real Estate AG 9.63% 15/05/2024	681.547	0,90
EUR	100.000	Casino Guichard Perrachon SA 4.56% 25/01/2023	92.855	0,12	EUR	200.000	Demire Deutsche Mittelstand Real Estate AG 1.88% 15/10/2024	185.029	0,24
EUR	100.000	Casino Guichard Perrachon SA 5.98% 26/05/2021	101.137	0,13	EUR	200.000	Douglas GmbH 6.25% 15/07/2022	185.177	0,24
EUR	220.138	CMA CGM SA 7.75% 15/01/2021	220.106	0,29	EUR	180.000	HT Troplast GmbH 9.25% 15/07/2025	192.028	0,25
EUR	147.000	Crown European Holdings SA 0.75% 15/02/2023	143.860	0,19	EUR	682.000	K+S AG 4.13% 06/12/2021	687.058	0,90
EUR	100.000	Crown European Holdings SA 2.25% 01/02/2023	101.228	0,13	EUR	729.000	Platin 1426 GmbH 5.38% 15/06/2023	690.633	0,91
EUR	1.147.000	Crown European Holdings SA 4.00% 15/07/2022	1.193.500	1,57	EUR	180.000	Safari Holding 5.38% 30/11/2022	165.881	0,22
EUR	1.000.000	Elis SA 1.88% 15/02/2023	993.414	1,30	EUR	784.000	Schaeffler AG 1.13% 26/03/2022	769.607	1,01
EUR	136.000	Faurecia SE 2.63% 15/06/2025	134.328	0,18	EUR	220.000	Thyssenkrupp AG 1.38% 03/03/2022	215.272	0,28
EUR	241.000	Faurecia SE 2.63% 15/06/2025	238.037	0,31	EUR	251.000	Thyssenkrupp AG 1.88% 06/03/2023	235.771	0,31
EUR	518.000	Getlink SE 3.63% 01/10/2023	519.970	0,68	EUR	933.000	Thyssenkrupp AG 2.75% 08/03/2021	933.786	1,23
EUR	350.000	La Financiere Atalian SASU 4.00% 15/05/2024	297.272	0,39			<b>Deutschland, insgesamt</b>	<b>6.302.167</b>	<b>8,28</b>

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond

### Portfolioaufstellung

(Fortsetzung)

	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Nettoinven- tarwerts		Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Nettoinven- tarwerts
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>					<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>					<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				
<b>IRLAND</b>					<b>LUXEMBURG (Fortsetzung)</b>				
EUR	733.000	Eircom Finance DAC 1.75% 01/11/2024	708.503	0,93	EUR	158.000	ArcelorMittal SA 1.00% 19/05/2023	155.696	0,20
EUR	100.000	Smurfit Kappa Acquisitions 2.38% 01/02/2024	103.982	0,14	EUR	412.000	ArcelorMittal SA 2.25% 17/01/2024	419.245	0,55
		<b>Irland, insgesamt</b>	<b>812.485</b>	<b>1,07</b>	EUR	737.000	Cirsa Finance International Sarl 6.25% 20/12/2023	674.736	0,89
<b>ISLE OF MAN</b>					EUR	250.000	CPI Property Group SA 1.45% 14/04/2022	250.858	0,33
EUR	1.476.000	Playtech plc 3.75% 12/10/2023	1.476.651	1,94	EUR	615.000	Crystal Almond Sarl 4.25% 15/10/2024	606.231	0,80
		<b>Isle of Man, insgesamt</b>	<b>1.476.651</b>	<b>1,94</b>	EUR	594.000	Fiat Finance & Trade 4.75% 22/03/2021	605.204	0,79
<b>ITALIEN</b>					EUR	515.000	Fiat Finance & Trade 4.75% 15/07/2022	545.396	0,72
GBP	150.000	Aeroporti di Roma SpA 5.44% 20/02/2023	177.395	0,23	EUR	420.000	Garfunkelux Holdco 3 SA 7.50% 01/08/2022	390.952	0,51
EUR	330.000	Autostrade per l'Italia SpA 1.63% 12/06/2023	321.685	0,43	EUR	260.000	Groupe Ecore Holding SAS FRN 15/11/2023	186.770	0,24
EUR	490.000	Lkq Italia Bondco 3.88% 01/04/2024	515.594	0,68	EUR	674.000	Ineos Group Holdings SA 5.38% 01/08/2024	674.950	0,89
EUR	644.000	Nexi SpA 1.75% 31/10/2024	636.682	0,84	EUR	598.000	Leonardo SpA 4.50% 19/01/2021	605.923	0,79
EUR	577.000	Telecom Italia SpA 2.50% 19/07/2023	592.987	0,78	EUR	250.000	Leonardo SpA 5.25% 21/01/2022	264.572	0,35
EUR	370.000	Telecom Italia SpA 4.50% 25/01/2021	375.333	0,49	EUR	400.000	Matterhorn Telecom SA 2.63% 15/09/2024	390.313	0,51
EUR	100.000	Telecom Italia SpA 5.25% 10/02/2022	106.362	0,14	EUR	375.000	PLT VII Finance Sarl 4.63% 05/01/2026	382.049	0,50
		<b>Italien, insgesamt</b>	<b>2.726.038</b>	<b>3,59</b>	EUR	332.000	Sig Combibloc Purchaseco Sarl 1.88% 18/06/2023	338.551	0,44
<b>JAPAN</b>					<b>Luxemburg, insgesamt</b>				
EUR	130.000	SoftBank Group Corp 4.00% 20/04/2023	134.854	0,18	<b>8.040.539</b>				
EUR	125.000	Softbank Group Corp. 4.00% 30/07/2022	129.719	0,17	<b>10,55</b>				
		<b>Japan, insgesamt</b>	<b>264.573</b>	<b>0,35</b>	<b>NIEDERLANDE</b>				
<b>JERSEY – KANALINSELN</b>					USD	250.000	Constellium SE 5.75% 15/05/2024	216.905	0,28
EUR	501.000	Adient Global Holdings Limited 3.50% 15/08/2024	462.849	0,61	EUR	157.000	Fiat Chrysler Automobiles NV 3.38% 07/07/2023	162.887	0,21
EUR	242.000	Avis Budget Finance plc 4.13% 15/11/2024	214.433	0,28	EUR	148.000	Fiat Chrysler Automobiles NV 3.75% 29/03/2024	156.219	0,21
EUR	699.570	Lhc3 plc 4.13% 15/08/2024	702.193	0,93	EUR	220.000	Oci NV 3.13% 01/11/2024	219.445	0,29
		<b>Jersey – Kanalinseln, insgesamt</b>	<b>1.379.475</b>	<b>1,82</b>	EUR	400.000	Oci NV 5.00% 15/04/2023	410.787	0,54
<b>LUXEMBURG</b>					EUR	685.000	OI European Group BV 3.13% 15/11/2024	694.185	0,91
EUR	650.000	Altice Financing SA 2.25% 15/01/2025	623.357	0,82	EUR	200.000	Phoenix Pharmahandel 2.38% 05/08/2025	201.900	0,27
EUR	965.000	Aramark International Finance 3.13% 01/04/2025	925.736	1,22	EUR	475.000	PPF Telecom Group BV 2.13% 31/01/2025	464.776	0,61
					EUR	368.000	PPF Telecom Group BV 3.50% 20/05/2024	378.572	0,50
					EUR	246.000	Q-Park Holding I BV 1.50% 01/03/2025	225.343	0,30

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.



## Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond

### Portfolioaufstellung

(Fortsetzung)

Nennwert		Anlage	Marktwert EUR	% des Nettoinven- tarwerts	Nennwert		Anlage	Marktwert EUR	% des Nettoinven- tarwerts
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>					<b>Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere</b>				
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>					<b>Anleihen</b>				
<b>VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)</b>					<b>VEREINIGTE STAATEN</b>				
EUR	760.000	IQVIA Inc. 3.25% 15/03/2025	766.725	1,01	USD	63.000	Adient US LLC 9.00% 15/04/2025	59.332	0,08
EUR	722.000	Kraft Heinz Foods Company 2.00% 30/06/2023	740.175	0,97	<b>Vereinigte Staaten, insgesamt</b>				
GBP	677.000	MPT Operating Partnership LP 2.55% 05/12/2023	745.889	0,98	<b>Anleihen, insgesamt</b>				
EUR	700.000	MPT Operating Partnership LP 4.00% 19/08/2022	728.434	0,96	<b>Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere, insgesamt</b>				
USD	1.001.000	Netflix Inc. 5.50% 15/02/2022	897.125	1,18	<b>59.332 0,08</b>				
EUR	184.000	Tenneco Inc. 4.88% 15/04/2022	177.153	0,23	<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren</b>				
EUR	500.000	ZF North America Capital 2.75% 27/04/2023	499.714	0,66	<b>Fonds</b>				
<b>Vereinigte Staaten, insgesamt</b>			<b>7.449.285</b>	<b>9,80</b>	<b>IRLAND</b>				
<b>Anleihen, insgesamt</b>			<b>64.494.291</b>	<b>84,71</b>	42.198	BlackRock Institutional Cash Series Euro Liquidity Fund Premier		4.186.159	5,50
<b>Hypothekenbesicherte Anleihen und ABS-Anleihen</b>					<b>Irland, insgesamt</b>				
<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH</b>					<b>4.186.159 5,50</b>				
GBP	615.428	Virgin Media Secured Finance plc FRN 15/01/2025	721.072	0,95	<b>Fonds, insgesamt</b>				
<b>Vereinigtes Königreich, insgesamt</b>			<b>721.072</b>	<b>0,95</b>	<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren, insgesamt</b>				
<b>Hypothekenbesicherte Anleihen und ABSAnleihen, insgesamt</b>			<b>721.072</b>	<b>0,95</b>	<b>4.186.159 5,50</b>				
<b>Wandelanleihen</b>					<b>Wert der Anlagen, insgesamt</b>				
<b>FRANKREICH</b>					<b>70.582.300 92,71</b>				
EUR	10.988	Elis SA 0.00% 06/10/2023	325.144	0,43	<b>(Gesamtkosten: EUR 72.238.396)</b>				
<b>Frankreich, insgesamt</b>			<b>325.144</b>	<b>0,43</b>					
<b>ITALIEN</b>									
EUR	300.000	Telecom Italia SpA 1.13% 26/03/2022	297.413	0,39					
<b>Italien, insgesamt</b>			<b>297.413</b>	<b>0,39</b>					
<b>SPANIEN</b>									
EUR	500.000	Telefonica Participaciones SAU 0.00% 09/03/2021	498.889	0,65					
<b>Spanien, insgesamt</b>			<b>498.889</b>	<b>0,65</b>					
<b>WandelAnleihen, insgesamt</b>			<b>1.121.446</b>	<b>1,47</b>					
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt</b>			<b>66.336.809</b>	<b>87,13</b>					

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - European Social Bond

### Portfolioaufstellung

zum 30. September 2020

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Nettoinven- tarwerts	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Nettoinven- tarwerts		
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>					
<b>Anleihen</b>				<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>					
<b>AUSTRALIEN</b>				<b>FRANKREICH (Fortsetzung)</b>					
EUR	400.000	National Australia Bank Limited 0.35% 07/09/2022	404.363	0,20	EUR	300.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 0.75% 08/06/2026	311.820	0,16
<b>Australien, insgesamt</b>			<b>404.363</b>	<b>0,20</b>	GBP	700.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 1.50% 07/10/2026	803.167	0,40
<b>ÖSTERREICH</b>				GBP	600.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 1.75% 19/12/2024	695.425	0,35	
EUR	600.000	Kommunalkredit Austria AG 0.38% 12/07/2021	602.324	0,30	EUR	1.700.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 1.88% 18/06/2029	1.820.968	0,90
EUR	700.000	Telekom Finanzmanagement GmbH 1.50% 07/12/2026	761.680	0,38	EUR	200.000	BNP Paribas SA Perp 0.50%	202.539	0,10
EUR	500.000	Telekom Finanzmanagement GmbH 3.50% 04/07/2023	549.030	0,27	EUR	1.500.000	BNP Paribas SA Perp 1.00%	1.545.316	0,76
<b>Österreich, insgesamt</b>			<b>1.913.034</b>	<b>0,95</b>	EUR	300.000	BPCE SA 0.01% 27/05/2030	306.068	0,15
<b>BELGIEN</b>				EUR	400.000	BPCE SA 0.13% 04/12/2024	402.846	0,20	
EUR	700.000	Bpost SA 1.25% 11/07/2026	749.010	0,37	EUR	800.000	BPCE SA 0.63% 26/09/2023	818.193	0,41
EUR	500.000	KBC Group NV FRN 16/06/2027	504.430	0,25	EUR	500.000	BPCE SA 0.63% 28/04/2025	513.395	0,26
EUR	1.000.000	KBC Group NV 0.88% 27/06/2023	1.025.394	0,51	EUR	1.700.000	BPCE SA 2.88% 22/04/2026	1.920.130	0,94
<b>Belgien, insgesamt</b>			<b>2.278.834</b>	<b>1,13</b>	EUR	400.000	Caisse des Depots et Consignations 0.01% 15/09/2025	409.542	0,20
<b>DÄNEMARK</b>				EUR	700.000	Carrefour SA 2.63% 15/12/2027	799.654	0,40	
EUR	300.000	ISS Global A/S 1.13% 07/01/2021	300.460	0,15	EUR	1.600.000	CNP Assurances 1.88% 20/10/2022	1.647.313	0,82
EUR	500.000	ISS Global A/S 2.13% 02/12/2024	527.695	0,26	EUR	1.000.000	Credit Agricole Assurances SA Perp FRN	1.087.468	0,54
EUR	630.000	Nykredit Realkredit A/S 0.75% 20/01/2027	639.639	0,32	EUR	100.000	Credit Agricole Home Loan SFH SA 0.88% 06/05/2034	112.549	0,06
EUR	600.000	Nykredit Realkredit A/S 0.88% 17/01/2024	612.389	0,30	EUR	400.000	Credit Agricole SA 0.75% 05/12/2023	411.221	0,20
GBP	830.000	Orsted A/S 2.13% 17/05/2027	989.893	0,50	EUR	1.100.000	Credit Agricole SA FRN 22/04/2026	1.130.835	0,56
GBP	1.300.000	Orsted A/S 2.50% 16/05/2033	1.634.228	0,82	EUR	1.300.000	Credit Agricole SA 1.00% 03/07/2029	1.398.559	0,70
EUR	800.000	Orsted AS FRN 09/12/3019	802.627	0,40	USD	1.100.000	Credit Agricole SA Perp FRN	1.038.108	0,52
EUR	715.000	Orsted AS FRN 24/11/3017	739.074	0,37	EUR	1.300.000	Credit Mutuel Arkea SA 0.38% 03/10/2028	1.308.112	0,65
<b>Dänemark, insgesamt</b>			<b>6.246.005</b>	<b>3,12</b>	EUR	400.000	Credit Mutuel Arkea SA 0.88% 07/05/2027	416.174	0,21
<b>FINNLAND</b>				EUR	600.000	Credit Mutuel Arkea SA FRN 11/06/2029	619.191	0,31	
EUR	1.000.000	Elenia Finance Oyj 0.38% 06/02/2027	1.004.537	0,51	EUR	200.000	Credit Mutuel CIC Home Loan 0.13% 09/04/2025	204.826	0,10
EUR	200.000	Tyottomyysvakuutusrahasto 0.01% 16/06/2027	203.934	0,10	EUR	3.100.000	Danone SA 1.00% 26/03/2025	3.259.372	1,62
<b>Finnland, insgesamt</b>			<b>1.208.471</b>	<b>0,61</b>	EUR	300.000	Getlink SE 3.63% 01/10/2023	301.141	0,15
<b>FRANKREICH</b>				EUR	900.000	Icade Sante SAS 0.88% 04/11/2029	878.538	0,44	
EUR	2.700.000	Action Logement SE 0.50% 30/10/2034	2.802.242	1,39	EUR	600.000	La Banque Postale SA 0.25% 12/07/2026	606.623	0,30
EUR	600.000	AXA SA FRN 28/05/2049	673.590	0,33	EUR	900.000	La Banque Postale SA 1.38% 24/04/2029	966.103	0,48
EUR	500.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 0.75% 17/07/2025	517.972	0,26	EUR	800.000	La Banque Postale SA 3.00% 09/06/2028	917.972	0,46

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.





## Threadneedle (Lux) - European Social Bond

### Portfolioaufstellung

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Nettoinven- tarwerts	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Nettoinven- tarwerts		
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>					
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>					
<b>ITALIEN (Fortsetzung)</b>				<b>NIEDERLANDE (Fortsetzung)</b>					
EUR	500.000	Ferrovie dello Stato Italiane SpA 1.13% 09/07/2026	515.556	0,26	EUR	600.000	Digital Dutch Finco BV 0.63% 15/07/2025	607.950	0,30
EUR	400.000	Ferrovie dello Stato Italiane SpA 1.50% 27/06/2025	417.268	0,21	EUR	800.000	Digital Dutch Finco BV 1.50% 15/03/2030	837.365	0,42
EUR	1.350.000	Intesa Sanpaolo SpA 0.75% 04/12/2024	1.367.059	0,68	EUR	900.000	Enel Finance International NV 1.50% 21/07/2025	961.299	0,48
EUR	500.000	Snam SpA 0.75% 17/06/2030	515.935	0,26	EUR	221.000	Enexis Holding NV 0.63% 17/06/2032	229.524	0,11
EUR	300.000	Terna Rete Elettrica Nazionale SpA 1.00% 23/07/2023	309.665	0,15	EUR	600.000	Enexis Holding NV 0.88% 28/04/2026	629.657	0,31
		<b>Italien, insgesamt</b>	<b>5.520.555</b>	<b>2,76</b>	EUR	400.000	Iberdrola International BV Perp FRN	403.969	0,20
<b>LUXEMBURG</b>					EUR	200.000	Iberdrola International BV Perp FRN	207.964	0,10
EUR	1.200.000	Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1.21% 04/06/2026	1.233.236	0,61	EUR	500.000	Iberdrola International BV Perp FRN	534.909	0,27
EUR	228.000	CPI Property Group SA 2.75% 12/05/2026	235.759	0,12	EUR	1.000.000	ING Groep NV 2.50% 15/11/2030	1.219.162	0,61
GBP	200.000	CPI Property Group SA 2.75% 22/01/2028	216.185	0,11	EUR	1.594.000	Innogy Finance BV 1.25% 19/10/2027	1.718.725	0,86
EUR	375.000	Prologis International Funding II SA 1.63% 17/06/2032	407.463	0,20	EUR	100.000	NE Property BV 3.38% 14/07/2027	100.893	0,05
EUR	461.000	Prologis International Funding II SA 2.38% 14/11/2030	539.628	0,27	EUR	100.000	NE Property BV 3.38% 14/07/2027	100.893	0,05
		<b>Luxemburg, insgesamt</b>	<b>2.632.271</b>	<b>1,31</b>	EUR	300.000	NederFinMaat 0.13% 03/04/2027	307.441	0,15
<b>NIEDERLANDE</b>					EUR	400.000	Royal Schiphol Group NV 1.50% 05/11/2030	430.954	0,21
EUR	750.000	ABN Amro Bank NV 0.50% 15/04/2026	771.427	0,38	EUR	100.000	Royal Schiphol Group NV 2.00% 06/04/2029	112.415	0,06
EUR	800.000	ABN Amro Bank NV 0.88% 22/04/2025	835.031	0,42	EUR	600.000	Stedin Holding NV 0.50% 14/11/2029	609.686	0,30
EUR	500.000	Achmea BV 1.50% 26/05/2027	528.398	0,26	EUR	550.000	Swisscom Finance BV 0.38% 14/11/2028	562.358	0,28
EUR	1.000.000	Akelius Residential Property AB 1.00% 17/01/2028	1.000.683	0,50	EUR	900.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	854.193	0,42
EUR	200.000	Alliander NV 0.38% 10/06/2030	205.532	0,10	EUR	200.000	TenneT Holding BV 1.50% 03/06/2039	230.549	0,11
EUR	100.000	Alliander NV 0.88% 24/06/2032	108.091	0,05	EUR	100.000	TenneT Holding BV 1.50% 03/06/2039	115.274	0,06
EUR	900.000	Allianz Finance II BV 1.50% 15/01/2030	1.022.061	0,51	EUR	115.000	TenneT Holding BV Perp FRN	116.708	0,06
EUR	700.000	Cooperatieve Rabobank UA 0.25% 30/10/2026	706.015	0,35	EUR	1.625.000	TenneT Holding BV Perp FRN	1.693.747	0,84
EUR	100.000	Cooperatieve Rabobank UA FRN 05/05/2028	104.021	0,05	EUR	550.000	Vesteda Finance BV 1.50% 24/05/2027	582.916	0,29
EUR	840.000	Cooperatieve Rabobank UA 1.38% 03/02/2027	916.217	0,46	EUR	450.000	Vesteda Finance BV 2.00% 10/07/2026	486.128	0,24
GBP	800.000	Cooperatieve Rabobank UA 4.63% 23/05/2029	1.085.520	0,54	<b>Niederlande, insgesamt</b>			<b>22.581.745</b>	<b>11,21</b>
EUR	200.000	Cooperatieve Rabobank UA Perp FRN	205.367	0,10	<b>NORWEGEN</b>				
EUR	1.400.000	De Volksbank NV FRN 22/10/2030	1.438.703	0,71	EUR	200.000	Avinor AS 0.75% 01/10/2030	200.908	0,10
					EUR	1.400.000	Avinor AS 1.00% 29/04/2025	1.448.817	0,72
					<b>Norwegen, insgesamt</b>			<b>1.649.725</b>	<b>0,82</b>

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - European Social Bond

### Portfolioaufstellung

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Nettoinven- tarwerts	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Nettoinven- tarwerts		
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>					
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>					
<b>PORTUGAL</b>				<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH (Fortsetzung)</b>					
EUR	500.000	EDP - Energias de Portugal SA 1.63% 15/04/2027	541.622	0,27	GBP	200.000	British Telecommunications plc 5.75% 07/12/2028	288.780	0,14
		<b>Portugal, insgesamt</b>	<b>541.622</b>	<b>0,27</b>	GBP	105.000	Bromford Housing Group Limited 3.13% 03/05/2048	150.598	0,07
<b>SPANIEN</b>				<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH (Fortsetzung)</b>					
EUR	1.000.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 0.75% 04/06/2025	1.026.943	0,51	GBP	100.000	BUPA Finance plc 1.75% 14/06/2027	111.238	0,06
EUR	1.400.000	Banco Santander SA 0.30% 04/10/2026	1.411.731	0,69	GBP	800.000	BUPA Finance plc 5.00% 08/12/2026	1.008.454	0,50
EUR	300.000	Banco Santander SA 1.13% 23/06/2027	308.912	0,15	EUR	450.000	Cadent Finance plc 0.75% 11/03/2032	449.306	0,22
EUR	1.200.000	CaixaBank SA 0.63% 01/10/2024	1.192.192	0,59	GBP	100.000	DWR Cymru Financing UK plc 1.38% 31/03/2033	112.366	0,06
EUR	200.000	CaixaBank SA FRN 10/07/2026	202.654	0,10	GBP	725.000	DWR Cymru Financing UK plc 1.63% 31/03/2026	808.403	0,39
EUR	200.000	Iberdrola Finanzas SA 1.25% 28/10/2026	214.411	0,11	GBP	300.000	First Hydro Finance plc 9.00% 31/07/2021	351.027	0,17
EUR	200.000	Red Electrica Financiaciones Sau 0.38% 24/07/2028	204.297	0,10	GBP	155.000	Glaxosmithkline Capital plc 1.25% 12/10/2028	173.862	0,09
EUR	500.000	Telefonica Emisiones SA 1.07% 05/02/2024	517.362	0,26	GBP	255.000	Glaxosmithkline Capital plc 1.25% 12/10/2028	286.031	0,14
EUR	500.000	Telefonica Emisiones SA 1.81% 21/05/2032	545.820	0,27	GBP	225.000	Glaxosmithkline Capital plc 1.63% 12/05/2035	254.057	0,13
		<b>Spanien, insgesamt</b>	<b>5.624.322</b>	<b>2,78</b>	GBP	100.000	Guinness Partnership Limited 2.00% 22/04/2055	119.095	0,06
<b>SCHWEDEN</b>				<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH (Fortsetzung)</b>					
EUR	300.000	Akelius Residential Property AB 1.13% 14/03/2024	305.751	0,15	USD	1.200.000	HSBC Holdings plc FRN 22/11/2023	1.069.961	0,53
EUR	800.000	Essity AB 0.63% 28/03/2022	807.867	0,41	EUR	546.000	Motability Operation 0.88% 14/03/2025	570.324	0,28
EUR	700.000	Essity AB 1.13% 27/03/2024	726.335	0,36	EUR	524.000	Motability Operations Group plc 0.38% 03/01/2026	534.201	0,27
EUR	450.000	Nordea Bank Abp 0.30% 30/06/2022	454.407	0,23	GBP	500.000	Motability Operations Group plc 1.75% 03/07/2029	586.423	0,29
		<b>Schweden, insgesamt</b>	<b>2.294.360</b>	<b>1,15</b>	GBP	80.000	Motability Operations Group plc 5.38% 28/06/2022	95.558	0,05
<b>SCHWEIZ</b>				<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH (Fortsetzung)</b>					
EUR	600.000	Credit Suisse AG 0.45% 19/05/2025	613.739	0,31	GBP	300.000	National Grid Electricity Transmission plc 2.00% 17/04/2040	351.826	0,17
		<b>Schweiz, insgesamt</b>	<b>613.739</b>	<b>0,31</b>	EUR	200.000	National Grid plc 0.55% 18/09/2029	199.555	0,10
<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH</b>				<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH (Fortsetzung)</b>					
GBP	200.000	Accent Capital plc 2.63% 18/07/2049	266.917	0,13	EUR	223.000	Nationwide Building Society 0.25% 22/07/2025	222.747	0,11
GBP	971.000	Anglian Water Services Financing plc 1.63% 10/08/2025	1.112.571	0,55	GBP	200.000	Nationwide Building Society Perp FRN	228.457	0,11
EUR	200.000	British Telecommunications plc 1.50% 23/06/2027	208.897	0,10	GBP	300.000	Nationwide Building Society Perp FRN	341.342	0,17
GBP	800.000	British Telecommunications plc 3.13% 21/11/2031	979.761	0,49	EUR	775.000	Natwest Group plc FRN 15/11/2025	771.265	0,38
					EUR	600.000	NGG Finance plc FRN 05/09/2082	589.009	0,29

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.



## Threadneedle (Lux) - European Social Bond

### Portfolioaufstellung

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Nettoinven- tarwerts	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Nettoinven- tarwerts				
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>							
<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)</b>				<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)</b>							
<b>FRANKREICH (Fortsetzung)</b>				<b>ITALIEN</b>							
EUR	400.000	Unedic 0.10% 25/11/2026	408.800	0,20	EUR	600.000	Cassa Depositi e Prestiti SpA 0.75% 21/11/2022	608.760	0,30		
EUR	600.000	Unedic 0.25% 16/07/2035	610.162	0,30	EUR	500.000	Cassa Depositi e Prestiti SpA 1.00% 11/02/2030	500.445	0,25		
		<b>Frankreich, insgesamt</b>	<b>10.641.790</b>	<b>5,27</b>	EUR	200.000	Cassa Depositi e Prestiti SpA 1.50% 20/04/2023	207.120	0,10		
<b>DEUTSCHLAND</b>				EUR				500.000	Cassa Depositi e Prestiti SpA 2.00% 20/04/2027	538.909	0,27
EUR	400.000	Bremen Freie Hansestadt 0.13% 29/04/2030	414.608	0,21	EUR	2.100.000	Cassa Depositi e Prestiti SpA 2.13% 21/03/2026	2.275.236	1,13		
EUR	400.000	Bremen Freie Hansestadt 0.15% 14/09/2040	402.023	0,20			<b>Italien, insgesamt</b>	<b>4.130.470</b>	<b>2,05</b>		
EUR	600.000	Free and Hanseatic City of Hamburg 0.30% 16/09/2050	618.235	0,31	<b>LUXEMBURG</b>						
EUR	200.000	Free State of Bavaria 0.01% 20/03/2023	202.810	0,10	EUR	200.000	Luxembourg (Govt of) 0.00% 14/09/2032	205.819	0,10		
EUR	100.000	Germany (Govt of) 0.00% 15/08/2030	105.645	0,05			<b>Luxemburg, insgesamt</b>	<b>205.819</b>	<b>0,10</b>		
EUR	500.000	Investitionsbank Schleswig-Holstein 0.50% 13/06/2025	522.104	0,26	<b>NIEDERLANDE</b>						
EUR	200.000	Land Berlin 0.13% 04/06/2035	204.396	0,10	EUR	700.000	BNG Bank NV 0.05% 13/07/2024	714.284	0,36		
EUR	250.000	Land Berlin 0.35% 09/09/2050	260.095	0,13	GBP	365.000	Deutsche Bahn Finance GmbH 1.38% 07/07/2025	419.230	0,21		
EUR	700.000	Land Berlin 0.63% 15/07/2039	769.610	0,38	EUR	100.000	Nederlandse Waterschapsbank NV 0.13% 28/05/2027	103.139	0,05		
EUR	2.000.000	Landwirtschaftliche Rentenbank 0.00% 22/09/2027	2.064.137	1,02	EUR	600.000	Nederlandse Waterschapsbank NV 0.13% 03/09/2035	607.908	0,30		
EUR	800.000	Landwirtschaftliche Rentenbank 0.50% 28/02/2029	859.881	0,43	EUR	650.000	Nederlandse Waterschapsbank NV 1.50% 15/06/2039	812.066	0,40		
USD	500.000	Landwirtschaftliche Rentenbank 0.88% 03/09/2030	426.304	0,21	EUR	475.000	Netherlands (Govt of) 0.50% 15/01/2040	535.772	0,27		
USD	250.000	Landwirtschaftliche Rentenbank 0.88% 03/09/2030	213.152	0,11			<b>Niederlande, insgesamt</b>	<b>3.192.399</b>	<b>1,59</b>		
EUR	92.000	Lower Saxony (State of) 0.88% 25/10/2028	101.351	0,05	<b>POLEN</b>						
EUR	1.200.000	North Rhine-Westphalia (State of) 0.95% 13/03/2028	1.321.041	0,66	EUR	800.000	Poland (Govt of) 1.13% 07/08/2026	862.227	0,43		
EUR	300.000	Saarland (State of) 0.01% 11/05/2027	308.516	0,15			<b>Polen, insgesamt</b>	<b>862.227</b>	<b>0,43</b>		
		<b>Deutschland, insgesamt</b>	<b>8.793.908</b>	<b>4,37</b>	<b>SPANIEN</b>						
<b>UNGARN</b>				EUR				675.000	Autonomous Community of Madrid 0.42% 30/04/2030	680.446	0,34
EUR	117.000	MFB Magyar Fejlesztési Bank Zrt 1.38% 24/06/2025	120.864	0,06	EUR	2.900.000	Autonomous Community of Madrid 1.57% 30/04/2029	3.216.662	1,59		
		<b>Ungarn, insgesamt</b>	<b>120.864</b>	<b>0,06</b>	EUR	150.000	Basque (Government) 1.13% 30/04/2029	161.014	0,08		
<b>IRLAND</b>				EUR				2.100.000	Instituto de Credito Oficial 0.10% 30/07/2021	2.108.821	1,06
EUR	1.475.000	Ireland (Govt of) 1.35% 18/03/2031	1.708.181	0,86	EUR	350.000	Instituto de Credito Oficial 0.25% 30/04/2024	357.062	0,18		
		<b>Irland, insgesamt</b>	<b>1.708.181</b>	<b>0,86</b>							

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - European Social Bond

### Portfolioaufstellung

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Nettoinven- tarwerts	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Nettoinven- tarwerts		
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>					
<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)</b>				<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)</b>					
<b>SPANIEN (Fortsetzung)</b>				<b>SUPRANATIONAL (Fortsetzung)</b>					
EUR	450.000	Instituto de Credito Oficial 0.75% 31/10/2023	465.223	0,23	EUR	350.000	International Bank for Reconstruction & Development 0.01% 24/04/2028	358.322	0,18
EUR	200.000	Xunta de Galicia 0.08% 30/07/2027	200.076	0,10	USD	1.100.000	International Bank for Reconstruction & Development 0.63% 22/04/2025	947.093	0,47
		<b>Spanien, insgesamt</b>	<b>7.189.304</b>	<b>3,58</b>	USD	600.000	International Finance Corp. 0.50% 20/03/2023	514.030	0,26
<b>SUPRANATIONAL</b>				<b>SUPRANATIONAL, insgesamt</b>					
EUR	2.150.000	African Development Bank 0.25% 21/11/2024	2.211.354	1,10	EUR	410.000	Nordic Investment Bank 0.00% 06/04/2023	415.819	0,21
USD	100.000	African Development Bank 0.75% 03/04/2023	86.334	0,04			<b>Supranational, insgesamt</b>	<b>12.535.916</b>	<b>6,25</b>
EUR	400.000	Corporacion Andina de Fomento 0.63% 20/11/2026	396.577	0,20	<b>SCHWEDEN</b>				
EUR	250.000	Council of Europe 0.38% 27/03/2025	260.170	0,13	SEK	1.750.000	Sweden (Govt of) 0.13% 09/09/2030	170.554	0,08
EUR	1.200.000	Council of Europe Development Bank 0.00% 10/04/2026	1.232.964	0,61			<b>Schweden, insgesamt</b>	<b>170.554</b>	<b>0,08</b>
EUR	1.763.000	Council of Europe Development Bank 0.00% 09/04/2027	1.809.090	0,91	<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH</b>				
EUR	1.409.000	European Investment Bank 0.00% 15/05/2028	1.458.615	0,73	USD	600.000	International Finance Facility for Immunisation Company FRN 16/11/2020	511.761	0,25
EUR	900.000	European Investment Bank 0.38% 15/05/2026	948.181	0,48			<b>Vereinigtes Königreich, insgesamt</b>	<b>511.761</b>	<b>0,25</b>
USD	170.000	European Investment Bank 0.88% 17/05/2030	145.421	0,07	<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente, insgesamt</b>				
GBP	150.000	IBRD 0.25% 23/09/2027	164.134	0,08			<b>55.190.519</b>	<b>27,45</b>	
GBP	450.000	Inter-American Development Bank 0.50% 15/09/2026	502.294	0,25	<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt</b>				
USD	100.000	Inter-American Development Bank 0.88% 03/04/2025	87.043	0,04			<b>194.085.431</b>	<b>96,52</b>	
USD	500.000	Inter-American Development Bank 3.00% 26/09/2022	449.831	0,22					
USD	237.000	Inter-American Investment Corp. 0.50% 21/07/2023	202.357	0,10					
USD	200.000	Inter-American Investment Corp. 0.75% 04/05/2022	171.595	0,09					
USD	100.000	Inter-American Investment Corp. 1.75% 02/10/2024	89.428	0,04					
USD	100.000	Inter-American Investment Corp. FRN 12/10/2021	85.264	0,04					

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - European Social Bond

### Portfolioaufstellung

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Nettoinven- tarwerts
<b>Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere</b>			
<b>Anleihen</b>			
<b>NIEDERLANDE</b>			
USD 600.000	ING Groep NV FRN 01/07/2026	517.036	0,26
	<b>Niederlande, insgesamt</b>	<b>517.036</b>	<b>0,26</b>
	<b>Anleihen, insgesamt</b>	<b>517.036</b>	<b>0,26</b>
<b>Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere, insgesamt</b>			
		<b>517.036</b>	<b>0,26</b>
<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren</b>			
<b>Fonds</b>			
<b>IRLAND</b>			
37.749	BlackRock Institutional Cash Series Euro Liquidity Fund Premier	3.744.777	1,86
	<b>Irland, insgesamt</b>	<b>3.744.777</b>	<b>1,86</b>
	<b>Fonds, insgesamt</b>	<b>3.744.777</b>	<b>1,86</b>
	<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren, insgesamt</b>	<b>3.744.777</b>	<b>1,86</b>
	<b>Wert der Anlagen, insgesamt</b>	<b>198.347.244</b>	<b>98,64</b>
<b>(Gesamtkosten: EUR 195.690.197)</b>			

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond

### Portfolioaufstellung

zum 30. September 2020

Nennwert		Anlage	Marktwert EUR	% des Nettoinven- tarwerts	Nennwert		Anlage	Marktwert EUR	% des Nettoinven- tarwerts
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung</b>					<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				
<b>Anleihen</b>					<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				
<b>AUSTRALIEN</b>					<b>DÄNEMARK</b>				
EUR	1.435.000	APT Pipelines Limited 2.00% 15/07/2030	1.557.240	0,86	EUR	478.000	Danske Bank A/S 0.63% 26/05/2025	488.326	0,27
EUR	840.000	Aurizon Network Pty Limited 3.13% 01/06/2026	945.169	0,53	<b>Dänemark, insgesamt</b>				
EUR	704.000	AusNet Services Holdings Pty Limited 0.63% 25/08/2030	721.743	0,40	<b>FINNLAND</b>				
EUR	417.000	Goodman Australia 1.38% 27/09/2025	430.414	0,24	EUR	281.000	Sampo Oyj FRN 03/09/2052	284.826	0,16
GBP	400.000	Pacific National Finance Pty Limited 5.00% 19/09/2023	480.442	0,26	<b>Finnland, insgesamt</b>				
<b>Australien, insgesamt</b>			<b>4.135.008</b>	<b>2,29</b>	<b>FRANKREICH</b>				
<b>BELGIEN</b>					EUR	124.000	Altice France SA 2.50% 15/01/2025	118.551	0,07
EUR	619.000	Anheuser-Busch Inbev SA 3.70% 02/04/2040	793.926	0,44	EUR	152.000	Altice France SA 3.38% 15/01/2028	146.627	0,08
EUR	500.000	Belfius Bank SA 0.00% 28/08/2026	497.614	0,27	EUR	601.000	Altice France SA 5.88% 01/02/2027	637.085	0,35
EUR	333.000	House of Finance NV 4.38% 15/07/2026	306.693	0,17	EUR	800.000	Auchan Holding SA 3.25% 23/07/2027	857.298	0,47
EUR	400.000	KBC Group NV Perp FRN	391.754	0,22	EUR	288.000	Banijay Group Sas 6.50% 01/03/2026	279.869	0,15
<b>Belgien, insgesamt</b>			<b>1.989.987</b>	<b>1,10</b>	EUR	500.000	Carrefour SA 2.63% 15/12/2027	571.181	0,31
<b>BERMUDAS</b>					EUR	900.000	Casino Guichard Perrachon SA 4.56% 25/01/2023	835.699	0,46
EUR	2.200.000	Bacardi Limited 2.75% 03/07/2023	2.305.116	1,27	EUR	100.000	Casino Guichard-Perrachon SA 4.50% 07/03/2024	80.548	0,04
<b>Bermudas, insgesamt</b>			<b>2.305.116</b>	<b>1,27</b>	EUR	100.000	CMA CGM SA 6.50% 15/07/2022	99.171	0,05
<b>KAIMANINSELN</b>					EUR	400.000	Credit Agricole SA FRN 05/06/2030	410.023	0,23
USD	1.454.000	Alibaba Group Holding Limited 4.00% 06/12/2037	1.474.736	0,81	GBP	170.000	Credit Agricole SA Perp FRN	212.134	0,12
USD	400.000	Comunicaciones Celulares SA 6.88% 06/02/2024	349.035	0,19	EUR	700.000	Electricite de France SA 2.00% 09/12/2049	722.800	0,40
USD	650.000	Energuate Trust 5.88% 03/05/2027	574.220	0,32	EUR	600.000	Electricite de France SA Perp FRN	590.250	0,32
GBP	1.488.000	Southern Water Services Finance Limited 3.00% 28/05/2037	1.740.979	0,96	EUR	500.000	Elis SA 1.00% 03/04/2025	466.436	0,26
USD	253.000	Tencent Holdings Limited 3.24% 03/06/2050	220.870	0,12	EUR	100.000	Elis SA 1.63% 03/04/2028	93.144	0,05
USD	730.000	Tencent Holdings Limited 3.60% 19/01/2028	685.549	0,38	EUR	100.000	Holding d'Infrastructures de Transport SASU 1.63% 18/09/2029	100.574	0,06
<b>Kaimaninseln, insgesamt</b>			<b>5.045.389</b>	<b>2,78</b>	EUR	141.000	Kapla Holding SAS 3.38% 15/12/2026	131.514	0,07
					EUR	377.000	Louvre Bidco SAS 4.25% 30/09/2024	360.347	0,20
					EUR	198.000	Louvre Bidco SAS 6.50% 30/09/2024	197.603	0,11
					EUR	270.000	Paprec Holding SA 4.00% 31/03/2025	259.382	0,14

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.



## Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond

### Portfolioaufstellung

(Fortsetzung)

Nennwert		Anlage	Marktwert EUR	% des Nettoinven- tarwerts	Nennwert		Anlage	Marktwert EUR	% des Nettoinven- tarwerts
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>					<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>					<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				
<b>FRANKREICH (Fortsetzung)</b>					<b>INDIEN</b>				
EUR	800.000	RTE Reseau de Transport d'Electricite SADIR 1.13% 08/07/2040	841.035	0,46	USD	1.328.000	Adani Ports & Special Economic Zone Limited 4.38% 03/07/2029	1.142.570	0,63
EUR	1.700.000	Sanef SA 1.88% 16/03/2026	1.781.142	0,98	USD	1.285.000	Bharti Airtel Limited 4.38% 10/06/2025	1.160.371	0,64
EUR	316.000	Vallourec SA 6.38% 15/10/2023	180.594	0,10	USD	1.850.000	GMR Hyderabad International Airport Limited 4.25% 27/10/2027	1.405.469	0,77
<b>Frankreich, insgesamt</b>			<b>9.973.007</b>	<b>5,48</b>	USD	905.000	GMR Hyderabad International Airport Limited 5.38% 10/04/2024	757.112	0,42
<b>DEUTSCHLAND</b>					<b>Indien, insgesamt</b>				
EUR	800.000	Adler Real Estate AG 1.88% 27/04/2023	774.217	0,43	<b>4.465.522 2,46</b>				
EUR	700.000	Alstria office REIT-AG 0.50% 26/09/2025	689.942	0,38	<b>IRLAND</b>				
EUR	1.200.000	Bayer AG 1.13% 06/01/2030	1.219.951	0,67	EUR	1.000.000	AIB Group plc FRN 19/11/2029	968.154	0,53
EUR	827.000	Cheplapharm Arzneimittel GmbH 3.50% 11/02/2027	798.663	0,44	EUR	378.000	AIB Group plc Perp FRN	377.827	0,21
EUR	750.000	Commerzbank AG 0.50% 04/12/2026	756.057	0,42	EUR	582.000	Bank of Ireland Group plc FRN 14/10/2029	574.831	0,32
EUR	1.015.000	Commerzbank AG 1.00% 04/03/2026	1.049.382	0,58	EUR	280.000	Eircom Finance DAC 2.63% 15/02/2027	269.427	0,15
EUR	300.000	Demire Deutsche Mittelstand Real Estate AG 1.88% 15/10/2024	277.544	0,15	EUR	654.000	Eircom Finance DAC 3.50% 15/05/2026	653.918	0,36
USD	695.000	Deutsche Bank FRN 18/09/2024	595.744	0,33	USD	395.000	GE Capital International Funding Company 4.42% 15/11/2035	355.882	0,20
EUR	817.000	Deutsche Bank AG FRN 10/06/2026	852.862	0,47	GBP	135.000	Virgin Media Vendor Financing Notes III DAC 4.88% 15/07/2028	150.529	0,08
EUR	100.000	Lanxess AG FRN 06/12/2076	106.012	0,06	<b>Irland, insgesamt</b>				
EUR	220.000	Safari Holding 5.38% 30/11/2022	202.744	0,11	<b>3.350.568 1,85</b>				
EUR	310.000	SGL Carbon SE 4.63% 30/09/2024	269.301	0,15	<b>ITALIEN</b>				
EUR	216.000	Techem Verwaltungsgesellschaft 674 2.00% 15/07/2025	206.845	0,11	EUR	956.000	Aeroporti di Roma SpA 1.63% 08/06/2027	938.194	0,52
EUR	360.000	Techem Verwaltungsgesellschaft 674 mbH 6.00% 30/07/2026	368.292	0,20	EUR	245.000	Assicurazioni Generali SpA 5.00% 08/06/2048	283.263	0,16
EUR	263.000	Wepa Hygieneprodukte GmbH 2.88% 15/12/2027	259.010	0,14	EUR	570.000	Autostrade per l'Italia SpA 1.88% 26/09/2029	532.619	0,29
<b>Deutschland, insgesamt</b>			<b>8.426.566</b>	<b>4,64</b>	EUR	200.000	Banco BPM SpA 1.75% 24/04/2023	202.498	0,11
<b>HONGKONG</b>					EUR	168.000	Banco BPM SpA 2.00% 08/03/2022	170.330	0,09
USD	300.000	Swire Pacific MTN Financing HK Limited 2.88% 30/01/2030	269.387	0,15	EUR	721.000	FCA Bank SpA 0.50% 13/09/2024	718.055	0,39
<b>Hongkong, insgesamt</b>			<b>269.387</b>	<b>0,15</b>	EUR	399.000	Infrastrutture Wireless Italiane SpA 1.88% 08/07/2026	404.409	0,22
					EUR	287.000	International Design Group SPA 6.50% 15/11/2025	272.732	0,15
					EUR	387.000	Nexi SpA 1.75% 31/10/2024	382.603	0,21
					<b>Italien, insgesamt</b>				
					<b>3.904.703 2,14</b>				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond

### Portfolioaufstellung

(Fortsetzung)

Nennwert		Anlage	Marktwert EUR	% des Nettoinven- tarwerts	Nennwert		Anlage	Marktwert EUR	% des Nettoinven- tarwerts
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>					<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>					<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				
<b>JERSEY – KANALINSELN</b>					<b>MEXIKO</b>				
EUR	155.000	Avis Budget Finance plc 4.75% 30/01/2026	132.975	0,07	GBP	300.000	Petroleos Mexicanos 3.75% 16/11/2025	290.467	0,16
EUR	645.000	Lhc3 plc 4.13% 15/08/2024	647.419	0,35	EUR	836.000	Petroleos Mexicanos 3.75% 16/04/2026	734.875	0,40
<b>Jersey – Kanalinseln, insgesamt</b>				<b>0,42</b>	<b>Mexiko, insgesamt</b>				<b>0,56</b>
<b>LUXEMBURG</b>					<b>NIEDERLANDE</b>				
EUR	600.000	ADO Properties SA 3.25% 05/08/2025	606.959	0,33	USD	673.000	Aegon NV FRN 11/04/2048	632.504	0,34
EUR	129.000	Altice Financing SA 2.25% 15/01/2025	123.712	0,07	USD	700.000	Braskem Netherlands Finance BV 4.50% 10/01/2028	576.046	0,32
EUR	817.000	Altice Financing SA 3.00% 15/01/2028	760.754	0,42	EUR	366.000	Constellium SE 4.25% 15/02/2026	365.800	0,20
EUR	355.000	Altice France Holding SA 4.00% 15/02/2028	324.365	0,18	EUR	500.000	Cooperatieve Rabobank UA FRN 05/05/2028	520.107	0,29
GBP	300.000	Aroundtown SA 3.00% 16/10/2029	340.285	0,19	EUR	550.000	Darling Global Finance BV 3.63% 15/05/2026	561.587	0,31
GBP	600.000	Aroundtown SA 3.25% 18/07/2027	704.474	0,39	EUR	185.000	Digital Dutch Finco BV 1.50% 15/03/2030	193.641	0,11
EUR	1.731.000	Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1.21% 04/06/2026	1.778.942	0,98	EUR	617.000	Enexis Holding NV 0.63% 17/06/2032	640.799	0,35
EUR	498.000	CPI Property Group SA 1.63% 23/04/2027	482.781	0,27	EUR	329.000	Enexis Holding NV 0.75% 02/07/2031	345.647	0,19
EUR	543.000	Garfunkelux Holdco 3 SA 7.50% 01/08/2022	505.445	0,28	EUR	928.000	Fiat Chrysler Automobiles NV 3.88% 05/01/2026	1.004.857	0,55
EUR	167.000	Groupe Ecore Holding SAS FRN 15/11/2023	119.964	0,07	EUR	500.000	ING Groep NV FRN 26/05/2031	520.179	0,29
EUR	300.000	Hanesbrands Inc. 3.50% 15/06/2024	312.664	0,17	GBP	2.085.000	Innogy Finance BV 6.25% 03/06/2030	3.248.297	1,79
EUR	180.000	Lincoln Financing SARL 3.63% 01/04/2024	173.489	0,10	EUR	344.000	LKQ Euro Holdings 3.63% 01/04/2026	348.312	0,19
EUR	200.000	Matterhorn Telecom SA 3.13% 15/09/2026	191.464	0,11	USD	667.000	Mong Duong Finance Holdings BV 5.13% 07/05/2029	579.993	0,32
EUR	1.291.000	Medtronic Global Holdings SCA 1.38% 15/10/2040	1.322.895	0,73	EUR	449.000	NE Property BV 3.38% 14/07/2027	453.008	0,25
USD	880.000	Millicom International Cellular SA 6.25% 25/03/2029	805.646	0,44	EUR	220.000	PPF Telecom Group BV 2.13% 31/01/2025	215.265	0,12
EUR	1.128.000	Novartis Finance SA 0.00% 23/09/2028	1.127.014	0,62	EUR	625.000	PPF Telecom Group BV 3.50% 20/05/2024	642.955	0,35
EUR	634.000	Prologis International Funding II SA 1.63% 17/06/2032	688.885	0,38	EUR	212.000	Q-Park Holding I BV 1.50% 01/03/2025	194.198	0,11
EUR	963.000	Sig Combibloc Purchaseco Sarl 2.13% 18/06/2025	991.266	0,55	EUR	556.000	Q-Park Holding I BV 2.00% 01/03/2027	499.130	0,27
EUR	400.000	Telenet Finance Luxembourg Notes Sarl 3.50% 01/03/2028	413.772	0,23	EUR	400.000	Redexis Gas Finance Sarl 1.88% 28/05/2025	418.765	0,23
<b>Luxemburg, insgesamt</b>				<b>0,23</b>	EUR	400.000	Relx Finance BV 0.50% 10/03/2028	401.796	0,23
					EUR	171.000	Repsol International Finance BV FRN 25/03/2075	180.170	0,10

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond

### Portfolioaufstellung

(Fortsetzung)

	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Nettoinven- tarwerts		Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Nettoinven- tarwerts
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>					<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>					<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				
<b>NIEDERLANDE (Fortsetzung)</b>					<b>SCHWEDEN</b>				
EUR	2.104.000	Stedin Holding NV Perp FRN	2.152.208	1,18	EUR	680.000	Akelius Residential Property AB 1.13% 14/03/2024	693.036	0,38
EUR	451.797	Summer BidCo BV 9.75% 15/11/2025	455.767	0,25	EUR	1.101.000	Akelius Residential Property AB 1.75% 07/02/2025	1.149.810	0,63
EUR	400.000	Syngenta Finance NV 3.38% 16/04/2026	430.464	0,24	GBP	1.091.000	Akelius Residential Property AB 2.38% 15/08/2025	1.255.963	0,69
USD	1.774.000	Syngenta Finance NV 4.89% 24/04/2025	1.641.425	0,89	EUR	826.000	Sagax AB 1.13% 30/01/2027	810.576	0,44
EUR	1.500.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	1.585.362	0,88	EUR	854.000	Sagax AB 2.00% 17/01/2024	881.810	0,48
EUR	600.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	661.567	0,36	<b>Schweden, insgesamt</b>				
EUR	1.040.000	TenneT Holding BV Perp FRN	1.055.443	0,58	<b>4.791.195</b>	<b>2,62</b>			
EUR	802.000	TenneT Holding BV Perp FRN	835.929	0,46	<b>SCHWEIZ</b>				
EUR	718.000	Trivium Packaging Finance BV 3.75% 15/08/2026	710.404	0,39	EUR	344.000	Credit Suisse Group AG FRN 02/04/2026	385.059	0,21
EUR	595.000	United Group BV 3.13% 15/02/2026	562.493	0,31	USD	481.000	UBS Group AG Perp FRN	420.850	0,23
EUR	211.000	United Group BV 4.88% 01/07/2024	213.648	0,12	EUR	448.000	UBS Group AG Perp FRN	467.740	0,26
EUR	569.000	Upjohn Finance BV 1.91% 23/06/2032	593.385	0,33	<b>Schweiz, insgesamt</b>				
EUR	400.000	Volkswagen International Finance NV 4.13% 16/11/2038	541.575	0,30	<b>1.273.649</b>	<b>0,70</b>			
<b>Niederlande, insgesamt</b>					<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH</b>				
			<b>23.982.726</b>	<b>13,20</b>	GBP	160.000	Arqiva Broadcast Finance plc 6.75% 30/09/2023	182.148	0,10
<b>SINGAPUR</b>					GBP	100.000	Arrow Global Finance 5.13% 15/09/2024	105.008	0,06
USD	640.000	Geo Coal International Pte Limited 8.00% 04/10/2022	359.398	0,20	USD	970.000	BAE Systems plc 3.40% 15/04/2030	928.294	0,51
USD	884.000	SingTel Group Treasury Pte Limited 1.88% 10/06/2030	765.883	0,42	EUR	1.113.000	BP Capital Markets plc Perp FRN	1.146.744	0,64
			<b>1.125.281</b>	<b>0,62</b>	GBP	500.000	BUPA Finance plc 4.13% 14/06/2035	585.677	0,32
<b>SPANIEN</b>					GBP	1.527.000	BUPA Finance plc 5.00% 08/12/2026	1.924.887	1,06
EUR	300.000	Bankia SA FRN 15/02/2029	317.824	0,17	EUR	2.090.000	DS Smith plc 0.88% 12/09/2026	2.087.102	1,14
EUR	500.000	CaixaBank SA FRN 10/07/2026	506.635	0,28	EUR	100.000	EC Finance plc 2.38% 15/11/2022	92.071	0,05
EUR	450.000	Grifols SA 2.25% 15/11/2027	447.669	0,25	USD	899.369	Enquest plc 7.00% 15/04/2022	423.246	0,23
EUR	298.000	Nortegas Energia Distribucion SAU 2.07% 28/09/2027	322.616	0,18	GBP	1.000.000	First Hydro Finance plc 9.00% 31/07/2021	1.170.089	0,63
			<b>1.594.744</b>	<b>0,88</b>	EUR	220.000	G4S International Finance plc 1.50% 02/06/2024	221.416	0,12
<b>SUPRANATIONAL</b>					EUR	580.000	G4S International Finance plc 1.88% 24/05/2025	584.388	0,33
EUR	182.000	Ardagh Packaging Finance plc 2.13% 15/08/2026	177.158	0,10	GBP	335.000	GKN Holdings plc 4.63% 12/05/2032	357.365	0,20
			<b>177.158</b>	<b>0,10</b>	EUR	1.074.000	HBOS plc FRN 18/03/2030	1.187.576	0,65
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>					GBP	180.000	Heathrow Finance plc 4.13% 01/09/2029	182.438	0,10
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>					GBP	482.000	HSBC Bank plc 5.38% 22/08/2033	700.705	0,39
<b>NIEDERLANDE (Fortsetzung)</b>					EUR	500.000	Imperial Brands Finance plc 1.38% 27/01/2025	515.703	0,28

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond

### Portfolioaufstellung

(Fortsetzung)

Nennwert		Anlage	Marktwert EUR	% des Nettoinven- tarwerts	Nennwert		Anlage	Marktwert EUR	% des Nettoinven- tarwerts
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>					<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>					<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				
<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH (Fortsetzung)</b>					<b>VEREINIGTE STAATEN</b>				
EUR	715.000	Imperial Brands Finance plc 3.38% 26/02/2026	807.137	0,45	USD	569.000	Amazon.com Inc. 2.70% 03/06/2060	500.540	0,28
USD	570.000	Imperial Brands Finance plc 3.50% 26/07/2026	527.148	0,29	EUR	515.000	American Tower Corp. 1.00% 15/01/2032	513.891	0,28
GBP	315.000	Iron Mountain UK plc 3.88% 15/11/2025	351.746	0,19	USD	500.000	Apple Inc. 2.65% 11/05/2050	443.848	0,25
GBP	100.000	Jaguar Land Rover Automotive plc 2.75% 24/01/2021	109.112	0,06	USD	259.000	Apple Inc. 4.50% 23/02/2036	295.603	0,16
GBP	191.000	Legal & General Group plc FRN 01/11/2050	229.115	0,13	EUR	203.000	AT&T Inc. 3.15% 04/09/2036	241.102	0,13
GBP	245.000	Legal & General Group plc FRN 14/11/2048	309.290	0,17	USD	500.000	AT&T Inc. 3.50% 01/06/2041	448.841	0,25
EUR	200.000	Natwest Group plc FRN 02/03/2026	206.959	0,11	EUR	430.000	Avantor Inc. 4.75% 01/10/2024	445.554	0,25
EUR	837.000	NGG Finance plc FRN 05/09/2082	821.668	0,45	EUR	300.000	Bank of America Corp. FRN 31/03/2029	366.254	0,20
EUR	230.000	OTE plc 0.88% 24/09/2026	236.044	0,13	EUR	400.000	Becton Dickinson & Company 1.90% 15/12/2026	426.160	0,23
GBP	520.000	Pinnacle Bidco plc 6.38% 15/02/2025	506.211	0,28	GBP	1.206.000	Becton Dickinson & Company 3.02% 24/05/2025	1.429.290	0,79
EUR	300.000	Rolls-Royce plc 1.63% 09/05/2028	241.845	0,13	EUR	162.000	Berry Global Inc. 1.00% 15/01/2025	156.239	0,09
GBP	165.000	Santander UK plc Perp 10.06%	293.475	0,16	EUR	100.000	Berry Global Inc. 1.50% 15/01/2027	96.807	0,05
EUR	855.000	SSE plc Perp FRN	875.612	0,48	USD	243.000	Boeing Company 5.93% 01/05/2060	256.390	0,14
EUR	774.000	Synthomer plc 3.88% 01/07/2025	791.017	0,44	EUR	706.000	Catalent Pharma Solutions Inc. 2.38% 01/03/2028	680.674	0,37
GBP	170.000	Telereal FRN 10/12/2033	192.022	0,11	EUR	629.000	Digital Euro Finco LLC 2.50% 16/01/2026	691.835	0,39
GBP	1.134.830	Tesco Property Finance 3 plc 5.74% 13/04/2040	1.666.139	0,92	EUR	305.000	Digital Euro Finco LLC 2.50% 16/01/2026	335.468	0,18
GBP	712.000	Tsb Banking Group plc FRN 06/05/2026	796.142	0,44	EUR	1.277.000	Equinix Inc. 2.88% 01/10/2025	1.297.281	0,71
USD	389.000	Tullow Oil plc 7.00% 01/03/2025	156.741	0,09	EUR	802.000	Equinix Inc. 2.88% 01/02/2026	819.020	0,45
GBP	221.000	Virgin Media Secured Finance plc 4.25% 15/01/2030	241.007	0,13	USD	80.000	Equinix Inc. 5.38% 15/05/2027	74.421	0,04
GBP	300.000	Virgin Media Secured Finance plc 5.00% 15/04/2027	347.324	0,19	EUR	367.000	Fidelity National Information SE 1.00% 03/12/2028	376.634	0,21
GBP	100.000	Virgin Media Secured Finance plc 5.25% 15/05/2029	116.780	0,06	EUR	320.000	Fidelity National Information SE 1.50% 21/05/2027	340.857	0,19
EUR	643.000	Vmed O2 UK Financing I plc 3.25% 31/01/2031	640.836	0,35	EUR	228.000	Fidelity National Information Services Inc. 1.50% 21/05/2027	242.861	0,13
GBP	272.000	Vmed O2 UK Financing I plc 4.00% 31/01/2029	298.662	0,16	EUR	350.000	Fidelity National Information Services Inc. 2.00% 21/05/2030	386.917	0,21
EUR	450.000	Vodafone Group plc FRN 03/01/2079	459.254	0,25	EUR	175.000	Fidelity National Information Services Inc. 2.95% 21/05/2039	212.510	0,12
EUR	432.000	Vodafone Group plc FRN 03/10/2078	474.185	0,26	EUR	196.000	Fiserv Inc. 1.63% 01/07/2030	209.803	0,12
USD	650.000	Vodafone Group plc FRN 03/10/2078	600.813	0,33	EUR	462.000	Ford Motor Credit Company LLC 3.25% 15/09/2025	450.541	0,25
GBP	405.000	Western Power Distribution plc 3.50% 16/10/2026	493.380	0,27	EUR	459.000	General Electric Company 2.13% 17/05/2037	447.971	0,25
		<b>Vereinigtes Königreich, insgesamt</b>	<b>25.184.521</b>	<b>13,84</b>	EUR	505.000	Honeywell Internation 0.75% 10/03/2032	509.336	0,28
					EUR	700.000	IQVIA Inc. 2.25% 15/01/2028	686.412	0,38
					EUR	679.000	IQVIA Inc. 2.88% 15/06/2028	687.612	0,38
					EUR	305.000	IQVIA Inc. 3.25% 15/03/2025	307.699	0,17

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond

### Portfolioaufstellung

(Fortsetzung)

	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Nettoinven- tarwerts		Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Nettoinven- tarwerts
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>					<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>					<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente</b>				
<b>VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)</b>					<b>DOMINIKANISCHE REPUBLIK</b>				
USD	1.024.000	JPMorgan Chase & Company FRN 22/04/2041	951.822	0,52	USD	333.000	Dominican Republic (Govt of) 5.88% 30/01/2060	268.815	0,15
EUR	556.000	Kraft Heinz Foods Company 2.25% 25/05/2028	565.297	0,31	USD	900.000	Dominican Republic (Govt of) 5.95% 25/01/2027	823.699	0,45
GBP	1.460.000	Kraft Heinz Foods Company 4.13% 01/07/2027	1.746.450	0,96	<b>Dominikanische Republik, insgesamt</b>				
USD	737.000	Microsoft Corp. 4.10% 06/02/2037	818.516	0,44	<b>1.092.514 0,60</b>				
GBP	118.000	MPT Operating Partnership LP 2.55% 05/12/2023	130.007	0,07	<b>ÄGYPTEN</b>				
EUR	228.000	Netflix Inc. 3.00% 15/06/2025	237.911	0,13	EUR	450.000	Egypt (Govt of) 5.63% 16/04/2030	409.108	0,23
EUR	987.000	Netflix Inc. 3.63% 15/05/2027	1.067.832	0,58	<b>Ägypten, insgesamt</b>				
EUR	300.000	Netflix Inc. 3.63% 15/06/2030	325.807	0,18	<b>409.108 0,23</b>				
EUR	673.000	Netflix Inc. 3.88% 15/11/2029	744.237	0,41	<b>FRANKREICH</b>				
USD	179.000	Plains All American Pipeline LP 3.55% 15/12/2029	147.852	0,08	EUR	700.000	Agence Francaise de Developpement EPIC 0.50% 31/10/2025	728.335	0,40
USD	335.000	Plains All American Pipeline LP 4.65% 15/10/2025	306.924	0,17	<b>Frankreich, insgesamt</b>				
EUR	243.000	Refinitiv US Holdings Inc. 4.50% 15/05/2026	255.176	0,14	<b>728.335 0,40</b>				
EUR	214.000	Silgan Holdings Inc. 2.25% 01/06/2028	209.313	0,12	<b>DEUTSCHLAND</b>				
EUR	200.000	Silgan Holdings Inc. 3.25% 15/03/2025	202.898	0,11	EUR	1.060.000	Germany (Govt of) 0.00% 15/02/2030	1.116.950	0,61
EUR	574.000	Spectrum Brands Inc. 4.00% 01/10/2026	588.814	0,32	EUR	2.600.000	Germany (Govt of) 0.00% 15/08/2030	2.738.880	1,51
EUR	218.000	Thermo Fisher Scientific Inc. 1.88% 01/10/2049	220.332	0,12	EUR	4.800.000	Germany (Govt of) 0.50% 15/02/2025	5.065.679	2,79
GBP	350.000	Time Warner Cable Inc. 5.75% 02/06/2031	491.576	0,27	EUR	2.000.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0.00% 15/09/2028	2.072.518	1,14
EUR	288.000	UGI International LLC 3.25% 01/11/2025	292.293	0,16	<b>Deutschland, insgesamt</b>				
EUR	1.210.000	Wells Fargo & Company FRN 04/05/2030	1.280.195	0,69	<b>10.994.027 6,05</b>				
<b>Vereinigte Staaten, insgesamt</b>					<b>ITALIEN</b>				
<b>24.961.623 13,71</b>					EUR	360.000	Italy (Govt of) BPT 2.45% 01/09/2050	418.470	0,23
<b>BRITISCHE JUNGFERNINSELN</b>					EUR	687.000	Italy (Govt of) BPT 2.70% 01/03/2047	836.713	0,46
USD	557.000	CLP Power Hong Kong Financing Limited 2.13% 30/06/2030	481.889	0,27	<b>Italien, insgesamt</b>				
USD	1.193.000	Gold Fields Orogen Holdings BVI Limited 6.13% 15/05/2029	1.198.657	0,66	<b>1.255.183 0,69</b>				
<b>Britische Jungferninseln, insgesamt</b>					<b>ELFENBEINKÜSTE</b>				
<b>1.680.546 0,93</b>					EUR	250.000	Ivory Coast (Govt of) 5.25% 22/03/2030	227.483	0,13
<b>Anleihen, insgesamt</b>					EUR	290.000	Ivory Coast (Govt of) 5.88% 17/10/2031	263.916	0,15
<b>142.990.360 78,68</b>					<b>Elfenbeinküste, insgesamt</b>				
					<b>491.399 0,28</b>				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond

### Portfolioaufstellung

(Fortsetzung)

Nennwert		Anlage	Marktwert EUR	% des Nettoinven- tarwerts	Nennwert		Anlage	Marktwert EUR	% des Nettoinven- tarwerts
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>					<b>Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere (Fortsetzung)</b>				
<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)</b>					<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				
<b>SENEGAL</b>					<b>VEREINIGTE STAATEN</b>				
EUR	550.000	Senegal (Govt of) 4.75% 13/03/2028	532.886	0,29	USD	815.000	AbbVie Inc. 4.25% 21/11/2049	821.525	0,45
					USD	485.000	Broadcom Inc. 5.00% 15/04/2030	488.593	0,27
		<b>Senegal, insgesamt</b>	<b>532.886</b>	<b>0,29</b>	USD	925.000	Carrier Global Corp. 2.72% 15/02/2030	824.907	0,45
					USD	700.000	Cott Holdings Inc. 5.50% 01/04/2025	613.079	0,34
<b>SPANIEN</b>					<b>Vereinigte Staaten, insgesamt</b>				
EUR	1.230.000	Spain (Govt of) 1.45% 30/04/2029	1.371.567	0,75				<b>2.748.104</b>	<b>1,51</b>
EUR	505.000	Spain (Govt of) 2.90% 31/10/2046	731.480	0,40	<b>Anleihen, insgesamt</b>				
		<b>Spanien, insgesamt</b>	<b>2.103.047</b>	<b>1,15</b>	<b>Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere, insgesamt</b>				
<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH</b>					<b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>				
GBP	2.230.000	United Kingdom Gilt 1.25% 22/10/2041	2.708.833	1,49	<b>Anleihen</b>				
		<b>Vereinigtes Königreich, insgesamt</b>	<b>2.708.833</b>	<b>1,49</b>	<b>BERMUDAS</b>				
<b>VEREINIGTE STAATEN</b>					USD 1.950.000 Bacardi Limited 4.45% 15/05/2025 1.855.124 1,02				
USD	250.000	United States Treasury N/B 1.25% 15/05/2050	202.083	0,11	<b>Bermudas, insgesamt</b>				
		<b>Vereinigte Staaten, insgesamt</b>	<b>202.083</b>	<b>0,11</b>	<b>ITALIEN</b>				
<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente, insgesamt</b>					USD 400.000 Intesa Sanpaolo SpA 4.00% 23/09/2029 372.234 0,20				
			<b>20.517.415</b>	<b>11,29</b>	<b>Italien, insgesamt</b>				
			<b>163.507.775</b>	<b>89,97</b>	<b>LUXEMBURG</b>				
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt</b>					EUR 1.220.000 Altice France Holding SA 8.00% 15/05/2027 1.297.085 0,72				
<b>Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere</b>					<b>Luxemburg, insgesamt</b>				
<b>Anleihen</b>					<b>1.297.085 0,72</b>				
<b>FRANKREICH</b>					<b>PORTUGAL</b>				
USD	850.000	BPCE SA 2.70% 01/10/2029	780.456	0,43	EUR	100.000	Banco Espirito Santo SA 4.00% 21/01/2021	21.676	0,01
		<b>Frankreich, insgesamt</b>	<b>780.456</b>	<b>0,43</b>	<b>Portugal, insgesamt</b>				
					<b>21.676 0,01</b>				
<b>NIEDERLANDE</b>					<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH</b>				
USD	467.000	Vonovia Finance BV 5.00% 02/10/2023	427.587	0,24	GBP	395.000	Pinewood Finance Company Limited 3.25% 30/09/2025	435.496	0,24
		<b>Niederlande, insgesamt</b>	<b>427.587</b>	<b>0,24</b>	<b>Vereinigtes Königreich, insgesamt</b>				
					<b>435.496 0,24</b>				
<b>Anleihen, insgesamt</b>					<b>Anleihen, insgesamt</b>				
					<b>3.981.615 2,19</b>				
<b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, insgesamt</b>					<b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, insgesamt</b>				
					<b>3.981.615 2,19</b>				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond

### Portfolioaufstellung

(Fortsetzung)

			% des
Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	Nettoinven- tarwerts
<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren</b>			
<b>Fonds</b>			
<b>IRLAND</b>			
26.236	BlackRock Institutional Cash Series Euro Liquidity Fund Premier	2.602.679	1,43
	<b>Irland, insgesamt</b>	<b>2.602.679</b>	<b>1,43</b>
	<b>Fonds, insgesamt</b>	<b>2.602.679</b>	<b>1,43</b>
	<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren, insgesamt</b>	<b>2.602.679</b>	<b>1,43</b>
	<b>Wert der Anlagen, insgesamt</b>	<b>174.048.216</b>	<b>95,77</b>
<b>(Gesamtkosten: EUR 173.508.734)</b>			

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds

### Portfolioaufstellung

zum 30. September 2020

	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts		Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung</b>					<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				
<b>Anleihen</b>					<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				
<b>BERMUDAS</b>					<b>KAIMANINSELN (Fortsetzung)</b>				
USD	200.000	China Oil & Gas Group Limited 5.50% 25/01/2023	205.203	0,48	USD	200.000	Qnb Finance Limited 2.75% 12/02/2027	208.850	0,49
USD	500.000	LI & Fung Limited 4.50% 18/08/2025	500.960	1,17	USD	200.000	Sands China Limited 5.13% 08/08/2025	219.589	0,51
USD	350.000	Ooredoo International Finance Limited 4.50% 31/01/2043	451.431	1,05	USD	750.000	Saudi Electricity Company 2.41% 17/09/2030	749.637	1,75
		<b>Bermudas, insgesamt</b>	<b>1.157.594</b>	<b>2,70</b>	USD	400.000	Semiconductor Manufacturing International Corp. 2.69% 27/02/2025	394.354	0,92
<b>BRASILIEN</b>					USD	200.000	Tencent Holdings Limited 3.60% 19/01/2028	220.249	0,51
USD	200.000	Cemig Geracao e Transmissao SA 9.25% 05/12/2024	221.250	0,52	USD	350.000	Times China Holdings Limited 10.95% 27/11/2020	354.261	0,83
USD	400.000	Light Servicos de Eletricidade SA 7.25% 03/05/2023	419.344	0,98	USD	367.000	Tingyi (Cayman Islands) Holding Corporation 1.63% 24/09/2025	364.098	0,85
		<b>Brasilien, insgesamt</b>	<b>640.594</b>	<b>1,50</b>	USD	470.000	Vale Overseas Limited 3.75% 08/07/2030	483.982	1,13
<b>KANADA</b>					<b>Kaimaninseln, insgesamt</b>				
USD	716.000	Meglobal Canada ULC 5.00% 18/05/2025	772.872	1,80				<b>7.248.283</b>	<b>16,94</b>
		<b>Kanada, insgesamt</b>	<b>772.872</b>	<b>1,80</b>	<b>CHILE</b>				
<b>KAIMANINSELN</b>					USD	200.000	VTR Comunicaciones SpA 5.13% 15/01/2028	207.281	0,48
USD	200.000	AAC Technologies Holdings Inc. 3.00% 27/11/2024	200.204	0,47	<b>Chile, insgesamt</b>				
USD	200.000	Alibaba Group Holding Limited 3.60% 28/11/2024	219.364	0,51				<b>207.281</b>	<b>0,48</b>
USD	400.000	Cifi Holdings Group Company Limited 6.00% 16/07/2025	403.040	0,94	<b>CHINA</b>				
USD	200.000	CK Hutchison International 17 II Limited 3.25% 29/09/2027	219.901	0,51	USD	200.000	Bank of China Limited 5.00% 13/11/2024	222.337	0,52
USD	343.000	Comunicaciones Celulares SA 6.88% 06/02/2024	350.971	0,82	<b>China, insgesamt</b>				
USD	400.000	Country Garden Holdings Company Limited 7.25% 08/04/2026	445.718	1,04				<b>222.337</b>	<b>0,52</b>
USD	600.000	Energuate Trust 5.88% 03/05/2027	621.563	1,45	<b>KOLUMBIEN</b>				
USD	212.000	ENN Energy Holdings Limited 2.63% 17/09/2030	212.351	0,50	USD	350.000	Ecopetrol SA 6.88% 29/04/2030	419.271	0,98
USD	200.000	JD.com Inc. 3.38% 14/01/2030	217.188	0,51	<b>Kolumbien, insgesamt</b>				
USD	200.000	Longfor Group Holdings Limited 3.95% 16/09/2029	213.744	0,50				<b>419.271</b>	<b>0,98</b>
USD	200.000	Longfor Properties Company 4.50% 16/01/2028	219.843	0,51	<b>HONGKONG</b>				
USD	400.000	Melco Resorts Finance Limited 5.75% 21/07/2028	407.250	0,96	USD	250.000	Bank of East Asia Limited FRN 03/11/2026	252.790	0,59
USD	500.000	Qnb Finance Limited 2.75% 12/02/2027	522.126	1,23	USD	200.000	CNAC HK Finbridge Company Limited 4.63% 14/03/2023	211.755	0,49
					USD	800.000	Lenovo Group Limited 5.88% 24/04/2025	859.837	2,01
					<b>Hongkong, insgesamt</b>				
								<b>1.324.382</b>	<b>3,09</b>

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.



## Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds

### Portfolioaufstellung

(Fortsetzung)

	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts		Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>					<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>					<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				
<b>INDIEN</b>					<b>LUXEMBURG (Fortsetzung)</b>				
USD	200.000	Adani Electricity Mumbai Limited 3.95% 12/02/2030	195.999	0,46	USD	200.000	Rede D'or Finance Sarl 4.50% 22/01/2030	190.250	0,44
USD	600.000	Adani Ports & Special Economic Zone Limited 4.00% 30/07/2027	600.176	1,41	USD	200.000	Rumo Luxembourg Sarl 5.25% 10/01/2028	208.290	0,49
USD	200.000	Adani Ports & Special Economic Zone Limited 4.20% 04/08/2027	201.635	0,47	<b>Luxemburg, insgesamt</b>				
USD	200.000	Bharti Airtel Limited 4.38% 10/06/2025	211.558	0,49	<b>1.938.165 4,54</b>				
USD	250.000	GMR Hyderabad International Airport Limited 4.25% 27/10/2027	222.719	0,52	<b>MALAYSIA</b>				
USD	200.000	JSW Steel Limited 5.95% 18/04/2024	205.014	0,48	USD	642.000	Press Metal Labuan Limited 4.80% 30/10/2022	630.488	1,47
USD	400.000	Neerg Energy Limited 6.00% 13/02/2022	400.533	0,93	<b>Malaysia, insgesamt</b>				
USD	250.000	Reliance Industries Limited 3.67% 30/11/2027	274.777	0,64	<b>630.488 1,47</b>				
<b>Indien, insgesamt</b>			<b>2.312.411</b>	<b>5,40</b>	<b>MAURITIUS</b>				
					USD	200.000	Greenko Solar Mauritius Limited 5.55% 29/01/2025	203.548	0,48
					USD	400.000	HTA Group Limited 7.00% 18/12/2025	418.250	0,98
					<b>Mauritius, insgesamt</b>				
					<b>621.798 1,46</b>				
<b>INDONESIEN</b>					<b>MEXIKO</b>				
USD	295.000	Bank Mandiri Persero Tbk Pt 4.75% 13/05/2025	325.811	0,76	USD	500.000	BBVA Bancomer SA FRN 13/09/2034	506.925	1,18
USD	648.000	Saka Energi Indonesia Pt 4.45% 05/05/2024	587.785	1,37	USD	600.000	Cemex SAB de CV 7.38% 05/06/2027	648.550	1,52
USD	600.000	Sri Rejeki Isman Tbk Pt 7.25% 16/01/2025	589.386	1,38	USD	237.000	Gruma SAB de CV 4.88% 01/12/2024	264.051	0,62
<b>Indonesien, insgesamt</b>			<b>1.502.982</b>	<b>3,51</b>	USD	800.000	Petroleos Mexicanos 5.35% 12/02/2028	690.263	1,61
					USD	250.000	Petroleos Mexicanos 6.84% 23/01/2030	222.969	0,52
					<b>Mexiko, insgesamt</b>				
					<b>2.332.758 5,45</b>				
<b>IRLAND</b>					<b>MAROKKO</b>				
USD	200.000	Phosagro OAO Via Phosagro Bond Funding Dac 3.05% 23/01/2025	204.625	0,48	USD	557.000	OCP SA 6.88% 25/04/2044	708.637	1,65
<b>Irland, insgesamt</b>			<b>204.625</b>	<b>0,48</b>	<b>Marokko, insgesamt</b>				
					<b>708.637 1,65</b>				
<b>ISLE OF MAN</b>					<b>NIEDERLANDE</b>				
USD	400.000	Gohl Capital Limited 4.25% 24/01/2027	398.905	0,93	USD	600.000	Braskem Netherlands Finance BV 4.50% 31/01/2030	559.305	1,31
<b>Isle of Man, insgesamt</b>			<b>398.905</b>	<b>0,93</b>	USD	400.000	Lukoil Securities BV 3.88% 06/05/2030	422.732	0,99
					USD	500.000	Mong Duong Finance Holdings BV 5.13% 07/05/2029	509.842	1,19
					USD	200.000	Petrobras Global Finance BV 4.38% 20/05/2023	210.711	0,49
<b>LUXEMBURG</b>									
USD	500.000	Altice Financing SA 5.00% 15/01/2028	486.788	1,14					
USD	400.000	MHP Lux SA 6.95% 03/04/2026	403.328	0,94					
USD	605.000	Millicom International Cellular SA 6.25% 25/03/2029	649.509	1,53					

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds

### Portfolioaufstellung

(Fortsetzung)

Nennwert		Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts	Nennwert		Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>					<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>					<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				
<b>NIEDERLANDE (Fortsetzung)</b>					<b>SINGAPUR</b>				
USD	400.000	Petrobras Global Finance BV 6.75% 03/06/2050	429.750	1,00	USD	200.000	Boc Aviation Limited 2.63% 17/09/2030	198.611	0,46
USD	250.000	Petrobras Global Finance BV 8.38% 23/05/2021	260.507	0,61	USD	600.000	DBS Group Holdings Limited FRN 11/12/2028	654.008	1,54
USD	286.000	Sabic Capital I BV 2.15% 14/09/2030	280.535	0,66	USD	450.000	Geo Coal International Pte Limited 8.00% 04/10/2022	296.331	0,69
USD	500.000	Syngenta Finance NV 5.18% 24/04/2028	550.922	1,29	USD	200.000	PSA Treasury PTE 2.25% 30/04/2030	210.458	0,49
USD	392.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV 3.15% 01/10/2026	346.185	0,81	USD	200.000	SingTel Group Treasury Pte Limited 2.38% 28/08/2029	212.044	0,50
		<b>Niederlande, insgesamt</b>	<b>3.570.489</b>	<b>8,35</b>	USD	450.000	United Overseas Bank Limited FRN 16/03/2031	446.978	1,04
							<b>Singapur, insgesamt</b>	<b>2.018.430</b>	<b>4,72</b>
<b>PERU</b>					<b>SÜDAFRIKA</b>				
USD	650.000	Hunt Oil Companyof Peru LLC 6.38% 01/06/2028	648.375	1,51	USD	244.000	Transnet SOC Limited 4.00% 26/07/2022	242.364	0,56
USD	500.000	Volcan Compania Minera SAA 5.38% 02/02/2022	499.970	1,17			<b>Südafrika, insgesamt</b>	<b>242.364</b>	<b>0,56</b>
		<b>Peru, insgesamt</b>	<b>1.148.345</b>	<b>2,68</b>					
<b>PHILIPPINEN</b>					<b>THAILAND</b>				
USD	250.000	Globe Telecom Inc. 2.50% 23/07/2030	241.693	0,56	USD	700.000	Bangkok Bank pcl FRN 25/09/2034	685.422	1,61
USD	200.000	International Container Terminal Services Inc. 4.75% 17/06/2030	209.585	0,49	USD	200.000	Kasikornbank pcl FRN 02/10/2031	196.675	0,46
USD	357.000	Metropolitan Bank & Trust Company 2.13% 15/01/2026	354.834	0,83	USD	200.000	PTT Treasury Center Company Limited 3.70% 16/07/2070	201.494	0,47
USD	200.000	Pldt Inc. 2.50% 23/01/2031	205.603	0,48	USD	200.000	Pttep Treasury Center Company Limited 2.59% 10/06/2027	207.590	0,48
USD	430.000	Smc Global Power Holdings Corp. Perp FRN	413.553	0,97			<b>Thailand, insgesamt</b>	<b>1.291.181</b>	<b>3,02</b>
		<b>Philippinen, insgesamt</b>	<b>1.425.268</b>	<b>3,33</b>					
<b>SÜDKOREA</b>					<b>TÜRKEI</b>				
USD	200.000	Kookmin Bank 4.50% 01/02/2029	232.527	0,54	USD	200.000	Akbank Turk AS 6.80% 06/02/2026	193.918	0,45
USD	200.000	SK Hynix Inc. 3.00% 17/09/2024	210.508	0,49	USD	380.000	KOC Holding AS 6.50% 11/03/2025	386.252	0,90
		<b>Südkorea, insgesamt</b>	<b>443.035</b>	<b>1,03</b>	USD	200.000	Türkiye Garanti Bankasi AS 5.88% 16/03/2023	198.534	0,46
							<b>Türkei, insgesamt</b>	<b>778.704</b>	<b>1,81</b>
<b>SAUDI-ARABIEN</b>					<b>VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE</b>				
USD	200.000	Saudi Arabian Oil Company 2.88% 16/04/2024	209.851	0,49	USD	700.000	DP World Limited 6.85% 02/07/2037	877.276	2,05
USD	400.000	Saudi Arabian Oil Company 3.50% 16/04/2029	439.738	1,03			<b>Vereinigte Arabische Emirate, insgesamt</b>	<b>877.276</b>	<b>2,05</b>
USD	200.000	Saudi Arabian Oil Company 3.50% 16/04/2029	219.869	0,51					
		<b>Saudi-Arabien, insgesamt</b>	<b>869.458</b>	<b>2,03</b>					

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds

### Portfolioaufstellung

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts			
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>						
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)</b>						
<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH</b>				<b>TÜRKEI</b>						
USD	200.000	Gazprom PJSC 3.00% 29/06/2027	200.033	0,47	USD	200.000	Turkey (Govt of) 4.25% 14/04/2026	180.507	0,42	
USD	400.000	Liquid Telecommunications Financing plc 8.50% 13/07/2022	408.766	0,95	USD	200.000	Turkey (Govt of) 5.13% 17/02/2028	182.164	0,43	
USD	200.000	Nak Naftogaz Ukraine Via Kondor Finance plc 7.63% 08/11/2026	193.079	0,45	USD	400.000	Turkey (Govt of) 5.75% 22/03/2024	393.763	0,92	
USD	400.000	Tullow Oil plc 7.00% 01/03/2025	189.000	0,44	<b>Türkei, insgesamt</b>					
USD	400.000	Vedanta Resources plc 6.38% 30/07/2022	322.919	0,75	<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente, insgesamt</b>					
<b>Vereinigtes Königreich, insgesamt</b>				<b>1.313.797</b>	<b>3,06</b>	<b>1.127.972</b>				<b>2,64</b>
<b>VEREINIGTE STAATEN</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt</b>				<b>41.687.829</b>	<b>97,39</b>	
USD	400.000	Braskem America Finance Company 7.13% 22/07/2041	424.005	0,99	<b>Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere</b>					
<b>Vereinigte Staaten, insgesamt</b>				<b>424.005</b>	<b>0,99</b>	<b>Anleihen</b>				
<b>BRITISCHE JUNGFERNINSELN</b>				<b>ISLE OF MAN</b>						
USD	400.000	Elect Global Investments Limited Perp FRN	389.622	0,91	USD	200.000	Anglogold Ashanti Holdings plc 3.75% 01/10/2030	204.250	0,48	
USD	450.000	FPC Resources Limited 4.38% 11/09/2027	457.763	1,07	<b>Isle of Man, insgesamt</b>					
USD	600.000	Gold Fields Orogen Holdings BVI Limited 6.13% 15/05/2029	706.926	1,65	<b>204.250</b>				<b>0,48</b>	
USD	511.000	HKT Capital No 5 Limited 3.25% 30/09/2029	551.214	1,29	<b>Anleihen, insgesamt</b>					
USD	728.000	JGSH Philippines Limited 4.13% 09/07/2030	740.088	1,73	<b>Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere, insgesamt</b>					
USD	200.000	Studio City Finance Limited 7.25% 11/02/2024	205.404	0,48	<b>204.250</b>				<b>0,48</b>	
USD	467.000	TSMC Global Limited 0.75% 28/09/2025	463.105	1,09	<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren</b>					
<b>Britische Jungferninseln, insgesamt</b>				<b>3.514.122</b>	<b>8,22</b>	<b>Fonds</b>				
<b>Anleihen, insgesamt</b>				<b>40.559.857</b>	<b>94,75</b>	<b>IRLAND</b>				
<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente</b>				136.433 BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund				136.433	0,32	
<b>SÜDAFRIKA</b>				<b>Irland, insgesamt</b>				<b>136.433</b>	<b>0,32</b>	
USD	380.000	Eskom Holdings Limited 5.75% 26/01/2021	371.538	0,87	<b>Fonds, insgesamt</b>					
<b>Südafrika, insgesamt</b>				<b>371.538</b>	<b>0,87</b>	<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren, insgesamt</b>				
<b>Wert der Anlagen, insgesamt</b>				<b>42.028.512</b>				<b>98,19</b>		
				<b>(Gesamtkosten: USD 41.321.412)</b>						

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt

### Portfolioaufstellung

zum 30. September 2020

	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts		Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung</b>					<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				
<b>Anleihen</b>					<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				
<b>KANADA</b>					<b>INDONESIEN</b>				
USD	316.000	Meglobal Canada ULC 5.00% 18/05/2025	341.099	0,70	USD	450.000	Indonesia Asahan Aluminium Persero Pt 5.45% 15/05/2030	519.081	1,06
		<b>Kanada, insgesamt</b>	<b>341.099</b>	<b>0,70</b>	USD	650.000	Indonesia Asahan Aluminium Persero Pt 6.76% 15/11/2048	839.719	1,73
<b>KAIMANINSELN</b>					<b>INDONESIEN, insgesamt</b>				
USD	200.000	Energuate Trust 5.88% 03/05/2027	207.188	0,42	USD	200.000	Pelabuhan Indonesia II 5.38% 05/05/2045	230.336	0,47
USD	500.000	Qnb Finance Limited 2.75% 12/02/2027	522.126	1,07	USD	700.000	Saka Energi Indonesia Pt 4.45% 05/05/2024	634.954	1,30
USD	750.000	Saudi Electricity Company 2.41% 17/09/2030	749.635	1,54	<b>Indonesien, insgesamt</b>				
USD	280.000	Vale Overseas Limited 3.75% 08/07/2030	288.330	0,59				<b>2.224.090</b>	<b>4,56</b>
		<b>Kaimaninseln, insgesamt</b>	<b>1.767.279</b>	<b>3,62</b>	<b>KASACHSTAN</b>				
<b>CHILE</b>					<b>LUXEMBURG</b>				
USD	200.000	Corp Nacional del Cobre de Chile 3.00% 30/09/2029	210.925	0,43	USD	200.000	MHP Lux SA 6.95% 03/04/2026	201.664	0,41
		<b>Chile, insgesamt</b>	<b>210.925</b>	<b>0,43</b>	USD	200.000	Millicom International Cellular SA 5.13% 15/01/2028	207.858	0,43
<b>ECUADOR</b>					<b>LUXEMBURG, insgesamt</b>				
USD	421.005	Ecuador (Govt of) 0.50% 31/07/2035	236.885	0,49	USD	200.000	Millicom International Cellular SA 6.25% 25/03/2029	214.714	0,44
USD	192.950	Ecuador (Govt of) 0.50% 31/07/2040	98.142	0,20	<b>Luxemburg, insgesamt</b>				
		<b>Ecuador, insgesamt</b>	<b>335.027</b>	<b>0,69</b>				<b>624.236</b>	<b>1,28</b>
<b>GUATEMALA</b>					<b>MALAYSIA</b>				
USD	250.000	Guatemala (Govt of) 6.13% 01/06/2050	298.305	0,61	USD	200.000	Petronas Capital Limited 3.50% 21/04/2030	224.060	0,46
		<b>Guatemala, insgesamt</b>	<b>298.305</b>	<b>0,61</b>	<b>Malaysia, insgesamt</b>				
								<b>224.060</b>	<b>0,46</b>
<b>HONGKONG</b>					<b>MEXIKO</b>				
USD	400.000	Lenovo Group Limited 5.88% 24/04/2025	429.918	0,88	USD	380.000	Petroleos Mexicanos 4.50% 23/01/2026	337.354	0,69
		<b>Hongkong, insgesamt</b>	<b>429.918</b>	<b>0,88</b>	USD	505.000	Petroleos Mexicanos 5.35% 12/02/2028	435.728	0,89
<b>INDIEN</b>					<b>MEXIKO, insgesamt</b>				
USD	200.000	Adani Ports & Special Economic Zone Limited 4.00% 30/07/2027	200.059	0,41	USD	500.000	Petroleos Mexicanos 5.95% 28/01/2031	416.435	0,85
		<b>Indien, insgesamt</b>	<b>200.059</b>	<b>0,41</b>	USD	200.000	Petroleos Mexicanos 6.38% 23/01/2045	150.250	0,31
					USD	400.000	Petroleos Mexicanos 6.50% 23/01/2029	359.000	0,74
					USD	1.290.000	Petroleos Mexicanos 6.84% 23/01/2030	1.150.518	2,36

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt

### Portfolioaufstellung

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts			
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>						
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>						
<b>MEXIKO (Fortsetzung)</b>				<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH</b>						
USD	1.140.000	Petroleos Mexicanos 7.69% 23/01/2050	941.783	1,93	USD	200.000	Liquid Telecommunications Financing plc 8.50% 13/07/2022	204.383	0,42	
		<b>Mexiko, insgesamt</b>	<b>3.791.068</b>	<b>7,77</b>	USD	200.000	Tullow Oil plc 7.00% 01/03/2025	94.500	0,19	
				<b>Vereinigtes Königreich, insgesamt</b>				<b>298.883</b>	<b>0,61</b>	
<b>MAROKKO</b>				<b>VEREINIGTE STAATEN</b>						
USD	250.000	OCP SA 6.88% 25/04/2044	318.060	0,65	USD	400.000	Braskem America Finance Company 7.13% 22/07/2041	424.005	0,87	
		<b>Marokko, insgesamt</b>	<b>318.060</b>	<b>0,65</b>	USD	378.000	Petroleos Mexicanos 6.63% 15/06/2035	311.214	0,64	
				<b>Vereinigte Staaten, insgesamt</b>				<b>735.219</b>	<b>1,51</b>	
<b>NIEDERLANDE</b>				<b>BRITISCHE JUNGFERNINSELN</b>						
USD	250.000	Braskem Netherlands Finance BV 3.50% 10/01/2023	251.648	0,52	USD	250.000	Gold Fields Orogen Holdings BVI Limited 6.13% 15/05/2029	294.553	0,60	
USD	200.000	Braskem Netherlands Finance BV 4.50% 31/01/2030	186.435	0,38	USD	894.000	JGSH Philippines Limited 4.13% 09/07/2030	908.845	1,86	
USD	250.000	Mong Duong Finance Holdings BV 5.13% 07/05/2029	254.921	0,52	USD	200.000	Sinopec Group Overseas Development 2017 Limited 3.25% 13/09/2027	218.183	0,45	
USD	200.000	Petrobras Global Finance BV 8.38% 23/05/2021	208.406	0,43	USD	200.000	Sinopec Group Overseas Development 2018 Limited 4.13% 12/09/2025	225.928	0,46	
USD	286.000	Sabic Capital I BV 2.15% 14/09/2030	280.535	0,58	USD	200.000	State Grid Overseas Investment 1.63% 05/08/2030	193.705	0,40	
USD	610.000	Syngenta Finance NV 5.18% 24/04/2028	672.125	1,38	<b>Britische Jungferninseln, insgesamt</b>				<b>1.841.214</b>	<b>3,77</b>
USD	250.000	Syngenta Finance NV 5.68% 24/04/2048	268.568	0,55	<b>Anleihen, insgesamt</b>				<b>18.032.126</b>	<b>36,97</b>
		<b>Niederlande, insgesamt</b>	<b>2.122.638</b>	<b>4,36</b>	<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente</b>					
<b>PHILIPPINEN</b>				<b>ANGOLA</b>						
USD	250.000	Smc Global Power Holdings Corp. Perp FRN 21/07/2168	240.438	0,49	USD	400.000	Angola (Govt of) 8.00% 26/11/2029	317.716	0,65	
		<b>Philippinen, insgesamt</b>	<b>240.438</b>	<b>0,49</b>	USD	500.000	Angola (Govt of) 9.38% 08/05/2048	391.705	0,80	
				<b>Angola, insgesamt</b>				<b>709.421</b>	<b>1,45</b>	
<b>SINGAPUR</b>				<b>ARGENTINIEN</b>						
USD	340.000	Geo Coal International Pte Limited 8.00% 04/10/2022	223.894	0,46	USD	1.601.468	Argentina (Govt of) FRN 09/07/2035	602.509	1,24	
		<b>Singapur, insgesamt</b>	<b>223.894</b>	<b>0,46</b>	USD	90.000	Argentina (Govt of) 0.13% 09/07/2046	34.679	0,07	
				<b>Argentinien, insgesamt</b>				<b>637.188</b>	<b>1,31</b>	
<b>VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE</b>										
USD	700.000	DP World Limited 6.85% 02/07/2037	877.276	1,80						
		<b>Vereinigte Arabische Emirate, insgesamt</b>	<b>877.276</b>	<b>1,80</b>						

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt

### Portfolioaufstellung

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts		
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>					
<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)</b>				<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)</b>					
<b>BELARUS</b>				<b>DOMINIKANISCHE REPUBLIK</b>					
USD	200.000	Belarus (Govt of) 6.20% 28/02/2030	187.563	0,38	USD	400.000	Dominican Republic (Govt of) 4.88% 23/09/2032	396.936	0,81
		<b>Belarus, insgesamt</b>	<b>187.563</b>	<b>0,38</b>	USD	222.000	Dominican Republic (Govt of) 5.88% 30/01/2060	210.151	0,43
<b>BRASILIEN</b>				<b>DOMINIKANISCHE REPUBLIK</b>					
USD	880.000	Brazil (Govt of) 5.00% 27/01/2045	885.898	1,82	USD	151.000	Dominican Republic (Govt of) 6.40% 05/06/2049	151.725	0,31
		<b>Brasilien, insgesamt</b>	<b>885.898</b>	<b>1,82</b>	USD	314.000	Dominican Republic (Govt of) 7.45% 30/04/2044	353.192	0,72
<b>KAIMANINSELN</b>				<b>DOMINIKANISCHE REPUBLIK</b>					
USD	200.000	KSA Sukuk 2.97% 29/10/2029	212.734	0,44	DOP	11.700.000	Dominican Republic (Govt of) 9.75% 05/06/2026	204.797	0,42
		<b>Kaimaninseln, insgesamt</b>	<b>212.734</b>	<b>0,44</b>	DOP	21.600.000	Dominican Republic (Govt of) 11.25% 05/02/2027	407.785	0,84
<b>CHILE</b>				<b>DOMINIKANISCHE REPUBLIK</b>					
USD	200.000	Chile (Govt of) 3.50% 25/01/2050	228.372	0,47			<b>Dominikanische Republik, insgesamt</b>	<b>1.724.586</b>	<b>3,53</b>
		<b>Chile, insgesamt</b>	<b>228.372</b>	<b>0,47</b>	<b>ECUADOR</b>				
<b>CHINA</b>				<b>ECUADOR</b>					
USD	200.000	China (Govt of) 1.95% 03/12/2024	210.670	0,43	USD	210.650	Ecuador (Govt of) 0.50% 31/07/2030	144.164	0,30
		<b>China, insgesamt</b>	<b>210.670</b>	<b>0,43</b>			<b>Ecuador, insgesamt</b>	<b>144.164</b>	<b>0,30</b>
<b>KOLUMBIEN</b>				<b>ÄGYPTEN</b>					
USD	1.100.000	Colombia (Govt of) 3.00% 30/01/2030	1.120.262	2,30	EUR	180.000	Egypt (Govt of) 5.63% 16/04/2030	191.896	0,39
USD	214.000	Colombia (Govt of) 3.13% 15/04/2031	218.901	0,45	EUR	200.000	Egypt (Govt of) 6.38% 11/04/2031	219.096	0,45
		<b>Kolumbien, insgesamt</b>	<b>1.339.163</b>	<b>2,75</b>	USD	250.000	Egypt (Govt of) 7.63% 29/05/2032	244.978	0,50
<b>COSTA RICA</b>				<b>ÄGYPTEN</b>					
USD	200.000	Costa Rica (Govt of) 6.13% 19/02/2031	188.110	0,39	USD	425.000	Egypt (Govt of) 8.50% 31/01/2047	412.097	0,84
		<b>Costa Rica, insgesamt</b>	<b>188.110</b>	<b>0,39</b>	USD	250.000	Egypt (Govt of) 8.88% 29/05/2050	247.985	0,51
<b>KROATIEN</b>				<b>ÄGYPTEN</b>					
USD	200.000	Croatia (Govt of) 6.00% 26/01/2024	231.831	0,48			<b>Ägypten, insgesamt</b>	<b>1.316.052</b>	<b>2,69</b>
		<b>Kroatien, insgesamt</b>	<b>231.831</b>	<b>0,48</b>	<b>EL SALVADOR</b>				
<b>EL SALVADOR</b>				<b>EL SALVADOR</b>					
USD	70.000	El Salvador (Govt of) 5.88% 30/01/2025			USD	70.000	El Salvador (Govt of) 5.88% 30/01/2025	61.635	0,13
USD	350.000	El Salvador (Govt of) 6.38% 18/01/2027			USD	350.000	El Salvador (Govt of) 6.38% 18/01/2027	304.238	0,62
USD	150.000	El Salvador (Govt of) 9.50% 15/07/2052			USD	150.000	El Salvador (Govt of) 9.50% 15/07/2052	142.800	0,29
		<b>El Salvador, insgesamt</b>					<b>El Salvador, insgesamt</b>	<b>508.673</b>	<b>1,04</b>
<b>GHANA</b>				<b>GHANA</b>					
USD	335.000	Ghana (Govt of) 6.38% 11/02/2027			USD	335.000	Ghana (Govt of) 6.38% 11/02/2027	302.795	0,62
USD	200.000	Ghana (Govt of) 7.88% 26/03/2027			USD	200.000	Ghana (Govt of) 7.88% 26/03/2027	190.851	0,39
USD	200.000	Ghana (Govt of) 7.88% 11/02/2035			USD	200.000	Ghana (Govt of) 7.88% 11/02/2035	169.447	0,35
		<b>Ghana, insgesamt</b>					<b>Ghana, insgesamt</b>	<b>663.093</b>	<b>1,36</b>

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt

### Portfolioaufstellung

(Fortsetzung)

Nennwert		Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts	Nennwert		Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>					<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				
<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)</b>					<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)</b>				
<b>INDIEN</b>					<b>PANAMA (Fortsetzung)</b>				
USD	200.000	Export-Import Bank of India 3.25% 15/01/2030	202.197	0,41	USD	400.000	Panama (Govt of) 4.50% 01/04/2056	501.540	1,03
		<b>Indien, insgesamt</b>	<b>202.197</b>	<b>0,41</b>			<b>Panama, insgesamt</b>	<b>934.149</b>	<b>1,92</b>
<b>INDONESIEN</b>					<b>PARAGUAY</b>				
USD	400.000	Indonesia (Govt of) 3.70% 30/10/2049	429.030	0,88	USD	340.000	Paraguay (Govt of) 5.60% 13/03/2048	419.600	0,86
USD	950.000	Indonesia (Govt of) 4.75% 18/07/2047	1.159.236	2,39			<b>Paraguay, insgesamt</b>	<b>419.600</b>	<b>0,86</b>
USD	200.000	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III 2.30% 23/06/2025	207.818	0,43					
		<b>Indonesien, insgesamt</b>	<b>1.796.084</b>	<b>3,70</b>					
<b>ELFENBEINKÜSTE</b>					<b>PERU</b>				
EUR	477.000	Ivory Coast (Govt of) 5.88% 17/10/2031	509.044	1,04	USD	400.000	Peruvian (Govt of) 2.84% 20/06/2030	435.797	0,89
USD	200.000	Ivory Coast (Govt of) 6.13% 15/06/2033	188.341	0,39			<b>Peru, insgesamt</b>	<b>435.797</b>	<b>0,89</b>
		<b>Elfenbeinküste, insgesamt</b>	<b>697.385</b>	<b>1,43</b>					
<b>MEXIKO</b>					<b>KATAR</b>				
USD	400.000	Mexico (Govt of) 3.25% 16/04/2030	409.264	0,84	USD	850.000	Qatar (Govt of) 3.75% 16/04/2030	985.484	2,02
MXN	85.000	Mexico (Govt of) 8.50% 31/05/2029	454.302	0,93	USD	700.000	Qatar (Govt of) 4.00% 14/03/2029	818.830	1,68
USD	200.000	United Mexican States (Govt of) 4.35% 15/01/2047	207.679	0,43	USD	400.000	Qatar (Govt of) 4.82% 14/03/2049	539.248	1,11
		<b>Mexiko, insgesamt</b>	<b>1.071.245</b>	<b>2,20</b>	USD	200.000	Qatar (Govt of) 5.10% 23/04/2048	278.259	0,57
<b>MONGOLEI</b>					<b>RUMÄNIEN</b>				
USD	200.000	Mongolia (Govt of) 5.13% 07/04/2026	201.697	0,41	USD	300.000	Romania (Govt of) 4.00% 14/02/2051	310.022	0,64
USD	200.000	Mongolia (Govt of) 5.63% 01/05/2023	205.762	0,42			<b>Rumänien, insgesamt</b>	<b>310.022</b>	<b>0,64</b>
		<b>Mongolei, insgesamt</b>	<b>407.459</b>	<b>0,83</b>					
<b>OMAN</b>					<b>RUSSISCHE FÖDERATION</b>				
USD	200.000	Oman (Govt of) 6.75% 17/01/2048	165.931	0,34	USD	200.000	Russia (Govt of) 4.25% 23/06/2027	225.384	0,46
		<b>Oman, insgesamt</b>	<b>165.931</b>	<b>0,34</b>	USD	400.000	Russia (Govt of) 4.75% 27/05/2026	459.353	0,94
<b>PANAMA</b>					<b>SAUDI-ARABIEN</b>				
USD	200.000	Panama (Govt of) 2.25% 29/09/2032	203.049	0,42	USD	200.000	Russia (Govt of) 5.10% 28/03/2035	246.168	0,50
USD	200.000	Panama (Govt of) 3.87% 23/07/2060	229.560	0,47	USD	400.000	Russian Foreign Bond - Eurobond 5.10% 28/03/2035	492.337	1,01
							<b>Russische Föderation, insgesamt</b>	<b>1.423.242</b>	<b>2,91</b>
					USD	200.000	Saudi (Govt) 3.63% 04/03/2028	221.851	0,45
					USD	800.000	Saudi (Govt) 3.75% 21/01/2055	866.729	1,78
					USD	285.000	Saudi (Govt) 4.50% 26/10/2046	342.688	0,70
							<b>Saudi-Arabien, insgesamt</b>	<b>1.431.268</b>	<b>2,93</b>

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt

### Portfolioaufstellung

(Fortsetzung)

Nennwert		Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts	Nennwert		Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>					<b>Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere</b>				
<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)</b>					<b>Anleihen</b>				
<b>SÜDAFRIKA</b>					<b>ISLE OF MAN</b>				
USD	400.000	Eskom Holdings Limited 5.75% 26/01/2021	391.093	0,80	USD	200.000	Anglogold Ashanti Holdings plc 3.75% 01/10/2030	204.250	0,42
USD	400.000	South Africa (Govt of) 5.75% 30/09/2049	341.001	0,70	<b>Isle of Man, insgesamt</b>				
<b>Südafrika, insgesamt</b>			<b>732.094</b>	<b>1,50</b>	<b>VENEZUELA</b>				
<b>SRI LANKA</b>					USD	1.999.683	Petroleos de Venezuela SA 6.00% 15/11/2026	62.990	0,13
USD	250.000	Sri Lanka (Govt of) 7.55% 28/03/2030	170.598	0,35	<b>Venezuela, insgesamt</b>				
<b>Sri Lanka, insgesamt</b>			<b>170.598</b>	<b>0,35</b>	<b>Anleihen, insgesamt</b>				
<b>TÜRKEI</b>					<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente</b>				
USD	250.000	Turkey (Govt of) 4.25% 14/04/2026	225.634	0,46	<b>ÄGYPTEN</b>				
USD	800.000	Turkey (Govt of) 5.13% 17/02/2028	728.657	1,49	EGP	8.500.000	Egypt (Govt of) 0.00% 16/02/2021	513.659	1,05
USD	625.000	Turkey (Govt of) 6.00% 25/03/2027	600.132	1,23	<b>Ägypten, insgesamt</b>				
USD	200.000	Turkey (Govt of) 6.00% 14/01/2041	166.211	0,34	<b>VENEZUELA</b>				
USD	450.000	Turkey (Govt of) 6.88% 17/03/2036	421.785	0,86	USD	2.004.400	Venezuela (Govt of) 8.25% 13/10/2024	165.363	0,34
<b>Türkei, insgesamt</b>			<b>2.142.419</b>	<b>4,38</b>	<b>Venezuela, insgesamt</b>				
<b>UKRAINE</b>					<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente, insgesamt</b>				
USD	200.000	Ukraine (Govt of) 7.25% 15/03/2033	184.828	0,38	<b>679.022</b>				
USD	400.000	Ukraine (Govt of) 7.75% 01/09/2026	399.476	0,82	<b>1,39</b>				
<b>Ukraine, insgesamt</b>			<b>584.304</b>	<b>1,20</b>	<b>Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere, insgesamt</b>				
<b>VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE</b>					<b>946.262</b>				
USD	1.300.000	Abu Dhabi (Govt of) 3.13% 30/09/2049	1.395.356	2,87	<b>1,94</b>				
<b>Vereinigte Arabische Emirate, insgesamt</b>			<b>1.395.356</b>	<b>2,87</b>	<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren</b>				
<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente, insgesamt</b>					<b>Fonds</b>				
			<b>26.128.489</b>	<b>53,58</b>	<b>IRLAND</b>				
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt</b>					2.556.335	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	2.556.335	5,24	
			<b>44.160.615</b>	<b>90,55</b>	<b>Irland, insgesamt</b>				
					<b>2.556.335</b>				
					<b>Fonds, insgesamt</b>				
					<b>2.556.335</b>				
					<b>5,24</b>				
					<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren, insgesamt</b>				
					<b>2.556.335</b>				
					<b>5,24</b>				
					<b>Wert der Anlagen, insgesamt</b>				
					<b>47.663.212</b>				
					<b>97,73</b>				
					<b>(Gesamtkosten: USD 49.063.682)</b>				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.



## Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds

### Portfolioaufstellung

zum 30. September 2020

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts		
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>					
<b>Anleihen</b>				<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>					
<b>BERMUDAS</b>				<b>HONGKONG</b>					
USD	1.000.000	China Oil & Gas Group Limited 5.50% 25/01/2023	1.026.017	0,99	USD	1.800.000	Lenovo Group Limited 5.88% 24/04/2025	1.934.633	1,87
<b>Bermudas, insgesamt</b>			<b>1.026.017</b>	<b>0,99</b>	<b>Hongkong, insgesamt</b>			<b>1.934.633</b>	<b>1,87</b>
<b>BRASILIEN</b>				<b>INDIEN</b>					
USD	500.000	Cemig Geracao e Transmissao SA 9.25% 05/12/2024	553.125	0,54	USD	750.000	Adani Ports & Special Economic Zone Limited 3.95% 19/01/2022	765.220	0,74
USD	1.200.000	Light Servicos de Eletricidade SA 7.25% 03/05/2023	1.258.033	1,22	USD	750.000	GMR Hyderabad International Airport Limited 5.38% 10/04/2024	735.769	0,71
<b>Brasilien, insgesamt</b>			<b>1.811.158</b>	<b>1,76</b>	USD	600.000	JSW Steel Limited 5.95% 18/04/2024	615.041	0,60
<b>KANADA</b>				<b>INDIEN, insgesamt</b>					
USD	1.450.000	Meglobal Canada ULC 5.00% 18/05/2025	1.565.171	1,51	USD	600.000	Neergy Energy Limited 6.00% 13/02/2022	600.800	0,59
<b>Kanada, insgesamt</b>			<b>1.565.171</b>	<b>1,51</b>	<b>Indien, insgesamt</b>			<b>2.716.830</b>	<b>2,64</b>
<b>KAIMANINSELN</b>				<b>INDONESIEN</b>					
USD	1.250.000	Braskem Finance Limited 6.45% 03/02/2024	1.343.235	1,30	USD	2.050.000	Indonesia Asahan Aluminium Persero Pt 5.71% 15/11/2023	2.271.432	2,20
USD	600.000	Cifi Holdings Group Company Limited 6.00% 16/07/2025	604.560	0,58	USD	200.000	PT Perusahaan Listrik Negara 5.50% 22/11/2021	209.623	0,20
USD	1.500.000	DP World Salaam Perp FRN	1.575.367	1,53	USD	1.600.000	Saka Energi Indonesia Pt 4.45% 05/05/2024	1.451.321	1,40
USD	1.500.000	Vale Overseas Limited 6.25% 10/08/2026	1.775.625	1,72	USD	1.200.000	Sri Rejeki Isman Tbk Pt 7.25% 16/01/2025	1.178.771	1,14
<b>Kaimaninseln, insgesamt</b>			<b>5.298.787</b>	<b>5,13</b>	<b>Indonesien, insgesamt</b>			<b>5.111.147</b>	<b>4,94</b>
<b>KOLUMBIEN</b>				<b>IRLAND</b>					
USD	500.000	Ecopetrol SA 5.88% 18/09/2023	550.547	0,53	USD	800.000	Phosagro DAO Via Phosagro Bond Funding Dac 3.05% 23/01/2025	818.501	0,79
<b>Kolumbien, insgesamt</b>			<b>550.547</b>	<b>0,53</b>	<b>Irland, insgesamt</b>			<b>818.501</b>	<b>0,79</b>
<b>DOMINIKANISCHE REPUBLIK</b>				<b>KASACHSTAN</b>					
USD	400.000	Dominican Republic (Govt of) 7.50% 06/05/2021	412.952	0,40	USD	1.350.000	KazMunayGas JSC 4.75% 24/04/2025	1.485.788	1,44
<b>Dominikanische Republik, insgesamt</b>			<b>412.952</b>	<b>0,40</b>	<b>Kasachstan, insgesamt</b>			<b>1.485.788</b>	<b>1,44</b>
<b>ECUADOR</b>									
USD	544.830	Ecuador (Govt of) 0.50% 31/07/2035	306.558	0,30					
USD	249.700	Ecuador (Govt of) 0.50% 31/07/2040	127.007	0,12					
<b>Ecuador, insgesamt</b>			<b>433.565</b>	<b>0,42</b>					

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds

### Portfolioaufstellung

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts		
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>					
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>					
<b>LUXEMBURG</b>				<b>SAUDI-ARABIEN</b>					
USD	500.000	Gazprom PJSC 5.15% 11/02/2026	557.902	0,54	USD	350.000	Saudi Arabian Oil Company 2.88% 16/04/2024	367.239	0,36
USD	1.000.000	MHP SE 7.75% 10/05/2024	1.048.665	1,01	USD	450.000	Saudi Arabian Oil Company 2.88% 16/04/2024	472.165	0,46
USD	1.250.000	Millicom International Cellular SA 6.63% 15/10/2026	1.342.671	1,30			<b>Saudi-Arabien, insgesamt</b>	<b>839.404</b>	<b>0,82</b>
		<b>Luxemburg, insgesamt</b>	<b>2.949.238</b>	<b>2,85</b>					
<b>MALAYSIA</b>				<b>SINGAPUR</b>					
USD	1.230.000	Press Metal Labuan Limited 4.80% 30/10/2022	1.207.944	1,17	USD	520.000	Geo Coal International Pte Limited 8.00% 04/10/2022	342.427	0,33
		<b>Malaysia, insgesamt</b>	<b>1.207.944</b>	<b>1,17</b>			<b>Singapur, insgesamt</b>	<b>342.427</b>	<b>0,33</b>
<b>MAURITIUS</b>				<b>SÜDAFRIKA</b>					
USD	400.000	Greenko Solar Mauritius Limited 5.55% 29/01/2025	407.095	0,39	USD	650.000	Eskom Holdings 6.75% 06/08/2023	600.438	0,58
USD	1.000.000	HTA Group Limited 7.00% 18/12/2025	1.045.625	1,01			<b>Südafrika, insgesamt</b>	<b>600.438</b>	<b>0,58</b>
		<b>Mauritius, insgesamt</b>	<b>1.452.720</b>	<b>1,40</b>					
<b>MEXIKO</b>				<b>TÜRKEI</b>					
USD	600.000	Cemex SAB de CV 7.38% 05/06/2027	648.550	0,63	USD	550.000	Akbank Turk AS 6.80% 06/02/2026	533.275	0,52
USD	4.121.000	Petroleos Mexicanos 6.88% 04/08/2026	3.968.626	3,84			<b>Türkei, insgesamt</b>	<b>533.275</b>	<b>0,52</b>
		<b>Mexiko, insgesamt</b>	<b>4.617.176</b>	<b>4,47</b>					
<b>MAROKKO</b>				<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH</b>					
USD	1.540.000	OCP SA 5.63% 25/04/2024	1.675.131	1,62	USD	1.025.000	Liquid Telecommunications Financing plc 8.50% 13/07/2022	1.047.464	1,01
		<b>Marokko, insgesamt</b>	<b>1.675.131</b>	<b>1,62</b>	USD	310.000	Nak Naftogaz Ukraine Via Kondor Finance plc 7.63% 08/11/2026	299.272	0,29
<b>NIEDERLANDE</b>				<b>VEREINIGTE STAATEN</b>					
USD	1.350.000	Petrobras Global Finance BV 8.38% 23/05/2021	1.406.740	1,36	USD	400.000	Cemex Finance LLC 6.00% 01/04/2024	408.777	0,40
USD	1.000.000	Syngenta Finance NV 4.44% 24/04/2023	1.056.852	1,02			<b>Vereinigte Staaten, insgesamt</b>	<b>408.777</b>	<b>0,40</b>
USD	1.900.000	Syngenta Finance NV 5.18% 24/04/2028	2.093.503	2,04					
		<b>Niederlande, insgesamt</b>	<b>4.557.095</b>	<b>4,42</b>					
<b>PHILIPPINEN</b>				<b>BRITISCHE JUNGFERNINSELN</b>					
USD	893.000	Metropolitan Bank & Trust Company 2.13% 15/01/2026	887.581	0,86	USD	400.000	Elect Global Investments Limited Perp FRN	389.622	0,38
USD	670.000	Smc Global Power Holdings Corp. Perp FRN	644.374	0,62	USD	1.700.000	Gold Fields Orogen Holdings BVI Limited 5.13% 15/05/2024	1.853.789	1,79
		<b>Philippinen, insgesamt</b>	<b>1.531.955</b>	<b>1,48</b>	USD	500.000	State Grid Overseas Investment 1.00% 05/08/2025	495.134	0,48

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds

### Portfolioaufstellung

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts			
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>						
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)</b>						
<b>BRITISCHE JUNGFERNINSELN (Fortsetzung)</b>				<b>ECUADOR</b>						
USD	400.000	Studio City Finance Limited 7.25% 11/02/2024	410.808	0,40	USD	272.900	Ecuador (Govt of) 0.50% 31/07/2030	186.766	0,18	
USD	1.133.000	TSMC Global Limited 0.75% 28/09/2025	1.123.552	1,09	<b>Ecuador, insgesamt</b>					
<b>Britische Jungfernseln, insgesamt</b>				<b>4.272.905</b>	<b>4,14</b>	<b>ÄGYPTEN</b>				
<b>Anleihen, insgesamt</b>				<b>50.629.916</b>	<b>49,01</b>	USD	839.000	Egypt (Govt of) 4.55% 20/11/2023	840.783	0,81
<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente</b>				<b>EL SALVADOR</b>						
<b>ANGOLA</b>				<b>EL SALVADOR</b>						
USD	750.000	Angola (Govt of) 9.50% 12/11/2025	653.611	0,63	USD	860.000	El Salvador (Govt of) 5.88% 30/01/2025	757.235	0,73	
<b>Angola, insgesamt</b>				<b>653.611</b>	<b>0,63</b>	<b>El Salvador, insgesamt</b>				
<b>BELARUS</b>				<b>GEORGIEN</b>						
USD	1.202.000	Belarus (Govt of) 6.88% 28/02/2023	1.169.095	1,13	USD	1.200.000	Georgia (Govt of) 6.88% 12/04/2021	1.224.552	1,19	
<b>Belarus, insgesamt</b>				<b>1.169.095</b>	<b>1,13</b>	<b>Georgien, insgesamt</b>				
<b>BRASILIEN</b>				<b>GHANA</b>						
USD	3.000.000	Brazil (Govt of) 4.25% 07/01/2025	3.234.645	3,12	USD	835.000	Ghana (Govt of) 6.38% 11/02/2027	754.727	0,73	
<b>Brasilien, insgesamt</b>				<b>3.234.645</b>	<b>3,12</b>	<b>Ghana, insgesamt</b>				
<b>KOLUMBIEN</b>				<b>GUATEMALA</b>						
USD	1.000.000	Colombia (Govt of) 4.00% 26/02/2024	1.068.018	1,03	USD	745.000	Guatemala (Govt of) 5.75% 06/06/2022	785.379	0,76	
<b>Kolumbien, insgesamt</b>				<b>1.068.018</b>	<b>1,03</b>	<b>Guatemala, insgesamt</b>				
<b>COSTA RICA</b>				<b>INDONESIEN</b>						
USD	250.000	Costa Rica (Govt of) 4.38% 30/04/2025	235.375	0,23	USD	250.000	Indonesia (Govt of) 4.13% 15/01/2025	279.393	0,27	
<b>Costa Rica, insgesamt</b>				<b>235.375</b>	<b>0,23</b>	USD	2.500.000	Indonesia (Govt of) 5.38% 17/10/2023	2.819.704	2,73
<b>DOMINIKANISCHE REPUBLIK</b>				<b>MONGOLEI</b>						
USD	1.330.000	Dominican Republic (Govt of) 5.50% 27/01/2025	1.415.735	1,37	USD	200.000	Mongolia (Govt of) 5.13% 07/04/2026	201.697	0,20	
USD	1.000.000	Dominican Republic (Govt of) 5.88% 18/04/2024	1.059.308	1,03	USD	500.000	Mongolia (Govt of) 5.63% 01/05/2023	514.405	0,50	
DOP	52.000.000	Dominican Republic (Govt of) 16.95% 04/02/2022	1.013.376	0,98	<b>Mongolei, insgesamt</b>					
<b>Dominikanische Republik, insgesamt</b>				<b>3.488.419</b>	<b>3,38</b>	<b>716.102</b>				
				<b>0,70</b>						

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds

### Portfolioaufstellung

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts		
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>					
<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)</b>				<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)</b>					
<b>OMAN</b>				<b>TÜRKEI (Fortsetzung)</b>					
USD	1.000.000	Oman (Govt of) 4.40% 01/06/2024	999.272	0,97	USD	1.673.000	Turkey (Govt of) 5.60% 14/11/2024	1.625.726	1,57
		<b>Oman, insgesamt</b>	<b>999.272</b>	<b>0,97</b>	USD	4.100.000	Turkey (Govt of) 5.75% 22/03/2024	4.036.064	3,90
					USD	550.000	Turkey (Govt of) 7.38% 05/02/2025	568.853	0,55
							<b>Türkei, insgesamt</b>	<b>8.128.114</b>	<b>7,86</b>
<b>PANAMA</b>				<b>UKRAINE</b>					
USD	1.350.000	Panama (Govt of) 3.75% 16/03/2025	1.474.361	1,43	USD	1.760.000	Ukraine (Govt of) 7.75% 01/09/2023	1.795.028	1,74
		<b>Panama, insgesamt</b>	<b>1.474.361</b>	<b>1,43</b>			<b>Ukraine, insgesamt</b>	<b>1.795.028</b>	<b>1,74</b>
<b>KATAR</b>				<b>VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE</b>					
USD	2.000.000	Qatar (Govt of) 3.25% 02/06/2026	2.203.573	2,13	USD	1.000.000	Abu Dhabi (Govt of) 2.13% 30/09/2024	1.046.255	1,01
USD	1.500.000	Qatar (Govt of) 3.38% 14/03/2024	1.617.731	1,57	USD	3.000.000	Abu Dhabi (Govt of) 2.50% 16/04/2025	3.184.489	3,08
		<b>Katar, insgesamt</b>	<b>3.821.304</b>	<b>3,70</b>			<b>Vereinigte Arabische Emirate, insgesamt</b>	<b>4.230.744</b>	<b>4,09</b>
<b>RUSSISCHE FÖDERATION</b>				<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente, insgesamt</b>					
USD	800.000	Russia (Govt of) 4.75% 27/05/2026	918.705	0,89			<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt</b>	<b>95.985.249</b>	<b>92,90</b>
		<b>Russische Föderation, insgesamt</b>	<b>918.705</b>	<b>0,89</b>	<b>Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere</b>				
<b>SENEGAL</b>				<b>Anleihen</b>					
USD	250.000	Senegal (Govt of) 8.75% 13/05/2021	257.447	0,25	<b>BERMUDAS</b>				
		<b>Senegal, insgesamt</b>	<b>257.447</b>	<b>0,25</b>	USD	1.000.000	Tengizchevroil Finance Company International Limited 2.63% 15/08/2025	1.005.059	0,97
<b>SÜDAFRIKA</b>				<b>Bermudas, insgesamt</b>					
USD	345.000	Eskom Holdings Limited 5.75% 26/01/2021	337.317	0,33			<b>1.005.059</b>	<b>0,97</b>	
USD	600.000	South Africa (Govt of) 4.88% 14/04/2026	607.684	0,59	<b>VENEZUELA</b>				
		<b>Südafrika, insgesamt</b>	<b>945.001</b>	<b>0,92</b>	USD	491.751	Petroleos de Venezuela SA 6.00% 15/11/2026	15.490	0,01
<b>SRI LANKA</b>				<b>Venezuela, insgesamt</b>					
USD	399.000	Sri Lanka (Govt of) 5.75% 18/04/2023	300.038	0,29			<b>15.490</b>	<b>0,01</b>	
USD	261.000	Sri Lanka (Govt of) 6.85% 03/11/2025	186.808	0,18	<b>Anleihen, insgesamt</b>				
		<b>Sri Lanka, insgesamt</b>	<b>486.846</b>	<b>0,47</b>			<b>1.020.549</b>	<b>0,98</b>	
<b>TÜRKEI</b>									
USD	1.000.000	Turkey (Govt of) 3.25% 23/03/2023	949.807	0,92					
USD	1.050.000	Turkey (Govt of) 4.25% 14/04/2026	947.664	0,92					

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds

### Portfolioaufstellung

(Fortsetzung)

	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts
<b>Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere (Fortsetzung)</b>				
<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente</b>				
<b>ÄGYPTEN</b>				
EGP	17.600.000	Egypt (Govt of) 0.00% 16/02/2021	1.063.577	1,03
		<b>Ägypten, insgesamt</b>	<b>1.063.577</b>	<b>1,03</b>
<b>VENEZUELA</b>				
USD	1.245.400	Venezuela (Govt of) 8.25% 13/10/2024	102.746	0,10
		<b>Venezuela, insgesamt</b>	<b>102.746</b>	<b>0,10</b>
		<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente, insgesamt</b>	<b>1.166.323</b>	<b>1,13</b>
		<b>Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere, insgesamt</b>	<b>2.186.872</b>	<b>2,11</b>
<b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>				
<b>Anleihen</b>				
<b>VENEZUELA</b>				
USD	3.288.783	Petroleos de Venezuela SA 6.00% 16/05/2024	103.597	0,10
		<b>Venezuela, insgesamt</b>	<b>103.597</b>	<b>0,10</b>
		<b>Anleihen, insgesamt</b>	<b>103.597</b>	<b>0,10</b>
		<b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, insgesamt</b>	<b>103.597</b>	<b>0,10</b>
<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren</b>				
<b>Fonds</b>				
<b>IRLAND</b>				
	3.866.217	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	3.866.217	3,74
		<b>Irland, insgesamt</b>	<b>3.866.217</b>	<b>3,74</b>
		<b>Fonds, insgesamt</b>	<b>3.866.217</b>	<b>3,74</b>
		<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren, insgesamt</b>	<b>3.866.217</b>	<b>3,74</b>
		<b>Wert der Anlagen, insgesamt</b>	<b>102.141.935</b>	<b>98,85</b>
<b>(Gesamtkosten: USD 102.514.369)</b>				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

### Portfolioaufstellung

zum 30. September 2020

Nennwert		Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts	Nennwert		Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung</b>					<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				
<b>Anleihen</b>					<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				
<b>ÖSTERREICH</b>					<b>NIEDERLANDE</b>				
USD	240.000	JBS Investments II GmbH 5.75% 15/01/2028	249.900	0,13	USD	218.000	Trivium Packaging Finance BV 5.50% 15/08/2026	225.870	0,12
		<b>Österreich, insgesamt</b>	<b>249.900</b>	<b>0,13</b>	USD	296.000	Trivium Packaging Finance BV 8.50% 15/08/2027	319.310	0,16
<b>KANADA</b>					USD	539.000	Ziggo Bond Finance BV 6.00% 15/01/2027	557.865	0,29
USD	533.000	Bausch Health Cos Inc. 7.00% 15/01/2028	566.203	0,29	<b>Niederlande, insgesamt</b>				
USD	314.000	Cenovus Energy Inc. 4.25% 15/04/2027	285.545	0,15	<b>1.103.045</b>	<b>0,57</b>			
USD	196.000	Cenovus Energy Inc. 5.38% 15/07/2025	189.416	0,10	<b>SUPRANATIONAL</b>				
USD	347.000	Cenovus Energy Inc. 6.75% 15/11/2039	348.291	0,18	USD	226.000	Ardagh Packaging Finance plc 5.25% 15/08/2027	230.303	0,12
		<b>Kanada, insgesamt</b>	<b>1.389.455</b>	<b>0,72</b>	USD	876.000	Nouryon Holding BV 8.00% 01/10/2026	934.049	0,47
<b>FRANKREICH</b>					<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH</b>				
USD	208.000	Altice France SA 5.50% 15/01/2028	210.788	0,11	USD	149.000	Virgin Media Secured Finance plc 5.50% 15/08/2026	155.209	0,08
USD	893.000	Altice France SA 7.38% 01/05/2026	937.487	0,49	USD	446.000	Vmed O2 UK Financing I plc 4.25% 31/01/2031	454.943	0,23
USD	581.000	Altice France SA 8.13% 01/02/2027	634.211	0,32	<b>Vereinigtes Königreich, insgesamt</b>				
USD	559.000	SPCM SA 4.88% 15/09/2025	578.895	0,30	<b>610.152</b>	<b>0,31</b>			
		<b>Frankreich, insgesamt</b>	<b>2.361.381</b>	<b>1,22</b>	<b>VEREINIGTE STAATEN</b>				
<b>DEUTSCHLAND</b>					USD	350.000	Acadia Healthcare Company 6.50% 01/03/2024	360.092	0,18
USD	261.000	IHO Verwaltungs GmbH 4.75% 15/09/2026	265.241	0,14	USD	111.000	AES Corp. 5.13% 01/09/2027	118.087	0,06
USD	384.000	IHO Verwaltungs GmbH 6.38% 15/05/2029	410.554	0,21	USD	133.000	Apache Corp. 4.25% 15/01/2044	113.881	0,06
USD	183.000	Vertical Holdco GmbH 7.63% 15/07/2028	193.751	0,10	USD	106.000	Apache Corp. 4.63% 15/11/2025	101.151	0,05
		<b>Deutschland, insgesamt</b>	<b>869.546</b>	<b>0,45</b>	USD	557.000	Apache Corp. 4.75% 15/04/2043	495.535	0,25
<b>LUXEMBURG</b>					USD	143.000	Apache Corp. 4.88% 15/11/2027	135.507	0,07
USD	496.000	Altice France Holding SA 6.00% 15/02/2028	473.060	0,24	USD	185.000	Apache Corp. 5.25% 01/02/2042	165.922	0,08
USD	651.000	Ineos Group Holdings 5.63% 01/08/2024	659.138	0,34	USD	148.000	Banff Merger Sub Inc. 9.75% 01/09/2026	156.747	0,08
USD	169.000	Telecom Italia Capital SA 6.00% 30/09/2034	196.452	0,10	USD	298.000	Berry Plastics Corp. 5.13% 15/07/2023	302.726	0,15
		<b>Luxemburg, insgesamt</b>	<b>1.328.650</b>	<b>0,68</b>	USD	539.000	Buckeye Partners LP 5.85% 15/11/2043	497.804	0,25
					USD	416.000	Calpine Corp. 5.25% 01/06/2026	432.609	0,22
					USD	153.000	Cedar Fair LP 5.38% 01/06/2024	146.689	0,08
					USD	709.000	Centene Corp. 3.00% 15/10/2030	724.395	0,36
					USD	517.000	Centurylink Inc. 7.50% 01/04/2024	578.831	0,30
					USD	445.000	CenturyLink Inc. 5.80% 15/03/2022	460.575	0,24
					USD	319.000	CenturyTel 6.88% 15/01/2028	359.078	0,18
					USD	178.000	CF Industries Inc. 5.38% 15/03/2044	215.092	0,11

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

### Portfolioaufstellung

(Fortsetzung)

Nennwert		Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts	Nennwert		Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>					<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>					<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				
<b>VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)</b>					<b>VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)</b>				
USD	281.000	Chemours Company 7.00% 15/05/2025	285.103	0,15	USD	1.206.000	Ford Motor Credit Company LLC 4.39% 08/01/2026	1.195.406	0,61
USD	448.000	Cit Group Inc. 5.00% 15/08/2022	462.280	0,24	USD	358.000	Ford Motor Credit Company LLC 5.11% 03/05/2029	368.293	0,19
USD	426.000	Clearway Energy Operating LLC 5.75% 15/10/2025	448.898	0,23	USD	178.000	Ford Motor Credit Company LLC 5.60% 07/01/2022	182.250	0,09
USD	556.000	Community Health Systems (CHS) 6.25% 31/03/2023	544.185	0,28	USD	35.000	Ford Motor Credit Company LLC 5.58% 18/03/2024	36.435	0,02
USD	88.000	Comstock Resources Inc. 9.75% 15/08/2026	90.229	0,05	USD	422.000	Freeport-Mcmoran Inc. 4.55% 14/11/2024	451.667	0,24
USD	228.000	Continental Resources Inc. 4.38% 15/01/2028	196.988	0,10	USD	426.000	Freeport-Mcmoran Inc. 4.63% 01/08/2030	448.748	0,23
USD	364.000	DCP Midstream Operating LP 5.13% 15/05/2029	359.450	0,18	USD	831.000	Freeport-McMoran Inc. 5.45% 15/03/2043	922.626	0,47
USD	291.000	DCP Midstream Operating LP 5.60% 01/04/2044	265.817	0,14	USD	553.000	Freeport-McMoRan Inc. 5.25% 01/09/2029	594.434	0,30
USD	482.000	Delta Air Lines Inc. 7.38% 15/01/2026	505.329	0,26	USD	308.000	Genesis Energy LP Genesis Energy Finance Corp. 7.75% 01/02/2028	267.282	0,14
USD	515.000	Dish DBS Corp. 5.88% 15/11/2024	532.317	0,27	USD	323.000	HCA Inc. 3.50% 01/09/2030	329.004	0,17
USD	115.000	DISH DBS Corp. 5.88% 15/07/2022	119.647	0,06	USD	473.000	HCA Inc. 5.63% 01/09/2028	542.176	0,28
USD	142.000	Encompass Health Corp. 4.50% 01/02/2028	143.289	0,07	USD	154.000	HCA Inc. 5.88% 01/02/2029	180.016	0,09
USD	382.000	Encompass Health Corp. 4.75% 01/02/2030	387.245	0,20	USD	79.000	Hillenbrand Inc. 5.75% 15/06/2025	84.777	0,04
USD	349.000	EQM Midstream Partners LP 5.50% 15/07/2028	350.755	0,18	USD	168.000	Icahn Enterprises LP 6.25% 01/02/2022	169.757	0,09
USD	325.000	EQT Corp 3.90% 01/10/2027	297.172	0,15	USD	344.000	Kraft Heinz Foods Company 3.95% 15/07/2025	374.399	0,19
USD	499.000	EQT Corp 7.00% 01/02/2030	589.915	0,30	USD	702.000	Kraft Heinz Foods Company 4.38% 01/06/2046	716.918	0,37
USD	187.000	Ford Motor Company 4.35% 08/12/2026	185.295	0,09	USD	319.000	Kraft Heinz Foods Company 5.00% 04/06/2042	349.463	0,18
USD	249.000	Ford Motor Company 4.75% 15/01/2043	225.918	0,12	USD	518.000	Kraft Heinz Foods Company 5.20% 15/07/2045	571.002	0,29
USD	315.000	Ford Motor Company 7.45% 16/07/2031	363.338	0,19	USD	297.000	L Brands Inc. 5.25% 01/02/2028	288.647	0,15
USD	142.000	Ford Motor Company 8.50% 21/04/2023	154.895	0,08	USD	240.000	L Brands Inc. 6.88% 01/11/2035	237.450	0,12
USD	216.000	Ford Motor Company 9.00% 22/04/2025	247.916	0,13	USD	221.000	L Brands Inc. 7.50% 15/06/2029	232.296	0,12
USD	119.000	Ford Motor Company 9.63% 22/04/2030	153.501	0,08	USD	568.000	Lennar Corp. 4.50% 30/04/2024	611.157	0,32
USD	418.000	Ford Motor Credit Company LLC 3.34% 18/03/2021	419.275	0,21	USD	220.000	Level 3 Fing Inc. 5.25% 15/03/2026	228.104	0,12
USD	535.000	Ford Motor Credit Company LLC 3.66% 08/09/2024	526.641	0,27	USD	105.000	Marriott International Inc. 4.63% 15/06/2030	112.693	0,06
USD	58.000	Ford Motor Credit Company LLC 4.13% 17/08/2027	56.364	0,03	USD	525.000	Marriott International Inc. 5.75% 01/05/2025	586.465	0,29
USD	88.000	Ford Motor Credit Company LLC 4.14% 15/02/2023	88.932	0,05	USD	221.000	Meritage Homes Corp. 5.13% 06/06/2027	244.990	0,13
					USD	61.000	MGIC Investment Corp. 5.25% 15/08/2028	63.094	0,03
					USD	244.000	MGM Resorts International 6.75% 01/05/2025	256.335	0,13

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

### Portfolioaufstellung

(Fortsetzung)

Nennwert		Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts	Nennwert		Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>					<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>					<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				
<b>VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)</b>					<b>VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)</b>				
USD	214.000	Navient Corp. 5.50% 25/01/2023	215.425	0,11	USD	336.000	Penske Automotive Group Inc. 5.38% 01/12/2024	343.031	0,18
USD	503.000	Navient Corp. 6.50% 15/06/2022	513.689	0,26	USD	220.000	PG&E Corp. 5.00% 01/07/2028	213.313	0,11
USD	117.000	Navient Corp. 6.75% 15/06/2026	116.662	0,06	USD	165.000	PG&E Corp. 5.25% 01/07/2030	160.050	0,08
USD	289.000	Navient LLC 7.25% 25/01/2022	297.394	0,15	USD	206.000	QEP Resources Inc. 5.63% 01/03/2026	116.905	0,06
USD	551.000	Netflix Inc. 4.88% 15/04/2028	619.917	0,32	USD	100.000	Radian Group Inc. 4.88% 15/03/2027	99.946	0,05
USD	352.000	Netflix Inc. 5.88% 15/11/2028	420.415	0,22	USD	829.000	SM Energy Company 6.75% 15/09/2026	371.274	0,19
USD	384.000	NortonLifeLock Inc. 5.00% 15/04/2025	393.105	0,20	USD	234.000	Spectrum Brands Inc. 5.75% 15/07/2025	241.693	0,12
USD	318.000	NRG Energy Inc. 6.63% 15/01/2027	336.449	0,17	USD	175.000	Sprint Capital Corp. 8.75% 15/03/2032	257.906	0,13
USD	322.000	NRG Energy Inc. 7.25% 15/05/2026	342.693	0,17	USD	206.000	Sprint Corp. 7.13% 15/06/2024	236.768	0,12
USD	32.000	NuStar Logistics LP 5.63% 28/04/2027	31.777	0,02	USD	665.000	Sprint Corp. 7.63% 15/02/2025	782.364	0,40
USD	222.000	NuStar Logistics LP 5.75% 01/10/2025	229.181	0,12	USD	303.000	Sprint Corp. 7.63% 01/03/2026	366.376	0,19
USD	678.000	NuStar Logistics LP 6.00% 01/06/2026	682.034	0,35	USD	372.000	Tenet Healthcare Corp. 5.13% 01/05/2025	372.574	0,19
USD	196.000	NuStar Logistics LP 6.38% 01/10/2030	203.482	0,10	USD	138.000	Tenet Healthcare Corp. 6.75% 15/06/2023	145.147	0,07
USD	369.000	Occidental Petroleum Corp. 2.70% 15/08/2022	345.013	0,18	USD	278.000	Tenet Healthcare Corp. 7.00% 01/08/2025	285.584	0,15
USD	46.000	Occidental Petroleum Corp. 2.70% 15/02/2023	42.051	0,02	USD	204.000	Tenet Healthcare Corp. 8.13% 01/04/2022	226.748	0,12
USD	499.000	Occidental Petroleum Corp. 2.90% 15/08/2024	419.310	0,21	USD	196.000	T-Mobile USA Inc. 4.50% 01/02/2026	202.326	0,10
USD	70.000	Occidental Petroleum Corp. 3.13% 15/02/2022	66.488	0,03	USD	399.000	T-Mobile USA Inc. 4.75% 01/02/2028	427.677	0,22
USD	26.000	Occidental Petroleum Corp. 3.20% 15/08/2026	20.654	0,01	USD	756.000	T-Mobile USA Inc. 5.38% 15/04/2027	808.447	0,41
USD	136.000	Occidental Petroleum Corp. 3.40% 15/04/2026	109.480	0,06	USD	761.000	T-Mobile USA Inc. 6.50% 15/01/2026	795.721	0,41
USD	940.000	Occidental Petroleum Corp. 3.50% 15/08/2029	721.708	0,37	USD	538.000	TransDigm Inc. 5.50% 15/11/2027	517.381	0,26
USD	898.000	Occidental Petroleum Corp. 4.40% 15/04/2046	635.487	0,33	USD	422.000	TransDigm Inc. 6.38% 15/06/2026	422.631	0,22
USD	115.000	Occidental Petroleum Corp. 4.40% 15/08/2049	81.003	0,04	USD	303.000	TransDigm Inc. 6.50% 15/05/2025	301.864	0,15
USD	417.000	Occidental Petroleum Corp. 6.63% 01/09/2030	385.122	0,20	USD	506.000	TRI Pointe Group Inc. 5.70% 15/06/2028	554.386	0,28
USD	163.000	Occidental Petroleum Corp. 7.50% 01/05/2031	156.095	0,08	USD	404.000	TRI Pointe Group Inc. 5.88% 15/06/2024	438.195	0,22
USD	288.000	OneMain Finance Corp. 5.63% 15/03/2023	299.259	0,15	USD	246.000	United Rentals North America Inc. 3.88% 15/02/2031	249.844	0,13
USD	216.000	OneMain Finance Corp. 6.13% 15/03/2024	226.998	0,12	USD	532.000	United Rentals North America Inc. 5.25% 15/01/2030	581.210	0,30
USD	189.000	OneMain Finance Corp. 6.88% 15/03/2025	209.847	0,11	USD	147.000	United Rentals North America Inc. 5.50% 15/05/2027	156.751	0,08
USD	234.000	OneMain Finance Corp. 7.13% 15/03/2026	261.425	0,13					
USD	313.000	OneMain Finance Corp. 8.88% 01/06/2025	347.414	0,18					

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.



## Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

### Portfolioaufstellung

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts		
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				<b>Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere (Fortsetzung)</b>					
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>					
<b>VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)</b>				<b>KANADA (Fortsetzung)</b>					
USD	310.000	United Rentals North America Inc. 5.88% 15/09/2026	327.050	0,17	USD	440.000	Bausch Health Cos Inc. 5.50% 01/11/2025	451.962	0,23
USD	373.000	Vertical US NewCo Inc. 5.25% 15/07/2027	387.228	0,20	USD	549.000	Bausch Health Cos Inc. P.P. 144A 6.13% 15/04/2025	562.382	0,29
USD	169.000	Welbilt Inc. 9.50% 15/02/2024	173.331	0,09	USD	320.000	Bausch Health Cos Inc. 6.25% 15/02/2029	330.400	0,17
USD	48.000	Western Midstream Operating LP 3.10% 01/02/2025	45.732	0,02	USD	99.000	Bombardier Inc. 6.00% 15/10/2022	91.829	0,05
USD	897.000	Western Midstream Operating LP 4.05% 01/02/2030	873.198	0,45	USD	242.000	Bombardier Inc. 7.50% 01/12/2024	185.420	0,09
USD	828.000	WPX Energy Inc. 4.50% 15/01/2030	817.132	0,42	USD	209.000	Bombardier Inc. 7.50% 15/03/2025	156.776	0,08
USD	229.000	WPX Energy Inc. 5.25% 15/09/2024	239.878	0,12	USD	267.000	Bombardier Inc. 7.88% 15/04/2027	198.248	0,11
USD	366.000	Xerox Corp. 4.13% 15/03/2023	376.724	0,19	USD	113.000	Clarios Global LP 6.75% 15/05/2025	119.447	0,06
USD	99.000	Yum! Brands Inc. 3.63% 15/03/2031	99.124	0,05	USD	390.000	GFL Environmental Inc. 3.75% 01/08/2025	390.382	0,20
		<b>Vereinigte Staaten, insgesamt</b>	<b>45.756.385</b>	<b>23,41</b>	USD	127.000	GFL Environmental Inc. 4.25% 01/06/2025	128.728	0,07
		<b>Anleihen, insgesamt</b>	<b>54.832.866</b>	<b>28,08</b>	USD	265.000	GFL Environmental Inc. 5.13% 15/12/2026	276.263	0,14
		<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt</b>	<b>54.832.866</b>	<b>28,08</b>	USD	156.000	GFL Environmental Inc. 7.00% 01/06/2026	164.358	0,08
		<b>Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere</b>			USD	428.000	GFL Environmental Inc. 8.50% 01/05/2027	466.529	0,24
		<b>Anleihen</b>			USD	392.000	Hudbay Minerals Inc. 6.13% 01/04/2029	389.051	0,20
		<b>BERMUDAS</b>			USD	369.000	Hudbay Minerals Inc. 7.63% 15/01/2025	376.803	0,19
USD	255.000	Nabors Industries Limited 7.25% 15/01/2026	126.863	0,06	USD	51.000	Nova Chemicals Corp. 5.00% 01/05/2025	50.047	0,03
USD	162.000	Nabors Industries Limited 7.50% 15/01/2028	78.773	0,04	USD	481.000	Nova Chemicals Corp. 5.25% 01/06/2027	451.839	0,23
USD	376.000	Viking Cruises Limited 5.88% 15/09/2027	292.575	0,15	USD	371.000	Ritchie Bros Auctioneers Inc. 5.38% 15/01/2025	382.826	0,20
USD	35.000	Viking Cruises Limited 13.00% 15/05/2025	40.500	0,02	USD	365.000	Rockpoint Gas Storage 7.00% 31/03/2023	339.195	0,17
		<b>Bermudas, insgesamt</b>	<b>538.711</b>	<b>0,27</b>			<b>Kanada, insgesamt</b>	<b>7.053.360</b>	<b>3,62</b>
		<b>KANADA</b>					<b>KAIMANINSELN</b>		
USD	580.000	1011778 BC ULC / New Red Finance Inc. 3.88% 15/01/2028	590.730	0,30	USD	183.300	Transocean Guardian Limited 5.88% 15/01/2024	118.458	0,06
USD	86.000	1011778 BC ULC / New Red Finance Inc. 5.75% 15/04/2025	91.698	0,05	USD	437.000	Transocean Sentry Limited 5.38% 15/05/2023	298.799	0,15
USD	364.000	Bausch Health Cos Inc. 5.00% 30/01/2028	354.218	0,18			<b>Kaimaninseln, insgesamt</b>	<b>417.257</b>	<b>0,21</b>
USD	511.000	Bausch Health Cos Inc. 5.25% 30/01/2030	504.229	0,26					

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

### Portfolioaufstellung

(Fortsetzung)

Nennwert		Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts	Nennwert		Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts		
<b>Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere (Fortsetzung)</b>					<b>Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere (Fortsetzung)</b>						
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>					<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>						
<b>FRANKREICH</b>					<b>PANAMA</b>						
USD	578.000	Constellium SE 5.63% 15/06/2028	590.644	0,30	USD	178.000	Carnival Corp. 11.50% 01/04/2023	199.089	0,10		
					<b>Panama, insgesamt</b>				<b>199.089</b>	<b>0,10</b>	
<b>IRLAND</b>					<b>SUPRANATIONAL</b>						
USD	562.000	Ardagh Packaging Finance plc 6.00% 15/02/2025	584.261	0,31	USD	132.000	Ardagh Packaging Finance plc 4.13% 15/08/2026	134.038	0,07		
USD	324.000	James Hardie International Finance DAC 4.75% 15/01/2025	331.896	0,17	USD	231.000	Clarios Global LP 6.25% 15/05/2026	242.192	0,12		
USD	319.000	James Hardie International Finance DAC 5.00% 15/01/2028	333.747	0,17	USD	403.000	Clarios Global LP 8.50% 15/05/2027	418.617	0,22		
					<b>Supranational, insgesamt</b>				<b>794.847</b>	<b>0,41</b>	
<b>IRLAND, insgesamt</b>					<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH</b>						
				<b>1.249.904</b>	<b>0,65</b>	USD	38.000	International Game Technology plc 5.25% 15/01/2029	38.635	0,02	
<b>LIBERIA</b>					USD	303.000	International Game Technology plc 6.25% 15/02/2022	309.818	0,16		
USD	186.000	Royal Caribbean Cruises Limited 9.13% 15/06/2023	197.509	0,10	USD	313.000	International Game Technology plc P.P. 144A 6.50% 15/02/2025	333.484	0,17		
USD	172.000	Royal Caribbean Cruises Limited 11.50% 01/06/2025	199.799	0,11	USD	937.000	Virgin Media Finance plc 5.00% 15/07/2030	937.358	0,48		
					USD	282.000	Virgin Media Secured Finance plc 4.50% 15/08/2030	289.844	0,15		
				<b>397.308</b>	<b>0,21</b>	<b>Vereinigtes Königreich, insgesamt</b>				<b>1.909.139</b>	<b>0,98</b>
<b>LUXEMBURG</b>					<b>VEREINIGTE STAATEN</b>						
USD	658.000	Axalta Coating System Limited 4.75% 15/06/2027	678.892	0,35	USD	221.000	Acadia Healthcare Company 5.50% 01/07/2028	227.301	0,12		
USD	489.000	Camelot Finance SA 4.50% 01/11/2026	501.616	0,26	USD	101.000	Advisor Group Holdings Inc. 10.75% 01/08/2027	101.808	0,05		
USD	403.000	Endo Finance Company 6.00% 30/06/2028	298.220	0,15	USD	118.000	AG Issuer LLC 6.25% 01/03/2028	117.566	0,06		
USD	266.000	Endo Finance Company 9.50% 31/07/2027	278.184	0,14	USD	300.000	Albertsons Companies Inc. 3.25% 15/03/2026	297.448	0,15		
USD	710.000	Fage International 5.63% 15/08/2026	686.258	0,35	USD	395.000	Albertsons Companies Inc. 4.88% 15/02/2030	413.120	0,21		
					USD	504.000	Albertsons Companies Inc. 5.75% 15/03/2025	520.531	0,27		
				<b>2.443.170</b>	<b>1,25</b>	USD	487.000	Albertsons Companies Inc. 5.88% 15/02/2028	521.615	0,27	
<b>NIEDERLANDE</b>					USD	141.000	Albertsons Companies Inc. 7.50% 15/03/2026	155.309	0,08		
USD	353.000	Alcoa Nederland Holding BV 6.75% 30/09/2024	365.340	0,19	USD	632.000	Alliant Holdings Intermediate LLC 6.75% 15/10/2027	665.035	0,35		
USD	642.000	Atotech Alpha 3 BV 6.25% 01/02/2025	649.492	0,33	USD	402.000	Allison Transmission Inc. 5.88% 01/06/2029	434.042	0,22		
USD	187.000	Clear Channel International BV 6.63% 01/08/2025	191.497	0,10							
USD	443.000	Constellium SE 5.88% 15/02/2026	455.920	0,23							
USD	407.000	Constellium SE 6.63% 01/03/2025	417.685	0,21							
USD	901.000	Ziggo Secured Finance 5.50% 15/01/2027	940.065	0,48							
				<b>3.019.999</b>	<b>1,54</b>						

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

### Portfolioaufstellung

(Fortsetzung)

Nennwert		Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts	Nennwert		Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts
<b>Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere (Fortsetzung)</b>					<b>Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere (Fortsetzung)</b>				
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>					<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				
<b>VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)</b>					<b>VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)</b>				
USD	204.000	American Airlines Inc. 11.75% 15/07/2025	196.274	0,10	USD	42.000	Burlington Coat Factory Warehouse Corp. 6.25% 15/04/2025	44.263	0,02
USD	407.000	American Builders & Contractors Supply Company Inc. 4.00% 15/01/2028	413.868	0,21	USD	291.000	BWX Technologies Inc. 4.13% 30/06/2028	299.366	0,15
USD	689.000	American Builders & Contractors Supply Company Inc. 5.88% 15/05/2026	714.586	0,37	USD	469.000	BWX Technologies Inc. 5.38% 15/07/2026	488.203	0,25
USD	98.000	APX Group Inc. 7.63% 01/09/2023	99.315	0,05	USD	117.000	By Crown Parent LLC 4.25% 31/01/2026	119.194	0,06
USD	576.000	APX Group Inc. 7.88% 01/12/2022	577.659	0,30	USD	604.000	Caesars Entertainment Inc. 6.25% 01/07/2025	628.944	0,32
USD	129.000	APX Group Inc. 8.50% 01/11/2024	136.565	0,07	USD	462.000	Caesars Entertainment Inc. 8.13% 01/07/2027	490.008	0,25
USD	358.000	Aramark Services Inc. 5.00% 01/02/2028	362.028	0,19	USD	496.000	Caesars Resort Collection LLC 5.25% 15/10/2025	480.810	0,25
USD	87.000	Aramark Services Inc. 6.38% 01/05/2025	90.606	0,05	USD	128.000	Caesars Resort Collection LLC 5.75% 01/07/2025	132.277	0,07
USD	257.000	Archrock Partners LP 6.25% 01/04/2028	242.955	0,12	USD	928.000	Callon Petroleum Company 6.38% 01/07/2026	239.924	0,12
USD	321.000	Aruba Investments Inc. P.P. 144A 8.75% 15/02/2023	324.563	0,17	USD	67.000	Calpine Corp. 4.63% 01/02/2029	67.084	0,03
USD	729.000	Ascend Learning LLC 6.88% 01/08/2025	750.269	0,38	USD	84.000	Calpine Corp. 5.00% 01/02/2031	85.498	0,04
USD	429.000	Avantor Funding Inc. 4.63% 15/07/2028	445.623	0,23	USD	475.000	Calpine Corp. 5.13% 15/03/2028	492.218	0,25
USD	198.000	Avis Budget Car Rental LLC 5.25% 15/03/2025	180.685	0,09	USD	455.000	Catalent Pharma Solutions Inc. 4.88% 15/01/2026	465.688	0,24
USD	563.000	Axalta Coating System Limited 4.88% 15/08/2024	574.730	0,29	USD	343.000	CCO Holdings LLC 5.13% 01/05/2027	361.245	0,18
USD	526.000	Bausch Health Americas Inc. 9.25% 01/04/2026	578.929	0,30	USD	983.000	CCO Holdings LLC 4.25% 01/02/2031	1.018.019	0,52
USD	509.000	Beacon Escrow Corp. 4.88% 01/11/2025	498.068	0,25	USD	176.000	CCO Holdings LLC 4.50% 15/08/2030	185.139	0,09
USD	306.000	Beacon Roofing Supply Inc. 4.50% 15/11/2026	316.136	0,16	USD	551.000	CCO Holdings LLC 4.50% 01/05/2032	576.408	0,30
USD	282.000	Black Knight Infoser 3.63% 01/09/2028	285.167	0,15	USD	1.573.000	CCO Holdings LLC 4.75% 01/03/2030	1.665.249	0,84
USD	211.000	Booz Allen Hamilton Inc. 3.88% 01/09/2028	217.130	0,11	USD	606.000	CCO Holdings LLC 5.00% 01/02/2028	637.437	0,33
USD	234.000	Boxer Parent Co Inc. 7.13% 02/10/2025	250.079	0,13	USD	518.000	CCO Holdings LLC 5.50% 01/05/2026	539.838	0,28
USD	51.000	Boxer Parent Co Inc. 9.13% 01/03/2026	54.092	0,03	USD	416.000	CD&R Smokey Buyer 6.75% 15/07/2025	440.160	0,22
USD	378.000	Boyd Gaming Corp. 4.75% 01/12/2027	370.913	0,19	USD	244.000	Cedar Fair LP 5.50% 01/05/2025	250.710	0,13
USD	145.000	Boyd Gaming Corp. 6.00% 15/08/2026	150.317	0,08	USD	221.000	Centene Corp. 3.38% 15/02/2030	229.426	0,12
USD	93.000	Boyd Gaming Corp. 8.63% 01/06/2025	102.070	0,05	USD	571.000	Centene Corp. 4.25% 15/12/2027	598.225	0,30
					USD	468.000	Centene Corp. 4.63% 15/12/2029	505.148	0,26
					USD	142.000	Centene Corp. 5.38% 01/06/2026	149.965	0,08
					USD	547.000	Centene Corp. 5.38% 15/08/2026	578.300	0,29
					USD	725.000	Centurylink Inc. 5.13% 15/12/2026	744.249	0,38

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

### Portfolioaufstellung

(Fortsetzung)

Nennwert		Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts	Nennwert		Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts
<b>Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere (Fortsetzung)</b>					<b>Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere (Fortsetzung)</b>				
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>					<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				
<b>VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)</b>					<b>VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)</b>				
USD	206.000	ChampionX Corp. 6.38% 01/05/2026	197.065	0,10	USD	324.000	Delta Air Lines Inc. 4.50% 20/10/2025	332.708	0,17
USD	923.000	Change Healthcare Holdings LLC 5.75% 01/03/2025	936.267	0,48	USD	590.000	Delta Air Lines Inc. 4.75% 20/10/2028	613.231	0,31
USD	111.000	Charles River Laboratories International Inc. 4.25% 01/05/2028	116.260	0,06	USD	631.000	Delta Air Lines Inc. 7.00% 01/05/2025	693.723	0,36
USD	290.000	Cheniere Energy Partners LP 4.50% 01/10/2029	297.613	0,15	USD	400.000	Diamond Sports Group LLC 5.38% 15/08/2026	282.163	0,14
USD	455.000	Cheniere Energy Partners LP 4.63% 15/10/2028	468.163	0,24	USD	129.000	Diamond Sports Group LLC 6.63% 15/08/2027	67.161	0,03
USD	333.000	Cheniere Energy Partners LP 5.63% 01/10/2026	347.153	0,18	USD	382.000	Dish DBS Corp. 7.38% 01/07/2028	393.938	0,20
USD	516.000	CHS/Community Health Systems Inc. 6.63% 15/02/2025	500.365	0,26	USD	1.088.000	Dish DBS Corp. 7.75% 01/07/2026	1.197.479	0,60
USD	314.000	Cinemark USA Inc. 8.75% 01/05/2025	332.820	0,17	USD	579.000	Element Solutions Inc. 3.88% 01/09/2028	568.868	0,29
USD	575.000	Clear Channel Worldwide Holdings Inc. 5.13% 15/08/2027	552.768	0,29	USD	734.000	Endeavor Energy Resources LP 5.75% 30/01/2028	739.763	0,38
USD	403.000	Clear Channel Worldwide Holdings Inc. 9.25% 15/02/2024	390.900	0,20	USD	128.000	Endeavor Energy Resources LP 6.63% 15/07/2025	131.840	0,07
USD	319.000	Clearway Energy Operating LLC 4.75% 15/03/2028	331.734	0,17	USD	228.000	Energizer Holdings Inc. 4.38% 31/03/2029	230.536	0,12
USD	497.000	CNX Resources 7.25% 14/03/2027	507.251	0,26	USD	329.000	Energizer Holdings Inc. 4.75% 15/06/2028	340.219	0,17
USD	350.000	Colfax Corp 6.00% 15/02/2024	364.247	0,19	USD	866.000	Energizer Holdings Inc. 7.75% 15/01/2027	947.187	0,49
USD	135.000	CommScope Inc. 8.25% 01/03/2027	140.780	0,07	USD	270.000	EQM Midstream Partners LP 6.00% 01/07/2025	278.668	0,14
USD	296.000	CommScope Technologies LLC P.P. 144A 6.00% 15/06/2025	300.225	0,15	USD	256.000	EQM Midstream Partners LP 6.50% 01/07/2027	271.525	0,14
USD	100.000	Comstock Resources Inc. 9.75% 15/08/2026	102.533	0,05	USD	289.000	Expedia Group Inc. 4.63% 01/08/2027	303.652	0,16
USD	733.000	Core & Main LP 6.13% 15/08/2025	742.015	0,38	USD	42.000	Expedia Group Inc. 6.25% 01/05/2025	46.286	0,02
USD	403.000	Cott Holdings Inc. 5.50% 01/04/2025	413.897	0,21	USD	295.000	Expedia Group Inc. 7.00% 01/05/2025	318.677	0,16
USD	658.000	Crownrock LP 5.63% 15/10/2025	623.043	0,32	USD	353.000	Flex Acquisition Company Inc. 7.88% 15/07/2026	359.817	0,18
USD	851.000	CSC Holdings LLC 4.63% 01/12/2030	856.319	0,44	USD	313.000	Frontdoor Inc. 6.75% 15/08/2026	335.004	0,17
USD	562.000	CSC Holdings LLC 5.50% 15/05/2026	584.831	0,30	USD	373.000	Gartner Inc. 3.75% 01/10/2030	378.381	0,19
USD	518.000	CSC Holdings LLC 5.75% 15/01/2030	551.131	0,28	USD	345.000	Gartner Inc. 4.50% 01/07/2028	361.991	0,19
USD	1.065.000	CSC Holdings LLC 6.50% 01/02/2029	1.189.472	0,61	USD	783.000	Gates Global LLC 6.25% 15/01/2026	807.655	0,41
USD	256.000	DCP Midstream Operating LP 5.63% 15/07/2027	261.760	0,13	USD	377.000	Genesys Telecommunications Laboratories Inc. 10.00% 30/11/2024	399.384	0,20
USD	508.000	Delek Logistics Partners LP 6.75% 15/05/2025	463.677	0,24	USD	439.000	GLP Capital LP 5.38% 01/11/2023	467.896	0,24
					USD	217.000	Golden Nugget Inc. 6.75% 15/10/2024	181.195	0,09

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

### Portfolioaufstellung

(Fortsetzung)

		% des				% des			
Nennwert	Anlage	Marktwert USD	Nettoinven- tarwerts	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	Nettoinven- tarwerts		
<b>Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere (Fortsetzung)</b>				<b>Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere (Fortsetzung)</b>					
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>					
<b>VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)</b>				<b>VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)</b>					
USD	129.000	Group 1 Automotive Inc. 4.00% 15/08/2028	126.905	0,06	USD	279.000	KFC Holding-Pizza Hut Holdings LLC-Taco Bell America LLC 5.25% 01/06/2026	290.767	0,15
USD	278.000	H&E Equipment Services 5.63% 01/09/2025	290.163	0,15	USD	388.000	Kraft Heinz Foods Company 3.88% 15/05/2027	412.289	0,21
USD	291.000	Hd Supply Inc. 5.38% 15/10/2026	306.278	0,16	USD	136.000	L Brands Inc. 6.63% 01/10/2030	138.890	0,07
USD	381.000	Herc Holdings Inc. 5.50% 15/07/2027	394.271	0,20	USD	116.000	L Brands Inc. 6.88% 01/07/2025	125.498	0,06
USD	532.000	Hertz Corp. 6.00% 15/01/2028	241.395	0,12	USD	81.000	L Brands Inc. 9.38% 01/07/2025	93.049	0,05
USD	59.000	Hertz Corp. 7.13% 01/08/2026	26.624	0,01	USD	38.000	Ladder Capital Finance Holdings 4.25% 01/02/2027	32.907	0,02
USD	106.000	Hertz Corp. 7.63% 01/06/2022	97.653	0,05	USD	662.000	Ladder Capital Finance Holdings 5.25% 01/10/2025	615.352	0,32
USD	360.000	Hilcorp Energy 5.75% 01/10/2025	328.034	0,17	USD	214.000	Lamar Media Corp. 3.75% 15/02/2028	213.789	0,11
USD	255.000	Hilcorp Energy 6.25% 01/11/2028	233.198	0,12	USD	168.000	Lamar Media Corp. 4.00% 15/02/2030	168.672	0,09
USD	293.000	Hill-Rom Holdings Inc. 4.38% 15/09/2027	303.918	0,16	USD	224.000	Lamb Weston Holdings Inc. 4.88% 01/11/2026	234.080	0,12
USD	486.000	Hilton Domestic Operating Company Inc. 4.88% 15/01/2030	500.884	0,26	USD	114.000	Lamb Weston Holdings Inc. 4.88% 15/05/2028	123.915	0,06
USD	211.000	Hilton Domestic Operating Company Inc. 5.13% 01/05/2026	216.803	0,11	USD	223.000	Lennar Corp. 5.00% 15/06/2027	251.856	0,13
USD	113.000	Hilton Domestic Operating Company Inc. 5.38% 01/05/2025	117.495	0,06	USD	155.000	Live Nation Entertainment Inc. 4.75% 15/10/2027	145.119	0,07
USD	125.000	Hilton Domestic Operating Company Inc. 5.75% 01/05/2028	132.137	0,07	USD	331.000	Live Nation Entertainment Inc. 6.50% 15/05/2027	357.476	0,18
USD	269.000	Hologic Inc. 3.25% 15/02/2029	272.747	0,14	USD	413.000	Logan Merger Sub Inc. 5.50% 01/09/2027	420.486	0,22
USD	633.000	HUB International Limited 7.00% 01/05/2026	652.560	0,33	USD	758.000	Matador Resources Company 5.88% 15/09/2026	636.340	0,33
USD	391.000	iHeartCommunications Inc. 4.75% 15/01/2028	369.984	0,19	USD	463.000	Match Group Holdings II LLC 4.63% 01/06/2028	477.588	0,24
USD	173.000	iHeartCommunications Inc. 5.25% 15/08/2027	169.748	0,09	USD	107.000	Mattel Inc. 5.45% 01/11/2041	100.037	0,05
USD	111.910	iHeartCommunications Inc. 6.38% 01/05/2026	116.840	0,06	USD	319.000	Mattel Inc. 5.88% 15/12/2027	343.723	0,18
USD	490.757	iHeartCommunications Inc. 8.38% 01/05/2027	488.221	0,25	USD	318.000	Mattel Inc. 6.75% 31/12/2025	336.086	0,17
USD	270.000	Illuminate Buyer LLC 9.00% 01/07/2028	290.250	0,15	USD	457.000	Mauser Packaging Solutions Holding Company 5.50% 15/04/2024	457.962	0,23
USD	446.000	Innophos Holdings Inc. 9.38% 15/02/2028	475.548	0,24	USD	214.000	MGM Growth Properties Operating Partnership LP 4.50% 15/01/2028	218.146	0,11
USD	911.000	IRB Holding 6.75% 15/02/2026	912.708	0,47	USD	485.000	MGM Growth Properties Operating Partnership LP 4.63% 15/06/2025	495.003	0,25
USD	344.000	IRB Holding 7.00% 15/06/2025	367.192	0,19	USD	260.000	MGM Growth Properties Operating Partnership LP 5.75% 01/02/2027	280.179	0,14
USD	237.000	Iron Mountain Inc. 5.00% 15/07/2028	242.629	0,12	USD	539.000	Microchip Technology Inc. 4.25% 01/09/2025	559.886	0,29
USD	604.000	Iron Mountain Inc. 5.25% 15/07/2030	630.425	0,33					
USD	122.000	Jaguar Holding Company II 4.63% 15/06/2025	125.813	0,06					
USD	393.000	Jaguar Holding Company II 5.00% 15/06/2028	410.439	0,21					
USD	969.000	Kar Auction Services Inc. 5.13% 01/06/2025	969.603	0,50					

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

### Portfolioaufstellung

(Fortsetzung)

Nennwert		Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts	Nennwert		Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts
<b>Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere (Fortsetzung)</b>					<b>Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere (Fortsetzung)</b>				
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>					<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				
<b>VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)</b>					<b>VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)</b>				
USD	705.469	Mileage Plus Holdings LLC 6.50% 20/06/2027	734.483	0,37	USD	288.000	Parsley Energy LLC 4.13% 15/02/2028	271.930	0,14
USD	266.000	Minerals Technologies Inc. 5.00% 01/07/2028	274.067	0,14	USD	767.000	Parsley Energy LLC 5.63% 15/10/2027	765.139	0,39
USD	328.000	MPH Acquisition Holdings LLC 7.13% 01/06/2024	337.225	0,17	USD	967.000	Pattern Energy Operations LP 4.50% 15/08/2028	1.006.586	0,53
USD	651.000	NCR Corp. 5.00% 01/10/2028	652.220	0,34	USD	217.000	Performance Food Group Inc. 5.50% 15/10/2027	223.646	0,11
USD	261.000	NCR Corp. 5.25% 01/10/2030	261.163	0,13	USD	62.000	Performance Food Group Inc. 6.88% 01/05/2025	66.185	0,03
USD	175.000	NCR Corp. 5.75% 01/09/2027	183.307	0,09	USD	562.000	PetSmart Inc. 5.88% 01/06/2025	576.400	0,31
USD	120.000	NCR Corp. 6.13% 01/09/2029	126.900	0,06	USD	899.000	PetSmart Inc. P.P. 144A 7.13% 15/03/2023	907.428	0,46
USD	170.000	NCR Corp. 8.13% 15/04/2025	188.105	0,10	USD	789.000	Pilgrim's Pride Corp. 5.88% 30/09/2027	820.927	0,42
USD	408.000	Netflix Inc. 4.88% 15/06/2030	465.375	0,24	USD	640.000	Plantronics Inc. P.P. 144A 5.50% 31/05/2023	574.734	0,29
USD	432.000	Netflix Inc. 5.38% 15/11/2029	509.447	0,26	USD	818.000	Post Holdings Inc. 4.63% 15/04/2030	842.029	0,43
USD	931.000	Newell Brands Inc. 4.88% 01/06/2025	1.006.644	0,52	USD	423.000	Post Holdings Inc. 5.00% 15/08/2026	434.990	0,22
USD	384.000	Nexstar Broadcasting 4.75% 01/11/2028	391.920	0,20	USD	1.089.000	Post Holdings Inc. 5.75% 01/03/2027	1.144.592	0,58
USD	153.000	NextEra Energy Operating Partners LP 4.25% 15/07/2024	159.730	0,08	USD	634.000	PQ Corp. 5.75% 15/12/2022	653.971	0,33
USD	501.000	NextEra Energy Operating Partners LP 4.50% 15/09/2027	543.365	0,28	USD	279.000	Prestige Brands Inc. 5.13% 15/01/2028	289.276	0,15
USD	1.025.000	NFP Corp. 6.88% 15/08/2028	1.038.037	0,52	USD	440.000	Prestige Brands Inc. 6.38% 01/03/2024	453.695	0,24
USD	266.000	NFP Corp. 7.00% 15/05/2025	284.124	0,15	USD	740.000	Provident Funding Associates LP 6.38% 15/06/2025	718.263	0,37
USD	261.000	Nielsen Finance LLC 5.63% 01/10/2028	268.303	0,14	USD	614.000	QualityTech LP 3.88% 01/10/2028	618.455	0,32
USD	195.000	Nielsen Finance LLC 5.88% 01/10/2030	202.478	0,10	USD	483.000	Quicken Loans LLC 3.63% 01/03/2029	479.579	0,25
USD	164.000	Nordstrom Inc. 8.75% 15/05/2025	182.294	0,09	USD	709.000	Quicken Loans LLC 3.88% 01/03/2031	703.238	0,36
USD	944.000	Novelis Corp. 4.75% 30/01/2030	924.531	0,48	USD	326.000	Radiate Holdco 4.50% 15/09/2026	328.650	0,17
USD	388.000	Novelis Corp. 5.88% 30/09/2026	399.155	0,20	USD	467.000	Radiate Holdco 6.50% 15/09/2028	480.025	0,25
USD	48.000	NRG Energy Inc. 5.25% 15/06/2029	52.339	0,03	USD	351.000	Refinitiv US Holdings Inc. 6.25% 15/05/2026	376.095	0,19
USD	85.000	Occidental Petroleum Corp. 6.20% 15/03/2040	70.747	0,04	USD	744.000	Refinitiv US Holdings Inc. 8.25% 15/11/2026	816.074	0,42
USD	122.000	Occidental Petroleum Corp. 6.60% 15/03/2046	104.946	0,05	USD	294.000	Resideo Funding Inc. 6.13% 01/11/2026	292.020	0,15
USD	65.000	Ortho-Clinical Diagnostics Inc. 7.38% 01/06/2025	66.365	0,03	USD	504.000	Reynolds Group Issuer Inc. 5.13% 15/07/2023	510.187	0,26
USD	335.000	Ortho-Clinical Inc. 7.25% 01/02/2028	349.238	0,18	USD	396.000	Sabre GLBL 7.38% 01/09/2025	402.485	0,21
USD	464.000	Outfront Media Capital LLC 4.63% 15/03/2030	446.902	0,22					
USD	78.000	Outfront Media Capital LLC 5.00% 15/08/2027	76.252	0,04					
USD	719.000	Par Pharmaceutical Inc. 7.50% 01/04/2027	754.715	0,38					
USD	252.000	Park Intermediate Holdings LLC 5.88% 01/10/2028	253.260	0,13					

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

### Portfolioaufstellung

(Fortsetzung)

Nennwert		Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts	Nennwert		Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts
<b>Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere (Fortsetzung)</b>					<b>Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere (Fortsetzung)</b>				
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>					<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				
<b>VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)</b>					<b>VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)</b>				
USD	137.000	Sabre GLBL 9.25% 15/04/2025	150.949	0,08	USD	324.000	Targa Resources Partners LP 4.88% 01/02/2031	313.972	0,16
USD	439.000	SBA Communications 4.88% 01/09/2024	450.106	0,23	USD	83.000	Targa Resources Partners LP 5.00% 15/01/2028	81.119	0,04
USD	866.000	Scientific Games International Inc. 5.00% 15/10/2025	873.577	0,45	USD	1.182.000	Targa Resources Partners LP 5.50% 01/03/2030	1.182.000	0,60
USD	164.000	Scientific Games International Inc. 7.00% 15/05/2028	165.089	0,08	USD	510.000	Taylor Morrison 5.88% 15/04/2023	538.503	0,28
USD	186.000	Scientific Games International Inc. 7.25% 15/11/2029	189.023	0,10	USD	16.000	Taylor Morrison Communities Inc. 5.13% 01/08/2030	17.170	0,01
USD	217.000	Scientific Games International Inc. 8.25% 15/03/2026	227.290	0,12	USD	541.000	Taylor Morrison Communities Inc. 5.75% 15/01/2028	591.029	0,30
USD	359.000	Scientific Games International Inc. 8.63% 01/07/2025	376.930	0,19	USD	394.000	Tegna Inc. 4.75% 15/03/2026	403.090	0,21
USD	479.000	Select Medical Corp. 6.25% 15/08/2026	498.759	0,26	USD	88.000	Teleflex Inc. 4.25% 01/06/2028	91.379	0,05
USD	251.000	Sensata Technologies Inc. 4.38% 15/02/2030	262.521	0,13	USD	136.000	Tempo Acquisition LLC 5.75% 01/06/2025	142.475	0,07
USD	173.000	Shea Homes LP 4.75% 15/02/2028	173.000	0,09	USD	237.000	Tempo Acquisition LLC 6.75% 01/06/2025	241.795	0,12
USD	80.000	Shea Homes LP 4.75% 01/04/2029	79.753	0,04	USD	115.000	Tenet Healthcare Corp. 4.63% 15/06/2028	116.680	0,06
USD	585.000	Sirius XM Radio Inc. 4.13% 01/07/2030	599.868	0,31	USD	154.000	Tenet Healthcare Corp. 4.88% 01/01/2026	156.796	0,08
USD	390.000	Sirius XM Radio Inc. 5.38% 15/07/2026	406.751	0,21	USD	505.000	Tenet Healthcare Corp. 5.13% 01/11/2027	519.052	0,27
USD	268.000	Six Flags Theme Parks Inc. 7.00% 01/07/2025	285.755	0,15	USD	879.000	Tenet Healthcare Corp. 6.13% 01/10/2028	855.862	0,43
USD	169.000	Solera LLC 10.50% 01/03/2024	176.922	0,09	USD	135.000	Tenet Healthcare Corp. 6.25% 01/02/2027	139.736	0,07
USD	149.000	Sophia LP P.P. 144A 9.00% 30/09/2023	149.419	0,08	USD	764.000	Tenet Healthcare Corp. 7.50% 01/04/2025	825.481	0,41
USD	203.000	SS&C Technologies Inc. 5.50% 30/09/2027	215.477	0,11	USD	271.000	Terraform Power Operating LLC 4.75% 15/01/2030	287.755	0,15
USD	421.000	Staples Inc. 7.50% 15/04/2026	389.078	0,20	USD	1.263.000	TransDigm Inc. 6.25% 15/03/2026	1.323.646	0,68
USD	235.000	Stevens Holding Company Inc. 6.13% 01/10/2026	251.744	0,13	USD	569.000	TransDigm Inc. 8.00% 15/12/2025	617.081	0,32
USD	61.000	Summit Materials LLC 5.25% 15/01/2029	63.669	0,03	USD	619.000	Transmontaigne Partners LP 6.13% 15/02/2026	635.971	0,33
USD	312.000	Sunoco LP 4.88% 15/01/2023	314.327	0,16	USD	102.000	Trimas Corp. 4.88% 15/10/2025	103.607	0,05
USD	648.000	Sunoco LP 5.88% 15/03/2028	665.398	0,34	USD	440.000	Twitter Inc. 3.88% 15/12/2027	459.087	0,24
USD	217.000	Surgery Center Holdings Inc. 6.75% 01/07/2025	216.792	0,12	USD	255.000	Uber Technologies Inc. 6.25% 15/01/2028	262.252	0,13
USD	68.000	Surgery Center Holdings Inc. 10.00% 15/04/2027	73.083	0,04	USD	229.000	Uber Technologies Inc. 7.50% 01/11/2023	238.120	0,12
USD	127.000	Switch Limited 3.75% 15/09/2028	128.429	0,07	USD	553.000	Uber Technologies Inc. 7.50% 15/05/2025	590.328	0,30
USD	110.000	Tallgrass Energy Partners 5.50% 15/09/2024	104.225	0,05	USD	136.000	USA Compression Partners LP 6.88% 01/04/2026	134.895	0,07
USD	191.000	Tallgrass Energy Partners 5.50% 15/01/2028	173.094	0,09	USD	177.000	USA Compression Partners LP 6.88% 01/09/2027	175.960	0,09
USD	652.000	Targa Resources 5.38% 01/02/2027	655.928	0,34					

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

### Portfolioaufstellung

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts		
<b>Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere (Fortsetzung)</b>				<b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>					
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				<b>Anleihen</b>					
<b>VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)</b>				<b>LUXEMBURG</b>					
USD	130.000	USI Inc. 6.88% 01/05/2025	132.022	0,07	USD	327.000	Altice France Holding SA 10.50% 15/05/2027	364.033	0,19
USD	653.000	Valvoline Inc. 4.25% 15/02/2030	666.876	0,34	<b>Luxemburg, insgesamt</b>				
USD	202.000	Valvoline Inc. 4.38% 15/08/2025	208.186	0,11	<b>364.033 0,19</b>				
USD	711.000	Verscend Escrow Corp. 9.75% 15/08/2026	774.840	0,40	<b>VEREINIGTE STAATEN</b>				
USD	243.000	Vici Properties LP 3.75% 15/02/2027	239.051	0,12	USD	114.000	Acadia Healthcare Company 5.00% 15/04/2029	115.676	0,06
USD	520.000	Vici Properties LP 4.13% 15/08/2030	512.850	0,26	USD	90.000	Emergent Biosolutions Inc. 3.88% 15/08/2028	90.113	0,05
USD	236.000	Vistra Operations Company LLC 5.50% 01/09/2026	246.675	0,13	USD	568.000	Holly Energy Partners Corp. 5.00% 01/02/2028	558.060	0,29
USD	449.000	Vistra Operations Company LLC 5.63% 15/02/2027	474.262	0,24	USD	660.000	Kraft Heinz Foods Company 4.88% 01/10/2049	694.238	0,36
USD	470.000	Waste Pro USA Inc. 5.50% 15/02/2026	478.072	0,24	USD	111.000	MTS Systems Corp 5.75% 15/08/2027	109.718	0,06
USD	344.000	Wesco Distribution Inc. 7.13% 15/06/2025	373.329	0,19	<b>Vereinigte Staaten, insgesamt</b>				
USD	857.000	Wesco Distribution Inc. 7.25% 15/06/2028	938.530	0,48	<b>1.567.805 0,82</b>				
USD	636.000	WR Grace & Co-Conn 4.88% 15/06/2027	657.592	0,34	<b>Anleihen, insgesamt</b>				
USD	283.000	Wyndham Hotels & Resorts 4.38% 15/08/2028	275.314	0,14	<b>1.931.838 1,01</b>				
USD	292.000	Wynn Las Vegas LLC 5.50% 01/03/2025	279.955	0,14	<b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, insgesamt</b>				
USD	59.000	Wynn Resorts Finance LLC 7.75% 15/04/2025	62.351	0,03	<b>1.931.838 1,01</b>				
USD	40.000	Yum! Brands Inc. 7.75% 01/04/2025	44.250	0,02	<b>Wert der Anlagen, insgesamt</b>				
USD	312.000	Zayo Group Holdings Inc. 4.00% 01/03/2027	307.273	0,16	<b>192.106.721 98,35</b>				
USD	746.000	Zayo Group Holdings Inc. 6.13% 01/03/2028	770.935	0,39	<b>(Gesamtkosten: USD 189.229.288)</b>				
<b>Vereinigte Staaten, insgesamt</b>			<b>116.728.589</b>	<b>59,72</b>					
<b>Anleihen, insgesamt</b>			<b>135.342.017</b>	<b>69,26</b>					
<b>Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere, insgesamt</b>				<b>135.342.017</b>	<b>69,26</b>				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.



## Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond

### Portfolioaufstellung

zum 30. September 2020

	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts		Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung</b>					<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				
<b>Anleihen</b>					<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				
<b>BAHAMAS</b>					<b>KAIMANINSELN (Fortsetzung)</b>				
USD	200.000	Competition Team Technologies Limited 3.75% 12/03/2024	214.111	0,39	USD	270.000	Sun Hung Kai Properties Limited 3.75% 25/02/2029	305.016	0,55
		<b>Bahamas, insgesamt</b>	<b>214.111</b>	<b>0,39</b>	USD	400.000	Tencent Holdings Limited 3.24% 03/06/2050	409.491	0,74
<b>BERMUDAS</b>					<b>Kaimaninseln, insgesamt</b>				
USD	200.000	China Oil & Gas Group Limited 4.63% 20/04/2022	201.803	0,37	USD	467.000	Tingyi (Cayman Islands) Holding Corporation 1.63% 24/09/2025	463.307	0,84
USD	200.000	China Oil & Gas Group Limited 5.50% 25/01/2023	205.203	0,37	<b>Kaimaninseln, insgesamt</b>				
USD	500.000	LI & Fung Limited 4.50% 18/08/2025	500.960	0,91				<b>7.895.447</b>	<b>14,31</b>
		<b>Bermudas, insgesamt</b>	<b>907.966</b>	<b>1,65</b>	<b>HONGKONG</b>				
<b>KAIMANINSELN</b>					<b>HONGKONG</b>				
USD	250.000	AAC Technologies Holdings Inc. 3.00% 27/11/2024	250.254	0,45	USD	400.000	Bank of East Asia Limited FRN 29/05/2030	413.230	0,75
USD	250.000	Alibaba Group Holding Limited 4.50% 28/11/2034	313.848	0,57	USD	450.000	CNAC HK Finbridge Company Limited 5.13% 14/03/2028	514.303	0,93
USD	500.000	China Mengniu Dairy Company Limited 1.88% 17/06/2025	501.818	0,91	USD	500.000	Ibcil Finance Company Limited 3.13% 15/11/2022	516.552	0,93
USD	600.000	Cifi Holdings Group Company Limited 6.00% 16/07/2025	604.560	1,10	USD	950.000	Lenovo Group Limited 5.88% 24/04/2025	1.021.056	1,85
USD	200.000	CK Hutchison International 17 II Limited 3.25% 29/09/2027	219.901	0,40	<b>Hongkong, insgesamt</b>				
USD	600.000	Country Garden Holdings Company Limited 7.25% 08/04/2026	668.576	1,21				<b>2.465.141</b>	<b>4,46</b>
USD	500.000	ENN Energy Holdings Limited 2.63% 17/09/2030	500.827	0,91	<b>INDIEN</b>				
USD	333.000	Goodman HK Finance 3.00% 22/07/2030	347.883	0,63	USD	200.000	Adani Electricity Mumbai Limited 3.95% 12/02/2030	195.999	0,36
USD	500.000	HPHT Finance 19 Limited 2.88% 05/11/2024	520.447	0,94	USD	400.000	Adani Ports & Special Economic Zone Limited 4.00% 30/07/2027	400.117	0,73
USD	200.000	JD.com Inc. 3.38% 14/01/2030	217.188	0,39	USD	400.000	Adani Ports & Special Economic Zone Limited 4.38% 03/07/2029	403.565	0,73
USD	600.000	Longfor Properties Company 4.50% 16/01/2028	659.530	1,20	USD	650.000	Bharti Airtel Limited 4.38% 10/06/2025	687.564	1,24
USD	500.000	Melco Resorts Finance 4.88% 06/06/2025	508.068	0,92	USD	200.000	Delhi International Airport Limited 6.45% 04/06/2029	199.392	0,36
USD	200.000	Powerlong Real Estate Holdings Limited 6.25% 10/08/2024	198.920	0,36	USD	250.000	GMR Hyderabad International Airport Limited 4.25% 27/10/2027	222.719	0,40
USD	500.000	Sands China Limited 5.13% 08/08/2025	548.972	1,00	USD	200.000	JSW Steel Limited 5.95% 18/04/2024	205.014	0,37
USD	400.000	Semiconductor Manufacturing International Corp. 2.69% 27/02/2025	394.354	0,71	USD	500.000	Neerg Energy Limited 6.00% 13/02/2022	500.667	0,91
USD	250.000	Sun Hung Kai Properties Limited 2.75% 13/05/2030	262.487	0,48	USD	500.000	Ongc Videsh Limited 4.63% 15/07/2024	537.061	0,97
					USD	500.000	Reliance Industries Limited 3.67% 30/11/2027	549.554	1,00
					USD	600.000	State Bank of India 4.38% 24/01/2024	641.108	1,16
					<b>Indien, insgesamt</b>				
								<b>4.542.760</b>	<b>8,23</b>

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond

### Portfolioaufstellung

(Fortsetzung)

Nennwert		Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts	Nennwert		Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts		
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>					<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>						
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>					<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>						
<b>INDONESIEN</b>					<b>PHILIPPINEN</b>						
USD	1.000.000	Indonesia Asahan Aluminium Persero Pt 6.76% 15/11/2048	1.291.876	2,35	USD	250.000	Globe Telecom Inc. 2.50% 23/07/2030	241.693	0,44		
USD	400.000	Pertamina Persero PT 5.63% 20/05/2043	469.341	0,85	USD	200.000	International Container Terminal Services Inc. 4.75% 17/06/2030	209.585	0,38		
USD	500.000	Perusahaan Listrik Negara Pt 5.25% 24/10/2042	573.414	1,04	USD	714.000	Metropolitan Bank & Trust Company 2.13% 15/01/2026	709.667	1,29		
USD	800.000	Saka Energi Indonesia Pt 4.45% 05/05/2024	725.661	1,31	USD	670.000	Smc Global Power Holdings Corp. Perp FRN	644.374	1,17		
USD	400.000	Sri Rejeki Isman Tbk Pt 7.25% 16/01/2025	392.924	0,71			<b>Philippinen, insgesamt</b>	<b>1.805.319</b>	<b>3,28</b>		
				<b>Indonesien, insgesamt</b>					<b>3.453.216</b>	<b>6,26</b>	
<b>ISLE OF MAN</b>					<b>SÜDKOREA</b>						
USD	400.000	Gohl Capital Limited 4.25% 24/01/2027	398.905	0,72	USD	500.000	Shinhan Financial Group Company Limited Perp FRN	539.450	0,98		
				<b>Isle of Man, insgesamt</b>					<b>Südkorea, insgesamt</b>	<b>539.450</b>	<b>0,98</b>
				<b>398.905</b>					<b>398.905</b>	<b>0,72</b>	
<b>MALAYSIA</b>					<b>SINGAPUR</b>						
USD	500.000	Malayan Banking Bhd FRN 29/10/2026	510.801	0,93	USD	400.000	Boc Aviation Limited 2.63% 17/09/2030	397.222	0,72		
USD	500.000	Petronas Capital Limited 3.50% 21/04/2030	560.150	1,02	USD	550.000	DBS Group Holdings Limited FRN 11/12/2028	599.507	1,09		
USD	400.000	Press Metal Labuan Limited 4.80% 30/10/2022	392.827	0,71	USD	750.000	Geo Coal International Pte Limited 8.00% 04/10/2022	493.884	0,90		
USD	400.000	TNB Global Ventures Capital Bhd 4.85% 01/11/2028	474.333	0,86	USD	800.000	PSA Treasury PTE 2.25% 30/04/2030	841.833	1,53		
				<b>Malaysia, insgesamt</b>					253.991	0,46	
				<b>1.938.111</b>					546.306	0,99	
				<b>3,52</b>					508.905	0,92	
<b>MAURITIUS</b>					<b>Singapur, insgesamt</b>						
USD	400.000	Greenko Solar Mauritius Limited 5.55% 29/01/2025	407.095	0,74					<b>3.641.648</b>	<b>6,61</b>	
				<b>Mauritius, insgesamt</b>					<b>407.095</b>	<b>0,74</b>	
<b>NIEDERLANDE</b>					<b>THAILAND</b>						
USD	250.000	Mong Duong Finance Holdings BV 5.13% 07/05/2029	254.921	0,46	USD	800.000	Bangkok Bank pcl FRN 25/09/2034	783.341	1,41		
				<b>Niederlande, insgesamt</b>					393.349	0,71	
				<b>254.921</b>					201.494	0,37	
				<b>0,46</b>					529.506	0,96	
									<b>Thailand, insgesamt</b>	<b>1.907.690</b>	<b>3,45</b>

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond

### Portfolioaufstellung

(Fortsetzung)

	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts		Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>					<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>					<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente</b>				
<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH</b>					<b>CHINA</b>				
USD	1.000.000	HSBC Holdings plc Perp FRN	1.007.715	1,82	USD	606.000	China (Govt of) 1.95% 03/12/2024	638.331	1,16
USD	600.000	Standard Chartered plc Perp FRN	612.290	1,11	<b>China, insgesamt</b>				
USD	200.000	Vedanta Resources plc 6.13% 09/08/2024	140.075	0,25	<b>INDONESIEN</b>				
USD	700.000	Vedanta Resources plc 6.38% 30/07/2022	565.107	1,02	USD	800.000	Indonesia (Govt of) 3.40% 18/09/2029	877.119	1,59
<b>Vereinigtes Königreich, insgesamt</b>					<b>INDONESIEN</b>				
<b>2.325.187</b>					<b>4,20</b>				
<b>BRITISCHE JUNGFERNINSELN</b>					<b>INDONESIEN</b>				
USD	500.000	Cmhi Finance BVI Company Limited FRN 09/04/2169	500.000	0,91	USD	700.000	Indonesia (Govt of) 4.75% 11/02/2029	832.339	1,51
USD	500.000	CNPC Global Capital Limited 1.35% 23/06/2025	501.097	0,91	USD	200.000	Indonesia (Govt of) 6.63% 17/02/2037	281.940	0,51
USD	500.000	Elect Global Investments Limited Perp FRN	487.028	0,88	USD	300.000	Indonesia (Govt of) 7.75% 17/01/2038	464.719	0,84
USD	550.000	FPC Resources Limited 4.38% 11/09/2027	559.488	1,01	USD	200.000	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III 2.30% 23/06/2025	207.818	0,38
USD	511.000	HKT Capital No 5 Limited 3.25% 30/09/2029	551.214	1,00	<b>Indonesien, insgesamt</b>				
USD	500.000	Hongkong Electric Finance Limited 1.88% 27/08/2030	493.117	0,89	<b>2.663.935</b>				
USD	1.239.000	JGSH Philippines Limited 4.13% 09/07/2030	1.259.573	2,28	<b>4,83</b>				
USD	500.000	Sinopec Group Overseas Development 2018 Limited 2.95% 12/11/2029	535.315	0,97	<b>MONGOLEI</b>				
USD	750.000	State Grid Overseas Investment 1.63% 05/08/2030	726.391	1,32	USD	200.000	Mongolia (Govt of) 5.13% 07/04/2026	201.697	0,37
USD	400.000	Studio City Finance Limited 7.25% 11/02/2024	410.808	0,74	USD	500.000	Mongolia (Govt of) 5.63% 01/05/2023	514.405	0,93
USD	850.000	TSMC Global Limited 0.75% 28/09/2025	842.911	1,53	<b>Mongolei, insgesamt</b>				
USD	400.000	Yongda Investment Limited 2.25% 16/06/2025	410.012	0,74	<b>716.102</b>				
<b>Britische Jungferninseln, insgesamt</b>					<b>1,30</b>				
<b>7.276.954</b>					<b>13,18</b>				
<b>Anleihen, insgesamt</b>					<b>39.973.921</b>				
					<b>72,44</b>				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond

### Portfolioaufstellung

(Fortsetzung)

	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				
<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)</b>				
<b>SRI LANKA</b>				
USD	600.000	Sri Lanka (Govt of) 6.75% 18/04/2028	410.000	0,74
USD	350.000	Sri Lanka (Govt of) 6.83% 18/07/2026	246.387	0,45
		<b>Sri Lanka, insgesamt</b>	<b>656.387</b>	<b>1,19</b>
<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente, insgesamt</b>			<b>7.814.946</b>	<b>14,17</b>
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt</b>			<b>47.788.867</b>	<b>86,61</b>
<b>Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere</b>				
<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente</b>				
<b>CHINA</b>				
CNY	6.000.000	China (Govt of) 2.36% 02/07/2023	872.114	1,58
CNY	10.000.000	China (Govt of) 2.85% 04/06/2027	1.444.216	2,61
CNY	7.000.000	China (Govt of) 3.12% 05/12/2026	1.029.089	1,86
		<b>China, insgesamt</b>	<b>3.345.419</b>	<b>6,05</b>
<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente, insgesamt</b>			<b>3.345.419</b>	<b>6,05</b>
<b>Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere, insgesamt</b>			<b>3.345.419</b>	<b>6,05</b>
<b>Wert der Anlagen, insgesamt</b>			<b>51.134.286</b>	<b>92,66</b>
<b>(Gesamtkosten: USD 50.617.691)</b>				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return

### Portfolioaufstellung

zum 30. September 2020

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Nettoinven- tarwerts	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Nettoinven- tarwerts				
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung</b>				<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren (Fortsetzung)</b>							
<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente</b>				<b>Fonds (Fortsetzung)</b>							
<b>INDONESIEN</b>				<b>LUXEMBURG (Fortsetzung)</b>							
IDR	4.000.000.000	Indonesia (Govt of 7.00% 15/09/2030)	230.862	0,87	71.866	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds AU*	670.887	2,52			
		<b>Indonesien, insgesamt</b>	<b>230.862</b>	<b>0,87</b>	182.998	Threadneedle Lux - Global Focus XU*	3.166.164	11,88			
					290.753	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities IE*	3.060.636	11,48			
<b>VEREINIGTE STAATEN</b>					86.284	Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies 4E*	960.824	3,60			
USD	266.000	United States Treasury Inflation Indexed N/B 0.13% 15/04/2022	246.047	0,91	<b>Luxemburg, insgesamt</b>			<b>15.268.851</b>	<b>57,27</b>		
USD	77.600	United States Treasury Inflation Indexed N/B FRN 15/02/2041	121.815	0,46	<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH</b>						
USD	81.000	United States Treasury Inflation Indexed N/B 2.55% 15/02/2040	127.103	0,48	253.966	Threadneedle Investment Funds ICVC - European Select Fund**	505.965	1,90			
		<b>Vereinigte Staaten, insgesamt</b>	<b>494.965</b>	<b>1,85</b>	72.228	Threadneedle Investment Funds ICVC - American Fund**	390.451	1,46			
<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente, insgesamt</b>				<b>725.827</b>	<b>2,72</b>	696.255	Threadneedle Investment Funds ICVC - Asia Fund**	1.594.521	5,98		
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt</b>				<b>725.827</b>	<b>2,72</b>	147.021	Threadneedle Investment Funds ICVC - European Fund**	258.623	0,97		
<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren</b>						809.445	Threadneedle Investment Funds ICVC - Japan Fund**	1.702.841	6,39		
<b>Fonds</b>						339.911	Threadneedle Specialist Investment Funds ICVC - Emerging Market Local Fund**	846.480	3,18		
<b>IRLAND</b>						1.548.159	Threadneedle Specialist Investment Funds ICVC - Sterling Short-Dated Corp. Bond Fund**	1.953.413	7,33		
	12.681	BlackRock Institutional Cash Series Euro Liquidity Fund Premier	1.258.038	4,72	<b>Vereinigtes Königreich, insgesamt</b>			<b>7.252.294</b>	<b>27,21</b>		
		<b>Irland, insgesamt</b>	<b>1.258.038</b>	<b>4,72</b>	<b>Fonds, insgesamt</b>				<b>23.779.183</b>	<b>89,20</b>	
<b>LUXEMBURG</b>						<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren, insgesamt</b>				<b>23.779.183</b>	<b>89,20</b>
	5.409	Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity Fund XUP*	55.911	0,21	<b>Wert der Anlagen, insgesamt</b>				<b>24.505.010</b>	<b>91,92</b>	
	47.654	Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities Portfolio XU*	539.327	2,02	<b>(Gesamtkosten: EUR 22.985.584)</b>						
	264.643	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond 8E*	2.861.130	10,73	<i>*Siehe Erläuterung 18.</i>						
	145.143	Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond 4E*	1.554.028	5,83	<i>**Fonds der verbundenen Partei.</i>						
	23.798	Threadneedle (Lux) - European Short Term High Yield Bond XE*	2.399.944	9,00							

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return

### Portfolioaufstellung

zum 30. September 2020

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts				
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>							
<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente</b>				<b>Aktien (Fortsetzung)</b>							
<b>VEREINIGTE STAATEN</b>				<b>HONGKONG</b>							
USD	530.000	United States Treasury Inflation Indexed N/B 0.13% 15/04/2022	574.888	1,01	46.000	AIA Group Limited	450.502	0,78			
USD	471.800	United States Treasury Inflation Indexed N/B 2.55% 15/02/2040	868.153	1,52	<b>Hongkong, insgesamt</b>			<b>450.502</b>	<b>0,78</b>		
<b>Vereinigte Staaten, insgesamt</b>			<b>1.443.041</b>	<b>2,53</b>	<b>INDIEN</b>						
<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente, insgesamt</b>				<b>1.443.041</b>	<b>2,53</b>	11.592	HDFC Bank Limited - ADR	579.136	1,02		
<b>Aktien</b>				<b>Indien, insgesamt</b>					<b>579.136</b>	<b>1,02</b>	
<b>KAIMANINSELN</b>				<b>INDONESIEN</b>							
2.577	Alibaba Group Holding Limited	757.586	1,33	1.022.100	Bank Rakyat Indonesia	208.803	0,37				
8.300	Tencent Holdings Limited	547.799	0,96	<b>Indonesien, insgesamt</b>					<b>208.803</b>	<b>0,37</b>	
<b>Kaimaninseln, insgesamt</b>			<b>1.305.385</b>	<b>2,29</b>	<b>IRLAND</b>						
<b>CHINA</b>				1.534	Aon plc	316.464	0,56				
41.000	Ping An Insurance Group Company of China Limited	420.580	0,74	11.872	CRH plc	429.763	0,75				
<b>China, insgesamt</b>			<b>420.580</b>	<b>0,74</b>	4.391	Medtronic Inc.	456.313	0,80			
<b>DÄNEMARK</b>				4.307	Trane Technologies plc	522.224	0,92				
8.925	Novo Nordisk A/S	617.730	1,08	<b>Irland, insgesamt</b>					<b>1.724.764</b>	<b>3,03</b>	
2.685	Orsted A/S	370.280	0,65	<b>JAPAN</b>							
<b>Dänemark, insgesamt</b>			<b>988.010</b>	<b>1,73</b>	1.100	Keyence Corp.	510.547	0,90			
<b>FINNLAND</b>				700	Nintendo Company Limited	395.736	0,69				
11.976	UPM-Kymmene Oyj	364.995	0,64	4.900	Rohm Company Limited	376.102	0,66				
<b>Finnland, insgesamt</b>			<b>364.995</b>	<b>0,64</b>	5.500	Sony Corp.	418.611	0,73			
<b>FRANKREICH</b>				<b>NIEDERLANDE</b>							
2.439	Essilor International SA	332.200	0,58	1.920	Airbus SE	139.750	0,25				
1.391	Pernod-Ricard SA	222.082	0,39	<b>Niederlande, insgesamt</b>					<b>139.750</b>	<b>0,25</b>	
3.869	Schneider Electric SE	481.147	0,84	<b>SÜDKOREA</b>							
<b>Frankreich, insgesamt</b>			<b>1.035.429</b>	<b>1,81</b>	15.955	Samsung Electronics Company Limited	794.002	1,39			
<b>DEUTSCHLAND</b>				<b>SCHWEIZ</b>							
1.851	Adidas AG	599.296	1,05	4.635	TE Connectivity Limited	453.025	0,79				
<b>Deutschland, insgesamt</b>			<b>599.296</b>	<b>1,05</b>	<b>Schweiz, insgesamt</b>					<b>453.025</b>	<b>0,79</b>
<b>TAIWAN</b>				31.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	463.469	0,81				
<b>Taiwan, insgesamt</b>			<b>463.469</b>	<b>0,81</b>							

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return

### Portfolioaufstellung

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts	
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				
<b>Aktien (Fortsetzung)</b>				<b>Strukturierte Instrumente – Rohstoffe</b>				
<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH</b>				<b>IRLAND</b>				
8.189	Diageo plc	280.549	0,49	1.691	Invesco Physical Gold ETC	311.448	0,55	
7.031	Reckitt Benckiser Group plc	687.180	1,21		<b>Irland, insgesamt</b>	<b>311.448</b>	<b>0,55</b>	
6.640	Unilever plc	409.981	0,72		<b>Strukturierte Instrumente - Rohstoffe, insgesamt</b>	<b>311.448</b>	<b>0,55</b>	
	<b>Vereinigtes Königreich, insgesamt</b>	<b>1.377.710</b>	<b>2,42</b>		<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt</b>	<b>35.498.404</b>	<b>62,28</b>	
<b>VEREINIGTE STAATEN</b>				<b>Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere</b>				
3.302	Abbott Laboratories	359.357	0,63		<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente</b>			
7.128	Activision Blizzard Inc.	577.012	1,01		<b>VEREINIGTE STAATEN</b>			
1.249	Adobe Systems Inc.	612.547	1,07	USD	3.000.000	United States Treasury Bill 0.00% 06/10/2020	2.999.972	5,27
956	Alphabet Inc. - A	1.401.114	2,46	USD	2.800.000	United States Treasury Bill 0.00% 27/10/2020	2.799.846	4,91
110	Alphabet Inc. - C	161.656	0,28		<b>Vereinigte Staaten, insgesamt</b>	<b>5.799.818</b>	<b>10,18</b>	
560	Amazon.com Inc.	1.763.288	3,10		<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente, insgesamt</b>	<b>5.799.818</b>	<b>10,18</b>	
4.850	Baxter International Inc.	390.037	0,68		<b>Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere, insgesamt</b>	<b>5.799.818</b>	<b>10,18</b>	
8.315	Boston Scientific Corp.	317.716	0,56		<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren</b>			
9.985	Centene Corp.	582.425	1,02		<b>Fonds</b>			
1.538	CME Group Inc.	257.323	0,45		<b>LUXEMBURG</b>			
16.436	Comcast Corp.	760.329	1,33	4.539	Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities XU*	60.238	0,11	
977	Cooper Companies Inc.	329.366	0,58	13.253	Threadneedle (Lux) - European Short Term High Yield Bond XE*	1.567.264	2,75	
2.200	Danaher Corp.	473.725	0,84	105.452	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds AU*	1.154.372	2,03	
2.329	Ecolab Inc.	465.427	0,82	191.099	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities IUH*	2.019.128	3,54	
3.994	Electronic Arts Inc.	520.858	0,91		<b>Luxemburg, insgesamt</b>	<b>4.801.002</b>	<b>8,43</b>	
755	Equinix Inc.	573.898	1,01					
3.271	Facebook Inc. - A	856.675	1,50					
4.739	Fidelity National Information Services Inc.	697.628	1,23					
1.696	Illumina Inc.	524.200	0,92					
1.085	Intuit Inc.	353.938	0,62					
4.936	JPMorgan Chase & Company	475.189	0,83					
1.304	Lam Research Corp.	432.602	0,76					
2.530	Mastercard Inc. - A	855.570	1,50					
8.162	Microsoft Corp.	1.716.712	3,02					
1.786	NextEra Energy Inc.	495.722	0,87					
1.509	Nvidia Corp.	816.701	1,44					
1.061	S&P Global Inc.	382.597	0,67					
8.856	Service Corp. International	373.546	0,66					
1.950	Stryker Corp.	406.322	0,71					
4.594	T-Mobile USA Inc.	525.370	0,92					
3.298	Transunion	277.461	0,49					
5.218	Uber Technologies Inc.	190.353	0,33					
1.863	Union Pacific Corp.	366.769	0,64					
1.534	United Health Group Inc.	478.255	0,84					
1.201	Vertex Pharmaceuticals Inc.	326.816	0,57					
3.643	Visa Inc. - A	728.490	1,28					
2.507	Walt Disney Company	311.069	0,55					
	<b>Vereinigte Staaten, insgesamt</b>	<b>21.138.063</b>	<b>37,10</b>					
<b>Aktien, insgesamt</b>		<b>33.743.915</b>	<b>59,20</b>					

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return

### Portfolioaufstellung

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts
<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren (Fortsetzung)</b>			
<b>Fonds (Fortsetzung)</b>			
<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH</b>			
268.250	Threadneedle Specialist Investment Funds ICVC - Emerging Market Local Fund**	782.272	1,37
	<b>Vereinigtes Königreich, insgesamt</b>	<b>782.272</b>	<b>1,37</b>
	<b>Fonds, insgesamt</b>	<b>5.583.274</b>	<b>9,80</b>
	<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren, insgesamt</b>	<b>5.583.274</b>	<b>9,80</b>
	<b>Wert der Anlagen, insgesamt</b>	<b>46.881.496</b>	<b>82,26</b>
<b>(Gesamtkosten: USD 35.711.671)</b>			

\*Siehe Erläuterung 18.

\*\*Fonds der verbundenen Partei.



## Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

### Portfolioaufstellung

zum 30. September 2020

	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts		Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung</b>					<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				
<b>Anleihen</b>					<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				
<b>AUSTRALIEN</b>					<b>FINNLAND</b>				
EUR	100.000	APT Pipelines Limited 2.00% 15/07/2030	127.254	0,07	EUR	189.000	Nokia Oyj 2.00% 11/03/2026	226.782	0,12
EUR	100.000	Aurizon Network Pty Limited 3.13% 01/06/2026	131.947	0,07	EUR	100.000	Nordea Bank Abp 0.50% 14/05/2027	120.875	0,06
USD	77.000	Ausgrid Finance Pty Limited 4.35% 01/08/2028	88.477	0,05	<b>Finnland, insgesamt</b>				
EUR	100.000	AusNet Services Holdings Pty Limited 1.50% 26/02/2027	127.427	0,07	<b>FRANKREICH</b>				
EUR	100.000	Goodman Australia 1.38% 27/09/2025	121.037	0,06	EUR	100.000	Altice France SA 2.50% 15/01/2025	112.112	0,06
<b>Australien, insgesamt</b>				<b>0,32</b>	EUR	100.000	Altice France SA 4.13% 15/01/2029	117.116	0,06
<b>BELGIEN</b>					EUR	386.000	Altice France SA 5.88% 01/02/2027	479.819	0,24
EUR	139.000	House of Finance NV 4.38% 15/07/2026	150.121	0,08	EUR	100.000	Auchan Holding SA 3.25% 23/07/2027	125.664	0,06
EUR	100.000	Solvay SA Perp FRN	115.617	0,06	EUR	100.000	Banijay Entertainment Sasu 3.50% 01/03/2025	115.061	0,06
EUR	300.000	Solvay SA Perp FRN	370.921	0,19	EUR	178.000	Banijay Group Sas 6.50% 01/03/2026	202.838	0,10
<b>Belgien, insgesamt</b>				<b>0,33</b>	EUR	500.000	Casino Guichard Perrachon SA 4.56% 25/01/2023	544.434	0,28
<b>BERMUDAS</b>					EUR	300.000	Casino Guichard-Perrachon SA 4.50% 07/03/2024	283.364	0,15
USD	100.000	Bacardi Limited 5.30% 15/05/2048	125.890	0,07	EUR	140.000	CMA CGM SA 6.50% 15/07/2022	162.811	0,09
<b>Bermudas, insgesamt</b>				<b>0,07</b>	EUR	100.000	Crown European Holdings SA 2.25% 01/02/2023	118.705	0,06
<b>KANADA</b>					EUR	100.000	Crown European Holdings SA 2.63% 30/09/2024	120.301	0,06
USD	75.000	Canadian Natural Resources Limited 2.95% 15/07/2030	75.665	0,04	EUR	100.000	Crown European Holdings SA 2.88% 01/02/2026	122.112	0,06
<b>Kanada, insgesamt</b>				<b>0,04</b>	EUR	100.000	Crown European Holdings SA 3.38% 15/05/2025	124.271	0,06
<b>KAIMANINSELN</b>					EUR	200.000	Electricite de France SA Perp FRN	231.012	0,12
GBP	100.000	Southern Water Services Finance Limited 3.00% 28/05/2037	137.202	0,07	EUR	200.000	Electricite de France SA Perp FRN	230.719	0,12
USD	200.000	Tencent Holdings Limited 3.60% 19/01/2028	220.249	0,11	EUR	300.000	Electricite de France SA Perp FRN	384.705	0,20
EUR	110.000	UPCB Finance VII Limited 3.63% 15/06/2029	129.398	0,07	EUR	300.000	Electricite de France SA Perp FRN	389.088	0,20
<b>Kaimaninseln, insgesamt</b>				<b>0,25</b>	GBP	200.000	Electricite de France SA Perp FRN	278.318	0,14
<b>DÄNEMARK</b>					EUR	300.000	Elis SA 1.00% 03/04/2025	328.181	0,17
EUR	100.000	Danske Bank A/S 0.63% 26/05/2025	119.798	0,06	EUR	200.000	Elis SA 1.75% 11/04/2024	231.216	0,12
<b>Dänemark, insgesamt</b>				<b>0,06</b>	EUR	100.000	Elis SA 2.88% 15/02/2026	119.043	0,06
					EUR	130.000	Europcar Mobility Group 4.00% 30/04/2026	65.892	0,03
					EUR	100.000	Faurecia SE 2.38% 15/06/2027	110.940	0,06
					EUR	130.000	Faurecia SE 2.63% 15/06/2025	150.570	0,08

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

### Portfolioaufstellung

(Fortsetzung)

	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts		Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>					<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>					<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				
<b>FRANKREICH (Fortsetzung)</b>					<b>DEUTSCHLAND (Fortsetzung)</b>				
EUR	144.000	Faurecia SE 3.13% 15/06/2026	168.254	0,09	EUR	79.000	Commerzbank AG 0.50% 04/12/2026	93.388	0,05
EUR	100.000	Faurecia SE 3.75% 15/06/2028	116.915	0,06	EUR	75.000	Commerzbank AG 1.00% 04/03/2026	90.928	0,05
EUR	100.000	Holding d'Infrastructures de Transport SASU 1.63% 18/09/2029	117.938	0,06	EUR	126.000	Consus Real Estate AG 9.63% 15/05/2024	158.335	0,08
EUR	100.000	Kapla Holding SAS 3.38% 15/12/2026	109.375	0,06	EUR	100.000	Demire Deutsche Mittelstand Real Estate AG 1.88% 15/10/2024	108.487	0,06
EUR	164.000	La Financiere Atalian SASU 4.00% 15/05/2024	163.342	0,08	EUR	76.000	Deutsche Bank AG FRN 10/06/2026	93.033	0,05
EUR	90.000	La Financiere Atalian SASU 5.13% 15/05/2025	89.935	0,05	EUR	100.000	Eurogrid GmbH 1.11% 15/05/2032	125.627	0,06
EUR	100.000	Louvre Bidco SAS 4.25% 30/09/2024	112.085	0,06	EUR	210.000	HT Troplast GmbH 9.25% 15/07/2025	262.712	0,14
EUR	160.000	Louvre Bidco SAS FRN 30/09/2024	185.748	0,10	EUR	165.000	IHO Verwaltungs GmbH 3.63% 15/05/2025	194.580	0,10
EUR	100.000	Louvre Bidco SAS 6.50% 30/09/2024	117.030	0,06	EUR	100.000	K+S AG 3.00% 20/06/2022	115.181	0,06
EUR	100.000	Loxam Sas 5.75% 15/07/2027	106.064	0,05	EUR	20.000	K+S AG 4.13% 06/12/2021	23.627	0,01
EUR	182.000	Loxam SAS 3.25% 14/01/2025	203.637	0,11	EUR	109.000	Kirk Beauty One GmbH 8.75% 15/07/2023	85.570	0,04
EUR	112.000	Loxam SAS 3.75% 15/07/2026	125.959	0,07	EUR	222.000	Lanxess AG FRN 06/12/2076	275.978	0,14
EUR	146.000	Orange SA Perp FRN	202.692	0,10	EUR	150.000	Platin 1426 GmbH 5.38% 15/06/2023	166.640	0,09
EUR	200.000	Orano SA 3.38% 23/04/2026	242.561	0,13	EUR	260.000	Progroup AG 3.00% 31/03/2026	303.292	0,16
EUR	160.000	Paprec Holding SA 4.00% 31/03/2025	180.245	0,09	EUR	105.000	Safari Holding 5.38% 30/11/2022	113.470	0,06
EUR	163.000	Parts Europe SA 6.50% 16/07/2025	193.338	0,10	EUR	129.000	SGL Carbon SE 4.63% 30/09/2024	131.412	0,07
EUR	160.000	Rexel SA 2.13% 15/06/2025	183.738	0,09	EUR	129.000	Techem Verwaltungsgesellschaft 674 2.00% 15/07/2025	144.860	0,07
EUR	100.000	RTE Reseau de Transport d'Electricite SADR 1.13% 08/07/2040	123.280	0,06	EUR	158.000	Techem Verwaltungsgesellschaft 674 mbH 6.00% 30/07/2026	189.546	0,10
EUR	100.000	SPCM SA 2.00% 01/02/2026	117.155	0,06	EUR	158.000	Thyssenkrupp AG 1.38% 03/03/2022	181.297	0,09
EUR	100.000	SPCM SA 2.63% 01/02/2029	116.788	0,06	EUR	168.000	Thyssenkrupp AG 1.88% 06/03/2023	185.052	0,10
EUR	100.000	Spie SA 3.13% 22/03/2024	119.501	0,06	EUR	192.000	Vertical MidCo GmbH 4.38% 15/07/2027	229.892	0,11
USD	38.000	Total Capital International 2.99% 29/06/2041	39.585	0,02	EUR	19.000	Volkswagen Financial Services AG 3.38% 06/04/2028	25.916	0,01
EUR	200.000	Valeo SA 1.63% 18/03/2026	230.388	0,12	EUR	100.000	Volkswagen Leasing GmbH 1.63% 15/08/2025	121.983	0,06
EUR	345.000	Vallourec SA 6.63% 15/10/2022	233.461	0,12	EUR	187.000	Wepa Hygieneprodukte GmbH 2.88% 15/12/2027	215.959	0,10
		<b>Frankreich, insgesamt</b>	<b>8.747.306</b>	<b>4,50</b>	EUR	200.000	ZF Finance GmbH 3.00% 21/09/2025	228.629	0,11
					EUR	200.000	ZF Finance GmbH 3.75% 21/09/2028	227.549	0,12
							<b>Deutschland, insgesamt</b>	<b>4.822.288</b>	<b>2,47</b>
		<b>DEUTSCHLAND</b>							
EUR	100.000	Adler Real Estate AG 1.88% 27/04/2023	113.486	0,06					
EUR	107.000	Adler Real Estate AG 2.13% 06/02/2024	120.709	0,06					
EUR	100.000	Adler Real Estate AG 3.00% 27/04/2026	115.466	0,06					
EUR	100.000	Bayer AG 1.13% 06/01/2030	119.215	0,06					
EUR	230.000	Cheplapharm Arzneimittel GmbH 3.50% 11/02/2027	260.469	0,14					

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

### Portfolioaufstellung

(Fortsetzung)

Nennwert		Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts	Nennwert		Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>					<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>					<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				
<b>IRLAND</b>					<b>ITALIEN (Fortsetzung)</b>				
EUR	100.000	AIB Group plc FRN 19/11/2029	113.531	0,06	EUR	218.000	Infrastrutture Wireless Italiane SpA 1.88% 08/07/2026	259.103	0,13
EUR	234.000	Eircom Finance DAC 2.63% 15/02/2027	264.039	0,14	EUR	174.000	International Design Group SPA 6.50% 15/11/2025	193.897	0,10
EUR	376.000	Eircom Finance DAC 3.50% 15/05/2026	440.861	0,22	EUR	107.000	Leonardo SpA 2.38% 08/01/2026	124.530	0,06
EUR	100.000	Europcar Mobility Group 4.13% 15/11/2024	50.984	0,03	EUR	171.000	Nexi SpA 1.75% 31/10/2024	198.245	0,10
EUR	122.000	James Hardie International Finance DAC 3.63% 01/10/2026	145.838	0,08	EUR	165.000	Rossini Sarl 6.75% 30/10/2025	204.167	0,11
EUR	168.000	Smurfit Kappa Acquisitions 2.38% 01/02/2024	204.850	0,11	EUR	150.000	Telecom Italia SpA 2.50% 19/07/2023	180.771	0,09
EUR	104.000	Smurfit Kappa Acquisitions ULC 2.88% 15/01/2026	130.370	0,07	EUR	220.000	Telecom Italia SpA 2.75% 15/04/2025	266.464	0,14
EUR	91.000	Smurfit Kappa Treasury ULC 1.50% 15/09/2027	105.943	0,05	EUR	150.000	Telecom Italia SpA 3.63% 25/05/2026	188.974	0,10
GBP	285.000	Virgin Media Vendor Financing Notes III DAC 4.88% 15/07/2028	372.648	0,20	EUR	261.000	Telecom Italia SpA 4.00% 11/04/2024	325.576	0,17
		<b>Irland, insgesamt</b>	<b>1.829.064</b>	<b>0,96</b>	EUR	150.000	Telecom Italia SpA 5.25% 10/02/2022	187.088	0,10
							<b>Italien, insgesamt</b>	<b>4.294.872</b>	<b>2,21</b>
<b>ISLE OF MAN</b>					<b>JAPAN</b>				
EUR	95.000	Playtech plc 3.75% 12/10/2023	111.451	0,06	USD	200.000	Japan Finance Organisation for Municipalities 0.63% 02/09/2025	199.460	0,10
EUR	142.000	Playtech plc 4.25% 07/03/2026	167.850	0,10	EUR	388.000	SoftBank Group Corp 5.00% 15/04/2028	484.007	0,24
		<b>Isle of Man, insgesamt</b>	<b>279.301</b>	<b>0,16</b>			<b>Japan, insgesamt</b>	<b>683.467</b>	<b>0,34</b>
<b>ITALIEN</b>					<b>JERSEY – KANALINSELN</b>				
EUR	116.000	Atlantia SpA 1.63% 03/02/2025	129.671	0,07	EUR	100.000	Adient Global Holdings Limited 3.50% 15/08/2024	108.335	0,06
EUR	113.000	Atlantia SpA 1.88% 13/07/2027	124.657	0,06	EUR	175.000	Avis Budget Finance plc 4.50% 15/05/2025	176.707	0,09
EUR	92.000	Autostrade per l'Italia SpA 1.63% 12/06/2023	105.166	0,05	EUR	154.000	Avis Budget Finance plc 4.75% 30/01/2026	154.927	0,08
EUR	81.000	Autostrade per l'Italia SpA 1.63% 12/06/2023	92.591	0,05	GBP	100.000	CPUK Finance Limited 6.50% 28/08/2026	127.519	0,07
EUR	200.000	Autostrade per l'Italia SpA 1.88% 04/11/2025	226.162	0,12	EUR	410.000	Lhc3 plc 4.13% 15/08/2024	482.590	0,25
EUR	199.000	Autostrade per l'Italia SpA 4.38% 16/09/2025	254.372	0,12			<b>Jersey – Kanalinseln, insgesamt</b>	<b>1.050.078</b>	<b>0,55</b>
EUR	100.000	Autostrade per l'Italia SpA 5.88% 09/06/2024	131.040	0,07	<b>LUXEMBURG</b>				
GBP	64.000	Autostrade per l'Italia SpA 6.25% 09/06/2022	87.462	0,05	EUR	100.000	ADO Properties SA 3.25% 05/08/2025	118.625	0,06
EUR	227.000	Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 2.63% 28/04/2025	264.411	0,14	EUR	130.000	Altice Financing SA 2.25% 15/01/2025	146.196	0,08
EUR	140.000	Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 3.63% 24/09/2024	169.332	0,09	EUR	234.000	Altice Financing SA 3.00% 15/01/2028	255.509	0,12
EUR	100.000	Banco BPM SpA 1.75% 24/04/2023	118.730	0,06	EUR	237.000	Altice Finco SA 4.75% 15/01/2028	252.669	0,12
EUR	100.000	Enel SpA FRN 24/05/2080	124.623	0,06					
EUR	79.000	Enel SpA FRN 10/01/2074	103.732	0,05					
EUR	100.000	Enel SpA Perp FRN	117.322	0,06					
EUR	100.000	FCA Bank SpA 0.50% 13/09/2024	116.786	0,06					

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

### Portfolioaufstellung

(Fortsetzung)

	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts		Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts	
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>					<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>					
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>					<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>					
<b>LUXEMBURG (Fortsetzung)</b>					<b>LUXEMBURG (Fortsetzung)</b>					
EUR	70.000	Altice France Holding SA 4.00% 15/02/2028	75.002	0,04	EUR	100.000	Novartis Finance SA 0.00% 23/09/2028	117.162	0,06	
EUR	120.000	Aramark International Finance 3.13% 01/04/2025	134.992	0,07	EUR	100.000	PLT VII Finance Sarl 4.63% 05/01/2026	119.469	0,06	
EUR	257.000	ArcelorMittal SA 2.25% 17/01/2024	306.671	0,15	EUR	287.000	Sig Combibloc Purchaseco Sarl 2.13% 18/06/2025	346.428	0,18	
EUR	198.000	ARD Finance SA 5.00% 30/06/2027	228.017	0,12	EUR	100.000	Telecom Italia Finance SA 7.75% 24/01/2033	169.438	0,09	
EUR	137.000	Ardagh Packaging Finance plc 2.13% 15/08/2026	156.379	0,08	EUR	200.000	Telenet Finance Luxembourg Notes Sarl 3.50% 01/03/2028	242.605	0,13	
GBP	120.000	Aroundtown SA 3.00% 16/10/2029	159.614	0,08	<b>Luxemburg, insgesamt</b>				<b>5.955.778</b>	<b>3,03</b>
GBP	240.000	B&M European Value Retail SA 3.63% 15/07/2025	316.568	0,16	<b>MEXIKO</b>					
EUR	100.000	Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1.21% 04/06/2026	120.513	0,06	EUR	100.000	Cemex SAB de CV 2.75% 05/12/2024	116.671	0,06	
EUR	121.000	Cirsa Finance International Sarl 4.75% 22/05/2025	123.896	0,06	USD	200.000	Cemex SAB De CV 7.75% 16/04/2026	210.708	0,11	
EUR	112.000	Cirsa Finance International Sarl 6.25% 20/12/2023	120.241	0,06	EUR	349.000	Petroleos Mexicanos 2.75% 21/04/2027	327.297	0,17	
EUR	125.000	Codere Finance 2 Luxembourg SA 6.75% 01/11/2021	82.910	0,04	EUR	349.000	Petroleos Mexicanos 4.75% 26/02/2029	351.979	0,19	
EUR	196.000	CPI Property Group SA Perp FRN	227.239	0,12	EUR	240.000	Petroleos Mexicanos 4.88% 21/02/2028	247.448	0,13	
EUR	134.000	Crystal Almond Sarl 4.25% 15/10/2024	154.894	0,08	USD	300.000	Petroleos Mexicanos 5.35% 12/02/2028	258.849	0,13	
EUR	161.000	Garfunkelux Holdco 3 SA 7.50% 01/08/2022	175.739	0,09	USD	50.000	Petroleos Mexicanos 6.88% 04/08/2026	48.151	0,02	
GBP	163.000	Garfunkelux Holdco 3 SA 8.50% 01/11/2022	194.740	0,10	<b>Mexiko, insgesamt</b>				<b>1.561.103</b>	<b>0,81</b>
EUR	105.000	Gestamp Fund Lux 3.50% 15/05/2023	118.407	0,06	<b>NIEDERLANDE</b>					
EUR	100.000	Grand City Properties SA 1.50% 17/04/2025	122.880	0,06	EUR	100.000	ABN Amro Bank NV 1.25% 28/05/2025	122.483	0,06	
EUR	108.000	Groupe Ecore Holding SAS FRN 15/11/2023	90.976	0,05	EUR	164.000	Ashland Services BV 2.00% 30/01/2028	183.707	0,09	
EUR	150.000	Hanesbrands Inc. 3.50% 15/06/2024	183.323	0,09	EUR	100.000	Constellium SE 4.25% 15/02/2026	117.201	0,06	
EUR	123.000	Holcim Finance Luxembourg SA Perp FRN	147.737	0,08	EUR	100.000	Cooperatieve Rabobank UA FRN 05/05/2028	121.981	0,06	
EUR	100.000	Ineos Group Holdings SA 5.38% 01/08/2024	117.430	0,06	EUR	301.000	Darling Global Finance BV 3.63% 15/05/2026	360.403	0,20	
EUR	298.000	Lincoln Financing SARL 3.63% 01/04/2024	336.809	0,17	EUR	160.000	Diebold Nixdorf Dutch Holding BV 9.00% 15/07/2025	193.824	0,10	
EUR	125.000	Matterhorn Telecom SA 3.13% 15/09/2026	140.325	0,07	EUR	157.000	Dufry One BV 2.50% 15/10/2024	159.989	0,08	
EUR	100.000	Medtronic Global Holdings SCA 1.38% 15/10/2040	120.162	0,06	EUR	118.000	Fiat Chrysler Automobiles NV 3.88% 05/01/2026	149.833	0,08	
EUR	200.000	Motion Finco Sarl 7.00% 15/05/2025	232.213	0,12	EUR	274.000	Fiat Chrysler Automobiles NV 3.88% 05/01/2026	347.916	0,17	
					EUR	100.000	Fiat Chrysler Automobiles NV 4.50% 07/07/2028	133.784	0,07	

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

### Portfolioaufstellung

(Fortsetzung)

	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts		Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts	
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>					<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>					
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>					<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>					
<b>NIEDERLANDE (Fortsetzung)</b>					<b>NIEDERLANDE (Fortsetzung)</b>					
EUR	100.000	Fiat Chrysler Automobiles NV 4.50% 07/07/2028	133.784	0,07	EUR	209.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 1.25% 31/03/2023	227.344	0,12	
EUR	100.000	Heineken NV 1.25% 07/05/2033	121.563	0,06	EUR	100.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 1.63% 15/10/2028	93.015	0,05	
GBP	108.000	Innogy Finance BV 6.25% 03/06/2030	197.307	0,10	EUR	187.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 3.25% 15/04/2022	219.258	0,11	
EUR	328.000	Intertrust Group BV 3.38% 15/11/2025	393.295	0,20	EUR	100.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 4.50% 01/03/2025	114.262	0,06	
EUR	100.000	Koninklijke KPN NV Perp FRN	115.231	0,06	EUR	177.000	Trivium Packaging Finance BV 3.75% 15/08/2026	205.363	0,11	
EUR	300.000	LKQ Euro Holdings 3.63% 01/04/2026	356.205	0,18	EUR	190.000	United Group BV 3.13% 15/02/2026	210.631	0,11	
EUR	100.000	NE Property BV 1.88% 09/10/2026	108.758	0,06	EUR	180.000	United Group BV 3.63% 15/02/2028	199.149	0,10	
EUR	50.000	Petrobras Global Finance BV 4.75% 14/01/2025	65.308	0,03	EUR	100.000	UPC Holding BV 3.88% 15/06/2029	114.114	0,06	
EUR	100.000	Phoenix Pharmahandel 2.38% 05/08/2025	118.379	0,06	EUR	100.000	Vonovia Finance BV 1.00% 09/07/2030	119.559	0,06	
EUR	170.000	PPF Telecom Group BV 2.13% 31/01/2025	195.060	0,10	EUR	116.000	VZ Vendor Financing BV 2.50% 31/01/2024	134.016	0,07	
EUR	167.000	PPF Telecom Group BV 3.25% 29/09/2027	195.068	0,10	EUR	110.000	Ziggo BV 2.88% 15/01/2030	126.407	0,07	
EUR	100.000	PPF Telecom Group BV 3.50% 20/05/2024	120.634	0,06	EUR	91.800	Ziggo BV 4.25% 15/01/2027	112.138	0,06	
EUR	148.000	Q-Park Holding I BV 1.50% 01/03/2025	158.979	0,08	<b>Niederlande, insgesamt</b>				<b>10.055.137</b>	<b>5,18</b>
EUR	190.000	Q-Park Holding I BV 2.00% 01/03/2027	200.014	0,10	<b>NORWEGEN</b>					
EUR	100.000	Relx Finance BV 0.50% 10/03/2028	117.792	0,06	EUR	100.000	Dnb Bank ASA 0.05% 14/11/2023	117.950	0,06	
EUR	174.000	Repsol International Finance BV FRN 25/03/2075	214.983	0,11	USD	244.000	Kommunalbanken AS 0.38% 11/09/2025	242.761	0,13	
EUR	186.000	Saipem Finance International BV 3.38% 15/07/2026	212.683	0,11	<b>Norwegen, insgesamt</b>				<b>360.711</b>	<b>0,19</b>
EUR	289.000	Schaeffler Finance BV 3.25% 15/05/2025	339.614	0,18	<b>PORTUGAL</b>					
EUR	131.619	Summer BidCo BV 9.00% 15/11/2025	155.699	0,08	EUR	100.000	Edp - Energias de Portugal SA FRN 30/04/2079	126.887	0,07	
EUR	118.083	Summer BidCo BV 9.75% 15/11/2025	139.687	0,07	<b>Portugal, insgesamt</b>				<b>126.887</b>	<b>0,07</b>
EUR	100.000	Syngenta Finance NV 3.38% 16/04/2026	126.196	0,07	<b>RUMÄNIEN</b>					
EUR	100.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	117.189	0,06	EUR	200.000	RCS & RDS SA 3.25% 05/02/2028	224.603	0,12	
EUR	300.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	358.340	0,18	<b>Rumänien, insgesamt</b>				<b>224.603</b>	<b>0,12</b>
EUR	100.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	120.158	0,06	<b>SPANIEN</b>					
EUR	700.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	867.568	0,44	EUR	100.000	CaixaBank SA 0.38% 03/02/2025	117.425	0,06	
EUR	100.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	129.298	0,07	EUR	200.000	Cellnex Telecom SA 1.88% 26/06/2029	239.782	0,12	
EUR	387.000	TenneT Holding BV Perp FRN	460.555	0,25						
EUR	237.000	TenneT Holding BV Perp FRN	289.675	0,15						
EUR	157.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 1.13% 15/10/2024	159.738	0,08						

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.



## Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

### Portfolioaufstellung

(Fortsetzung)

Nennwert		Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts	Nennwert		Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>					<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>					<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				
<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH (Fortsetzung)</b>					<b>VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)</b>				
EUR	200.000	Natwest Group plc FRN 02/03/2026	242.690	0,13	EUR	100.000	American Tower Corp. 1.00% 15/01/2032	117.012	0,06
USD	240.000	Natwest Group plc 8.63% 30/09/2166	246.994	0,13	USD	35.000	Amgen Inc. 3.15% 21/02/2040	37.307	0,02
GBP	214.000	Pinnacle Bidco plc 6.38% 15/02/2025	244.293	0,13	USD	148.000	Anheuser-Busch Companies LLC 4.70% 01/02/2036	177.923	0,09
GBP	15.000	Santander UK plc Perp 10.06%	31.286	0,02	USD	50.000	Anheuser-Busch Inbev Worldwide Inc. 4.35% 01/06/2040	58.521	0,03
EUR	200.000	Synlab Unsecured Bondco plc 8.25% 01/07/2023	241.316	0,13	USD	53.000	Anheuser-Busch Inbev Worldwide Inc. 5.45% 23/01/2039	68.725	0,04
EUR	231.000	Synthomer plc 3.88% 01/07/2025	276.837	0,14	USD	121.000	Apple Inc. 2.65% 11/05/2050	125.956	0,07
GBP	166.000	Talktalk Telecom Group plc 3.88% 20/02/2025	208.046	0,11	USD	16.000	Apple Inc. 4.50% 23/02/2036	21.414	0,01
GBP	96.254	Tesco Property Finance 3 plc 5.74% 13/04/2040	165.717	0,10	USD	34.000	Arizona Public Service Company 3.35% 15/05/2050	37.479	0,02
GBP	100.000	Travis Perkins 4.50% 07/09/2023	130.668	0,07	USD	54.000	AT&T Inc. 2.30% 01/06/2027	56.693	0,03
GBP	187.000	Very Group Funding plc 7.75% 15/11/2022	231.790	0,12	USD	31.000	AT&T Inc. 3.10% 01/02/2043	30.326	0,02
EUR	150.000	Victoria plc 5.25% 15/07/2024	175.803	0,08	USD	15.000	AT&T Inc. 3.50% 01/06/2041	15.790	0,01
GBP	181.000	Virgin Media Secured Finance plc 5.25% 15/05/2029	247.866	0,13	USD	96.000	AT&T Inc. 4.90% 15/08/2037	116.206	0,06
EUR	222.000	Vmed O2 UK Financing I plc 3.25% 31/01/2031	259.452	0,13	EUR	285.000	Avantor Inc. 4.75% 01/10/2024	346.295	0,18
GBP	110.000	Vmed O2 UK Financing I plc 4.00% 31/01/2029	141.636	0,07	EUR	117.000	Ball Corp. 0.88% 15/03/2024	135.191	0,07
EUR	214.000	Vodafone Group plc FRN 27/08/2080	250.157	0,13	EUR	100.000	Ball Corp. 1.50% 15/03/2027	114.472	0,06
EUR	100.000	Vodafone Group plc FRN 27/08/2080	114.724	0,06	USD	53.000	Bank of America Corp. FRN 13/02/2031	55.533	0,03
EUR	254.000	Vodafone Group plc FRN 03/01/2079	303.978	0,16	USD	136.000	Bank of America Corp. FRN 29/04/2031	143.865	0,07
GBP	155.000	Vodafone Group plc FRN 03/10/2078	212.828	0,11	USD	82.000	Bank of America Corp. FRN 23/07/2030	90.695	0,05
USD	231.000	Vodafone Group plc FRN 03/10/2078	250.384	0,13	USD	137.000	BAT Capital Corp. 4.70% 02/04/2027	157.265	0,08
USD	159.000	Vodafone Group plc FRN 04/04/2079	189.059	0,10	EUR	100.000	Becton Dickinson & Company 1.90% 15/12/2026	124.934	0,07
GBP	200.000	William Hill plc 4.75% 01/05/2026	273.014	0,14	USD	56.000	Berkshire Hathaway Finance Corp 4.25% 15/01/2049	72.723	0,03
		<b>Vereinigtes Königreich, insgesamt</b>	<b>10.409.247</b>	<b>5,41</b>	EUR	191.000	Berry Global Inc. 1.00% 15/01/2025	216.012	0,11
					EUR	114.000	Berry Global Inc. 1.50% 15/01/2027	129.414	0,07
					USD	20.000	Boeing Company 3.95% 01/08/2059	18.624	0,01
					USD	30.000	Boeing Company 5.93% 01/05/2060	37.118	0,02
					USD	48.000	Broadcom Cayman Finance 3.50% 15/01/2028	52.054	0,03
<b>VEREINIGTE STAATEN</b>					USD	28.000	Broadcom Inc. 4.15% 15/11/2030	31.377	0,02
USD	32.000	AbbVie Inc. 4.88% 14/11/2048	40.654	0,02	USD	20.000	Burlington Northern Santa Fe LLC 4.38% 01/09/2042	25.250	0,01
USD	48.000	Amazon.com Inc. 2.70% 03/06/2060	49.515	0,03	EUR	311.000	Catalent Pharma Solutions Inc. 2.38% 01/03/2028	351.611	0,18
USD	51.000	American International Group Inc. 3.40% 30/06/2030	56.441	0,03					
USD	51.000	American International Group Inc. 3.90% 01/04/2026	58.061	0,03					

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

### Portfolioaufstellung

(Fortsetzung)

Nennwert		Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts	Nennwert		Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>					<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>					<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				
<b>VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)</b>					<b>VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)</b>				
EUR	100.000	Cemex Finance LLC 4.63% 15/06/2024	119.999	0,06	EUR	132.000	Ford Motor Credit Company LLC 3.25% 15/09/2025	150.950	0,08
USD	17.000	CenterPoint Energy Houston Electric LLC 2.90% 01/07/2050	17.984	0,01	GBP	100.000	Ford Motor Credit Company LLC 4.54% 06/03/2025	128.865	0,07
USD	40.000	Charter Communications Operating LLC FRN 01/02/2024	40.955	0,02	EUR	70.000	General Electric Company 4.13% 19/09/2035	97.359	0,05
USD	56.000	Charter Communications Operating LLC 4.80% 01/03/2050	63.976	0,03	USD	19.000	Georgia Power Company 3.70% 30/01/2050	21.299	0,01
USD	34.000	Cigna Corp. 4.90% 15/12/2048	44.199	0,02	USD	36.000	Intel Corp. 4.75% 25/03/2050	49.468	0,03
USD	80.000	Citigroup Inc. FRN 31/03/2031	95.994	0,05	EUR	100.000	International Business Machines Corp. 0.95% 23/05/2025	122.902	0,06
EUR	159.000	Colfax Corp. 3.25% 15/05/2025	187.549	0,10	USD	100.000	International Business Machines Corp. 1.95% 15/05/2030	103.181	0,05
USD	40.000	Comcast Corp. 2.65% 15/08/2062	37.960	0,02	EUR	363.000	IQVIA Inc. 2.25% 15/01/2028	417.409	0,22
USD	15.000	Consolidated Edison Co of NY 3.95% 01/04/2050	18.043	0,01	EUR	134.000	IQVIA Inc. 2.88% 15/06/2028	159.128	0,08
USD	30.000	Consumers Energy Company 2.50% 01/05/2060	28.280	0,01	EUR	342.000	IQVIA Inc. 3.25% 15/03/2025	404.595	0,21
USD	51.000	CSX Corp. 3.80% 15/04/2050	60.879	0,03	USD	40.000	Johnson & Johnson 2.10% 01/09/2040	39.965	0,02
USD	53.000	CVS Health Corp. 5.05% 25/03/2048	67.552	0,03	USD	40.000	Johnson & Johnson 2.45% 01/09/2060	40.107	0,02
EUR	100.000	Digital Euro Finco LLC 2.50% 16/01/2026	128.979	0,07	USD	173.000	JPMorgan Chase & Company FRN 22/04/2041	188.569	0,10
USD	37.000	Discovery Communications LLC 5.30% 15/05/2049	45.434	0,02	USD	73.000	JPMorgan Chase & Company FRN 24/07/2038	86.367	0,04
USD	70.000	DTE Energy Company 1.05% 01/06/2025	70.192	0,04	USD	96.000	Kinder Morgan Energy Partners LP 5.00% 01/03/2043	106.939	0,05
USD	81.000	Duke Energy Carolinas LLC 3.20% 15/08/2049	89.899	0,05	EUR	215.000	Kraft Heinz Foods Company 2.25% 25/05/2028	256.335	0,13
USD	46.000	Duke Energy Progress Inc. 4.20% 15/08/2045	57.572	0,03	GBP	100.000	Kraft Heinz Foods Company 4.13% 01/07/2027	140.272	0,07
USD	34.000	Enterprise Products Operating LLC 3.70% 31/01/2051	33.551	0,02	USD	41.000	Kraft Heinz Foods Company 4.38% 01/06/2046	41.871	0,02
USD	25.000	Eversholt Funding plc 3.45% 15/01/2050	27.871	0,01	USD	65.000	Merck & Company Inc. 2.35% 24/06/2040	66.086	0,03
USD	205.000	Federal Home Loan Banks 5.50% 15/07/2036	319.969	0,17	USD	121.000	Microsoft Corp. 4.10% 06/02/2037	157.584	0,08
USD	15.000	Fedex Corp. 4.95% 17/10/2048	19.274	0,01	USD	30.000	Mondelez International Inc. 2.63% 04/09/2050	28.911	0,01
EUR	100.000	Fidelity National Information SE 1.50% 21/05/2027	124.908	0,06	GBP	173.000	MPT Operating Partnership LP 3.69% 05/06/2028	225.991	0,11
EUR	100.000	Fidelity National Information Services Inc. 2.00% 21/05/2030	129.634	0,07	EUR	100.000	Netflix Inc. 3.00% 15/06/2025	122.362	0,06
EUR	100.000	Fiserv Inc. 1.13% 01/07/2027	121.936	0,06	EUR	303.000	Netflix Inc. 3.63% 15/05/2027	384.412	0,21
EUR	100.000	Ford Motor Credit Company LLC 1.36% 07/02/2025	106.898	0,06	EUR	140.000	Netflix Inc. 3.63% 15/06/2030	178.294	0,09
EUR	196.000	Ford Motor Credit Company LLC 2.33% 25/11/2025	215.139	0,11	EUR	214.000	Netflix Inc. 3.88% 15/11/2029	277.510	0,14
EUR	100.000	Ford Motor Credit Company LLC 2.39% 17/02/2026	109.682	0,06	EUR	353.000	Netflix Inc. 4.63% 15/05/2029	479.843	0,25
EUR	323.000	Ford Motor Credit Company LLC 3.02% 06/03/2024	371.947	0,18	USD	25.000	Nisource Finance Corp. 4.38% 15/05/2047	30.969	0,02

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.



## Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

### Portfolioaufstellung

(Fortsetzung)

Nennwert		Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts	Nennwert		Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>					<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>					<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				
<b>VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)</b>					<b>BRITISCHE JUNGFERNINSELN</b>				
USD	125.000	Nisource Finance Corp. 4.80% 15/02/2044	156.679	0,08	USD	200.000	CLP Power Hong Kong Financing Limited 2.13% 30/06/2030	202.904	0,10
USD	69.000	Oracle Corp. 3.60% 01/04/2040	78.583	0,04	USD	200.000	Gold Fields Orogen Holdings BVI Limited 5.13% 15/05/2024	218.093	0,11
USD	19.000	Oracle Corp. 4.30% 08/07/2034	23.831	0,01	<b>Britische Jungfernseln, insgesamt</b>				
USD	51.000	Pfizer Inc. 2.55% 28/05/2040	52.992	0,03	<b>420.997</b>				
USD	20.000	Piedmont Natural Gas Company Inc. 3.35% 01/06/2050	21.730	0,01	<b>0,21</b>				
USD	39.000	Plains All American Pipeline LP 3.55% 15/12/2029	37.775	0,02	<b>Anleihen, insgesamt</b>				
USD	39.000	Plains All American Pipeline LP 4.70% 15/06/2044	34.932	0,02	<b>69.355.896</b>				
USD	33.000	PPL Electric Utilities Corp 4.15% 15/06/2048	41.779	0,02	<b>35,82</b>				
EUR	200.000	Refinitiv US Holdings Inc. 4.50% 15/05/2026	246.282	0,13	<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente</b>				
EUR	166.000	Refinitiv US Holdings Inc. 6.88% 15/11/2026	210.896	0,11	<b>ÖSTERREICH</b>				
USD	68.000	Relx Capital Inc. 3.00% 22/05/2030	74.577	0,04	EUR	10.000	Austria (Govt of) 0.85% 30/06/2120	14.498	0,01
USD	30.000	San Diego Gas & Electric Company 3.32% 15/04/2050	32.696	0,02	<b>Österreich, insgesamt</b>				
USD	44.000	San Diego Gas & Electric Company 4.15% 15/05/2048	53.469	0,03	<b>14.498</b>				
EUR	101.000	Silgan Holdings Inc. 2.25% 01/06/2028	115.844	0,06	<b>0,01</b>				
EUR	229.000	Silgan Holdings Inc. 3.25% 15/03/2025	272.427	0,14	<b>BELGIEN</b>				
USD	50.000	Southern California Edison Company 4.13% 01/03/2048	54.713	0,03	EUR	20.000	Belgium (Govt of) 1.70% 22/06/2050	32.084	0,02
USD	39.000	Southern Company 3.70% 30/04/2030	44.542	0,02	<b>Belgien, insgesamt</b>				
USD	19.000	Southern Company 4.40% 01/07/2046	22.589	0,01	<b>32.084</b>				
EUR	300.000	Spectrum Brands Inc. 4.00% 01/10/2026	360.875	0,18	<b>0,02</b>				
EUR	135.000	Tenneco Inc. 4.88% 15/04/2022	152.416	0,08	<b>KANADA</b>				
USD	10.000	Tyson Foods Inc. 4.55% 02/06/2047	12.635	0,01	CAD	60.000	Canada (Govt of) 2.75% 01/12/2048	63.021	0,03
EUR	195.000	UGI International LLC 3.25% 01/11/2025	232.075	0,12	CAD	250.000	Canada Housing Trust 1.75% 15/06/2030	201.121	0,10
USD	101.000	Verizon Communications Inc. 4.40% 01/11/2034	126.188	0,07	USD	80.000	Ontario (Province of) 1.13% 07/10/2030	79.890	0,04
USD	39.000	Virginia Electric & Power Company 4.60% 01/12/2048	53.260	0,03	USD	154.000	Ontario (Province of) 2.25% 18/05/2022	158.861	0,08
EUR	200.000	Wells Fargo & Company FRN 04/05/2030	248.136	0,13	<b>Kanada, insgesamt</b>				
USD	50.000	Williams Partners LP 4.85% 01/03/2048	56.123	0,03	<b>502.893</b>				
<b>Vereinigte Staaten, insgesamt</b>			<b>13.252.298</b>	<b>6,85</b>	<b>0,25</b>				
					<b>FRANKREICH</b>				
					USD	200.000	Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale 0.38% 23/09/2025	198.860	0,10
					EUR	225.000	France (Govt of) OAT 1.25% 25/05/2034	311.946	0,16
					EUR	145.000	France (Govt of) OAT 1.50% 25/05/2031	201.890	0,10
					EUR	40.000	France (Govt of) OAT 1.50% 25/05/2050	61.588	0,03
					EUR	100.000	Unedic 0.25% 16/07/2035	119.251	0,06
					<b>Frankreich, insgesamt</b>				
					<b>893.535</b>				
					<b>0,45</b>				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

### Portfolioaufstellung

(Fortsetzung)

	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts		Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>					<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				
<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)</b>					<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)</b>				
<b>DEUTSCHLAND</b>					<b>SUPRANATIONAL</b>				
EUR	400.000	Germany (Govt of) 0.00% 10/10/2025	486.209	0,25	USD	80.000	Asian Development Bank 0.75% 08/10/2030	78.824	0,04
EUR	100.000	Germany (Govt of) 0.00% 15/02/2030	123.565	0,06	USD	170.000	Asian Development Bank 1.75% 19/09/2029	183.477	0,09
EUR	107.000	Germany (Govt of) 0.00% 15/08/2050	129.306	0,07	USD	65.000	Asian Infrastructure Investment Bank 0.25% 29/09/2023	64.823	0,03
EUR	120.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0.00% 15/09/2028	145.820	0,08	USD	100.000	IBRD 1.88% 27/10/2026	107.918	0,06
		<b>Deutschland, insgesamt</b>	<b>884.900</b>	<b>0,46</b>	USD	150.000	Inter-American Development Bank 3.00% 21/02/2024	163.320	0,08
					USD	80.000	International Bank for Reconstruction & Development 0.88% 14/05/2030	80.250	0,04
					USD	200.000	New Development Bank 0.63% 29/09/2025	199.455	0,11
		<b>Indonesien, insgesamt</b>	<b>1.962.720</b>	<b>1,02</b>			<b>Supranational, insgesamt</b>	<b>878.067</b>	<b>0,45</b>
<b>INDONESIEN</b>					<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH</b>				
IDR	29.000.000.000	Indonesia (Govt of) 7.00% 15/09/2030	1.962.720	1,02	GBP	70.000	United Kingdom Gilt 0.50% 22/10/2061	84.198	0,04
		<b>Indonesien, insgesamt</b>	<b>1.962.720</b>	<b>1,02</b>	GBP	110.000	United Kingdom Gilt 0.63% 22/10/2050	136.791	0,07
					GBP	65.000	United Kingdom Gilt 1.75% 22/01/2049	105.256	0,05
					GBP	45.000	United Kingdom Gilt 3.25% 22/01/2044	89.347	0,05
		<b>Italien, insgesamt</b>	<b>211.485</b>	<b>0,11</b>			<b>Vereinigtes Königreich, insgesamt</b>	<b>415.592</b>	<b>0,21</b>
<b>ITALIEN</b>					<b>VEREINIGTE STAATEN</b>				
EUR	108.000	Italy (Govt of) BPT 2.45% 01/09/2050	147.216	0,08	USD	400.000	United States Treasury N/B 0.25% 31/08/2025	399.719	0,21
EUR	45.000	Italy (Govt of) BPT 2.70% 01/03/2047	64.269	0,03	USD	25.000	United States Treasury N/B 0.63% 15/05/2030	24.914	0,01
		<b>Italien, insgesamt</b>	<b>211.485</b>	<b>0,11</b>	USD	292.000	United States Treasury N/B 0.63% 15/08/2030	290.312	0,15
					USD	569.300	United States Treasury N/B 1.25% 15/05/2050	539.634	0,29
					USD	29.000	United States Treasury N/B 2.00% 15/02/2050	32.811	0,02
					USD	280.000	United States Treasury N/B 2.25% 15/08/2027	314.081	0,16
		<b>Japan, insgesamt</b>	<b>665.175</b>	<b>0,33</b>			<b>Vereinigte Staaten, insgesamt</b>	<b>1.601.471</b>	<b>0,84</b>
<b>JAPAN</b>					<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente, insgesamt</b>				
JPY	20.500.000	Japan (Govt of) Forty Year Bond 0.40% 20/03/2056	181.304	0,09				<b>10.495.498</b>	<b>5,42</b>
JPY	3.600.000	Japan (Govt of) Thirty Year Bond 0.40% 20/06/2049	32.562	0,02					
JPY	3.200.000	Japan (Govt of) Thirty Year Bond 0.40% 20/03/2050	28.805	0,01					
JPY	22.500.000	Japan (Govt of) Thirty Year Bond 0.70% 20/12/2048	220.751	0,11					
USD	200.000	Japan Bank for International Cooperation 1.88% 20/04/2021	201.753	0,10					
		<b>Japan, insgesamt</b>	<b>665.175</b>	<b>0,33</b>					
<b>MEXIKO</b>									
USD	2.000.000	Mexico (Govt of) 5.75% 12/10/2110	2.312.481	1,21					
		<b>Mexiko, insgesamt</b>	<b>2.312.481</b>	<b>1,21</b>					
<b>SPANIEN</b>									
EUR	71.000	Spain (Govt of) 2.90% 31/10/2046	120.597	0,06					
		<b>Spanien, insgesamt</b>	<b>120.597</b>	<b>0,06</b>					

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.



## Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

### Portfolioaufstellung

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>			
<b>Aktien (Fortsetzung)</b>				<b>Aktien (Fortsetzung)</b>			
<b>HONGKONG</b>				<b>MACAU</b>			
28.000	AIA Group Limited	274.219	0,14	75.200	Wynn Macau Limited	119.932	0,06
25.500	China Mobile Limited	162.706	0,08		<b>Macau, insgesamt</b>	<b>119.932</b>	<b>0,06</b>
85.000	Cnooc Limited	81.710	0,04				
5.700	Hong Kong Exchanges and Clearing Limited	266.097	0,13		<b>NIEDERLANDE</b>		
7.500	Sun Hung Kai Properties Limited	95.613	0,05	2.136	ASM International NV	306.460	0,16
102.000	Xinyi Glass Holdings Limited	205.053	0,10	6.894	Philips NV	324.987	0,17
	<b>Hongkong, insgesamt</b>	<b>1.085.398</b>	<b>0,54</b>	12.851	Relx plc	286.777	0,15
				10.210	Unilever NV	616.597	0,32
					<b>Niederlande, insgesamt</b>	<b>1.534.821</b>	<b>0,80</b>
<b>INDIEN</b>				<b>NORWEGEN</b>			
25.600	Embassy Office Parks REIT	125.184	0,06	11.742	Equinor ASA	166.656	0,09
7.919	HDFC Bank Limited	115.771	0,06		<b>Norwegen, insgesamt</b>	<b>166.656</b>	<b>0,09</b>
38.406	Petronet Lng Limited	114.860	0,06				
	<b>Indien, insgesamt</b>	<b>355.815</b>	<b>0,18</b>		<b>SÜDKOREA</b>		
<b>INDONESIEN</b>				<b>SINGAPUR</b>			
1.583.200	Bank Rakyat Indonesia	323.429	0,17	78.600	Capitamall Trust	111.126	0,06
1.472.900	Telekomunikasi Indonesia Tbk Pt	253.386	0,13	66.000	Comfortdelgro Corp. Limited	68.171	0,04
	<b>Indonesien, insgesamt</b>	<b>576.815</b>	<b>0,30</b>	24.300	DBS Group Holdings Limited	354.416	0,18
				4.000	United Overseas Bank Limited	55.761	0,03
					<b>Singapur, insgesamt</b>	<b>589.474</b>	<b>0,31</b>
<b>IRLAND</b>				<b>SPANIEN</b>			
5.632	CRH plc	203.877	0,11	23.537	Iberdrola SA	290.083	0,15
6.300	CRH plc	227.724	0,11	9.927	Inditex SA	277.053	0,14
8.451	Eaton Corp. plc	862.255	0,44		<b>Spanien, insgesamt</b>	<b>567.136</b>	<b>0,29</b>
7.053	Medtronic Inc.	732.948	0,38				
	<b>Irland, insgesamt</b>	<b>2.026.804</b>	<b>1,04</b>		<b>SCHWEDEN</b>		
<b>ITALIEN</b>				<b>SCHWEDEN</b>			
35.864	Enel SpA	311.971	0,16	6.209	Atlas Copco AB	260.293	0,13
2.890	Fincobank Banca Fineco SpA	39.837	0,02	7.366	Elekta AB - B	93.042	0,05
25.709	Infrastrutture Wireless Italiane SpA	284.594	0,15	32.287	Sandvik AB	634.558	0,33
16.004	Marr SpA	257.860	0,13		<b>Schweden, insgesamt</b>	<b>987.893</b>	<b>0,51</b>
10.445	Snam Rete Gas SpA	53.758	0,03				
	<b>Italien, insgesamt</b>	<b>948.020</b>	<b>0,49</b>				
<b>JAPAN</b>							
600	Nintendo Company Limited	339.202	0,18				
4.600	Rohm Company Limited	353.075	0,18				
	<b>Japan, insgesamt</b>	<b>692.277</b>	<b>0,36</b>				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.





## Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

### Portfolioaufstellung

(Fortsetzung)

Nennwert		Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts	Nennwert		Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts
<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)</b>					<b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente (Fortsetzung)</b>				
<b>VEREINIGTE STAATEN</b>					<b>Wandelanleihen</b>				
USD	197.000	Fannie Mae 5.63% 15/07/2037	316.993	0,16					
USD	709.500	United States Treasury N/B 1.13% 30/09/2021	716.318	0,38					
<b>Vereinigte Staaten, insgesamt</b>			<b>1.033.311</b>	<b>0,54</b>					
<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente, insgesamt</b>					<b>1.112.654 0,58</b>				
<b>Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere, insgesamt</b>					<b>2.321.522 1,20</b>				
<b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>					<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren</b>				
<b>Anleihen</b>					<b>Fonds</b>				
<b>AUSTRALIEN</b>					<b>LUXEMBURG</b>				
USD	95.000	APT Pipelines Limited 4.25% 15/07/2027	107.413	0,06	652.171	Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income Fund ZUP*	7.767.747	4,01	
USD	47.000	Sydney Airport Finance Company Pty Limited 3.63% 28/04/2026	50.618	0,03	585.537	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds AUP*	5.632.335	2,91	
USD	137.000	Woodside Finance Limited 4.50% 04/03/2029	153.365	0,08	<b>Luxemburg, insgesamt</b>				
<b>Australien, insgesamt</b>			<b>311.396</b>	<b>0,17</b>	<b>13.400.082 6,92</b>				
<b>LUXEMBURG</b>					<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH</b>				
EUR	464.000	Altice France Holding SA 8.00% 15/05/2027	578.489	0,31	1.808.218	Threadneedle Specialist Investment Funds ICVC - Emerging Market Local Fund**	5.273.124	2,73	
<b>Luxemburg, insgesamt</b>			<b>578.489</b>	<b>0,31</b>	<b>Vereinigtes Königreich, insgesamt</b>				
<b>PORTUGAL</b>					<b>5.273.124 2,73</b>				
EUR	100.000	Banco Espirito Santo SA 4.00% 21/01/2021	25.418	0,01	<b>Fonds, insgesamt</b>				
<b>Portugal, insgesamt</b>			<b>25.418</b>	<b>0,01</b>	<b>18.673.206 9,65</b>				
<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH</b>					<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren, insgesamt</b>				
GBP	205.000	Pinewood Finance Company Limited 3.25% 30/09/2025	265.039	0,14	<b>Wert der Anlagen, insgesamt</b>				
GBP	100.000	Stonegate Pub 8.25% 31/07/2025	119.705	0,06	<b>183.622.171 94,89</b>				
GBP	100.000	Virgin Media Secured Finance plc 4.13% 15/08/2030	127.797	0,07	<b>(Gesamtkosten: USD 181.191.884)</b>				
<b>Vereinigtes Königreich, insgesamt</b>			<b>512.541</b>	<b>0,27</b>					
<b>Anleihen, insgesamt</b>			<b>1.427.844</b>	<b>0,76</b>					

\* Siehe Erläuterung 18.

\*\* Fonds der verbundenen Partei.

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.





## Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities\*

### Portfolioaufstellung

(Fortsetzung)

Anzahl		Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts	Anzahl		Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>					<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren</b>				
<b>Aktien (Fortsetzung)</b>					<b>Fonds</b>				
<b>SÜDKOREA</b>					<b>IRLAND</b>				
121	Kakao Corp.		37.712	0,73	29.318	iShares MSCI India UCITS ETF		154.359	3,00
230	Naver Corp.		58.312	1,13		<b>Irland, insgesamt</b>		<b>154.359</b>	<b>3,00</b>
242	Pearlabyss Corp.		41.841	0,81		<b>Fonds, insgesamt</b>		<b>154.359</b>	<b>3,00</b>
786	Samsung Electro-Mechanics Company Limited		93.420	1,82		<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren, insgesamt</b>		<b>154.359</b>	<b>3,00</b>
5.762	Samsung Electronics Company Limited		286.746	5,56		<b>Wert der Anlagen, insgesamt</b>		<b>4.965.460</b>	<b>96,36</b>
239	Samsung Sdi Company Limited		88.591	1,72		<b>(Gesamtkosten: USD 4.816.797)</b>			
1.566	SK hynix Inc.		112.479	2,18					
	<b>Südkorea, insgesamt</b>		<b>719.101</b>	<b>13,95</b>					
<b>SÜDAFRIKA</b>					<i>*Siehe Erläuterung 1.</i>				
989	Capitec Bank Holdings Limited		61.509	1,19					
	<b>Südafrika, insgesamt</b>		<b>61.509</b>	<b>1,19</b>					
<b>TAIWAN</b>									
5.000	Delta Electronics Inc.		32.629	0,63					
5.000	MediaTek Inc.		104.792	2,03					
4.367	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited - ADR		354.034	6,88					
	<b>Taiwan, insgesamt</b>		<b>491.455</b>	<b>9,54</b>					
<b>THAILAND</b>									
51.600	Muangthai Capital plc		80.198	1,56					
	<b>Thailand, insgesamt</b>		<b>80.198</b>	<b>1,56</b>					
<b>VEREINIGTE STAATEN</b>									
59	Mercadolibre Inc.		63.866	1,24					
	<b>Vereinigte Staaten, insgesamt</b>		<b>63.866</b>	<b>1,24</b>					
	<b>Aktien, insgesamt</b>		<b>4.811.101</b>	<b>93,36</b>					
	<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt</b>		<b>4.811.101</b>	<b>93,36</b>					

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Global Focus

## Portfolioaufstellung

zum 30. September 2020

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts	Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>			
<b>Aktien</b>				<b>Aktien (Fortsetzung)</b>			
<b>KAIMANINSELN</b>				<b>SCHWEIZ (Fortsetzung)</b>			
354.000	Tencent Holdings Limited	23.363.953	1,70	66.448	Roche Holding AG	22.793.012	1,66
	<b>Kaimaninseln, insgesamt</b>	<b>23.363.953</b>	<b>1,70</b>		<b>Schweiz, insgesamt</b>	<b>36.204.667</b>	<b>2,64</b>
<b>DÄNEMARK</b>				<b>TAIWAN</b>			
496.150	Novo Nordisk A/S	34.340.249	2,50	1.678.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	25.087.147	1,83
	<b>Dänemark, insgesamt</b>	<b>34.340.249</b>	<b>2,50</b>		<b>Taiwan, insgesamt</b>	<b>25.087.147</b>	<b>1,83</b>
<b>DEUTSCHLAND</b>				<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH</b>			
40.803	Adidas AG	13.210.733	0,96	74.920	Linde plc	17.737.912	1,29
	<b>Deutschland, insgesamt</b>	<b>13.210.733</b>	<b>0,96</b>		<b>Vereinigtes Königreich, insgesamt</b>	<b>17.737.912</b>	<b>1,29</b>
<b>HONGKONG</b>				<b>VEREINIGTE STAATEN</b>			
2.715.400	AIA Group Limited	26.593.348	1,94	391.043	Abbott Laboratories	42.557.210	3,11
	<b>Hongkong, insgesamt</b>	<b>26.593.348</b>	<b>1,94</b>	195.038	Activision Blizzard Inc.	15.788.326	1,15
<b>INDIEN</b>				121.937	Adobe Systems Inc.	59.801.563	4,36
757.421	Kotak Mahindra Bank Limited	13.019.448	0,95	38.510	Alphabet Inc. - A	56.440.256	4,12
	<b>Indien, insgesamt</b>	<b>13.019.448</b>	<b>0,95</b>	33.078	Amazon.com Inc.	104.153.691	7,61
<b>JAPAN</b>				42.542	Ansys Inc.	13.921.019	1,02
66.000	Daikin Industries Limited	12.070.503	0,88	503.199	Baxter International Inc.	40.467.263	2,95
72.100	Disco Corp.	17.360.573	1,27	939.236	Boston Scientific Corp.	35.888.208	2,62
259.100	Hoya Corp.	29.118.985	2,12	129.286	Cadence Design Systems Inc.	13.785.766	1,01
71.712	Keyence Corp.	33.283.942	2,43	104.171	CME Group Inc.	17.428.850	1,27
	<b>Japan, insgesamt</b>	<b>91.834.003</b>	<b>6,70</b>	694.571	Comcast Corp.	32.130.854	2,34
<b>NIEDERLANDE</b>				94.079	Danaher Corp.	20.258.031	1,48
485.807	Philips NV	22.901.199	1,67	151.723	Edwards Lifesciences Corp.	12.110.530	0,88
	<b>Niederlande, insgesamt</b>	<b>22.901.199</b>	<b>1,67</b>	100.693	Facebook Inc. - A	26.371.497	1,93
<b>SÜDKOREA</b>				476.596	Fidelity National Information Services Inc.	70.159.697	5,12
598.476	Samsung Electronics Company Limited	29.783.202	2,17	152.621	Intuit Inc.	49.786.496	3,63
	<b>Südkorea, insgesamt</b>	<b>29.783.202</b>	<b>2,17</b>	102.256	Lam Research Corp.	33.923.429	2,48
<b>SCHWEDEN</b>				223.958	Mastercard Inc. - A	75.735.877	5,53
292.082	Atlas Copco AB	12.244.617	0,89	522.550	Microsoft Corp.	109.907.942	8,03
	<b>Schweden, insgesamt</b>	<b>12.244.617</b>	<b>0,89</b>	52.378	Nvidia Corp.	28.348.021	2,07
<b>SCHWEIZ</b>				96.194	S&P Global Inc.	34.687.556	2,53
112.694	Nestle SA - Reg	13.411.655	0,98	27.598	Servicenow Inc.	13.385.030	0,98
				111.528	Thermo Fisher Scientific Inc.	49.241.843	3,60
				251.329	Transunion	21.144.309	1,54
				98.919	United Health Group Inc.	30.839.977	2,25
					<b>Vereinigte Staaten, insgesamt</b>	<b>1.008.263.241</b>	<b>73,61</b>
					<b>Aktien, insgesamt</b>	<b>1.354.583.719</b>	<b>98,85</b>
					<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt</b>	<b>1.354.583.719</b>	<b>98,85</b>

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Global Focus

### Portfolioaufstellung

(Fortsetzung)

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts
<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren</b>			
<b>Fonds</b>			
<b>IRLAND</b>			
16.641.798	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	16.641.798	1,21
	<b>Irland, insgesamt</b>	<b>16.641.798</b>	<b>1,21</b>
	<b>Fonds, insgesamt</b>	<b>16.641.798</b>	<b>1,21</b>
	<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren, insgesamt</b>	<b>16.641.798</b>	<b>1,21</b>
	<b>Wert der Anlagen, insgesamt</b>	<b>1.371.225.517</b>	<b>100,06</b>
<b>(Gesamtkosten: USD 1.066.925.108)</b>			

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.





## Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities

### Portfolioaufstellung

(Fortsetzung)

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts
<b>Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere</b>			
<b>Aktien</b>			
<b>RUSSISCHE FÖDERATION</b>			
549.221	Detsky Mir PJSC	833.277	0,71
	<b>Russische Föderation, insgesamt</b>	<b>833.277</b>	<b>0,71</b>
	<b>Aktien, insgesamt</b>	<b>833.277</b>	<b>0,71</b>
<b>Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere, insgesamt</b>			
		<b>833.277</b>	<b>0,71</b>
	<b>Wert der Anlagen, insgesamt</b>	<b>116.121.922</b>	<b>99,03</b>
<b>(Gesamtkosten: USD 85.814.649)</b>			

## Threadneedle (Lux) - Global Equity Income

### Portfolioaufstellung

zum 30. September 2020

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts	Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>			
<b>Aktien</b>				<b>Aktien (Fortsetzung)</b>			
<b>AUSTRALIEN</b>				<b>JAPAN</b>			
172.218	Amcor plc	1.892.293	0,94	4.577	Nintendo Company Limited	2.587.547	1,29
	<b>Australien, insgesamt</b>	<b>1.892.293</b>	<b>0,94</b>	38.500	Rohm Company Limited	2.955.084	1,47
<b>KANADA</b>				<b>NIEDERLANDE</b>			
109.132	Manulife Financial Corp.	1.513.101	0,75	46.289	Relx plc	1.032.964	0,51
78.824	Suncor Energy Inc.	959.519	0,48	68.921	Unilever NV	4.162.241	2,07
33.981	TC Energy Corp.	1.422.076	0,71	<b>Niederlande, insgesamt</b>			
	<b>Kanada, insgesamt</b>	<b>3.894.696</b>	<b>1,94</b>	<b>5.195.205</b>			
<b>KAIMANINSELN</b>				<b>NORWEGEN</b>			
3.426	NetEase Inc. - ADR	1.557.699	0,77	98.901	Equinor ASA	1.403.716	0,69
	<b>Kaimaninseln, insgesamt</b>	<b>1.557.699</b>	<b>0,77</b>	<b>Norwegen, insgesamt</b>			
<b>CHINA</b>				<b>SÜDKOREA</b>			
348.292	Ping An Insurance Group Company of China Limited	3.572.795	1,78	146.341	Samsung Electronics Company Limited	7.282.671	3,62
	<b>China, insgesamt</b>	<b>3.572.795</b>	<b>1,78</b>	<b>Südkorea, insgesamt</b>			
<b>FINNLAND</b>				<b>SINGAPUR</b>			
72.449	UPM-Kymmene Oyj	2.208.041	1,10	204.200	DBS Group Holdings Limited	2.978.259	1,48
	<b>Finnland, insgesamt</b>	<b>2.208.041</b>	<b>1,10</b>	<b>Singapur, insgesamt</b>			
<b>FRANKREICH</b>				<b>SCHWEDEN</b>			
25.623	Schneider Electric SE	3.186.464	1,59	142.692	Sandvik AB	2.804.420	1,39
	<b>Frankreich, insgesamt</b>	<b>3.186.464</b>	<b>1,59</b>	<b>Schweden, insgesamt</b>			
<b>DEUTSCHLAND</b>				<b>SCHWEIZ</b>			
326.759	Deutsche Telekom AG - Reg	5.475.556	2,73	48.152	Novartis AG - Reg	4.188.108	2,08
175.526	E.ON AG	1.940.571	0,97	973	SGS SA - Reg	2.614.787	1,30
85.145	Evonik Industries AG	2.206.581	1,10	31.356	TE Connectivity Limited	3.064.735	1,52
12.347	Muenchener Rueckversicherungs AG - Reg	3.136.088	1,56	<b>Schweiz, insgesamt</b>			
	<b>Deutschland, insgesamt</b>	<b>12.758.796</b>	<b>6,36</b>	<b>9.867.630</b>			
<b>INDONESIEN</b>				<b>TAIWAN</b>			
13.176.000	Bank Rakyat Indonesia	2.691.699	1,34	223.000	Eclat Textile Company Limited	2.764.208	1,37
8.114.100	Telekomunikasi Indonesia Tbk Pt	1.395.885	0,69	49.000	MediaTek Inc.	1.026.966	0,51
	<b>Indonesien, insgesamt</b>	<b>4.087.584</b>	<b>2,03</b>	306.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	4.574.891	2,28
<b>IRLAND</b>				<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH</b>			
48.502	CRH plc	1.755.758	0,87	126.975	Anglo American plc	3.079.188	1,54
40.938	Medtronic Inc.	4.254.277	2,12	438.954	BAE Systems plc	2.735.252	1,36
	<b>Irland, insgesamt</b>	<b>6.010.035</b>	<b>2,99</b>				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.





## Threadneedle (Lux) - Global Select

## Portfolioaufstellung

zum 30. September 2020

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts	Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts	
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				
<b>Aktien</b>				<b>Aktien (Fortsetzung)</b>				
<b>KAIMANINSELN</b>				<b>IRLAND</b>				
36.914	Alibaba Group Holding Limited	10.851.978	2,14	21.300	Aon plc	4.394.190	0,87	
122.200	Tencent Holdings Limited	8.065.184	1,59	174.925	CRH plc	6.332.233	1,25	
	<b>Kaimaninseln, insgesamt</b>	<b>18.917.162</b>	<b>3,73</b>	64.690	Medtronic Inc.	6.722.584	1,33	
				63.508	Trane Technologies plc	7.700.345	1,52	
					<b>Irland, insgesamt</b>	<b>25.149.352</b>	<b>4,97</b>	
<b>CHINA</b>				<b>JAPAN</b>				
564.000	Ping An Insurance Group Company of China Limited	5.785.537	1,14	15.700	Keyence Corp.	7.286.896	1,44	
	<b>China, insgesamt</b>	<b>5.785.537</b>	<b>1,14</b>	10.800	Nintendo Company Limited	6.105.639	1,20	
				71.400	Rohm Company Limited	5.480.338	1,08	
				80.100	Sony Corp.	6.096.497	1,20	
					<b>Japan, insgesamt</b>	<b>24.969.370</b>	<b>4,92</b>	
<b>DÄNEMARK</b>				<b>NIEDERLANDE</b>				
133.953	Novo Nordisk A/S	9.271.348	1,83	28.879	Airbus SE	2.101.998	0,41	
41.537	Orsted A/S	5.728.244	1,13		<b>Niederlande, insgesamt</b>	<b>2.101.998</b>	<b>0,41</b>	
	<b>Dänemark, insgesamt</b>	<b>14.999.592</b>	<b>2,96</b>	<b>SÜDKOREA</b>				
				244.435	Samsung Electronics Company Limited	12.164.327	2,41	
<b>FINNLAND</b>					<b>Südkorea, insgesamt</b>	<b>12.164.327</b>	<b>2,41</b>	
177.218	UPM-Kymmene Oyj	5.401.104	1,07	<b>SCHWEIZ</b>				
	<b>Finnland, insgesamt</b>	<b>5.401.104</b>	<b>1,07</b>	69.941	TE Connectivity Limited	6.836.033	1,35	
					<b>Schweiz, insgesamt</b>	<b>6.836.033</b>	<b>1,35</b>	
<b>FRANKREICH</b>				<b>TAIWAN</b>				
33.659	Essilor International SA	4.584.467	0,90	427.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	6.383.916	1,26	
19.546	Pernod-Ricard SA	3.120.642	0,62		<b>Taiwan, insgesamt</b>	<b>6.383.916</b>	<b>1,26</b>	
57.082	Schneider Electric SE	7.098.691	1,40	<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH</b>				
	<b>Frankreich, insgesamt</b>	<b>14.803.800</b>	<b>2,92</b>	114.084	Diageo plc	3.908.427	0,77	
				104.447	Reckitt Benckiser Group plc	10.208.199	2,01	
<b>DEUTSCHLAND</b>					94.373	Unilever plc	5.826.979	1,15
26.835	Adidas AG	8.688.332	1,71		<b>Vereinigtes Königreich, insgesamt</b>	<b>19.943.605</b>	<b>3,93</b>	
	<b>Deutschland, insgesamt</b>	<b>8.688.332</b>	<b>1,71</b>	<b>VEREINIGTE STAATEN</b>				
<b>HONGKONG</b>				49.031	Abbott Laboratories	5.336.044	1,05	
668.600	AIA Group Limited	6.547.953	1,29	105.417	Activision Blizzard Inc.	8.533.506	1,68	
	<b>Hongkong, insgesamt</b>	<b>6.547.953</b>	<b>1,29</b>	18.199	Adobe Systems Inc.	8.925.336	1,76	
<b>INDIEN</b>				16.192	Alphabet Inc. - A	23.730.995	4,68	
582.415	HDFC Bank Limited	8.514.525	1,68					
	<b>Indien, insgesamt</b>	<b>8.514.525</b>	<b>1,68</b>					
<b>INDONESIEN</b>								
15.704.300	Bank Rakyat Indonesia	3.208.200	0,63					
	<b>Indonesien, insgesamt</b>	<b>3.208.200</b>	<b>0,63</b>					

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Global Select

### Portfolioaufstellung

(Fortsetzung)

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts	Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren</b>			
<b>Aktien (Fortsetzung)</b>				<b>Fonds</b>			
<b>VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)</b>				<b>IRLAND</b>			
8.273	Amazon.com Inc.	26.049.443	5,15	8.593.577	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	8.593.577	1,70
70.916	Baxter International Inc.	5.703.065	1,13		<b>Irland, insgesamt</b>	<b>8.593.577</b>	<b>1,70</b>
118.472	Boston Scientific Corp.	4.526.815	0,89		<b>Fonds, insgesamt</b>	<b>8.593.577</b>	<b>1,70</b>
147.834	Centene Corp.	8.623.157	1,70		<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren, insgesamt</b>	<b>8.593.577</b>	<b>1,70</b>
22.166	CME Group Inc.	3.708.593	0,73		<b>Wert der Anlagen, insgesamt</b>	<b>503.019.605</b>	<b>99,28</b>
239.522	Comcast Corp.	11.080.288	2,19		<b>(Gesamtkosten: USD 395.069.686)</b>		
13.625	Cooper Companies Inc.	4.593.260	0,91				
28.532	Danaher Corp.	6.143.796	1,21				
29.764	Ecolab Inc.	5.948.038	1,17				
59.244	Electronic Arts Inc.	7.726.010	1,52				
11.177	Equinix Inc.	8.495.973	1,68				
49.407	Facebook Inc. - A	12.939.693	2,55				
69.918	Fidelity National Information Services Inc.	10.292.629	2,04				
24.889	Illumina Inc.	7.692.692	1,52				
16.084	Intuit Inc.	5.246.762	1,04				
74.218	JPMorgan Chase & Company	7.144.967	1,41				
19.168	Lam Research Corp.	6.358.984	1,25				
38.026	Mastercard Inc. - A	12.859.252	2,53				
119.453	Microsoft Corp.	25.124.549	4,97				
26.471	NextEra Energy Inc.	7.347.290	1,45				
22.147	Nvidia Corp.	11.986.399	2,37				
15.871	S&P Global Inc.	5.723.083	1,13				
122.463	Service Corp. International	5.165.489	1,02				
28.869	Stryker Corp.	6.015.434	1,19				
67.718	T-Mobile USA Inc.	7.744.230	1,53				
45.477	Transunion	3.825.980	0,76				
71.713	Uber Technologies Inc.	2.616.090	0,52				
27.588	Union Pacific Corp.	5.431.250	1,07				
23.332	United Health Group Inc.	7.274.218	1,44				
17.553	Vertex Pharmaceuticals Inc.	4.776.522	0,94				
51.777	Visa Inc. - A	10.353.847	2,04				
40.035	Walt Disney Company	4.967.543	0,98				
	<b>Vereinigte Staaten, insgesamt</b>	<b>310.011.222</b>	<b>61,20</b>				
	<b>Aktien, insgesamt</b>	<b>494.426.028</b>	<b>97,58</b>				
	<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt</b>	<b>494.426.028</b>	<b>97,58</b>				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies

### Portfolioaufstellung

zum 30. September 2020

Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Nettoinven- tarwerts	Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Nettoinven- tarwerts
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>			
<b>Aktien</b>				<b>Aktien (Fortsetzung)</b>			
<b>BERMUDAS</b>				<b>ITALIEN</b>			
435.399	Axalta Coating System Limited	8.231.609	0,72	436.664	Carel Industries SpA	7.877.419	0,69
	<b>Bermudas, insgesamt</b>	<b>8.231.609</b>	<b>0,72</b>	90.615	Diasorin SpA	15.576.719	1,37
<b>KANADA</b>				539.596	Fincobank Banca Fineco SpA	6.342.951	0,55
48.181	Andlauer Healthcare Group	1.338.355	0,12	204.886	GVS SpA	2.356.189	0,21
139.541	Cargojet Inc.	16.989.541	1,48	979.445	Infrastrutture Wireless Italiane SpA	9.245.961	0,81
465.979	Ritchie Bros Auctioneers Inc.	23.544.328	2,05	194.103	Marr SpA	2.666.975	0,23
	<b>Kanada, insgesamt</b>	<b>41.872.224</b>	<b>3,65</b>		<b>Italien, insgesamt</b>	<b>44.066.214</b>	<b>3,86</b>
<b>DÄNEMARK</b>				<b>JAPAN</b>			
115.551	Simcorp A/S	12.969.749	1,13	279.500	Asahi Intecc Company Limited	7.453.349	0,65
	<b>Dänemark, insgesamt</b>	<b>12.969.749</b>	<b>1,13</b>	82.800	Disco Corp.	17.001.637	1,49
<b>FINNLAND</b>				240.694	Grace Technology Inc.	10.269.633	0,90
29.501	Revenio Group Oyj	1.144.639	0,10	1.095.000	Infomart Corp.	8.229.109	0,72
	<b>Finnland, insgesamt</b>	<b>1.144.639</b>	<b>0,10</b>	115.600	IR Japan Holdings Limited	12.349.376	1,08
<b>FRANKREICH</b>				111.900	Lasertec Corp.	7.785.544	0,68
542.001	Elis SA	5.859.031	0,51	255.100	Menicon Company Limited	14.471.158	1,26
367.555	Lectra	7.424.611	0,65	199.600	Milbon Company Limited	9.000.165	0,79
85.186	Orpea	8.268.153	0,72	389.886	Nihon M&A Center Inc.	18.840.592	1,64
99.324	Remy Cointreau	15.474.679	1,35	291.400	Pigeon Corp.	11.067.337	0,96
	<b>Frankreich, insgesamt</b>	<b>37.026.474</b>	<b>3,23</b>	524.700	Raksul Inc.	18.189.639	1,59
<b>DEUTSCHLAND</b>				361.000	Square Enix Holdings Company Limited	20.303.558	1,77
186.708	CompuGroup Medical SE & Company KgaA	14.740.597	1,29	314.700	Zuken Inc.	7.191.705	0,63
331.424	CTS Eventim AG	13.681.183	1,20		<b>Japan, insgesamt</b>	<b>162.152.802</b>	<b>14,16</b>
189.620	Gerresheimer AG	18.099.229	1,58	<b>JERSEY – KANALINSELN</b>			
184.344	Grenkeleasing AG	5.814.210	0,51	746.053	Clarivate Analytics plc	19.716.183	1,72
28.568	Hypoport AG	15.255.311	1,33		<b>Jersey – Kanalinseln, insgesamt</b>	<b>19.716.183</b>	<b>1,72</b>
270.815	Nemetschek SE	16.925.938	1,48	<b>LUXEMBURG</b>			
21.077	Stratec Biomedical AG	2.621.979	0,23	16.545	Eurofins Scientific	11.174.493	0,98
	<b>Deutschland, insgesamt</b>	<b>87.138.447</b>	<b>7,62</b>		<b>Luxemburg, insgesamt</b>	<b>11.174.493</b>	<b>0,98</b>
<b>ISLAND</b>				<b>NIEDERLANDE</b>			
1.791.565	Marel HF	7.434.995	0,65	76.256	ASM International NV	9.329.922	0,82
	<b>Island, insgesamt</b>	<b>7.434.995</b>	<b>0,65</b>	80.724	IMCD Group NV	8.201.558	0,72
<b>INDIEN</b>					<b>Niederlande, insgesamt</b>	<b>17.531.480</b>	<b>1,54</b>
232.792	HDFC Asset Management Company Limited	6.107.511	0,53	<b>SCHWEDEN</b>			
	<b>Indien, insgesamt</b>	<b>6.107.511</b>	<b>0,53</b>	1.144.303	Karnov Group AB	5.887.677	0,51
					<b>Schweden, insgesamt</b>	<b>5.887.677</b>	<b>0,51</b>

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.





## Threadneedle (Lux) - American Select

### Portfolioaufstellung

zum 30. September 2020

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung</b>			
<b>Aktien</b>			
<b>VEREINIGTE STAATEN</b>			
32.714	Adobe Systems Inc.	16.043.927	4,06
44.663	Alexion Pharmaceuticals Inc.	5.110.787	1,29
22.068	Alphabet Inc. - A	32.342.861	8,19
11.178	Amazon.com Inc.	35.196.503	8,92
19.692	Analog Devices Inc.	2.298.844	0,58
26.998	Ansys Inc.	8.834.556	2,24
112.348	Apple Inc.	13.011.022	3,29
270.990	Bank of America Corp.	6.528.149	1,65
125.678	Berkshire Hathaway Inc.	26.761.873	6,77
140.119	BioMarin Pharmaceuticals Inc.	10.660.254	2,71
6.139	Booking Holdings Inc.	10.501.865	2,66
7.673	Charter Communications Inc. - A	4.790.561	1,21
350.108	Comcast Corp.	16.195.996	4,10
7.651	Curtiss-Wright Corp.	713.533	0,18
73.440	Edwards Lifesciences Corp.	5.861.981	1,48
77.537	Facebook Inc. - A	20.306.940	5,14
5.208	Heico Corp.	545.069	0,14
17.917	Illumina Inc.	5.537.786	1,40
9.370	Intuit Inc.	3.056.588	0,77
73.940	JPMorgan Chase & Company	7.118.204	1,80
51.092	Lam Research Corp.	16.949.772	4,29
37.960	Mastercard Inc. - A	12.836.933	3,25
88.844	Microchip Technology Inc.	9.129.609	2,31
167.325	Microsoft Corp.	35.193.466	8,91
103.881	Mondelez International Inc.	5.967.963	1,51
44.685	Norfolk Southern Corp.	9.562.143	2,42
206.933	Nutanix Inc. - A	4.589.774	1,16
6.760	Nvidia Corp.	3.658.647	0,93
44.167	Paypal Holdings Inc.	8.702.224	2,20
30.311	PepsiCo Inc.	4.201.105	1,06
40.175	PNC Financial Services	4.415.634	1,12
20.002	Square Inc. - A	3.251.325	0,82
312.689	Uber Technologies Inc.	11.406.895	2,89
30.210	United Health Group Inc.	9.418.572	2,38
19.204	Vertex Pharmaceuticals Inc.	5.225.792	1,32
67.716	Visa Inc. - A	13.541.169	3,43
16.252	VMware Inc. - A	2.334.925	0,59
20.394	Walt Disney Company	2.530.488	0,64
	<b>Vereinigte Staaten, insgesamt</b>	<b>394.333.735</b>	<b>99,81</b>
	<b>Aktien, insgesamt</b>	<b>394.333.735</b>	<b>99,81</b>
	<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt</b>	<b>394.333.735</b>	<b>99,81</b>
	<b>Wert der Anlagen, insgesamt</b>	<b>394.333.735</b>	<b>99,81</b>
	<b>(Gesamtkosten: USD 297.421.058)</b>		

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies

### Portfolioaufstellung

zum 30. September 2020

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts	Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>			
<b>Aktien</b>				<b>Aktien (Fortsetzung)</b>			
<b>BERMUDAS</b>				<b>VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)</b>			
92.475	Axalta Coating System Limited	2.050.171	1,02	136.583	Moelis & Company - A	4.799.527	2,38
	<b>Bermudas, insgesamt</b>	<b>2.050.171</b>	<b>1,02</b>	24.456	MSA Safety Inc.	3.281.262	1,63
				87.775	Mts Systems Corp.	1.677.380	0,83
				2.336.522	Newpark Resources	2.453.348	1,22
				20.782	Novavax Inc.	2.251.730	1,12
				27.173	PTC Inc.	2.247.750	1,12
				63.507	QTS Realty Trust Inc. - A	4.002.211	1,99
				135.017	Quanex Building Products Corp.	2.489.713	1,24
				70.727	Quanterix Corp.	2.386.329	1,19
				212.955	Qurate Retail Inc.	1.529.017	0,76
				6.388	Qurate Retail Inc.	629.218	0,31
				46.661	Sage Therapeutics Inc.	2.851.920	1,41
				257.051	Schnitzer Steel Industries Inc.	4.943.091	2,45
				21.227	SiTime Corp.	1.783.705	0,89
				86.426	Store Capital Corp.	2.370.665	1,18
				64.263	TechTarget Inc.	2.825.001	1,40
				151.080	Teradata Corp.	3.429.516	1,70
				9.108	Topbuild Corp.	1.554.645	0,77
				335.681	Virtu Financial Inc.	7.724.019	3,83
				253.213	Vishay Intertechnology Inc.	3.942.526	1,96
				53.449	Voya Financial Inc.	2.561.811	1,27
				104.229	Wendy's Company	2.323.786	1,15
				34.330	Westrock Company	1.192.624	0,59
				373.525	Willscot Mobile Mini Holdings Corp.	6.230.397	3,09
				30.306	Wingstop Inc.	4.141.315	2,06
				15.193	XPO Logistics Inc.	1.286.239	0,64
					<b>Vereinigte Staaten, insgesamt</b>	<b>183.087.547</b>	<b>90,86</b>
					<b>Aktien, insgesamt</b>	<b>199.532.393</b>	<b>99,02</b>
					<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt</b>	<b>199.532.393</b>	<b>99,02</b>
					<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren</b>		
					<b>Fonds</b>		
					<b>IRLAND</b>		
				2.012.260	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	2.012.260	1,00
					<b>Irland, insgesamt</b>	<b>2.012.260</b>	<b>1,00</b>
					<b>Fonds, insgesamt</b>	<b>2.012.260</b>	<b>1,00</b>
					<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren, insgesamt</b>	<b>2.012.260</b>	<b>1,00</b>
					<b>Wert der Anlagen, insgesamt</b>	<b>201.544.653</b>	<b>100,02</b>
					<b>(Gesamtkosten: USD 193.435.008)</b>		

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity

## Portfolioaufstellung

zum 30. September 2020

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts	Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>			
<b>Aktien</b>				<b>Aktien (Fortsetzung)</b>			
<b>AUSTRALIEN</b>				<b>HONGKONG</b>			
111.570	Amcor plc	1.225.906	0,74	340.600	AIA Group Limited	3.335.676	2,00
110.581	Aristocrat Leisure Limited	2.375.390	1,43	302.400	ASM Pacific Technology Limited	3.074.719	1,84
185.950	Australia & New Zealand Banking Group Limited	2.295.076	1,37	879.500	China Mobile Limited	5.611.767	3,37
172.508	BHP Group Limited	4.401.766	2,64	850.000	China Overseas Land & Investment Limited	2.127.738	1,28
356.083	Dexus Property Group	2.268.928	1,37	401.000	Galaxy Entertainment Group Limited	2.687.988	1,61
252.632	Lendlease Group	1.997.246	1,20	141.067	Hong Kong Exchanges and Clearing Limited	6.585.540	3,96
52.196	Macquarie Group Limited	4.473.291	2,68	1.069.000	Hua Hong Semiconductor Limited	4.075.985	2,45
12.852	Rio Tinto Limited	868.845	0,52	2.420.000	Sinopec Kantons Holdings Limited	852.463	0,51
	<b>Australien, insgesamt</b>	<b>19.906.448</b>	<b>11,95</b>		<b>Hongkong, insgesamt</b>	<b>28.351.876</b>	<b>17,02</b>
<b>KAIMANINSELN</b>				<b>INDIEN</b>			
16.736	Agora Inc.	719.313	0,43	82.489	Godrej Consumer Products Limited	810.535	0,49
56.296	Alibaba Group Holding Limited	16.549.898	9,92	20.956	Reliance Industries Limited - GDR	1.274.125	0,76
362.000	China Mengniu Dairy Company Limited	1.695.558	1,02	45.904	Tata Consultancy Services Limited	1.550.666	0,93
60.978	Dada Nexus Limited	1.614.088	0,97	273.601	Tech Mahindra Limited	2.936.116	1,76
3.116	NetEase Inc. - ADR	1.416.752	0,85	433.348	UPL Limited	2.953.833	1,77
204.100	Tencent Holdings Limited	13.470.573	8,08		<b>Indien, insgesamt</b>	<b>9.525.275</b>	<b>5,71</b>
69.988	Xpeng Inc.	1.404.659	0,84		<b>INDONESIEN</b>		
	<b>Kaimaninseln, insgesamt</b>	<b>36.870.841</b>	<b>22,11</b>	458.100	Indocement Tunggal Prakarsa Tbk Pt	320.157	0,19
<b>CHINA</b>				12.255.900	Telekomunikasi Indonesia Tbk Pt	2.108.407	1,27
5.643.000	BBMG Corp.	1.041.222	0,63		<b>Indonesien, insgesamt</b>	<b>2.428.564</b>	<b>1,46</b>
2.512.000	China Construction Bank Corp.	1.627.124	0,98		<b>MACAU</b>		
13.718.000	China Telecom Corp. Limited	4.106.541	2,46	1.295.600	Wynn Macau Limited	2.066.269	1,24
214.300	Gree Electric Appliances Inc. - A	1.683.129	1,01		<b>Macau, insgesamt</b>	<b>2.066.269</b>	<b>1,24</b>
474.500	Ping An Insurance Group Company of China Limited	4.867.442	2,92				
2.172.000	Times Property Holdings Limited	3.004.360	1,80				
460.437	Venustech Group Inc. - A	2.342.797	1,41				
	<b>China, insgesamt</b>	<b>18.672.615</b>	<b>11,21</b>				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.



## Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity

### Portfolioaufstellung

(Fortsetzung)

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts	Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren</b>			
<b>Aktien (Fortsetzung)</b>				<b>Fonds</b>			
<b>SÜDKOREA</b>				<b>IRLAND</b>			
77.171	Hana Financial Group Inc.	1.854.224	1,11	17.580	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	17.580	0,01
206.014	Hanon Systems	2.175.531	1,31		<b>Irland, insgesamt</b>	<b>17.580</b>	<b>0,01</b>
22.897	Samsung Electro-Mechanics Company Limited	2.721.417	1,63		<b>Fonds, insgesamt</b>	<b>17.580</b>	<b>0,01</b>
252.291	Samsung Electronics Company Limited	12.555.280	7,52		<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren, insgesamt</b>	<b>17.580</b>	<b>0,01</b>
13.015	SK hynix Inc.	934.814	0,56		<b>Wert der Anlagen, insgesamt</b>	<b>163.921.444</b>	<b>98,35</b>
	<b>Südkorea, insgesamt</b>	<b>20.241.266</b>	<b>12,13</b>		<b>(Gesamtkosten: USD 133.734.834)</b>		
<b>SINGAPUR</b>							
981.200	Capitamall Trust	1.387.236	0,83				
	<b>Singapur, insgesamt</b>	<b>1.387.236</b>	<b>0,83</b>				
<b>TAIWAN</b>							
6.000	Largan Precision Company Limited	696.084	0,42				
197.000	MediaTek Inc.	4.128.824	2,48				
513.000	Powertech Technology Inc.	1.528.620	0,92				
785.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	11.736.240	7,04				
339.000	Yageo Corp.	4.114.304	2,47				
	<b>Taiwan, insgesamt</b>	<b>22.204.072</b>	<b>13,33</b>				
<b>THAILAND</b>							
192.700	Bumrungrad Hospital pcl - NVDR	579.237	0,35				
3.768.500	Thai Beverage pcl	1.670.165	1,00				
	<b>Thailand, insgesamt</b>	<b>2.249.402</b>	<b>1,35</b>				
	<b>Aktien, insgesamt</b>	<b>163.903.864</b>	<b>98,34</b>				
	<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt</b>	<b>163.903.864</b>	<b>98,34</b>				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Asia Equities

## Portfolioaufstellung

zum 30. September 2020

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts	Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>			
<b>Aktien</b>				<b>Aktien (Fortsetzung)</b>			
<b>AUSTRALIEN</b>				<b>HONGKONG</b>			
234.459	Amcor plc	2.576.183	0,95	848.800	AIA Group Limited	8.312.747	3,06
171.866	Aristocrat Leisure Limited	3.691.853	1,36	170.200	ASM Pacific Technology Limited	1.730.546	0,64
240.144	Australia & New Zealand Banking Group Limited	2.963.962	1,09	242.500	China Mobile Limited	1.547.303	0,57
260.812	BHP Group Limited	6.654.957	2,45	2.267.000	Cnooc Limited	2.179.241	0,80
32.543	CSL Limited	6.694.331	2,46	1.269.600	CSPC Pharmaceutical Group Limited	2.457.285	0,90
278.841	Lendlease Group	2.204.448	0,81	653.000	Galaxy Entertainment Group Limited	4.377.198	1,61
63.268	Macquarie Group Limited	5.422.181	2,00	132.137	Hong Kong Exchanges and Clearing Limited	6.168.655	2,27
	<b>Australien, insgesamt</b>	<b>30.207.915</b>	<b>11,12</b>	498.000	Hua Hong Semiconductor Limited	1.898.822	0,70
<b>KAIMANINSELN</b>				<b>INDIEN</b>			
91.531	Alibaba Group Holding Limited	26.908.283	9,91	440.837	Bharti Airtel Limited	2.515.220	0,93
672.000	China Mengniu Dairy Company Limited	3.147.555	1,16	189.676	Godrej Consumer Products Limited	1.863.751	0,69
798.816	China Resources Land Limited	3.597.242	1,32	319.853	HDFC Bank Limited	4.676.042	1,73
135.383	Meituan Dianping - B	4.223.941	1,55	756.901	Petronet Lng Limited	2.263.656	0,83
1.071.200	Sands China Limited	4.125.839	1,52	12.974	Reliance Industries Limited	236.254	0,09
21.333	Sea Limited	3.286.135	1,21	218.491	Reliance Industries Limited	6.616.864	2,43
300.100	Tencent Holdings Limited	19.806.560	7,29		<b>Indien, insgesamt</b>	<b>18.171.787</b>	<b>6,70</b>
7.500	Wuxi Biologics Cayman Inc.	182.516	0,07	<b>INDONESIEN</b>			
67.055	Xpeng Inc.	1.345.794	0,50	5.913.100	Bank Rakyat Indonesia	1.207.975	0,44
	<b>Kaimaninseln, insgesamt</b>	<b>66.623.865</b>	<b>24,53</b>	11.395.000	Telekomunikasi Indonesia Tbk Pt	1.960.305	0,72
<b>CHINA</b>				<b>PHILIPPINEN</b>			
478.000	Anhui Conch Cement Company Limited	3.287.400	1,21	2.645.490	Ayala Land Inc.	1.620.685	0,60
2.196.000	China Construction Bank Corp.	1.422.438	0,52	1.329.105	Metropolitan Bank & Trust Company	1.047.270	0,39
815.000	China Merchants Bank Company Limited - H	3.843.638	1,41		<b>Philippinen, insgesamt</b>	<b>2.667.955</b>	<b>0,99</b>
69.437	JD.com Inc. - ADR	5.389.006	1,98	<b>INDONESIEN</b>			
23.242	New Oriental Education & Technology Group - ADR	3.474.679	1,28	<b>PHILIPPINEN</b>			
625.500	Ping An Insurance Group Company of China Limited	6.416.407	2,36	<b>INDONESIEN</b>			
137.000	Shanghai International Airport - A	1.388.515	0,51	<b>PHILIPPINEN</b>			
130.977	Wuliangye Yibin Company Limited - A	4.265.355	1,57	<b>INDONESIEN</b>			
	<b>China, insgesamt</b>	<b>29.487.438</b>	<b>10,84</b>	<b>PHILIPPINEN</b>			

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Asia Equities

### Portfolioaufstellung

(Fortsetzung)

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>			
<b>Aktien (Fortsetzung)</b>			
<b>SÜDKOREA</b>			
266.900	Hanon Systems	2.818.495	1,04
11.216	Kakao Corp.	3.495.725	1,29
129.892	Kia Motors Corp.	5.209.031	1,91
4.379	LG Chem Limited P.P. 144A	2.448.806	0,90
35.526	Samsung Electro-Mechanics Company Limited	4.222.433	1,55
306.038	Samsung Electronics Company Limited	15.230.004	5,61
9.821	Samsung Sdi Company Limited	3.640.378	1,34
33.020	SK hynix Inc.	2.371.691	0,87
	<b>Südkorea, insgesamt</b>	<b>39.436.563</b>	<b>14,51</b>
<b>SINGAPUR</b>			
1.979.600	Capitamall Trust	2.798.790	1,03
130.800	United Overseas Bank Limited	1.823.400	0,67
	<b>Singapur, insgesamt</b>	<b>4.622.190</b>	<b>1,70</b>
<b>TAIWAN</b>			
479.000	Chroma ATE Inc.	2.530.454	0,93
282.000	Delta Electronics Inc.	1.840.273	0,68
2.926.471	E.Sun Financial Holding Company Limited	2.586.757	0,95
1.144.000	Hon Hai Precision Industry Company Limited	3.057.302	1,13
292.000	MediaTek Inc.	6.119.881	2,25
1.408.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	21.050.478	7,74
	<b>Taiwan, insgesamt</b>	<b>37.185.145</b>	<b>13,68</b>
	<b>Aktien, insgesamt</b>	<b>266.944.160</b>	<b>98,25</b>
	<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt</b>	<b>266.944.160</b>	<b>98,25</b>
<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren</b>			
<b>Fonds</b>			
<b>IRELAND</b>			
230.833	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	230.833	0,08
	<b>Irland, insgesamt</b>	<b>230.833</b>	<b>0,08</b>
	<b>Fonds, insgesamt</b>	<b>230.833</b>	<b>0,08</b>
	<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren, insgesamt</b>	<b>230.833</b>	<b>0,08</b>
	<b>Wert der Anlagen, insgesamt</b>	<b>267.174.993</b>	<b>98,33</b>
<b>(Gesamtkosten: USD 209.312.357)</b>			

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.



## Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities

### Portfolioaufstellung

(Fortsetzung)

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>			
<b>Aktien (Fortsetzung)</b>			
<b>VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)</b>			
35.605	Union Pacific Corp.	7.009.556	1,63
38.585	Walt Disney Company	4.787.627	1,11
66.505	Western Digital Corp.	2.430.758	0,57
	<b>Vereinigte Staaten, insgesamt</b>	<b>399.200.881</b>	<b>92,92</b>
	<b>Aktien, insgesamt</b>	<b>425.456.521</b>	<b>99,05</b>
	<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt</b>	<b>425.456.521</b>	<b>99,05</b>
	<b>Wert der Anlagen, insgesamt</b>	<b>425.456.521</b>	<b>99,05</b>
<b>(Gesamtkosten: USD 313.259.522)</b>			

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.



## Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities

### Portfolioaufstellung

(Fortsetzung)

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>			
<b>Aktien (Fortsetzung)</b>			
<b>VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)</b>			
65	Vertex Pharmaceuticals Inc.	17.688	0,39
32	Visa Inc. - A	6.399	0,14
60	Voya Financial Inc.	2.876	0,06
320	Weyerhaeuser Company	9.126	0,20
	<b>Vereinigte Staaten, insgesamt</b>	<b>4.217.358</b>	<b>93,90</b>
	<b>Aktien, insgesamt</b>	<b>4.475.823</b>	<b>99,65</b>
	<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt</b>	<b>4.475.823</b>	<b>99,65</b>
	<b>Wert der Anlagen, insgesamt</b>	<b>4.475.823</b>	<b>99,65</b>
	<b>(Gesamtkosten: USD 4.130.590)</b>		

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Pan European Equities

## Portfolioaufstellung

zum 30. September 2020

Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Nettoinven- tarwerts	Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Nettoinven- tarwerts
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>			
<b>Aktien</b>				<b>Aktien (Fortsetzung)</b>			
<b>DÄNEMARK</b>				<b>LUXEMBURG</b>			
23.956	DSV Panalpina A/S	3.338.980	1,63	3.061	Eurofins Scientific	2.067.400	1,01
92.103	Novo Nordisk A/S	5.436.204	2,66		<b>Luxemburg, insgesamt</b>	<b>2.067.400</b>	<b>1,01</b>
32.153	Orsted A/S	3.781.285	1,85				
	<b>Dänemark, insgesamt</b>	<b>12.556.469</b>	<b>6,14</b>				
<b>FINNLAND</b>				<b>NIEDERLANDE</b>			
109.226	Neste Oil Oyj	4.911.893	2,40	28.692	ASML Holding NV	9.029.373	4,42
	<b>Finnland, insgesamt</b>	<b>4.911.893</b>	<b>2,40</b>	14.149	Ferrari NV	2.216.441	1,09
				12.465	IMCD Group NV	1.266.444	0,62
				454.921	ING Groep NV	2.755.457	1,35
				46.125	Philips NV	1.854.225	0,91
				36.919	Prosus NV	2.905.525	1,42
				119.492	Relx plc	2.273.933	1,11
					<b>Niederlande, insgesamt</b>	<b>22.301.398</b>	<b>10,92</b>
<b>FRANKREICH</b>				<b>NORWEGEN</b>			
38.272	Air Liquide SA	5.185.856	2,54	239.974	Dnb Bank ASA	2.827.968	1,39
181.265	AXA SA	2.859.637	1,40		<b>Norwegen, insgesamt</b>	<b>2.827.968</b>	<b>1,39</b>
12.519	Dassault Systemes SA	1.999.910	0,98				
18.609	L'Oréal SA	5.165.858	2,53				
7.758	Louis Vuitton Moët Hennessy SE	3.098.545	1,52				
17.888	Orpea	1.736.209	0,85				
16.516	Pernod-Ricard SA	2.248.653	1,10				
21.175	Schneider Electric SE	2.245.609	1,10				
19.964	Teleperformance	5.262.510	2,58				
48.226	Worldline SA	3.381.607	1,66				
	<b>Frankreich, insgesamt</b>	<b>33.184.394</b>	<b>16,26</b>				
<b>DEUTSCHLAND</b>				<b>SPANIEN</b>			
12.094	Adidas AG	3.339.154	1,64	66.605	Grifols SA	1.637.817	0,80
25.010	Allianz SE - Reg	4.092.136	2,00		<b>Spanien, insgesamt</b>	<b>1.637.817</b>	<b>0,80</b>
161.028	Infineon Technologies AG	3.883.190	1,90				
48.449	Knorr-Bremse AG	4.875.907	2,39				
34.143	Puma SE	2.624.231	1,28				
40.366	SAP SE	5.358.991	2,62				
36.303	Vonovia SE	2.126.630	1,04				
	<b>Deutschland, insgesamt</b>	<b>26.300.239</b>	<b>12,87</b>				
<b>IRLAND</b>				<b>SCHWEDEN</b>			
179.303	CRH plc	5.526.976	2,71	92.844	Atlas Copco AB - A	3.793.305	1,86
76.039	Kingspan Group plc	5.908.230	2,89	291.558	Sandvik AB	4.886.523	2,39
	<b>Irland, insgesamt</b>	<b>11.435.206</b>	<b>5,60</b>		<b>Schweden, insgesamt</b>	<b>8.679.828</b>	<b>4,25</b>
<b>ITALIEN</b>				<b>SCHWEIZ</b>			
516.628	Enel SpA	3.832.347	1,88	6.028	Lonza Group AG - Reg	3.181.370	1,56
214.440	Infrastrutture Wireless Italiane SpA	2.024.314	0,99	91.878	Nestle SA - Reg	9.324.482	4,56
253.417	Nexi SpA	4.338.499	2,12	3.068	Partners Group Holding AG - Reg	2.413.684	1,18
319.577	UniCredit SpA	2.251.420	1,10	20.504	Roche Holding AG	5.997.772	2,93
	<b>Italien, insgesamt</b>	<b>12.446.580</b>	<b>6,09</b>	150.692	SIG Combibloc Group AG	2.586.195	1,27
				32.325	Sika AG	6.789.803	3,32
					<b>Schweiz, insgesamt</b>	<b>30.293.306</b>	<b>14,82</b>
				<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH</b>			
				503.061	3i Group plc	5.527.189	2,71
				69.444	Ashtead Group plc	2.143.659	1,05
				44.200	Astrazeneca plc	4.120.989	2,02
				17.620	Linde plc	3.557.478	1,74
				149.149	Persimmon plc	4.066.374	1,99
				264.380	Prudential plc	3.232.384	1,58
				81.222	Rio Tinto plc	4.168.721	2,04
				212.204	St James's Place plc	2.178.041	1,07

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.



## Threadneedle (Lux) - Pan European Equities

### Portfolioaufstellung

(Fortsetzung)

Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Nettoinven- tarwerts
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>			
<b>Aktien (Fortsetzung)</b>			
<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH (Fortsetzung)</b>			
807.546	Tesco plc	1.891.860	0,93
3.142.462	Vodafone Group plc	3.557.286	1,74
	<b>Vereinigtes Königreich, insgesamt</b>	<b>34.443.981</b>	<b>16,87</b>
	<b>Aktien, insgesamt</b>	<b>203.086.479</b>	<b>99,42</b>
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt</b>			
		<b>203.086.479</b>	<b>99,42</b>
<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren</b>			
<b>Fonds</b>			
<b>IRLAND</b>			
25	BlackRock Institutional Cash Series Euro Liquidity Fund Premier	2.525	0,00
	<b>Irland, insgesamt</b>	<b>2.525</b>	<b>0,00</b>
	<b>Fonds, insgesamt</b>	<b>2.525</b>	<b>0,00</b>
	<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren, insgesamt</b>	<b>2.525</b>	<b>0,00</b>
	<b>Wert der Anlagen, insgesamt</b>	<b>203.089.004</b>	<b>99,42</b>
<b>(Gesamtkosten: EUR 176.129.367)</b>			

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend

## Portfolioaufstellung

zum 30. September 2020

Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Nettoinven- tarwerts	Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Nettoinven- tarwerts
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>			
<b>Aktien</b>				<b>Aktien (Fortsetzung)</b>			
<b>BELGIEN</b>				<b>ITALIEN</b>			
12.546	Melexis NV	833.682	1,93	171.531	Enel SpA	1.272.417	2,93
	<b>Belgien, insgesamt</b>	<b>833.682</b>	<b>1,93</b>	13.946	Finecobank Banca Fineco SpA	163.935	0,38
<b>DÄNEMARK</b>				113.958	Infrastrutture Wireless Italiane SpA	1.075.764	2,48
43.713	Tryg A/S	1.176.846	2,72	76.570	Marr SpA	1.052.072	2,43
	<b>Dänemark, insgesamt</b>	<b>1.176.846</b>	<b>2,72</b>	50.153	Snam Rete Gas SpA	220.122	0,51
<b>FINNLAND</b>				<b>ITALIEN, insgesamt</b>			
9.199	Kone Oyj	690.477	1,59	<b>3.784.310</b> <b>8,73</b>			
24.070	Neste Oil Oyj	1.082.428	2,50	<b>NIEDERLANDE</b>			
	<b>Finnland, insgesamt</b>	<b>1.772.905</b>	<b>4,09</b>	10.236	ASM International NV	1.252.374	2,89
<b>FRANKREICH</b>				32.998	Philips NV	1.326.519	3,07
7.030	Air Liquide SA	952.565	2,20	34.284	Relx plc	652.425	1,51
76.762	AXA SA	1.210.996	2,79	11.142	Unilever NV	573.813	1,33
15.747	Edenred	604.685	1,40	<b>Niederlande, insgesamt</b>			
2.028	Louis Vuitton Moet Hennessy SE	809.984	1,87	<b>3.805.131</b> <b>8,80</b>			
23.918	Nexity SA	621.390	1,43	<b>SPANIEN</b>			
6.162	Pernod-Ricard SA	838.956	1,94	112.705	Iberdrola SA	1.184.530	2,74
10.227	Schneider Electric SE	1.084.573	2,50	47.610	Inditex SA	1.133.118	2,62
24.909	Total SA	727.343	1,68	<b>Spanien, insgesamt</b>			
27.091	Verallia SA	614.966	1,42	<b>2.317.648</b> <b>5,36</b>			
7.745	Vinci SA	553.922	1,28	<b>SCHWEDEN</b>			
	<b>Frankreich, insgesamt</b>	<b>8.019.380</b>	<b>18,51</b>	29.777	Atlas Copco AB	1.064.518	2,46
<b>DEUTSCHLAND</b>				31.238	Elekta AB - B	336.483	0,78
2.763	Adidas AG	762.864	1,76	65.161	Sandvik AB	1.092.101	2,52
17.586	Brenntag AG	954.920	2,20	<b>Schweden, insgesamt</b>			
36.084	DWS Group GmbH & Company KGaA	1.060.689	2,44	<b>2.493.102</b> <b>5,76</b>			
10.768	Knorr-Bremse AG	1.083.692	2,50	<b>SCHWEIZ</b>			
8.386	SAP SE	1.113.325	2,57	127.564	Credit Suisse Group AG - Reg	1.094.516	2,53
17.722	Siemens Healthineers AG	678.753	1,57	670	Partners Group Holding AG - Reg	527.108	1,22
	<b>Deutschland, insgesamt</b>	<b>5.654.243</b>	<b>13,04</b>	3.698	Roche Holding AG	1.081.729	2,50
<b>IRLAND</b>				<b>Schweiz, insgesamt</b>			
30.226	CRH plc	931.710	2,15	<b>2.703.353</b> <b>6,25</b>			
10.232	Medtronic Inc.	906.758	2,09	<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH</b>			
	<b>Irland, insgesamt</b>	<b>1.838.468</b>	<b>4,24</b>	78.562	3i Group plc	863.170	1,99
				9.114	Astrazeneca plc	849.744	1,96
				66.890	Glaxosmithkline plc	1.070.756	2,47
				384.403	lbstock plc	661.111	1,53
				6.973	London Stock Exchange Group plc	682.338	1,58

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend

### Portfolioaufstellung

(Fortsetzung)

Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Nettoinven- tarwerts
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>			
<b>Aktien (Fortsetzung)</b>			
<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH (Fortsetzung)</b>			
545.527	M&G plc	959.268	2,22
19.984	Persimmon plc	544.840	1,26
16.661	Rio Tinto plc	855.126	1,97
147.571	Signature Aviation plc	388.669	0,90
125.297	St James's Place plc	1.286.036	2,97
326.481	Vodafone Group plc	369.578	0,85
	<b>Vereinigtes Königreich, insgesamt</b>	<b>8.530.636</b>	<b>19,70</b>
	<b>Aktien, insgesamt</b>	<b>42.929.704</b>	<b>99,13</b>
	<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt</b>	<b>42.929.704</b>	<b>99,13</b>
	<b>Wert der Anlagen, insgesamt</b>	<b>42.929.704</b>	<b>99,13</b>
	(Gesamtkosten: EUR 42.423.680)		

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities

## Portfolioaufstellung

zum 30. September 2020

Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Nettoinven- tarwerts	Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Nettoinven- tarwerts
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>			
<b>Aktien</b>				<b>Aktien (Fortsetzung)</b>			
<b>ÖSTERREICH</b>				<b>DEUTSCHLAND (Fortsetzung)</b>			
44.232	Do & Company AG	1.543.697	0,21	27.439	Dermapharm Holding SE	1.251.218	0,17
	<b>Österreich, insgesamt</b>	<b>1.543.697</b>	<b>0,21</b>	126.202	Gerresheimer AG	12.045.981	1,64
<b>BELGIEN</b>				116.670	Grenkeleasing AG	3.679.772	0,50
151.242	Barco NV	2.707.232	0,37	15.864	Hypoport AG	8.471.376	1,15
483.523	Fagron	10.405.415	1,42	115.320	Nemetschek SE	7.207.500	0,98
160.644	Melexis NV	10.674.793	1,46	147.576	Norma Group	3.910.764	0,53
103.767	Umicore SA	3.688.917	0,50	48.889	Puma SE	3.757.609	0,51
	<b>Belgien, insgesamt</b>	<b>27.476.357</b>	<b>3,75</b>	22.732	Sartorius AG	7.965.293	1,08
<b>DÄNEMARK</b>				145.413	Stabilus GmbH	7.292.461	0,99
125.675	Simcorp A/S	14.106.093	1,92	85.843	Stratec Biomedical AG	10.678.869	1,45
	<b>Dänemark, insgesamt</b>	<b>14.106.093</b>	<b>1,92</b>	245.924	TeamViewer AG	10.358.319	1,41
<b>FINNLAND</b>				35.597	Varta AG	4.264.521	0,58
282.521	Huhtamaki Oyj	11.916.736	1,62		<b>Deutschland, insgesamt</b>	<b>131.575.534</b>	<b>17,89</b>
27.360	Revenio Group Oyj	1.061.568	0,14	<b>ISLAND</b>			
327.923	Tikkurila Oyj	4.899.170	0,67	1.609.244	Marel HF	6.678.363	0,91
143.948	Vaisala Oyj	5.318.879	0,72		<b>Island, insgesamt</b>	<b>6.678.363</b>	<b>0,91</b>
	<b>Finnland, insgesamt</b>	<b>23.196.353</b>	<b>3,15</b>	<b>IRLAND</b>			
<b>FRANKREICH</b>				2.168.017	Dalata Hotel Group Limited	5.365.842	0,73
243.566	Bureau Veritas SA	4.691.081	0,64	1.651.681	Irish Continental Group plc	5.136.728	0,70
69.593	Edenred	2.672.371	0,36	49.224	Kingspan Group plc	3.819.782	0,52
747.246	Elis SA	8.077.729	1,10		<b>Irland, insgesamt</b>	<b>14.322.352</b>	<b>1,95</b>
367.258	Korian-Medica	10.995.705	1,50	<b>ISLE OF MAN</b>			
349.036	Lectra	7.050.527	0,96	2.479.364	Strix Group plc	6.642.161	0,90
78.802	Orpea	7.648.522	1,04		<b>Isle of Man, insgesamt</b>	<b>6.642.161</b>	<b>0,90</b>
39.237	Remy Cointreau	6.113.125	0,83	<b>ITALIEN</b>			
204.302	Verallia SA	4.637.655	0,63	669.757	Carel Industries SpA	12.082.416	1,64
	<b>Frankreich, insgesamt</b>	<b>51.886.715</b>	<b>7,06</b>	76.334	Diasorin SpA	13.121.815	1,79
<b>DEUTSCHLAND</b>				915.231	Finacobank Banca Fineco SpA	10.758.540	1,46
60.551	Brenntag AG	3.287.919	0,45	342.240	GVS SpA	3.935.760	0,54
286.410	Cancom AG	12.630.681	1,72	1.014.616	Infrastrutture Wireless Italiane SpA	9.577.975	1,30
59.085	Carl Zeiss Meditec AG	6.381.180	0,87	189.353	Marr SpA	2.601.710	0,35
193.588	CompuGroup Medical SE & Company KgaA	15.283.772	2,08	554.655	Nexi SpA	9.495.694	1,29
317.546	CTS Eventim AG	13.108.299	1,78		<b>Italien, insgesamt</b>	<b>61.573.910</b>	<b>8,37</b>

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.



## Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities

### Portfolioaufstellung

(Fortsetzung)

Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Nettoinven- tarwerts
<b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>			
<b>Aktien</b>			
<b>DÄNEMARK</b>			
49.761	Ow Bunker A/S	0	0,00
	<b>Dänemark, insgesamt</b>	<b>0</b>	<b>0,00</b>
	<b>Aktien, insgesamt</b>	<b>0</b>	<b>0,00</b>
	<b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, insgesamt</b>	<b>0</b>	<b>0,00</b>
<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren</b>			
<b>Fonds</b>			
<b>IRLAND</b>			
110.825	BlackRock Institutional Cash Series Euro Liquidity Fund Premier	10.994.175	1,50
	<b>Irland, insgesamt</b>	<b>10.994.175</b>	<b>1,50</b>
	<b>Fonds, insgesamt</b>	<b>10.994.175</b>	<b>1,50</b>
	<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren, insgesamt</b>	<b>10.994.175</b>	<b>1,50</b>
	<b>Wert der Anlagen, insgesamt</b>	<b>733.274.701</b>	<b>99,72</b>
<b>(Gesamtkosten: EUR 591.319.037)</b>			







## Threadneedle (Lux) - European Select

### Portfolioaufstellung

zum 30. September 2020

Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Nettoinven- tarwerts	Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Nettoinven- tarwerts
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>			
<b>Aktien</b>				<b>Aktien (Fortsetzung)</b>			
<b>DÄNEMARK</b>				<b>NIEDERLANDE (Fortsetzung)</b>			
296.600	DSV Panalpina A/S	41.340.018	2,69	1.470.983	Philips NV	59.133.517	3,85
1.045.705	Novo Nordisk A/S	61.720.754	4,02	789.119	Relx plc	15.016.935	0,98
	<b>Dänemark, insgesamt</b>	<b>103.060.772</b>	<b>6,71</b>		<b>Niederlande, insgesamt</b>	<b>247.638.717</b>	<b>16,14</b>
<b>FINNLAND</b>				<b>SPANIEN</b>			
313.045	Kone Oyj	23.497.158	1,53	495.294	Amadeus IT Holding SA - A	23.571.041	1,54
	<b>Finnland, insgesamt</b>	<b>23.497.158</b>	<b>1,53</b>	712.933	Grifols SA - ADR	10.548.235	0,69
				2.126.693	Inditex SA	50.615.293	3,30
<b>FRANKREICH</b>				<b>Spanien, insgesamt</b>			
214.727	Air Liquide SA	29.095.509	1,90			<b>84.734.569</b>	<b>5,53</b>
662.133	Bureau Veritas SA	12.752.682	0,83	<b>SCHWEDEN</b>			
187.676	Dassault Systemes SA	29.981.241	1,95	1.062.296	Atlas Copco AB - A	43.401.975	2,83
2.550.630	Elis SA	27.572.310	1,79	1.564.510	Epiroc AB - A	19.401.338	1,26
69.233	Essilor International SA	8.041.413	0,52	2.306.271	Sandvik AB	38.653.190	2,52
207.317	Legrand SA	14.134.873	0,92		<b>Schweden, insgesamt</b>	<b>101.456.503</b>	<b>6,61</b>
193.679	L'Oreal SA	53.765.290	3,50	<b>SCHWEIZ</b>			
63.344	Louis Vuitton Moet Hennessy SE	25.299.594	1,65	105.308	Lonza Group AG - Reg	55.577.922	3,62
193.679	Pernod-Ricard SA	26.369.396	1,72	798.295	Nestle SA - Reg	81.017.077	5,28
223.878	Schneider Electric SE	23.742.262	1,55	202.946	Roche Holding AG	59.365.195	3,87
233.396	Ubisoft Entertainment SA	17.985.496	1,17	135.436	Schindler Holding AG	31.615.947	2,06
1.072.417	Worldline SA	75.197.880	4,89	203.667	Sika AG	42.779.855	2,79
	<b>Frankreich, insgesamt</b>	<b>343.937.946</b>	<b>22,39</b>	884.208	STMicroelectronics NV	23.210.460	1,51
<b>DEUTSCHLAND</b>				<b>Schweiz, insgesamt</b>			
156.533	Adidas AG	43.218.761	2,81			<b>293.566.456</b>	<b>19,13</b>
1.346.319	Brenntag AG	73.105.121	4,76	<b>Aktien, insgesamt</b>			
405.266	Knorr-Bremse AG	40.785.970	2,66			<b>1.509.971.383</b>	<b>98,37</b>
619.213	SAP SE	82.206.717	5,36	<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt</b>			
879.542	Siemens Healthineers AG	33.686.459	2,19			<b>1.509.971.383</b>	<b>98,37</b>
	<b>Deutschland, insgesamt</b>	<b>273.003.028</b>	<b>17,78</b>	<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren</b>			
<b>ITALIEN</b>				<b>Fonds</b>			
1.836.291	Infrastrutture Wireless Italiane SpA	17.334.587	1,13	<b>IRLAND</b>			
1.269.956	Nexi SpA	21.741.647	1,42	220.075	BlackRock Institutional Cash Series Euro Liquidity Fund Premier	21.832.031	1,43
	<b>Italien, insgesamt</b>	<b>39.076.234</b>	<b>2,55</b>	1.020.408	Insight Liquidity Funds plc	995.612	0,06
<b>NIEDERLANDE</b>				<b>Irland, insgesamt</b>			
5.271	Adyen NV	8.288.648	0,54			<b>22.827.643</b>	<b>1,49</b>
171.576	ASML Holding NV	53.994.967	3,52	<b>Fonds, insgesamt</b>			
3.934.741	Davide Campari-Milano NV	36.667.851	2,39			<b>22.827.643</b>	<b>1,49</b>
382.521	IMCD Group NV	38.864.133	2,53	<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren, insgesamt</b>			
196.613	Just Eat Takeaway	18.827.661	1,23			<b>22.827.643</b>	<b>1,49</b>
119.808	Koninklijke DSM NV	16.845.005	1,10	<b>Wert der Anlagen, insgesamt</b>			
						<b>1.532.799.026</b>	<b>99,86</b>
				<b>(Gesamtkosten: EUR 1.295.115.062)</b>			

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies

## Portfolioaufstellung

zum 30. September 2020

Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Nettoinven- tarwerts	Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Nettoinven- tarwerts
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>			
<b>Aktien</b>				<b>Aktien (Fortsetzung)</b>			
<b>ÖSTERREICH</b>				<b>DEUTSCHLAND</b>			
119.964	Do & Company AG	4.186.744	0,24	682.511	Brenntag AG	37.060.347	2,09
	<b>Österreich, insgesamt</b>	<b>4.186.744</b>	<b>0,24</b>	265.557	Cancom AG	11.711.064	0,66
				120.488	Carl Zeiss Meditec AG	13.012.704	0,73
				577.111	CompuGroup Medical SE & Company KgaA	45.562.914	2,58
<b>BELGIEN</b>				828.803	CTS Eventim AG	34.212.988	1,93
318.794	Barco NV	5.706.413	0,32	77.246	Dermapharm Holding SE	3.522.418	0,20
562.957	Melexis NV	37.408.493	2,12	308.516	Gerresheimer AG	29.447.852	1,66
572.966	Umicore SA	20.368.941	1,15	348.835	Grenkeleasing AG	11.002.256	0,62
	<b>Belgien, insgesamt</b>	<b>63.483.847</b>	<b>3,59</b>	39.591	Hypoport AG	21.141.594	1,19
				323.539	Knorr-Bremse AG	32.560.965	1,84
<b>DÄNEMARK</b>				502.346	Nemetschek SE	31.396.625	1,77
448.225	Simcorp A/S	50.309.956	2,84	606.081	Norma Group	16.061.146	0,91
865.760	Tryg A/S	23.308.088	1,32	301.116	Puma SE	23.143.776	1,31
	<b>Dänemark, insgesamt</b>	<b>73.618.044</b>	<b>4,16</b>	120.317	Sartorius AG	42.159.077	2,37
				276.934	Stabilus GmbH	13.888.240	0,78
<b>FINNLAND</b>				279.637	Stratec Biomedical AG	34.786.843	1,97
268.003	Cargotec Corp.	7.884.648	0,45	543.627	TeamViewer AG	22.897.569	1,29
823.149	Huhtamaki Oyj	34.720.425	1,97	96.954	Varta AG	11.615.089	0,66
405.817	Konecranes Oyj	10.859.663	0,61		<b>Deutschland, insgesamt</b>	<b>435.183.467</b>	<b>24,56</b>
72.983	Revenio Group Oyj	2.831.740	0,16				
1.078.052	Tikkurila Oyj	16.106.097	0,91	<b>ISLAND</b>			
473.525	Vaisala Oyj	17.496.749	0,99	4.035.650	Marel HF	16.747.947	0,96
	<b>Finnland, insgesamt</b>	<b>89.899.322</b>	<b>5,09</b>		<b>Island, insgesamt</b>	<b>16.747.947</b>	<b>0,96</b>
<b>FRANKREICH</b>				<b>IRLAND</b>			
1.607.275	Bureau Veritas SA	30.956.116	1,74	3.258.123	Dalata Hotel Group Limited	8.063.854	0,46
353.046	Edenred	13.556.966	0,77	6.086.142	Irish Continental Group plc	18.927.902	1,06
1.958.096	Elis SA	21.167.018	1,20	641.991	Kingspan Group plc	49.818.501	2,82
72.851	Ingenico	9.638.187	0,54		<b>Irland, insgesamt</b>	<b>76.810.257</b>	<b>4,34</b>
277.707	Korian-Medica	8.314.548	0,47				
354.383	Nexity SA	9.206.870	0,52	<b>ITALIEN</b>			
332.380	Orpea	32.260.803	1,82	225.744	Diasorin SpA	38.805.393	2,20
151.774	Remy Cointreau	23.646.389	1,34	3.523.829	Fincobank Banca Fineco SpA	41.422.610	2,34
130.607	SEB SA	18.141.312	1,02	976.416	GVS SpA	11.228.784	0,63
10.775	Somfy SA	1.295.155	0,07	3.967.867	Infrastrutture Wireless Italiane SpA	37.456.664	2,12
58.569	Teleperformance	15.438.788	0,87	997.535	Marr SpA	13.706.131	0,77
198.868	Ubisoft Entertainment SA	15.324.768	0,87	1.795.669	Nexi SpA	30.741.853	1,73
486.191	Verallia SA	11.036.536	0,62		<b>Italien, insgesamt</b>	<b>173.361.435</b>	<b>9,79</b>
	<b>Frankreich, insgesamt</b>	<b>209.983.456</b>	<b>11,85</b>				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies

### Portfolioaufstellung

(Fortsetzung)

Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Nettoinven- tarwerts	Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Nettoinven- tarwerts	
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				
<b>Aktien (Fortsetzung)</b>				<b>Aktien (Fortsetzung)</b>				
<b>LUXEMBURG</b>				<b>VEREINIGTE STAATEN</b>				
72.511	Eurofins Scientific	48.973.929	2,77	53.908	Autoliv Inc.	3.390.052	0,19	
231.897	Solutions 30 SE	4.157.913	0,23					
	<b>Luxemburg, insgesamt</b>	<b>53.131.842</b>	<b>3,00</b>		<b>Vereinigte Staaten, insgesamt</b>	<b>3.390.052</b>	<b>0,19</b>	
<b>NIEDERLANDE</b>				<b>Aktien, insgesamt</b>				
238.081	ASM International NV	29.129.210	1,64			<b>1.737.136.055</b>	<b>98,09</b>	
3.049.727	Davide Campari-Milano NV	28.420.406	1,60		<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt</b>	<b>1.737.136.055</b>	<b>98,09</b>	
488.106	IMCD Group NV	49.591.570	2,80					
413.764	Just Eat Takeaway	39.622.041	2,24		<b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>			
77.224	Shop Apotheke Europe NV	11.537.266	0,65		<b>Aktien</b>			
	<b>Niederlande, insgesamt</b>	<b>158.300.493</b>	<b>8,93</b>		<b>DÄNEMARK</b>			
<b>SPANIEN</b>					280.528	Ow Bunker A/S	0	0,00
1.203.059	Applus Services SA	7.693.562	0,43		<b>Dänemark, insgesamt</b>	<b>0</b>	<b>0,00</b>	
1.725.130	Fluidra SA	24.979.882	1,41		<b>Aktien, insgesamt</b>	<b>0</b>	<b>0,00</b>	
	<b>Spanien, insgesamt</b>	<b>32.673.444</b>	<b>1,84</b>		<b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, insgesamt</b>	<b>0</b>	<b>0,00</b>	
<b>SCHWEDEN</b>								
1.988.937	Avanza Bank Holding AB	33.315.709	1,88		<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren</b>			
2.169.313	Elekta AB - B	23.366.946	1,32		<b>Fonds</b>			
110.064	Stillfront Group AB	11.787.475	0,67		<b>IRLAND</b>			
584.935	Thule Group AB	16.541.720	0,93		366.869	BlackRock Institutional Cash Series Euro Liquidity Fund Premier	36.394.445	2,06
	<b>Schweden, insgesamt</b>	<b>85.011.850</b>	<b>4,80</b>		<b>Irland, insgesamt</b>	<b>36.394.445</b>	<b>2,06</b>	
<b>SCHWEIZ</b>						<b>Fonds, insgesamt</b>	<b>36.394.445</b>	<b>2,06</b>
6.476	Belimo Holding AG - Reg	41.836.002	2,36		<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren, insgesamt</b>	<b>36.394.445</b>	<b>2,06</b>	
65.403	Burckhardt Compression Holding AG	14.144.503	0,80		<b>Wert der Anlagen, insgesamt</b>	<b>1.773.530.500</b>	<b>100,15</b>	
14.795	Inficon Holding AG	10.436.687	0,59		<b>(Gesamtkosten: EUR 1.358.856.635)</b>			
16.885	LEM Holding SA	27.050.540	1,53					
2.841.886	SIG Combibloc Group AG	48.772.796	2,75					
215.968	Sika AG	45.363.656	2,56					
45.508	Tecan Group AG - Reg	19.388.068	1,09					
280.313	Vat Group AG	45.818.059	2,59					
41.839	Zur Rose Group AG	8.543.544	0,48					
	<b>Schweiz, insgesamt</b>	<b>261.353.855</b>	<b>14,75</b>					

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income

## Portfolioaufstellung

zum 30. September 2020

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts	Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>			
<b>Aktien</b>				<b>Aktien (Fortsetzung)</b>			
<b>AUSTRALIEN</b>				<b>INDIEN</b>			
42.325	Aristocrat Leisure Limited	909.183	1,87	156.200	Embassy Office Parks REIT	763.819	1,57
52.177	Australia & New Zealand Banking Group Limited	643.991	1,32	48.543	HDFC Bank Limited	709.667	1,47
21.530	BHP Group Limited	549.366	1,13	234.141	Petronet Lng Limited	700.243	1,44
98.968	Dexus Property Group	630.615	1,30	<b>Indien, insgesamt</b>			
126.256	Fortescue Metals Group Limited	1.475.052	3,03	<b>2.173.729 4,48</b>			
15.156	Macquarie Group Limited	1.298.896	2,67	<b>INDONESIEN</b>			
118.690	Oz Minerals Limited	1.191.845	2,45	2.972.000	Telekomunikasi Indonesia Tbk Pt	511.279	1,05
127.341	Sydney Airport Finance Company Pty Limited	534.852	1,10	<b>Indonesien, insgesamt</b>			
75.736	Transurban Group	765.945	1,57	<b>511.279 1,05</b>			
<b>Australien, insgesamt</b>				<b>MACAU</b>			
<b>7.999.745 16,44</b>				457.600	Wynn Macau Limited	729.797	1,50
<b>KAIMANINSELN</b>				<b>Macau, insgesamt</b>			
203.000	China Mengniu Dairy Company Limited	950.824	1,95	<b>729.797 1,50</b>			
952.000	China Resources Cement Holdings Limited	1.299.631	2,67	<b>SÜDKOREA</b>			
262.000	China Resources Land Limited	1.179.843	2,42	51.328	Hanon Systems	542.030	1,11
1.833	NetEase Inc. - ADR	833.410	1,71	14.007	KB Financial Group Inc.	449.735	0,93
242.800	Sands China Limited	935.170	1,92	33.051	Kia Motors Corp.	1.325.437	2,72
18.300	Tencent Holdings Limited	1.207.798	2,48	7.352	LG Corp.	465.828	0,96
<b>Kaimaninseln, insgesamt</b>				86.374	Samsung Electronics Company Limited Pfd	3.729.719	7,67
<b>6.406.676 13,15</b>				<b>Südkorea, insgesamt</b>			
<b>CHINA</b>				<b>6.512.749 13,39</b>			
503.900	Baoshan Iron & Steel Company Limited - A	370.521	0,76	<b>SINGAPUR</b>			
1.030.000	China Construction Bank Corp.	667.173	1,37	479.800	Capitamall Trust	678.349	1,39
198.500	China Merchants Bank Company Limited - H	936.150	1,93	404.800	Comfortdelgro Corp. Limited	418.114	0,86
123.500	Ping An Insurance Group Company of China Limited	1.266.868	2,60	24.400	United Overseas Bank Limited	340.145	0,70
263.000	Times Property Holdings Limited	363.788	0,75	<b>Singapur, insgesamt</b>			
36.900	Wuliangye Yibin Company Limited - A	1.201.673	2,47	<b>1.436.608 2,95</b>			
<b>China, insgesamt</b>				<b>TAIWAN</b>			
<b>4.806.173 9,88</b>				195.000	Chroma ATE Inc.	1.030.143	2,12
<b>HONGKONG</b>				51.000	Delta Electronics Inc.	332.815	0,68
171.000	AIA Group Limited	1.674.694	3,45	272.000	Hon Hai Precision Industry Company Limited	726.911	1,49
155.000	China Mobile Limited	988.998	2,03	70.000	MediaTek Inc.	1.467.095	3,02
521.000	Cnooc Limited	500.831	1,03	175.000	Powertech Technology Inc.	521.459	1,07
34.722	Hong Kong Exchanges and Clearing Limited	1.620.954	3,34	306.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	4.574.890	9,41
46.500	Sun Hung Kai Properties Limited	592.799	1,22	62.000	Yageo Corp.	752.469	1,55
622.000	Xinyi Glass Holdings Limited	1.250.418	2,57	<b>Taiwan, insgesamt</b>			
<b>Hongkong, insgesamt</b>				<b>9.405.782 19,34</b>			
<b>6.628.694 13,64</b>							

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income

### Portfolioaufstellung

(Fortsetzung)

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>			
<b>Aktien (Fortsetzung)</b>			
<b>THAILAND</b>			
324.900	Intouch Holdings plc - NVDR	525.476	1,08
	<b>Thailand, insgesamt</b>	<b>525.476</b>	<b>1,08</b>
	<b>Aktien, insgesamt</b>	<b>47.136.708</b>	<b>96,90</b>
	<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt</b>	<b>47.136.708</b>	<b>96,90</b>
	<b>Wert der Anlagen, insgesamt</b>	<b>47.136.708</b>	<b>96,90</b>
<b>(Gesamtkosten: USD 40.456.619)</b>			

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.



## Threadneedle (Lux) - Global Technology

### Portfolioaufstellung

(Fortsetzung)

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>			
<b>Aktien (Fortsetzung)</b>			
<b>VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)</b>			
25.477	Salesforce.com Inc.	6.402.880	1,78
69.302	Sciplay Corp. - A	1.124.078	0,31
8.601	Splunk Inc.	1.618.106	0,45
107.467	Synaptics Inc.	8.642.496	2,41
70.747	Synopsys Inc.	15.138.444	4,22
17.788	Tenable Holdings Inc.	671.497	0,19
188.218	Teradyne Inc.	14.955.802	4,17
20.900	Twitter Inc.	930.050	0,26
30.582	Verint Systems Inc.	1.473.441	0,41
57.814	Visa Inc. - A	11.561.065	3,22
191.147	Western Digital Corp.	6.986.423	1,95
308.061	Xperi Holding Corp.	3.539.621	0,99
	<b>Vereinigte Staaten, insgesamt</b>	<b>321.553.241</b>	<b>89,55</b>
	<b>Aktien, insgesamt</b>	<b>360.650.039</b>	<b>100,44</b>
	<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt</b>	<b>360.650.039</b>	<b>100,44</b>
	<b>Wert der Anlagen, insgesamt</b>	<b>360.650.039</b>	<b>100,44</b>
	<b>(Gesamtkosten: USD 274.508.286)</b>		

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.







## Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity

## Portfolioaufstellung

zum 30. September 2020

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts	Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>			
<b>Aktien</b>				<b>Aktien (Fortsetzung)</b>			
<b>ÄGYPTEN</b>				<b>NIGERIA</b>			
488.200	Cleopatra Hospital	154.886	2,43	453.200	Dangote Cement plc	167.993	2,64
143.809	Commercial International Bank	607.357	9,53	2.904.587	Guaranty Trust Bank plc	211.343	3,32
125.083	Credit Agricole	210.404	3,30	858.602	MTN Nigeria Communications plc	287.311	4,51
279.117	Eastern Tobacco	213.412	3,35	85.471	Nestle Nigeria plc	260.511	4,09
283.225	Edita Food Industries SAE	166.773	2,62	140.400	Seplat Petroleum Development	105.275	1,65
188.130	ElSewedy Electric Company	81.889	1,29	161.547.689	Standard Alliance Insurance*	0	0,00
242.386	Ibnsina Pharma SAE	112.119	1,76	4.823.000	Zenith Bank plc	223.319	3,51
128.809	Juhayna Food Industries	51.900	0,82		<b>Nigeria, insgesamt</b>	<b>1.255.752</b>	<b>19,72</b>
233.781	Obour Land for Food Industries	81.438	1,28				
	<b>Ägypten, insgesamt</b>	<b>1.680.178</b>	<b>26,38</b>		<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH</b>		
				87.300	Vivo Energy plc	84.646	1,33
					<b>Vereinigtes Königreich, insgesamt</b>	<b>84.646</b>	<b>1,33</b>
					<b>Aktien, insgesamt</b>	<b>6.214.356</b>	<b>97,58</b>
					<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt</b>	<b>6.214.356</b>	<b>97,58</b>
					<b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>		
					<b>Aktien</b>		
					<b>TANSANIA</b>		
				14.050	Tanzania Breweries Limited	66.006	1,04
					<b>Tansania, insgesamt</b>	<b>66.006</b>	<b>1,04</b>
					<b>SIMBABWE</b>		
				193.596	Afrasia Zimbabwe Holdings Limited*	0	0,00
					<b>Simbabwe, insgesamt</b>	<b>0</b>	<b>0,00</b>
					<b>Aktien, insgesamt</b>	<b>66.006</b>	<b>1,04</b>
					<b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, insgesamt</b>	<b>66.006</b>	<b>1,04</b>
					<b>Wert der Anlagen, insgesamt</b>	<b>6.280.362</b>	<b>98,62</b>
					<b>(Gesamtkosten: USD 7.579.598)</b>		

\*Wertpapiere zum beizulegenden Zeitwert.

## Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha

### Portfolioaufstellung

zum 30. September 2020

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts	Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung</b>				<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren</b>			
<b>Aktien</b>				<b>Fonds</b>			
<b>VEREINIGTE STAATEN</b>				<b>IRLAND</b>			
7.513	Adobe Systems Inc.	3.684.601	4,20	5.920.389	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	5.920.389	6,75
15.518	Alexion Pharmaceuticals Inc.	1.775.725	2,02		<b>Irland, insgesamt</b>	<b>5.920.389</b>	<b>6,75</b>
3.669	Alphabet Inc. - A	5.377.286	6,13		<b>Fonds, insgesamt</b>	<b>5.920.389</b>	<b>6,75</b>
1.477	Amazon.com Inc.	4.650.675	5,30		<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren, insgesamt</b>	<b>5.920.389</b>	<b>6,75</b>
8.725	Analog Devices Inc.	1.018.557	1,16		<b>Wert der Anlagen, insgesamt</b>	<b>83.684.549</b>	<b>95,38</b>
32.672	Apple Inc.	3.783.744	4,31		<b>(Gesamtkosten: USD 58.184.035)</b>		
67.786	Bank of America Corp.	1.632.965	1,86				
15.914	Berkshire Hathaway Inc.	3.388.727	3,86				
38.436	BioMarin Pharmaceuticals Inc.	2.924.210	3,33				
1.088	Booking Holdings Inc.	1.861.220	2,12				
3.249	Charter Communications Inc. - A	2.028.481	2,31				
44.598	Comcast Corp.	2.063.103	2,35				
3.985	Curtiss-Wright Corp.	371.641	0,42				
24.822	Edwards Lifesciences Corp.	1.981.292	2,26				
15.978	Facebook Inc. - A	4.184.638	4,77				
9.213	Heico Corp.	964.233	1,10				
5.595	Illumina Inc.	1.729.303	1,97				
2.223	Intuit Inc.	725.165	0,83				
24.648	JPMorgan Chase & Company	2.372.863	2,71				
10.028	Lam Research Corp.	3.326.788	3,79				
9.944	Mastercard Inc. - A	3.362.762	3,83				
8.252	Microchip Technology Inc.	847.976	0,97				
9.148	Microsoft Corp.	1.924.099	2,19				
3.337	Mondelez International Inc.	191.711	0,22				
14.406	Norfolk Southern Corp.	3.082.740	3,51				
92.846	Nutanix Inc. - A	2.059.324	2,35				
3.763	Nvidia Corp.	2.036.611	2,32				
10.508	Paypal Holdings Inc.	2.070.391	2,36				
5.964	Square Inc. - A	969.448	1,10				
85.029	Uber Technologies Inc.	3.101.858	3,54				
1.909	United Health Group Inc.	595.169	0,68				
9.016	Vertex Pharmaceuticals Inc.	2.453.434	2,80				
14.591	Visa Inc. - A	2.917.762	3,33				
10.394	VMware Inc. - A	1.493.306	1,70				
6.547	Walt Disney Company	812.352	0,93				
	<b>Vereinigte Staaten, insgesamt</b>	<b>77.764.160</b>	<b>88,63</b>				
	<b>Aktien, insgesamt</b>	<b>77.764.160</b>	<b>88,63</b>				
	<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt</b>	<b>77.764.160</b>	<b>88,63</b>				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.



## Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities

### Portfolioaufstellung

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Nettoinven- tarwerts	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Nettoinven- tarwerts		
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>					
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>					
<b>DEUTSCHLAND</b>				<b>INDIEN (Fortsetzung)</b>					
EUR	325.000	Adler Real Estate AG 1.50% 06/12/2021	319.683	0,03	USD	8.251.000	GMR Hyderabad International Airport Limited 4.25% 27/10/2027	6.268.395	0,53
EUR	6.600.000	Adler Real Estate AG 1.88% 27/04/2023	6.387.287	0,53			<b>Indien, insgesamt</b>	<b>14.615.463</b>	<b>1,24</b>
EUR	2.300.000	Adler Real Estate AG 2.13% 06/02/2024	2.212.672	0,19			<b>IRLAND</b>		
EUR	1.200.000	Adler Real Estate AG 3.00% 27/04/2026	1.181.592	0,10	EUR	4.767.000	AIB Group plc FRN 19/11/2029	4.615.191	0,39
EUR	4.200.000	Alstria office REIT-AG 0.50% 26/09/2025	4.139.654	0,35	EUR	1.181.000	AIB Group plc Perp FRN	1.180.459	0,10
EUR	4.200.000	Bayer AG 1.13% 06/01/2030	4.269.829	0,36	EUR	3.009.000	Bank of Ireland Group plc FRN 14/10/2029	2.971.938	0,25
EUR	4.790.000	Cheplapharm Arzneimittel GmbH 3.50% 11/02/2027	4.625.873	0,39	EUR	7.369.000	Eircom Finance DAC 3.50% 15/05/2026	7.368.079	0,62
EUR	9.228.000	Commerzbank AG 0.50% 04/12/2026	9.302.531	0,79	USD	3.060.000	GE Capital International Funding Company 4.42% 15/11/2035	2.756.957	0,23
EUR	7.428.000	Commerzbank AG 1.00% 04/03/2026	7.679.612	0,65	GBP	1.340.000	Virgin Media Vendor Financing Notes III DAC 4.88% 15/07/2028	1.494.138	0,13
EUR	3.400.000	Commerzbank AG FRN 05/12/2030	3.485.210	0,29			<b>Irland, insgesamt</b>	<b>20.386.762</b>	<b>1,72</b>
EUR	5.166.000	Consus Real Estate AG 9.63% 15/05/2024	5.535.963	0,47			<b>ITALIEN</b>		
USD	2.245.000	Deutsche Bank FRN 18/09/2024	1.924.383	0,16	EUR	3.107.000	Aeroporti di Roma SpA 1.63% 08/06/2027	3.049.130	0,26
EUR	7.498.000	Deutsche Bank AG FRN 10/06/2026	7.828.167	0,66	EUR	3.800.000	Autostrade per l'Italia SpA 1.88% 26/09/2029	3.550.795	0,30
EUR	3.987.000	HT Troplast GmbH 9.25% 15/07/2025	4.253.414	0,36	EUR	1.800.000	Banca Monte dei Paschi di Siena SpA FRN 10/09/2030	1.745.839	0,15
EUR	2.159.000	Innogy Finance BV 5.75% 14/02/2033	3.456.453	0,29	EUR	3.870.000	Banco BPM SpA 1.75% 24/04/2023	3.918.338	0,33
EUR	2.288.000	K+S AG 4.13% 06/12/2021	2.304.973	0,20	EUR	11.599.000	Banco BPM SpA 2.00% 08/03/2022	11.759.896	1,01
EUR	3.800.000	Platin 1426 GmbH 5.38% 15/06/2023	3.600.011	0,30	EUR	3.634.000	FCA Bank SpA 0.50% 13/09/2024	3.619.155	0,31
EUR	2.029.000	SGL Carbon SE 4.63% 30/09/2024	1.762.616	0,15			<b>Italien, insgesamt</b>	<b>27.643.153</b>	<b>2,36</b>
EUR	1.835.000	Techem Verwaltungsgesellschaft 674 2.00% 15/07/2025	1.757.222	0,15			<b>JERSEY – KANALINSELN</b>		
EUR	4.886.000	Techem Verwaltungsgesellschaft 674 mbH 6.00% 30/07/2026	4.998.535	0,42	EUR	8.625.000	Lhc3 plc 4.13% 15/08/2024	8.657.344	0,73
EUR	2.390.000	Volkswagen Financial Services AG 3.38% 06/04/2028	2.779.952	0,24			<b>Jersey – Kanalinseln, insgesamt</b>	<b>8.657.344</b>	<b>0,73</b>
EUR	2.500.000	Wepa Hygieneprodukte GmbH FRN 15/11/2026	2.451.361	0,21			<b>LUXEMBURG</b>		
		<b>Deutschland, insgesamt</b>	<b>86.256.993</b>	<b>7,29</b>	EUR	4.100.000	ADO Properties SA 3.25% 05/08/2025	4.147.553	0,35
		<b>INDIEN</b>			EUR	1.040.000	Altice Financing SA 2.25% 15/01/2025	997.371	0,08
USD	3.630.000	Adani Ports & Special Economic Zone Limited 4.38% 03/07/2029	3.123.139	0,27	EUR	6.443.000	Altice Financing SA 3.00% 15/01/2028	5.999.429	0,51
USD	5.785.000	Bharti Airtel Limited 4.38% 10/06/2025	5.223.929	0,44	EUR	2.460.000	Altice France Holding SA 4.00% 15/02/2028	2.247.714	0,19

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities

### Portfolioaufstellung

(Fortsetzung)

	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Nettoinven- tarwerts		Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Nettoinven- tarwerts		
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>					<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>						
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>					<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>						
<b>LUXEMBURG (Fortsetzung)</b>					<b>NIEDERLANDE (Fortsetzung)</b>						
EUR	3.900.000	Aroundtown SA 1.45% 09/07/2028	3.965.098	0,34	EUR	6.000.000	Schaeffler Finance BV 3.25% 15/05/2025	6.012.720	0,51		
GBP	1.855.000	Aroundtown SA 3.00% 16/10/2029	2.104.098	0,18	EUR	8.219.000	Stedin Holding NV Perp FRN	8.407.318	0,71		
EUR	6.180.000	Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1.21% 04/06/2026	6.351.163	0,54	EUR	4.646.324	Summer BidCo BV 9.75% 15/11/2025	4.687.152	0,40		
EUR	4.750.000	Cirsa Finance International Sarl 6.25% 20/12/2023	4.348.702	0,37	USD	18.806.000	Syngenta Finance NV 4.89% 24/04/2025	17.400.597	1,47		
EUR	817.000	CPI Property Group SA 2.75% 12/05/2026	844.804	0,07	EUR	8.100.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	8.560.958	0,72		
EUR	7.100.000	Grand City Properties SA 1.38% 03/08/2026	7.420.256	0,63	EUR	3.758.000	TenneT Holding BV Perp FRN	3.813.803	0,32		
EUR	4.200.000	Grand City Properties SA Perp FRN	4.345.325	0,37	EUR	5.221.000	TenneT Holding BV Perp FRN	5.441.878	0,46		
EUR	3.359.000	Groupe Ecore Holding SAS FRN 15/11/2023	2.412.923	0,20	EUR	3.680.000	United Group BV 3.13% 15/02/2026	3.478.949	0,29		
EUR	4.206.000	Medtronic Global Holdings SCA 1.38% 15/10/2040	4.309.914	0,36	EUR	2.212.000	Upjohn Finance BV 1.91% 23/06/2032	2.306.795	0,20		
EUR	3.689.000	Novartis Finance SA 0.00% 23/09/2028	3.685.775	0,31	GBP	2.300.000	Volkswagen Financial Services NV 2.75% 10/07/2023	2.652.882	0,22		
EUR	2.625.000	Prologis International Funding II SA 1.63% 17/06/2032	2.852.243	0,24	<b>Niederlande, insgesamt</b>				<b>118.256.253</b>	<b>10,00</b>	
EUR	8.217.000	Sig Combibloc Purchaseco Sarl 2.13% 18/06/2025	8.458.183	0,72	<b>PORTUGAL</b>						
<b>Luxemburg, insgesamt</b>											
			<b>64.490.551</b>	<b>5,46</b>	EUR	3.100.000	EDP - Energias de Portugal SA FRN 20/07/2080	2.988.085	0,25		
<b>NIEDERLANDE</b>					<b>Portugal, insgesamt</b>					<b>2.988.085</b>	<b>0,25</b>
USD	4.534.000	Aegon NV FRN 11/04/2048	4.261.179	0,36	<b>SPANIEN</b>						
USD	1.750.000	Constellium SE 5.75% 15/05/2024	1.518.333	0,13	EUR	1.100.000	Bankia SA FRN 15/02/2029	1.165.356	0,10		
EUR	5.000.000	Cooperatieve Rabobank UA FRN 05/05/2028	5.201.068	0,44	EUR	4.700.000	Caixabank SA 1.13% 17/05/2024	4.845.700	0,41		
EUR	7.200.000	Cooperatieve Rabobank UA Perp FRN	7.393.216	0,63	EUR	2.400.000	CaixaBank SA 0.38% 03/02/2025	2.403.277	0,20		
EUR	4.087.000	Enexis Holding NV 0.75% 02/07/2031	4.293.797	0,36	EUR	1.242.000	Nortegas Energia Distribucion SAU 2.07% 28/09/2027	1.344.592	0,11		
EUR	6.978.000	Fiat Chrysler Automobiles NV 3.88% 05/01/2026	7.555.921	0,64	<b>Spanien, insgesamt</b>				<b>9.758.925</b>	<b>0,82</b>	
USD	10.000.000	ING Groep NV Perp FRN	8.891.954	0,75	<b>SCHWEDEN</b>						
EUR	1.616.000	NE Property BV 3.38% 14/07/2027	1.630.425	0,14	EUR	10.710.000	Akelius Residential Property AB 1.75% 07/02/2025	11.184.801	0,94		
EUR	4.600.000	Oci NV 5.00% 15/04/2023	4.724.055	0,40	EUR	4.000.000	Akelius Residential Property AB FRN 05/10/2078	4.129.406	0,35		
EUR	1.285.000	Q-Park Holding I BV 1.50% 01/03/2025	1.177.096	0,10	EUR	4.034.000	Sagax AB 1.13% 30/01/2027	3.958.675	0,33		
EUR	3.381.000	Q-Park Holding I BV 2.00% 01/03/2027	3.035.174	0,26	EUR	3.862.000	Sagax AB 2.00% 17/01/2024	3.987.760	0,34		
EUR	5.785.000	Relx Finance BV 0.50% 10/03/2028	5.810.983	0,49	<b>Schweden, insgesamt</b>				<b>23.260.642</b>	<b>1,96</b>	
					<b>SCHWEIZ</b>						
					USD	4.500.000	Credit Suisse Group AG Perp FRN	4.190.706	0,35		
					USD	6.600.000	UBS Group AG Perp FRN	6.274.566	0,54		

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities

### Portfolioaufstellung

(Fortsetzung)

	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Nettoinven- tarwerts		Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Nettoinven- tarwerts
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>					<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>					<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				
<b>SCHWEIZ (Fortsetzung)</b>					<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH (Fortsetzung)</b>				
USD	3.906.000	UBS Group Funding Switzerland AG Perp FRN	3.563.541	0,30	GBP	836.000	Legal & General Group plc FRN 01/11/2050	1.002.829	0,08
		<b>Schweiz, insgesamt</b>	<b>14.028.813</b>	<b>1,19</b>	GBP	7.133.000	Lloyds Banking Group plc Perp FRN	7.600.900	0,64
<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH</b>					GBP	12.060.000	Lloyds TSB Bank plc 7.63% 22/04/2025	16.888.458	1,44
USD	4.551.000	BAE Systems plc 3.40% 15/04/2030	4.355.324	0,37	GBP	2.915.000	M&G PLC FRN 20/07/2049	3.374.926	0,29
GBP	6.945.000	Barclays Bank plc 5.75% 14/09/2026	9.209.156	0,78	GBP	2.462.000	Marks & Spencer plc 6.13% 06/12/2021	2.851.611	0,24
GBP	7.100.000	BAT International Finance plc 2.25% 26/06/2028	7.870.310	0,67	GBP	1.249.955	Marston's Issuer plc FRN 15/10/2027	1.162.709	0,10
EUR	694.000	BP Capital Markets plc 2.52% 07/04/2028	790.702	0,07	GBP	1.709.014	Mitchells & Butlers Finance plc 5.57% 15/12/2030	2.041.433	0,17
USD	6.633.000	BP Capital Markets plc Perp FRN	5.909.190	0,50	GBP	205.280	Mitchells & Butlers Finance plc 5.97% 15/12/2023	230.133	0,02
GBP	1.444.000	BUPA Finance plc 4.13% 14/06/2035	1.691.436	0,14	EUR	2.231.000	Natwest Group plc FRN 02/03/2026	2.308.625	0,20
GBP	7.394.000	BUPA Finance plc 5.00% 08/12/2026	9.320.636	0,79	GBP	5.225.000	Natwest Group plc FRN 19/09/2026	6.089.361	0,52
EUR	9.181.000	DS Smith plc 0.88% 12/09/2026	9.168.268	0,77	USD	1.500.000	Natwest Group plc FRN 08/05/2030	1.475.080	0,12
EUR	7.160.000	EC Finance plc 2.38% 15/11/2022	6.592.299	0,56	USD	3.680.000	Natwest Group plc Perp FRN	3.206.678	0,27
EUR	6.049.000	EG Global Finance plc 3.63% 07/02/2024	5.881.175	0,50	EUR	4.686.000	NGG Finance plc FRN 05/09/2082	4.600.160	0,39
USD	8.760.536	Enquest plc 7.00% 15/04/2022	4.122.740	0,35	GBP	2.000.000	Pinnacle Bidco plc 6.38% 15/02/2025	1.946.966	0,16
EUR	4.705.000	FCE Bank plc 1.13% 10/02/2022	4.613.613	0,39	GBP	3.100.000	Santander UK plc Perp 10.06%	5.513.770	0,47
GBP	10.180.000	First Hydro Finance plc 9.00% 31/07/2021	11.911.521	1,00	EUR	6.512.000	Synthomer plc 3.88% 01/07/2025	6.655.172	0,56
EUR	9.565.000	G4S International Finance plc 1.50% 02/06/2024	9.626.572	0,81	GBP	5.834.000	Telereal FRN 10/12/2033	6.589.730	0,56
EUR	2.465.000	G4S International Finance plc 1.88% 24/05/2025	2.483.655	0,21	GBP	3.512.808	Telereal 4.97% 10/09/2027	4.386.847	0,37
GBP	7.759.000	GKN Holdings plc 4.63% 12/05/2032	8.277.012	0,70	GBP	1.785.525	Telereal 5.43% 10/12/2031	2.376.214	0,20
GBP	3.919.000	GKN Holdings plc 5.38% 19/09/2022	4.488.702	0,38	GBP	5.762.704	Tesco Property Finance 3 plc 5.74% 13/04/2040	8.460.708	0,71
EUR	6.500.000	HBOS plc FRN 18/03/2030	7.187.375	0,61	GBP	2.026.239	Tesco Property Finance 5 plc 5.66% 13/10/2041	2.988.638	0,25
GBP	2.920.000	HSBC Bank plc 5.38% 22/08/2033	4.244.935	0,36	GBP	6.800.000	Tsb Banking Group plc FRN 06/05/2026	7.603.607	0,64
GBP	6.850.000	HSBC Holdings plc Perp FRN	7.660.409	0,65	EUR	1.922.000	Vmed O2 UK Financing I plc 3.25% 31/01/2031	1.915.531	0,16
EUR	2.930.000	Imperial Brands Finance plc 1.13% 14/08/2023	3.000.671	0,25	GBP	1.107.000	Vmed O2 UK Financing I plc 4.00% 31/01/2029	1.215.511	0,10
EUR	1.840.000	Imperial Brands Finance plc 3.38% 26/02/2026	2.077.110	0,18	EUR	2.698.000	Vodafone Group plc FRN 27/08/2080	2.689.509	0,23
EUR	2.500.000	International Game Technology plc 4.75% 15/02/2023	2.557.750	0,22	USD	3.500.000	Vodafone Group plc FRN 03/10/2078	3.235.146	0,27
GBP	4.755.000	Jaguar Land Rover Automotive plc 2.75% 24/01/2021	5.188.278	0,44	GBP	8.600.000	Western Power Distribution plc 3.50% 16/10/2026	10.476.702	0,90
GBP	2.166.000	Legal & General Group plc FRN 26/11/2049	2.457.509	0,21			<b>Vereinigtes Königreich, insgesamt</b>	<b>259.573.302</b>	<b>21,97</b>

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities

### Portfolioaufstellung

(Fortsetzung)

	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Nettoinven- tarwerts	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Nettoinven- tarwerts	
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>					<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>					<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				
<b>VEREINIGTE STAATEN</b>					<b>VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)</b>				
USD	3.550.000	American Electric Power Company Inc. 3.20% 13/11/2027	3.323.664	0,28	EUR	2.284.000	Silgan Holdings Inc. 2.25% 01/06/2028	2.233.979	0,19
GBP	5.250.000	American International Group Inc. 5.00% 26/04/2023	6.339.821	0,54	USD	5.000.000	Teva Pharmaceutical Finance BV 3.65% 10/11/2021	4.254.847	0,36
USD	3.140.000	Anheuser-Busch Inbev Worldwide Inc. 5.45% 23/01/2039	3.472.145	0,29	EUR	1.741.000	Thermo Fisher Scientific Inc. 1.88% 01/10/2049	1.759.622	0,15
EUR	9.820.000	AT&T Inc. FRN 05/09/2023	9.882.914	0,84	GBP	3.925.000	Time Warner Cable Inc. 5.75% 02/06/2031	5.512.678	0,47
USD	3.667.000	AT&T Inc. 2.30% 01/06/2027	3.283.052	0,28	USD	2.275.000	Williams Cos Inc. 3.50% 15/11/2030	2.111.589	0,18
USD	2.690.000	AT&T Inc. 3.80% 15/02/2027	2.588.811	0,22			<b>Vereinigte Staaten, insgesamt</b>	<b>171.084.887</b>	<b>14,49</b>
EUR	9.688.000	Avantor Inc. 4.75% 01/10/2024	10.038.440	0,85			<b>BRITISCHE JUNGFERNINSELN</b>		
EUR	14.575.000	Becton Dickinson & Company 1.40% 24/05/2023	14.998.247	1,27	GBP	5.090.000	Global Switch Holdings Limited 4.38% 13/12/2022	6.002.648	0,51
EUR	4.245.000	Catalent Pharma Solutions Inc. 2.38% 01/03/2028	4.092.718	0,35			<b>Britische Jungfernseln, insgesamt</b>	<b>6.002.648</b>	<b>0,51</b>
EUR	5.214.000	Digital Euro Finco LLC 1.13% 09/04/2028	5.345.246	0,46			<b>Anleihen, insgesamt</b>	<b>965.528.110</b>	<b>81,70</b>
EUR	2.089.000	Digital Euro Finco LLC 2.50% 16/01/2026	2.297.682	0,19			<b>Hypothekenbesicherte Anleihen und ABS-Anleihen</b>		
USD	9.070.000	Duke Energy Florida LLC 2.50% 01/12/2029	8.421.148	0,71			<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH</b>		
EUR	10.710.000	Equinix Inc. 2.88% 01/10/2025	10.880.093	0,92	GBP	1.331.593	Virgin Media Secured Finance plc FRN 15/01/2025	1.560.173	0,13
EUR	3.943.000	Fidelity National Information SE 1.00% 03/12/2028	4.046.510	0,34			<b>Vereinigtes Königreich, insgesamt</b>	<b>1.560.173</b>	<b>0,13</b>
EUR	5.953.000	Fidelity National Information Services Inc. 2.00% 21/05/2030	6.580.913	0,56			<b>Hypothekenbesicherte Anleihen und ABS-Anleihen, insgesamt</b>	<b>1.560.173</b>	<b>0,13</b>
EUR	1.869.000	Fidelity National Information Services Inc. 2.95% 21/05/2039	2.269.604	0,19			<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente</b>		
EUR	3.073.000	Ford Motor Credit Company LLC 3.25% 15/09/2025	2.996.777	0,25			<b>MEXIKO</b>		
EUR	2.526.000	General Electric Company 2.13% 17/05/2037	2.465.305	0,21	GBP	1.855.000	Mexico (Govt of) 5.63% 19/03/2114	2.192.052	0,19
EUR	2.554.000	Honeywell Internation 0.75% 10/03/2032	2.575.931	0,22			<b>Mexiko, insgesamt</b>	<b>2.192.052</b>	<b>0,19</b>
EUR	6.000.000	IQVIA Inc. 2.25% 15/01/2028	5.883.530	0,50			<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente, insgesamt</b>	<b>2.192.052</b>	<b>0,19</b>
EUR	5.439.000	IQVIA Inc. 2.88% 15/06/2028	5.507.985	0,47			<b>Wandelanleihen</b>		
USD	4.366.000	JPMorgan Chase & Company FRN 22/04/2041	4.058.256	0,34			<b>FRANKREICH</b>		
EUR	2.475.000	Kraft Heinz Foods Company 2.25% 25/05/2028	2.516.383	0,21	GBP	6.600.000	Orange SA 0.38% 27/06/2021	7.236.217	0,61
GBP	5.498.000	Kraft Heinz Foods Company 4.13% 01/07/2027	6.576.705	0,56			<b>Frankreich, insgesamt</b>	<b>7.236.217</b>	<b>0,61</b>
USD	2.580.000	Microsoft Corp. 4.10% 06/02/2037	2.865.363	0,24			<b>Wandelanleihen, insgesamt</b>	<b>7.236.217</b>	<b>0,61</b>
EUR	1.983.000	Netflix Inc. 3.00% 15/06/2025	2.069.200	0,18			<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt</b>	<b>976.516.552</b>	<b>82,63</b>
EUR	4.000.000	Netflix Inc. 3.88% 15/11/2029	4.423.400	0,37					
USD	12.314.000	NiSource Inc. 3.49% 15/05/2027	11.716.381	0,99					
USD	2.478.000	Plains All American Pipeline LP 3.55% 15/12/2029	2.046.806	0,17					
USD	1.800.000	Plains All American Pipeline LP 4.65% 15/10/2025	1.649.142	0,14					

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.



## Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities

### Portfolioaufstellung

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Nettoinven- tarwerts	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Nettoinven- tarwerts		
<b>Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere</b>				<b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente (Fortsetzung)</b>					
<b>Anleihen</b>				<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>					
<b>BERMUDAS</b>				<b>LUXEMBURG</b>					
USD	11.721.000	Bacardi Limited 4.70% 15/05/2028	11.610.997	0,98	EUR	7.994.000	Altice France Holding SA 8.00% 15/05/2027	8.499.093	0,72
<b>Bermudas, insgesamt</b>				<b>11.610.997</b>	<b>0,98</b>	<b>Luxemburg, insgesamt</b>		<b>8.499.093</b>	<b>0,72</b>
<b>FRANKREICH</b>				<b>PORTUGAL</b>					
USD	6.461.000	BPCE SA 2.70% 01/10/2029	5.932.381	0,50	EUR	17.100.000	Banco Espirito Santo SA 4.00% 21/01/2021	3.706.612	0,31
<b>Frankreich, insgesamt</b>				<b>5.932.381</b>	<b>0,50</b>	<b>Portugal, insgesamt</b>		<b>3.706.612</b>	<b>0,31</b>
<b>NIEDERLANDE</b>				<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH</b>					
USD	3.856.000	Vonovia Finance BV 5.00% 02/10/2023	3.530.566	0,30	GBP	5.119.000	Pinewood Finance Company Limited 3.25% 30/09/2025	5.643.807	0,48
<b>Niederlande, insgesamt</b>				<b>3.530.566</b>	<b>0,30</b>	<b>Vereinigtes Königreich, insgesamt</b>		<b>5.643.807</b>	<b>0,48</b>
<b>VEREINIGTE STAATEN</b>				<b>Anleihen, insgesamt</b>				<b>44.420.466</b>	<b>3,76</b>
USD	5.941.000	AbbVie Inc. 4.25% 21/11/2049	5.988.569	0,51	<b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, insgesamt</b>				
USD	8.093.000	Broadcom Inc. 4.11% 15/09/2028	7.728.793	0,65	<b>44.420.466</b>				<b>3,76</b>
USD	4.470.000	Carrier Global Corp. 2.72% 15/02/2030	3.986.305	0,34	<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren</b>				
<b>Vereinigte Staaten, insgesamt</b>				<b>17.703.667</b>	<b>1,50</b>	<b>Fonds</b>			
<b>Anleihen, insgesamt</b>				<b>38.777.611</b>	<b>3,28</b>	<b>IRLAND</b>			
<b>Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere, insgesamt</b>				<b>38.777.611</b>	<b>3,28</b>	3.527.423	BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund	3.888.842	0,33
<b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>				<b>Anleihen, insgesamt</b>				<b>63.057.242</b>	<b>5,34</b>
<b>Anleihen</b>				<b>Fonds, insgesamt</b>				<b>63.057.242</b>	<b>5,34</b>
<b>AUSTRALIEN</b>				<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren, insgesamt</b>				<b>63.057.242</b>	<b>5,34</b>
USD	9.082.000	APT Pipelines Limited 4.25% 15/07/2027	8.756.783	0,74	542.188	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	462.361	0,04	
<b>Australien, insgesamt</b>				<b>8.756.783</b>	<b>0,74</b>	591.418	BlackRock Institutional Cash Series Euro Liquidity Fund Premier	58.670.282	4,97
<b>BERMUDAS</b>				<b>Irland, insgesamt</b>				<b>63.057.242</b>	<b>5,34</b>
USD	18.685.000	Bacardi Limited 4.45% 15/05/2025	17.775.890	1,51	32.434	Insight Liquidity Funds plc	35.757	0,00	
<b>Bermudas, insgesamt</b>				<b>17.775.890</b>	<b>1,51</b>	<b>Wert der Anlagen, insgesamt</b>			
<b>KAIMANINSELN</b>				<b>(Gesamtkosten: EUR 1.119.140.409)</b>				<b>1.122.771.871</b>	<b>95,01</b>
USD	4.489.000	Noble Holding International Limited 8.95% 01/04/2045	38.281	0,00	<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren, insgesamt</b>				
<b>Kaimaninseln, insgesamt</b>				<b>38.281</b>	<b>0,00</b>	<b>1.122.771.871</b>			

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities

### Portfolioaufstellung

zum 30. September 2020

Nennwert		Anlage	Marktwert EUR	% des Nettoinven- tarwerts	Nennwert		Anlage	Marktwert EUR	% des Nettoinven- tarwerts
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung</b>					<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				
<b>Anleihen</b>					<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				
<b>AUSTRALIEN</b>					<b>FINNLAND (Fortsetzung)</b>				
EUR	456.000	APT Pipelines Limited 2.00% 15/07/2030	494.844	0,98	EUR	100.000	OP Corporate Bank plc FRN 09/06/2030	102.212	0,20
USD	144.000	APT Pipelines Limited 4.25% 15/07/2027	138.844	0,27	<b>Finnland, insgesamt</b>				
EUR	122.000	Aurizon Network Pty Limited 3.13% 01/06/2026	137.274	0,27	<b>352.692 0,70</b>				
EUR	228.000	AusNet Services Holdings Pty Limited 0.63% 25/08/2030	233.746	0,46	<b>FRANKREICH</b>				
USD	750.000	AusNet Services Holdings Pty Limited FRN 17/03/2076	660.311	1,31	EUR	200.000	Auchan Holding SA 3.25% 23/07/2027	214.324	0,42
EUR	300.000	Goodman Australia 1.38% 27/09/2025	309.650	0,61	USD	235.000	BNP Paribas SA Perp FRN	214.113	0,42
USD	400.000	SGSP Australia Assets Pty Limited 3.25% 29/07/2026	376.026	0,74	EUR	200.000	Carrefour SA 2.63% 15/12/2027	228.473	0,45
<b>Australien, insgesamt</b>			<b>2.350.695</b>	<b>4,64</b>	EUR	200.000	Credit Agricole SA FRN 05/06/2030	205.011	0,41
<b>BELGIEN</b>					USD	400.000	Credit Agricole SA Perp FRN	367.489	0,73
EUR	288.000	Anheuser-Busch Inbev SA 3.70% 02/04/2040	369.387	0,73	EUR	300.000	Electricite de France SA 2.00% 09/12/2049	309.771	0,61
EUR	300.000	Belfius Bank SA 0.00% 28/08/2026	298.568	0,59	EUR	144.000	Electricite de France SA Perp FRN	196.750	0,39
EUR	400.000	KBC Group NV Perp FRN	391.754	0,77	EUR	300.000	RCI Banque SA 2.00% 11/07/2024	146.734	0,29
<b>Belgien, insgesamt</b>			<b>1.059.709</b>	<b>2,09</b>	EUR	500.000	RTE Reseau de Transport d'Electricite SADIR 1.13% 08/07/2040	315.388	0,62
<b>BERMUDAS</b>					EUR	500.000	Sanef SA 1.88% 16/03/2026	523.866	1,04
EUR	540.000	Bacardi Limited 2.75% 03/07/2023	565.801	1,12	<b>Frankreich, insgesamt</b>				
<b>Bermudas, insgesamt</b>			<b>565.801</b>	<b>1,12</b>	<b>2.721.919 5,38</b>				
<b>KAIMANINSELN</b>					<b>DEUTSCHLAND</b>				
GBP	463.000	Southern Water Services Finance Limited 3.00% 28/05/2037	541.716	1,07	EUR	300.000	Alstria office REIT-AG 0.50% 26/09/2025	295.690	0,59
USD	555.000	Tencent Holdings Limited 3.60% 19/01/2028	521.205	1,03	EUR	400.000	Bayer AG 1.13% 06/01/2030	406.650	0,80
<b>Kaimaninseln, insgesamt</b>			<b>1.062.921</b>	<b>2,10</b>	EUR	196.000	Commerzbank AG 0.50% 04/12/2026	197.583	0,39
<b>DÄNEMARK</b>					EUR	631.000	Commerzbank AG 1.00% 04/03/2026	652.374	1,29
EUR	509.000	Danske Bank A/S 0.63% 26/05/2025	519.996	1,03	EUR	200.000	Commerzbank AG FRN 05/12/2030	205.012	0,41
<b>Dänemark, insgesamt</b>			<b>519.996</b>	<b>1,03</b>	USD	215.000	Deutsche Bank FRN 18/09/2024	184.295	0,36
<b>FINNLAND</b>					EUR	385.000	Deutsche Bank AG FRN 10/06/2026	401.899	0,79
EUR	243.000	Nordea Bank Abp 0.50% 14/05/2027	250.480	0,50	EUR	100.000	Volkswagen Bank GmbH 2.50% 31/07/2026	109.066	0,22
					EUR	90.000	Volkswagen Financial Services AG 3.38% 06/04/2028	104.684	0,21
					<b>Deutschland, insgesamt</b>				
					<b>2.557.253 5,06</b>				
					<b>INDIEN</b>				
					USD	334.000	Adani Ports & Special Economic Zone Limited 4.38% 03/07/2029	287.363	0,57
					USD	600.000	Bharti Airtel Limited 4.38% 10/06/2025	541.808	1,07
					<b>Indien, insgesamt</b>			<b>829.171</b>	<b>1,64</b>

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities

### Portfolioaufstellung

(Fortsetzung)

	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Nettoinven- tarwerts		Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Nettoinven- tarwerts
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>					<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>					<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				
<b>IRLAND</b>					<b>NIEDERLANDE (Fortsetzung)</b>				
EUR	496.000	AIB Group plc FRN 19/11/2029	480.204	0,95	EUR	500.000	Cooperatieve Rabobank UA FRN 05/05/2028	520.107	1,03
EUR	245.000	Bank of Ireland Group plc FRN 14/10/2029	241.982	0,48	EUR	600.000	Cooperatieve Rabobank UA Perp FRN	616.101	1,22
USD	400.000	GE Capital International Funding Company 4.42% 15/11/2035	360.387	0,71	EUR	278.000	Enexis Holding NV 0.75% 02/07/2031	292.066	0,58
		<b>Irland, insgesamt</b>	<b>1.082.573</b>	<b>2,14</b>	USD	1.000.000	ING Groep NV Perp FRN	889.196	1,75
					GBP	260.000	Innogy Finance BV 6.25% 03/06/2030	405.064	0,80
<b>ITALIEN</b>					EUR				
EUR	268.000	Aeroporti di Roma SpA 1.63% 08/06/2027	263.008	0,52	EUR	124.000	NE Property BV 3.38% 14/07/2027	125.107	0,25
EUR	220.000	Banco BPM SpA 2.50% 21/06/2024	225.525	0,45	EUR	200.000	Redexis Gas Finance Sarl 1.88% 28/05/2025	209.382	0,41
EUR	380.000	FCA Bank SpA 0.50% 13/09/2024	378.448	0,75	EUR	417.000	Relx Finance BV 0.50% 10/03/2028	418.873	0,83
		<b>Italien, insgesamt</b>	<b>866.981</b>	<b>1,72</b>	EUR	350.000	Stedin Holding NV Perp FRN	358.019	0,71
<b>LUXEMBURG</b>					USD				
EUR	300.000	Aroundtown SA 1.45% 09/07/2028	305.008	0,61	USD	863.000	Syngenta Finance NV 4.89% 24/04/2025	798.506	1,58
GBP	100.000	Aroundtown SA 3.00% 16/10/2029	113.428	0,22	EUR	319.000	TenneT Holding BV Perp FRN	323.737	0,64
EUR	1.156.000	Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1.21% 04/06/2026	1.188.017	2,35	EUR	198.000	Upjohn Finance BV 1.91% 23/06/2032	206.485	0,41
EUR	100.000	CPI Property Group SA 2.75% 12/05/2026	103.403	0,20	GBP	400.000	Volkswagen Financial Services NV 2.75% 10/07/2023	461.371	0,91
EUR	355.000	Medtronic Global Holdings SCA 1.38% 15/10/2040	363.771	0,72			<b>Niederlande, insgesamt</b>	<b>6.507.042</b>	<b>12,87</b>
EUR	318.000	Novartis Finance SA 0.00% 23/09/2028	317.722	0,63	<b>PORTUGAL</b>				
EUR	246.000	Prologis International Funding II SA 1.63% 17/06/2032	267.296	0,53	EUR	100.000	EDP - Energias de Portugal SA FRN 20/07/2080	96.390	0,19
		<b>Luxemburg, insgesamt</b>	<b>2.658.645</b>	<b>5,26</b>			<b>Portugal, insgesamt</b>	<b>96.390</b>	<b>0,19</b>
<b>MEXIKO</b>					<b>SPANIEN</b>				
EUR	125.000	America Movil SAB de CV FRN 06/09/2073	143.262	0,28	EUR	100.000	Bankia SA FRN 15/02/2029	105.941	0,21
EUR	200.000	Petroleos Mexicanos 3.75% 16/04/2026	175.808	0,35	EUR	300.000	CaixaBank SA 1.13% 27/03/2026	311.114	0,62
		<b>Mexiko, insgesamt</b>	<b>319.070</b>	<b>0,63</b>	EUR	100.000	Nortegas Energia Distribucion SAU 2.07% 28/09/2027	108.260	0,21
<b>NIEDERLANDE</b>					<b>SPANIEN, insgesamt</b>				
EUR	500.000	ABN Amro Bank NV 1.25% 28/05/2025	522.249	1,03			<b>Spanien, insgesamt</b>	<b>525.315</b>	<b>1,04</b>
USD	200.000	Aegon NV FRN 11/04/2048	187.965	0,38	<b>SCHWEDEN</b>				
USD	210.000	Braskem Netherlands Finance BV 4.50% 10/01/2028	172.814	0,34	EUR	350.000	Akelius Residential Property AB 1.75% 07/02/2025	365.516	0,72
					EUR	290.000	Sagax AB 1.13% 30/01/2027	284.585	0,56
					EUR	100.000	Sagax AB 2.00% 17/01/2024	103.256	0,20
							<b>Schweden, insgesamt</b>	<b>753.357</b>	<b>1,48</b>

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities

### Portfolioaufstellung

(Fortsetzung)

	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Nettoinven- tarwerts		Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Nettoinven- tarwerts
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>					<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>					<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				
<b>SCHWEIZ</b>					<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH (Fortsetzung)</b>				
USD	400.000	Credit Suisse Group AG Perp FRN	372.507	0,73	GBP	187.000	Natwest Group plc FRN		
USD	200.000	UBS Group AG Perp FRN	174.990	0,35			28/03/2027	220.420	0,44
USD	200.000	UBS Group Funding Switzerland AG Perp FRN	182.465	0,36	USD	280.000	Natwest Group plc FRN		
		<b>Schweiz, insgesamt</b>	<b>729.962</b>	<b>1,44</b>			08/05/2030	275.348	0,54
					USD	320.000	Natwest Group plc Perp FRN	278.842	0,55
					EUR	313.000	NGG Finance plc FRN		
							05/09/2082	307.266	0,61
					GBP	100.000	RI Finance FRN 30/11/2043	123.602	0,24
					GBP	150.000	Santander UK plc Perp 10.06%	266.795	0,53
					EUR	474.000	SSE plc Perp FRN	485.428	0,96
					GBP	72.475	Telereal 4.97% 10/09/2027	90.508	0,18
					GBP	140.515	Telereal 5.43% 10/12/2031	187.000	0,37
					GBP	283.690	Tesco Property Finance 7.62%		
							13/07/2039	466.830	0,91
					GBP	91.441	Tesco Property Finance 3 plc		
							5.74% 13/04/2040	134.252	0,27
					GBP	350.000	Tsb Banking Group plc FRN		
							06/05/2026	391.362	0,77
					EUR	282.000	Vodafone Group plc FRN		
							27/08/2080	281.112	0,56
					GBP	400.000	Western Power Distribution plc		
							3.50% 16/10/2026	487.289	0,96
							<b>Vereinigtes Königreich, insgesamt</b>	<b>13.075.600</b>	<b>25,85</b>
					<b>VEREINIGTE STAATEN</b>				
					USD	252.000	AT&T Inc. 3.80% 15/02/2027	242.521	0,48
					EUR	189.000	Digital Euro Finco LLC 1.13%		
							09/04/2028	193.757	0,38
					EUR	100.000	Digital Euro Finco LLC 2.50%		
							16/01/2026	109.990	0,22
					EUR	55.000	Digital Euro Finco LLC 2.50%		
							16/01/2026	60.494	0,12
					EUR	818.000	Equinix Inc. 2.88% 01/10/2025	830.992	1,65
					EUR	100.000	Fidelity National Information Services Inc. 1.50% 21/05/2027		
								106.518	0,21
					EUR	286.000	Fidelity National Information Services Inc. 2.00% 21/05/2030	316.166	0,63
					EUR	214.000	Fidelity National Information Services Inc. 2.95% 21/05/2039	259.869	0,51
					EUR	249.000	Honeywell Internation 0.75%		
							10/03/2032	251.138	0,50
					USD	357.000	JPMorgan Chase & Company FRN 22/04/2041	331.836	0,66
					EUR	175.000	Kraft Heinz Foods Company 2.25% 25/05/2028	177.926	0,35
					GBP	468.000	Kraft Heinz Foods Company 4.13% 01/07/2027	559.821	1,11
					USD	206.000	Microsoft Corp. 4.10%		
							06/02/2037	228.785	0,45

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities

### Portfolioaufstellung

(Fortsetzung)

Nennwert		Anlage	Marktwert EUR	% des Nettoinven- tarwerts	Nennwert		Anlage	Marktwert EUR	% des Nettoinven- tarwerts
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>					<b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>				
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>					<b>Anleihen</b>				
<b>VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)</b>					<b>BERMUDAS</b>				
EUR	163.000	Netflix Inc. 3.00% 15/06/2025	170.086	0,34	USD	620.000	Bacardi Limited 4.45% 15/05/2025	589.834	1,17
USD	1.002.000	NiSource Inc. 3.49% 15/05/2027	953.372	1,89	<b>Bermudas, insgesamt</b>				
EUR	70.000	Petroleos Mexicanos 5.50% 24/02/2025	70.732	0,14	<b>589.834 1,17</b>				
USD	299.000	Plains All American Pipeline LP 3.55% 15/12/2029	246.971	0,50	<b>Anleihen, insgesamt</b>				
EUR	134.000	Thermo Fisher Scientific Inc. 1.88% 01/10/2049	135.433	0,27	<b>589.834 1,17</b>				
GBP	295.000	Time Warner Cable Inc. 5.75% 02/06/2031	414.329	0,82	<b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, insgesamt</b>				
USD	193.000	Williams Cos Inc. 3.50% 15/11/2030	179.137	0,35	<b>589.834 1,17</b>				
<b>Vereinigte Staaten, insgesamt</b>			<b>5.839.873</b>	<b>11,58</b>	<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren</b>				
<b>Anleihen, insgesamt</b>			<b>44.474.965</b>	<b>87,96</b>	<b>Fonds</b>				
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt</b>			<b>44.474.965</b>	<b>87,96</b>	<b>IRLAND</b>				
<b>Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere</b>					98 BlackRock Institutional Cash Series Euro Liquidity Fund Premier				
<b>Anleihen</b>					9.687 0,02				
<b>BERMUDAS</b>					<b>Irland, insgesamt</b>				
USD	333.000	Bacardi Limited 4.70% 15/05/2028	329.875	0,65	<b>9.687 0,02</b>				
<b>Bermudas, insgesamt</b>			<b>329.875</b>	<b>0,65</b>	<b>Fonds, insgesamt</b>				
<b>FRANKREICH</b>					<b>9.687 0,02</b>				
USD	250.000	BPCE SA 2.70% 01/10/2029	229.546	0,45	<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren, insgesamt</b>				
<b>Frankreich, insgesamt</b>			<b>229.546</b>	<b>0,45</b>	<b>Wert der Anlagen, insgesamt</b>				
<b>NIEDERLANDE</b>					<b>46.897.410 92,75</b>				
USD	50.000	Vonovia Finance BV 5.00% 02/10/2023	45.780	0,09	<b>(Gesamtkosten: EUR 46.607.500)</b>				
<b>Niederlande, insgesamt</b>			<b>45.780</b>	<b>0,09</b>					
<b>VEREINIGTE STAATEN</b>									
USD	420.000	AbbVie Inc. 4.25% 21/11/2049	423.363	0,84					
USD	300.000	Broadcom Inc. 4.11% 15/09/2028	286.499	0,57					
USD	158.000	Broadcom Inc. 5.00% 15/04/2030	159.171	0,31					
USD	391.000	Carrier Global Corp. 2.72% 15/02/2030	348.690	0,69					
<b>Vereinigte Staaten, insgesamt</b>			<b>1.217.723</b>	<b>2,41</b>					
<b>Anleihen, insgesamt</b>			<b>1.822.924</b>	<b>3,60</b>					
<b>Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere, insgesamt</b>									
			<b>1.822.924</b>	<b>3,60</b>					

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha

## Portfolioaufstellung

zum 30. September 2020

Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Nettoinven- tarwerts	Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Nettoinven- tarwerts
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>			
<b>Aktien</b>				<b>Aktien (Fortsetzung)</b>			
<b>DÄNEMARK</b>				<b>NIEDERLANDE (Fortsetzung)</b>			
64.253	DSV Panalpina A/S	8.955.564	4,93	65.343	Koninklijke DSM NV	9.187.225	5,07
	<b>Dänemark, insgesamt</b>	<b>8.955.564</b>	<b>4,93</b>	50.623	Wolters Kluwer NV	3.687.379	2,03
<b>FINNLAND</b>				<b>SCHWEDEN</b>			
115.845	Kone Oyj	8.695.326	4,79	218.927	Atlas Copco AB - A	8.944.647	4,93
67.799	UPM-Kymmene Oyj	1.762.096	0,97	661.264	Epiroc AB - A	8.200.272	4,52
	<b>Finnland, insgesamt</b>	<b>10.457.422</b>	<b>5,76</b>	112.758	Sandvik AB	1.889.828	1,04
<b>FRANKREICH</b>				<b>Schweden, insgesamt</b>			
58.043	Air Liquide SA	7.864.827	4,33			<b>19.034.747</b>	<b>10,49</b>
83.602	Schneider Electric SE	8.865.992	4,88	<b>SCHWEIZ</b>			
33.956	Teleperformance	8.950.802	4,93	3.394	Lonza Group AG - Reg	1.791.236	0,99
18.849	Worldline SA	1.321.692	0,73	13.539	Nestle SA - Reg	1.374.041	0,76
	<b>Frankreich, insgesamt</b>	<b>27.003.313</b>	<b>14,87</b>	42.570	Sika AG	8.941.745	4,93
<b>DEUTSCHLAND</b>				<b>Schweiz, insgesamt</b>			
124.809	Brenntag AG	6.777.129	3,73			<b>12.107.022</b>	<b>6,68</b>
9.745	Deutsche Boerse AG	1.459.801	0,80	<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH</b>			
78.999	Infineon Technologies AG	1.905.061	1,05	39.141	Linde plc	7.902.568	4,35
88.362	Knorr-Bremse AG	8.892.752	4,90	92.929	London Stock Exchange Group plc	9.093.506	5,01
13.574	SAP SE	1.802.084	0,99	17.934	Reckitt Benckiser Group plc	1.494.727	0,82
	<b>Deutschland, insgesamt</b>	<b>20.836.827</b>	<b>11,47</b>	28.738	Unilever plc	1.513.156	0,83
<b>IRLAND</b>				<b>Vereinigtes Königreich, insgesamt</b>			
58.305	CRH plc	1.799.875	0,99			<b>20.003.957</b>	<b>11,01</b>
117.955	Kingspan Group plc	9.165.104	5,05	<b>Aktien, insgesamt</b>			
	<b>Irland, insgesamt</b>	<b>10.964.979</b>	<b>6,04</b>			<b>177.743.647</b>	<b>97,93</b>
<b>ITALIEN</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt</b>			
535.593	Nexi SpA	9.169.352	5,05			<b>177.743.647</b>	<b>97,93</b>
	<b>Italien, insgesamt</b>	<b>9.169.352</b>	<b>5,05</b>	<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren</b>			
<b>LUXEMBURG</b>				<b>Fonds</b>			
2.132	Eurofins Scientific	1.439.953	0,79	<b>IRLAND</b>			
	<b>Luxemburg, insgesamt</b>	<b>1.439.953</b>	<b>0,79</b>	34.232	BlackRock Institutional Cash Series Euro Liquidity Fund Premier	3.395.954	1,87
<b>NIEDERLANDE</b>				<b>Irland, insgesamt</b>			
5.790	Adyen NV	9.104.775	5,02			<b>3.395.954</b>	<b>1,87</b>
99.499	Akzo Nobel NV	8.598.703	4,75	<b>Fonds, insgesamt</b>			
5.743	ASML Holding NV	1.807.322	1,00			<b>3.395.954</b>	<b>1,87</b>
13.055	Euronext NV	1.395.580	0,77	<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren, insgesamt</b>			
39.267	IMCD Group NV	3.989.527	2,20			<b>3.395.954</b>	<b>1,87</b>
				<b>Wert der Anlagen, insgesamt</b>			
						<b>181.139.601</b>	<b>99,80</b>
				<b>(Gesamtkosten: EUR 166.712.564)</b>			

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha

### Portfolioaufstellung

zum 30. September 2020

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts	Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung</b>				<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren</b>			
<b>Aktien</b>				<b>Fonds</b>			
<b>VEREINIGTE STAATEN</b>				<b>IRLAND</b>			
11.234	Alexion Pharmaceuticals Inc.	1.285.507	1,18	6.265.589	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	6.265.589	5,76
6.408	Alphabet Inc. - A	9.391.565	8,64		<b>Irland, insgesamt</b>	<b>6.265.589</b>	<b>5,76</b>
3.231	Amazon.com Inc.	10.173.547	9,35		<b>Fonds, insgesamt</b>	<b>6.265.589</b>	<b>5,76</b>
13.053	Analog Devices Inc.	1.523.807	1,40		<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren, insgesamt</b>	<b>6.265.589</b>	<b>5,76</b>
27.636	Apple Inc.	3.200.525	2,94		<b>Wert der Anlagen, insgesamt</b>	<b>106.446.065</b>	<b>97,91</b>
98.016	Bank of America Corp.	2.361.205	2,17		<b>(Gesamtkosten: USD 84.161.617)</b>		
32.752	Berkshire Hathaway Inc.	6.974.211	6,42				
38.949	BioMarin Pharmaceuticals Inc.	2.963.240	2,73				
1.805	Booking Holdings Inc.	3.087.777	2,84				
14.648	Comcast Corp.	677.616	0,62				
2.409	Curtiss-Wright Corp.	224.663	0,21				
31.141	Edwards Lifesciences Corp.	2.485.675	2,29				
21.263	Facebook Inc. - A	5.568.780	5,12				
2.636	Illumina Inc.	814.735	0,75				
3.874	Intuit Inc.	1.263.738	1,16				
28.490	JPMorgan Chase & Company	2.742.733	2,52				
13.815	Lam Research Corp.	4.583.126	4,22				
13.858	Mastercard Inc. - A	4.686.360	4,31				
25.818	Microchip Technology Inc.	2.653.058	2,44				
45.317	Microsoft Corp.	9.531.524	8,77				
24.158	Mondelez International Inc.	1.387.877	1,28				
17.081	Norfolk Southern Corp.	3.655.163	3,36				
52.122	Nutanix Inc. - A	1.156.066	1,06				
2.868	Nvidia Corp.	1.552.219	1,43				
13.707	Paypal Holdings Inc.	2.700.690	2,48				
92.899	Uber Technologies Inc.	3.388.956	3,12				
9.382	United Health Group Inc.	2.925.026	2,69				
4.734	Vertex Pharmaceuticals Inc.	1.288.216	1,18				
21.884	Visa Inc. - A	4.376.143	4,03				
3.833	VMware Inc. - A	550.687	0,51				
8.108	Walt Disney Company	1.006.041	0,93				
	<b>Vereinigte Staaten, insgesamt</b>	<b>100.180.476</b>	<b>92,15</b>				
	<b>Aktien, insgesamt</b>	<b>100.180.476</b>	<b>92,15</b>				
	<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt</b>	<b>100.180.476</b>	<b>92,15</b>				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha

## Portfolioaufstellung

zum 30. September 2020

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts	Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>			
<b>Aktien</b>				<b>Aktien (Fortsetzung)</b>			
<b>KAIMANINSELN</b>				<b>IRLAND</b>			
5.895	Alibaba Group Holding Limited	1.733.012	0,90	9.450	Aon plc	1.949.535	1,01
42.700	Tencent Holdings Limited	2.818.194	1,45	41.990	CRH plc	1.520.026	0,79
	<b>Kaimaninseln, insgesamt</b>	<b>4.551.206</b>	<b>2,35</b>	23.897	Medtronic Inc.	2.483.376	1,29
				22.903	Trane Technologies plc	2.776.989	1,44
					<b>Irland, insgesamt</b>	<b>8.729.926</b>	<b>4,53</b>
<b>CHINA</b>				<b>JAPAN</b>			
180.000	Ping An Insurance Group Company of China Limited	1.846.448	0,96	7.000	Keyence Corp.	3.248.934	1,68
	<b>China, insgesamt</b>	<b>1.846.448</b>	<b>0,96</b>	3.800	Nintendo Company Limited	2.148.280	1,11
				32.900	Rohm Company Limited	2.525.254	1,31
				29.700	Sony Corp.	2.260.499	1,17
					<b>Japan, insgesamt</b>	<b>10.182.967</b>	<b>5,27</b>
<b>DÄNEMARK</b>				<b>NIEDERLANDE</b>			
46.243	Novo Nordisk A/S	3.200.637	1,66	11.256	Airbus SE	819.284	0,42
18.478	Orsted A/S	2.548.246	1,32		<b>Niederlande, insgesamt</b>	<b>819.284</b>	<b>0,42</b>
	<b>Dänemark, insgesamt</b>	<b>5.748.883</b>	<b>2,98</b>				
<b>FINNLAND</b>				<b>SÜDKOREA</b>			
70.724	UPM-Kymmene Oyj	2.155.468	1,12	110.883	Samsung Electronics Company Limited	5.518.101	2,85
	<b>Finnland, insgesamt</b>	<b>2.155.468</b>	<b>1,12</b>		<b>Südkorea, insgesamt</b>	<b>5.518.101</b>	<b>2,85</b>
<b>FRANKREICH</b>				<b>SCHWEIZ</b>			
10.252	Essilor International SA	1.396.356	0,72	26.093	TE Connectivity Limited	2.550.330	1,32
7.457	Pernod-Ricard SA	1.190.557	0,62		<b>Schweiz, insgesamt</b>	<b>2.550.330</b>	<b>1,32</b>
23.326	Schneider Electric SE	2.900.810	1,50				
	<b>Frankreich, insgesamt</b>	<b>5.487.723</b>	<b>2,84</b>				
<b>DEUTSCHLAND</b>				<b>TAIWAN</b>			
10.064	Adidas AG	3.258.408	1,69	173.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	2.586.458	1,34
	<b>Deutschland, insgesamt</b>	<b>3.258.408</b>	<b>1,69</b>		<b>Taiwan, insgesamt</b>	<b>2.586.458</b>	<b>1,34</b>
<b>HONGKONG</b>				<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH</b>			
203.200	AIA Group Limited	1.990.045	1,03	42.374	Diageo plc	1.451.699	0,75
	<b>Hongkong, insgesamt</b>	<b>1.990.045</b>	<b>1,03</b>	63.383	Reckitt Benckiser Group plc	6.194.781	3,21
				15.182	Unilever plc	937.399	0,49
					<b>Vereinigtes Königreich, insgesamt</b>	<b>8.583.879</b>	<b>4,45</b>
<b>INDIEN</b>							
294.816	HDFC Bank Limited	4.310.016	2,23				
	<b>Indien, insgesamt</b>	<b>4.310.016</b>	<b>2,23</b>				
<b>INDONESIEN</b>							
8.107.400	Bank Rakyat Indonesia	1.656.245	0,86				
	<b>Indonesien, insgesamt</b>	<b>1.656.245</b>	<b>0,86</b>				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.



## Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha

### Portfolioaufstellung

(Fortsetzung)

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts	Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren</b>			
<b>Aktien (Fortsetzung)</b>				<b>Fonds</b>			
<b>VEREINIGTE STAATEN</b>				<b>IRLAND</b>			
19.928	Abbott Laboratories	2.168.764	1,12	9.139.901	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	9.139.901	4,73
37.319	Activision Blizzard Inc.	3.020.973	1,56				
3.456	Adobe Systems Inc.	1.694.926	0,88		<b>Irland, insgesamt</b>	<b>9.139.901</b>	<b>4,73</b>
3.947	Alphabet Inc. - A	5.784.723	2,99		<b>Fonds, insgesamt</b>	<b>9.139.901</b>	<b>4,73</b>
4.682	Amazon.com Inc.	14.742.354	7,62				
35.462	Baxter International Inc.	2.851.854	1,48		<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren, insgesamt</b>	<b>9.139.901</b>	<b>4,73</b>
17.627	Berkshire Hathaway Inc.	3.753.493	1,94				
649	Booking Holdings Inc.	1.110.231	0,57		<b>Wert der Anlagen, insgesamt</b>	<b>186.274.287</b>	<b>96,39</b>
48.715	Boston Scientific Corp.	1.861.400	0,96				
54.935	Centene Corp.	3.204.359	1,66		<b>(Gesamtkosten: USD 153.423.863)</b>		
8.617	CME Group Inc.	1.441.710	0,75				
157.043	Comcast Corp.	7.264.809	3,76				
4.413	Cooper Companies Inc.	1.487.711	0,77				
11.215	Danaher Corp.	2.414.926	1,25				
9.673	Ecolab Inc.	1.933.052	1,00				
25.376	Electronic Arts Inc.	3.309.284	1,71				
32.726	Fidelity National Information Services Inc.	4.817.595	2,49				
13.509	Illumina Inc.	4.175.362	2,16				
6.085	Intuit Inc.	1.984.988	1,03				
7.639	JPMorgan Chase & Company	735.407	0,38				
8.863	Lam Research Corp.	2.940.300	1,52				
10.508	Mastercard Inc. - A	3.553.490	1,84				
13.964	NextEra Energy Inc.	3.875.848	2,00				
9.272	Nvidia Corp.	5.018.192	2,60				
5.329	S&P Global Inc.	1.921.637	0,99				
60.920	Service Corp. International	2.569.606	1,33				
30.252	T-Mobile USA Inc.	3.459.619	1,79				
62.000	Uber Technologies Inc.	2.261.760	1,17				
10.944	Union Pacific Corp.	2.154.545	1,11				
10.540	United Health Group Inc.	3.286.055	1,70				
21.568	Visa Inc. - A	4.312.954	2,23				
16.498	Walt Disney Company	2.047.072	1,06				
	<b>Vereinigte Staaten, insgesamt</b>	<b>107.158.999</b>	<b>55,42</b>				
	<b>Aktien, insgesamt</b>	<b>177.134.386</b>	<b>91,66</b>				
	<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt</b>	<b>177.134.386</b>	<b>91,66</b>				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities

### Portfolioaufstellung

zum 30. September 2020

	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung</b>				
<b>Strukturierte Instrumente – Rohstoffe</b>				
<b>IRLAND</b>				
	1.788	Invesco Physical Gold ETC	329.314	0,09
		<b>Irland, insgesamt</b>	<b>329.314</b>	<b>0,09</b>
		<b>Strukturierte Instrumente - Rohstoffe, insgesamt</b>	<b>329.314</b>	<b>0,09</b>
		<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt</b>	<b>329.314</b>	<b>0,09</b>
<b>Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere</b>				
<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente</b>				
<b>VEREINIGTE STAATEN</b>				
USD	74.500.000	United States Treasury Bill 0.00% 08/10/2020	74.499.039	20,93
USD	29.500.000	United States Treasury Bill 0.00% 05/11/2020	29.497.448	8,29
USD	30.500.000	United States Treasury Bill 0.00% 03/12/2020	30.494.846	8,57
USD	47.000.000	United States Treasury Bill 0.00% 17/12/2020	46.990.826	13,21
USD	79.500.000	United States Treasury Bill 0.00% 31/12/2020	79.479.560	22,33
USD	43.500.000	United States Treasury Bill 0.00% 28/01/2021	43.485.010	12,22
USD	40.500.000	United States Treasury Bill 0.00% 25/02/2021	40.482.759	11,38
		<b>Vereinigte Staaten, insgesamt</b>	<b>344.929.488</b>	<b>96,93</b>
		<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente, insgesamt</b>	<b>344.929.488</b>	<b>96,93</b>
		<b>Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere, insgesamt</b>	<b>344.929.488</b>	<b>96,93</b>
		<b>Wert der Anlagen, insgesamt</b>	<b>345.258.802</b>	<b>97,02</b>
<b>(Gesamtkosten: USD 344.213.818)</b>				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Gatehouse Shariah Global Equity

### Portfolioaufstellung

zum 30. September 2020

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts	Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>			
<b>Aktien</b>				<b>Aktien (Fortsetzung)</b>			
<b>AUSTRALIEN</b>				<b>NIEDERLANDE</b>			
818	CSL Limited	168.269	2,00	578	ASML Holding NV	213.301	2,54
	<b>Australien, insgesamt</b>	<b>168.269</b>	<b>2,00</b>	923	NXP Semiconductor NV	115.200	1,37
<b>DÄNEMARK</b>				<b>Niederlande, insgesamt</b>			
3.180	Novo Nordisk A/S	220.099	2,62			<b>328.501</b>	<b>3,91</b>
911	Orsted A/S	125.633	1,50	<b>SÜDKOREA</b>			
	<b>Dänemark, insgesamt</b>	<b>345.732</b>	<b>4,12</b>	4.506	Samsung Electronics Company Limited	224.241	2,67
<b>FRANKREICH</b>				<b>Südkorea, insgesamt</b>			
523	Essilor International SA	71.234	0,85			<b>224.241</b>	<b>2,67</b>
130	L'Oreal SA	42.319	0,50	<b>SPANIEN</b>			
1.206	Schneider Electric SE	149.978	1,79	1.599	Inditex SA	44.627	0,53
	<b>Frankreich, insgesamt</b>	<b>263.531</b>	<b>3,14</b>		<b>Spanien, insgesamt</b>	<b>44.627</b>	<b>0,53</b>
<b>DEUTSCHLAND</b>				<b>SCHWEDEN</b>			
470	Adidas AG	152.171	1,81	3.747	Atlas Copco AB - A	179.521	2,14
	<b>Deutschland, insgesamt</b>	<b>152.171</b>	<b>1,81</b>	3.043	Epiroc AB - A	44.251	0,53
<b>IRLAND</b>				<b>Schweden, insgesamt</b>			
1.985	Trane Technologies plc	240.681	2,87			<b>223.772</b>	<b>2,67</b>
	<b>Irland, insgesamt</b>	<b>240.681</b>	<b>2,87</b>	<b>SCHWEIZ</b>			
<b>JAPAN</b>				2.005	Nestle SA - Reg	238.614	2,84
4.900	Capcom Company Limited	272.093	3,24	1.555	Novartis AG - Reg	135.249	1,61
1.900	Hoya Corp.	213.532	2,55	732	Roche Holding AG	251.091	3,00
200	Keyence Corp.	92.827	1,11	770	Sika AG	189.661	2,26
2.500	Koito Manufacturing Company Limited	126.741	1,51	2.002	TE Connectivity Limited	195.675	2,33
2.300	Murata Manufacturing Company Limited	147.616	1,76		<b>Schweiz, insgesamt</b>	<b>1.010.290</b>	<b>12,04</b>
200	Nintendo Company Limited	113.067	1,35	<b>TAIWAN</b>			
3.800	Terumo Corp.	150.516	1,79	9.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	134.556	1,60
300	Tokyo Electron Limited	77.694	0,93		<b>Taiwan, insgesamt</b>	<b>134.556</b>	<b>1,60</b>
3.300	Yaskawa Electric Corp.	128.053	1,52	<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH</b>			
	<b>Japan, insgesamt</b>	<b>1.322.139</b>	<b>15,76</b>	1.509	Ferguson plc	152.399	1,82
<b>JERSEY – KANALINSELN</b>				1.246	Rio Tinto plc	74.992	0,89
640	Aptiv plc	58.675	0,70		<b>Vereinigtes Königreich, insgesamt</b>	<b>227.391</b>	<b>2,71</b>
	<b>Jersey – Kanalinseln, insgesamt</b>	<b>58.675</b>	<b>0,70</b>				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Gatehouse Shariah Global Equity

### Portfolioaufstellung

(Fortsetzung)

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinven- tarwerts
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>			
<b>Aktien (Fortsetzung)</b>			
<b>VEREINIGTE STAATEN</b>			
316	3M Company	50.617	0,60
2.622	Activision Blizzard Inc.	212.251	2,53
563	Adobe Systems Inc.	276.112	3,29
95	Alphabet Inc. - A	139.232	1,66
1.178	Baxter International Inc.	94.735	1,13
4.484	Boston Scientific Corp.	171.334	2,04
425	Cooper Companies Inc.	143.276	1,71
309	Danaher Corp.	66.537	0,79
266	Estee Lauder Companies Inc.	58.054	0,70
378	Facebook Inc. - A	98.998	1,18
493	Illumina Inc.	152.376	1,82
2.593	Maxim Integrated Products Inc.	175.313	2,09
3.229	Microsoft Corp.	679.157	8,09
514	Mohawk Industries Inc.	50.161	0,60
1.678	PepsiCo Inc.	232.571	2,77
2.259	Pfizer Inc.	82.905	0,99
2.079	PTC Inc.	171.975	2,05
848	Salesforce.com Inc.	213.119	2,54
313	Stryker Corp.	65.220	0,78
1.517	Tjx Companies Inc.	84.421	1,01
908	Union Pacific Corp.	178.758	2,13
	<b>Vereinigte Staaten, insgesamt</b>	<b>3.397.122</b>	<b>40,50</b>
	<b>Aktien, insgesamt</b>	<b>8.141.698</b>	<b>97,03</b>
	<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt</b>	<b>8.141.698</b>	<b>97,03</b>
	<b>Wert der Anlagen, insgesamt</b>	<b>8.141.698</b>	<b>97,03</b>
	<b>(Gesamtkosten: USD 5.976.958)</b>		

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Erläuterungen zum Abschluss

### 1 ALLGEMEINES

Threadneedle (Lux) (die „SICAV“) ist eine Investmentgesellschaft mit variablem Kapital (*Société d'Investissement à Capital Variable*), die den Vorschriften von Teil I des Gesetzes vom 17. Dezember 2010 über Organismen für gemeinsame Anlagen unterliegt.

Die SICAV bietet Anlegern die Möglichkeit, Anlagen in separaten Teilfonds (die „Portfolios“) zu tätigen, die jeweils unterschiedliche Anlageziele haben und getrennt geführte Vermögensportfolios sind, die separate Wertpapiere umfassen. Jedes Portfolio kann eine oder mehrere entsprechende Anteilklassen (die „Anteilklassen“) haben. Die SICAV als Ganzes, einschließlich der bestehenden und aller künftigen Portfolios, ist eine ungeteilte juristische Person. Im Verhältnis zu Dritten, insbesondere in Bezug auf die Kreditoren der SICAV und im Verhältnis zwischen den Anteilhabern haftet jedoch jedes Portfolio ausschließlich für die ihm zuzurechnenden Passiva.

#### Wesentliche Ereignisse während des Berichtszeitraums:

##### Neuer Verkaufsprospekt

Im September 2020 wurde ein neuer Verkaufsprospekt veröffentlicht.

##### Gebührensenkung

Mit Wirkung zum 1. September 2020 wurde die Anlageverwaltungsgebühr für die Anteilklassen I und Z des Threadneedle (Lux) - European Social Bond Portfolio von 0,40 % auf 0,30 % gesenkt. Bitte beachten Sie auch Erläuterung 5.

##### Auflegung von Portfolios

Das Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities Portfolio wurde am 24. September 2020 aufgelegt.

##### Auflegung und Schließung von Anteilklassen

Im Berichtszeitraum zum 30. September 2020 wurden folgende Anteilklassen aufgelegt:

Anteilklasse	Portfolio	Auflegungsdatum
4E	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	8. April 2020
AE	Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	6. Mai 2020
AE	Threadneedle (Lux) - European Social Bond	18. September 2020
AEP	Threadneedle (Lux) - European Social Bond	18. September 2020
ZGC	Threadneedle (Lux) - European Social Bond	3. April 2020
ZGH	Threadneedle (Lux) - European Social Bond	3. April 2020
ZUH	Threadneedle (Lux) - European Social Bond	12. Juni 2020
AE	Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities	24. September 2020
AEC	Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities	24. September 2020
AEH	Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities	24. September 2020
AU	Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities	24. September 2020
AUP	Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities	24. September 2020
IE	Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities	24. September 2020
IEH	Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities	24. September 2020
IG	Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities	24. September 2020
IU	Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities	24. September 2020
LE	Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities	24. September 2020
LG	Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities	24. September 2020
XU	Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities	24. September 2020
ZE	Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities	24. September 2020
ZEC	Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities	24. September 2020
ZEH	Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities	24. September 2020
ZU	Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities	24. September 2020
ZUP	Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities	24. September 2020
ZEH	Threadneedle (Lux) - Global Focus	16. September 2020
ZFH	Threadneedle (Lux) - Global Focus	16. September 2020
IE	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	6. Mai 2020
IEP	Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	29. Juli 2020
NE	Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	18. September 2020
NG	Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	18. September 2020
NU	Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	18. September 2020
XG	Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	20. Mai 2020
XE	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	8. April 2020
XUH	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	8. April 2020

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 1 ALLGEMEINES

(Fortsetzung)

Im Berichtszeitraum zum 30. September 2020 wurden folgende Anteilklassen inaktiv:

Anteilklasse	Portfolio	Auflegungsdatum
4GP	Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	17. Juni 2020
W	Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	22. Mai 2020
ZUH	Threadneedle (Lux) - UK Equities	24. September 2020
XU	Threadneedle (Lux) - Gatehouse Shariah Global Equity	29. Juli 2020

Zum 30. September 2020 lauteten die aktiven Portfolios der SICAV wie folgt:

#### Die Anleiheportfolios:

- Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond
- Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond
- Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond
- Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond
- Threadneedle (Lux) - European Social Bond
- Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond
- Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds<sup>1</sup>
- Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt
- Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds<sup>1</sup>
- Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond<sup>1</sup>
- Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond

#### Die Vermögensallokationsportfolios:

- Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return
- Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return
- Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income<sup>1</sup>

#### Die Aktienportfolios:

- Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities
- Threadneedle (Lux) - Global Focus<sup>1</sup>
- Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities<sup>1</sup>
- Threadneedle (Lux) - Global Equity Income
- Threadneedle (Lux) - Global Select
- Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies
- Threadneedle (Lux) - American<sup>1</sup>
- Threadneedle (Lux) - American Select
- Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies
- Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity<sup>1</sup>
- Threadneedle (Lux) - Asia Equities
- Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities
- Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities
- Threadneedle (Lux) - Pan European Equities
- Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend
- Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities<sup>1</sup>
- Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies
- Threadneedle (Lux) - European Select
- Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies
- Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income<sup>1</sup>
- Threadneedle (Lux) - Global Technology<sup>1</sup>
- Threadneedle (Lux) - UK Equities
- Threadneedle (Lux) - UK Equity Income
- Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity

#### Die Absolute-Return-Portfolios:

- Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha
- Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities
- Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities
- Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha

#### Die Extended-Alpha-Portfolios:

- Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha
- Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha

#### Das Specialist-Portfolio:

- Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 1 ALLGEMEINES

(Fortsetzung)

#### Das Shariah-Portfolio:

- Threadneedle (Lux) - Gatehouse Shariah Global Equity

<sup>1</sup>Diese Portfolios wurden zum 30. September 2020 von der Securities and Futures Commission in Hongkong zugelassen und sind in Hongkong für die Öffentlichkeit verfügbar.

### 2 ZUSAMMENFASSUNG DER WESENTLICHEN RECHNUNGSLEGUNGSGRUNDSÄTZE

Der Abschluss wurde im Einklang mit den in Luxemburg allgemein anerkannten Grundsätzen der Rechnungslegung erstellt und vorgelegt, die für als OGAW (Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren) zugelassene Fonds gelten, und seine Erstellung erfordert Schätzungen und Annahmen seitens des Fondsmanagements, welche die im Abschluss und in den Erläuterungen ausgewiesenen Beträge beeinflussen. Die tatsächlichen Ergebnisse können von diesen Schätzungen abweichen.

Der Abschluss wird auf der Grundlage der Nettoinventarwerte der Portfolios erstellt, die zum 30. September 2020 berechnet werden. Der letzte offizielle Handelsnettoinventarwert der entsprechenden Portfolios wurde zum 30. September 2020 berechnet.

Der Abschluss wurde in Übereinstimmung mit den in Luxemburg für Investmentfonds geltenden gesetzlichen und aufsichtsrechtlichen Vorschriften nach dem Grundsatz der Unternehmensfortführung erstellt.

#### I) Bewertung der Wertpapiere

Übertragbare Wertpapiere, Geldmarktinstrumente und Finanzwerte, die an einem geregelten Markt notiert sind oder gehandelt werden, werden zu ihrem letzten Börsenkurs am entsprechenden Markt zum Zeitpunkt der Schließung des Marktes bewertet. Falls die Kurse dieser Wertpapiere nicht für deren fairen Marktwert repräsentativ sind, werden sie zu dem beizulegenden Zeitwert ausgewiesen, zu dem sie sich erwartungsgemäß wiederverkaufen lassen und den der Verwaltungsrat nach Treu und Glauben festlegt oder gemäß seinen Anweisungen festlegen lässt.

Die festverzinslichen Wertpapiere, die nicht auf diesen Märkten gehandelt werden, werden zum zuletzt verfügbaren Kurs, zu den Zinsgegenwerten der vom Verwaltungsrat genehmigten Händler oder Kursstellungsdienste oder zu einem anderen vom Verwaltungsrat für angemessen erachteten Kurs bewertet.

Geldmarktinstrumente (oder sonstige Instrumente, die in der Rechtsordnung, in der das Instrument gehalten wird, den Marktgrundsätzen entsprechen) mit einer Restlaufzeit von maximal 90 Tagen werden gemäß der Restbuchwertmethode (amortized cost method) bewertet, die in etwa den Marktwert widerspiegelt. Bei dieser Bewertungsmethode werden die entsprechenden Portfolioanlagen zu ihren Anschaffungskosten bzw. zu dem letzten, vor Beginn der 90-Tage-Frist verfügbaren Marktwert (sofern ein Instrument am Kaufdatum ursprünglich eine Restlaufzeit von mehr als 90 Tagen hatte), angepasst um die Abschreibung des Aufschlags oder des Abschlags, und nicht zum Marktwert bewertet.

Die Anteile offener Organismen für gemeinsame Anlagen („OGA“) werden zu ihrem zuletzt festgestellten und verfügbaren Nettoinventarwert (der „Nettoinventarwert“) bewertet. Falls die Preise dieser Vermögenswerte für deren beizulegenden Marktwert nicht repräsentativ sind, werden sie von der SICAV nach Treu und Glauben festgelegt. Die Anteile geschlossener OGA werden zu ihrem letztverfügbaren Kurswert bewertet.

Die Verwaltungsratsmitglieder der SICAV (die „Verwaltungsratsmitglieder“) können in eigenem Ermessen die Verwendung anderer Bewertungsmethoden genehmigen, wenn sie der Ansicht sind, dass sie den beizulegenden Zeitwert eines Vermögenswerts der SICAV besser wiedergeben.

#### II) Devisenterminkontrakte

Zur Absicherung besonderer Währungsrisiken bzw. zur Anlage in anderen Währungen darf die SICAV Devisenterminkontrakte eingehen. Zum Ende des Berichtszeitraumes wurden die offenen Devisenterminkontrakte zu den Terminkursen bewertet, die für die Restlaufzeit bis Fälligkeit gültig waren. Die Nettobewegung der entstandenen nicht realisierten Gewinne/(Verluste) aus Devisenterminkontrakten ist in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und Entwicklung des Nettovermögens ausgewiesen. Die zum 30. September 2020 offenen Kontrakte sind in Erläuterung 9 aufgeführt.

#### III) Terminkontrakte

Die SICAV kann Devisenterminkontrakte eingehen. Offene Terminkontrakte werden zu den Kursen an der Börse bewertet, an denen die Kontrakte gehandelt werden. Die Nettobewegung der entstandenen nicht realisierten Gewinne/(Verluste) aus Terminkontrakten ist in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und Entwicklung des Nettovermögens ausgewiesen. Die zum 30. September 2020 offenen Kontrakte sind in Erläuterung 11 aufgeführt.

#### IV) Swaps

Die SICAV darf Aktienswaps, Zinsswaps („IRS“), Credit Default Swaps („CDS“) und Total Return Swaps („TRS“) abschließen. Zinsswaps (IRS) werden auf Basis ihres Marktwerts bewertet, der sich aus der gültigen Zinskurve ergibt. Kreditausfallswaps werden unter Bezug auf den aktuellen Nettowert des erwarteten zukünftigen Cashflows basierend auf den marktüblichen Zinssätzen und der an dem Markt zu erwartenden Ausfall- und Rückgewinnungsrate der zugrunde liegenden Vermögenswerte bewertet. Eine gegebenenfalls von der SICAV geleistete Vorauszahlung wird in der Aufstellung des Nettovermögens als Vermögenswert ausgewiesen. Eine gegebenenfalls von der SICAV erhaltene Vorauszahlung wird in der Aufstellung des Nettovermögens als Verbindlichkeit ausgewiesen. TRS werden anhand ihres Marktwerts bewertet, der auf dem Marktwert des Basiswerts basiert. Die Nettobewegung der entstandenen nicht realisierten Gewinne oder Verluste aus Swap-Geschäften ist in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und Entwicklung des Nettovermögens ausgewiesen. Die zum 30. September 2020 offenen Kontrakte sind in Erläuterung 10 aufgeführt. Die ggf. auf Swap-Short-Positionen zahlbaren Dividenden werden in der Aufstellung des Nettovermögens als Verbindlichkeit ausgewiesen.

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 2 ZUSAMMENFASSUNG DER WESENTLICHEN RECHNUNGSLEGUNGSGRUNDSÄTZE

(Fortsetzung)

#### V) Optionen

An einem geregelten Markt gehandelte Optionen werden zum Marktpreis am Tag der Bewertung bewertet. Solche zum 30. September 2020 offenen Optionen sind dem Anlageverzeichnis zu entnehmen. Over the Counter („OTC“)-Optionen werden zu Preisen bewertet, die von externen Preisagenturen/Modellen bereitgestellt werden. Solche zum 30. September 2020 offenen Optionen sind in Erläuterung 12 aufgeführt. Zum Zeitpunkt der Berichterstellung durch die Bewertung von Optionsgeschäften entstandene nicht realisierte Gewinne oder Verluste werden in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und Entwicklung des Nettovermögens ausgewiesen.

#### VI) Währungsverrechnung

Die Konten eines Portfolios werden in der Währung geführt, in der dessen Nettovermögen ausgedrückt ist. Auf diese Währung (die „Basiswährung“) lauten auch jeweils die Aufstellung des Nettovermögens, die Ertrags- und Aufwandsrechnung und Entwicklung des Nettovermögens sowie das Anlageverzeichnis.

Während des Berichtszeitraums wurden Transaktionen, Erträge und Aufwendungen, die auf eine andere Währung als die Basiswährung lauten, auf Basis der Wechselkurse verbucht, die an dem Datum, an dem sie erfolgten oder im Portfolio anfielen, gültig waren.

Zum Datum der Aufstellung des Nettovermögens werden monetäre Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, die auf eine andere Währung als die Basiswährung lauten, auf Basis der an diesem Datum geltenden Wechselkurse in die Basiswährung umgerechnet. Wechselkursdifferenzen sind in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und Entwicklung des Nettovermögens ausgewiesen.

Die konsolidierte Aufstellung des Nettovermögens sowie die konsolidierte Ertrags- und Aufwandsrechnung und Entwicklung des Nettovermögens werden in USD vorgelegt. Sie beruhen auf den Wechselkursen, die am Datum der Aufstellung des Nettovermögens gültig waren. Wechselkurse zum 30. September 2020: 1 USD = 1,395187 AUD, 1 USD = 0,852769 EUR, 1 USD = 0,773515 GBP, 1 USD = 0,918750 CHF, 1 USD = 8,949987 SEK, 1 USD = 6,347755 DKK, 1 USD = 9,356638 NOK, 1 USD = 7,750016 HKD und 1 USD = 1,365100 SGD.

Die Differenz zwischen dem Eröffnungs-Nettovermögen, das zu den zu Beginn des Berichtszeitraums geltenden Wechselkursen ausgewiesen ist, und dessen Wert am Ende der Berichtsperiode werden als Umrechnungsanpassung in der konsolidierten Ertrags- und Aufwandsrechnung und Entwicklung des Nettovermögens unter der Überschrift „Wechselkursdifferenzen“ ausgewiesen.

#### VII) Bankguthaben

Das in der Aufstellung des Nettovermögens angegebene Bankguthaben beinhaltet auch die Margen auf Futures und von Maklern zahlbare Barsicherheiten für Swapgeschäfte und Devisenterminkontrakte.

Bankguthaben und Margen auf Futures werden zu Anschaffungskosten bewertet, was in etwa dem Marktwert entspricht.

#### VIII) Termineinlagen

Termineinlagen werden zu Anschaffungskosten bewertet, was in etwa dem Marktwert entspricht.

#### IX) Anlagetransaktionen und Anlageertrag

Wertpapiere werden zum Anschaffungspreis und ggf. auf der Grundlage der am Kauftag geltenden Wechselkurse ausgewiesen.

Einnahmen aus dem Verkauf von Wertpapieren werden auf der Basis der Durchschnittskostenmethode ermittelt. Anlagetransaktionen werden zum Transaktionsdatum abgerechnet. Dividenden werden zum Ex-Dividenden-Datum abgerechnet. Zinserträge werden bei ihrem Anfallen ausgewiesen. Abschläge/Aufschläge auf Nullkuponanleihen werden als Anpassungen mit den Zinserträgen verrechnet.

Zinsen, Dividenden und Kapitalerträge auf Wertpapiere können in bestimmten Ländern einer Quellen- oder Kapitalertragsteuer unterliegen.

#### X) Ausschüttungspolitik

Gemäß der Ausschüttungspolitik der SICAV sind für keine der Anteilklassen der Portfolios Ausschüttungen vorgesehen, mit Ausnahme der Klassen, deren Bezeichnung mit „C“, „M“, „P“ oder „T“ endet. Sämtliche Nettoerträge der Portfolios werden thesauriert und innerhalb der betreffenden Portfolios und der betreffenden Klasse wieder angelegt. Die SICAV beabsichtigt, für die Klassen, deren Bezeichnung mit „C“, „M“, „P“ oder „T“ endet, regelmäßig (mindestens jährlich) Ausschüttungen in einer vom Verwaltungsrat festzulegenden Höhe durchzuführen. Die Anteilinhaber dieser Anteilklassen können sich entweder für eine Ausschüttung oder eine Wiederanlage der Erträge in die SICAV entscheiden.

#### XI) Rückvergütungen von Anlageverwaltungsgebühren

Überkreuzbeteiligungen und Anlagen in anderen Fonds von Columbia Threadneedle werden entweder in nicht gebührenpflichtigen Anteilklassen getätigt oder die gezahlte Verwaltungsgebühr wird vollständig zurückerstattet. Bitte lesen Sie auch Erläuterung 18, die Einzelheiten zu Überkreuzbeteiligungen enthält.



## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 3 BESTEUERUNG

Gemäß der aktuellen Gesetzgebung und Praxis unterliegt die SICAV keiner luxemburgischen Einkommens- oder Kapitalertragssteuer auf den realisierten Wertzuwachs ihrer Vermögenswerte, und auch die durch die SICAV ausgeschütteten Dividenden unterliegen keiner luxemburgischen Quellensteuer.

Gemäß den geltenden Gesetzen und Vorschriften unterliegt die SICAV im Großherzogtum Luxemburg einer jährlichen Zeichnungssteuer in Höhe von 0,05 %, die sich aus ihrem Nettoinventarwert am Ende eines Quartals herleitet und vierteljährlich abzuführen ist. Auf die von der SICAV gehaltenen Vermögenswerte anderer OGAW, die bereits dieser luxemburgischen Steuer unterliegen, fällt keine Steuer an.

Für institutionelle Anteilklassen wird am letzten Tag eines jeden Kalenderquartals in Übereinstimmung mit dem Gesetz vom 17. Dezember 2010 in der jeweils gültigen Fassung eine verringerte jährliche Zeichnungssteuer von 0,01 % auf den Nettoinventarwert erhoben.

Auch für Portfolios, deren einziges Ziel in der gemeinsamen Anlage in Geldmarktinstrumenten und der Platzierung von Einlagen bei Kreditinstituten besteht, gilt eine verringerte Steuer von 0,01 %. Diese Steuer fällt ebenfalls nicht auf den Anteil der Vermögenswerte der SICAV an, der gegebenenfalls in anderen luxemburgischen OGAW angelegt ist.

Obwohl die realisierten Kapitalerträge der SICAV, ganz gleich ob kurz- oder langfristig, in Luxemburg nicht versteuert werden müssen, können sie in den Herkunftsländern der Steuerpflicht unterliegen.

### 4 SONSTIGE GEBÜHREN

Die sonstigen Gebühren umfassen hauptsächlich italienische Steuern.

### 5 TRANSAKTIONEN MIT VERBUNDENEN PARTEIEN

Die SICAV kann im Namen der verschiedenen Portfolios Kreditgeschäfte (vorbehaltlich der Beschränkungen unter „Anlagebeschränkungen“ in Anhang A des Verkaufsprospekts) sowie den Kauf oder Verkauf von übertragbaren Wertpapieren, Devisen oder sonstigen Finanzinstrumenten über die Threadneedle Asset Management Limited („TAML“), eine verbundene Partei und ihre verbundenen Unternehmen tätigen, sofern diese Geschäfte nach dem Fremdvergleichsprinzip und zu üblichen Handelsbedingungen ausgeführt werden und im besten Interesse der betreffenden Portfolios und ihrer Anteilinhaber liegen.

Für den Berichtszeitraum zum 30. September 2020 ging die SICAV keine Transaktionen mit verbundenen Personen ein.

Die SICAV hat Threadneedle Management Luxembourg S.A. (die „Verwaltungsgesellschaft“) gemäß Kapitel 15 des Gesetzes vom 17. Dezember 2010 in der jeweils gültigen Fassung zu ihrer bezeichneten Verwaltungsgesellschaft ernannt. Gemäß der Verwaltungsgesellschaftsvereinbarung erbringt die Verwaltungsgesellschaft vorbehaltlich der allgemeinen Aufsicht und Kontrolle durch den Verwaltungsrat Anlageverwaltungs-, Verwaltungs- und Marketingdienstleistungen für die SICAV.

Weder die Verwaltungsgesellschaft noch TAML haben Provisionen für Brokertransaktionen erhalten.

Gewisse Führungskräfte und/oder Verwaltungsratsmitglieder der Verwaltungsgesellschaft, der SICAV und von anderen Unternehmen von Columbia Threadneedle Group sind auch Führungskräfte und/oder Verwaltungsratsmitglieder von TAML.

Die Verwaltungsgesellschaft hat (im Namen der SICAV) bestimmte Marketing- bzw. Vertriebsfunktionen an weitere Unternehmen von Columbia Threadneedle Group übertragen. Die Verwaltungsgesellschaft erhält für ihre Anlageverwaltungsdienste eine monatliche Gebühr zu dem in dieser Erläuterung aufgeführten Jahressatz, ausgedrückt als Prozentsatz des durchschnittlichen täglichen Nettovermögens der einzelnen Portfolios. Die Verwaltungsgesellschaft ist verpflichtet, aus dieser Gebühr die Untervertriebsgebühren zu zahlen. Einige der Unterberater sind verbundene Parteien.

Wie in Erläuterung 8 beschrieben, kann die Verwaltungsgesellschaft auch Performancegebühren in Bezug auf alle A-, D-, I- und Z-Anteile des Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha Portfolio, in Bezug auf alle J- und Y-Anteile des Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities Portfolio und in Bezug auf alle A-, D-, I-, L- und Z-Anteile des Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha Portfolio erhalten.

Sämtliche durch den Betrieb der SICAV entstandenen und nachstehend definierten Kosten (nachstehend die „Betriebskosten“, „Anlageverwaltungsgebühr“ oder „Portfoliogeühren“, zusammen die „Aufwendungen“) werden zu den in den Tabellen ab Seite 226 aufgeführten Sätzen festgelegt. Alle Aufwendungen fallen auf der Grundlage des Nettoinventarwerts der entsprechenden Anteilklasse im entsprechenden Portfolio täglich an.

Die Betriebskosten beinhalten unter anderem Steuern, Aufwendungen für Rechtsberatungs- und Prüfungsdienste, Druckkosten für Vollmachtsformulare, Aktienzertifikate, Berichte und Mitteilungen an die Anteilinhaber, Verkaufsprospekte und die wesentlichen Informationen für den Anleger (KIID) sowie weitere Werbekosten, Gebühren und Kosten der Verwahrstelle und deren Korrespondenten, der Domizilstelle, Verwaltungsstelle, Register- und Transferstelle sowie der Zahlstelle, Aufwendungen für die Ausgabe und Rücknahme von Anteilen, Registrierungsgebühren und Aufwendungen in verschiedenen Rechtsgebieten, Notierungsgebühren, Gebühren für nicht verbundene Verwaltungsratsmitglieder der SICAV, Aufwendungen für die Verwaltungsratsmitglieder und Führungskräfte der SICAV und die Unterberater für deren Teilnahme an Sitzungen des Verwaltungsrates und Versammlungen der Anteilinhaber der SICAV, Übersetzungskosten, Rechnungslegungs- und Kursermittlungskosten (einschließlich der Berechnung des Nettoinventarwerts je Anteil), Versicherung, Rechtsstreitigkeiten und sonstige außerordentliche oder nicht wiederkehrende Aufwendungen und alle sonstigen Aufwendungen, die durch die SICAV ordnungsgemäß zu entrichten sind. In den Betriebskosten ist auch die an die Verwaltungsgesellschaft zahlbare Servicegebühr enthalten. Die Verwaltungsgesellschaft trägt den Teil der Betriebskosten, der über dem Jahressatz liegt. Hingegen ist die Verwaltungsgesellschaft berechtigt, einen Betrag einzubehalten, um den der Jahressatz für Betriebskosten die der SICAV tatsächlich entstandenen Aufwendungen übersteigt.

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 5 TRANSAKTIONEN MIT VERBUNDENEN PARTEIEN

(Fortsetzung)

Darüber hinaus hat die Verwaltungsgesellschaft Anspruch auf eine Anlageverwaltungsgebühr (die „Anlageverwaltungsgebühr“), die in den Tabellen ab Seite 226 näher beschrieben wird und die täglich anfällt und monatlich zahlbar ist. Für die X-Anteile und 4-Anteile wird keine Anlageverwaltungsgebühr fällig. Zur Klarstellung: Die Betriebskosten umfassen weder Anlageverwaltungsgebühren noch Performancegebühren, die hiervon unabhängig sind und gesondert erhoben werden.

Die SICAV bietet B-Anteile im Threadneedle (Lux) Global Technology Portfolio an.

Diese B-Anteile sind eine veraltete Anteilklasse, die nur von bestehenden Anteilhabern gezeichnet werden können und für die kein Ausgabeaufschlag anfällt.

#### A-ANTEILE:

Portfolio(s)	Ausgabeaufschlag in % des Anlagebetrages	Umtauschgebühr
Anleiheportfolios	maximal 3,0 %	maximal 0,75 %
Aktienportfolios und Vermögensallokationsportfolios	maximal 5,0 %	maximal 0,75 %
Absolute-Return-Portfolios	maximal 5,0 %	maximal 0,75 %
Extended-Alpha-Portfolios	maximal 5,0 %	maximal 0,75 %
Specialist-Portfolio	maximal 5,0 %	maximal 0,75 %
Shariah-Portfolio	maximal 5,0 %	maximal 0,75 %

Bei den angegebenen Ausgabeaufschlägen handelt es sich um Höchstsätze, auf die die Vertriebsstellen oder die Untervertriebsstellen in Abhängigkeit von dem jeweiligen Zeichnungsbetrag bzw. angesichts örtlicher Marktgegebenheiten ganz oder teilweise verzichten können.

Portfolio-Typ	Name des Portfolios	Anlageverwaltungsgebühr	Betriebskosten	Basiswährung
<b>Anleiheportfolios</b>				
	Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	0,60 %	0,25 %	USD
	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	0,90 %	0,30 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	1,25 %	0,30 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond	0,75 %	0,15 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Social Bond	0,40 %	0,15 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	0,90 %	0,25 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	1,35 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	1,35 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	1,30 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	1,25 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	1,25 %	0,30 %	USD
<b>Vermögensallokationsportfolios</b>				
	Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	1,25 %	0,30 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	1,35 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	1,25 %	0,30 %	USD
<b>Aktienportfolios</b>				
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities*	1,50 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Focus	1,50 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	1,50 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	1,50 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	1,50 %	0,30 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - American	1,50 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American Select	1,50 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	1,50 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	1,50 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	1,50 %	0,35 %	USD
	Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	0,55 %	0,15 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equities	1,50 %	0,30 %	EUR

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 5 TRANSAKTIONEN MIT VERBUNDENEN PARTEIEN

(Fortsetzung)

<b>Aktienportfolios</b>				
<i>(Fortsetzung)</i>				
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	1,50 %	0,30 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	1,50 %	0,35 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Select	1,50 %	0,30 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	1,50 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Technology	1,65 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - UK Equities	1,50 %	0,30 %	GBP
	Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	1,50 %	0,30 %	GBP
<b>Absolute-Return-Portfolios</b>				
	Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	1,50 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	0,90 %	0,30 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	1,50 %	0,35 %	EUR
<b>Extended-Alpha-Portfolios</b>				
	Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	1,50 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	1,50 %	0,30 %	USD
<b>Specialist-Portfolio</b>				
	Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	1,75 %	0,30 %	USD
<b>Shariah-Portfolio</b>				
	Threadneedle (Lux) - Gatehouse Shariah Global Equity	1,50 %	0,35 %	USD

#### B-ANTEILE:

Portfolio(s)	Ausgabeaufschlag in % des Anlagebetrages	Umtauschgebühr
Jedes unten aufgeführte Portfolio	n. z.	Null

Portfolio-Typ	Name des Portfolios	Anlage- verwaltungsgebühr	Betriebskosten	Basiswährung
<b>Aktienportfolios</b>				
	Threadneedle (Lux) - Global Technology	2,00 %	0,35 %	USD

#### D-ANTEILE:

Portfolio(s)	Ausgabeaufschlag in % des Anlagebetrages	Umtauschgebühr
Jedes unten aufgeführte Portfolio	maximal 1,00 %	maximal 0,75 %

Bei den angegebenen Ausgabeaufschlägen handelt es sich um Höchstsätze, auf die die Vertriebsstellen oder die Untervertriebsstellen in Abhängigkeit von dem jeweiligen Zeichnungsbetrag bzw. angesichts örtlicher Marktgegebenheiten ganz oder teilweise verzichten können.

Portfolio-Typ	Name des Portfolios	Anlage- verwaltungsgebühr	Betriebskosten	Basiswährung
<b>Anleiheportfolios</b>				
	Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	1,35 %	0,25 %	USD
	Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	1,45 %	0,25 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	1,45 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	1,45 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	1,45 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	1,45 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	1,45 %	0,30 %	USD

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 5 TRANSAKTIONEN MIT VERBUNDENEN PARTEIEN

(Fortsetzung)

Portfolio-Typ	Name des Portfolios	Anlage-verwaltungsgebühr	Betriebskosten	Basiswährung
<b>Vermögensallokationsportfolios</b>				
	Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	2,00 %	0,30 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	2,00 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset income	2,00 %	0,30 %	USD
<b>Aktienportfolios</b>				
	Threadneedle (Lux) - Global Focus	2,25 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	2,25 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	2,00 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	2,00 %	0,30 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - American	1,85 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American Select	2,25 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	2,00 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	2,25 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	2,00 %	0,35 %	USD
	Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	0,75 %	0,15 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equities	1,85 %	0,30 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	1,85 %	0,30 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	2,40 %	0,35 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Select	2,00 %	0,35 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	2,25 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Technology	2,00 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - UK Equities	2,25 %	0,35 %	GBP
	Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	2,25 %	0,30 %	GBP
<b>Absolute-Return-Portfolios</b>				
	Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	2,00 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	1,45 %	0,30 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	2,00 %	0,35 %	EUR
<b>Extended-Alpha-Portfolios</b>				
	Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	2,00 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	2,00 %	0,30 %	USD
<b>Specialist-Portfolio</b>				
	Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	2,25 %	0,30 %	USD

#### I-ANTEILE:

Portfolio(s)	Ausgabeaufschlag in % des Anlagebetrages	Umtauschgebühr
Jedes unten aufgeführte Portfolio	n. z.	maximal 0,75 %

Portfolio-Typ	Name des Portfolios	Anlage-verwaltungsgebühr	Betriebskosten	Basiswährung
<b>Anleiheportfolios</b>				
	Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	0,50 %	0,15 %	USD
	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	0,40 %	0,20 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	0,65 %	0,20 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond	0,40 %	0,10 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Social Bond	0,30 %**	0,10 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	0,40 %	0,15 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	0,65 %	0,20 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	0,65 %	0,20 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	0,65 %	0,20 %	USD

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 5 TRANSAKTIONEN MIT VERBUNDENEN PARTEIEN

(Fortsetzung)

Portfolio-Typ	Name des Portfolios	Anlageverwaltungsgebühr	Betriebskosten	Basiswährung
<b>Anleiheportfolios</b> (Fortsetzung)				
	Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	0,55 %	0,10 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	0,60 %	0,20 %	USD
<b>Vermögensallokationsportfolios</b>				
	Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	0,65 %	0,20 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	0,75 %	0,20 %	USD
<b>Aktienportfolios</b>				
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities*	0,65 %	0,15 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Focus	0,75 %	0,20 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	0,75 %	0,20 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	0,75 %	0,20 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Select	0,75 %	0,20 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	0,75 %	0,20 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - American	0,70 %	0,20 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American Select	0,80 %	0,20 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	0,75 %	0,20 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	0,75 %	0,20 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Asia Equities	0,75 %	0,20 %	USD
	Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	0,80 %	0,25 %	USD
	Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	0,25 %	0,10 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equities	0,75 %	0,20 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	0,75 %	0,20 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	0,85 %	0,25 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	0,75 %	0,20 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Select	0,75 %	0,20 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	0,75 %	0,20 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	0,75 %	0,20 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Technology	0,85 %	0,20 %	USD
	Threadneedle (Lux) - UK Equities	0,65 %	0,20 %	GBP
	Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	0,65 %	0,20 %	GBP
	Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity	1,25 %	0,35 %	USD
<b>Absolute-Return-Portfolios</b>				
	Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	0,75 %	0,20 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	0,35 %	0,20 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	0,75 %	0,20 %	EUR
<b>Extended-Alpha-Portfolios</b>				
	Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	0,75 %	0,15 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	0,75 %	0,15 %	USD
<b>Specialist-Portfolio</b>				
	Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	0,80 %	0,20 %	USD

#### J-ANTEILE:

Portfolio(s)	Ausgabeaufschlag in % des Anlagebetrages	Umtauschgebühr
Jedes unten aufgeführte Portfolio	n. z.	maximal 0,75 %

Eine Performancegebühr wird auch für J-Anteile erhoben, wie im Abschnitt „Performancegebühr“ im Hauptteil des Prospekts beschrieben.

Portfolio-Typ	Name des Portfolios	Anlageverwaltungsgebühr	Betriebskosten	Basiswährung
<b>Absolute-Return-Portfolio</b>				
	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	0,25 %	0,20 %	EUR

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 5 TRANSAKTIONEN MIT VERBUNDENEN PARTEIEN

(Fortsetzung)

#### L-ANTEILE:

Portfolio(s)	Ausgabeaufschlag in % des Anlagebetrages	Umtauschgebühr
Jedes unten aufgeführte Portfolio	n. z.	0,75 %

Bei den angegebenen Ausgabeaufschlägen handelt es sich um Höchstsätze, auf die die Vertriebsstellen oder die Untervertriebsstellen in Abhängigkeit von dem jeweiligen Zeichnungsbetrag bzw. angesichts örtlicher Marktgegebenheiten ganz oder teilweise verzichten können.

Portfolio-Typ	Name des Portfolios	Anlage- verwaltungsgebühr	Betriebskosten	Basiswährung
<b>Anleiheportfolio</b>				
	Threadneedle (Lux) - European Social Bond	0,30 %	0,10 %	EUR
<b>Vermögensallokationsportfolio</b>				
	Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	0,50 %	0,20 %	EUR
<b>Aktienportfolios</b>				
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities*	0,35 %	0,15 %	USD
	Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	0,50 %	0,20 %	GBP
<b>Absolute-Return-Portfolios</b>				
	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	0,20 %	0,20 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	0,375 %	0,20 %	EUR

#### N-ANTEILE:

Portfolio(s)	Ausgabeaufschlag in % des Anlagebetrages	Umtauschgebühr
Jedes unten aufgeführte Portfolio	n. z.	0,75 %

Bei den angegebenen Ausgabeaufschlägen handelt es sich um Höchstsätze, auf die die Vertriebsstellen oder die Untervertriebsstellen in Abhängigkeit von dem jeweiligen Zeichnungsbetrag bzw. angesichts örtlicher Marktgegebenheiten ganz oder teilweise verzichten können.

Portfolio-Typ	Name des Portfolios	Anlage- verwaltungsgebühr	Betriebskosten	Basiswährung
<b>Anleiheportfolios</b>				
	Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	0,30 %	0,15 %	USD
	Threadneedle (Lux) - European Social Bond	0,30 %	0,10 %	EUR
<b>Aktienportfolios</b>				
	Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	0,55 %	0,20 %	USD
	Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	0,10 %	0,10 %	USD
<b>Specialist-Portfolio</b>				
	Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	0,45 %	0,20 %	USD

#### S-ANTEILE:

Portfolio(s)	Ausgabeaufschlag in % des Anlagebetrages	Umtauschgebühr
Jedes unten aufgeführte Portfolio	maximal 5,0%	maximal 0,75 %

Bei den angegebenen Ausgabeaufschlägen handelt es sich um Höchstsätze, auf die die Vertriebsstellen oder die Untervertriebsstellen in Abhängigkeit von dem jeweiligen Zeichnungsbetrag bzw. angesichts örtlicher Marktgegebenheiten ganz oder teilweise verzichten können.

Portfolio-Typ	Name des Portfolios	Anlage- verwaltungsgebühr	Betriebskosten	Basiswährung
<b>Anleiheportfolio</b>				
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	1,50 %	0,30 %	USD

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 5 TRANSAKTIONEN MIT VERBUNDENEN PARTEIEN

(Fortsetzung)

#### T-ANTEILE:

Portfolio(s)	Ausgabeaufschlag in % des Anlagebetrages	Umtauschgebühr
Jedes unten aufgeführte Portfolio	5,00 %	0,75 %

Bei den angegebenen Ausgabeaufschlägen handelt es sich um Höchstsätze, auf die die Vertriebsstellen oder die Untervertriebsstellen in Abhängigkeit von dem jeweiligen Zeichnungsbetrag bzw. angesichts örtlicher Marktgegebenheiten ganz oder teilweise verzichten können.

Portfolio- Typ	Name des Portfolios	Anlage- verwaltungsgebühr	Betriebskosten	Basiswährung
<b>Anleiheportfolio</b>				
	Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	0,55 %	0,10 %	USD
<b>Aktienportfolio</b>				
	Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	0,90 %	0,19 %	USD

#### W-ANTEILE:

Portfolio(s)	Ausgabeaufschlag in % des Anlagebetrages	Umtauschgebühr
Jedes unten aufgeführte Portfolio	maximal 5,0 %	maximal 0,75 %

Bei den angegebenen Ausgabeaufschlägen handelt es sich um Höchstsätze, auf die die Vertriebsstellen oder die Untervertriebsstellen in Abhängigkeit von dem jeweiligen Zeichnungsbetrag bzw. angesichts örtlicher Marktgegebenheiten ganz oder teilweise verzichten können.

Portfolio- Typ	Name des Portfolios	Anlage- verwaltungsgebühr	Betriebskosten	Basiswährung
<b>Anleiheportfolios</b>				
	Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	0,85 %	0,30 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	1,00 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	1,00 %	0,30 %	USD
<b>Vermögensallokationsportfolio</b>				
	Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	1,40 %	0,35 %	USD
<b>Aktienportfolios</b>				
	Threadneedle (Lux) - Global Focus	1,40 %	0,35 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American	1,15 %	0,35 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American Select	1,40 %	0,35 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equities	1,40 %	0,35 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	1,55 %	0,35 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	1,65 %	0,35 %	USD

#### X-ANTEILE:

Portfolio(s)	Ausgabeaufschlag in % des Anlagebetrages	Umtauschgebühr
Jedes unten aufgeführte Portfolio	n. z.	maximal 0,75 %

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 5 TRANSAKTIONEN MIT VERBUNDENEN PARTEIEN

(Fortsetzung)

Portfolio-Typ	Name des Portfolios	Betriebskosten	Basiswährung
<b>Anleiheportfolios</b>			
	Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	0,15 %	USD
	Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	0,15 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond	0,10 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	0,15 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	0,15 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	0,15 %	USD
	Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	0,15 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	0,15 %	USD
<b>Aktienportfolios</b>			
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities*	0,15 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Focus	0,15 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	0,15 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	0,15 %	USD
	Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	0,15 %	USD
	Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	0,10 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equities	0,15 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	0,15 %	USD
<b>Absolute-Return-Portfolios</b>			
	Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	0,15 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	0,15 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	0,15 %	EUR
<b>Specialist-Portfolio</b>			
	Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	0,15 %	USD
<b>Shariah-Portfolio</b>			
	Threadneedle (Lux) - Gatehouse Shariah Global Equity	0,25 %	USD

#### Y-ANTEILE:

Portfolio(s)	Ausgabeaufschlag in % des Anlagebetrages	Umtauschgebühr
Jedes unten aufgeführte Portfolio	5,00 %	maximal 0,75 %

Bei den angegebenen Ausgabeaufschlägen handelt es sich um Höchstsätze, auf die die Vertriebsstellen oder die Untervertriebsstellen in Abhängigkeit von dem jeweiligen Zeichnungsbetrag bzw. angesichts örtlicher Marktgegebenheiten ganz oder teilweise verzichten können.

Portfolio-Typ	Name des Portfolios	Anlageverwaltungsgebühr	Betriebskosten	Basiswährung
<b>Absolute-Return-Portfolio</b>				
	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	0,35 %	0,25 %	EUR



## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 5 TRANSAKTIONEN MIT VERBUNDENEN PARTEIEN

(Fortsetzung)

#### Z-ANTEILE:

Portfolio(s)	Ausgabeaufschlag in % des Anlagebetrages	Umtauschgebühr
Jedes unten aufgeführte Portfolio	5,00 %	maximal 0,75 %

Bei den angegebenen Ausgabeaufschlägen handelt es sich um Höchstsätze, auf die die Vertriebsstellen oder die Untervertriebsstellen in Abhängigkeit von dem jeweiligen Zeichnungsbetrag bzw. angesichts örtlicher Marktgegebenheiten ganz oder teilweise verzichten können.

Portfolio-Typ	Name des Portfolios	Anlage- verwaltungsgebühr	Betriebskosten	Basiswährung
<b>Anleiheportfolios</b>				
	Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	0,40 %	0,20 %	USD
	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	0,40 %	0,30 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	0,60 %	0,30 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond	0,40 %	0,15 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Social Bond	0,30 %**	0,15 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	0,60 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	0,60 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	0,60 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	0,60 %	0,30 %	USD
<b>Vermögensallokationsportfolio</b>				
	Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	0,75 %	0,30 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	0,75 %	0,30 %	USD
<b>Aktienportfolios</b>				
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities*	0,75 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Focus	0,75 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	0,75 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	0,75 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Select	0,75 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	0,75 %	0,30 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - American	0,75 %	0,25 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American Select	0,75 %	0,35 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	0,75 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	0,75 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Asia Equities	0,75 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	0,75 %	0,35 %	USD
	Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	0,30 %	0,15 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equities	0,75 %	0,30 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	0,75 %	0,30 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	0,75 %	0,35 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	0,75 %	0,35 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Select	0,75 %	0,30 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	0,75 %	0,35 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	0,75 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Technology	0,85 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - UK Equities	0,75 %	0,30 %	GBP
	Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	0,75 %	0,30 %	GBP
	Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity	1,25 %	0,35 %	USD

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 5 TRANSAKTIONEN MIT VERBUNDENEN PARTEIEN

(Fortsetzung)

Portfolio-Typ	Name des Portfolios	Anlageverwaltungsgebühr	Betriebskosten	Basiswährung
<b>Absolute-Return-Portfolios</b>				
	Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	0,75 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	0,55 %	0,25 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	0,45 %	0,25 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	0,75 %	0,30 %	EUR
<b>Extended-Alpha-Portfolios</b>				
	Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	0,75 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	0,75 %	0,30 %	USD
<b>Specialist-Portfolio</b>				
	Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	0,75 %	0,30 %	USD

#### 1-ANTEILE:

Portfolio(s)	Ausgabeaufschlag in % des Anlagebetrages	Umtauschgebühr
Jedes unten aufgeführte Portfolio	5,00 %	n. z.

Bei den angegebenen Ausgabeaufschlägen handelt es sich um Höchstsätze, auf die die Vertriebsstellen oder die Untervertriebsstellen in Abhängigkeit von dem jeweiligen Zeichnungsbetrag bzw. angesichts örtlicher Marktgegebenheiten ganz oder teilweise verzichten können.

Portfolio-Typ	Name des Portfolios	Anlageverwaltungsgebühr	Betriebskosten	Basiswährung
<b>Anleiheportfolios</b>				
	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	1,00 %	0,19 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	1,20 %	0,18 %	EUR
<b>Aktienportfolios</b>				
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	1,50 %	0,21 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	1,50 %	0,18 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Select	1,50 %	0,18 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American	1,50 %	0,17 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American Select	1,50 %	0,17 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	1,50 %	0,18 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Asia Equities	1,50 %	0,20 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equities	1,50 %	0,23 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	1,50 %	0,20 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	1,50 %	0,22 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Select	1,50 %	0,15 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	1,50 %	0,22 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	1,50 %	0,14 %	GBP
<b>Absolute-Return-Portfolio</b>				
	Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	1,00 %	0,17 %	EUR
<b>Extended-Alpha-Portfolios</b>				
	Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	1,50 %	0,19 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	1,50 %	0,19 %	USD

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 5 TRANSAKTIONEN MIT VERBUNDENEN PARTEIEN

(Fortsetzung)

#### 2-ANTEILE:

Portfolio(s)	Ausgabeaufschlag in % des Anlagebetrages	Umtauschgebühr
Jedes unten aufgeführte Portfolio	n. z.	n. z.

Portfolio-Typ	Name des Portfolios	Anlage- verwaltungsgebühr	Betriebskosten	Basiswährung
<b>Anleiheportfolios</b>				
	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	0,50 %	0,08 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	0,75 %	0,07 %	EUR
<b>Aktienportfolios</b>				
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	1,00 %	0,10 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	1,00 %	0,07 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Select	1,00 %	0,07 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American	1,00 %	0,06 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American Select	1,00 %	0,06 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	1,00 %	0,07 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Asia Equities	1,00 %	0,09 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equities	1,00 %	0,08 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	1,00 %	0,09 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	1,00 %	0,07 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Select	1,00 %	0,06 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	1,00 %	0,07 %	EUR
<b>Absolute-Return-Portfolio</b>				
	Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	0,50 %	0,06 %	EUR
<b>Extended-Alpha-Portfolios</b>				
	Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	0,75 %	0,08 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	0,75 %	0,08 %	USD

#### 3-ANTEILE:

Portfolio(s)	Ausgabeaufschlag in % des Anlagebetrages	Umtauschgebühr
Jedes unten aufgeführte Portfolio	maximal 3,00 %	n. z.

Bei den angegebenen Ausgabeaufschlägen handelt es sich um Höchstsätze, auf die die Vertriebsstellen oder die Untervertriebsstellen in Abhängigkeit von dem jeweiligen Zeichnungsbetrag bzw. angesichts örtlicher Marktgegebenheiten ganz oder teilweise verzichten können.

Portfolio-Typ	Name des Portfolios	Anlage- verwaltungsgebühr	Betriebskosten	Basiswährung
<b>Anleiheportfolios</b>				
	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	0,50 %	0,19 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	0,60 %	0,17 %	EUR
<b>Aktienportfolios</b>				
	Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	0,75 %	0,18 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Select	0,75 %	0,15 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American	0,75 %	0,13 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American Select	0,75 %	0,12 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	0,75 %	0,18 %	USD

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 5 TRANSAKTIONEN MIT VERBUNDENEN PARTEIEN

(Fortsetzung)

Portfolio-Typ	Name des Portfolios	Anlageverwaltungsgebühr	Betriebskosten	Basiswährung
<b>Aktienportfolios</b>				
<i>(Fortsetzung)</i>				
	Threadneedle (Lux) - Asia Equities	0,75 %	0,20 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equities	0,75 %	0,19 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	0,75 %	0,20 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	0,75 %	0,16 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Select	0,75 %	0,13 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	0,75 %	0,18 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - UK Equities	0,75 %	0,12 %	GBP
	Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	0,75 %	0,13 %	GBP
<b>Extended-Alpha-Portfolio</b>				
	Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	0,75 %	0,19 %	USD

### 4-ANTEILE:

Portfolio(s)	Ausgabeaufschlag in % des Anlagebetrages	Umtauschgebühr
Jedes unten aufgeführte Portfolio	n. z.	n. z.

Portfolio-Typ	Name des Portfolios	Betriebskosten	Basiswährung
<b>Anleiheportfolios</b>			
	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	0,08 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	0,07 %	EUR
<b>Aktienportfolios</b>			
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equities	0,08 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	0,09 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	0,07 %	EUR
<b>Absolute-Return-Portfolio</b>			
	Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	0,06 %	EUR

### 8-ANTEILE:

Portfolio(s)	Ausgabeaufschlag in % des Anlagebetrages	Umtauschgebühr
Jedes unten aufgeführte Portfolio	n. z.	n. z.

Portfolio-Typ	Name des Portfolios	Anlageverwaltungsgebühr	Betriebskosten	Basiswährung
<b>Anleiheportfolios</b>				
	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	0,50 %	0,12 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	0,75 %	0,11 %	EUR

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 5 TRANSAKTIONEN MIT VERBUNDENEN PARTEIEN

(Fortsetzung)

Portfolio-Typ	Name des Portfolios	Anlageverwaltungsgebühr	Betriebskosten	Basiswährung
<b>Aktienportfolios</b>				
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	1,00 %	0,14 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	1,00 %	0,11 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Select	1,00 %	0,11 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American	1,00 %	0,10 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American Select	1,00 %	0,10 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	1,00 %	0,11 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Asia Equities	1,00 %	0,13 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equities	1,00 %	0,12 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	1,00 %	0,13 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	1,00 %	0,11 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Select	1,00 %	0,10 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	1,00 %	0,11 %	EUR
<b>Absolute-Return-Portfolio</b>				
	Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	0,50 %	0,10 %	EUR
<b>Extended-Alpha-Portfolios</b>				
	Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	0,75 %	0,12 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	0,75 %	0,12 %	USD

### 9-ANTEILE:

Portfolio(s)	Ausgabeaufschlag in % des Anlagebetrages	Umtauschgebühr
Jedes unten aufgeführte Portfolio	n. z.	n. z.

Portfolio-Typ	Name des Portfolios	Anlageverwaltungsgebühr	Betriebskosten	Basiswährung
<b>Anleiheportfolios</b>				
	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	0,50 %	0,15 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	0,60 %	0,13 %	EUR
<b>Aktienportfolios</b>				
	Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	0,75 %	0,14 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Select	0,75 %	0,11 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American	0,75 %	0,09 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American Select	0,75 %	0,08 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	0,75 %	0,14 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Asia Equities	0,75 %	0,16 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equities	0,75 %	0,15 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	0,75 %	0,16 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	0,75 %	0,12 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Select	0,75 %	0,09 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	0,75 %	0,14 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - UK Equities	0,75 %	0,08 %	GBP
	Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	0,75 %	0,09 %	GBP
<b>Extended-Alpha-Portfolio</b>				
	Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	0,75 %	0,15 %	USD

\*Siehe Erläuterung 1.

\*\*0,40 % bis zum 31. August 2020

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 6 PROVISIONSTEILUNGSVEREINBARUNGEN

Die Verwaltungsgesellschaft und bestimmte Unterberater dürfen Provisionsteilungsvereinbarungen mit Makler-Händlern abschließen. Im Rahmen dieser Vereinbarungen stellen diese Makler-Händler direkt oder über Dritte bestimmte gewerbliche Dienstleistungen bereit, die sie aus den für die Aufträge der SICAV erhaltenen Provisionen bezahlen. Für die bestmögliche Ausführung können Maklerprovisionen für Portfoliotransaktionen der SICAV von der Verwaltungsgesellschaft oder dem jeweiligen Unterberater an Makler-Händler insbesondere für von diesen erbrachte Research-Leistungen sowie Dienstleistungen im Zusammenhang mit der Ausführung von Bestellungen gewährt werden. Zusätzliche Informationen zu den Praktiken der einzelnen Unterberater in Bezug auf Provisionsteilungsvereinbarungen finden Sie im Abschnitt „Anlageberatungsvereinbarungen“ des Prospekts.

Alle von der Verwaltungsgesellschaft oder einem Unterberater eingegangenen Provisionsteilungsvereinbarungen unterliegen den folgenden Bedingungen: (i) die Verwaltungsgesellschaft oder der Unterberater handelt, wenn sie bzw. er Provisionsteilungsvereinbarungen eingeht, jederzeit im besten Interesse der SICAV und ihrer Anteilhaber; (ii) die erbrachten Dienstleistungen stehen in direktem Zusammenhang mit den Aktivitäten der Verwaltungsgesellschaft oder des Unterbauers; (iii) die Verwaltungsgesellschaft oder der Unterberater gewähren Maklerprovisionen für Portfoliotransaktionen der SICAV nur Makler-Händlern, bei denen es sich nicht um natürliche, sondern um juristische Personen handelt; (iv) Provisionsteilungsvereinbarungen sind nicht ausschlaggebend für die Auswahl der Makler-Händler für die Abwicklung; (v) die Verwaltungsgesellschaft oder der Unterberater legen dem Verwaltungsrat einen Bericht über die Provisionsteilungsvereinbarungen vor, aus welchem auch die Art der von ihnen erhaltenen Dienstleistungen hervorgeht; (vi) weder die Verwaltungsgesellschaft, der Unterberater noch eine mit ihnen verbundene Person darf von Makler-Händlern Bargeld oder sonstige Vergünstigungen erhalten; (vii) die erhaltenen Waren oder Dienstleistungen besitzen einen nachweisbaren Nutzen für die Anteilhaber; und (viii) es erfolgt eine regelmäßige Offenlegung im Jahresbericht der SICAV in Form einer Erklärung, in der die jeweiligen Provisionsteilungsvereinbarungen beschrieben sind, einschließlich einer Beschreibung der erhaltenen Waren und Dienstleistungen. Die erhaltenen Waren und Dienstleistungen können Folgendes beinhalten: Analysen, die für den Entscheidungsfindungsprozess des Unterbauers von zusätzlichem Nutzen sein können, und Abwicklungsdienste, die die Möglichkeiten des Unterbauers zur Durchführung von Transaktionen erweitern.

Nur die Unterberater Columbia Management Investment Advisors, LLC und STANLIB Asset Management (Pty) Limited dürfen Provisionsteilungsvereinbarungen abschließen.

### 7 DIVIDENDEN

Die SICAV hat im Berichtszeitraum zum 30. September 2020 die folgenden Dividenden erklärt:

Portfolio	Anteilklasse	Ex-Datum	Währung	Betrag je Anteil	Gesamtbetrag
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	Klasse AEC	24.06.2020	USD	0,097	35.066
	Klasse AEC	24.09.2020	USD	0,089	60.779
	Klasse AUP	24.06.2020	USD	0,093	373
	Klasse AUP	24.09.2020	USD	0,087	3.837
	Klasse DEC	24.06.2020	USD	0,089	361
	Klasse DEC	24.09.2020	USD	0,082	3.728
	Klasse DUP	24.06.2020	USD	0,089	2.108
	Klasse DUP	24.09.2020	USD	0,078	3.147
	Klasse IEC	24.06.2020	USD	0,094	9
	Klasse IEC	24.09.2020	USD	0,086	1.173
	Klasse IEP	24.06.2020	USD	0,107	11
	Klasse IEP	24.09.2020	USD	0,092	9
	Klasse IGC	24.06.2020	USD	0,108	11
	Klasse IGC	24.09.2020	USD	0,098	17.506
	Klasse IUP	24.06.2020	USD	0,091	9
	Klasse IUP	24.09.2020	USD	0,080	6.180
	Klasse NEC	24.06.2020	USD	0,096	19.905
	Klasse NEC	24.09.2020	USD	0,088	17.468
	Klasse NGC	24.06.2020	USD	0,106	500.867
	Klasse NGC	24.09.2020	USD	0,096	640.393
Klasse NUP	24.06.2020	USD	0,092	2.308	
Klasse NUP	24.09.2020	USD	0,081	3.418	
					<b>USD 1.318.666</b>

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 7 DIVIDENDEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Anteilkategorie	Ex-Datum	Währung	Betrag je Anteil	Gesamtbetrag	
<b>Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond</b>	Klasse 1UT	24.04.2020	EUR	0,028	7.064	
	Klasse 1UT	22.05.2020	EUR	0,029	7.423	
	Klasse 1UT	24.06.2020	EUR	0,032	8.329	
	Klasse 1UT	27.07.2020	EUR	0,030	7.917	
	Klasse 1UT	24.08.2020	EUR	0,025	6.474	
	Klasse 1UT	24.09.2020	EUR	0,030	7.884	
						<b>EUR 45.091</b>
<b>Threadneedle (Lux) - European Social Bond</b>	Klasse AEP	24.09.2020	EUR	0,002	0*	
	Klasse IEP	24.06.2020	EUR	0,032	72.976	
	Klasse IEP	24.09.2020	EUR	0,033	76.441	
	Klasse NEP	24.06.2020	EUR	3,199	259.953	
	Klasse NEP	24.09.2020	EUR	3,370	274.705	
	Klasse ZEP	24.06.2020	EUR	0,029	7.652	
	Klasse ZEP	24.09.2020	EUR	0,032	9.425	
	Klasse ZGC	24.06.2020	EUR	0,034	3	
	Klasse ZGC	24.09.2020	EUR	0,038	4	
					<b>EUR 701.159</b>	
<b>Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond</b>	Klasse AEP	24.04.2020	EUR	0,028	12.947	
	Klasse AEP	22.05.2020	EUR	0,028	12.822	
	Klasse AEP	24.06.2020	EUR	0,038	17.581	
	Klasse AEP	27.07.2020	EUR	0,038	18.233	
	Klasse AEP	24.08.2020	EUR	0,038	18.463	
	Klasse AEP	24.09.2020	EUR	0,041	20.221	
	Klasse DEP	24.04.2020	EUR	0,021	14.591	
	Klasse DEP	22.05.2020	EUR	0,021	14.719	
	Klasse DEP	24.06.2020	EUR	0,029	19.939	
	Klasse DEP	27.07.2020	EUR	0,029	21.843	
	Klasse DEP	24.08.2020	EUR	0,029	21.810	
	Klasse DEP	24.09.2020	EUR	0,031	24.943	
						<b>EUR 218.112</b>
	<b>Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds</b>	Klasse AEC	24.04.2020	USD	0,048	17.205
Klasse AEC		22.05.2020	USD	0,048	17.680	
Klasse AEC		24.06.2020	USD	0,060	23.856	
Klasse AEC		27.07.2020	USD	0,062	25.595	
Klasse AEC		24.08.2020	USD	0,062	28.009	
Klasse AEC		24.09.2020	USD	0,061	27.883	
Klasse AUP		24.04.2020	USD	0,028	21.568	
Klasse AUP		22.05.2020	USD	0,028	21.765	
Klasse AUP		24.06.2020	USD	0,034	26.719	
Klasse AUP		27.07.2020	USD	0,034	26.991	
Klasse AUP		24.08.2020	USD	0,034	26.542	
Klasse AUP		24.09.2020	USD	0,033	25.897	
Klasse DEC		24.04.2020	USD	0,035	1.793	
Klasse DEC		22.05.2020	USD	0,035	1.821	
Klasse DEC		24.06.2020	USD	0,044	2.271	
Klasse DEC		27.07.2020	USD	0,045	2.253	
Klasse DEC		24.08.2020	USD	0,046	2.186	

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 7 DIVIDENDEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Anteilkategorie	Ex-Datum	Währung	Betrag je Anteil	Gesamtbetrag
<b>Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds</b>					
<i>(Fortsetzung)</i>					
	Klasse DEC	24.09.2020	USD	0,043	1.786
	Klasse XUP	24.06.2020	USD	0,145	15
	Klasse XUP	24.09.2020	USD	0,138	14
					<b>USD 301.849</b>
<b>Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt</b>					
	Klasse AEC	24.04.2020	USD	0,038	3.742
	Klasse AEC	22.05.2020	USD	0,038	3.460
	Klasse AEC	24.06.2020	USD	0,047	4.149
	Klasse AEC	27.07.2020	USD	0,049	4.288
	Klasse AEC	24.08.2020	USD	0,049	4.334
	Klasse AEC	24.09.2020	USD	0,043	3.543
	Klasse AUP	24.04.2020	USD	0,043	153.393
	Klasse AUP	22.05.2020	USD	0,043	152.373
	Klasse AUP	24.06.2020	USD	0,052	181.554
	Klasse AUP	27.07.2020	USD	0,052	180.605
	Klasse AUP	24.08.2020	USD	0,052	178.811
	Klasse AUP	24.09.2020	USD	0,045	153.074
	Klasse SUP	24.04.2020	USD	0,041	2.412
	Klasse SUP	22.05.2020	USD	0,041	2.412
	Klasse SUP	24.06.2020	USD	0,050	2.941
	Klasse SUP	27.07.2020	USD	0,050	2.941
	Klasse SUP	24.08.2020	USD	0,050	2.941
	Klasse SUP	24.09.2020	USD	0,043	2.529
	Klasse XUP	24.06.2020	USD	0,122	12
	Klasse XUP	24.09.2020	USD	0,129	13
					<b>USD 1.039.527</b>
<b>Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds</b>					
	Klasse AEC	24.04.2020	USD	0,023	20.811
	Klasse AEC	22.05.2020	USD	0,023	22.213
	Klasse AEC	24.06.2020	USD	0,027	25.317
	Klasse AEC	27.07.2020	USD	0,028	26.283
	Klasse AEC	24.08.2020	USD	0,028	26.437
	Klasse AEC	24.09.2020	USD	0,027	24.834
	Klasse ASC	24.04.2020	USD	0,020	801
	Klasse ASC	22.05.2020	USD	0,020	800
	Klasse ASC	24.06.2020	USD	0,024	951
	Klasse ASC	27.07.2020	USD	0,024	976
	Klasse ASC	24.08.2020	USD	0,024	1.025
	Klasse ASC	24.09.2020	USD	0,023	1.035
	Klasse AUP	24.04.2020	USD	0,022	43.534
	Klasse AUP	22.05.2020	USD	0,022	41.507
	Klasse AUP	24.06.2020	USD	0,026	48.760
	Klasse AUP	27.07.2020	USD	0,026	48.323
	Klasse AUP	24.08.2020	USD	0,026	48.130
	Klasse AUP	24.09.2020	USD	0,025	45.876
	Klasse XUP	24.04.2020	USD	0,037	36.889



## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 7 DIVIDENDEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Anteilkategorie	Ex-Datum	Währung	Betrag je Anteil	Gesamtbetrag
<b>Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds</b>					
<i>(Fortsetzung)</i>					
	Klasse XUP	22.05.2020	USD	0,037	36.889
	Klasse XUP	24.06.2020	USD	0,044	45.272
	Klasse XUP	27.07.2020	USD	0,044	46.382
	Klasse XUP	24.08.2020	USD	0,044	46.382
	Klasse XUP	24.09.2020	USD	0,042	47.626
					<b>USD 687.053</b>
<b>Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond</b>					
	Klasse AEC	24.04.2020	USD	0,051	1.839
	Klasse AEC	22.05.2020	USD	0,052	1.867
	Klasse AEC	24.06.2020	USD	0,065	2.409
	Klasse AEC	27.07.2020	USD	0,067	2.250
	Klasse AEC	24.08.2020	USD	0,068	2.252
	Klasse AEC	24.09.2020	USD	0,063	2.078
	Klasse AUP	24.04.2020	USD	0,050	14.599
	Klasse AUP	22.05.2020	USD	0,050	14.504
	Klasse AUP	24.06.2020	USD	0,062	18.068
	Klasse AUP	27.07.2020	USD	0,062	18.339
	Klasse AUP	24.08.2020	USD	0,062	18.322
	Klasse AUP	24.09.2020	USD	0,057	17.175
	Klasse DEC	24.04.2020	USD	0,038	1.368
	Klasse DEC	22.05.2020	USD	0,038	1.389
	Klasse DEC	24.06.2020	USD	0,049	1.786
	Klasse DEC	27.07.2020	USD	0,051	1.808
	Klasse DEC	24.08.2020	USD	0,052	1.558
	Klasse DEC	24.09.2020	USD	0,047	1.404
	Klasse IEC	24.04.2020	USD	0,037	4
	Klasse IEC	22.05.2020	USD	0,037	4
	Klasse IEC	24.06.2020	USD	0,047	5
	Klasse IEC	27.07.2020	USD	0,049	5
	Klasse IEC	24.08.2020	USD	0,049	5
	Klasse IEC	24.09.2020	USD	0,046	5
	Klasse XUP	24.06.2020	USD	0,154	15
	Klasse XUP	24.09.2020	USD	0,145	15
					<b>USD 123.073</b>
<b>Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond</b>					
	Klasse ASC	24.04.2020	USD	0,023	304
	Klasse ASC	22.05.2020	USD	0,023	318
	Klasse ASC	24.06.2020	USD	0,027	372
	Klasse ASC	27.07.2020	USD	0,027	359
	Klasse ASC	24.08.2020	USD	0,028	420
	Klasse ASC	24.09.2020	USD	0,028	369
	Klasse AUP	24.04.2020	USD	0,035	1.094
	Klasse AUP	22.05.2020	USD	0,035	1.907
	Klasse AUP	24.06.2020	USD	0,040	3.570
	Klasse AUP	27.07.2020	USD	0,040	5.215
	Klasse AUP	24.08.2020	USD	0,040	13.792
	Klasse AUP	24.09.2020	USD	0,041	24.642
	Klasse AVC	24.04.2020	USD	0,020	2

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 7 DIVIDENDEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Anteilkategorie	Ex-Datum	Währung	Betrag je Anteil	Gesamtbetrag
<b>Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond</b>					
<i>(Fortsetzung)</i>					
	Klasse AVC	22.05.2020	USD	0,021	2
	Klasse AVC	24.06.2020	USD	0,026	3
	Klasse AVC	27.07.2020	USD	0,026	3
	Klasse AVC	24.08.2020	USD	0,026	3
	Klasse AVC	24.09.2020	USD	0,027	3
	Klasse ZUP	24.04.2020	USD	0,033	3
	Klasse ZUP	22.05.2020	USD	0,033	3
	Klasse ZUP	24.06.2020	USD	0,038	4
	Klasse ZUP	27.07.2020	USD	0,038	4
	Klasse ZUP	24.08.2020	USD	0,038	4
	Klasse ZUP	24.09.2020	USD	0,039	4
					<b>USD 52.400</b>
<b>Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return</b>					
	Klasse AEP	24.09.2020	EUR	0,009	1
	Klasse IEP	24.09.2020	EUR	0,009	1
	Klasse LEP	24.09.2020	EUR	0,009	1
	Klasse ZEP	24.09.2020	EUR	0,009	1
					<b>EUR 4</b>
<b>Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return</b>					
	Klasse AEC	24.04.2020	USD	0,016	2.111
	Klasse AEC	22.05.2020	USD	0,016	2.129
	Klasse AEC	24.06.2020	USD	0,021	2.816
	Klasse AEC	27.07.2020	USD	0,022	2.910
	Klasse AEC	24.08.2020	USD	0,022	2.415
	Klasse AEC	24.09.2020	USD	0,020	1.772
	Klasse AUP	24.04.2020	USD	0,017	7.427
	Klasse AUP	22.05.2020	USD	0,017	7.389
	Klasse AUP	24.06.2020	USD	0,022	9.485
	Klasse AUP	27.07.2020	USD	0,022	9.431
	Klasse AUP	24.08.2020	USD	0,022	9.367
	Klasse AUP	24.09.2020	USD	0,019	8.181
					<b>USD 65.433</b>
<b>Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income</b>					
	Klasse AEC	24.06.2020	USD	0,106	784.842
	Klasse AEC	24.09.2020	USD	0,110	763.324
	Klasse AEP	24.06.2020	USD	0,124	286.976
	Klasse AEP	24.09.2020	USD	0,125	255.186
	Klasse AQM	24.04.2020	USD	0,041	4
	Klasse AQM	22.05.2020	USD	0,041	4
	Klasse AQM	24.06.2020	USD	0,047	5
	Klasse AQM	27.07.2020	USD	0,047	5
	Klasse AQM	24.08.2020	USD	0,047	5
	Klasse AQM	24.09.2020	USD	0,048	5
	Klasse ASC	24.06.2020	USD	0,078	990
	Klasse ASC	24.09.2020	USD	0,080	940
	Klasse ASP	24.06.2020	USD	0,080	1.377
	Klasse ASP	24.09.2020	USD	0,081	1.375
	Klasse AUM	24.04.2020	USD	0,033	1.345

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 7 DIVIDENDEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Anteilklasse	Ex-Datum	Währung	Betrag je Anteil	Gesamtbetrag
<b>Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income</b>					
<i>(Fortsetzung)</i>					
	Klasse AUM	22.05.2020	USD	0,033	1.345
	Klasse AUM	24.06.2020	USD	0,038	1.549
	Klasse AUM	27.07.2020	USD	0,038	1.549
	Klasse AUM	24.08.2020	USD	0,038	1.549
	Klasse AUM	24.09.2020	USD	0,038	1.549
	Klasse AUP	24.06.2020	USD	0,109	147.991
	Klasse AUP	24.09.2020	USD	0,110	149.644
	Klasse DEC	24.06.2020	USD	0,101	421.767
	Klasse DEC	24.09.2020	USD	0,105	405.405
	Klasse DEP	24.06.2020	USD	0,118	72.629
	Klasse DEP	24.09.2020	USD	0,119	59.528
	Klasse DUP	24.06.2020	USD	0,100	228.524
	Klasse DUP	24.09.2020	USD	0,101	222.839
	Klasse ZEC	24.06.2020	USD	0,116	12
	Klasse ZEC	24.09.2020	USD	0,121	12
	Klasse ZUP	24.06.2020	USD	0,109	11
	Klasse ZUP	24.09.2020	USD	0,110	11
					<b>USD 3.812.297</b>
<b>Threadneedle (Lux) - Global Focus</b>					
	Klasse AEP	24.09.2020	USD	0,078	68.771
	Klasse AUP	24.09.2020	USD	0,048	923
	Klasse IUP	24.09.2020	USD	0,039	138
	Klasse ZEP	24.09.2020	USD	0,068	66.973
					<b>USD 136.805</b>
<b>Threadneedle (Lux) - Global Equity Income</b>					
	Klasse 1EP	24.06.2020	USD	0,115	200.541
	Klasse 1EP	24.09.2020	USD	0,098	162.644
	Klasse 1SC	24.06.2020	USD	0,069	40.129
	Klasse 1SC	24.09.2020	USD	0,060	33.926
	Klasse 1ST	24.04.2020	USD	0,019	1.818
	Klasse 1ST	22.05.2020	USD	0,029	2.766
	Klasse 1ST	24.06.2020	USD	0,021	1.997
	Klasse 1ST	27.07.2020	USD	0,020	1.950
	Klasse 1ST	24.08.2020	USD	0,020	2.292
	Klasse 1ST	24.09.2020	USD	0,016	1.804
	Klasse 1UP	24.06.2020	USD	0,102	53.559
	Klasse 1UP	24.09.2020	USD	0,083	42.770
	Klasse 1VT	24.04.2020	USD	0,017	128
	Klasse 1VT	22.05.2020	USD	0,026	198
	Klasse 1VT	24.06.2020	USD	0,019	149
	Klasse 1VT	27.07.2020	USD	0,019	148
	Klasse 1VT	24.08.2020	USD	0,021	165
	Klasse 1VT	24.09.2020	USD	0,016	121
	Klasse 2EP	24.06.2020	USD	0,115	634.505
	Klasse 2EP	24.09.2020	USD	0,096	10
	Klasse 2UP	24.06.2020	USD	0,100	10
	Klasse 2UP	24.09.2020	USD	0,084	8
	Klasse 3EP	24.06.2020	USD	0,125	1.446.916
	Klasse 3EP	24.09.2020	USD	0,098	1.102.691

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 7 DIVIDENDEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Anteilklasse	Ex-Datum	Währung	Betrag je Anteil	Gesamtbetrag
<b>Threadneedle (Lux) - Global Equity Income</b>					
<i>(Fortsetzung)</i>					
	Klasse 3UP	24.06.2020	USD	0,101	4.423
	Klasse 3UP	24.09.2020	USD	0,084	3.679
	Klasse 8EP	24.06.2020	USD	0,115	19
	Klasse 8EP	24.09.2020	USD	0,096	16
	Klasse 8UP	24.06.2020	USD	0,100	7.131
	Klasse 8UP	24.09.2020	USD	0,084	5.990
	Klasse 9EP	24.06.2020	USD	0,115	11
	Klasse 9EP	24.09.2020	USD	0,097	10
	Klasse 9UP	24.06.2020	USD	0,100	10
	Klasse 9UP	24.09.2020	USD	0,084	8
	Klasse AEC	24.06.2020	USD	0,103	321
	Klasse AEC	24.09.2020	USD	0,091	282
	Klasse AUP	24.06.2020	USD	0,099	10
	Klasse AUP	24.09.2020	USD	0,082	8
	Klasse DEC	24.06.2020	USD	0,102	10
	Klasse DEC	24.09.2020	USD	0,091	9
	Klasse DUP	24.06.2020	USD	0,098	10
	Klasse DUP	24.09.2020	USD	0,082	8
					<b>USD 3.753.200</b>
<b>Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity</b>	Klasse XUP	24.09.2020	USD	0,223	1.046.567
					<b>USD 1.046.567</b>
<b>Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities</b>	Klasse AEC	24.09.2020	USD	0,111	5
	Klasse AUP	24.09.2020	USD	0,101	1.516
					<b>USD 1.521</b>
<b>Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities</b>	Klasse AUP	24.09.2020	USD	0,124	6.117
	Klasse IEC	24.09.2020	USD	0,131	23
					<b>USD 6.140</b>
<b>Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend</b>	Klasse 1EP	24.09.2020	EUR	0,021	249.570
	Klasse 1GP	24.09.2020	EUR	0,021	7.825
	Klasse 2EP	24.09.2020	EUR	0,214	21
	Klasse 2GP	24.09.2020	EUR	0,243	24
	Klasse 3EP	24.09.2020	EUR	0,034	2.407
	Klasse 3GP	24.09.2020	EUR	0,039	36.882
	Klasse 4GP	24.09.2020	EUR	0,032	269.295
	Klasse 8EP	24.09.2020	EUR	0,023	23.163
	Klasse 8GP	24.09.2020	EUR	0,023	10.100
	Klasse 9EP	24.09.2020	EUR	0,215	22
	Klasse 9GP	24.09.2020	EUR	0,244	24
	Klasse AEP	24.09.2020	EUR	0,211	897
	Klasse AUP	24.09.2020	EUR	0,192	19
	Klasse DEP	24.09.2020	EUR	0,210	464

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 7 DIVIDENDEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Anteilkategorie	Ex-Datum	Währung	Betrag je Anteil	Gesamtbetrag
<b>Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend</b>					
<i>(Fortsetzung)</i>					
	Klasse IEP	24.09.2020	EUR	0,211	1.535
	Klasse ZEP	24.09.2020	EUR	0,214	21
					<b>EUR 602.269</b>
<b>Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income</b>					
	Klasse AUP	24.09.2020	USD	0,303	1.915
	Klasse DUP	24.09.2020	USD	0,251	90
	Klasse IEP	24.09.2020	USD	0,290	29
	Klasse XUP	24.09.2020	USD	0,232	321.417
	Klasse ZGP	24.09.2020	USD	0,300	30
	Klasse ZUP	24.09.2020	USD	0,292	986
					<b>USD 324.467</b>
<b>Threadneedle (Lux) - UK Equities</b>					
	Klasse 9EP	24.09.2020	GBP	0,107	212.576
	Klasse AGP	24.09.2020	GBP	0,298	110.781
	Klasse IGP	24.09.2020	GBP	0,436	433.643
	Klasse ZGP	24.09.2020	GBP	0,138	174.245
					<b>GBP 931.245</b>
<b>Threadneedle (Lux) - UK Equity Income</b>					
	Klasse AEC	24.06.2020	GBP	0,055	212
	Klasse AEC	24.09.2020	GBP	0,049	213
	Klasse ASC	24.06.2020	GBP	0,050	149
	Klasse ASC	24.09.2020	GBP	0,033	98
	Klasse AUC	24.06.2020	GBP	0,057	7
	Klasse AUC	24.09.2020	GBP	0,047	6
	Klasse DEC	24.06.2020	GBP	0,056	6
	Klasse DEC	24.09.2020	GBP	0,050	6
	Klasse DGP	24.06.2020	GBP	0,068	7
	Klasse DGP	24.09.2020	GBP	0,060	6
	Klasse IGP	24.06.2020	GBP	0,070	85.607
	Klasse IGP	24.09.2020	GBP	0,062	70.164
	Klasse LGP	24.06.2020	GBP	0,073	534.197
	Klasse LGP	24.09.2020	GBP	0,061	447.043
	Klasse ZGP	24.06.2020	GBP	0,073	351
	Klasse ZGP	24.09.2020	GBP	0,064	308
					<b>GBP 1.138.380</b>
<b>Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities</b>					
	Klasse IEP	24.06.2020	EUR	0,110	11
	Klasse IEP	24.09.2020	EUR	0,082	8
	Klasse LEP	24.06.2020	EUR	0,120	8.593
	Klasse LEP	24.09.2020	EUR	0,079	6.209
					<b>EUR 14.821</b>

\*Bruchbetrag gerundet auf 0.

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 8 PERFORMANCEGEBÜHREN

Die Verwaltungsgesellschaft erhält in Bezug auf die Anteilsklassen der in der nachstehenden Tabelle aufgeführten Portfolios eine Performancegebühr. Für die Performancegebühr werden tägliche Rückstellungen im Hinblick auf den Saldo der Performancegebühr gebildet (wie nachstehend beschrieben), wobei der aufgelaufene Betrag am Ende jedes Kalenderjahres (d. h. am 31. Dezember) an die Verwaltungsgesellschaft ausbezahlt wird. Die Höhe dieser Performancegebühr hängt von der Wertentwicklung des Nettoinventarwertes (NIW) der betreffenden Anteilsklasse innerhalb des betreffenden Portfolios im Vergleich zu der Wertentwicklung des jeweiligen Performance-Index ab (der „Performance-Index“, wie in der nachstehenden Tabelle aufgeführt). Es laufen nur dann Gebühren auf, wenn der Saldo der Performancegebühr positiv ist und die NIW High Water Mark (wie nachstehend definiert) überschritten wird.

Die Wertentwicklung der Anteilsklassen wird unter Berücksichtigung gezahlter Ausschüttungen ermittelt.

Portfolio	Anteilsklassen	Performance-Index	Performance-Satz
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	A-Anteile	Der höhere Wert des 3-Monats-LIBOR (USD) <sup>1</sup> zuzüglich 1,50 % oder 1,50 %	20 %
	D-Anteile		
	I-Anteile		
	Z-Anteile		
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	J-Anteile	Der höhere Wert des ICE BofA Euro Currency Deposit Bid Rate Constant Maturity (1M) (Local Total Return) Index <sup>2</sup> zuzüglich 1,00 % oder 1,00 %	10 %
	Y-Anteile		
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	A-Anteile	Der höhere Wert des 3-Monats-EURIBOR (EUR) <sup>3</sup> zuzüglich 1,50 % oder 1,50 %	20 %
	D-Anteile		
	I-Anteile		
	L-Anteile		
	Z-Anteile		

<sup>1</sup> Die Benchmark wird von ICE Benchmark Administration Limited bereitgestellt, einem Administrator, der im ESMA-Register der Benchmark-Administratoren eingetragen ist. Die Verwaltungsgesellschaft unterhält einen schriftlichen Plan, in dem die Maßnahmen festgelegt sind, die im Falle einer wesentlichen Änderung oder Einstellung der Benchmark ergriffen werden. Vor dem 3. August 2020 galt für den Performance-Index der höhere Wert des 3-Monats-LIBOR (USD) oder Null.

<sup>2</sup> Die Benchmark wird von ICE Data Indices LLC bereitgestellt, einem Administrator, der im ESMA-Register der Benchmark-Administratoren eingetragen ist. Die Verwaltungsgesellschaft unterhält einen schriftlichen Plan, in dem die Maßnahmen festgelegt sind, die im Falle einer wesentlichen Änderung oder Einstellung der Benchmark ergriffen werden.

<sup>3</sup> Die Benchmark wird von European Money Markets Institute bereitgestellt, einem Administrator, der im ESMA-Register der Benchmark-Administratoren eingetragen ist. Die Verwaltungsgesellschaft unterhält einen schriftlichen Plan, in dem die Maßnahmen festgelegt sind, die im Falle einer wesentlichen Änderung oder Einstellung der Benchmark ergriffen werden. Vor dem 3. August 2020 galt für den Performance-Index der höhere Wert des 3-Monats-EURIBOR (EUR) oder Null.

Die Wertentwicklung des Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha Portfolio, des Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities Portfolio und des Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha Portfolio wird unter Berücksichtigung aller anwendbaren Gebühren mit dem Performance-Index verglichen.

Der Saldo der Performancegebühr wird basierend auf der Differenz zwischen der Wertentwicklung des Performance-Index und der Wertentwicklung der betreffenden Anteilsklasse berechnet (die „Tagesdifferenz“):

- Wenn die Tagesdifferenz positiv ist, steigt der Saldo der Performancegebühr um einen Betrag, der sich nach der Tagesdifferenz richtet und anhand des Performance-Gebührensatzes bestimmt wird;
- Ist die Tagesdifferenz negativ, verringert sich der Saldo der Performancegebühr um einen Betrag, der sich nach der Tagesdifferenz richtet und anhand des Performance-Gebührensatzes bestimmt wird.

Ist der Saldo der Performancegebühr am Ende des Kalenderjahres, d. h. am 31. Dezember, positiv und wurde die NIW High Water Mark überschritten, so wird der aufgelaufene Betrag der Performancegebühr innerhalb des ersten Quartals des folgenden Kalenderjahres an die Verwaltungsgesellschaft gezahlt. Eine Performancegebühr wird an die Verwaltungsgesellschaft nur in dem Fall gezahlt, in dem der Nettoinventarwert der betreffenden Anteilsklasse über der NIW High Water Mark liegt.

Ist der Saldo der Performancegebühr am Ende des Kalenderjahres negativ und wurde die NIW High Water Mark überschritten, wird der negative Betrag zurückgesetzt. In diesem Fall wäre keine Performancegebühr zu zahlen.

Wenn am Ende des Kalenderjahres der Saldo der Performancegebühr negativ ist und die NIW High Water Mark nicht überschritten wurde, wird dieser negative Betrag vorgetragen und die Verwaltungsgesellschaft erhält so lange keine Performancegebühr, bis die aufgelaufene Performancegebühr am Ende eines nachfolgenden Kalenderjahres wieder positiv ausfällt und die NIW High Water Mark überschritten wurde.

Falls ein Portfolio oder eine Anteilsklasse liquidiert oder ein Portfolio oder eine Anteilsklasse inaktiv werden, werden noch ausstehende, aufgelaufene Performancegebühren abgerechnet und an die Verwaltungsgesellschaft zahlbar. Investieren im Anschluss daran neue Anteilinhaber in ein solches Portfolio oder eine solche Anteilsklasse, wird der Saldo der Performancegebühr zurückgesetzt.

NIW High Water Mark: Bezüglich der einzelnen Anteilsklassen entspricht der Nettoinventarwert eines Anteils dieser Anteilsklasse dem des letzten Bewertungstichtags des letzten relevanten Kalenderjahres, in dem eine eventuell aufgelaufene Performancegebühr bezahlt oder der negative Saldo der Performancegebühr zurückgesetzt wurde. Wurde noch nie eine Performancegebühr gezahlt, entspricht die NIW High Water Mark dem Anfangspreis der jeweiligen Anteilsklasse.

Es gibt keinen Höchstwert für die erhobene Performancegebühr.

Zum 30. September 2020 beliefen sich die Performancegebühren für den Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha auf 1.030.286 EUR.

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

Zum 30. September 2020 hielt die SICAV die folgenden offenen Devisenterminkontrakte:

Portfolio	Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	19.10.2020	EUR	7.711.616	USD	9.172.535	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(125.861)
	19.10.2020	EUR	7.175.047	USD	8.534.316	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(117.104)
	19.10.2020	SEK	19.948	USD	2.279	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(49)
	19.10.2020	EUR	2.409.203	USD	2.865.612	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(39.321)
	19.10.2020	EUR	353.492	USD	420.459	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(5.769)
	19.10.2020	EUR	11.995.842	USD	14.268.382	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(195.784)
	19.10.2020	GBP	23.832.016	USD	30.661.557	Absicherung	JP Morgan Chase New York	151.548
	19.10.2020	SEK	279.109	USD	31.885	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(694)
	19.10.2020	GBP	344.634	USD	443.395	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2.192
	19.10.2020	EUR	7.130.297	USD	8.481.089	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(116.374)
	19.10.2020	EUR	1.420.479	USD	1.689.580	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(23.184)
	19.10.2020	GBP	10.527.434	USD	13.544.281	Absicherung	JP Morgan Chase New York	66.944
	19.10.2020	GBP	71.434.939	USD	91.906.049	Absicherung	JP Morgan Chase New York	454.255
	19.10.2020	EUR	150.466	USD	178.971	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2.456)
	19.10.2020	GBP	1.952.903	USD	2.512.546	Absicherung	JP Morgan Chase New York	12.419
	19.10.2020	EUR	2.075.012	USD	2.468.111	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(33.866)
	19.10.2020	GBP	105.178.286	USD	135.319.228	Absicherung	JP Morgan Chase New York	668.829
	19.10.2020	NOK	10.821	USD	1.200	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(44)
	19.10.2020	NOK	10.859	USD	1.205	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(44)
	19.10.2020	EUR	64.753	USD	76.931	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(967)
	19.10.2020	GBP	114.098	USD	147.012	Absicherung	JP Morgan Chase New York	508
	19.10.2020	GBP	224.340	USD	289.057	Absicherung	JP Morgan Chase New York	999
	19.10.2020	EUR	194.596	USD	230.762	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2.477)
	19.10.2020	EUR	20.833	USD	24.704	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(265)
	19.10.2020	USD	415	EUR	350	Absicherung	JP Morgan Chase New York	5
	19.10.2020	USD	2.334	EUR	1.968	Absicherung	JP Morgan Chase New York	25
	19.10.2020	USD	3.733	EUR	3.148	Absicherung	JP Morgan Chase New York	40
	19.10.2020	GBP	129.159	USD	166.038	Absicherung	JP Morgan Chase New York	955
	19.10.2020	EUR	59.226	USD	70.099	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(619)
	19.10.2020	EUR	21.828	USD	25.835	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(228)
	19.10.2020	EUR	14.978	USD	17.727	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(157)
	19.10.2020	GBP	175.842	USD	228.667	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.316)
	19.10.2020	EUR	3.159	USD	3.739	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(33)
	19.10.2020	GBP	5.295	USD	6.885	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(40)
	19.10.2020	GBP	368.941	USD	479.775	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2.761)
	19.10.2020	EUR	124.987	USD	147.931	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.307)
	19.10.2020	EUR	4.516	USD	5.335	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(38)
	19.10.2020	EUR	1.034	USD	1.222	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(9)
	19.10.2020	EUR	13.686	USD	16.169	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(114)
	19.10.2020	GBP	4.077	USD	5.280	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(9)
	19.10.2020	GBP	313.688	USD	406.259	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(683)
	19.10.2020	USD	1.911	EUR	1.618	Absicherung	JP Morgan Chase New York	13
19.10.2020	EUR	42.621	USD	50.577	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(577)	
19.10.2020	EUR	99.988	USD	118.653	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.354)	
19.10.2020	EUR	1.039	USD	1.233	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(14)	
19.10.2020	GBP	8.035	USD	10.415	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(27)	
19.10.2020	GBP	54.490	USD	70.632	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(181)	
19.10.2020	EUR	4.990	USD	5.863	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(9)	

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 9 NICHT REALISIRTER NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeits- datum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio- Basiswährung
<b>Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond (Fortsetzung)</b>								
	19.10.2020	EUR	49.170	USD	57.772	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(89)
	19.10.2020	EUR	62.963	USD	73.977	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(114)
	19.10.2020	GBP	276.752	USD	354.166	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3.655
	19.10.2020	EUR	39.933	USD	46.767	Absicherung	JP Morgan Chase New York	79
	19.10.2020	EUR	249.408	USD	292.091	Absicherung	JP Morgan Chase New York	496
	19.10.2020	EUR	9.496	USD	11.122	Absicherung	JP Morgan Chase New York	19
	19.10.2020	GBP	10.656	USD	13.561	Absicherung	JP Morgan Chase New York	217
	19.10.2020	GBP	42.863	USD	54.546	Absicherung	JP Morgan Chase New York	873
	19.10.2020	EUR	24.601	USD	28.731	Absicherung	JP Morgan Chase New York	129
	19.10.2020	EUR	659.407	USD	770.096	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3.469
	19.10.2020	USD	404.699	GBP	317.059	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(5.235)
	19.10.2020	USD	1.331	EUR	1.140	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(6)
	19.10.2020	USD	4.218	GBP	3.305	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(55)
	19.10.2020	GBP	47.850	USD	61.077	Absicherung	JP Morgan Chase New York	790
	19.10.2020	GBP	35.000	USD	44.675	Absicherung	JP Morgan Chase New York	578
	19.10.2020	USD	90.155	EUR	77.208	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(419)
	19.10.2020	USD	5.695	EUR	4.877	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(27)
	19.10.2020	USD	923.044	GBP	722.701	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(11.357)
	19.10.2020	USD	1.737	EUR	1.487	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(8)
	19.10.2020	USD	25.282	GBP	19.794	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(311)
	19.10.2020	USD	25.658	EUR	21.974	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(119)
	19.10.2020	EUR	7.590	USD	8.839	Absicherung	JP Morgan Chase New York	65
	19.10.2020	EUR	67.336	USD	78.416	Absicherung	JP Morgan Chase New York	578
	19.10.2020	GBP	199.481	USD	253.666	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4.249
	19.10.2020	EUR	13.100	USD	15.227	Absicherung	JP Morgan Chase New York	141
	19.10.2020	EUR	14.990	USD	17.424	Absicherung	JP Morgan Chase New York	161
	19.10.2020	EUR	54.950	USD	63.872	Absicherung	JP Morgan Chase New York	591
	19.10.2020	USD	1.480	EUR	1.273	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(14)
	19.10.2020	GBP	2.051	USD	2.605	Absicherung	JP Morgan Chase New York	46
	19.10.2020	GBP	270.247	USD	343.371	Absicherung	JP Morgan Chase New York	6.040
	19.10.2020	USD	502.211	EUR	431.109	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(3.532)
	19.10.2020	EUR	39.736	USD	46.290	Absicherung	JP Morgan Chase New York	326
	19.10.2020	USD	8.453	EUR	7.257	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(59)
	19.10.2020	GBP	106.736	USD	137.077	Absicherung	JP Morgan Chase New York	925
	19.10.2020	EUR	44.815	USD	52.591	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(17)
	19.10.2020	EUR	94.293	USD	110.653	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(36)
	19.10.2020	GBP	178.068	USD	228.667	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.563
	28.10.2020	USD	143.583.509	EUR	123.195.546	Handel	Barclays	(967.407)
	28.10.2020	USD	87.351	AUD	123.883	Handel	Barclays	(1.448)
	28.10.2020	USD	816.326	JPY	86.039.059	Handel	Barclays	766
	28.10.2020	USD	2.139.479	CAD	2.864.493	Handel	Goldman Sachs	(5.215)
	28.10.2020	USD	35.996.735	GBP	28.207.002	Handel	Barclays	(474.706)
	28.10.2020	USD	2.769.909	EUR	2.376.050	Handel	Barclays	(18.019)
	28.10.2020	EUR	2.280.000	USD	2.667.390	Handel	Barclays	7.848
	28.10.2020	USD	867	AUD	1.218	Handel	Goldman Sachs	(6)
	28.10.2020	JPY	512.331	USD	4.854	Handel	Barclays	3
								<b>USD (769.595)</b>



## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 9 NICHT REALISIRTER NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
<b>Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond</b>								
	19.10.2020	NOK	10.245	EUR	956	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(23)
	19.10.2020	NOK	10.298	EUR	961	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(23)
	26.10.2020	EUR	2.766.282	GBP	2.538.255	Handel	Barclays	(30.898)
	26.10.2020	EUR	5.691.760	USD	6.690.031	Handel	Barclays	(10.143)
	26.10.2020	USD	49.010	EUR	42.061	Handel	Barclays	(290)
								<b>EUR (41.377)</b>
<b>Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond</b>								
	19.10.2020	SEK	10.050	EUR	966	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(8)
	19.10.2020	SEK	10.106	EUR	971	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(8)
	19.10.2020	USD	2.682.897	EUR	2.255.590	Absicherung	JP Morgan Chase New York	31.380
	19.10.2020	CHF	332.928	EUR	308.966	Absicherung	JP Morgan Chase New York	96
	19.10.2020	CHF	129.015	EUR	119.729	Absicherung	JP Morgan Chase New York	37
	19.10.2020	CHF	541.776	EUR	502.782	Absicherung	JP Morgan Chase New York	156
	19.10.2020	CHF	72.476	EUR	67.259	Absicherung	JP Morgan Chase New York	21
	19.10.2020	CHF	75.392	EUR	69.965	Absicherung	JP Morgan Chase New York	22
	19.10.2020	CHF	24.638	EUR	22.865	Absicherung	JP Morgan Chase New York	7
	19.10.2020	NOK	10.080	EUR	941	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(22)
	19.10.2020	NOK	10.144	EUR	946	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(22)
	19.10.2020	EUR	12	SEK	129	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2020	EUR	12	SEK	129	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2020	EUR	35.963	USD	41.993	Absicherung	JP Morgan Chase New York	166
	19.10.2020	EUR	3.861	CHF	4.174	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(14)
	19.10.2020	EUR	1.493	CHF	1.614	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(5)
	19.10.2020	EUR	6.271	CHF	6.779	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(22)
	19.10.2020	EUR	840	CHF	908	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(3)
	19.10.2020	EUR	872	CHF	943	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(3)
	19.10.2020	EUR	285	CHF	308	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1)
	19.10.2020	EUR	12	NOK	130	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2020	EUR	12	NOK	129	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	26.10.2020	EUR	61.329.592	GBP	56.274.150	Handel	Barclays	(685.032)
	26.10.2020	EUR	14.149.450	USD	16.631.106	Handel	Barclays	(25.217)
	26.10.2020	GBP	285.458	EUR	309.833	Handel	Royal Bank of Scotland	4.743
	26.10.2020	USD	88.697	EUR	75.808	Handel	Citigroup Global Markets	(212)
	26.10.2020	USD	46.308	EUR	39.714	Handel	Barclays	(246)
	26.10.2020	USD	120.644	EUR	103.476	Handel	Citigroup Global Markets	(651)
	26.10.2020	GBP	240.485	EUR	264.958	Handel	JP Morgan Chase New York	57
	26.10.2020	EUR	90.036	USD	105.313	Handel	JP Morgan Chase New York	278
	26.10.2020	USD	45.911	EUR	39.116	Handel	Citigroup Global Markets	14
								<b>EUR (674.489)</b>

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
<b>Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond</b>								
	19.10.2020	SEK	10.073	EUR	968	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(8)
	19.10.2020	NOK	10.167	EUR	949	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(22)
	19.10.2020	GBP	1.017	EUR	1.101	Absicherung	JP Morgan Chase New York	21
	19.10.2020	GBP	993	EUR	1.074	Absicherung	JP Morgan Chase New York	20
	19.10.2020	GBP	54.469.487	EUR	58.920.202	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.112.037
	19.10.2020	SEK	10.068	EUR	967	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(8)
	19.10.2020	NOK	10.120	EUR	944	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(22)
	19.10.2020	GBP	9.640.193	EUR	10.427.896	Absicherung	JP Morgan Chase New York	196.811
	19.10.2020	GBP	723.449	EUR	790.239	Absicherung	JP Morgan Chase New York	7.093
	19.10.2020	GBP	278.990	EUR	307.561	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(79)
	26.10.2020	EUR	12.245.537	GBP	11.236.129	Handel	Barclays	(136.779)
	26.10.2020	EUR	1.491.731	USD	1.753.364	Handel	Barclays	(2.659)
	26.10.2020	USD	11.332	EUR	9.719	Handel	Citigroup Global Markets	(61)
	26.10.2020	USD	4.495	EUR	3.858	Handel	Barclays	(27)
	26.10.2020	GBP	32.634	EUR	35.955	Handel	JP Morgan Chase New York	8
	26.10.2020	EUR	4.718	USD	5.519	Handel	JP Morgan Chase New York	15
								<b>EUR 1.176.340</b>
<b>Threadneedle (Lux) - European Social Bond</b>								
	19.10.2020	CHF	3.438	EUR	3.191	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	19.10.2020	CHF	3.436	EUR	3.189	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	19.10.2020	GBP	1.060	EUR	1.146	Absicherung	JP Morgan Chase New York	22
	19.10.2020	SEK	10.061	EUR	967	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(8)
	19.10.2020	NOK	10.188	EUR	951	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(22)
	19.10.2020	GBP	1.056	EUR	1.143	Absicherung	JP Morgan Chase New York	22
	19.10.2020	USD	1.020	EUR	858	Absicherung	JP Morgan Chase New York	12
	19.10.2020	EUR	8.485.041	USD	10.101.771	Handel	Citigroup Global Markets	(126.018)
	19.10.2020	EUR	21.391.984	GBP	19.738.127	Handel	Citigroup Global Markets	(362.029)
	19.10.2020	EUR	340.506	SEK	3.543.638	Handel	HSBC	2.931
	19.10.2020	EUR	114.343	GBP	105.000	Handel	Citigroup Global Markets	(1.380)
	19.10.2020	EUR	102.865	GBP	94.160	Handel	Citigroup Global Markets	(911)
	19.10.2020	USD	60.900	EUR	52.241	Handel	Citigroup Global Markets	(329)
	19.10.2020	EUR	85.494	USD	100.000	Handel	Citigroup Global Markets	252
	19.10.2020	SEK	1.784.180	EUR	169.134	Handel	HSBC	831
								<b>EUR (486.625)</b>
<b>Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond</b>								
	19.10.2020	USD	1.139	EUR	958	Absicherung	JP Morgan Chase New York	13
	19.10.2020	USD	1.124	EUR	945	Absicherung	JP Morgan Chase New York	13
	19.10.2020	SEK	10.359	EUR	995	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(8)
	19.10.2020	NOK	10.428	EUR	973	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(23)
	19.10.2020	NOK	10.503	EUR	980	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(23)
	19.10.2020	EUR	106.265	AUD	175.664	Handel	Lloyds	(1.067)
	19.10.2020	EUR	24.602.988	GBP	22.247.621	Handel	Lloyds	83.332
	19.10.2020	EUR	33.783.778	USD	39.922.821	Handel	Barclays	(247.554)
	19.10.2020	USD	268.708	EUR	226.518	Handel	Citigroup Global Markets	2.535

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 9 NICHT REALISIRTER NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeits- datum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio- Basiswährung
<b>Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond (Fortsetzung)</b>								
	19.10.2020	EUR	248.418	GBP	221.712	Handel	Citigroup Global Markets	4.064
	19.10.2020	EUR	310.460	USD	367.167	Handel	UBS	(2.522)
	19.10.2020	EUR	588.417	GBP	539.409	Handel	Barclays	(6.081)
	19.10.2020	USD	365.890	EUR	314.183	Handel	Citigroup Global Markets	(2.289)
	19.10.2020	GBP	58.049	EUR	63.949	Handel	Lloyds	28
								<b>EUR (169.582)</b>
<b>Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds</b>								
	19.10.2020	EUR	5.520.453	USD	6.566.269	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(90.099)
	19.10.2020	EUR	2.293.452	USD	2.727.932	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(37.431)
	19.10.2020	EUR	11.325.795	USD	13.471.399	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(184.848)
	19.10.2020	SGD	194.891	USD	143.155	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(385)
	19.10.2020	EUR	5.982.644	USD	7.116.020	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(97.643)
	19.10.2020	EUR	157.679	USD	187.550	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2.573)
	19.10.2020	EUR	394.370	USD	469.082	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(6.437)
	19.10.2020	SEK	10.464	USD	1.195	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(26)
	19.10.2020	NOK	10.537	USD	1.169	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(43)
	19.10.2020	EUR	142	USD	168	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2)
	19.10.2020	USD	9.125	EUR	7.695	Absicherung	JP Morgan Chase New York	98
	19.10.2020	EUR	20.138	USD	23.835	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(211)
	19.10.2020	USD	5.175	EUR	4.372	Absicherung	JP Morgan Chase New York	46
	19.10.2020	EUR	38.015	USD	44.994	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(397)
	19.10.2020	EUR	15.120	USD	17.863	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(126)
	19.10.2020	USD	1.510	EUR	1.278	Absicherung	JP Morgan Chase New York	11
	19.10.2020	USD	7.360	SGD	10.004	Absicherung	JP Morgan Chase New York	32
	19.10.2020	EUR	5.668	USD	6.696	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(47)
	19.10.2020	USD	19.990	EUR	16.845	Absicherung	JP Morgan Chase New York	228
	19.10.2020	EUR	3.488	USD	4.139	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(47)
	19.10.2020	USD	2.376	EUR	2.002	Absicherung	JP Morgan Chase New York	27
	19.10.2020	USD	20.061	EUR	17.074	Absicherung	JP Morgan Chase New York	31
	19.10.2020	USD	5.536	EUR	4.712	Absicherung	JP Morgan Chase New York	9
	19.10.2020	USD	9.376	SGD	12.778	Absicherung	JP Morgan Chase New York	15
	19.10.2020	USD	376	EUR	320	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	19.10.2020	USD	19.330	EUR	16.505	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(33)
	19.10.2020	EUR	3.000	USD	3.513	Absicherung	JP Morgan Chase New York	6
	19.10.2020	EUR	14.963	USD	17.474	Absicherung	JP Morgan Chase New York	79
	19.10.2020	EUR	28.011	USD	32.713	Absicherung	JP Morgan Chase New York	146
	19.10.2020	EUR	14.470	USD	16.899	Absicherung	JP Morgan Chase New York	76
	19.10.2020	USD	95.305	EUR	81.618	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(443)
	19.10.2020	USD	6.211	EUR	5.319	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(29)
	19.10.2020	EUR	993	USD	1.157	Absicherung	JP Morgan Chase New York	9
	19.10.2020	USD	23.225	EUR	19.944	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(171)
	19.10.2020	EUR	737	USD	858	Absicherung	JP Morgan Chase New York	6
	19.10.2020	USD	64.708	EUR	55.621	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(543)
	19.10.2020	USD	26.847	EUR	23.077	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(225)
	19.10.2020	USD	1.272	SGD	1.751	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(11)
	19.10.2020	USD	1.825	EUR	1.569	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(15)

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 9 NICHT REALISIRTER NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeits- datum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio- Basiswährung
<b>Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds</b> <i>(Fortsetzung)</i>								
	19.10.2020	USD	12	SEK	106	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2020	USD	11	NOK	107	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2020	EUR	2.000	USD	2.325	Absicherung	JP Morgan Chase New York	22
	19.10.2020	USD	134.228	EUR	114.859	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(517)
	19.10.2020	EUR	2.500	USD	2.912	Absicherung	JP Morgan Chase New York	20
	19.10.2020	EUR	15.327	USD	17.855	Absicherung	JP Morgan Chase New York	126
	19.10.2020	USD	1.290	EUR	1.099	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2020	EUR	5.832	USD	6.844	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2)
								<b>USD (421.316)</b>
<b>Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt</b>								
	19.10.2020	EUR	339.764	USD	404.130	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(5.545)
	19.10.2020	EUR	381.472	USD	453.740	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(6.226)
	19.10.2020	EUR	661.284	USD	786.560	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(10.793)
	19.10.2020	EUR	785.927	USD	934.816	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(12.827)
	19.10.2020	SGD	54.102	USD	39.740	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(107)
	19.10.2020	SEK	10.182	USD	1.163	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(25)
	19.10.2020	NOK	10.220	USD	1.134	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(41)
	19.10.2020	USD	6.106	EUR	5.195	Absicherung	JP Morgan Chase New York	11
	19.10.2020	USD	6.847	EUR	5.826	Absicherung	JP Morgan Chase New York	12
	19.10.2020	USD	11.751	EUR	9.999	Absicherung	JP Morgan Chase New York	21
	19.10.2020	USD	14.101	EUR	11.998	Absicherung	JP Morgan Chase New York	25
	19.10.2020	USD	598	SGD	816	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2020	USD	18	SEK	156	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2020	USD	17	NOK	159	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2020	USD	28.335	EUR	24.195	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(48)
	19.10.2020	USD	4.725	EUR	4.047	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(22)
	19.10.2020	USD	5.061	EUR	4.334	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(24)
	19.10.2020	USD	9.142	EUR	7.829	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(43)
	19.10.2020	USD	14.477	EUR	12.398	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(68)
	19.10.2020	USD	467	SGD	643	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(3)
	19.10.2020	USD	14	SEK	124	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2020	USD	13	NOK	124	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2020	EUR	6.000	USD	6.974	Absicherung	JP Morgan Chase New York	65
	19.10.2020	EUR	250	USD	291	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2
	19.10.2020	EUR	103	USD	121	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	10.11.2020	USD	473.911	MXN	10.323.943	Handel	Royal Bank of Scotland	8.602
	10.11.2020	USD	1.220.317	EUR	1.032.246	Handel	Lloyds	8.800
	10.11.2020	EUR	184.370	USD	217.943	Handel	HSBC	(1.554)
								<b>USD (19.788)</b>

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 9 NICHT REALISIRTER NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeits- datum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio- Basiswährung
<b>Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds</b>								
	19.10.2020	EUR	1.945.057	USD	2.313.537	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(31.745)
	19.10.2020	EUR	4.134.040	USD	4.917.209	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(67.472)
	19.10.2020	EUR	13.668.303	USD	16.257.681	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(223.080)
	19.10.2020	EUR	5.018.604	USD	5.969.349	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(81.909)
	19.10.2020	SGD	293.670	USD	215.712	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(581)
	19.10.2020	SGD	323.089	USD	237.321	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(639)
	19.10.2020	SEK	9.882	USD	1.129	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(25)
	19.10.2020	EUR	224.684	USD	267.249	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(3.667)
	19.10.2020	NOK	9.986	USD	1.108	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(40)
	19.10.2020	SGD	798	USD	586	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2)
	19.10.2020	USD	1.123	EUR	949	Absicherung	JP Morgan Chase New York	10
	19.10.2020	USD	67.196	EUR	56.876	Absicherung	JP Morgan Chase New York	473
	19.10.2020	USD	21.707	EUR	18.373	Absicherung	JP Morgan Chase New York	153
	19.10.2020	USD	3.726	EUR	3.153	Absicherung	JP Morgan Chase New York	26
	19.10.2020	USD	1.849	EUR	1.558	Absicherung	JP Morgan Chase New York	21
	19.10.2020	USD	287.726	EUR	242.465	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3.283
	19.10.2020	USD	233.676	EUR	198.884	Absicherung	JP Morgan Chase New York	360
	19.10.2020	USD	9.401	EUR	8.027	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(16)
	19.10.2020	USD	580	EUR	497	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(3)
	19.10.2020	USD	126	EUR	108	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1)
	19.10.2020	USD	80.904	EUR	69.286	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(376)
	19.10.2020	USD	3.250	SGD	4.469	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(24)
	19.10.2020	USD	18.810	EUR	16.152	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(139)
	19.10.2020	USD	11.188	EUR	9.607	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(82)
	19.10.2020	SGD	479	USD	348	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3
	19.10.2020	USD	6.113	EUR	5.259	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(56)
	19.10.2020	USD	15.294	EUR	13.157	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(141)
	19.10.2020	USD	28.169	EUR	24.234	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(261)
	19.10.2020	USD	1.672	EUR	1.435	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(12)
	19.10.2020	USD	23.680	EUR	20.173	Absicherung	JP Morgan Chase New York	15
	19.10.2020	USD	51.719	EUR	44.061	Absicherung	JP Morgan Chase New York	30
	19.10.2020	USD	161.840	EUR	137.876	Absicherung	JP Morgan Chase New York	94
	19.10.2020	USD	2.230	SGD	3.054	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(7)
	19.10.2020	USD	12	SEK	106	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2020	USD	2.700	EUR	2.300	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2
	19.10.2020	USD	11	NOK	107	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2020	USD	1.184	EUR	1.009	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2020	USD	111.898	EUR	95.354	Absicherung	JP Morgan Chase New York	37
	19.10.2020	SGD	100	USD	73	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
								<b>USD (405.771)</b>

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 9 NICHT REALISIRTER NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeits- datum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio- Basiswährung
<b>Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond</b>	19.10.2020	EUR	773.255	USD	919.743	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(12.620)
	19.10.2020	EUR	642.717	USD	764.476	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(10.490)
	19.10.2020	EUR	58.387.188	USD	69.448.291	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(952.937)
	19.10.2020	SGD	470.773	USD	345.801	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(931)
	19.10.2020	EUR	408.323	USD	485.677	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(6.664)
	19.10.2020	EUR	281.430	USD	334.746	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(4.593)
	19.10.2020	SEK	10.028	USD	1.146	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(25)
	19.10.2020	SEK	10.117	USD	1.156	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(25)
	19.10.2020	CHF	1.063	USD	1.173	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(16)
	19.10.2020	GBP	1.164	USD	1.498	Absicherung	JP Morgan Chase New York	7
	19.10.2020	EUR	62.407	USD	74.229	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.019)
	19.10.2020	EUR	902	USD	1.073	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(15)
	19.10.2020	NOK	10.045	USD	1.114	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(41)
	19.10.2020	NOK	10.138	USD	1.125	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(41)
	19.10.2020	SGD	200	USD	147	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2020	USD	20.175	EUR	17.077	Absicherung	JP Morgan Chase New York	142
	19.10.2020	USD	2.198	SGD	2.996	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4
	19.10.2020	EUR	92	USD	108	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2020	USD	10.067	EUR	8.626	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(52)
	19.10.2020	USD	8.144	EUR	6.978	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(42)
	19.10.2020	USD	745.031	EUR	638.357	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(3.840)
	19.10.2020	USD	3.742	SGD	5.143	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(26)
	19.10.2020	USD	5.314	EUR	4.553	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(27)
	19.10.2020	USD	3.678	EUR	3.152	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(19)
	19.10.2020	USD	12	SEK	113	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2020	USD	12	SEK	111	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2020	USD	13	CHF	12	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2020	USD	16	GBP	13	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2020	USD	796	EUR	682	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(4)
	19.10.2020	USD	12	EUR	10	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2020	USD	12	NOK	113	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2020	USD	12	NOK	111	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2020	EUR	550	USD	640	Absicherung	JP Morgan Chase New York	6
	19.10.2020	USD	19.332	EUR	16.595	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(136)
	19.10.2020	USD	2.354	SGD	3.234	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(15)
	19.10.2020	EUR	123	USD	144	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
								<b>USD (993.419)</b>
<b>Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond</b>	19.10.2020	EUR	553.882	USD	658.811	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(9.040)
	19.10.2020	SGD	940.142	USD	690.570	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.859)
	19.10.2020	SGD	143.882	USD	105.687	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(284)
	19.10.2020	EUR	393.307	USD	467.816	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(6.419)
	19.10.2020	EUR	8.443.853	USD	10.043.491	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(137.812)
	19.10.2020	GBP	2.628	USD	3.381	Absicherung	JP Morgan Chase New York	17
	19.10.2020	SGD	3.420	USD	2.512	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(7)
	19.10.2020	AUD	1.162	USD	851	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(18)
	19.10.2020	AUD	1.064	USD	780	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(17)

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 9 NICHT REALISIRTER NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeits- datum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio- Basiswährung
<b>Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond (Fortsetzung)</b>								
	19.10.2020	SEK	10.306	USD	1.177	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(26)
	19.10.2020	USD	8.672	EUR	7.300	Absicherung	JP Morgan Chase New York	109
	19.10.2020	USD	95	EUR	80	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	19.10.2020	USD	253	EUR	214	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2
	19.10.2020	USD	14.599	SGD	19.844	Absicherung	JP Morgan Chase New York	63
	19.10.2020	EUR	15.382	USD	18.172	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(128)
	19.10.2020	SGD	1.530	USD	1.127	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(6)
	19.10.2020	USD	9.595	EUR	8.086	Absicherung	JP Morgan Chase New York	109
	19.10.2020	USD	21.629	SGD	29.477	Absicherung	JP Morgan Chase New York	35
	19.10.2020	USD	1.070	EUR	911	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2
	19.10.2020	EUR	913	USD	1.069	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2
	19.10.2020	USD	15.286	EUR	13.088	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(69)
	19.10.2020	USD	1.100	SGD	1.512	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(8)
	19.10.2020	USD	8	AUD	11	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2020	SGD	29	USD	21	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2020	USD	1.664	EUR	1.429	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(12)
	19.10.2020	USD	2.369	EUR	2.038	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(22)
	19.10.2020	SGD	1.530	USD	1.114	Absicherung	JP Morgan Chase New York	7
	19.10.2020	USD	3.184	EUR	2.733	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(22)
	19.10.2020	SGD	133	USD	97	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2020	USD	1.407	EUR	1.199	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2020	USD	2.221	EUR	1.893	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	08.10.2020	SGD	3.850.000	USD	2.808.454	Handel	UBS	11.875
	08.10.2020	USD	310.345	IDR	4.600.000.000	Handel	Barclays	1.920
	08.10.2020	KRW	5.930.000.000	USD	5.002.630	Handel	UBS	86.793
	08.10.2020	USD	20.329	PHP	1.000.000	Handel	UBS	(297)
	08.10.2020	MYR	1.200.000	USD	286.636	Handel	Barclays	1.960
	08.10.2020	THB	44.000.000	USD	1.410.528	Handel	Citigroup Global Markets	(22.020)
	08.10.2020	IDR	4.100.000.000	USD	279.585	Handel	Citigroup Global Markets	(4.680)
	09.10.2020	CNY	9.910.084	USD	1.453.296	Handel	Citibank London	6.043
	10.11.2020	USD	1.726.891	CNY	11.790.000	Handel	Barclays	(5.159)
	08.10.2020	USD	5.064.091	KRW	5.930.000.000	Handel	Citigroup Global Markets	(25.238)
	08.10.2020	IDR	500.000.000	USD	33.590	Handel	Citigroup Global Markets	(65)
	10.11.2020	PHP	26.780.000	USD	551.903	Handel	Citigroup Global Markets	(235)
	10.11.2020	USD	1.664.460	SGD	2.275.000	Handel	UBS	(2.162)
	08.10.2020	USD	2.816.687	SGD	3.850.000	Handel	UBS	(3.642)
	08.10.2020	PHP	1.000.000	USD	20.637	Handel	JP Morgan Chase New York	(11)
	10.11.2020	USD	276.110	MYR	1.150.000	Handel	Barclays	(268)
	08.10.2020	USD	288.254	MYR	1.200.000	Handel	Barclays	(342)
	10.11.2020	USD	276.341	THB	8.760.000	Handel	Citigroup Global Markets	(90)
	08.10.2020	USD	1.390.645	THB	44.000.000	Handel	Citigroup Global Markets	2.137
								<b>USD (108.882)</b>

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISETERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeits- datum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio- Basiswährung
<b>Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return</b>								
	26.10.2020	EUR	1.056.811	USD	1.243.000	Handel	Barclays	(2.597)
	26.10.2020	EUR	2.096.649	GBP	1.914.000	Handel	Barclays	(12.592)
	26.10.2020	GBP	178.733	EUR	197.743	Handel	Barclays	(779)
	26.10.2020	USD	125.160	EUR	105.951	Handel	Citigroup Global Markets	722
	26.10.2020	USD	643.106	EUR	543.260	Handel	Citigroup Global Markets	4.858
								<b>EUR (10.388)</b>
<b>Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return</b>								
	19.10.2020	EUR	9.498.258	USD	11.297.646	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(155.021)
	19.10.2020	EUR	2.210.764	USD	2.629.580	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(36.082)
	19.10.2020	EUR	1.205.558	USD	1.433.944	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(19.676)
	19.10.2020	GBP	339.290	USD	436.521	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2.158
	19.10.2020	EUR	1.070	USD	1.272	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(18)
	19.10.2020	SEK	10.683	USD	1.220	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(27)
	19.10.2020	USD	43.459	EUR	36.580	Absicherung	JP Morgan Chase New York	546
	19.10.2020	EUR	268	USD	318	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(3)
	19.10.2020	USD	34.889	EUR	29.401	Absicherung	JP Morgan Chase New York	398
	19.10.2020	EUR	135	USD	158	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	19.10.2020	USD	792	EUR	680	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(6)
	19.10.2020	USD	6.505	EUR	5.543	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2
	19.10.2020	EUR	71	USD	83	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	26.10.2020	JPY	248.204.000	USD	2.362.480	Handel	Lloyds	(9.818)
								<b>USD (217.546)</b>
<b>Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income</b>								
	19.10.2020	EUR	18.309.553	USD	21.778.188	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(298.830)
	19.10.2020	SGD	5.236	USD	3.846	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(10)
	19.10.2020	EUR	88.465	USD	105.224	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.444)
	19.10.2020	CHF	971	USD	1.072	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(15)
	19.10.2020	EUR	54.055.089	USD	64.295.501	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(882.233)
	19.10.2020	EUR	28.512.647	USD	33.914.197	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(465.355)
	19.10.2020	EUR	847	USD	1.007	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(14)
	19.10.2020	EUR	3.943.167	USD	4.690.176	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(64.356)
	19.10.2020	SGD	105.598	USD	77.566	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(209)
	19.10.2020	USD	20.437	EUR	17.202	Absicherung	JP Morgan Chase New York	257
	19.10.2020	EUR	2.985	USD	3.546	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(45)
	19.10.2020	USD	65.935	EUR	55.601	Absicherung	JP Morgan Chase New York	708
	19.10.2020	SGD	200	USD	147	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2020	USD	52.098	EUR	43.933	Absicherung	JP Morgan Chase New York	559
	19.10.2020	USD	29.489	EUR	24.867	Absicherung	JP Morgan Chase New York	316
	19.10.2020	USD	76.463	EUR	64.603	Absicherung	JP Morgan Chase New York	675
	19.10.2020	USD	17.467	EUR	14.758	Absicherung	JP Morgan Chase New York	154
	19.10.2020	USD	86.979	EUR	73.620	Absicherung	JP Morgan Chase New York	613
	19.10.2020	USD	68.268	EUR	57.784	Absicherung	JP Morgan Chase New York	481
	19.10.2020	USD	24.493	EUR	20.732	Absicherung	JP Morgan Chase New York	173
	19.10.2020	EUR	7.009	USD	8.317	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(95)
	19.10.2020	USD	133.250	EUR	112.289	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.520



## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 9 NICHT REALISIRTER NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeits- datum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio- Basiswährung
<b>Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income</b> (Fortsetzung)								
	19.10.2020	USD	31.807	EUR	26.804	Absicherung	JP Morgan Chase New York	363
	19.10.2020	USD	133.441	EUR	113.573	Absicherung	JP Morgan Chase New York	206
	19.10.2020	USD	5.373	EUR	4.573	Absicherung	JP Morgan Chase New York	8
	19.10.2020	USD	16.541	EUR	14.078	Absicherung	JP Morgan Chase New York	26
	19.10.2020	USD	13.635	EUR	11.605	Absicherung	JP Morgan Chase New York	21
	19.10.2020	USD	19.718	EUR	16.782	Absicherung	JP Morgan Chase New York	30
	19.10.2020	USD	12.591	EUR	10.751	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(21)
	19.10.2020	USD	594	EUR	507	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1)
	19.10.2020	USD	290.552	EUR	248.095	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(493)
	19.10.2020	USD	441.887	EUR	378.617	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2.277)
	19.10.2020	USD	82	SGD	113	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1)
	19.10.2020	USD	2.108	EUR	1.806	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(11)
	19.10.2020	USD	22	CHF	20	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2020	USD	1.315.916	EUR	1.127.502	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(6.781)
	19.10.2020	USD	702.211	EUR	601.669	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(3.618)
	19.10.2020	USD	21	EUR	18	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2020	USD	97.198	EUR	83.281	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(501)
	19.10.2020	USD	1.594	SGD	2.190	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(11)
	19.10.2020	USD	106.287	EUR	91.010	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(479)
	19.10.2020	USD	21.163	EUR	18.121	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(95)
	19.10.2020	USD	39.140	EUR	33.514	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(176)
	19.10.2020	USD	10.619	EUR	9.092	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(48)
	19.10.2020	USD	135.055	EUR	115.972	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(995)
	19.10.2020	USD	33.894	EUR	29.105	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(250)
	19.10.2020	USD	5.284	EUR	4.538	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(39)
	19.10.2020	SGD	217	USD	157	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	19.10.2020	EUR	336	USD	390	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4
	19.10.2020	USD	83.698	EUR	72.007	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(774)
	19.10.2020	USD	82.508	EUR	70.983	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(763)
	19.10.2020	USD	17.422	EUR	14.988	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(161)
	19.10.2020	USD	108.125	EUR	92.817	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(760)
	19.10.2020	USD	63.829	EUR	54.792	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(449)
	19.10.2020	USD	130.498	EUR	112.023	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(918)
	19.10.2020	USD	11.972	EUR	10.202	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4
	19.10.2020	USD	26.454	EUR	22.542	Absicherung	JP Morgan Chase New York	9
	19.10.2020	USD	142.483	EUR	121.417	Absicherung	JP Morgan Chase New York	46
	19.10.2020	SGD	725	USD	530	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2
	19.10.2020	CNY	3.002.301	USD	440.562	Handel	Barclays	1.211
	19.10.2020	NOK	65.310	USD	7.009	Handel	Citigroup Global Markets	(29)
	19.10.2020	NZD	16.534	USD	11.005	Handel	Goldman Sachs	(76)
	19.10.2020	KRW	211.656.986	USD	181.329	Handel	UBS	330
	19.10.2020	SEK	315.230	USD	35.522	Handel	Royal Bank of Scotland	(294)
	19.10.2020	JPY	128.724.600	USD	1.229.797	Handel	Royal Bank of Scotland	(9.748)
	19.10.2020	USD	97.919	GBP	76.551	Handel	Royal Bank of Scotland	(1.056)
	19.10.2020	MXN	1.276.516	USD	59.064	Handel	Royal Bank of Scotland	(1.374)
	19.10.2020	CHF	38.576	USD	42.111	Handel	JP Morgan Chase New York	(101)
	19.10.2020	CAD	11.602	USD	8.719	Handel	JP Morgan Chase New York	(33)
	19.10.2020	AUD	38.327	USD	27.618	Handel	Lloyds	(146)

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISETERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeits- datum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio- Basiswährung
<b>Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income</b> (Fortsetzung)								
	19.10.2020	EUR	577.472	USD	678.192	Handel	Lloyds	(746)
	19.10.2020	JPY	309.443	USD	2.961	Handel	HSBC	(28)
	19.10.2020	EUR	9.723	USD	11.421	Handel	Royal Bank of Scotland	(15)
	26.10.2020	USD	51.222.287	EUR	43.580.161	Handel	HSBC	89.678
	26.10.2020	USD	7.188.026	GBP	5.612.260	Handel	Barclays	(68.504)
	19.10.2020	USD	437.697	JPY	45.916.642	Handel	UBS	2.499
	26.10.2020	EUR	158.178	USD	185.066	Handel	Lloyds	523
	26.10.2020	GBP	22.066	USD	28.024	Handel	Lloyds	507
	19.10.2020	EUR	241.969	USD	282.046	Handel	Barclays	1.813
	28.10.2020	USD	32.610	JPY	3.436.992	Handel	Barclays	31
	28.10.2020	USD	6.250.002	EUR	5.362.705	Handel	Lloyds	(42.303)
	28.10.2020	USD	1.216.582	GBP	953.461	Handel	Lloyds	(16.236)
	28.10.2020	USD	65.574	CAD	87.791	Handel	Royal Bank of Scotland	(156)
	26.10.2020	GBP	14.107	USD	17.984	Handel	Lloyds	256
	26.10.2020	EUR	221.901	USD	258.712	Handel	Lloyds	1.645
	28.10.2020	USD	14.060	EUR	12.060	Handel	HSBC	(90)
	19.10.2020	USD	24.257	EUR	20.838	Handel	UBS	(188)
	19.10.2020	JPY	442.998	USD	4.201	Handel	JP Morgan Chase New York	(2)
	26.10.2020	EUR	167.575	USD	195.255	Handel	UBS	1.360
	28.10.2020	USD	115.683	EUR	99.280	Handel	Lloyds	(807)
	19.10.2020	GBP	44.935	EUR	49.471	Handel	Royal Bank of Scotland	62
	05.10.2020	HKD	914.700	USD	118.026	Handel	JP Morgan Chase New York	1
	28.10.2020	GBP	29.700	USD	38.071	Handel	Goldman Sachs	331
	28.10.2020	JPY	20.493	USD	194	Handel	Barclays	0
	06.10.2020	USD	15.532	HKD	120.370	Handel	HSBC	0
	26.10.2020	GBP	400.000	USD	512.762	Handel	Lloyds	4.431
	26.10.2020	USD	202.658	EUR	172.618	Handel	Lloyds	125
	28.10.2020	USD	475.508	EUR	405.000	Handel	Lloyds	301
								<b>USD (1.762.880)</b>
<b>Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities*</b>								
	19.10.2020	EUR	1.000	USD	1.168	Absicherung	JP Morgan Chase New York	5
	19.10.2020	EUR	1.000	USD	1.168	Absicherung	JP Morgan Chase New York	5
	19.10.2020	EUR	1.000	USD	1.168	Absicherung	JP Morgan Chase New York	5
	19.10.2020	EUR	1.000	USD	1.168	Absicherung	JP Morgan Chase New York	5
	19.10.2020	EUR	1.000	USD	1.168	Absicherung	JP Morgan Chase New York	6
								<b>USD 26</b>
<b>Threadneedle (Lux) - Global Focus</b>								
	19.10.2020	EUR	56.961.378	USD	67.752.370	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(929.667)
	19.10.2020	EUR	9.072.911	USD	10.791.719	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(148.079)
	19.10.2020	EUR	64.408.990	USD	76.610.886	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.051.219)
	19.10.2020	EUR	7.221	USD	8.580	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(108)
	19.10.2020	EUR	2.529.324	USD	3.004.996	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(37.788)
	19.10.2020	USD	367.915	EUR	310.253	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3.949
	19.10.2020	EUR	1.000	USD	1.186	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(13)
	19.10.2020	CHF	1.000	USD	1.102	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(13)
	19.10.2020	EUR	126.940	USD	150.243	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.327)

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
<b>Threadneedle (Lux) - Global Focus</b>								
<i>(Fortsetzung)</i>	19.10.2020	USD	5.511	EUR	4.657	Absicherung	JP Morgan Chase New York	49
	19.10.2020	EUR	115.056	USD	135.932	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(958)
	19.10.2020	EUR	21.355	USD	25.230	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(178)
	19.10.2020	USD	25	EUR	21	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2020	USD	23	CHF	21	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2020	EUR	12.908	USD	15.317	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(175)
	19.10.2020	EUR	25.924	USD	30.763	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(351)
	19.10.2020	USD	36.698	EUR	31.234	Absicherung	JP Morgan Chase New York	57
	19.10.2020	EUR	32.625	USD	38.332	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(59)
	19.10.2020	USD	69.624	EUR	59.450	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(118)
	19.10.2020	USD	28.264	EUR	24.134	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(48)
	19.10.2020	USD	468.732	EUR	400.238	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(796)
	19.10.2020	USD	1.733.385	EUR	1.485.198	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(8.932)
	19.10.2020	USD	279.739	EUR	239.686	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.441)
	19.10.2020	USD	2.019.857	EUR	1.730.653	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(10.408)
	19.10.2020	EUR	173.219	USD	202.296	Absicherung	JP Morgan Chase New York	911
	19.10.2020	EUR	5.062	USD	5.911	Absicherung	JP Morgan Chase New York	27
	19.10.2020	EUR	189.257	USD	220.398	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.624
	19.10.2020	USD	27.555	EUR	23.662	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(203)
	19.10.2020	EUR	22.348	USD	25.977	Absicherung	JP Morgan Chase New York	240
	19.10.2020	EUR	25.757	USD	29.939	Absicherung	JP Morgan Chase New York	277
	19.10.2020	EUR	1.558.166	USD	1.820.923	Absicherung	JP Morgan Chase New York	6.996
	19.10.2020	EUR	247.365	USD	289.079	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.111
	19.10.2020	EUR	1.820.139	USD	2.127.074	Absicherung	JP Morgan Chase New York	8.173
	19.10.2020	EUR	88.396	USD	102.974	Absicherung	JP Morgan Chase New York	724
	19.10.2020	EUR	127.185	USD	149.253	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(49)
	19.10.2020	EUR	73.732	USD	86.525	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(28)
	19.10.2020	USD	1.057	EUR	901	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
								<b>USD (2.167.820)</b>
<b>Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities</b>								
	19.10.2020	EUR	257.956	USD	306.824	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(4.210)
	19.10.2020	EUR	1.101.515	USD	1.310.191	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(17.978)
	19.10.2020	EUR	484.885	USD	576.744	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(7.914)
	19.10.2020	USD	2.441	EUR	2.054	Absicherung	JP Morgan Chase New York	31
	19.10.2020	USD	15.796	EUR	13.346	Absicherung	JP Morgan Chase New York	139
	19.10.2020	EUR	9.931	USD	11.754	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(105)
	19.10.2020	EUR	5.985	USD	7.009	Absicherung	JP Morgan Chase New York	12
	19.10.2020	USD	12.006	EUR	10.251	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(20)
	19.10.2020	USD	8.147	EUR	6.980	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(42)
	19.10.2020	USD	34.522	EUR	29.579	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(178)
	19.10.2020	USD	15.422	EUR	13.214	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(79)
	19.10.2020	EUR	9.991	USD	11.668	Absicherung	JP Morgan Chase New York	53
	19.10.2020	USD	46.835	EUR	40.293	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(433)
	19.10.2020	EUR	10.000	USD	11.735	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(4)
								<b>USD (30.728)</b>

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 9 NICHT REALISIRTER NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung	
<b>Threadneedle (Lux) - Global Equity Income</b>	19.10.2020	SGD	5.467.666	USD	4.016.208	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(10.809)	
	19.10.2020	SGD	1.078.434	USD	792.151	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2.132)	
	19.10.2020	SGD	317.169	USD	232.973	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(627)	
	19.10.2020	AUD	72.459	USD	53.074	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.137)	
	19.10.2020	EUR	28.890	USD	34.363	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(472)	
	19.10.2020	EUR	924	USD	1.099	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(15)	
	19.10.2020	USD	114.394	SGD	156.071	Absicherung	JP Morgan Chase New York	62	
	19.10.2020	USD	22.578	SGD	30.804	Absicherung	JP Morgan Chase New York	12	
	19.10.2020	USD	6.636	SGD	9.053	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4	
	19.10.2020	USD	1.506	AUD	2.092	Absicherung	JP Morgan Chase New York	7	
	19.10.2020	USD	978	EUR	832	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2	
	19.10.2020	USD	31	EUR	27	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0	
	19.10.2020	USD	97.219	SGD	133.698	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(723)	
	19.10.2020	USD	820	EUR	702	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(4)	
	19.10.2020	USD	26	EUR	23	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0	
	19.10.2020	SGD	10.208	USD	7.408	Absicherung	JP Morgan Chase New York	70	
	19.10.2020	SGD	13	USD	9	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0	
	19.10.2020	SGD	1.000	USD	725	Absicherung	JP Morgan Chase New York	7	
	19.10.2020	SGD	1.000	USD	725	Absicherung	JP Morgan Chase New York	7	
	19.10.2020	SGD	110.493	USD	80.631	Absicherung	JP Morgan Chase New York	313	
	19.10.2020	EUR	581	USD	679	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3	
	19.10.2020	EUR	19	USD	22	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0	
	19.10.2020	SGD	100	USD	73	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0	
19.10.2020	SGD	167	USD	122	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0		
19.10.2020	SGD	58	USD	43	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0		
								<b>USD (15.432)</b>	
<b>Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies</b>	19.10.2020	GBP	1.475.527	EUR	1.596.093	Absicherung	JP Morgan Chase New York	30.124	
	19.10.2020	CHF	14.781.696	EUR	13.717.798	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4.254	
	19.10.2020	GBP	1.861	EUR	2.013	Absicherung	JP Morgan Chase New York	38	
	19.10.2020	GBP	120	EUR	130	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2	
	19.10.2020	EUR	15	GBP	14	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0	
	19.10.2020	GBP	572	EUR	629	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2	
	19.10.2020	GBP	30	EUR	33	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0	
	19.10.2020	GBP	31.042	EUR	34.120	Absicherung	JP Morgan Chase New York	91	
	19.10.2020	CHF	309.518	EUR	286.632	Absicherung	JP Morgan Chase New York	697	
	19.10.2020	GBP	40	EUR	44	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0	
	19.10.2020	GBP	2.385	EUR	2.607	Absicherung	JP Morgan Chase New York	22	
	19.10.2020	EUR	1.669	GBP	1.525	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(12)	
									<b>EUR 35.218</b>

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
<b>Threadneedle (Lux) - American</b>								
	19.10.2020	EUR	61.294.290	USD	72.906.126	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.000.384)
	19.10.2020	EUR	2.150.767	USD	2.558.217	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(35.103)
	19.10.2020	EUR	25.570.869	USD	30.415.116	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(417.342)
	19.10.2020	EUR	17.631.951	USD	20.972.218	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(287.771)
	19.10.2020	EUR	2.597.807	USD	3.089.946	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(42.399)
	19.10.2020	EUR	126.875	USD	150.911	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2.071)
	19.10.2020	EUR	1.195	USD	1.422	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(20)
	19.10.2020	EUR	94.645	USD	112.444	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.414)
	19.10.2020	USD	427	EUR	360	Absicherung	JP Morgan Chase New York	5
	19.10.2020	EUR	78.634	USD	93.249	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.001)
	19.10.2020	USD	13.074	EUR	11.025	Absicherung	JP Morgan Chase New York	140
	19.10.2020	USD	13.622	EUR	11.487	Absicherung	JP Morgan Chase New York	146
	19.10.2020	EUR	148	USD	175	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2)
	19.10.2020	USD	157.467	EUR	133.043	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.390
	19.10.2020	USD	6.221	EUR	5.256	Absicherung	JP Morgan Chase New York	55
	19.10.2020	USD	2.392.608	EUR	2.021.505	Absicherung	JP Morgan Chase New York	21.126
	19.10.2020	USD	3.397	EUR	2.870	Absicherung	JP Morgan Chase New York	30
	19.10.2020	EUR	74.011	USD	87.441	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(616)
	19.10.2020	USD	2.204	EUR	1.866	Absicherung	JP Morgan Chase New York	16
	19.10.2020	USD	205	EUR	174	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	19.10.2020	USD	1.440.117	EUR	1.213.783	Absicherung	JP Morgan Chase New York	16.194
	19.10.2020	USD	50.538	EUR	42.596	Absicherung	JP Morgan Chase New York	568
	19.10.2020	USD	596.312	EUR	502.593	Absicherung	JP Morgan Chase New York	6.705
	19.10.2020	USD	365.706	EUR	308.231	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4.112
	19.10.2020	USD	60.823	EUR	51.264	Absicherung	JP Morgan Chase New York	684
	19.10.2020	USD	2.961	EUR	2.495	Absicherung	JP Morgan Chase New York	33
	19.10.2020	USD	28	EUR	24	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2020	USD	4.024.093	EUR	3.391.083	Absicherung	JP Morgan Chase New York	45.917
	19.10.2020	USD	1.006	EUR	848	Absicherung	JP Morgan Chase New York	11
	19.10.2020	USD	16.806	EUR	14.163	Absicherung	JP Morgan Chase New York	192
	19.10.2020	EUR	21.435	USD	25.185	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(39)
	19.10.2020	USD	9.073	EUR	7.722	Absicherung	JP Morgan Chase New York	14
	19.10.2020	USD	4.429	EUR	3.769	Absicherung	JP Morgan Chase New York	7
	19.10.2020	USD	66.985	EUR	57.012	Absicherung	JP Morgan Chase New York	103
	19.10.2020	USD	2.698	EUR	2.297	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4
	19.10.2020	EUR	260.379	USD	304.939	Absicherung	JP Morgan Chase New York	518
	19.10.2020	USD	27.292	EUR	23.304	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(46)
	19.10.2020	USD	4.934	EUR	4.213	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(8)
	19.10.2020	USD	1.637.558	EUR	1.403.092	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(8.438)
	19.10.2020	USD	59.785	EUR	51.225	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(308)
	19.10.2020	USD	714.654	EUR	612.330	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(3.682)
	19.10.2020	USD	435.365	EUR	373.030	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2.243)
	19.10.2020	USD	72.871	EUR	62.437	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(374)
	19.10.2020	USD	3.549	EUR	3.041	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(18)
	19.10.2020	USD	33	EUR	29	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2020	EUR	177.757	USD	207.596	Absicherung	JP Morgan Chase New York	935
	19.10.2020	USD	3.320	EUR	2.842	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(15)
	19.10.2020	USD	11.822	EUR	10.122	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(53)

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
<b>Threadneedle (Lux) - American</b>								
<i>(Fortsetzung)</i>	19.10.2020	USD	22.512	EUR	19.277	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(101)
	19.10.2020	USD	6.736	EUR	5.784	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(50)
	19.10.2020	EUR	293	USD	342	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3
	19.10.2020	USD	4.128	EUR	3.545	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(30)
	19.10.2020	EUR	1.151.366	USD	1.339.468	Absicherung	JP Morgan Chase New York	11.226
	19.10.2020	EUR	41.662	USD	48.468	Absicherung	JP Morgan Chase New York	406
	19.10.2020	EUR	504.562	USD	586.994	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4.919
	19.10.2020	EUR	306.220	USD	356.248	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2.987
	19.10.2020	EUR	51.119	USD	59.471	Absicherung	JP Morgan Chase New York	498
	19.10.2020	EUR	2.507	USD	2.917	Absicherung	JP Morgan Chase New York	24
	19.10.2020	EUR	24	USD	27	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2020	EUR	31.274	USD	36.352	Absicherung	JP Morgan Chase New York	336
	19.10.2020	EUR	68	USD	79	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	19.10.2020	EUR	361	USD	420	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4
	19.10.2020	EUR	95	USD	111	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	19.10.2020	EUR	50.493	USD	58.821	Absicherung	JP Morgan Chase New York	414
	19.10.2020	USD	9.604	EUR	8.244	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(68)
	19.10.2020	USD	1.352	EUR	1.161	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(10)
	19.10.2020	USD	49.995	EUR	42.917	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(351)
	19.10.2020	EUR	114.762	USD	134.673	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(43)
	19.10.2020	USD	10.728	EUR	9.142	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3
	19.10.2020	USD	677	EUR	577	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2020	USD	36.361	EUR	30.985	Absicherung	JP Morgan Chase New York	12
								<b>USD (1.684.260)</b>
<b>Threadneedle (Lux) - American Select</b>								
	19.10.2020	EUR	845.003	USD	1.005.084	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(13.791)
	19.10.2020	EUR	326.518	USD	388.375	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(5.329)
	19.10.2020	EUR	1.018.101	USD	1.210.974	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(16.616)
	19.10.2020	EUR	14.408	USD	17.137	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(235)
	19.10.2020	EUR	229.908	USD	273.463	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(3.752)
	19.10.2020	EUR	1.267	USD	1.507	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(21)
	19.10.2020	EUR	943.996	USD	1.122.831	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(15.407)
	19.10.2020	USD	36.219	EUR	30.486	Absicherung	JP Morgan Chase New York	455
	19.10.2020	USD	4	EUR	4	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2020	EUR	9.741	USD	11.552	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(124)
	19.10.2020	USD	28.991	EUR	24.447	Absicherung	JP Morgan Chase New York	311
	19.10.2020	USD	24.451	EUR	20.608	Absicherung	JP Morgan Chase New York	275
	19.10.2020	USD	9.679	EUR	8.157	Absicherung	JP Morgan Chase New York	109
	19.10.2020	USD	29.026	EUR	24.464	Absicherung	JP Morgan Chase New York	326
	19.10.2020	USD	424	EUR	358	Absicherung	JP Morgan Chase New York	5
	19.10.2020	USD	6.789	EUR	5.722	Absicherung	JP Morgan Chase New York	76
	19.10.2020	USD	37	EUR	31	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2020	USD	27.808	EUR	23.437	Absicherung	JP Morgan Chase New York	313
	19.10.2020	EUR	986	USD	1.170	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(13)
	19.10.2020	USD	1.929	EUR	1.642	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3
	19.10.2020	USD	6.814	EUR	5.800	Absicherung	JP Morgan Chase New York	11
	19.10.2020	USD	202	EUR	172	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
<b>Threadneedle (Lux) - American Select</b>								
<i>(Fortsetzung)</i>	19.10.2020	USD	20.702	EUR	17.738	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(107)
	19.10.2020	USD	8.208	EUR	7.033	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(42)
	19.10.2020	USD	24.740	EUR	21.198	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(127)
	19.10.2020	USD	360	EUR	308	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2)
	19.10.2020	USD	5.761	EUR	4.936	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(30)
	19.10.2020	USD	32	EUR	27	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2020	USD	23.582	EUR	20.205	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(122)
	19.10.2020	EUR	18.772	USD	21.838	Absicherung	JP Morgan Chase New York	183
	19.10.2020	EUR	7.375	USD	8.580	Absicherung	JP Morgan Chase New York	72
	19.10.2020	EUR	22.518	USD	26.197	Absicherung	JP Morgan Chase New York	220
	19.10.2020	EUR	328	USD	382	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3
	19.10.2020	EUR	5.228	USD	6.082	Absicherung	JP Morgan Chase New York	51
	19.10.2020	EUR	29	USD	34	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2020	EUR	21.513	USD	25.028	Absicherung	JP Morgan Chase New York	209
	19.10.2020	EUR	250	USD	291	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2
	19.10.2020	EUR	87	USD	101	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	19.10.2020	EUR	83	USD	97	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
								<b>USD (53.093)</b>
<b>Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies</b>								
	19.10.2020	EUR	1.121	USD	1.334	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(18)
	19.10.2020	EUR	1.111	USD	1.321	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(18)
	19.10.2020	EUR	45.198	USD	53.760	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(738)
	19.10.2020	EUR	1.144	USD	1.361	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(19)
	19.10.2020	USD	34	EUR	29	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2020	USD	33	EUR	29	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2020	USD	1.348	EUR	1.147	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2
	19.10.2020	USD	34	EUR	29	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2020	USD	27	EUR	23	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2020	USD	27	EUR	23	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2020	USD	1.090	EUR	934	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(6)
	19.10.2020	USD	28	EUR	24	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2020	EUR	37	USD	44	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2020	EUR	37	USD	43	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2020	EUR	1.507	USD	1.761	Absicherung	JP Morgan Chase New York	8
	19.10.2020	EUR	38	USD	45	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
								<b>USD (789)</b>

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 9 NICHT REALISIRTER NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeits- datum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio- Basiswährung
<b>Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity</b>								
	19.10.2020	SGD	871.130	USD	639.878	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.722)
	19.10.2020	SGD	9.845	USD	7.231	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(19)
	19.10.2020	EUR	5.222	USD	6.212	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(85)
	19.10.2020	SGD	800	USD	587	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1)
	19.10.2020	SGD	500	USD	367	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1)
	19.10.2020	SGD	953	USD	702	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(4)
	19.10.2020	SGD	500	USD	368	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2)
	19.10.2020	SGD	500	USD	368	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2)
	19.10.2020	USD	23.382	SGD	32.139	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(162)
	19.10.2020	USD	262	SGD	360	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2)
	19.10.2020	USD	224	EUR	192	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1)
								<b>USD (2.001)</b>
<b>Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities</b>								
	19.10.2020	EUR	306.227	USD	364.239	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(4.998)
	19.10.2020	EUR	7.486.438	USD	8.904.698	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(122.186)
	19.10.2020	CHF	3.029	USD	3.345	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(46)
	19.10.2020	GBP	3.194	USD	4.110	Absicherung	JP Morgan Chase New York	20
	19.10.2020	EUR	610	USD	726	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(10)
	19.10.2020	SGD	143.900.904	USD	105.700.679	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(284.489)
	19.10.2020	USD	34.053	EUR	28.662	Absicherung	JP Morgan Chase New York	428
	19.10.2020	USD	585	EUR	493	Absicherung	JP Morgan Chase New York	6
	19.10.2020	EUR	98	USD	115	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1)
	19.10.2020	EUR	3.719	USD	4.413	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(50)
	19.10.2020	USD	11.148	EUR	9.485	Absicherung	JP Morgan Chase New York	20
	19.10.2020	USD	270.289	EUR	229.987	Absicherung	JP Morgan Chase New York	486
	19.10.2020	USD	102	CHF	93	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2020	USD	126	GBP	99	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1)
	19.10.2020	USD	22	EUR	19	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2020	USD	3.210.292	SGD	4.379.899	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.749
	19.10.2020	USD	12.590	EUR	10.715	Absicherung	JP Morgan Chase New York	19
	19.10.2020	EUR	13.230	USD	15.494	Absicherung	JP Morgan Chase New York	26
	19.10.2020	EUR	1.756	USD	2.045	Absicherung	JP Morgan Chase New York	15
	19.10.2020	USD	4.042	EUR	3.477	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(37)
	19.10.2020	EUR	6.310	USD	7.374	Absicherung	JP Morgan Chase New York	28
	19.10.2020	EUR	154.735	USD	180.828	Absicherung	JP Morgan Chase New York	695
	19.10.2020	CHF	63	USD	68	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2020	GBP	66	USD	85	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2020	SGD	3.017.801	USD	2.202.203	Absicherung	JP Morgan Chase New York	8.521
	19.10.2020	USD	7.450	EUR	6.395	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(51)
	19.10.2020	USD	3.791	EUR	3.231	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
								<b>USD (399.855)</b>



## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISETERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
<b>Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities</b>								
	19.10.2020	EUR	2.120	USD	2.521	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(35)
	19.10.2020	EUR	15.855	USD	18.859	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(259)
	19.10.2020	EUR	2.142	USD	2.547	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(35)
	19.10.2020	CHF	1.956	USD	2.159	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(29)
	19.10.2020	EUR	2.137	USD	2.542	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(35)
	19.10.2020	CHF	1.947	USD	2.150	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(29)
	19.10.2020	EUR	2.018	USD	2.400	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(32)
	19.10.2020	USD	76	EUR	65	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2020	USD	568	EUR	483	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	19.10.2020	USD	76	EUR	65	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2020	USD	65	CHF	59	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2020	USD	76	EUR	65	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2020	USD	65	CHF	59	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2020	USD	72	EUR	61	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2020	USD	47	EUR	40	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2020	EUR	59	USD	69	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
								<b>USD (453)</b>
<b>Threadneedle (Lux) - Pan European Equities</b>								
	19.10.2020	SGD	4.744.348	EUR	2.929.098	Absicherung	JP Morgan Chase New York	33.527
	19.10.2020	USD	2.931	EUR	2.464	Absicherung	JP Morgan Chase New York	34
	19.10.2020	USD	555.513	EUR	467.036	Absicherung	JP Morgan Chase New York	6.498
	19.10.2020	SGD	4.200	EUR	2.593	Absicherung	JP Morgan Chase New York	29
	19.10.2020	EUR	346.255	USD	411.373	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(4.411)
	19.10.2020	SGD	8.868	EUR	5.493	Absicherung	JP Morgan Chase New York	45
	19.10.2020	SGD	500	EUR	311	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	19.10.2020	SGD	500	EUR	311	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	19.10.2020	SGD	319	EUR	198	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	19.10.2020	EUR	69.146	SGD	110.898	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(105)
	19.10.2020	EUR	57	USD	67	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2020	EUR	2.838	USD	3.335	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(5)
	19.10.2020	SGD	4.753	EUR	2.968	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2020	EUR	354	SGD	567	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2020	EUR	46.743	SGD	74.832	Absicherung	JP Morgan Chase New York	15
	19.10.2020	EUR	522	SGD	836	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2020	EUR	3.970	SGD	6.355	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2
								<b>EUR 35.632</b>
<b>Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities</b>								
	19.10.2020	SGD	17.990.698	EUR	11.107.221	Absicherung	JP Morgan Chase New York	127.136
	19.10.2020	CHF	428.568	EUR	397.722	Absicherung	JP Morgan Chase New York	123
	19.10.2020	USD	265.298	EUR	223.044	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3.103
	19.10.2020	USD	1.156	EUR	972	Absicherung	JP Morgan Chase New York	14
	19.10.2020	EUR	32.742	SGD	53.024	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(369)
	19.10.2020	SGD	26.203	EUR	16.230	Absicherung	JP Morgan Chase New York	132
	19.10.2020	SGD	2.273	EUR	1.415	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISETERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeits- datum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio- Basiswährung
<b>Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities</b> <i>(Fortsetzung)</i>								
	19.10.2020	EUR	14.940	SGD	23.990	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(41)
	19.10.2020	SGD	17.248	EUR	10.708	Absicherung	JP Morgan Chase New York	63
	19.10.2020	EUR	11.180	SGD	17.902	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	19.10.2020	EUR	90.709	SGD	145.099	Absicherung	JP Morgan Chase New York	102
	19.10.2020	EUR	57.828	SGD	92.577	Absicherung	JP Morgan Chase New York	18
	19.10.2020	EUR	357.847	SGD	574.250	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(746)
	19.10.2020	EUR	111.364	SGD	178.490	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(94)
	19.10.2020	EUR	24.175	SGD	38.694	Absicherung	JP Morgan Chase New York	12
	19.10.2020	USD	13.000	EUR	11.159	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(78)
	19.10.2020	SGD	24.930	EUR	15.513	Absicherung	JP Morgan Chase New York	54
								<b>EUR 129.434</b>
<b>Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies</b>								
	19.10.2020	CHF	1.622.422	EUR	1.505.650	Absicherung	JP Morgan Chase New York	467
	19.10.2020	USD	20.331.915	EUR	17.093.629	Absicherung	JP Morgan Chase New York	237.814
	19.10.2020	CHF	1.430.080	EUR	1.327.151	Absicherung	JP Morgan Chase New York	411
	19.10.2020	USD	5.266.926	EUR	4.428.057	Absicherung	JP Morgan Chase New York	61.605
	19.10.2020	CHF	114.355	EUR	106.124	Absicherung	JP Morgan Chase New York	33
	19.10.2020	USD	1.398.896	EUR	1.176.092	Absicherung	JP Morgan Chase New York	16.362
	19.10.2020	EUR	255.255	USD	302.115	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2.276)
	19.10.2020	EUR	5.565	CHF	5.980	Absicherung	JP Morgan Chase New York	14
	19.10.2020	EUR	91.354	USD	107.335	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(141)
	19.10.2020	USD	2.164.433	EUR	1.853.329	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(8.311)
	19.10.2020	USD	958.582	EUR	823.140	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(6.021)
								<b>EUR 299.957</b>
<b>Threadneedle (Lux) - European Select</b>								
	19.10.2020	USD	402.393	EUR	338.304	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4.707
	19.10.2020	USD	1.238	EUR	1.041	Absicherung	JP Morgan Chase New York	14
	19.10.2020	GBP	7.365	EUR	7.966	Absicherung	JP Morgan Chase New York	150
	19.10.2020	GBP	9.228.595	EUR	9.982.666	Absicherung	JP Morgan Chase New York	188.409
	19.10.2020	SGD	19.153.073	EUR	11.824.856	Absicherung	JP Morgan Chase New York	135.350
	19.10.2020	USD	2.950.529	EUR	2.480.595	Absicherung	JP Morgan Chase New York	34.511
	19.10.2020	GBP	5.142	EUR	5.577	Absicherung	JP Morgan Chase New York	91
	19.10.2020	SGD	485.000	EUR	299.483	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3.377
	19.10.2020	EUR	28.124	GBP	25.943	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(469)
	19.10.2020	EUR	26.975	GBP	24.552	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(84)
	19.10.2020	USD	1.200	EUR	1.014	Absicherung	JP Morgan Chase New York	9
	19.10.2020	EUR	17.051	GBP	15.555	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(92)
	19.10.2020	SGD	9.918	EUR	6.176	Absicherung	JP Morgan Chase New York	17
	19.10.2020	EUR	7.308	GBP	6.690	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(66)
	19.10.2020	EUR	129.439	GBP	118.841	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.539)
	19.10.2020	EUR	28.328	GBP	26.070	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(405)

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 9 NICHT REALISIRTER NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeits- datum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio- Basiswährung
<b>Threadneedle (Lux) - European Select (Fortsetzung)</b>								
	19.10.2020	SGD	30.000	EUR	18.755	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(21)
	19.10.2020	USD	39	EUR	33	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2020	EUR	27.530	GBP	25.189	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(232)
	19.10.2020	SGD	10.918	EUR	6.820	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2)
	19.10.2020	SGD	460.000	EUR	286.651	Absicherung	JP Morgan Chase New York	598
	19.10.2020	GBP	19.046	EUR	20.820	Absicherung	JP Morgan Chase New York	171
	19.10.2020	EUR	8	SGD	13	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2020	EUR	918	USD	1.067	Absicherung	JP Morgan Chase New York	8
	19.10.2020	EUR	17.152	GBP	15.559	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4
	19.10.2020	EUR	27.891	GBP	25.489	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(200)
	19.10.2020	EUR	920	USD	1.080	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
								<b>EUR 364.306</b>
<b>Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies</b>								
	19.10.2020	CHF	587.745	EUR	545.443	Absicherung	JP Morgan Chase New York	169
	19.10.2020	CHF	6.238.510	EUR	5.789.500	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.795
	19.10.2020	CHF	1.802	EUR	1.673	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	19.10.2020	CHF	325.101	EUR	301.229	Absicherung	JP Morgan Chase New York	566
	19.10.2020	CHF	19.262	EUR	17.818	Absicherung	JP Morgan Chase New York	64
								<b>EUR 2.595</b>
<b>Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income</b>								
	19.10.2020	EUR	400.123	USD	475.924	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(6.530)
	19.10.2020	EUR	325.017	USD	386.590	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(5.305)
	19.10.2020	GBP	149.436	USD	192.260	Absicherung	JP Morgan Chase New York	950
	19.10.2020	USD	13.843	EUR	11.717	Absicherung	JP Morgan Chase New York	98
	19.10.2020	USD	13.748	EUR	11.636	Absicherung	JP Morgan Chase New York	97
	19.10.2020	USD	19.203	EUR	16.453	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(99)
	19.10.2020	USD	15.423	EUR	13.215	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(79)
	19.10.2020	USD	7.945	GBP	6.239	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(122)
	19.10.2020	USD	23.041	EUR	19.785	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(170)
	19.10.2020	USD	296	EUR	255	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(3)
	19.10.2020	EUR	150	USD	175	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	19.10.2020	EUR	12.000	USD	14.082	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(5)
	05.10.2020	HKD	5.517.372	USD	711.917	Handel	JP Morgan Chase New York	6
								<b>USD (11.161)</b>
<b>Threadneedle (Lux) - Global Technology</b>								
	19.10.2020	EUR	472.226	USD	561.687	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(7.707)
	19.10.2020	EUR	26.413.304	USD	31.417.146	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(431.092)
	19.10.2020	EUR	11.200.962	USD	13.322.918	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(182.811)
	19.10.2020	EUR	1.624.144	USD	1.931.828	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(26.508)
	19.10.2020	CHF	1.769.642	USD	1.953.782	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(26.596)
	19.10.2020	USD	128.574	EUR	108.221	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.616
	19.10.2020	USD	1.115	EUR	938	Absicherung	JP Morgan Chase New York	14
	19.10.2020	USD	241.446	EUR	203.605	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2.591
	19.10.2020	USD	167.596	EUR	141.329	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.799

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 9 NICHT REALISIRTER NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeits- datum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio- Basiswährung
<b>Threadneedle (Lux) - Global Technology</b> (Fortsetzung)								
	19.10.2020	EUR	31.086	USD	36.792	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(325)
	19.10.2020	EUR	23.538	USD	27.859	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(246)
	19.10.2020	USD	35.774	EUR	30.280	Absicherung	JP Morgan Chase New York	252
	19.10.2020	USD	866.408	EUR	733.343	Absicherung	JP Morgan Chase New York	6.104
	19.10.2020	USD	97.023	EUR	81.761	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.107
	19.10.2020	USD	12	EUR	10	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2020	USD	45.830	EUR	39.006	Absicherung	JP Morgan Chase New York	71
	19.10.2020	USD	4.429	EUR	3.770	Absicherung	JP Morgan Chase New York	7
	19.10.2020	USD	104.745	EUR	89.439	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(178)
	19.10.2020	EUR	1.756	USD	2.056	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3
	19.10.2020	USD	15.826	EUR	13.560	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(82)
	19.10.2020	USD	865.003	EUR	741.151	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(4.457)
	19.10.2020	USD	343.468	EUR	294.290	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.770)
	19.10.2020	USD	53.901	EUR	46.183	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(278)
	19.10.2020	USD	54.698	CHF	50.527	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(327)
	19.10.2020	USD	47.801	EUR	40.930	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(215)
	19.10.2020	EUR	5.133	USD	5.995	Absicherung	JP Morgan Chase New York	27
	19.10.2020	USD	120.872	EUR	103.794	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(890)
	19.10.2020	USD	1.375	EUR	1.181	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(10)
	19.10.2020	USD	84.952	EUR	73.085	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(786)
	19.10.2020	EUR	743	USD	864	Absicherung	JP Morgan Chase New York	8
	19.10.2020	EUR	19.369	USD	22.636	Absicherung	JP Morgan Chase New York	87
	19.10.2020	EUR	1.055.860	USD	1.233.913	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4.741
	19.10.2020	EUR	426.467	USD	498.383	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.915
	19.10.2020	EUR	66.891	USD	78.171	Absicherung	JP Morgan Chase New York	301
	19.10.2020	CHF	72.818	USD	78.906	Absicherung	JP Morgan Chase New York	395
	19.10.2020	USD	1.083	EUR	929	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(8)
	19.10.2020	USD	683	EUR	586	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(5)
	19.10.2020	EUR	16.502	USD	19.365	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(6)
	19.10.2020	USD	549	EUR	468	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2020	USD	4.729	EUR	4.030	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2
								<b>USD (663.257)</b>
<b>Threadneedle (Lux) - UK Equities</b>								
	19.10.2020	CHF	63.369	GBP	54.405	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.030)
	19.10.2020	EUR	1.681.058	GBP	1.554.074	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(28.788)
	19.10.2020	EUR	1.709.162	GBP	1.580.056	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(29.269)
	19.10.2020	USD	21.940	GBP	17.053	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(84)
	19.10.2020	EUR	511.606	GBP	472.961	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(8.761)
	19.10.2020	CHF	60.214	GBP	51.696	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(979)
	19.10.2020	EUR	347.891	GBP	321.612	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(5.958)
	19.10.2020	EUR	2.546.299	GBP	2.353.957	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(43.605)
	19.10.2020	USD	1.607.522	GBP	1.249.463	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(6.145)
	19.10.2020	EUR	94.081	GBP	86.974	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.611)
	19.10.2020	CHF	55.065	GBP	47.276	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(895)
	19.10.2020	USD	7.505	GBP	5.833	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(29)
	19.10.2020	GBP	36.987	EUR	40.113	Absicherung	JP Morgan Chase New York	591
	19.10.2020	GBP	5.226	USD	6.734	Absicherung	JP Morgan Chase New York	18

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeits- datum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio- Basiswährung
<b>Threadneedle (Lux) - UK Equities</b> (Fortsetzung)								
	19.10.2020	GBP	1.548	EUR	1.701	Absicherung	JP Morgan Chase New York	5
	19.10.2020	GBP	4.634	USD	6.027	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(27)
	19.10.2020	GBP	1.829	EUR	2.005	Absicherung	JP Morgan Chase New York	10
	19.10.2020	GBP	1.237	EUR	1.356	Absicherung	JP Morgan Chase New York	7
	19.10.2020	USD	87.054	GBP	67.218	Absicherung	JP Morgan Chase New York	113
	19.10.2020	GBP	6.831	EUR	7.462	Absicherung	JP Morgan Chase New York	61
	19.10.2020	EUR	75.000	GBP	68.661	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(611)
	19.10.2020	GBP	2.592	CHF	3.036	Absicherung	JP Morgan Chase New York	35
	19.10.2020	GBP	73.840	EUR	80.386	Absicherung	JP Morgan Chase New York	903
	19.10.2020	GBP	73.491	EUR	80.006	Absicherung	JP Morgan Chase New York	898
	19.10.2020	GBP	811	USD	1.037	Absicherung	JP Morgan Chase New York	9
	19.10.2020	GBP	22.072	EUR	24.029	Absicherung	JP Morgan Chase New York	270
	19.10.2020	GBP	2.456	CHF	2.876	Absicherung	JP Morgan Chase New York	33
	19.10.2020	GBP	15.384	EUR	16.747	Absicherung	JP Morgan Chase New York	188
	19.10.2020	GBP	114.549	EUR	124.704	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.400
	19.10.2020	GBP	62.257	USD	79.626	Absicherung	JP Morgan Chase New York	672
	19.10.2020	GBP	4.130	EUR	4.496	Absicherung	JP Morgan Chase New York	50
	19.10.2020	GBP	2.244	CHF	2.628	Absicherung	JP Morgan Chase New York	30
	19.10.2020	GBP	277	USD	354	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3
	19.10.2020	EUR	650	GBP	597	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(7)
	19.10.2020	GBP	84	EUR	91	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	19.10.2020	CHF	11.399	GBP	9.675	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(74)
	19.10.2020	EUR	7.393	GBP	6.764	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(56)
	19.10.2020	EUR	6.111	GBP	5.591	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(47)
	19.10.2020	USD	8.749	GBP	6.855	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(88)
	19.10.2020	EUR	10.165	GBP	9.301	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(78)
	19.10.2020	EUR	28.736	GBP	26.317	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(243)
	19.10.2020	EUR	472	GBP	432	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(4)
	19.10.2020	EUR	28.632	GBP	26.221	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(242)
	19.10.2020	USD	42.042	GBP	33.061	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(545)
	19.10.2020	GBP	16.376	USD	20.903	Absicherung	JP Morgan Chase New York	209
	19.10.2020	CHF	1.505	GBP	1.268	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1)
	19.10.2020	EUR	37.072	GBP	33.693	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(56)
	19.10.2020	EUR	37.215	GBP	33.823	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(56)
	19.10.2020	EUR	11.054	GBP	10.047	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(17)
	19.10.2020	CHF	1.323	GBP	1.115	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1)
	19.10.2020	EUR	7.556	GBP	6.867	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(11)
	19.10.2020	EUR	58.553	GBP	53.216	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(88)
	19.10.2020	USD	38.523	GBP	29.961	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(164)
	19.10.2020	EUR	2.185	GBP	1.986	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(3)
	19.10.2020	CHF	1.212	GBP	1.021	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1)
	19.10.2020	USD	167	GBP	130	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1)
	19.10.2020	EUR	600	GBP	544	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2020	CHF	32.655	GBP	27.604	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(98)
	19.10.2020	EUR	1.090	GBP	996	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(7)
								<b>GBP (124.174)</b>

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
<b>Threadneedle (Lux) - UK Equity Income</b>								
	19.10.2020	EUR	99.177	GBP	91.686	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.698)
	19.10.2020	EUR	31.392	GBP	29.020	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(538)
	19.10.2020	EUR	1.967.454	GBP	1.818.837	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(33.692)
	19.10.2020	CHF	213.436	GBP	183.246	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(3.470)
	19.10.2020	USD	1.140	GBP	886	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(4)
	19.10.2020	SGD	25.145	GBP	14.368	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(121)
	19.10.2020	EUR	35.340	GBP	32.670	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(605)
	19.10.2020	EUR	911	GBP	842	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(16)
	19.10.2020	EUR	1.104	GBP	1.021	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(19)
	19.10.2020	USD	11.440	GBP	8.892	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(44)
	19.10.2020	USD	1.014	GBP	788	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(4)
	19.10.2020	EUR	469.204	GBP	433.761	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(8.035)
	19.10.2020	CHF	267.501	GBP	229.663	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(4.349)
	19.10.2020	USD	471.946	GBP	366.825	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.804)
	19.10.2020	CHF	241.007	GBP	206.916	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(3.918)
	19.10.2020	CHF	933	GBP	801	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(15)
	19.10.2020	USD	2.078.530	GBP	1.615.559	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(7.946)
	19.10.2020	EUR	1.874.498	GBP	1.732.902	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(32.100)
	19.10.2020	USD	982	GBP	763	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(4)
	19.10.2020	EUR	938	GBP	867	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(16)
	19.10.2020	EUR	2.747	GBP	2.533	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(40)
	19.10.2020	GBP	10.342	USD	13.295	Absicherung	JP Morgan Chase New York	59
	19.10.2020	EUR	452	GBP	411	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1)
	19.10.2020	GBP	3.792	USD	4.931	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(22)
	19.10.2020	EUR	106.315	GBP	96.986	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(522)
	19.10.2020	USD	31.956	GBP	24.652	Absicherung	JP Morgan Chase New York	63
	19.10.2020	GBP	2.380	EUR	2.591	Absicherung	JP Morgan Chase New York	29
	19.10.2020	GBP	757	EUR	824	Absicherung	JP Morgan Chase New York	9
	19.10.2020	GBP	46.962	EUR	51.126	Absicherung	JP Morgan Chase New York	574
	19.10.2020	GBP	4.720	CHF	5.528	Absicherung	JP Morgan Chase New York	64
	19.10.2020	GBP	23	USD	29	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2020	GBP	373	SGD	651	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4
	19.10.2020	GBP	848	EUR	923	Absicherung	JP Morgan Chase New York	10
	19.10.2020	GBP	22	EUR	24	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2020	GBP	26	EUR	29	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2020	GBP	1.046	USD	1.338	Absicherung	JP Morgan Chase New York	11
	19.10.2020	GBP	20	USD	26	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2020	GBP	11.245	EUR	12.242	Absicherung	JP Morgan Chase New York	137
	19.10.2020	GBP	5.941	CHF	6.958	Absicherung	JP Morgan Chase New York	81
	19.10.2020	GBP	9.476	USD	12.119	Absicherung	JP Morgan Chase New York	102
	19.10.2020	GBP	5.324	CHF	6.234	Absicherung	JP Morgan Chase New York	72
	19.10.2020	GBP	21	CHF	24	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2020	GBP	40.983	USD	52.416	Absicherung	JP Morgan Chase New York	442
	19.10.2020	GBP	44.637	EUR	48.594	Absicherung	JP Morgan Chase New York	546
	19.10.2020	GBP	20	USD	25	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2020	GBP	3.648	EUR	3.972	Absicherung	JP Morgan Chase New York	45
	19.10.2020	EUR	644	GBP	592	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(7)
	19.10.2020	EUR	57.582	GBP	52.867	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(621)

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISETERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
<b>Threadneedle (Lux) - UK Equity Income</b>								
<i>(Fortsetzung)</i>	19.10.2020	GBP	23.320	EUR	25.340	Absicherung	JP Morgan Chase New York	329
	19.10.2020	EUR	4.587	GBP	4.197	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(35)
	19.10.2020	EUR	19.393	GBP	17.760	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(164)
	19.10.2020	GBP	11.270	EUR	12.319	Absicherung	JP Morgan Chase New York	92
	19.10.2020	GBP	21.511	EUR	23.514	Absicherung	JP Morgan Chase New York	177
	19.10.2020	GBP	3.842	USD	4.935	Absicherung	JP Morgan Chase New York	27
	19.10.2020	EUR	1.243	GBP	1.136	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(8)
								<b>GBP (96.945)</b>
<b>Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha</b>								
	19.10.2020	EUR	699.339	USD	831.824	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(11.414)
	19.10.2020	CHF	8.750	USD	9.660	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(132)
	19.10.2020	GBP	21.820	USD	28.072	Absicherung	JP Morgan Chase New York	139
	19.10.2020	EUR	144.298	USD	171.635	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2.355)
	19.10.2020	EUR	1.269.789	USD	1.510.343	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(20.724)
	19.10.2020	GBP	1.848.215	USD	2.377.858	Absicherung	JP Morgan Chase New York	11.753
	19.10.2020	GBP	59.332.055	USD	76.334.843	Absicherung	JP Morgan Chase New York	377.293
	19.10.2020	GBP	88.959	USD	114.453	Absicherung	JP Morgan Chase New York	566
	19.10.2020	EUR	975	USD	1.160	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(16)
	19.10.2020	EUR	500	USD	593	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(6)
	19.10.2020	USD	28.486	EUR	24.323	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(48)
	19.10.2020	EUR	102.424	USD	119.617	Absicherung	JP Morgan Chase New York	538
	19.10.2020	EUR	77.588	USD	90.385	Absicherung	JP Morgan Chase New York	635
								<b>USD 356.229</b>
<b>Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities</b>								
	19.10.2020	USD	6.668.676	EUR	5.606.549	Absicherung	JP Morgan Chase New York	78.001
	19.10.2020	GBP	624.856	EUR	675.913	Absicherung	JP Morgan Chase New York	12.757
	19.10.2020	GBP	20.791.341	EUR	22.490.207	Absicherung	JP Morgan Chase New York	424.471
	19.10.2020	GBP	2.508.149	EUR	2.713.091	Absicherung	JP Morgan Chase New York	51.206
	19.10.2020	GBP	1.711.017	EUR	1.850.824	Absicherung	JP Morgan Chase New York	34.932
	19.10.2020	GBP	964	EUR	1.043	Absicherung	JP Morgan Chase New York	20
	19.10.2020	GBP	144.315	EUR	156.107	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2.946
	19.10.2020	EUR	241.365	GBP	222.557	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(3.922)
	19.10.2020	EUR	67	GBP	62	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1)
	19.10.2020	EUR	259.814	GBP	239.669	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(4.332)
	19.10.2020	EUR	127.426	USD	150.819	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.136)
	19.10.2020	EUR	349.633	GBP	318.224	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.091)
	19.10.2020	GBP	10	EUR	11	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2020	EUR	444.673	GBP	405.652	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2.408)
	19.10.2020	EUR	2.048	GBP	1.868	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(11)
	19.10.2020	EUR	29.482	GBP	26.990	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(265)
	19.10.2020	EUR	28	GBP	25	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2020	GBP	7.505	EUR	8.174	Absicherung	JP Morgan Chase New York	97
	19.10.2020	EUR	180	GBP	165	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2)
	19.10.2020	EUR	105.009	GBP	96.640	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.501)
	19.10.2020	EUR	69.878	GBP	63.936	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(588)

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
<b>Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities</b>								
<i>(Fortsetzung)</i>	19.10.2020	EUR	21.998	GBP	20.146	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(205)
	19.10.2020	EUR	62.944	GBP	57.583	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(521)
	19.10.2020	EUR	170	GBP	156	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1)
	19.10.2020	EUR	245.783	GBP	222.951	Absicherung	JP Morgan Chase New York	63
	19.10.2020	EUR	60.088	GBP	54.911	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(431)
	26.10.2020	EUR	103.534.380	GBP	95.000.000	Handel	Barclays	(1.156.478)
	26.10.2020	EUR	102.366.033	GBP	93.930.233	Handel	Citigroup Global Markets	(1.145.933)
	26.10.2020	EUR	107.200.559	USD	126.000.000	Handel	Lloyds	(189.051)
	26.10.2020	EUR	106.731.261	USD	125.456.151	Handel	JP Morgan Chase New York	(194.831)
	26.10.2020	EUR	2.181.803	USD	2.552.750	Handel	Citigroup Global Markets	6.103
	26.10.2020	USD	3.359.505	EUR	2.881.136	Handel	Barclays	(17.837)
	26.10.2020	GBP	645.076	EUR	705.512	Handel	Lloyds	5.364
	26.10.2020	USD	9.000.000	EUR	7.724.394	Handel	Lloyds	(53.715)
	26.10.2020	USD	1.323.533	EUR	1.135.867	Handel	Barclays	(7.823)
								<b>EUR (2.166.123)</b>
<b>Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities Fund</b>								
	19.10.2020	CHF	1.883	EUR	1.747	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	19.10.2020	USD	1.066	EUR	896	Absicherung	JP Morgan Chase New York	12
	19.10.2020	GBP	1.469	EUR	1.589	Absicherung	JP Morgan Chase New York	30
	19.10.2020	USD	1.081	EUR	909	Absicherung	JP Morgan Chase New York	13
	19.10.2020	GBP	1.470	EUR	1.590	Absicherung	JP Morgan Chase New York	30
	19.10.2020	USD	1.077	EUR	905	Absicherung	JP Morgan Chase New York	13
	19.10.2020	GBP	1.464	EUR	1.584	Absicherung	JP Morgan Chase New York	30
	19.10.2020	USD	1.074	EUR	903	Absicherung	JP Morgan Chase New York	13
	19.10.2020	CHF	1.903	EUR	1.766	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	19.10.2020	GBP	1.465	EUR	1.585	Absicherung	JP Morgan Chase New York	30
	19.10.2020	USD	1.078	EUR	906	Absicherung	JP Morgan Chase New York	13
	19.10.2020	GBP	1.474	EUR	1.594	Absicherung	JP Morgan Chase New York	30
	19.10.2020	SEK	10.030	EUR	964	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(8)
	19.10.2020	NOK	10.138	EUR	946	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(22)
	19.10.2020	NOK	10.145	EUR	947	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(22)
	19.10.2020	GBP	38.664.027	EUR	41.823.273	Absicherung	JP Morgan Chase New York	789.356
	19.10.2020	USD	2.019.671	EUR	1.697.996	Absicherung	JP Morgan Chase New York	23.623
	26.10.2020	EUR	9.317.381	GBP	8.552.705	Handel	Barclays	(107.779)
	26.10.2020	EUR	11.864.896	USD	13.945.867	Handel	Barclays	(21.147)
	26.10.2020	USD	84.717	EUR	72.654	Handel	Barclays	(450)
	26.10.2020	USD	110.182	EUR	94.559	Handel	Barclays	(652)
	26.10.2020	GBP	56.933	EUR	62.726	Handel	JP Morgan Chase New York	13
								<b>EUR 683.128</b>



## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 9 NICHT REALISIRTER NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeits- datum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio- Basiswährung
<b>Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha</b>								
	19.10.2020	USD	28.062	EUR	23.593	Absicherung	JP Morgan Chase New York	328
	19.10.2020	GBP	1.943.998	EUR	2.102.842	Absicherung	JP Morgan Chase New York	39.688
	19.10.2020	GBP	54.508.844	EUR	58.962.774	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.112.840
	19.10.2020	GBP	2.583	EUR	2.794	Absicherung	JP Morgan Chase New York	53
	19.10.2020	CHF	34.038	EUR	31.588	Absicherung	JP Morgan Chase New York	10
	19.10.2020	GBP	50.230	EUR	54.709	Absicherung	JP Morgan Chase New York	650
	19.10.2020	USD	4.005	EUR	3.429	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(15)
	19.10.2020	USD	701	EUR	597	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2020	GBP	46.512	EUR	50.897	Absicherung	JP Morgan Chase New York	365
	19.10.2020	GBP	1.617.687	EUR	1.770.205	Absicherung	JP Morgan Chase New York	12.690
	19.10.2020	GBP	61	EUR	66	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2020	CHF	798	EUR	738	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3
	19.10.2020	GBP	40.000	EUR	43.771	Absicherung	JP Morgan Chase New York	315
								<b>EUR 1.166.927</b>
<b>Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha</b>								
	19.10.2020	EUR	3.267.987	USD	3.887.087	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(53.337)
	19.10.2020	EUR	1.267	USD	1.507	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(21)
	19.10.2020	EUR	1.256	USD	1.494	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(21)
	19.10.2020	EUR	115	USD	137	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2)
	19.10.2020	EUR	610	USD	723	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(8)
	19.10.2020	USD	5	EUR	5	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2020	USD	100.222	EUR	84.471	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.128
	19.10.2020	USD	39	EUR	33	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2020	USD	39	EUR	33	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2020	USD	18.445	EUR	15.544	Absicherung	JP Morgan Chase New York	210
	19.10.2020	USD	206	EUR	175	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2020	USD	90.842	EUR	77.836	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(467)
	19.10.2020	USD	35	EUR	30	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2020	USD	35	EUR	30	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2020	EUR	4	USD	5	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2020	EUR	80.368	USD	93.498	Absicherung	JP Morgan Chase New York	785
	19.10.2020	EUR	31	USD	36	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2020	EUR	31	USD	36	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2020	EUR	210	USD	244	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2
	19.10.2020	EUR	109	USD	128	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
								<b>USD (51.731)</b>
<b>Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha</b>								
	19.10.2020	EUR	268.755	USD	319.668	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(4.386)
	19.10.2020	EUR	46.951	USD	55.845	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(766)
	19.10.2020	USD	9.287	EUR	7.902	Absicherung	JP Morgan Chase New York	17
	19.10.2020	USD	1.629	EUR	1.386	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3
	19.10.2020	EUR	1.000.000	USD	1.167.862	Absicherung	JP Morgan Chase New York	5.261
	19.10.2020	EUR	34.028	USD	39.766	Absicherung	JP Morgan Chase New York	152
	19.10.2020	EUR	932	USD	1.089	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4
								<b>USD 285</b>

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 9 NICHT REALISIRTER NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeits- datum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio- Basiswährung
<b>Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities</b>								
	19.10.2020	EUR	1.527.152	USD	1.816.462	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(24.925)
	19.10.2020	CHF	916.259	USD	1.011.600	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(13.770)
	19.10.2020	GBP	260.491	USD	335.140	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.656
	19.10.2020	EUR	1.146.103	USD	1.363.226	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(18.706)
	19.10.2020	EUR	7.340.868	USD	8.731.552	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(119.810)
	19.10.2020	GBP	63.566.774	USD	81.783.105	Absicherung	JP Morgan Chase New York	404.221
	19.10.2020	SGD	724.019	USD	531.819	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.431)
	19.10.2020	GBP	313.143	USD	402.880	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.991
	19.10.2020	EUR	175.346	USD	208.564	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2.862)
	19.10.2020	CHF	22.734	USD	25.100	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(342)
	19.10.2020	USD	560	GBP	435	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2)
	19.10.2020	EUR	751	USD	(891)	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(10)
	19.10.2020	USD	21.115	GBP	16.425	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(121)
	19.10.2020	USD	389	GBP	302	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2)
	19.10.2020	CHF	1.518	USD	1.673	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(20)
	19.10.2020	GBP	998	USD	1.297	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(7)
	19.10.2020	EUR	17.250	USD	20.483	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(246)
	19.10.2020	CHF	10.341	USD	11.403	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(141)
	19.10.2020	GBP	2.937	USD	3.810	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(13)
	19.10.2020	EUR	12.893	USD	15.309	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(184)
	19.10.2020	EUR	83.595	USD	99.262	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.194)
	19.10.2020	GBP	721.943	USD	936.725	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(3.305)
	19.10.2020	SGD	8.168	USD	6.024	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(40)
	19.10.2020	GBP	3.553	USD	4.610	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(16)
	19.10.2020	EUR	1.996	USD	2.370	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(29)
	19.10.2020	CHF	258	USD	285	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(4)
	19.10.2020	EUR	4	USD	4	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2020	GBP	1.000	USD	1.295	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2)
	19.10.2020	EUR	490	USD	582	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(7)
	19.10.2020	USD	443	GBP	341	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	19.10.2020	USD	641	GBP	494	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2
	19.10.2020	USD	33.393	EUR	28.414	Absicherung	JP Morgan Chase New York	60
	19.10.2020	USD	18.563	CHF	16.991	Absicherung	JP Morgan Chase New York	59
	19.10.2020	USD	6.170	GBP	4.824	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(67)
	19.10.2020	USD	25.112	EUR	21.367	Absicherung	JP Morgan Chase New York	45
	19.10.2020	USD	159.379	EUR	135.615	Absicherung	JP Morgan Chase New York	287
	19.10.2020	USD	1.495.892	GBP	1.169.602	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(16.319)
	19.10.2020	USD	9.732	SGD	13.277	Absicherung	JP Morgan Chase New York	5
	19.10.2020	USD	7.373	GBP	5.765	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(80)
	19.10.2020	USD	3.808	EUR	3.240	Absicherung	JP Morgan Chase New York	7
	19.10.2020	USD	457	CHF	418	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	19.10.2020	GBP	214	USD	274	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3
	19.10.2020	USD	3.001	EUR	2.554	Absicherung	JP Morgan Chase New York	5
	19.10.2020	USD	1.465.198	GBP	1.144.934	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(15.118)
	19.10.2020	GBP	28	USD	36	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2020	USD	5.034	GBP	3.956	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(81)

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 9 NICHT REALISIERTER NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeits- datum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio- Basiswährung
<b>Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities</b>								
<i>(Fortsetzung)</i>	19.10.2020	EUR	500	USD	586	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	19.10.2020	USD	1.335	GBP	1.049	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(21)
	19.10.2020	USD	69	EUR	59	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2020	EUR	98	USD	114	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	19.10.2020	USD	2.782	EUR	2.389	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(20)
	19.10.2020	SGD	300	USD	218	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2
	19.10.2020	USD	17.809	EUR	15.308	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(149)
	19.10.2020	USD	9.967	CHF	9.256	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(113)
	19.10.2020	USD	3.249	GBP	2.542	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(38)
	19.10.2020	USD	13.399	EUR	11.518	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(112)
	19.10.2020	USD	84.582	EUR	72.705	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(709)
	19.10.2020	USD	5.242	SGD	7.216	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(44)
	19.10.2020	USD	2.021	EUR	1.738	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(17)
	19.10.2020	USD	244	CHF	227	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(3)
	19.10.2020	USD	3.604	EUR	3.100	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(33)
	19.10.2020	CHF	380	USD	409	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4
	19.10.2020	GBP	176	USD	226	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2
	19.10.2020	USD	1.138	GBP	886	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(9)
	19.10.2020	USD	3.384	EUR	2.884	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	19.10.2020	USD	8.535	GBP	6.646	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(59)
	19.10.2020	SGD	200	USD	146	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2020	GBP	425	USD	546	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4
								<b>USD 188.177</b>

\*Siehe Erläuterung 1.

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 10 NICHT REALISIERTER NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS SWAPS

Zum 30. September 2020 hatte Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond die folgenden ausstehenden Credit-Default-Swap-Kontrakte:

Beschreibung	Kontrahent	Zugrunde liegend/Emittent	Kauf/Verkauf	Währung	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Marktwert USD	% des Nettovermögens
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Kauf	EUR	150.000	20.06.2022	(6.128)	(0,00)
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Kauf	EUR	295.000	20.06.2022	(12.051)	(0,00)
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Kauf	EUR	185.000	20.06.2022	(7.558)	(0,00)
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Kauf	EUR	74.000	20.06.2022	(3.023)	(0,00)
CDS	Barclays	ITRAXX Asia XJ IG 32	Kauf	USD	770.000	20.12.2024	(16.255)	(0,00)
CDS	Barclays	Metro AG	Kauf	EUR	75.000	20.06.2021	(424)	(0,00)
CDS	Barclays	PostNL NV	Kauf	EUR	50.000	20.12.2020	(121)	(0,00)
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Kauf	EUR	146.000	20.06.2022	(5.964)	(0,00)
CDS	Citigroup Global Markets	Metro AG	Kauf	EUR	165.000	20.06.2021	(932)	(0,00)
CDS	Citigroup Global Markets	PostNL NV	Kauf	EUR	80.000	20.12.2020	(194)	(0,00)
CDS	Citigroup Global Markets	Barclays plc	Kauf	EUR	2.100.000	20.12.2025	57.404	0,01
CDS	Citigroup Global Markets	Lloyds Banking Group	Kauf	EUR	3.300.000	20.12.2025	73.155	0,02
CDS	Citigroup Global Markets	SSE Plc	Kauf	EUR	1.400.000	20.12.2025	(42.041)	(0,01)
CDS	Goldman Sachs	Banco Commercial Portugues SA	Kauf	EUR	50.000	20.12.2023	(1.603)	(0,00)
CDS	Goldman Sachs	ITRAXX Asia XJ IG 32	Kauf	USD	930.000	20.12.2024	(19.633)	(0,01)
CDS	Goldman Sachs	PostNL NV	Kauf	EUR	58.000	20.12.2020	(141)	(0,00)
CDS	Goldman Sachs	Tesco plc	Kauf	EUR	200.000	20.06.2021	(1.537)	(0,00)
CDS	Goldman Sachs	Standard Chartered Plc	Kauf	EUR	3.100.000	20.12.2025	(59.548)	(0,02)
CDS	JPMorgan	BCP Finance Bank	Kauf	EUR	55.000	20.06.2022	(1.764)	(0,00)
CDS	JPMorgan	BCP Finance Bank	Kauf	EUR	80.000	20.06.2022	(2.565)	(0,00)
CDS	JPMorgan	Banco BPM SPA	Kauf	EUR	580.000	20.12.2023	(20.191)	(0,01)
CDS	JPMorgan	Innogy SE	Kauf	EUR	50.000	20.06.2021	(408)	(0,00)
CDS	JPMorgan	Banco BPM SPA	Kauf	EUR	200.000	20.12.2023	(6.962)	(0,00)
CDS	JPMorgan	Metro AG	Kauf	EUR	100.000	20.06.2021	(565)	(0,00)
CDS	JPMorgan	RWE Finance II	Kauf	EUR	260.000	20.06.2021	(2.119)	(0,00)
CDS	JPMorgan	BCP Finance Bank	Kauf	EUR	55.000	20.06.2022	(1.764)	(0,00)
CDS	JPMorgan	BCP Finance Bank	Kauf	EUR	60.000	20.06.2022	(1.924)	(0,00)
CDS	JPMorgan	Swedbank AB	Kauf	EUR	1.650.000	20.06.2025	(59.397)	(0,02)
CDS	JPMorgan	Airbus SE	Verkauf	EUR	1.300.000	20.06.2025	(26.556)	(0,01)
CDS	JPMorgan	Electricite DE	Kauf	EUR	2.900.000	20.12.2025	(76.652)	(0,02)
CDS	JPMorgan	Deutsche Bank AG	Kauf	EUR	3.300.000	20.12.2025	350.595	0,10
CDS	JPMorgan	Veolia Environnment	Kauf	EUR	1.600.000	20.12.2025	(57.024)	(0,01)
CDS	Citigroup Global Markets	GKN Holdings	Kauf	EUR	175.000	20.12.2025	19.115	0,00
CDS	JPMorgan	Banco Bilbao Vizcaya	Kauf	EUR	1.200.000	20.12.2025	5.325	0,00
CDS	JPMorgan	Fortum OYJ	Kauf	EUR	1.900.000	20.12.2025	(42.548)	(0,01)
CDS	JPMorgan	Telia Company	Kauf	EUR	2.000.000	20.12.2025	(89.124)	(0,02)
CDS	Morgan Stanley	Markit ITRX	Kauf	EUR	750.000	20.06.2021	(5.464)	(0,00)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 33	Kauf	EUR	23.000.000	20.06.2025	(474.090)	(0,12)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 33	Kauf	EUR	24.000.000	20.06.2025	(494.702)	(0,13)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 33	Verkauf	EUR	31.000.000	20.06.2025	638.990	0,16
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 33	Kauf	EUR	23.000.000	20.06.2025	(474.090)	(0,11)

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 10 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS SWAPS

(Fortsetzung)

Beschreibung	Kontrahent	Zugrunde liegend/Emittent	Kauf/Verkauf	Währung	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Marktwert USD	% des Nettovermögens
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 33	Kauf	EUR	17.000.000	20.06.2025	(350.414)	(0,09)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 33	Verkauf	EUR	8.000.000	20.06.2025	164.901	0,04
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 33	Kauf	EUR	10.550.000	20.06.2025	(217.463)	(0,06)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 33	Verkauf	EUR	58.550.000	20.06.2025	1.206.868	0,31
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 34	Kauf	EUR	58.550.000	20.12.2025	(1.463.685)	(0,38)
							<b>USD (1.530.271)</b>	<b>(0,39)</b>

Zum 30. September 2020 hatte Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond die folgenden ausstehenden Credit-Default-Swap-Kontrakte:

Beschreibung	Kontrahent	Zugrunde liegend/Emittent	Kauf/Verkauf	Währung	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Marktwert EUR	% des Nettovermögens
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 33	Kauf	EUR	9.600.000	20.06.2025	(168.747)	(0,12)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 33	Verkauf	EUR	6.000.000	20.06.2025	105.467	0,07
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 33	Kauf	EUR	5.600.000	20.06.2025	(98.436)	(0,07)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 33	Kauf	EUR	3.000.000	20.06.2025	(52.733)	(0,04)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 33	Kauf	EUR	8.500.000	20.06.2025	(149.411)	(0,10)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 33	Kauf	EUR	9.700.000	20.06.2025	(170.504)	(0,12)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 33	Kauf	EUR	5.000.000	20.06.2025	(87.889)	(0,06)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 33	Verkauf	EUR	4.000.000	20.06.2025	70.312	0,05
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 33	Kauf	EUR	14.000.000	20.06.2025	(246.089)	(0,17)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 33	Kauf	EUR	3.500.000	20.06.2025	(61.522)	(0,03)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 33	Kauf	EUR	3.230.000	20.06.2025	(56.776)	(0,04)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 33	Verkauf	EUR	52.130.000	20.06.2025	916.329	0,63
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 33	Verkauf	EUR	1.654.678	20.06.2025	(104.653)	(0,07)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 33	Verkauf	EUR	1.654.678	20.06.2025	104.653	0,07
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 33	Kauf	EUR	1.700.000	20.12.2025	(121.406)	(0,08)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 34	Kauf	EUR	52.130.000	20.12.2025	(1.111.322)	(0,77)
							<b>EUR (1.232.727)</b>	<b>(0,85)</b>

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 10 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS SWAPS

(Fortsetzung)

Zum 30. September 2020 hatte Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond die folgenden ausstehenden Credit-Default-Swap-Kontrakte:

Beschreibung	Kontrahent	Zugrunde liegend/Emittent	Kauf/ Verkauf	Währung	Nennbetrag	Fälligkeits- datum	Marktwert EUR	% des Netto- vermögens
CDS	Goldman Sachs	Cellnex Telecom SA	Verkauf	EUR	300.000	20.06.2022	24.468	0,03
CDS	JPMorgan	ITRAXX Europe Crossover Series 31	Verkauf	EUR	960.000	20.06.2022	23.481	0,03
							<b>EUR 47.949</b>	<b>0,06</b>

Zum 30. September 2020 hatte Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond die folgenden ausstehenden Credit-Default-Swap-Kontrakte:

Beschreibung	Kontrahent	Zugrunde liegend/Emittent	Kauf/ Verkauf	Währung	Nennbetrag	Fälligkeits- datum	Marktwert EUR	% des Netto- vermögens
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Kauf	EUR	120.000	20.06.2022	(4.180)	(0,00)
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Kauf	EUR	245.000	20.06.2022	(8.535)	(0,00)
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Kauf	EUR	150.000	20.06.2022	(5.226)	(0,00)
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Kauf	EUR	61.000	20.06.2022	(2.125)	(0,00)
CDS	Barclays	ITRAXX Asia XJ IG 32	Verkauf	USD	220.000	20.12.2024	3.961	0,00
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Kauf	EUR	124.000	20.06.2022	(4.320)	(0,00)
CDS	Citigroup Global Markets	Rolls Royce plc	Verkauf	EUR	400.000	20.06.2025	(65.495)	(0,04)
CDS	Citigroup Global Markets	Barclays plc	Kauf	EUR	1.700.000	20.06.2025	39.628	0,02
CDS	Citigroup Global Markets	Lloyds Banking Group	Kauf	EUR	1.700.000	20.06.2025	32.137	0,02
CDS	Citigroup Global Markets	SSE plc	Kauf	EUR	1.870.000	20.06.2025	(47.887)	(0,03)
CDS	Goldman Sachs	ITRAXX Asia XJ IG 32	Kauf	USD	1.240.000	20.12.2024	(22.323)	(0,01)
CDS	Goldman Sachs	ITRAXX Asia XJ IG 32	Kauf	USD	1.850.000	20.12.2024	(33.305)	(0,02)
CDS	Goldman Sachs	Standard Chartered plc	Kauf	EUR	1.700.000	20.12.2025	(27.847)	(0,02)
CDS	JPMorgan	BCP Finance	Kauf	EUR	165.000	20.06.2022	(4.512)	(0,00)
CDS	JPMorgan	BCP Finance	Kauf	EUR	235.000	20.06.2022	(6.426)	(0,00)
CDS	JPMorgan	General Motors Company	Kauf	USD	800.000	20.06.2023	(69.425)	(0,04)
CDS	JPMorgan	Banco BPM SPA	Kauf	EUR	325.000	20.12.2023	(9.648)	(0,01)
CDS	JPMorgan	BCP Finance	Kauf	EUR	165.000	20.06.2022	(4.512)	(0,00)
CDS	JPMorgan	BCP Finance	Kauf	EUR	165.000	20.06.2022	(4.512)	(0,00)
CDS	JPMorgan	Swedbank AB	Kauf	EUR	1.330.000	20.06.2025	(40.828)	(0,02)
CDS	JPMorgan	Airbus SE	Verkauf	EUR	900.000	20.06.2025	(15.678)	(0,01)
CDS	JPMorgan	Daimler AG	Kauf	EUR	537.500	20.12.2025	(7.060)	(0,00)
CDS	JPMorgan	Electricite DE	Kauf	EUR	2.300.000	20.12.2025	(51.843)	(0,03)
CDS	JPMorgan	Banco Bilbao Vizcaya	Kauf	EUR	800.000	20.12.2025	3.027	0,00
CDS	JPMorgan	Fortum OYJ	Kauf	EUR	2.200.000	20.12.2025	(42.012)	(0,02)
CDS	JPMorgan	Deutsche Bank AG	Kauf	EUR	1.980.000	20.12.2025	179.386	0,10
CDS	JPMorgan	Telia Company	Kauf	EUR	1.400.000	20.12.2025	(53.201)	(0,03)
CDS	JPMorgan	Veolia Environment	Kauf	EUR	1.250.000	20.12.2025	(37.991)	(0,02)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX FINSUB Series 33	Kauf	EUR	5.100.000	20.06.2025	89.103	0,05
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX FINSUB Series 33	Verkauf	EUR	5.100.000	20.06.2025	(89.103)	(0,05)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Series 33	Kauf	EUR	3.500.000	20.06.2025	(61.522)	(0,03)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Series 33	Kauf	EUR	11.000.000	20.06.2025	(193.356)	(0,11)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Series 33	Kauf	EUR	5.000.000	20.06.2025	(87.889)	(0,05)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Series 33	Kauf	EUR	15.000.000	20.06.2025	(263.667)	(0,15)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Series 33	Kauf	EUR	8.020.000	20.06.2025	(140.974)	(0,08)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Series 33	Verkauf	EUR	42.520.000	20.06.2025	747.407	0,41
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Series 33	Kauf	EUR	2.433.350	20.06.2025	(153.901)	(0,08)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Series 33	Kauf	EUR	3.309.356	20.06.2025	(209.305)	(0,12)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Series 33	Kauf	EUR	1.654.678	20.06.2025	(104.653)	(0,06)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Series 33	Verkauf	EUR	7.397.384	20.06.2025	467.859	0,26

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 10 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS SWAPS

(Fortsetzung)

Beschreibung	Kontrahent	Zugrunde liegend/Emittent	Kauf/ Verkauf	Währung	Nennbetrag	Fälligkeits- datum	Marktwert EUR	% des Netto- vermögens
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Series 34	Kauf	EUR	42.520.000	20.06.2025	(906.454)	(0,50)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Series 34	Kauf	EUR	7.600.000	20.12.2025	(542.755)	(0,30)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Series 34	Kauf	EUR	3.400.000	20.12.2025	(242.811)	(0,14)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX FINSUB Series 34	Kauf	EUR	5.100.000	20.12.2025	138.448	0,08
							<b>EUR (1.864.325)</b>	<b>(1,03)</b>

Zum 30. September 2020 hatte Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return die folgenden ausstehenden Credit-Default-Swap-Kontrakte:

Beschreibung	Kontrahent	Zugrunde liegend/Emittent	Kauf/ Verkauf	Währung	Nennbetrag	Fälligkeits- datum	Marktwert USD	% des Netto- vermögens
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 32	Verkauf	USD	2.500.000	20.06.2025	17.079	0,03
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 32	Verkauf	USD	1.100.000	20.06.2025	7.515	0,01
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 32	Verkauf	USD	290.000	20.06.2025	1.981	0,00
CDS	JPMorgan	ITRAXX Europe Crossover Series 32	Kauf	USD	3.890.000	20.06.2025	(26.575)	(0,05)
CDS	JPMorgan	ITRAXX Europe Crossover Series 32	Verkauf	USD	3.890.000	20.12.2025	81.413	0,14
CDS	Barclays	ITRAXX Europe Crossover Series 32	Verkauf	EUR	3.280.156	20.12.2024	243.276	0,43
CDS	JPMorgan	ITRAXX Europe Crossover Series 32	Verkauf	EUR	223.868	20.06.2025	16.603	0,03
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 32	Kauf	EUR	3.504.024	20.06.2025	(259.880)	(0,45)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 32	Verkauf	EUR	3.600.000	20.12.2025	301.482	0,53
							<b>USD 382.894</b>	<b>0,67</b>

Zum 30. September 2020 hatte Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income die folgenden ausstehenden Credit-Default-Swap-Kontrakte:

Beschreibung	Kontrahent	Zugrunde liegend/Emittent	Kauf/ Verkauf	Währung	Nennbetrag	Fälligkeits- datum	Marktwert USD	% des Netto- vermögens
CDS	JPMorgan	Barclays plc	Kauf	EUR	80.000	20.12.2025	2.187	0,00
CDS	JPMorgan	Fortum OYJ	Kauf	EUR	90.000	20.12.2025	(2.015)	(0,00)
CDS	JPMorgan	Deutsche Bank AG	Kauf	EUR	110.000	20.12.2025	11.686	0,01
CDS	JPMorgan	Telia Company	Kauf	EUR	90.000	20.12.2025	(4.010)	(0,00)
CDS	JPMorgan	Veolia Environment	Kauf	EUR	70.000	20.12.2025	(2.495)	(0,00)
CDS	Barclays	Banco BPL SPA	Kauf	EUR	100.000	20.12.2023	(17.417)	(0,01)
CDS	JPMorgan	Standard Chartered plc	Kauf	EUR	130.000	20.12.2025	(2.497)	(0,00)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 33	Kauf	EUR	1.200.000	20.06.2025	(24.735)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 33	Kauf	EUR	1.000.000	20.06.2025	(20.613)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 33	Kauf	EUR	450.000	20.06.2025	(9.276)	(0,00)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 33	Verkauf	EUR	400.000	20.06.2025	8.245	0,00
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 33	Verkauf	EUR	2.250.000	20.06.2025	46.378	0,02
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 34	Kauf	EUR	2.250.000	20.12.2025	(56.247)	(0,04)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 34	Verkauf	EUR	870.000	20.12.2025	21.749	0,01

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 10 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS SWAPS

(Fortsetzung)

Beschreibung	Kontrahent	Zugrunde liegend/Emittent	Kauf/ Verkauf	Währung	Nennbetrag	Fälligkeits- datum	Marktwert USD	% des Netto- vermögens
CDS	Morgan Stanley	NA IG 35	Verkauf	USD	1.000.000	20.12.2025	20.929	0,01
CDS	Citigroup Global Markets	SSE plc	Kauf	EUR	70.000	20.12.2025	(2.102)	(0,00)
							<b>USD (30.233)</b>	<b>(0,02)</b>

Zum 30. September 2020 hatte Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha die folgenden ausstehenden Total-Return-Swap-Kontrakte:

Beschreibung	Kontrahent	Zugrunde liegend/ Emittent	Zahlung/Erhalt	Währung	Nennbetrag	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio- Basiswährung	% des Netto- vermögens
TRS	Bank of America Merrill Lynch	Nordamerika- Aktienkorb	Zahlung von US- 1M-LIBOR +0,30 % und Erhalt der Wertentwicklung des zugrunde liegenden Korbes von 5 Aktien. Zahlung der Wertentwicklung des zugrunde liegenden Korbes von 34 Aktien und Erhalt des US-1M-LIBOR.	USD	52.528.766	22.03.2021	(854.730)	(0,97)
							<b>USD (854.730)</b>	<b>(0,97)</b>

Zum 30. September 2020 hatte Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities die folgenden ausstehenden Credit-Default-Swap-Kontrakte:

Beschreibung	Kontrahent	Zugrunde liegend/ Emittent	Kauf/Verkauf	Währung	Nennbetrag	Fälligkeits- datum	Marktwert EUR	% des Netto- vermögens
CDS	Bank of America Merrill Lynch	Lloyds Banking Group	Kauf	EUR	12.220.000	20.12.2025	(201.350)	(0,02)
CDS	Bank of America Merrill Lynch	ING Groep NV	Kauf	EUR	18.300.000	20.12.2025	263.903	0,02
CDS	Bank of America Merrill Lynch	Barclays plc	Kauf	EUR	9.830.000	20.12.2025	(110.288)	(0,01)
CDS	Bank of America Merrill Lynch	BNP Paribas	Kauf	EUR	11.880.000	20.12.2025	176.808	0,01
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Kauf	EUR	400.000	20.06.2022	(13.935)	(0,00)
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Kauf	EUR	100.000	20.06.2022	(3.484)	(0,00)
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Kauf	EUR	1.000.000	20.06.2022	(34.837)	(0,00)
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Kauf	EUR	2.855.000	20.06.2022	(99.461)	(0,01)
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Kauf	EUR	5.810.000	20.06.2022	(202.405)	(0,02)
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Kauf	EUR	3.645.000	20.06.2022	(126.982)	(0,01)
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Kauf	EUR	1.477.000	20.06.2022	(51.455)	(0,00)
CDS	Barclays	Metro AG	Kauf	EUR	3.850.000	20.06.2021	(18.546)	(0,00)
CDS	Barclays	PostNL NV	Kauf	EUR	3.370.000	20.12.2020	(6.980)	(0,00)
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Kauf	EUR	2.853.000	20.06.2022	(99.391)	(0,01)
CDS	Barclays	ITRAXX Asia XJ IG 32	Kauf	USD	9.665.000	20.12.2024	(173.996)	(0,01)
CDS	Citigroup Global Markets	PostNL NV	Kauf	EUR	300.000	20.12.2020	(621)	(0,00)
CDS	Citigroup Global Markets	PostNL NV	Kauf	EUR	100.000	20.12.2020	(207)	(0,00)
CDS	Citigroup Global Markets	PostNL NV	Kauf	EUR	700.000	20.12.2020	(1.450)	(0,00)
CDS	Citigroup Global Markets	Metro AG	Kauf	EUR	10.680.000	20.06.2021	(51.447)	(0,00)



## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 10 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS SWAPS

(Fortsetzung)

Beschreibung	Kontrahent	Zugrunde liegend/ Emittent	Kauf/Verkauf	Währung	Nennbetrag	Fälligkeits- datum	Marktwert EUR	% des Netto- vermögens
CDS	Citigroup Global Markets	PostNL NV	Kauf	EUR	5.150.000	20.12.2020	(10.666)	(0,00)
CDS	Citigroup Global Markets	Commerzbank AG	Kauf	EUR	3.780.000	20.12.2025	256.049	0,02
CDS	Citigroup Global Markets	Barclays plc	Kauf	EUR	10.590.000	20.12.2025	246.859	0,02
CDS	Citigroup Global Markets	HSBC Holdings	Kauf	EUR	16.460.000	20.12.2025	307.664	0,03
CDS	Citigroup Global Markets	HSBC Holdings	Kauf	EUR	4.115.000	20.12.2025	(67.146)	(0,01)
CDS	Citigroup Global Markets	Lloyds Banking Group	Kauf	EUR	24.700.000	20.12.2025	466.936	0,04
CDS	Citigroup Global Markets	GKN Holdings	Kauf	EUR	1.700.000	20.12.2025	158.349	0,01
CDS	Citigroup Global Markets	Sanofi SA	Kauf	EUR	8.400.000	20.12.2025	(359.457)	(0,03)
CDS	Credit Suisse	Rexel SA	Kauf	EUR	7.000.000	20.12.2024	(1.095.359)	(0,09)
CDS	Credit Suisse	Schaeffler Ag	Kauf	EUR	10.000.000	20.12.2025	(1.704.144)	(0,14)
CDS	Credit Suisse	Monitchem Holdco 3 S.A.	Kauf	EUR	10.000.000	20.12.2025	(647.890)	(0,05)
CDS	Goldman Sachs	Vattenfall AB	Kauf	EUR	200.000	20.06.2021	(1.320)	(0,00)
CDS	Goldman Sachs	Vattenfall AB	Kauf	EUR	400.000	20.06.2021	(2.641)	(0,00)
CDS	Goldman Sachs	Vattenfall AB	Kauf	EUR	7.800.000	20.06.2021	(51.494)	(0,00)
CDS	Goldman Sachs	PostNL NV	Kauf	EUR	3.595.000	20.12.2020	(7.446)	(0,00)
CDS	Goldman Sachs	Arcelormittal	Kauf	EUR	7.500.000	20.12.2023	(811.429)	(0,07)
CDS	Goldman Sachs	ITRAXX Asia XJ IG 32	Kauf	USD	2.120.000	20.12.2024	(38.166)	(0,00)
CDS	Goldman Sachs	Cooperatieve Rabobank	Kauf	EUR	14.200.000	20.12.2025	52.537	0,00
CDS	Goldman Sachs	Standard Chartered	Kauf	EUR	13.500.000	20.12.2025	(221.141)	(0,02)
CDS	Goldman Sachs	Natwest Group	Kauf	EUR	6.820.000	20.12.2025	209.205	0,02
CDS	Goldman Sachs	BHP Billiton	Kauf	USD	5.900.000	20.12.2025	(142.908)	(0,01)
CDS	JPMorgan	General Motors Company	Kauf	USD	600.000	20.12.2022	(43.915)	(0,00)
CDS	JPMorgan	Banco Commercial Portugues SA	Kauf	EUR	500.000	20.06.2022	(13.672)	(0,00)
CDS	JPMorgan	Banco Commercial Portugues SA	Kauf	EUR	900.000	20.06.2022	(24.610)	(0,00)
CDS	JPMorgan	General Motors Company	Kauf	USD	1.200.000	20.12.2022	(87.829)	(0,01)
CDS	JPMorgan	BCP Finance	Kauf	EUR	3.765.000	20.06.2022	(102.952)	(0,01)
CDS	JPMorgan	BCP Finance	Kauf	EUR	5.185.000	20.06.2022	(141.781)	(0,01)
CDS	JPMorgan	Metro AG	Kauf	EUR	7.650.000	20.06.2021	(36.851)	(0,00)
CDS	JPMorgan	BCP Finance	Kauf	EUR	3.765.000	20.06.2022	(102.952)	(0,01)
CDS	JPMorgan	BCP Finance	Kauf	EUR	3.765.000	20.06.2022	(102.952)	(0,01)
CDS	JPMorgan	General Motors Company	Kauf	USD	21.150.000	20.12.2022	(1.547.989)	(0,13)
CDS	JPMorgan	Swedbank AB	Kauf	EUR	18.560.000	20.06.2025	(569.757)	(0,05)
CDS	JPMorgan	BP plc	Verkauf	EUR	3.160.000	20.06.2025	19.214	0,00
CDS	JPMorgan	Airbus SE	Verkauf	EUR	3.950.000	20.06.2025	(68.810)	(0,01)
CDS	JPMorgan	TDS A/s	Kauf	EUR	17.000.000	20.12.2025	726.997	0,06
CDS	JPMorgan	EDP Finance	Kauf	EUR	9.300.000	20.12.2025	(194.544)	(0,02)
CDS	JPMorgan	Bayerische Motoren	Kauf	EUR	10.860.000	20.12.2025	(225.345)	(0,02)
CDS	JPMorgan	Electricite DE	Kauf	EUR	24.250.000	20.12.2025	(546.600)	(0,05)
CDS	JPMorgan	Daimler AG	Kauf	EUR	19.355.000	20.12.2025	(254.237)	(0,02)

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 10 NICHT REALISIERTER NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS SWAPS

(Fortsetzung)

Beschreibung	Kontrahent	Zugrunde liegend/ Emittent	Kauf/Verkauf	Währung	Nennbetrag	Fälligkeits- datum	Marktwert EUR	% des Netto- vermögens
CDS	JPMorgan	Banco Bilbao Vizcaya	Kauf	EUR	9.700.000	20.12.2025	36.704	0,00
CDS	JPMorgan	Tesco plc	Kauf	EUR	10.000.000	20.12.2025	(118.032)	(0,01)
CDS	JPMorgan	Henkel AG & Co.	Kauf	EUR	17.700.000	20.12.2025	(752.745)	(0,06)
CDS	JPMorgan	Altria Group Inc	Kauf	USD	19.000.000	20.12.2025	(458.194)	(0,04)
CDS	JPMorgan	Westpac banking Corp.	Kauf	USD	23.030.000	20.12.2025	(688.253)	(0,06)
CDS	JPMorgan	Deutsche Bank AG	Kauf	EUR	12.850.000	20.12.2025	1.164.195	0,10
CDS	JPMorgan	Telia Co AB	Kauf	EUR	16.400.000	20.12.2025	(623.215)	(0,05)
CDS	JPMorgan	Veolia Environment	Kauf	EUR	17.000.000	20.12.2025	(516.678)	(0,04)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe SNR FIN	Kauf	EUR	52.000.000	20.06.2021	(323.049)	(0,03)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX FINSR 25	Kauf	EUR	2.900.000	20.06.2021	(18.016)	(0,00)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX FINSR 25	Kauf	EUR	500.000	20.06.2021	(3.106)	(0,00)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX FINSR 25	Kauf	EUR	900.000	20.06.2021	(5.591)	(0,00)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 33	Kauf	EUR	9.400.000	20.06.2025	(165.231)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 33	Kauf	EUR	16.450.000	20.06.2025	(289.154)	(0,02)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 33	Kauf	EUR	300.000.000	20.06.2025	(5.273.333)	(0,45)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 33	Verkauf	EUR	40.000.000	20.06.2025	703.111	0,06
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 33	Verkauf	EUR	40.000.000	20.06.2025	703.111	0,06
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 33	Verkauf	EUR	80.000.000	20.06.2025	1.406.222	0,12
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 33	Verkauf	EUR	25.000.000	20.06.2025	439.444	0,04
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 33	Verkauf	EUR	140.850.000	20.06.2025	2.475.830	0,21
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX FINUB 33	Kauf	EUR	29.520.000	20.12.2024	515.751	0,04
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX FINUB 33	Verkauf	EUR	29.520.000	20.06.2025	(515.751)	(0,04)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX FINSR 33	Kauf	EUR	27.000.000	20.12.2024	(432.475)	(0,04)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX FINSR 33	Verkauf	EUR	27.000.000	20.06.2025	432.475	0,04
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 33	Kauf	EUR	66.673.790	20.06.2025	(4.216.890)	(0,36)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 33	Verkauf	EUR	66.673.790	20.06.2025	4.216.889	0,36
CDS	Morgan Stanley	NA IG 34	Kauf	USD	64.000.000	20.06.2025	(372.857)	(0,03)
CDS	Morgan Stanley	NA IG 34	Kauf	USD	172.500.000	20.06.2025	(1.004.965)	(0,09)
CDS	Morgan Stanley	NA IG 34	Kauf	USD	141.000.000	20.06.2025	(821.450)	(0,07)
CDS	Morgan Stanley	NA IG 34	Verkauf	USD	40.000.000	20.06.2025	233.035	0,02
CDS	Morgan Stanley	NA IG 34	Verkauf	USD	18.850.000	20.06.2025	109.817	0,01
CDS	Morgan Stanley	NA IG 34	Verkauf	USD	50.000.000	20.06.2025	291.294	0,02
CDS	Morgan Stanley	NA IG 34	Verkauf	USD	268.650.000	20.06.2025	1.565.121	0,13
CDS	Morgan Stanley	NA IG 35	Kauf	USD	268.650.000	20.12.2025	(4.794.681)	(0,41)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 34	Kauf	EUR	68.500.000	20.12.2025	(4.891.937)	(0,41)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX FINSR 34	Kauf	EUR	27.000.000	20.12.2025	(306.638)	(0,03)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX FINUB 34	Kauf	EUR	29.520.000	20.12.2025	801.368	0,07
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 34	Kauf	EUR	140.850.000	20.12.2025	(3.002.679)	(0,26)
							<b>EUR (22.038.870)</b>	<b>(1,86)</b>

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 10 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS SWAPS

(Fortsetzung)

Zum 30. September 2020 hatte Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities die folgenden ausstehenden Credit-Default-Swap-Kontrakte:

Beschreibung	Kontrahent	Zugrunde liegend/ Emittent	Kauf/Verkauf	Währung	Nennbetrag	Fälligkeits- datum	Marktwert EUR	% des Netto- vermögens
CDS	Barclays	Tesco plc	Kauf	EUR	100.000	20.12.2023	(1.877)	(0,00)
CDS	Barclays	ITRAXX Asia XJ IG 32	Verkauf	USD	150.000	20.12.2024	(1.053)	(0,00)
CDS	Citigroup Global Markets	Tesco plc	Kauf	EUR	60.000	20.06.2023	(1.404)	(0,00)
CDS	Citigroup Global Markets	Tesco plc	Kauf	EUR	80.000	20.06.2023	14.902	0,03
CDS	Citigroup Global Markets	Commerzbank AG	Kauf	EUR	220.000	20.12.2025	(24.584)	(0,05)
CDS	Citigroup Global Markets	SSE Plc	Kauf	EUR	960.000	20.12.2025	(5.826)	(0,01)
CDS	Citigroup Global Markets	ITRAXX Asia XJ IG 32	Kauf	USD	700.000	20.12.2024	4.440	0,01
CDS	Citigroup Global Markets	ITRAXX Asia XJ IG 32	Kauf	USD	1.100.000	20.12.2024	(21.295)	(0,04)
CDS	Citigroup Global Markets	Banco BPM SPA	Kauf	EUR	270.000	20.12.2024	17.792	0,04
CDS	Citigroup Global Markets	Coöperatieve Rabobank U.A.	Kauf	EUR	1.200.000	20.12.2025	(8.096)	(0,02)
CDS	Citigroup Global Markets	Standard Chartered	Kauf	EUR	1.300.000	20.12.2025	(1.053)	(0,00)
CDS	Citigroup Global Markets	Natwest Group	Kauf	EUR	580.000	20.12.2025	(929)	(0,00)
CDS	Citigroup Global Markets	Vodafone Group	Kauf	EUR	540.000	20.12.2025	(929)	(0,00)
CDS	JPMorgan	Tesco plc	Kauf	EUR	60.000	20.06.2023	(559)	(0,00)
CDS	JPMorgan	Banco Commercial Portugues SA	Kauf	EUR	30.000	20.06.2023	(929)	(0,00)
CDS	JPMorgan	Banco BPM SPA	Kauf	EUR	30.000	20.06.2023	(929)	(0,00)
CDS	JPMorgan	Pearson plc	Kauf	EUR	40.000	20.06.2023	(2.034)	(0,00)
CDS	JPMorgan	Banco Commercial Portugues SA	Kauf	EUR	30.000	20.06.2023	(4.304)	(0,01)
CDS	JPMorgan	Banca Popolare Di Milano	Kauf	EUR	30.000	20.06.2023	(4.881)	(0,01)
CDS	JPMorgan	United Utilities Group	Kauf	EUR	80.000	20.12.2023	(7.421)	(0,01)
CDS	JPMorgan	Banco BPM SPA	Kauf	EUR	145.000	20.12.2023	(14.153)	(0,03)
CDS	JPMorgan	Tesco plc	Kauf	EUR	260.000	20.12.2023	2.460	0,00
CDS	JPMorgan	Banco BPM SPA	Kauf	EUR	250.000	20.12.2023	61.607	0,12
CDS	JPMorgan	Daimler AG	Kauf	EUR	1.077.500	20.12.2025	(34.201)	(0,07)
CDS	JPMorgan	Banco bilbao Vizcaya Argentaria	Kauf	EUR	650.000	20.12.2025	11.643	0,02
CDS	JPMorgan	Deutsche Bank AG	Kauf	EUR	680.000	20.12.2025	17.570	0,03
CDS	JPMorgan	Telia Co AB	Kauf	EUR	900.000	20.12.2025	25.408	0,05
CDS	Citigroup Global Markets	GKN Holdings	Kauf	EUR	125.000	20.12.2025	49.151	0,10
CDS	Citigroup Global Markets	General Motors	Kauf	USD	1.150.000	20.12.2025	(11.993)	(0,02)
CDS	Citigroup Global Markets	HSBC Holdings	Kauf	EUR	940.000	20.12.2025	(68.468)	(0,14)
CDS	Citigroup Global Markets	Barclays plc	Kauf	EUR	1.090.000	20.12.2025	(26.093)	(0,05)
CDS	Citigroup Global Markets	Lloyds Banking Group	Kauf	EUR	2.600.000	20.12.2025	1.703	0,00

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 10 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS SWAPS

(Fortsetzung)

Beschreibung	Kontrahent	Zugrunde liegend/ Emittent	Kauf/Verkauf	Währung	Nennbetrag	Fälligkeits- datum	Marktwert EUR	% des Netto- vermögens
CDS	Citigroup Global Markets	HSBC Holdings	Kauf	EUR	735.000	20.12.2025	(6.097)	(0,01)
CDS	Citigroup Global Markets	Sanofi SA	Kauf	EUR	1.600.000	20.12.2025	(6.276)	(0,01)
CDS	JPMorgan	Swedbank AB	Kauf	EUR	850.000	20.06.2025	(12.450)	(0,02)
CDS	JPMorgan	BP plc	Verkauf	EUR	280.000	20.06.2025	(27.048)	(0,05)
CDS	JPMorgan	Airbus SE	Verkauf	EUR	350.000	20.06.2025	(20.678)	(0,04)
CDS	JPMorgan	EDP Finance	Kauf	EUR	300.000	20.12.2025	(16.232)	(0,03)
CDS	JPMorgan	Bayerische Motoren Werke AG	Kauf	EUR	600.000	20.12.2025	(55.286)	(0,11)
CDS	JPMorgan	Electricite DE	Kauf	EUR	1.200.000	20.12.2025	(25.226)	(0,05)
CDS	JPMorgan	Naturgy Energy Group SA	Kauf	EUR	800.000	20.12.2025	(204.254)	(0,40)
CDS	JPMorgan	Fortium OYJ	Kauf	EUR	850.000	20.12.2025	70.311	0,14
CDS	JPMorgan	Henkel AG & Co	Kauf	EUR	1.300.000	20.12.2025	(61.522)	(0,12)
CDS	JPMorgan	Altria Group	Kauf	USD	1.000.000	20.12.2025	(7.031)	(0,01)
CDS	JPMorgan	Westpac Banking Corp	Kauf	USD	1.700.000	20.12.2025	(12.304)	(0,02)
CDS	JPMorgan	Veolia Environment	Kauf	EUR	830.000	20.12.2025	(114.256)	(0,23)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 33	Kauf	EUR	11.620.000	20.06.2025	87.889	0,17
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 33	Verkauf	EUR	4.000.000	20.06.2025	8.789	0,02
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 33	Kauf	EUR	3.500.000	20.06.2025	35.156	0,07
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 33	Kauf	EUR	400.000	20.06.2025	197.223	0,39
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 33	Kauf	EUR	700.000	20.06.2025	78.271	0,14
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 33	Kauf	EUR	6.500.000	20.06.2025	(78.271)	(0,15)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 33	Verkauf	EUR	5.000.000	20.06.2025	(132.970)	(0,26)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 33	Verkauf	EUR	500.000	20.06.2025	18.468	0,04
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 33	Verkauf	EUR	2.000.000	20.06.2025	114.502	0,23
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 33	Verkauf	EUR	11.220.000	20.06.2025	(132.832)	(0,26)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX FINUB 33	Kauf	EUR	4.480.000	20.06.2025	121.617	0,23
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX FINUB 33	Verkauf	EUR	4.480.000	20.06.2025	(239.191)	(0,47)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 33	Kauf	EUR	2.102.414	20.06.2025	(42.637)	(0,09)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 33	Verkauf	EUR	292.002	20.06.2025	(15.324)	(0,03)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 33	Verkauf	EUR	1.810.412	20.06.2025	(8.415)	(0,02)
CDS	Morgan Stanley	NA IG 34	Kauf	USD	7.500.000	20.06.2025	6.251	0,01
CDS	Morgan Stanley	NA IG 34	Kauf	USD	9.000.000	20.06.2025	24.516	0,04
CDS	Morgan Stanley	NA IG 34	Verkauf	USD	5.000.000	20.06.2025	2.700	0,01
CDS	Morgan Stanley	NA IG 34	Verkauf	USD	1.150.000	20.06.2025	(12.602)	(0,02)
CDS	Morgan Stanley	NA IG 34	Verkauf	USD	10.350.000	20.06.2025	(19.803)	(0,04)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 34	Kauf	EUR	1.860.000	20.12.2025	(165.845)	(0,33)

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 10 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS SWAPS

(Fortsetzung)

Beschreibung	Kontrahent	Zugrunde liegend/ Emittent	Kauf/Verkauf	Währung	Nennbetrag	Fälligkeits- datum	Marktwert EUR	% des Netto- vermögens
CDS	Morgan Stanley	NA IG 35	Kauf	USD	10.350.000	20.12.2025	(24.116)	(0,05)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX FINUB 34	Kauf	EUR	4.480.000	20.12.2025	(50.805)	(0,10)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 34	Kauf	EUR	11.220.000	20.12.2025	(43.693)	(0,10)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 34	Kauf	EUR	2.000.000	20.12.2025	(52.433)	(0,10)
CDS	Merrill Lynch	Lloyds Banking Group	Kauf	EUR	930.000	20.12.2025	29.129	0,06
CDS	Merrill Lynch	Barclays plc	Kauf	EUR	750.000	20.12.2025	6.700	0,01
CDS	Merrill Lynch	BNP Paribus	Kauf	EUR	420.000	20.12.2025	60.298	0,12
CDS	Merrill Lynch	ING Groep NV	Kauf	EUR	1.700.000	20.12.2025	(184.720)	(0,37)
							<b>EUR (946.832)</b>	<b>(1,87)</b>

Zum 30. September 2020 hatte Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha die folgenden ausstehenden Total-Return-Swap-Kontrakte:

Beschreibung	Kontrahent	Zugrunde liegend/ Emittent	Zahlung/Erhalt	Währung	Nennbetrag	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio- Basiswährung	% des Netto- vermögens
TRS	Goldman Sachs	Aktienkorb	Zahlung der Wertentwicklung des zugrunde liegenden Korbes von 3 Aktien und Erhalt des 1M-TOIS -0,35 %.	CHF	1.218.297	vom 08.02.2029 bis 28.09.2029	(70.156)	(0,04)
TRS	Goldman Sachs	Aktienkorb	Zahlung der Wertentwicklung der zugrunde liegenden Aktie und Erhalt des 1M-CIBOR -0,35 %.	DKK	2.735.198	06.11.2029	(2.219)	(0,00)
TRS	Goldman Sachs	Aktienkorb	Zahlung der Wertentwicklung des zugrunde liegenden Korbes von 10 Aktien und Erhalt des 1M-EONIA -0,35 %.	EUR	15.062.583	vom 05.05.2027 bis 02.10.2030	(93.385)	(0,05)
TRS	Goldman Sachs	Aktienkorb	Zahlung der Wertentwicklung des zugrunde liegenden Korbes von 3 Aktien und Erhalt des 1M-SONIA -0,35 %.	GBP	4.496.894	vom 18.05.2029 bis 24.09.2029	125.467	0,07
TRS	UBS	Aktienkorb	Zahlung der Wertentwicklung des zugrunde liegenden Korbes von 6 Aktien und Erhalt des 1M-TOIS.	CHF	7.307.602	24.01.2022	47.505	0,03
TRS	UBS	Aktienkorb	Zahlung der Wertentwicklung des zugrunde liegenden Korbes von 2 Aktien und Erhalt des 1M-CIBOR.	DKK	29.644.714	24.01.2022	(124.596)	(0,07)
TRS	UBS	Aktienkorb	Zahlung der Wertentwicklung des zugrunde liegenden Korbes von 15 Aktien und Erhalt des 1M-EONIA.	EUR	33.056.333	24.01.2022	(242.826)	(0,13)
TRS	UBS	Aktienkorb	Zahlung der Wertentwicklung des zugrunde liegenden Korbes von 2 Aktien und Erhalt des 1M-SONIA.	GBP	1.679.202	24.01.2022	(37.590)	(0,02)

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 10 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS SWAPS

(Fortsetzung)

Beschreibung	Kontrahent	Zugrunde liegend/ Emittent	Zahlung/Erhalt	Währung	Nennbetrag	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio- Basiswährung	% des Netto- vermögens
TRS	UBS	Aktienkorb	Zahlung der Wertentwicklung des zugrunde liegenden Korbes von 3 Aktien und Erhalt des 1M-NIBOR.	NOK	79.800.962	24.01.2022	(30.650)	(0,02)
TRS	UBS	Aktienkorb	Zahlung der Wertentwicklung des zugrunde liegenden Korbes von 10 Aktien und Erhalt des 1M-STIBOR.	SEK	199.140.651	24.01.2022	(83.041)	(0,05)
							<b>EUR (511.491)</b>	<b>(0,28)</b>

Zum 30. September 2020 hatte Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha die folgenden ausstehenden Total-Return-Swap-Kontrakte:

Beschreibung	Kontrahent	Zugrunde liegend/ Emittent	Zahlung/Erhalt	Währung	Nennbetrag	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio- Basiswährung	% des Netto- vermögens
TRS	Bank of America Merrill Lynch	Nordamerika- Aktienkorb	Zahlung von US-1M-LIBOR +0,30 % und Erhalt der Wertentwicklung des zugrunde liegenden Korbes von 18 Aktien. Zahlung der Wertentwicklung des zugrunde liegenden Korbes von 34 Aktien und Erhalt des US-1M-LIBOR.	USD	50.161.547	21.02.2021	501.141	0,46
							<b>USD 501.141</b>	<b>0,46</b>

Zum 30. September 2020 hatte Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha die folgenden ausstehenden Total-Return-Swap-Kontrakte:

Beschreibung	Kontrahent	Zugrunde liegend/ Emittent	Zahlung/Erhalt	Währung	Nennbetrag	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio- Basiswährung	% des Netto- vermögens
TRS	UBS	Aktienkorb	Zahlung der Wertentwicklung der zugrunde liegenden Aktie und Erhalt des AUD-1M-LIBOR.	AUD	2.512.497	24.01.2022	100.507	0,05
TRS	UBS	Aktienkorb	Zahlung von 1M-CIBOR +0,30 % und Erhalt der Wertentwicklung der zugrunde liegenden Aktie.	DKK	2.574.664	24.01.2022	25.044	0,01
TRS	UBS	Aktienkorb	Zahlung von 1M-EURIBOR +0,35 % und Erhalt der Wertentwicklung der zugrunde liegenden Aktie. Zahlung der Wertentwicklung des zugrunde liegenden Korbes von 3 Aktien und Erhalt des 1M-EONIA.	EUR	5.627.507	24.01.2022	378.671	0,20

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 10 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS SWAPS

(Fortsetzung)

Beschreibung	Kontrahent	Zugrunde liegend/ Emittent	Zahlung/Erhalt	Währung	Nennbetrag	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio- Basiswährung	% des Netto- vermögens
TRS	UBS	Aktienkorb	Zahlung von GBP-1M-LIBOR +0,35 % und Erhalt der Wertentwicklung des zugrunde liegenden Korbes von 2 Aktien. Zahlung der Wertentwicklung des zugrunde liegenden Korbes von 3 Aktien und Erhalt des GBP-1M-LIBOR.	GBP	8.066.892	24.01.2022	(49.323)	(0,03)
TRS	UBS	Aktienkorb	Zahlung von HIBOR +0,40 % und Erhalt der Wertentwicklung des zugrunde liegenden Korbes von 2 Aktien.	HKD	17.831.257	24.01.2022	(70.578)	(0,04)
TRS	UBS	Aktienkorb	Zahlung von JPY-1M-LIBOR +0,40 % und Erhalt der Wertentwicklung der zugrunde liegenden Aktie.	JPY	199.074.150	24.01.2022	22.720	0,01
TRS	UBS	Aktienkorb	Zahlung von US-1M-LIBOR +0,35 % und Erhalt der Wertentwicklung des zugrunde liegenden Korbes von 20 Aktien. Zahlung der Wertentwicklung des zugrunde liegenden Korbes von 17 Aktien und Erhalt des US-1M-LIBOR.	USD	86.166.137	24.01.2022	298.176	0,16
							<b>USD 705.217</b>	<b>0,36</b>

Zum 30. September 2020 hatte Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities die folgenden ausstehenden Total-Return-Swap-Kontrakte:

Beschreibung	Kontrahent	Zugrunde liegend/ Emittent	Zahlung/Erhalt	Währung	Nennbetrag	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio- Basiswährung	% des Netto- vermögens
TRS	Citigroup Global Markets	Nordamerika-Rohstoffkorb	Zahlung von 0,14 % und Erhalt der Wertentwicklung des BCOMF3 Index.	USD	32.474.031	30.09.2020	(316.979)	(0,09)
TRS	Credit Suisse	Nordamerika-Rohstoffkorb	Zahlung von 0,25 % und Erhalt der Wertentwicklung des BCOMF3 Index.	USD	36.924.090	30.09.2020	(360.416)	(0,10)
TRS	Goldman Sachs	Nordamerika-Rohstoffkorb	Zahlung von 0,11 % und Erhalt der Wertentwicklung des BCOMF3 Index.	USD	106.213.256	30.09.2020	(1.036.746)	(0,29)
TRS	JPMorgan	Nordamerika-Rohstoffkorb	Zahlung von 0 % bis 0,27 % und Erhalt der Wertentwicklung des zugrunde liegenden Korbes von 29 Indizes. Zahlung der Wertentwicklung des zugrunde liegenden Korbes von 27 Indizes.	USD	1.035.808.949	30.09.2020	911.100	0,26

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 10 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS SWAPS

(Fortsetzung)

Beschreibung	Kontrahent	Zugrunde liegend/ Emittent	Zahlung/Erhalt	Währung	Nennbetrag	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio- Basiswährung	% des Netto- vermögens
TRS	Macquarie	Nordamerika- Rohstoffkorb	Zahlung von 0 % bis 0,17 % und Erhalt der Wertentwicklung des zugrunde liegenden Korbes von 3 Indizes. Zahlung der Wertentwicklung des zugrunde liegenden Index.	USD	445.499.663	30.09.2020	(1.803.689)	(0,51)
							<b>USD (2.606.730)</b>	<b>(0,73)</b>

### 11 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS TERMINKONTRAKTEN

Zum 30. September 2020 ist der Kontrahent von ausstehenden Terminkontrakten UBS.

Zum 30. September 2020 hatte Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond die folgenden ausstehenden Terminkontrakte:

Beschreibung	Status	Anzahl der Kontrakte	Währung	Fiktive Verpflichtungen in der Portfolio- Basiswährung	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio- Basiswährung	% des Netto- vermögens	
Bundesrepublik Deutschland Future	Verkäufe	(178)	EUR	(36.427.856)	08.12.2020	(179.522)	(0,04)	
Bundesrepublik Deutschland Future	Verkäufe	(354)	EUR	(56.111.514)	08.12.2020	(67.181)	(0,01)	
Euro-OAT Future	Verkäufe	(15)	EUR	(2.964.752)	08.12.2020	(23.570)	(0,01)	
Bundesrepublik Deutschland Future	Käufe	7	EUR	1.827.880	08.12.2020	41.699	0,01	
10-Year Australian Treasury Bond Future	Käufe	4	AUD	428.309	15.12.2020	5.038	0,00	
Government of Canada Bond Future	Käufe	37	CAD	4.205.105	18.12.2020	(3.047)	(0,00)	
US Treasury Bond Future	Käufe	13	USD	2.078.984	21.12.2020	2.563	0,00	
10-Year US Treasury Note Future	Käufe	55	USD	7.674.219	21.12.2020	14.164	0,00	
US Long Bond	Käufe	14	USD	2.467.938	21.12.2020	(656)	(0,00)	
3-Year Treasury Note Future	Verkäufe	(18)	USD	(3.992.625)	21.12.2020	10.266	0,00	
UK Treasury Future	Verkäufe	(78)	GBP	(13.725.115)	29.12.2020	(60.503)	(0,02)	
US Treasury Bond Future	Käufe	59	USD	13.036.695	31.12.2020	7.375	0,00	
5-Year US Treasury Note Future	Käufe	122	USD	15.375.813	31.12.2020	32.406	0,01	
							<b>USD (220.968)</b>	<b>(0,06)</b>



## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 11 NICHT REALISIERTER NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS TERMINKONTRAKTEN

(Fortsetzung)

Zum 30. September 2020 hatte Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond die folgenden ausstehenden Terminkontrakte:

Beschreibung	Status	Anzahl der Kontrakte	Währung	Fiktive Verpflichtungen in der Portfolio-Basiswährung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter (Verlust) in der Portfolio-Basiswährung	% des Nettovermögens
Bundesrepublik Deutschland Future	Verkäufe	(47)	EUR	(6.352.990)	08.12.2020	(5.230)	(0,00)
2 Year Federal Treasury Note Future	Verkäufe	(8)	EUR	(898.320)	08.12.2020	(240)	(0,00)
Bundesrepublik Deutschland Future	Verkäufe	(2)	EUR	(445.360)	08.12.2020	(10.160)	(0,01)
Bundesrepublik Deutschland Future	Verkäufe	(85)	EUR	(14.834.201)	08.12.2020	(74.730)	(0,06)
US Long Bond	Verkäufe	(5)	USD	(751.636)	21.12.2020	(666)	(0,00)
10-Year US Treasury Note Future	Verkäufe	(5)	USD	(594.940)	21.12.2020	(2.465)	(0,00)
US Treasury Bond Futures	Verkäufe	(8)	USD	(1.091.012)	21.12.2020	(5.010)	(0,00)
UK Treasury Future	Verkäufe	(9)	GBP	(1.350.502)	29.12.2020	(4.906)	(0,00)
5-Year US Treasury Note Future	Verkäufe	(19)	USD	(2.042.036)	31.12.2020	(3.724)	(0,00)
						<b>EUR (107.131)</b>	<b>(0,07)</b>

Zum 30. September 2020 hatte Threadneedle (Lux) - European Social Bond die folgenden ausstehenden Terminkontrakte:

Beschreibung	Status	Anzahl der Kontrakte	Währung	Fiktive Verpflichtungen in der Portfolio-Basiswährung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter (Verlust) in der Portfolio-Basiswährung	% des Nettovermögens
Bundesrepublik Deutschland Future	Verkäufe	(122)	EUR	(16.490.740)	08.12.2020	(19.040)	(0,01)
Bundesrepublik Deutschland Future	Verkäufe	(35)	EUR	(6.108.200)	08.12.2020	(19.730)	(0,01)
Buoni Poliennali Del Future	Verkäufe	(2)	EUR	(226.540)	08.12.2020	(660)	(0,00)
10-Year US Treasury Note Future	Verkäufe	(8)	USD	(951.904)	21.12.2020	(2.965)	(0,00)
UK Treasury Future	Verkäufe	(45)	GBP	(6.752.512)	29.12.2020	(21.134)	(0,01)
5-Year US Treasury Note Future	Verkäufe	(2)	USD	(214.951)	31.12.2020	(333)	(0,00)
						<b>EUR (63.862)</b>	<b>(0,03)</b>

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 11 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS TERMINKONTRAKTEN

(Fortsetzung)

Zum 30. September 2020 hatte Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond die folgenden ausstehenden Terminkontrakte:

Beschreibung	Status	Anzahl der Kontrakte	Währung	Fiktive Verpflichtungen in der Portfolio-Basiswährung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung	% des Nettovermögens
Bundesrepublik Deutschland Future	Verkäufe	(14)	EUR	(3.117.520)	08.12.2020	(86.800)	(0,04)
Bundesrepublik Deutschland Future	Verkäufe	(181)	EUR	(31.588.120)	08.12.2020	(211.199)	(0,11)
Bundesschatzanweisungen Future	Verkäufe	(14)	EUR	(1.572.060)	08.12.2020	(770)	(0,00)
Bundesrepublik Deutschland Future	Verkäufe	(256)	EUR	(34.603.520)	08.12.2020	(63.970)	(0,04)
Euro-OAT Future	Käufe	16	EUR	2.696.800	08.12.2020	28.160	0,02
10-Year JGB Future	Käufe	2	JPY	2.458.349	14.12.2020	6.626	0,00
10-Year US Treasury Note Future	Verkäufe	(32)	USD	(3.807.615)	21.12.2020	(12.792)	(0,01)
US Long Bond	Verkäufe	(15)	USD	(2.254.909)	21.12.2020	2.798	0,00
3-Year Treasury Note Future	Käufe	4	USD	756.620	21.12.2020	(2.985)	(0,00)
US Treasury Bond Future	Käufe	1	USD	136.376	21.12.2020	187	0,00
UK Treasury Future	Verkäufe	(113)	GBP	(16.956.309)	29.12.2020	(46.094)	(0,03)
5-Year US Treasury Note Future	Käufe	26	USD	2.794.365	31.12.2020	5.370	0,00
						<b>EUR (381.469)</b>	<b>(0,21)</b>

Zum 30. September 2020 hatte Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds die folgenden ausstehenden Terminkontrakte:

Beschreibung	Status	Anzahl der Kontrakte	Währung	Fiktive Verpflichtungen in der Portfolio-Basiswährung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung	% des Nettovermögens
10-Year US Treasury Note Future	Verkäufe	(72)	USD	(10.046.250)	21.12.2020	(33.187)	(0,04)
5-Year US Treasury Note Future	Käufe	131	USD	16.510.094	31.12.2020	26.609	0,03
						<b>USD (6.578)</b>	<b>(0,01)</b>

Zum 30. September 2020 hatte Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return die folgenden ausstehenden Terminkontrakte:

Beschreibung	Status	Anzahl der Kontrakte	Währung	Fiktive Verpflichtungen in der Portfolio-Basiswährung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung	% des Nettovermögens
SGX MSCI Taiwan Index Future	Käufe	12	USD	504.498	29.10.2020	12.005	0,05
KOSPI 200 Index	Käufe	20	KRW	1.130.043	10.12.2020	(20.981)	(0,09)
S&P 500 Future	Käufe	1	USD	142.924	18.12.2020	(861)	(0,00)
						<b>EUR (9.837)</b>	<b>(0,04)</b>

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 11 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS TERMINKONTRAKTEN

(Fortsetzung)

Zum 30. September 2020 hatte Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return die folgenden ausstehenden Terminkontrakte:

Beschreibung	Status	Anzahl der Kontrakte	Währung	Fiktive Verpflichtungen in der Portfolio-Basiswährung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung	% des Nettovermögens
SGX MSCI Taiwan Index Future	Käufe	12	USD	591.600	29.10.2020	14.078	0,02
KOSPI 200 Index	Käufe	21	KRW	1.391.402	10.12.2020	(25.833)	(0,05)
TOPIX Index	Käufe	16	JPY	2.464.513	10.12.2020	47.001	0,08
S&P 500 Future	Verkäufe	(94)	USD	(15.754.400)	18.12.2020	94.940	0,18
						<b>USD 130.186</b>	<b>0,23</b>

Zum 30. September 2020 hatte Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income die folgenden ausstehenden Terminkontrakte:

Beschreibung	Status	Anzahl der Kontrakte	Währung	Fiktive Verpflichtungen in der Portfolio-Basiswährung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung	% des Nettovermögens
Bundesrepublik Deutschland Future	Verkäufe	(22)	EUR	(3.487.156)	08.12.2020	(3.811)	(0,00)
Bundesrepublik Deutschland Future	Verkäufe	(8)	EUR	(1.637.207)	08.12.2020	(5.628)	(0,00)
Government of Canada Bond Future	Käufe	1	CAD	113.651	18.12.2020	(82)	(0,00)
3-Year Treasury Note Future	Verkäufe	(3)	USD	(665.438)	21.12.2020	1.172	0,00
US Treasury Bond Future	Käufe	2	USD	319.844	21.12.2020	1.484	0,00
10-Year US Treasury Note Future	Verkäufe	(4)	USD	(558.125)	21.12.2020	(2.313)	(0,00)
UK Treasury Future	Verkäufe	(3)	GBP	(527.889)	29.12.2020	(2.327)	(0,00)
US Treasury Bond Future	Käufe	2	USD	441.922	31.12.2020	250	0,00
5-Year US Treasury Note Future	Käufe	10	USD	1.260.313	31.12.2020	2.625	0,00
						<b>USD (8.630)</b>	<b>(0,00)</b>

Zum 30. September 2020 hatte Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha die folgenden ausstehenden Terminkontrakte:

Beschreibung	Status	Anzahl der Kontrakte	Währung	Fiktive Verpflichtungen in der Portfolio-Basiswährung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Gewinn in der Portfolio-Basiswährung	% des Nettovermögens
S&P 500 Future	Verkäufe	(201)	USD	(33.687.599)	18.12.2020	155.650	0,18
						<b>USD 155.650</b>	<b>0,18</b>

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 11 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS TERMINKONTRAKTEN

(Fortsetzung)

Zum 30. September 2020 hatte Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities die folgenden ausstehenden Terminkontrakte:

Beschreibung	Status	Anzahl der Kontrakte	Währung	Fiktive Verpflichtungen in der Portfolio-Basiswährung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung	% des Nettovermögens
Bundesrepublik Deutschland Future	Verkäufe	(684)	EUR	(119.371.680)	08.12.2020	(628.949)	(0,05)
Bundesrepublik Deutschland Future	Verkäufe	(66)	EUR	(14.696.880)	08.12.2020	(335.280)	(0,03)
Bundesrepublik Deutschland Future	Verkäufe	(1.664)	EUR	(224.922.879)	08.12.2020	(275.050)	(0,02)
Euro-OAT Future	Verkäufe	(149)	EUR	(25.113.950)	08.12.2020	(199.660)	(0,02)
US Long Bond	Verkäufe	(139)	USD	(20.895.488)	21.12.2020	(18.521)	(0,00)
10-Year US Treasury Note Future	Verkäufe	(508)	USD	(60.445.892)	21.12.2020	(250.448)	(0,02)
3-Year Treasury Note Future	Verkäufe	(12)	USD	(2.269.859)	21.12.2020	3.997	0,00
US Treasury Bond Future	Verkäufe	(332)	USD	(45.276.990)	21.12.2020	(207.916)	(0,02)
UK Treasury Future	Verkäufe	(916)	GBP	(137.451.141)	29.12.2020	(606.662)	(0,05)
						<b>EUR (2.518.489)</b>	<b>(0,21)</b>

Zum 30. September 2020 hatte Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities Fund die folgenden ausstehenden Terminkontrakte:

Beschreibung	Status	Anzahl der Kontrakte	Währung	Fiktive Verpflichtungen in der Portfolio-Basiswährung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter (Verlust) in der Portfolio-Basiswährung	% des Nettovermögens
Euro-OAT Future	Verkäufe	(18)	EUR	(3.033.900)	08.12.2020	(24.120)	(0,05)
Bundesrepublik Deutschland Future	Verkäufe	(4)	EUR	(890.720)	08.12.2020	(20.320)	(0,04)
2 Year Federal Treasury Note Future	Verkäufe	(2)	EUR	(224.580)	08.12.2020	(60)	(0,00)
Bundesrepublik Deutschland Future	Verkäufe	(50)	EUR	(6.758.500)	08.12.2020	(8.250)	(0,02)
Bundesrepublik Deutschland Future	Verkäufe	(48)	EUR	(8.376.960)	08.12.2020	(43.321)	(0,09)
10-Year US Treasury Note Future	Verkäufe	(18)	USD	(2.141.784)	21.12.2020	(7.155)	(0,01)
US Long Bond	Verkäufe	(13)	USD	(1.954.254)	21.12.2020	(1.732)	(0,00)
US Treasury Bond Future	Verkäufe	(29)	USD	(3.954.918)	21.12.2020	(18.161)	(0,04)
UK Treasury Future	Verkäufe	(45)	GBP	(6.752.512)	29.12.2020	(22.600)	(0,04)
5-Year US Treasury Note Future	Verkäufe	(4)	USD	(429.902)	31.12.2020	(713)	(0,00)
						<b>EUR (146.432)</b>	<b>(0,29)</b>

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 12 OPTIONEN ZUM MARKTWERT

Zum 30. September 2020 hatte Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income die folgenden ausstehenden Optionen:

Beschreibung	Kontrahent	Ausübungspreis	Währung	Kontrakte	Fälligkeitsdatum	Engagement in der Portfolio-Basiswährung	Marktwert in der Portfolio-Basiswährung	% des Nettovermögens
<b>Optionen auf Futures</b>								
Call S&P 500 Index	UBS	3.480,000	USD	(100)	16.10.2020	34.800.000*	(138.000)	(0,07)
Call Euro Stoxx 50	UBS	3.425,000	EUR	(214)	16.10.2020	8.594.942*	(7.277)	(0,01)
Call FTSE 100 Index	UBS	6.250,000	GBP	(48)	16.10.2020	3.878.399*	(3.413)	(0,00)
							<b>USD (148.690)</b>	<b>(0,08)</b>

\*Das Engagement in Short-Call-Positionen ist unbegrenzt.

### 13 POOLING

Die SICAV kann die Gesamtheit oder einen Teil des Vermögens zweier oder mehrerer Portfolios („teilnehmende Portfolios“) in Form eines Pools anlegen und verwalten. Ein solcher Vermögenspool wird durch Übertragung von Barmitteln oder anderen Vermögenswerten der jeweiligen teilnehmenden Portfolios gebildet (wobei diese Vermögenswerte im Hinblick auf die Anlagepolitik des betreffenden Pools geeignet sein müssen).

Der Anteil eines teilnehmenden Portfolios an einem Vermögenspool wird anhand von rechnerischen Anteilen (Units) gleichen Werts an dem Vermögenspool bestimmt.

Zum 30. September 2020 verfügte die SICAV über kein Pooling von Vermögenswerten, jedoch ist das Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return Portfolio zu Anlageverwaltungszwecken nach Anlageklassen in mehrere Körbe aufgeteilt, die ausschließlich von ihm selbst gehalten werden.

### 14 ÄNDERUNGEN BEI DEN PORTFOLIOAUFGESTELLUNGEN

Änderungen bei den Portfolioaufstellungen werden den Anteilinhabern auf Anfrage am eingetragenen Firmensitz der SICAV kostenlos zur Verfügung gestellt.

### 15 VERWÄSSERUNGSANPASSUNG

Die Portfolios können aufgrund von Handelsspreads, Transaktionskosten und Steueraufwendungen von einer Verringerung des Nettoinventarwerts je Anteil betroffen sein. Dieser entsteht, wenn der Unterberater Käufe und Verkäufe von zugrunde liegenden Anlagen vornimmt, um Mittelzu- und Abflüsse zu ermöglichen – dies ist als „Verwässerung“ bekannt. Eine Verwässerungsanpassung kann vorgenommen werden, um die Anteilinhaber des Portfolios zu schützen, indem den Auswirkungen einer Verwässerung entgegengewirkt wird (die „Verwässerungsanpassung“). Wenn die Nettokapitalaktivitäten (einschließlich Zeichnungen, Rückgaben und Umtausch in ein bestimmtes Portfolio) an einem bestimmten Bewertungstag die von der Verwaltungsgesellschaft gegebenenfalls für dieses Portfolio festgelegte Schwelle übersteigen, kann der Nettoinventarwert des Portfolios nach oben oder nach unten angepasst werden, um den Nettozuflüssen bzw. den Nettoabflüssen Rechnung zu tragen.

Der Nettoinventarwert je Anteil jeder Anteilklasse im Portfolio wird separat berechnet, aber jede Verwässerungsanpassung wirkt sich identisch auf den Nettoinventarwert je Anteil jeder Anteilklasse des Portfolios aus. Die Höhe der Verwässerungsanpassung wird von der Verwaltungsgesellschaft festgelegt, um die geschätzten Handelsspreads, Transaktionskosten und Steueraufwendungen, die möglicherweise für das Portfolio anfallen, zu berücksichtigen. Diese Kosten können je nach Marktbedingungen und Portfoliozusammensetzung schwanken. Die Verwässerungsanpassung kann daher gegebenenfalls geändert werden. Diese Verwässerungsanpassung kann je nach Portfolio und den täglichen Nettozuflüssen und -abflüssen variieren und ist auf maximal 2 % des ursprünglichen Nettoinventarwertes je Anteil beschränkt (mit Ausnahme des Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity Portfolios, bei dem die Verwässerungsanpassung nicht mehr als 5 % des ursprünglichen Nettoinventarwertes je Anteil betragen wird). Die Angemessenheit der Verwässerungsanpassungen wird regelmäßig überprüft. Im normalen Geschäftsverlauf wird die Anwendung der Verwässerungsanpassung durchgehend mechanisch ausgelöst. Die Verwaltungsgesellschaft behält sich jedoch das Recht vor, in ihrem eigenen Ermessen eine Verwässerungsanpassung vorzunehmen, wenn sie der Ansicht ist, dass dies im besten Interesse der bestehenden Anteilinhaber ist, einschließlich im Falle außergewöhnlicher Umstände. Zu diesen außergewöhnlichen Umständen gehören unter anderem Zeiten erhöhter Marktvolatilität und Zeiten gedrückter Marktliquidität.

Die Verwässerungsanpassung kann auf sämtliche Portfolios mit Ausnahme des Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities Portfolios angewendet werden.

Schätzungen zur Höhe der Verwässerungsanpassung auf der Grundlage der in jedem Portfolio gehaltenen Wertpapiere sowie der Marktbedingungen zum Datum des Verkaufsprospekts (September 2020) und die Anzahl der Gelegenheiten, bei denen eine Verwässerungsanpassung vorgenommen wird, werden auf der Website [www.columbiathreadneedle.com](http://www.columbiathreadneedle.com) veröffentlicht.

Zum 30. September 2020 war die folgende Verwässerungsanpassung vorgenommen worden:

Portfolio	NIW vor Verwässerung	Verwässerungsanpassung	NIW nach Verwässerung
Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	429.772.403	(214.886)	429.557.517

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 16 TRANSAKTIONSKOSTEN

Für den Berichtszeitraum entstanden der SICAV wie folgt Transaktionskosten bezüglich des Kaufs oder Verkaufs von übertragbaren Wertpapieren oder Geldmarktinstrumenten:

Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond <sup>1</sup>	USD	n. z.
Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond <sup>1</sup>	EUR	n. z.
Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	EUR	9.407
Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond <sup>1</sup>	EUR	n. z.
Threadneedle (Lux) - European Social Bond <sup>1</sup>	EUR	n. z.
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond <sup>1</sup>	EUR	n. z.
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds <sup>1</sup>	USD	n. z.
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt <sup>1</sup>	USD	n. z.
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds <sup>1</sup>	USD	n. z.
Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond <sup>1</sup>	USD	n. z.
Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	USD	76.325
Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return <sup>1</sup>	EUR	n. z.
Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	USD	7.772
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	USD	126.084
Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities <sup>2</sup>	USD	3.903
Threadneedle (Lux) - Global Focus	USD	320.586
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	USD	47.695
Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	USD	222.998
Threadneedle (Lux) - Global Select	USD	99.906
Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	EUR	535.168
Threadneedle (Lux) - American	USD	101.890
Threadneedle (Lux) - American Select	USD	17.351
Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	USD	131.740
Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	USD	170.161
Threadneedle (Lux) - Asia Equities	USD	109.058
Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	USD	109.875
Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	USD	4.653
Threadneedle (Lux) - Pan European Equities	EUR	113.302
Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	EUR	47.077
Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	EUR	245.233
Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	EUR	472.702
Threadneedle (Lux) - European Select	EUR	617.455
Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	EUR	209.200
Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	USD	40.856
Threadneedle (Lux) - Global Technology	USD	102.045
Threadneedle (Lux) - UK Equities	GBP	77.237
Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	GBP	2.828
Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity	USD	7.920
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	USD	8.417
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities <sup>1</sup>	EUR	n. z.
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities <sup>1</sup>	EUR	n. z.
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	EUR	727.720
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	USD	6.465
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	USD	40.165
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	USD	209
Threadneedle (Lux) - Gatehouse Shariah Global Equity	USD	4.262

Die Transaktionskosten sind in den Gesamtkosten der Anlage gemäß der Portfolioaufstellung enthalten. Der Betrag der während des Berichtszeitraums von der SICAV getragenen Transaktionskosten ist in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und Entwicklung des Nettovermögens unter der Überschrift „Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Wertpapierverkäufen“ und „Änderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus Anlagen“ enthalten.

<sup>1</sup> Bei festverzinslichen Wertpapieren sind die Transaktionskosten nicht vom Kaufpreis des Wertpapiers getrennt ermittelbar und können daher nicht getrennt ausgewiesen werden.

<sup>2</sup> Siehe Erläuterung 1.

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 17 INFORMATIONEN ZU SICHERHEITEN

In der nachstehenden Tabelle sind die aktivischen und passivischen Barsicherheitsalden gegenüber Maklern zum 30. September 2020 dargestellt:

Portfolios	Kontrahent	Anlageart	Währung	Barsicherheiten
<b>Forderungen gegenüber Maklern - Geleistete Sicherheiten</b>				
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	Goldman Sachs	Termingeschäfte und Swaps	USD	40.000
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	JPM Securities	Swaps	USD	140.000
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	JPM Chase	Termingeschäfte und Swaps	USD	1.180.000
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	Barclays	Termingeschäfte und Swaps	USD	240.000
Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	JPM Chase	Termingeschäfte	EUR	10.000
Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	Barclays	Termingeschäfte	EUR	810.000
Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond	Barclays	Termingeschäfte	EUR	150.000
Threadneedle (Lux) - European Social Bond	Citigroup Global Markets	Termingeschäfte	EUR	340.000
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	Citigroup Global Markets	Termingeschäfte und Swaps	EUR	10.000
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	JPM Securities	Swaps	EUR	130.000
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	Barclays	Termingeschäfte und Swaps	EUR	580.000
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	JPM Chase	Termingeschäfte	USD	420.000
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	JPM Chase	Termingeschäfte	USD	400.000
Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	JPM Chase	Termingeschäfte	USD	1.510.000
Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	JPM Chase	Termingeschäfte	USD	250.000
Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	JPM Chase	Termingeschäfte und Swaps	USD	210.000
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	JPM Securities	Swaps	USD	10.000
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	Lloyds	Termingeschäfte	USD	10.000
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	JPM Chase	Termingeschäfte und Swaps	USD	1.690.000
Threadneedle (Lux) - Global Focus	JPM Chase	Termingeschäfte	USD	2.120.000
Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	JPM Chase	Termingeschäfte	EUR	20.000
Threadneedle (Lux) - American	JPM Chase	Termingeschäfte	USD	1.650.000
Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	JPM Chase	Termingeschäfte	USD	1.410.000
Threadneedle (Lux) - Pan European Equities	JPM Chase	Termingeschäfte	EUR	20.000
Threadneedle (Lux) - Global Technology	JPM Chase	Termingeschäfte	USD	1.010.000
Threadneedle (Lux) - UK Equities	JPM Chase	Termingeschäfte	GBP	80.000
Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	JPM Chase	Termingeschäfte	GBP	70.000
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	JPM Chase	Termingeschäfte	USD	200.000
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	Bank of America Merrill Lynch	Swaps	USD	1.040.000
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	Lloyds	Termingeschäfte	EUR	210.000
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	Goldman Sachs	Swaps	EUR	1.050.000
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	Barclays	Termingeschäfte und Swaps	EUR	1.770.000
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	Credit Suisse	Swaps	EUR	3.440.000
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	JPM Securities	Swaps	EUR	5.260.000
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	Citigroup Global Markets	Swaps	EUR	110.000
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	Barclays	Termingeschäfte und Swaps	EUR	120.000
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	JPM Securities	Swaps	EUR	270.000
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	Goldman Sachs	Swaps	EUR	570.000
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	JPM Chase	Termingeschäfte und Swaps	USD	560.000
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	Goldman Sachs	Swaps	USD	2.010.000
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	Macquarie	Swaps	USD	2.430.000
<b>Verbindlichkeiten gegenüber Makler - Erhaltene Sicherheiten</b>				
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	Citigroup Global Markets	Swaps	USD	180.000
Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond	JPM Chase	Termingeschäfte und Swaps	EUR	820.000
Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond	JPM Securities	Swaps	EUR	20.000
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	Lloyds	Termingeschäfte	EUR	260.000
Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	UBS	Termingeschäfte	USD	130.000
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	HSBC	Termingeschäfte	USD	440.000
Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	JPM Chase	Termingeschäfte	EUR	110.000
Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	JPM Chase	Termingeschäfte	EUR	290.000
Threadneedle (Lux) - European Select	JPM Chase	Termingeschäfte	EUR	300.000
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	Citigroup Global Markets	Termingeschäfte und Swaps	EUR	610.000

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 17 INFORMATIONEN ZU SICHERHEITEN

(Fortsetzung)

Portfolios	Kontrahent	Anlageart	Währung	Barsicherheiten
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	JPM Chase	Termingeschäfte und Swaps	EUR	400.000
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	Bank of America Merrill Lynch	Swaps	EUR	160.000
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	JPM Chase	Termingeschäfte und Swaps	EUR	520.000
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	UBS	Swaps	EUR	2.470.000
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	JPM Chase	Termingeschäfte	EUR	720.000
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	Bank of America Merrill Lynch	Swaps	USD	100.000
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	UBS	Swaps	USD	3.000

In der nachstehenden Tabelle sind die aktivischen und passivischen Wertpapiere als Sicherheiten von Maklern zum 30. September 2020 dargestellt:

Portfolio	Kontrahent	Anlageart	Art der Sicherheit	Emittent der Sicherheit	Währung	Betrag der Sicherheit
<b>Forderungen gegenüber Maklern - Geleistete Sicherheiten</b>						
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	Credit Suisse	Swaps	Anleihe	US-Regierung	USD	662.000
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	Citigroup Global Markets	Swaps	Anleihe	US-Regierung	USD	580.000

### 18 ÜBERKREUZBETEILIGUNGEN IN PORTFOLIOS

Zum 30. September 2020 investierte das Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return Portfolio in Anteile folgender Portfolios:

Portfolio	Währung	Marktwert	% des Nettovermögens
Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	EUR	55.911	0,04
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	EUR	539.327	0,18
Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	EUR	2.861.130	1,97
Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	EUR	1.554.028	0,30
Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond	EUR	2.399.944	3,15
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	EUR	670.887	0,76
Threadneedle (Lux) - Global Focus	EUR	3.166.164	0,27
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	EUR	3.060.636	6,05
Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	EUR	960.824	0,07

Zum 30. September 2020 investierte das Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return Portfolio in Anteile folgender Portfolios:

Portfolio	Währung	Marktwert	% des Nettovermögens
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	USD	60.238	0,02
Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond	USD	1.567.264	1,76
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	USD	1.154.372	1,12
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	USD	2.019.128	3,41

Zum 30. September 2020 investierte das Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income Portfolio in Anteile folgender Portfolios:

Portfolio	Währung	Marktwert	% des Nettovermögens
Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	USD	7.767.747	15,97
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	USD	5.632.335	5,45

Die Auswirkungen der Transaktionen im Rahmen von Überkreuzbeteiligungen wurden aus der kombinierten Aufstellung des Nettovermögens und der Aufstellung der Entwicklung des Nettovermögens entfernt.

Bitte lesen Sie auch Erläuterung 2 xi) zu Rückerstattungen der Vermögensverwaltungsgebühr.



## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 19 TERMINEINLAGEN

Die folgende Tabelle zeigt die von der SICAV zum 30. September 2020 gehaltenen Termineinlagen:

Portfolios	Kontrahent	Währung	Betrag der Termineinlagen (in der Basiswährung des Portfolios)
Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond	Mitsubishi UFJ Securities	EUR	1.599.675
	Sumitomo Bank Ltd London	EUR	1.599.744
	<b>Summe</b>	<b>EUR</b>	<b>3.199.419</b>
Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	BNP Paribas Paris	USD	1.500.000
	<b>Summe</b>	<b>USD</b>	<b>1.500.000</b>
Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	Sumitomo Bank Ltd London	EUR	998.538
	BNP Paribas Paris	EUR	799.907
	<b>Summe</b>	<b>EUR</b>	<b>1.798.445</b>
Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	Lloyds TSB Financial Market	USD	1.500.000
	Rabobank Nederland Utrecht	USD	1.800.057
	Mitsubishi UFJ Securities	USD	1.800.078
	Lloyds TSB Financial Market	USD	300.000
	<b>Summe</b>	<b>USD</b>	<b>5.400.135</b>
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	Sumitomo Bank Ltd London	EUR	14.997.863
	<b>Summe</b>	<b>EUR</b>	<b>14.997.863</b>
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	Mitsubishi UFJ Securities	USD	4.402.524
	<b>Summe</b>	<b>USD</b>	<b>4.402.524</b>

### 20 ANDERE VERMÖGENSWERTE

Da einige Märkte am Ende des Berichtszeitraums geschlossen waren, wurde auf der Grundlage des bestehenden Preisfestsetzungsverfahrens auf der Fondsebene eine Fair-Value-Anpassung vorgenommen, um Market Timing zu vermeiden.

### 21 GESAMTKOSTENQUOTE (TER)

Die Gesamtkostenquote wird gemäß der Richtlinie der Swiss Funds & Asset Management Association (SFAMA) ermittelt.

Die verwendete Formel lautet wie folgt:

Die TER erfasst sämtliche den Anteilsklassen fortlaufend belasteten Provisionen und Kosten (Betriebskosten) rückwirkend als prozentualen Anteil des Nettovermögens der Anteilsklassen und wird anhand der folgenden Formel berechnet:

$$\text{TER \%} = \frac{\text{Gesamtbetriebskosten}}{\text{Durchschnittliches Nettovermögen}} \times 100$$

Wenn ein Fonds mehr als 10 % in andere Organismen für gemeinsame Anlagen (Zielfonds) investiert, umfasst die Berechnung den Anteil des Fonds an den Aufwendungen der Zielfonds abzüglich erhaltener Gebührennachlässe.

Die Gesamtkostenquote für den Berichtszeitraum zum 30. September 2020 beträgt:

Portfolio	Klasse	TER/TER <sup>1</sup>	Kommentare
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	AEC	0,85 %	
	AEH	0,85 %	
	AKH	0,85 %	
	ANH	0,91 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	AU	0,85 %	
	AUP	0,85 %	
	DEC	1,60 %	
	DEH	1,60 %	
	DU	1,60 %	
	DUP	1,60 %	
	IEC	0,65 %	
	IEH	0,65 %	

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 21 GESAMTKOSTENQUOTE (TER)

(Fortsetzung)

Portfolio	Klasse	TER/TER <sup>1</sup>	Kommentare
<b>Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond</b> (Fortsetzung)	IEP	0,76 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	IGC	0,65 %	
	IGH	0,65 %	
	IKH	0,65 %	
	INH	0,58 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	IU	0,65 %	
	IUP	0,65 %	
	NEC	0,45 %	
	NEH	0,45 %	
	NGC	0,45 %	
	NGH	0,45 %	
	NU	0,45 %	
	NUP	0,45 %	
	XGH	0,15 %	
	ZEH	0,60 %	
	ZGH	0,60 %	
	ZU	0,60 %	
<b>Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond</b>	AE	1,20 %	
	ANH	1,20 %	
	IE	0,60 %	
	INH	0,60 %	
	ZE	0,70 %	
	1E	1,19 %	
	1G	1,19 %	
	2E	0,58 %	
	2G	0,58 %	
	3G	0,69 %	
	4E	0,08 %	
	4G	0,08 %	
	8E	0,62 %	
8G	0,62 %		
9G	0,65 %		
<b>Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond</b>	AE	1,64 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens und der erst kürzlich erfolgten Auflegung der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	AKH	1,55 %	
	ANH	1,55 %	
	IE	0,85 %	
	IEP	0,85 %	
	IKH	0,97 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	INH	0,90 %	
	XE	0,15 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	ZE	0,90 %	
	ZEP	0,90 %	
	1E	1,38 %	
	1EP	1,38 %	
	1G	1,38 %	
1GP	1,38 %		
1UT	1,38 %		
2E	0,82 %		

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 21 GESAMTKOSTENQUOTE (TER)

(Fortsetzung)

Portfolio	Klasse	TER/TER <sup>1</sup>	Kommentare
Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond (Fortsetzung)	2EP	0,82 %	
	2FH	0,82 %	
	2G	0,82 %	
	2GP	0,74 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	3E	0,77 %	
	3EP	0,77 %	
	3FC	0,77 %	
	3FH	0,77 %	
	3G	0,77 %	
	3GP	0,77 %	
	4E	0,07 %	
	4G	0,07 %	
	8E	0,86 %	
	8EP	0,86 %	
	8FH	0,86 %	
	8G	0,86 %	
	8GP	0,86 %	
	9E	0,73 %	
	9EP	0,73 %	
9FC	0,73 %		
9FH	0,73 %		
9G	0,67 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.	
9GP	0,68 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.	
Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond	AE	0,90 %	
	AEP	0,90 %	
	AKH	0,83 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	ANH	0,82 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	IE	0,50 %	
	IEP	0,43 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	IGC	0,50 %	
	IGH	0,41 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	IKH	0,45 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	INH	0,43 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	XE	0,10 %	
	XGC	0,10 %	
	XGH	0,10 %	
ZE	0,55 %		
Threadneedle (Lux) - European Social Bond	AE	0,42 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens und der erst kürzlich erfolgten Auflegung der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	AEP	0,42 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens und der erst kürzlich erfolgten Auflegung der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 21 GESAMTKOSTENQUOTE (TER)

(Fortsetzung)

Portfolio	Klasse	TER/TER <sup>1</sup>	Kommentare
<b>Threadneedle (Lux) - European Social Bond</b> (Fortsetzung)	ID	0,48 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund der am 1. September 2020 für diese Anteilklasse vorgenommene Gebührenermäßigung von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	IE	0,49 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund der am 1. September 2020 für diese Anteilklasse vorgenommene Gebührenermäßigung von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	IEP	0,49 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund der am 1. September 2020 für diese Anteilklasse vorgenommene Gebührenermäßigung von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	IFH	0,49 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund der am 1. September 2020 für diese Anteilklasse vorgenommenen Gebührenermäßigung und des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	IKH	0,45 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund der am 1. September 2020 für diese Anteilklasse vorgenommenen Gebührenermäßigung und des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	INH	0,40 %	
	LE	0,40 %	
	NEP	0,40 %	
	ZD	0,54 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund der am 1. September 2020 für diese Anteilklasse vorgenommene Gebührenermäßigung von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	ZE	0,53 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund der am 1. September 2020 für diese Anteilklasse vorgenommene Gebührenermäßigung von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	ZEP	0,54 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund der am 1. September 2020 für diese Anteilklasse vorgenommene Gebührenermäßigung von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	ZFH	0,51 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund der am 1. September 2020 für diese Anteilklasse vorgenommene Gebührenermäßigung und des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	ZGC	0,45 %	
	ZGH	0,45 %	
	ZUH	0,45 %	
<b>Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond</b>	AE	1,15 %	
	AEP	1,15 %	
	AKH	1,15 %	
	ANH	1,15 %	
	AUH	1,15 %	
	DE	1,70 %	
	DEP	1,70 %	
	DUH	1,81 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	IE	0,55 %	
INH	0,43 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.	
<b>Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds</b>	AEC	1,65 %	
	AEH	1,65 %	
	AKH	1,65 %	
	ANH	1,65 %	
	ASH	1,65 %	
	AU	1,65 %	
	AUP	1,65 %	
	DEC	1,75 %	

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 21 GESAMTKOSTENQUOTE (TER)

(Fortsetzung)

Portfolio	Klasse	TER/TER'	Kommentare
<b>Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds</b> (Fortsetzung)	DEH	1,75 %	
	DU	1,75 %	
	IEH	0,85 %	
	IU	0,85 %	
	W	1,30 %	
	WEH	1,30 %	
	XUP	0,05 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
<b>Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt</b>	AEC	1,65 %	
	AEH	1,65 %	
	AKH	1,65 %	
	ANH	1,65 %	
	ASH	1,65 %	
	AU	1,65 %	
	AUP	1,65 %	
	DEH	1,75 %	
	DU	1,75 %	
	IEH	0,85 %	
	IU	0,85 %	
	SU	1,80 %	
	SUP	1,80 %	
	W	1,30 %	
	XUP	0,06 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
ZU	0,90 %		
<b>Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds</b>	AEC	1,60 %	
	AEH	1,60 %	
	AKH	1,67 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	ANH	1,66 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	ASC	1,60 %	
	ASH	1,60 %	
	AU	1,60 %	
	AUP	1,60 %	
	DEH	1,75 %	
	DU	1,75 %	
	IE	0,85 %	
	IEH	0,85 %	
	XU	0,15 %	
	XUP	0,15 %	
	ZEH	0,90 %	
<b>Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond</b>	AEC	1,55 %	
	AEH	1,55 %	
	AKH	1,63 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	ANH	1,60 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	ASH	1,55 %	
	AU	1,55 %	
	AUP	1,55 %	
DEC	1,75 %		
DEH	1,75 %		

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 21 GESAMTKOSTENQUOTE (TER)

(Fortsetzung)

Portfolio	Klasse	TER/TER'	Kommentare
<b>Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond</b> (Fortsetzung)	DU	1,75 %	
	IEC	0,65 %	
	IEH	0,65 %	
	IKH	0,65 %	
	INH	0,65 %	
	IU	0,65 %	
	TEH	0,65 %	
	XUP	0,06 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	ZFH	0,96 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	ZGH	0,90 %	
ZU	0,90 %		
<b>Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond</b>	AEH	1,55 %	
	AKH	1,61 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	AS	1,55 %	
	ASC	1,55 %	
	ASH	1,55 %	
	AU	1,55 %	
	AUP	1,50 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund der großen Schwankung des durchschnittlichen NIW von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	AVC	1,63 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	AVH	1,69 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	DEH	1,75 %	
	IEH	0,80 %	
	IGH	0,80 %	
	ISH	0,80 %	
	IU	0,80 %	
	XU	0,15 %	
	ZU	0,90 %	
ZUP	0,96 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.	
<b>Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return</b>	AE	1,57 %/1,55 %	Die Schweizer Gesamtkostenquote umfasst die synthetischen Kosten für das Halten der zugrunde liegenden Anlagen, die während des Berichtszeitraums annualisiert 9 Basispunkten entsprechen.
	AEP	1,56 %	
	DE	2,31 %	
	IE	0,88 %/0,82 %	
	IEP	0,85 %	
	LE	0,72 %/0,68 %	
	LEP	0,70 %	
	ZE	1,05 %	
	ZEP	1,05 %	
	<b>Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return</b>	AEC	1,65 %
AEH		1,65 %	
AKH		1,65 %	
AU		1,65 %	
AUP		1,65 %	
DEH		2,30 %	
DU		2,30 %	

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 21 GESAMTKOSTENQUOTE (TER)

(Fortsetzung)

Portfolio	Klasse	TER/TER'	Kommentare
<b>Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return</b> (Fortsetzung)	IEH	1,00 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	IGH	0,95 %	
	IU	0,95 %	
	W	1,75 %	
<b>Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income</b>	AE	1,55 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund der großen Schwankung des durchschnittlichen NIW von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	AEC	1,55 %	
	AEH	1,55 %	
	AEP	1,55 %	
	AQ	1,55 %	
	AQM	1,55 %	
	AS	1,70 %	
	ASC	1,55 %	
	ASH	1,61 %	
	ASP	1,55 %	
	AU	1,55 %	
	AUM	1,55 %	
	AUP	1,55 %	
	DEC	2,30 %	
	DEH	2,30 %	
	DEP	2,30 %	
	DU	2,30 %	
	DUP	2,30 %	
	ZE	1,05 %	
ZEC	1,05 %		
ZEH	1,05 %		
ZFH	1,05 %		
ZU	1,05 %		
ZUP	1,13 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.	
<b>Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities*</b>	AE	1,80 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens und der erst kürzlich erfolgten Auflegung der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	AEC	1,80 %	
	AEH	1,80 %	
	AU	1,75 %	
	AUP	1,75 %	
	IE	0,66 %	
	IEH	0,66 %	
	IG	0,85 %	
	IU	0,72 %	

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 21 GESAMTKOSTENQUOTE (TER)

(Fortsetzung)

Portfolio	Klasse	TER/TER'	Kommentare
<b>Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities*</b> (Fortsetzung)	LE	0,35 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens und der erst kürzlich erfolgten Auflegung der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	LG	0,56 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens und der erst kürzlich erfolgten Auflegung der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	XU	0,05 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens und der erst kürzlich erfolgten Auflegung der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	ZE	0,97 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens und der erst kürzlich erfolgten Auflegung der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	ZEC	0,97 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens und der erst kürzlich erfolgten Auflegung der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	ZEH	0,97 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens und der erst kürzlich erfolgten Auflegung der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	ZU	1,05 %	
	ZUP	1,05 %	
<b>Threadneedle (Lux) - Global Focus</b>	AEH	1,80 %	
	AEP	1,80 %	
	AU	1,80 %	
	AUP	1,80 %	
	DEH	2,55 %	
	DU	2,55 %	
	IE	0,95 %	
	IEH	0,95 %	
	IU	0,95 %	
	IUP	0,95 %	
	W	1,75 %	
	XU	0,15 %	
	ZE	1,05 %	
	ZEH	0,99 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens und der erst kürzlich erfolgten Auflegung der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
ZFH	1,05 %		
ZEP	1,05 %		
ZG	1,05 %		
ZU	1,05 %		
<b>Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities</b>	AEH	1,80 %	
	AU	1,80 %	
	DEH	2,55 %	
	DU	2,55 %	
	IE	0,95 %	
	IEH	0,95 %	
	IU	0,95 %	
	ZU	1,05 %	
	1E	1,71 %	
	1U	1,71 %	
	2E	1,10 %	
2U	1,04 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.	
8E	1,14 %		
8U	1,14 %		



## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 21 GESAMTKOSTENQUOTE (TER)

(Fortsetzung)

Portfolio	Klasse	TER/TER'	Kommentare
<b>Threadneedle (Lux) - Global Equity Income</b>	AEC	1,80 %	
	AUP	1,80 %	
	DEC	2,30 %	
	DUP	2,35 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	IU	0,95 %	
	TE	1,15 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	ZU	1,05 %	
	1E	1,68 %	
	1EP	1,68 %	
	1SC	1,68 %	
	1SH	1,68 %	
	1ST	1,68 %	
	1U	1,68 %	
	1UP	1,68 %	
	1VT	1,68 %	
	2E	1,07 %	
	2EP	1,07 %	
	2U	1,07 %	
	2UP	1,07 %	
	3E	0,93 %	
3EP	0,93 %		
3U	0,93 %		
3UP	0,93 %		
8E	1,11 %		
8EP	1,11 %		
8U	1,11 %		
8UP	1,11 %		
9E	0,83 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.	
9EP	0,80 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.	
9U	0,78 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.	
9UP	0,81 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.	
<b>Threadneedle (Lux) - Global Select</b>	IU	0,95 %	
	ZU	1,05 %	
	1E	1,68 %	
	1U	1,68 %	
	2E	1,07 %	
	2U	1,07 %	
	3U	0,90 %	
	8E	1,11 %	
8U	1,11 %		
9U	0,86 %		
<b>Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies</b>	AE	1,80 %	
	AEP	1,80 %	
	AK	1,80 %	
	AUP	1,80 %	
	DE	2,30 %	
IE	0,95 %		

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 21 GESAMTKOSTENQUOTE (TER)

(Fortsetzung)

Portfolio	Klasse	TER/TER'	Kommentare
<b>Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies</b> (Fortsetzung)	IEP	0,95 %	
	NE	0,75 %	
	XE	0,15 %	
	XG	0,21 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	XGH	0,15 %	
	ZE	1,05 %	
	ZFH	1,05 %	
	ZG	1,05 %	
	ZGH	1,05 %	
	ZU	1,05 %	
<b>Threadneedle (Lux) - American</b>	AEH	1,80 %	
	AU	1,80 %	
	DEH	2,15 %	
	DU	2,15 %	
	IEH	0,90 %	
	IU	0,90 %	
	W	1,50 %	
	ZE	1,00 %	
	ZEH	1,00 %	
	ZU	1,00 %	
	1E	1,67 %	
	1EH	1,67 %	
	1EP	1,67 %	
	1U	1,67 %	
	2E	1,06 %	
	2U	1,06 %	
	3EH	0,88 %	
	3U	0,88 %	
	8E	1,10 %	
	8U	1,10 %	
9EH	0,84 %		
9U	0,84 %		
<b>Threadneedle (Lux) - American Select</b>	AD	1,80 %	
	AEH	1,80 %	
	AN	1,80 %	
	AU	1,80 %	
	DEH	2,55 %	
	DU	2,55 %	
	ID	1,00 %	
	IE	1,07 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	IEH	1,00 %	
	IN	1,05 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	W	1,75 %	
	ZEH	1,04 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund der großen Schwankung des durchschnittlichen NIW und des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	ZU	1,10 %	
1E	1,67 %		
1EH	1,67 %		
1EP	1,67 %		

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 21 GESAMTKOSTENQUOTE (TER)

(Fortsetzung)

Portfolio	Klasse	TER/TER'	Kommentare
<b>Threadneedle (Lux) - American Select</b> (Fortsetzung)	1U	1,67 %	
	2EH	1,06 %	
	2U	1,06 %	
	3E	0,87 %	
	3U	0,87 %	
	8EH	1,10 %	
	8U	1,10 %	
	9E	0,83 %	
	9U	0,78 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
<b>Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies</b>	AEH	1,80 %	
	AU	1,85 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	DEH	2,30 %	
	DU	2,30 %	
	IE	0,95 %	
	IU	0,95 %	
	ZU	1,05 %	
	1E	1,68 %	
	1EP	1,68 %	
	1U	1,68 %	
	2U	1,07 %	
	3EH	0,93 %	
	3U	0,93 %	
	8U	1,11 %	
	9EH	0,84 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
9U	0,89 %		
<b>Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity</b>	AE	1,80 %	
	AF	1,80 %	
	AS	1,71 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund der großen Schwankung des durchschnittlichen NIW von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	ASH	1,80 %	
	AU	1,80 %	
	DE	2,55 %	
	IF	0,95 %	
	ISH	0,95 %	
	IU	0,95 %	
	XU	0,15 %	
	XUP	0,15 %	
	ZE	1,05 %	
	ZEH	1,05 %	
	ZF	1,00 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	ZG	1,05 %	
ZU	1,05 %		
<b>Threadneedle (Lux) - Asia Equities</b>	IE	0,95 %	
	IU	0,95 %	
	ZU	1,05 %	
	1E	1,70 %	
	1U	1,70 %	
	2E	1,09 %	
2U	1,09 %		

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 21 GESAMTKOSTENQUOTE (TER)

(Fortsetzung)

Portfolio	Klasse	TER/TER'	Kommentare
<b>Threadneedle (Lux) - Asia Equities</b> (Fortsetzung)	3U	0,95 %	
	8E	1,13 %	
	8U	1,13 %	
	9U	0,91 %	
<b>Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities</b>	AEC	1,85 %	
	AEH	1,85 %	
	AU	1,85 %	
	AUP	1,85 %	
	DU	2,35 %	
	IU	1,05 %	
	XS	0,06 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	XSH	0,15 %	
	ZEH	1,10 %	
	ZFH	1,10 %	
ZGH	1,10 %		
ZU	1,10 %		
<b>Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities</b>	AE	0,70 %	
	AEH	0,70 %	
	AU	0,70 %	
	AUP	0,70 %	
	DE	0,90 %	
	DEH	0,90 %	
	DU	0,90 %	
	IE	0,35 %	
	IEC	0,40 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	IEH	0,35 %	
	IFH	0,35 %	
	IG	0,35 %	
	IU	0,35 %	
	NE	0,10 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens und der erst kürzlich erfolgten Auflegung der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	NG	0,09 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens und der erst kürzlich erfolgten Auflegung der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
NU	0,11 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens und der erst kürzlich erfolgten Auflegung der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.	
XG	0,10 %		
ZEH	0,45 %		
ZFH	0,45 %		
ZU	0,45 %		
<b>Threadneedle (Lux) - Pan European Equities</b>	AE	1,80 %	
	ASH	1,80 %	
	AUH	1,80 %	
	DE	2,15 %	
	IE	0,95 %	
	W	1,75 %	
	XE	0,15 %	
	ZUH	1,05 %	
	1E	1,73 %	
1EP	1,73 %		

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 21 GESAMTKOSTENQUOTE (TER)

(Fortsetzung)

Portfolio	Klasse	TER/TER'	Kommentare
<b>Threadneedle (Lux) - Pan European Equities</b> (Fortsetzung)	1G	1,73 %	
	1GP	1,79 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	2E	1,08 %	
	2G	1,08 %	
	2U	1,02 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	3E	0,94 %	
	3G	0,94 %	
	3GP	0,94 %	
	4E	0,08 %	
	4G	0,08 %	
	8E	1,12 %	
	8G	1,12 %	
	8U	1,03 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	9E	0,77 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	9G	0,81 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	9GP	0,81 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	<b>Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend</b>	AE	1,80 %
AEP		1,80 %	
AUP		1,86 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
DE		2,15 %	
DEP		2,10 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
IE		0,95 %	
IEP		0,95 %	
ZE		1,05 %	
ZEP		1,05 %	
1E		1,70 %	
1EP		1,70 %	
1G		1,70 %	
1GP		1,70 %	
2E		1,09 %	
2EP		1,09 %	
2G		1,04 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
2GP		1,03 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
3EP	0,95 %		
3G	0,95 %		
3GP	0,95 %		
4GP	0,09 %		
8E	1,13 %		
8EP	1,13 %		
8G	1,13 %		
8GP	1,13 %		

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 21 GESAMTKOSTENQUOTE (TER)

(Fortsetzung)

Portfolio	Klasse	TER/TER'	Kommentare
<b>Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend</b> (Fortsetzung)	9EP	0,81 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	9G	0,91 %	
	9GP	0,91 %	
<b>Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities</b>	AE	1,85 %	
	ASH	1,85 %	
	AUH	1,85 %	
	DE	2,75 %	
	DUH	2,75 %	
	IE	1,10 %	
	W	1,90 %	
	ZE	1,10 %	
	ZFH	1,10 %	
<b>Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies</b>	IE	0,95 %	
	ZE	1,10 %	
	1E	1,72 %	
	1EP	1,72 %	
	1FH	1,72 %	
	1G	1,72 %	
	1UH	1,72 %	
	2E	1,07 %	
	2G	1,00 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	3E	0,91 %	
	3EP	0,91 %	
	3FH	0,91 %	
	3G	0,91 %	
	3GP	0,91 %	
	3UH	0,91 %	
	4E	0,07 %	
	4G	0,07 %	
	8E	1,11 %	
	8G	1,11 %	
	9E	0,87 %	
9EP	0,77 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.	
9FH	0,87 %		
9G	0,87 %		
9GP	0,76 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.	
9UH	0,87 %		
<b>Threadneedle (Lux) - European Select</b>	AE	1,80 %	
	AGH	1,80 %	
	AUH	1,80 %	
	DUH	2,35 %	
	IE	0,95 %	
	ZG	1,05 %	
	ZGH	1,05 %	
	1E	1,65 %	
	1EP	1,65 %	
	1SH	1,65 %	
1U	1,65 %		
1UH	1,65 %		

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 21 GESAMTKOSTENQUOTE (TER)

(Fortsetzung)

Portfolio	Klasse	TER/TER'	Kommentare
<b>Threadneedle (Lux) - European Select</b> (Fortsetzung)	2E	1,06 %	
	2EP	0,99 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	3E	0,88 %	
	3U	0,88 %	
	8E	1,10 %	
	8EP	1,10 %	
	9E	0,84 %	
	9U	0,76 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
<b>Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies</b>	IE	0,95 %	
	ZE	1,10 %	
	1E	1,72 %	
	1EP	1,72 %	
	1FH	1,72 %	
	2E	1,07 %	
	3E	0,93 %	
	3EP	0,93 %	
	3FH	0,93 %	
	8E	1,11 %	
	9E	0,89 %	
	9EP	0,89 %	
	9FH	0,89 %	
<b>Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income</b>	AEH	1,80 %	
	AU	1,80 %	
	AUP	1,80 %	
	DEH	2,55 %	
	DU	2,55 %	
	DUP	2,55 %	
	IEP	0,95 %	
	IU	0,95 %	
	W	2,00 %	
	XU	0,15 %	
	XUP	0,15 %	
	ZG	1,05 %	
	ZGH	1,05 %	
	ZGP	1,05 %	
	ZUP	1,05 %	
<b>Threadneedle (Lux) - Global Technology</b>	AEH	1,95 %	
	AS	1,95 %	
	AU	1,95 %	
	AUP	1,95 %	
	BU	2,35 %	
	DEH	2,30 %	
	DU	2,30 %	
	IE	1,05 %	
	IEH	1,05 %	
	IG	1,05 %	
	IU	1,05 %	
	ZEH	1,15 %	
	ZFH	1,15 %	
	ZG	1,15 %	
	ZU	1,15 %	

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 21 GESAMTKOSTENQUOTE (TER)

(Fortsetzung)

Portfolio	Klasse	TER/TER'	Kommentare
<b>Threadneedle (Lux) - UK Equities</b>	AE	1,80 %	
	AEH	1,80 %	
	AFH	1,80 %	
	AG	1,80 %	
	AGP	1,80 %	
	DEH	2,60 %	
	DG	2,60 %	
	IE	0,85 %	
	IEH	0,85 %	
	IG	0,85 %	
	IGP	0,85 %	
	ZE	1,05 %	
	ZEH	1,05 %	
	ZFH	1,05 %	
	ZG	1,05 %	
	ZGP	1,05 %	
	3EH	0,87 %	
	3UH	0,87 %	
	9EH	0,83 %	
	9EP	0,83 %	
9FH	0,83 %		
9G	0,83 %		
9UH	0,78 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund der großen Schwankung des durchschnittlichen NIW von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.	
<b>Threadneedle (Lux) - UK Equity Income</b>	AE	1,80 %	
	AEC	1,80 %	
	AEH	1,80 %	
	AG	1,80 %	
	ASC	1,80 %	
	AUC	1,80 %	
	DE	2,55 %	
	DEC	2,64 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	DEH	2,55 %	
	DG	2,55 %	
	DGP	2,55 %	
	IE	0,85 %	
	IEH	0,85 %	
	IG	0,85 %	
	IGP	0,85 %	
	IU	0,85 %	
	IUH	0,74 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	LG	0,70 %	
	LGP	0,70 %	
	ZE	1,05 %	
	ZEH	1,05 %	
	ZFH	1,05 %	
	ZG	1,05 %	
ZGP	1,05 %		
ZUH	1,05 %		
1EH	1,64 %		
1FH	1,64 %		



## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 21 GESAMTKOSTENQUOTE (TER)

(Fortsetzung)

Portfolio	Klasse	TER/TER <sup>1</sup>	Kommentare
<b>Threadneedle (Lux) - UK Equity Income</b> (Fortsetzung)	1UH	1,64 %	
	3EH	0,88 %	
	3FH	0,88 %	
	3UH	0,88 %	
	9EH	0,84 %	
	9FH	0,84 %	
	9G	0,84 %	
	9UH	0,84 %	
<b>Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity</b>	IU	1,60 %	
	ZU	1,60 %	
<b>Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha</b>	AEH	1,80 %	
	AFH	1,80 %	
	AGH	1,80 %	
	AU	1,80 %	
	DEH	2,30 %	
	DU	2,30 %	
	IEH	0,95 %	
	IGH	0,95 %	
	IU	0,95 %	
	XGH	0,15 %	
	ZE	0,97 %/0,88 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
ZEH	1,05 %		
ZGH	1,05 %		
ZU	1,05 %		
<b>Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities</b>	ZE	0,80 %	
	1E	1,17 %	
	1EP	1,17 %	
	1GH	1,17 %	
	1UH	1,17 %	
	2E	0,56 %	
	2EP	0,43 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	2GC	0,56 %	
	2GH	0,56 %	
	4GH	0,06 %	
	8E	0,60 %	
	8EP	0,60 %	
	8GC	0,60 %	
8GH	0,60 %		
<b>Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities</b>	AE	1,11 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	AFH	1,12 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	AKH	1,20 %	
	ANH	1,20 %	
	AUH	1,20 %	
	DE	1,75 %	
	IE	0,55 %	
	IEP	0,69 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	IGH	0,55 %	

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 21 GESAMTKOSTENQUOTE (TER)

(Fortsetzung)

Portfolio	Klasse	TER/TER <sup>1</sup>	Kommentare
<b>Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities</b> (Fortsetzung)	INH	0,62 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	IU	0,47 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	IUH	0,55 %	
	JE	0,61 %/0,63 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	JGH	0,45 %/0,55 %	
	JUH	0,60 %/0,71 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	LE	0,40 %	
	LEP	0,40 %	
	LGH	0,40 %	
	XE	0,15 %	
	XGH	0,15 %	
	XUH	0,15 %	
	YE	0,67 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	YGH	0,60 %/0,72 %	
	YUH	0,71 %/0,82 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	ZE	0,70 %	
	ZFH	0,70 %	
ZGH	0,70 %		
ZUH	0,70 %		
<b>Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha</b>	AE	1,85 %/3,70 %	
	AEP	1,85 %/3,80 %	
	AUH	1,78 %/5,60 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	DE	2,35 %/3,80 %	
	IE	0,95 %/2,57 %	
	IGH	0,95 %/2,66 %	
	LE	0,58 %/2,51 %	
	XGH	0,15 %	
	ZE	1,05 %/3,46 %	
	ZF	1,05 %/1,96 %	
ZFH	1,05 %/5,96 %		
ZGH	1,05 %/0,58 %		
<b>Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha</b>	AEH	1,80 %	
	AU	1,80 %	
	DEH	2,30 %	
	DU	2,30 %	
	IU	0,90 %	
	ZU	1,05 %	
	1E	1,69 %	
	1EH	1,69 %	
	1U	1,69 %	

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

Portfolio	Klasse	TER/TER'	Kommentare
<b>Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha</b> <i>(Fortsetzung)</i>	2E	0,83 %	
	2U	0,83 %	
	3U	0,94 %/1,47 %	
	8E	0,87 %/1,32 %	
	8U	0,87 %/2,54 %	
	9U	0,90 %	
<b>Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha</b>	AEH	1,74 %/2,78 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	AU	1,80 %/2,45 %	
	DEH	2,30 %	
	DU	2,35 %/3,42 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund der großen Schwankung des durchschnittlichen NIW von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	IU	0,90 %	
	ZU	1,05 %/3,31 %	
	1E	1,69 %/2,68 %	
	1U	1,69 %/2,68 %	
	2E	0,83 %/1,77 %	
	2U	0,83 %/1,80 %	
	8E	0,87 %/1,76 %	
	8U	0,87 %	
<b>Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities</b>	AEH	2,05 %	
	AFH	2,05 %	
	AGH	2,05 %	
	ASH	2,05 %	
	AU	2,05 %	
	DEH	2,55 %	
	DU	2,55 %	
	IEH	1,00 %	
	IG	1,07 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	IGH	1,00 %	
	IU	1,00 %	
	NG	0,65 %	
	XU	0,15 %	
ZEH	1,05 %		
ZFH	1,05 %		
ZGH	1,05 %		
ZU	1,05 %		
<b>Threadneedle (Lux) - Gatehouse Shariah Global Equity</b>	AU	1,85 %	

<sup>1</sup>Die TER versteht sich einschließlich Performancegebühren.

\* Siehe Erläuterung 1.

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 22 EREIGNISSE NACH DEM BILANZSTICHTAG

Mit Wirkung zum 1. Oktober 2020 wurde die Anlagepolitik des Threadneedle (Lux) - American Portfolio geändert.

Mit Wirkung zum 1. Oktober 2020 wurden die Gebühren für die nachfolgenden Klassen des Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond Portfolio wie folgt reduziert:

Klasse	Aktuell			Ab dem 1. Oktober 2020		
	Anlageverwaltungsgebühr	Betriebskosten	TER	Anlageverwaltungsgebühr	Betriebskosten	TER
A	1,25 %	0,30 %	1,55 %	0,90 %	0,25 %	1,15 %
D	1,45 %	0,30 %	1,75 %	1,20 %	0,25 %	1,45 %
I	0,60 %	0,20 %	0,80 %	0,40 %	0,15 %	0,55 %
Z	0,60 %	0,30 %	0,90 %	0,40 %	0,25 %	0,65 %

Mit Wirkung zum 2. Oktober 2020 wurde die Anlagepolitik des Threadneedle (Lux) - Pan European Equities Portfolio geändert, es wurde in Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities umbenannt und die Gebühren für die nachfolgend genannten Klassen wurde wie folgt reduziert:

Klasse	Aktuell			Ab dem 2. Oktober 2020		
	Anlageverwaltungsgebühr	Betriebskosten	TER	Anlageverwaltungsgebühr	Betriebskosten	TER
A	1,50 %	0,30 %	1,80 %	1,30 %	0,25 %	1,55 %
D	1,85 %	0,30 %	2,15 %	1,50 %	0,25 %	1,75 %
I	0,75 %	0,20 %	0,95 %	0,65 %	0,15 %	0,80 %
Z	0,75 %	0,30 %	1,05 %	0,75 %*	0,25 %	1,00 %
1	1,50 %	0,23 %	1,73 %	1,30 %	0,23 %*	1,53 %

\*keine Änderung

Mit Wirkung zum 3. November 2020 wurde für den Teilfonds Threadneedle (Lux) - Gatehouse Shariah Global Equity ein Liquidationsverfahren eingeleitet und die abschließenden Rücknahmen für Anteilinhaber wurden am 10. November 2020 angewiesen.

### 23 SONSTIGE INFORMATIONEN

Die durch das Coronavirus (COVID-19) ausgelöste Krise im Gesundheitswesen hat sich zu einer Pandemie entwickelt, die zu erheblichen wirtschaftlichen und gesellschaftlichen Störungen weltweit sowie zu Marktvolatilität, u. a. aufgrund von Unterbrechungen des Marktzugangs, der Verfügbarkeit von Personal, des Betriebs von Einrichtungen sowie aufgrund der Erhebung von Zöllen, von Ausfuhrkontrollen und von Unterbrechungen der Versorgungskette, geführt hat und weiter dazu führen kann. Diese Störungen können durch Quarantänen und Reisebeschränkungen, Entlassungen von Arbeitnehmern und den Verlust von Personal- und anderen Ressourcen verursacht oder verstärkt werden. Die Ungewissheit in Bezug auf das Ausmaß sowie die Dauer, Reichweite, Kosten und Auswirkungen der globalen Pandemie, ebenso wie Maßnahmen, die durch Regierungsbehörden oder andere Dritte ergriffen wurden oder werden könnten, sind mit Unbekanntem verbunden, deren Entwicklung noch nicht absehbar ist. Die Auswirkungen – ebenso wie die Unsicherheit bezüglich noch bevorstehender Auswirkungen – von COVID-19 und anderen Ausbrüchen von Infektionskrankheiten, Epidemien und Pandemien, die in Zukunft stattfinden könnten, könnten die Volkswirtschaften und Märkte weltweit in unvorhersehbarer Weise beeinträchtigen. Hinzu kommt, dass die Auswirkungen von Ausbrüchen von Infektionskrankheiten und Epidemien in Schwellenländern größer sein könnten, da diese im Allgemeinen über weniger gefestigte Gesundheitssysteme, Regierungen und Finanzmärkte verfügen. Die durch den Ausbruch von COVID-19 verursachten Krisen des Gesundheitswesens können andere, bereits zuvor bestehende, politische, soziale und wirtschaftliche Risiken in bestimmten Ländern oder weltweit verstärken. Die durch COVID-19 bedingten Störungen könnten verhindern, dass die Portfolios vorteilhafte Anlageentscheidungen rechtzeitig umsetzen können und die Fähigkeit der Portfolios, ihre Anlageziele zu erreichen, beeinträchtigen. Solche Ereignisse könnten sich wesentlich nachteilig auf den Wert und das Risikoprofil der Portfolios auswirken.

## Informationen für Anteilhaber

Die SICAV ist eine im Großherzogtum Luxemburg entsprechend der aktuellen Fassung des Gesetzes vom 10. August 1915 gegründete Investmentgesellschaft mit variablem Kapital („Société d'Investissement à Capital Variable“) und gilt gemäß Teil I der aktuellen Fassung des Gesetzes vom 17. Dezember 2010 als Organismus für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren („OGAW“).

Die SICAV wurde am 10. Februar 1995 für unbegrenzte Dauer gegründet. Die Satzung der SICAV wurde erstmalig am 31. Mai 1995 im Recueil des Sociétés et Associations des Großherzogtums Luxemburg veröffentlicht und mit Wirkung zum 14. September 2018 zuletzt geändert.

Die SICAV ist unter der Nummer R.C.S. Luxembourg B-50216 eingetragen.

Die Jahreshauptversammlung der Anteilhaber der SICAV findet, wie in der Versammlungsmitteilung angegeben, innerhalb von sechs Monaten nach Ablauf des Rechnungsjahres in Luxemburg statt. Die Jahreshauptversammlung kann im Ausland abgehalten werden, wenn außergewöhnliche Umstände dies nach dem absoluten und endgültigen Urteil des Verwaltungsrats erfordern. Sonstige Hauptversammlungen der Anteilhaber können zu den Terminen und an den Orten in Luxemburg abgehalten werden, die in der Versammlungsmitteilung angegeben sind. Versammlungsmitteilungen erfolgen gemäß luxemburgischem Recht und im Einklang mit den maßgeblichen Regelungen der Länder, in denen die Anteile öffentlich angeboten werden. Die Versammlungsmitteilung muss Ort und Termin der Versammlung, die Teilnahmevoraussetzungen, die Tagesordnung, die Mindestanwesenheitsanforderungen zur Beschlussfähigkeit und die Voraussetzungen für die Stimmabgabe enthalten.

Das Rechnungsjahr der SICAV endet am 31. März eines jeden Jahres.

Der Jahresbericht und geprüfte Jahresabschluss sowie der ungeprüfte Halbjahresbericht sind am eingetragenen Firmensitz der SICAV und am Hauptsitz der einzelnen Zahl- und Vertriebsstellen erhältlich. Die konsolidierten Konten der SICAV werden in US-Dollar ausgedrückt.

Der Nettoinventarwert sowie die Ausgabe- und Rücknahmepreise der Anteile der SICAV werden am eingetragenen Firmensitz der SICAV veröffentlicht.

Dieser Bericht stellt kein Angebot und keine Aufforderung zum Kauf von Anteilen der SICAV dar. Zeichnungen werden nur auf der Grundlage des Verkaufsprospekts, des letzten verfügbaren Jahresberichts mit dem geprüften Abschluss zum 31. März und, sofern danach veröffentlicht, des letzten verfügbaren Halbjahresberichts zum 30. September akzeptiert.

Bestimmte Portfolios und/oder Anteilklassen in diesem Bericht sind zu diesem Datum möglicherweise nicht in allen Gebietskörperschaften zugelassen oder werden nicht in allen Gebietskörperschaften zum Kauf angeboten.

### **Dokument mit den wesentlichen Informationen für den Anleger („KIID“) – Bedingungen für die Zeichnung**

Das Dokument mit den wesentlichen Anlegerinformationen (Key Investor Information Document, KIID) ist ein vorvertragliches Dokument und Anleger müssen bestätigen, dass sie das neueste KIID gelesen haben, bevor sie eine Zeichnung tätigen. Die Verwaltungsgesellschaft darf einen Zeichnungsantrag ablehnen, wenn ein Anleger bei Antragstellung nicht bestätigt, dass er das neueste KIID zur Kenntnis genommen hat. Das neueste KIID ist auf [www.columbiathreadneedle.com](http://www.columbiathreadneedle.com) erhältlich.

## **Informationen für Anleger in der Schweiz**

Der Jahresbericht und geprüfte Jahresabschluss, der ungeprüfte Halbjahresbericht, der Bericht über die Veränderungen des Portfoliobestands im Berichtszeitraum, die Satzung, der Verkaufsprospekt (Schweizer Version) und die KIID können auf Anfrage kostenlos bei den Geschäftsstellen der Vertretung und Zahlstelle der SICAV in der Schweiz, RBC Investor Services Bank S.A., Esch-sur-Alzette, Zweigniederlassung Zürich, Bleicherweg 7, CH-8027 Zürich, Schweiz, oder am eingetragenen Firmensitz der SICAV angefordert werden.

Die Wertentwicklung in der Vergangenheit gibt keinen Aufschluss über die aktuelle oder zukünftige Wertentwicklung, und bei den Daten zur Wertentwicklung sind Provisionen und Kosten im Rahmen der Ausgabe und Rücknahme von Anteilen nicht berücksichtigt.

## Verordnung über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte

Die Verordnung über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (Securities Financing Transaction Regulation, „SFTR“) führt Meldepflichten für Wertpapierfinanzierungsgeschäfte („SFTs“) und Total Return Swaps ein. Ein Wertpapierfinanzierungsgeschäft ist gemäß der Definition in Artikel 3(11) der SFTR Folgendes:

- ein Pensionsgeschäft/umgekehrtes Pensionsgeschäft;
- ein Wertpapier- oder Warenverleihgeschäft und ein Wertpapier- oder Warenentleihgeschäft;
- ein Kauf-/Rückverkaufgeschäft oder ein Verkauf-/Rückkaufgeschäft; oder
- ein Lombardgeschäft.

Zum 30. September 2020 hielt die SICAV Total Return Swaps („TRS“) als die Art von Instrumenten, die in den Geltungsbereich der SFTR fallen.

### Weltweite Daten

Name des Portfolios	Art des Vermögenswerts	Nicht realisierter Gewinn und Verlust in der Portfolio-Basiswährung und als absoluter Wert	% des Nettovermögens
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	TRS	854.730	0,97
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	TRS	857.435	0,48
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	TRS	501.141	0,46
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	TRS	945.019	0,50
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	TRS	4.428.930	1,25

### Daten zur Wiederverwendung von Sicherheiten

Während des Berichtszeitraums zum 30. September 2020 wurden keine Sicherheiten wiederverwendet.

### Konzentrationsdaten

Alle in Bezug auf TRS zum 30. September 2020 erhaltenen Sicherheiten sind Barsicherheiten. Die Angabe der zehn größten Emittenten ist daher nicht möglich.

Die folgende Tabelle bietet Details zu den zehn wichtigsten Gegenparteien (auf Basis des Bruttovolumens ausstehender Transaktionen) in Bezug auf TRS, die zum 30. September 2020 pro Portfolio gehalten wurden:

Name des Portfolios	Art des Vermögenswerts	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn und Verlust in der Portfolio-Basiswährung und als absoluter Wert
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	TRS	Bank of America Merrill Lynch	854.730
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	TRS	UBS	566.208
		Goldman Sachs	291.227
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	TRS	Bank of America Merrill Lynch	501.141
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	TRS	UBS	945.019
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	TRS	Macquarie	1.803.689
		Goldman Sachs	1.036.746
		JPMorgan	911.100
		Credit Suisse	360.416
		Citigroup Global Markets	316.979

### Verwahrung erhaltener Sicherheiten

Barsicherheiten werden im Geldkonto des jeweiligen Portfolios bei der Citibank Europe plc, Niederlassung Luxemburg, gehalten.

## Verordnung über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte

(Fortsetzung)

Die folgende Tabelle zeigt die von der SICAV zum 30. September 2020 gehaltenen Termineinlagen:

Name des Portfolios	Art der Sicherheit	Kontrahent	Währung der Sicherheit	Betrag der Sicherheit
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	Barmittel	UBS	EUR	2.470.000
		<b>Summe</b>	<b>EUR</b>	<b>2.470.000</b>
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	Barmittel	Bank of America Merrill Lynch	USD	100.000
		<b>Summe</b>	<b>USD</b>	<b>100.000</b>
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	Barmittel	UBS	USD	3.000
		<b>Summe</b>	<b>USD</b>	<b>3.000</b>

### Transaktionsdaten, insgesamt

Name des Portfolios	Art der Sicherheit	Laufzeit (Sicherheit)	Währung der Sicherheit	Laufzeit (SFT/TRS)	Land der Niederlassung (Kontrahent)	Abwicklung und Clearing	Qualität der Sicherheit
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	Barmittel	Restlaufzeit	USD	3 Monate bis 1 Jahr	GB	Bilateral	n.z. - Barmittel
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	Barmittel	Restlaufzeit	EUR	mehr als 1 Jahr	GB	Bilateral	n.z. - Barmittel
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	Barmittel	Restlaufzeit	USD	3 Monate bis 1 Jahr	GB	Bilateral	n.z. - Barmittel
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	Barmittel	Restlaufzeit	USD	mehr als 1 Jahr	GB	Bilateral	n.z. - Barmittel
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	Barmittel	Restlaufzeit	USD	weniger als 1 Tag	GB	Bilateral	n.z. - Barmittel
	Anleihe	3 Monate bis 1 Jahr	USD	weniger als 1 Tag	GB	Bilateral	R-1H (DBRS)

### Verwahrung gewährter Sicherheiten

An die Kontrahenten gezahlte Barmittel und Sicherheiten werden auf separate Konten beim Kontrahenten eingezahlt.

Der Betrag der für TRS gewährten Sicherheiten zum 30. September 2020 ist wie folgt:

Name des Portfolios	Art der Sicherheit	Kontrahent	Währung der Sicherheit	Betrag der Sicherheit	% der zum Ende der Berichtsperiode gehaltenen Sicherheiten nach Kategorie
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	Barmittel	Bank of America Merrill Lynch	USD	1.040.000	1,19
		<b>Summe</b>	<b>USD</b>	<b>1.040.000</b>	<b>1,19</b>
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	Barmittel	Goldman Sachs	EUR	570.000	0,31
		<b>Summe</b>	<b>EUR</b>	<b>570.000</b>	<b>0,31</b>
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	Barmittel	Macquarie	USD	2.430.000	0,68
		Goldman Sachs	USD	2.010.000	0,56
		JPMorgan	USD	560.000*	0,16
	Anleihe	Credit Suisse	USD	662.000	0,19
		Citigroup Global Markets	USD	580.000	0,16
		<b>Summe</b>	<b>USD</b>	<b>6.242.000</b>	<b>1,75</b>

### Rendite/Kosten

Die Rendite und die Kosten von TRS-Transaktionen zum 30. September 2020 werden in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und Entwicklung des Nettovermögens des jeweiligen Portfolios unter der Überschrift „Zinsaufwand aus Swaps“, „Realisierter Nettogewinn/-verlust aus Swaps“ und „Änderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus Swaps“ ausgewiesen.

\*Diese Sicherheiten beziehen sich möglicherweise auf andere Transaktionen als TRS, die nicht unter die Offenlegung gemäß SFT-Verordnung fallen.



## Adressverzeichnis

### Eingetragener Firmensitz

31 Z.A. Bourmicht  
L-8070 Bertrange  
Großherzogtum Luxemburg

### Anlageberater

Threadneedle Management Luxembourg S.A.

### Unterbevollmächtigte<sup>1</sup>:

Columbia Management  
Investment Advisers, LLC  
225 Franklin Street  
Boston MA 02110  
Vereinigte Staaten von Amerika

Threadneedle Asset  
Management Limited  
Cannon Place  
78 Cannon Street  
London EC4N 6AG  
Vereinigtes Königreich

### Verwaltungsgesellschaft

Threadneedle Management Luxembourg S.A.  
44, rue de la Vallée  
L-2661 Luxemburg  
Großherzogtum Luxemburg

Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond  
Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities<sup>2,3</sup>  
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities<sup>3</sup>  
Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities  
Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities  
Threadneedle (Lux) - Global Technology  
  
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond<sup>4</sup>  
Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond  
Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond  
Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond  
Threadneedle (Lux) - European Social Bond  
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond  
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds<sup>4</sup>  
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt<sup>4</sup>  
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds<sup>4</sup>  
Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond<sup>5</sup>  
Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return  
Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return  
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income<sup>6</sup>  
Threadneedle (Lux) - Global Focus  
Threadneedle (Lux) - Global Equity Income  
Threadneedle (Lux) - Global Select  
Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies  
Threadneedle (Lux) - American<sup>6</sup>  
Threadneedle (Lux) - American Select<sup>6</sup>  
Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies<sup>6</sup>  
Threadneedle (Lux) - Asia Equities<sup>5</sup>  
Threadneedle (Lux) - Pan European Equities  
Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend  
Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities  
Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies  
Threadneedle (Lux) - European Select  
Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies  
Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income<sup>5</sup>  
Threadneedle (Lux) - UK Equities  
Threadneedle (Lux) - UK Equity Income  
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha<sup>6</sup>  
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities  
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities  
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha  
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha  
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha  
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities  
Threadneedle (Lux) - Gatehouse Shariah Global Equity<sup>7</sup>

Threadneedle Investments  
Singapore (Pte.) Limited  
3 Killiney Road  
#07-07 Winsland House 1  
Singapur 239519  
Singapur

Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity<sup>8</sup>

STANLIB Asset Management (Pty) Limited Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity  
17 Melrose Boulevard  
Melrose Arch 2196  
Johannesburg  
Südafrika

<sup>1</sup>Unter der Verantwortlichkeit und Aufsicht von Threadneedle Management Luxembourg S.A.

<sup>2</sup>Siehe Erläuterung 1 auf Seite 221.

<sup>3</sup>Threadneedle Asset Management Limited gibt Anlageempfehlungen an Columbia Management Investment Advisers, LLC und stellt daher eine auf Analysen gestützte Anlageberatung für Columbia Management Investment Advisers, LLC bereit.

<sup>4</sup>Threadneedle Asset Management Limited kann vorbehaltlich seiner eigenen Haftung die diskretionäre Anlageverwaltung eines Teils des Portfoliovermögens an Columbia Management Investment Advisers, LLC delegieren.

<sup>5</sup>Threadneedle Asset Management Limited kann vorbehaltlich seiner eigenen Haftung die diskretionäre Anlageverwaltung eines Teils des Portfoliovermögens an Threadneedle Investments Singapore (Pte.) Limited delegieren.

<sup>6</sup>Columbia Management Investment Advisers, LLC gibt Anlageempfehlungen an Threadneedle Asset Management Limited und stellt daher eine auf Analysen gestützte Anlageberatung für Threadneedle Asset Management Limited bereit.

<sup>7</sup>Die Verwaltungsgesellschaft hat einen Shariah-Aufsichtsgremium ernannt, um die Einhaltung der Shariah-Richtlinien durch das Shariah-Portfolio zu überwachen. Gatehouse Bank plc, 14 Grosvenor Street, London, W1K 4PS, Vereinigtes Königreich, wurde zum Shariah-Berater bestellt.

<sup>8</sup>Columbia Management Investment Advisers, LLC gibt Anlageempfehlungen an Threadneedle Investments Singapore (Pte.) Limited und stellt daher eine auf Analysen gestützte Anlageberatung für Threadneedle Investments Singapore (Pte.) Limited bereit.

## Adressverzeichnis

(Fortsetzung)

### **Verwahr-, Domizil-, Verwaltungs- und Zahlstelle**

Citibank Europe plc, Zweigniederlassung Luxemburg  
31, Z.A. Bourmicht  
L-8070 Bertrange  
Großherzogtum Luxemburg

### **Register- und Transferstelle**

International Financial Data Services (Luxembourg) S.A.  
47, Avenue John F. Kennedy  
L-1855 Luxemburg  
Großherzogtum Luxemburg

### **Vertriebsstelle (an verschiedene Vertriebsstellen delegiert)**

Threadneedle Management Luxembourg S.A.  
44, rue de la Vallée  
L-2661 Luxemburg  
Großherzogtum Luxemburg

### **Vertretung und Zahlstellen**

#### **In Österreich**

Erste Bank der österreichischen Sparkassen AG  
Graben 21  
A-1010 Wien  
Österreich

#### **In Belgien**

CACEIS Belgium S.A  
Avenue du Port 86 C b 320  
B-1000 Brüssel  
Belgien

#### **In Frankreich**

CACEIS Bank France  
1/3 Place Valhubert  
F-75206 Paris Cedex 13  
Frankreich

#### **In Deutschland**

J.P. Morgan AG  
Junghofstraße 14  
D-60311 Frankfurt am Main  
Deutschland

#### **In Hongkong**

HSBC Institutional Trust Services (Asia) Limited  
17/F Tower 2 & 3 HSBC Centre  
1 Sham Mong Road  
Kowloon  
Hongkong

#### **In der Schweiz**

RBC Investor Services Bank S.A., Esch-sur-Alzette  
Zweigniederlassung Zürich  
Bleicherweg 7  
CH-8027 Zürich  
Schweiz

#### **Abschlussprüfer**

PricewaterhouseCoopers, *Société coopérative*  
2, rue Gerhard Mercator, B.P. 1443  
L-1014 Luxemburg  
Großherzogtum Luxemburg

#### **Rechtsberater in Luxemburg**

Linklaters LLP, Luxemburg  
35 Avenue John F. Kennedy, B.P. 1107  
L-1011 Luxemburg  
Großherzogtum Luxemburg

Weitere Informationen finden Sie auf unserer Website: [columbiathreadneedle.com](https://columbiathreadneedle.com)



**Herausgegeben von Threadneedle Management Luxembourg S.A.** Eingetragen beim luxemburgischen Registre de Commerce et des Sociétés (Handels- und Gesellschaftsregister) unter der Nummer B 110242, 44, rue de la Vallée, L-2661 Luxembourg, Großherzogtum Luxemburg. Im Vereinigten Königreich herausgegeben von Threadneedle Asset Management Limited (TAML) Eingetragen in England und Wales unter der Registernummer 573204, Cannon Place, 78 Cannon Street, London EC4N 6AG, Vereinigtes Königreich. Im Vereinigten Königreich autorisiert und beaufsichtigt von der Financial Conduct Authority. Columbia Threadneedle Investments ist der globale Markenname der Columbia- und Threadneedle-Unternehmensgruppe. [columbiathreadneedle.com](https://columbiathreadneedle.com) 359562