

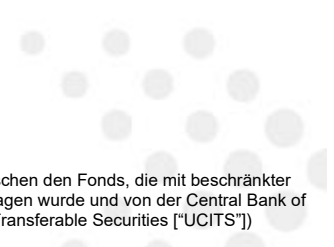


PIMCO

PIMCO ETFs plc

# Halbjahresbericht

30. September 2021



ALLGEMEINE MERKMALE

**Fondstyp:**  
OGAW

**Anzahl der in der Gesellschaft angebotenen Fonds:**  
9 Fonds

**Zum 30. September 2021 angebotene Anteilsklassen der Gesellschaft:\***

CHF (abgesichert) thesaurierend  
EUR thesaurierend  
EUR ausschüttend  
EUR (abgesichert) thesaurierend  
EUR (abgesichert) ausschüttend  
GBP ausschüttend  
GBP (abgesichert) thesaurierend  
GBP (abgesichert) ausschüttend  
USD thesaurierend  
USD ausschüttend

**Art der Anteile:**

Innerhalb jeder Anteilsklasse kann die Gesellschaft, vorbehaltlich des maßgeblichen Nachtrags des Verkaufsprospekts (der „Nachtrag“), ausschüttende Anteile (Anteile, deren Erträge ausgeschüttet werden) und/oder thesaurierende Anteile (Anteile, deren Erträge einbehalten und wiederangelegt werden) ausgeben.

**Nettovermögen (Beträge in Tausend):**  
EUR 9.621.444

**Mindestzeichnungsbetrag:**

Der PIMCO Emerging Markets Advantage Local Bond Index UCITS ETF, der PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF und der PIMCO US Low Duration Corporate Bond UCITS ETF schreiben einen Mindestzeichnungsbetrag von 1.000.000 USD oder die Zeichnung eines Primäranteils vor. Der PIMCO US Short-Term High Yield Corporate Bond Index UCITS ETF schreibt einen Mindestzeichnungsbetrag von 1.000.000 USD (oder dem Gegenwert in der Währung der jeweiligen Anteilsklasse) je Anleger vor.

Der PIMCO Covered Bond UCITS ETF, der PIMCO Euro Low Duration Corporate Bond UCITS ETF und der PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF schreiben einen Mindestzeichnungsbetrag von 1.000.000 EUR oder die Zeichnung eines Primäranteils vor. Der PIMCO Euro Short-Term High Yield Corporate Bond Index UCITS ETF schreibt einen Mindestzeichnungsbetrag von 1.000.000 EUR (oder dem Gegenwert in der Währung der jeweiligen Anteilsklasse) je Anleger vor.

Der PIMCO Sterling Short Maturity UCITS ETF schreibt einen Mindestzeichnungsbetrag von 1.000.000 GBP oder die Zeichnung eines Primäranteils vor.

Der Verwaltungsrat behält sich vor, die Anteilsinhaber in Bezug auf den Mindestbetrag für Erstzeichnungen unterschiedlich zu behandeln und bei bestimmten Anlegern auf einen Mindestzeichnungsbetrag bzw. die Mindesttransaktionsgröße zu verzichten oder diese zu vermindern.

**Handelstag:**

Ein Handelstag ist für den PIMCO Emerging Markets Advantage Local Bond Index UCITS ETF jeder Tag, an dem die Banken in England für den Geschäftsverkehr geöffnet sind. Handelstage für den PIMCO Euro Low Duration Corporate Bond UCITS ETF, den PIMCO Sterling Short Maturity UCITS ETF und den PIMCO US Low Duration Corporate Bond UCITS ETF sind alle Tage, an denen die Banken in London für den Geschäftsverkehr geöffnet sind. Handelstage für den PIMCO Covered Bond UCITS ETF, den PIMCO Euro Short-Term High Yield Corporate Bond Index UCITS ETF und den PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF sind alle Tage, an denen die Deutsche Börse AG und Banken in London für den Geschäftsverkehr geöffnet sind. Handelstage für den PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF und den PIMCO US Short-Term High Yield Corporate Bond Index UCITS ETF sind alle Tage, an denen die NYSE Arca und Banken in London für den Geschäftsverkehr geöffnet sind. Ungeachtet des Vorstehenden gilt ein Tag nicht als Handelstag für die Fonds, wenn es entweder aufgrund gesetzlicher Feiertage oder aufgrund der Schließung eines Markts/einer Börse in einer Rechtsordnung erschwert wird, (i) den Fonds zu verwalten oder (ii) einen Anteil am Vermögen eines Fonds zu bewerten. Die Fonds sind in jedem Jahr am 01. Januar sowie am 24., 25. und 26. Dezember geschlossen.

Handelstage der einzelnen Fonds können aber auch andere Tage sein, die ggf. von der Gesellschaft festgelegt und den Anteilsinhabern im Voraus mitgeteilt werden, sofern es alle 14 Tage mindestens einen Handelstag gibt.

**Funktionale Währung der Fonds:**

Die funktionale Währung des PIMCO Emerging Markets Advantage Local Bond Index UCITS ETF, des PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF, des PIMCO US Low Duration Corporate Bond UCITS ETF und des PIMCO US Short-Term High Yield Corporate Bond Index UCITS ETF ist der US-Dollar (\$) oder USD). Die funktionale Währung des PIMCO Covered Bond UCITS ETF, des PIMCO Euro Low Duration Corporate Bond UCITS ETF, des PIMCO Euro Short-Term High Yield Corporate Bond Index UCITS ETF und des PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF ist der Euro (EUR oder €), und die funktionale Währung des PIMCO Sterling Short Maturity UCITS ETF ist das britische Pfund (GBP oder £).

**Promoter:**

PIMCO Europe Ltd. fungiert als Promoter der Gesellschaft. PIMCO Europe Ltd. wurde von der UK Financial Conduct Authority zugelassen und steht unter deren Aufsicht.

\* Eine vollständige Liste aller während des aktuellen und vorangegangenen Berichtszeitraums ausgegebenen Anteilsklassen ist Erläuterung 15 zu entnehmen. Eine Liste aller für die einzelnen Fonds angebotenen Anteilsklassen ist dem Verkaufsprospekt zu entnehmen.

	Seite
Bericht des Vorsitzenden*	2
Wichtige Informationen über die Fonds	3
Beschreibungen der Benchmark	14
Vermögensaufstellung	16
Gewinn- und Verlustrechnung	20
Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens	24
Aufstellung des Wertpapierbestands	26
Anmerkungen zum Abschluss	76
Wesentliche Veränderungen der Portfoliozusammensetzung	85
Glossar	94
Allgemeine Informationen	95

Fonds	Fonds- zusammen- fassung*	Aufstellung des Wertpapier- bestands
PIMCO Covered Bond UCITS ETF	5	26
PIMCO Emerging Markets Advantage Local Bond Index UCITS ETF	6	29
PIMCO Euro Low Duration Corporate Bond UCITS ETF	7	32
PIMCO Euro Short-Term High Yield Corporate Bond Index UCITS ETF	8	38
PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF	9	43
PIMCO Sterling Short Maturity UCITS ETF	10	50
PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF	11	54
PIMCO US Low Duration Corporate Bond UCITS ETF	12	60
PIMCO US Short-Term High Yield Corporate Bond Index UCITS ETF	13	68

Dieser Halbjahresbericht und ungeprüfte Abschluss (der „Halbjahresbericht“) kann in andere Sprachen übersetzt werden. Jede derartige Übersetzung muss dieselben Informationen enthalten und dieselbe Bedeutung haben wie der Halbjahresbericht in englischer Sprache. Soweit zwischen dem englischsprachigen Halbjahresbericht und dem Halbjahresbericht in einer anderen Sprache Widersprüche bestehen, hat der englischsprachige Halbjahresbericht Vorrang, es sei denn, es ist in irgendeiner Rechtsordnung, in der die Anteile verkauft werden, gesetzlich vorgeschrieben, dass bei einer Klage, die auf Angaben in einem Halbjahresbericht in einer anderen Sprache als Englisch beruht, die Sprache des Halbjahresbericht, auf der diese Klage beruht, maßgeblich ist. Jegliche Streitigkeiten in Bezug auf die Bedingungen des Halbjahresberichts unterliegen ungeachtet der Sprache des Halbjahresberichts irischem Recht und sind nach diesem auszuliegen.

\* Dieses Dokument enthält die Meinungen der Verwaltungsgesellschaft, und diese Meinungen können sich ohne Vorankündigung ändern. Diese Unterlagen wurde ausschließlich zu Informationszwecken verteilt. Prognosen, Schätzungen und bestimmte hierin enthaltene Informationen beruhen auf firmeneigenem Research und sollten nicht als Anlageberatung oder Empfehlung eines bestimmten Wertpapiers, einer bestimmten Strategie oder eines bestimmten Anlageprodukts erachtet werden. Eine Direktanlage in einem nicht aktiv verwalteten Index ist nicht möglich Die hierin enthaltenen Informationen wurden aus Quellen bezogen, die als verlässlich erachtet werden. Eine diesbezügliche Garantie wird jedoch nicht abgegeben. Kein Teil dieses Dokuments darf ohne ausdrückliche schriftliche Zustimmung in jedweder Form reproduziert werden, und es ist ebenso untersagt, in anderen Veröffentlichungen darauf Bezug zu nehmen. PIMCO ist in den USA und weltweit eine Marke von Allianz Asset Management of America L.P. ©2021, PIMCO.

### Sehr geehrte Anteilshaberin, sehr geehrter Anteilshaber,

Wir hoffen, dass Sie und Ihre Familie in diesen schwierigen Zeiten sicher und gesund bleiben. Wir arbeiten weiterhin unermüdlich daran, die Märkte zu erkunden und das Vermögen, das Sie uns anvertraut haben, zu verwalten. Im Anschluss an diesen Bericht folgt der Halbjahresbericht von PIMCO ETFs plc für den sechsmonatigen Berichtszeitraum zum 30. September 2021. Auf den nachfolgenden Seiten finden Sie nähere Einzelheiten zu den Anlageergebnissen sowie eine Erörterung der Faktoren, die während des Berichtszeitraums den stärksten Einfluss auf die Wertentwicklung hatten.

### Für den sechsmonatigen Berichtszeitraum zum 30. September 2021

Die Weltwirtschaft war weiterhin von der COVID-19-Pandemie („COVID-19“) betroffen. In seinem im Oktober 2021 (nach Ende des Berichtszeitraums) veröffentlichten World Economic Outlook erklärte der Internationale Währungsfonds („IWF“), er rechne damit, dass das US-BIP 2021 um 6,0 % wachsen werde, nach einem Rückgang von 3,4 % im Jahr 2020. In der Eurozone, Großbritannien und Japan schätzte der IWF das BIP-Wachstum im Jahr 2021 derweil auf jeweils 5,0 % bzw. 6,8 % bzw. 2,4 %. Zum Vergleich: 2020 wurde für diese Länder ein BIP-Rückgang von 6,3 %, 9,8 % und 4,6 % prognostiziert.

Vor diesem Hintergrund hielten Zentralbanken außerhalb der USA an ihren aggressiven Maßnahmen zur Unterstützung ihrer Volkswirtschaften fest. Die Europäische Zentralbank (die „EZB“) hielt die Zinssätze auf einem Allzeittief und setzte ihr Programm zum Ankauf von Vermögenswerten fort. Im Juli 2021 kündigte die EZB ihre erste Strategieüberprüfung seit 2003 an und legte ein mittelfristiges Inflationsziel von 2 % fest, während das vorherige Inflationsziel knapp unter 2 % lag. Schließlich ließ die EZB bei ihrer Sitzung im September 2021 ihre Leitzinsen unverändert, reduzierte aber im vierten Quartal 2021 „moderat“ ihr Tempo bei den Anleihekäufen. Die Bank of England hielt ihren Leitzins auf einem Rekordtief von 0,10 % und setzte ihr Anleihekaufprogramm fort. Im Juni 2021 gab die Bank of England bekannt, dass sie keine Anhebung der Leitzinsen erwarten würde, bis klare Belege vorliegen, dass erhebliche Fortschritte bei der Beseitigung freier Kapazitäten und der Erreichung ihres Inflationsziels von 2 % erzielt wurden. Die Bank of Japan beließ unterdessen ihren kurzfristigen Zinssatz unverändert bei -0,10 % und erhöhte das Ziel für ihre Bestände an Unternehmensanleihen. Im Juni 2021 hat sie die Frist für das Hilfsprogramm COVID-19 im September um mindestens sechs Monate verlängert.

Trotz verbesserter Wirtschaftsdaten und Inflationserwartung hielt die US-Notenbank (die „Fed“) an ihrer lockeren Geldpolitik fest. Dies umfasste die Beibehaltung der Federal Funds Rate auf einem Allzeittief in einer Spanne zwischen 0,00 % und 0,25 % sowie den fortgesetzten Kauf von US-Schatzpapieren für mindestens 80 Mrd. USD pro Monat und Agency Mortgage-Backed Securities für mindestens 40 Mrd. USD pro Monat. Bei ihrer Sitzung vom Juni 2021 hob die Fed jedoch ihre Prognose für die ersten Zinserhöhungen an. Zum Zeitpunkt dieses Schreibens erwartet die Zentralbank bis Ende 2023 zwei Zinserhöhungen. In ihren Prognosen vom März 2021 erwartete die Fed bis mindestens 2024 keine Anhebung. Darüber hinaus hielt der Fed-Vorsitzende Jerome Powell an seiner Einschätzung zur Inflation fest und sagte: „Da diese vorübergehenden Angebotseffekte nachlassen, wird erwartet, dass die Inflation wieder in Richtung unseres längerfristigen Ziels zurückgeht.“ Schließlich gab die Fed auf ihrer Sitzung vom 21. September bekannt: „Wenn sich die [wirtschaftlichen] Fortschritte weitgehend wie erwartet fortsetzen, ist der Ausschuss der Auffassung, dass eine Mäßigung des Tempos der Anleihekäufe bald angezeigt sein könnte.“

Die kurzfristigen Renditen der US-Schatzanleihen stiegen, während die langfristigen Renditen im Berichtszeitraum zurückgingen. Die Rendite auf die als Benchmark angesetzten 10-jährigen US-Staatsanleihen lag zum Ende des Berichtszeitraums bei 1,52 %, nachdem sie zum 31. März 2021 noch 1,74 % betragen hatte. Der Bloomberg Global Treasury Index (USD Hedged), der festverzinsliche, auf Lokalwährung lautende staatliche Schuldtitel von Ländern mit Investment Grade-Rating abdeckt und sowohl Industrie- als auch Schwellenländer umfasst, erzielte eine Rendite von 0,71 %. Der Bloomberg Global Aggregate Credit Index (USD Hedged), ein weitläufig verwendeter Index für globale Anleihen mit Investment Grade-Rating, rentierte derweil mit 2,17 %. Mit höherem Risiko behaftete festverzinsliche Anlageklassen wie etwa hochverzinsliche Unternehmensanleihen und Schuldtitel aus Schwellenländern rentierten allgemein höher. Der ICE BofAML Developed Markets High Yield Constrained Index (USD Hedged), ein gängiger Index für Anleihen unterhalb von Investment Grade, verzeichnete eine Rendite von 3,38 %, während Auslandsschulden von Schwellenländern, die vom JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global (USD Hedged) abgebildet werden, mit 3,38 % rentierten. Auf Landeswährungen lautende Schwellenmarktanleihen, die vom JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (Unhedged) abgebildet werden, rentierten mit 0,32 %.

Trotz Phasen der Volatilität erzielten weltweite Aktien insgesamt solide Ergebnisse. US-Aktien verzeichneten gemessen am S&P 500 Index insgesamt ein Plus von 9,18 %, teilweise aufgrund starker Anlegernachfrage. Die am MSCI World Index gemessenen weltweiten Aktien rentierten mit 7,74 %, während Aktien aus Schwellenländern gemessen am MSCI Emerging Markets Index eine Rendite von -3,45 % erzielten. Japanische Aktien verbuchten derweil am Nikkei 225 Index (in JPY) gemessen ein Plus von 1,63 %, während die vom MSCI Europe Index (in EUR) abgebildeten europäischen Aktien mit 7,25 % rentierten.

Die Rohstoffpreise waren volatil, erzielten aber positive Ergebnisse. Zu Beginn des Berichtszeitraums notierte Rohöl der Sorte Brent noch bei etwa 63 USD je Barrel, Brent Rohöl beendete den Berichtszeitraum mit rund 79 USD pro Barrel. Wir glauben, dass ein Treiber für den Anstieg des Ölpreises die stärkere Nachfrage ist, da sich das globale Wachstum verbesserte. Auch die Gold- und Kupferpreise tendierten aufwärts.

An den Devisenmärkten schließlich wurden ebenfalls Phasen erhöhter Volatilität verzeichnet, was unserer Einschätzung nach auf Wachstumserwartungen, eine veränderte geldpolitische Ausrichtung der Zentralbanken, steigende Inflation sowie verschiedene geopolitische Ereignisse zurückzuführen war. Der US-Dollar wertete gegenüber mehreren bedeutenden Währungen auf. So gab der US-Dollar gegenüber dem Euro, dem britischen Pfund und dem japanischen Yen beispielsweise jeweils um 1,28 %, 2,24 % bzw. 0,51 % nach.

Vielen Dank für das Vertrauen, das Sie PIMCO entgegengebracht haben. Wir freuen uns, Ihnen unsere globalen ETF-Produkte anbieten zu dürfen. Von unseren ETF-Produkten können Sie das für PIMCO typische Engagement in Bezug auf herausragende Leistungen im Risikomanagement und in der Erzielung von Renditen erwarten. Bei Fragen in Bezug auf die PIMCO ETFs plc wenden Sie sich bitte an die Londoner Geschäftsstelle unter der Rufnummer **+44 (0)20 3640 1000** oder für Fragen betreffend den operativen Betrieb an den Administrator unter **+353 (0)1 776 9990**. Weitere Informationen finden Sie auch unter <https://www.pimco.co.uk/en-gb/investments/etfs>.

Blieben Sie sicher und gesund,



Craig A. Dawson  
Vorsitzender

Die Wertentwicklung in der Vergangenheit bietet keine Garantie für künftige Ergebnisse. Sofern nichts Anderweitiges angegeben ist, spiegeln Indexrenditen die Wiederanlage etwaiger Ertragsausschüttungen und Kapitalgewinne wider; Gebühren, Maklerprovisionen und sonstige Anlagekosten bleiben jedoch unberücksichtigt. Eine Direktanlage in einem nicht aktiv verwalteten Index ist nicht möglich.

Dieses Dokument darf nur in Verbindung mit dem aktuellen Verkaufsprospekt der Gesellschaft verwendet werden. Anleger sollten vor einer Anlage die Anlageziele, Risiken, Gebühren und Aufwendungen jedes Fonds sorgfältig abwägen. Diese und andere Informationen sind im Prospekt enthalten. Bitte lesen Sie den Verkaufsprospekt sorgfältig, bevor Sie eine Anlage tätigen oder Geld überweisen.

Der PIMCO Emerging Markets Advantage Local Bond Index UCITS ETF, der PIMCO Euro Short-Term High Yield Corporate Bond Index UCITS ETF und der PIMCO US Short-Term High Yield Corporate Bond Index UCITS ETF sind börsengehandelte Fonds (Exchange-Traded Funds, „ETFs“), die eine Rendite erzielen sollen, die möglichst genau die Gesamrendite vor Abzug von Gebühren und Aufwendungen des angegebenen Index abbilden sollen (zusammen die „passiv verwalteten Fonds“). Die passiv verwalteten Fonds verfolgen bei der Erreichung ihres Anlageziels eine repräsentative Stichprobenstrategie; daher kann es sein, dass die Fonds nicht alle im zugrunde liegenden Index enthaltenen Wertpapiere halten. Der PIMCO Covered Bond UCITS ETF, der PIMCO Euro Low Duration Corporate Bond UCITS ETF, der PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF, der PIMCO Sterling Short Maturity UCITS ETF, der PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF und der PIMCO US Low Duration Corporate Bond UCITS ETF sind im Gegensatz zu passiven Fonds aktiv verwaltete ETFs, die nicht die Abbildung der Wertentwicklung eines bestimmten Index anstreben (zusammen die „aktiv verwalteten Fonds“ und zusammen mit den passiv verwalteten Fonds die „Fonds“). Der PIMCO Emerging Markets Advantage Local Bond Index UCITS ETF, der PIMCO Sterling Short Maturity UCITS ETF, der PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF der PIMCO US Low Duration Corporate Bond UCITS ETF und der PIMCO US Short-Term High Yield Corporate Bond Index UCITS ETF werden an der Euronext Dublin („Euronext“) notiert und an der London Stock Exchange gehandelt. Die Anteile des PIMCO Covered Bond UCITS ETF, des PIMCO Euro Low Duration Corporate Bond UCITS ETF, des PIMCO Euro Short-Term High Yield Corporate Bond Index UCITS ETF und des PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF sind an der Deutsche Börse AG zugelassen und werden dort zu Marktpreisen gehandelt. Die Fonds sind auch auf anderen Sekundärmärkten zugelassen und werden dort gehandelt. Der Marktpreis für die Anteile der jeweiligen Fonds kann vom Nettoinventarwert („NIW“) des Fonds abweichen. Die Ausgabe und Rücknahme von Anteilen jedes Fonds (mit Ausnahme des PIMCO Euro Short-Term High Yield Corporate Bond Index UCITS ETF und des PIMCO US Short-Term High Yield Corporate Bond Index UCITS ETF) erfolgen zum jeweiligen Nettoinventarwert in Blöcken einer spezifizierten Anzahl von Anteilen („Primäranteile“). Nur bestimmte große institutionelle Anleger dürfen Primäranteile direkt bei den Fonds zum NIW kaufen oder zurückgeben („befugte Teilnehmer“). Anleger am Sekundärmarkt können ihre Anteile in Situationen, in denen der Börsenwert der Anteile sich erheblich vom NIW unterscheidet, direkt zurückgeben. Diese Transaktionen werden im Tausch gegen bestimmte Wertpapiere, die ähnlich zum Portfolio eines Fonds sind, und/oder gegen Barzahlung durchgeführt.

Die Fonds investieren in bestimmte Segmente des Wertpapiermarktes, die nicht repräsentativ für die breiteren Wertpapiermärkte sind. Zwar sind wir der Ansicht, dass Rentenfonds eine wichtige Rolle in einem breit gestreuten Anlageportfolio spielen, dennoch sollte eine Anlage in einem Fonds alleine kein vollständiges Anlageprogramm darstellen. Es ist zu beachten, dass in einem Umfeld potenziell steigender Zinsen ein tatsächlicher Zinsanstieg die Wertentwicklung der meisten Rentenfonds nachteilig beeinflussen würde und dass die von den Fonds gehaltenen festverzinslichen Wertpapiere wahrscheinlich an Wert verlieren werden. Auch die Preisvolatilität festverzinslicher Wertpapiere kann bei steigenden Zinssätzen zunehmen, was zu erhöhten Verlusten für die Fonds führen könnte. Rentenfonds und einzelne Anleihen mit einer längeren Duration (eine Kennzahl für die erwartete Laufzeit eines Wertpapiers) sind meist anfälliger für Zinsänderungen, weshalb sie normalerweise volatil sind als Wertpapiere oder Fonds mit einer kürzeren Duration.

Die Fonds können zusätzlich zu den vorstehend, im Verkaufsprospekt der Fonds und im Abschnitt „Finanzrisiken“ in den Erläuterungen zum Abschluss beschriebenen Risiken weiteren Risiken unterliegen. Zu diesen Risiken gehören insbesondere die folgenden: Markthandelsrisiko, Zinsrisiko, Kreditrisiko, Marktrisiko, Liquiditätsrisiko, Derivatrisiko, Hebelrisiko, Emittentenrisiko, Risiko in Verbindung mit hypotheckenbesicherten und sonstigen besicherten Wertpapieren, Risiko von Auslandsanlagen, Schwellenländerisiko und Management-Risiko. Eine vollständige Beschreibung dieser und anderer Risiken ist im Verkaufsprospekt der Gesellschaft enthalten. Die Fonds können derivative Finanzinstrumente zu Sicherungszwecken oder als Teil einer Anlagestrategie einsetzen. Der Einsatz dieser Instrumente ist mit bestimmten Kosten und Risiken wie Liquiditätsrisiko, Zinsrisiko, Marktrisiko, Kreditrisiko, Management-Risiko sowie dem Risiko verbunden, dass ein Fonds eine Position nicht dann glattstellen konnte, wenn es am vorteilhaftesten wäre. Ein Fonds konnte mehr als den in diese derivativen Finanzinstrumente investierten Kapitalbetrag verlieren. Die Bonität eines bestimmten Wertpapiers oder einer bestimmten Gruppe von Wertpapieren kann nicht die Stabilität oder Sicherheit des gesamten Portfolios garantieren.

Die Klassifizierung der Portfoliositionen eines Fonds in diesem Bericht erfolgt gemäß den Vorschriften für die Finanzberichterstattung. Die Einstufung einer bestimmten Portfoliosition im Abschnitt mit der Aufstellung der Wertpapieranlagen in diesem Bericht kann von der Einstufung abweichen, die für die Compliance-Berechnungen eines Fonds verwendet wird. Dies gilt unter anderem für diejenigen, die jeweils im Verkaufsprospekt, in den Anlagezielen oder in aufsichtsrechtlichen und anderen Anlagebeschränkungen und -richtlinien des Fonds verwendet werden, welche gegebenenfalls auf anderen Klassifizierungen in Bezug auf Anlageklassen, Sektoren oder geografische Regionen beruhen können. Alle Fonds werden bezüglich der Einhaltung der im Verkaufsprospekt sowie in maßgeblichen Vorschriften enthaltenen Anforderungen separat überwacht.

Die geografischen Klassifizierungen von Wertpapieren in diesem Bericht richten sich nach dem Gründungsland des jeweiligen Unternehmens. Unter bestimmten Umständen kann das Gründungsland eines Wertpapiers vom Land, in dem es wirtschaftlich engagiert ist, abweichen.

Bestimmte Wertpapiere und Instrumente, in die ein Fonds investieren kann, stützen sich gegebenenfalls in bestimmter Weise auf den London Interbank Offered Rate („LIBOR“). Der LIBOR ist ein durchschnittlicher Zinssatz, den die ICE Benchmark Administration bestimmt und den sich Banken gegenseitig für die Nutzung kurzfristiger Geldmittel berechnen. Die Financial Conduct Authority („FCA“) des Vereinigten Königreichs, die den LIBOR reguliert, hat Pläne angekündigt, die Verwendung des LIBOR bis Ende 2021 auslaufen zu lassen. Es besteht weiterhin Ungewissheit hinsichtlich der zukünftigen Nutzung des LIBOR und des Charakters eines etwaigen Ersatzzinssatzes (z. B. des besicherten Tagesgeldsatzes (Secured Overnight Financing Rate), der den USD-LIBOR ersetzen soll und die Kosten von Übernachtskrediten in der Form von mit US-Schatzpapieren besicherten Pensionsgeschäften misst.). Die möglichen Auswirkungen des Übergangs weg vom LIBOR auf einen Fonds oder auf bestimmte Wertpapiere und Instrumente, in die ein Fonds investiert, lassen sich gegebenenfalls nur mit Schwierigkeiten ermitteln, und sie können in Abhängigkeit von u. a. den folgenden Faktoren unterschiedlich ausfallen: (i) bestehende Ausweich- oder Kündigungsbestimmungen in Einzelverträgen und (ii) ob, wie und wann die Branchenteilnehmer neue Referenzzinssätze und Ausweichregelungen sowohl für bestehende als auch für neue Produkte und Instrumente entwickeln und annehmen.

Beispielsweise können bestimmte Wertpapiere und Anlagen eines Fonds einzelne Verträge beinhalten, die keine bestehende Ausweichklausel oder Formulierung beinhalten, die die Abschaffung des LIBOR vorsieht, und diese Anlagen könnten infolge des Übergangsprozesses eine erhöhte Volatilität oder eine verringerte Liquidität verzeichnen. Darüber hinaus müssen die in solchen Verträgen enthaltenen Zinsbestimmungen möglicherweise unter Berücksichtigung des Übergangs weg vom LIBOR neu ausgehandelt werden. Der Übergang kann außerdem zu einer Verringerung des Werts bestimmter von einem Fonds gehaltener Anlagen oder zu einer Verringerung der Wirksamkeit damit verbundener Fondstransaktionen wie z.B. Absicherungen führen. Darüber hinaus kann der Übergangsprozess auch Änderungen an den Anlagezielen und der Anlagepolitik eines Fonds erfordern. Derartige Auswirkungen des Übergangs weg vom LIBOR sowie andere unvorhergesehene Auswirkungen könnten dazu führen, dass ein Fonds Verluste erleidet oder zusätzliche Kosten tragen muss.

Die Grafik zur Netto-Wertentwicklung in jeder in diesem Halbjahresbericht enthaltenen Fondszusammenfassung misst die Wertentwicklung unter der Annahme, dass sämtliche Dividendenausschüttungen und Ausschüttungen von Kapitalgewinnen reinvestiert werden. Die Renditen verstehen sich ohne Abzug von Steuern, die ein Anteilinhaber für folgende Sachverhalte zu zahlen hatte: (i) Ausschüttungen der Fonds; oder (ii) Rückgabe von Fondsanteilen. Die Grafik zur Netto-Wertentwicklung misst die Wertentwicklung jedes Fonds im Vergleich zur Wertentwicklung eines breit angelegten Wertpapiermarktindex (Benchmarkindex). Die Wertentwicklung eines Fonds in der Vergangenheit (vor und nach Steuern) ist nicht unbedingt ein Hinweis auf die künftige Wertentwicklung des Fonds. Eine Anlage in einem Fonds ist keine Einlage bei einer Bank und ist nicht durch die Bundeseinlagenversicherung der USA (Federal Deposit Insurance Corporation) oder eine andere staatliche Behörde garantiert oder versichert. Durch Anlagen in den Fonds kann es zum Verlust von Geldern kommen.

Eine Anlage in einem Fonds ist keine Einlage bei einer Bank und ist nicht durch eine staatliche Behörde garantiert oder versichert. Der Wert und die Erträge der Aktien des Fonds können steigen oder fallen und es ist möglich, dass Sie den Betrag, den Sie in Fonds investiert haben, nicht zurückerhalten.

Die Fonds können eine vollständige Aufstellung der Portfoliositionen und ihres prozentualen Anteils am Nettovermögen des jeweiligen Fonds zur Verfügung stellen. An jedem Geschäftstag, vor Beginn des Handels an den relevanten Börsen (wie im Verkaufsprospekt definiert), veröffentlicht jeder Fonds unter <https://www.pimco.co.uk/en-gb/investments/etfs> Bezeichnungen und die Mengen der Portfoliositionen des Fonds; diese Angaben bilden die Grundlage für die Berechnung des Nettoinventarwerts des Fonds am Ende des entsprechenden Geschäftstages. Die Factsheets der Fonds bieten zusätzliche Informationen in Bezug auf einen Fonds und können telefonisch unter der Rufnummer +44 (0) 20 3640 1000 angefordert werden.



Gesamtrendite nach Gebühren und Aufwendungen für den Zeitraum zum 30. September 2021<sup>1</sup>

	6 Monate	Seit Auflegung der Klasse
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
EUR ausschüttend (aufgelegt am 17. Dez. 2013)	(0,54 %)	2,39 %
Bloomberg Euro Aggregate Covered 3 % Cap	(0,52 %)	1,77 %

<sup>1</sup> Annualisierte Wertentwicklung für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Fonds verfolgt das Anlageziel, in Einklang mit umsichtiger Anlageverwaltung den Gesamtertrag zu maximieren. Dieses Ziel strebt der Fonds an durch die Anlage in ein aktiv gemanagtes Portfolio aus festverzinslichen Wertpapieren (wie im Verkaufsprospekt definiert). Davon werden gemäß den im Verkaufsprospekt dargelegten Richtlinien mindestens 80 % in Covered Bonds (gedeckte Schuldverschreibungen) investiert. Covered Bonds sind Wertpapiere, die von einem Finanzinstitut emittiert und durch eine Gruppe von Krediten in der Bilanz des Finanzinstituts (dem so genannten Deckungsstock) besichert werden.

Wertentwicklung des Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Die Wertpapierausswahl bei gedeckten Anleihen, insbesondere bei in Großbritannien emittierten gedeckten Anleihen, trug zur relativen Wertentwicklung bei.
- » Das moderate langfristige Engagement in US-Duration im mittleren Teil der Kurve trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Kurse im 10- bis 30-jährigen Teil der Kurve stiegen.
- » Die Übergewichtung im mittleren Teil der britischen Kurve im Vergleich zum längeren Ende beeinträchtigte die relative Wertentwicklung, da die Zinsen am längeren Ende eine Outperformance zeigten.

Gesamtrendite nach Gebühren und Aufwendungen für den Zeitraum zum 30. September 2021<sup>1</sup>

Auf USD lautende Klassen	6 Monate	Seit Auflegung der Klasse
USD thesaurierend (aufgelegt am 19. Sept. 2011)	1,52 %	0,52 %
USD ausschüttend (aufgelegt am 23. Jan. 2014)	1,54 %	0,80 %
PIMCO Emerging Markets Advantage Local Currency Bond Index	1,82 %	1,07 % <sup>2</sup>

<sup>1</sup> Annualisierte Wertentwicklung für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Das Anlageziel des Fonds besteht darin, eine Rendite zu erzielen, die vor Kosten und Gebühren dem Gesamtertrag des PIMCO Emerging Markets Advantage Local Currency Bond Index (der „Index“) entspricht. Der Fonds investiert sein Vermögen in ein diversifiziertes Portfolio von nicht auf den US-Dollar lautenden festverzinslichen Instrumenten (gemäß der im Verkaufsprospekt angegebenen Definition), welches sich, soweit dies möglich und praktisch umsetzbar ist, aus den Wertpapieren zusammensetzt, die die Komponenten des Index bilden. Der Fonds kann direkt in die Wertpapiere investieren, die eine Komponente des Index bilden, oder über derivative Instrumente wie Swaps ein indirektes Engagement in diesen Wertpapieren eingehen. Der Index bildet die Wertentwicklung eines BIP-gewichteten Korbs lokaler Schwellenländer-Staatsanleihen, Währungen oder Devisenterminkontrakte ab, vorbehaltlich eines Maximalengagements von 15 % je Land.

Wertentwicklung des Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Das Engagement des Fonds in Lokalwährungen von Schwellenländern wie dem brasilianischen Real, dem mexikanischen Peso, der indonesischen Rupiah, dem chinesischen Yuan und dem russischen Rubel wirkte sich positiv auf die Wertentwicklung aus, da diese Währungen gegenüber dem US-Dollar aufwerteten.
- » Das Engagement des Fonds in lokaler Duration der Schwellenländer Südafrika, Indonesien und China wirkte sich positiv auf die Wertentwicklung aus, da die lokalen Renditen in diesen Ländern allgemein zurückgingen.
- » Das Engagement des Fonds in Lokalwährungen von Schwellenländern wie dem thailändischen Bhat, dem chilenischen Peso und dem philippinischen Peso wirkte sich negativ auf die Wertentwicklung aus, da diese Währungen gegenüber dem US-Dollar abwerteten.
- » Das Engagement des Fonds in lokaler Duration der Schwellenländer Brasilien, Mexiko, Chile und Russland wirkte sich negativ auf die Wertentwicklung aus, da die lokalen Renditen stiegen.



Gesamtrendite nach Gebühren und Aufwendungen für den Zeitraum zum 30. September 2021<sup>1</sup>

Auf EUR lautende Klassen	6 Monate	Seit Auflegung der Klasse
EUR ausschüttend (aufgelegt am 17. Nov. 2014)	0,33 %	1,47 %
ICE BofAML Euro Corporate Bond 1-5 Year Index	0,32 %	1,18 %

<sup>1</sup> Annualisierte Wertentwicklung für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Fonds verfolgt das Anlageziel, in Einklang mit umsichtiger Anlageverwaltung den Gesamtertrag zu maximieren. Der Fonds strebt sein Anlageziel an, indem er primär in ein aktiv verwaltetes diversifiziertes Portfolio von auf den Euro lautenden festverzinslichen Unternehmensanleihen mit Investment Grade (gemäß der im Verkaufsprospekt angegebenen Definition) investiert. Der Fonds setzt zur Auswahl seiner Anlagen nach Möglichkeit das gesamtertragsorientierte Anlageverfahren und die Philosophie der Anlageberater ein. Es werden Top-down- und Bottom-up-Strategien verfolgt, um verschiedene diversifizierte Werttreiber ausfindig zu machen und so beständige Erträge zu erwirtschaften. Top-down-Strategien werden herangezogen unter Berücksichtigung gesamtwirtschaftlicher Einschätzungen der Kräfte, die sich mittelfristig auf die Weltwirtschaft und die Finanzmärkte auswirken dürften. Bottom-up-Strategien liegen dem Verfahren zur Einzeltitelauswahl zugrunde und dienen der Ermittlung und Analyse unterbewerteter Wertpapiere.

Wertentwicklung des Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Makrostrategien und insbesondere die Positionierung der Euro-Kurve trugen zur Wertentwicklung bei.
- » Die Titelauswahl im Energiesektor (ohne Pipelinebau und -betrieb) trug zur Wertentwicklung bei, da bestimmte ausgewählte Emittenten überdurchschnittlich abschnitten.
- » Die Titelauswahl im übrigen Finanzsektor trug zur Wertentwicklung bei, da ausgewählte Emittenten überdurchschnittlich abschnitten.
- » Die Titelauswahl im Baustoffsektor belastete die Wertentwicklung, da sich ein ausgewählter Emittent unterdurchschnittlich entwickelte.
- » Die Wertpapierauswahl in den Schwellenländern und insbesondere die Übergewichtung eines ausgewählten chinesischen Immobilienemittenten beeinträchtigte die Wertentwicklung, da sie sich unterdurchschnittlich entwickelte.

Gesamtrendite nach Gebühren und Aufwendungen für den Zeitraum zum 30. September 2021<sup>1</sup>

	6 Monate	Seit Auflegung der Klasse
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
EUR thesaurierend (aufgelegt am 09. Okt. 2017)	1,69 %	2,05 %
EUR ausschüttend (aufgelegt am 09. Okt. 2017)	1,67 %	2,06 %
ICE BofAML 0-5 Year Euro Developed Markets High Yield 2 % Constrained Index	1,98 %	2,65 %

<sup>1</sup> Annualisierte Wertentwicklung für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Fonds verfolgt das Anlageziel, einen Ertrag zu erwirtschaften, der vor Gebühren und Aufwendungen möglichst genau dem Gesamtertrag des ICE BofAML 0-5 Year Euro Developed Markets High Yield 2 % Constrained Index (der „Index“) entspricht. Der Fonds investiert sein Vermögen in ein diversifiziertes Portfolio von auf Euro lautenden festverzinslichen Instrumenten (gemäß der im Verkaufsprospekt angegebenen Definition) welches, soweit dies möglich und praktisch umsetzbar ist, aus den Wertpapieren besteht, die die Komponenten des Index bilden. Der Fonds kann direkt in die Wertpapiere investieren, die eine Komponente des Index bilden, oder über derivative Instrumente wie Swaps ein indirektes Engagement in diesen Wertpapieren eingehen. Der Index bildet die Wertentwicklung kurzlaufender auf Euro lautender Unternehmensanleihen unter Investment-Grade nach, die auf dem Euro-Inlandsmarkt oder den Eurobond-Märkten öffentlich emittiert werden, darunter auch Anleihen, „Pay-In-Kind“-Wertpapiere und Toggle Notes. Sich eignende Wertpapiere müssen eine Restlaufzeit von unter fünf Jahren, ein Rating unter Investment-Grade (basierend auf einem Durchschnitt von Moody's, S&P und Fitch), einen festen Zinszahlungsplan und ein im Umlauf befindliches Mindestvolumen von 250 Mio. EUR haben. Ferner müssen Emittenten geeigneter Wertpapiere ihren Sitz in Investment-Grade-Ländern haben, die Mitglieder der G10-Staaten, Westeuropas oder Territorien der USA und Westeuropas sind oder einen wesentlichen Teil ihrer Geschäftstätigkeit dort ausüben.

Wertentwicklung des Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Die Titelauswahl im Glücksspiel- und Hotelsektor trug zur Wertentwicklung bei, da ein ausgewählter Emittent überdurchschnittlich abschnitt.
- » Die Titelauswahl im Automobilssektor wirkte sich positiv auf die Wertentwicklung aus.
- » Die Titelauswahl im Metall- und Bergbausektor belastete die Wertentwicklung, da sich ein untergewichteter Emittent überdurchschnittlich entwickelte.
- » Die Wertpapierauswahl im Sektor der auf gewerbliche Hypothekendarlehen gestützten Wertpapiere und Immobilieninvestitionskredite wirkte sich negativ auf die Wertentwicklung aus, da ausgewählte Emittenten unterdurchschnittlich abschnitten.
- » Die Wertpapierauswahl im Energiesektor beeinträchtigte die Wertentwicklung.

Gesamtrendite nach Gebühren und Aufwendungen für den Zeitraum zum 30. September 2021<sup>1</sup>

Auf EUR lautende Klassen	6 Monate	Seit Auflegung der Klasse
EUR thesaurierend (aufgelegt am 30. Apr. 2015)	(0,18 %)	(0,37 %)
EUR ausschüttend (aufgelegt am 11. Jan. 2011)	(0,19 %)	0,25 %
Euro Short-Term Rate (ESTER)	(0,29 %)	(0,12 %) <sup>2</sup>

<sup>1</sup> Annualisierte Wertentwicklung für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Das Anlageziel des Fonds besteht darin, einen maximalen laufenden Ertrag bei Kapitalerhalt und täglicher Liquidität zu erzielen. Der Fonds investiert primär in ein aktiv verwaltetes diversifiziertes Portfolio von auf den Euro lautenden festverzinslichen Wertpapieren (gemäß der im Verkaufsprospekt angegebenen Definition) mit unterschiedlichen Laufzeiten, darunter Staatsanleihen und von Regierungen, ihren Organen, Behörden oder Körperschaften begebene oder garantierte Wertpapiere, Unternehmensanleihen und hypotheckenbesicherte oder sonstige besicherte Wertpapiere (MBS- und ABS-Titel). Der Fonds kann versuchen, am Markt ein Engagement in den Wertpapieren, in die er primär investiert, einzugehen, indem er eine Reihe von Kauf- und Verkaufsverträgen abschließt oder andere Anlagetechniken (wie z. B. Rückkäufe) einsetzt. Es wird erwartet, dass die gewichtete durchschnittliche Laufzeit des Fonds 3 Jahre nicht übersteigen wird. Die durchschnittliche Duration des Fondsportfolios wird auf Grundlage der Zinsprognosen der Anlageberater bis zu einem Jahr betragen. Der Fonds investiert ausschließlich in Titel mit Investment-Grade, die von Moody's mit einem Rating von Baa3 bzw. von S&P mit einem Rating von BBB- oder von Fitch mit einem äquivalenten Rating bewertet wurden (bzw. die, sollte kein Bonitätsrating vorliegen, nach Ansicht der Anlageberater von vergleichbarer Qualität sind). Der Fonds darf maximal 5 Prozent seines Vermögens in festverzinsliche Wertpapiere aus Schwellenmärkten investieren.

Wertentwicklung des Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Ein Long-Engagement in Unternehmensanleihen, insbesondere im Investment-Grade-Finanzsektor, wirkte sich positiv auf die absolute Wertentwicklung aus, da sich die Spreads verengten.
- » Die Titelauswahl in verbrieften Schuldtiteln, vornehmlich europäischen RMBS, wirkte sich positiv auf die absolute Wertentwicklung aus.
- » Ein Engagement in den negativen Euro-Barzinsen schmälerte die Wertentwicklung.

Gesamtrendite nach Gebühren und Aufwendungen für den Zeitraum zum 30. September 2021<sup>1</sup>

	6 Monate	Seit Auflegung der Klasse
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
GBP ausschüttend (aufgelegt am 10. Jun. 2011)	0,09 %	0,77 %
ICE BofAML Sterling Govt Bill Index	0,02 %	0,49 %

<sup>1</sup> Annualisierte Wertentwicklung für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Das Anlageziel des Fonds besteht darin, einen maximalen laufenden Ertrag bei Kapitalerhalt und täglicher Liquidität zu erzielen. Der Fonds investiert primär in ein aktiv verwaltetes diversifiziertes Portfolio von auf das britische Pfund lautenden festverzinslichen Wertpapieren (gemäß der im Verkaufsprospekt angegebenen Definition) mit unterschiedlichen Laufzeiten, darunter Staatsanleihen und von Regierungen, ihren Organen, Behörden oder Körperschaften begebene oder garantierte Wertpapiere, Unternehmensanleihen und ungehebelte hypothekenbesicherte oder sonstige besicherte Wertpapiere (MBS- und ABS-Titel). Der Fonds kann versuchen, am Markt ein Engagement in den Wertpapieren, in die er primär investiert, einzugehen, indem er eine Reihe von Kauf- und Verkaufsverträgen abschließt oder andere Anlagetechniken (wie z. B. Rückkäufe) einsetzt. Der Fonds darf ohne Einschränkungen in hypothekenbesicherte oder sonstige besicherte Wertpapiere (MBS- und ABS-Titel) investieren. Es wird erwartet, dass die gewichtete durchschnittliche Laufzeit des Fonds 3 Jahre nicht übersteigen wird. Die durchschnittliche Duration des Fondsportfolios wird auf Grundlage der Zinsprognosen der Anlageberater bis zu einem Jahr betragen. Der Fonds investiert ausschließlich in Titel mit Investment-Grade, die von Moody's mit einem Rating von Baa3 bzw. von S&P mit einem Rating von BBB- oder von Fitch mit einem äquivalenten Rating bewertet wurden (bzw. die, sollte kein Bonitätsrating vorliegen, nach Ansicht der Anlageberater von vergleichbarer Qualität sind). Der Fonds darf maximal 5 Prozent seines Vermögens in festverzinsliche Wertpapiere aus Schwellenmärkten investieren.

Wertentwicklung des Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Die Titelauswahl in verbrieften Schuldtiteln, vornehmlich europäischen RMBS, wirkte sich positiv auf die absolute Wertentwicklung aus.
- » Ein Long-Engagement in Investment-Grade-Unternehmensanleihen, vornehmlich aus dem Finanzsektor, wirkte sich positiv auf die absolute Wertentwicklung aus, da sich die Spreads verengten.
- » Ein Long-Engagement in britischer Duration wirkte sich negativ auf die absolute Wertentwicklung aus, da die Renditen stiegen.

Gesamtrendite nach Gebühren und Aufwendungen für den Zeitraum 30. September 2021<sup>1</sup>

	6 Monate	Seit Auflegung der Klasse
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
USD ausschüttend (aufgelegt am 22. Feb. 2011)	0,21 %	1,35 %
FTSE 3-Month Treasury Bill Index	0,02 %	0,57 %
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Sep. 2019)	0,15 %	0,46 %
ICE BofAML 3-Month Treasury Bill Index (GBP Hedged)	(0,03 %)	0,10 %

<sup>1</sup> Annualisierte Wertentwicklung für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Das Anlageziel des Fonds besteht darin, einen maximalen laufenden Ertrag bei Kapitalerhalt und täglicher Liquidität zu erzielen. Der Fonds investiert primär in ein aktiv verwaltetes diversifiziertes Portfolio von auf US-Dollar lautenden festverzinslichen Wertpapieren (gemäß der im Verkaufsprospekt angegebenen Definition) mit unterschiedlichen Laufzeiten, darunter Staatsanleihen und von Regierungen, ihren Organen, Behörden oder Körperschaften begebene oder garantierte Wertpapiere, Unternehmensanleihen und hypothekebesicherte oder sonstige besicherte Wertpapiere (MBS- und ABS-Titel). Der Fonds kann versuchen, am Markt ein Engagement in den Wertpapieren, in die er primär investiert, einzugehen, indem er eine Reihe von Kauf- und Verkaufsverträgen abschließt oder andere Anlagetechniken (wie z. B. Rückkäufe) einsetzt. Der Fonds darf ohne Einschränkungen in hypothekebesicherte oder sonstige besicherte Wertpapiere (MBS- und ABS-Titel) investieren. Es wird erwartet, dass die gewichtete durchschnittliche Laufzeit des Fonds 3 Jahre nicht übersteigen wird. Die durchschnittliche Duration des Fondsportfolios wird auf Grundlage der Zinsprognosen der Anlageberater bis zu einem Jahr betragen. Der Fonds darf maximal 5 Prozent seines Vermögens in festverzinsliche Wertpapiere aus Schwellenmärkten investieren und investiert ausschließlich in Titel mit Investment-Grade, die von Moody's mit einem Rating von Baa3 bzw. von S&P mit einem Rating von BBB- oder von Fitch mit einem äquivalenten Rating bewertet wurden (bzw. die, sollte kein Bonitätsrating vorliegen, nach Ansicht der Anlageberater von vergleichbarer Qualität sind).

Wertentwicklung des Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Die Zinspositionierung in den USA trug zur relativen Wertentwicklung bei, da sich die Kurve abflachte.
- » Der Bestand an Unternehmenskrediten mit Investment-Grade trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Anlageklasse positive Gesamtrendite lieferte.
- » Ausgewählte Positionen in verbrieften Krediten trugen zur relativen Wertentwicklung bei, da die Anlagen in CLOs positive Gesamtrendite brachten.
- » Bei diesem Fonds gab es keine wesentlichen Verlustbringer.

Gesamtrendite nach Gebühren und Aufwendungen für den Zeitraum 30. September 2021<sup>1</sup>

	6 Monate	Seit Auflegung der Klasse
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
USD ausschüttend (aufgelegt am 17. Nov. 2014)	0,75 %	3,21 %
ICE BofAML US Corporate Bond 1-5 Year Index	0,89 %	3,02 %
<b>Auf CHF lautende Klassen</b>		
CHF (abgesichert) thesaurierend (aufgelegt am 30. Apr. 2015)	0,21 %	0,87 %
ICE BofAML 1-5 Year US Corporate Index (CHF Hedged)	0,38 %	0,72 %

<sup>1</sup> Annualisierte Wertentwicklung für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Fonds verfolgt das Anlageziel, in Einklang mit umsichtiger Anlageverwaltung den Gesamtertrag zu maximieren. Der Fonds strebt sein Anlageziel an, indem er primär in ein aktiv verwaltetes diversifiziertes Portfolio von auf den US-Dollar lautenden festverzinslichen Unternehmensanleihen mit Investment Grade (gemäß der im Verkaufsprospekt angegebenen Definition) investiert. Der Fonds setzt zur Auswahl seiner Anlagen nach Möglichkeit das gesamtertragsorientierte Anlageverfahren und die Philosophie der Anlageberater ein. Es werden Top-down- und Bottom-up-Strategien verfolgt, um verschiedene diversifizierte Werttreiber ausfindig zu machen und so beständige Erträge zu erwirtschaften. Top-down-Strategien werden herangezogen unter Berücksichtigung gesamtwirtschaftlicher Einschätzungen der Kräfte, die sich mittelfristig auf die Weltwirtschaft und die Finanzmärkte auswirken dürften. Bottom-up-Strategien liegen dem Verfahren zur Einzeltitelauswahl zugrunde und dienen der Ermittlung und Analyse unterbewerteter Wertpapiere.

Wertentwicklung des Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Makrostrategien, da eine Untergewichtung in Duration und die Kurvenpositionierung zur Wertentwicklung beitrugen.
- » Die Titelauswahl im Bankensektor trug zur Wertentwicklung bei, da ausgewählte übergewichtete Emittenten überdurchschnittlich abschnitten.
- » Die Titelauswahl im Chemiesektor trug zur Wertentwicklung bei, da ausgewählte übergewichtete Emittenten überdurchschnittlich abschnitten.
- » Die Wertpapierauswahl bei Auslandsschulden von Schwellenländern beeinträchtigte die Wertentwicklung.
- » Das übergewichtete Engagement im Glücksspielsektor, der sich aufgrund potenzieller Maßnahmen von asiatischen Regulierungsbehörden unterdurchschnittlich entwickelte, beeinträchtigte die Wertentwicklung.

Gesamtrendite nach Gebühren und Aufwendungen für den Zeitraum zum 30. September 2021<sup>1</sup>

	6 Monate	Seit Auflegung der Klasse
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
USD thesaurierend (aufgelegt am 30. Apr. 2015)	2,61 %	4,64 %
USD ausschüttend (aufgelegt am 14. Mrz. 2012)	2,60 %	5,07 %
ICE BofAML 0-5 Year US High Yield Constrained Index	3,12 %	5,62 % <sup>2</sup>
<b>Auf CHF lautende Klassen</b>		
CHF (abgesichert) thesaurierend (aufgelegt am 28. Mai 2015)	2,10 %	2,20 %
ICE BofAML 0-5 Year US High Yield Constrained Index (CHF Hedged)	2,63 %	2,75 %
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
EUR (abgesichert) thesaurierend (aufgelegt am 11. Dez. 2017)	2,19 %	2,08 %
EUR (abgesichert) ausschüttend (aufgelegt am 16. Okt. 2013)	2,19 %	2,75 %
ICE BofAML 0-5 Year US High Yield Constrained Index (EUR Hedged)	2,75 %	3,27 % <sup>2</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
GBP (abgesichert) ausschüttend (aufgelegt am 16. Nov. 2015)	2,55 %	4,55 %
ICE BofAML 0-5 Year US High Yield Constrained Index (GBP Hedged)	3,09 %	5,26 %

<sup>1</sup> Annualisierte Wertentwicklung für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Fonds verfolgt das Anlageziel, einen Ertrag zu erwirtschaften, der vor Gebühren und Aufwendungen möglichst genau dem Gesamtertrag des ICE BofAML 0-5 Year US High Yield Constrained Index (der „Index“) entspricht. Der Fonds investiert sein Vermögen in ein diversifiziertes Portfolio von auf den US-Dollar lautenden festverzinslichen Instrumenten (gemäß der im Verkaufsprospekt angegebenen Definition) welches, soweit dies möglich und praktisch umsetzbar ist, aus den Wertpapieren besteht, die die Komponenten des Index bilden. Der Fonds kann direkt in die Wertpapiere investieren, die eine Komponente des Index bilden, oder über derivative Instrumente wie Swaps ein indirektes Engagement in diesen Wertpapieren eingehen. Der Index bildet die Wertentwicklung kurzlaufender auf US-Dollar lautender Unternehmensanleihen unter Investment Grade nach, die auf dem US-Markt öffentlich emittiert werden, einschließlich Anleihen, „Rule 144a“-Wertpapiere und „Pay-In-Kind“-Wertpapiere (diese Wertpapiere leisten Zinszahlungen in Form zusätzlicher Wertpapiere, Toggle Notes inbegriffen). Sich eignende Wertpapiere müssen eine Restlaufzeit von unter fünf Jahren, ein Rating unter Investment-Grade (basierend auf einem Durchschnitt von Moody's, S&P und Fitch), einen festen Zinszahlungsplan und ein im Umlauf befindliches Mindestvolumen von 250 Mio. USD haben. Ferner müssen Emittenten geeigneter Wertpapiere ihren Sitz in Investment-Grade-Ländern haben, die Mitglieder der G10-Staaten, Westeuropas oder Territorien der USA und Westeuropas sind oder einen wesentlichen Teil ihrer Geschäftstätigkeit dort ausüben.

Wertentwicklung des Fonds

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Die Titelauswahl im Transportsektor trug zur Wertentwicklung bei, da sich die untergewichteten Positionen des Fonds im Sektor schlechter entwickelten als der Gesamtsektor.
- » Ein untergewichtetes Engagement im Versorgungssektor trug zur Wertentwicklung bei, da der Sektor schlechter abschnitt als der Gesamtmarkt.
- » Die Titelauswahl im Medien-, Unterhaltungs- und Verlagssektor wirkte sich positiv auf die Wertentwicklung aus, da die Positionen des Fonds im Medien-, Unterhaltungs- und Verlagssektor besser abschnitten als der Sektor insgesamt.
- » Die Titelauswahl im Transportsektor beeinträchtigte die Wertentwicklung, da sich die untergewichteten Positionen des Fonds im Sektor besser entwickelten als der Gesamtsektor.
- » Die Titelauswahl im Telekommunikationssektor schmälerte die Wertentwicklung, da die Positionen des Fonds im Telekommunikationssektor schlechter abschnitten als der Sektor insgesamt.
- » Die Titelauswahl im Sektor für unterstützende Dienstleistungen beeinträchtigte die Wertentwicklung, da untergewichtete Positionen des Fonds in diesem Sektor besser abschnitten als der Sektor insgesamt.



## Beschreibungen der Benchmark

Index	Beschreibung
<b>Bloomberg Euro Aggregate Covered 3 % Cap</b>	Der Bloomberg Euro Aggregate Covered 3 % Cap Index bildet die Wertentwicklung von auf Euro lautenden gedeckten Schuldverschreibungen ab. Aufnahmekriterium ist die Wahrung, auf die die Emission lautet, nicht der Sitz des Emittenten. Infrage kommende Wertpapiere mussen ein Investment-Grade-Rating aufweisen (basierend auf einem Durchschnitt aus Moody's, S&P und Fitch), eine Restlaufzeit von mindestens einem Jahr, einen fixen Kuponplan und einen ausstehenden Mindestrestbetrag von 300 Millionen Euro. Die Indexkomponenten sind kapitalisierungsgewichtet, basierend auf dem aktuell ausstehenden Betrag. Das gilt unter dem Vorbehalt, dass die Allokation auf einen einzelnen Emittenten insgesamt 3 % nicht uberschreiten darf. Eine Direktanlage in einem nicht aktiv verwalteten Index ist nicht moglich
<b>PIMCO Emerging Markets Advantage Local Currency Bond Index</b>	Der PIMCO Emerging Markets Advantage Local Currency Bond Index bildet die Wertentwicklung eines BIP-gewichteten Korbs lokaler Schwellenlander-Staatsanleihen, -Wahrungen oder Devisenterminkontrakte ab, vorbehaltlich eines Maximalengagements von 15 % je Land. Jeweils jahrlich werden die Lander ausgewahlt und ihre Gewichtungen festgelegt. Geeignete Lander mussen im Schnitt mindestens eine Landerbonitat von BB- (nach Bewertung durch eine anerkannte Rating-Agentur) aufweisen, mehr als 0,3 % des globalen BIP reprasentieren, nach dem von der Weltbank veroeffentlichten Bruttonationaleinkommen pro Kopf als Land mit mittlerem oder geringem Einkommen ausgewiesen sein und uber einen liquiden lokalen Anleihen- oder Devisenmarkt verfugen. Lander, deren interne oder externe Kreditaufnahme EU- oder US-Sanktionen unterliegt, kommen fur den Index nicht infrage. Eine Direktanlage in einem nicht aktiv verwalteten Index ist nicht moglich
<b>Euro Short-Term Rate (ESTER)</b>	Die ESTER spiegelt die Geschaftskundenkosten fur unbesicherte Euro-ubernachtkredite von Banken in der Eurozone wider. Die ESTER wird an jedem Tag veroeffentlicht, an dem das Transeuropaische Automatisierte Echtzeit-Brutto-Express-Zahlungssystem (oder ein Nachfolge-Zahlungssystem) fur die Abwicklung von Zahlungen in Euro geoffnet ist. Die ESTER beruht auf Transaktionen, die am vorhergehenden Geschaftstag (dem Stichtag „T“) mit einem Falligkeitsdatum von T+1 durchgefuhrt und abgewickelt wurden und die als zu marktublichen Bedingungen ausgefuhrt gelten und somit die Marktsatze unverzerrt widerspiegeln.
<b>FTSE 3-Month Treasury Bill Index</b>	Der FTSE 3-Month Treasury Bill Index ist ein nicht aktiv verwalteter Index, der die monatlichen Ertragsaquivalente der durchschnittlichen Renditen der in den letzten drei Monaten emittierten Treasury Bills abbildet. Eine Direktanlage in einem nicht aktiv verwalteten Index ist nicht moglich
<b>ICE BofAML 0-5 Year Euro Developed Markets High Yield 2 % Constrained Index</b>	Der ICE BofAML 0-5 Year Euro Developed Markets High Yield 2 % Constrained Index setzt sich aus auf Euro lautenden Unternehmensanleihen unter Investment-Grade mit einer Restlaufzeit von weniger als 5 Jahren zusammen, die an den europaischen Inlandsmarkten oeffentlich emittiert werden.
<b>ICE BofAML 0-5 Year US High Yield Constrained Index</b>	Der ICE BofAML 0-5 Year US High Yield Constrained Index bildet die Wertentwicklung kurzlaufender auf US-Dollar lautender Unternehmensanleihen unter Investment-Grade nach, die auf dem US-Markt emittiert werden, eine Restlaufzeit von unter funf Jahren, einen festen Zinszahlungsplan und ein im Umlauf befindliches Mindestvolumen von 100 Mio. USD haben. Vor dem 30. September 2016 mussten die Wertpapiere ein im Umlauf befindliches Mindestvolumen von 100 Mio. USD aufweisen. Positionen in einzelnen Emittenten sind auf 2 % Eine Direktanlage in einem nicht aktiv verwalteten Index ist nicht moglich
<b>ICE BofAML Euro Corporate Bond 1-5 Year Index</b>	Der ICE BofAML Euro Corporate Bond 1-5 Year Index bietet ein Engagement in auf den Euro lautenden Unternehmensanleihen mit Investment Grade von Emittenten aus den Sektoren Industrie, Versorgung und Finanzen mit einer Restlaufzeit von unter 5 Jahren.
<b>ICE BofAML US 3-Month Treasury Bill Index (GBP Hedged)</b>	Der ICE BofAML US 3-monatige Treasury Bill Index GBP Hedged besteht aus einer Einzelemission, die Anfang des Monats gekauft und einen ganzen Monat lang gehalten wurde. Am Ende des Monats wird diese Emission verkauft und durch eine neu ausgewahlte Emission ersetzt. Die Emission, die bei jeder Neuausrichtung am Monatsende ausgewahlt wird, ist die ausstehende US-Schatzanleihe, deren Falligkeit am nachsten zum Datum der Neuausrichtung liegt. Dieser zeitliche Abstand betragt maximal drei Monate. Um sich fur die Auswahl zu qualifizieren, muss eine Emission am oder vor dem Datum der Neuausrichtung am Monatsende beglichen sein. Wahrend der Index in den meisten Fallen die Schatzanleihe enthalt, die bei der letzten 3-monatigen Auktion emittiert wurde, ist es auch moglich, dass eine 6-monatige Schatzanleihe ausgewahlt wird. Eine Direktanlage in einem nicht aktiv verwalteten Index ist nicht moglich
<b>ICE BofAML US Corporate Bond 1-5 Year Index</b>	Der ICE BofAML US Corporate Bond 1-5 Year Index bietet ein Engagement in auf den US-Dollar lautenden Unternehmensanleihen mit Investment Grade von Emittenten aus den Sektoren Industrie, Versorgung und Finanzen mit einer Restlaufzeit von unter 5 Jahren.
<b>ICE BofAML Sterling Govt Bill Index</b>	Der ICE BofAML Sterling Govt Bill Index bildet die Wertentwicklung von auf GBP lautenden Staatsanleihen ab, die von der britischen Regierung oeffentlich am inlandischen Markt Grobritannien begeben wurden.

(Diese Seite wird absichtlich leer gelassen)

## Vermögensaufstellung

(Beträge in Tsd.)

	PIMCO Covered Bond UCITS ETF		PIMCO Emerging Markets Advantage Local Bond Index UCITS ETF	
	Zum 30. Sept. 2021	Zum 31. März 2021	Zum 30. Sept. 2021	Zum 31. März 2021
<b>Umlaufvermögen:</b>				
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
Wertpapiere	€ 48.789	€ 60.879	\$ 193.576	\$ 261.819
Investmentfonds	0	0	0	0
Pensionsgeschäfte	0	0	867	0
Derivative Finanzinstrumente	464	899	1.959	2.153
Barmittel	1.578	358	917	1.747
Einlagen bei Kontrahenten	549	887	0	850
Zinsforderungen	326	297	2.153	3.482
Forderungen aus Wertpapierverkäufen	0	506	0	7.048
Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen	0	0	0	0
Forderungen aus dem Verkauf von Fondsanteilen	0	0	0	0
Forderungen aus Margen für Finanzderivate	0	0	0	0
<b>Umlaufvermögen insgesamt</b>	<b>51.706</b>	<b>63.826</b>	<b>199.472</b>	<b>277.099</b>
<b>Kurzfristige Verbindlichkeiten:</b>				
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
Derivative Finanzinstrumente	(257)	(784)	(1.633)	(2.428)
Beizulegender Zeitwert der kurzfristig verkauften Wertpapiere	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen	0	0	0	(13.404)
Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus der Rücknahme von Fondsanteilen	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Managementgebühren	(18)	(25)	(99)	(134)
Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensionsgeschäften	0	0	0	0
Zu zahlende Kapitalertragsteuer	0	0	(97)	(157)
Überziehungskredite	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Margen für Finanzderivate	(39)	(403)	0	0
Einlagen von Kontrahenten	0	0	(370)	(1.750)
<b>Kurzfristige Verbindlichkeiten gesamt (ohne das den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)</b>	<b>(314)</b>	<b>(1.212)</b>	<b>(2.199)</b>	<b>(17.873)</b>
<b>Den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen</b>	<b>€ 51.392</b>	<b>€ 62.614</b>	<b>\$ 197.273</b>	<b>\$ 259.226</b>

Ein Saldo von Null kann auf die Rundung der tatsächlichen Beträge auf weniger als 1.000 zurückzuführen sein.

PIMCO Euro Low Duration Corporate Bond UCITS ETF		PIMCO Euro Short-Term High Yield Corporate Bond Index UCITS ETF		PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF	
Zum 30. Sept. 2021	Zum 31. März 2021	Zum 30. Sept. 2021	Zum 31. März 2021	Zum 30. Sept. 2021	Zum 31. März 2021
€ 235.379	€ 230.935	€ 106.924	€ 102.986	€ 2.615.814	€ 2.315.158
6.740	6.751	0	0	0	0
6.996	14.400	0	401	194.300	124.900
581	719	1	0	4.239	5.560
223	15.127	706	527	18.192	173
2.100	2.153	17	17	1.609	12.240
1.721	1.920	1.545	1.400	11.190	8.848
0	0	0	2.698	0	1.247
0	0	0	0	0	0
0	0	0	0	0	18.856
176	0	64	58	0	0
253.916	272.005	109.257	108.087	2.845.344	2.486.982
(515)	(899)	(9)	0	(5.238)	(13.863)
0	0	0	0	0	0
0	(14.612)	(133)	(3.052)	(28.468)	(11.423)
0	0	0	0	0	0
0	0	0	0	0	(14.938)
(100)	(104)	(45)	(44)	(764)	(735)
0	0	0	(396)	0	(1.032)
0	0	0	0	0	0
0	0	0	0	0	0
0	(363)	0	0	0	0
(270)	0	0	0	(4.812)	(3.610)
(885)	(15.978)	(187)	(3.492)	(39.282)	(45.601)
€ 253.031	€ 256.027	€ 109.070	€ 104.595	€ 2.806.062	€ 2.441.381

## Vermögensaufstellung (Fortsetzung)

(Beträge in Tsd.)	PIMCO Sterling Short Maturity UCITS ETF		PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF	
	Zum 30. Sept. 2021	Zum 31. März 2021	Zum 30. Sept. 2021	Zum 31. März 2021
<b>Umlaufvermögen:</b>				
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
Wertpapiere	£ 277.830	£ 153.675	\$ 5.202.590	\$ 4.418.752
Investmentfonds	0	0	0	0
Pensionsgeschäfte	21.600	5.300	118.272	17.377
Derivative Finanzinstrumente	39	2.104	0	3
Barmittel	2.865	535	0	4.116
Einlagen bei Kontrahenten	310	0	0	0
Zinsforderungen	2.283	1.174	12.591	8.143
Forderungen aus Wertpapierverkäufen	0	0	1.430	3.944
Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen	0	0	0	0
Forderungen aus dem Verkauf von Fondsanteilen	0	514	0	0
Forderungen aus Margen für Finanzderivate	0	0	0	0
<b>Umlaufvermögen insgesamt</b>	<b>304.927</b>	<b>163.302</b>	<b>5.334.883</b>	<b>4.452.335</b>
<b>Kurzfristige Verbindlichkeiten:</b>				
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
Derivative Finanzinstrumente	(1.504)	(232)	(20)	(23)
Beizulegender Zeitwert der kurzfristig verkauften Wertpapiere	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen	(3.049)	(611)	(89.419)	(77.797)
Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus der Rücknahme von Fondsanteilen	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Managementgebühren	(84)	(48)	(1.511)	(1.297)
Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensionsgeschäften	0	0	0	0
Zu zahlende Kapitalertragsteuer	0	0	0	0
Überziehungskredite	0	0	(1.972)	0
Verbindlichkeiten aus Margen für Finanzderivate	0	0	0	0
Einlagen von Kontrahenten	0	(1.440)	0	0
<b>Kurzfristige Verbindlichkeiten gesamt (ohne das den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)</b>	<b>(4.637)</b>	<b>(2.331)</b>	<b>(92.922)</b>	<b>(79.117)</b>
<b>Den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen</b>	<b>£ 300.290</b>	<b>£ 160.971</b>	<b>\$ 5.241.961</b>	<b>\$ 4.373.218</b>

Ein Saldo von Null kann auf die Rundung der tatsächlichen Beträge auf weniger als 1.000 zurückzuführen sein.

\* Die Gesamtsumme der Gesellschaft zum 30. September 2021 und 31. März 2021 wurde angepasst, um Cross-Investitionen und Salden im Namen der Gesellschaft zu berücksichtigen. Einzelheiten zu Cross-Investments finden Sie in Anhang 10 der Anmerkungen zum Abschluss.

PIMCO US Low Duration Corporate Bond UCITS ETF		PIMCO US Short-Term High Yield Corporate Bond Index UCITS ETF		Gesellschaft insgesamt*	
Zum 30. Sept. 2021	Zum 31. März 2021	Zum 30. Sept. 2021	Zum 31. März 2021	Zum 30. Sept. 2021	Zum 31. März 2021
\$ 99.029	\$ 104.173	\$ 1.476.364	\$ 1.436.673	€ 9.345.548	€ 8.183.851
0	0	0	0	0	0
574	0	6.791	8.476	335.580	167.920
236	336	723	6.026	7.848	16.895
203	1.257	428	8.408	25.368	30.033
1.424	1.623	13.681	44.530	17.669	55.290
601	630	21.148	20.432	48.926	41.655
3	1	600	11.063	1.754	23.217
2.635	7.367	0	0	2.274	6.268
0	0	0	32.546	0	47.151
263	152	795	0	1.153	187
104.968	115.539	1.520.530	1.568.154	9.786.120	8.572.467
(511)	(733)	(19.689)	(32.728)	(26.625)	(46.374)
(512)	(398)	0	0	(442)	(339)
(100)	(800)	(15.368)	(28.073)	(122.650)	(131.969)
(4.350)	(11.900)	0	0	(3.753)	(10.125)
0	0	0	(25.587)	0	(36.717)
(41)	(43)	(721)	(736)	(3.071)	(2.845)
0	0	(783)	(7.361)	(676)	(7.691)
0	0	0	0	(84)	(134)
0	0	0	0	(1.702)	0
0	0	0	(548)	(39)	(1.232)
0	0	(270)	0	(5.634)	(6.789)
(5.514)	(13.874)	(36.831)	(95.033)	(164.676)	(244.215)
\$ 99.454	\$ 101.665	\$ 1.483.699	\$ 1.473.121	€ 19.621.444	€ 8.328.252

## Gewinn- und Verlustrechnung

(Beträge in Tsd.)	PIMCO Covered Bond UCITS ETF		PIMCO Emerging Markets Advantage Local Bond Index UCITS ETF	
	Berichtszeitraum zum 30. Sept. 2021	Berichtszeitraum zum 30. Sept. 2020	Berichtszeitraum zum 30. Sept. 2021	Berichtszeitraum zum 30. Sept. 2020
<b>Ausschüttend</b>				
Zins- und Dividendenerträge	€ 101	€ 274	\$ 6.141	\$ 8.182
Sonstige Erträge	0	0	0	0
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	90	(1.181)	(1.888)	(17.389)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten	(156)	1.864	(487)	3.234
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährungen	(14)	(347)	(67)	(298)
Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(Wertverlustes) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	(284)	3.913	1.251	38.561
Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(Wertverlustes) aus derivativen Finanzinstrumenten	92	(1.043)	601	(1.791)
Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(Wertverlustes) aus Fremdwährungen	(2)	(20)	(6)	900
Gesamtanlageertrag/(-verlust)	(173)	3.460	5.545	31.399
<b>Betriebliche Aufwendungen</b>				
Managementgebühren	(121)	(235)	(705)	(1.059)
Sonstige Aufwendungen	0	0	(1)	(1)
Gesamtaufwand	(121)	(235)	(706)	(1.060)
Rückerstattung durch Anlageberater	0	0	0	0
Betriebliche Nettoaufwendungen	(121)	(235)	(706)	(1.060)
<b>Nettoanlageerträge/(-verluste)</b>	(294)	3.225	4.839	30.339
<b>Finanzierungskosten</b>				
Zinsaufwand	(1)	(8)	0	(4)
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile	0	0	(2.520)	(2.037)
Nettoausgleichsgutschriften und (Belastungen)	3	0	32	3
Gesamtfinanzierungskosten	2	(8)	(2.488)	(2.038)
<b>Vorsteuergewinn/(-verlust) für den Berichtszeitraum</b>	(292)	3.217	2.351	28.301
Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge	0	0	(111)	(423)
Kapitalertragsteuer	0	0	(21)	(302)
<b>Nachsteuergewinn/(-verlust) für den Berichtszeitraum</b>	(292)	3.217	2.219	27.576
<b>Zunahme/(Abnahme) des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der laufenden Geschäftstätigkeit</b>	€ (292)	€ 3.217	\$ 2.219	\$ 27.576

Ein Saldo von Null kann auf die Rundung der tatsächlichen Beträge auf weniger als 1.000 zurückzuführen sein. Alle Beträge stammen ausschließlich aus fortgeführten Aktivitäten.



PIMCO Euro Low Duration Corporate Bond UCITS ETF		PIMCO Euro Short-Term High Yield Corporate Bond Index UCITS ETF		PIMCO Euro Short Maturity UCITS SETF							
Berichtszeitraum zum 30. Sept. 2021		Berichtszeitraum zum 30. Sept. 2020		Berichtszeitraum zum 30. Sept. 2021		Berichtszeitraum zum 30. Sept. 2020					
€	1.251	€	1.471	€	1.568	€	1.759	€	2.648	€	889
	0		0		0		0		1		3
	701		95		513		(1.676)		(4.858)		(3.599)
	(256)		2.589		6		4		(7.638)		22.707
	20		(118)		0		0		(686)		(2.426)
	(488)		10.854		(140)		13.342		3.692		23.294
	242		(60)		(8)		3		7.304		(9.896)
	(22)		(8)		0		0		(83)		(290)
	1.448		14.823		1.939		13.432		380		30.682
	(620)		(745)		(262)		(264)		(4.488)		(4.237)
	(1)		(1)		0		0		(6)		(6)
	(621)		(746)		(262)		(264)		(4.494)		(4.243)
	12		4		0		0		0		0
	(609)		(742)		(262)		(264)		(4.494)		(4.243)
	839		14.081		1.677		13.168		(4.114)		26.439
	(37)		(36)		(3)		(8)		(985)		(510)
	(617)		(762)		(724)		(716)		0		0
	(10)		4		0		(2)		(94)		367
	(664)		(794)		(727)		(726)		(1.079)		(143)
	175		13.287		950		12.442		(5.193)		26.296
	(3)		0		(6)		0		(1)		0
	0		0		0		0		0		0
	172		13.287		944		12.442		(5.194)		26.296
€	172	€	13.287	€	944	€	12.442	€	(5.194)	€	26.296

## Gewinn- und Verlustrechnung (Fortsetzung)

(Beträge in Tsd.)	PIMCO Sterling Short Maturity UCITS ETF		PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF	
	Berichtszeitraum zum 30. Sept. 2021	Berichtszeitraum zum 30. Sept. 2020	Berichtszeitraum zum 30. Sept. 2021	Berichtszeitraum zum 30. Sept. 2020
<b>Ausschüttend</b>				
Zins- und Dividenderträge	£ 477	£ 468	\$ 16.467	\$ 23.962
Sonstige Erträge	0	0	10	0
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	(2.066)	1.445	(456)	(5.448)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten	2.372	(7.800)	(25)	17
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährungen	18	651	0	0
Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(Wertverlustes) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	3.048	997	2.909	85.314
Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(Wertverlustes) aus derivativen Finanzinstrumenten	(3.337)	6.391	0	(10)
Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(Wertverlustes) aus Fremdwährungen	3	(32)	0	0
Gesamtanlageertrag/(-verlust)	515	2.120	18.905	103.835
<b>Betriebliche Aufwendungen</b>				
Managementgebühren	(395)	(259)	(8.821)	(6.480)
Sonstige Aufwendungen	0	0	(12)	(12)
Gesamtaufwand	(395)	(259)	(8.833)	(6.492)
Rückerstattung durch Anlageberater	0	0	0	0
Betriebliche Nettoaufwendungen	(395)	(259)	(8.833)	(6.492)
<b>Nettoanlageerträge/(-verluste)</b>	120	1.861	10.072	97.343
<b>Finanzierungskosten</b>				
Zinsaufwand	0	0	0	(597)
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile	(97)	(242)	(7.737)	(19.148)
Nettoausgleichsgutschriften und (Belastungen)	(3)	(1)	3	(150)
Gesamtfinanzierungskosten	(100)	(243)	(7.734)	(19.895)
<b>Vorsteuergewinn/(-verlust) für den Berichtszeitraum</b>	20	1.618	2.338	77.448
Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge	0	0	0	(16)
Kapitalertragsteuer	0	0	0	0
<b>Nachsteuergewinn/(-verlust) für den Berichtszeitraum</b>	20	1.618	2.338	77.432
<b>Zunahme/(Abnahme) des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der laufenden Geschäftstätigkeit</b>	£ 20	£ 1.618	\$ 2.338	\$ 77.432

Ein Saldo von Null kann auf die Rundung der tatsächlichen Beträge auf weniger als 1.000 zurückzuführen sein. Alle Beträge stammen ausschließlich aus fortgeführten Aktivitäten.

\* Die Gesamtsumme der Gesellschaft für die Finanzperioden, die am 30. September 2021 und am 30. September 2020 endeten, wurde angepasst, um Cross-Investments und Salden im Namen der Gesellschaft zu berücksichtigen. Einzelheiten zu Cross-Investments finden Sie in Anhang 10 der Anmerkungen zum Abschluss.

PIMCO US Low Duration Corporate Bond UCITS ETF		PIMCO US Short-Term High Yield Corporate Bond Index UCITS ETF		Gesellschaft insgesamt*	
Berichtszeitraum zum 30. Sept. 2021	Berichtszeitraum zum 30. Sept. 2020	Berichtszeitraum zum 30. Sept. 2021	Berichtszeitraum zum 30. Sept. 2020	Berichtszeitraum zum 30. Sept. 2021	Berichtszeitraum zum 30. Sept. 2020
\$ 1.121	\$ 1.782	\$ 32.886	\$ 32.905	€ 53.636	€ 63.856
0	0	76	0	73	3
691	87	11.440	(20.519)	2.253	(42.909)
24	1.337	(21.064)	58.072	(23.368)	73.721
(20)	10	275	70	(501)	(2.357)
(919)	5.354	(7.778)	120.527	2.533	272.758
111	(442)	7.737	947	10.834	(5.006)
6	(35)	(16)	(653)	(117)	(167)
1.014	8.093	23.556	191.349	45.343	359.899
(249)	(336)	(4.323)	(3.739)	(17.783)	(16.013)
0	0	(4)	(4)	(21)	(22)
(249)	(336)	(4.327)	(3.743)	(17.804)	(16.035)
0	0	0	0	12	4
(249)	(336)	(4.327)	(3.743)	(17.792)	(16.031)
765	7.757	19.229	187.606	27.551	343.868
0	(7)	(25)	(11)	(1.047)	(1.108)
(848)	(1.296)	(26.539)	(27.366)	(33.046)	(45.710)
(12)	(23)	(111)	60	(178)	271
(860)	(1.326)	(26.675)	(27.317)	(34.271)	(46.547)
(95)	6.431	(7.446)	160.289	(6.720)	297.321
0	0	0	0	(103)	(387)
0	0	0	0	(18)	(266)
(95)	6.431	(7.446)	160.289	(6.841)	296.668
\$ (95)	\$ 6.431	\$ (7.446)	\$ 160.289	€ (6.841)	€ 296.668

## Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens

(Beträge in Tsd.)	PIMCO Covered Bond UCITS ETF		PIMCO Emerging Markets Advantage Local Bond Index UCITS ETF	
	Berichtszeitraum zum 30. Sept. 2021	Berichtszeitraum zum 30. Sept. 2020	Berichtszeitraum zum 30. Sept. 2021	Berichtszeitraum zum 30. Sept. 2020
<b>Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums</b>	€ 62.614	€ 111.462	\$ 259.226	\$ 332.805
Erlöse aus ausgegebenen Anteilen und Verrechnungen	499	12.267	7.724	13.266
Zahlungen für Anteilsrücknahmen	(11.429)	(25.576)	(71.896)	(22.433)
Nominelle Wechselkursanpassung	0	0	0	0
Zunahme/(Abnahme) des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der laufenden Geschäftstätigkeit	(292)	3.217	2.219	27.576
<b>Nettovermögen zum Ende des Berichtszeitraums</b>	€ 51.392	€ 101.370	\$ 197.273	\$ 351.214

	PIMCO Sterling Short Maturity UCITS ETF		PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF	
	Berichtszeitraum zum 30. Sept. 2021	Berichtszeitraum zum 30. Sept. 2020	Berichtszeitraum zum 30. Sept. 2021	Berichtszeitraum zum 30. Sept. 2020
<b>Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums</b>	£ 160.971	£ 172.151	£ 160.971	£ 172.151
Erlöse aus ausgegebenen Anteilen und Verrechnungen	214.460	59.117	214.460	59.117
Zahlungen für Anteilsrücknahmen	(75.161)	(78.482)	(75.161)	(78.482)
Nominelle Wechselkursanpassung	0	0	0	0
Zunahme/(Abnahme) des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der laufenden Geschäftstätigkeit	20	1.618	20	1.618
<b>Nettovermögen zum Ende des Berichtszeitraums</b>	£ 300.290	£ 154.404	£ 300.290	£ 154.404

Ein Saldo von Null kann auf die Rundung der tatsächlichen Beträge auf weniger als 1.000 zurückzuführen sein.

\* Die Gesamtsumme der Gesellschaft für die Finanzperioden, die am 30. September 2021 und am 30. September 2020 endeten, wurde angepasst, um Cross-Investments und Salden im Namen der Gesellschaft zu berücksichtigen. Einzelheiten zu Cross-Investments finden Sie in Anhang 10 der Anmerkungen zum Abschluss.

PIMCO Euro Low Duration Corporate Bond UCITS ETF		PIMCO Euro Short-Term High Yield Corporate Bond Index UCITS ETF		PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF	
Berichtszeitraum zum 30. Sept. 2021	Berichtszeitraum zum 30. Sept. 2020	Berichtszeitraum zum 30. Sept. 2021	Berichtszeitraum zum 30. Sept. 2021	Berichtszeitraum zum 30. Sept. 2021	Berichtszeitraum zum 30. Sept. 2020
€ 256.027	€ 289.835	€ 104.595	€ 101.865	€ 2.441.381	€ 2.481.678
12.629	7.798	15.831	4.634	1.178.700	1.038.537
(15.797)	(3.078)	(12.300)	(15.195)	(808.825)	(1.058.559)
0	0	0	0	0	0
172	13.287	944	12.442	(5.194)	26.296
€ 253.031	€ 307.842	€ 109.070	€ 103.746	€ 2.806.062	€ 2.487.952
PIMCO US Low Duration Corporate Bond UCITS ETF		PIMCO US Short-Term High Yield Corporate Bond Index UCITS ETF		Gesellschaft insgesamt*	
Berichtszeitraum zum 30. Sept. 2021	Berichtszeitraum zum 30. Sept. 2020	Berichtszeitraum zum 30. Sept. 2021	Berichtszeitraum zum 30. Sept. 2020	Berichtszeitraum zum 30. Sept. 2021	Berichtszeitraum zum 30. Sept. 2020
\$ 101.665	\$ 145.163	\$ 1.473.121	\$ 1.119.510	€ 8.328.252	€ 7.620.198
1.909	6.272	383.982	295.732	2.681.235	2.091.228
(4.025)	(22.517)	(365.958)	(187.443)	(1.473.091)	(1.535.750)
0	0	0	0	91.889	(318.492)
(95)	6.431	(7.446)	160.289	(6.841)	296.668
\$ 99.454	\$ 135.349	\$ 1.483.699	\$ 1.388.088	€ 9.621.444	€ 8.153.852

## Aufstellung des Wertpapierbestands PIMCO Covered Bond UCITS ETF

BESCHREIBUNG WERTPAPIERE	NENN- WERT (in Tsd.)	BEIZULE- GENDER ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	NENN- WERT (in Tsd.)	BEIZULE- GENDER ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	NENN- WERT (in Tsd.)	BEIZULE- GENDER ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO VERMÖ- GENS			
<b>KANADA</b>				<b>DEUTSCHLAND</b>				<b>PORTUGAL</b>						
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN</b>						
Bank of Montreal 0,050 % due 08.06.2029	€	2.200	€ 2.195	4,27	Aareal Bank AG 1,050 % due 29.04.2025	£	1.000	€ 1.193	2,32	Caixa Economica Montepio Geral Caixa Economica Bancaria S.A. 0,875 % due 17.10.2067	€	1.200	€ 1.215	2,36
Bank of Nova Scotia 1,050 % due 14.03.2025	£	700	836	1,63	Deutsche Bank AG 0,050 % due 20.11.2024	€	1.900	1.913	3,72	<b>RUMÄNIEN</b>				
Canadian Imperial Bank of Commerce 0,381 % due 14.09.2026	AUD	500	311	0,60	Deutsche Pfandbriefbank AG 1,050 % due 26.04.2024	£	1.000	1.186	2,31	<b>STAATSANLEIHEN</b>				
HSBC Bank Canada 0,010 % due 14.09.2026	€	100	101	0,20	Deutschland insgesamt			4.292	8,35	Romania Government International Bond 1,750 % due 13.07.2030	100	98	0,19	
Royal Bank of Canada 1,050 % due 14.09.2026	\$	900	774	1,51	<b>IRLAND</b>				<b>SINGAPUR</b>					
Kanada insgesamt			4.217	8,21	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN</b>					
<b>DÄNEMARK</b>				<b>ITALIEN</b>				<b>SÜDKOREA</b>						
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN</b>						
DLR Kredit A/S 2,000 % due 01.10.2050	DKK	0	0	0,00	AMCO - Asset Management Co. SpA 2,625 % due 13.02.2024		1.600	1.701	3,31	Kookmin Bank 0,052 % due 15.07.2025	1.000	1.008	1,96	
2,500 % due 01.10.2047		0	0	0,00	Banca Carige SpA 0,951 % due 25.05.2022		300	301	0,59	<b>SPANIEN</b>				
Jyske Realkredit A/S 1,000 % due 01.10.2053		0	0	0,00	Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 0,875 % due 08.10.2027		2.000	2.084	4,05	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN</b>				
1,500 % due 01.10.2037		0	0	0,00	<b>STAATSANLEIHEN</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN</b>					
1,500 % due 01.10.2040		0	0	0,00	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,950 % due 15.09.2027		2.200	2.283	4,44	AyT Cedula Cajas Fondo de Titulizacion de Activos 3,750 % due 30.06.2025	1.700	1.947	3,79	
1,500 % due 01.10.2050	1.907	250	0,49	0,00	Italien insgesamt			6.369	12,39	Cajamar Caja Rural SCC 0,875 % due 18.06.2023	1.800	1.836	3,57	
2,000 % due 01.10.2047		0	0,00	0,00	<b>JAPAN</b>				<b>LIBERBANK S.A.</b>					
2,000 % due 01.10.2050		0	0,00	0,00	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN</b>				<b>PITCH</b>					
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 1,000 % due 01.10.2053		0	0	0,00	Sumitomo Mitsui Banking Corp. 0,409 % due 07.11.2029		2.150	2.183	4,25	5,125 % due 20.07.2022	1.300	1.357	2,64	
1,500 % due 01.10.2037		0	0,00	0,00	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd. 0,010 % due 15.10.2027		2.000	1.987	3,86	<b>STAATSANLEIHEN</b>				
1,500 % due 01.10.2050		0	0,00	0,00	Japan insgesamt			4.170	8,11	Spain Government International Bond 1,450 % due 31.10.2071	460	410	0,80	
2,000 % due 01.10.2050		0	0,00	0,00	<b>MEXIKO</b>				<b>SPANIEN INSGESAMT</b>					
Nykredit Realkredit A/S 0,500 % due 01.10.2040		0	0,00	0,00	<b>STAATSANLEIHEN</b>				<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH</b>					
1,000 % due 01.10.2050	357	45	0,09	0,00	<b>Mexico Government International Bond 2,250 % due 12.08.2036</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN</b>					
1,000 % due 01.10.2053		0	0,00	0,00		300	295	0,58	Clydesdale Bank PLC 0,010 % due 22.09.2026	1.900	1.908	3,71		
1,500 % due 01.10.2037		0	0,00	0,00	<b>NIEDERLANDE</b>				<b>Co-Operative Bank PLC 4,750 % due 11.11.2021</b>					
1,500 % due 01.10.2040		0	0,00	0,00	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN</b>				<b>Lloyds Bank PLC 6,000 % due 08.02.2029</b>					
1,500 % due 01.10.2050	16.661	2.181	4,24	0,00	NIBC Bank NV 0,125 % due 21.04.2031		1.300	1.288	2,51	<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH INSGESAMT</b>				
2,000 % due 01.10.2050		0	0,00	0,00	<b>POLEN</b>				<b>USA</b>					
Realkredit Danmark A/S 1,000 % due 01.10.2050		0	0,00	0,00	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN</b>				<b>US-TREASURY-OBLIGATIONEN</b>					
1,000 % due 01.10.2053		0	0,00	0,00	<b>mBank Hipoteczny S.A. 0,242 % due 15.09.2025</b>				<b>U.S. Treasury Notes 1,125 % due 15.02.2031</b>					
1,500 % due 01.10.2037		0	0,00	0,00		1.600	1.622	3,16	<b>Wertpapiere insgesamt</b>					
1,500 % due 01.10.2050	16.661	2.181	4,24	0,00	<b>Dänemark insgesamt</b>				<b>€ 48.789</b>					
2,000 % due 01.10.2050		0	0,00	0,00	<b>Frankreich insgesamt</b>				<b>94,94</b>					
Dänemark insgesamt		4.701	9,15											
<b>FRANKREICH</b>				<b>FRANKREICH</b>				<b>FRANKREICH</b>						
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN</b>						
Cie de Financement Foncier S.A. 3,875 % due 25.04.2055	€	825	1.531	2,98										
5,500 % due 26.01.2027	£	500	715	1,39										
Frankreich insgesamt			2.246	4,37										

### AN EINEM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE DERIVATIVE FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Ein Saldo von Null kann auf die Rundung der tatsächlichen Beträge auf weniger als 1.000 zurückzuführen sein.

#### FUTURES

Beschreibung	Typ	Verfallsmonat	# der Kontrakte	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)	% des Nettovermögens
Euro-Bobl December Futures	Long	12/2021	12	€ (9)	(0,02)
Euro-Bono December Futures	Short	12/2021	13	23	0,05
Euro-BTP Italy Government Bond December Futures	Short	12/2021	14	28	0,05
Euro-Bund 10-Year Bond December Futures	Short	12/2021	33	68	0,13
Euro-Buxl 30-Year Bond December Futures	Long	12/2021	9	(59)	(0,11)
Euro-OAT France Government 10-Year Bond December Futures	Long	12/2021	3	(9)	(0,02)
Euro-Schatz December Futures	Short	12/2021	43	4	0,01
				€ 46	0,09
<b>An einem geregelten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente insgesamt</b>				<b>€ 46</b>	<b>0,09</b>

**ZENTRAL ABGEWICKELTE DERIVATIVE FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*)**

\* Ein Saldo von null kann auf die Rundung der tatsächlichen Beträge auf weniger als 1.000 zurückzuführen sein.

**ZINSSWAPS**

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Zinsvariabler Index	Festzins	Fälligkeitsdatum	Nominalbetrag	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)	% des Nettovermögens
Zu erhalten <sup>(1)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,750 %	16.03.2052	£ 1.160	€ 107	0,21
Zu zahlen <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,250	16.03.2027	€ 4.700	(29)	(0,06)
Zu zahlen <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,250	16.03.2032	8.200	(114)	(0,22)
Zu erhalten <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,500	16.03.2052	2.600	93	0,18
					€ 57	0,11
<b>Zentral abgewickelte derivative Finanzinstrumente insgesamt</b>					<b>€ 57</b>	<b>0,11</b>

<sup>(1)</sup> Dieses Instrument hat ein in der Zukunft liegendes Datum des Inkrafttretens.**DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)**

\* Ein Saldo von null kann auf die Rundung der tatsächlichen Beträge auf weniger als 1.000 zurückzuführen sein.

**DEVISENTERMINKONTRAKTE**

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu liefernde Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierter Wertzuwachs	Nicht realisierter (Wertverlust)	Nicht realisierter Nettowertzuwachs/ (Wertverlust)	% des Nettovermögens
BOA	11/2021	€ 902	£ 771	€ 0	€ (6)	€ (6)	(0,01)
BRC	11/2021	815	SEK 8.325	5	0	5	0,01
	04/2022	DKK 1.125	€ 151	0	0	0	0,00
GLM	11/2021	¥ 34.300	266	1	0	1	0,00
	04/2022	DKK 1.985	267	0	0	0	0,00
JPM	10/2021	\$ 501	425	0	(7)	(7)	(0,01)
	11/2021	€ 354	£ 302	0	(3)	(3)	(0,01)
	11/2021	£ 8.204	€ 9.664	128	0	128	0,25
	04/2022	DKK 18.950	2.547	0	(1)	(1)	0,00
	04/2022	€ 164	DKK 1.220	0	0	0	0,00
MYI	04/2022	DKK 17.375	€ 2.335	0	(1)	(1)	0,00
	04/2022	€ 209	DKK 1.555	0	0	0	0,00
RYL	11/2021	1.333	£ 1.144	0	(3)	(3)	(0,01)
SCX	10/2021	\$ 906	€ 767	0	(16)	(16)	(0,03)
SOG	11/2021	£ 116	136	1	0	1	0,00
UAG	11/2021	AUD 500	312	0	0	0	0,00
	11/2021	€ 54	£ 46	0	0	0	0,00
	11/2021	£ 726	€ 850	6	0	6	0,01
				€ 141	€ (37)	€ 104	0,20
<b>Derivative OTC-Finanzinstrumente insgesamt</b>					<b>€ 104</b>	<b>0,20</b>	
<b>Anlagen insgesamt</b>					<b>€ 48.996</b>	<b>95,34</b>	
<b>Sonstige kurzfristige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>					<b>€ 2.396</b>	<b>4,66</b>	
<b>Nettovermögen</b>					<b>€ 51.392</b>	<b>100,00</b>	

**ANGABEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Beträge in Tsd.\*):**

\* Ein Saldo von Null kann auf die Rundung der tatsächlichen Beträge auf weniger als 1.000 zurückzuführen sein.

Barmittel in Höhe von 549€ waren zum 30. September 2021 als Sicherheiten für börsengehandelte und zentral abgewickelte derivative Finanzinstrumente verpfändet.

Bewertung zum beizulegenden Zeitwert<sup>(1)</sup>

Die folgende Darstellung ist eine Zusammenfassung der Zeitwertbewertung gemäß den zum 30. September 2021 für die Bewertung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten der Fonds verwendeten Parametern:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Preise für identische Anlagen (Ebene 1)	Sonstige wesentliche beobachtbare Parameter (Ebene 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Parameter (Ebene 3)	Beizulegender Zeitwert
Wertpapiere	€ 0	€ 48.789	€ 0	€ 48.789
Derivative Finanzinstrumente <sup>(3)</sup>	46	161	0	207
<b>Gesamt</b>	<b>€ 46</b>	<b>€ 48.950</b>	<b>€ 0</b>	<b>€ 48.996</b>

Die folgende Darstellung ist eine Zusammenfassung der Zeitwertbewertung gemäß den zum 31. März 2021 für die Bewertung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten der Fonds verwendeten Parametern:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Preise für identische Anlagen (Ebene 1)	Sonstige wesentliche beobachtbare Parameter (Ebene 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Parameter (Ebene 3)	Beizulegender Zeitwert
Wertpapiere	€ 0	€ 60.879	€ 0	€ 60.879
Derivative Finanzinstrumente <sup>(3)</sup>	(2)	117	0	115
<b>Gesamt</b>	<b>€ (2)</b>	<b>€ 60.996</b>	<b>€ 0</b>	<b>€ 60.994</b>

<sup>(1)</sup> Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.



(2) Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

(3) Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

**(Erhaltene) / verpfändete Sicherheiten für derivative OTC-Finanzinstrumente**

Die folgende Tabelle ist eine Zusammenfassung des beizulegenden Zeitwerts der derivativen OTC-Finanzinstrumente und (erhaltenen)/verpfändeten Sicherheiten zum 30. September 2021:

Kontrahent	Beizulegender Zeitwert von OTC- Derivaten insgesamt	(Erhaltene) / verpfändete Sicherheiten	Nettoengagement <sup>(1)</sup>
BOA	€ (6)	€ 0	€ (6)
BRC	5	0	5
GLM	1	0	1
JPM	117	0	117
MYI	(1)	0	(1)
RYL	(3)	0	(3)
SCX	(16)	0	(16)
SOG	1	0	1
UAG	6	0	6

(1) Das Netto-Engagement stellt die Nettoforderung/(-verbindlichkeit) dar, die bei einem Ausfall vom bzw. an den Kontrahenten zu zahlen wäre.

**Vergleichsangaben**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. September 2021:

	30. Sept. 2021 (%)	31. März 2021 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene Wertpapiere	89,25	92,96
An einem anderen geregelten Markt gehandelte Wertpapiere*	5,08	4,26
Sonstige Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	0,61	-
An einem geregelten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente	0,09	0,00
Zentral abgewickelte derivative Finanzinstrumente	0,11	0,80
Derivative OTC-Finanzinstrumente	0,20	(0,61)

\* Gemäß der in Anhang 2 des Verkaufsprospekt angegebenen Liste von Märkten, die die OGAW-Kriterien für geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. September 2021 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum beizulegenden Zeitwert	30. Sept. 2021 (%)	31. März 2021 (%)
Australien	-	4,14
Kanada	8,21	-
Dänemark	9,15	0,08
Frankreich	4,37	6,97
Deutschland	8,35	8,54
Irland	2,57	-
Italien	12,39	13,12
Japan	8,11	7,98
Mexiko	0,58	-
Niederlande	2,51	0,68
Norwegen	-	4,45
Polen	3,16	3,58
Portugal	2,36	5,02
Rumänien	0,19	-
Slowakei	-	4,69
Singapur	4,28	-
Südkorea	1,96	3,23
Spanien	14,72	8,17
Schweden	-	4,67
Vereinigtes Königreich	10,48	17,22
USA	1,55	4,68
An einem geregelten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente		
Futures	0,09	0,00
Zentral abgewickelte derivative Finanzinstrumente		
Zinsswaps	0,11	0,80
Derivative OTC-Finanzinstrumente		
Devisenterminkontrakte	0,20	(0,61)
Sonstige kurzfristige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	4,66	2,59
<b>Nettovermögen</b>	<b>100,00</b>	<b>100,00</b>

BESCHREIBUNG	NENN- WERT (in Tsd.)	BEIZULE- GENDER ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	NENN- WERT (in Tsd.)	BEIZULE- GENDER ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	NENN- WERT (in Tsd.)	BEIZULE- GENDER ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO VERMÖ- GENS			
<b>WERTPAPIERE</b>								<b>WERTPAPIERE</b>						
<b>STAATSANLEIHEN</b>								<b>STAATSANLEIHEN</b>						
Bonos de la Tesorería de la Republica en Pesos				Dominican Republic Government International Bond				Russia Government International Bond						
2,300 % due 01.10.2028	CLP	635.000	\$ 641	0,32	10,000 % due 24.07.2024	COP	5.335.200	\$ 1.563	0,79	4,500 % due 16.07.2025	RUB	336.557	\$ 4.223	2,14
2,500 % due 01.03.2025		5.000	6	0,00	8,900 % due 15.02.2023	DOP	402.400	7.651	3,88	5,300 % due 04.10.2023		1.000	13	0,01
4,500 % due 01.03.2026	3.585.000	4.309	2,18	6,125 % due 15.05.2028	IDR	2.934.000	209	0,11	6,700 % due 14.03.2029		590.000	7.864	3,99	
5,000 % due 01.10.2028	2.330.000	2.798	1,42	6,375 % due 15.04.2042		13.240.000	901	0,46	7,050 % due 19.01.2028		233.100	3.189	1,62	
5,100 % due 15.07.2050	45.000	49	0,02	6,625 % due 15.05.2033		3.700.000	259	0,13	7,150 % due 12.11.2025		319.300	4.393	2,23	
6,000 % due 01.01.2043	150.000	188	0,10	7,000 % due 15.05.2022		909.000	65	0,03	7,400 % due 17.07.2024		440.600	6.094	3,09	
Bonos del Banco Central de Chile en Pesos				Indonesia Government International Bond				South Africa Government International Bond						
6,000 % due 01.03.2023	15.000	19	0,01	6,250 % due 15.06.2035		2.717.000	202	0,10	8,000 % due 31.01.2030	ZAR	179	11	0,01	
Brazil Government International Bond				Malaysia Government International Bond				Thailand Government International Bond						
8,500 % due 05.01.2024	BRL	19.425	3,540	1,79	8,250 % due 15.06.2032		8.820.000	696	0,35	2,000 % due 17.06.2042	THB	28.100	765	0,39
10,250 % due 10.01.2028	31.665	6.000	3,04	8,375 % due 15.09.2026		7.103.000	556	0,28	2,875 % due 17.06.2046		100	3	0,00	
12,500 % due 05.01.2022	23.634	4.392	2,23	8,375 % due 15.03.2034		25.044.000	2.000	1,01	3,300 % due 17.06.2038		55.500	1.831	0,93	
Brazil Letras do Tesouro Nacional				Mexico Government International Bond				U.S. TREASURY BILLS						
0,000 % due 01.01.2024 (a)	64.400	9.545	4,83	8,500 % due 15.05.2041		21.139.000	1.733	0,88	0,022 % due 12.11.2021					
0,000 % due 01.07.2023 (a)	1.700	239	0,12	8,750 % due 15.02.2044		18.770.000	1.541	0,78	(a)(b)(c)	\$	900	900	0,46	
Brazil Notas do Tesouro Nacional				Philippines Government International Bond				ISRAELISCHE SCHATZANLEIHEN						
10,000 % due 01.01.2023	2.200	407	0,21	9,000 % due 15.03.2029		21.139.000	1.733	0,88	0,004 % due 08.06.2022	ILS	7.200	2.231	1,13	
10,000 % due 01.01.2025	13.200	2.412	1,22	9,500 % due 15.05.2047		2.073.000	181	0,09	(a)(b)					
10,000 % due 01.01.2031	7.200	1.242	0,63	10,500 % due 15.07.2027		2.638.000	232	0,12	0,031 % due 26.11.2021 (a)(b)		2.100	2.100	1,06	
China Government Bond				Poland Government International Bond				Kurzfristige Instrumente insgesamt						
2,360 % due 02.07.2023	CNY	6.300	973	0,49	10,500 % due 15.07.2038		1.360.000	117	0,06	0,044 % due 02.12.2021 (a)(b)		1.000	1.000	0,51
2,410 % due 19.06.2025		2.600	399	0,20	Malaysia Government International Bond	MYR	117	29	0,01	0,049 % due 03.02.2022 (a)(b)		2.800	2.799	1,42
2,710 % due 19.06.2027	17.600	2.715	1,38	3,899 % due 16.11.2027		3.899.000	117	0,01	0,051 % due 31.03.2022 (a)(b)		5.100	5.099	2,58	
2,850 % due 04.06.2027	2.400	372	0,19	3,900 % due 30.11.2026		200	50	0,03	0,053 % due 03.03.2022 (a)(b)		1.000	1.000	0,51	
2,860 % due 16.07.2020	13.400	2.056	1,04	4,232 % due 30.06.2031		100	25	0,01	12.898					
2,880 % due 05.11.2033	1.800	281	0,14	4,498 % due 15.04.2030		200	52	0,03	6,54					
3,020 % due 22.10.2025	25.500	3.999	2,03	4,736 % due 15.03.2046		1.300	329	0,17	15.129					
3,030 % due 11.03.2026	3.800	596	0,30	4,921 % due 06.07.2048		1.500	391	0,20	7,67					
3,290 % due 23.05.2029	2.800	446	0,23	Malaysia Government Investment Issue		900	220	0,11	Wertpapiere insgesamt					
3,720 % due 12.04.2051	8.000	1.309	0,66	4,638 % due 15.11.2049		900	228	0,12	\$ 193.576					
3,810 % due 14.09.2050	20.000	3.291	1,67	4,895 % due 08.05.2047		900	228	0,12	98,12					
3,860 % due 22.07.2049	7.400	1.220	0,62	Mexico Government International Bond	MXN	64.492	2.999	1,52						
4,080 % due 22.10.2048	10.800	1.847	0,94	5,750 % due 05.03.2026		64.492	2.999	1,52						
Colombia Government International Bond				Philippines Government International Bond										
4,375 % due 21.03.2023	COP	640.000	171	0,09	6,250 % due 14.01.2036		154.000	3.609	1,83					
Colombian TES				Poland Government International Bond										
6,000 % due 28.04.2028	11.783.200	2.911	1,48	0,000 % due 25.04.2023 (a)	PLN	34.700	8.647	4,38						
6,250 % due 26.11.2025	3.637.900	963	0,49	1,250 % due 25.10.2030		2.800	659	0,33						
7,000 % due 30.06.2032	4.456.400	1.107	0,56	2,750 % due 25.04.2028		550	148	0,07						
7,500 % due 26.08.2026	5.581.800	1.518	0,77	2,750 % due 25.10.2029		5.085	1.357	0,69						
7,750 % due 18.09.2030	5.812.200	1.558	0,79											

**PENSIONSGESCHÄFTEN**

Kontrahent	Leihzins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kapital- betrag	Besichert durch	(Erhaltene) Sicherheiten	Pensions- geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions- geschäften <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
FICC	0,000 %*	30.09.2021	01.10.2021	\$ 867	U.S. Treasury Notes 0,875 % due 30.09.2026	\$ (884)	\$ 867	\$ 867	0,44
Pensionsgeschäfte insgesamt						\$ (884)	\$ 867	\$ 867	0,44

<sup>(1)</sup> Umfasst aufgelaufene Zinsen.

**DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)**

\* Ein Saldo von null kann auf die Rundung der tatsächlichen Beträge auf weniger als 1.000 zurückzuführen sein.

**DEVISENTERMINKONTRAKTE**

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu liefernde Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierter Wertzuwachs	Nicht realisierter (Wertverlust)	Nicht realisierter Nettowertzuwachs/ (Wertverlust)	% des Nettovermögens	
BOA	10/2021	CNH	\$	13.817	2.134	\$ 0	0,00	
	10/2021	MXN	\$	195.329	9.537	\$ 54	0,03	
	10/2021	MYR	\$	19.440	4.647	\$ 8	0,00	
	10/2021	\$	BRL	2.476	12.752	0	(0,07)	
	10/2021	430	CNH	2.784	1	0	0,00	
	10/2021	5.910	CNY	38.290	15	0	0,01	
	11/2021	1.560	\$	410	17	0	0,01	
	11/2021	RUB		1.861	25	0	0,00	
	12/2021	\$	17.160	INR	1.275.344	0	(99)	(0,05)
	12/2021	8.976	MXN	185.200	0	(42)	(0,02)	
	12/2021	4.635	MYR	19.440	0	(10)	(0,01)	
	12/2021	508	PHP	25.994	0	(3)	0,00	

## Aufstellung des Wertpapierbestands PIMCO Emerging Markets Advantage Local Bond Index UCITS ETF (Fortsetzung)

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu liefernde Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierter Wertzuwachs	Nicht realisierter (Wertverlust)	Nicht realisierter Nettowertzuwachs/ (Wertverlust)	% des Nettovermögens	
	12/2021	ZAR	3.170	\$	221	\$	12	0,01
	02/2022	PLN	1.895		494		18	0,01
BPS	10/2021	CNH	8.233		1.270		(4)	0,00
	10/2021	\$	10.323	BRL	54.547		(313)	(0,16)
	10/2021		12.144	MXN	245.252		(209)	(0,11)
	11/2021	BRL	54.547	\$	10.275		311	0,16
	11/2021	\$	205	IDR	2.942.427		0	0,00
	11/2021		2.357	MXN	47.582		(53)	(0,03)
	12/2021	PHP	23.678	\$	464		4	0,00
	12/2021	\$	247	INR	18.312		(2)	0,00
	12/2021	ZAR	657	\$	46		3	0,00
BRC	01/2022	MXN	245.252		11.976		210	0,11
	10/2021	MYR	3.030		726		3	0,00
	11/2021	RUB	26.645		357		(6)	0,00
	12/2021	\$	1.784	THB	58.470		(57)	(0,03)
	03/2022	THB	9.316	\$	298		22	0,01
BSS	10/2021	\$	247	CLP	189.919		(14)	(0,01)
CBK	10/2021	CLP	1.628.611	\$	2.118		116	0,06
	10/2021	\$	222	CLP	174.112		(8)	0,00
	11/2021	PLN	162	\$	42		1	0,00
	11/2021	RUB	15.406		206		(4)	0,00
	12/2021	CNH	4.599		708		(1)	0,00
	12/2021	ZAR	2.550		176		8	0,00
	02/2022	PLN	1.455		380		14	0,01
	06/2022	ILS	7.200		2.220		(19)	(0,01)
DUB	11/2021	CLP	2.104.026		2.939		359	0,19
GLM	10/2021	BRL	15.322		2.951		139	0,07
	10/2021	CNH	6.265		987		(3)	0,00
	10/2021	DOP	464.449		8.058		(138)	(0,07)
	10/2021	\$	227	CLP	177.182		(9)	(0,01)
	10/2021		9.623	MXN	194.624		(174)	(0,09)
	10/2021		2.955	RUB	218.036		31	0,01
	11/2021	RUB	28.006	\$	376		(6)	0,00
	12/2021	CNH	4.616		710		(1)	0,00
	12/2021	\$	1.811	IDR	26.066.835		(4)	0,00
	12/2021	ZAR	1.963	\$	136		7	0,00
	03/2022	THB	30.780		981		72	0,04
HUS	11/2021	COP	19.183.733		4.972		(44)	(0,02)
	11/2021	IDR	2.901.730		202		0	0,00
	11/2021	RUB	397		5		0	0,00
	12/2021	PHP	2.127		44		3	0,00
	12/2021	\$	596	IDR	8.584.417		(1)	0,00
	12/2021	ZAR	2.571	\$	178		8	0,00
IND	10/2021	\$	723	MYR	3.030		0	0,00
	12/2021	MYR	3.030	\$	722		1	0,00
JPM	10/2021	MXN	245.252		11.935		0	0,00
	10/2021	RUB	182.231		2.487		(8)	(0,01)
	11/2021	\$	1.582	IDR	22.736.855		(1)	0,00
	12/2021	INR	24.151	\$	324		1	0,00
	12/2021	PHP	169.882		3.519		217	0,11
	12/2021	\$	1.516	THB	49.741		(46)	(0,02)
MYI	10/2021	BRL	51.977	\$	9.611		73	0,04
	10/2021	RUB	14.769		200		(2)	0,00
	10/2021	\$	5.156	CNY	33.389		11	0,01
	11/2021	PLN	2.938	\$	773		33	0,02
	11/2021	\$	518	IDR	7.442.800		0	0,00
	12/2021	PHP	17.565	\$	344		3	0,00
	12/2021	\$	4.336	PHP	220.561		(49)	(0,03)
RYL	10/2021	MXN	5.644	\$	280		7	0,00
SCX	10/2021	RUB	64.266		865		(15)	(0,01)
	10/2021	\$	4.672	MYR	19.440		(32)	(0,02)
	12/2021	CNH	5.451	\$	838		(2)	0,00
	12/2021	\$	6.478	CNY	42.159		15	0,01
	12/2021		1.101	IDR	15.815.353		(5)	0,00
	12/2021		12.820	INR	950.553		(104)	(0,05)
SOG	12/2021	ZAR	4.564	\$	319		18	0,01
	12/2021	INR	1.802		24		0	0,00
TOR	12/2021	CNH	4.947		763		1	0,00
	12/2021	MXN	77.895		3.864		106	0,05
	12/2021	\$	558	IDR	8.017.043		(2)	0,00
UAG	10/2021	CLP	353.771	\$	457		22	0,01
	11/2021	RUB	7.735		103		(2)	0,00
	12/2021	ZAR	5.034		347		15	0,01
						\$	1.959	
						\$	(1.633)	
						\$	326	
								0,17
Derivative OTC-Finanzinstrumente insgesamt						\$	326	0,17
Anlagen insgesamt						\$	194.769	98,73
Sonstige kurzfristige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten						\$	2.504	1,27
Nettovermögen						\$	197.273	100,00

## ANGABEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Beträge in Tsd.\*):

\* Ein Saldo von null kann auf die Rundung der tatsächlichen Beträge auf weniger als 1.000 zurückzuführen sein.

- (a) Nullkupon-Papier.
- (b) Kupon stellt eine Rendite bis Fälligkeit dar.
- (c) Zum 30. September 2021 wurden Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von 14\$ als Sicherheiten für derivative Finanzinstrumente verpfändet, die von Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. geregelt werden.

Bewertung zum beizulegenden Zeitwert<sup>(1)</sup>

Die folgende Darstellung ist eine Zusammenfassung der Zeitwertbewertung gemäß den zum 30. September 2021 für die Bewertung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten der Fonds verwendeten Parametern:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Preise für identische Anlagen (Ebene 1)	Sonstige wesentliche beobachtbare Parameter (Ebene 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Parameter (Ebene 3)	Beizulegender Zeitwert
Wertpapiere	\$ 0	\$ 193.576	\$ 0	\$ 193.576
Pensionsgeschäfte	0	867	0	867
Derivative Finanzinstrumente <sup>(3)</sup>	0	326	0	326
<b>Gesamt</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 194.769</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 194.769</b>

Die folgende Darstellung ist eine Zusammenfassung der Zeitwertbewertung gemäß den zum 31. März 2021 für die Bewertung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten der Fonds verwendeten Parametern:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Preise für identische Anlagen (Ebene 1)	Sonstige wesentliche beobachtbare Parameter (Ebene 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Parameter (Ebene 3)	Beizulegender Zeitwert
Wertpapiere	\$ 0	\$ 261.819	\$ 0	\$ 261.819
Derivative Finanzinstrumente <sup>(3)</sup>	0	(275)	0	(275)
<b>Gesamt</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 261.544</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 261.544</b>

<sup>(1)</sup> Siehe Anmerkung 3 in den Anmerkungen zum Abschluss für weitere Informationen.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

<sup>(3)</sup> Derivative Finanzinstrumente umfassen ggf. offene Futures, Swap-Vereinbarungen, verkaufte Optionen, gekaufte Optionen und Devisenterminkontrakte.

(Erhaltene) / verpfändete Sicherheiten für derivative OTC-Finanzinstrumente

Die folgende Tabelle ist eine Zusammenfassung des beizulegenden Zeitwerts der derivativen OTC-Finanzinstrumente und (erhaltenen)/verpfändeten Sicherheiten zum 30. September 2021:

Kontrahent	Beizulegender Zeitwert von OTC-Derivaten insgesamt	(Erhaltene) / verpfändete Sicherheiten	Nettoengagement <sup>(1)</sup>
BOA	\$ (170)	\$ 14	\$ (156)
BPS	(53)	0	(53)
BRC	(38)	0	(38)
BSS	(14)	0	(14)
CBK	107	0	107
DUB	359	(370)	(11)
GLM	(86)	0	(86)
HUS	(34)	0	(34)
IND	1	0	1
JPM	163	0	163
MYI	69	0	69
RYL	7	0	7
SCX	(125)	0	(125)
TOR	105	0	105
UAG	35	0	35

<sup>(1)</sup> Das Netto-Engagement stellt die Nettoforderung/(-verbindlichkeit) dar, die bei einem Ausfall vom bzw. an den Kontrahenten zu zahlen wäre.

Vergleichsangaben

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. September 2021:

	30. Sept. 2021 (%)	31. März 2021 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene Wertpapiere	69,76	62,92
An einem anderen geregelten Markt gehandelte Wertpapiere*	28,36	38,08
Pensionsgeschäfte	0,44	-
Derivative OTC-Finanzinstrumente	0,17	(0,11)

\* Gemäß der in Anhang 2 des Verkaufsprospekt angegebenen Liste von Märkten, die die OGAW-Kriterien für geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. September 2021 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum beizulegenden Zeitwert	30. Sept. 2021 (%)	31. März 2021 (%)
Staatsanleihen	90,45	92,13
Kurzfristige Instrumente	7,67	8,87
Pensionsgeschäfte	0,44	-
Derivative OTC-Finanzinstrumente		
Devisenterminkontrakte	0,17	(0,11)
Sonstige kurzfristige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	1,27	(0,89)
<b>Nettovermögen</b>	<b>100,00</b>	<b>100,00</b>

## Aufstellung des Wertpapierbestands PIMCO Euro Low Duration Corporate Bond UCITS ETF

BESCHREIBUNG	NENN- WERT (in Tsd.)	BEIZULE- GENDER ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	NENN- WERT (in Tsd.)	BEIZULE- GENDER ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	NENN- WERT (in Tsd.)	BEIZULE- GENDER ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO VERMÖ- GENS				
<b>WERTPAPIERE</b>				<b>FRANKREICH</b>				<b>0,375 % due 16.06.2027</b>			€ 1.000	€ 1.001	0,39		
<b>AUSTRALIEN</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN</b>				<b>Deutschland insgesamt</b>				20.927	8,27		
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN</b>				<b>BNP Paribas S.A.</b>				<b>GUERNSEY, KANALINSELN</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN</b>			
Woolworths Group Ltd. 0,375 % due 15.11.2028	€	300	€ 298	0,12	0,500 % due 15.07.2025	€	800	€ 811	0,32	Globalworth Real Estate Investments Ltd. 3,000 % due 29.03.2025			700	751	0,29
					1,125 % due 22.11.2023	1.100	1.132	0,45	Sirius Real Estate Ltd. 1,125 % due 22.06.2026			500	502	0,20	
					1,125 % due 28.08.2024	1.300	1.347	0,53	<b>Guernsey, Kanalinseln insgesamt</b>				1.253	0,49	
<b>ÖSTERREICH</b>				<b>BPCE S.A.</b>				<b>INDIEN</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN</b>				<b>0,500 % due 15.09.2027</b>			1.400	1.407	0,56	<b>Shriram Transport Finance Co. Ltd.</b>				<b>5,950 % due 24.10.2022</b>	
CA Immobilien Anlagen AG 1,000 % due 27.10.2025		800	820	0,33	Bureau Veritas S.A. 1,250 % due 07.09.2023	1.600	1.636	0,65	Indonesia Government International Bond 2,625 % due 14.06.2023			€ 1.600	1.669	0,66	
IMMOFINANZ AG 2,625 % due 27.01.2023		600	616	0,24	Credit Agricole Assurances S.A. 4,500 % due 14.10.2025 (d)	1.500	1.710	0,68	<b>IRLAND</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN</b>		
Österreich insgesamt			1.436	0,57	ELO SACA 3,250 % due 23.07.2027	200	229	0,09	<b>AIB Group PLC</b>				<b>0,500 % due 17.11.2027</b>		
					Holding d'Infrastructures et des Metiers de l'Environnement 0,125 % due 16.09.2025	300	300	0,12	2,875 % due 30.05.2031			800	803	0,32	
<b>BELGIEN</b>				<b>Indigo Group S.A.S.</b>				<b>Bank of Ireland Group PLC</b>				<b>1,375 % due 29.08.2023</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN</b>				<b>2,125 % due 16.04.2025</b>			1.200	1.276	0,50	1,375 % due 11.08.2031			1.500	1.543	0,61
Barry Callebaut Services NV 2,375 % due 24.05.2024		1.700	1.797	0,71	Mutuelle Assurance Des Commerçants et Industriels de France et Des 0,625 % due 21.06.2027	900	895	0,35	Dell Bank International DAC 1,625 % due 24.06.2024			600	625	0,25	
Sofina S.A. 1,000 % due 23.09.2028		2.400	2.373	0,94	Peugeot Invest 1,875 % due 30.10.2026	800	834	0,33	German Postal Pensions Securitisation PLC 4,375 % due 18.01.2022			2.000	2.029	0,80	
UCB S.A. 1,000 % due 30.03.2028		400	404	0,16	SEB S.A. 1,375 % due 16.06.2025	600	618	0,24	<b>Irland insgesamt</b>				<b>6.803</b>		
5,125 % due 22.10.2023		217	239	0,09	1,500 % due 31.05.2024	700	723	0,29							
Belgien insgesamt			4.813	1,90	2,375 % due 25.11.2022	700	715	0,28							
					Societe Generale S.A. 0,875 % due 01.07.2026	200	205	0,08							
<b>BERMUDA</b>				<b>1,250 % due 15.02.2024</b>			300	310	0,12						
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN</b>				<b>TDF Infrastructure SASU</b>											
Bacardi Ltd. 2,750 % due 03.07.2023		3.900	4.087	1,62	2,875 % due 19.10.2022	1.500	1.535	0,61							
					Ubisoft Entertainment S.A. 0,878 % due 24.11.2027	1.700	1.687	0,67							
<b>KANADA</b>				<b>1,289 % due 30.01.2023</b>			700	710	0,28						
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN</b>				<b>Vilmorin &amp; Cie S.A.</b>											
Bank of Nova Scotia 1,049 % due 02.10.2026	£	2.100	2.527	1,00	Worldline S.A. 1,625 % due 13.09.2024	2.000	2.086	0,82							
							20.569	8,13							
<b>KAIMANINSELN</b>				<b>STAATSANLEIHEN</b>				<b>France Government International Bond</b>				<b>0,250 % due 25.07.2024 (c)</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN</b>				<b>France Government International Bond</b>				<b>3,151</b>				<b>3.415</b>			
Avolon Holdings Funding Ltd. 4,250 % due 15.04.2026	\$	400	371	0,15	Frankreich insgesamt				<b>23.984</b>				<b>9,48</b>		
Hutchison Whampoa Finance Ltd. 1,375 % due 31.10.2021	€	2.700	2.704	1,07	<b>DEUTSCHLAND</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN</b>						
Sunac China Holdings Ltd. 5,950 % due 26.04.2024	\$	500	341	0,13	<b>Bayer AG</b>				<b>0,375 % due 06.07.2024</b>			1.200	1.215	0,48	
Kaimaninseln insgesamt			3.416	1,35	<b>Daimler AG</b>				<b>0,000 % due 03.07.2024</b>			300	302	0,12	
					<b>Deutsche Bank AG</b>				<b>0,750 % due 17.02.2027</b>			800	807	0,32	
<b>CHINA</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN</b>				<b>1,000 % due 19.11.2025</b>			4.100	4.191	1,66		
Bank of China Ltd. 0,250 % due 17.04.2022	€	700	701	0,28	<b>Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide</b>				<b>1,625 % due 09.07.2024</b>			1.500	1.550	0,61	
China Huaneng Group Hong Kong Treasury Management Holding Ltd. 2,400 % due 10.12.2022	\$	1.600	1.405	0,55	<b>Gruenenthal GmbH</b>				<b>3,625 % due 15.11.2026</b>			600	624	0,25	
China insgesamt			2.106	0,83	<b>Hamburg Commercial Bank AG</b>				<b>0,500 % due 22.09.2026</b>			1.200	1.204	0,48	
					<b>Schaeffler AG</b>				<b>0,750 % due 23.11.2023</b>			100	101	0,04	
<b>ZYPERN</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN</b>				<b>Sixt SE</b>				<b>1,750 % due 09.12.2024</b>			
Cyprus Government International Bond 0,000 % due 09.02.2026 (a)	€	200	201	0,08	<b>Vantage Towers AG</b>				<b>0,000 % due 31.03.2025 (a)</b>			2.300	2.297	0,91	
					<b>Volkswagen Bank GmbH</b>				<b>1,875 % due 31.01.2024</b>			3.300	3.446	1,36	
<b>DÄNEMARK</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN</b>				<b>Volkswagen Financial Services AG</b>				<b>0,875 % due 12.04.2023</b>			
H Lundbeck A/S 0,875 % due 14.10.2027		1.200	1.225	0,48	<b>Vonovia SE</b>				<b>0,250 % due 01.09.2028</b>			400	393	0,15	
					<b>FINNLAND</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN</b>						
Neste Oyj 0,750 % due 25.03.2028		300	300	0,12	<b>Asahi Group Holdings Ltd.</b>				<b>0,010 % due 19.04.2024</b>			€ 200	201	0,08	
					<b>Japan Government International Bond</b>				<b>0,155 % due 23.10.2024</b>			100	101	0,04	
					<b>Mizuho Financial Group, Inc.</b>				<b>0,000 % due 10.04.2023</b>			1.500	1.510	0,60	
					<b>0,118 % due 06.09.2024</b>							400	402	0,16	



## Aufstellung des Wertpapierbestands PIMCO Euro Low Duration Corporate Bond UCITS ETF (Fortsetzung)

BESCHREIBUNG	NENN- WERT (in Tsd.)	BEIZULE- GENDER ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	NENN- WERT (in Tsd.)	BEIZULE- GENDER ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	NENN- WERT (in Tsd.)	BEIZULE- GENDER ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
Hawksmoor Mortgages PLC 1,100 % due 25.05.2053	£ 1.506	€ 1.760	0,69	Ford Motor Credit Co. LLC 0,000 % due 07.12.2022	€ 1.200	€ 1.196	0,47	FRANCE TREASURY BILLS			
Towd Point Mortgage Funding PLC 1,097 % due 20.10.2051	423	496	0,20	1,744 % due 19.07.2024	700	709	0,28	(0,659) % due 17.11.2021 (a)(b)	€ 300	€ 300	0,12
		2.627	1,04	General Electric Co. 0,875 % due 17.05.2025	2.500	2.569	1,01	(0,659) % due 24.11.2021 (a)(b)	390	391	0,15
Vereinigtes Königreich insgesamt		28.598	11,30	Global Payments, Inc. 2,650 % due 15.02.2025	\$ 100	90	0,04	(0,656) % due 17.11.2021 (a)(b)	100	100	0,04
				Goldman Sachs Group, Inc. 0,010 % due 30.04.2024	€ 2.500	2.505	0,99	(0,655) % due 10.11.2021 (a)(b)	220	220	0,09
				2,000 % due 27.07.2023	1.800	1.873	0,74	(0,654) % due 17.11.2021 (a)(b)	310	310	0,12
				JPMorgan Chase & Co. 0,625 % due 25.01.2024	1.300	1.324	0,52	(0,651) % due 20.10.2021 (a)(b)	20	20	0,01
				Kinder Morgan, Inc. 1,500 % due 16.03.2022	900	908	0,36	(0,647) % due 20.10.2021 (a)(b)	530	530	0,21
				Las Vegas Sands Corp. 2,900 % due 25.06.2025	\$ 700	607	0,24	(0,646) % due 20.10.2021 (a)(b)	1.080	1.081	0,43
				Mattel, Inc. 3,375 % due 01.04.2026	1.100	980	0,39	(0,645) % due 20.10.2021 (a)(b)	300	300	0,12
				Metropolitan Life Global Funding 0,375 % due 09.04.2024	€ 300	305	0,12				
				MPT Operating Partnership LP 2,550 % due 05.12.2023	€ 1.100	1.315	0,52				
				Philip Morris International, Inc. 2,875 % due 30.05.2024	€ 1.600	1.728	0,68				
				Quanta Services, Inc. 0,950 % due 01.10.2024	\$ 500	432	0,17				
				Radian Group, Inc. 6,625 % due 15.03.2025	900	868	0,34				
				Reliance Standard Life Global Funding 2,625 % due 22.07.2022	400	352	0,14				
				Standard Industries, Inc. 2,250 % due 21.11.2026	€ 1.500	1.483	0,59				
				Utah Acquisition Sub, Inc. 2,250 % due 22.11.2024	1.000	1.065	0,42				
				Wells Fargo & Co. 0,500 % due 26.04.2024	1.200	1.219	0,48				
				1,359 % due 31.10.2023	\$ 1.700	1.485	0,59				
				Worley U.S. Finance Sub Ltd. 0,875 % due 09.06.2026	€ 1.100	1.112	0,44				
				Vereinigte Staaten insgesamt		41.057	16,23				

BESCHREIBUNG	NENN- WERT (in Tsd.)	BEIZULE- GENDER ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
KURZFRISTIGE INSTRUMENTE			
FRANCE TREASURY BILLS			
(0,659) % due 17.11.2021 (a)(b)	€ 300	€ 300	0,12
(0,659) % due 24.11.2021 (a)(b)	390	391	0,15
(0,656) % due 17.11.2021 (a)(b)	100	100	0,04
(0,655) % due 10.11.2021 (a)(b)	220	220	0,09
(0,654) % due 17.11.2021 (a)(b)	310	310	0,12
(0,651) % due 20.10.2021 (a)(b)	20	20	0,01
(0,647) % due 20.10.2021 (a)(b)	530	530	0,21
(0,646) % due 20.10.2021 (a)(b)	1.080	1.081	0,43
(0,645) % due 20.10.2021 (a)(b)	300	300	0,12
		3.252	1,29

BESCHREIBUNG	NENN- WERT (in Tsd.)	BEIZULE- GENDER ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
DEUTSCHE SCHATZANLEIHEN			
(0,653) % due 27.10.2021 (a)(b)	300	300	0,12
(0,652) % due 27.10.2021 (a)(b)	1.330	1.330	0,52
		1.630	0,64
Kurzfristige Instrumente insgesamt		4.882	1,93

Wertpapiere insgesamt € 235.379 93,03

BESCHREIBUNG	NENN- WERT (in Tsd.)	BEIZULE- GENDER ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
ANTEILE			
INVESTMENTFONDS			
BÖRSENGEHANDELTE FONDS			
PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (e)	69.000	6.740	2,66
Investmentfonds insgesamt	€	6.740	2,66

### PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Leihzins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kapitalbetrag	Besichert durch	(Erhaltene) Sicherheiten	Pensionsgeschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions- geschäften <sup>(1)</sup>	% des Netto- vermögens
BPS	(1,000) %	30.09.2021	01.10.2021	€ 6.900	Bundesrepublik Deutschland 0,000% due 15.08.2050	€ (6.887)	€ 6.900	€ 6.900	2,73
FICC	0,000	30.09.2021	01.10.2021	\$ 111	U.S. Treasury Notes 0,875 % due 30.09.2026	(98)	96	96	0,03
Pensionsgeschäfte insgesamt						€ (6.985)	€ 6.996	€ 6.996	2,76

<sup>(1)</sup> Umfasst aufgelaufene Zinsen.

### AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE DERIVATIVE FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Ein Saldo von null kann auf die Rundung der tatsächlichen Beträge auf weniger als 1.000 zurückzuführen sein.

### FUTURES

Beschreibung	Typ	Verfallsmonat	# der Kontrakte	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)	% des Netto- vermögens
Euro-Bobl December Futures	Long	12/2021	200	€ (150)	(0,06)
Euro-Bund 10-Year Bond December Futures	Short	12/2021	69	100	0,04
Euro-Schatz December Futures	Long	12/2021	505	(35)	(0,01)
U.S. Treasury 2-Year Note December Futures	Short	12/2021	78	6	0,00
U.S. Treasury 5-Year Note December Futures	Short	12/2021	46	30	0,01
U.S. Treasury 10-Year Note December Futures	Short	12/2021	1	2	0,00
U.S. Treasury 10-Year Ultra December Futures	Long	12/2021	14	(22)	(0,01)
United Kingdom Long Gilt December Futures	Short	12/2021	34	124	0,05
				€ 55	0,02
An einem geregelten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente insgesamt				€ 55	0,02



## ZENTRAL ABGEWICKELTE DERIVATIVE FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*)

\* Ein Saldo von null kann auf die Rundung der tatsächlichen Beträge auf weniger als 1.000 zurückzuführen sein.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF EMISSIONEN VON UNTERNEHMEN, STAATEN UND US-KOMMUNEN - ALS SICHERUNGSGEBER<sup>(1)</sup>

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nominalbetrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)	% des Nettovermögens
Auchan Holding S.A.	1,000 %	20.12.2027	€ 400	€ 23	0,01
Rolls-Royce PLC	1,000	20.06.2024	1.100	(12)	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20.12.2024	300	(4)	0,00
Stellantis NV	5,000	20.06.2026	1.300	(4)	0,00
Telefonica Emisiones S.A.	1,000	20.06.2026	200	2	0,00
Valeo S.A.	1,000	20.06.2026	1.300	(1)	0,00
Vodafone Group PLC	1,000	20.06.2024	500	6	0,00
Volkswagen International Finance N.V.	1,000	20.12.2026	700	(1)	0,00
				€ 9	0,01

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - ALS SICHERUNGSGEBER<sup>(1)</sup>

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nominalbetrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)	% des Nettovermögens
iTraxx Europe Main 36 5-Year Index	1,000 %	20.12.2026	€ 2.400	€ 1	0,00

## ZINSSWAPS

Zu zahlen/zu erhalten variabler Zins	Zinsvariabler Index	Festzins	Fälligkeitsdatum	Nominalbetrag	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)	% des Nettovermögens
Zu erhalten	6-Month JPY-LIBOR	0,300 %*	20.09.2027	¥ 380.000	€ (43)	(0,02)
Zentral abgewickelte derivative Finanzinstrumente insgesamt					€ (33)	(0,01)

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Der Maximalbetrag, der vom Fonds bei einem Kreditereignis nach Maßgabe der betreffenden Swap-Vereinbarung als Sicherungsgeber potenziell gefordert oder als Sicherungsnehmer potenziell vereinnahmt werden kann.

## DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Ein Saldo von null kann auf die Rundung der tatsächlichen Beträge auf weniger als 1.000 zurückzuführen sein.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF EMISSIONEN VON UNTERNEHMEN, STAATEN UND US-KOMMUNEN - ALS SICHERUNGSGEBER<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nominalbetrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte / (erhaltene) Prämien	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)	Beizulegen der Zeitwert	% des Nettovermögens
JPM	Hochtief AG	5,000 %	20.12.2026	€ 400	€ 81	€ 0	€ 81	0,03

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Der Maximalbetrag, der vom Fonds bei einem Kreditereignis nach Maßgabe der betreffenden Swap-Vereinbarung als Sicherungsgeber potenziell gefordert oder als Sicherungsnehmer potenziell vereinnahmt werden kann.

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu liefernde Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierter Wertzuwachs	Nicht realisierter (Wertverlust)	Nicht realisierter Nettowertzuwachs/ (Wertverlust)	% des Nettovermögens
BPS	11/2021	AUD	1.094	€ 680	€ 0	€ (1)	0,00
BRC	11/2021	\$	210	€ 179	€ (2)	€ (2)	0,00
JPM	11/2021	£	13.205	€ 15.554	€ 204	€ 204	0,08
	11/2021	\$	586	€ 496	€ 0	€ (9)	0,00
SCX	11/2021	€	1.664	€ 1.421	€ 0	€ (12)	0,00
	11/2021	£	233	€ 272	€ 1	€ 1	0,00
UAG	11/2021	€	156	€ 182	€ 1	€ 1	0,00
	11/2021	\$	18.780	€ 15.973	€ 0	€ (219)	(0,09)
				€ 206	€ (243)	€ (37)	(0,01)

Derivative OTC-Finanzinstrumente insgesamt

€ 44 0,02

Anlagen insgesamt

€ 249.181 98,48

Sonstige kurzfristige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten

€ 3.850 1,52

Nettovermögen

€ 253.031 100,00

## Aufstellung des Wertpapierbestands PIMCO Euro Low Duration Corporate Bond UCITS ETF (Fortsetzung)

### ANGABEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Beträge in Tsd.\*):

\* Ein Saldo von null kann auf die Rundung der tatsächlichen Beträge auf weniger als 1.000 zurückzuführen sein.

- (a) Nullkupon-Papier.
- (b) Kupon stellt eine gewichtete Durchschnittsrendite bis Fälligkeit dar.
- (c) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.
- (d) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.
- (e) Mit dem Fonds verbunden.
- (f) Bedingt wandelbares Wertpapier.

Barmittel in Höhe von 2.100€ waren zum 30. September 2021 als Sicherheiten für börsengehandelte und zentral abgewickelte derivative Finanzinstrumente verpfändet.

Bewertung zum beizulegenden Zeitwert<sup>(1)</sup>

Die folgende Darstellung ist eine Zusammenfassung der Zeitwertbewertung gemäß den zum 30. September 2021 für die Bewertung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten der Fonds verwendeten Parametern:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Preise für identische Anlagen (Ebene 1)	Sonstige wesentliche beobachtbare Parameter (Ebene 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Parameter (Ebene 3)	Beizulegender Zeitwert
Wertpapiere	€ 0	€ 235.379	€ 0	€ 235.379
Investmentfonds	100	6.640	0	6.740
Pensionsgeschäfte	0	6.996	0	6.996
Derivative Finanzinstrumente <sup>(3)</sup>	39	27	0	66
<b>Gesamt</b>	<b>€ 139</b>	<b>€ 249.042</b>	<b>€ 0</b>	<b>€ 249.181</b>

Die folgende Darstellung ist eine Zusammenfassung der Zeitwertbewertung gemäß den zum 31. März 2021 für die Bewertung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten der Fonds verwendeten Parametern:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Preise für identische Anlagen (Ebene 1)	Sonstige wesentliche beobachtbare Parameter (Ebene 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Parameter (Ebene 3)	Beizulegender Zeitwert
Wertpapiere	€ 0	€ 230.935	€ 0	€ 230.935
Investmentfonds	6.751	0	0	6.751
Pensionsgeschäfte	0	14.400	0	14.400
Derivative Finanzinstrumente <sup>(3)</sup>	237	(417)	0	(180)
<b>Gesamt</b>	<b>€ 6.988</b>	<b>€ 244.918</b>	<b>€ 0</b>	<b>€ 251.906</b>

<sup>(1)</sup> Siehe Anmerkung 3 in den Anmerkungen zum Abschluss für weitere Informationen.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

<sup>(3)</sup> Derivative Finanzinstrumente umfassen ggf. offene Futures, Swap-Vereinbarungen, verkaufte Optionen, gekaufte Optionen und Devisenterminkontrakte.

(Erhaltene) / verpfändete Sicherheiten für derivative OTC-Finanzinstrumente

Die folgende Tabelle ist eine Zusammenfassung des beizulegenden Zeitwerts der derivativen OTC-Finanzinstrumente und (erhaltenen)/verpfändeten Sicherheiten zum 30. September 2021:

Kontrahent	Beizulegender Zeitwert von OTC-Derivaten insgesamt	(Erhaltene) / verpfändete Sicherheiten	Nettoengagement <sup>(1)</sup>
BPS	€ (1)	€ 0	€ (1)
BRC	(2)	0	(2)
JPM	276	(270)	6
SCX	(11)	0	(11)
UAG	(218)	0	(218)

<sup>(1)</sup> Das Netto-Engagement stellt die Nettoforderung/(-verbindlichkeit) dar, die bei einem Ausfall vom bzw. an den Kontrahenten zu zahlen wäre.

Vergleichsangaben

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. September 2021:

	30. Sept. 2021 (%)	31. März 2021 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene Wertpapiere	85,90	85,66
An einem anderen geregelten Markt gehandelte Wertpapiere*	7,13	4,54
Investmentfonds	2,66	2,64
Pensionsgeschäfte	2,76	5,62
An einem geregelten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente	0,02	0,09
Zentral abgewickelte derivative Finanzinstrumente	(0,01)	0,11
Derivative OTC-Finanzinstrumente	0,02	(0,27)

\* Gemäß der in Anhang 2 des Verkaufsprospekt angegebenen Liste von Märkten, die die OGAW-Kriterien für geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. September 2021 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum beizulegenden Zeitwert	30. Sept. 2021 (%)	31. März 2021 (%)
Australien	0,12	-
Österreich	0,57	0,72
Belgien	1,90	1,44
Bermuda	1,62	1,69
Kanada	1,00	-
Kaimaninseln	1,35	1,37
China	0,83	0,82
Zypern	0,08	0,08
Dänemark	0,48	0,52
Finnland	0,12	0,12
Frankreich	9,48	9,29
Deutschland	8,27	7,51
Guernsey, Kanalinseln	0,49	1,20
Indien	0,21	0,21
Indonesien	0,66	0,66
Irland	2,69	2,18
Insel Man	0,31	0,30
Italien	3,38	4,34
Japan	2,50	3,79
Jersey, Kanalinseln	0,30	0,29
Luxemburg	5,54	7,26
Mauritius	0,07	0,07
Niederlande	11,36	8,80
Norwegen	0,36	0,34
Saudi-Arabien	0,38	0,37
Slowenien	0,16	0,15
Südkorea	0,27	0,28
Spanien	4,44	6,09
Schweden	2,01	1,77
Schweiz	2,62	1,55
Vereinigtes Königreich	11,30	12,74
USA	16,23	13,82
Kurzfristige Instrumente	1,93	0,43
Investmentfonds	2,66	2,64
Pensionsgeschäfte	2,76	5,62
An einem geregelten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente		
Futures	0,02	0,09
Zentral abgewickelte derivative Finanzinstrumente		
Credit Default Swaps auf Emissionen von Unternehmen, Staaten und US-Kommunen – Schutzkauf	-	0,14
Credit Default Swaps auf Emissionen von Unternehmen, Staaten und US-Kommunen – Als Sicherungsgeber	0,01	(0,01)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes - Als Sicherungsgeber	-	0,00
Zinsswaps	(0,02)	(0,02)
Derivative OTC-Finanzinstrumente		
Credit Default Swaps auf Emissionen von Unternehmen, Staaten und US-Kommunen - Als Sicherungsgeber	0,03	0,03
Devisenterminkontrakte	(0,01)	(0,30)
Sonstige kurzfristige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	1,52	1,61
<b>Nettovermögen</b>	<b>100,00</b>	<b>100,00</b>



BESCHREIBUNG	NENN- WERT (in Tsd.)	BEIZULE- GENDER ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	NENN- WERT (in Tsd.)	BEIZULE- GENDER ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	NENN- WERT (in Tsd.)	BEIZULE- GENDER ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO VERMÖ- GENS
<b>BESCHREIBUNG</b>				<b>ITALIEN</b>				<b>BESCHREIBUNG</b>			
Raffinerie Heide GmbH 6,375 % due 01.12.2022	€ 100	€ 89	0,08	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN</b>				Piaggio & C SpA 3,625 % due 30.04.2025	€ 100	€ 102	0,09
Renk AG 5,750 % due 15.07.2025	132	138	0,13	Almaniva-The Italian Innovation Co. SpA 7,250 % due 15.10.2022	€ 200	€ 200	0,18	Pro-Gest SpA 3,250 % due 15.12.2024	150	147	0,13
RWE AG 3,500 % due 21.04.2075	100	107	0,10	Assicurazioni Generali SpA 4,596 % due 21.11.2025	700	787	0,72	Rekeep SpA 7,250 % due 01.02.2026	115	124	0,11
Safari Holding Verwaltungs GmbH 5,375 % due 30.11.2022	150	146	0,13	(b)(c)				SACE SpA 3,875 % due 10.02.2025 (b)	200	209	0,19
Schaeffler AG 1,875 % due 26.03.2024	200	206	0,19	Atlantia SpA 1,625 % due 03.02.2025	1.600	1.644	1,51	Sisal Group SpA 7,000 % due 31.07.2023	198	198	0,18
Schenck Process Holding GmbH 5,375 % due 15.06.2023	300	320	0,29	Azzurra Aeroporti SpA 2,125 % due 30.05.2024	115	118	0,11	Telecom Italia SpA 2,500 % due 19.07.2023	400	416	0,38
SGL Carbon SE 4,625 % due 30.09.2024	170	174	0,16	Banca del Mezzogiorno-MedioCredito Centrale SpA 1,500 % due 24.10.2024	200	205	0,19	2,875 % due 28.01.2026	150	159	0,15
Standard Profil Automotive GmbH 6,250 % due 30.04.2026	100	92	0,08	Banca IFIS SpA 4,500 % due 17.10.2027	250	254	0,23	3,000 % due 30.09.2025	200	213	0,20
Techem Verwaltungsgesellschaft mbH 2,000 % due 15.07.2025	300	299	0,27	Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 1,875 % due 09.01.2026	450	453	0,42	3,625 % due 19.01.2024	250	267	0,24
Tele Columbus AG 3,875 % due 02.05.2025	300	302	0,28	3,625 % due 24.09.2024	420	439	0,40	4,000 % due 11.04.2024	750	803	0,74
thyssenkrupp AG 1,375 % due 03.03.2022	373	373	0,34	4,000 % due 10.07.2022	380	385	0,35	UniCredit SpA 2,000 % due 23.09.2029	400	408	0,37
2,875 % due 22.02.2024	725	744	0,68	5,375 % due 18.01.2028	225	171	0,16	4,875 % due 20.02.2029	437	475	0,44
TUI Cruises GmbH 6,500 % due 15.05.2026	100	103	0,09	8,000 % due 22.01.2030	250	202	0,18	6,950 % due 31.10.2022	730	784	0,72
ZF Finance GmbH 3,000 % due 21.09.2025	300	316	0,29	8,500 % due 10.09.2030	100	82	0,08	UnipolSai Assicurazioni SpA 5,750 % due 18.06.2024 (b)	450	498	0,46
Deutschland insgesamt	14.582	13,37		Banca Popolare di Sondrio SCpA 2,375 % due 03.04.2024	300	314	0,29	Webuild SpA 1,750 % due 26.10.2024	306	309	0,28
				Banco BPM SpA 1,625 % due 18.02.2025	250	254	0,23	5,875 % due 15.12.2025	120	134	0,12
				1,750 % due 24.04.2023	200	205	0,19	Italien insgesamt	19.086	17,50	
				1,750 % due 28.01.2025	100	104	0,10				
				2,500 % due 21.06.2024	300	317	0,29	<b>JAPAN</b>			
				3,250 % due 14.01.2031	100	102	0,09	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN</b>			
				4,250 % due 01.10.2029	200	213	0,20	SoftBank Group Corp. 3,125 % due 19.09.2025	380	380	0,35
				4,375 % due 21.09.2027	250	259	0,24	4,500 % due 20.04.2025	250	264	0,24
				5,000 % due 14.09.2030	200	219	0,20	4,750 % due 30.07.2025	300	318	0,29
				BFF Bank SpA 1,750 % due 23.05.2023	50	51	0,05	Japan insgesamt	962	0,88	
				BPER Banca 1,375 % due 31.03.2027	150	151	0,14				
				1,875 % due 07.07.2025	200	209	0,19	<b>JERSEY, KANALINSELN</b>			
				3,625 % due 30.11.2030	100	105	0,10	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN</b>			
				5,125 % due 31.05.2027	330	341	0,31	Adient Global Holdings Ltd. 3,500 % due 15.08.2024	320	323	0,30
				Credito Emiliano SpA 1,500 % due 25.10.2025	250	258	0,24	Avis Budget Finance PLC 4,125 % due 15.11.2024	210	213	0,20
				doValue SpA 5,000 % due 04.08.2025	100	105	0,10	4,750 % due 30.01.2026	100	103	0,09
				Gamma Bidco SpA 5,125 % due 15.07.2025	170	174	0,16	Jersey, Kanalinseln insgesamt	639	0,59	
				6,250 % due 15.07.2025	140	146	0,13				
				Iccrea Banca SpA 1,500 % due 11.10.2022	320	325	0,30	<b>LITAUEN</b>			
				4,125 % due 28.11.2029	200	208	0,19	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN</b>			
				Illimity Bank SpA 3,375 % due 11.12.2023	100	105	0,10	Maxima Grupe UAB 3,250 % due 13.09.2023	230	238	0,22
				Immobiliare Grande Distribuzione SIHQ SpA 2,125 % due 28.11.2024	150	152	0,14				
				Infrastrutture Wireless Italiane SpA 1,875 % due 08.07.2026	350	365	0,33	<b>LUXEMBURG</b>			
				International Design Group SpA 6,500 % due 15.11.2025	161	167	0,15	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN</b>			
				Intesa Sanpaolo SpA 2,855 % due 23.04.2025	155	167	0,15	ADLER Group S.A. 1,500 % due 26.07.2024	300	266	0,24
				4,375 % due 12.07.2029	200	219	0,20	1,875 % due 14.01.2026	200	170	0,16
				4,450 % due 15.09.2027	200	208	0,19	3,250 % due 05.08.2025	300	266	0,24
				5,875 % due 04.03.2029	160	179	0,16	Altice Financing S.A. 2,250 % due 15.01.2025	200	193	0,18
				6,625 % due 13.09.2023	560	628	0,58	Aramark International Finance SARL 3,125 % due 01.04.2025	100	101	0,09
				Intesa Sanpaolo Vita SpA 4,750 % due 17.12.2024 (b)	300	331	0,30	Cirsa Finance International SARL 4,750 % due 22.05.2025	250	251	0,23
				Kedrion SpA 3,375 % due 15.05.2026	120	120	0,11	6,250 % due 20.12.2023	296	301	0,28
				Leonardo SpA 1,500 % due 07.06.2024	360	369	0,34	Codere Finance Luxembourg S.A. (4,500 % bar und 6,250 % PIK) 10,750 % due 01.11.2023 (a)	340	231	0,21
				2,375 % due 08.01.2026	200	210	0,19	ContourGlobal Power Holdings S.A. 2,750 % due 01.01.2026	130	133	0,12
				5,250 % due 21.01.2022	350	355	0,33	4,125 % due 01.08.2025	330	337	0,31
				LKQ Italia Bondco SpA 3,875 % due 01.04.2024	200	216	0,20	Corestate Capital Holding S.A. 3,500 % due 15.04.2023	200	186	0,17
				Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA 2,300 % due 23.11.2030	250	256	0,23	Crystal Almond SARL 4,250 % due 15.10.2024	210	215	0,20
				Nexi SpA 1,625 % due 30.04.2026	300	301	0,28	eDreams ODIGEO S.A. 5,500 % due 01.09.2023	125	126	0,12
				1,750 % due 31.10.2024	480	492	0,45				

**Aufstellung des Wertpapierbestands PIMCO Euro Short-Term High Yield Corporate Bond Index UCITS ETF (Fortsetzung)**

BESCHREIBUNG	NENN- WERT (in Tsd.)	BEIZULE- GENDER ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	NENN- WERT (in Tsd.)	BEIZULE- GENDER ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	NENN- WERT (in Tsd.)	BEIZULE- GENDER ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
<b>EUROFINS SCIENTIFIC SE</b> 3,250 % due 13.11.2025 (b)	€ 200	€ 214	0,20	<b>ELM BV for Firmenich International S.A.</b> 3,750 % due 03.09.2025 (b)	€ 519	€ 559	0,51	<b>PANAMA</b> <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN</b>			
<b>Garfunkelux Holdco S.A.</b> 6,750 % due 01.11.2025	300	314	0,29	<b>Ferrovial Netherlands BV</b> 2,124 % due 14.02.2023 (b)	300	301	0,28	<b>Carnival Corp.</b> 1,875 % due 07.11.2022	€ 175	€ 174	0,16
<b>Hanesbrands Finance Luxembourg S.C.A.</b> 3,500 % due 15.06.2024	200	214	0,20	<b>Frigoglass Finance BV</b> 6,875 % due 12.02.2025	100	89	0,08	7,625 % due 01.03.2026	160	173	0,16
<b>Holcim Finance Luxembourg S.A.</b> 3,000 % due 05.07.2024 (b)	240	252	0,23	<b>Intertrust Group BV</b> 3,375 % due 15.11.2025	155	158	0,15	10,125 % due 01.02.2026	280	323	0,29
<b>Ideal Standard International S.A.</b> 6,375 % due 30.07.2026	100	95	0,09	<b>IPD BV</b> 5,500 % due 01.12.2025	200	210	0,19	<b>Panama gesamt</b>		670	0,61
<b>INEOS Group Holdings S.A.</b> 5,375 % due 01.08.2024	270	270	0,25	<b>Kongsberg Actuation Systems BV</b> 5,000 % due 15.07.2025	100	100	0,09	<b>PORTUGAL</b> <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN</b>			
<b>Intralot Capital Luxembourg S.A.</b> 5,250 % due 15.09.2024	190	161	0,15	<b>Koninklijke FrieslandCampina NV</b> 2,850 % due 10.09.2025 (b)	100	103	0,09	<b>Banco Comercial Portugues S.A.</b> 3,871 % due 27.03.2030	100	103	0,09
<b>Kleopatra Finco SARL</b> 4,250 % due 01.03.2026	325	319	0,29	<b>Koninklijke KPN NV</b> 2,000 % due 08.11.2024 (b)	200	204	0,19	4,500 % due 07.12.2027	300	311	0,28
<b>LHMC Finco 2 SARL (7,250 % bar oder 8,000 % PIK)</b> 7,250 % due 02.10.2025 (a)	104	106	0,10	<b>Louis Dreyfus Co. Finance BV</b> 2,375 % due 27.11.2025	195	208	0,19	<b>Caixa Geral de Depositos S.A.</b> 5,750 % due 28.06.2028	300	327	0,30
<b>Lincoln Financing SARL</b> 3,625 % due 01.04.2024	390	394	0,36	<b>Naturgy Finance BV</b> 3,375 % due 24.04.2024 (b)	200	212	0,19	<b>EDP - Energias de Portugal S.A.</b> 1,700 % due 20.07.2080	200	203	0,19
<b>Mangrove Luxco SARL (7,775 % bar oder 7,775 % PIK)</b> 7,775 % due 09.10.2025 (a)	140	131	0,12	4,125 % due 18.11.2022 (b)	400	417	0,38	4,496 % due 30.04.2079	500	543	0,50
<b>Matterhorn Telecom S.A.</b> 2,625 % due 15.09.2024	200	202	0,18	<b>Nobian Finance BV</b> 3,625 % due 15.07.2026	180	179	0,16	<b>Novo Banco S.A.</b> 8,500 % due 06.07.2028	200	206	0,19
<b>Monitchem HoldCo S.A.</b> 5,250 % due 15.03.2025	300	308	0,28	<b>OCI NV</b> 3,125 % due 01.11.2024	380	386	0,35	<b>Transportes Aereos Portugueses S.A.</b> 5,625 % due 02.12.2024	200	166	0,15
<b>Motion Finco SARL</b> 7,000 % due 15.05.2025	200	211	0,19	<b>Oi European Group BV</b> 3,125 % due 15.11.2024	430	445	0,41	<b>Portugal insgesamt</b>		1.859	1,70
<b>Mytilineos Financial Partners S.A.</b> 2,500 % due 01.12.2024	170	175	0,16	<b>Phoenix PIB Dutch Finance BV</b> 2,375 % due 05.08.2025	100	103	0,09	<b>SPANIEN</b> <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN</b>			
<b>PLT Finance SARL</b> 4,625 % due 05.01.2026	130	134	0,12	<b>Promontoria Holding BV</b> 6,750 % due 15.08.2023	180	181	0,17	<b>Abanca Corp. Bancaria S.A.</b> 6,125 % due 18.01.2029	200	221	0,20
<b>Rossini SARL</b> 6,750 % due 30.10.2025	200	208	0,19	<b>Q-Park Holding BV</b> 1,500 % due 01.03.2025	135	130	0,12	<b>ACS Actividades de Construccion y Servicios S.A.</b> 1,375 % due 17.06.2025	200	203	0,19
<b>Samsonite Finco SARL</b> 3,500 % due 15.05.2026	100	98	0,09	<b>Repsol International Finance BV</b> 4,500 % due 25.03.2075	600	654	0,60	<b>Almirall S.A.</b> 2,125 % due 30.09.2026	100	101	0,09
<b>SES S.A.</b> 5,625 % due 29.01.2024 (b)	360	392	0,36	<b>Saipem Finance International BV</b> 2,625 % due 07.01.2025	150	155	0,14	<b>Banco de Sabadell S.A.</b> 1,750 % due 10.05.2024	700	724	0,66
<b>SIG Combibloc Purchase Co. SARL</b> 2,125 % due 18.06.2025	230	243	0,22	2,750 % due 05.04.2022	290	293	0,27	2,000 % due 17.01.2030	100	100	0,09
<b>Signa Development Finance SCS</b> 5,500 % due 23.07.2026	100	94	0,09	3,750 % due 08.09.2023	280	296	0,27	5,375 % due 12.12.2028	300	329	0,30
<b>Stena International S.A.</b> 3,750 % due 01.02.2025	100	100	0,09	<b>Samvardhana Motherson Automotive Systems Group BV</b> 1,800 % due 06.07.2024	200	202	0,19	<b>Cellnex Telecom S.A.</b> 2,375 % due 16.01.2024	400	419	0,38
<b>Takko Luxembourg S.C.A.</b> 5,375 % due 15.11.2023 ^	200	189	0,17	<b>Schoeller Packaging BV</b> 6,375 % due 01.11.2024	200	207	0,19	2,875 % due 18.04.2025	100	108	0,10
<b>Vivion Investments SARL</b> 3,000 % due 08.08.2024	400	391	0,36	<b>Selecta Group BV (3,500 % bar und 4,500 % PIK)</b> 8,000 % due 01.04.2026 (a)	206	210	0,19	<b>El Corte Ingles S.A.</b> 3,000 % due 15.03.2024	350	353	0,32
<b>Luxemburg insgesamt</b>		7.991	7,33	<b>Sigma Holdco BV</b> 5,750 % due 15.05.2026	340	326	0,30	<b>Foodco Bondco S.A.</b> 6,250 % due 15.05.2026	100	95	0,09
<b>MULTINATIONAL</b> <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN</b>				<b>Summer BidCo BV (9,000 % bar und 9,750 % PIK)</b> 9,000 % due 15.11.2025 (a)	105	108	0,10	<b>Gestamp Automocion S.A.</b> 3,250 % due 30.04.2026	115	117	0,11
<b>Ardagh Packaging Finance PLC</b> 2,125 % due 15.08.2026	200	201	0,18	<b>Sunshine Mid BV</b> 6,500 % due 15.05.2026	128	132	0,12	<b>Grifols S.A.</b> 1,625 % due 15.02.2025	500	501	0,46
<b>Clarios Global LP</b> 4,375 % due 15.05.2026	200	207	0,19	<b>Telefonica Europe BV</b> 2,625 % due 07.03.2023 (b)	500	511	0,47	3,200 % due 01.05.2025	300	301	0,28
<b>Eagle Intermediate Global Holding BV</b> 5,375 % due 01.05.2023	100	97	0,09	3,000 % due 04.09.2023 (b)	600	621	0,57	<b>Ibercaja Banco S.A.</b> 2,750 % due 23.07.2030	200	202	0,19
<b>Multinationale Unternehmen gesamt</b>		505	0,46	4,375 % due 14.12.2024 (b)	300	326	0,30	<b>International Consolidated Airlines Group S.A.</b> 0,500 % due 04.07.2023	200	197	0,18
<b>NIEDERLANDE</b> <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN</b>				5,875 % due 31.03.2024 (b)	500	555	0,51	2,750 % due 25.03.2025	100	101	0,09
<b>Abertis Infraestructuras Finance BV</b> 3,248 % due 24.11.2025 (b)	600	617	0,57	<b>TenneT Holding BV</b> 2,374 % due 22.07.2025 (b)	300	315	0,29	<b>Liberbank S.A.</b> 6,875 % due 14.03.2027	200	206	0,19
<b>Compact Bidco BV</b> 5,750 % due 01.05.2026	100	99	0,09	2,995 % due 01.03.2024 (b)	480	507	0,47	<b>OHL Operaciones S.A. (5,100 % bar und 1,500 % PIK)</b> 6,600 % due 31.03.2026 (a)	150	137	0,13
<b>Darling Global Finance BV</b> 3,625 % due 15.05.2026	150	153	0,14	<b>United Group BV</b> 3,125 % due 15.02.2026	175	170	0,16	<b>Unicaja Banco S.A.</b> 2,875 % due 13.11.2029	200	206	0,19
<b>Diamond BC BV</b> 5,625 % due 15.08.2025	100	102	0,09	4,875 % due 01.07.2024	300	304	0,28	<b>Spanien insgesamt</b>		4.621	4,24
<b>Diebold Nixdorf Dutch Holding BV</b> 9,000 % due 15.07.2025	200	217	0,20	<b>Wintershall Dea Finance BV</b> 2,499 % due 20.04.2026 (b)	300	298	0,27	<b>SCHWEDEN</b> <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN</b>			
<b>Dufry One BV</b> 2,500 % due 15.10.2024	247	245	0,22	<b>ZF Europe Finance BV</b> 1,250 % due 23.10.2023	300	304	0,28	<b>Akelius Residential Property AB</b> 3,875 % due 05.10.2078	300	317	0,29
				2,000 % due 23.02.2026	300	303	0,28	<b>Domestic Group AB</b> 3,000 % due 13.09.2023	200	210	0,19
				<b>Niederlande insgesamt</b>		12.215	11,20	<b>Fastighets AB Balder</b> 2,873 % due 02.06.2081	100	99	0,09
				<b>NORWEGEN</b> <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN</b>				3,000 % due 07.03.2078	200	204	0,19
				<b>Adevinta ASA</b> 2,625 % due 15.11.2025	250	256	0,23	<b>Heimstaden Bostad AB</b> 3,248 % due 19.11.2024 (b)	250	257	0,23
				<b>Explorer A/S</b> 3,375 % due 24.02.2025	100	96	0,09	3,375 % due 15.01.2026 (b)	150	154	0,14
				<b>Norwegen insgesamt</b>		352	0,32	<b>Intrum AB</b> 3,125 % due 15.07.2024	420	423	0,39

BESCHREIBUNG	NENN-WERT (in Tsd.)	BEIZULE- GENDER ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	NENN- WERT (in Tsd.)	BEIZULE- GENDER ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	NENN- WERT (in Tsd.)	BEIZULE- GENDER ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
3,500 % due 15.07.2026	€ 200	€ 205	0,19	Jaguar Land Rover Automotive PLC	€ 304	€ 298	0,27	Encore Capital Group, Inc.	€ 141	€ 148	0,14
4,875 % due 15.08.2025	200	210	0,19	2,200 % due 15.01.2024	200	203	0,19	4,875 % due 15.10.2025	300	310	0,28
<b>Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB</b>				4,500 % due 15.01.2026	155	166	0,15	Ford Motor Credit Co. LLC	696	727	0,67
2,624 % due 30.01.2025 (b)	100	100	0,09	5,875 % due 15.11.2024	195	199	0,18	2,386 % due 17.02.2026	300	310	0,28
2,625 % due 14.12.2025 (b)	150	150	0,14	<b>Modulaire Global Finance PLC</b>				3,021 % due 06.03.2024	250	267	0,24
Unilabs Subholding AB	125	127	0,12	6,500 % due 15.02.2023	200	203	0,19	3,250 % due 15.09.2025	175	178	0,16
5,750 % due 15.05.2025	300	303	0,28	1,625 % due 05.12.2019	170	175	0,16	2,875 % due 15.09.2025	130	131	0,12
Verisure Holding AB	240	251	0,23	<b>Pinnacle Bidco PLC</b>				Kraft Heinz Foods Co.	260	269	0,25
3,500 % due 15.05.2023	230	239	0,22	5,500 % due 15.02.2025	200	199	0,18	1,500 % due 24.05.2024	130	132	0,12
Volvo Car AB	300	303	0,28	<b>Rolls-Royce PLC</b>				Kronos International, Inc.	130	132	0,12
2,000 % due 24.01.2025	230	239	0,22	0,875 % due 09.05.2024	300	333	0,31	3,750 % due 15.09.2025	240	251	0,23
2,125 % due 02.04.2024	300	300	0,22	4,625 % due 16.02.2026	164	170	0,16	Liberty Mutual Group, Inc.	240	251	0,23
Schweden insgesamt	3.249	2.98		<b>Synthomer PLC</b>				3,625 % due 23.05.2019	140	140	0,13
				3,875 % due 01.07.2025	100	103	0,09	Mauser Packaging Solutions Holding Co.	660	677	0,62
				Titan Global Finance PLC	400	10	0,01	4,750 % due 15.04.2024	148	161	0,15
				2,375 % due 16.11.2024	350	363	0,33	Scientific Games International, Inc.	100	101	0,09
				<b>USA</b>				3,375 % due 15.02.2026	300	310	0,28
				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN</b>				5,500 % due 15.02.2026	135	145	0,13
				1,874 % due 18.08.2080	200	195	0,18	Sealed Air Corp.	200	202	0,19
				<b>British Telecommunications PLC</b>				4,500 % due 15.09.2023	110	112	0,10
				EC Finance PLC	290	291	0,27	Silgan Holdings, Inc.	200	207	0,19
				2,375 % due 15.11.2022	370	368	0,34	3,250 % due 15.03.2025	200	207	0,19
				eG Global Finance PLC	280	287	0,26	UGI International LLC	200	207	0,19
				3,625 % due 07.02.2024	290	286	0,26	3,250 % due 01.11.2025	200	207	0,19
				6,250 % due 30.10.2025	112	113	0,10	ZF North America Capital, Inc.	200	207	0,19
				Ellaktor Value PLC	290	286	0,26	2,750 % due 27.04.2023	200	207	0,19
				6,375 % due 15.12.2024	112	113	0,10	Vereinigte Staaten insgesamt	6.764	6.20	
				<b>USA</b>				JUNGFERNINSELN (BRITISCH)			
				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN</b>				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN			
				Energia Group NI Finance Co. PLC	112	113	0,10	MAS Securities BV	100	100	0,09
				4,000 % due 15.09.2025	900	918	0,84	4,250 % due 19.05.2026	100	100	0,09
				FCE Bank PLC	170	170	0,16				
				1,615 % due 11.05.2023	225	227	0,21				
				INEOS Finance PLC	100	102	0,09				
				2,125 % due 15.11.2025	130	133	0,12				
				2,875 % due 01.05.2026	100	102	0,09				
				3,375 % due 31.03.2026	150	158	0,15				
				INEOS Quattro Finance PLC	150	154	0,14				
				2,500 % due 15.01.2026	150	154	0,14				
				International Game Technology PLC	140	153	0,14				
				3,500 % due 15.07.2024	140	153	0,14				
				3,500 % due 15.06.2026	140	153	0,14				
				International Personal Finance PLC	140	153	0,14				
				9,750 % due 12.11.2025	300	304	0,28				
				4,750 % due 15.04.2026	300	304	0,28				
								Wertpapiere insgesamt	€	106.924	98,04

**AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE DERIVATIVE FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)**

\* Ein Saldo von null kann auf die Rundung der tatsächlichen Beträge auf weniger als 1.000 zurückzuführen sein.

**FUTURES**

Beschreibung	Typ	Verfalls- monat	# der Kontrakte	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)	% des Nettovermögens
Euro-Bobl December Futures	Long	12/2021	13	€ (9)	(0,01)
Euro-Schatz December Futures	Short	12/2021	17	1	0,00
				€ (8)	(0,01)
<b>An einem geregelten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente insgesamt</b>				€ (8)	(0,01)
<b>Anlagen insgesamt</b>				€ 106.916	98,03
<b>Sonstige kurzfristige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>				€ 2.154	1,97
<b>Nettovermögen</b>				€ 109.070	100,00

**ANGABEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Beträge in Tsd.\*):**

\* Ein Saldo von null kann auf die Rundung der tatsächlichen Beträge auf weniger als 1.000 zurückzuführen sein.

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.

(b) Unbegrenzte Laufzeit; sofern ein Datum angegeben ist, stellt dies den nächsten vertraglichen Abruffertermin dar.

(c) Bedingt wandelbares Wertpapier.

Barmittel in Höhe von 17€ waren zum 30. September 2021 als Sicherheiten für börsengehandelte und zentral abgewickelte derivative Finanzinstrumente verpfändet.



Bewertung zum beizulegenden Zeitwert<sup>(1)</sup>

Die folgende Darstellung ist eine Zusammenfassung der Zeitwertbewertung gemäß den zum 30. September 2021 für die Bewertung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten der Fonds verwendeten Parametern:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Preise für identische Anlagen (Ebene 1)	Sonstige wesentliche beobachtbare Parameter (Ebene 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Parameter (Ebene 3)	Beizulegender Zeitwert
Wertpapiere	€ 0	€ 106.924	€ 0	€ 106.924
Derivative Finanzinstrumente <sup>(3)</sup>	(8)	0	0	(8)
<b>Gesamt</b>	<b>€ (8)</b>	<b>€ 106.924</b>	<b>€ 0</b>	<b>€ 106.916</b>

Die folgende Darstellung ist eine Zusammenfassung der Zeitwertbewertung gemäß den zum 31. März 2021 für die Bewertung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten der Fonds verwendeten Parametern:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Preise für identische Anlagen (Ebene 1)	Sonstige wesentliche beobachtbare Parameter (Ebene 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Parameter (Ebene 3)	Beizulegender Zeitwert
Wertpapiere	€ 0	€ 102.986	€ 0	€ 102.986
Pensionsgeschäfte	0	401	0	401
Derivative Finanzinstrumente <sup>(3)</sup>	0	0	0	0
<b>Gesamt</b>	<b>€ 0</b>	<b>€ 103.387</b>	<b>€ 0</b>	<b>€ 103.387</b>

<sup>(1)</sup> Siehe Anmerkung 3 in den Anmerkungen zum Abschluss für weitere Informationen.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

<sup>(3)</sup> Derivative Finanzinstrumente umfassen ggf. offene Futures, Swap-Vereinbarungen, verkaufte Optionen, gekaufte Optionen und Devisenterminkontrakte.

#### Vergleichsangaben

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. September 2021:

	30. Sept. 2021 (%)	31. März 2021 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene Wertpapiere	92,09	95,68
An einem anderen geregelten Markt gehandelte Wertpapiere*	5,75	2,59
Sonstige Wertpapiere	0,20	0,20
Pensionsgeschäfte	-	0,38
An einem geregelten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente	(0,01)	0,00
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	-	(0,38)

\* Gemäß der in Anhang 2 des Verkaufsprospekt angegebenen Liste von Märkten, die die OGAW-Kriterien für geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. September 2021 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum beizulegenden Zeitwert	30. Sept. 2021 (%)	31. März 2021 (%)
Österreich	0,81	0,84
Belgien	0,38	0,20
Kanada	-	0,29
Zypern	0,16	0,17
Dänemark	1,02	0,84
Finnland	1,89	1,90
Frankreich	16,92	15,12
Deutschland	13,37	11,60
Griechenland	1,03	0,95
Guernsey, Kanalinseln	0,09	0,09
Irland	1,48	0,92
Insel Man	0,31	0,32
Italien	17,50	18,35
Japan	0,88	0,80
Jersey, Kanalinseln	0,59	1,23
Litauen	0,22	0,23
Luxemburg	7,33	8,86
Multinational	0,46	0,08
Niederlande	11,20	10,51
Norwegen	0,32	0,33
Panama	0,61	0,75
Portugal	1,70	1,93
Spanien	4,24	5,41
Schweden	2,98	3,13
Vereinigtes Königreich	6,26	7,00
USA	6,20	6,62
Jungferinseln (Britisch)	0,09	-
Pensionsgeschäfte	-	0,38
An einem geregelten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente		
Futures	(0,01)	0,00
Sonstige kurzfristige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	1,97	1,15
<b>Nettovermögen</b>	<b>100,00</b>	<b>100,00</b>



BESCHREIBUNG	NENN- WERT (in Tsd.)	BEIZULE- GENDER ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	NENN- WERT (in Tsd.)	BEIZULE- GENDER ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	NENN- WERT (in Tsd.)	BEIZULE- GENDER ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO VERMÖ- GENS	
<b>WERTPAPIERE</b>				<b>Export-Import Bank of China</b>				<b>1,500 % due 20.01.2022</b>				
<b>AUSTRALIEN</b>				<b>0,300 % due 06.03.2022</b>				<b>€ 400 € 401 0,01</b>				
<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>				<b>China insgesamt</b>				<b>2,002 0,07</b>				
Driver Australia Five Trust	AUD	254	158	0,01					<b>1,750 % due 16.12.2021</b>			
0,940 % due 21.07.2026									<b>€ 400 467 0,02</b>			
Driver Australia Six Trust									<b>1,875 % due 14.02.2022</b>			
0,910 % due 21.12.2027	1.142	714	0,02					<b>€ 1.800 1.815 0,07</b>				
								<b>4,250 % due 14.10.2021</b>				
								<b>€ 2.700 2.332 0,08</b>				
								<b>Deutsche Pfandbriefbank AG</b>				
								<b>1,049 % due 29.09.2023</b>				
								<b>€ 3.400 4.016 0,14</b>				
								<b>E.ON SE</b>				
								<b>0,000 % due 29.09.2022 (b)</b>				
								<b>€ 500 502 0,02</b>				
								<b>0,000 % due 24.10.2022 (b)</b>				
								<b>388 389 0,01</b>				
								<b>5,000 5.050 0,18</b>				
								<b>Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide</b>				
								<b>1,625 % due 09.07.2024</b>				
								<b>19.400 20.051 0,72</b>				
								<b>Hamburg Commercial Bank AG</b>				
								<b>0,375 % due 20.04.2023</b>				
								<b>6.500 6.562 0,23</b>				
								<b>Volkswagen Bank GmbH</b>				
								<b>0,151 % due 08.12.2021</b>				
								<b>400 400 0,01</b>				
								<b>0,750 % due 15.06.2023</b>				
								<b>700 710 0,03</b>				
								<b>0,926 % due 01.08.2022</b>				
								<b>1.400 1.414 0,05</b>				
								<b>Volkswagen Financial Services AG</b>				
								<b>0,750 % due 14.10.2021</b>				
								<b>200 200 0,01</b>				
								<b>Volkswagen Leasing GmbH</b>				
								<b>0,000 % due 12.07.2023 (b)</b>				
								<b>7.200 7.213 0,26</b>				
								<b>0,000 % due 19.07.2024 (b)</b>				
								<b>11.100 11.096 0,40</b>				
								<b>0,500 % due 20.06.2022</b>				
								<b>6.200 6.238 0,22</b>				
								<b>1,000 % due 16.02.2023</b>				
								<b>1.958 1.990 0,07</b>				
								<b>95.116 3,39</b>				
								<b>STAATSANLEIHEN</b>				
								<b>Gemeinsame Kommunalanleihe NRW</b>				
								<b>1,250 % due 17.06.2022</b>				
								<b>4.200 4.250 0,15</b>				
								<b>Deutschland insgesamt</b>				
								<b>99.366 3,54</b>				
								<b>GUERNSEY, KANALINSELN</b>				
								<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN</b>				
								<b>Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd.</b>				
								<b>1,250 % due 14.04.2022</b>				
								<b>7.033 7.090 0,25</b>				
								<b>INDONESIEN</b>				
								<b>STAATSANLEIHEN</b>				
								<b>Indonesia Government International Bond</b>				
								<b>2,625 % due 14.06.2023</b>				
								<b>25.200 26.282 0,94</b>				
								<b>IRLAND</b>				
								<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>				
								<b>Accunia European CLO DAC</b>				
								<b>0,930 % due 15.10.2030</b>				
								<b>1.500 1.502 0,05</b>				
								<b>Aqueduct European CLO DAC</b>				
								<b>0,640 % due 20.07.2030</b>				
								<b>6.370 6.379 0,23</b>				
								<b>1,450 % due 20.04.2032</b>				
								<b>4.800 4.803 0,17</b>				
								<b>Barings Euro CLO DAC</b>				
								<b>0,271 % due 25.10.2029</b>				
								<b>389 389 0,01</b>				
								<b>0,680 % due 27.07.2030</b>				
								<b>101 101 0,00</b>				
								<b>Black Diamond CLO DAC</b>				
								<b>0,860 % due 20.01.2032</b>				
								<b>2.500 2.502 0,09</b>				
								<b>BlueMountain Fuji EUR CLO DAC</b>				
								<b>0,650 % due 15.07.2030</b>				
								<b>3.500 3.510 0,13</b>				
								<b>Cairn CLO DAC</b>				
								<b>0,600 % due 30.04.2031</b>				
								<b>6.800 6.782 0,24</b>				
								<b>0,650 % due 20.10.2028</b>				
								<b>1.471 1.473 0,05</b>				
								<b>0,670 % due 31.01.2030</b>				
								<b>7.668 7.672 0,27</b>				
								<b>0,790 % due 25.07.2029</b>				
								<b>1.628 1.630 0,06</b>				
								<b>Citizen Irish Auto Receivables Trust DAC</b>				
								<b>0,263 % due 15.12.2029</b>				
								<b>5.100 5.137 0,18</b>				
								<b>Fortuna Consumer Loan ABS DAC</b>				
								<b>0,000 % due 15.10.2030 (a)</b>				
								<b>7.000 7.028 0,25</b>				
								<b>Harvest CLO DAC</b>				
								<b>0,650 % due 26.06.2030</b>				
								<b>5.800 5.790 0,21</b>				
								<b>Mackay Shields Euro CLO DAC</b>				
								<b>1,550 % due 15.08.2033</b>				
								<b>2.700 2.704 0,10</b>				
								<b>Man GLG Euro CLO DAC</b>				
								<b>0,680 % due 15.10.2030</b>				
								<b>3.400 3.405 0,12</b>				
								<b>0,870 % due 15.01.2030</b>				
								<b>1.110 1.108 0,04</b>				
								<b>Oak Hill European Credit Partners Ltd.</b>				
								<b>0,900 % due 22.07.2030</b>				
								<b>1.100 1.105 0,04</b>				
								<b>Palmer Square European Loan Funding DAC</b>				
								<b>0,780 % due 15.04.2031</b>				
								<b>1.100 1.100 0,04</b>				
								<b>0,870 % due 15.02.2030</b>				
								<b>1.682 1.684 0,06</b>				

**Aufstellung des Wertpapierbestands PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (Fortsetzung)**

BESCHREIBUNG	NENN-WERT (in Tsd.)	BEIZULE- GENDER ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	NENN-WERT (in Tsd.)	BEIZULE- GENDER ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	NENN-WERT (in Tsd.)	BEIZULE- GENDER ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO VERMÖ- GENS
<b>Pepper Iberia Unsecured DAC</b> 0,000 % due 07.04.2028	€	443	€	444	0,02	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHEIBUNGEN</b>					
<b>Purple Finance CLO DAC</b> 0,800 % due 25.01.2031		1.800		1.802	0,06	<b>JUBILEE CLO BV</b>					
<b>St Paul's CLO DAC</b> 0,850 % due 25.04.2030		1.600		1.603	0,06	0,294 % due 12.07.2028					
				69.653	2,48	0,610 % due 15.04.2030					
						0,650 % due 15.04.2031					
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHEIBUNGEN</b>				<b>STAUDI-ARABIEN STAATSANLEIHEN</b>				<b>Saudi Government International Bond</b>			
<b>Dell Bank International DAC</b> 0,625 % due 17.10.2022		10.000		10.094	0,36	2,375 % due 26.10.2021					
<b>GE Capital UK Funding Unlimited Co.</b> 4,125 % due 13.09.2023	£	2.200		2.724	0,10						
<b>Ryanair DAC</b> 1,125 % due 10.03.2023	€	8.700		8.857	0,31	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHEIBUNGEN</b>					
<b>SMBC Aviation Capital Finance DAC</b> 3,000 % due 15.07.2022	\$	200		176	0,01	0,007 % due 26.06.2022					
				23.078	0,82	<b>BMW Finance NV</b>					
<b>NON-AGENCY MORTGAGE-BACKED SECURITIES</b>				<b>ISRAEL STAATSANLEIHEN</b>				<b>E.ON International Finance BV</b>			
<b>Bluestep Mortgage Securities DAC</b> 0,179 % due 10.08.2066	€	870		870	0,03	0,055 % due 02.10.2023					
<b>Dilosk RMBS DAC</b> 0,202 % due 20.02.2060		4.337		4.362	0,16	0,056 % due 24.06.2022					
<b>Fingal Securities RMBS DAC</b> 0,456 % due 28.07.2055		7.508		7.559	0,27	0,125 % due 13.07.2022					
<b>Mulcair Securities DAC</b> 0,451 % due 24.04.2071		804		806	0,03	<b>Cooperative Rabobank UA</b>					
<b>Primrose Residential DAC</b> 0,189 % due 24.03.2061		12.594		12.626	0,45	4,125 % due 14.09.2022					
				26.223	0,94	4,750 % due 06.06.2022					
<b>Irland insgesamt</b>				118.954	4,24	<b>Daimler International Finance BV</b>					
<b>INSEL MAN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHEIBUNGEN</b>				<b>LUXEMBURG FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>				<b>Digital Dutch Finco BV</b>			
<b>NE Property BV</b> 2,625 % due 22.05.2023		1.000		1.041	0,04	0,000 % due 11.05.2022					
<b>ISRAEL STAATSANLEIHEN</b>				<b>FACT Master S.A.</b>				<b>ING Groep NV</b>			
<b>Israel Government International Bond</b> 0,000 % due 22.07.2022 (b)		23.500		23.560	0,84	0,750 % due 09.03.2022					
<b>0,750 % due 31.07.2022</b>	ILS	13.200		3.552	0,13	0,125 % due 11.05.2022					
<b>5,500 % due 31.01.2022</b>		47.700		12.992	0,46	0,750 % due 14.09.2022					
<b>Israel gesamt</b>				40.104	1,43	5,625 % due 06.12.2023					
<b>ITALIEN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHEIBUNGEN</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHEIBUNGEN</b>				<b>LeasePlan Corp. NV</b>			
<b>Aeroporto di Roma SpA</b> 5,441 % due 20.02.2023	£	5.225		6.439	0,23	0,125 % due 13.09.2023					
<b>AMCO – Asset Management Co. SpA</b> 1,500 % due 17.07.2023	€	4.900		5.048	0,18	0,750 % due 03.10.2022					
<b>Banca Carige SpA</b> 1,151 % due 25.10.2021		28.800		28.816	1,03	1,000 % due 25.02.2022					
<b>Banca Monte dei Paschi di Siena SpA</b> 1,250 % due 20.01.2022		24.200		24.323	0,87	1,000 % due 02.05.2023					
<b>Intesa Sanpaolo SpA</b> 0,402 % due 19.04.2022		4.200		4.220	0,15	<b>Stellantis NV</b>					
<b>0,750 % due 17.10.2022</b>		500		506	0,02	3,375 % due 07.07.2023					
<b>0,875 % due 27.06.2022</b>		5.100		5.149	0,18	<b>Syngenta Finance NV</b>					
<b>1,125 % due 04.03.2022</b>		7.300		7.348	0,26	1,875 % due 02.11.2021					
<b>UniCredit SpA</b> 1,000 % due 18.01.2023		900		914	0,03	<b>Vesteda Finance BV</b>					
<b>4,033 % due 14.01.2022</b>	\$	350		305	0,01	2,500 % due 27.10.2022					
<b>6,572 % due 14.01.2022</b>		400		351	0,01	<b>Vonovia Finance BV</b>					
<b>7,830 % due 04.12.2023</b>		4.300		4.247	0,15	0,125 % due 06.04.2023					
				87.666	3,12	0,875 % due 10.06.2022					
<b>NON-AGENCY MORTGAGE-BACKED SECURITIES</b>				<b>NEUSEELAND UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHEIBUNGEN</b>				<b>Philippines Government International Bond</b>			
<b>Mars SRL</b> 0,751 % due 25.10.2050	€	129		129	0,01	0,000 % due 03.02.2023 (b)					
<b>Italien insgesamt</b>				87.795	3,13	1,000 % due 23.11.2021					
<b>NIEDERLANDE FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>				<b>PHILIPPINEN STAATSANLEIHEN</b>				<b>Polen UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHEIBUNGEN</b>			
<b>BNPP AM Euro CLO BV</b> 0,600 % due 15.04.2031		500		500	0,02	<b>PKO Bank Hipoteczny S.A.</b>					
<b>Contego CLO DAC</b> 0,640 % due 23.01.2030		3.500		3.492	0,12	0,250 % due 23.11.2021					



## Aufstellung des Wertpapierbestands PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (Fortsetzung)

BESCHREIBUNG	NENN- WERT (in Tsd.)	BEIZULE- GENDER ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	NENN- WERT (in Tsd.)	BEIZULE- GENDER ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	NENN- WERT (in Tsd.)	BEIZULE- GENDER ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO VERMÖ- GENS
Boeing Co. 1,167 % due 04.02.2023 1,433 % due 04.02.2024	\$ 1.800 600	€ 1.557 518	0,06 0,02	Freddie Mac 0,600 % due 15.10.2025 0,650 % due 27.10.2025 0,800 % due 28.10.2026	\$ 30.000 14.400 15.500	€ 25.661 12.341 13.210	0,91 0,44 0,47	Syngenta Finance NV 0,071 % due 29.10.2021	€ 9.000	€ 9.002	0,32
Booking Holdings, Inc. 2,150 % due 25.11.2022	€ 1.800	1.840	0,07	Vereinigte Staaten insgesamt		383.511	13,67	FRANCE TREASURY BILLS (0,705) % due 09.02.2022 (b)(c)	26.000	26.065	0,93
Citigroup, Inc. 0,000 % due 21.03.2023 2,750 % due 24.01.2024	2.000 € 11.000	2.013 13.309	0,07 0,47	JUNGFERNINSELN (BRITISCH) UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN				(0,684) % due 18.05.2022 (b)(c)	27.870	27.989	1,00
Expedia Group, Inc. 2,500 % due 03.06.2022	€ 9.500	9.608	0,34	Global Switch Holdings Ltd. 4,375 % due 13.12.2022	€ 4.000	4.849	0,17	(0,675) % due 09.02.2022 (b)(c)	51.000	51.128	1,82
Fidelity National Information Services, Inc. 0,125 % due 03.12.2022	8.300	8.338	0,30	KURZFRISTIGE INSTRUMENTE COMMERCIAL PAPER				(0,672) % due 09.02.2022 (b)(c)	25.000	25.063	0,89
General Electric Co. 0,375 % due 17.05.2022	3.400	3.414	0,12	Nomura Bank International PLC (0,375) % due 14.10.2021 (0,365) % due 15.11.2021	€ 8.500 4.000	8.502 4.002	0,30 0,14	(0,663) % due 20.10.2021 (b)(c)	5.460	5.462	0,20
General Motors Financial Co., Inc. 0,007 % due 26.03.2022 0,955 % due 07.09.2023	4.500 14.000	4.507 14.261	0,16 0,51	Pure Finance S.A. 0,051 % due 07.12.2021 0,051 % due 08.12.2021 0,051 % due 21.12.2021 0,051 % due 28.12.2021 0,051 % due 06.01.2022 0,051 % due 13.01.2022 0,051 % due 18.01.2022 0,051 % due 25.01.2022 0,051 % due 28.01.2022 0,051 % due 03.02.2022 0,051 % due 15.02.2022 0,051 % due 22.03.2022	374 100 100 300 200 100 300 100 100 100 300 200	374 100 100 300 200 100 300 100 100 100 300 200	0,01 0,00 0,00 0,01 0,00 0,00 0,01 0,00 0,00 0,00 0,01 0,01	(0,659) % due 24.11.2021 (b)(c)	1.810	1.812	0,07
0,955 % due 07.09.2023 1,442 % due 30.06.2022 2,200 % due 01.04.2024 2,250 % due 06.09.2024	14.000 200 € 4.100 € 3.000	14.261 174 4.319 3.580	0,51 0,01 0,15 0,13	(a) 0,152 % due 05.10.2021 0,152 % due 12.10.2021 0,152 % due 19.10.2021 0,152 % due 16.11.2021 0,152 % due 16.12.2021 0,152 % due 28.12.2021 0,152 % due 04.01.2022 0,203 % due 25.10.2021 0,401 % due 14.12.2021 0,411 % due 21.12.2021 0,411 % due 30.12.2021 0,411 % due 05.01.2022 0,411 % due 11.01.2022 0,411 % due 18.01.2022 0,421 % due 22.02.2022 0,441 % due 07.10.2021 0,441 % due 22.03.2022 0,451 % due 05.10.2021 0,461 % due 06.10.2021 0,498 % due 18.11.2021 0,508 % due 28.12.2021 0,508 % due 04.01.2022 0,518 % due 07.12.2021 0,529 % due 17.11.2021 0,549 % due 10.11.2021 34,731 % due 15.03.2022	100 1.518 200 100 200 100 100 5.200 300 400 300 100 500 100 1.521 485 400 600 100 100 700 2.000 300 1.000 3.497	100 1.518 200 100 200 100 100 5.200 349 465 349 116 581 116 1.768 564 465 698 116 86 603 1.724 259 862 3.016	0,00 0,06 0,01 0,00 0,01 0,00 0,00 0,19 0,01 0,02 0,01 0,01 0,02 0,06 0,02 0,02 0,03 0,01 0,00 0,02 0,06 0,01 0,03 0,11	(0,655) % due 10.11.2021 (b)(c)	1.050	1.051	0,04
0,007 % due 26.03.2022 0,955 % due 07.09.2023 1,442 % due 30.06.2022 2,200 % due 01.04.2024 2,250 % due 06.09.2024	4.500 14.000 200 € 4.100 € 3.000	4.507 14.261 174 4.319 3.580	0,16 0,51 0,01 0,15 0,13	Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB (0,112) % due 12.10.2021	€ 24.400	24.401	0,87	(0,654) % due 08.12.2021 (b)(c)	48.290	48.347	1,72
Goldman Sachs Group, Inc. 0,453 % due 30.04.2024 4,750 % due 12.10.2021	€ 50.200 300	50.782 300	1,81 0,01					(0,649) % due 20.10.2021 (b)(c)	3.640	3.641	0,13
JPMorgan Chase & Co. 1,500 % due 26.10.2022	5.500	5.614	0,20					(0,646) % due 08.12.2021 (b)(c)	48.290	48.347	1,72
Kinder Morgan, Inc. 1,500 % due 16.03.2022	12.910	13.021	0,46						394.639	394.639	14,07
Kraft Heinz Foods Co. 1,500 % due 24.05.2024 2,000 % due 30.06.2023	2.000 5.200	2.067 5.360	0,07 0,19					DEUTSCHE SCHATZANLEIHEN (0,650) % due 27.10.2021 (b)(c)	260	260	0,01
McDonald's Corp. 1,125 % due 26.05.2022	800	808	0,03					ISRAELISCHE SCHATZANLEIHEN (0,022) % due 30.11.2021 (b)(c)	ILS 17.400	4.654	0,17
Morgan Stanley 0,160 % due 08.11.2022	19.800	19.813	0,71					(0,020) % due 02.02.2022 (b)(c)	17.400	4.653	0,17
MPT Operating Partnership LP 2,550 % due 05.12.2023 4,000 % due 19.08.2022	€ 1.700 € 15.100	2.032 15.493	0,07 0,55					0,000 % due 06.04.2022 (b)(c)	41.400	11.071	0,39
National Grid North America, Inc. 0,750 % due 11.02.2022	2.400	2.410	0,09					0,011 % due 06.04.2022 (b)(c)	3.300	882	0,03
Pacific Gas & Electric Co. 1,750 % due 16.06.2022	\$ 100	86	0,00					0,023 % due 28.02.2022 (b)(c)	4.400	1.177	0,04
Southern Power Co. 1,000 % due 20.06.2022	€ 13.100	13.229	0,47						22.437	22.437	0,80
Wells Fargo & Co. 0,000 % due 31.01.2022 1,375 % due 30.06.2022 2,250 % due 02.05.2023	15.260 € 4.600 € 7.400	15.285 5.388 7.698	0,54 0,19 0,27					JAPANISCHE SCHATZANLEIHEN (0,111) % due 08.11.2021 (b)(c)	¥ 6.500.000	50.273	1,79
Zimmer Biomet Holdings, Inc. 1,414 % due 13.12.2022	6.600	6.726	0,24					(0,105) % due 16.12.2021 (b)(c)	6.460.000	49.969	1,78
		299.804	10,69						100.242	100.242	3,57
<b>EMISSIONEN VON US-BEHÖRDEN</b>								Kurzfristige Instrumente insgesamt	585.900	585.900	20,89
Fannie Mae 0,875 % due 18.12.2026	\$ 30.000	25.609	0,91					<b>Wertpapiere insgesamt</b>	<b>€ 2.615.814</b>	<b>93,23</b>	
Federal Home Loan Bank 1,000 % due 27.07.2026	8.000	6.886	0,25								

### PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Leihzins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kapitalbetrag	Besichert durch	(Erhaltene) Sicherheiten	Pensionsgeschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions- geschäften <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
COM	(0,670) %	30.09.2021	01.10.2021	€ 194.300	NRW Bank 0,250 % - 0,625 % due 20.01.2025 - 07.06.2027	€ (193.959)	€ 194.300	€ 194.296	6,92
<b>Pensionsgeschäfte insgesamt</b>						<b>€ (193.959)</b>	<b>€ 194.300</b>	<b>€ 194.296</b>	<b>6,92</b>

<sup>(1)</sup> Umfasst aufgelaufene Zinsen.

## DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Ein Saldo von null kann auf die Rundung der tatsächlichen Beträge auf weniger als 1.000 zurückzuführen sein.

## DEWISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu liefernde Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierter Wertzuwachs	Nicht realisierter Wertverlust	Nicht realisierter Nettowertzuwachs/ (Wertverlust)	% des Nettovermögens			
BOA	10/2021	£	485	€	560	€	0,00			
	10/2021	\$	168	ILS	540	€	0,00			
	11/2021	CHF	400	€	366	€	0,00			
	11/2021	€	3.853	£	3.298	€	0,00			
BPS	11/2021	\$	1.100	€	899	€	0,00			
	11/2021	AUD	1.550	€	964	€	0,00			
	11/2021	€	2.206	£	1.887	€	0,00			
	11/2021	£	118	€	137	€	0,00			
BRC	11/2021	\$	564	€	479	€	0,00			
	04/2022	€	122	DKK	910	€	0,00			
	10/2021	DKK	319.640	€	42.979	€	0,00			
	04/2022	€	37.000	€	4.972	€	0,00			
CBK	07/2022	€	16.500	€	2.217	€	0,00			
	11/2021	€	1.923	£	1.641	€	0,00			
	11/2021	€	15.191	\$	18.069	€	0,01			
	11/2021	£	19.355	€	22.539	€	0,00			
	11/2021	ILS	17.403	\$	5.350	€	0,00			
	11/2021	\$	750	€	633	€	0,00			
	01/2022	ILS	25.268	\$	7.841	€	0,00			
	02/2022	€	21.803	€	6.651	€	0,00			
	04/2022	DKK	42.910	€	5.767	€	0,00			
	04/2022	ILS	44.700	\$	13.659	€	0,00			
	07/2022	DKK	26.100	€	3.508	€	0,00			
	08/2022	ILS	3.348	\$	1.013	€	0,00			
GLM	01/2022	€	19.947	€	6.125	€	0,00			
	11/2021	CHF	12.360	€	11.459	€	0,00			
HUS	11/2021	€	1.271	£	1.099	€	0,00			
	11/2021	€	992	\$	1.160	€	0,00			
	11/2021	£	1.217	€	1.416	€	0,00			
	11/2021	\$	4.534	€	3.824	€	0,00			
	12/2021	£	300	€	348	€	0,00			
	01/2022	ILS	2.216	\$	676	€	0,00			
	04/2022	DKK	19.200	€	2.579	€	0,00			
	11/2021	\$	80	€	68	€	0,00			
	01/2022	€	2.391	DKK	17.800	€	0,00			
	10/2021	\$	43	ILS	137	€	0,00			
JPM	11/2021	€	7.543	£	6.472	€	0,00			
	11/2021	€	932	\$	1.090	€	0,00			
	11/2021	¥	10.309.100	€	79.512	€	0,00			
	11/2021	\$	8.101	€	6.859	€	0,00			
	01/2022	DKK	17.800	€	2.390	€	0,00			
	01/2022	ILS	3.589	\$	1.104	€	0,00			
	04/2022	€	13.198	DKK	98.200	€	0,00			
	08/2022	ILS	10.043	\$	3.104	€	0,00			
	11/2021	£	314.427	€	369.055	€	0,13			
	11/2021	€	2.224	€	2.600	€	0,00			
MYI	11/2021	\$	2.560	€	2.173	€	0,00			
	12/2021	¥	6.460.000	€	49.108	€	0,00			
RBC	11/2021	€	2.224	€	2.600	€	0,00			
	11/2021	\$	2.560	€	2.173	€	0,00			
RYL	12/2021	¥	6.460.000	€	49.108	€	0,00			
SCX	11/2021	£	12.303	€	14.362	€	0,00			
	11/2021	\$	2.641	€	2.226	€	0,00			
SOG	07/2022	DKK	14.800	€	1.987	€	0,00			
	11/2021	€	6.201	€	7.207	€	0,00			
UAG	07/2022	€	7.714	DKK	57.400	€	0,00			
	11/2021	£	16.544	€	19.256	€	0,00			
	11/2021	\$	282.668	€	240.489	€	0,00			
				€	4.239	€	(5.238)	€	(999)	(0,04)
Derivative OTC-Finanzinstrumente insgesamt						€	(999)	(0,04)		
Anlagen insgesamt						€	2.809.115	100,11		
Sonstige kurzfristige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten						€	(3.053)	(0,11)		
Nettovermögen						€	2.806.062	100,00		

## ANGABEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Beträge in Tsd.\*):

\* Ein Saldo von null kann auf die Rundung der tatsächlichen Beträge auf weniger als 1.000 zurückzuführen sein.

- (a) „When-issued“-Wertpapier.
- (b) Nullkuponwertpapier.
- (c) Kupon stellt eine Rendite bis Fälligkeit dar.
- (d) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.
- (e) Bedingt wandelbares Wertpapier.

## Aufstellung des Wertpapierbestands PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (Fortsetzung)

Zum 30. September 2021 wurden Barmittel in Höhe von 2.669€ als Sicherheiten für derivative Finanzinstrumente verpfändet, die von Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. geregelt werden.

Bewertung zum beizulegenden Zeitwert<sup>(1)</sup>

Die folgende Darstellung ist eine Zusammenfassung der Zeitwertbewertung gemäß den zum 30. September 2021 für die Bewertung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten der Fonds verwendeten Parametern:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Preise für identische Anlagen (Ebene 1)	Sonstige wesentliche beobachtbare Parameter (Ebene 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Parameter (Ebene 3)	Beizulegender Zeitwert
Wertpapiere	€ 0	€ 2.615.814	€ 0	€ 2.615.814
Pensionsgeschäfte	0	194.300	0	194.300
Derivative Finanzinstrumente <sup>(3)</sup>	0	(999)	0	(999)
<b>Gesamt</b>	<b>€ 0</b>	<b>€ 2.809.115</b>	<b>€ 0</b>	<b>€ 2.809.115</b>

Die folgende Darstellung ist eine Zusammenfassung der Zeitwertbewertung gemäß den zum 31. März 2021 für die Bewertung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten der Fonds verwendeten Parametern:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Preise für identische Anlagen (Ebene 1)	Sonstige wesentliche beobachtbare Parameter (Ebene 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Parameter (Ebene 3)	Beizulegender Zeitwert
Wertpapiere	€ 0	€ 2.315.158	€ 0	€ 2.315.158
Pensionsgeschäfte	0	124.900	0	124.900
Derivative Finanzinstrumente <sup>(3)</sup>	0	(8.303)	0	(8.303)
<b>Gesamt</b>	<b>€ 0</b>	<b>€ 2.431.755</b>	<b>€ 0</b>	<b>€ 2.431.755</b>

<sup>(1)</sup> Siehe Anmerkung 3 in den Anmerkungen zum Abschluss für weitere Informationen.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

<sup>(3)</sup> Derivative Finanzinstrumente umfassen ggf. offene Futures, Swap-Vereinbarungen, verkaufte Optionen, gekaufte Optionen und Devisenterminkontrakte.

(Erhaltene) / verpfändete Sicherheiten für derivative OTC-Finanzinstrumente

Die folgende Tabelle ist eine Zusammenfassung des beizulegenden Zeitwerts der derivativen OTC-Finanzinstrumente und (erhaltenen)/verpfändeten Sicherheiten zum 30. September 2021:

Kontrahent	Beizulegender Zeitwert von OTC-Derivaten insgesamt	(Erhaltene) / verpfändete Sicherheiten	Nettoengagement <sup>(1)</sup>
BOA	€ (77)	€ 60	€ (17)
BPS	(21)	0	(21)
BRC	(13)	9	(4)
CBK	29	0	29
GLM	(57)	50	(7)
HUS	(58)	0	(58)
IND	1	0	1
JPM	(337)	(9)	(346)
MYI	3.533	(5.480)	(1.947)
RBC	(17)	0	(17)
RYL	(806)	530	(276)
SCX	7	0	7
SOG	3	0	3
UAG	(3.186)	2.020	(1.166)

<sup>(1)</sup> Das Netto-Engagement stellt die Nettoforderung/(-verbindlichkeit) dar, die bei einem Ausfall vom bzw. an den Kontrahenten zu zahlen wäre.

Vergleichsangaben

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. September 2021:

	30. Sept. 2021 (%)	31. März 2021 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene Wertpapiere	67,13	73,13
An einem anderen geregelten Markt gehandelte Wertpapiere*	24,54	18,46
Sonstige Wertpapiere	1,56	3,24
Pensionsgeschäfte	6,92	5,12
Derivative OTC-Finanzinstrumente	(0,04)	(0,34)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	-	(0,04)

\* Gemäß der in Anhang 2 des Verkaufsprospekt angegebenen Liste von Märkten, die die OGAW-Kriterien für geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. September 2021 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum beizulegenden Zeitwert	30. Sept. 2021 (%)	31. März 2021 (%)
Australien	0,27	0,29
Österreich	0,04	0,04
Belgien	0,49	0,07
Kanada	1,31	1,35
Kaimaninseln	0,73	1,49
China	1,73	0,34
Dänemark	1,53	0,04
Finnland	0,48	0,34

Anlagen zum beizulegenden Zeitwert	30. Sept. 2021 (%)	31. März 2021 (%)
Frankreich	2,89	3,95
Deutschland	3,54	3,33
Guernsey, Kanalinseln	0,25	1,94
Indien	-	0,24
Indonesien	0,94	0,22
Irland	4,24	2,15
Insel Man	0,04	0,04
Israel	1,43	1,59
Italien	3,13	3,41
Japan	2,58	3,03
Jersey, Kanalinseln	0,47	0,13
Luxemburg	4,49	5,07
Marokko	-	0,03
Niederlande	5,45	8,07
Neuseeland	0,02	0,02
Philippinen	0,04	0,04
Polen	0,06	0,05
Saudi-Arabien	0,04	0,07
Singapur	0,15	-
Slowakei	-	0,31
Spanien	1,70	1,80
Supranational	-	0,20
Schweden	0,43	0,98
Schweiz	2,47	0,11
Vereinigte Arabische Emirate	0,83	1,27
Vereinigtes Königreich	16,73	18,30
USA	13,67	14,79
Jungferninseln (Britisch)	0,17	0,05
Kurzfristige Instrumente	20,89	19,68
Pensionsgeschäfte	6,92	5,12
Derivative OTC-Finanzinstrumente		
Devisenterminkontrakte	(0,04)	(0,34)
Sonstige kurzfristige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	(0,11)	0,39
Nettovermögen	100,00	100,00



Aufstellung des Wertpapierbestands PIMCO Sterling Short Maturity UCITS ETF

BESCHREIBUNG WERTPAPIERE	NENN- WERT (in Tsd.)	BEIZULE- GENDER ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	NENN- WERT (in Tsd.)	BEIZULE- GENDER ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG INDUSTRIESEKTOR	NENN- WERT (in Tsd.)	BEIZULE- GENDER ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO VERMÖ- GENS
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN</b>											
<b>BANKEN UND FINANZEN</b>											
Aareal Bank AG 1,050 % due 29.04.2025 1,500 % due 16.06.2022	£ 2.700 500	£ 2.768 505	0,92 0,17	Hutchison Whampoa Europe Finance Ltd. 3,625 % due 06.06.2022 Industrial & Commercial Bank of China Ltd. 0,250 % due 25.04.2022 1,000 % due 09.09.2023	£ 200 \$ 500	£ 176 372	0,06 0,12	AA Bond Co. Ltd. 2,875 % due 31.07.2043	£ 100	£ 100	0,03
American International Group, Inc. 5,000 % due 26.04.2023	2.500	2.665	0,89	LeasePlan Corp. NV 0,125 % due 13.09.2023	€ 1.800	1.557	0,52	Aeropordi di Roma SpA 5,441 % due 20.02.2023	600	635	0,21
Balder Finland Oyj 0,056 % due 14.06.2023	€ 200	172	0,06	Lloyds Bank PLC 7,500 % due 15.04.2024	£ 1.100	1.283	0,43	Anheuser-Busch InBev S.A. 9,750 % due 30.07.2024	2.400	2.986	0,99
Banca Carige SpA 1,151 % due 25.10.2021	1.300	1.118	0,37	Lloyds Banking Group PLC 0,625 % due 15.01.2024	€ 1.500	1.303	0,43	ArcelorMittal S.A. 1,000 % due 19.05.2023	€ 1.500	1.308	0,44
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 1,250 % due 20.01.2022	1.870	1.615	0,54	Logicor Financing SARL 1,500 % due 14.11.2022	2.600	2.268	0,75	Babcock International Group PLC 1,750 % due 14.06.2022	200	174	0,06
Bank of China Ltd. 0,250 % due 17.04.2022 0,610 % due 10.08.2023	£ 200 £ 2.400	172 2.404	0,06 0,80	MDGH - GMTN BV 3,625 % due 30.05.2023	400	366	0,12	BAE Systems PLC 4,125 % due 08.06.2022	£ 2.700	2.769	0,92
Bank of Nova Scotia 1,050 % due 14.03.2025	1.800	1.848	0,62	Merlin Properties Socimi S.A. 2,375 % due 23.05.2022	800	695	0,23	BAT International Finance PLC 2,375 % due 19.01.2023 6,000 % due 29.06.2022	€ 100 £ 1.500	89 1.559	0,03 0,52
Barclays Bank PLC 6,625 % due 30.03.2022	€ 600	533	0,18	Metropolitan Life Global Funding 1,625 % due 09.06.2022 2,875 % due 11.01.2023	£ 1.300 1.100	1.312 1.133	0,44 0,38	BEL S.A. 1,500 % due 18.04.2024	€ 200	177	0,06
Barclays Bank UK PLC 4,250 % due 12.01.2022	£ 1.600	1.618	0,54	MPT Operating Partnership LP 2,550 % due 05.12.2023 4,000 % due 19.08.2022	€ 2.800 100	2.876 88	0,96 0,03	Boeing Co. 1,167 % due 04.02.2023 1,433 % due 04.02.2024	\$ 100 100	74 74	0,02 0,02
Barclays PLC 2,375 % due 06.10.2023 3,125 % due 17.01.2024	700 1.400	711 1.460	0,24 0,49	National Australia Bank Ltd. 1,125 % due 10.11.2021	£ 1.600	1.602	0,53	CNAC HK Finbridge Co. Ltd. 1,750 % due 06.10.2022	€ 1.500	1.301	0,43
Bayerische Landesbank 1,250 % due 20.12.2021	2.200	2.205	0,73	Nationwide Building Society 0,480 % due 02.08.2022 1,000 % due 24.01.2023	3.800 2.000	3.812 2.011	1,27 0,67	Daimler International Finance BV 1,500 % due 13.01.2022 2,000 % due 04.09.2023	£ 400 1.700	401 1.738	0,13 0,58
BMW International Investment BV 1,875 % due 11.09.2023	2.300	2.354	0,78	Nissan Motor Acceptance Co. LLC 1,019 % due 13.01.2022	\$ 700	528	0,18	Deutsche Telekom International Finance BV 6,500 % due 08.04.2022	€ 1.400	1.444	0,48
BOC Aviation Ltd. 3,000 % due 23.05.2022	\$ 400	300	0,10	Royal Bank of Canada 0,289 % due 08.12.2022	€ 900	901	0,30	Expedia Group, Inc. 2,500 % due 03.06.2022	€ 1.100	956	0,32
Canadian Imperial Bank of Commerce 1,125 % due 30.06.2022	£ 900	906	0,30	Santander UK Group Holdings PLC 7,375 % due 24.06.2022	900	207	0,07	Fidelity National Information Services, Inc. 1,700 % due 30.06.2022	£ 1.000	1.009	0,34
China Construction Bank Europe S.A. 0,000 % due 28.06.2024	€ 200	172	0,06	Santander UK PLC 0,650 % due 12.11.2024	2.700	2.736	0,91	Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide 1,625 % due 09.07.2024	€ 2.900	2.576	0,86
Citigroup, Inc. 2,750 % due 24.01.2024	£ 1.600	1.664	0,55	SBB Treasury Oyj 0,106 % due 01.02.2023	€ 2.600	2.238	0,75	Gazprom PJSC Via Gaz Capital S.A. 2,750 % due 30.11.2021 3,125 % due 17.11.2023 4,950 % due 19.07.2022 6,510 % due 07.03.2022	CHF 1.200 € 700 \$ 700 100	958 635 536 76	0,32 0,21 0,18 0,03
Cooperatieve Rabobank UA 4,125 % due 14.09.2022	€ 400	358	0,12	Sberbank of Russia Via SB Capital S.A. 6,125 % due 07.02.2022	\$ 800	605	0,20	Glencore Finance Europe Ltd. 6,000 % due 03.04.2022	£ 1.000	1.027	0,34
CPI Property Group S.A. 4,750 % due 08.03.2023	\$ 300	235	0,08	Segro PLC 6,750 % due 23.02.2024	£ 300	338	0,11	Harvest Operations Corp. 1,000 % due 26.04.2024	\$ 200	148	0,05
Credit Suisse AG 6,500 % due 08.08.2023 (e)	200	163	0,05	Societe Generale S.A. 1,875 % due 03.10.2024	1.500	1.527	0,51	Imperial Brands Finance PLC 9,000 % due 17.02.2022	£ 3.100	3.198	1,06
Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd. 3,000 % due 27.05.2022	£ 900	914	0,30	Standard Chartered PLC 0,750 % due 03.10.2023 1,284 % due 20.01.2023 1,300 % due 14.10.2023	€ 600 \$ 400 300	520 298 225	0,17 0,10 0,07	InterContinental Hotels Group PLC 3,875 % due 28.11.2022	£ 1.400	1.449	0,48
Deutsche Bank AG 1,354 % due 27.02.2023 1,750 % due 16.12.2021	\$ 100 £ 2.900	75 2.908	0,02 0,97	Toronto-Dominion Bank 1,000 % due 13.12.2021	£ 1.500	1.503	0,50	ITV PLC 2,125 % due 21.09.2022	€ 200	175	0,06
Deutsche Pfandbriefbank AG 1,050 % due 26.04.2024 1,500 % due 16.12.2021	1.800 2.500	1.835 2.507	0,61 0,83	TP ICAP Ltd. 5,250 % due 26.01.2024	2.700	2.934	0,98	Kraft Heinz Foods Co. 2,000 % due 30.06.2023	600	532	0,18
Digital Stout Holding LLC 2,750 % due 19.07.2024	2.800	2.933	0,98	UBS AG 0,500 % due 09.08.2024 7,625 % due 17.08.2022	\$ 1.100 3.150	822 2.476	0,27 0,82	Lendlease Europe Finance PLC 6,125 % due 12.10.2021	£ 1.500	1.502	0,50
DNB Bank ASA 1,375 % due 12.06.2023	600	609	0,20	UniCredit SpA 4,033 % due 14.01.2022 6,572 % due 14.01.2022 7,830 % due 04.12.2023	350 350 500	262 264 425	0,09 0,09 0,14	National Grid Electricity Transmission PLC 5,875 % due 02.02.2024	300	333	0,11
European Investment Bank 0,330 % due 10.01.2022	1.600	1.601	0,53	Virgin Money UK PLC 0,375 % due 27.05.2024 3,125 % due 22.06.2025	€ 1.300 £ 1.800	1.127 1.880	0,38 0,63	Nissan Motor Co. Ltd. 1,940 % due 15.09.2023	€ 600	536	0,18
FCE Bank PLC 2,727 % due 03.06.2022	4.400	4.453	1,49	Volkswagen Financial Services NV 1,125 % due 18.09.2023 1,625 % due 30.11.2022 2,750 % due 10.07.2023	300 700 1.700	301 707 1.753	0,10 0,24 0,58	Ryanair DAC 1,125 % due 10.03.2023 1,125 % due 15.08.2023	1.100 100	963 88	0,32 0,03
First Abu Dhabi Bank PJSC 1,375 % due 19.02.2023	100	101	0,03	Volkswagen Leasing GmbH 0,000 % due 12.07.2023 (b) 0,000 % due 19.07.2024 (b)	€ 700 200	603 172	0,20 0,06	SIG Combibloc Purchase Co. SARL 1,875 % due 18.06.2023	1.350	1.196	0,40
GE Capital Canada Funding Co. 4,600 % due 26.01.2022	CAD 1.700	1.008	0,34	Wells Fargo & Co. 1,375 % due 30.06.2022 2,125 % due 20.12.2023	£ 2.500 3.300	2.517 3.383	0,84 1,13	Smiths Group PLC 1,250 % due 28.04.2023	500	438	0,15
GE Capital UK Funding Unlimited Co. 4,125 % due 13.09.2023	£ 1.900	2.022	0,67					Southern Gas Networks PLC 4,875 % due 05.10.2023	£ 1.300	1.403	0,47
General Motors Financial Co., Inc. 0,955 % due 07.09.2023 2,250 % due 06.09.2024	€ 1.500 £ 1.600	1.313 1.641	0,44 0,55					Stellantis NV 3,375 % due 07.07.2023	€ 400	362	0,12
Goldman Sachs Group, Inc. 0,453 % due 30.04.2024	€ 3.200	2.782	0,93					Telefonica Emisiones S.A.U. 5,289 % due 09.12.2022	£ 2.500	2.638	0,88
Hamburg Commercial Bank AG 0,750 % due 23.11.2023	100	87	0,03					Tesco PLC 6,125 % due 24.02.2022	2.683	2.744	0,91
HSBC Holdings PLC 2,175 % due 27.06.2023 5,250 % due 16.09.2022	£ 3.200	3.237	1,08					Western Power Distribution West Midlands PLC 3,875 % due 17.10.2024	200	216	0,07
(d)(e) 6,500 % due 20.05.2024	€ 200 £ 1.800	178 2.050	0,06 0,68					Worldline S.A. 0,500 % due 30.06.2023	€ 400	348	0,12
						112.411	37,45			40.871	13,61



BESCHREIBUNG	NENN- WERT (in Tsd.)	BEIZULE- GENDER ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	NENN- WERT (in Tsd.)	BEIZULE- GENDER ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	NENN- WERT (in Tsd.)	BEIZULE- GENDER ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO VERMÖ- GENS			
<b>VERSORGUNGSUNTERNEHMEN</b>				<b>STANLINGTON PLC</b>				<b>TURBO FINANCE 9 PLC</b>						
AT&T, Inc.				1,067 % due 12.06.2046	£ 1.012	£ 1.014	0,34	0,880 % due 20.08.2028	£ 181	£ 182	0,06			
1,300 % due 05.09.2023	€ 100	£ 88	0,03	Stratton Mortgage Funding PLC										
CK Hutchison Group Telecom Finance S.A.				0,000 % due 12.12.2043	865	868	0,29			17.298	5,76			
0,375 % due 17.10.2023	300	260	0,09	0,900 % due 25.09.2051	1.021	1.027	0,34	<b>STAATSANLEIHEN</b>						
E.ON International Finance BV				0,950 % due 20.07.2060	2.781	2.797	0,93	<b>Bpifrance Financement S.A.</b>						
5,500 % due 06.07.2022	£ 1.550	1.609	0,53	1,250 % due 25.05.2051	1.247	1.253	0,42	0,750 % due 22.07.2022	1.900	1.906	0,63			
5,625 % due 06.12.2023	1.300	1.435	0,48	Towd Point Mortgage Funding PLC				China Development Bank						
Global Switch Holdings Ltd.				0,950 % due 20.05.2045	182	183	0,06	0,375 % due 24.01.2022	€ 200	172	0,06			
4,375 % due 13.12.2022	1.400	1.459	0,49	1,097 % due 20.10.2051	302	304	0,10	Indonesia Government International Bond						
Iberdrola Finanzas S.A.				Tower Bridge Funding PLC				2,625 % due 14.06.2023	2.700	2.421	0,81			
7,375 % due 29.01.2024	3.900	4.481	1,49	0,000 % due 20.11.2063	2.000	2.006	0,67	Israel Government International Bond						
Saudi Electricity Global Sukuk Co.				1,420 % due 20.09.2063	375	379	0,13	0,000 % due 22.07.2022 (b)	1.700	1.465	0,49			
4,211 % due 03.04.2022	\$ 400	302	0,10	Trinity Square PLC				Kommunalbanken A/S						
Severn Trent Utilities Finance PLC				0,899 % due 15.07.2059	1.571	1.580	0,52	1,125 % due 30.11.2022	£ 1.200	1.211	0,40			
1,625 % due 04.12.2022	£ 1.200	1.216	0,40	<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>						7.175	2,39			
Sinopec Group Overseas Development Ltd.				<b>Aqueduct European CLO DAC</b>				<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>						
1,000 % due 28.04.2022	€ 530	458	0,15	0,640 % due 20.07.2030				<b>COMMERCIAL PAPER</b>						
SSE PLC				1,450 % due 20.04.2032				<b>Nomura Bank International PLC</b>						
5,875 % due 22.09.2022	£ 1.300	1.367	0,45	Barings Euro CLO DAC				0,375 % due 14.10.2021				€ 500	430	0,14
Verizon Communications, Inc.				0,271 % due 25.10.2029				0,365 % due 15.11.2021				500	430	0,14
4,073 % due 18.06.2024	2.500	2.721	0,91	Bavarian Sky UK PLC				Pure Finance S.A.						
Western Power Distribution East Midlands PLC				0,401 % due 20.08.2029				0,203 % due 25.10.2021				600	516	0,17
5,250 % due 17.01.2023	1.100	1.163	0,39	£ 800				0,401 % due 03.11.2021				£ 100	100	0,03
		16.559	5,51	BBVA Consumer Auto				0,411 % due 21.12.2021				400	399	0,13
Unternehmensanleihen u.				0,270 % due 20.07.2031				0,411 % due 11.01.2022				200	200	0,07
Schuldverschreibungen insgesamt		169.841	56,57	€ 1.408				0,411 % due 25.01.2022				200	200	0,07
<b>EMISSIONEN VON US-BEHÖRDEN</b>				<b>BlueMountain Fuji EUR CLO DAC</b>				0,421 % due 22.02.2022				200	200	0,07
Freddie Mac				0,650 % due 15.07.2030				0,441 % due 07.10.2021				300	300	0,10
0,650 % due 27.10.2025	\$ 1.100	810	0,27	BNPP AM Euro CLO BV				0,451 % due 04.11.2021				100	100	0,03
0,800 % due 28.10.2026	1.200	879	0,29	0,600 % due 15.04.2031				0,451 % due 23.11.2021				200	200	0,07
		1.689	0,56	Bumper BE NV/S.A.				0,508 % due 14.12.2021				\$ 100	74	0,03
<b>NON-AGENCY MORTGAGE-BACKED SECURITIES</b>				Cairn CLO DAC				0,508 % due 28.12.2021				100	74	0,03
Ardmore Securities No. 1 DAC				0,600 % due 30.04.2031				0,508 % due 11.01.2022				100	74	0,02
0,000 % due 15.08.2057	€ 125	107	0,03	0,670 % due 31.01.2030				0,508 % due 25.01.2022				100	74	0,02
Atlas Funding PLC				0,790 % due 25.07.2029				0,508 % due 01.02.2022				200	148	0,05
0,949 % due 25.07.2058	£ 195	196	0,06	Cardiff Auto Receivables Securitisation PLC				0,508 % due 08.03.2022				100	74	0,02
Avon Finance No. 2 PLC				0,680 % due 16.09.2025				0,518 % due 21.12.2021				200	148	0,05
0,950 % due 20.09.2048	606	608	0,20	€ 653				0,529 % due 17.11.2021				100	74	0,02
Ciel No. 1 PLC				Carlisle Global Market Strategies Euro CLO DAC				Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB						
1,117 % due 12.06.2046	160	161	0,05	0,730 % due 21.09.2029				0,112 % due 12.10.2021				€ 1.100	945	0,32
Dilosk RMBS DAC				1,200 % due 21.09.2029				Syngenta Finance NV						
0,202 % due 20.02.2060	€ 486	420	0,14	CIT Mortgage Loan Trust				0,071 % due 29.10.2021				3.200	2.751	0,92
Dutch Property Finance BV				1,436 % due 25.10.2037										
0,106 % due 28.07.2054	842	727	0,24	\$ 100				7,511				2,50		
Fingal Securities RMBS DAC				Citizen Irish Auto Receivables Trust DAC				<b>JAPANISCHE SCHATZANLEIHEN</b>						
0,456 % due 28.07.2055	265	229	0,08	0,263 % due 15.12.2029				(0,138) % due 06.01.2022						
Finsbury Square PLC				Contego CLO DAC				(b)(c)				¥ 1.000.000	6.650	2,21
1,350 % due 16.06.2070	£ 2.337	2.363	0,79	0,640 % due 23.01.2030				(0,111) % due 08.11.2021						
Harben Finance PLC				Cork Street CLO DAC				(b)(c)				1.200.000	7.977	2,66
0,868 % due 20.08.2056	116	116	0,04	0,590 % due 27.11.2028				(0,110) % due 25.10.2021				500.000		
Hawksmoor Mortgages PLC				FACT Master S.A.				(b)(c)				0	3.324	1,11
1,100 % due 25.05.2053	2.296	2.307	0,77	0,141 % due 20.07.2028				(0,103) % due 04.10.2021				700.000	4.653	1,55
Jubilee Place BV				Fortuna Consumer Loan ABS DAC				(b)(c)						
0,452 % due 17.10.2057	€ 134	117	0,04	0,000 % due 15.10.2030				22.604				7,53		
Lanebrook Mortgage Transaction PLC				(a)				<b>U.K. TREASURY BILLS</b>						
1,150 % due 12.06.2057	£ 541	547	0,18	Harvest CLO DAC				0,020 % due 01.11.2021						
London Wall Mortgage Capital PLC				0,650 % due 26.06.2030				(b)(c)				£ 11.500	11.500	3,83
0,921 % due 15.11.2049	35	35	0,01	Jubilee CLO BV				0,060 % due 06.12.2021				17.000	17.000	5,66
Mulcair Securities DAC				0,610 % due 15.04.2030				(b)(c)						
0,451 % due 24.04.2071	€ 62	53	0,02	0,650 % due 15.04.2031				28.500				9,49		
Precise Mortgage Funding PLC				Man GLG Euro CLO				Kurzzfristige Instrumente insgesamt				58.615	19,52	
0,717 % due 12.12.2054	£ 88	88	0,03	0,900 % due 15.10.2032				<b>Wertpapiere insgesamt</b>				£ 277.830	92,53	
Primrose Residential DAC				Man GLG Euro CLO DAC										
0,189 % due 24.03.2061	€ 969	835	0,28	0,680 % due 15.10.2030										
Residential Mortgage Securities PLC				0,870 % due 15.01.2030										
1,300 % due 20.06.2070	£ 800	808	0,27	Oak Hill European Credit Partners Ltd.										
RMAC PLC				0,900 % due 22.07.2030										
0,767 % due 12.06.2046	1.112	1.114	0,37	Palmer Square European Loan Funding DAC										
1,037 % due 12.06.2046	946	951	0,32	0,780 % due 15.04.2031										
SapphireOne Mortgages FCT				0,870 % due 15.02.2030										
0,000 % due 27.06.2061	€ 22	19	0,01	731										
				PCL Funding PLC										
				0,800 % due 15.10.2025										
				1,100 % due 15.09.2024										
				St Paul's CLO DAC										
				0,850 % due 25.04.2030										

## Aufstellung des Wertpapierbestands PIMCO Sterling Short Maturity UCITS ETF (Fortsetzung)

### PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Leihzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kapitalbetrag	Besichert durch	(Erhaltene Sicherheiten)	Pensionsgeschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäften <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
SCX	(0,100) %	30.09.2021	01.10.2021	£ 21.600	United Kingdom Gilt 0,750 % due 22.03.2034	£ (21.581)	£ 21.600	£ 21.600	7,19
<b>Pensionsgeschäfte insgesamt</b>						<b>£ (21.581)</b>	<b>£ 21.600</b>	<b>£ 21.600</b>	<b>7,19</b>

<sup>(1)</sup> Umfasst aufgelaufene Zinsen.

### DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Ein Saldo von null kann auf die Rundung der tatsächlichen Beträge auf weniger als 1.000 zurückzuführen sein.

### DEWISENTERMIKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu liefernde Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierter Wertzuwachs	Nicht realisierter (Wertverlust)	Nicht realisierter Nettowertzuwachs/ (Wertverlust)	% des Nettovermögens
AZD	11/2021	¥ 311	£ 2	£ 0	£ 0	£ 0	0,00
BOA	10/2021	700.000	£ 4.567	0	(86)	(86)	(0,03)
	11/2021	€ 2.951	2.533	0	(5)	(5)	0,00
	11/2021	\$ 199	142	0	(6)	(6)	0,00
BPS	10/2021	¥ 500.000	£ 3.337	13	0	13	0,00
	11/2021	€ 2.934	2.517	0	(7)	(7)	0,00
	01/2022	¥ 1.000.000	£ 6.602	0	(51)	(51)	(0,02)
BRC	11/2021	€ 1.413	£ 1.214	0	(1)	(1)	0,00
	11/2021	£ 398	€ 464	1	0	1	0,00
	11/2021	¥ 1.200.000	£ 7.851	0	(127)	(127)	(0,04)
CBK	11/2021	€ 584	€ 499	0	(4)	(4)	0,00
	11/2021	CHF 1.220	€ 964	0	(7)	(7)	0,00
	11/2021	€ 1.016	€ 868	0	(6)	(6)	0,00
HUS	11/2021	£ 772	€ 901	3	0	3	0,00
	11/2021	\$ 710	£ 513	0	(14)	(14)	(0,01)
	11/2021	€ 70.027	£ 59.448	0	(791)	(791)	(0,26)
JPM	11/2021	CAD 1.711	€ 984	0	(18)	(18)	(0,01)
	11/2021	€ 3.476	€ 2.984	0	(6)	(6)	0,00
	11/2021	£ 11.045	€ 12.781	0	(50)	(50)	(0,02)
MYI	11/2021	\$ 14.910	£ 10.765	0	(293)	(293)	(0,10)
	01/2022	100	72	0	(2)	(2)	0,00
	11/2021	€ 402	€ 346	0	0	0	0,00
RBC	11/2021	2.100	£ 1.802	0	(4)	(4)	0,00
	11/2021	\$ 304	€ 221	0	(5)	(5)	0,00
	11/2021	£ 5.791	€ 6.757	22	0	22	0,01
RYL	11/2021	£ 704	£ 512	0	(10)	(10)	(0,01)
	11/2021	€ 1.515	£ 1.296	0	(8)	(8)	0,00
	11/2021	\$ 202	£ 146	0	(3)	(3)	0,00
<b>Derivative OTC-Finanzinstrumente insgesamt</b>						<b>£ (1.465)</b>	<b>(0,49)</b>
<b>Anlagen insgesamt</b>						<b>£ 297.965</b>	<b>99,23</b>
<b>Sonstige kurzfristige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>						<b>£ 2.325</b>	<b>0,77</b>
<b>Nettovermögen</b>						<b>£ 300.290</b>	<b>100,00</b>

### ANGABEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Beträge in Tsd.\*):

\* Ein Saldo von null kann auf die Rundung der tatsächlichen Beträge auf weniger als 1.000 zurückzuführen sein.

- (a) „When-issued“-Wertpapier.
- (b) Nullkuponwertpapier.
- (c) Kupon stellt eine Rendite bis Fälligkeit dar.
- (d) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.
- (e) Bedingt wandelbares Wertpapier.

Zum 30. September 2021 wurden Barmittel in Höhe von 310£ als Sicherheiten für derivative Finanzinstrumente verpfändet, die von Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. geregelt werden.

#### Bewertung zum beizulegenden Zeitwert<sup>(1)</sup>

Die folgende Darstellung ist eine Zusammenfassung der Zeitwertbewertung gemäß den zum 30. September 2021 für die Bewertung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten der Fonds verwendeten Parametern:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Preise für identische Anlagen (Ebene 1)	Sonstige wesentliche beobachtbare Parameter (Ebene 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Parameter (Ebene 3)	Beizulegender Zeitwert
Wertpapiere	£ 0	£ 277.830	£ 0	£ 277.830
Pensionsgeschäfte	0	21.600	0	21.600
Derivative Finanzinstrumente <sup>(3)</sup>	0	(1.465)	0	(1.465)
<b>Gesamt</b>	<b>£ 0</b>	<b>£ 297.965</b>	<b>£ 0</b>	<b>£ 297.965</b>

Die folgende Darstellung ist eine Zusammenfassung der Zeitwertbewertung gemäß den zum 31. März 2021 für die Bewertung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten der Fonds verwendeten Parametern:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Preise für identische Anlagen (Ebene 1)	Sonstige wesentliche beobachtbare Parameter (Ebene 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Parameter (Ebene 3)	Beizulegender Zeitwert
Wertpapiere	£ 100	£ 153.575	£ 0	£ 153.675
Pensionsgeschäfte	0	5.300	0	5.300
Derivative Finanzinstrumente <sup>(3)</sup>	0	1.872	0	1.872
<b>Gesamt</b>	<b>£ 100</b>	<b>£ 160.747</b>	<b>£ 0</b>	<b>£ 160.847</b>

<sup>(1)</sup> Siehe Anmerkung 3 in den Anmerkungen zum Abschluss für weitere Informationen.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

<sup>(3)</sup> Derivative Finanzinstrumente umfassen ggf. offene Futures, Swap-Vereinbarungen, verkaufte Optionen, gekaufte Optionen und Devisenterminkontrakte.

#### (Erhaltene) / verpfändete Sicherheiten für derivative OTC-Finanzinstrumente

Die folgende Tabelle ist eine Zusammenfassung des beizulegenden Zeitwerts der derivativen OTC-Finanzinstrumente und (erhaltenen)/verpfändeten Sicherheiten zum 30. September 2021:

Kontrahent	Beizulegender Zeitwert von OTC- Derivaten insgesamt	(Erhaltene) / verpfändete Sicherheiten	Nettoengagement <sup>(1)</sup>
BOA	£ (97)	£ 30	£ (67)
BPS	(45)	0	(45)
BRC	(127)	0	(127)
CBK	(4)	0	(4)
HUS	(24)	0	(24)
JPM	(791)	0	(791)
MYI	(369)	280	(89)
RYL	(9)	0	(9)
SCX	12	0	12
SSB	(8)	0	(8)
UAG	(3)	0	(3)

<sup>(1)</sup> Das Netto-Engagement stellt die Nettoforderung/(-verbindlichkeit) dar, die bei einem Ausfall vom bzw. an den Kontrahenten zu zahlen wäre.

#### Vergleichsangaben

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. September 2021:

	30. Sept. 2021 (%)	31. März 2021 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene Wertpapiere	66,76	75,24
An einem anderen geregelten Markt gehandelte Wertpapiere*	24,44	19,40
Sonstige Wertpapiere	1,33	0,83
Pensionsgeschäfte	7,19	3,29
Derivative OTC-Finanzinstrumente	(0,49)	1,16

\* Gemäß der in Anhang 2 des Verkaufsprospekt angegebenen Liste von Märkten, die die OGAW-Kriterien für geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. September 2021 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum beizulegenden Zeitwert	30. Sept. 2021 (%)	31. März 2021 (%)
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen	56,57	59,87
Emissionen von US-Behörden	0,56	1,02
Non-Agency Mortgage-Backed Securities	7,73	7,96
Forderungsbesicherte Wertpapiere	5,76	7,02
Staatsanleihen	2,39	2,98
Kurzfristige Instrumente	19,52	16,62
Pensionsgeschäfte	7,19	3,29
Derivative OTC-Finanzinstrumente		
Devisenterminkontrakte	(0,49)	1,16
Sonstige kurzfristige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	0,77	0,08
<b>Nettovermögen</b>	<b>100,00</b>	<b>100,00</b>



BESCHREIBUNG	NENN-WERT (in Tsd.)	BEIZULE- GENDER ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	NENN- WERT (in Tsd.)	BEIZULE- GENDER ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	NENN- WERT (in Tsd.)	BEIZULE- GENDER ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO VERMÖ- GENS
Park Aerospace Holdings Ltd. 4,500 % due 15.03.2023	\$ 1.400	\$ 1.463	0,03	BAT International Finance PLC 3,250 % due 07.06.2022	\$ 400	\$ 407	0,01	Imperial Brands Finance PLC 3,500 % due 11.02.2023 3,750 % due 21.07.2022	\$ 800	\$ 824	0,02
PNC Bank N.A. 0,453 % due 24.02.2023	23.750	23.784	0,45	Bayer U.S. Finance LLC 1,126 % due 15.12.2023 3,000 % due 08.10.2021	14.600 3.506	14.800 3.507	0,28 0,07	Kia Corp. 1,000 % due 16.04.2024 3,000 % due 25.04.2023	500 15.300	500 15.860	0,01 0,30
QNB Finance Ltd. 1,125 % due 17.06.2024 1,275 % due 12.02.2022	26.900 25.300	26.895 25.389	0,51 0,48	BMW Finance NV 0,913 % due 12.08.2022	11.000	11.077	0,21	Komatsu Finance America, Inc. 2,437 % due 11.09.2022	1.000	1.019	0,02
Royal Bank of Canada 0,350 % due 19.01.2024 0,494 % due 17.01.2023 0,500 % due 26.10.2023 0,600 % due 29.04.2022	10.400 4.300 7.400 12.400	10.432 4.320 7.446 12.434	0,20 0,08 0,14 0,24	BMW U.S. Capital LLC 0,430 % due 12.08.2024 0,663 % due 14.04.2022 0,778 % due 06.04.2022	1.700 3.200 3.200	1.709 3.208 3.208	0,03 0,06 0,06	Leidos, Inc. 2,950 % due 15.05.2023	3.500	3.622	0,07
Santander Holdings USA, Inc. 3,400 % due 18.01.2023 4,450 % due 03.12.2021	15.500 3.175	16.033 3.185	0,31 0,06	Boeing Co. 1,167 % due 04.02.2023 1,433 % due 04.02.2024 2,800 % due 01.03.2023 4,508 % due 01.05.2023	24.467 9.000 2.000 27.017	24.523 9.014 2.056 28.549	0,47 0,17 0,04 0,55	Lennar Corp. 4,750 % due 15.11.2022 5,375 % due 01.10.2022	250 4.000	259 4.195	0,01 0,08
Santander UK Group Holdings PLC 1,089 % due 15.03.2025	10.000	10.020	0,19	Bristol-Myers Squibb Co. 0,505 % due 16.05.2022	20.400	20.458	0,39	Martin Marietta Materials, Inc. 0,650 % due 15.07.2023	7.700	7.716	0,15
Santander UK PLC 0,785 % due 15.11.2021	10.900	10.908	0,21	BP Capital Markets America, Inc. 0,772 % due 19.09.2022	6.724	6.761	0,13	Mitsubishi Corp. 2,625 % due 14.07.2022	200	203	0,00
Shinhan Bank Co. Ltd. 2,875 % due 28.03.2022	700	708	0,01	CenterPoint Energy Resources Corp. 0,620 % due 02.03.2023	9.200	9.201	0,18	NXP BV 3,875 % due 01.09.2022	5.253	5.410	0,10
Skandinaviska Enskilda Banken AB 0,759 % due 12.12.2022	25.900	26.078	0,50	Central Nippon Expressway Co. Ltd. 0,585 % due 15.02.2022	70.200	70.296	1,34	Penske Truck Leasing Co. LP 3,375 % due 01.02.2022	2.615	2.628	0,05
Standard Chartered PLC 1,300 % due 14.10.2023 1,319 % due 14.10.2023 4,247 % due 20.01.2023	6.800 2.000 300	6.865 2.013 303	0,13 0,04 0,01	Charter Communications Operating LLC 1,776 % due 01.02.2024 4,464 % due 23.07.2022	4.675 39.487	4.809 40.495	0,09 0,77	Phillips 66 0,745 % due 15.02.2024	8.100	8.105	0,15
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc. 0,874 % due 18.10.2022 0,874 % due 17.01.2023 0,899 % due 12.07.2022 1,089 % due 11.01.2022 1,274 % due 19.10.2021	8.500 5.800 4.100 4.300 1.657	8.560 5.851 4.124 4.311 1.658	0,16 0,11 0,08 0,08 0,03	Cigna Corp. 0,613 % due 15.03.2024 1,016 % due 15.07.2023	2.500 5.700	2.495 5.771	0,05 0,11	Pioneer Natural Resources Co. 0,550 % due 15.05.2023	6.400	6.408	0,12
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd. 0,490 % due 16.09.2024 0,850 % due 25.03.2024	17.200 15.400	17.248 15.441	0,33 0,29	Conagra Brands, Inc. 0,500 % due 11.08.2023	3.500	3.501	0,07	Reynolds American, Inc. 4,850 % due 15.09.2023	1.000	1.083	0,02
Svensk Exportkredit AB 0,234 % due 13.12.2021	6.000	6.002	0,11	DAE Funding LLC 5,250 % due 15.11.2021	3.111	3.114	0,06	Rogers Communications, Inc. 0,725 % due 22.03.2022	18.900	18.956	0,36
Synchrony Bank 3,000 % due 15.06.2022	10.975	11.156	0,21	Daimler Finance North America LLC 0,791 % due 05.11.2021 1,011 % due 22.02.2022 1,025 % due 15.02.2022	35.500 8.400 30.300	35.523 8.429 30.397	0,68 0,16 0,58	Sabine Pass Liquefaction LLC 6,250 % due 15.03.2022	1.410	1.426	0,03
Synchrony Financial 2,850 % due 25.07.2022	10.540	10.733	0,20	Dolphin Energy Ltd. LLC 5,500 % due 15.12.2021	22.000	22.223	0,42	Saudi Arabian Oil Co. 2,750 % due 16.04.2022	1.100	1.114	0,02
Toronto-Dominion Bank 0,405 % due 04.03.2024	13.500	13.551	0,26	Enbridge, Inc. 0,550 % due 04.10.2023 (b) 0,625 % due 18.02.2022	1.500 41.285	1.501 41.365	0,03 0,79	SK Broadband Co. Ltd. 3,875 % due 13.08.2023	3.500	3.707	0,07
Toyota Motor Credit Corp. 0,340 % due 13.09.2024 0,380 % due 11.01.2024 0,428 % due 07.10.2021 0,524 % due 17.05.2022 0,595 % due 08.09.2022	1.500 5.500 1.500 4.700 3.400	1.503 5.522 1.500 4.713 3.416	0,03 0,11 0,03 0,09 0,07	ERAC USA Finance LLC 2,600 % due 01.12.2021	240	240	0,00	SK Telecom Co. Ltd. 3,750 % due 16.04.2023	1.495	1.565	0,03
Truist Financial Corp. 0,781 % due 01.04.2022	410	411	0,01	Fidelity National Information Services, Inc. 0,375 % due 01.03.2023	3.000	3.002	0,06	Southern Natural Gas Co. LLC 0,625 % due 28.04.2023	2.100	2.100	0,04
UBS AG 0,410 % due 09.02.2024 0,500 % due 09.08.2024	5.000 25.000	5.020 25.196	0,10 0,48	GATX Corp. 0,841 % due 05.11.2021	3.000	3.002	0,06	Verisk Analytics, Inc. 4,125 % due 12.09.2022	200	207	0,00
UBS Group AG 1,075 % due 15.08.2023	35.600	35.872	0,68	General Mills, Inc. 6,410 % due 15.10.2022	4.400	4.667	0,09	VMware, Inc. 0,600 % due 15.08.2023	7.000	7.011	0,13
Wells Fargo & Co. 1,359 % due 31.10.2023	51.000	51.647	0,99	Humana, Inc. 0,650 % due 03.08.2023	13.000	13.009	0,25	Volkswagen Group of America Finance LLC 0,750 % due 23.11.2022 1,063 % due 12.11.2021 4,000 % due 12.11.2021	4.700 42.744 3.000	4.715 42.789 3.012	0,09 0,82 0,06
Woori Bank 0,996 % due 01.02.2023	2.000	2.015	0,04	Huntington Ingalls Industries, Inc. 0,670 % due 16.08.2023	4.800	4.800	0,09	<b>VERSORGUNGSUNTERNEHMEN</b>			
		2.104.286	40,14	Hyundai Capital America 0,800 % due 03.04.2023 1,150 % due 10.11.2022 1,250 % due 18.09.2023 2,375 % due 10.02.2023 2,850 % due 01.11.2022 3,000 % due 20.06.2022 3,100 % due 05.04.2022 3,250 % due 20.09.2022 4,125 % due 08.06.2023 5,750 % due 06.04.2023	6.000 3.140 492 6.071 4.735 1.668 2.174 4.330 2.065 2.200	6.004 3.158 496 6.206 4.849 1.697 2.202 4.440 2.179 2.360	0,11 0,06 0,01 0,12 0,09 0,03 0,04 0,09 0,04 0,05	American Electric Power Co., Inc. 0,606 % due 01.11.2023	49.000	49.032	0,94
<b>INDUSTRIESEKTOR</b>				Illumina, Inc. 0,550 % due 23.03.2023	6.400	6.402	0,12	AT&T, Inc. 1,015 % due 15.02.2023	22.000	22.203	0,42
7-Eleven, Inc. 0,578 % due 10.08.2022	16.312	16.316	0,31					Atmos Energy Corp. 0,496 % due 09.03.2023 0,625 % due 09.03.2023	28.500 7.800	28.504 7.800	0,55 0,15
AbbVie, Inc. 0,587 % due 19.11.2021 0,781 % due 21.11.2022 3,375 % due 14.11.2021 3,450 % due 15.03.2022	10.275 11.400 2.800 4.300	10.282 11.475 2.810 4.339	0,20 0,22 0,05 0,08					BG Energy Capital PLC 4,000 % due 15.10.2021	2.700	2.704	0,05
Arrow Electronics, Inc. 3,500 % due 01.04.2022	1.555	1.571	0,03					British Transco International Finance BV 0,000 % due 04.11.2021 (c)	6.460	6.461	0,12
BAT Capital Corp. 1,005 % due 15.08.2022 2,764 % due 15.08.2022	52.686 700	52.987 713	1,01 0,01					Dominion Energy, Inc. 0,646 % due 15.09.2023	11.000	11.008	0,21
								Duke Energy Corp. 0,764 % due 11.03.2022	20.400	20.451	0,39
								Duke Energy Florida LLC 0,372 % due 26.11.2021	585	585	0,01
								KT Corp. 2,625 % due 07.08.2022	3.400	3.457	0,07
								Mississippi Power Co. 0,350 % due 28.06.2024	5.000	5.006	0,10
								NextEra Energy Capital Holdings, Inc. 0,590 % due 01.03.2023 0,650 % due 01.03.2023 0,849 % due 25.02.2022	5.300 20.500 8.000	5.324 20.574 8.020	0,10 0,39 0,15





BESCHREIBUNG	NENN- WERT (in Tsd.)	BEIZULE- GENDER ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	NENN- WERT (in Tsd.)	BEIZULE- GENDER ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	NENN- WERT (in Tsd.)	BEIZULE- GENDER ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO VERMÖ- GENS
SLM Private Credit Student Loan Trust 0,446 % due 15.03.2024 \$	547	\$ 546	0,01	WhiteHorse Ltd. 1,064 % due 17.04.2027 \$	51	\$ 51	0,00	Niederlande Waterschapsbank NV 0,186 % due 15.12.2021 \$	70.700	\$ 70.715	1,35
SLM Student Loan Trust 0,265 % due 25.10.2028	618	616	0,01	Wind River CLO Ltd. 0,996 % due 15.10.2027	186	186	0,00	2,250 % due 02.03.2022	5.000	5.043	0,10
0,275 % due 25.10.2029	1.431	1.426	0,03	Zais CLO Ltd. 1,276 % due 15.04.2028	421	421	0,01	3,000 % due 21.12.2021	142.000	142.878	2,73
0,586 % due 15.12.2027	754	754	0,02					Saudi Government International Bond 2,375 % due 26.10.2021	2.600	2.604	0,05
0,666 % due 15.12.2025	614	614	0,01					Land Nordrhein-Westfalen 0,312 % due 28.10.2021	7.700	7.698	0,15
0,675 % due 25.01.2028	250	250	0,01					Tokyo Metropolitan Government 0,750 % due 16.07.2025	5.900	5.835	0,11
0,725 % due 25.10.2029	394	395	0,01					2,500 % due 08.06.2022	500	506	0,01
0,736 % due 27.12.2038	558	561	0,01							400.849	7,65
SMB Private Education Loan Trust 0,936 % due 15.09.2054	972	985	0,02								
0,984 % due 15.09.2034	3.005	3.025	0,06	Agence Francaise de Developpement 0,330 % due 17.12.2021	10.000	10.005	0,19				
1,184 % due 15.09.2034	2.185	2.198	0,04	BNG Bank NV 0,184 % due 11.03.2022	36.200	36.206	0,69				
1,284 % due 15.07.2027	101	101	0,00	Caisse des Depots et Consignations 2,750 % due 18.01.2022	12.800	12.907	0,24				
2,340 % due 15.09.2034	1.311	1.335	0,03	Export Development Canada 0,520 % due 26.05.2024	36.000	35.981	0,69				
2,980 % due 15.07.2027	405	408	0,01	Export-Import Bank of India 1,131 % due 21.08.2022	10.419	10.471	0,20				
SoFi Professional Loan Program LLC 0,436 % due 25.02.2042	149	149	0,00	Export-Import Bank of Korea 0,657 % due 25.06.2022	2.000	2.007	0,04				
0,686 % due 25.07.2039	29	29	0,00	0,868 % due 22.03.2023	1.200	1.210	0,02				
0,786 % due 26.03.2040	159	159	0,00	0,895 % due 01.06.2023	3.000	3.028	0,06				
0,936 % due 25.07.2039	29	29	0,00	1,051 % due 01.11.2022	1.700	1.713	0,03				
1,186 % due 27.10.2036	236	237	0,01	Industrial Bank of Korea 0,588 % due 23.10.2022	8.400	8.440	0,16				
1,386 % due 25.02.2040	167	168	0,00	Korea Development Bank 0,475 % due 18.02.2023	9.700	9.722	0,18				
1,836 % due 25.08.2036	190	191	0,00	0,606 % due 01.10.2022	400	401	0,01				
2,360 % due 27.12.2032	66	66	0,00	0,829 % due 27.02.2022	1.000	1.002	0,02				
2,650 % due 25.09.2040	630	642	0,01	0,863 % due 06.07.2022	4.150	4.169	0,08				
2,740 % due 25.05.2040	567	575	0,01	0,929 % due 30.10.2022	3.900	3.927	0,07				
Towd Point Mortgage Trust 0,686 % due 25.02.2057	62	62	0,00	1,576 % due 16.04.2023	2.975	3.034	0,06				
2,750 % due 25.06.2057	5.576	5.707	0,11	Korea Expressway Corp. 0,729 % due 25.11.2022	18.800	18.831	0,36				
Tralee CLO Ltd. 1,244 % due 20.10.2028	1.496	1.497	0,03	3,625 % due 22.10.2021	1.100	1.102	0,02				
Utah State Board of Regents 0,836 % due 25.09.2056	2.829	2.832	0,05	Korea National Oil Corp. 1,001 % due 16.07.2023	1.400	1.414	0,03				
0,836 % due 25.01.2057	1.787	1.782	0,03								
Venture CLO Ltd. 1,006 % due 15.07.2027	2.283	2.283	0,04								
1,115 % due 07.09.2030	5.000	4.996	0,10								
1,184 % due 20.07.2030	25.900	25.885	0,49								

## PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Leihzins	Abrechnungs- datum	Fälligkeitsdatum	Kapitalbetrag	Besichert durch	(Erhaltene) Sicherheiten	Pensions- geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions- geschäften <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
BPS	0,030 %	30.09.2021	01.10.2021	\$ 25.400	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % due 15.01.2030	\$ (25.968)	\$ 25.400	\$ 25.400	0,49
BSN	0,030	30.09.2021	01.10.2021	90.300	U.S. Treasury Bonds 3,000 % due 15.11.2044	(92.201)	90.300	90.300	1,72
FICC	0,000	30.09.2021	01.10.2021	2.572	U.S. Treasury Notes 0,875 % due 30.09.2026	(2.624)	2.572	2.572	0,05
Pensionsgeschäfte insgesamt						\$ (120.793)	\$ 118.272	\$ 118.272	2,26

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

## DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Ein Saldo von null kann auf die Rundung der tatsächlichen Beträge auf weniger als 1.000 zurückzuführen sein.

## ABSICHERUNG DURCH DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. September 2021 hatte die (abgesicherte) thesaurierende GBP-Klasse die folgenden ausstehenden Devisenterminkontrakte:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu liefernde Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierter Wertzuwachs	Nicht realisierter (Wertverlust)	Nicht realisierter Nettoerlöswachst/ (Wertverlust)	% des Nettovermögens
BRC	10/2021	£	267	\$	360	\$ 0	0,00
	10/2021	\$	349	£	255	0	0,00
	11/2021		360		267	0	0,00
HUS	10/2021		348		253	0	0,00
	10/2021		350		254	0	0,00
SCX	10/2021		350		254	0	0,00
						\$ 0	0,00

Derivative OTC-Finanzinstrumente insgesamt

Anlagen insgesamt

Sonstige kurzfristige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten

Nettovermögen

\$ (20) 0,00

\$ 5.320.842 101,51

\$ (78.881) (1,51)

\$ 5.241.961 100,00

**ANGABEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Beträge in Tsd.\*):**

\* Ein Saldo von null kann auf die Rundung der tatsächlichen Beträge auf weniger als 1.000 zurückzuführen sein.

(a) Das Wertpapier ist ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.

(b) „When-issued“-Wertpapier.

(c) Nullkupon-Papier.

(d) Kupon stellt eine Rendite bis Fälligkeit dar.

(e) Eingeschränkte Wertpapiere:

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeitsdatum	Kaufdatum	Kosten	Beizulegender Zeitwert	% des Nettovermögens
Citigroup, Inc.	0,719 %*	01.05.2025	27.04.2021	\$ 8.500	\$ 8.581	0,16

**Bewertung zum beizulegenden Zeitwert<sup>(1)</sup>**

Die folgende Darstellung ist eine Zusammenfassung der Zeitwertbewertung gemäß den zum 30. September 2021 für die Bewertung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten der Fonds verwendeten Parametern:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Preise für identische Anlagen (Ebene 1)	Sonstige wesentliche beobachtbare Parameter (Ebene 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Parameter (Ebene 3)	Beizulegender Zeitwert
Wertpapiere	\$ 0	\$ 5.192.226	\$ 10.364	\$ 5.202.590
Pensionsgeschäfte	0	118.272	0	118.272
Derivative Finanzinstrumente <sup>(3)</sup>	0	(20)	0	(20)
<b>Gesamt</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 5.310.478</b>	<b>\$ 10.364</b>	<b>\$ 5.320.842</b>

Die folgende Darstellung ist eine Zusammenfassung der Zeitwertbewertung gemäß den zum 31. März 2021 für die Bewertung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten der Fonds verwendeten Parametern:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Preise für identische Anlagen (Ebene 1)	Sonstige wesentliche beobachtbare Parameter (Ebene 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Parameter (Ebene 3)	Beizulegender Zeitwert
Wertpapiere	\$ 13.185	\$ 4.405.567	\$ 0	\$ 4.418.752
Pensionsgeschäfte	0	17.377	0	17.377
Derivative Finanzinstrumente <sup>(3)</sup>	0	(20)	0	(20)
<b>Gesamt</b>	<b>\$ 13.185</b>	<b>\$ 4.422.924</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 4.436.109</b>

<sup>(1)</sup> Siehe Anmerkung 3 in den Anmerkungen zum Abschluss für weitere Informationen.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

<sup>(3)</sup> Derivative Finanzinstrumente umfassen ggf. offene Futures, Swap-Vereinbarungen, verkaufte Optionen, gekaufte Optionen und Devisenterminkontrakte.

**(Erhaltene) / verpfändete Sicherheiten für derivative OTC-Finanzinstrumente**

Die folgende Tabelle ist eine Zusammenfassung des beizulegenden Zeitwerts der derivativen OTC-Finanzinstrumente und (erhaltenen)/verpfändeten Sicherheiten zum 30. September 2021:

Kontrahent	Beizulegender Zeitwert von OTC-Derivaten insgesamt	(Erhaltene) / verpfändete Sicherheiten	Nettoengagement <sup>(1)</sup>
BRC	\$ (6)	\$ 0	\$ (6)
HUS	(7)	0	(7)
SCX	(7)	0	(7)

<sup>(1)</sup> Das Netto-Engagement stellt die Nettoforderung/(-verbindlichkeit) dar, die bei einem Ausfall vom bzw. an den Kontrahenten zu zahlen wäre.

**Vergleichsangaben**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. September 2021:

	30. Sept. 2021 (%)	31. März 2021 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene Wertpapiere	47,35	45,61
An einem anderen geregelten Markt gehandelte Wertpapiere*	50,71	54,61
Sonstige Wertpapiere	1,19	0,82
Pensionsgeschäfte	2,26	0,40
Derivative OTC-Finanzinstrumente	0,00	0,00

\* Gemäß der in Anhang 2 des Verkaufsprospekt angegebenen Liste von Märkten, die die OGAW-Kriterien für geregelte Märkte erfüllen.



Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. September 2021 auf die folgenden Segmente:

<b>Anlagen zum beizulegenden Zeitwert</b>	<b>30. Sept. 2021 (%)</b>	<b>31. März 2021 (%)</b>
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen	60,64	62,87
Kommunalanleihen und Schuldverschreibungen	0,23	0,27
Emissionen von US-Behörden	16,76	17,36
Non-Agency Mortgage-Backed Securities	4,22	2,95
Forderungsbesicherte Wertpapiere	4,52	5,66
Staatsanleihen	7,65	2,30
Kurzfristige Instrumente	5,23	9,63
Pensionsgeschäfte	2,26	0,40
Derivative OTC-Finanzinstrumente		
Absicherung durch Devisenterminkontrakte	0,00	0,00
Sonstige kurzfristige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	(1,51)	(1,44)
<b>Nettovermögen</b>	<b>100,00</b>	<b>100,00</b>

## Aufstellung des Wertpapierbestands PIMCO US Low Duration Corporate Bond UCITS ETF

BESCHREIBUNG WERTPAPIERE	NENN- WERT (in Tsd.)	BEIZULE- GENDER ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	NENN- WERT (in Tsd.)	BEIZULE- GENDER ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	NENN- WERT (in Tsd.)	BEIZULE- GENDER ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO VERMÖ- GENS
<b>AUSTRALIEN</b> UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN				<b>DÄNEMARK</b> UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN				<b>LIBERIA</b> UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN			
Pacific National Finance Pty. Ltd. 6,000 % due 07.04.2023	\$ 500	\$ 533	0,54	AP Moller - Maersk A/S 3,750 % due 22.09.2024	\$ 1.800	\$ 1.936	1,95	Nomura Holdings, Inc. 2,648 % due 16.01.2025	\$ 300	\$ 313	0,32
Sydney Airport Finance Co. Pty. Ltd. 3,375 % due 30.04.2025	200	212	0,21	<b>FRANKREICH</b> UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN				ORIX Corp. 2,900 % due 18.07.2022	300	306	0,31
Woodside Finance Ltd. 3,650 % due 05.03.2025	300	319	0,32	BPCE S.A. 1,652 % due 06.10.2026	250	250	0,25	Panasonic Corp. 2,536 % due 19.07.2022	900	913	0,92
Australien insgesamt		1.064	1,07	Danone S.A. 2,077 % due 02.11.2021	300	300	0,30	Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc. 1,474 % due 08.07.2025	300	303	0,30
<b>BERMUDA</b> UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN				<b>DEUTSCHLAND</b> UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN				<b>LUXEMBURG</b> UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN			
IHS Markit Ltd. 4,000 % due 01.03.2026	200	221	0,22	Deutsche Bank AG 0,898 % due 28.05.2024 (f)	200	200	0,20	Gazprom Neft OAO Via GPN Capital S.A. 6,000 % due 27.11.2023	300	330	0,33
5,000 % due 01.11.2022	1.500	1.557	1,56	1,447 % due 01.04.2025 (f)	500	503	0,51	Gazprom PJSC Via Gaz Capital S.A. 6,510 % due 07.03.2022	600	615	0,62
Viking Cruises Ltd. 13,000 % due 15.05.2025	100	115	0,12	2,222 % due 18.09.2024	200	205	0,21	Sberbank of Russia Via SB Capital S.A. 6,125 % due 07.02.2022	300	306	0,31
Bermuda insgesamt		1.893	1,90	3,961 % due 26.11.2025	400	433	0,43			6.574	6,61
<b>BRASILIEN</b> UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN				<b>GUERNSEY, KANALINSELN</b> UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN				<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNGEN</b>			
Banco BTG Pactual S.A. 4,500 % due 10.01.2025	300	308	0,31	Doric Nimrod Air Alpha Pass-Through Trust 5,250 % due 30.05.2025	61	62	0,06	Delos Finance SARL 1,882 % due 06.10.2023	35	35	0,04
Itau Unibanco Holding S.A. 2,900 % due 24.01.2023	300	305	0,31	Doric Nimrod Air Finance Alpha Ltd. Pass-Through Trust 5,125 % due 30.11.2024	53	53	0,06	Ortho-Clinical Diagnostics S.A. 3,083 % due 30.06.2025	54	54	0,05
Brasilien insgesamt		613	0,62	Guernsey, Kanalinseln insgesamt		115	0,12			89	0,09
<b>KANADA</b> UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN				<b>INDIEN</b> UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN				<b>MEXIKO</b> UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN			
Bank of Nova Scotia 0,430 % due 31.07.2024	800	802	0,81	Shriram Transport Finance Co. Ltd. 5,100 % due 16.07.2023	200	204	0,20	BBVA Bancamer S.A. 6,750 % due 30.09.2022	300	316	0,32
Enbridge, Inc. 0,625 % due 18.02.2022	400	401	0,40	<b>IRLAND</b> UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN				<b>MULTINATIONAL</b> UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN			
Kanada insgesamt		1.203	1,21	GE Capital International Funding Co. 3,373 % due 15.11.2025	200	217	0,22	American Airlines, Inc. 5,500 % due 20.04.2026	200	210	0,21
<b>KAIMANINSELN</b> UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN				<b>IRLAND</b> UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN				<b>NIEDERLANDE</b> UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN			
Alibaba Group Holding Ltd. 2,800 % due 06.06.2023	\$ 200	207	0,21	Novatek OAO Via Novatek Finance DAC 4,422 % due 13.12.2022	200	208	0,21	British Transco International Finance BV 0,000 % due 04.11.2021 (b)	450	450	0,45
Avolon Holdings Funding Ltd. 2,528 % due 18.11.2027	633	623	0,63	Perrigo Finance Unlimited Co. 3,900 % due 15.12.2024	200	212	0,21	Enel Finance International NV 1,375 % due 12.07.2026	400	398	0,40
Kaisa Group Holdings Ltd. 8,500 % due 30.06.2022	700	607	0,61	Irland insgesamt		637	0,64	LeasePlan Corp. NV 2,875 % due 24.10.2024	400	419	0,42
MGM China Holdings Ltd. 4,750 % due 01.02.2027	300	295	0,30	<b>ITALIEN</b> UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN				Lundin Energy Finance BV 2,000 % due 15.07.2026	400	402	0,41
5,875 % due 15.05.2026	200	204	0,20	Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 2,625 % due 28.04.2025	€ 100	€ 119	0,12	Syngenta Finance NV 4,441 % due 24.04.2023	250	261	0,26
Sands China Ltd. 2,300 % due 08.03.2027	500	484	0,49	UniCredit SpA 6,572 % due 14.01.2022	\$ 500	\$ 508	0,51	4,892 % due 24.04.2025	200	219	0,22
5,125 % due 08.08.2025	1.000	1.078	1,08	Italien insgesamt		627	0,63	Volkswagen Financial Services NV 1,125 % due 18.09.2023	£ 300	£ 406	0,41
Tencent Holdings Ltd. 3,280 % due 11.04.2024	700	739	0,74	<b>JAPAN</b> UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN				Niederlande insgesamt		2.555	2,57
Wynn Macau Ltd. 4,875 % due 01.10.2024	300	292	0,29	Central Japan Railway Co. 3,400 % due 06.09.2023	200	211	0,21	<b>RUSSLAND</b> UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN			
Kaimaninseln insgesamt		4.529	4,55	Central Nippon Expressway Co. Ltd. 2,567 % due 02.11.2021	800	801	0,81	ALROSA Finance S.A. 4,650 % due 09.04.2024	\$ 400	\$ 429	0,43
<b>CHINA</b> UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN				<b>BRASILIEN</b> UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN				<b>SINGAPUR</b> UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN			
Industrial & Commercial Bank of China Ltd. 0,874 % due 21.12.2021	300	300	0,30	Mitsubishi HC Capital, Inc. 3,406 % due 28.02.2022	1.400	1.413	1,42	BOC Aviation Ltd. 2,750 % due 18.09.2022	800	813	0,82
New Metro Global Ltd. 7,500 % due 16.12.2021	200	200	0,20	Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. 0,953 % due 19.07.2025	600	601	0,60	3,500 % due 10.10.2024	400	425	0,42
China insgesamt		500	0,50	Mizuho Financial Group, Inc. 0,964 % due 13.09.2023	700	705	0,71	Singapur insgesamt		1.238	1,24
				2,721 % due 16.07.2023	400	407	0,41				
				Nissan Motor Co. Ltd. 1,940 % due 15.09.2023	€ 500	€ 601	0,60				

BESCHREIBUNG	NENN- WERT (in Tsd.)	BEIZULE- GENDER ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	NENN- WERT (in Tsd.)	BEIZULE- GENDER ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	NENN- WERT (in Tsd.)	BEIZULE- GENDER ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO VERMÖ- GENS
<b>SÜDKOREA</b>				<b>SÜDKOREA</b>				<b>SÜDKOREA</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN</b>			
NongHyup Bank 0,875 % due 28.07.2024	\$ 300	\$ 301	0,30	BMW U.S. Capital LLC 1,250 % due 12.08.2026	\$ 200	\$ 200	0,20	0,875 % due 14.06.2024	\$ 100	\$ 100	0,10
SK Hynix, Inc. 1,000 % due 19.01.2024	200	199	0,20	Boeing Co. 1,433 % due 04.02.2024	400	401	0,40	1,150 % due 10.11.2022	300	302	0,30
Südkorea insgesamt		500	0,50	British Airways Pass-Through Trust 3,350 % due 15.12.2030	607	611	0,61	1,500 % due 15.06.2026	100	99	0,10
				Brixmor Operating Partnership LP 1,176 % due 01.02.2022	600	601	0,60	2,850 % due 01.11.2022	400	410	0,41
<b>SPANIEN</b>				Broadcom, Inc. 1,950 % due 15.02.2028	200	198	0,20	Infor, Inc. 1,450 % due 15.07.2023	100	101	0,10
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN</b>				Cantor Fitzgerald LP 4,875 % due 01.05.2024	400	436	0,44	International Flavors & Fragrances, Inc. 3,200 % due 01.05.2023	300	311	0,31
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. 0,875 % due 18.09.2023	600	604	0,61	Charles Schwab Corp. 0,550 % due 18.03.2024	400	403	0,41	IPALCO Enterprises, Inc. 3,700 % due 01.09.2024	100	107	0,11
				Cleco Power LLC 0,616 % due 15.06.2023	300	300	0,30	Kinder Morgan, Inc. 1,406 % due 15.01.2023	200	203	0,20
<b>SCHWEIZ</b>				CommonSpirit Health 2,760 % due 01.10.2024	300	316	0,32	Kraft Heinz Foods Co. 0,948 % due 10.08.2022	400	400	0,40
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN</b>				Community Health Systems, Inc. 6,625 % due 15.02.2025	100	105	0,11	Lennar Corp. 4,500 % due 30.04.2024	300	325	0,33
Credit Suisse AG 0,430 % due 09.08.2023	500	502	0,50	Continental Airlines Pass-Through Trust 5,983 % due 19.10.2023	179	182	0,18	Marvell Technology, Inc. 1,650 % due 15.04.2026	400	401	0,40
6,500 % due 08.08.2023 (d)	500	548	0,55	DAE Funding LLC 1,625 % due 15.02.2024	600	597	0,60	Metroplitan Edison Co. 3,500 % due 15.03.2023	400	413	0,42
UBS AG 5,125 % due 15.05.2024 (d)	300	328	0,33	2,625 % due 20.03.2025	200	204	0,21	Metroplitan Life Global Funding 0,700 % due 27.09.2024	600	601	0,60
7,625 % due 17.08.2022 (d)	700	742	0,75	2,375 % due 20.03.2028	200	207	0,21	Mid-America Apartments LP 1,100 % due 15.09.2026	200	197	0,20
UBS Group AG 1,351 % due 23.05.2023	500	504	0,51	Daimler Finance North America LLC 1,025 % due 15.02.2022	400	401	0,40	Midwest Connector Capital Co. LLC 3,625 % due 01.04.2022	200	202	0,20
Schweiz insgesamt		2.624	2,64	2,850 % due 06.01.2021	700	705	0,71	3,900 % due 15.04.2024	200	209	0,21
				3,750 % due 05.11.2022	529	531	0,53	Monongahela Power Co. 4,100 % due 15.04.2024	100	107	0,11
<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH</b>				Dell International LLC 4,900 % due 01.10.2026	250	288	0,29	Morgan Stanley 0,731 % due 05.04.2024	500	502	0,51
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN</b>				5,850 % due 15.07.2025	200	233	0,23	National Fuel Gas Co. 5,500 % due 15.01.2026	400	461	0,46
Barclays Bank PLC 7,625 % due 21.11.2022 (d)	244	262	0,26	Delta Air Lines, Inc. 2,900 % due 28.10.2024	200	205	0,21	NetApp, Inc. 3,250 % due 15.12.2022	500	510	0,51
Barclays PLC 4,338 % due 16.05.2024	400	424	0,43	7,000 % due 01.05.2025	117	136	0,14	Nissan Motor Acceptance Co. LLC 0,822 % due 28.09.2022	1.250	1.253	1,26
BAT International Finance PLC 1,668 % due 25.03.2026	500	500	0,50	7,375 % due 15.01.2026	166	196	0,20	2,650 % due 13.07.2022	400	406	0,41
Chanel Ceres PLC 0,500 % due 31.07.2026	€ 200	234	0,24	Devon Energy Corp. 5,250 % due 15.09.2024	50	55	0,06	ONE Gas, Inc. 0,850 % due 11.03.2023	200	200	0,20
Lloyds Banking Group PLC 4,050 % due 16.08.2023	\$ 200	213	0,21	Diamondback Energy, Inc. 0,900 % due 24.03.2023	400	400	0,40	ONEOK Partners LP 5,000 % due 15.09.2023	450	482	0,49
LSEGA Financing PLC 1,375 % due 06.04.2026	200	200	0,20	Edison International 3,125 % due 15.11.2022	200	205	0,21	Oracle Corp. 1,650 % due 25.03.2026 (f)	600	609	0,61
Nationwide Building Society 3,622 % due 26.04.2023	696	708	0,71	Enact Holdings, Inc. 6,500 % due 15.08.2025	300	328	0,33	Pacific Gas & Electric Co. 3,750 % due 15.02.2024 ^	300	313	0,32
Santander UK Group Holdings PLC 1,532 % due 21.08.2026	500	499	0,50	Energy Transfer LP 4,250 % due 15.03.2023	100	104	0,11	4,250 % due 01.08.2023	400	419	0,42
Santander UK PLC 0,785 % due 15.11.2021	500	500	0,50	Expedia Group, Inc. 6,250 % due 01.05.2025	310	358	0,36	Pacific Life Global Funding 1,375 % due 14.04.2026	300	301	0,30
Standard Chartered PLC 1,300 % due 14.10.2023	300	303	0,31	Fidelity National Financial, Inc. 5,500 % due 01.09.2022	200	209	0,21	Penske Truck Leasing Co. LP 4,875 % due 11.07.2022	117	121	0,12
Vereinigtes Königreich insgesamt		3.843	3,86	FMR LLC 5,350 % due 15.11.2021	250	251	0,25	Principal Life Global Funding 1,250 % due 16.08.2026	300	298	0,30
				Ford Motor Credit Co. LLC 1,402 % due 28.03.2022	200	200	0,20	Protective Life Global Funding 1,170 % due 15.07.2025	600	600	0,60
<b>USA</b>				3,550 % due 07.10.2022	700	714	0,72	Quanta Services, Inc. 0,950 % due 01.10.2024	200	200	0,20
<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>				Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC 6,500 % due 01.10.2025	200	206	0,21	Reliance Standard Life Global Funding 2,150 % due 21.01.2023	400	409	0,41
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN</b>				Fresenius Medical Care U.S. Finance, Inc. 1,875 % due 01.12.2026	200	201	0,20	Rockies Express Pipeline LLC 3,600 % due 15.05.2025	200	207	0,21
Alliant Energy Finance LLC 1,400 % due 15.03.2026	300	296	0,30	GA Global Funding Trust 1,000 % due 08.04.2024	200	201	0,20	Santander Holdings USA, Inc. 3,244 % due 05.10.2026	700	748	0,75
Ally Financial, Inc. 1,450 % due 02.10.2023	400	406	0,41	GLP Capital LP 3,350 % due 01.09.2024	400	422	0,42	SBA Tower Trust 1,631 % due 15.05.2051	300	300	0,30
American Airlines Pass-Through Trust 3,150 % due 15.08.2033	276	279	0,28	Golub Capital BDC, Inc. 2,500 % due 24.08.2026	800	806	0,81	Sealed Air Corp. 1,573 % due 15.10.2026	400	398	0,40
Athene Global Funding 2,500 % due 14.01.2025	400	416	0,42	Hasbro, Inc. 3,550 % due 19.11.2026	200	218	0,22	Service Properties Trust 4,350 % due 01.10.2024	100	101	0,10
Atmos Energy Corp. 0,625 % due 09.03.2023	200	200	0,20	HollyFrontier Corp. 2,625 % due 01.10.2023	300	310	0,31	Skyworks Solutions, Inc. 0,900 % due 01.06.2023	200	200	0,20
Aviation Capital Group LLC 3,875 % due 01.05.2023	500	522	0,53	Hyatt Hotels Corp. 1,300 % due 01.10.2023 (a)	100	100	0,10	SLM Corp. 5,125 % due 05.04.2022	100	102	0,10
Bank of America Corp. 1,319 % due 19.06.2026	1.700	1.700	1,71	3,120 % due 01.09.2022	200	200	0,20	Southern California Edison Co. 1,200 % due 01.02.2026	300	298	0,30
Bank of America Corp. 1,319 % due 19.06.2026	1.700	1.700	1,71	Hyundai Capital America 0,800 % due 03.04.2023	100	100	0,10				
Bayer U.S. Finance LLC 1,126 % due 15.12.2023	450	456	0,46								
Berry Global, Inc. 0,950 % due 15.02.2024	300	301	0,30								

## Aufstellung des Wertpapierbestands PIMCO US Low Duration Corporate Bond UCITS ETF (Fortsetzung)

BESCHREIBUNG	NENN- WERT (in Tsd.)	BEIZULE- GENDER ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	NENN- WERT (in Tsd.)	BEIZULE- GENDER ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	NENN- WERT (in Tsd.)	BEIZULE- GENDER ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
Southwest Airlines Co. Pass-Through Trust 6,650 % due 01.08.2022	\$ 70	\$ 71	0,07	Vistra Operations Co. LLC 3,550 % due 15.07.2024	\$ 550	\$ 579	0,58	1,500 % due 31.10.2024	\$ 1.820	\$ 1.874	1,89
Spirit AeroSystems, Inc. 7,500 % due 15.04.2025	200	212	0,21	VMware, Inc. 0,600 % due 15.08.2023	200	200	0,20	2,125 % due 31.07.2024	2.065	2.161	2,17
Spirit Airlines Pass-Through Trust 3,650 % due 15.08.2031	300	296	0,30	4,500 % due 15.05.2025	300	334	0,34	2,250 % due 15.11.2024	851	896	0,90
4,100 % due 01.10.2029	120	126	0,13	Westinghouse Air Brake Technologies Corp. 3,200 % due 15.06.2025	1.100	1.168	1,18				
Sprint Corp. 7,625 % due 15.02.2025	300	351	0,35	WP Carey, Inc. 4,600 % due 01.04.2024	400	434	0,44	Vereinigte Staaten insgesamt		51.517	51,80
Steel Dynamics, Inc. 2,800 % due 15.12.2024	200	211	0,21			37.474	37,68				
SYNNEX Corp. 1,250 % due 09.08.2024	500	500	0,50	<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNGEN</b>				<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>			
Systems Energy Resources, Inc. 2,140 % due 09.12.2025	250	254	0,26	RPI Intermediate Finance Trust 1,834 % due 11.02.2027	8	7	0,01	<b>KURZFRISTIGE SCHULDITITEL</b>			
Trans-Allegheny Interstate Line Co. 3,850 % due 01.06.2025	300	323	0,33	<b>EMISSIONEN VON US-BEHÖRDEN</b>				Federal Home Loan Bank 0,040 % due 22.10.2021 (b)(c)	1.700	1.700	1,71
U.S. Airways Pass-Through Trust 3,950 % due 15.05.2027	57	58	0,06	Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % due 01.10.2051	200	206	0,21	Pacific Gas and Electric Co. 1,500 % due 15.11.2021	1.200	1.201	1,21
United Airlines, Inc. 4,375 % due 15.04.2026	200	205	0,21	3,500 % due 01.11.2051	1.910	2.023	2,03	Southern California Edison Co. 0,389 % due 03.12.2021	900	900	0,90
Valero Energy Corp. 1,200 % due 15.03.2024	200	202	0,20			2.229	2,24				
Verizon Communications, Inc. 0,840 % due 20.03.2026	150	153	0,15	<b>US-TREASURY-OBLIGATIONEN</b>				<b>U.S. TREASURY BILLS</b>			
2,355 % due 15.03.2032	201	199	0,20	U.S. Treasury Notes 0,250 % due 15.05.2024	3.800	3.782	3,80	0,044 % due 25.01.2022 (b)(c)	3.000	3.000	3,02
				0,250 % due 31.05.2025	500	492	0,50	0,046 % due 04.01.2022 (b)(c)	1.500	1.500	1,51
				0,750 % due 31.05.2026	2.600	2.578	2,59	0,046 % due 24.03.2022 (b)(c)	2.300	2.299	2,31
										6.799	6,84
								Kurzfristige Instrumente insgesamt		10.600	10,66
								<b>Wertpapiere insgesamt</b>		\$ 99.029	99,57

### PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Leihzins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kapitalbetrag	Besichert durch	(Erhaltene) Sicherheiten	Pensionsgeschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions- geschäften <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
SSB	0,000 %*	30.09.2021	01.10.2021	\$ 574	U.S. Treasury Notes 1,875 % due 30.06.2026	\$ (586)	\$ 574	\$ 574	0,58
<b>Pensionsgeschäfte insgesamt</b>						<b>\$ (586)</b>	<b>\$ 574</b>	<b>\$ 574</b>	<b>0,58</b>

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

### AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE DERIVATIVE FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Ein Saldo von null kann auf die Rundung der tatsächlichen Beträge auf weniger als 1.000 zurückzuführen sein.

#### FUTURES

Beschreibung	Typ	Verfallsmonat	# der Kontrakte	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)	% des Nettovermögens
Euro-Bobl December Futures	Short	12/2021	33	\$ 34	0,03
Euro-BTP Italy Government Bond December Futures	Long	12/2021	1	(2)	0,00
Euro-Bund 10-Year Bond December Futures	Long	12/2021	5	(16)	(0,02)
U.S. Treasury 2-Year Note December Futures	Long	12/2021	40	(4)	0,00
U.S. Treasury 5-Year Note December Futures	Long	12/2021	116	(86)	(0,09)
U.S. Treasury 10-Year Note December Futures	Short	12/2021	30	55	0,06
<b>An einem geregelten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente insgesamt</b>				<b>\$ (19)</b>	<b>(0,02)</b>

### ZENTRAL ABGEWICKELTE DERIVATIVE FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*)

\* Ein Saldo von null kann auf die Rundung der tatsächlichen Beträge auf weniger als 1.000 zurückzuführen sein.

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF EMISSIONEN VON UNTERNEHMEN, STAATEN UND US-KOMMUNEN - SCHUTZKAUF<sup>(1)</sup>

Referenzinheit	Zu (zahlender) Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nominalbetrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)	% des Nettovermögens
Kraft Heinz Foods Co.	(1,000) %	20.06.2022	\$ 400	\$ 1	0,00
Newell Brands, Inc.	(1,000)	20.06.2023	300	1	0,00
				<b>\$ 2</b>	<b>0,00</b>

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF EMISSIONEN VON UNTERNEHMEN, STAATEN UND US-KOMMUNEN - ALS SICHERUNGSGEBER<sup>(1)</sup>

Referenzinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nominalbetrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)	% des Nettovermögens
Atlantia SpA	1,000 %	20.12.2025	€ 100	\$ 1	0,00
Boeing Co.	1,000	20.12.2021	\$ 300	0	0,00
Boeing Co.	1,000	20.12.2022	200	0	0,00
Boeing Co.	1,000	20.06.2023	200	1	0,00
Energy Transfer Operating LP	1,000	20.12.2025	300	0	0,00
Ford Motor Co.	5,000	20.06.2022	100	(1)	0,00
General Electric Co.	1,000	20.06.2026	1.000	5	0,01
General Electric Co.	1,000	20.12.2026	100	0	0,00
NextEra Energy Capital Holdings, Inc.	1,000	20.06.2026	100	1	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20.06.2026	€ 600	24	0,02
Vodafone Group PLC	1,000	20.06.2024	200	0	0,00
				\$ 31	0,03

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - ALS SICHERUNGSGEBER<sup>(1)</sup>

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nominalbetrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)	% des Nettovermögens
CDX.IG-37 5-Year Index	1,000 %	20.12.2026	\$ 500	\$ 0	0,00

## ZINSSWAPS

Zu zahlen/zu erhalten	Zinsvariabler Index	Festzins	Fälligkeitsdatum	Nominalbetrag	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)	% des Nettovermögens
Zu erhalten <sup>(4)</sup>	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,500 %	16.03.2027	£ 2.400	\$ 42	0,04
Zu zahlen	1-Year BRL-CDI	6,789	02.01.2023	BRL 18.400	(64)	(0,06)
Zu zahlen	1-Year BRL-CDI	7,900	02.01.2024	2.600	(14)	(0,01)
Zu zahlen	3-Month CAD-Bank Bill	1,000	16.06.2026	CAD 1.100	(1)	0,00
Zu zahlen	3-Month CAD-Bank Bill	1,220	03.03.2025	800	(3)	0,00
Zu zahlen	3-Month CAD-Bank Bill	1,235	04.03.2025	500	(2)	0,00
Zu erhalten <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	0,360	22.08.2024	\$ 500	1	0,00
Zu erhalten <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	1,250	15.12.2026	400	3	0,00
Zu erhalten	3-Month USD-LIBOR	1,470	24.03.2030	200	(1)	0,00
Zu erhalten	3-Month USD-LIBOR	2,000	18.03.2030	800	(3)	0,00
Zu zahlen	3-Month ZAR-JIBAR	5,680	08.06.2026	ZAR 11.800	(13)	(0,01)
Zu zahlen	3-Month ZAR-JIBAR	5,723	08.06.2026	10.100	(10)	(0,01)
Zu zahlen	28-Day MXN-TIIE	5,345	13.06.2023	MXN 5.300	(4)	(0,01)
Zu zahlen	28-Day MXN-TIIE	5,400	05.03.2026	21.400	(29)	(0,03)
Zu zahlen	28-Day MXN-TIIE	5,925	05.05.2026	3.100	(5)	(0,01)
Zu zahlen	28-Day MXN-TIIE	6,015	03.06.2026	4.500	(9)	(0,01)
Zu zahlen	28-Day MXN-TIIE	6,113	11.05.2026	1.590	(2)	0,00
					\$ (114)	(0,11)
					\$ (81)	(0,08)

Zentral abgewickelte derivative Finanzinstrumente insgesamt

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Fonds entweder (i) vom Sicherungsgeber einen Betrag in Höhe des Nennwerts des Swaps und liefert die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er erhält einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(3)</sup> Der Maximalbetrag, der vom Fonds bei einem Kreditereignis nach Maßgabe der betreffenden Swap-Vereinbarung als Sicherungsgeber potenziell gefordert oder als Sicherungsnehmer potenziell vereinnahmt werden kann.

<sup>(4)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

## DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Ein Saldo von null kann auf die Rundung der tatsächlichen Beträge auf weniger als 1.000 zurückzuführen sein.

## VERKAUFTE OPTIONEN

## CREDIT DEFAULT SWAPPTIONS AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/-verkauf	Ausübungssatz	Verfallsdatum	Nominalbetrag <sup>(1)</sup>	Prämie	Beizulegender Zeitwert	% des Nettovermögens
BOA	Put - OTC CDX.HY-36 5-Year Index	Verkauf	102.000 %	17.11.2021	100	\$ (1)	\$ 0	0,00
	Put - OTC CDX.HY-36 5-Year Index	Verkauf	103.000	17.11.2021	100	(1)	0	0,00
	Put - OTC CDX.HY-37 5-Year Index	Verkauf	101.000	19.01.2022	300	(1)	(2)	(0,01)
	Put - OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,700	17.11.2021	200	0	0	0,00
BPS	Put - OTC CDX.HY-36 5-Year Index	Verkauf	101.000	20.10.2021	100	0	0	0,00
	Put - OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,750	17.11.2021	300	0	0	0,00

## Aufstellung des Wertpapierbestands PIMCO US Low Duration Corporate Bond UCITS ETF (Fortsetzung)

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/ -verkauf	Ausübungssatz	Verfallsdatum	Nominalbetrag <sup>(1)</sup>	Prämie	Beizulegender Zeitwert	% des Nettvermögens
	Put - OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,750 %	15.12.2021	200	\$ 0	\$ 0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.11.2021	400	(1)	0	0,00
BRC	Put - OTC CDX.IG-37 5-Year Index	Verkauf	0,850	19.01.2022	300	0	(1)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,850	20.10.2021	680	(1)	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	3,500	20.10.2021	100	(1)	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	3,750	20.10.2021	100	(1)	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.11.2021	200	0	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	3,500	17.11.2021	100	(1)	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,700	15.12.2021	400	(1)	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 36 5-Year Index	Verkauf	0,750	19.01.2022	200	0	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 36 5-Year Index	Verkauf	3,750	19.01.2022	100	(1)	(1)	0,00
CBK	Put - OTC CDX.HY-36 5-Year Index	Verkauf	101,000	20.10.2021	100	0	0	0,00
DUB	Put - OTC CDX.HY-36 5-Year Index	Verkauf	101,000	17.11.2021	200	(1)	0	0,00
	Put - OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,750	15.12.2021	300	0	0	0,00
	Put - OTC CDX.IG-37 5-Year Index	Verkauf	0,800	19.01.2022	300	0	(1)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.11.2021	400	0	0	0,00
FBF	Put - OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	15.12.2021	100	0	0	0,00
GST	Put - OTC CDX.HY-36 5-Year Index	Verkauf	103,000	20.10.2021	200	(1)	0	0,00
	Put - OTC CDX.HY-36 5-Year Index	Verkauf	102,000	17.11.2021	400	(2)	(1)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,750	20.10.2021	100	0	0	0,00
	Put - OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	20.10.2021	300	0	0	0,00
	Put - OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,900	17.11.2021	200	0	0	0,00
	Put - OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	15.12.2021	200	0	0	0,00
JPM	Put - OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,850	20.10.2021	200	0	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,750	17.11.2021	200	0	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,700	15.12.2021	200	0	0	0,00
MYC	Put - OTC CDX.HY-36 5-Year Index	Verkauf	100,000	17.11.2021	400	(2)	(1)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,750	17.11.2021	500	(1)	0	0,00
	Put - OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,750	15.12.2021	500	(1)	0	0,00
	Put - OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	15.12.2021	200	0	0	0,00
	Put - OTC CDX.IG-37 5-Year Index	Verkauf	0,800	19.01.2022	700	(1)	(1)	0,00
						\$ (19)	\$ (8)	(0,01)

### WÄHRUNGSOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- preis	Verfallsdatum	Nominalbetrag <sup>(1)</sup>	Prämie	Beizulegender Zeitwert	% des Nettvermögens
CBK	Put - OTC EUR versus CHF	CHF 1,067	01.12.2021	48	\$ 0	\$ 0	0,00
	Call - OTC EUR versus CHF	1,100	01.12.2021	48	1	0	0,00
UAG	Put - OTC EUR versus CHF	1,070	29.10.2021	182	(1)	(1)	0,00
	Call - OTC EUR versus CHF	1,098	29.10.2021	182	(1)	0	0,00
					\$ (1)	\$ (1)	0,00

### ZINS-SWAPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Zinsvariabler Index	Zu zahlen/zu erhalten variabler Zins	Ausübungssatz	Verfallsdatum	Nominalbetrag <sup>(1)</sup>	Prämie	Beizulegender Zeitwert	% des Nettvermögens
BPS	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zu erhalten	0,010 %	29.10.2021	600	\$ 0	\$ 0	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zu zahlen	0,012	29.10.2021	600	(1)	(1)	0,00
							\$ (1)	\$ (1)	0,00

### OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungspreis	Verfallsdatum	Nominalbetrag <sup>(1)</sup>	Prämie	Beizulegender Zeitwert	% des Nettvermögens
JPM	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % due 01.10.2051	101,188\$	07.10.2021	300	\$ (2)	\$ 0	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % due 01.11.2051	101,336	03.11.2021	100	0	0	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % due 01.11.2051	101,473	03.11.2021	600	(2)	(1)	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % due 01.10.2051	103,734	07.10.2021	100	0	0	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % due 01.10.2051	103,766	07.10.2021	100	0	0	0,00
SAL	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % due 01.10.2051	101,000	03.11.2021	150	(1)	0	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % due 01.11.2051	101,000	03.11.2021	150	(1)	0	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % due 01.11.2051	101,508	03.11.2021	1.200	(4)	(1)	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % due 01.10.2051	103,977	07.10.2021	300	(1)	0	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % due 01.11.2051	103,070	12.11.2021	300	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,000 % due 01.10.2051	103,719	14.10.2021	1.000	(1)	0	0,00
					\$ (12)	\$ (3)	0,00

<sup>(1)</sup> Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF EMISSIONEN VON UNTERNEHMEN, STAATEN UND US-KOMMUNEN - ALS SICHERUNGSGEBER<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nominalbetrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte / (erhaltene) Prämien	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)	Beizulegender Zeitwert	% des Nettvermögens
BOA	Brazil Government International Bond	1,000 %	20.06.2026	\$ 200	\$ (8)	\$ (1)	\$ (9)	(0,01)
BRC	Petroleos Mexicanos	1,000	20.06.2022	100	(4)	4	0	0,00
	Springleaf Finance Corp.	5,000	20.06.2022	100	9	(5)	4	0,00
GST	Petroleos Mexicanos	1,000	20.06.2022	200	(8)	8	0	0,00
HUS	Petrobras Global Finance BV	1,000	20.06.2022	100	(9)	9	0	0,00
					\$ (20)	\$ 15	\$ (5)	(0,01)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - ALS SICHERUNGSGEBER<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Index/Tranchen	Zu erhaltender Festszinssatz	Fälligkeitsdatum	Nominalbetrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte / (erhaltene) Prämien	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)	Beizulegender Zeitwert	% des Nettovermögens
FBF	CMBX.NA.AAA.8 Index	0,500 %*	17.10.2057	\$ 100	\$ (5)	\$ 6	\$ 1	0,00

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Der Maximalbetrag, der vom Fonds bei einem Kreditereignis nach Maßgabe der betreffenden Swap-Vereinbarung als Sicherungsgeber potenziell gefordert oder als Sicherungsnehmer potenziell vereinnahmt werden kann.

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu liefernde Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierter Wertzuwachs	Nicht realisierter (Wertverlust)	Nicht realisierter Nettowertzuwachs/ (Wertverlust)	% des Nettovermögens
BOA	11/2021	\$ 24	RUB 1.773	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	12/2021	38	2.829	0	0	0	0,00
BPS	10/2021	41	CLP 32.202	0	(1)	(1)	0,00
	11/2021	CAD 784	\$ 626	8	0	8	0,01
BRC	11/2021	648	32	1	0	1	0,00
	11/2021	\$ 27	RUB 2.008	0	0	0	0,00
CBK	10/2021	€ 434	\$ 513	10	0	10	0,01
	10/2021	\$ 312	MXN 6.384	0	(2)	(2)	0,00
FBF	12/2021	25	RUB 1.865	0	0	0	0,00
	11/2021	15	1.114	0	0	0	0,00
GLM	10/2021	BRL 1.736	\$ 324	6	0	6	0,01
	10/2021	\$ 37	RUB 2.775	1	0	1	0,00
HUS	11/2021	323	BRL 1.736	0	(5)	(5)	(0,01)
	11/2021	28	RUB 2.110	0	0	0	0,00
MYI	12/2021	61	4.539	1	0	1	0,00
	10/2021	10	721	0	0	0	0,00
SCX	11/2021	3	213	0	0	0	0,00
	10/2021	329	BRL 1.736	0	(11)	(11)	(0,01)
UAG	10/2021	109	CLP 86.229	0	(3)	(3)	0,00
	10/2021	£ 812	\$ 1.113	19	0	19	0,02
UAG	10/2021	\$ 719	£ 525	0	(12)	(12)	(0,01)
	10/2021	500	¥ 54.900	0	(8)	(8)	(0,01)
UAG	10/2021	48	RUB 3.554	1	0	1	0,00
	12/2021	242	INR 18.162	1	0	1	0,00
UAG	12/2021	13	ZAR 182	0	(1)	(1)	0,00
	10/2021	29	RUB 2.183	1	0	1	0,00
UAG	11/2021	27	2.013	1	0	1	0,00
	12/2021	14	ZAR 200	0	(1)	(1)	0,00
				\$ 50	\$ (44)	\$ 6	0,01

## ABSICHERUNG DURCH DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. September 2021 hatte die (abgesicherte) thesaurierende CHF-Klasse die folgenden ausstehenden Devisenterminkontrakte:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu liefernde Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierter Wertzuwachs	Nicht realisierter (Wertverlust)	Nicht realisierter Nettowertzuwachs/ (Wertverlust)	% des Nettovermögens
BOA	10/2021	CHF 2.578	\$ 2.776	\$ 12	\$ 0	\$ 12	0,01
	10/2021	\$ 2.685	CHF 2.462	0	(47)	(47)	(0,05)
BPS	11/2021	2.778	2.578	0	(12)	(12)	(0,01)
	10/2021	2.701	2.466	0	(57)	(57)	(0,06)
BRC	10/2021	3	3	0	0	0	0,00
CBK	10/2021	2.702	2.465	0	(60)	(60)	(0,06)
				\$ 12	\$ (176)	\$ (164)	(0,17)
<b>Derivative OTC-Finanzinstrumente insgesamt</b>						<b>\$ (175)</b>	<b>(0,18)</b>

## LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	NENNWERT (in Tsd.)	ZEIT-WERT (in Tsd.)	% DES NETTO-VERMÖGENS
<b>EMISSIONEN VON US-BEHÖRDEN</b>			
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA			
2,000 % due 01.11.2051	\$ 100	(100)	(0,10)
2,500 % due 01.10.2051 (e)	200	(206)	(0,21)
2,500 % due 01.11.2051	200	(206)	(0,20)
<b>Leerverkaufte Wertpapiere gesamt</b>		<b>(512)</b>	<b>(0,51)</b>
<b>Anlagen insgesamt</b>		<b>\$ 98.816</b>	<b>99,36</b>
<b>Sonstige kurzfristige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>		<b>\$ 638</b>	<b>0,64</b>
<b>Nettovermögen</b>		<b>\$ 99.454</b>	<b>100,00</b>

ANGABEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Beträge in Tsd.\*):

\* Ein Saldo von null kann auf die Rundung der tatsächlichen Beträge auf weniger als 1.000 zurückzuführen sein.

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) „When-issued“-Wertpapier.

(b) Nullkuponwertpapier.

(c) Kupon stellt eine Rendite bis Fälligkeit dar.

(d) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(e) Bis 30. September 2021 leerverkaufte Wertpapiere werden durch Long-Portfolio-Investitionen in übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente abgedeckt.

(f) Eingeschränkte Wertpapiere:

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeitsdatum	Kaufdatum	Kosten	Beizulegender Zeitwert	% des Nettovermögens
Deutsche Bank AG	0,898 %	28.05.2024	25.05.2021	\$ 200	\$ 200	0,20
Deutsche Bank AG	1,447	01.04.2025	30.03.2021	500	503	0,51
Oracle Corp.	1,650	25.03.2026	22.03.2021	600	609	0,61
				\$ 1.300	\$ 1.312	1,32

Barmittel in Höhe von 1.424\$ waren zum 30. September 2021 als Sicherheiten für börsengehandelte und zentral abgewickelte derivative Finanzinstrumente verpfändet.

Bewertung zum beizulegenden Zeitwert<sup>(1)</sup>

Die folgende Darstellung ist eine Zusammenfassung der Zeitwertbewertung gemäß den zum 30. September 2021 für die Bewertung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten der Fonds verwendeten Parametern:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Preise für identische Anlagen			Beizulegender Zeitwert
	(Ebene 1)	Sonstige wesentliche beobachtbare Parameter (Ebene 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Parameter (Ebene 3)	
Wertpapiere	\$ 0	\$ 99.029	\$ 0	\$ 99.029
Pensionsgeschäfte	0	574	0	574
Derivative Finanzinstrumente <sup>(3)</sup>	16	(291)	0	(275)
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(512)	0	(512)
<b>Gesamt</b>	<b>\$ 16</b>	<b>\$ 98.800</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 98.816</b>

Die folgende Darstellung ist eine Zusammenfassung der Zeitwertbewertung gemäß den zum 31. März 2021 für die Bewertung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten der Fonds verwendeten Parametern:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Preise für identische Anlagen			Beizulegender Zeitwert
	(Ebene 1)	Sonstige wesentliche beobachtbare Parameter (Ebene 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Parameter (Ebene 3)	
Wertpapiere	\$ 0	\$ 104.173	\$ 0	\$ 104.173
Derivative Finanzinstrumente <sup>(3)</sup>	(80)	(317)	0	(397)
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(398)	0	(398)
<b>Gesamt</b>	<b>\$ (80)</b>	<b>\$ 103.458</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 103.378</b>

<sup>(1)</sup> Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

(Erhaltene) / verpfändete Sicherheiten für derivative OTC-Finanzinstrumente

Die folgende Tabelle ist eine Zusammenfassung des beizulegenden Zeitwerts der derivativen OTC-Finanzinstrumente und (erhaltenen)/verpfändeten Sicherheiten zum 30. September 2021:

Kontrahent	Beizulegender Zeitwert von OTC-Derivaten insgesamt	(Erhaltene) / verpfändete Sicherheiten	Nettoengagement <sup>(1)</sup>
BOA	\$ (58)	\$ 0	\$ (58)
BPS	(50)	0	(50)
BRC	2	0	2
CBK	(52)	0	(52)
DUB	(1)	0	(1)
FBF	1	0	1
GLM	3	0	3
GST	(1)	0	(1)
JPM	(1)	0	(1)
MYC	(2)	0	(2)
MYI	(14)	0	(14)
SAL	(2)	0	(2)

<sup>(1)</sup> Das Netto-Engagement stellt die Nettoforderung/(-verbindlichkeit) dar, die bei einem Ausfall vom bzw. an den Kontrahenten zu zahlen wäre.



## Vergleichsangaben

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. September 2021:

	30. Sept. 2021 (%)	31. März 2021 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene Wertpapiere	51,28	50,35
An einem anderen geregelten Markt gehandelte Wertpapiere*	45,28	48,34
Sonstige Wertpapiere	3,01	3,77
Pensionsgeschäfte	0,58	-
An einem geregelten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente	(0,02)	(0,08)
Zentral abgewickelte derivative Finanzinstrumente	(0,08)	0,05
Derivative OTC-Finanzinstrumente	(0,18)	(0,36)
Leerverkaufte Wertpapiere	(0,51)	(0,39)

\* Gemäß der in Anhang 2 des Verkaufsprospekt angegebenen Liste von Märkten, die die OGAW-Kriterien für geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. September 2021 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum beizulegenden Zeitwert	30. Sept. 2021 (%)	31. März 2021 (%)
Australien	1,07	0,74
Bermuda	1,90	2,03
Brasilien	0,62	0,60
Kanada	1,86	1,09
Kaimaninseln	4,55	3,66
China	0,50	0,50
Dänemark	1,95	1,91
Frankreich	1,27	1,24
Deutschland	1,35	0,91
Guernsey, Kanalinseln	0,12	0,14
Indien	0,20	0,20
Irland	0,64	5,24
Italien	0,63	0,51
Japan	6,61	8,69
Liberia	0,11	-
Luxemburg	1,35	1,34
Mauritius	-	0,20
Mexiko	0,32	0,32
Multinational	0,21	-
Niederlande	2,57	2,03
Russland	0,43	0,42
Singapur	1,24	1,22
Südkorea	0,50	0,20
Spanien	0,61	0,59
Schweiz	2,64	2,12
Ukraine	-	0,10
Vereinigtes Königreich	3,86	4,39
USA	51,80	54,39
Kurzfristige Instrumente	10,66	7,68
Pensionsgeschäfte	0,58	-
An einem geregelten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente		
Futures	(0,02)	(0,08)
Verkaufte Optionen		
Optionen auf börsengehandelte Futures-Kontrakte	-	0,00
Zentral abgewickelte derivative Finanzinstrumente		
Credit Default Swaps auf Emissionen von Unternehmen, Staaten und US-Kommunen – Schutzkauf	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Emissionen von Unternehmen, Staaten und US-Kommunen - Als Sicherungsgeber	0,03	0,04
Credit Default Swaps auf Kreditindizes - Als Sicherungsgeber	0,00	-
Zinsswaps	(0,11)	0,01
Derivative OTC-Finanzinstrumente		
Verkaufte Optionen		
Credit Default Swaptions auf Kreditindizes	(0,01)	(0,01)
Devisenoptionen	0,00	-
Zins-Swaptions	0,00	-
Optionen auf Wertpapiere	0,00	(0,04)
Credit Default Swaps auf Emissionen von Unternehmen, Staaten und US-Kommunen - Als Sicherungsgeber	(0,01)	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes - Als Sicherungsgeber	0,00	0,00
Devisenterminkontrakte	0,01	0,01
Absicherung durch Devisenterminkontrakte	(0,17)	(0,32)
Leerverkaufte Wertpapiere	(0,51)	(0,39)
Sonstige kurzfristige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	0,64	(1,68)
Nettovermögen	100,00	100,00

## Aufstellung des Wertpapierbestands PIMCO US Short-Term High Yield Corporate Bond Index UCITS ETF

BESCHREIBUNG WERTPAPIERE	BEIZULE- NENN- GENDER WERT (in Tsd.)	% DES NETTO ZEITWERT (in Tsd.)	% DES VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	NENN- WERT (in Tsd.)	BEIZULE- GENDER ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	NENN- WERT (in Tsd.)	BEIZULE- GENDER ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO VERMÖ- GENS
<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNGEN</b>											
iHeartCommunications, Inc. 3,084 % due 01.05.2026	\$ 2.994	\$ 2.976	0,20	KCA Deutag UK Finance PLC 9,875 % due 01.12.2025	\$ 632	\$ 690	0,05	Air Canada 3,875 % due 15.08.2026	\$ 2.900	\$ 2.930	0,20
Intelsat Jackson Holdings S.A. 3,600 % - 5,750 % due 13.10.2022	942	935	0,06	Ladder Capital Finance Holdings LLLP 5,250 % due 01.10.2025	2.951	2.992	0,20	Albertsons Cos., Inc. 3,250 % due 15.03.2026 3,500 % due 15.02.2023 4,625 % due 15.01.2027 7,500 % due 15.03.2026	135 1.194 667 1.110	137 1.223 701 1.200	0,01 0,08 0,05 0,08
Revlon Consumer Products Corp. 3,625 % due 30.06.2025 10,250 % due 15.12.2023	2.176 1.454	1.651 1.389	0,11 0,10	MGIC Investment Corp. 5,750 % due 15.08.2023	1.320	1.415	0,10	Allegheny Technologies, Inc. 7,875 % due 15.08.2023	5.291	5.959	0,40
		6.951	0,47	MGM Growth Properties Operating Partnership LP 4,625 % due 15.06.2025 5,625 % due 01.05.2024	2.281 8.572	2.461 9.333	0,17 0,63	Altice France S.A. 8,125 % due 01.02.2027	1.292	1.392	0,09
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN BANKEN UND FINANZEN</b>											
Acrisure LLC 7,000 % due 15.11.2025 10,125 % due 01.08.2026	750 1.100	765 1.228	0,05 0,08	Navient Corp. 6,125 % due 25.03.2024 6,500 % due 15.06.2022 6,750 % due 15.06.2026	4.526 2.343 700	4.852 2.422 773	0,33 0,16 0,05	Ambience Merger Sub, Inc. 4,875 % due 15.07.2028 7,125 % due 15.07.2029	1.000 1.000	1.001 993	0,07 0,07
AerCap Holdings NV 5,875 % due 10.10.2079	1.705	1.782	0,12	Newmark Group, Inc. 6,125 % due 15.11.2023	850	921	0,06	AMC Entertainment Holdings, Inc. (10,000 % bar und 2,000 % PIK) 12,000 % due 15.06.2026 (b)	320	310	0,02
AGFC Capital Trust 1,876 % due 15.01.2067	638	377	0,03	NMI Holdings, Inc. 7,375 % due 01.06.2025	340	388	0,03	AMC Networks, Inc. 4,750 % due 01.08.2025 5,000 % due 01.04.2024	6.997 2.957	7.181 2.999	0,48 0,20
Allied Universal Holdco LLC 6,625 % due 15.07.2026	5.030	5.324	0,36	OneMain Finance Corp. 5,625 % due 15.03.2023 6,125 % due 15.05.2022 6,125 % due 15.03.2024 6,875 % due 15.03.2025 8,875 % due 01.06.2025	7.579 12.964 2.970 146 100	7.986 13.320 3.177 164 109	0,54 0,90 0,21 0,01 0,01	American Airlines, Inc. 5,500 % due 20.04.2026 11,750 % due 15.07.2025	16.133 2.990	16.980 3.704	1,14 0,25
Ally Financial, Inc. 5,750 % due 20.11.2025	1.480	1.693	0,11	Park Intermediate Holdings LLC 6,375 % due 01.06.2025	2.150	2.289	0,15	Antero Resources Corp. 5,000 % due 01.03.2025 8,375 % due 15.07.2026	5.067 953	5.196 1.081	0,35 0,07
CIT Group, Inc. 3,929 % due 19.06.2024 4,750 % due 16.02.2024 5,000 % due 15.08.2022 5,000 % due 01.08.2023 5,250 % due 07.03.2025	40 1.628 5.902 784 85	42 1.740 6.116 839 95	0,00 0,12 0,41 0,06 0,01	PennyMac Financial Services, Inc. 5,375 % due 15.10.2025	3.692	3.802	0,26	Apache Corp. 4,625 % due 15.11.2025	3.617	3.893	0,26
Credit Acceptance Corp. 5,125 % due 31.12.2024 6,625 % due 15.03.2026	370 1.281	382 1.340	0,03 0,09	PRA Group, Inc. 7,375 % due 01.09.2025	3.609	3.866	0,26	Aramark Services, Inc. 6,375 % due 15.05.2025	2.900	3.052	0,21
Deutsche Bank AG 4,296 % due 24.05.2028 (f) 4,500 % due 01.04.2025 (f)	458 8.400	475 9.035	0,03 0,61	Provident Funding Associates LP 6,375 % due 15.06.2025	2.000	2.038	0,14	ArcelorMittal S.A. 3,600 % due 16.07.2024 4,550 % due 11.03.2026	462 520	491 580	0,03 0,04
Diversified Healthcare Trust 9,750 % due 15.06.2025	6.300	6.898	0,47	Radian Group, Inc. 4,500 % due 01.10.2024 6,625 % due 15.03.2025	650 4.162	694 4.651	0,05 0,31	Ardagh Packaging Finance PLC 4,125 % due 15.08.2026 5,250 % due 30.04.2025	3.086 421	3.207 440	0,22 0,03
Enact Holdings, Inc. 6,500 % due 15.08.2025	8.531	9.325	0,63	RLJ Lodging Trust LP 3,750 % due 01.07.2026	4.370	4.397	0,30	Artera Services LLC 9,033 % due 04.12.2025	1.120	1.217	0,08
Enova International, Inc. 8,500 % due 01.09.2024	514	525	0,04	Rocket Mortgage LLC 2,875 % due 15.10.2026 (a)	1.750	1.712	0,12	ATP Tower Holdings LLC 4,050 % due 27.04.2026	1.923	1.930	0,13
Ford Motor Credit Co. LLC 2,700 % due 10.08.2026 3,664 % due 08.09.2024 4,063 % due 01.11.2024 4,250 % due 20.09.2022 4,389 % due 08.01.2026 5,125 % due 16.06.2025 5,584 % due 18.03.2024	200 3.930 3.400 10 6.209 346 4.888	201 4.063 3.579 10 6.628 376 5.260	0,01 0,27 0,24 0,00 0,45 0,03 0,35	SBA Communications Corp. 4,875 % due 01.09.2024	3.254	3.312	0,22	Avient Corp. 5,250 % due 15.03.2023 5,750 % due 15.05.2025	1.524 900	1.622 950	0,11 0,06
Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC 6,500 % due 01.10.2025	5.214	5.374	0,36	Service Properties Trust 4,350 % due 01.10.2024 7,500 % due 15.09.2025	1.000 6.191	1.014 6.954	0,07 0,47	Avon Products, Inc. 6,500 % due 15.03.2023	4.607	4.880	0,33
Freedom Mortgage Corp. 6,625 % due 15.01.2027 8,125 % due 15.11.2024 8,250 % due 15.04.2025	1.200 3.831 2.808	1.168 3.896 2.868	0,08 0,26 0,19	Sitka Holdings LLC 5,250 % due 06.07.2026	2.200	2.233	0,15	B&G Foods, Inc. 5,250 % due 01.04.2025	2.464	2.526	0,17
Genworth Holdings, Inc. 4,900 % due 15.08.2023	1.685	1.725	0,12	SLM Corp. 4,200 % due 29.10.2025	3.238	3.475	0,23	B.C. Unlimited Liability Co. 5,750 % due 15.04.2025	840	883	0,06
GEO Group, Inc. 5,125 % due 01.04.2023	2.172	2.050	0,14	Starwood Property Trust, Inc. 3,625 % due 15.07.2026 4,750 % due 15.03.2025 5,000 % due 15.12.2021	1.200 4.092 2.426	1.210 4.312 2.432	0,08 0,29 0,16	Ball Corp. 4,875 % due 15.03.2026 5,000 % due 15.03.2022 5,250 % due 01.07.2025	2.130 635 650	2.351 648 726	0,16 0,04 0,05
HAT Holdings LLC 3,375 % due 15.06.2026 6,000 % due 15.04.2025	4.450 48	4.522 50	0,30 0,00	United Wholesale Mortgage LLC 5,500 % due 15.11.2025	808	815	0,05	Banijay Entertainment SASU 5,375 % due 01.03.2025	2.672	2.759	0,19
Icahn Enterprises LP 4,750 % due 15.09.2024 6,250 % due 15.05.2026 6,375 % due 15.12.2025	2.585 3.735 1.000	2.692 3.908 1.027	0,18 0,26 0,07	Uniti Group LP 7,125 % due 15.12.2024 7,875 % due 15.02.2025	5.832 5.667	5.963 5.995	0,40 0,40	Bath & Body Works, Inc. 9,375 % due 01.07.2025	116	147	0,01
Intesa Sanpaolo SpA 5,017 % due 26.06.2024 5,710 % due 15.01.2026	3.400 410	3.672 460	0,25 0,03	VICI Properties LP 3,500 % due 15.02.2025 4,250 % due 01.12.2026	2.428 2.736	2.480 2.861	0,17 0,19	Bausch Health Americas, Inc. 9,250 % due 01.04.2026	5.902	6.311	0,43
iStar, Inc. 4,250 % due 01.08.2025 4,750 % due 01.10.2024	361 2.502	375 2.649	0,03 0,18	Voyager Aviation Holdings LLC 8,500 % due 09.05.2026	1.312	1.205	0,08	Bausch Health Cos., Inc. 5,500 % due 01.11.2025 6,125 % due 15.04.2025 9,000 % due 15.12.2025	194 8.275 6.675	197 8.456 7.054	0,01 0,57 0,48
Jefferson Capital Holdings LLC 6,000 % due 15.08.2026	1.270	1.307	0,09		225.302	15.19		Berry Global, Inc. 4,500 % due 15.02.2026	220	224	0,02
				<b>INDUSTRIESEKTOR</b>							
				24 Hour Fitness Worldwide, Inc. 8,000 % due 01.06.2022 ^	5.666	15	0,00	Blackstone Mortgage Trust, Inc. 3,750 % due 15.01.2027 (a)	1.000	993	0,07
				Adient Global Holdings Ltd. 4,875 % due 15.08.2026	1.850	1.896	0,13	Bombardier, Inc. 7,125 % due 15.06.2026 7,500 % due 01.12.2024 7,500 % due 15.03.2025	4.731 3.200 4.000	4.973 3.332 4.090	0,34 0,22 0,28
				Adient U.S. LLC 9,000 % due 15.04.2025	1.080	1.168	0,08	Boxer Parent Co., Inc. 7,125 % due 02.10.2025 9,125 % due 01.03.2026	1.410 412	1.507 433	0,10 0,03
				ADT Security Corp. 4,125 % due 15.06.2023	49	51	0,00	Boyd Gaming Corp. 8,625 % due 01.06.2025	1.656	1.797	0,12
				AerCap Global Aviation Trust 6,500 % due 15.06.2045	250	271	0,02				

BESCHREIBUNG	NENN- WERT (in Tsd.)	BEIZULE- GENDER ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	NENN- WERT (in Tsd.)	BEIZULE- GENDER ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	NENN- WERT (in Tsd.)	BEIZULE- GENDER ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO VERMÖ- GENS
Brink's Co. 5,500 % due 15.07.2025	\$ 200	\$ 209	0,01	Crown Americas LLC 4,500 % due 15.01.2023 4,750 % due 01.02.2026	\$ 7.522	\$ 7.900	0,53 0,04	Freeport-McMoRan, Inc. 3,550 % due 01.03.2022 4,550 % due 14.11.2024	\$ 750	\$ 753	0,05 0,26
Buckeye Partners LP 4,125 % due 01.03.2025 4,150 % due 01.07.2023 4,500 % due 01.03.2028 6,375 % due 22.01.2078	1.025 126 2.160 284	1.063 130 2.196 261	0,07 0,01 0,15 0,02	CSC Holdings LLC 5,250 % due 01.06.2024 5,875 % due 15.09.2022 6,750 % due 15.11.2021	1.823 1.226 9.129	1.955 1.270 9.163	0,13 0,09 0,62	Gates Global LLC 6,250 % due 15.01.2026 GFL Environmental, Inc. 3,750 % due 01.08.2025 4,250 % due 01.06.2025	1.250 1.674 670	1.298 1.724 692	0,09 0,12 0,05
Caesars Entertainment, Inc. 6,250 % due 01.07.2025	23.573	24.846	1,67	CVR Energy, Inc. 5,250 % due 15.02.2025	4.040	4.006	0,27	Global Medical Response, Inc. 6,500 % due 01.10.2025	1.250	1.294	0,09
Carnival Corp. 7,625 % due 01.03.2026 11,500 % due 01.04.2023	4.050 2.973	4.328 3.322	0,29 0,22	Dave & Buster's, Inc. 7,625 % due 01.11.2025	675	723	0,05	goeasy Ltd. 4,375 % due 01.05.2026 5,375 % due 01.12.2024	4.435 157	4.563 162	0,31 0,01
Carvana Co. 5,625 % due 01.10.2025	2.050	2.122	0,14	DCP Midstream Operating LP 3,875 % due 15.03.2023 4,950 % due 01.04.2022 5,375 % due 15.07.2025 5,850 % due 21.05.2043	4.665 4.913 2.300 619	4.783 4.948 2.544 577	0,32 0,33 0,17 0,04	Golden Entertainment, Inc. 7,625 % due 15.04.2026 Golden Nugget, Inc. 6,750 % due 15.10.2024	250	264	0,02
Cascades, Inc. 5,125 % due 15.01.2026	1.639	1.745	0,12	Delta Air Lines, Inc. 2,900 % due 28.10.2024	12.44	5	12,747	Goodyear Tire & Rubber Co. 5,000 % due 31.05.2026 9,500 % due 31.05.2025	10 1.300	10 1.428	0,00 0,10
CCO Holdings LLC 4,500 % due 15.08.2030 4,500 % due 01.05.2032	3.100 1.700	3.202 1.753	0,22 0,12	Diamond Foreign Asset Co. 9,000 % due 22.04.2027 9,000 % due 22.04.2027 (g)	300 145 3.267	303 151 3.851	0,02 0,01 0,26	Gran Tierra Energy International Holdings Ltd. 6,250 % due 15.02.2025	333	289	0,02
CD&R Smokey Buyer, Inc. 6,750 % due 15.07.2025	930	985	0,07	Diamond Offshore Drilling, Inc. 13,000 % due 21.12.2026 (a)	52	52	0,00	Graphic Packaging International LLC 4,125 % due 15.08.2024 4,875 % due 15.11.2022	202 168	215 174	0,01 0,01
CDW LLC 4,125 % due 01.05.2025	1.652	1.714	0,12	Diamond Sports Group LLC 5,375 % due 15.08.2026	7.000	4.629	0,31	Grinding Media, Inc. 7,375 % due 15.12.2023	5.211	5.315	0,36
CEC Entertainment LLC 6,750 % due 01.05.2026	1.240	1.245	0,08	Diebold Nixdorf, Inc. 9,375 % due 15.07.2025	2.950	3.232	0,22	Gulfport Energy Operating Corp. 8,000 % due 17.05.2026	2.100	2.299	0,16
Cedar Fair LP 5,500 % due 01.05.2025	4.621	4.806	0,32	DIRECTV Holdings LLC 5,875 % due 15.08.2027	1.700	1.776	0,12	H-Food Holdings LLC 8,500 % due 01.06.2026	1.410	1.463	0,10
Centennial Resource Production LLC 5,375 % due 15.01.2026	764	751	0,05	DISH DBS Corp. 5,000 % due 15.03.2023 5,875 % due 15.07.2022	150 13.35	156 0	0,01 13,776	Hadrian Merger Sub, Inc. 8,500 % due 01.05.2026	700	726	0,05
CF Industries, Inc. 3,450 % due 01.06.2023	1.913	1.999	0,13	5,875 % due 15.11.2024	4.100	4.414	0,30	Hanesbrands, Inc. 4,625 % due 15.05.2024 4,875 % due 15.05.2026 5,375 % due 15.05.2025	2.116 826 5.628	2.234 896 5.899	0,15 0,06 0,40
Change Healthcare Holdings LLC 5,750 % due 01.03.2025	10.79	10.886	0,73	DKT Finance ApS 9,375 % due 17.06.2023	1.105	1.127	0,08	HCA, Inc. 5,375 % due 01.02.2025 5,875 % due 01.05.2023	1.329 14.08	1.487 15.154	0,10 1,02
Chesapeake Energy Corp. 5,500 % due 01.02.2026	4.139	4.330	0,29	eG Global Finance PLC 6,750 % due 07.02.2025 8,500 % due 30.10.2025	250 400	256 417	0,02 0,03	Hess Midstream Operations LP 5,625 % due 15.02.2026	560	643	0,04
Cimpress PLC 7,000 % due 15.06.2026	799	834	0,06	Elanco Animal Health, Inc. 5,272 % due 28.08.2023	2.264	2.416	0,16	Hexcel Corp. 4,950 % due 15.08.2025	200	222	0,02
Cinemark USA, Inc. 5,875 % due 15.03.2026 8,750 % due 01.05.2025	750 1.000	759 1.074	0,05 0,07	EMC Corp. 3,375 % due 01.06.2023	6.295	6.507	0,44	Hillenbrand, Inc. 5,750 % due 15.06.2025	280	296	0,02
Clarios Global LP 6,250 % due 15.05.2026 6,750 % due 15.05.2025	1.464 352	1.540 372	0,10 0,03	EnLink Midstream Partners LP 4,150 % due 01.06.2025 4,400 % due 01.04.2024 4,850 % due 15.07.2026	4.797 400 3.800	4.953 416 3.996	0,33 0,03 0,27	Hilton Domestic Operating Co., Inc. 5,375 % due 01.05.2025	7.983	8.352	0,56
ClariVate Science Holdings Corp. 4,875 % due 01.07.2029	100	100	0,01	Ensign Drilling, Inc. 9,250 % due 15.04.2024	3.308	3.200	0,22	Howmet Aerospace, Inc. 5,125 % due 01.10.2024	654	722	0,05
Clear Channel International BV 6,625 % due 01.08.2025	1.806	1.887	0,13	EQM Midstream Partners LP 4,000 % due 01.08.2024 4,750 % due 15.07.2023 6,000 % due 01.07.2025	157 5.145 1.386	163 5.379 1.521	0,01 0,36 0,10	Hudbay Minerals, Inc. 4,500 % due 01.04.2026	3.464	3.434	0,23
Clearwater Paper Corp. 5,375 % due 01.02.2025	600	648	0,04	EQT Corp. 3,000 % due 01.10.2022 3,125 % due 15.05.2026 6,625 % due 01.02.2025	475 1.460 6.032	484 1.499 6.911	0,03 0,10 0,47	iHeartCommunications, Inc. 3,084 % due 01.05.2026 8,375 % due 01.05.2027	938 1.414	991 1.513	0,07 0,10
Cleveland-Cliffs, Inc. 6,750 % due 15.03.2026 9,875 % due 17.10.2025	3.870 750	4.131 862	0,28 0,06	Exela Intermediate LLC 10,000 % due 15.07.2023	1.500	1.165	0,08	Independence Energy Finance LLC 7,250 % due 01.05.2026	500	516	0,03
CNX Midstream Partners LP 6,500 % due 15.03.2026	290	305	0,02	F-Brasile SpA 7,375 % due 15.08.2026	1.500	1.547	0,10	INEOS Quattro Finance PLC 3,375 % due 15.01.2026	3.010	3.044	0,21
Cogent Communications Group, Inc. 3,500 % due 01.05.2026 5,375 % due 01.03.2022	1.210 4.653	1.228 4.682	0,08 0,32	FAGE International S.A. 5,625 % due 15.08.2026	500	515	0,03	Ingevity Corp. 3,875 % due 01.11.2028 4,500 % due 01.02.2026	2.342 1.710	2.339 1.731	0,16 0,12
Colfax Corp. 6,375 % due 15.02.2026	1.200	1.264	0,09	Fair Isaac Corp. 5,250 % due 15.05.2026	300	341	0,02	Intelsat Connect Finance S.A. 9,500 % due 15.02.2023 ^	7.534	1.990	0,13
Colgate Energy Partners LLC 7,750 % due 15.02.2026	1.100	1.160	0,08	Flex Acquisition Co., Inc. 6,875 % due 15.01.2025	4.563	4.626	0,31	Intelsat Jackson Holdings S.A. 5,500 % due 01.08.2023 ^ 8,500 % due 15.10.2024 ^ 9,500 % due 30.09.2022	9.808 4.013 3.326	5.486 2.294 3.937	0,37 0,15 0,27
CommScope Technologies LLC 6,000 % due 15.06.2025	1.611	1.633	0,11	FMG Resources Pty. Ltd. 5,125 % due 15.05.2024	250	267	0,02	Intelsat Luxembourg S.A. 8,125 % due 01.06.2023 ^	5.318	47	0,00
CommScope, Inc. 6,000 % due 01.03.2026 8,250 % due 01.03.2027	2.848 2.200	2.961 2.306	0,20 0,16	Ford Motor Co. 8,500 % due 21.04.2023 9,000 % due 22.04.2025	6.702 9.245	7.380 11.129	0,50 0,75	International Game Technology PLC 4,125 % due 15.04.2026 6,500 % due 15.02.2025	986 4.000	1.026 4.469	0,07 0,30
Community Health Systems, Inc. 6,625 % due 15.02.2025 8,000 % due 15.03.2026	7.210 2.035	7.552 2.161	0,51 0,15	Forterra Finance LLC 6,500 % due 15.07.2025	1.150	1.232	0,08	IRB Holding Corp. 6,750 % due 15.02.2026	294	302	0,02
Continental Resources, Inc. 3,800 % due 01.06.2024 4,500 % due 15.04.2023	1.970 1.568	2.073 1.627	0,14 0,11								
Coty, Inc. 5,000 % due 15.04.2026 6,500 % due 15.04.2026	5.994 431	6.131 442	0,41 0,03								

**Aufstellung des Wertpapierbestands PIMCO US Short-Term High Yield Corporate Bond Index UCITS ETF (Fortsetzung)**

BESCHREIBUNG	NENN- WERT (in Tsd.)	BEIZULE- GENDER ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	NENN- WERT (in Tsd.)	BEIZULE- GENDER ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	NENN- WERT (in Tsd.)	BEIZULE- GENDER ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO VERMÖ- GENS	
7,000 % due 15.06.2025	\$ 4.639	\$ 4.931	0,33	Navios Maritime Holdings, Inc. 7,375 % due 15.01.2022	\$ 2.644	\$ 2.582	0,17	Performance Food Group, Inc. 6,875 % due 01.05.2025	\$ 460	\$ 488	0,03	
Jaguar Holding Co. 4,625 % due 15.06.2025		410	426	0,03	NCL Corp. Ltd. 3,625 % due 15.12.2024	2,626	2,498	0,17	Picasso Finance Sub, Inc. 6,125 % due 15.06.2025	598	633	0,04
Jaguar Land Rover Automotive PLC 7,750 % due 15.10.2025	5,125	5,539	0,37	5,875 % due 15.03.2026	6,310	6,476	0,44	PRA Health Sciences, Inc. 2,875 % due 15.07.2026	725	733	0,05	
Jeld-Wen, Inc. 4,625 % due 15.12.2025	1,281	1,303	0,09	10,250 % due 01.02.2026	1,568	1,802	0,12	Precision Drilling Corp. 7,125 % due 15.01.2026	273	281	0,02	
6,250 % due 15.05.2025	200	212	0,01	12,250 % due 15.05.2024	609	719	0,05	Prime Healthcare Services, Inc. 7,250 % due 01.11.2025	5,470	5,873	0,40	
KAR Auction Services, Inc. 5,125 % due 01.06.2025	9,708	9,829	0,66	Netflix, Inc. 3,625 % due 15.06.2025	10	11	0,00	Prime Security Services Borrower LLC 5,250 % due 15.04.2024	1,026	1,096	0,07	
KB Home 7,500 % due 15.09.2022	3,999	4,241	0,29	5,750 % due 01.03.2024	154	170	0,01	5,750 % due 15.04.2026	4,025	4,359	0,29	
Kraft Heinz Foods Co. 3,000 % due 01.06.2026	1,205	1,270	0,09	5,875 % due 15.02.2025	110	126	0,01	PTC, Inc. 3,625 % due 15.02.2025	400	407	0,03	
3,500 % due 06.06.2022	206	210	0,01	New Fortress Energy, Inc. 6,750 % due 15.09.2025	1,400	1,350	0,09	Quebecor Media, Inc. 5,750 % due 15.01.2023	971	1,028	0,07	
LABL, Inc. 6,750 % due 15.07.2026	4,751	4,994	0,34	Newell Brands, Inc. 4,000 % due 15.06.2022	160	162	0,01	QVC, Inc. 4,850 % due 01.04.2024	789	853	0,06	
Lamb Weston Holdings, Inc. 4,625 % due 01.11.2024	3,414	3,477	0,23	4,350 % due 01.04.2023	454	473	0,03	Radiate Holdco LLC 4,500 % due 15.09.2026	3,400	3,515	0,24	
Laredo Petroleum, Inc. 9,500 % due 15.01.2025	2,574	2,671	0,18	4,700 % due 01.04.2026	1,874	2,068	0,14	Range Resources Corp. 4,875 % due 15.05.2025	1,961	2,073	0,14	
Legacy LifePoint Health LLC 6,750 % due 15.04.2025	5,194	5,465	0,37	4,875 % due 01.06.2025	748	827	0,06	5,000 % due 15.08.2022	6,403	6,525	0,44	
Legends Hospitality Holding Co. LLC 5,000 % due 01.02.2026	3,794	3,895	0,26	NextEra Energy Operating Partners LP 4,250 % due 15.07.2024	740	784	0,05	5,000 % due 15.03.2023	123	128	0,01	
Life Time, Inc. 5,750 % due 15.01.2026	2,168	2,247	0,15	Nielsen Co. Luxembourg SARM 5,000 % due 01.02.2025	157	161	0,01	9,250 % due 01.02.2026	1,288	1,406	0,10	
Ligado Networks LLC (15,500 % bar oder 15,500 % PIK) 15,500 % due 01.11.2023 (b)	5,550	5,032	0,34	Nine Energy Service, Inc. 8,750 % due 01.11.2023	794	382	0,03	Rattler Midstream LP 5,625 % due 15.07.2025	500	521	0,04	
Ligado Networks LLC (17,500 % bar oder 17,500 % PIK) 17,500 % due 01.05.2024 (b)	1,200	823	0,06	Nokia Oyj 3,375 % due 12.06.2022	5,264	5,384	0,36	RBS Global, Inc. 4,875 % due 15.12.2025	860	881	0,06	
Live Nation Entertainment, Inc. 4,875 % due 01.11.2024	10	10	0,00	Northriver Midstream Finance LP 5,625 % due 15.02.2026	1,357	1,414	0,10	RegionalCare Hospital Partners Holdings, Inc. 9,750 % due 01.12.2026	4,455	4,711	0,32	
5,625 % due 15.03.2026	1,217	1,262	0,09	Northwest Acquisitions ULCC 7,125 % due 01.11.2022 ^	3,244	4	0,00	Resolute Forest Products, Inc. 4,875 % due 01.03.2026	3,490	3,557	0,24	
LSF9 Atlantis Holdings LLC 7,750 % due 15.02.2026	3,410	3,541	0,24	NortonLifeLock, Inc. 3,950 % due 15.06.2022	1,450	1,469	0,10	Revlon Consumer Products Corp. 6,250 % due 01.08.2024	2,864	1,265	0,09	
Macy's Retail Holdings LLC 2,875 % due 15.02.2023	750	762	0,05	NOVA Chemicals Corp. 4,875 % due 01.06.2024	1,400	1,465	0,10	Rite Aid Corp. 7,500 % due 01.07.2025	695	696	0,05	
Magnolia Oil & Gas Operating LLC 6,000 % due 01.08.2026	750	771	0,05	Novelis Corp. 3,250 % due 15.11.2026	1,500	1,523	0,10	8,000 % due 15.11.2026	1,492	1,505	0,10	
Manitowoc Co., Inc. 9,000 % due 01.04.2026	200	215	0,01	Nufarm Australia Ltd. 5,750 % due 30.04.2026	200	206	0,01	Riverbed Technology, Inc. 8,875 % due 01.03.2023	4,412	3,021	0,20	
Marriott Ownership Resorts, Inc. 6,125 % due 15.09.2025	400	423	0,03	NuStar Logistics LP 4,750 % due 01.02.2022	5,483	5,513	0,37	Rockies Express Pipeline LLC 3,600 % due 15.05.2025	210	217	0,01	
Mattel, Inc. 3,150 % due 15.03.2023	3,657	3,727	0,25	5,750 % due 01.10.2025	1,100	1,187	0,08	Rockpoint Gas Storage Canada Ltd. 7,000 % due 31.03.2023	3,528	3,585	0,24	
3,375 % due 01.04.2026	10	10	0,00	6,000 % due 01.06.2026	1,210	1,309	0,09	Rolls-Royce PLC 3,625 % due 14.10.2025	4,695	4,757	0,32	
Matthews International Corp. 5,250 % due 01.12.2025	200	206	0,01	Occidental Petroleum Corp. 3,500 % due 15.06.2025	20	21	0,00	Royal Caribbean Cruises Ltd. 9,125 % due 15.06.2023	2,195	2,388	0,16	
Mauser Packaging Solutions Holding Co. 5,500 % due 15.04.2024	7,097	7,168	0,48	5,500 % due 01.12.2025 (g)	1,981	2,196	0,15	10,875 % due 01.06.2023	4,950	5,550	0,37	
7,250 % due 15.04.2025	3,308	3,292	0,22	5,550 % due 15.03.2026	2,410	2,678	0,18	11,500 % due 01.06.2025	2,938	3,356	0,23	
Mclaren Finance PLC 7,500 % due 01.08.2026	2,450	2,493	0,17	5,875 % due 01.09.2025	4,139	4,644	0,31	RP Escrow Issuer LLC 5,250 % due 15.12.2025	4,676	4,817	0,32	
Mercer International, Inc. 5,500 % due 15.01.2026	150	153	0,01	6,950 % due 01.07.2024	4,879	5,522	0,37	Sabre Global, Inc. 7,375 % due 01.09.2025	8,442	9,008	0,61	
MGM China Holdings Ltd. 5,375 % due 15.05.2024	3,656	3,706	0,25	OCI NV 4,625 % due 15.10.2025	400	421	0,03	9,250 % due 15.04.2025	574	664	0,05	
MGM Resorts International 6,750 % due 01.05.2025	2,872	3,030	0,20	5,250 % due 01.11.2024	400	412	0,03	Scientific Games International, Inc. 5,000 % due 15.10.2025	167	172	0,01	
Microchip Technology, Inc. 4,250 % due 01.09.2025	1,269	1,327	0,09	Ol European Group BV 4,000 % due 15.03.2023	2,090	2,135	0,14	8,250 % due 15.03.2026	2,553	2,713	0,18	
Midas Intermediate Holdco LLC 7,875 % due 01.10.2022 (h)	1,287	1,064	0,07	Olin Corp. 9,500 % due 01.06.2025	3,942	4,918	0,33	8,625 % due 01.07.2025	6,229	6,753	0,46	
Millennium Escrow Corp. 6,625 % due 01.08.2026	4,300	4,434	0,30	Ortho-Clinical Diagnostics, Inc. 7,375 % due 01.06.2025	780	824	0,06	Seagate HDD Cayman 4,750 % due 01.06.2023	1,669	1,771	0,12	
Modulaire Global Finance PLC 8,000 % due 15.02.2023	4,815	4,923	0,33	Outfront Media Capital LLC 6,250 % due 15.06.2025	200	212	0,01	4,750 % due 01.01.2025	10	11	0,00	
Mohegan Gaming & Entertainment 8,000 % due 01.02.2026	3,651	3,810	0,26	Ovintiv Exploration, Inc. 5,375 % due 01.01.2026	1,210	1,369	0,09	4,875 % due 01.03.2024	510	550	0,04	
MoneyGram International, Inc. 5,375 % due 01.08.2026	3,210	3,262	0,22	5,625 % due 01.07.2024	3,819	4,236	0,29	Sealed Air Corp. 4,875 % due 01.12.2022	10	10	0,00	
Nabors Industries, Inc. 9,000 % due 01.02.2025	1,330	1,384	0,09	Owens-Brockway Glass Container, Inc. 5,375 % due 15.01.2025	10	11	0,00	5,125 % due 01.12.2024	200	218	0,01	
				5,875 % due 15.08.2023	4,935	5,227	0,35	5,250 % due 01.04.2023	750	785	0,05	
				Pactiv LLC 7,950 % due 15.12.2025	700	790	0,05	5,500 % due 15.09.2025	310	346	0,02	
				Par Pharmaceutical, Inc. 7,500 % due 01.04.2027	270	275	0,02	Select Medical Corp. 6,250 % due 15.08.2026	4,430	4,664	0,31	
				PDC Energy, Inc. 5,750 % due 15.05.2026	1,887	1,967	0,13	Sensata Technologies BV 4,875 % due 15.10.2023	2,961	3,155	0,21	
				6,125 % due 15.09.2024	2,913	2,960	0,20	5,000 % due 01.10.2025	190	209	0,01	
				Penske Automotive Group, Inc. 3,500 % due 01.09.2025	746	768	0,05	5,625 % due 01.11.2024	410	454	0,03	
				Perenti Finance Pty. Ltd. 6,500 % due 07.10.2025	176	185	0,01					

BESCHREIBUNG	NENN- WERT (in Tsd.)	BEIZULE- GENDER ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	NENN- WERT (in Tsd.)	BEIZULE- GENDER ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	NENN- WERT (in Tsd.)	BEIZULE- GENDER ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO VERMÖ- GENS
Sigma Holdco BV 7,875 % due 15.05.2026	\$ 2.212	\$ 2.188	0,15	Trinseo Materials Operating S.C.A. 5,375 % due 01.09.2025	\$ 2.221	\$ 2.257	0,15	XPO Logistics, Inc. 6,250 % due 01.05.2025	\$ 2.625	\$ 2.774	0,19
Sirius XM Radio, Inc. 3,125 % due 01.09.2026	1.200	1.218	0,08	TripAdvisor, Inc. 7,000 % due 15.07.2025	1.517	1.610	0,11	Yum! Brands, Inc. 3,875 % due 01.11.2023	4.983	5.223	0,35
Six Flags Entertainment Corp. 4,875 % due 31.07.2024	4.506	4.554	0,31	Triumph Group, Inc. 6,250 % due 15.09.2024	4.955	4.960	0,33	7,750 % due 01.04.2025	497	532	0,04
Six Flags Theme Parks, Inc. 7,000 % due 01.07.2025	150	160	0,01	U.S. Acute Care Solutions LLC 6,375 % due 01.03.2026	1.300	1.373	0,09	ZF North America Capital, Inc. 4,500 % due 29.04.2022	579	588	0,04
SM Energy Co. 5,625 % due 01.06.2025	1.516	1.527	0,10	U.S. Foods, Inc. 6,250 % due 15.04.2025	10.841	11.385	0,77	4,750 % due 29.04.2025	2.942	3.183	0,21
6,750 % due 15.09.2026	900	920	0,06	U.S. Steel Corp. 6,250 % due 15.03.2026	288	297	0,02				
10,000 % due 15.01.2025	400	447	0,03	Uber Technologies, Inc. 4,500 % due 15.08.2029	1.000	1.009	0,07	<b>VERSORGUNGSUNTERNEHMEN</b>			
Southwestern Energy Co. 6,450 % due 23.01.2025	2.414	2.661	0,18	7,500 % due 15.05.2025	3.582	3.823	0,26	Antero Midstream Partners LP 7,875 % due 15.05.2026	962	1.054	0,07
Spectrum Brands, Inc. 5,750 % due 15.07.2025	2.957	3.035	0,20	8,000 % due 01.11.2026	2.267	2.399	0,16	Blue Racer Midstream LLC 6,625 % due 15.07.2026	200	210	0,01
Spirit AeroSystems, Inc. 3,950 % due 15.06.2023	4.789	4.883	0,33	United Airlines Pass-Through Trust 5,875 % due 15.04.2029	93	104	0,01	7,625 % due 15.12.2025	800	866	0,06
5,500 % due 15.01.2025	357	378	0,03	United Airlines, Inc. 4,375 % due 15.04.2026	8.441	8.673	0,58	Calpine Corp. 5,250 % due 01.06.2026	1.718	1.770	0,12
7,500 % due 15.04.2025	6.258	6.633	0,45	Univision Communications, Inc. 5,125 % due 15.02.2025	7.175	7.289	0,49	Crestwood Midstream Partners LP 5,750 % due 01.04.2025	10	10	0,00
Square, Inc. 2,750 % due 01.06.2026	4.400	4.466	0,30	USA Compression Partners LP 6,875 % due 01.04.2026	405	422	0,03	CrownRock LP 5,625 % due 15.10.2025	7.910	8.105	0,55
Staples, Inc. 7,500 % due 15.04.2026	7.105	7.215	0,49	Vail Resorts, Inc. 6,250 % due 15.05.2025	1.967	2.083	0,14	DPL, Inc. 4,125 % due 01.07.2025	10	11	0,00
Station Casinos LLC 5,000 % due 01.10.2025	3.907	3.969	0,27	Vericast Corp. 11,000 % due 15.09.2026	5.818	6.130	0,41	Drax Finco PLC 6,625 % due 01.11.2025	400	414	0,03
Strathcona Resources Ltd. 6,875 % due 01.08.2026	1.600	1.588	0,11	Veritas U.S., Inc. 7,500 % due 01.09.2025	5.890	6.133	0,41	Electricite de France S.A. 5,250 % due 29.01.2023 (e)	310	322	0,02
Sugarhouse HSP Gaming Prop Mezz LP 5,875 % due 15.05.2025	766	767	0,05	ViaSat, Inc. 5,625 % due 15.09.2025	7.589	7.700	0,52	5,625 % due 22.01.2024 (e)	3.966	4.235	0,28
Summer BC Bidco LLC 5,500 % due 31.10.2026	1.300	1.334	0,09	Videotron Ltd. 5,375 % due 15.06.2024	340	370	0,03	Endeavor Energy Resources LP 6,625 % due 15.07.2025	4.538	4.788	0,32
Sunnova Energy Corp. 5,875 % due 01.09.2026	825	842	0,06	Viking Cruises Ltd. 6,250 % due 15.05.2025	750	754	0,05	FirstEnergy Corp. 1,600 % due 15.01.2026	170	169	0,01
Sunoco LP 5,500 % due 15.02.2026	10	10	0,00	13,000 % due 15.05.2025	2.466	2.842	0,19	2,050 % due 01.03.2025	10	10	0,00
Surgery Center Holdings, Inc. 6,750 % due 01.07.2025	200	204	0,01	Virgin Australia Holdings Pty. Ltd 7,875 % due 15.10.2021 ^	1.148	93	0,01	3,350 % due 15.07.2022	1.651	1.673	0,11
10,000 % due 15.04.2027	1.675	1.811	0,12	Wabash National Corp. 5,500 % due 01.10.2025	10	10	0,00	4,750 % due 15.03.2023	10	10	0,00
T-Mobile USA, Inc. 2,250 % due 15.02.2026	881	892	0,06	Waste Pro USA, Inc. 5,500 % due 15.02.2026	2.758	2.789	0,19	FirstEnergy Transmission LLC 4,350 % due 15.01.2025	79	86	0,01
4,000 % due 15.04.2022	364	369	0,03	Weatherford International Ltd. 11,000 % due 01.12.2024	1.800	1.898	0,13	Genesis Energy LP 5,625 % due 15.06.2024	1.432	1.430	0,10
Team Health Holdings, Inc. 6,375 % due 01.02.2025	2.700	2.614	0,18	Weir Group PLC 2,200 % due 13.05.2026	314	317	0,02	6,500 % due 01.10.2025	5.446	5.426	0,37
TEGNA, Inc. 4,750 % due 15.03.2026	1.150	1.201	0,08	WESCO Distribution, Inc. 7,125 % due 15.06.2025	5.766	6.160	0,42	Koninklijke KPN NV 7,000 % due 28.03.2073	325	350	0,02
Tempo Acquisition LLC 5,750 % due 01.06.2025	448	471	0,03	Western Digital Corp. 4,750 % due 15.02.2026	5.263	5.835	0,39	Lumen Technologies, Inc. 5,800 % due 15.03.2022	12.633	12.889	0,87
Tenet Healthcare Corp. 4,625 % due 15.07.2024	4.407	4.479	0,30	Western Midstream Operating LP 3,950 % due 01.06.2025	150	159	0,01	7,500 % due 01.04.2024	7.296	8.089	0,54
4,625 % due 01.09.2024	7.621	7.802	0,53	White Cap Parent LLC (8,250 % bar oder 8,250 % PIK) 8,250 % due 15.03.2026	2.200	2.275	0,15	NGL Energy Operating LLC 7,500 % due 01.02.2026	6.258	6.384	0,43
4,875 % due 01.01.2026	1.320	1.368	0,09	Wolverine Escrow LLC 8,500 % due 15.11.2024	800	745	0,05	NGL Energy Partners LP 6,125 % due 01.03.2025	800	707	0,05
6,750 % due 15.06.2023	3.259	3.517	0,24	9,000 % due 15.11.2026	800	740	0,05	PBF Holding Co. LLC 7,250 % due 15.06.2025	1.100	742	0,05
7,500 % due 01.04.2025	1.085	1.153	0,08	WR Grace Holdings LLC 5,625 % due 01.10.2024	211	232	0,02	9,250 % due 15.05.2025	3.508	3.329	0,22
Toll Brothers Finance Corp. 4,375 % due 15.04.2023	130	135	0,01	Wynn Las Vegas LLC 4,250 % due 30.05.2023	2.835	2.861	0,19	PBF Logistics LP 6,875 % due 15.05.2023	1.204	1.175	0,08
4,875 % due 15.11.2025	1.310	1.469	0,10	5,500 % due 01.03.2025	7.073	7.223	0,49	Sanchez Energy Corp. 7,750 % due 15.06.2021 ^	2.769	93	0,01
5,875 % due 15.02.2022	142	143	0,01	Wynn Macau Ltd. 4,875 % due 01.10.2024	500	487	0,03	Sprint Communications, Inc. 6,000 % due 15.11.2022	6.813	7.172	0,48
TransDigm UK Holdings PLC 6,875 % due 15.05.2026	400	421	0,03	Wynn Resorts Finance LLC 7,750 % due 15.04.2025	780	824	0,06	Sprint Corp. 7,125 % due 15.06.2024			
TransDigm, Inc. 6,250 % due 15.03.2026	12.644	13.197	0,89	Xerox Holdings Corp. 5,000 % due 15.08.2025	5.204	5.475	0,37	7,625 % due 15.02.2025	135	158	0,01
6,375 % due 15.06.2026	1.465	1.513	0,10					7,625 % due 01.03.2026	4.758	5.771	0,39
8,000 % due 15.12.2025	4.400	4.697	0,32					7,875 % due 15.09.2023	14.845	16.606	1,12
Transocean Guardian Ltd. 5,875 % due 15.01.2024	456	454	0,03					Talen Energy Supply LLC 6,500 % due 01.06.2025	1.330	664	0,04
Transocean, Inc. 7,250 % due 01.11.2025	250	209	0,01					10,500 % due 15.01.2026	167	92	0,01
7,500 % due 15.01.2026	1.250	1.015	0,07					Tallgrass Energy Partners LP 7,500 % due 01.10.2025	653	708	0,05
Travel + Leisure Co. 4,250 % due 01.03.2022	882	884	0,06					Targa Resources Partners LP 5,875 % due 15.04.2026	1.500	1.568	0,11
5,650 % due 01.04.2024	6.127	6.627	0,45					Telecom Italia SpA 5,303 % due 30.05.2024	4.966	5.356	0,36
6,600 % due 01.10.2025	320	360	0,02					TerraForm Power Operating LLC 4,250 % due 31.01.2023	2.150	2.213	0,15
Trinity Industries, Inc. 4,550 % due 01.10.2024	10	11	0,00								





## DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Ein Saldo von null kann auf die Rundung der tatsächlichen Beträge auf weniger als 1.000 zurückzuführen sein.

## TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES

Kontrahent	Zu zahlender/zu erhaltender	Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	variabler Zinssatz	Nominalbetrag	Fälligkeitsdatum	Gezahlte/ (erhaltene) Prämien	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)	Beizulegender Zeitwert	% des Nettovermögens
BPS	Zu zahlen	iBoxx USD Liquid High Yield Index	-	3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	\$ 1.300	20.12.2021	\$ 0	\$ 9	\$ 9	0,00
GST	Zu zahlen	iBoxx USD Liquid High Yield Index	-	3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	23.100	20.12.2021	(1)	200	199	0,01
							\$ (1)	\$ 209	\$ 208	0,01

## ABSICHERUNG DURCH DEWISETERMINKONTRAKTE

Zum 30. September 2021 hatte die (abgesicherte) thesaurierende CHF-Klasse die folgenden ausstehenden Devisenterminkontrakte:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu liefernde Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierter Wertzuwachs	Nicht realisierter (Wertverlust)	Nicht realisierter Nettowertzuwachs/ (Wertverlust)	% des Nettovermögens
BOA	10/2021	CHF	\$ 2.579	\$ 12	\$ 0	\$ 12	0,00
	10/2021	\$	2.667 CHF	0	(46)	(46)	0,00
	11/2021		2.778	0	(12)	(12)	0,00
BPS	10/2021		2.687	0	(57)	(57)	0,00
	10/2021		25	0	(1)	(1)	0,00
CBK	10/2021		2.671	0	(59)	(59)	(0,01)
				\$ 12	\$ (175)	\$ (163)	(0,01)

Zum 30. September 2021 hatten die (abgesicherte) thesaurierende EUR-Klasse und die (abgesicherte) ausschüttende EUR-Klasse die folgenden ausstehenden Devisenterminkontrakte:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu liefernde Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierter Wertzuwachs	Nicht realisierter (Wertverlust)	Nicht realisierter Nettowertzuwachs/ (Wertverlust)	% des Nettovermögens
CBK	10/2021	€	\$ 4.528	\$ 89	\$ 0	\$ 89	0,01
	10/2021	\$	2.722 €	0	(55)	(55)	(0,01)
HUS	10/2021	€	836	12	0	12	0,00
	10/2021	\$	2.986 €	0	(32)	(32)	0,00
RBC	10/2021		309.510	0	(5.832)	(5.832)	(0,40)
SCX	10/2021	€	167	4	0	4	0,00
	10/2021	\$	309.510 €	0	(5.832)	(5.832)	(0,39)
TOR	10/2021		309.510	0	(5.832)	(5.832)	(0,39)
				\$ 105	\$ (17.583)	\$ (17.478)	(1,18)

Zum 30. September 2021 hatte die (abgesicherte) ausschüttende GBP-Klasse die folgenden ausstehenden Devisenterminkontrakte:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu liefernde Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierter Wertzuwachs	Nicht realisierter (Wertverlust)	Nicht realisierter Nettowertzuwachs/ (Wertverlust)	% des Nettovermögens
BOA	10/2021	£	\$ 22.724	\$ 86	\$ 0	\$ 86	0,01
	10/2021	\$	498 £	0	(10)	(10)	0,00
	11/2021		30.728	0	(86)	(86)	(0,01)
BPS	10/2021		1.324	0	(20)	(20)	0,00
BRC	10/2021	£	22.724	0	(40)	(40)	0,00
	10/2021	\$	29.190	0	(478)	(478)	(0,03)
	11/2021		30.601	40	0	40	0,00
CBK	10/2021	£	1.282	36	0	36	0,00
HUS	10/2021	\$	29.724	0	(613)	(613)	(0,04)
SCX	10/2021		30.121	0	(611)	(611)	(0,04)
				\$ 162	\$ (1.858)	\$ (1.696)	(0,11)

Derivative OTC-Finanzinstrumente insgesamt

\$ (19.129) (1,29)

Anlagen insgesamt

\$ 1.464.189 98,69

Sonstige kurzfristige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten

\$ 19.510 1,31

Nettovermögen

\$ 1.483.699 100,00

## ANGABEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Beträge in Tsd. \*):

\* Ein Saldo von null kann auf die Rundung der tatsächlichen Beträge auf weniger als 1.000 zurückzuführen sein.

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) „When-issued“-Wertpapier.

(b) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.

(c) Nullkupon-Papier.

(d) Kupon stellt eine Rendite bis Fälligkeit dar.

(e) Unbegrenzte Laufzeit; sofern ein Datum angegeben ist, stellt dies den nächsten vertraglichen Abruffermin dar.

# Aufstellung des Wertpapierbestands PIMCO US Short-Term High Yield Corporate Bond Index UCITS ETF (Fortsetzung)

(f) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(g) Eingeschränkte Wertpapiere:

Emittentenbeschreibung	Kaufdatum	Kosten	Beizulegender Zeitwert	% des Nettovermögens
Bruin Blocker LLC	20.04.2021	\$ 0	\$ 0	0,00
Diamond Foreign Asset Co. 9,000 % due 22.04.2027	12.05.2021	52	52	0,00
Diamond Offshore Drilling, Inc.	12.05.2021	0	131	0,01
Occidental Petroleum Corp. 5,500 % due 01.12.2025	01.06.2021 – 24.08.2021	2.137	2.196	0,15
Stearns Holdings LLC 'B'	15.03.2021	385	304	0,02
		\$ 2.574	\$ 2.683	0,18

(h) Zum 30. September 2021 wurden Wertpapiere mit einem beizulegenden Zeitwert von insgesamt 827 \$ gemäß den Bedingungen der Rahmen-Rückkaufverträge und/oder globalen Rahmen-Rückkaufverträge als Sicherheiten verpfändet.

(i) Zum 30. September 2021 wurden Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von 7.027 \$ und Barmittel in Höhe von 6.700 \$ als Sicherheiten für derivative Finanzinstrumente verpfändet, die von Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. geregelt werden.

Barmittel in Höhe von 6.981 \$ waren zum 30. September 2021 als Sicherheiten für börsengehandelte und zentral abgewickelte derivative Finanzinstrumente verpfändet.

Bewertung zum beizulegenden Zeitwert<sup>(1)</sup>

Die folgende Darstellung ist eine Zusammenfassung der Zeitwertbewertung gemäß den zum 30. September 2021 für die Bewertung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten der Fonds verwendeten Parametern:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Preise für identische Anlagen (Ebene 1)	Sonstige wesentliche beobachtbare Parameter (Ebene 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Parameter (Ebene 3)	Beizulegender Zeitwert
Wertpapiere	\$ 0	\$ 1.473.726	\$ 2.638	\$ 1.476.364
Pensionsgeschäfte	0	6.791	0	6.791
Derivative Finanzinstrumente <sup>(3)</sup>	0	(18.966)	0	(18.966)
<b>Gesamt</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 1.461.551</b>	<b>\$ 2.638</b>	<b>\$ 1.464.189</b>

Die folgende Darstellung ist eine Zusammenfassung der Zeitwertbewertung gemäß den zum 31. März 2021 für die Bewertung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten der Fonds verwendeten Parametern:

Kategorie <sup>(2)</sup>	An aktiven Märkten notierte Preise für identische Anlagen (Ebene 1)	Sonstige wesentliche beobachtbare Parameter (Ebene 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Parameter (Ebene 3)	Beizulegender Zeitwert
Wertpapiere	\$ 0	\$ 1.435.574	\$ 1.099	\$ 1.436.673
Pensionsgeschäfte	0	8.476	0	8.476
Derivative Finanzinstrumente <sup>(3)</sup>	(454)	(26.248)	0	(26.702)
<b>Gesamt</b>	<b>\$ (454)</b>	<b>\$ 1.417.802</b>	<b>\$ 1.099</b>	<b>\$ 1.418.447</b>

<sup>(1)</sup> Siehe Anmerkung 3 in den Anmerkungen zum Abschluss für weitere Informationen.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

<sup>(3)</sup> Derivative Finanzinstrumente umfassen ggf. offene Futures, Swap-Vereinbarungen, verkaufte Optionen, gekaufte Optionen und Devisenterminkontrakte.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. September 2021:

Kontrahent	Leihzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Leihbetrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensionsgeschäften	% des Nettovermögens
JML	(1,000) %	09.09.2021	08.11.2021	\$ (783)	\$ (783)	(0,05)
<b>Umgekehrte Pensionsgeschäfte insgesamt</b>					<b>\$ (783)</b>	<b>(0,05)</b>

(Erhaltene) / verpfändete Sicherheiten für derivative OTC-Finanzinstrumente

Die folgende Tabelle ist eine Zusammenfassung des beizulegenden Zeitwerts der derivativen OTC-Finanzinstrumente und (erhaltenen)/verpfändeten Sicherheiten zum 30. September 2021:

Kontrahent	Beizulegender Zeitwert von OTC-Derivaten insgesamt	(Erhaltene) / verpfändete Sicherheiten	Nettoengagement <sup>(1)</sup>
BOA	\$ (56)	\$ 0	\$ (56)
BPS	(68)	0	(68)
BRC	(479)	403	(76)
CBK	11	0	11
GST	199	(270)	(71)
HUS	(633)	752	119
RBC	(5.832)	3.270	(2.562)
SCX	(6.439)	5.872	(567)
TOR	(5.832)	3.430	(2.402)

<sup>(1)</sup> Das Netto-Engagement stellt die Nettoforderung/(-verbindlichkeit) dar, die bei einem Ausfall vom bzw. an den Kontrahenten zu zahlen wäre.



**Vergleichsangaben**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. September 2021:

	30. Sept. 2021 (%)	31. März 2021 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene Wertpapiere	48,80	59,90
An einem anderen geregelten Markt gehandelte Wertpapiere*	50,21	37,08
Sonstige Wertpapiere	0,50	0,55
Pensionsgeschäfte	0,46	0,57
An einem geregelten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente	0,01	(0,03)
Zentral abgewickelte derivative Finanzinstrumente	0,00	0,37
Derivative OTC-Finanzinstrumente	(1,29)	(2,15)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(0,05)	(0,50)

\* Gemäß der in Anhang 2 des Verkaufsprospekt angegebenen Liste von Märkten, die die OGAW-Kriterien für geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. September 2021 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum beizulegenden Zeitwert	30. Sept. 2021 (%)	31. März 2021 (%)
Kreditbeteiligungen und -abtretungen	0,47	0,48
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen	92,60	89,56
Stammaktien	0,03	0,07
Optionsscheine	0,01	-
Vorzugsaktien	0,07	-
Kurzfristige Instrumente	6,33	7,42
Pensionsgeschäfte	0,46	0,57
An einem geregelten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente		
Futures	0,01	(0,03)
Zentral abgewickelte derivative Finanzinstrumente		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes - Als Sicherungsgeber	0,00	0,37
Derivative OTC-Finanzinstrumente		
Total Return Swaps auf Indizes	0,01	-
Absicherung durch Devisenterminkontrakte	(1,30)	(2,15)
Sonstige kurzfristige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	1,31	3,71
Nettovermögen	100,00	100,00

# Anmerkungen zum Abschluss

## 1. ALLGEMEINE INFORMATIONEN

Jeder der in diesem Bericht aufgeführten Fonds (im Folgenden einzeln ein „Fonds“ und zusammen die „Fonds“) ist ein Teilfonds der PIMCO ETFs plc (die „Gesellschaft“), eine offene Umbrella-Investmentgesellschaft mit beschränkter Haftung, mit veränderlichem Kapital und getrennter Haftung zwischen den Fonds gemäß dem irischen Companies Act 2014 in der Rechtsform einer Aktiengesellschaft nach irischem Recht unter der Registernummer 489440. Die Gesellschaft wurde von der irischen Zentralbank (die „Zentralbank“) gemäß den European Communities (Undertakings for Collective Investment in Transferable Securities) Regulations von 2011 (Durchführungsverordnung Nr. 352 von 2011) in der jeweils geltenden Fassung (die „OGAW-Vorschriften“) zugelassen. Bei der Gesellschaft handelt es sich um eine Umbrella-Gesellschaft, die aus verschiedenen Fonds besteht, die jeweils eine oder mehrere Anteilsklassen umfassen. Nach dem Ermessen des Verwaltungsrats (der „Verwaltungsrat“ oder die „Verwaltungsratsmitglieder“) dürfen für einen Fonds mehrere Anteilsklassen („Klassen“) ausgegeben werden. Für jeden Fonds wird ein gesondertes Portfolio von Vermögenswerten unterhalten, das in Übereinstimmung mit dem Anlageziel und der Anlagepolitik dieses Fonds angelegt wird. Von Zeit zu Zeit darf der Verwaltungsrat mit vorheriger schriftlicher Zustimmung der Zentralbank weitere Fonds auflegen. Der Verwaltungsrat darf gemäß den Anforderungen der Zentralbank zu gegebener Zeit zusätzliche Klassen auflegen. Die Gesellschaft wurde am 24. September 2010 gegründet.

Bei den Fonds handelt es sich um börsengehandelte Fonds („ETFs“). Die Anteile der Fonds (wie im Verkaufsprospekt definiert) werden zu Marktpreisen an einer oder mehreren relevanten Börsen (wie im Verkaufsprospekt definiert) und anderen Sekundärmärkten notiert und gehandelt. Der Marktpreis für die Anteile der jeweiligen Fonds kann vom NIW des Fonds abweichen. In aller Regel dürfen nur befugte Teilnehmer (gemäß der im Verkaufsprospekt angegebenen Definition) von der Gesellschaft Anteile zum Nettoinventarwert kaufen. Befugte Teilnehmer können Anteile gegen Barmittel oder gegen eine Sacheinlage von Wertpapieren zeichnen, die dem Portfolio eines Fonds entsprechen (und als solche von den Anlageberatern anerkannt werden).

Der PIMCO Covered Bond UCITS ETF, der PIMCO Euro Low Duration Corporate Bond UCITS ETF, der PIMCO Euro Short-Term High Yield Corporate Bond Index UCITS ETF und der PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF werden an der Deutsche Börse AG gehandelt, und der PIMCO Emerging Markets Advantage Local Bond Index UCITS ETF, der PIMCO Sterling Short Maturity UCITS ETF, der PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF, der PIMCO US Low Duration Corporate Bond UCITS ETF und der PIMCO US Short-Term High Yield Corporate Bond Index UCITS ETF werden an der Euronext Dublin notiert und an der London Stock Exchange gehandelt.

PIMCO Global Advisors (Ireland) Ltd. (die „Verwaltungsgesellschaft“) ist die Verwaltungsgesellschaft der Gesellschaft.

Eingetragener Sitz der Gesellschaft ist 78 Sir John Rogerson's Quay, Dublin D02 HD32, Irland.

## 2. WESENTLICHE BILANZIERUNGSGRUNDSÄTZE

Die wesentlichen Bilanzierungs- und Bewertungsmethoden und Schätztechniken, die von der Gesellschaft übernommen und für die Erstellung des Abschlusses angewandt wurden, entsprechen denjenigen, die für den geprüften Jahresabschluss für das Geschäftsjahr zum 31. März 2021 (der „geprüfte Jahresabschluss“) verwendet wurden. Der Abschluss wird für alle Fonds auf Basis der Fortführung der Unternehmenstätigkeit erstellt.

### Bilanzierungsgrundlage

Bei dem vorliegenden Abschluss handelt es sich um den ungeprüften verkürzten Abschluss für den Sechsmonatszeitraum zum 30. September 2021. Er wurde gemäß Financial Reporting Standard („FRS“) 104: „Zwischenberichterstattung“, der vom Financial Reporting Council („FRC“) veröffentlicht wurde, sowie den OGAW-Vorschriften erstellt.

Der ungeprüfte verkürzte Abschluss sollte in Verbindung mit dem geprüften Jahresabschluss gelesen werden, der von den Abschlussprüfern ein uneingeschränktes Testat erhalten und gemäß den in Irland allgemein anerkannten Rechnungslegungsgrundsätzen (FRS 102) und den irischen Rechtsvorschriften, bestehend aus dem Companies Act von 2014 und den OGAW-Vorschriften, erstellt wurde. Bei den in Irland allgemein für die Erstellung von Rechnungsabschlüssen anerkannten Rechnungslegungsgrundsätzen handelt es sich um diejenigen, die vom FRC herausgegeben werden.

Die in die Gesamtergebnisrechnung (Statement of Total Recognised Gains and Losses) und die Eigenkapitalveränderungsrechnung (Reconciliation of Movements in Shareholders Funds) aufzunehmenden Informationen sind nach Auffassung des Verwaltungsrats in der Gewinn- und Verlustrechnung und der Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens enthalten.

Die Gesellschaft hat von der für offene Investmentfonds, die einen erheblichen Anteil ihres Vermögens in äußerst liquiden und zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen halten, verfügbaren Ausnahmeregelung gemäß Section 7 von FRS 102 Gebrauch gemacht und legt daher keine Kapitalflussrechnung vor.

Der Abschluss wird nach dem Anschaffungskostenprinzip erstellt, modifiziert durch die erfolgswirksame Neubewertung der gehaltenen finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten zum beizulegenden Zeitwert.

Alle Beträge wurden, sofern nicht anders angegeben, auf die nächsten Tausend gerundet. Ein Saldo von null kann auf die Rundung der tatsächlichen Beträge auf weniger als 1.000 zurückzuführen sein. Der Anlageplan bestimmter Fonds kann übertragbare Wertpapiere mit einem Nennwert von Null und einem beizulegenden Zeitwert von Null halten, wenn der tatsächliche Nennwert und der beizulegende Zeitwert auf die nächsten Tausend gerundet werden.

## 3. ANLAGEN ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT UND ZEITWERTHIERARCHIE

Die Gesellschaft ist verpflichtet, die Zeitwerthierarchie, in der Bewertungen zum beizulegenden Zeitwert für die finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten kategorisiert werden, offenzulegen. Diese Offenlegungen beruhen auf einer Zeitwerthierarchie mit drei Ebenen für die Parameter, die bei Bewertungstechniken zur Ermittlung des Zeitwertes verwendet werden.

Der beizulegende Zeitwert ist als der Betrag definiert, für den ein Vermögenswert zwischen sachverständigen, vertragswilligen Parteien im Rahmen einer Transaktion zu marktüblichen Konditionen getauscht, eine Verbindlichkeit beglichen oder ein Eigenkapitalinstrument übertragen werden konnte. Es muss eine Zeitwerthierarchie angegeben werden, gemäß der separat für jede Hauptkategorie von Vermögenswerten und Verbindlichkeiten Einstufungen von Bewertungen zum beizulegenden Zeitwert in verschiedene Ebenen vorzunehmen sind (Ebenen 1, 2 und 3). Die für die Bewertung von Wertpapieren verwendeten Parameter bzw. der verwendete Ansatz liefern nicht unbedingt einen Hinweis auf das mit einer Anlage in diesen Wertpapieren verbundene Risiko. Die Ebenen 1, 2 und 3 der Zeitwerthierarchie sind wie folgt definiert:

- Ebene 1 – Quotierte Preise auf aktiven Märkten oder Börsen für identische Vermögenswerte und Verbindlichkeiten.
- Ebene 2 – Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren. Hierzu können insbesondere quotierte Preise für ähnliche Vermögenswerte oder Verbindlichkeiten an Märkten, die aktiv sind, quotierte Preise für identische oder ähnliche Vermögenswerte und Verbindlichkeiten an Märkten, die nicht aktiv sind, andere Inputfaktoren als quotierte Preise, die für die Vermögenswerte und Verbindlichkeiten zu beobachten sind (wie zum Beispiel Zinssätze, Renditekurven, Volatilitäten, Tilgungsgeschwindigkeit, Verlustquoten, Kreditrisiken und Ausfallraten) oder andere bestätigte Inputfaktoren vom Markt zählen.
- Ebene 3 – Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren, die unter diesen Umständen auf bestmöglich verfügbaren Informationen beruhen, wenn beobachtbare Inputfaktoren nicht verfügbar sind, was zur Bestimmung des Marktwerts von Anlagen verwendete Annahmen des Verwaltungsrats oder anderer Personen, die auf dessen Weisung handeln, einschließen kann.

Eine Analyse der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten der einzelnen Fonds zum 30. September 2021 und zum 31. März 2021 ist der jeweiligen Aufstellung des Wertpapierbestands zu entnehmen. Die von den Fonds angewandte Methode zur Klassifizierung von finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, die mit einer Fair Value-Hierarchie zum beizulegenden Zeitwert bewertet wurden, entspricht der im geprüften Jahresabschluss angewandten Methode. Dies gilt nicht für bestimmte börsengehandelte Futures, wo Bewertungsanpassungen angewandt wurden, um die Marktbewegungen zwischen der Börsenabwicklung und dem NYSE-Abschluss zu berücksichtigen. Diese Wertpapiere werden anhand von Quoten bewertet, die von einem Quotierungssystem, einem etablierten Market-Maker oder von Preisinformationsdiensten bezogen werden. Finanzderivate, die diese Bewertungsanpassungen verwenden, werden als Stufe 2 klassifiziert.

## 4. EFFIZIENTES PORTFOLIOMANAGEMENT

Soweit gemäß den Anlagezielen und der Anlagepolitik der Fonds zulässig und vorbehaltlich der von Zentralbank von Zeit zu Zeit festgelegten Grenzen sowie vorbehaltlich der Bestimmungen des Verkaufsprospekts, dürfen derivative Finanzinstrumente und Anlagetechniken für die Zwecke eines effizienten Portfoliomanagements von allen Fonds eingesetzt werden. Die Fonds können diese derivativen Finanzinstrumente und Anlagetechniken zur Absicherung gegen Veränderungen der Zinsen, Wechselkurse der nicht funktionalen Währungen, Wertpapierkurse oder im Rahmen der übergeordneten Anlagestrategien anwenden.

Der Gesamtzinsbetrag/(-aufwand) aus Pensionsgeschäften belief sich im Berichtszeitraum zum 30. September 2021 auf € 13.184/(€ 983.913) (30. September 2020: € 77.380/(€ 465.993)).

Der Gesamtzinsbetrag/(-aufwand) aus umgekehrten Pensionsgeschäften belief sich im Geschäftsjahr zum 30. September 2021 auf € 10.333/(€ Null) (30. September 2020: € 19.735/(€ 530.031)).

Der Gesamtzinsbetrag/(-aufwand) aus Sale-Buy-Back-Transaktionen belief sich im Geschäftsjahr zum 30. September 2021 auf € Null/(€ 31) (30. September 2020: € Null/(€ 799)).

## 5. AUSSCHÜTTUNGSPOLITIK

Nach der aktuellen Ausschüttungspolitik der Gesellschaft wird den Inhabern von Anteilen ausschüttender Klassen ein etwaiger Nettoanlageertrag der Fonds ausgezahlt (dieser besteht aus Erträgen abzüglich Aufwendungen). Dividenden auf Anteile ausschüttender Anteilsklassen der Fonds werden monatlich beschlossen und nach Beschluss in bar ausgezahlt. Im Falle des PIMCO Covered Bond UCITS ETF werden für ausschüttende Anteilsklassen gezahlte Dividenden jährlich festgesetzt und nach der Festsetzung in bar ausgezahlt. Im Falle des PIMCO Euro Low Duration Corporate Bond UCITS ETF und des PIMCO US Low Duration Corporate Bond UCITS ETF werden auf etwaige ausschüttende Anteilsklassen gezahlte Dividenden quartalsmäßig festgesetzt und nach Festsetzung in bar ausbezahlt.

Die Nettoanlageerträge, die den Anteilen thesaurierender Klassen der Fonds zugewiesen werden, werden weder ausgewiesen noch ausgeschüttet. Der NIW je Anteil der thesaurierenden Klassen wird jedoch erhöht, um die Nettoanlageerträge zu berücksichtigen.

Jede Dividendenausschüttung, die nicht innerhalb eines Zeitraums von sechs Jahren ab dem Datum des Dividendenbeschlusses in Anspruch genommen wird, verjährt und fällt wieder dem jeweiligen Fonds zu.

## 6. VERRECHNUNGSPROVISIONEN (SOFT COMMISSIONS)

Die Gesellschaft bzw. ihre Anlageberatungsgesellschaft kann Transaktionen im Namen der Teilfonds über oder mit Unterstützung von Ausführungsmaklern durchführen, die zusätzlich zur routinemäßigen Order-Ausführung gelegentlich Güter, Dienstleistungen oder andere Vorteile wie etwa Research- und Beratungsdienste für die Gesellschaft oder ihre Beauftragten bereitstellen oder beschaffen können. Die Gesellschaft bzw. ihr Anlageberater kann diesen Maklern Full-Service-Maklergebühren zahlen, die teilweise für die Bereitstellung zulässiger Güter oder Dienstleistungen verwendet werden. Diese Anlageberater, bei denen es sich um Investmentgesellschaften gemäß der Richtlinie über Märkte für Finanzinstrumente (MiFID) oder äquivalenten regulatorischen

Rahmenbedingungen handelt, müssen Research-Leistungen Dritter, die sie im Zusammenhang mit der Verwaltung des Vermögens der einzelnen Fonds kaufen, direkt aus ihren eigenen Mitteln bezahlen.

## 7. GETRENNTE HAFTUNG

Die Gesellschaft ist eine offene Investmentgesellschaft des Umbrella-Typs mit variablem Kapital und Haftungstrennung zwischen ihren Teilfonds. Daher müssen Verbindlichkeiten, die in einem Fonds der Gesellschaft aufgelaufen sind oder die einem Fonds der Gesellschaft zuzuweisen sind, ausschließlich aus dem Vermögen dieses Fonds getilgt werden. Es ist den Fonds und den Verwaltungsratsmitgliedern, sowie Insolvenzverwaltern, Prüfern, Abwicklern oder sonstigen Personen untersagt, das Vermögen eines Fonds einzusetzen, um Verbindlichkeiten zu tilgen, die einem anderen Fonds entstanden sind oder die einem anderen Fonds zugewiesen werden. Sie dürfen auch nicht verpflichtet werden, das Vermögen eines Fonds einzusetzen, um Verbindlichkeiten zu tilgen, die einem anderen Fonds entstanden sind oder die einem anderen Fonds der Gesellschaft zugewiesen werden, unabhängig davon, wann eine solche Verbindlichkeit entstanden ist.

## 8. ÄNDERUNGEN IM VERKAUFSPROSPEKT, IN DER GRÜNDUNGSURKUNDE UND DER SATZUNG

Der Prospekt und die Ergänzungen der Gesellschaft wurden während des Berichtszeitraums nicht aktualisiert.

Das Memorandum und die Satzung der Gesellschaft wurden während des Berichtszeitraums nicht aktualisiert.

## 9. GEBÜHREN UND AUFWENDUNGEN

### (a) An die Verwaltungsgesellschaft zu zahlende Gebühren:

Die im Verkaufsprospekt beschriebenen, an die Verwaltungsgesellschaft zu zahlenden Gebühren dürfen 2,50 % p.a. des Nettoinventarwerts jedes Fonds nicht übersteigen.

### (b) Managementgebühr

Die Verwaltungsgesellschaft erbringt oder beschafft für jeden Fonds, wie im Verkaufsprospekt beschrieben, Anlageberatungs-, Administrations-, Verwah- und andere Dienstleistungen, wofür jeder Fonds eine einzelne Managementgebühr an die Verwaltungsgesellschaft zahlt. Die Managementgebühr für jeden Fonds fällt an jedem Handelstag (wie im Nachtrag des jeweiligen Fonds definiert) an und ist monatlich rückwirkend zahlbar. Die Verwaltungsgesellschaft kann die Managementgebühr vollständig oder teilweise an die Anlageberater zahlen, um die von den Anlageberatern erbrachten Anlageberatungs- und sonstigen Dienstleistungen zu vergüten, und damit die Anlageberater die von der Verwaltungsgesellschaft für die Fonds beschafften Administrations-, Verwah- und sonstigen Dienstleistungen bezahlen können.

Die Managementgebühr für jede Klasse der einzelnen Fonds (ausgedrückt als jährlicher Prozentsatz vom Nettoinventarwert) stellt sich wie folgt dar:

Fonds	(Abgesicherte) ausschüttende/ thesaurierende CHF-Klasse	Ausschüttende/ thesaurierende EUR-Klasse	(Abgesicherte) ausschüttende/ thesaurierende EUR-Klasse	Ausschüttende/ thesaurierende GBP-Klasse	(Abgesicherte) ausschüttende/ thesaurierende GBP-Klasse	Ausschüttende/ thesaurierende USD-Klasse
PIMCO Covered Bond UCITS ETF	-	0,43 %	-	-	-	-
PIMCO Emerging Markets Advantage Local Bond Index UCITS ETF	-	-	-	-	-	0,60 %
PIMCO Euro Low Duration Corporate Bond UCITS ETF	-	0,49 %	-	-	-	-
PIMCO Euro Short-Term High Yield Corporate Bond Index UCITS ETF	-	0,50 %	-	-	-	-
PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF	-	0,35 %	-	-	-	-
PIMCO Sterling Short Maturity UCITS ETF	-	-	-	0,35 %	-	-
PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF	-	-	-	-	0,40 %	0,35 %*
PIMCO US Low Duration Corporate Bond UCITS ETF	0,54 %	-	-	-	-	0,49 %
PIMCO US Short-Term High Yield Corporate Bond Index UCITS ETF	0,60 %	-	0,60 %	-	0,60 %	0,55 %*

Die Managementgebühr für alle Teilfonds blieb gegenüber dem 31. März 2021 unverändert.

Angesichts des Fixcharakters der Managementgebühr trägt die Verwaltungsgesellschaft, nicht die Anteilsinhaber, das Risiko von Preissteigerungen bei den von der Managementgebühr abgedeckten Dienstleistungen sowie das Risiko, dass die Aufwendungen in Bezug auf solche Dienstleistungen infolge eines Rückgangs des Nettovermögens die Höhe der Managementgebühr übersteigen. Umgekehrt würde die Verwaltungsgesellschaft, und nicht die Anteilsinhaber, von einem Preisrückgang bei den von der Managementgebühr abgedeckten Kosten profitieren, zum Beispiel bei einem Rückgang der Aufwendungen infolge eines Anstiegs des Nettovermögens.

### (c) Anlageberatungsdienstleistungen

Die Verwaltungsgesellschaft erbringt und/oder beschafft im Auftrag der Gesellschaft Anlageberatungsdienstleistungen. Solche Dienstleistungen beinhalten die Anlage und Wiederanlage der Vermögenswerte der einzelnen Fonds. Die Gebühren der Anlageberater und der Vertriebsstelle (sowie die gegebenenfalls darauf anfallende Mehrwertsteuer) werden von der Verwaltungsgesellschaft aus der Managementgebühr gezahlt.

## Anmerkungen zum Abschluss (Fortsetzung)

### (d) Administrations-, Verwah- und Sonstige Dienstleistungen

Die Verwaltungsgesellschaft erbringt und/oder beschafft im Auftrag der Gesellschaft Administrations-, Verwah- und andere Dienstleistungen. Zu diesen Dienstleistungen gehören Administrations- und Transferstellenfunktionen, Fondsbuchhaltung sowie die Funktion als Verwahrstelle und Unterverwahrstelle in Bezug auf die einzelnen Fonds. Die Gebühren und Aufwendungen des Administrators und der Depotbank (sowie die gegebenenfalls darauf anfallende Mehrwertsteuer) werden von der aus der Managementgebühr oder von den Anlageberatern gezahlt.

Die Verwaltungsgesellschaft erbringt und/oder beschafft im Auftrag der Gesellschaft bestimmte andere Dienstleistungen. Dazu gehören u. a. Listing-Sponsor-Dienste, Zahlstellen- und andere lokale Vertreterdienstleistungen, Rechnungslegung, Prüfung, Rechtsberatung und andere Fachberatungsleistungen, Sekretärdienstleistungen, Druck-, Veröffentlichungs- und Übersetzungskosten sowie die Bereitstellung und Koordinierung von aufsichtsrechtlichen, administrativen und aktionärsbezogenen Dienstleistungen, die für den Betrieb der Fonds erforderlich sind. Die Gebühren und ordentlichen Aufwendungen in Zusammenhang mit diesen Dienstleistungen (sowie die gegebenenfalls darauf anfallende Mehrwertsteuer) werden von der Verwaltungsgesellschaft oder von den Anlageberatern im Auftrag der Verwaltungsgesellschaft aus der Managementgebühr gezahlt.

### (e) Transaktionsbezogene Gebühren

Der Verwaltungsrat kann in seinem Ermessen den Anteilinhabern berechnen:

Fonds	Zeichnungs-/Rücknahmegebühr	Umtauschgebühr	Transaktionsgebühr für Sachübertragungen	Mischgebühren
PIMCO Covered Bond UCITS ETF	bis zu 3 %	bis zu 1 %	€ bis zu 1.000	Bis zu 1.000 EUR Transaktionsgebühr für Sachübertragungen zzgl. eines Höchstbetrages von 3 % auf etwaige Baranteile
PIMCO Emerging Markets Advantage Local Bond Index UCITS ETF	bis zu 3 %	bis zu 1 %	\$ bis zu 1.000	500 USD zzgl. eines Höchstbetrages von 3 % auf etwaige Baranteile
PIMCO Euro Low Duration Corporate Bond UCITS ETF	bis zu 3 %	bis zu 1 %	€ bis zu 1.000	Bis zu 1.000 EUR Transaktionsgebühr für Sachübertragungen zzgl. eines Höchstbetrages von 3 % auf etwaige Baranteile
PIMCO Euro Short-Term High Yield Corporate Bond Index UCITS ETF	bis zu 3 %	bis zu 1 %	\$ bis zu 1.000	500 USD zzgl. eines Höchstbetrages von 3 % auf etwaige Baranteile
PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF	bis zu 3 %	bis zu 1 %	€ bis zu 1.000	500 EUR zzgl. eines Höchstbetrages von 3 % auf etwaige Baranteile
PIMCO Sterling Short Maturity UCITS ETF	bis zu 3 %	bis zu 1 %	£ bis zu 1.000	500 USD zzgl. eines Höchstbetrages von 3 % auf etwaige Baranteile
PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF	bis zu 3 %	bis zu 1 %	\$ bis zu 1.000	500 USD zzgl. eines Höchstbetrages von 3 % auf etwaige Baranteile
PIMCO US Low Duration Corporate Bond UCITS ETF	bis zu 3 %	bis zu 1 %	\$ bis zu 1.000	Bis zu 1.000 USD Transaktionsgebühr für Sachübertragungen zzgl. eines Höchstbetrages von 3 % auf etwaige Baranteile
PIMCO US Short-Term High Yield Corporate Bond Index UCITS ETF	bis zu 3 %	bis zu 1 %	\$ bis zu 1.000	500 USD zzgl. eines Höchstbetrages von 3 % auf etwaige Baranteile

### (f) Aufwandsbegrenzung (einschließlich Verzicht auf Managementgebühr und Rückerstattung)

Die Verwaltungsgesellschaft hat im Rahmen des Managementvertrags zwischen der Gesellschaft und der Verwaltungsgesellschaft vom 09. Dezember 2010 in der jeweils geltenden Fassung mit der Gesellschaft vereinbart, die gesamten jährlichen Fondsbetriebskosten für sämtliche Klassen eines Fonds zu kontrollieren, indem sie ihre Managementgebühr gänzlich oder teilweise erlässt, bzw. insoweit (und so lange) reduziert oder rückerstattet, wie diese Betriebskosten und anteiligen Verwaltungsrats Honorare die Summe der Managementgebühr der Klasse des entsprechenden Fonds (vor Anwendung eines möglichen Verzichts auf die Managementgebühr) und der sonstigen von der Anteilsklasse des entsprechenden Fonds getragenen Aufwendungen, die nicht wie oben beschrieben von der Managementgebühr abgedeckt sind (außer anteilige Verwaltungsrats Honorare), zuzüglich 0,0049 % pro Jahr (täglich auf Grundlage des NIW des Fonds berechnet), übersteigen.

## 10. TRANSAKTIONEN MIT NAHE STEHENDEN UNTERNEHMEN UND PERSONEN

Die Verwaltungsgesellschaft, die Anlageberater, die Vertriebsstelle und die Verwaltungsratsmitglieder sind nahe stehende Unternehmen bzw. Personen. Die an diese Unternehmen bzw. Personen zu zahlenden Gebühren sind ggf. in Anmerkung 9 angegeben.

Jeder der Fonds kann in die anderen Fonds des Unternehmens und/oder andere kollektive Kapitalanlagen investieren, die vom Anlageberater oder mit dem Anlageberater verbundenen Unternehmen verwaltet werden („verbundener Fonds“).

Der PIMCO Euro Low Duration Corporate Bond UCITS ETF legt zum 30. September 2021, zum 31. März 2021 und zum 30. September 2020 in Anteile des PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF an.

Die Fonds übernehmen sonstige Aufwendungen im Zusammenhang mit ihrem Betrieb, die nicht von der Managementgebühr abgedeckt werden und die variieren und die Gesamthöhe der Aufwendungen der Fonds beeinflussen können. Hierzu zählen unter anderem Steuern und staatliche Abgaben, Maklergebühren, Provisionen und sonstige Transaktionskosten (einschließlich u. a. Gebühren und Aufwendungen in Verbindung mit Due-Diligence-Prüfungen für Anlagen und potenzielle Anlagen und/oder in Verbindung mit der Aushandlung solcher Transaktionen), Fremdfinanzierungskosten einschließlich Zinsaufwand, Gründungskosten, außerordentliche Aufwendungen (wie Prozesskosten und Schadenersatzleistungen) sowie die Gebühren und Aufwendungen der unabhängigen Verwaltungsratsmitglieder der Gesellschaft sowie ihrer Berater.

Die Gesellschaft hat den unabhängigen Verwaltungsratsmitgliedern im Berichtszeitraum zum 30. September 2021 ein Honorar in Höhe von € 21.300 gezahlt (30. September 2020: € 21.300). Darüber hinaus erhält jedes unabhängige Verwaltungsratsmitglied eine Erstattung für sämtliche angemessenen Spesen. Nicht-unabhängige Direktoren haben keinen Anspruch auf eine gesonderte Vergütung für ihre Leitung der Fonds. Das Honorar der Verwaltungsratsmitglieder wird unter der Position „Sonstige Kosten“ in der Gewinn- und Verlustrechnung erfasst.

In jedem Geltungsmonat des Verwaltungsvertrags kann die Verwaltungsgesellschaft gemäß dem Verwaltungsvertrag von einem Fonds einen Teil der Verwaltungsgebühren, auf die sie in den vorangegangenen 36 Monaten verzichtet, die sie gemindert oder zurückerstattet hat, zurückerlangen (den „Rückerstattungsbetrag“), sofern ein solcher an die Verwaltungsgesellschaft gezahlter Betrag nicht: 1) höher ist als 0,0049 % per annum der Klasse des jeweiligen durchschnittlichen Nettovermögens des Fonds (auf Tagesbasis berechnet); 2) höher ist als der gesamte Rückerstattungsbetrag; 3) Beträge enthält, die der Verwaltungsgesellschaft bereits zuvor erstattet wurden; bzw. 4) bewirkt, dass eine Klasse eines Fonds eine negative Nettorendite aufweist.

Die in der Gewinn- und Verlustrechnung ausgewiesenen Verwaltungsgebühren werden vor Abzug einer eventuellen Befreiung von der Verwaltungsgebühr angesetzt. Die Befreiung von der Verwaltungsgebühr wird von den Anlageberatern in der Gewinn- und Verlustrechnung im Rahmen der Kostenerstattung anerkannt. Die Verwaltungsgebühr wird an den Manager ohne die Verzichtserklärung gezahlt.

Im Berichtszeitraum zum 30. September 2021 und zum 30. September 2020 führten die nachstehenden Fonds Wertpapierkäufe und -verkäufe mit verbundenen Fonds, Wertpapierkäufe und -verkäufe in Verbindung mit Cross-Investments und Wertpapierkäufe und -verkäufe von Anlagen in verbundenen Fonds durch (Beträge in Tausend):

Fonds	30. Sept. 2021		30. Sept. 2020	
	Käufe	Verkäufe	Käufe	Verkäufe
PIMCO Covered Bond UCITS ETF	€ 0	€ 0	€ 104	€ 3.935
PIMCO Emerging Markets Advantage Local Bond Index UCITS ETF	0	3.779	6.504	843
PIMCO Euro Low Duration Corporate Bond UCITS ETF	103	1.435	4.993	0
PIMCO Euro Short-Term High Yield Corporate Bond Index UCITS ETF	0	0	712	1.299
PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF	137.877	1.908	114.876	56.122
PIMCO Sterling Short Maturity UCITS ETF	18.398	0	10.471	23.220
PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF	190.002	152.854	293.011	105.157
PIMCO US Low Duration Corporate Bond UCITS ETF	683	87	0	1.879
PIMCO US Short-Term High Yield Corporate Bond Index UCITS ETF	47.640	48.674	21.883	0

In der folgenden Tabelle sind die im Umlauf befindlichen Anteile angegeben, die von PIMCO-Fonds gehalten werden: Global Investor Series plc, PIMCO Select Funds plc und PIMCO Cayman Trust, der Gesellschaft zum 30. September 2021 bzw. zum 31. März 2021 nahe stehende Unternehmen:

Fonds	30. Sept. 2021 % im Besitz	31. März 2021 % im Besitz
PIMCO Euro Short-Term High Yield Corporate Bond Index UCITS ETF	14,41	14,97
PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF	48,32	49,37
PIMCO Sterling Short Maturity UCITS ETF	25,60	41,24
PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF	74,93	85,98

#### Beteiligungen der Verwaltungsratsmitglieder und des Sekretärs an Anteilen und Verträgen

Weder die Verwaltungsratsmitglieder noch der Sekretär hielten während der Geschäftsjahre zum 30. September 2021 und zum 30. September 2020 Beteiligungen an Anteilen der Gesellschaft.

Keines der Verwaltungsratsmitglieder hat einen Dienstvertrag mit der Gesellschaft.

#### 11. TRANSAKTIONEN MIT VERBUNDENEN PERSONEN

Transaktionen, die mit der Verwaltungsgesellschaft oder Verwahrstelle eines OGAW, den Beauftragten oder Unterbeauftragten einer solchen Verwaltungsgesellschaft oder Verwahrstelle (unter Ausschluss von konzernfremden, von einer Verwahrstelle bestellten Unterverwahrstellen) oder angeschlossenen Unternehmen oder Konzerngesellschaften einer solchen Verwaltungsgesellschaft, Verwahrstelle oder von entsprechenden Beauftragten oder Unterbeauftragten („verbundene Personen“) durchgeführt werden, müssen so durchgeführt werden, als wären sie unter gewöhnlichen geschäftlichen Bedingungen ausgehandelt worden, und nur dann, wenn sie im besten Interesse der Anteilhaber sind. Der Verwaltungsrat hat sich vergewissert, dass (durch schriftliche Verfahren belegte) Vorkehrungen getroffen wurden, um sicherzustellen, dass Transaktionen mit verbundenen Parteien wie vorstehend beschrieben ausgeführt werden und dass die entsprechenden Vorgaben im Berichtszeitraum eingehalten wurden.

#### 12. WECHSELKURSE

Für die Zwecke der Zusammenfassung der Abschlüsse zur Ermittlung der Zahlen der Gesellschaft (wie nach irischem Unternehmensrecht erforderlich) sind die Beträge in der Vermögensaufstellung zu dem am 30. September 2021 gültigen Wechselkurs von US-Dollar in Euro (USD/EUR 0,86285) (31. März 2021 USD/EUR 0,85085) und von GBP in Euro (GBP/EUR 1,16342) (31. März 2021 GBP/EUR 1,17391) umgerechnet worden. Die Beträge in der Gewinn- und Verlustrechnung und in der Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens wurden zu einem durchschnittlichen Wechselkurs für den Berichtszeitraum zum 30. September 2021 von US-Dollar in Euro (USD/EUR 0,83922) (31. März 2021 USD/EUR 0,85838) und vom britischen Pfund in Euro (GBP/EUR 1,16466) (31. März 2021 GBP/EUR 1,12086) umgerechnet.

Die folgenden Tabellen geben die für die Umrechnung der Anlagen und sonstigen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, die auf von der funktionalen Währung des jeweiligen Fonds abweichende Währungen lauten, in Pfund Sterling, Euro und US-Dollar, die funktionalen Währungen von Fonds der Gesellschaft, verwendeten Wechselkurse wieder.

Die Wechselkurse für den argentinischen Peso („ARS“) zum 30. September 2021 beinhalten einen Abschlag von 80 % (31. März 2021: 61 %) aufgrund einer Differenz zwischen den offiziellen und inoffiziellen Wechselkursen Argentiniens.

Fremdwährungen	30. Sept. 2021 Darstellungswährung		
	EUR	GBP	USD
ARS	-	-	178,05000
AUD	1,60442	-	1,38437
BRL	-	-	5,44890
CAD	-	1,70816	1,26685
CHF	1,08113	1,25781	0,93285
CLP	-	-	812,20000
CNH	-	-	6,45400
CNY	-	-	6,46215
COP	-	-	3.811,93000
CZK	25,34299	-	-
DKK	7,43594	-	-
DOP	-	-	56,30000
EUR (oder €)	1,00000	1,16342	0,86285
GBP (oder £)	0,85953	1,00000	0,74165
IDR	-	-	14.312,50000
ILS	3,73895	-	3,22615
INR	-	-	74,22750
JPY (oder ¥)	129,30985	150,44219	111,57500
MXN	23,81005	-	20,54450
MYR	-	-	4,18650
PHP	-	-	51,01000
PLN	-	-	3,97125
RUB	-	-	72,78500
SEK	10,13913	11,79611	-
SGD	-	-	1,35760
THB	-	-	33,83500
TRY	-	-	8,88425
USD (oder \$)	1,15895	1,34835	1,00000
ZAR	-	-	15,04500

Fremdwährungen	31. März 2021 Darstellungswährung		
	EUR	GBP	USD
ARS	-	-	145,48000
AUD	1,54310	-	1,31294
BRL	-	-	5,64300
CAD	-	1,73408	1,25685
CHF	1,10613	1,29851	0,94115
CLP	-	-	718,40000
CNH	-	-	6,56120
CNY	-	-	6,55500
COP	-	-	3.675,00000
CZK	26,12003	-	-
DKK	7,43724	-	-
DOP	-	-	56,72000
EUR (oder €)	1,00000	1,17391	0,85085
GBP (oder £)	0,85185	1,00000	0,72480
IDR	-	-	14.525,00000
ILS	3,91927	-	3,33470
INR	-	-	73,11375



## Anmerkungen zum Abschluss (Fortsetzung)

Fremdwährungen	31. März 2021 Darstellungswährung		
	EUR	GBP	USD
JPY (oder ¥)	129,87059	152,45690	110,50000
MXN	24,04721	-	20,46050
MYR	-	-	4,14650
PHP	-	-	48,53750
PLN	-	-	3,94600
RUB	-	-	75,51875
SEK	10,24426	12,02588	-
SGD	-	-	1,34360
THB	-	-	31,25000
TRY	-	-	8,27625
USD (oder \$)	1,17530	1,37970	1,00000
ZAR	-	-	14,76625

### 13. FINANZRISIKEN

Durch ihre Aktivitäten sind die Fonds verschiedenen finanziellen Risiken ausgesetzt, z. B. dem Marktrisiko (einschließlich Preisrisiko, Zinsrisiko und Währungsrisiko), dem Kreditrisiko und dem Liquiditätsrisiko. Der allgemeine Risikomanagementprozess für die Fonds konzentriert sich auf die Unvorhersehbarkeit der Finanzmärkte und versucht, potenziell nachteilige Effekte auf die finanzielle Entwicklung der Fonds zu minimieren.

Die Zielsetzungen und Richtlinien des Finanzrisikomanagements der Gesellschaft entsprechen auch weiterhin denjenigen, die im geprüften Jahresabschluss der Gesellschaft für das Geschäftsjahr zum 31. März 2021 angegeben sind.

### 14. GRUNDKAPITAL

#### (a) Genehmigtes Kapital

Das genehmigte Grundkapital der Gesellschaft wird repräsentiert durch 2 rückkaufbare, nicht gewinnberechtigende Anteile ohne Nennwert sowie 500.000.000.000 gewinnberechtigende Anteile ohne Nennwert, die als nicht klassifizierte Anteile ausgewiesen werden

#### (b) Zeichneranteile

Die Zeichneranteile zählen nicht zum Nettoinventarwert der Gesellschaft und werden daher nur in dieser Anmerkung im Anhang des Abschlusses angegeben. Diese Offenlegung spiegelt nach Ansicht des Verwaltungsrats das Wesen der Geschäftstätigkeit der Gesellschaft als Investmentfonds wider.

#### (c) Rückkaufbare, gewinnberechtigende Anteile

Das Kapital aus ausgegebenen rückkaufbaren, gewinnberechtigenden Anteilen entspricht zu jedem Zeitpunkt dem Nettoinventarwert der Fonds. Rückkaufbare, gewinnberechtigende Anteile sind auf Wunsch der Anteilsinhaber zurückzunehmen und werden als finanzielle Verbindlichkeiten ausgewiesen.

### 15. NETTOINVENTARWERT

Das den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigender Anteile zuzurechnende Nettovermögen jedes Fonds, die ausgegebenen und im Umlauf befindlichen Anteile und der NIW je Anteil für die letzten drei Berichtszeiträume stellt sich wie folgt dar (Beträge in Tsd., außer Angaben je Anteil). Der in diesem Abschluss veröffentlichte NIW je Anteil kann gemäß FRS 102 erforderliche Anpassungen beinhalten, wodurch der Nettoinventarwert oder die Gesamttrenditen der Anteilsinhaber von jenen abweichen können, die in diesem Abschluss veröffentlicht werden. Das Nettovermögen geteilt durch die ausgegebenen und umlaufenden Anteile entspricht aufgrund von Rundungen möglicherweise nicht genau dem NIW je Anteil.

	Zum		
	30. Sept. 2021	31. März 2021	31. März 2020
	<b>PIMCO Covered Bond UCITS ETF</b>		
Nettovermögen	€ 51.392	€ 62.614	€ 111.462
EUR ausschüttend	€ 51.392	€ 62.614	€ 111.462
Ausgegebene und im Umlauf befindliche Anteile	451	547	1.000
NIW je Anteil	€ 113,84	€ 114,46	€ 111,46

	Zum		Zum		Zum	
	30. Sept. 2021	31. März 2021	30. Sept. 2021	31. März 2021	30. Sept. 2020	31. März 2020
	<b>PIMCO Emerging Markets Advantage Local Bond Index UCITS ETF</b>					
Nettovermögen	\$ 197.273	\$ 259.226	\$ 197.273	\$ 259.226	\$ 332.805	\$ 332.805
USD thesaurierend	\$ 107.978	\$ 140.805	\$ 107.978	\$ 140.805	\$ 232.243	\$ 232.243

Ausgegebene und im Umlauf befindliche Anteile	1.025	1.358	1.025	1.358	2.501	2.501
NIW je Anteil	\$ 105,30	\$ 103,72	\$ 105,30	\$ 103,72	\$ 92,86	\$ 92,86
USD ausschüttend	\$ 89.295	\$ 118.421	\$ 89.295	\$ 118.421	\$ 100.562	\$ 100.562
Ausgegebene und im Umlauf befindliche Anteile	1.250	1.646	1.250	1.646	1.504	1.504
NIW je Anteil	\$ 71,43	\$ 71,94	\$ 71,43	\$ 71,94	\$ 66,86	\$ 66,86

	Zum		Zum		Zum	
	30. Sept. 2021	31. März 2021	30. Sept. 2021	31. März 2021	30. Sept. 2020	31. März 2020
	<b>PIMCO Euro Low Duration Corporate Bond UCITS ETF</b>					
Nettovermögen	€ 253.031	€ 256.027	€ 253.031	€ 256.027	€ 289.835	€ 289.835
EUR ausschüttend	€ 253.031	€ 256.027	€ 253.031	€ 256.027	€ 289.835	€ 289.835
Ausgegebene und im Umlauf befindliche Anteile	2.402	2.433	2.402	2.433	2.919	2.919
NIW je Anteil	€ 105,32	€ 105,23	€ 105,32	€ 105,23	€ 99,29	€ 99,29

	Zum		Zum		Zum	
	30. Sept. 2021	31. März 2021	30. Sept. 2021	31. März 2021	30. Sept. 2020	31. März 2020
	<b>PIMCO Euro Short-Term High Yield Corporate Bond Index UCITS ETF</b>					
Nettovermögen	€ 109.070	€ 104.595	€ 109.070	€ 104.595	€ 101.865	€ 101.865
EUR thesaurierend	€ 46.270	€ 51.246	€ 46.270	€ 51.246	€ 54.390	€ 54.390
Ausgegebene und im Umlauf befindliche Anteile	4.268	4.805	4.268	4.805	6.125	6.125
NIW je Anteil	€ 10,84	€ 10,66	€ 10,84	€ 10,66	€ 8,88	€ 8,88
EUR ausschüttend	€ 62.800	€ 53.349	€ 62.800	€ 53.349	€ 47.475	€ 47.475
Ausgegebene und im Umlauf befindliche Anteile	6.365	5.428	6.365	5.428	5.644	5.644
NIW je Anteil	€ 9,87	€ 9,83	€ 9,87	€ 9,83	€ 8,41	€ 8,41

	Zum		Zum		Zum	
	30. Sept. 2021	31. März 2021	30. Sept. 2021	31. März 2021	30. Sept. 2020	31. März 2020
	<b>PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF</b>					
Nettovermögen	€ 2.806.062	€ 2.441.381	€ 2.806.062	€ 2.441.381	€ 2.481.678	€ 2.481.678
EUR thesaurierend	€ 1.352.600	€ 1.078.934	€ 1.352.600	€ 1.078.934	€ 518.558	€ 518.558
Ausgegebene und im Umlauf befindliche Anteile	13.853	11.030	13.853	11.030	5.352	5.352
NIW je Anteil	€ 97,64	€ 97,82	€ 97,64	€ 97,82	€ 96,89	€ 96,89
EUR ausschüttend	€ 1.453.462	€ 1.362.447	€ 1.453.462	€ 1.362.447	€ 1.963.120	€ 1.963.120
Ausgegebene und im Umlauf befindliche Anteile	14.624	13.681	14.624	13.681	19.904	19.904
NIW je Anteil	€ 99,39	€ 99,58	€ 99,39	€ 99,58	€ 98,63	€ 98,63

	Zum		Zum		Zum	
	30. Sept. 2021	31. März 2021	30. Sept. 2021	31. März 2021	30. Sept. 2020	31. März 2020
	<b>PIMCO Sterling Short Maturity UCITS ETF</b>					
Nettovermögen	£ 300.290	£ 160.971	£ 300.290	£ 160.971	£ 172.151	£ 172.151
GBP ausschüttend	£ 300.290	£ 160.971	£ 300.290	£ 160.971	£ 172.151	£ 172.151
Ausgegebene und im Umlauf befindliche Anteile	2.920	1.566	2.920	1.566	1.697	1.697
NIW je Anteil	£ 102,85	£ 102,80	£ 102,85	£ 102,80	£ 101,47	£ 101,47

	Zum		Zum		Zum	
	30. Sept. 2021	31. März 2021	30. Sept. 2021	31. März 2021	30. Sept. 2020	31. März 2020
	<b>PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF</b>					
Nettovermögen	\$ 5.241.961	\$ 4.373.218	\$ 5.241.961	\$ 4.373.218	\$ 3.277.273	\$ 3.277.273
GBP (abgesichert) thesaurierend	£ 763	£ 762	£ 763	£ 762	£ 246	£ 246
Ausgegebene und im Umlauf befindliche Anteile	8	8	8	8	3	3
NIW je Anteil	£ 100,92	£ 100,77	£ 100,92	£ 100,77	£ 98,21	£ 98,21
USD ausschüttend	\$ 5.240.932	\$ 4.372.166	\$ 5.240.932	\$ 4.372.166	\$ 3.276.969	\$ 3.276.969
Ausgegebene und im Umlauf befindliche Anteile	51.609	43.080	51.609	43.080	33.000	33.000
NIW je Anteil	\$ 101,55	\$ 101,49	\$ 101,55	\$ 101,49	\$ 99,30	\$ 99,30

	Zum		Zum		Zum	
	30. Sept. 2021	31. März 2021	30. Sept. 2021	31. März 2021	30. Sept. 2020	31. März 2020
	<b>PIMCO US Low Duration Corporate Bond UCITS ETF</b>					
Nettovermögen	\$ 99.454	\$ 101.665	\$ 99.454	\$ 101.665	\$ 145.163	\$ 145.163
CHF (abgesichert) thesaurierend	CHF 7.372	CHF 7.548	CHF 7.372	CHF 7.548	CHF 9.256	CHF 9.256
Ausgegebene und im Umlauf befindliche Anteile	70	72	70	72	93	93
NIW je Anteil	CHF 105,69	CHF 105,48	CHF 105,69	CHF 105,48	CHF 100,01	CHF 100,01
USD ausschüttend	\$ 91.551	\$ 93.646	\$ 91.551	\$ 93.646	\$ 135.596	\$ 135.596
Ausgegebene und im Umlauf befindliche Anteile	866	884	866	884	1.343	1.343
NIW je Anteil	\$ 105,70	\$ 105,91	\$ 105,70	\$ 105,91	\$ 100,97	\$ 100,97

	Zum 30. Sept. 2021	Zum 31. März 2021	Zum 31. März 2020
<b>PIMCO US Short-Term High Yield Corporate Bond Index UCITS ETF</b>			
Nettvermögen	\$ 1.483.699	\$ 1.473.121	\$ 1.119.510
CHF (abgesichert) thesaurierend	CHF 7.373	CHF 9.825	CHF 10.644
Ausgegebene und im Umlauf befindliche Anteile	64	87	112
NIW je Anteil	CHF 114,82	CHF 112,46	CHF 94,68
EUR (abgesichert) thesaurierend	€ 100.899	€ 80.551	€ 48.716
Ausgegebene und im Umlauf befindliche Anteile	933	761	548
NIW je Anteil	€ 108,15	€ 105,83	€ 88,91
EUR (abgesichert) ausschüttend	€ 685.444	€ 675.411	€ 591.723
Ausgegebene und im Umlauf befindliche Anteile	8.195	8.073	7.996
NIW je Anteil	€ 83,64	€ 83,67	€ 74,00
GBP (abgesichert) ausschüttend	£ 64.896	£ 57.422	£ 30.817
Ausgegebene und im Umlauf befindliche Anteile	6.740	5.982	3.649
NIW je Anteil	£ 9,63	£ 9,60	£ 8,45
USD thesaurierend	\$ 160.065	\$ 147.302	\$ 91.363
Ausgegebene und im Umlauf befindliche Anteile	1.197	1.130	845
NIW je Anteil	\$ 133,77	\$ 130,38	\$ 108,12
USD ausschüttend	\$ 316.893	\$ 347.672	\$ 276.214
Ausgegebene und im Umlauf befindliche Anteile	3.180	3.501	3.186
NIW je Anteil	\$ 99,64	\$ 99,30	\$ 86,71

## 16. VERGÜTUNG

Die Vergütungspolitik der Verwaltungsgesellschaft entspricht den maßgeblichen OGAW-Vorschriften und ist im Verkaufsprospekt zusammengefasst.

Einzelheiten zur Vergütung der Verwaltungsgesellschaft sowie damit verbundene finanzielle Angaben werden im geprüften Jahresabschluss für das Geschäftsjahr zum 31. März 2022 enthalten sein.

## 17. REGULATORISCHE ANGELEGENHEITEN UND RECHTSSTREITIGKEITEN

Die Gesellschaft ist an keinen wesentlichen Rechtsstreitigkeiten oder Schiedsgerichtsverfahren als Beklagter benannt, und ihm sind etwaige solche gegen ihn bestehenden oder drohenden wesentlichen Rechtsstreitigkeiten oder Schadensersatzforderungen nicht bekannt.

Vorgenanntes ist lediglich zum Datum dieses Berichts gültig.

## 18. VERORDNUNG ÜBER WERTPAPIERFINANZIRUNGSGESCHÄFTE

Die Verordnung über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte („SFTR“) führt Berichts- und Angabepflichten für Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (Securities Financing Transactions, SFTs) und Total Return Swaps ein. SFTs sind gemäß Artikel 3(11) der SFTR ausdrücklich folgendermaßen definiert:

- Pensionsgeschäfte / umgekehrte Pensionsgeschäfte
- Ver- oder Entleihe von Wertpapieren oder Rohstoffen
- Buy-Sellback- oder Sale-Buyback-Geschäfte
- Lombardgeschäfte

### (a) Globale Daten und Konzentration von SFT-Kontrahenten

Zum 30. September 2021 hielten die Fonds Total Return Swaps und die folgenden Arten von SFTs:

- Pensionsgeschäfte
- Umgekehrte Pensionsgeschäfte

Der beizulegende Zeitwert der Vermögenswerte/(Verbindlichkeiten) gestaltete sich zum 30. September 2021 über alle SFTs und Total Return Swaps hinweg gruppiert nach Arten von SFTs und den zehn größten Kontrahenten wie folgt (wenn weniger als zehn Kontrahenten verwendet werden, sind alle Kontrahenten aufgeführt).

Fonds	30. Sept. 2021	
	Beizulegender Zeitwert (in Tsd.)	% des Nettvermögens
<b>PIMCO Emerging Markets Advantage Local Bond Index UCITS ETF</b>		
Pensionsgeschäfte		
FICC	\$ 867	0,44
<b>PIMCO Euro Low Duration Corporate Bond UCITS ETF</b>		
Pensionsgeschäfte		
BPS	€ 6.900	2,73
FICC	96	0,03
<b>Insgesamt</b>	<b>6.996</b>	<b>2,76</b>
<b>PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF</b>		
Pensionsgeschäfte		
COM	€ 194.300	6,92
<b>PIMCO Sterling Short Maturity UCITS ETF</b>		
Pensionsgeschäfte		
SCX	£ 21.600	7,19
<b>PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF</b>		
Pensionsgeschäfte		
BPS	\$ 25.400	0,49
BSN	90.300	1,72
FICC	2.572	0,05
<b>Insgesamt</b>	<b>118.272</b>	<b>2,26</b>
<b>PIMCO US Low Duration Corporate Bond UCITS ETF</b>		
Pensionsgeschäfte		
SSB	\$ 574	0,58
<b>PIMCO US Short-Term High Yield Corporate Bond Index UCITS ETF</b>		
Total Return Swaps		
BPS	\$ 9	0,00
GST	199	0,01
<b>Insgesamt</b>	<b>208</b>	<b>0,01</b>
Pensionsgeschäfte		
FICC	6.791	0,46
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
JML	(783)	(0,05)

Zum 31. März 2021 hielten die Fonds die folgenden Arten von SFTs:

- Pensionsgeschäfte
- Umgekehrte Pensionsgeschäfte

Der beizulegende Zeitwert der Vermögenswerte/(Verbindlichkeiten) gestaltete sich zum 31. März 2021 über alle SFTs hinweg gruppiert nach Arten von SFTs und den zehn größten Kontrahenten wie folgt (wenn weniger als zehn Kontrahenten verwendet werden, sind alle Kontrahenten aufgeführt).

Fonds	31. März 2021	
	Beizulegender Zeitwert (in Tsd.)	% des Nettvermögens
<b>PIMCO Euro Low Duration Corporate Bond UCITS ETF</b>		
Pensionsgeschäfte		
BPS	€ 14.400	5,62
<b>PIMCO Euro Short-Term High Yield Corporate Bond Index UCITS ETF</b>		
Pensionsgeschäfte		
BRC	€ 221	0,21
CFR	180	0,17
<b>Insgesamt</b>	<b>401</b>	<b>0,38</b>
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BRC	(220)	(0,21)
CFR	(176)	(0,17)
<b>Insgesamt</b>	<b>(396)</b>	<b>(0,38)</b>
<b>PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF</b>		
Pensionsgeschäfte		
COM	€ 124.900	5,12
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
CFR	(1.032)	(0,04)

## Anmerkungen zum Abschluss (Fortsetzung)

Fonds	31. März 2021	
	Beizulegender Zeitwert (in Tsd.)	% des Nettovermögens
<b>PIMCO Sterling Short Maturity UCITS ETF</b> Pensionsgeschäfte BRC	£ 5.300	3,29
<b>PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF</b> Pensionsgeschäfte FICC	\$ 17.377	0,40
<b>PIMCO US Short-Term High Yield Corporate Bond Index UCITS ETF</b> Pensionsgeschäfte FICC	\$ 8.476	0,57
Umgekehrte Pensionsgeschäfte JML	(7.361)	(0,50)

### (b) Sicherheiten

#### (i) Verwahrung erhaltener Sicherheiten:

Die zum 30. September 2021 und zum 31. März 2021 erhaltenen Sicherheiten werden im Depotbanknetz von State Street Bank and Trust im Auftrag der Verwahrstelle gehalten.

#### (ii) Konzentrationsdaten:

Die zehn größten Emittenten für die im Rahmen aller SFTs zum 30. September 2021 erhaltenen Wertpapiersicherheiten gestalteten sich wie folgt. Wenn weniger als zehn Emittenten vorliegen, sind sämtliche Emittenten nachfolgend aufgeführt:

Fonds	30. Sept. 2021	
	Emittent der Sicherheit	Beizulegender Zeitwert (in Tsd.)
PIMCO Emerging Markets Advantage Local Bond Index UCITS ETF	Regierung der USA	\$ 884
PIMCO Euro Low Duration Corporate Bond UCITS ETF	Republic of Germany	€ 6.887
	Regierung der USA	98
PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF	NRW Bank	193.959

#### (iii) Aggregierte Transaktionsdaten:

Die aggregierten Transaktionsdaten für im Rahmen sämtlicher SFTs und Total Return Swaps erhaltene Sicherheitenpositionen gestalteten sich zum 30. September 2021 wie folgt:

Fonds	Wertpapierart	Beschreibung der Sicherheit	Art der Sicherheit	Beizulegender Zeitwert (in Tsd.)	Qualität	Fälligkeitsprofil der Sicherheiten	Währung der Sicherheiten	Gründungsland des Kontrahenten	Abwicklung und Clearing
PIMCO Emerging Markets Advantage Local Bond Index UCITS ETF	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	\$ 884	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	USA	FED, bilateral
PIMCO Euro Low Duration Corporate Bond UCITS ETF	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	€ 98	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	USA	FED, bilateral
		Republic of Germany	Treasury	6.887	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, bilateral
PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF	Pensionsgeschäfte	NRW Bank	Unternehmen	193.959	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Deutschland	FED, bilateral
PIMCO Sterling Short Maturity UCITS ETF	Pensionsgeschäfte	Britischer Gilt	Treasury	£ 21.581	AA-	Mehr als 1 Jahr	GBP	Vereinigtes Königreich	FED, bilateral
PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bonds	Treasury	\$ 92.201	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Kanada	FED, bilateral
		U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	25.968	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	2.624	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	USA	FED, bilateral
PIMCO US Low Duration Corporate Bond UCITS ETF	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	586	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	USA	FED, bilateral
PIMCO US Short-Term High Yield Corporate Bond Index UCITS ETF	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Barmittel	270	-	-	USD	Vereinigtes Königreich	FED, bilateral
	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	6.927	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	USA	FED, bilateral

Fonds	30. Sept. 2021	
	Emittent der Sicherheit	Beizulegender Zeitwert (in Tsd.)
PIMCO Sterling Short Maturity UCITS ETF	Regierung des Vereinigten Königreichs	£ 21.581
PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF	Regierung der USA	\$ 120.793
PIMCO US Low Duration Corporate Bond UCITS ETF	Regierung der USA	586
PIMCO US Short-Term High Yield Corporate Bond Index UCITS ETF	Regierung der USA	6.927

Die zehn größten Emittenten für die im Rahmen aller SFTs zum 31. März 2021 erhaltenen Wertpapiersicherheiten gestalteten sich wie folgt. Wenn weniger als zehn Emittenten vorliegen, sind sämtliche Emittenten nachfolgend aufgeführt:

Fonds	31. März 2021	
	Emittent der Sicherheit	Beizulegender Zeitwert (in Tsd.)
PIMCO Euro Low Duration Corporate Bond UCITS ETF	Regierung der Niederlande	€ 14.238
PIMCO Euro Short-Term High Yield Corporate Bond Index UCITS ETF	Bundesregierung Deutschland	383
PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF	European Investment Bank	47.853
	KfW	77.059
PIMCO Sterling Short Maturity UCITS ETF	Regierung des Vereinigten Königreichs	£ 5.273
PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF	Regierung der USA	\$ 17.725
PIMCO US Short-Term High Yield Corporate Bond Index UCITS ETF	Regierung der USA	8.646



Die aggregierten Transaktionsdaten für im Rahmen sämtlicher SFTs erhaltene Sicherheitenpositionen gestalteten sich zum 31. März 2021 wie folgt:

Fonds	Wertpapierart	Beschreibung der Sicherheit	Art der Sicherheit	Beizulegender Zeitwert (in Tsd.)	Qualität	Fälligkeitsprofil der Sicherheiten	Währung der Sicherheiten	Gründungsland des Kontrahenten	Abwicklung und Clearing
PIMCO Euro Low Duration Corporate Bond UCITS ETF	Pensionsgeschäfte	Netherlands Government International Bond	Treasury	€ 14.238	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, bilateral
PIMCO Euro Short-Term High Yield Corporate Bond Index UCITS ETF	Pensionsgeschäfte	Republic of Germany	Treasury	170	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Vereinigtes Königreich	FED, bilateral
		Republic of Germany	Treasury	213	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Vereinigtes Königreich	FED, bilateral
PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF	Pensionsgeschäfte	European Investment Bank	Supranational	47.853	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Deutschland	FED, bilateral
		KFW	Unternehmen	77.059	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Deutschland	FED, bilateral
PIMCO Sterling Short Maturity UCITS ETF	Pensionsgeschäfte	Britischer Gilt	Treasury	£ 5.273	AA-	Mehr als 1 Jahr	GBP	Vereinigtes Königreich	FED, bilateral
PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	\$ 17.725	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	USA	FED, bilateral
PIMCO US Short-Term High Yield Corporate Bond Index UCITS ETF	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	8.646	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	USA	FED, bilateral

Der beizulegende Zeitwert der Sicherheiten aus Pensionsgeschäften umfasst aufgelaufene Zinsen. Rahmenterminverträge decken eine Kombination von Buy-Sellback-Geschäften, Sale-Buyback-Geschäften und sonstigen oben nicht enthaltenen Finanzierungsgeschäften ab. Der Gesamtbetrag der für alle im Rahmen dieser Vereinbarungen abgeschlossenen Geschäfte zum 30. September 2021 und zum 31. März 2021 erhaltenen Sicherheiten ist in den obigen Angaben enthalten. Es ist nicht möglich, die Sicherheiten für die einzelnen SFT jeweils getrennt zu analysieren.

ISDA-Vereinbarungen decken eine Kombination von Swap-Kontrakten ab, und der Gesamtbetrag der Sicherheiten für diese Vereinbarungen ist in den obigen Angaben enthalten.

Ein Teil der angegebenen Sicherheiten bezieht sich auf Derivate, die nicht unter die SFTR fallen.

### (c) Renditen/Kosten

Die nachfolgenden Tabellen enthalten detaillierte Daten über die Renditen und die Kosten für jede Art von SFT während der Berichtszeiträume zum 30. September 2021 und zum 30. September 2020. Die Beträge sind in der Basiswährung des Fonds angegeben.

Fonds:	Berichtszeitraum zum 30. September 2021					
	Pensionsgeschäfte		Umgekehrte Pensionsgeschäfte		Sale-Buyback-Finanzierungsgeschäfte	
	Renditen (in Tsd.)	Kosten (in Tsd.)	Renditen (in Tsd.)	Kosten (in Tsd.)	Renditen (in Tsd.)	Kosten (in Tsd.)
PIMCO Euro Low Duration Corporate Bond UCITS ETF	€ 0	€ 34	€ 0	€ 0	€ 0	€ 0
PIMCO Euro Short-Term High Yield Corporate Bond Index UCITS ETF	0	1	2	0	0	0
PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF	0	949	2	0	0	0
PIMCO Sterling Short Maturity UCITS ETF	£ 4	£ 0	£ 0	£ 0	£ 0	£ 0
PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF	\$ 9	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0
PIMCO US Short-Term High Yield Corporate Bond Index UCITS ETF	1	0	8	0	0	0

Fonds:	Berichtszeitraum zum 30. September 2020					
	Pensionsgeschäfte		Umgekehrte Pensionsgeschäfte		Sale-Buyback-Finanzierungsgeschäfte	
	Renditen (in Tsd.)	Kosten (in Tsd.)	Renditen (in Tsd.)	Kosten (in Tsd.)	Renditen (in Tsd.)	Kosten (in Tsd.)
PIMCO Covered Bond UCITS ETF	€ 0	€ 5	€ 0	€ 0	€ 0	€ 0
PIMCO Euro Low Duration Corporate Bond UCITS ETF	0	29	3	0	0	0
PIMCO Euro Short-Term High Yield Corporate Bond Index UCITS ETF	0	0	12	0	0	0
PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF	0	433	0	0	0	0
PIMCO Sterling Short Maturity UCITS ETF	£ 2	£ 0	£ 0	£ 0	£ 0	£ 0
PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF	\$ 48	\$ 0	\$ 5	\$ 596	\$ 0	\$ 0
PIMCO US Low Duration Corporate Bond UCITS ETF	1	0	0	4	0	0
PIMCO US Short-Term High Yield Corporate Bond Index UCITS ETF	36	0	0	0	0	0

Sämtliche Renditen aus SFT-Derivattransaktionen fallen dem Fonds an und fallen nicht unter Ertragsteilungsvereinbarungen mit der Verwaltungsgesellschaft der Gesellschaft oder sonstigen Dritten.

Für Total Return Swaps lassen sich die Transaktionskosten nicht separat identifizieren. Für diese Anlagen sind die Transaktionskosten im Kauf- und Verkaufspreis enthalten und bilden Teil des Bruttoanlageergebnisses jedes Fonds. Renditen werden als realisierte Gewinne und Veränderungen der nicht realisierten Gewinne auf den Swap-Kontrakt während des Berichtszeitraums identifiziert und sind in der Gewinn- und Verlustrechnung im realisierten Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten und in der Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(Wertverlustes) aus derivativen Finanzinstrumenten enthalten.

#### 19. TRACKING ERROR

In der folgenden Tabelle ist der Tracking Error für jeden passiven Fonds in den Berichtszeiträumen zum 30. September 2021 und 30. September 2020 ausgewiesen. Der Tracking Error wird in den Richtlinien der Europäischen Wertpapieraufsichtsbehörde („ESMA“) als die Volatilität der Differenz zwischen der Jahresrendite des indexabbildenden OGAW und der Jahresrendite des Index oder der Indizes, die abgebildet werden, definiert. Jeder dieser Fonds entwickelte sich innerhalb des angestrebten Tracking Error.

Fonds	Tracking Error: 30. September 2021	Tracking Error: 30. September 2020
PIMCO Emerging Markets Advantage Local Bond Index UCITS ETF	0,57 %	0,46 %
PIMCO Euro Short-Term High Yield Corporate Bond Index UCITS ETF	0,18 %	0,67 %
PIMCO US Short-Term High Yield Corporate Bond Index UCITS ETF	0,31 %	0,69 %

#### 20. WESENTLICHE EREIGNISSE

Seit Januar 2020 verzeichnen die globalen Finanzmärkte aufgrund der Ausbreitung eines neuartigen Coronavirus namens COVID-19 erhebliche Volatilität und könnten dies auch weiterhin tun. Der Ausbruch von COVID-19 hat zu Reise- und Grenzbeschränkungen, Quarantänen, Unterbrechungen von Lieferketten, geringerer Verbrauchernachfrage und allgemeiner Marktunsicherheit geführt. Die Auswirkungen von COVID-19 halten an und können weiterhin negative Auswirkungen auf die Weltwirtschaft, die Volkswirtschaften bestimmter Länder und einzelne Emittenten haben. Aufgrund von COVID-19 gab es bisher keine nennenswerten Auswirkungen auf die Fonds.

Am 01. Juli 2021 änderte sich die eingetragene Adresse der Verwaltungsgesellschaft von 78 Sir John Rogerson's Quay, Dublin 2, D02 HD32, Irland in Third Floor, Harcourt Building, Harcourt Street, Dublin, D02 F721, Irland.

Außer den vorstehend aufgeführten gab es während des Berichtszeitraums keine wesentlichen Ereignisse.

#### 21. EREIGNISSE NACH ABLAUF DES BERICHTSZEITRAUMS

Es gab keine signifikanten Ereignisse nach dem Ende des Berichtszeitraums.

#### 22. GENEHMIGUNG DES ABSCHLUSSES

Der Abschluss wurde vom Verwaltungsrat am 26. Oktober 2021 genehmigt.

BESCHREIBUNG	NENNWERT (in Tsd.)		KOSTEN (in Tsd.)		BESCHREIBUNG	NENNWERT (in Tsd.)		ERLÖSE (in Tsd.)	
<b>KÄUFE BIS 30. SEPTEMBER 2021</b>					<b>VERKÄUFE BIS 30. SEPTEMBER 2021</b>				
United Overseas Bank Ltd. 0,100 % due 25.05.2029	€	3.100	€	3.097	Vseobecna Uverova Banka A/S 0,010 % due 24.03.2026	€	2.900	€	2.933
Deutsche Pfandbriefbank AG 1,050 % due 26.04.2024	€	2.400		2.839	Stadshypotek AB 0,010 % due 24.11.2028		2.900		2.921
Liberbank S.A. 0,250 % due 25.09.2029	€	2.800		2.834	Nationwide Building Society 1,125 % due 31.05.2028		2.600		2.830
Bank of Montreal 0,050 % due 08.06.2029		2.800		2.799	DNB Boligkreditt A/S 0,010 % due 21.01.2031		2.800		2.787
AyT Cédulas Cajas Fondo de Titulización de Activos 3,750 % due 30.06.2025		2.400		2.798	U.S. Treasury Notes 1,125 % due 15.02.2031	\$	2.700		2.245
Aareal Bank AG 1,050 % due 29.04.2025	€	2.000		2.366	Commonwealth Bank of Australia 0,875 % due 19.02.2029	€	2.050		2.180
Realkredit Danmark A/S 1,500 % due 01.10.2050	DKK	17.300		2.336	Aareal Bank AG 0,625 % due 14.02.2025	\$	2.600		2.149
Nykredit Realkredit A/S 1,500 % due 01.10.2050		17.000		2.295	Deutsche Pfandbriefbank AG 1,050 % due 26.04.2024	€	1.400		1.677
NIBC Bank NV 0,125 % due 21.04.2031	€	1.500		1.514	Caixa Economica Montepio Geral Caixa Economica Bancaria S.A. 0,125 % due 14.11.2024	€	1.600		1.619
AIB Mortgage Bank 5,000 % due 12.02.2030		950		1.353	Santander UK PLC 0,050 % due 12.01.2027		1.600		1.612
Bank of Nova Scotia 1,050 % due 14.03.2025	€	700		836	Caisse Francaise de Financement Local 5,500 % due 16.07.2026	€	1.100		1.571
Royal Bank of Canada 1,050 % due 14.09.2026	\$	900		759	Aareal Bank AG 1,050 % due 29.04.2025		1.000		1.194
Canadian Imperial Bank of Commerce 0,381 % due 14.09.2026	AUD	500		312	AMCO - Asset Management Co. SpA 2,625 % due 13.02.2024	€	1.000		1.067
Sumitomo Mitsui Banking Corp. 0,409 % due 07.11.2029	€	300		309	United Overseas Bank Ltd. 0,100 % due 25.05.2029		900		903
Coventry Building Society 0,010 % due 07.07.2028		300		300	Cajamar Caja Rural SCC 0,875 % due 18.06.2023		800		819
Mexico Government International Bond 2,250 % due 12.08.2036		300		298	AyT Cédulas Cajas Fondo de Titulización de Activos 3,750 % due 30.06.2025		700		811
Jyske Realkredit A/S 1,500 % due 01.10.2050	DKK	2.000		266	Liberbank S.A. 0,250 % due 25.09.2029		800		809
Nykredit Realkredit A/S 1,500 % due 01.10.2053		1.900		251	Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 0,875 % due 08.10.2027		700		730
SpareBank Boligkreditt A/S 0,010 % due 08.09.2028	€	100		101	Volkswagen Bank GmbH 1,875 % due 31.01.2024		600		629
HSBC Bank Canada 0,010 % due 14.09.2026		100		101	Sumitomo Mitsui Banking Corp. 0,409 % due 07.11.2029		600		613
					Deutsche Bank AG 0,050 % due 20.11.2024		600		606
					Clydesdale Bank PLC 0,010 % due 22.09.2026		600		604
					Bank of Montreal 0,050 % due 08.06.2029		600		601
					Korea Housing Finance Corp. 0,010 % due 07.07.2025		500		505
					Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd. 0,010 % due 15.10.2027		500		499
					PITCH 5,125 % due 20.07.2022		400		424
					Van Lanschot Kempen NV 0,875 % due 15.02.2059		400		424
					mBank Hipoteczny S.A. 0,242 % due 15.09.2025		400		406
					Bank of Queensland Ltd. 0,125 % due 04.06.2024		400		406

Wesentliche Veränderungen des Portfolios sind definiert als Käufe, deren Wert 1 % der Gesamtkosten der Käufe übersteigt, sowie Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse übersteigen. Es sind mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe anzugeben. Wenn weniger Transaktionen durchgeführt wurden, sind alle derartigen Transaktionen anzugeben.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Barmittel des Fonds verwendet werden können und die in der Regel am nächsten Geschäftstag fällig werden, und bis zur Endfälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums ihre Fälligkeit erreicht haben, wurden nicht in die Darstellung der wesentlichen Veränderungen der Portfoliozusammensetzung aufgenommen.

BESCHREIBUNG		NENNWERT (in Tsd.)	KOSTEN (in Tsd.)	BESCHREIBUNG		NENNWERT (in Tsd.)	ERLÖSE (in Tsd.)
<b>KÄUFE BIS 30. SEPTEMBER 2021</b>				<b>VERKÄUFE BIS 30. SEPTEMBER 2021</b>			
Mexico Government International Bond 8,500 % due 31.05.2029	MXN	180.000	\$ 9.927	Mexico Government International Bond 8,000 % due 05.09.2024	MXN	210.110	\$ 11.147
Poland Government International Bond 0,000 % due 25.04.2023	PLN	34.700	9.001	China Government Bond 2,880 % due 05.11.2023	CNY	66.300	10.290
Russia Government International Bond 6,700 % due 14.03.2029	RUB	590.000	7.971	Mexico Government International Bond 8,500 % due 31.05.2029	MXN	155.829	8.674
Mexico Government International Bond 8,000 % due 05.09.2024	MXN	149.800	7.956	Malaysia Government International Bond 3,620 % due 30.11.2021	MYR	31.100	7.636
Brazil Letras do Tesouro Nacional 0,000 % due 01.07.2024	BRL	33.100	4.806	Brazil Letras do Tesouro Nacional 0,000 % due 01.07.2023	BRL	39.900	6.306
China Government International Bond 2,840 % due 08.04.2024	CNY	25.200	3.914	Russia Government International Bond 6,000 % due 06.10.2027	RUB	455.300	5.917
Brazil Letras do Tesouro Nacional 0,000 % due 01.07.2023	BRL	23.300	3.891	Brazil Government International Bond 12,500 % due 05.01.2022	BRL	26.800	5.279
Bonos de la Tesorería de la Republica en Pesos 4,500 % due 01.03.2026	CLP	2.340.000	3.623	Brazil Letras do Tesouro Nacional 0,000 % due 01.01.2024		31.200	4.843
Colombian TES 10,000 % due 24.07.2024	COP	10.668.300	3.383	Brazil Letras do Tesouro Nacional 0,000 % due 01.07.2024		31.400	4.808
Bonos de la Tesorería de la Republica en pesos 5,000 % due 01.10.2028	CLP	2.330.000	3.181	Philippines Government International Bond 3,900 % due 26.11.2022	PHP	217.000	4.341
Poland Government International Bond 2,750 % due 25.10.2029	PLN	9.700	2.790	China Government International Bond 2,840 % due 08.04.2024	CNY	25.200	3.919
China Government Bond 2,710 % due 19.06.2027	CNY	17.600	2.707	Russia Government International Bond 7,750 % due 16.09.2026	RUB	258.800	3.687
Brazil Government International Bond 12,500 % due 05.01.2022	BRL	12.584	2.471	South Africa Government International Bond 8,875 % due 28.02.2035	ZAR	48.020	3.099
Russia Government International Bond 7,650 % due 10.04.2030	RUB	164.400	2.338	Colombian TES 7,000 % due 30.06.2032	COP	11.614.100	3.037
Israelische Schatzanleihen 0,004 % due 08.06.2022	ILS	7.200	2.205	Poland Government International Bond 2,500 % due 25.07.2027	PLN	9.378	2.663
Brazil Notas do Tesouro Nacional 10,000 % due 01.01.2031	BRL	10.600	2.136	Brazil Letras do Tesouro Nacional 0,000 % due 01.10.2022	BRL	15.600	2.657
China Government Bond 3,810 % due 14.09.2050	CNY	12.800	2.077	China Government Bond 2,360 % due 02.07.2023	CNY	16.800	2.597
China Government Bond 2,860 % due 16.07.2030		13.400	2.026	Russia Government International Bond 4,500 % due 16.07.2025	RUB	199.043	2.513
South Africa Government International Bond 8,750 % due 31.01.2044	ZAR	30.200	1.782	Russia Government International Bond 6,900 % due 23.05.2029		182.300	2.480
Russia Government International Bond 7,000 % due 25.01.2023	RUB	119.000	1.649	Russia Government International Bond 7,400 % due 17.07.2024		179.000	2.446
Thailand Government International Bond 3,400 % due 17.06.2036	THB	44.800	1.629	Russia Government International Bond 7,650 % due 10.04.2030		164.400	2.385
Thailand Government International Bond 2,000 % due 17.06.2042		50.000	1.491	Poland Government International Bond 2,750 % due 25.10.2029	PLN	8.115	2.323
Mexico Government International Bond 5,750 % due 05.03.2026	MXN	30.700	1.487	China Government Bond 3,250 % due 06.06.2026	CNY	13.800	2.181
Colombian TES 7,500 % due 26.08.2026	COP	5.192.200	1.428	Russia Government International Bond 5,700 % due 17.05.2028	RUB	165.500	2.109
South Africa Government International Bond 8,250 % due 31.03.2032	ZAR	22.100	1.414	Indonesia Government International Bond 10,250 % due 15.07.2027	IDR	22.668.000	1.924
Russia Government International Bond 8,500 % due 17.09.2031	RUB	91.400	1.375	Russia Government International Bond 7,700 % due 16.03.2039	RUB	129.875	1.851
China Government Bond 3,720 % due 12.04.2051	CNY	8.000	1.266	Mexico Government International Bond 8,500 % due 18.11.2038	MXN	32.640	1.769
Brazil Letras do Tesouro Nacional 0,000 % due 01.01.2024	BRL	7.500	1.198	Mexico Government International Bond 8,000 % due 07.11.2047		33.000	1.656
Poland Government International Bond 2,750 % due 25.04.2028	PLN	3.500	1.021	Russia Government International Bond 7,000 % due 25.01.2023	RUB	119.000	1.634
Colombian TES 6,250 % due 26.11.2025	COP	3.637.900	987	Russia Government International Bond 8,500 % due 17.09.2031		106.490	1.594
China Government Bond 2,360 % due 02.07.2023	CNY	6.300	973	Colombian TES 10,000 % due 24.07.2024	COP	5.333.100	1.558
				Bonos de la Tesorería de la Republica en Pesos 4,500 % due 01.03.2026	CLP	1.145.000	1.533
				South Africa Government International Bond 8,750 % due 31.01.2044	ZAR	26.420	1.501
				China Government Bond 2,640 % due 13.08.2022	CNY	9.000	1.409

Wesentliche Veränderungen des Portfolios sind definiert als Käufe, deren Wert 1 % der Gesamtkosten der Käufe übersteigt, sowie Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse übersteigen. Es sind mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe anzugeben. Wenn weniger Transaktionen durchgeführt wurden, sind alle derartigen Transaktionen anzugeben.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Barmittel des Fonds verwendet werden können und die in der Regel am nächsten Geschäftstag fällig werden, und bis zur Endfälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums ihre Fälligkeit erreicht haben, wurden nicht in die Darstellung der wesentlichen Veränderungen der Portfoliozusammensetzung aufgenommen.

BESCHREIBUNG	NENNWERT (in Tsd.)	KOSTEN (in Tsd.)	BESCHREIBUNG	NENNWERT (in Tsd.)	ERLÖSE (in Tsd.)
<b>KAUFE BIS 30. SEPTEMBER 2021</b>			<b>VERKAUFE BIS 30. SEPTEMBER 2021</b>		
Euronext NV 0,125 % due 17.05.2026	€ 4.000	€ 3.996	General Electric Co. 0,375 % due 17.05.2022	€ 2.700	€ 2.712
Deutsche Bank AG 1,000 % due 19.11.2025	2.900	2.956	Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd. 1,250 % due 14.04.2022	2.500	2.529
Goldman Sachs Group, Inc. 0,010 % due 30.04.2024	2.700	2.701	Takeda Pharmaceutical Co. Ltd. 0,750 % due 09.07.2027	1.800	1.833
General Electric Co. 0,875 % due 17.05.2025	2.500	2.573	Deutsche Bank AG 1,500 % due 20.01.2022	1.700	1.718
Bank of Nova Scotia 1,049 % due 22.06.2026	£ 2.100	2.533	Telecom Italia SpA 5,875 % due 19.05.2023	£ 1.300	1.644
Sofina S.A. 1,000 % due 23.09.2028	€ 2.400	2.381	ArcelorMittal S.A. 1,000 % due 19.05.2023	€ 1.600	1.625
JDE Peet's NV 0,000 % due 16.01.2026	2.300	2.288	Goldman Sachs Group, Inc. 0,002 % due 21.04.2023	1.500	1.503
Becton Dickinson and Co. 0,000 % due 13.08.2023	2.200	2.206	G4S International Finance PLC 1,500 % due 09.01.2023	1.300	1.300
Credit Suisse AG 0,250 % due 05.01.2026	2.000	1.996	Syngenta Finance NV 1,875 % due 02.11.2021	1.200	1.204
Telecom Italia SpA 2,750 % due 15.04.2025	1.600	1.695	Immobiliare Grande Distribuzione SIQ SpA 2,125 % due 28.11.2024	1.100	1.094
HSBC Holdings PLC 0,456 % due 24.09.2026	1.500	1.530	Deutsche Bank AG 4,250 % due 14.10.2021	\$ 1.300	1.081
Nexi SpA 1,625 % due 30.04.2026	1.300	1.300	Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB 1,125 % due 04.09.2026	€ 900	921
Indigo Group S.A.S. 2,125 % due 16.04.2025	1.200	1.283	Daimler International Finance BV 2,000 % due 22.08.2026	800	878
Ferrari NV 1,500 % due 27.05.2025	1.200	1.252	AT&T, Inc. 1,600 % due 19.05.2028	800	855
Expedia Group, Inc. 2,500 % due 03.06.2022	1.200	1.224	FCE Bank PLC 1,134 % due 10.02.2022	800	804
Takeda Pharmaceutical Co. Ltd. 1,125 % due 21.11.2022	1.200	1.223	Valeo S.A. 1,000 % due 03.08.2028	800	800
Wells Fargo & Co. 0,500 % due 26.04.2024	1.200	1.220	Jaguar Land Rover Automotive PLC 4,500 % due 15.07.2028	700	710
Alfa Laval Treasury International AB 1,375 % due 12.09.2022	1.200	1.220	Nissan Motor Co. Ltd. 4,345 % due 17.09.2027	\$ 700	624
Syngenta Finance NV 3,375 % due 16.04.2026	1.100	1.212	Bank of Ireland Group PLC 0,750 % due 08.07.2024	€ 600	611
Hamburg Commercial Bank AG 0,500 % due 22.09.2026	1.200	1.202	LeasePlan Corp. NV 0,125 % due 13.09.2023	600	604
Worley U.S. Finance Sub Ltd. 0,875 % due 09.06.2026	1.100	1.103	International Game Technology PLC 3,500 % due 15.06.2026	500	516
Becton Dickinson and Co. 0,034 % due 13.08.2025	1.100	1.100	NorteGas Energia Distribucion S.A. 0,905 % due 22.01.2031	500	490
Vonovia SE 0,375 % due 16.06.2027	1.000	999			
Castellum AB 0,750 % due 04.09.2026	900	906			
Sagax Euro MTN BV 1,000 % due 17.05.2029	900	900			
CTP NV 0,500 % due 21.06.2025	900	900			
Mutuelle Assurance Des Commerçants et Industriels de France et Des Cadres et Sal 0,625 % due 21.06.2027	900	897			
Valeo S.A. 1,000 % due 03.08.2028	800	801			
AIB Group PLC 0,500 % due 17.11.2027	800	799			
Credit Suisse Group AG 1,250 % due 17.07.2025	700	721			
Zuercher Kantonalbank 0,000 % due 15.05.2026	700	704			
Jaguar Land Rover Automotive PLC 4,500 % due 15.07.2028	700	700			
John Lewis PLC 6,125 % due 21.01.2025	£ 500	660			
Dell Bank International DAC 1,625 % due 24.06.2024	€ 600	627			

Wesentliche Veränderungen des Portfolios sind definiert als Käufe, deren Wert 1 % der Gesamtkosten der Käufe übersteigt, sowie Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse übersteigen. Es sind mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe anzugeben. Wenn weniger Transaktionen durchgeführt wurden, sind alle derartigen Transaktionen anzugeben.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Barmittel des Fonds verwendet werden können und die in der Regel am nächsten Geschäftstag fällig werden, und bis zur Endfälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums ihre Fälligkeit erreicht haben, wurden nicht in die Darstellung der wesentlichen Veränderungen der Portfoliozusammensetzung aufgenommen.

BESCHREIBUNG	NENNWERT (in Tsd.)	KOSTEN (in Tsd.)	BESCHREIBUNG	NENNWERT (in Tsd.)	ERLÖSE (in Tsd.)
<b>KÄUFE BIS 30. SEPTEMBER 2021</b>			<b>VERKÄUFE BIS 30. SEPTEMBER 2021</b>		
Bayer AG 3,750 % due 01.07.2074	€ 900	€ 955	ArcelorMittal S.A. 1,000 % due 19.05.2023	€ 600	€ 609
G4S International Finance PLC 1,500 % due 09.01.2023	600	599	METRO AG 1,375 % due 28.10.2021	363	365
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 1,875 % due 09.01.2026	450	444	CaixaBank S.A. 3,750 % due 15.02.2029	300	324
Valeo S.A. 1,625 % due 18.03.2026	400	416	Intesa Sanpaolo SpA 2,625 % due 20.06.2024	300	323
Crown European Holdings S.A. 4,000 % due 15.07.2022	400	410	Aroundtown S.A. 3,375 % due 23.09.2024	300	318
Bayer AG 2,375 % due 12.11.2079	400	407	Cellnex Telecom S.A. 3,125 % due 27.07.2022	300	311
Douglas GmbH 6,000 % due 08.04.2026	400	403	CaixaBank S.A. 3,375 % due 15.03.2027	300	308
ADLER Real Estate AG 1,500 % due 17.04.2022	400	398	CaixaBank S.A. 1,000 % due 25.06.2024	300	308
Teollisuuden Voima Oyj 1,125 % due 09.03.2026	380	385	Intesa Sanpaolo SpA 0,625 % due 24.02.2026	300	303
Infrastrutture Wireless Italiane SpA 1,875 % due 08.07.2026	350	367	Berry Global, Inc. 1,000 % due 15.01.2025	295	300
Vodafone Group PLC 2,625 % due 27.08.2080	350	365	Rolls-Royce PLC 2,125 % due 18.06.2021	270	270
Vallourec S.A. 8,500 % due 30.06.2026	340	355	Intesa Sanpaolo SpA 6,625 % due 13.09.2023	200	227
Deutsche Bank AG 4,500 % due 19.05.2026	300	346	UniCredit SpA 4,875 % due 20.02.2029	200	218
CT Investment GmbH 5,500 % due 15.04.2026	335	344	Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 3,625 % due 24.09.2024	200	213
Sigma Holdco BV 5,750 % due 15.05.2026	340	328	Electricite de France S.A. 4,000 % due 04.07.2024	200	213
AIB Group PLC 2,875 % due 30.05.2031	300	321	Banco de Credito Social Cooperativo S.A. 7,750 % due 07.06.2027	200	212
Ford Motor Credit Co. LLC 2,386 % due 17.02.2026	300	317	Vodafone Group PLC 3,100 % due 03.01.2079	200	208
MPT Operating Partnership LP 4,000 % due 19.08.2022	300	310	Leonardo SpA 5,250 % due 21.01.2022	200	207
Veolia Environnement S.A. 2,250 % due 20.01.2026	300	308	Caixa Geral de Depositos S.A. 1,250 % due 25.11.2024	200	207
Deutsche Lufthansa AG 3,000 % due 29.05.2026	300	301	Credito Valtellinese SpA 2,000 % due 27.11.2022	200	207
Wintershall Dea Finance BV 2,499 % due 20.04.2026	300	301	Newell Brands, Inc. 3,750 % due 01.10.2021	200	205
Nexi SpA 1,625 % due 30.04.2026	300	300	Modulaire Global Finance PLC 6,500 % due 15.02.2023	200	204
Renault S.A. 2,375 % due 25.05.2026	300	300	ArcelorMittal S.A. 0,950 % due 17.01.2023	200	202
Coty, Inc. 4,750 % due 15.04.2026	300	293	Renault S.A. 1,000 % due 08.03.2023	200	202
SoftBank Group Corp. 4,500 % due 20.04.2025	250	279	Nomad Foods Bondco PLC 3,250 % due 15.05.2024	200	202
Credito Emiliano SpA 1,500 % due 25.10.2025	250	258	thyssenkrupp AG 1,375 % due 03.03.2022	200	201
Picard Groupe S.A.S. 3,875 % due 01.07.2026	250	256	Goodyear Europe BV 3,750 % due 15.12.2023	200	201
ELM BV for Firmenich International S.A. 3,750 % due 03.09.2025	219	239	Dufry One BV 2,500 % due 15.10.2024	200	198
			Sealed Air Corp. 4,500 % due 15.09.2023	165	178
			eDreams ODIGEO S.A. 5,500 % due 01.09.2023	175	175
			Mausier Packaging Solutions Holding Co. 4,750 % due 15.04.2024	160	161
			Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 5,375 % due 18.01.2028	180	151
			Crown European Holdings S.A. 4,000 % due 15.07.2022	130	133

Wesentliche Veränderungen des Portfolios sind definiert als Käufe, deren Wert 1 % der Gesamtkosten der Käufe übersteigt, sowie Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse übersteigen. Es sind mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe anzugeben. Wenn weniger Transaktionen durchgeführt wurden, sind alle derartigen Transaktionen anzugeben.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Barmittel des Fonds verwendet werden können und die in der Regel am nächsten Geschäftstag fällig werden, und bis zur Endfälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums ihre Fälligkeit erreicht haben, wurden nicht in die Darstellung der wesentlichen Veränderungen der Portfoliozusammensetzung aufgenommen.

BESCHREIBUNG		NENNWERT (in Tsd.)		KOSTEN (in Tsd.)	BESCHREIBUNG		NENNWERT (in Tsd.)		ERLÖSE (in Tsd.)
<b>KAUFE BIS 30. SEPTEMBER 2021</b>					<b>VERKAUFE BIS 30. SEPTEMBER 2021</b>				
Goldman Sachs Group, Inc. 0,453 % due 30.04.2024	€	50.200	€	50.658	Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd. 1,250 % due 14.04.2022	€	39.700	€	40.060
Credit Suisse AG 0,451 % due 01.09.2023		39.700		40.265	HSBC Holdings PLC 0,162 % due 27.09.2022		25.000		25.011
Nykredit Realkredit A/S 2,000 % due 01.10.2050	DKK	257.800		35.714	Goldman Sachs Group, Inc. 0,093 % due 09.09.2022		21.000		21.033
Bank of China Ltd. 0,610 % due 10.08.2023	£	21.600		25.306	Goldman Sachs Group, Inc. 0,085 % due 26.09.2023		15.900		15.948
Indonesia Government International Bond 2,625 % due 14.06.2023	€	20.200		21.149	Goldman Sachs Group, Inc. 0,002 % due 21.04.2023		12.900		12.925
Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide 1,625 % due 09.07.2024		19.400		20.078	Essity AB 0,625 % due 28.03.2022		10.100		10.147
UBS AG 7,625 % due 17.08.2022	\$	17.700		16.170	Santander UK Group Holdings PLC 3,571 % due 10.01.2023	\$	10.000		8.507
General Motors Financial Co., Inc. 0,955 % due 07.09.2023	€	14.000		14.300	BPCE S.A. 4,625 % due 18.07.2023	€	6.600		7.189
Bumper BE NV/S.A. 0,000 % due 23.10.2031		13.500		13.595	Blackstone Property Partners Europe Holdings SARL 1,400 % due 06.07.2022		5.900		5.967
National Westminster Bank PLC 0,440 % due 28.05.2021	\$	16.150		13.529	Dolphin Energy Ltd. LLC 5,500 % due 15.12.2021	\$	6.000		5.074
CNP Assurances 7,375 % due 30.09.2041	£	11.300		13.428	LeasePlan Corp. NV 1,000 % due 25.02.2022	€	2.900		2.920
Citigroup, Inc. 2,750 % due 24.01.2024		11.000		13.410	Emirate of Abu Dhabi Government International Bond 0,750 % due 02.09.2023	\$	3.300		2.761
Primrose Residential DAC 0,189 % due 24.03.2061	€	13.000		12.947	Cooperatieve Rabobank UA 3,950 % due 09.11.2022		2.500		2.191
BAE Systems PLC 4,125 % due 08.06.2022	£	10.600		12.874	NN Group NV 1,000 % due 18.03.2022	€	1.400		1.411
Lloyds Banking Group PLC 0,625 % due 15.01.2024	€	12.700		12.859	China Construction Bank Corp. 0,000 % due 22.04.2024		1.400		1.404
ArcelorMittal S.A. 1,000 % due 19.05.2023		12.600		12.815	Nationwide Building Society 3,622 % due 26.04.2023	\$	1.600		1.385
SIG Combibloc Purchase Co. SARL 1,875 % due 18.06.2023		11.450		11.849	KBC Group NV 0,007 % due 24.11.2022	€	1.200		1.207
Virgin Money UK PLC 0,375 % due 27.05.2024		11.400		11.510	Saudi Arabian Oil Co. 2,750 % due 16.04.2022	\$	800		683
MPT Operating Partnership LP 4,000 % due 19.08.2022		11.100		11.470	Morocco Government International Bond 4,250 % due 11.12.2022		700		607
Imperial Brands Finance PLC 9,000 % due 17.02.2022	£	9.200		11.308	AbbVie, Inc. 3,450 % due 15.03.2022		600		511
Volkswagen Leasing GmbH 0,000 % due 19.07.2024	€	11.100		11.080					
Bank of Scotland Capital Funding LP 7,754 % due 29.03.2049	£	9.452		10.986					
Expedia Group, Inc. 2,500 % due 03.06.2022	€	9.500		9.651					
InterContinental Hotels Group PLC 1,625 % due 08.10.2024		8.500		8.891					
Ryanair DAC 1,125 % due 10.03.2023		8.700		8.884					
TP ICAP Ltd. 5,250 % due 26.01.2024	£	6.900		8.834					
Logicor Financing SARL 1,500 % due 14.11.2022	€	8.100		8.240					
BEL S.A. 1,500 % due 18.04.2024		7.900		8.158					
UBS AG 0,500 % due 09.08.2024	\$	9.600		8.095					
American International Group, Inc. 5,000 % due 26.04.2023	£	6.300		7.904					
Gazprom PJSC Via Gaz Capital S.A. 2,750 % due 30.11.2021	CHF	8.400		7.823					
Fingal Securities RMBS DAC 0,456 % due 28.07.2055	€	7.760		7.812					
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 2,000 % due 01.10.2050	DKK	56.300		7.799					
Barclays PLC 2,375 % due 06.10.2023	£	6.500		7.725					

Wesentliche Veränderungen des Portfolios sind definiert als Käufe, deren Wert 1 % der Gesamtkosten der Käufe übersteigt, sowie Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse übersteigen. Es sind mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe anzugeben. Wenn weniger Transaktionen durchgeführt wurden, sind alle derartigen Transaktionen anzugeben.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Barmittel des Fonds verwendet werden können und die in der Regel am nächsten Geschäftstag fällig werden, und bis zur Endfälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums ihre Fälligkeit erreicht haben, wurden nicht in die Darstellung der wesentlichen Veränderungen der Portfoliozusammensetzung aufgenommen.



BESCHREIBUNG	NENNWERT (in Tsd.)		KOSTEN (in Tsd.)		BESCHREIBUNG	NENNWERT (in Tsd.)		ERLÖSE (in Tsd.)	
<b>KAUFE BIS 30. SEPTEMBER 2021</b>					<b>VERKAUFE BIS 30. SEPTEMBER 2021</b>				
Iberdrola Finanzas S.A. 7,375 % due 29.01.2024	£	3.900	£	4.504	Credit Suisse AG 0,451 % due 01.09.2023	€	3.000	£	2.631
FCE Bank PLC 2,727 % due 03.06.2022		4.400		4.467	Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd. 1,250 % due 14.04.2022		2.800		2.423
Nationwide Building Society 0,480 % due 02.08.2022		3.800		3.816	Heathrow Funding Ltd. 5,225 % due 15.02.2023	£	2.200		2.339
Wells Fargo & Co. 2,125 % due 20.12.2023		3.300		3.387	Fastighets AB Balder 1,125 % due 14.03.2022	€	2.700		2.336
Anheuser-Busch InBev S.A. 9,750 % due 30.07.2024		2.400		2.992	BPCE S.A. 2,125 % due 16.12.2022	£	1.500		1.533
Digital Stout Holding LLC 2,750 % due 19.07.2024		2.800		2.955	LeasePlan Corp. NV 0,750 % due 03.10.2022	€	1.700		1.482
TP ICAP Ltd. 5,250 % due 26.01.2024		2.700		2.952	Goldman Sachs Group, Inc. 0,002 % due 21.04.2023		1.600		1.394
MPT Operating Partnership LP 2,550 % due 05.12.2023		2.800		2.880	Hutchison Whampoa Finance Ltd. 1,375 % due 31.10.2021		1.400		1.202
Goldman Sachs Group, Inc. 0,453 % due 30.04.2024	€	3.200		2.794	Natwest Group PLC 2,000 % due 08.03.2023		1.300		1.132
Aareal Bank AG 1,050 % due 29.04.2025	£	2.700		2.771	NatWest Markets PLC 0,625 % due 02.03.2022		1.300		1.127
Verizon Communications, Inc. 4,073 % due 18.06.2024		2.500		2.744	Aroundtown S.A. 0,375 % due 23.09.2022		1.300		1.127
Santander UK PLC 0,650 % due 12.11.2024		2.700		2.738	LeasePlan Corp. NV 1,000 % due 25.02.2022		1.200		1.042
American International Group, Inc. 5,000 % due 26.04.2023		2.500		2.701	Goldman Sachs Group, Inc. 0,085 % due 26.09.2023		1.200		1.039
Telefonica Emisiones S.A.U. 5,289 % due 09.12.2022		2.500		2.666	Daimler Canada Finance, Inc. 0,157 % due 11.09.2022		1.200		1.039
Credit Suisse AG 0,451 % due 01.09.2023	€	3.000		2.606	National Express Group PLC 2,500 % due 11.11.2023	£	900		932
Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide 1,625 % due 09.07.2024		2.900		2.549	BMW Finance NV 0,875 % due 16.08.2022		900		905
BMW International Investment BV 1,875 % due 11.09.2023	£	2.400		2.467	Glencore Finance Europe Ltd. 1,625 % due 18.01.2022	€	900		773
Indonesia Government International Bond 2,625 % due 14.06.2023	€	2.700		2.424	Intesa Sanpaolo SpA 1,125 % due 04.03.2022		800		691
Hawksmoor Mortgages PLC 1,100 % due 25.05.2053	£	2.398		2.410	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. 0,057 % due 09.03.2023		600		518
Bank of China Ltd. 0,610 % due 10.08.2023		2.400		2.400	BMW International Investment BV 1,875 % due 11.09.2023	£	500		514
Fastighets AB Balder 1,125 % due 14.03.2022	€	2.700		2.320	BPCE S.A. 4,625 % due 18.07.2023	€	500		466
UBS AG 7,625 % due 17.08.2022	\$	2.900		2.253	Goldman Sachs Group, Inc. 2,000 % due 27.07.2023		500		456
FACT Master S.A. 0,141 % due 20.07.2028	€	2.600		2.248	Booking Holdings, Inc. 2,150 % due 25.11.2022		500		439
Finsbury Square PLC 1,350 % due 16.06.2070	£	2.215		2.240	Zimmer Biomet Holdings, Inc. 1,414 % due 13.12.2022		500		437
HSBC Holdings PLC 6,500 % due 20.05.2024		1.800		2.072	Alfa Laval Treasury International AB 1,375 % due 12.09.2022		400		349
GE Capital UK Funding Unlimited Co. 4,125 % due 13.09.2023		1.900		2.041	Southern Power Co. 1,000 % due 20.06.2022		400		346
Nationwide Building Society 1,000 % due 24.01.2023		2.000		2.019	Societe Generale S.A. 0,000 % due 06.03.2023		400		345
Tower Bridge Funding PLC 0,000 % due 20.11.2063		2.000		2.000					
Virgin Money UK PLC 3,125 % due 22.06.2025		1.800		1.890					
Bank of Nova Scotia 1,050 % due 14.03.2025		1.800		1.848					
Deutsche Pfandbriefbank AG 1,050 % due 26.04.2024		1.800		1.839					
Palmer Square European Loan Funding DAC 0,780 % due 15.04.2031	€	2.100		1.791					
Volkswagen Financial Services NV 2,750 % due 10.07.2023	£	1.700		1.768					
Daimler International Finance BV 2,000 % due 04.09.2023		1.700		1.749					
Citigroup, Inc. 2,750 % due 24.01.2024		1.600		1.675					
General Motors Financial Co., Inc. 2,250 % due 06.09.2024		1.600		1.652					
BAT International Finance PLC 6,000 % due 29.06.2022		1.500		1.582					
LeasePlan Corp. NV 0,125 % due 13.09.2023	€	1.800		1.556					

Wesentliche Veränderungen des Portfolios sind definiert als Käufe, deren Wert 1 % der Gesamtkosten der Käufe übersteigt, sowie Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse übersteigen. Es sind mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe anzugeben. Wenn weniger Transaktionen durchgeführt wurden, sind alle derartigen Transaktionen anzugeben.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Barmittel des Fonds verwendet werden können und die in der Regel am nächsten Geschäftstag fällig werden, und bis zur Endfälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums ihre Fälligkeit erreicht haben, wurden nicht in die Darstellung der wesentlichen Veränderungen der Portfoliozusammensetzung aufgenommen.



BESCHREIBUNG	NENNWERT (in Tsd.)	KOSTEN (in Tsd.)	BESCHREIBUNG	NENNWER T (in Tsd.)	ERLÖSE (in Tsd.)
<b>KAUFE BIS 30. SEPTEMBER 2021</b>			<b>VERKAUFE BIS 30. SEPTEMBER 2021</b>		
Niederlande Waterschapsbank NV 3,000 % due 21.12.2021	\$ 142.000	\$ 143.380	Federal Home Loan Bank 0,650 % due 26.02.2026	\$ 40.300	\$ 39.897
Asian Development Bank 0,126 % due 15.12.2021	105.000	105.011	Federal Home Loan Bank 1,110 % due 27.07.2026	32.667	32.667
Niederlande Waterschapsbank NV 0,186 % due 15.12.2021	70.700	70.736	Federal Home Loan Bank 0,750 % due 24.02.2026	20.000	19.790
Federal Home Loan Bank 1,110 % due 28.05.2026	70.000	70.000	Freddie Mac 0,600 % due 15.10.2025	14.300	14.170
Ginnie Mae 0,450 % due 20.07.2051	53.000	52.870	Freddie Mac 0,800 % due 27.10.2026	11.500	11.378
Ginnie Mae 0,450 % due 20.06.2051	51.300	51.156	Siemens Financieringsmaatschappij NV 0,440 % due 11.03.2024	10.300	10.355
Federal Home Loan Bank 1,050 % due 13.08.2026	50.000	50.000	Cooperatieve Rabobank UA 0,335 % due 12.01.2024	10.000	10.013
Federal Home Loan Bank 1,110 % due 27.07.2026	49.000	49.000	QNB Finance Ltd. 1,126 % due 02.05.2022	8.700	8.748
Federal Home Loan Bank 0,810 % due 21.05.2025	48.500	48.500	Freddie Mac 0,600 % due 20.10.2025	8.400	8.318
Federal Home Loan Bank 1,070 % due 28.05.2026	48.000	48.000	Freddie Mac 0,800 % due 28.10.2026	8.000	7.884
Federal Home Loan Bank 0,500 % due 28.05.2024	45.000	45.000	John Deere Capital Corp. 0,726 % due 07.06.2023	7.000	7.073
Aozora Bank Ltd. 1,050 % due 09.09.2024	45.120	44.943	Toyota Motor Credit Corp. 0,380 % due 11.01.2024	6.900	6.914
BNG Bank NV 0,184 % due 11.03.2022	36.200	36.223	QNB Finance Ltd. 1,275 % due 12.02.2022	6.300	6.333
Export Development Canada 0,520 % due 26.05.2024	36.000	36.000	Metropolitan Life Global Funding 0,358 % due 07.01.2024	4.500	4.509
Catamaran CLO Ltd. 1,482 % due 22.04.2030	35.816	35.823	JT International Financial Services BV 3,500 % due 28.09.2023	4.000	4.234
Ally Financial, Inc. 4,125 % due 13.02.2022	30.630	31.264	Hana Bank 2,125 % due 18.10.2021	4.000	4.008
Freddie Mac 1,000 % due 15.09.2044	30.000	30.150	Export-Import Bank of Korea 1,093 % due 25.01.2022	3.000	3.011
QNB Finance Ltd. 1,125 % due 17.06.2024	26.900	26.891	Roche Holdings, Inc. 0,251 % due 05.03.2024	2.800	2.803
Wells Fargo-RBS Commercial Mortgage Trust 3,337 % due 15.06.2046	25.200	26.300	MET Tower Global Funding 0,600 % due 17.01.2023	1.400	1.407
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2,918 % due 15.02.2046	25.600	26.263	Bank of Nova Scotia 0,430 % due 31.07.2024	1.400	1.403
CSAIL Commercial Mortgage Trust 3,718 % due 15.08.2048	24.000	26.232			
CIT Mortgage Loan Trust 1,436 % due 25.10.2037	25.282	25.534			
Danske Bank A/S 1,171 % due 08.12.2023	24.931	25.043			
Federal Home Loan Bank 0,625 % due 27.11.2024	25.000	25.000			
Federal Home Loan Bank 0,620 % due 09.12.2024	25.000	25.000			
UBS AG 0,500 % due 09.08.2024	25.000	25.000			
Goldman Sachs Group, Inc. 2,876 % due 31.10.2022	24.058	24.317			
Danske Bank A/S 3,001 % due 20.09.2022	24.000	24.219			
AerCap Ireland Capital DAC 4,625 % due 01.07.2022	22.645	23.466			
Wells Fargo-RBS Commercial Mortgage Trust 3,071 % due 15.03.2045	22.263	22.833			
Boeing Co. 4,508 % due 01.05.2023	21.317	22.702			
European Investment Bank 0,340 % due 10.06.2022	22.300	22.343			

Wesentliche Veränderungen des Portfolios sind definiert als Käufe, deren Wert 1 % der Gesamtkosten der Käufe übersteigt, sowie Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse übersteigen. Es sind mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe anzugeben. Wenn weniger Transaktionen durchgeführt wurden, sind alle derartigen Transaktionen anzugeben.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Barmittel des Fonds verwendet werden können und die in der Regel am nächsten Geschäftstag fällig werden, und bis zur Endfälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums ihre Fälligkeit erreicht haben, wurden nicht in die Darstellung der wesentlichen Veränderungen der Portfoliozusammensetzung aufgenommen.

BESCHREIBUNG	NENNWERT (in Tsd.)	KOSTEN (in Tsd.)	BESCHREIBUNG	NENNWERT (in Tsd.)	ERLÖSE (in Tsd.)
<b>KAUFE BIS 30. SEPTEMBER 2021</b>			<b>VERKÄUFE BIS 30. SEPTEMBER 2021</b>		
U.S. Treasury Notes 0,250 % due 15.05.2024	\$ 3.800	\$ 3.794	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % due 15.04.2025 (a)	\$ 6.565	\$ 7.161
U.S. Treasury Notes 0,750 % due 31.05.2026	2.600	2.595	Volkswagen Financial Services NV 0,875 % due 20.02.2025	£ 500	680
Bank of Nova Scotia 0,430 % due 31.07.2024	800	800	NTT Finance Corp. 0,583 % due 01.03.2024	\$ 600	599
Kaisa Group Holdings Ltd. 8,500 % due 30.06.2022	700	706	Owens Corning 4,200 % due 01.12.2024	500	551
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. 0,953 % due 19.07.2025	600	600	Citigroup, Inc. 0,981 % due 01.05.2025	500	503
Metropolitan Life Global Funding 0,700 % due 27.09.2024	600	600	Wells Fargo & Co. 0,805 % due 19.05.2025	500	502
Morgan Stanley 0,731 % due 05.04.2024	500	500	Broadcom, Inc. 3,469 % due 15.04.2034	400	419
Wells Fargo & Co. 0,805 % due 19.05.2025	500	500	AerCap Ireland Capital DAC 2,875 % due 14.08.2024	300	312
Credit Suisse AG 0,430 % due 09.08.2023	500	500	Verizon Communications, Inc. 1,450 % due 20.03.2026	150	151
Citigroup, Inc. 0,981 % due 01.05.2025	500	500			
SYNNEX Corp. 1,250 % due 09.08.2024	500	500	(a) Der Nennwert des Wertpapiers wird um die Inflation bereinigt.		
Sands China Ltd. 2,300 % due 08.03.2027	500	499	Wesentliche Veränderungen des Portfolios sind definiert als Käufe, deren Wert 1 % der Gesamtkosten der Käufe übersteigt, sowie Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse übersteigen. Es sind mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe anzugeben. Wenn weniger Transaktionen durchgeführt wurden, sind alle derartigen Transaktionen anzugeben.		
Bayer U.S. Finance LLC 1,126 % due 15.12.2023	450	457	Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Barmittel des Fonds verwendet werden können und die in der Regel am nächsten Geschäftstag fällig werden, und bis zur Endfälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums ihre Fälligkeit erreicht haben, wurden nicht in die Darstellung der wesentlichen Veränderungen der Portfoliozusammensetzung aufgenommen.		
Metropolitan Edison Co. 3,500 % due 15.03.2023	400	415			
Sealed Air Corp. 1,573 % due 15.10.2026	400	400			
Lundin Energy Finance BV 2,000 % due 15.07.2026	400	400			
Marvell Technology, Inc. 1,650 % due 15.04.2026	400	399			
Enel Finance International NV 1,375 % due 12.07.2026	400	398			
Sprint Corp. 7,625 % due 15.02.2025	300	357			
Delta Air Lines, Inc. 7,375 % due 15.01.2026	300	352			
Enact Holdings, Inc. 6,500 % due 15.08.2025	300	327			
Trans-Allegheny Interstate Line Co. 3,850 % due 01.06.2025	300	324			
Woodside Finance Ltd. 3,650 % due 05.03.2025	300	323			
Wynn Macau Ltd. 4,875 % due 01.10.2024	300	305			
MGM China Holdings Ltd. 4,750 % due 01.02.2027	300	304			
Cleco Power LLC 0,616 % due 15.06.2023	300	300			
SBA Tower Trust 1,631 % due 15.05.2051	300	300			
Pacific Life Global Funding 1,375 % due 14.04.2026	300	300			
NongHyup Bank 0,875 % due 28.07.2024	300	300			
Principal Life Global Funding 1,250 % due 16.08.2026	300	299			
Syngenta Finance NV 4,441 % due 24.04.2023	250	264			
Expedia Group, Inc. 6,250 % due 01.05.2025	200	233			
Syngenta Finance NV 4,892 % due 24.04.2025	200	221			

BESCHREIBUNG	NENNWERT (in Tsd.)	KOSTEN (in Tsd.)	BESCHREIBUNG	NENNWERT (in Tsd.)	ERLÖSE (in Tsd.)
<b>KÄUFE BIS 30. SEPTEMBER 2021</b>			<b>VERKÄUFE BIS 30. SEPTEMBER 2021</b>		
American Airlines, Inc. 5,500 % due 20.04.2026	\$ 16.350	\$ 17.190	Netflix, Inc. 5,500 % due 15.02.2022	\$ 7.653	\$ 7.867
TransDigm, Inc. 6,250 % due 15.03.2026	12.710	13.423	OneMain Finance Corp. 3,500 % due 15.01.2027	6.900	6.976
United Airlines, Inc. 4,375 % due 15.04.2026	10.160	10.455	NGPL PipeCo LLC 4,375 % due 15.08.2022	6.163	6.392
Genesis Energy LP 6,500 % due 01.10.2025	9.560	9.631	OneMain Finance Corp. 6,125 % due 15.05.2022	6.090	6.364
NCL Corp. Ltd. 5,875 % due 15.03.2026	7.900	8.187	Park Aerospace Holdings Ltd. 5,500 % due 15.02.2024	5.488	6.034
Enact Holdings, Inc. 6,500 % due 15.08.2025	7.275	7.930	Cheniere Corpus Christi Holdings LLC 7,000 % due 30.06.2024	5.056	5.808
Bausch Health Cos., Inc. 9,000 % due 15.12.2025	6.700	7.188	Sirius XM Radio, Inc. 3,125 % due 01.09.2026	5.500	5.610
Diversified Healthcare Trust 9,750 % due 15.06.2025	6.310	7.084	Cenovus Energy, Inc. 5,375 % due 15.07.2025	4.640	5.316
OneMain Finance Corp. 3,500 % due 15.01.2027	6.900	6.900	XPO Logistics, Inc. 6,125 % due 01.09.2023	5.257	5.316
Bausch Health Americas, Inc. 9,250 % due 01.04.2026	6.237	6.845	Ensign Drilling, Inc. 9,250 % due 15.04.2024	5.350	4.952
Veritas U.S., Inc. 7,500 % due 01.09.2025	6.460	6.734	ADT Security Corp. 3,500 % due 15.07.2022	4.708	4.826
Ford Motor Credit Co. LLC 4,389 % due 08.01.2026	6.300	6.732	XPO Logistics, Inc. 6,750 % due 15.08.2024	4.550	4.756
Sirius XM Radio, Inc. 3,125 % due 01.09.2026	6.700	6.729	Energy Transfer LP 5,875 % due 15.01.2024	4.189	4.658
NGL Energy Operating LLC 7,500 % due 01.02.2026	6.137	6.411	FMG Resources Pty. Ltd. 5,125 % due 15.05.2024	4.217	4.609
Coty, Inc. 5,000 % due 15.04.2026	6.275	6.302	Ally Financial, Inc. 3,875 % due 21.05.2024	4.184	4.536
Sprint Corp. 7,625 % due 01.03.2026	5.060	6.260	Navios Maritime Holdings, Inc. 7,375 % due 15.01.2022	5.024	4.319
Staples, Inc. 7,500 % due 15.04.2026	5.957	6.204	Travel + Leisure Co. 5,650 % due 01.04.2024	3.889	4.182
Uniti Group LP 7,125 % due 15.12.2024	5.900	6.090	T-Mobile USA, Inc. 4,000 % due 15.04.2022	4.050	4.141
Western Digital Corp. 4,750 % due 15.02.2026	5.295	5.879	Continental Resources, Inc. 3,800 % due 01.06.2024	3.880	4.103
Owens-Brockway Glass Container, Inc. 5,875 % due 15.08.2023	5.150	5.575	Stellantis NV 5,250 % due 15.04.2023	3.629	3.931
			CIT Group, Inc. 5,000 % due 01.08.2023	3.606	3.926
			Telecom Italia SpA 5,303 % due 30.05.2024	3.597	3.914
			Seagate HDD Cayman 4,750 % due 01.06.2023	3.591	3.832
			Freeport-McMoRan, Inc. 4,550 % due 14.11.2024	3.457	3.768
			American Airlines Group, Inc. 5,000 % due 01.06.2022	3.684	3.712
			<b>ANTEILE</b>		
			Frontier Communications Parent, Inc.	143.952	3.586
			<b>NENNWERT (in Tsd.)</b>		
			Lumen Technologies, Inc. 7,500 % due 01.04.2024	\$ 3.151	3.546
			Royal Caribbean Cruises Ltd. 10,875 % due 01.06.2023	3.110	3.517
			Enact Holdings, Inc. 6,500 % due 15.08.2025	3.144	3.412
			United Airlines Holdings, Inc. 4,250 % due 01.10.2022	3.221	3.297
			Nine Energy Service, Inc. 8,750 % due 01.11.2023	6.885	3.254
			HCA, Inc. 4,750 % due 01.05.2023	2.884	3.109
			Toll Brothers Finance Corp. 5,875 % due 15.02.2022	3.000	3.060
			QVC, Inc. 4,850 % due 01.04.2024	2.800	3.038
			Freedom Mortgage Corp. 8,250 % due 15.04.2025	2.905	2.968
			Voya Financial, Inc. 5,650 % due 15.05.2053	2.734	2.912
			Navient Corp. 6,125 % due 25.03.2024	2.674	2.900
			Energy Transfer LP 6,250 % due 15.02.2023	3.372	2.808

Wesentliche Veränderungen des Portfolios sind definiert als Käufe, deren Wert 1 % der Gesamtkosten der Käufe übersteigt, sowie Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse übersteigen. Es sind mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe anzugeben. Wenn weniger Transaktionen durchgeführt wurden, sind alle derartigen Transaktionen anzugeben.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Barmittel des Fonds verwendet werden können und die in der Regel am nächsten Geschäftstag fällig werden, und bis zur Endfälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums ihre Fälligkeit erreicht haben, wurden nicht in die Darstellung der wesentlichen Veränderungen der Portfoliozusammensetzung aufgenommen.

**Abkürzungen der Kontrahenten:**

<b>AZD</b>	Australia and New Zealand Banking Group	<b>FICC</b>	Fixed Income Clearing Corporation	<b>PER</b>	Pershing LLC
<b>BOA</b>	Bank of America N.A.	<b>GLM</b>	Goldman Sachs Bank USA	<b>RBC</b>	Royal Bank of Canada
<b>BPS</b>	BNP Paribas S.A.	<b>GST</b>	Goldman Sachs International	<b>RYL</b>	NatWest Markets Plc
<b>BRC</b>	Barclays Bank PLC	<b>HUS</b>	HSBC Bank USA N.A.	<b>SAL</b>	Citigroup Global Markets, Inc.
<b>BSN</b>	The Bank of Nova Scotia-Toronto	<b>IND</b>	Credit Agricole Corporate and Investment Bank S.A.	<b>SCX</b>	Standard Chartered Bank, London
<b>BSS</b>	Banco Santander S.A.	<b>JML</b>	JP Morgan Securities Plc	<b>SOG</b>	Societe Generale Paris
<b>CBK</b>	Citibank N.A.	<b>JPM</b>	JP Morgan Chase Bank N.A.	<b>SSB</b>	State Street Bank and Trust Co.
<b>COM</b>	Commerzbank AG	<b>MYC</b>	Morgan Stanley Capital Services LLC	<b>TOR</b>	The Toronto-Dominion Bank
<b>DUB</b>	Deutsche Bank AG	<b>MYI</b>	Morgan Stanley & Co. International PLC	<b>UAG</b>	UBS AG Stamford
<b>FBF</b>	Credit Suisse International	<b>NENNWERT</b>	BNP Paribas London		
<b>FCT</b>	Credit Suisse Capital LLC				

**Währungskürzel:**

<b>ARS</b>	Argentinischer Peso	<b>DKK</b>	Dänische Krone	<b>MYR</b>	Malaysischer Ringgit
<b>AUD</b>	Australischer Dollar	<b>DOP</b>	Dominikanischer Peso	<b>PHP</b>	Philippinischer Peso
<b>BRL</b>	Brasilianischer Real	<b>EUR (oder €)</b>	Euro	<b>PLN</b>	Polnischer Zloty
<b>CAD</b>	Kanadischer Dollar	<b>GBP (oder £)</b>	Britisches Pfund	<b>RUB</b>	Russischer Rubel
<b>CHF</b>	Schweizer Franken	<b>IDR</b>	Indonesische Rupiah	<b>SEK</b>	Schwedische Krone
<b>CLP</b>	Chilenischer Peso	<b>ILS</b>	Israelischer Schehel	<b>THB</b>	Thailändischer Baht
<b>CNH</b>	Chinesischer Renminbi (Ausland)	<b>INR</b>	Indische Rupie	<b>TRY</b>	Neue Türkische Lira
<b>CNY</b>	Chinesischer Renminbi (Festland)	<b>JPY (oder ¥)</b>	Japanischer Yen	<b>USD (oder \$)</b>	US-Dollar
<b>COP</b>	Kolumbianischer Peso	<b>MXN</b>	Mexikanischer Peso	<b>ZAR</b>	Südafrikanischer Rand

**Börsen-Abkürzungen:**

<b>OTC</b>	Over the Counter (im Freiverkehr)
------------	-----------------------------------

**Index-/Spread-Abkürzungen:**

<b>ACS</b>	Algonquin Cityfates Natural Gas Basis Futures Index	<b>CDX.IG</b>	Credit Derivatives Index-Investment Grade	<b>PRIME</b>	Daily US Prime Rate
<b>CDX.HY</b>	Credit Derivatives Index-High Yield	<b>CMBX</b>	Commercial Mortgage-Backed Index	<b>SONIO</b>	Sterling Overnight Interbank Average Rate

**Sonstige Abkürzungen:**

<b>ABS</b>	Asset-Backed Security	<b>EURIBOR</b>	Euro Interbank Offered Rate	<b>PIK</b>	Payment-in-Kind
<b>BTP</b>	Buoni del Tesoro Poliennali „Langfristige Schatzanleihe“	<b>JIBAR</b>	Johannesburg Interbank Agreed Rate	<b>RMBS</b>	Residential Mortgage-Backed Security
<b>CDI</b>	Brasilianischer Interbankenzinssatz	<b>LIBOR</b>	London Interbank Offered Rate	<b>TBA</b>	To-Be-Announced
<b>CLO</b>	Collateralized Loan Obligation	<b>OAT</b>	Obligations Assimilables du Trésor	<b>TIE</b>	Tasa de Interés Interbancaria de Equilibrio
<b>DAC</b>	Designated Activity Company	<b>OIS</b>	Overnight Index Swap		„Gleichgewichts-Interbankenzinssatz“

**VERWALTUNGSGESELLSCHAFT**

PIMCO Global Advisors (Ireland) Limited,  
Third Floor,  
Harcourt Building,  
Harcourt Street,  
Dublin,  
D02 F721,  
Irland.

**ANLAGEBERATER**

Pacific Investment Management Company LLC,  
650 Newport Center Drive,  
Newport Beach, Kalifornien 92660,  
USA.

PIMCO Europe Ltd.,  
11 Baker Street,  
London W1U 3AH,  
Vereinigtes Königreich.

PIMCO Europe GmbH,  
Seidlstraße 24-24a,  
80335 München,  
Deutschland.

**ADMINISTRATOR**

State Street Fund Services (Ireland) Limited,  
78 Sir John Rogerson's Quay,  
Dublin 2,  
D02 HD32,  
Irland.

**VERWAHRSTELLE**

State Street Custodial Services (Ireland) Limited,  
78 Sir John Rogerson's Quay,  
Dublin 2,  
D02 HD32,  
Irland.

**VERTRIEBSSTELLE**

PIMCO Europe Ltd.,  
11 Baker Street,  
London W1U 3AH,  
Vereinigtes Königreich.

**VERTRETER IM VEREINIGTEN KÖNIGREICH**

PIMCO Europe Ltd.,  
11 Baker Street,  
London W1U 3AH,  
England.

**PROMOTER:**

PIMCO Europe Ltd.,  
11 Baker Street,  
London W1U 3AH,  
England.

**ZAHLSTELLE IN ÖSTERREICH**

Erste Bank der österreichischen Sparkassen AG,  
Am Belvedere 1,  
1100 Wien,  
Österreich.

**INTERNATIONALE ZAHLSTELLE**

Citibank, N.A., London Branch,  
Citigroup Centre,  
Canada Square,  
Canary Wharf,  
London E14 5LB,  
England.

**DEUTSCHE INFORMATIONSTELLE**

Marcard, Stein & Co. AG,  
Ballindamm 36,  
20095 Hamburg,  
Deutschland.

**ZENTRALSTELLE UND FINANZVERMITTLER IN FRANKREICH**

Société Générale,  
29, boulevard Haussmann,  
75009 Paris,  
Frankreich.

**VERTRETUNG IN LUXEMBURG**

(mit Wirkung vom 18. September 2021)  
Société Générale Luxembourg,  
11, Avenue Emile Reuter,  
L- 2420 Luxemburg.

(bis 17. September 2021)

BNP Paribas Securities Services,  
23, avenue de la Porte-Neuve,  
L-2085, Luxemburg.

**ZAHLSTELLE UND VERTRETUNG IN DER SCHWEIZ**

BNP Paribas Securities Services,  
Paris, succursale de Zurich,  
Selnaustrasse 16,  
8002 Zürich,  
Schweiz.

**ZAHLSTELLE IN SCHWEDEN**

Skandinaviska Enskilda Banken AB (publ),  
Investor Services – Paying Agent / AS-12,  
Råsta Strandväg 5,  
SE-169 79 Solna,  
Schweden.

**VERTRETUNG IN SPANIEN**

Uria Menendez,  
Príncipe de Vergara, 187,  
Plaza de Rodrigo Uría,  
28002 Madrid,  
Spanien.

**BELGISCHER FINANZDIENSTLEISTUNGSAGENT**

ABN AMRO Bank NV,  
Post X,  
Borsbeeksebrug 30,  
2600 Antwerpen-Berchem,  
Belgien.

**RECHTSBERATER FÜR IRISCHES RECHT**

Dillon Eustace,  
33 Sir John Rogerson's Quay,  
Dublin 2, D02 XK09,  
Irland.

**UNABHÄNGIGE ABSCHLUSSPRÜFER**

Grant Thornton,  
13-18 City Quay,  
Dublin 2,  
D02 ED70,  
Irland.

**SEKRETÄR**

State Street Fund Services (Ireland) Limited,  
78 Sir John Rogerson's Quay,  
Dublin 2,  
D02 HD32,  
Irland.

**EINGETRAGENER SITZ**

PIMCO ETFs plc,  
78 Sir John Rogerson's Quay,  
Dublin 2, D02 HD32,  
Irland.

**VERWALTUNGSRAT DER GESELLSCHAFT UND DER VERWALTUNGSGESELLSCHAFT**

V. Mangala Ananthanarayanan<sup>1</sup> (Indien)  
Ryan P. Blute<sup>1</sup> (USA)  
John Bruton (unabhängiges Verwaltungsratsmitglied)  
(Irland)  
Craig A. Dawson<sup>1</sup> (USA)  
David M. Kennedy (unabhängiges  
Verwaltungsratsmitglied) (Irland)  
Frances Ruane (unabhängiges  
Verwaltungsratsmitglied) (Irland)

Der Verkaufsprospekt, Nachträge zum Verkaufsprospekt, die Gründungsurkunde und die Satzung sowie Jahres- und Halbjahresberichte sind kostenlos in den Geschäftsstellen der Vertretung oder Vertreter in der jeweiligen Rechtsordnung erhältlich. Anteilhaber können ein Exemplar der Liste mit den Änderungen im Portfolio während des Berichtszeitraums zum 30. September 2021 kostenlos vom Büro des Administrators oder den Zahlstellen, von der Zahl- und Informationsstelle in Deutschland und der Schweizer Vertretung in der Schweiz beziehen.

<sup>1</sup> Angestellter bei PIMCO.

**PIMCO Europe Ltd (Registernummer 2604517)** wurde von der Financial Conduct Authority (12 Endeavour Square, London, E20 1JN) im Vereinigten Königreich zugelassen und steht unter deren Aufsicht. Die von PIMCO Europe Ltd erbrachten Dienstleistungen sind nicht für Privatanleger verfügbar, die sich nicht auf diese Unterlagen verlassen sollten, sondern ihren Finanzberater kontaktieren sollten.

**PIMCO Europe GmbH (Registernummer 192083, Seidlstr. 24-24a, 80335 München, Deutschland), PIMCO Europe GmbH/Niederlassung Italien (Registernummer 10005170963), PIMCO Europe GmbH/Niederlassung Irland (Registernummer 909462), PIMCO Europe GmbH/Niederlassung Großbritannien (Registernummer 2604517) und PIMCO Europe GmbH/Niederlassung Spanien (N.I.F. W2765338E)** sind von der Bundesanstalt für Finanzdienstleistungsaufsicht (BaFin) (Marie-Curie-Str. 24-28, 60439 Frankfurt am Main) in Deutschland zugelassen und werden von dieser gemäß § 15 des Wertpapierinstitutsgesetzes (WpIG) reguliert. Die italienische, die irische, die britische und die spanische Niederlassung werden zusätzlich beaufsichtigt von: (1) Niederlassung Italien: Commissione Nazionale per le Società e la Borsa (CONSOB) gemäß Artikel 27 des italienischen konsolidierten Finanzgesetzes; (2) Niederlassung Irland: Zentralbank von Irland gemäß der Regulation 43 der Europäischen Union (Märkte für Finanzinstrumente) als Teil der Regulations 2017 in der jeweils geltenden Fassung; (3) Niederlassung Großbritannien: Financial Conduct Authority; und (4) Niederlassung Spanien: Comisión Nacional del Mercado de Valores (CNMV) in Übereinstimmung mit den in den Artikeln 168 und 203 bis 224 festgelegten Verpflichtungen sowie den Verpflichtungen in Teil V, Abschnitt I des Gesetzes über den Wertpapiermarkt (LSM) und in den Artikeln 111, 114 und 117 des Königlichen Erlasses 217/2008. Die von PIMCO Europe GmbH erbrachten Dienstleistungen stehen nur professionellen Kunden im Sinne von § 67 Abs. 2 WpHG (Wertpapierhandelsgesetz) zur Verfügung. Sie sind nicht für Privatanleger verfügbar, die sich nicht auf diese Unterlagen verlassen sollten.

**PIMCO (Schweiz) GmbH (eingetragen in der Schweiz, Registernummer CH-020.4.038.582-2).** Die von PIMCO (Schweiz) GmbH erbrachten Dienstleistungen sind nicht für Privatanleger verfügbar, die sich nicht auf diese Unterlagen verlassen sollten, sondern ihren Finanzberater kontaktieren sollten.